

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成27年2月6日提出
【計算期間】	第12期(自 平成25年11月7日至 平成26年11月6日)
【ファンド名】	D C インデックスバランス(株式40)
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 村上 雅彦
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	雄谷 敦史
【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	年1回	グローバル (含む日本)		
大型株	年2回			
中小型株	年4回	日本		
債券		北米	ファミリーファンド	あり
一般	年6回			()
公債	(隔月)	欧州		
社債				
その他債券	年12回	アジア		
クレジット属性 ()	(毎月)	オセアニア		
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オブ・	なし
	その他		ファンズ	
その他資産 (投資信託証券(資産 複合 資産配分 固定型(株式、債 券)))	()	アフリカ		
		中近東 (中東)		
資産複合 ()		エマージング		
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

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

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

年1回

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

グローバル(含む日本)

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジなし

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。

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

2. インデックスファンドで構成しています。

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

<国内株式>

「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

<海外株式>

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

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

<国内債券>

「日本債券インデックスマザーファンド」

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

<海外債券>

「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」

主として世界各国の債券に投資し、シティ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の高標は、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の高標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。
- ※MSCI-KOKUSAI インデックス：同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
- ※日興債券パフォーマンスインデックス(総合)：同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はSMBC日興証券株式会社に帰属します。また、SMBC日興証券株式会社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
- ※シティ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40%、債券などに60%投資します。

資産の標準実質組入比率は、株式40%、債券など60%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	30%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	10%
日本債券インデックスマザーファンド	45%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	10%
短期金融資産	5%

※基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。

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

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

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

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



主な投資制限

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

分配方針

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

信託金限度額

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

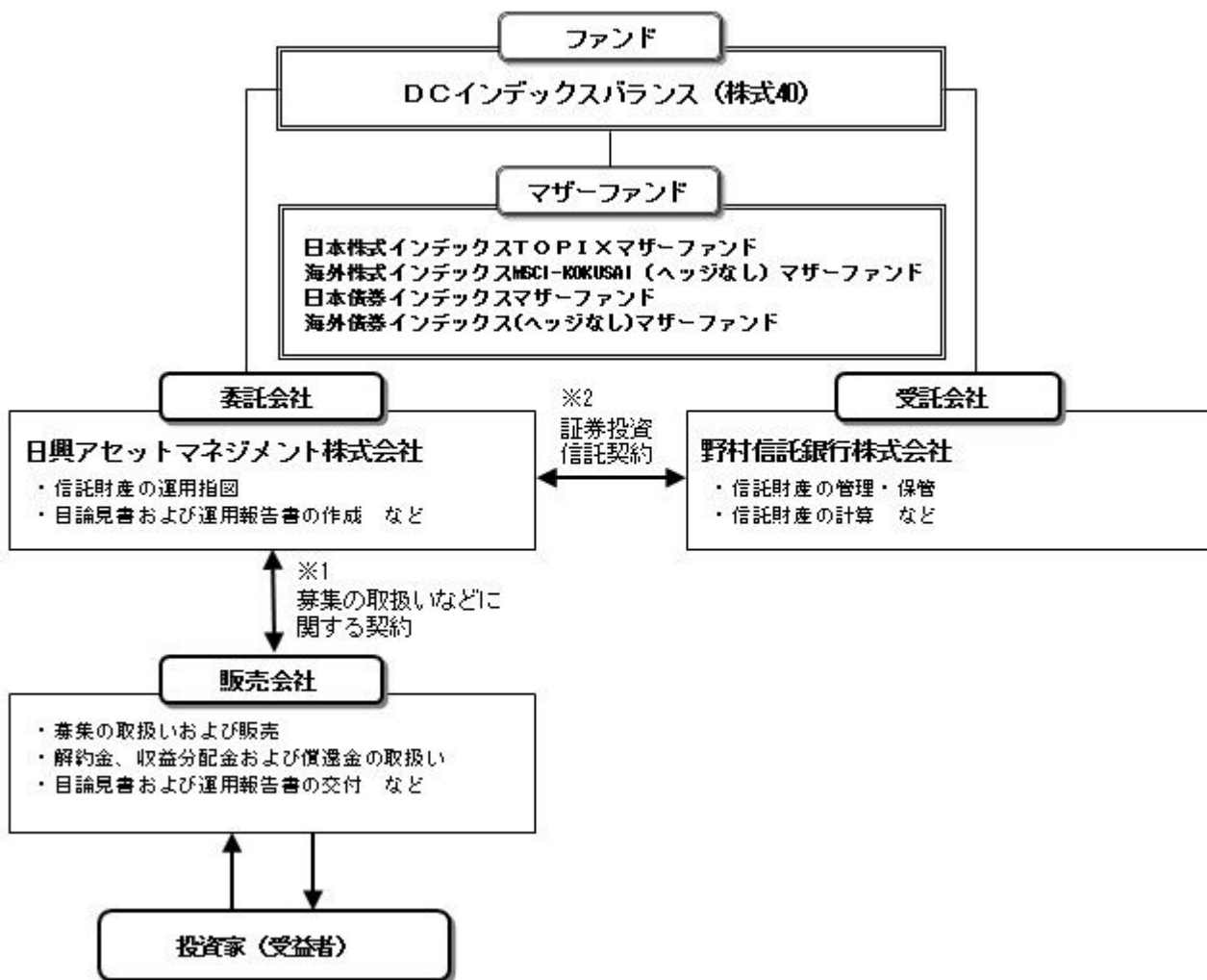
(2) 【ファンドの沿革】

平成14年12月10日

- ・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものです。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です。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26年11月末現在）

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

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

- ・主として、以下に掲げる各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長をめざします。
 - 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.....40%
 - 公社債および短期金融資産の標準実質組入比率.....60%
- ・組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンド受益証券への投資比率を調整することで行ないますが、市況動向などによっては内外の有価証券などへの直接投資を行なうことがあります。
- ・また、資金動向などによっては組入比率を引き下げることもあります。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

(2)【投資対象】

<DCインデックスバランス(株式40)>

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す。)

- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 1) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」受益証券
- 2) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド」受益証券
- 3) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券
- 4) 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」受益証券
- 5) 株券または新株引受権証書
- 6) 国債証券
- 7) 地方債証券
- 8) 特別の法律により法人の発行する債券
- 9) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 10) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 11) コマーシャル・ペーパー
- 12) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
- 13) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、5)~12)の証券または証書の性質を有するもの
- 14) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。)
- 15) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下

同じ。)で16)に定めるもの以外のもの

- 16) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
- 17) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 18) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りま。
- 19) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 20) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 21) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りま。
- 22) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 23) 外国の者に対する権利で22)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

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

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

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

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

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

- 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)～7)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 11) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で12)に定めるもの以外のもの
- 12) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
- 13) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 14) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- 15) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 17) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
- 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引
- <日本債券インデックスマザーファンド>
わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）
 - 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限ります。）
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
- 1) 国債証券
 - 2) 地方債証券
 - 3) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付

社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)に限ります。

- 5) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、1)~6)の証券の性質を有するもの
- 8) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)で投資法人債券に類する証券
- 9) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 10) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

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

<海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

投資対象とするマザーファンドの概要

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX(東証株価指数)*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主としてわが国の株式に投資し、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出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。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成11年10月29日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

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

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカンツリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出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。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成12年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、日興債券パフォーマンスインデックス（総合） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主としてわが国の公社債に投資し、日興債券パフォーマンスインデックス（総合）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。 運用の効率化をはかるため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式への投資は行ないません。 外貨建資産への投資は行ないません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出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。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.1%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社

信託期間	無期限（平成10年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

* 日興債券パフォーマンスインデックス（総合）は、日興フィナンシャル・インテリジェンス株式会社が発表している、日本の債券市場の動きを表す指数です。国債、地方債、政府保証債、財投機関債、金融債、事業債などの円建て公募利付債で構成されています。対象となる債券は残存年数1年以上、残存額面10億円以上で、格付会社からBBB格相当以上の格付を取得している発行体に限られます。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はSMBC日興証券株式会社に帰属します。また、SMBC日興証券株式会社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

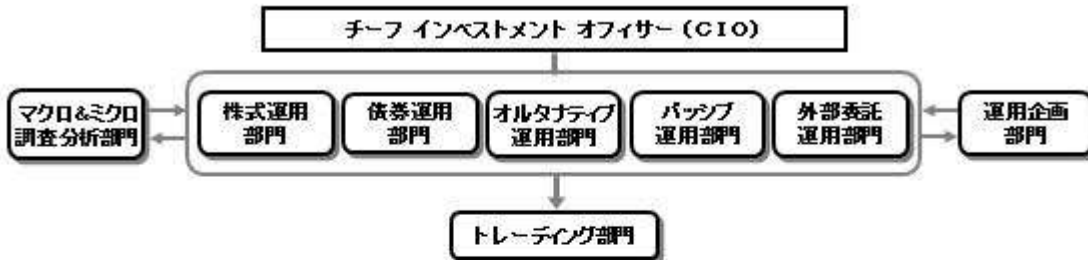
運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として世界各国の債券に投資し、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式への投資は行ないません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出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。
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。 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

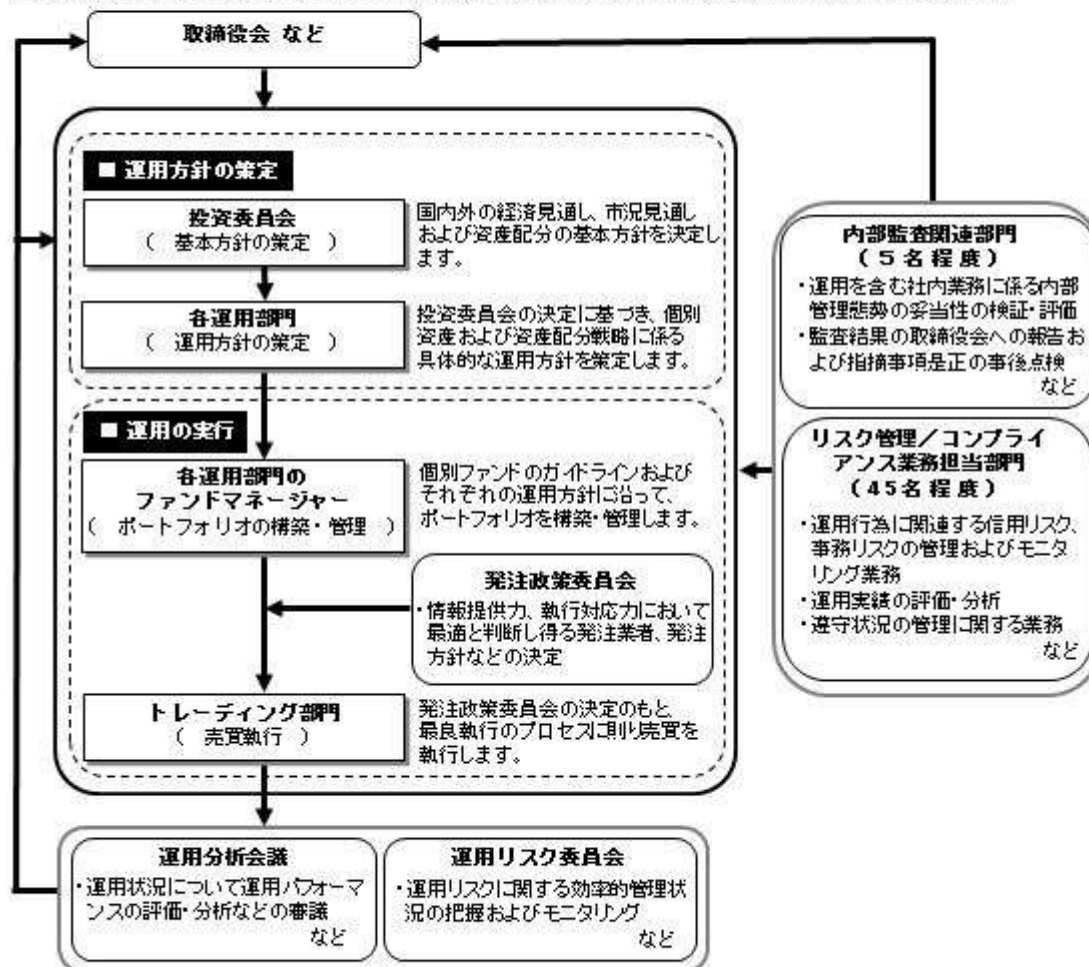
し・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

（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26年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

- 1) 分配対象額の範囲
経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。
- 2) 分配対象額についての分配方針

分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。

3) 留保益の運用方針

収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行いません。

収益分配金の支払い

原則として、収益分配金は無手数料で自動的に再投資されます。

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

< DCインデックスバランス(株式40) >

- 1) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合は、信託財産の総額の70%未満とします。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。)されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 投資信託証券(マザーファンドの受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の50%以下とします。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、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。
- 16) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出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。
- <日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>
- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 4) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 5) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 6) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 8) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
- イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
- ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出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。
- < 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、当該取引の契約期間が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 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。

15) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出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。

<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。

10) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出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。

<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、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡し取引および為替先渡し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。
- 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出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。

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。

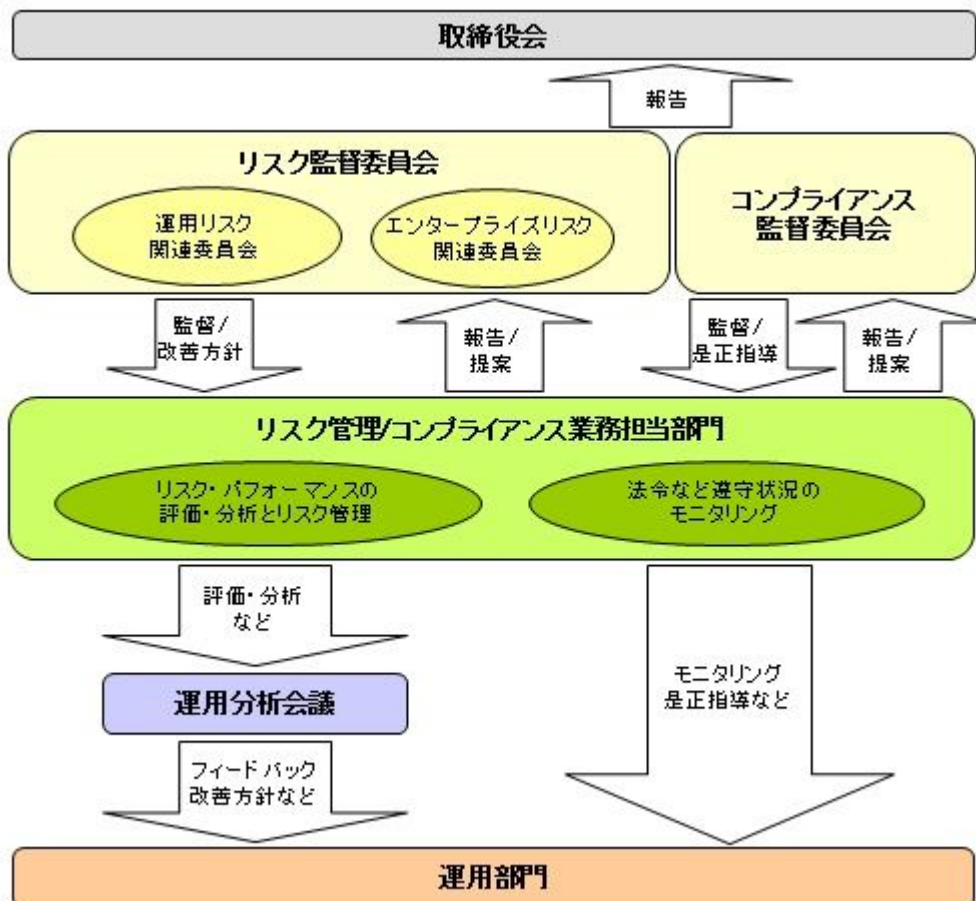
為替変動リスク

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。
- ・ 投資対象とする投資信託証券に関する事項
ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴う資金流出入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。
- ・ 解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項
一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。
- ・ 基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。
- ・ 運用制限や規制上の制限に関する事項
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。
- ・ 法令・税制・会計方針などの変更に関する事項
ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

(2) リスク管理体制



全社的なリスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理/コンプライアンス業務担当部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況についてはコンプライアンス部門が事務局を務めるコンプライアンス監督委員会、リスク管理状況についてはリスク管理部門が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。両委員会およびそれに関連する部門別委員会においては、法令遵守状況や各種リスク（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、重要事故への対応と各種リスク対応、事故防止のための施策やその管理手法の構築などの支援に努めております。

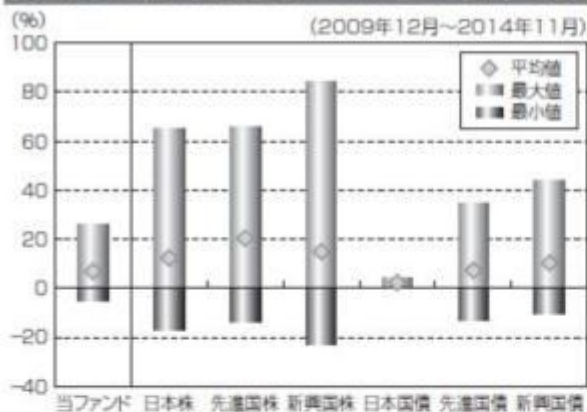
リスク・パフォーマンスの評価・分析とリスク管理

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

法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は平成26年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)**当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較****(当ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大騰落率および最小騰落率(%))**

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	7.0%	12.3%	20.4%	14.9%	2.3%	7.3%	10.3%
最大値	26.0%	65.0%	65.7%	83.9%	4.1%	34.9%	43.7%
最小値	-4.8%	-17.0%	-13.6%	-22.8%	0.4%	-12.7%	-10.1%

※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2009年12月から2014年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、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り、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

新興国株……MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について**東証株価指数(TOPIX、配当込)**

当指数は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

当指数は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当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。

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

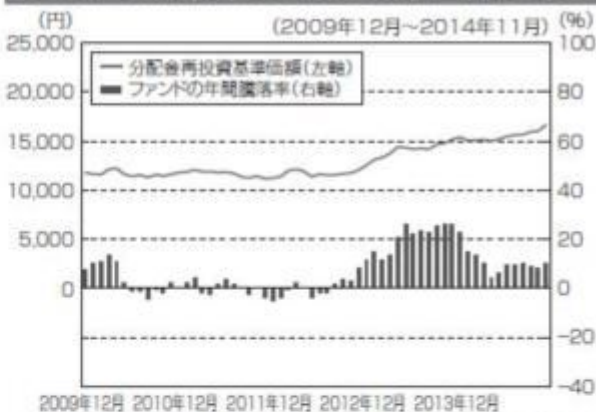
当指数は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス国債

当指数は、野村證券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、当指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

当指数は、Citigroup Index LLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、当指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、Citigroup

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

2009年12月 2010年12月 2011年12月 2012年12月 2013年12月

※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。

※分配金再投資基準価額は、2009年12月末の基準価額を起点として指数化しています。

※当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)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り、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

日本国債……NOMURA-ボンドパフォーマンス・インデックス国債

先進国債……シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債……JPモルガンGBI-EMグローバル(レティバースィファイド(円ヘッジなし、円ベース))

Index LLC に帰属します。

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド（円ヘッジなし、円ベース）

当指数は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

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0.2%の率を乗じて得た額（1口当たり）が差し引かれます。

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

（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0.324%（税抜0.3%）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（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.30%	0.17%	0.10%	0.03%

委託会社	委託した資金の運用の対価
販売会社	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
受託会社	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外貨建資産の保管などに要する費用、解

約に伴う支払資金の手当てなどを目的とした借入金の利息および受託会社の立て替えた立替金の利息。

<投資対象とするマザーファンドに係る費用>

- ・組入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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

確定拠出年金の場合

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

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

確定拠出年金でない場合

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

2) 解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益（譲渡益）^{*}については譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座（源泉徴収選択口座）を選択している場合は、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。

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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

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

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、15.315%（所得税のみ）の税率による源泉徴収が行なわれます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

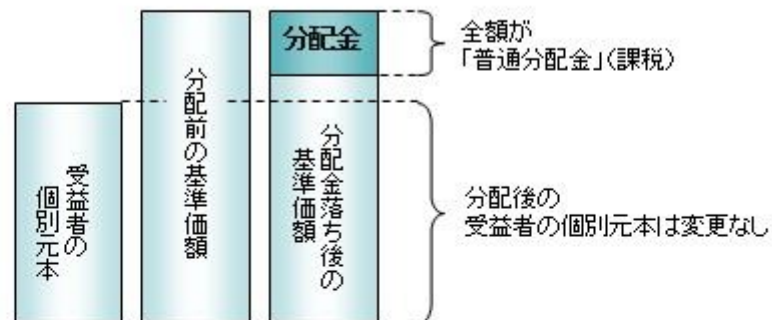
- 1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

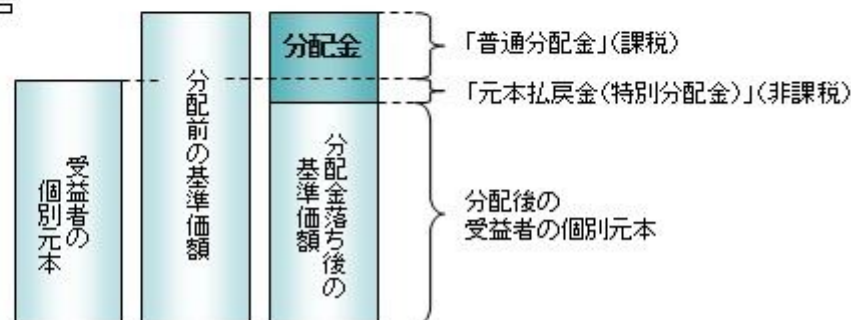
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
 -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

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は平成27年 2月 6日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【DCインデックスバランス(株式40)】

以下の運用状況は2014年11月28日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,555,435,668	95.10
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		131,799,038	4.90
合計(純資産総額)		2,687,234,706	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	905,778,486	1.3131	1,189,420,088	1.3195	1,195,174,712	44.48
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックストピックスマザーファンド	696,271,511	1.1259	783,932,095	1.1708	815,194,685	30.34
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	137,379,177	1.8856	259,042,177	1.9968	274,318,740	10.21
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	113,783,371	2.2859	260,097,408	2.3795	270,747,531	10.08

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.10
合計	95.10

【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3計算期間末 (2005年11月7日)	541	541	1.2799	1.2799
第4計算期間末 (2006年11月6日)	804	805	1.3524	1.3534

第5計算期間末	(2007年11月 6日)	1,085	1,085	1.3957	1.3967
第6計算期間末	(2008年11月 6日)	1,009	1,009	1.1219	1.1229
第7計算期間末	(2009年11月 6日)	1,203	1,204	1.1521	1.1531
第8計算期間末	(2010年11月 8日)	1,338	1,339	1.1621	1.1631
第9計算期間末	(2011年11月 7日)	1,435	1,436	1.1334	1.1344
第10計算期間末	(2012年11月 6日)	1,609	1,610	1.1729	1.1739
第11計算期間末	(2013年11月 6日)	2,074	2,076	1.4699	1.4709
第12計算期間末	(2014年11月 6日)	2,656	2,657	1.6212	1.6222
	2013年11月末日	2,135		1.5112	
	12月末日	2,172		1.5347	
	2014年 1月末日	2,144		1.4999	
	2月末日	2,148		1.5051	
	3月末日	2,162		1.5084	
	4月末日	2,157		1.4966	
	5月末日	2,210		1.5148	
	6月末日	2,466		1.5425	
	7月末日	2,515		1.5568	
	8月末日	2,522		1.5596	
	9月末日	2,584		1.5897	
	10月末日	2,620		1.5967	
	11月末日	2,687		1.6600	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第3期	2004年11月 9日～2005年11月 7日	0.0000
第4期	2005年11月 8日～2006年11月 6日	0.0010
第5期	2006年11月 7日～2007年11月 6日	0.0010
第6期	2007年11月 7日～2008年11月 6日	0.0010
第7期	2008年11月 7日～2009年11月 6日	0.0010
第8期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	0.0010
第9期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	0.0010
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	0.0010
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	0.0010
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	0.0010

【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第3期	2004年11月 9日～2005年11月 7日	13.63
第4期	2005年11月 8日～2006年11月 6日	5.74

第5期	2006年11月 7日～2007年11月 6日	3.28
第6期	2007年11月 7日～2008年11月 6日	19.55
第7期	2008年11月 7日～2009年11月 6日	2.78
第8期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	0.95
第9期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	2.38
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	3.57
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	25.41
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	10.36

(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3期	2004年11月 9日～2005年11月 7日	301,719,942	24,893,281
第4期	2005年11月 8日～2006年11月 6日	221,444,810	49,438,556
第5期	2006年11月 7日～2007年11月 6日	256,467,907	73,913,335
第6期	2007年11月 7日～2008年11月 6日	212,320,920	90,369,023
第7期	2008年11月 7日～2009年11月 6日	223,234,805	78,013,735
第8期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	206,736,758	99,558,607
第9期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	199,510,879	84,921,462
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	232,315,742	126,886,432
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	252,340,970	212,819,956
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	402,200,788	175,054,267

（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2014年11月28日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	28,822,728,360	99.22
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		225,883,033	0.78
合計（純資産総額）		29,048,611,393	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	225,680,000	0.78
----------	----	----	-------------	------

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	193,100	6,195.00	1,196,254,500	7,314.00	1,412,333,400	4.86
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,108,200	587.90	651,510,780	686.40	760,668,480	2.62
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	73,000	7,439.98	543,118,540	7,963.00	581,299,000	2.00
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	104,500	4,018.50	419,933,250	4,475.00	467,637,500	1.61
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	125,900	3,330.50	419,309,950	3,571.50	449,651,850	1.55
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,907,900	189.92	362,348,368	204.50	390,165,550	1.34
日本	株式	KDDI	情報・通信業	46,800	6,780.09	317,308,212	7,604.00	355,867,200	1.23
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	54,000	6,452.00	348,408,000	6,351.00	342,954,000	1.18
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	86,900	3,559.00	309,277,100	3,802.50	330,437,250	1.14
日本	株式	キヤノン	電気機器	81,100	3,275.50	265,643,050	3,801.50	308,301,650	1.06
日本	株式	日立製作所	電気機器	336,000	804.60	270,345,600	916.50	307,944,000	1.06
日本	株式	ファナック	電気機器	14,600	17,910.00	261,486,000	20,020.00	292,292,000	1.01
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	166,900	1,626.50	271,462,850	1,707.00	284,898,300	0.98
日本	株式	三菱地所	不動産業	103,000	2,333.29	240,328,870	2,671.50	275,164,500	0.95
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	54,900	4,579.50	251,414,550	4,972.00	272,962,800	0.94
日本	株式	パナソニック	電気機器	170,600	1,221.58	208,401,548	1,532.50	261,444,500	0.90
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	57,800	3,991.00	230,679,800	4,427.50	255,909,500	0.88
日本	株式	三井不動産	不動産業	73,000	3,056.00	223,088,000	3,430.50	250,426,500	0.86
日本	株式	三菱商事	卸売業	105,800	2,044.50	216,308,100	2,245.00	237,521,000	0.82
日本	株式	ソニー	電気機器	90,000	1,899.47	170,952,300	2,600.00	234,000,000	0.81
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	25,700	8,274.00	212,641,800	8,897.00	228,652,900	0.79
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	56,800	3,255.96	184,938,528	3,880.50	220,412,400	0.76
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	196,400	945.60	185,715,840	1,108.50	217,709,400	0.75
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	12,500	14,970.00	187,125,000	17,275.00	215,937,500	0.74
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	113,800	1,739.50	197,955,100	1,851.50	210,700,700	0.73
日本	株式	信越化学工業	化学	26,300	6,898.00	181,417,400	7,990.00	210,137,000	0.72
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	47,600	3,310.50	157,579,800	4,318.00	205,536,800	0.71
日本	株式	小松製作所	機械	72,600	2,450.90	177,935,340	2,811.00	204,078,600	0.70
日本	株式	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	282,400	606.30	171,219,120	714.00	201,633,600	0.69

日本	株式	三菱電機	電気機器	140,000	1,328.50	185,990,000	1,426.50	199,710,000	0.69
----	----	------	------	---------	----------	-------------	----------	-------------	------

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	0.08
		鉱業	0.41
		建設業	2.62
		食料品	4.04
		繊維製品	0.76
		パルプ・紙	0.22
		化学	5.85
		医薬品	4.43
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.89
		ガラス・土石製品	0.93
		鉄鋼	1.54
		非鉄金属	0.96
		金属製品	0.64
		機械	5.30
		電気機器	13.06
		輸送用機器	11.79
		精密機器	1.46
		その他製品	1.38
		電気・ガス業	2.05
		陸運業	3.94
		海運業	0.32
		空運業	0.60
		倉庫・運輸関連業	0.23
		情報・通信業	6.90
		卸売業	4.16
		小売業	4.05
銀行業	9.15		
証券、商品先物取引業	1.44		
保険業	2.35		
その他金融業	1.27		
不動産業	3.11		
サービス業	2.85		
合 計			99.22

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2014年12月	買建	16	日本円	208,198,535	225,680,000	0.78

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

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2014年11月28日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

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	50,161,733,699	57.76
	カナダ	3,740,478,196	4.31
	モーリシャス	5,491,883	0.01
	ドイツ	3,240,937,207	3.73
	イタリア	770,108,389	0.89
	フランス	3,184,928,935	3.67
	オランダ	1,285,625,184	1.48
	スペイン	1,273,693,876	1.47
	ベルギー	445,986,192	0.51
	オーストリア	80,090,073	0.09
	ルクセンブルク	127,065,745	0.15
	フィンランド	319,934,315	0.37
	アイルランド	1,071,420,427	1.23
	ポルトガル	54,159,125	0.06
	イギリス	6,924,630,690	7.97
	スイス	3,528,072,775	4.06
	スウェーデン	1,105,322,178	1.27
	ノルウェー	246,760,268	0.28
	デンマーク	543,565,273	0.63
	ケイマン	81,194,398	0.09
オーストラリア	2,395,287,574	2.76	
バミューダ	139,390,452	0.16	
ニュージーランド	41,732,828	0.05	
香港	987,627,091	1.14	
シンガポール	570,891,735	0.66	
イスラエル	193,876,598	0.22	

	ジャージー	458,048,650	0.53
	ガーンジー	25,474,766	0.03
	英ヴァージン諸島	45,723,443	0.05
	小計	83,049,251,965	95.62
投資証券	アメリカ	1,443,520,982	1.66
	カナダ	14,974,454	0.02
	フランス	107,693,786	0.12
	オランダ	11,902,454	0.01
	イギリス	118,599,561	0.14
	オーストラリア	231,248,584	0.27
	香港	38,619,100	0.04
	シンガポール	29,741,564	0.03
	小計	1,996,300,485	2.30
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,803,505,482	2.08
合計（純資産総額）		86,849,057,932	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	1,286,292,152	1.48
	買建	ドイツ	475,117,440	0.55

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		1,180,010,190	1.36
	売建		298,961,800	0.34

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	138,502	12,440.16	1,722,987,124	14,069.37	1,948,635,884	2.24
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	98,651	11,171.55	1,102,084,845	11,170.37	1,101,968,210	1.27
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	181,044	5,453.94	987,404,906	5,645.48	1,022,080,734	1.18

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	65,221	12,193.05	795,243,559	12,675.43	826,704,761	0.95
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	115,120	6,053.37	696,864,645	6,417.52	738,785,409	0.85
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	231,233	3,031.41	700,963,694	3,176.84	734,590,267	0.85
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	74,443	8,324.55	619,704,811	8,839.09	658,008,861	0.76
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	62,469	10,068.46	628,967,052	10,508.28	656,441,893	0.76
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	87,000	6,944.83	604,200,227	7,133.99	620,657,843	0.71
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	53,103	10,505.23	557,859,361	11,393.42	605,025,313	0.70
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	43,891	13,704.03	601,483,989	13,609.45	597,332,603	0.69
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	16,218	34,057.77	552,349,076	35,515.64	575,992,795	0.66
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	95,717	5,766.07	551,911,601	5,916.22	566,283,710	0.65
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	146,540	3,441.67	504,343,099	3,676.95	538,820,693	0.62
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	439,911	1,168.24	513,922,375	1,173.44	516,210,104	0.59
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	114,392	3,922.87	448,745,105	4,362.68	499,056,491	0.57
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	119,776	4,004.45	479,637,015	4,153.41	497,480,022	0.57
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	243,139	1,976.80	480,638,537	2,022.91	491,849,603	0.57
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	91,202	4,850.97	442,418,795	5,236.40	477,570,764	0.55
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	26,940	16,500.91	444,534,692	17,520.50	472,002,370	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	66,653	6,811.23	453,988,933	7,064.24	470,852,955	0.54
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	70,047	6,124.31	428,989,823	6,399.78	448,286,083	0.52
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	6,570	64,896.44	426,369,657	64,758.11	425,460,835	0.49
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	6,635	63,818.18	423,433,687	63,887.94	423,896,516	0.49
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	45,710	9,537.61	435,964,341	9,177.01	419,481,246	0.48
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	21,892	19,162.71	419,510,231	19,147.34	419,173,753	0.48
アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	34,974	13,089.24	457,783,195	11,858.46	414,738,095	0.48
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	38,063	10,476.36	398,761,702	10,867.70	413,657,326	0.48
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	34,851	11,184.55	389,793,031	11,746.15	409,365,091	0.47

アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	82,273	4,579.04	376,732,007	4,950.29	407,275,217	0.47
------	----	-------------	-------------	--------	----------	-------------	----------	-------------	------

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	8.82
		素材	5.05
		資本財	7.01
		商業・専門サービス	0.85
		運輸	2.11
		自動車・自動車部品	1.65
		耐久消費財・アパレル	1.64
		消費者サービス	1.65
		メディア	2.96
		小売	3.14
		食品・生活必需品小売り	2.07
		食品・飲料・タバコ	6.09
		家庭用品・パーソナル用品	1.75
		ヘルスケア機器・サービス	3.29
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.72
		銀行	9.56
		各種金融	3.94
		保険	4.14
		不動産	0.61
		ソフトウェア・サービス	6.86
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.52		
電気通信サービス	3.17		
公益事業	3.26		
半導体・半導体製造装置	1.77		
投資証券			2.30
合計			97.92

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500 1412	買建	21	米ドル	10,714,125	1,266,730,998	10,879,575	1,286,292,152	1.48

株価指数先物取引	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1412	買建	105	ユーロ	3,138,820	462,034,304	3,227,700	475,117,440	0.55
----------	-----	-------------------	-------------	----	-----	-----	-----------	-------------	-----------	-------------	------

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	買建	7,021,000.00	801,318,481	829,688,620	0.96
	ユーロ	買建	2,381,000.00	345,937,741	350,321,570	0.40
	米ドル	売建	2,000,000.00	235,100,000	236,440,000	0.27
	加ドル	売建	260,000.00	27,141,660	27,092,000	0.03
	豪ドル	売建	140,000.00	14,093,940	14,093,800	0.02
	香港ドル	売建	1,400,000.00	21,224,000	21,336,000	0.02

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2014年11月28日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

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	28,010,290,599	79.84
地方債証券	日本	2,332,553,000	6.65
特殊債券	日本	2,604,075,000	7.42
社債券	日本	1,787,444,000	5.09
	オーストラリア	203,117,000	0.58
	小計	1,990,561,000	5.67
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		147,074,901	0.42
合計(純資産総額)		35,084,554,500	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	750,000,000	105.31	789,840,000	105.29	789,675,000	1.300	2019/3/20	2.25
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	673,000,000	106.08	713,952,050	106.05	713,750,150	1.300	2019/12/20	2.03

日本	国債証券	第107回利付国債(5年)	705,000,000	100.51	708,644,850	100.56	708,969,150	0.200	2017/12/20	2.02
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	581,000,000	106.30	617,626,240	106.23	617,225,350	1.400	2019/9/20	1.76
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	545,000,000	108.65	592,175,200	108.90	593,515,900	1.400	2022/12/20	1.69
日本	国債証券	第284回利付国債(10年)	462,000,000	103.59	478,618,140	103.47	478,045,260	1.700	2016/12/20	1.36
日本	国債証券	第93回利付国債(5年)	445,000,000	100.55	447,487,550	100.51	447,309,550	0.500	2015/12/20	1.27
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	410,000,000	107.14	439,312,200	107.23	439,679,900	1.300	2021/3/20	1.25
日本	国債証券	第290回利付国債(10年)	406,000,000	104.60	424,684,120	104.54	424,452,700	1.400	2018/3/20	1.21
日本	国債証券	第106回利付国債(5年)	420,000,000	100.48	422,047,000	100.53	422,230,200	0.200	2017/9/20	1.20
日本	国債証券	第334回利付国債(2年)	420,000,000	100.09	420,379,149	100.09	420,379,149	0.100	2015/11/15	1.20
日本	国債証券	第117回利付国債(5年)	370,000,000	100.48	371,776,000	100.55	372,057,200	0.200	2019/3/20	1.06
日本	国債証券	第36回利付国債(30年)	310,000,000	109.28	338,774,200	113.98	353,359,700	2.000	2042/3/20	1.01
日本	国債証券	第97回利付国債(5年)	350,000,000	100.63	352,208,500	100.61	352,138,500	0.400	2016/6/20	1.00
日本	国債証券	第292回利付国債(10年)	331,000,000	105.61	349,595,580	105.53	349,314,230	1.700	2018/3/20	1.00
日本	国債証券	第29回利付国債(30年)	276,000,000	118.22	326,289,960	121.87	336,377,760	2.400	2038/9/20	0.96
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	260,000,000	119.13	309,753,600	119.78	311,451,400	2.300	2026/9/20	0.89
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	260,000,000	119.01	309,439,000	119.65	311,092,600	2.300	2026/6/20	0.89
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	280,000,000	108.88	304,886,400	110.57	309,615,600	1.700	2032/9/20	0.88
日本	国債証券	第291回利付国債(10年)	287,000,000	104.26	299,237,680	104.21	299,097,050	1.300	2018/3/20	0.85
日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	240,000,000	116.75	280,214,400	118.14	283,538,400	2.100	2029/9/20	0.81
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	275,000,000	102.12	280,830,000	102.46	281,789,750	0.600	2023/3/20	0.80
日本	国債証券	第102回利付国債(5年)	280,000,000	100.59	281,677,200	100.59	281,663,200	0.300	2016/12/20	0.80
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	270,000,000	103.89	280,516,500	104.16	281,253,600	0.800	2022/9/20	0.80
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	261,000,000	104.01	271,468,710	103.89	271,155,510	1.700	2017/3/20	0.77
日本	国債証券	第50回利付国債(20年)	237,000,000	110.97	263,017,860	111.02	263,136,360	1.900	2021/3/22	0.75
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	208,000,000	119.25	248,040,000	121.46	252,647,200	2.400	2034/3/20	0.72
日本	国債証券	第301回利付国債(10年)	223,000,000	106.49	237,477,160	106.43	237,347,820	1.500	2019/6/20	0.68
日本	国債証券	第34回利付国債(30年)	200,000,000	114.54	229,099,500	118.44	236,898,000	2.200	2041/3/20	0.68
日本	国債証券	第298回利付国債(10年)	221,000,000	105.05	232,178,180	105.03	232,116,300	1.300	2018/12/20	0.66

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	79.84

地方債証券	6.65
特殊債券	7.42
社債券	5.67
合 計	99.58

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2014年11月28日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

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	85,233,258,549	38.98
	カナダ	5,088,939,474	2.33
	メキシコ	2,425,201,889	1.11
	ドイツ	18,073,642,521	8.27
	イタリア	22,242,636,706	10.17
	フランス	22,002,097,124	10.06
	オランダ	5,846,367,536	2.67
	スペイン	12,114,906,019	5.54
	ベルギー	5,877,361,718	2.69
	オーストリア	3,653,560,176	1.67
	フィンランド	1,444,661,036	0.66
	アイルランド	1,789,014,741	0.82
	イギリス	18,000,178,790	8.23
	スイス	743,287,979	0.34
	スウェーデン	1,095,402,436	0.50
	ノルウェー	614,627,358	0.28
	デンマーク	1,827,506,374	0.84
	ポーランド	1,396,594,707	0.64
	オーストラリア	3,646,413,624	1.67
	シンガポール	840,717,833	0.38
マレーシア	1,111,798,334	0.51	
南アフリカ	1,196,132,820	0.55	

	小計	216,264,307,744	98.90
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		2,395,414,467	1.10
合計(純資産総額)		218,659,722,211	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		323,475,270	0.15

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	18,200,000	12,706.95	2,312,665,624	12,657.07	2,303,587,777	5.125	2016/5/15	1.05
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	17,700,000	12,481.57	2,209,239,314	12,437.24	2,201,391,798	4.500	2016/2/15	1.01
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	15,900,000	13,079.19	2,079,591,806	13,069.03	2,077,976,303	3.625	2021/2/15	0.95
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,000,000	16,584.52	1,990,143,422	16,519.87	1,982,384,578	8.000	2021/11/15	0.91
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	15,200,000	12,978.51	1,972,734,055	12,951.72	1,968,662,509	3.750	2018/11/15	0.90
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,800,000	13,043.13	1,799,952,437	13,021.92	1,797,025,801	3.625	2020/2/15	0.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	14,300,000	12,093.63	1,729,389,927	12,070.54	1,726,087,801	2.125	2015/12/31	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,000,000	12,877.83	1,674,118,326	12,849.19	1,670,395,928	3.375	2019/11/15	0.76
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,100,000	12,160.14	1,471,376,968	12,140.74	1,469,029,918	2.250	2016/3/31	0.67
ドイツ	国債証券	BUNDESREP. DEUTSCHLAND	8,080,000	17,506.49	1,414,524,877	17,617.46	1,423,491,106	3.250	2021/7/4	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,500,000	12,374.43	1,423,059,692	12,339.33	1,419,023,246	3.250	2016/5/31	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	15,489.05	1,394,014,830	15,400.38	1,386,034,305	8.125	2019/8/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,500,000	11,902.43	1,368,780,114	11,895.04	1,367,930,336	1.500	2018/12/31	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,700,000	13,513.31	1,310,791,994	13,433.88	1,303,086,724	7.500	2016/11/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,950,000	16,446.90	1,307,528,661	16,369.31	1,301,360,380	8.750	2020/8/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,800,000	13,022.84	1,276,239,277	12,960.96	1,270,174,448	4.250	2017/11/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,000,000	12,399.37	1,239,937,125	12,365.19	1,236,519,539	3.250	2016/6/30	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,000,000	12,392.90	1,239,290,554	12,356.88	1,235,688,234	3.000	2016/8/31	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,500,000	12,981.65	1,233,257,130	12,955.42	1,230,765,063	3.500	2020/5/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,000,000	12,091.78	1,209,178,851	12,071.46	1,207,146,773	2.000	2016/1/31	0.55
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,160,000	22,742.40	1,173,507,840	23,373.68	1,206,081,987	9.000	2023/11/1	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,250,000	12,920.32	1,195,129,801	12,865.82	1,190,088,862	4.625	2017/2/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,100,000	13,067.96	1,189,184,533	13,030.23	1,185,751,762	4.000	2018/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,500,000	12,491.73	1,186,715,151	12,462.18	1,183,907,189	2.750	2018/2/28	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	13,091.20	1,178,208,133	13,018.23	1,171,640,827	7.250	2016/5/15	0.54
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,320,000	15,510.46	1,135,365,965	15,523.68	1,136,334,102	3.750	2016/8/1	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,800,000	12,974.81	1,141,784,057	12,903.69	1,135,525,256	4.500	2017/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	14,241.17	1,139,293,837	14,149.72	1,131,978,356	8.750	2017/5/15	0.52

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,600,000	13,117.06	1,128,067,529	13,063.49	1,123,460,254	4.750	2017/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	12,507.44	1,125,669,677	12,465.87	1,121,928,806	3.125	2017/1/31	0.51

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.90
合計	98.90

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	売建	920,000.00	108,166,356	108,762,400	0.05
	加ドル	売建	100,000.00	10,455,400	10,420,000	0.00
	メキシコペソ	売建	1,419,000.00	12,220,853	12,146,640	0.01
	ユーロ	売建	842,000.00	123,682,821	123,933,980	0.06
	英ポンド	売建	179,000.00	33,171,101	33,242,090	0.02
	ノルウェークローネ	売建	692,000.00	11,899,839	11,764,000	0.01
	ポーランドズロチ	売建	339,000.00	11,923,138	11,929,410	0.01
	南アフリカランド	売建	1,049,000.00	11,280,421	11,276,750	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。

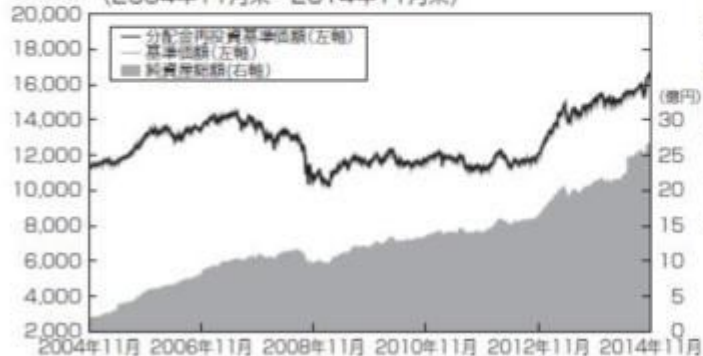
参考情報

運用実績

2014年11月28日現在

基準価額・純資産の推移

(円) (2004年11月末～2014年11月末)



基準価額……………16,600円
純資産総額……………26.87億円

※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。
※分配金再投資基準価額は、2004年11月末の基準価額を起点として指数化しています。
※分配金再投資基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものである点にご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2010年11月	2011年11月	2012年11月	2013年11月	2014年11月	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	90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	30.34%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	10.21%
日本債券インデックスマザーファンド	44.48%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	10.08%
現金その他	4.90%

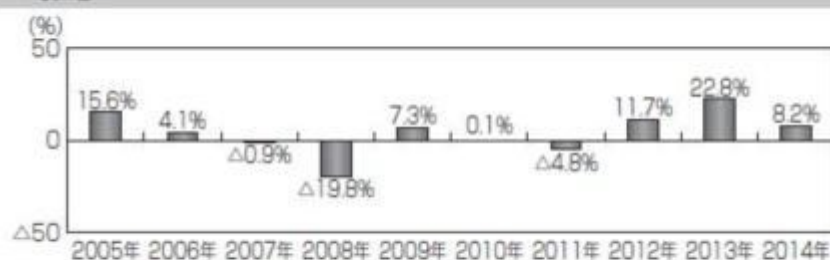
※当ファンドの対純資産総額比です。

<組入上位銘柄>

組入資産	銘柄	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	輸送用機器	4.86%	
	2 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.62%	
	3 ソフトバンク	情報・通信業	2.00%	
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.24%	
	2 EXXON MOBIL CORP	エネルギー	1.27%	
	3 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1.18%	
組入資産	銘柄	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)	国債証券	2019/3/20	2.25%
	2 第305回利付国債(10年)	国債証券	2019/12/20	2.03%
	3 第107回利付国債(5年)	国債証券	2017/12/20	2.02%
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5.125%)	国債証券	2016/5/15	1.05%
	2 US TREASURY N/B (クーポン4.500%)	国債証券	2016/2/15	1.01%
	3 US TREASURY N/B (クーポン3.625%)	国債証券	2021/2/15	0.95%

※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。

※2014年は、2014年11月末までの騰落率です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(1) 申込方法

- ・確定拠出年金制度の規定に従い、販売会社所定の方法でお申し込みください。
- ・当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドで

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

(2) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(3) 取扱時間

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

(4) 申込金額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

(5) 申込単位

1円以上1円単位

(6) 申込代金の支払い

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

(7) 受付の中止および取消

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

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

2【換金(解約)手続等】

<解約請求による換金>

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約制限

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

(4) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額(当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た額)を控除した価額とします。

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時~午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額に基づいて計算された金額となります。

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

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

(6) 解約単位

1口単位

販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。

(7) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(8) 受付の中止および取消

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

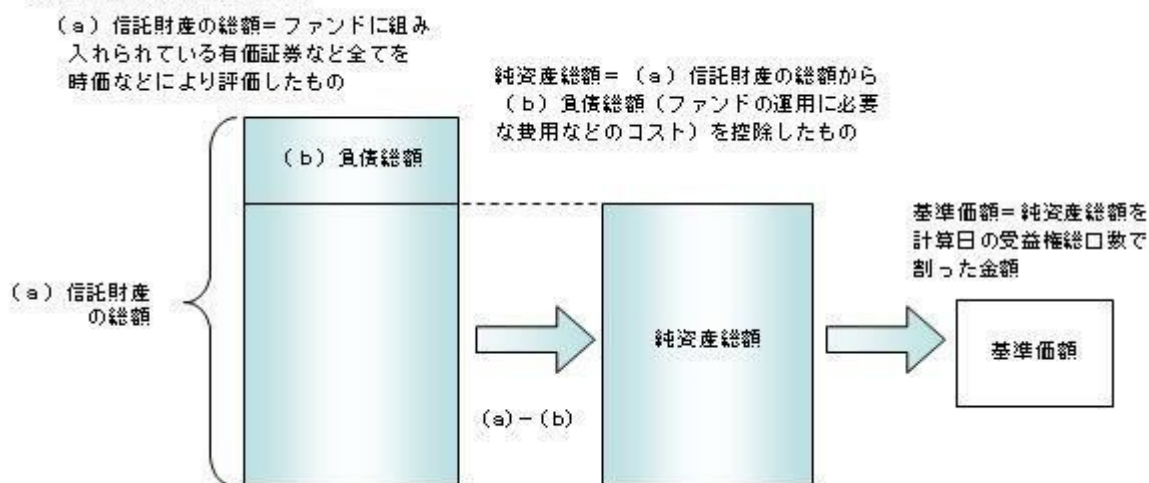
3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

- ・信託財産に属する資産については、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価します。

<主な資産の評価方法>

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

外国株式

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

公社債（国内・外国）

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

- ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
 - ・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）
 - ・価格情報会社の提供する価額
- 残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。

* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

- ・外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算については、原則と

してわが国における計算日の対顧客相場の仲値によって計算します。

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします（平成14年12月10日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

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

(5) 【その他】

信託の終了（繰上償還）

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

償還金について

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

信託約款の変更

 - 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
 - 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを

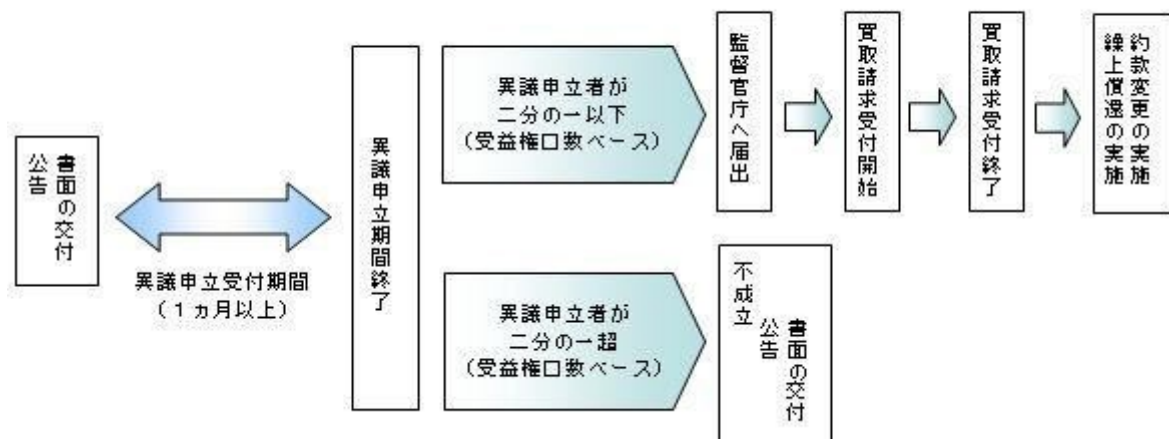
公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。

- 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)
- 4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

異議の申立て

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

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

- 委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。
- 交付運用報告書は、原則として知っている受益者に対して交付されます。
- 運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の交付請求があった場合には、交付します。

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

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。

す。

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期計算期間(平成25年11月7日から平成26年11月6日まで)の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【DCインデックスバランス(株式40)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第11期 平成25年11月6日現在	第12期 平成26年11月6日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	106,939,936	92,027,672
親投資信託受益証券	1,972,452,526	2,527,380,329
未収入金	188,380	45,923,548
未収利息	179	124
流動資産合計	2,079,581,021	2,665,331,673
資産合計	2,079,581,021	2,665,331,673
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,411,406	1,638,553
未払解約金	259,679	3,339,313
未払受託者報酬	316,955	394,183
未払委託者報酬	2,853,122	3,548,236
その他未払費用	51,716	64,333
流動負債合計	4,892,878	8,984,618
負債合計	4,892,878	8,984,618
純資産の部		
元本等		
元本	1,411,406,764	1,638,553,285
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	663,281,379	1,017,793,770
(分配準備積立金)	322,057,342	509,913,611
元本等合計	2,074,688,143	2,656,347,055
純資産合計	2,074,688,143	2,656,347,055
負債純資産合計	2,079,581,021	2,665,331,673

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期		第12期	
	自 至	平成24年11月 7日 平成25年11月 6日	自 至	平成25年11月 7日 平成26年11月 6日
営業収益				
受取利息		59,805		65,202
有価証券売買等損益		421,618,117		241,019,946
営業収益合計		421,677,922		241,085,148
営業費用				
受託者報酬		602,393		732,174
委託者報酬		5,422,613		6,590,683
その他費用		98,291		119,159
営業費用合計		6,123,297		7,442,016
営業利益又は営業損失（ ）		415,554,625		233,643,132
経常利益又は経常損失（ ）		415,554,625		233,643,132
当期純利益又は当期純損失（ ）		415,554,625		233,643,132
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（ ）		45,357,849		8,836,072
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		237,263,239		663,281,379
剰余金増加額又は欠損金減少額		97,027,951		214,168,895
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		97,027,951		214,168,895
剰余金減少額又は欠損金増加額		39,795,181		82,825,011
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		39,795,181		82,825,011
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		1,411,406		1,638,553
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		663,281,379		1,017,793,770

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		第11期 平成25年11月 6日現在	第12期 平成26年11月 6日現在
1.	期首元本額	1,371,885,750円	1,411,406,764円
	期中追加設定元本額	252,340,970円	402,200,788円
	期中一部解約元本額	212,819,956円	175,054,267円
2.	受益権の総数	1,411,406,764口	1,638,553,285口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第11期 自 平成24年11月 7日 至 平成25年11月 6日		第12期 自 平成25年11月 7日 至 平成26年11月 6日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	35,307,865円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 40,111,405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	159,259,658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 184,695,655円
C	信託約款に定める収益調整金	356,395,552円	C 信託約款に定める収益調整金 507,880,159円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	128,901,225円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 286,745,104円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	679,864,300円	E 分配対象収益(A+B+C+D) 1,019,432,323円
F	分配対象収益(1万口当たり)	4,816円	F 分配対象収益(1万口当たり) 6,221円
G	分配金額	1,411,406円	G 分配金額 1,638,553円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり) 10円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第11期 自 平成24年11月 7日 至 平成25年11月 6日	第12期 自 平成25年11月 7日 至 平成26年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	第11期 平成25年11月 6日現在	第12期 平成26年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第11期（平成25年11月 6日現在）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	337,405,019
合計	337,405,019

第12期(平成26年11月6日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	224,831,820
合計	224,831,820

(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11期 平成25年11月6日現在		第12期 平成26年11月6日現在	
1口当たり純資産額	1.4699円	1口当たり純資産額	1.6212円
(1万口当たり純資産額)	(14,699円)	(1万口当たり純資産額)	(16,212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	146,819,018	276,841,940	
	日本債券インデックスマザーファンド	897,888,395	1,179,017,251	

海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	119,135,388	272,331,583	
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	709,822,858	799,189,555	
合計	1,873,665,659	2,527,380,329	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

貸借対照表

	平成25年11月 6日現在	平成26年11月 6日現在
(単位:円)		
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	163,429,816	100,313,408
株式	27,322,939,646	28,311,290,530
派生商品評価勘定	754,205	15,692,921
未収入金	-	403,573,540
未収配当金	206,715,885	210,218,346
未収利息	273	136
前払金	5,510,000	-
流動資産合計	27,699,349,825	29,041,088,881
資産合計	27,699,349,825	29,041,088,881
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,814,432	-
前受金	-	18,865,000
未払解約金	5,435,292	309,962,448
流動負債合計	8,249,724	328,827,448
負債合計	8,249,724	328,827,448
純資産の部		

平成25年11月 6日現在

平成26年11月 6日現在

元本等		
元本	28,560,407,434	25,502,591,555
剰余金		
剰余金又は欠損金()	869,307,333	3,209,669,878
元本等合計	27,691,100,101	28,712,261,433
純資産合計	27,691,100,101	28,712,261,433
負債純資産合計	27,699,349,825	29,041,088,881

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成25年11月 6日現在	平成26年11月 6日現在
1.	期首	平成24年11月 7日	平成25年11月 7日
	期首元本額	40,912,921,379円	28,560,407,434円
	期首からの追加設定元本額	1,278,780,247円	1,582,667,991円
	期首からの一部解約元本額	13,631,294,192円	4,640,483,870円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス(株式20)	168,495,504円	185,148,991円
	DCインデックスバランス(株式40)	640,206,089円	709,822,858円
	DCインデックスバランス(株式60)	1,226,891,486円	1,334,068,029円
	DCインデックスバランス(株式80)	1,474,076,768円	1,605,941,404円
	インデックスファンド日本株式(DC専用)	1,064,138,558円	1,064,255,787円
	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	9,628,079,002円	7,682,541,246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	10,879,626円	6,688,312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)	28,627,449円	32,462,437円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	122,665,512円	86,247,925円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	89,674,943円	67,959,583円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	143,464,536円	100,058,810円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	180,221,257円	121,866,499円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	9,894,065,129円	8,728,480,826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)	54,520,360円	35,383,791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)	75,912,879円	56,380,916円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	55,661,438円	50,019,327円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	311,541,321円	297,241,733円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	894,916,667円	867,382,378円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	1,233,661,971円	1,222,452,766円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	1,262,706,939円	1,248,187,937円
計	28,560,407,434円	25,502,591,555円
2. 受益権の総数	28,560,407,434口	25,502,591,555口
3. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	869,307,333円	- 円
4. 担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。 株式	362,338,000円	405,935,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 平成24年11月 7日 至 平成25年11月 6日	自 平成25年11月 7日 至 平成26年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成25年11月 6日現在	平成26年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成25年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

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

(平成26年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	2,120,784,703
合計	2,120,784,703

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成25年11月 6日現在)

(単位：円)

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

(平成26年11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	283,305,000	-	299,090,000	15,785,000
合計		283,305,000	-	299,090,000	15,785,000

(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25年11月 6日現在		平成26年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	0.9696円	1口当たり純資産額	1.1259円
(1万口当たり純資産額)	(9,696円)	(1万口当たり純資産額)	(11,259円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	7,000	258.00	1,806,000	
日本水産	19,800	373.00	7,385,400	
マルハニチロ	3,100	1,581.00	4,901,100	
サカタのタネ	2,400	1,618.00	3,883,200	
ホクト	1,800	1,996.00	3,592,800	
住石ホールディングス	4,900	121.00	592,900	
日鉄鉱業	4,000	405.00	1,620,000	
三井松島産業	11,000	132.00	1,452,000	
国際石油開発帝石	84,600	1,332.00	112,687,200	
日本海洋掘削	500	4,270.00	2,135,000	
石油資源開発	2,300	3,560.00	8,188,000	
K & O エナジーグループ	1,100	1,407.00	1,547,700	
ショーボンドホールディングス	1,400	4,180.00	5,852,000	
ミライト・ホールディングス	4,900	1,238.00	6,066,200	
タマホーム	1,100	612.00	673,200	
サンヨーホームズ	100	668.00	66,800	
ダイセキ環境ソリューション	200	1,797.00	359,400	
安藤・間	10,700	729.00	7,800,300	
東急建設	5,700	531.00	3,026,700	

コムシスホールディングス	7,200	2,005.00	14,436,000
ミサワホーム	1,900	1,021.00	1,939,900
高松コンストラクショングループ	1,200	2,139.00	2,566,800
東建コーポレーション	600	5,040.00	3,024,000
ヤマウラ	800	405.00	324,000
大成建設	81,000	614.00	49,734,000
大林組	48,000	755.00	36,240,000
清水建設	49,000	807.00	39,543,000
飛島建設	10,500	298.00	3,129,000
長谷工コーポレーション	20,100	829.00	16,662,900
松井建設	2,000	525.00	1,050,000
銭高組	2,000	356.00	712,000
鹿島建設	71,000	482.00	34,222,000
不動テトラ	12,200	263.00	3,208,600
大末建設	700	935.00	654,500
鉄建建設	10,000	477.00	4,770,000
日鉄住金テックスエンジ	3,000	544.00	1,632,000
西松建設	17,000	528.00	8,976,000
三井住友建設	65,000	131.00	8,515,000
大豊建設	4,000	516.00	2,064,000
前田建設工業	11,000	932.00	10,252,000
ナカノフドー建設	1,300	367.00	477,100
奥村組	15,000	607.00	9,105,000
大和小田急建設	900	838.00	754,200
東鉄工業	1,900	2,490.00	4,731,000
イチケン	2,000	338.00	676,000
浅沼組	5,000	170.00	850,000
戸田建設	20,000	504.00	10,080,000
熊谷組	20,000	400.00	8,000,000
青木あすなる建設	1,000	811.00	811,000
北野建設	3,000	335.00	1,005,000
植木組	2,000	287.00	574,000
三井ホーム	2,000	488.00	976,000
矢作建設工業	2,000	878.00	1,756,000
ピーエス三菱	1,800	499.00	898,200
東日本ハウス	2,100	465.00	976,500
大東建託	6,100	13,880.00	84,668,000
新日本建設	1,900	382.00	725,800
N I P P O	4,000	1,957.00	7,828,000
東亜道路工業	3,000	431.00	1,293,000
前田道路	5,000	1,720.00	8,600,000
日本道路	5,000	612.00	3,060,000

東亜建設工業	12,000	193.00	2,316,000
若築建設	9,000	217.00	1,953,000
東洋建設	4,300	499.00	2,145,700
五洋建設	17,900	357.00	6,390,300
大林道路	2,000	785.00	1,570,000
福田組	2,000	1,134.00	2,268,000
住友林業	11,800	1,199.00	14,148,200
日本基礎技術	2,000	395.00	790,000
日成ビルド工業	5,000	281.00	1,405,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	8,000	105.00	840,000
巴コーポレーション	2,100	440.00	924,000
パナホーム	6,000	729.00	4,374,000
大和ハウス工業	47,000	2,137.50	100,462,500
ライト工業	2,600	1,011.00	2,628,600
積水ハウス	49,400	1,412.00	69,752,800
日特建設	2,200	562.00	1,236,400
北陸電気工事	1,000	594.00	594,000
ユアテック	2,000	601.00	1,202,000
西部電気工業	2,000	482.00	964,000
四電工	2,000	402.00	804,000
中電工	2,300	1,852.00	4,259,600
関電工	7,000	601.00	4,207,000
きんでん	11,000	1,156.00	12,716,000
東京エネシス	2,000	745.00	1,490,000
トーエネック	2,000	593.00	1,186,000
住友電設	1,300	1,359.00	1,766,700
日本電設工業	2,600	1,478.00	3,842,800
協和エクシオ	6,800	1,350.00	9,180,000
新日本空調	1,400	911.00	1,275,400
N D S	3,000	312.00	936,000
九電工	3,000	1,230.00	3,690,000
三機工業	3,300	766.00	2,527,800
日揮	16,000	2,817.00	45,072,000
中外炉工業	5,000	219.00	1,095,000
ヤマト	1,000	394.00	394,000
太平電業	2,000	905.00	1,810,000
高砂熱学工業	4,500	1,418.00	6,381,000
三晃金属工業	2,000	258.00	516,000
朝日工業社	2,000	398.00	796,000
明星工業	3,000	771.00	2,313,000
大気社	2,300	2,421.00	5,568,300
ダイダン	2,000	653.00	1,306,000

日比谷総合設備	2,100	1,618.00	3,397,800
東芝プラントシステム	2,600	1,831.00	4,760,600
東洋エンジニアリング	8,000	556.00	4,448,000
千代田化工建設	11,000	1,083.00	11,913,000
新興プランテック	3,300	830.00	2,739,000
日本製粉	10,000	552.00	5,520,000
日清製粉グループ本社	17,600	1,117.00	19,659,200
日東富士製粉	1,000	316.00	316,000
昭和産業	6,000	435.00	2,610,000
鳥越製粉	1,300	760.00	988,000
中部飼料	1,600	673.00	1,076,800
フィード・ワンホールディングス	10,000	110.00	1,100,000
東洋精糖	3,000	101.00	303,000
日本甜菜製糖	8,000	187.00	1,496,000
三井製糖	6,000	372.00	2,232,000
塩水港精糖	1,800	280.00	504,000
森永製菓	15,000	257.00	3,855,000
中村屋	4,000	429.00	1,716,000
江崎グリコ	3,700	3,645.00	13,486,500
名糖産業	700	1,137.00	795,900
不二家	9,000	199.00	1,791,000
山崎製パン	12,000	1,386.00	16,632,000
第一屋製パン	3,000	133.00	399,000
モロゾフ	2,000	357.00	714,000
亀田製菓	900	3,545.00	3,190,500
寿スピリッツ	400	2,210.00	884,000
カルビー	6,000	3,870.00	23,220,000
森永乳業	15,000	361.00	5,415,000
六甲バター	700	1,173.00	821,100
ヤクルト本社	8,600	6,080.00	52,288,000
明治ホールディングス	4,800	9,400.00	45,120,000
雪印メグミルク	3,800	1,440.00	5,472,000
プリマハム	9,000	256.00	2,304,000
日本ハム	12,000	2,387.00	28,644,000
伊藤ハム	9,000	570.00	5,130,000
林兼産業	6,000	78.00	468,000
丸大食品	8,000	414.00	3,312,000
米久	500	1,488.00	744,000
S Foods	1,000	2,172.00	2,172,000
サッポロホールディングス	26,000	466.00	12,116,000
アサヒグループホールディングス	32,300	3,466.00	111,951,800
キリンホールディングス	68,700	1,418.00	97,416,600

宝ホールディングス	12,600	838.00	10,558,800
オエノンホールディングス	4,000	227.00	908,000
養命酒製造	1,000	871.00	871,000
コカ・コーラウエスト	5,500	1,587.00	8,728,500
コカ・コーライーストジャパン	4,900	2,091.00	10,245,900
サントリー食品インターナショナル	9,600	4,190.00	40,224,000
ダイドードリンコ	800	4,590.00	3,672,000
伊藤園	4,400	2,168.00	9,539,200
キーコーヒー	1,400	1,613.00	2,258,200
ユニカフェ	500	670.00	335,000
ジャパンフーズ	200	1,084.00	216,800
日清オイリオグループ	8,000	405.00	3,240,000
不二製油	4,300	1,756.00	7,550,800
かどや製油	200	2,617.00	523,400
J - オイルミルズ	7,000	363.00	2,541,000
キッコーマン	13,000	2,649.00	34,437,000
味の素	37,000	2,153.00	79,661,000
キューピー	8,200	1,927.00	15,801,400
ハウス食品グループ本社	5,900	1,888.00	11,139,200
カゴメ	6,200	1,760.00	10,912,000
焼津水産化学工業	700	979.00	685,300
アリアケジャパン	1,400	2,527.00	3,537,800
ニチレイ	17,000	460.00	7,820,000
東洋水産	8,400	3,885.00	32,634,000
イトアンド	200	1,661.00	332,200
日清食品ホールディングス	6,800	5,900.00	40,120,000
永谷園	2,000	1,067.00	2,134,000
フジッコ	1,000	1,654.00	1,654,000
ロック・フィールド	800	1,895.00	1,516,000
日本たばこ産業	89,000	3,927.00	349,503,000
ケンコーマヨネーズ	500	1,202.00	601,000
わらべや日洋	1,000	1,965.00	1,965,000
なとり	700	1,134.00	793,800
ミヨシ油脂	6,000	137.00	822,000
片倉工業	1,900	1,325.00	2,517,500
グンゼ	12,000	311.00	3,732,000
東洋紡	60,000	158.00	9,480,000
ユニチカ	45,000	49.00	2,205,000
富士紡ホールディングス	7,000	283.00	1,981,000
日清紡ホールディングス	10,000	1,060.00	10,600,000
倉敷紡績	15,000	182.00	2,730,000
シキボウ	9,000	122.00	1,098,000

日本毛織	5,000	742.00	3,710,000
大東紡織	3,000	74.00	222,000
トーア紡コーポレーション	8,000	77.00	616,000
ダイドーリミテッド	1,700	500.00	850,000
帝国繊維	1,600	2,665.00	4,264,000
帝人	61,000	310.00	18,910,000
東レ	116,000	757.60	87,881,600
サカイオーベックス	4,000	158.00	632,000
住江織物	4,000	295.00	1,180,000
日本フェルト	800	480.00	384,000
イチカワ	1,000	275.00	275,000
日本バイリーン	2,000	618.00	1,236,000
日東製網	2,000	171.00	342,000
芦森工業	3,000	185.00	555,000
アツギ	13,000	113.00	1,469,000
ダイニック	3,000	177.00	531,000
セーレン	3,700	953.00	3,526,100
東海染工	2,000	121.00	242,000
小松精練	2,500	543.00	1,357,500
ワコールホールディングス	9,000	1,145.00	10,305,000
ホギメディカル	900	5,730.00	5,157,000
レナウン	3,700	112.00	414,400
クラウディア	200	1,281.00	256,200
T S Iホールディングス	6,700	692.00	4,636,400
三陽商会	8,000	289.00	2,312,000
ナイガイ	6,000	62.00	372,000
オンワードホールディングス	11,000	678.00	7,458,000
ルック	3,000	235.00	705,000
キムラタン	69,000	11.00	759,000
ゴールドウイン	3,000	596.00	1,788,000
デサント	3,000	1,058.00	3,174,000
キング	700	438.00	306,600
ヤマトインターナショナル	1,000	400.00	400,000
特種東海製紙	9,000	260.00	2,340,000
王子ホールディングス	62,000	390.00	24,180,000
日本製紙	7,200	1,599.00	11,512,800
三菱製紙	24,000	84.00	2,016,000
北越紀州製紙	9,300	457.00	4,250,100
中越パルプ工業	6,000	180.00	1,080,000
巴川製紙所	3,000	186.00	558,000
大王製紙	7,000	938.00	6,566,000
レンゴー	13,000	467.00	6,071,000

トモク	5,000	282.00	1,410,000	
ザ・パック	1,100	2,299.00	2,528,900	
クラレ	25,600	1,310.00	33,536,000	
旭化成	94,000	936.80	88,059,200	
共和レザー	1,000	765.00	765,000	
コープケミカル	2,000	104.00	208,000	
昭和電工	100,000	150.00	15,000,000	
住友化学	111,000	392.00	43,512,000	
日本化成	3,000	141.00	423,000	
住友精化	3,000	695.00	2,085,000	
日産化学工業	10,000	2,085.00	20,850,000	
ラサ工業	6,000	136.00	816,000	
クレハ	10,000	515.00	5,150,000	
多木化学	1,000	748.00	748,000	
テイカ	3,000	459.00	1,377,000	
石原産業	26,000	90.00	2,340,000	
片倉チッカリン	1,000	265.00	265,000	
日本曹達	10,000	625.00	6,250,000	
東ソー	38,000	498.00	18,924,000	
トクヤマ	23,000	247.00	5,681,000	
セントラル硝子	15,000	359.00	5,385,000	
東亜合成	19,000	481.00	9,139,000	
ダイソー	6,000	356.00	2,136,000	
関東電化工業	4,000	432.00	1,728,000	
電気化学工業	31,000	358.00	11,098,000	
信越化学工業	26,900	7,327.00	197,096,300	
日本カーバイド工業	5,000	228.00	1,140,000	
堺化学工業	6,000	335.00	2,010,000	
エア・ウォーター	13,000	1,815.00	23,595,000	
大陽日酸	19,000	1,149.00	21,831,000	
日本化学工業	6,000	166.00	996,000	
日本パーカライジング	3,500	2,605.00	9,117,500	
高圧ガス工業	2,000	588.00	1,176,000	
四国化成工業	2,000	780.00	1,560,000	
戸田工業	3,000	441.00	1,323,000	
ステラ ケミファ	800	1,337.00	1,069,600	
保土谷化学工業	5,000	193.00	965,000	
日本触媒	12,000	1,320.00	15,840,000	
大日精化工業	6,000	593.00	3,558,000	
カネカ	20,000	619.00	12,380,000	
三菱瓦斯化学	26,000	676.00	17,576,000	
三井化学	68,000	321.00	21,828,000	

J S R	14,800	1,994.00	29,511,200
東京応化工業	3,100	3,255.00	10,090,500
大阪有機化学工業	1,100	482.00	530,200
三菱ケミカルホールディングス	93,800	558.00	52,340,400
日本合成化学工業	3,000	705.00	2,115,000
ダイセル	21,000	1,254.00	26,334,000
住友ベークライト	14,000	439.00	6,146,000
積水化学工業	36,000	1,399.00	50,364,000
日本ゼオン	13,000	996.00	12,948,000
アイカ工業	4,500	2,289.00	10,300,500
宇部興産	76,000	171.00	12,996,000
積水樹脂	2,300	1,505.00	3,461,500
タキロン	3,000	527.00	1,581,000
旭有機材工業	5,000	271.00	1,355,000
日立化成	7,400	2,067.00	15,295,800
ニチバン	2,000	391.00	782,000
リケンテクノス	2,400	494.00	1,185,600
大倉工業	4,000	393.00	1,572,000
積水化成品工業	4,000	324.00	1,296,000
群栄化学工業	4,000	338.00	1,352,000
タイガースポリマー	800	682.00	545,600
ミライアル	600	1,709.00	1,025,400
ダイキョーニシカワ	400	3,100.00	1,240,000
日本化薬	10,000	1,480.00	14,800,000
カーリットホールディングス	1,200	576.00	691,200
日本精化	1,300	839.00	1,090,700
A D E K A	6,900	1,427.00	9,846,300
日油	12,000	726.00	8,712,000
新日本理化	2,400	219.00	525,600
ハリマ化成グループ	1,300	455.00	591,500
花王	41,300	4,355.00	179,861,500
第一工業製薬	3,000	412.00	1,236,000
三洋化成工業	5,000	706.00	3,530,000
大日本塗料	9,000	156.00	1,404,000
日本ペイントホールディングス	13,000	2,517.00	32,721,000
関西ペイント	18,000	1,705.00	30,690,000
神東塗料	1,000	206.00	206,000
中国塗料	4,000	863.00	3,452,000
日本特殊塗料	1,200	738.00	885,600
藤倉化成	2,100	589.00	1,236,900
太陽ホールディングス	1,200	3,785.00	4,542,000
D I C	60,000	234.00	14,040,000

サカティンクス	3,100	1,126.00	3,490,600
東洋インキSCホールディングス	15,000	506.00	7,590,000
T & K TOKA	500	2,468.00	1,234,000
富士フィルムホールディングス	34,400	3,802.50	130,806,000
資生堂	26,700	1,734.50	46,311,150
ライオン	17,000	597.00	10,149,000
高砂香料工業	5,000	532.00	2,660,000
マンダム	1,500	3,810.00	5,715,000
ミルボン	900	3,485.00	3,136,500
ファンケル	3,500	1,470.00	5,145,000
コーセー	2,400	4,155.00	9,972,000
コタ	400	1,315.00	526,000
ドクターシーラボ	1,000	3,510.00	3,510,000
シーボン	200	2,327.00	465,400
ポーラ・オルビスホールディングス	1,800	4,085.00	7,353,000
ノエビアホールディングス	1,000	1,986.00	1,986,000
アジュバンコスメジャパン	300	920.00	276,000
エステー	1,000	1,009.00	1,009,000
アグロ カネショウ	400	1,029.00	411,600
コニシ	1,200	1,843.00	2,211,600
長谷川香料	1,900	1,693.00	3,216,700
星光PMC	800	959.00	767,200
小林製薬	2,400	6,650.00	15,960,000
荒川化学工業	1,300	1,104.00	1,435,200
メック	1,200	1,125.00	1,350,000
日本高純度化学	400	2,357.00	942,800
JCU	400	5,090.00	2,036,000
新田ゼラチン	1,000	862.00	862,000
アース製薬	1,100	4,070.00	4,477,000
イハラケミカル工業	2,300	1,141.00	2,624,300
北興化学工業	1,000	381.00	381,000
大成ラミック	400	2,713.00	1,085,200
クミアイ化学工業	3,000	667.00	2,001,000
日本農薬	3,400	1,122.00	3,814,800
アキレス	13,000	151.00	1,963,000
有沢製作所	2,500	801.00	2,002,500
日東電工	11,600	6,031.00	69,959,600
レック	500	1,136.00	568,000
きもと	2,700	291.00	785,700
藤森工業	1,300	3,085.00	4,010,500
前澤化成工業	1,100	1,132.00	1,245,200
JSP	1,100	1,732.00	1,905,200

エフピコ	1,300	3,130.00	4,069,000	
天馬	1,200	1,581.00	1,897,200	
信越ポリマー	3,000	517.00	1,551,000	
東リ	4,000	241.00	964,000	
ニフコ	3,300	3,480.00	11,484,000	
日本バルカー工業	6,000	315.00	1,890,000	
ユニ・チャーム	30,400	2,535.50	77,079,200	
協和発酵キリン	18,000	1,274.00	22,932,000	
武田薬品工業	56,200	4,856.00	272,907,200	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	171,000	1,753.00	299,763,000	
大日本住友製薬	10,600	1,271.00	13,472,600	
塩野義製薬	23,400	2,872.00	67,204,800	
田辺三菱製薬	17,500	1,731.00	30,292,500	
わかもと製薬	2,000	275.00	550,000	
あすか製薬	1,800	1,201.00	2,161,800	
日本新薬	3,000	3,180.00	9,540,000	
ピオフェルミン製薬	300	2,914.00	874,200	
中外製薬	14,900	3,390.00	50,511,000	
科研製薬	5,000	2,765.00	13,825,000	
エーザイ	19,800	4,317.00	85,476,600	
ロート製薬	6,800	1,553.00	10,560,400	
小野薬品工業	6,800	10,960.00	74,528,000	
久光製薬	4,200	3,710.00	15,582,000	
有機合成薬品工業	1,000	261.00	261,000	
持田製薬	1,100	6,750.00	7,425,000	
参天製薬	5,500	6,590.00	36,245,000	
扶桑薬品工業	5,000	315.00	1,575,000	
日本ケミファ	2,000	551.00	1,102,000	
ツムラ	4,700	2,429.00	11,416,300	
日医工	3,500	1,766.00	6,181,000	
キッセイ薬品工業	2,800	3,040.00	8,512,000	
生化学工業	2,900	1,759.00	5,101,100	
栄研化学	1,300	1,899.00	2,468,700	
日水製薬	600	1,272.00	763,200	
鳥居薬品	1,000	3,175.00	3,175,000	
JCRファーマ	1,200	2,446.00	2,935,200	
東和薬品	800	4,830.00	3,864,000	
富士製薬工業	400	2,146.00	858,400	
沢井製薬	2,400	6,510.00	15,624,000	
ゼリア新薬工業	3,100	1,993.00	6,178,300	
第一三共	50,500	1,703.50	86,026,750	

キョーリン製薬ホールディングス	4,000	2,332.00	9,328,000
大幸薬品	700	1,919.00	1,343,300
ダイト	600	1,945.00	1,167,000
大塚ホールディングス	29,800	3,914.00	116,637,200
大正製薬ホールディングス	3,600	7,650.00	27,540,000
日本コークス工業	13,900	110.00	1,529,000
昭和シェル石油	13,400	938.00	12,569,200
コスモ石油	41,000	163.00	6,683,000
ニチレキ	2,000	875.00	1,750,000
東燃ゼネラル石油	22,000	965.00	21,230,000
ユシロ化学工業	900	1,423.00	1,280,700
ピーピー・カストロール	600	1,107.00	664,200
富士石油	3,500	319.00	1,116,500
MORESCO	400	1,756.00	702,400
出光興産	7,100	2,078.00	14,753,800
JXホールディングス	166,500	453.30	75,474,450
横浜ゴム	17,000	1,028.00	17,476,000
東洋ゴム工業	6,800	1,917.00	13,035,600
ブリヂストン	47,000	3,804.50	178,811,500
住友ゴム工業	11,700	1,604.00	18,766,800
藤倉ゴム工業	1,300	821.00	1,067,300
オカモト	5,000	413.00	2,065,000
フコク	600	1,228.00	736,800
ニッタ	1,500	2,500.00	3,750,000
住友理工	2,800	945.00	2,646,000
三ツ星ベルト	4,000	802.00	3,208,000
バンドー化学	6,000	435.00	2,610,000
日東紡績	11,000	416.00	4,576,000
旭硝子	74,000	580.00	42,920,000
日本板硝子	73,000	108.00	7,884,000
石塚硝子	2,000	159.00	318,000
日本山村硝子	6,000	165.00	990,000
日本電気硝子	29,000	517.00	14,993,000
オハラ	600	574.00	344,400
住友大阪セメント	28,000	351.00	9,828,000
太平洋セメント	94,000	394.00	37,036,000
デイ・シイ	1,600	491.00	785,600
日本ヒューム	1,600	876.00	1,401,600
日本コンクリート工業	2,600	644.00	1,674,400
三谷セキサン	800	1,880.00	1,504,000
ジャパンパイル	2,000	856.00	1,712,000
東海カーボン	13,000	290.00	3,770,000

日本カーボン	8,000	184.00	1,472,000
東洋炭素	800	2,074.00	1,659,200
ノリタケカンパニーリミテド	8,000	253.00	2,024,000
TOTO	22,000	1,257.00	27,654,000
日本碍子	19,000	2,528.00	48,032,000
日本特殊陶業	12,900	3,205.00	41,344,500
ダントーホールディングス	2,000	147.00	294,000
MARUWA	400	3,230.00	1,292,000
品川リフラクトリーズ	4,000	266.00	1,064,000
黒崎播磨	3,000	237.00	711,000
ヨータイ	1,000	374.00	374,000
イソライト工業	800	208.00	166,400
東京窯業	2,000	207.00	414,000
ニッカトー	500	399.00	199,500
フジミインコーポレーテッド	1,500	1,548.00	2,322,000
エーアンドエーマテリアル	3,000	107.00	321,000
ニチアス	7,000	671.00	4,697,000
ニチハ	2,000	986.00	1,972,000
新日鐵住金	634,000	295.90	187,600,600
神戸製鋼所	260,000	176.00	45,760,000
合同製鐵	8,000	154.00	1,232,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	38,300	2,268.50	86,883,550
日新製鋼	6,400	1,026.00	6,566,400
東京製鐵	7,700	575.00	4,427,500
共英製鋼	1,600	1,820.00	2,912,000
大和工業	3,400	3,440.00	11,696,000
東京鐵鋼	3,000	491.00	1,473,000
大阪製鐵	1,000	2,013.00	2,013,000
淀川製鋼所	11,000	407.00	4,477,000
東洋鋼鈹	4,000	644.00	2,576,000
丸一鋼管	4,600	2,657.00	12,222,200
モリ工業	2,000	425.00	850,000
大同特殊鋼	25,000	432.00	10,800,000
日本高周波鋼業	6,000	111.00	666,000
日本冶金工業	11,900	271.00	3,224,900
山陽特殊製鋼	9,000	381.00	3,429,000
愛知製鋼	9,000	394.00	3,546,000
日立金属	15,000	1,959.00	29,385,000
日本金属	4,000	146.00	584,000
大平洋金属	10,000	337.00	3,370,000
新日本電工	9,300	276.00	2,566,800
栗本鐵工所	8,000	228.00	1,824,000

虹技	2,000	216.00	432,000
日本鑄鉄管	2,000	244.00	488,000
三菱製鋼	10,000	244.00	2,440,000
日亜鋼業	2,000	333.00	666,000
日本精線	1,000	694.00	694,000
シンニッタン	1,600	576.00	921,600
新家工業	3,000	177.00	531,000
大紀アルミニウム工業所	2,000	302.00	604,000
日本軽金属ホールディングス	36,600	165.00	6,039,000
三井金属鉱業	41,000	285.00	11,685,000
東邦亜鉛	9,000	359.00	3,231,000
三菱マテリアル	94,000	338.00	31,772,000
住友金属鉱山	42,000	1,480.00	62,160,000
D O W Aホールディングス	18,000	915.00	16,470,000
古河機械金属	23,000	219.00	5,037,000
エス・サイエンス	7,600	50.00	380,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,500	2,015.00	3,022,500
東邦チタニウム	2,600	676.00	1,757,600
U A C J	17,000	351.00	5,967,000
古河電気工業	44,000	190.00	8,360,000
住友電気工業	56,500	1,520.00	85,880,000
フジクラ	21,000	466.00	9,786,000
昭和電線ホールディングス	17,000	102.00	1,734,000
タツタ電線	2,800	539.00	1,509,200
沖電線	1,000	288.00	288,000
カナレ電気	200	1,771.00	354,200
平河ヒューテック	400	1,083.00	433,200
リョービ	8,000	309.00	2,472,000
アーレスティ	1,300	614.00	798,200
アサヒホールディングス	2,300	1,804.00	4,149,200
稲葉製作所	700	1,379.00	965,300
宮地エンジニアリンググループ	5,000	214.00	1,070,000
トーカロ	1,000	1,939.00	1,939,000
アルファC o	500	1,094.00	547,000
S U M C O	10,400	1,537.00	15,984,800
川田テクノロジーズ	300	5,030.00	1,509,000
東洋製罐グループホールディングス	10,700	1,334.00	14,273,800
ホッカンホールディングス	4,000	282.00	1,128,000
コロナ	800	1,187.00	949,600
横河ブリッジホールディングス	2,900	1,354.00	3,926,600
駒井ハルテック	3,000	271.00	813,000
高田機工	2,000	213.00	426,000

三和ホールディングス	14,500	826.00	11,977,000
文化シャッター	4,000	981.00	3,924,000
三協立山	1,800	1,938.00	3,488,400
東洋シャッター	400	772.00	308,800
L I X I Lグループ	22,300	2,311.00	51,535,300
日本フィルコン	1,100	512.00	563,200
ノーリツ	2,900	2,004.00	5,811,600
長府製作所	1,600	3,185.00	5,096,000
リンナイ	2,800	8,770.00	24,556,000
ダイニチ工業	800	767.00	613,600
日東精工	2,000	370.00	740,000
三洋工業	2,000	204.00	408,000
岡部	2,900	962.00	2,789,800
中国工業	300	767.00	230,100
東プレ	2,900	1,544.00	4,477,600
高周波熱錬	2,600	787.00	2,046,200
東京製綱	10,000	169.00	1,690,000
サンコール	1,000	670.00	670,000
モリテック スチール	800	330.00	264,000
パイオラックス	800	4,910.00	3,928,000
日本発條	13,000	1,067.00	13,871,000
中央発條	2,000	321.00	642,000
アドバネクス	3,000	172.00	516,000
三益半導体工業	1,300	980.00	1,274,000
日本ドライケミカル	200	2,292.00	458,400
日本製鋼所	22,000	408.00	8,976,000
三浦工業	6,700	1,333.00	8,931,100
タクマ	5,000	700.00	3,500,000
ツガミ	4,000	573.00	2,292,000
オークマ	10,000	838.00	8,380,000
東芝機械	8,000	472.00	3,776,000
アマダ	22,400	997.00	22,332,800
アイダエンジニアリング	3,300	1,072.00	3,537,600
滝澤鉄工所	5,000	215.00	1,075,000
富士機械製造	4,700	1,002.00	4,709,400
牧野フライス製作所	7,000	792.00	5,544,000
オーエスジー	6,800	1,855.00	12,614,000
ダイジェット工業	2,000	245.00	490,000
旭ダイヤモンド工業	4,100	1,284.00	5,264,400
D M G 森精機	9,500	1,320.00	12,540,000
ディスコ	1,700	7,580.00	12,886,000
日東工器	900	2,104.00	1,893,600

パンチ工業	300	1,509.00	452,700
豊和工業	900	744.00	669,600
大阪機工	6,000	157.00	942,000
東洋機械金属	1,100	458.00	503,800
津田駒工業	4,000	148.00	592,000
島精機製作所	2,100	1,858.00	3,901,800
日阪製作所	1,900	1,011.00	1,920,900
やまびこ	600	4,400.00	2,640,000
ペガサスマシン製造	1,300	699.00	908,700
ナブテスコ	9,100	2,757.00	25,088,700
三井海洋開発	1,500	2,589.00	3,883,500
レオン自動機	1,000	497.00	497,000
S M C	4,600	30,590.00	140,714,000
新川	1,300	568.00	738,400
ホソカワミクロン	2,000	615.00	1,230,000
ユニオンツール	700	2,842.00	1,989,400
オイレス工業	1,900	2,012.00	3,822,800
日精エー・エス・ビー機械	500	2,433.00	1,216,500
サトーホールディングス	1,900	2,770.00	5,263,000
日本エアテック	500	1,075.00	537,500
日精樹脂工業	1,100	889.00	977,900
ワイエイシイ	600	585.00	351,000
小松製作所	74,400	2,701.00	200,954,400
住友重機械工業	41,000	666.00	27,306,000
日立建機	6,700	2,322.00	15,557,400
日工	2,000	442.00	884,000
巴工業	600	1,714.00	1,028,400
井関農機	15,000	258.00	3,870,000
T O W A	1,300	635.00	825,500
丸山製作所	4,000	248.00	992,000
北川鉄工所	7,000	197.00	1,379,000
クボタ	72,000	1,736.50	125,028,000
荏原実業	500	1,422.00	711,000
三菱化工機	5,000	410.00	2,050,000
月島機械	2,600	1,213.00	3,153,800
帝国電機製作所	1,000	1,248.00	1,248,000
新東工業	3,500	773.00	2,705,500
澁谷工業	1,300	2,682.00	3,486,600
アイチ コーポレーション	2,100	542.00	1,138,200
小森コーポレーション	3,700	1,078.00	3,988,600
鶴見製作所	1,100	1,853.00	2,038,300
住友精密工業	2,000	434.00	868,000

酒井重工業	3,000	285.00	855,000	
荏原製作所	31,000	592.00	18,352,000	
石井鐵工所	2,000	241.00	482,000	
西島製作所	1,500	888.00	1,332,000	
北越工業	1,000	990.00	990,000	
ダイキン工業	20,900	7,007.00	146,446,300	
オルガノ	3,000	487.00	1,461,000	
トーヨーカネツ	9,000	260.00	2,340,000	
栗田工業	8,500	2,404.00	20,434,000	
椿本チエイン	8,000	892.00	7,136,000	
大同工業	3,000	264.00	792,000	
日本コンベヤ	5,000	254.00	1,270,000	
木村化工機	1,500	470.00	705,000	
アネスト岩田	2,300	808.00	1,858,400	
ダイフク	7,100	1,262.00	8,960,200	
サムコ	200	981.00	196,200	
加藤製作所	3,000	821.00	2,463,000	
油研工業	3,000	247.00	741,000	
タダノ	7,000	1,688.00	11,816,000	
フジテック	4,200	1,140.00	4,788,000	
C K D	4,000	963.00	3,852,000	
キトー	1,600	1,306.00	2,089,600	
平和	3,100	2,288.00	7,092,800	
理想科学工業	900	3,590.00	3,231,000	
S A N K Y O	4,300	3,930.00	16,899,000	
日本金銭機械	1,300	1,675.00	2,177,500	
マースエンジニアリング	800	1,980.00	1,584,000	
福島工業	800	2,105.00	1,684,000	
オーイズミ	500	890.00	445,000	
ダイコク電機	600	1,801.00	1,080,600	
アマノ	4,800	1,230.00	5,904,000	
J U K I	11,000	373.00	4,103,000	
サンデン	9,000	645.00	5,805,000	
蛇の目マシン工業	14,000	186.00	2,604,000	
マックス	2,000	1,245.00	2,490,000	
グローリー	4,600	2,841.00	13,068,600	
新晃工業	1,000	991.00	991,000	
大和冷機工業	2,000	808.00	1,616,000	
セガサミーホールディングス	15,400	1,648.00	25,379,200	
日本ピストンリング	6,000	245.00	1,470,000	
リケン	6,000	444.00	2,664,000	
T P R	1,600	2,692.00	4,307,200	

ホシザキ電機	3,100	5,380.00	16,678,000
大豊工業	1,200	1,182.00	1,418,400
日本精工	29,000	1,483.00	43,007,000
N T N	33,000	488.00	16,104,000
ジェイテクト	15,300	1,794.00	27,448,200
不二越	13,000	696.00	9,048,000
日本トムソン	5,000	490.00	2,450,000
T H K	9,500	2,800.00	26,600,000
ユーシン精機	600	2,251.00	1,350,600
前澤給装工業	500	1,374.00	687,000
イーグル工業	2,000	2,163.00	4,326,000
前澤工業	1,100	334.00	367,400
日本ピラー工業	1,600	889.00	1,422,400
キッツ	6,400	463.00	2,963,200
日立工機	3,900	962.00	3,751,800
マキタ	9,400	6,260.00	58,844,000
日立造船	11,200	619.00	6,932,800
三菱重工業	240,000	690.90	165,816,000
I H I	103,000	558.00	57,474,000
イビデン	9,400	1,691.00	15,895,400
コニカミノルタ	34,200	1,269.00	43,399,800
ブラザー工業	18,500	2,045.00	37,832,500
ミネベア	21,000	1,462.00	30,702,000
日立製作所	344,000	872.90	300,277,600
東芝	302,000	496.20	149,852,400
三菱電機	143,000	1,430.00	204,490,000
富士電機	40,000	495.00	19,800,000
東洋電機製造	3,000	385.00	1,155,000
安川電機	16,900	1,449.00	24,488,100
シンフォニアテクノロジー	10,000	161.00	1,610,000
明電舎	13,000	395.00	5,135,000
オリジン電気	2,000	434.00	868,000
山洋電気	3,000	772.00	2,316,000
デンヨー	1,300	1,440.00	1,872,000
東芝テック	10,000	778.00	7,780,000
芝浦メカトロニクス	2,000	345.00	690,000
マブチモーター	2,200	9,600.00	21,120,000
日本電産	15,500	7,378.00	114,359,000
東光高岳	700	1,612.00	1,128,400
宮越ホールディングス	500	563.00	281,500
ダイヘン	8,000	407.00	3,256,000
ヤーマン	200	1,339.00	267,800

JVCケンウッド	10,600	216.00	2,289,600	
第一精工	500	2,112.00	1,056,000	
日新電機	3,000	583.00	1,749,000	
大崎電気工業	2,000	696.00	1,392,000	
オムロン	16,200	5,320.00	86,184,000	
日東工業	2,300	1,986.00	4,567,800	
I D E C	1,700	916.00	1,557,200	
不二電機工業	100	1,536.00	153,600	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	28,000	545.00	15,260,000	
サクサホールディングス	3,000	154.00	462,000	
メルコホールディングス	800	1,558.00	1,246,400	
テクノメディカ	300	2,320.00	696,000	
日本電気	186,000	388.00	72,168,000	
富士通	138,000	693.00	95,634,000	
沖電気工業	49,000	247.00	12,103,000	
岩崎通信機	7,000	91.00	637,000	
電気興業	4,000	546.00	2,184,000	
サンケン電気	7,000	865.00	6,055,000	
ナカヨ	1,000	359.00	359,000	
アイホン	800	1,959.00	1,567,200	
ルネサスエレクトロニクス	7,400	858.00	6,349,200	
セイコーエプソン	9,800	5,370.00	52,626,000	
ワコム	11,400	443.00	5,050,200	
アルバック	2,700	1,381.00	3,728,700	
アクセル	700	1,505.00	1,053,500	
E I Z O	1,300	2,150.00	2,795,000	
ジャパンディスプレイ	22,100	318.00	7,027,800	
日本信号	4,000	1,083.00	4,332,000	
京三製作所	3,000	355.00	1,065,000	
能美防災	1,900	1,654.00	3,142,600	
ホーチキ	1,000	918.00	918,000	
エレコム	400	2,308.00	923,200	
日本無線	3,000	396.00	1,188,000	
パナソニック	174,700	1,380.00	241,086,000	
シャープ	121,000	286.00	34,606,000	
アンリツ	9,000	867.00	7,803,000	
富士通ゼネラル	4,000	1,381.00	5,524,000	
日立国際電気	4,000	1,657.00	6,628,000	
ソニー	92,100	2,231.00	205,475,100	
T D K	8,700	6,530.00	56,811,000	
帝国通信工業	3,000	176.00	528,000	
ミツミ電機	5,100	717.00	3,656,700	

タムラ製作所	6,000	393.00	2,358,000
アルプス電気	11,300	2,092.00	23,639,600
池上通信機	5,000	124.00	620,000
パイオニア	21,600	274.00	5,918,400
日本電波工業	1,300	891.00	1,158,300
鈴木	200	894.00	178,800
日本トリム	400	2,430.00	972,000
ローランド ディー . ジー .	600	4,690.00	2,814,000
フォスター電機	1,500	1,782.00	2,673,000
クラリオン	8,000	390.00	3,120,000
S M K	4,000	440.00	1,760,000
ヨコオ	1,100	576.00	633,600
東光	3,000	311.00	933,000
ティアック	9,000	57.00	513,000
ホシデン	4,600	597.00	2,746,200
ヒロセ電機	2,300	14,020.00	32,246,000
日本航空電子工業	4,000	2,374.00	9,496,000
T O A	1,600	1,192.00	1,907,200
日立マクセル	2,100	1,719.00	3,609,900
古野電気	1,700	929.00	1,579,300
ユニデン	4,000	239.00	956,000
アルパイン	3,400	1,923.00	6,538,200
スミダコーポレーション	1,300	796.00	1,034,800
アイコム	800	2,749.00	2,199,200
リオン	400	1,412.00	564,800
船井電機	1,500	1,210.00	1,815,000
横河電機	14,400	1,494.00	21,513,600
新電元工業	5,000	701.00	3,505,000
アズビル	4,700	2,622.00	12,323,400
東亜ディーケーケー	600	585.00	351,000
日本光電工業	3,100	5,680.00	17,608,000
チノー	500	1,210.00	605,000
共和電業	1,800	452.00	813,600
日本電子材料	700	590.00	413,000
堀場製作所	2,700	4,050.00	10,935,000
アドバンテスト	9,800	1,333.00	13,063,400
小野測器	700	961.00	672,700
エスベック	1,600	1,025.00	1,640,000
パナソニック デバイス S U N X	1,200	595.00	714,000
キーエンス	3,200	52,800.00	168,960,000
日置電機	800	1,698.00	1,358,400
シスメックス	11,100	4,825.00	53,557,500

メガチップス	1,500	1,457.00	2,185,500
O B A R A G R O U P	900	4,185.00	3,766,500
澤藤電機	1,000	232.00	232,000
コーセル	2,100	1,270.00	2,667,000
新日本無線	1,000	490.00	490,000
オブテックス	1,000	1,974.00	1,974,000
千代田インテグレ	600	1,903.00	1,141,800
レーザーテック	1,500	1,270.00	1,905,000
スタンレー電気	10,300	2,218.00	22,845,400
岩崎電気	5,000	245.00	1,225,000
ウシオ電機	8,700	1,108.00	9,639,600
岡谷電機産業	700	384.00	268,800
ヘリオス テクノ ホールディング	1,400	337.00	471,800
日本セラミック	800	1,665.00	1,332,000
遠藤照明	700	1,315.00	920,500
日本デジタル研究所	1,200	1,768.00	2,121,600
古河電池	1,000	1,056.00	1,056,000
双信電機	700	395.00	276,500
山一電機	1,700	865.00	1,470,500
図研	1,100	1,058.00	1,163,800
日本電子	6,000	538.00	3,228,000
カシオ計算機	14,400	1,714.00	24,681,600
ファナック	14,900	19,690.00	293,381,000
日本シイエムケイ	3,700	270.00	999,000
エンプラス	700	3,900.00	2,730,000
大真空	3,000	338.00	1,014,000
ローム	7,100	6,930.00	49,203,000
浜松ホトニクス	6,000	5,150.00	30,900,000
三井ハイテック	1,900	672.00	1,276,800
新光電気工業	5,500	667.00	3,668,500
京セラ	23,500	5,140.00	120,790,000
太陽誘電	7,500	1,166.00	8,745,000
村田製作所	15,000	12,685.00	190,275,000
ユーシン	2,000	717.00	1,434,000
双葉電子工業	2,500	1,588.00	3,970,000
北陸電気工業	6,000	169.00	1,014,000
ニチコン	4,600	819.00	3,767,400
日本ケミコン	12,000	302.00	3,624,000
K O A	2,000	1,012.00	2,024,000
市光工業	4,000	259.00	1,036,000
小糸製作所	8,600	3,415.00	29,369,000
ミツバ	2,600	1,827.00	4,750,200

スター精密	2,700	1,685.00	4,549,500	
S C R E E Nホールディングス	14,000	653.00	9,142,000	
キヤノン電子	1,300	2,018.00	2,623,400	
キヤノン	83,100	3,531.50	293,467,650	代用有価証券 10,000株
リコー	43,100	1,189.50	51,267,450	
M U T O Hホールディングス	2,000	546.00	1,092,000	
東京エレクトロン	12,100	7,427.00	89,866,700	
トヨタ紡織	5,000	1,258.00	6,290,000	
鬼怒川ゴム工業	3,000	473.00	1,419,000	
ユニプレス	2,700	2,017.00	5,445,900	
豊田自動織機	13,100	5,480.00	71,788,000	
モリタホールディングス	2,500	1,114.00	2,785,000	
三櫻工業	1,800	725.00	1,305,000	
デンソー	35,400	5,320.00	188,328,000	
東海理化電機製作所	3,800	2,265.00	8,607,000	
三井造船	55,000	254.00	13,970,000	
川崎重工業	104,000	453.00	47,112,000	
名村造船所	4,000	1,170.00	4,680,000	
サノヤスホールディングス	1,800	272.00	489,600	
日本車輛製造	5,000	341.00	1,705,000	
ニチュ三菱フォークリフト	1,700	775.00	1,317,500	
近畿車輛	2,000	301.00	602,000	
日産自動車	201,100	1,047.00	210,551,700	
いすゞ自動車	45,300	1,484.50	67,247,850	
トヨタ自動車	197,700	6,812.00	1,346,732,400	代用有価証券 35,000株
日野自動車	20,500	1,604.00	32,882,000	
三菱自動車工業	52,500	1,179.00	61,897,500	
エフテック	800	1,125.00	900,000	
レシップホールディングス	500	875.00	437,500	
G M B	200	1,258.00	251,600	
武蔵精密工業	1,500	2,281.00	3,421,500	
日産車体	6,300	1,516.00	9,550,800	
新明和工業	6,000	996.00	5,976,000	
極東開発工業	2,600	1,563.00	4,063,800	
日信工業	2,600	1,755.00	4,563,000	
トピー工業	12,000	209.00	2,508,000	
ティラド	6,000	266.00	1,596,000	
曙ブレーキ工業	6,100	442.00	2,696,200	
タチエス	2,300	1,427.00	3,282,100	
N O K	6,900	2,914.00	20,106,600	

フタバ産業	4,400	623.00	2,741,200
カヤバ工業	16,000	472.00	7,552,000
シロキ工業	3,000	220.00	660,000
大同メタル工業	2,000	1,327.00	2,654,000
プレス工業	7,000	437.00	3,059,000
カルソニックカンセイ	11,000	591.00	6,501,000
太平洋工業	2,900	821.00	2,380,900
ケーヒン	3,300	1,409.00	4,649,700
河西工業	1,800	987.00	1,776,600
アイシン精機	13,100	3,875.00	50,762,500
富士機工	2,000	537.00	1,074,000
マツダ	42,700	2,698.50	115,225,950
ダイハツ工業	17,100	1,608.00	27,496,800
今仙電機製作所	1,200	1,881.00	2,257,200
本田技研工業	129,000	3,616.50	466,528,500
スズキ	30,000	3,726.50	111,795,000
富士重工業	48,800	4,142.50	202,154,000
安永	500	599.00	299,500
ヤマハ発動機	21,800	2,244.00	48,919,200
ショーワ	3,400	1,185.00	4,029,000
T B K	1,800	666.00	1,198,800
エクセディ	1,900	2,873.00	5,458,700
豊田合成	4,600	2,170.00	9,982,000
愛三工業	2,200	876.00	1,927,200
盟和産業	1,000	163.00	163,000
ヨロズ	1,300	1,958.00	2,545,400
エフ・シー・シー	2,100	1,953.00	4,101,300
シマノ	6,200	15,140.00	93,868,000
タカタ	2,600	1,527.00	3,970,200
テイ・エス テック	3,000	2,725.00	8,175,000
テルモ	22,000	2,727.00	59,994,000
クリエートメディック	500	1,047.00	523,500
日機装	4,700	1,127.00	5,296,900
島津製作所	17,000	975.00	16,575,000
J M S	3,000	294.00	882,000
ショットモリテックス	400	280.00	112,000
長野計器	900	656.00	590,400
ブイ・テクノロジー	300	2,675.00	802,500
東京計器	5,000	276.00	1,380,000
愛知時計電機	2,000	317.00	634,000
オーバル	1,100	295.00	324,500
東京精密	2,600	1,778.00	4,622,800

マニー	400	6,860.00	2,744,000
ニコン	26,800	1,532.00	41,057,600
トプコン	4,300	2,705.00	11,631,500
オリンパス	21,400	4,220.00	90,308,000
理研計器	1,300	1,098.00	1,427,400
タムロン	1,100	2,183.00	2,401,300
H O Y A	34,100	4,005.00	136,570,500
ノーリツ鋼機	1,300	618.00	803,400
エー・アンド・デイ	1,300	533.00	692,900
シチズンホールディングス	17,700	752.00	13,310,400
リズム時計工業	6,000	153.00	918,000
大研医器	500	2,274.00	1,137,000
松風	700	1,338.00	936,600
セイコーホールディングス	10,000	572.00	5,720,000
ニプロ	9,200	909.00	8,362,800
パラマウントベッドホールディングス	1,500	3,220.00	4,830,000
S H O - B I	600	413.00	247,800
前田工織	1,400	1,198.00	1,677,200
永大産業	2,000	442.00	884,000
アートネイチャー	600	1,447.00	868,200
ダンロップスポーツ	900	1,340.00	1,206,000
バンダイナムコホールディングス	15,800	2,757.00	43,560,600
共立印刷	2,700	285.00	769,500
フランスベッドホールディングス	10,000	185.00	1,850,000
パイロットコーポレーション	1,200	6,360.00	7,632,000
萩原工業	300	1,678.00	503,400
トッパン・フォームズ	2,600	1,091.00	2,836,600
フジシールインターナショナル	1,700	3,250.00	5,525,000
タカラトミー	5,200	591.00	3,073,200
廣濟堂	1,400	445.00	623,000
アーク	4,800	155.00	744,000
タカノ	700	604.00	422,800
プロネクサス	1,500	713.00	1,069,500
ホクシン	1,300	132.00	171,600
ウッドワン	3,000	278.00	834,000
大建工業	6,000	251.00	1,506,000
凸版印刷	41,000	746.00	30,586,000
大日本印刷	44,000	1,083.00	47,652,000
図書印刷	2,000	353.00	706,000
共同印刷	4,000	382.00	1,528,000
日本写真印刷	2,400	1,811.00	4,346,400
光村印刷	2,000	260.00	520,000

宝印刷	800	785.00	628,000
アシックス	14,300	2,742.00	39,210,600
ツツミ	700	2,611.00	1,827,700
小松ウオール工業	400	2,613.00	1,045,200
ヤマハ	10,600	1,513.00	16,037,800
河合楽器製作所	500	2,083.00	1,041,500
クリナップ	1,500	967.00	1,450,500
ピジョン	2,700	6,950.00	18,765,000
兼松日産農林	3,000	164.00	492,000
キングジム	1,200	750.00	900,000
リンテック	3,400	2,351.00	7,993,400
T A S A K I	300	1,196.00	358,800
イトーキ	3,100	579.00	1,794,900
任天堂	8,800	12,200.00	107,360,000
三菱鉛筆	1,200	3,560.00	4,272,000
タカラスタンダード	6,000	927.00	5,562,000
コクヨ	7,400	887.00	6,563,800
ナカバヤシ	3,000	204.00	612,000
岡村製作所	5,500	767.00	4,218,500
美津濃	8,000	552.00	4,416,000
アデランス	1,800	1,251.00	2,251,800
東京電力	121,600	430.00	52,288,000
中部電力	43,900	1,357.00	59,572,300
関西電力	58,500	1,110.00	64,935,000
中国電力	19,800	1,478.00	29,264,400
北陸電力	14,100	1,516.00	21,375,600
東北電力	35,800	1,398.00	50,048,400
四国電力	12,900	1,516.00	19,556,400
九州電力	31,700	1,240.00	39,308,000
北海道電力	13,400	943.00	12,636,200
沖縄電力	900	3,450.00	3,105,000
電源開発	9,600	3,900.00	37,440,000
東京瓦斯	174,000	641.60	111,638,400
大阪瓦斯	148,000	450.20	66,629,600
東邦瓦斯	37,000	615.00	22,755,000
北海道瓦斯	3,000	289.00	867,000
西部瓦斯	16,000	271.00	4,336,000
静岡瓦斯	4,100	727.00	2,980,700
S B S ホールディングス	1,100	938.00	1,031,800
東武鉄道	77,000	552.00	42,504,000
相鉄ホールディングス	25,000	421.00	10,525,000
東京急行電鉄	78,000	722.00	56,316,000

京浜急行電鉄	39,000	899.00	35,061,000
小田急電鉄	46,000	1,052.00	48,392,000
京王電鉄	40,000	843.00	33,720,000
京成電鉄	22,000	1,274.00	28,028,000
富士急行	4,000	1,105.00	4,420,000
東日本旅客鉄道	26,300	8,640.00	227,232,000
西日本旅客鉄道	13,800	5,367.00	74,064,600
東海旅客鉄道	12,800	16,605.00	212,544,000
西武ホールディングス	11,400	2,190.00	24,966,000
鴻池運輸	900	2,178.00	1,960,200
西日本鉄道	19,000	458.00	8,702,000
ハマキョウレックス	400	3,570.00	1,428,000
サカイ引越センター	200	3,445.00	689,000
近畿日本鉄道	144,000	388.00	55,872,000
阪急阪神ホールディングス	96,000	638.00	61,248,000
南海電気鉄道	30,000	526.00	15,780,000
京阪電気鉄道	32,000	557.00	17,824,000
神戸電鉄	4,000	372.00	1,488,000
名糖運輸	600	676.00	405,600
名古屋鉄道	51,000	473.00	24,123,000
山陽電気鉄道	5,000	449.00	2,245,000
日本通運	57,000	498.00	28,386,000
ヤマトホールディングス	26,300	2,377.00	62,515,100
山九	18,000	464.00	8,352,000
丸運	1,000	242.00	242,000
丸全昭和運輸	5,000	349.00	1,745,000
センコー	6,000	489.00	2,934,000
トナミホールディングス	3,000	247.00	741,000
日本梱包運輸倉庫	4,700	1,806.00	8,488,200
日本石油輸送	2,000	232.00	464,000
福山通運	9,000	558.00	5,022,000
セイノーホールディングス	11,000	901.00	9,911,000
神奈川中央交通	2,000	548.00	1,096,000
日立物流	3,000	1,452.00	4,356,000
日本郵船	121,000	299.00	36,179,000
商船三井	75,000	345.00	25,875,000
川崎汽船	63,000	271.00	17,073,000
N S ユナイテッド海運	6,000	289.00	1,734,000
明治海運	1,300	379.00	492,700
飯野海運	7,400	657.00	4,861,800
共栄タンカー	1,000	210.00	210,000
日本航空	27,500	3,090.00	84,975,000

ANAホールディングス	282,000	258.60	72,925,200
スカイマーク	3,800	196.00	744,800
パスコ	1,000	344.00	344,000
トランコム	400	4,495.00	1,798,000
日新	6,000	278.00	1,668,000
三菱倉庫	9,000	1,721.00	15,489,000
三井倉庫ホールディングス	8,000	432.00	3,456,000
住友倉庫	10,000	632.00	6,320,000
澁澤倉庫	4,000	372.00	1,488,000
東陽倉庫	3,000	273.00	819,000
乾汽船	1,000	1,017.00	1,017,000
日本トランスシティ	3,000	368.00	1,104,000
ケイヒン	3,000	165.00	495,000
中央倉庫	800	914.00	731,200
安田倉庫	1,100	1,026.00	1,128,600
東洋埠頭	5,000	209.00	1,045,000
宇徳	1,200	596.00	715,200
上組	17,000	1,076.00	18,292,000
サンリツ	400	519.00	207,600
キムラユニティー	400	965.00	386,000
キューソー流通システム	400	1,290.00	516,000
郵船ロジスティクス	1,300	1,184.00	1,539,200
近鉄エクスプレス	1,300	4,000.00	5,200,000
東海運	800	265.00	212,000
エーアイティー	700	792.00	554,400
NEC ネットエスアイ	1,800	2,432.00	4,377,600
システナ	1,400	825.00	1,155,000
デジタルアーツ	800	1,145.00	916,000
新日鉄住金ソリューションズ	1,200	3,320.00	3,984,000
キューブシステム	600	524.00	314,400
コア	600	812.00	487,200
ソフトクリエイトホールディングス	400	928.00	371,200
ITホールディングス	4,700	1,838.00	8,638,600
ネオス	400	745.00	298,000
電算システム	500	1,578.00	789,000
グリー	8,600	773.00	6,647,800
コーエーテクモホールディングス	3,200	1,818.00	5,817,600
三菱総合研究所	500	2,698.00	1,349,000
ボルテージ	300	1,307.00	392,100
電算	200	2,157.00	431,400
AGS	200	918.00	183,600
ヒト・コミュニケーションズ	200	1,705.00	341,000

ブレインパッド	200	1,217.00	243,400
K L a b	1,500	1,662.00	2,493,000
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	1,000	858.00	858,000
イーブックイニシアティブジャパン	300	1,255.00	376,500
ネクソン	13,400	1,007.00	13,493,800
アイスタイル	500	498.00	249,000
エムアップ	400	774.00	309,600
エイチーム	200	5,220.00	1,044,000
e n i s h	400	2,451.00	980,400
コロプラ	2,500	3,785.00	9,462,500
モバイルクリエイト	600	793.00	475,800
オルトプラス	300	860.00	258,000
ブロードリーフ	1,200	1,739.00	2,086,800
ハーツユナイテッドグループ	400	1,952.00	780,800
ベリサーブ	200	1,011.00	202,200
ティーガイア	1,400	1,102.00	1,542,800
豆蔵ホールディングス	1,100	690.00	759,000
テクマトリックス	600	644.00	386,400
GMOペイメントゲートウェイ	1,200	2,250.00	2,700,000
ザッパラス	800	595.00	476,000
インターネットイニシアティブ	2,300	1,933.00	4,445,900
ビットアイル	1,600	456.00	729,600
S R Aホールディングス	800	1,404.00	1,123,200
システムインテグレータ	200	568.00	113,600
パイプドビッツ	100	1,566.00	156,600
朝日ネット	1,400	509.00	712,600
コムチュア	300	1,883.00	564,900
パナソニック インフォメーションシステムズ	300	3,035.00	910,500
フェイス	500	1,056.00	528,000
野村総合研究所	8,000	3,685.00	29,480,000
サイバネットシステム	1,200	482.00	578,400
インテージホールディングス	800	1,393.00	1,114,400
東邦システムサイエンス	200	1,228.00	245,600
ソースネクスト	700	903.00	632,100
ティー・ワイ・オー	1,500	176.00	264,000
クレスコ	300	1,430.00	429,000
フジ・メディア・ホールディングス	14,700	1,450.00	21,315,000
オービック	4,900	3,815.00	18,693,500
ジャストシステム	1,900	818.00	1,554,200
TDCソフトウェアエンジニアリング	300	937.00	281,100
ヤフー	101,400	401.00	40,661,400

トレンドマイクロ	7,500	3,690.00	27,675,000	
インフォメーション・ディベロプメント	300	917.00	275,100	
日本オラクル	2,300	4,225.00	9,717,500	
アルファシステムズ	500	1,509.00	754,500	
フューチャーアーキテクト	1,500	637.00	955,500	
C A C Holdings	1,000	1,203.00	1,203,000	
ソフトバンク・テクノロジー	400	1,366.00	546,400	
トーセ	300	725.00	217,500	
オービックビジネスコンサルタント	900	3,300.00	2,970,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	1,600	4,405.00	7,048,000	
アイティフォー	1,700	421.00	715,700	
東計電算	300	1,617.00	485,100	
エクスネット	100	1,415.00	141,500	
大塚商会	3,800	4,045.00	15,371,000	
サイボウズ	1,900	362.00	687,800	
ソフトブレーン	2,000	203.00	406,000	
アグレックス	400	1,425.00	570,000	
電通国際情報サービス	900	1,266.00	1,139,400	
E Mシステムズ	100	1,722.00	172,200	
ウェザーニューズ	400	3,020.00	1,208,000	
C I J	1,200	491.00	589,200	
東洋ビジネスエンジニアリング	100	1,376.00	137,600	
日本エンタープライズ	900	449.00	404,100	
WOWOW	300	5,030.00	1,509,000	
日本コロムビア	500	444.00	222,000	
イマジカ・ロボットホールディングス	800	469.00	375,200	
ネットワンシステムズ	5,800	670.00	3,886,000	
アルゴグラフィックス	600	1,963.00	1,177,800	
マーベラス	2,400	1,161.00	2,786,400	
エイベックス・グループ・ホールディングス	2,800	1,603.00	4,488,400	
日本ユニシス	3,900	1,020.00	3,978,000	
兼松エレクトロニクス	900	1,486.00	1,337,400	
東京放送ホールディングス	8,500	1,337.00	11,364,500	
日本テレビホールディングス	12,900	1,653.00	21,323,700	
テレビ朝日ホールディングス	3,900	1,813.00	7,070,700	
スカパーJ S A Tホールディングス	10,700	679.00	7,265,300	
テレビ東京ホールディングス	1,100	2,237.00	2,460,700	
コネクシオ	1,000	1,207.00	1,207,000	
クロップス	200	495.00	99,000	
日本電信電話	55,300	6,800.00	376,040,000	代用有価証券 12,300株
K D D I	47,900	7,368.00	352,927,200	

光通信	1,300	7,260.00	9,438,000
NTTドコモ	116,500	1,823.50	212,437,750
GMOインターネット	4,700	1,022.00	4,803,400
KADOKAWA・DWANGO	3,700	1,981.00	7,329,700
学研ホールディングス	5,000	263.00	1,315,000
ゼンリン	1,900	1,370.00	2,603,000
昭文社	900	776.00	698,400
インプレスホールディングス	1,200	126.00	151,200
アイネット	700	845.00	591,500
松竹	9,000	1,026.00	9,234,000
東宝	10,100	2,601.00	26,270,100
東映	5,000	581.00	2,905,000
AOI Pro.	700	719.00	503,300
エヌ・ティ・ティ・データ	8,700	4,360.00	37,932,000
DTS	1,500	2,302.00	3,453,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,200	2,291.00	11,913,200
シーイーシー	900	1,060.00	954,000
カブコン	3,600	1,738.00	6,256,800
ジャステック	800	894.00	715,200
SCSK	3,400	3,120.00	10,608,000
日本システムウエア	500	650.00	325,000
アイネス	1,900	857.00	1,628,300
TKC	1,200	2,162.00	2,594,400
富士ソフト	1,900	2,669.00	5,071,100
NSD	3,000	1,626.00	4,878,000
コナミ	5,800	2,108.00	12,226,400
福井コンピュータホールディングス	400	776.00	310,400
JBCホールディングス	1,200	765.00	918,000
ミロク情報サービス	900	580.00	522,000
ソフトバンク	74,800	7,824.00	585,235,200
ハウスイ	1,000	129.00	129,000
高千穂交易	500	1,025.00	512,500
伊藤忠食品	400	3,690.00	1,476,000
エレマテック	700	2,466.00	1,726,200
JALUX	400	1,309.00	523,600
あらた	3,000	321.00	963,000
トーメンデバイス	200	1,758.00	351,600
東京エレクトロン デバイス	300	1,475.00	442,500
双日	95,100	169.00	16,071,900
アルフレッサ ホールディングス	16,700	1,368.00	22,845,600
横浜冷凍	3,500	815.00	2,852,500
神栄	2,000	203.00	406,000

山下医科器械	100	1,693.00	169,300
ラサ商事	700	527.00	368,900
アルコニックス	800	1,630.00	1,304,000
神戸物産	200	4,825.00	965,000
あい ホールディングス	2,300	2,126.00	4,889,800
ディーブイエックス	400	1,075.00	430,000
ダイワボウホールディングス	13,000	205.00	2,665,000
パイタルケーエスケー・ホールディングス	2,600	882.00	2,293,200
八洲電機	1,100	560.00	616,000
U K C ホールディングス	900	1,853.00	1,667,700
T O K A I ホールディングス	6,900	568.00	3,919,200
三洋貿易	800	1,314.00	1,051,200
ウイン・パートナーズ	500	1,674.00	837,000
ミタチ産業	300	731.00	219,300
シップヘルスケアホールディングス	2,600	2,689.00	6,991,400
スターティア	100	1,795.00	179,500
富士興産	600	636.00	381,600
協栄産業	2,000	221.00	442,000
小野建	1,200	1,110.00	1,332,000
佐島電機	1,100	715.00	786,500
エコートレーディング	400	668.00	267,200
伯東	900	1,148.00	1,033,200
コンドーテック	1,000	727.00	727,000
中山福	900	810.00	729,000
ナガイレーベン	2,000	2,038.00	4,076,000
三菱食品	1,500	2,579.00	3,868,500
松田産業	1,000	1,236.00	1,236,000
メディパルホールディングス	14,100	1,251.00	17,639,100
アドヴァン	700	1,143.00	800,100
S P K	300	1,928.00	578,400
アズワン	1,000	3,095.00	3,095,000
スズデン	400	660.00	264,000
シモジマ	900	1,002.00	901,800
ドウシシャ	1,800	1,816.00	3,268,800
小津産業	300	1,775.00	532,500
高速	800	904.00	723,200
黒田電気	2,400	1,567.00	3,760,800
丸文	1,200	739.00	886,800
ハビネット	900	1,928.00	1,735,200
トーメンエレクトロニクス	600	1,647.00	988,200
橋本総業	200	2,119.00	423,800
エクセル	700	1,423.00	996,100

マルカキカイ	400	1,367.00	546,800
ガリバーインターナショナル	4,300	968.00	4,162,400
日本エム・ディ・エム	1,200	518.00	621,600
進和	800	1,308.00	1,046,400
エスケイジャパン	500	260.00	130,000
ダイトエレクトロン	700	508.00	355,600
シークス	900	1,935.00	1,741,500
田中商事	400	669.00	267,600
オーハシテクニカ	900	1,342.00	1,207,800
マクニカ	700	3,120.00	2,184,000
白銅	500	1,030.00	515,000
伊藤忠商事	118,400	1,381.50	163,569,600
丸紅	123,700	726.00	89,806,200
高島	3,000	234.00	702,000
長瀬産業	8,600	1,353.00	11,635,800
蝶理	900	1,652.00	1,486,800
豊田通商	15,800	2,716.00	42,912,800
三共生興	2,300	412.00	947,600
兼松	28,000	177.00	4,956,000
ツカモトコーポレーション	3,000	130.00	390,000
三井物産	119,900	1,641.00	196,755,900
日本紙パルプ商事	7,000	325.00	2,275,000
日立ハイテクノロジーズ	4,900	3,400.00	16,660,000
カメイ	1,800	798.00	1,436,400
東都水産	3,000	190.00	570,000
OUGホールディングス	2,000	232.00	464,000
スターゼン	6,000	335.00	2,010,000
山善	5,400	863.00	4,660,200
椿本興業	1,000	304.00	304,000
住友商事	83,500	1,193.50	99,657,250
内田洋行	4,000	356.00	1,424,000
三菱商事	108,400	2,187.50	237,125,000
第一実業	4,000	542.00	2,168,000
キヤノンマーケティングジャパン	4,000	2,213.00	8,852,000
西華産業	5,000	277.00	1,385,000
佐藤商事	1,300	746.00	969,800
菱洋エレクトロ	1,600	1,102.00	1,763,200
東京産業	1,400	436.00	610,400
ユアサ商事	1,200	2,107.00	2,528,400
神鋼商事	4,000	275.00	1,100,000
小林産業	1,100	273.00	300,300
阪和興業	14,000	398.00	5,572,000

カナデン	2,000	787.00	1,574,000	
菱電商事	2,000	812.00	1,624,000	
フルサト工業	800	1,684.00	1,347,200	
岩谷産業	16,000	713.00	11,408,000	
すてきナイスグループ	6,000	197.00	1,182,000	
昭光通商	5,000	165.00	825,000	
ニチモウ	2,000	191.00	382,000	
極東貿易	2,000	247.00	494,000	
イワキ	2,000	235.00	470,000	
三愛石油	4,000	776.00	3,104,000	
稲畑産業	3,400	1,046.00	3,556,400	
G S Iクレオス	4,000	138.00	552,000	
明和産業	1,100	408.00	448,800	
ワキタ	3,000	1,131.00	3,393,000	
東邦ホールディングス	4,900	1,408.00	6,899,200	
サンゲツ	2,700	2,701.00	7,292,700	
ミツウロコグループホールディングス	2,300	538.00	1,237,400	
シナネン	3,000	436.00	1,308,000	
伊藤忠エネクス	3,100	726.00	2,250,600	
サンリオ	4,000	3,020.00	12,080,000	
サンワテクノス	900	1,150.00	1,035,000	
リョーサン	2,400	2,405.00	5,772,000	
新光商事	1,700	1,098.00	1,866,600	
トーヨー	3,000	423.00	1,269,000	
三信電気	2,000	809.00	1,618,000	
東陽テクニカ	2,100	1,000.00	2,100,000	
モスフードサービス	1,800	2,110.00	3,798,000	
加賀電子	1,300	1,397.00	1,816,100	
ソーダニッカ	2,000	475.00	950,000	
立花エレテック	900	1,434.00	1,290,600	
P a l t a c	2,300	1,353.00	3,111,900	
太平洋興発	6,000	93.00	558,000	
ヤマタネ	7,000	172.00	1,204,000	
丸紅建材リース	1,000	304.00	304,000	
日鉄住金物産	9,000	405.00	3,645,000	
トラスコ中山	1,800	3,140.00	5,652,000	
オートバックスセブン	5,200	1,658.00	8,621,600	
加藤産業	2,000	2,403.00	4,806,000	
イノテック	1,300	534.00	694,200	
イエローハット	1,300	2,290.00	2,977,000	
富士エレクトロニクス	700	1,310.00	917,000	
J Kホールディングス	1,400	564.00	789,600	

日伝	600	2,439.00	1,463,400
北沢産業	1,200	181.00	217,200
杉本商事	800	1,106.00	884,800
因幡電機産業	2,100	3,845.00	8,074,500
パイテック	500	756.00	378,000
ミスミグループ本社	5,300	3,645.00	19,318,500
江守グループホールディングス	600	1,098.00	658,800
アルテック	1,100	224.00	246,400
タキヒヨー	2,000	408.00	816,000
スズケン	5,800	3,010.00	17,458,000
ジェコス	1,000	1,869.00	1,869,000
ルネサスイーストン	700	812.00	568,400
ローソン	5,400	7,540.00	40,716,000
サンエー	1,100	3,730.00	4,103,000
ダイユーエイト	300	697.00	209,100
カワチ薬品	1,100	1,760.00	1,936,000
エービーシー・マート	2,000	6,110.00	12,220,000
ハードオフコーポレーション	700	886.00	620,200
アスクル	1,500	2,108.00	3,162,000
ゲオホールディングス	2,700	973.00	2,627,100
アダストリアホールディングス	1,200	2,203.00	2,643,600
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,000	145.00	290,000
くらコーポレーション	800	2,941.00	2,352,800
キャンドウ	700	1,641.00	1,148,700
パル	800	2,971.00	2,376,800
エディオン	6,500	797.00	5,180,500
サーラコーポレーション	1,200	611.00	733,200
ワッツ	600	862.00	517,200
あみやき亭	300	4,095.00	1,228,500
ひらまつ	2,000	607.00	1,214,000
ゲンキー	200	5,550.00	1,110,000
サッポロドラッグストアー	100	1,794.00	179,400
大黒天物産	300	3,300.00	990,000
ハニーズ	1,100	1,016.00	1,117,600
アルペン	1,300	1,666.00	2,165,800
クオール	1,400	717.00	1,003,800
ジェイアイエヌ	1,000	2,332.00	2,332,000
ビックカメラ	6,100	966.00	5,892,600
D C Mホールディングス	6,800	722.00	4,909,600
MonotaRO	2,800	2,895.00	8,106,000
きちり	300	703.00	210,900
アークランドサービス	200	3,405.00	681,000

J・フロント リテイリング	17,900	1,438.00	25,740,200
ドトール・日レスホールディングス	2,500	1,591.00	3,977,500
マツモトキヨシホールディングス	3,200	3,235.00	10,352,000
ブロンコピリー	300	3,085.00	925,500
スタートトゥデイ	4,400	2,309.00	10,159,600
物語コーポレーション	400	3,590.00	1,436,000
ココカラファイン	1,500	2,801.00	4,201,500
三越伊勢丹ホールディングス	28,100	1,478.00	41,531,800
ウエルシアホールディングス	1,300	3,610.00	4,693,000
クリエイティブSDホールディングス	600	3,925.00	2,355,000
丸善C H Iホールディングス	1,700	375.00	637,500
エー・ピーカンパニー	200	1,599.00	319,800
チムニー	300	2,239.00	671,700
ネクステージ	200	496.00	99,200
ジョイフル本田	800	3,965.00	3,172,000
麒麟堂ホールディングス	500	685.00	342,500
ブックオフコーポレーション	800	827.00	661,600
あさひ	900	1,170.00	1,053,000
日本調剤	200	3,185.00	637,000
コスモス薬品	800	16,030.00	12,824,000
トーエル	800	668.00	534,400
一六堂	400	447.00	178,800
セブン&アイ・ホールディングス	59,200	4,283.00	253,553,600
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	1,000	1,388.00	1,388,000
ツルハホールディングス	2,800	6,530.00	18,284,000
サンマルクホールディングス	500	5,810.00	2,905,000
フェリシモ	400	1,096.00	438,400
トリドール	1,400	1,402.00	1,962,800
クスリのアオキ	600	5,130.00	3,078,000
メディカルシステムネットワーク	1,300	355.00	461,500
総合メディカル	300	5,400.00	1,620,000
はるやま商事	600	705.00	423,000
カッパ・クリエイティブホールディングス	2,300	1,029.00	2,366,700
ライトオン	1,100	705.00	775,500
ジーンズメイト	600	210.00	126,000
良品計画	1,800	14,540.00	26,172,000
三城ホールディングス	1,800	478.00	860,400
コナカ	1,700	633.00	1,076,100
ハウス オブ ローゼ	200	1,386.00	277,200
G-7ホールディングス	300	919.00	275,700
イオン北海道	900	653.00	587,700

コジマ	2,200	296.00	651,200
ヒマラヤ	300	952.00	285,600
コーナン商事	2,200	1,274.00	2,802,800
エコス	500	844.00	422,000
ワタミ	1,700	1,261.00	2,143,700
マルシェ	400	873.00	349,200
ドンキホーテホールディングス	4,900	7,030.00	34,447,000
西松屋チェーン	2,800	989.00	2,769,200
ゼンショーホールディングス	7,300	995.00	7,263,500
幸楽苑	900	1,400.00	1,260,000
ハークスレイ	400	887.00	354,800
サイゼリヤ	2,100	1,630.00	3,423,000
ポプラ	400	539.00	215,600
ユナイテッドアローズ	1,800	3,745.00	6,741,000
ハイデイ日高	900	3,300.00	2,970,000
京都きもの友禅	900	1,006.00	905,400
コロワイド	4,700	1,300.00	6,110,000
壱番屋	600	5,080.00	3,048,000
トップカルチャー	600	496.00	297,600
P L A N T	400	1,157.00	462,800
スギホールディングス	2,500	4,810.00	12,025,000
スクロール	1,900	271.00	514,900
ヨンドシーホールディングス	1,100	1,977.00	2,174,700
ファミリーマート	4,800	4,380.00	21,024,000
木曽路	1,700	1,904.00	3,236,800
サトレストランシステムズ	1,300	861.00	1,119,300
千趣会	2,500	861.00	2,152,500
タカキュー	1,100	205.00	225,500
ケーヨー	2,700	527.00	1,422,900
上新電機	3,000	1,001.00	3,003,000
日本瓦斯	2,300	2,541.00	5,844,300
ベスト電器	4,800	136.00	652,800
マルエツ	3,000	542.00	1,626,000
ロイヤルホールディングス	2,300	1,669.00	3,838,700
東天紅	1,000	178.00	178,000
いなげや	1,600	1,160.00	1,856,000
島忠	3,400	2,876.00	9,778,400
チヨダ	1,700	2,173.00	3,694,100
ライフコーポレーション	900	1,757.00	1,581,300
カスミ	2,900	1,043.00	3,024,700
リンガーハット	1,400	1,713.00	2,398,200
さが美	1,000	96.00	96,000

MrMax	1,500	309.00	463,500
テンアライド	1,200	347.00	416,400
AOKIホールディングス	3,300	1,188.00	3,920,400
オークワ	2,000	935.00	1,870,000
コメリ	2,400	2,474.00	5,937,600
青山商事	3,600	2,618.00	9,424,800
しまむら	1,600	9,510.00	15,216,000
CFSコーポレーション	1,000	639.00	639,000
はせがわ	500	582.00	291,000
高島屋	20,000	932.00	18,640,000
松屋	2,800	1,522.00	4,261,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	6,700	1,782.00	11,939,400
近鉄百貨店	5,000	313.00	1,565,000
丸栄	2,000	145.00	290,000
ニッセンホールディングス	3,000	349.00	1,047,000
パルコ	1,400	905.00	1,267,000
丸井グループ	17,000	936.00	15,912,000
アクシアル リテイリング	1,100	2,371.00	2,608,100
ダイエー	16,300	127.00	2,070,100
イオン	56,500	1,096.00	61,924,000
ユニーグループ・ホールディングス	13,700	583.00	7,987,100
イズミ	3,200	3,525.00	11,280,000
東武ストア	2,000	286.00	572,000
平和堂	2,900	2,094.00	6,072,600
フジ	1,600	2,143.00	3,428,800
ヤオコー	800	6,720.00	5,376,000
ゼビオ	1,900	1,753.00	3,330,700
ケーズホールディングス	3,300	2,865.00	9,454,500
Olympicグループ	900	986.00	887,400
日産東京販売ホールディングス	2,400	281.00	674,400
アインファーマシーズ	1,500	3,020.00	4,530,000
元気寿司	400	1,828.00	731,200
ヤマダ電機	56,000	358.00	20,048,000
アークランドサカモト	1,000	2,515.00	2,515,000
ニトリホールディングス	6,100	6,920.00	42,212,000
愛眼	1,200	259.00	310,800
ケーユーホールディングス	700	591.00	413,700
吉野家ホールディングス	4,000	1,250.00	5,000,000
松屋フーズ	700	2,036.00	1,425,200
サガミチェーン	2,000	1,054.00	2,108,000
関西スーパーマーケット	1,100	783.00	861,300
王将フードサービス	1,000	3,980.00	3,980,000

プレナス	1,600	1,970.00	3,152,000
ミニストップ	1,100	1,570.00	1,727,000
アークス	2,400	2,429.00	5,829,600
パロー	3,000	1,705.00	5,115,000
藤久	100	1,686.00	168,600
ベルク	600	3,150.00	1,890,000
大庄	800	1,318.00	1,054,400
ファーストリテイリング	2,800	42,235.00	118,258,000
サンドラッグ	3,000	5,120.00	15,360,000
サックスパー ホールディングス	1,100	1,493.00	1,642,300
ヤマザワ	300	1,601.00	480,300
やまや	300	1,585.00	475,500
ペルーナ	3,500	470.00	1,645,000
島根銀行	300	1,354.00	406,200
じもとホールディングス	10,100	221.00	2,232,100
足利ホールディングス	8,900	405.00	3,604,500
東京ＴＹフィナンシャルグループ	1,800	3,460.00	6,228,000
新生銀行	135,000	241.00	32,535,000
あおぞら銀行	96,000	393.00	37,728,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	1,134,900	623.70	707,837,130
りそなホールディングス	165,500	644.70	106,697,850
三井住友トラスト・ホールディングス	317,000	464.60	147,278,200
三井住友フィナンシャルグループ	107,000	4,431.00	474,117,000
第四銀行	18,000	387.00	6,966,000
北越銀行	15,000	216.00	3,240,000
西日本シティ銀行	50,000	305.00	15,250,000
千葉銀行	55,000	791.00	43,505,000
横浜銀行	98,000	648.20	63,523,600
常陽銀行	51,000	580.00	29,580,000
群馬銀行	34,000	693.00	23,562,000
武蔵野銀行	2,300	3,670.00	8,441,000
千葉興業銀行	3,000	784.00	2,352,000
筑波銀行	5,900	371.00	2,188,900
七十七銀行	24,000	617.00	14,808,000
青森銀行	11,000	332.00	3,652,000
秋田銀行	9,000	307.00	2,763,000
山形銀行	8,000	512.00	4,096,000
岩手銀行	1,000	4,930.00	4,930,000
東邦銀行	13,000	402.00	5,226,000
東北銀行	8,000	156.00	1,248,000
みちのく銀行	7,000	213.00	1,491,000
ふくおかフィナンシャルグループ	57,000	575.00	32,775,000

静岡銀行	41,000	1,135.00	46,535,000
十六銀行	18,000	431.00	7,758,000
スルガ銀行	14,900	2,285.00	34,046,500
八十二銀行	26,000	680.00	17,680,000
山梨中央銀行	9,000	490.00	4,410,000
大垣共立銀行	18,000	301.00	5,418,000
福井銀行	12,000	258.00	3,096,000
北國銀行	16,000	368.00	5,888,000
清水銀行	500	2,919.00	1,459,500
滋賀銀行	14,000	597.00	8,358,000
南都銀行	14,000	429.00	6,006,000
百五銀行	13,000	462.00	6,006,000
京都銀行	27,000	951.00	25,677,000
紀陽銀行	5,600	1,576.00	8,825,600
三重銀行	6,000	257.00	1,542,000
ほくほくフィナンシャルグループ	96,000	220.00	21,120,000
広島銀行	42,000	573.00	24,066,000
山陰合同銀行	9,000	848.00	7,632,000
中国銀行	10,200	1,618.00	16,503,600
鳥取銀行	4,000	222.00	888,000
伊予銀行	15,100	1,187.00	17,923,700
百十四銀行	15,000	348.00	5,220,000
四国銀行	11,000	237.00	2,607,000
阿波銀行	11,000	652.00	7,172,000
鹿児島銀行	10,000	707.00	7,070,000
大分銀行	9,000	417.00	3,753,000
宮崎銀行	9,000	332.00	2,988,000
肥後銀行	11,000	619.00	6,809,000
佐賀銀行	9,000	252.00	2,268,000
十八銀行	9,000	308.00	2,772,000
沖縄銀行	1,100	4,840.00	5,324,000
琉球銀行	2,900	1,802.00	5,225,800
セブン銀行	47,700	471.00	22,466,700
みずほフィナンシャルグループ	1,953,800	202.30	395,253,740
高知銀行	5,000	150.00	750,000
山口フィナンシャルグループ	14,000	1,076.00	15,064,000
長野銀行	5,000	189.00	945,000
名古屋銀行	13,000	437.00	5,681,000
北洋銀行	21,300	453.00	9,648,900
愛知銀行	500	5,300.00	2,650,000
第三銀行	8,000	177.00	1,416,000
中京銀行	6,000	203.00	1,218,000

東日本銀行	6,000	313.00	1,878,000	
大光銀行	5,000	215.00	1,075,000	
愛媛銀行	8,000	244.00	1,952,000	
トマト銀行	5,000	178.00	890,000	
みなと銀行	13,000	214.00	2,782,000	
京葉銀行	12,000	587.00	7,044,000	
関西アーバン銀行	1,900	1,183.00	2,247,700	
栃木銀行	7,000	442.00	3,094,000	
北日本銀行	400	2,583.00	1,033,200	
東和銀行	19,000	98.00	1,862,000	
福島銀行	18,000	85.00	1,530,000	
大東銀行	9,000	140.00	1,260,000	
トモニホールディングス	10,800	471.00	5,086,800	
フィデアホールディングス	8,100	221.00	1,790,100	
池田泉州ホールディングス	11,600	571.00	6,623,600	
F P G	1,200	1,148.00	1,377,600	
S B Iホールディングス	17,000	1,330.00	22,610,000	
ジャフコ	1,900	4,465.00	8,483,500	
大和証券グループ本社	132,000	947.90	125,122,800	
野村ホールディングス	289,200	713.80	206,430,960	
岡三証券グループ	12,000	918.00	11,016,000	
丸三証券	4,500	832.00	3,744,000	
東洋証券	6,000	341.00	2,046,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	16,200	798.00	12,927,600	
光世証券	4,000	239.00	956,000	
水戸証券	4,400	421.00	1,852,400	
いちよし証券	3,000	1,368.00	4,104,000	
松井証券	7,200	1,086.00	7,819,200	
だいこう証券ビジネス	700	703.00	492,100	
マネックスグループ	16,800	306.00	5,140,800	
カブドットコム証券	6,300	576.00	3,628,800	
極東証券	1,900	1,906.00	3,621,400	
岩井コスモホールディングス	1,500	1,253.00	1,879,500	
マネースクウェアHD	500	1,470.00	735,000	
マネーパートナーズグループ	1,500	408.00	612,000	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	31,400	2,870.00	90,118,000	
アニコムホールディングス	600	1,275.00	765,000	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	45,100	2,453.50	110,652,850	
ソニーフィナンシャルホールディングス	13,600	1,756.00	23,881,600	
第一生命保険	90,700	1,677.00	152,103,900	
東京海上ホールディングス	58,200	3,622.50	210,829,500	

T & Dホールディングス	51,600	1,412.50	72,885,000
全国保証	3,700	3,670.00	13,579,000
クレディセゾン	11,600	2,243.00	26,018,800
芙蓉総合リース	1,500	4,355.00	6,532,500
興銀リース	2,700	2,622.00	7,079,400
東京センチュリーリース	3,300	3,040.00	10,032,000
日本証券金融	6,800	662.00	4,501,600
アイフル	23,700	467.00	11,067,900
ポケットカード	1,100	661.00	727,100
リコーリース	1,100	3,135.00	3,448,500
イオンフィナンシャルサービス	9,300	2,260.00	21,018,000
アコム	28,500	354.00	10,089,000
ジャックス	8,000	601.00	4,808,000
オリエントコーポレーション	32,900	223.00	7,336,700
日立キャピタル	2,800	2,721.00	7,618,800
アプラスフィナンシャル	6,900	152.00	1,048,800
オリックス	100,100	1,582.00	158,358,200
三菱UFJリース	36,000	580.00	20,880,000
日本取引所グループ	20,800	3,030.00	63,024,000
イー・ギャランティ	400	1,945.00	778,000
アサックス	300	1,418.00	425,400
NECキャピタルソリューション	600	2,098.00	1,258,800
日本駐車場開発	15,400	120.00	1,848,000
ヒューリック	23,900	1,150.00	27,485,000
東京建物不動産販売	800	396.00	316,800
三栄建築設計	600	926.00	555,600
野村不動産ホールディングス	8,500	1,888.00	16,048,000
プレサンスコーポレーション	500	3,170.00	1,585,000
常和ホールディングス	500	3,750.00	1,875,000
日本管理センター	400	2,102.00	840,800
エストラスト	100	688.00	68,800
フージャースホールディングス	2,100	535.00	1,123,500
オープンハウス	900	2,169.00	1,952,100
東急不動産ホールディングス	37,100	790.00	29,309,000
飯田グループホールディングス	9,200	1,228.00	11,297,600
エコナックホールディングス	6,000	46.00	276,000
パーク24	7,100	1,647.00	11,693,700
パラカ	600	838.00	502,800
三井不動産	75,000	3,411.50	255,862,500
三菱地所	105,000	2,605.00	273,525,000
平和不動産	2,700	1,838.00	4,962,600
東京建物	31,000	912.00	28,272,000

ダイビル	3,600	1,207.00	4,345,200
京阪神ビルディング	2,400	639.00	1,533,600
住友不動産	34,000	4,122.50	140,165,000
大京	23,000	197.00	4,531,000
テーオーシー	4,900	753.00	3,689,700
東京楽天地	2,000	499.00	998,000
レオパレス21	15,500	666.00	10,323,000
スターツコーポレーション	1,600	1,617.00	2,587,200
フジ住宅	1,800	627.00	1,128,600
空港施設	1,700	743.00	1,263,100
明和地所	800	508.00	406,400
住友不動産販売	1,000	2,510.00	2,510,000
ゴールドクレスト	1,300	2,029.00	2,637,700
日本エスリード	600	1,065.00	639,000
日神不動産	1,900	456.00	866,400
タカラレーベン	6,400	512.00	3,276,800
サンヨーハウジング名古屋	800	1,221.00	976,800
イオンモール	9,100	1,955.00	17,790,500
ファースト住建	500	1,222.00	611,000
トーセイ	2,000	749.00	1,498,000
穴吹興産	1,000	252.00	252,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	8,800	1,189.00	10,463,200
サンフロンティア不動産	1,500	1,283.00	1,924,500
エフ・ジェー・ネクスト	1,100	501.00	551,100
ランドビジネス	800	424.00	339,200
グランディハウス	1,200	296.00	355,200
日本空港ビルディング	4,900	4,470.00	21,903,000
日本工営	5,000	469.00	2,345,000
ネクスト	1,800	631.00	1,135,800
日本M&Aセンター	2,300	3,375.00	7,762,500
ノバレーゼ	400	873.00	349,200
アコーディア・ゴルフ	5,600	1,116.00	6,249,600
タケエイ	1,500	1,014.00	1,521,000
トラスト・テック	300	1,889.00	566,700
パソナグループ	1,100	526.00	578,600
CDS	300	1,004.00	301,200
リンクアンドモチベーション	2,000	163.00	326,000
GCAサヴィアン	1,200	1,123.00	1,347,600
エス・エム・エス	800	2,596.00	2,076,800
テンブホールディングス	2,900	3,475.00	10,077,500
リニカル	400	853.00	341,200
クックパッド	700	3,715.00	2,600,500

エスクリ	500	1,000.00	500,000
アイ・ケイ・ケイ	400	890.00	356,000
学情	600	1,046.00	627,600
スタジオアリス	700	1,430.00	1,001,000
シミックホールディングス	600	1,580.00	948,000
総合警備保障	5,000	2,395.00	11,975,000
カカクコム	10,000	1,630.00	16,300,000
ルネサンス	700	965.00	675,500
ディップ	300	3,960.00	1,188,000
オプト	700	765.00	535,500
新日本科学	1,500	813.00	1,219,500
ツクイ	1,800	956.00	1,720,800
総合臨床ホールディングス	700	468.00	327,600
キャリアデザインセンター	500	1,106.00	553,000
エムスリー	12,900	1,839.00	23,723,100
ツカダ・グローバルホールディング	1,100	876.00	963,600
アウトソーシング	600	1,531.00	918,600
ディー・エヌ・エー	7,400	1,436.00	10,626,400
博報堂D Yホールディングス	20,700	1,104.00	22,852,800
ぐるなび	1,900	1,474.00	2,800,600
一休	1,200	1,438.00	1,725,600
ジャパンベストレスキューシステム	1,300	284.00	369,200
ファンコミュニケーションズ	2,600	1,063.00	2,763,800
ジェイコムホールディングス	300	783.00	234,900
P G Mホールディングス	2,100	1,100.00	2,310,000
W D Bホールディングス	300	1,802.00	540,600
ティア	400	694.00	277,600
バリューコマース	1,300	678.00	881,400
J Pホールディングス	3,700	373.00	1,380,100
イーピーエス	1,800	1,293.00	2,327,400
プレステージ・インターナショナル	1,100	960.00	1,056,000
アミューズ	500	3,440.00	1,720,000
ドリームインキュベータ	500	1,799.00	899,500
クイック	500	1,001.00	500,500
T A C	800	233.00	186,400
ケネディクス	21,400	541.00	11,577,400
電通	16,700	4,095.00	68,386,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	1,121.00	672,600
ぴあ	400	1,889.00	755,600
イオンファンタジー	500	1,455.00	727,500
みらかホールディングス	3,900	4,635.00	18,076,500
アルプス技研	600	1,247.00	748,200

サニックス	1,800	513.00	923,400
ダイオーズ	300	915.00	274,500
日本空調サービス	700	801.00	560,700
オリエンタルランド	4,100	23,570.00	96,637,000
ダスキン	4,200	1,830.00	7,686,000
明光ネットワークジャパン	1,500	1,208.00	1,812,000
ファルコホールディングス	700	1,218.00	852,600
秀英予備校	400	285.00	114,000
田谷	200	767.00	153,400
ラウンドワン	4,300	671.00	2,885,300
リゾートトラスト	5,500	2,577.00	14,173,500
ビー・エム・エル	900	3,390.00	3,051,000
ワタベウェディング	500	542.00	271,000
もしもしホットライン	2,800	1,106.00	3,096,800
リソー教育	2,500	227.00	567,500
早稲田アカデミー	200	786.00	157,200
ユー・エス・エス	18,100	1,736.00	31,421,600
東京個別指導学院	700	404.00	282,800
サイバーエージェント	2,700	4,390.00	11,853,000
楽天	65,000	1,414.00	91,910,000
テー・オー・ダブリュー	500	735.00	367,500
セントラルスポーツ	500	1,769.00	884,500
フルキャストホールディングス	1,600	542.00	867,200
リゾートソリューション	2,000	241.00	482,000
リブセンス	900	796.00	716,400
ジャパンマテリアル	200	4,675.00	935,000
ウチヤマホールディングス	700	666.00	466,200
サクセスホールディングス	100	1,306.00	130,600
アサンテ	400	1,278.00	511,200
E R Iホールディングス	300	1,133.00	339,900
リロ・ホールディング	500	7,530.00	3,765,000
東祥	300	2,091.00	627,300
エイチ・アイ・エス	2,400	2,599.00	6,237,600
共立メンテナンス	700	4,700.00	3,290,000
イチネンホールディングス	1,600	928.00	1,484,800
建設技術研究所	900	1,710.00	1,539,000
スペース	800	1,281.00	1,024,800
燦ホールディングス	300	1,584.00	475,200
スバル興業	1,000	438.00	438,000
東京テアトル	6,000	145.00	870,000
よみうりランド	3,000	504.00	1,512,000
東京都競馬	10,000	318.00	3,180,000

常磐興産	6,000	147.00	882,000	
カナモト	2,100	3,745.00	7,864,500	
東京ドーム	10,000	460.00	4,600,000	
西尾レントオール	1,200	3,920.00	4,704,000	
トランス・コスモス	1,900	1,991.00	3,782,900	
乃村工藝社	2,900	1,024.00	2,969,600	
藤田観光	6,000	375.00	2,250,000	
KNT-CTホールディングス	7,000	163.00	1,141,000	
日本管財	700	2,993.00	2,095,100	
トーカイ	700	3,390.00	2,373,000	
白洋舎	2,000	246.00	492,000	
セコム	14,500	6,954.00	100,833,000	
セントラル警備保障	700	1,172.00	820,400	
丹青社	1,700	1,041.00	1,769,700	
メイテック	2,000	3,270.00	6,540,000	
アサツー ディ・ケイ	2,800	2,763.00	7,736,400	
応用地質	1,600	1,872.00	2,995,200	
船井総研ホールディングス	1,700	998.00	1,696,600	
進学会	600	406.00	243,600	
ベネッセホールディングス	5,500	3,415.00	18,782,500	
イオンディライト	1,400	2,723.00	3,812,200	
ナック	1,000	1,235.00	1,235,000	
ニチイ学館	2,900	851.00	2,467,900	
ダイセキ	2,400	1,960.00	4,704,000	
ステップ	500	846.00	423,000	
合 計	23,741,100		28,311,290,530	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド

貸借対照表

	平成25年11月 6日現在	平成26年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,580,071,540	222,697,424
コール・ローン	488,987,214	1,363,573,011
株式	74,085,402,542	81,244,724,484
投資証券	1,559,674,670	1,945,936,630
派生商品評価勘定	18,579,319	86,127,802
未収入金	67,917,049	21,413,215
未収配当金	48,663,757	63,824,238
未収利息	819	1,851
差入委託証拠金	293,036,937	275,970,959
流動資産合計	78,142,333,847	85,224,269,614
資産合計	78,142,333,847	85,224,269,614
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,130,586	9,571,368
未払金	7,489,066	29,730,285
未払解約金	147,342,368	213,624,968
流動負債合計	158,962,020	252,926,621
負債合計	158,962,020	252,926,621
純資産の部		
元本等		
元本	52,890,133,012	45,063,157,199
剰余金		
剰余金又は欠損金()	25,093,238,815	39,908,185,794
元本等合計	77,983,371,827	84,971,342,993
純資産合計	77,983,371,827	84,971,342,993
負債純資産合計	78,142,333,847	85,224,269,614

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1) デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 (2) 為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

		平成25年11月 6日現在	平成26年11月 6日現在
1.	期首	平成24年11月 7日	平成25年11月 7日
	期首元本額	66,367,767,459円	52,890,133,012円
	期首からの追加設定元本額	1,973,851,590円	2,115,048,715円
	期首からの一部解約元本額	15,451,486,037円	9,942,024,528円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外株式ヘッジなし（DC専用）	13,947,374,757円	14,486,530,809円
	DCインデックスバランス（株式20）	37,233,090円	38,378,525円
	DCインデックスバランス（株式40）	143,366,618円	146,819,018円
	DCインデックスバランス（株式60）	275,730,948円	275,932,015円
	DCインデックスバランス（株式80）	324,847,835円	322,007,153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	6,385,207,921円	4,684,069,671円
	日興五大陸株式ファンド	13,393,010,105円	9,774,819,063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	56,892,765円	37,408,481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）	24,095,247円	14,975,405円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	13,565,839円	8,648,697円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	9,901,251円	7,037,149円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	15,747,024円	10,361,713円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	19,867,103円	12,356,965円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	11,097,092,106円	8,863,891,626円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	15,230,756円	12,427,867円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	34,407,940円	30,699,577円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	100,180,127円	89,654,539円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	136,056,561円	126,022,414円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	141,025,715円	126,036,614円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	6,719,299,304円	5,995,079,898円
	計	52,890,133,012円	45,063,157,199円
2.	受益権の総数	52,890,133,012口	45,063,157,199口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成24年11月 7日 至 平成25年11月 6日	自 平成25年11月 7日 至 平成26年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成25年11月 6日現在	平成26年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）

（平成25年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

（平成26年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	2,059,643,121
投資証券	49,816,493
合計	2,109,459,614

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（平成25年11月 6日現在）

（単位：円）

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

合計	2,227,527,691	-	2,242,725,701	15,198,010
----	---------------	---	---------------	------------

(平成26年11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,569,662,912	-	1,583,340,315	13,677,403
合計		1,569,662,912	-	1,583,340,315	13,677,403

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(平成25年11月 6日現在)

(単位：円)

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

合計	2,323,639,595	-	2,325,653,300	749,277
----	---------------	---	---------------	---------

(平成26年11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,173,563,369	-	1,236,522,400	62,959,031
	米ドル	864,314,012	-	914,258,250	49,944,238
	ユーロ	309,249,357	-	322,264,150	13,014,793
	売建	91,664,000	-	91,744,000	80,000
	米ドル	91,664,000	-	91,744,000	80,000
合計		1,265,227,369	-	1,328,266,400	62,879,031

(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25年11月 6日現在		平成26年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	1.4744円	1口当たり純資産額	1.8856円
(1万口当たり純資産額)	(14,744円)	(1万口当たり純資産額)	(18,856円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	12,263	91.32	1,119,857.16	
	ANTERO RESOURCES CORP	1,060	52.31	55,448.60	
	APACHE CORP	9,254	75.56	699,232.24	
	BAKER HUGHES INC	10,615	51.35	545,080.25	
	CABOT OIL & GAS CORP	9,950	31.73	315,713.50	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	5,361	56.97	305,416.17	
	CHENIERE ENERGY INC	5,580	71.07	396,570.60	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	13,880	22.76	315,908.80	
	CHEVRON CORP	45,841	117.05	5,365,689.05	
	CIMAREX ENERGY CO	2,005	111.49	223,537.45	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	8,000	10.50	84,000.00	
	CONCHO RESOURCES INC	2,885	106.49	307,223.65	
	CONOCOPHILLIPS	29,670	69.88	2,073,339.60	
	CONSOL ENERGY INC	5,288	39.25	207,554.00	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,960	53.55	104,958.00	
	CORE LABORATORIES N.V.	1,240	133.63	165,701.20	
	DENBURY RESOURCES INC	7,335	11.47	84,132.45	
	DEVON ENERGY CORPORATION	9,751	61.62	600,856.62	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	1,525	35.43	54,030.75	
	ENERGEN CORP	1,520	66.60	101,232.00	
	ENSCO PLC-CL A	5,990	40.01	239,659.90	
	EOG RESOURCES INC	13,252	96.10	1,273,517.20	
	EQT CORP	3,735	97.04	362,444.40	
	EXXON MOBIL CORP	103,271	95.07	9,817,973.97	
	FMC TECHNOLOGIES INC	5,645	55.03	310,644.35	
	HALLIBURTON CO	20,427	52.37	1,069,761.99	
HELMERICH & PAYNE	2,800	84.26	235,928.00		
HESS CORP	7,120	83.17	592,170.40		

HOLLYFRONTIER CORP	4,520	43.60	197,072.00
KINDER MORGAN INC	19,510	38.10	743,331.00
MARATHON OIL CORP	16,157	33.57	542,390.49
MARATHON PETROLEUM CORP	7,236	90.71	656,377.56
MURPHY OIL CORP	4,295	52.25	224,413.75
NABORS INDUSTRIES LTD	7,671	16.65	127,722.15
NATIONAL OILWELL VARCO INC	9,981	71.56	714,240.36
NOBLE CORP PLC	5,872	20.26	118,966.72
NOBLE ENERGY INC	8,662	55.55	481,174.10
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	19,021	86.47	1,644,745.87
OCEANEERING INTL INC	2,060	68.66	141,439.60
ONEOK INC	5,160	56.50	291,540.00
PEABODY ENERGY CORP	7,060	10.78	76,106.80
PHILLIPS 66	13,945	74.74	1,042,249.30
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,600	172.86	622,296.00
QEP RESOURCES INC	4,290	24.44	104,847.60
RANGE RESOURCES CORP	4,050	70.08	283,824.00
SCHLUMBERGER LTD	31,239	96.64	3,018,936.96
SOUTHWESTERN ENERGY CO	8,835	34.16	301,803.60
SPECTRA ENERGY CORP	16,934	39.07	661,611.38
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	3,820	23.93	91,412.60
TESORO CORP	3,190	72.42	231,019.80
VALERO ENERGY CORP	13,022	49.64	646,412.08
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	16,939	15.13	256,287.07
WHITING PETROLEUM CORP	3,115	57.82	180,109.30
WILLIAMS COS INC	16,994	54.57	927,362.58
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	5,125	133.97	686,596.25
AIRGAS INC	1,430	112.13	160,345.90
ALBEMARLE CORP	1,630	60.75	99,022.50
ALCOA INC	26,179	16.26	425,670.54
ASHLAND INC	2,050	106.62	218,571.00
AVERY DENNISON CORP	2,260	46.93	106,061.80
BALL CORP	3,133	64.50	202,078.50
CELANESE CORP-SERIES A	3,900	58.96	229,944.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1,130	253.63	286,601.90

CROWN HOLDINGS INC	4,035	48.28	194,809.80
DOW CHEMICAL CO/THE	28,953	49.16	1,423,329.48
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	21,978	69.81	1,534,284.18
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,705	82.04	303,958.20
ECOLAB INC	6,710	110.46	741,186.60
FMC CORP	3,270	56.62	185,147.40
FREEMPORT-MCMORAN INC	24,558	27.13	666,258.54
INTERNATIONAL PAPER CO	10,390	52.38	544,228.20
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,664	97.51	162,256.64
LYONDELLBASELL INDU-CL A	11,050	85.25	942,012.50
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,045	120.48	125,901.60
MEADWESTVACO CORP	4,879	44.11	215,212.69
MONSANTO CO	12,541	113.82	1,427,416.62
MOSAIC CO/THE	7,850	43.90	344,615.00
NEWMONT MINING CORP	12,230	17.83	218,060.90
NUCOR CORP	7,849	53.06	416,467.94
OWENS-ILLINOIS INC	3,885	25.61	99,494.85
PPG INDUSTRIES INC	3,477	205.25	713,654.25
PRAXAIR INC	7,060	125.77	887,936.20
ROCK-TENN COMPANY-CL A	3,660	54.14	198,152.40
SEALED AIR CORP	4,356	37.75	164,439.00
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,167	230.39	499,255.13
SIGMA-ALDRICH	2,705	135.29	365,959.45
VULCAN MATERIALS CO	3,643	64.17	233,771.31
WESTLAKE CHEMICAL CORP	960	67.33	64,636.80
3M CO	14,896	155.69	2,319,158.24
AGCO CORP	1,670	43.58	72,778.60
AMETEK INC	6,343	51.39	325,966.77
B/E AEROSPACE INC	2,570	73.50	188,895.00
BOEING CO/THE	16,602	124.22	2,062,300.44
CATERPILLAR INC	14,196	99.41	1,411,224.36
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	2,410	53.96	130,043.60
CUMMINS INC	4,045	144.12	582,965.40
DANAHER CORP	14,889	80.77	1,202,584.53
DEERE & CO	8,180	84.97	695,054.60

DOVER CORP	3,640	81.25	295,750.00
EATON CORP PLC	11,306	68.32	772,425.92
EMERSON ELECTRIC CO	17,080	64.41	1,100,122.80
FASTENAL CO	6,153	44.44	273,439.32
FLOWSERVE CORP	3,325	67.30	223,772.50
FLUOR CORP	4,223	65.50	276,606.50
GENERAL DYNAMICS CORP	6,922	141.95	982,577.90
GENERAL ELECTRIC CO.	240,513	25.82	6,210,045.66
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	17,816	96.71	1,722,985.36
ILLINOIS TOOL WORKS	9,800	91.72	898,856.00
INGERSOLL-RAND PLC	6,866	62.20	427,065.20
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3,330	47.93	159,606.90
JOY GLOBAL INC	1,945	52.72	102,540.40
KBR INC	4,120	18.59	76,590.80
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	2,051	123.10	252,478.10
LOCKHEED MARTIN CORP	6,561	189.73	1,244,818.53
MASCO CORP	8,569	22.47	192,545.43
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,184	137.84	714,562.56
PACCAR INC	8,364	65.95	551,605.80
PALL CORP	2,596	93.55	242,855.80
PARKER HANNIFIN CORP	3,260	127.78	416,562.80
PENTAIR PLC	5,148	67.16	345,739.68
PRECISION CASTPARTS CORP	3,490	223.11	778,653.90
QUANTA SERVICES INC	6,025	33.23	200,210.75
RAYTHEON COMPANY	7,792	104.14	811,458.88
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,383	110.23	372,908.09
ROCKWELL COLLINS INC.	3,315	83.94	278,261.10
ROPER INDUSTRIES INC	2,310	157.06	362,808.60
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,100	48.16	149,296.00
SPX CORP	887	92.39	81,949.93
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,776	93.27	352,187.52
TEXTRON INC	6,606	42.05	277,782.30
TRANSDIGM GROUP INC	1,190	187.00	222,530.00
UNITED RENTALS INC	2,250	111.17	250,132.50
UNITED TECHNOLOGIES CORP	20,875	107.93	2,253,038.75

WW GRAINGER INC	1,577	253.16	399,233.32
XYLEM INC	4,368	36.39	158,951.52
ADT CORP/THE	4,917	35.96	176,815.32
CINTAS CORP	2,037	70.40	143,414.98
DUN & BRADSTREET CORP	872	121.83	106,235.76
EQUIFAX INC	2,634	76.43	201,316.62
IHS INC-CLASS A	1,710	129.70	221,787.00
MANPOWERGROUP INC	1,937	66.52	128,849.24
NIELSEN NV	6,945	42.28	293,634.60
REPUBLIC SERVICES INC	7,000	38.54	269,780.00
ROBERT HALF INTL INC	3,425	54.93	188,135.25
STERICYCLE INC	2,285	126.53	289,121.05
TOWERS WATSON & CO-CL-A	1,630	112.90	184,027.00
TYCO INTERNATIONAL LTD	10,845	43.13	467,744.85
VERISK ANALYTICS INC	4,000	62.83	251,320.00
WASTE MANAGEMENT INC	10,754	48.89	525,763.06
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	4,080	42.25	172,380.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,250	71.45	232,212.50
CSX CORP	24,953	34.58	862,874.74
DELTA AIR LINES INC	5,335	41.87	223,376.45
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,747	43.47	206,352.09
FEDEX CORP	6,668	169.42	1,129,692.56
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	9,780	21.12	206,553.60
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,310	80.84	186,740.40
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	158,000	0.68	107,440.00
KANSAS CITY SOUTHERN	2,910	121.81	354,467.10
NORFOLK SOUTHERN CORP	7,390	109.79	811,348.10
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,190	36.75	153,982.50
UNION PACIFIC CORP	21,796	116.41	2,537,272.36
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	2,495	54.11	135,004.45
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	16,907	107.54	1,818,178.78
AUTOLIV INC	2,610	93.86	244,974.60
BORGWARNER INC	5,230	57.32	299,783.60
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	7,140	69.94	499,371.60
FORD MOTOR COMPANY	88,145	13.94	1,228,741.30

GENERAL MOTORS CORP	30,545	30.73	938,647.85
HARLEY-DAVIDSON INC	5,619	64.36	361,638.84
JOHNSON CONTROLS INC	15,358	48.56	745,784.48
TESLA MOTORS INC	2,200	230.97	508,134.00
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	2,955	101.66	300,405.30
COACH INC	5,876	33.02	194,025.52
DR HORTON INC	6,906	22.51	155,454.06
FOSSIL GROUP INC	1,165	100.75	117,373.75
GARMIN LTD	2,865	55.60	159,294.00
HASBRO INC	3,368	57.85	194,838.80
LEGGETT & PLATT INC	2,648	39.73	105,205.04
LENNAR CORP-CL A	3,660	42.73	156,391.80
LULULEMON ATHLETICA INC	2,790	41.29	115,199.10
MATTEL INC	8,499	31.30	266,018.70
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	5,100	72.40	369,240.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,378	139.65	192,437.70
NEWELL RUBBERMAID INC	5,800	34.50	200,100.00
NIKE INC -CL B	16,754	94.68	1,586,268.72
POLARIS INDUSTRIES INC	1,580	152.00	240,160.00
PULTE GROUP INC	9,270	19.20	177,984.00
PVH CORP	2,030	113.35	230,100.50
RALPH LAUREN CORP	1,365	164.78	224,924.70
TOLL BROTHERS INC	4,501	31.40	141,331.40
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4,280	64.25	274,990.00
VF CORP	7,950	68.50	544,575.00
WHIRLPOOL CORP	1,814	172.85	313,549.90
CARNIVAL CORP	10,117	39.99	404,578.83
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	755	642.59	485,155.45
DARDEN RESTAURANTS INC	2,853	52.69	150,324.57
H&R BLOCK INC	7,080	32.25	228,330.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	9,150	25.04	229,116.00
LAS VEGAS SANDS CORP	10,260	58.31	598,260.60
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	5,966	74.90	446,853.40
MCDONALD'S CORP	23,691	94.64	2,242,116.24
MGM RESORTS INTERNATIONAL	9,790	21.72	212,638.80

ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,538	67.33	238,213.54
STARBUCKS CORP	17,962	76.66	1,376,966.92
STARWOOD HOTELS & RESORTS	5,037	75.64	380,998.68
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,980	76.77	228,774.60
WYNN RESORTS LTD	2,000	179.74	359,480.00
YUM! BRANDS INC	10,844	72.44	785,539.36
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	5,725	18.46	105,683.50
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	12,038	52.50	631,995.00
CHARTER COMMUNICATION-A	1,400	159.31	223,034.00
COMCAST CORP-CLASS A	51,186	55.09	2,819,836.74
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	11,221	54.91	616,145.11
DIRECTV	11,554	87.82	1,014,672.28
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,320	34.47	114,440.40
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	7,690	34.48	265,189.65
DISH NETWORK CORP-A	5,829	63.05	367,518.45
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	11,796	19.22	226,719.12
LIBERTY BROADBAND-A(N)	616	50.95	31,385.20
LIBERTY BROADBAND-C(N)	1,232	50.96	62,782.72
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,355	44.91	240,493.05
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	11,941	44.04	525,881.64
LIBERTY MEDIA CORP-A	2,465	35.84	88,345.60
LIBERTY MEDIA CORP-C	4,930	35.25	173,782.50
NEWS CORP - CLASS A	7,570	15.30	115,821.00
OMNICOM GROUP	6,427	72.33	464,864.91
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	2,320	74.59	173,048.80
SIRIUS XM HOLDINGS INC	80,330	3.49	280,351.70
THE WALT DISNEY CO.	39,753	91.00	3,617,523.00
TIME WARNER CABLE	6,937	146.16	1,013,911.92
TIME WARNER INC	21,338	77.99	1,664,150.62
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	10,729	33.41	358,455.89
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	34,132	34.84	1,189,158.88
VIACOM INC-CLASS B	8,958	70.48	631,359.84
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,848	149.37	276,035.76
AMAZON.COM INC	9,355	296.52	2,773,944.60
AUTONATION INC	1,650	56.80	93,720.00

AUTOZONE INC	822	559.15	459,621.30
BED BATH & BEYOND INC	5,282	68.16	360,021.12
BEST BUY CO INC	6,504	34.64	225,298.56
CARMAX INC	5,869	56.57	332,009.33
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,770	44.23	122,517.10
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	7,780	63.32	492,629.60
DOLLAR TREE INC	5,264	61.13	321,788.32
EXPEDIA INC	2,232	83.05	185,367.60
FAMILY DOLLAR STORES	2,623	78.51	205,931.73
GAMESTOP CORP-CLASS A	3,440	43.04	148,057.60
GAP INC/THE	5,936	37.25	221,116.00
GENUINE PARTS CO	4,011	98.79	396,246.69
HOME DEPOT INC	32,810	95.78	3,142,541.80
KOHL'S CORP	5,202	55.09	286,578.18
L BRANDS INC	6,408	75.00	480,600.00
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	11,400	28.13	320,682.00
LKQ CORP	6,990	28.76	201,032.40
LOWE'S COS INC	24,202	56.94	1,378,061.88
MACY'S INC	9,009	57.20	515,314.80
NETFLIX INC	1,390	380.38	528,728.20
NORDSTROM INC	3,690	72.26	266,639.40
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,675	177.46	474,705.50
PETSMART INC	2,240	70.40	157,696.00
PRICELINE GROUP INC/THE	1,255	1,095.34	1,374,651.70
ROSS STORES INC	4,616	80.77	372,834.32
STAPLES INC	17,384	12.96	225,296.64
TARGET CORP	14,050	61.12	858,736.00
TIFFANY & CO	3,360	95.72	321,619.20
TJX COMPANIES INC	16,223	63.72	1,033,729.56
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,600	73.36	264,096.00
TRIPADVISOR INC	2,830	71.95	203,618.50
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	1,770	118.66	210,028.20
URBAN OUTFITTERS INC	2,040	30.06	61,332.60
COSTCO WHOLESALE CORP	10,519	136.50	1,435,843.50
CVS HEALTH CORP	28,317	87.50	2,477,737.50

KROGER CO	11,755	57.51	676,030.05
SAFEWAY INC	5,633	34.97	196,986.01
SYSCO CORP	13,076	37.82	494,534.32
WAL-MART STORES INC	38,712	77.70	3,007,922.40
WALGREEN CO	21,932	65.66	1,440,055.12
WHOLE FOODS MARKET INC	8,610	39.99	344,313.90
ALTRIA GROUP INC	47,948	49.75	2,385,413.00
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	15,683	50.31	789,011.73
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2,867	92.94	266,458.98
BUNGE LTD	3,647	89.21	325,348.87
CAMPBELL SOUP CO	4,215	44.87	189,127.05
COCA-COLA CO/THE	94,962	42.31	4,017,842.22
COCA-COLA ENTERPRISES	5,530	42.19	233,310.70
CONAGRA FOODS INC	9,730	34.37	334,420.10
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,990	92.60	369,474.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	5,129	69.00	353,901.00
GENERAL MILLS INC	14,949	53.17	794,838.33
HERSHEY CO/THE	3,485	95.55	332,991.75
HORMEL FOODS CORP	3,770	54.53	205,578.10
JM SMUCKER CO/THE	2,680	105.34	282,311.20
KELLOGG CO	6,618	63.84	422,493.12
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	3,185	150.46	479,215.10
KRAFT FOODS GROUP INC	14,681	57.66	846,506.46
LORILLARD INC	9,250	61.99	573,407.50
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,365	72.60	244,299.00
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	5,141	98.79	507,879.39
MOLSON COORS BREWING CO -B	3,760	74.16	278,841.60
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	40,885	37.15	1,518,877.75
MONSTER BEVERAGE CORP	3,710	99.17	367,920.70
PEPSICO INC	36,541	96.89	3,540,457.49
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	37,748	89.90	3,393,545.20
REYNOLDS AMERICAN INC	7,920	64.77	512,978.40
TYSON FOODS INC-CL A	6,456	41.46	267,665.76
AVON PRODUCTS	10,013	10.24	102,533.12
CHURCH & DWIGHT CO INC	3,255	73.24	238,396.20

CLOROX COMPANY	3,246	100.73	326,969.58
COLGATE-PALMOLIVE CO	21,900	68.15	1,492,485.00
ENERGIZER HOLDINGS INC	1,571	122.07	191,771.97
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	5,740	71.20	408,688.00
HERBALIFE LTD	1,850	39.78	73,593.00
KIMBERLY-CLARK CORP	8,953	112.28	1,005,242.84
PROCTER & GAMBLE CO	64,999	89.00	5,784,911.00
ABBOTT LABORATORIES	35,997	43.66	1,571,629.02
AETNA INC	8,809	84.26	742,246.34
AMERISOURCEBERGEN CORP	5,444	87.81	478,037.64
BAXTER INTERNATIONAL INC	13,039	70.90	924,465.10
BECTON DICKINSON AND CO	4,946	127.22	629,230.12
BOSTON SCIENTIFIC CORP	32,668	13.33	435,464.44
CARDINAL HEALTH INC	8,305	78.91	655,347.55
CAREFUSION CORP	4,525	57.41	259,780.25
CERNER CORP	7,420	63.20	468,944.00
CIGNA CORP	6,580	100.00	658,000.00
COVIDIEN PLC	10,805	93.32	1,008,322.60
CR BARD INC	1,854	164.58	305,131.32
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	3,938	77.51	305,234.38
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	2,972	51.62	153,414.64
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,520	121.10	305,172.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	18,544	77.15	1,430,669.60
HALYARD HEALTH INC(N)	1,119	38.13	42,667.47
HCA HOLDINGS INC	7,535	67.85	511,249.75
HENRY SCHEIN INC	2,170	122.21	265,195.70
HOLOGIC INC	5,928	26.46	156,854.88
HUMANA INC	3,735	138.94	518,940.90
INTUITIVE SURGICAL INC	910	505.37	459,886.70
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,155	102.21	220,262.55
MCKESSON CORP	5,664	201.60	1,141,862.40
MEDTRONIC INC	23,902	68.70	1,642,067.40
OMNICARE INC	2,710	68.23	184,903.30
PATTERSON COS INC	2,042	43.69	89,214.98
QUEST DIAGNOSTICS	3,656	60.44	220,968.64

RESMED INC	3,370	51.45	173,386.50
ST JUDE MEDICAL INC	7,400	65.22	482,628.00
STRYKER CORP	7,533	88.02	663,054.66
UNITEDHEALTH GROUP INC	23,670	95.80	2,267,586.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,250	98.70	222,075.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,474	84.41	208,830.34
WELLPOINT INC	7,036	127.03	893,783.08
ZIMMER HOLDINGS INC	4,122	110.99	457,500.78
ABBVIE INC	38,207	62.54	2,389,465.78
ACTAVIS PLC	6,296	247.91	1,560,841.36
AGILENT TECHNOLOGIES INC	8,010	40.13	321,441.30
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	4,850	189.89	920,966.50
ALLERGAN INC	7,185	196.32	1,410,559.20
AMGEN INC	18,101	158.94	2,876,972.94
BIOGEN IDEC INC	5,693	319.55	1,819,198.15
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,500	81.97	286,895.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	39,651	57.82	2,292,620.82
CELGENE CORP	19,244	105.15	2,023,506.60
ELI LILLY & CO	24,083	66.99	1,613,320.17
ENDO INTERNATIONAL PLC	3,310	68.70	227,397.00
GILEAD SCIENCES INC	36,924	106.05	3,915,790.20
HOSPIRA INC	3,921	53.10	208,205.10
ILLUMINA INC	3,195	186.37	595,452.15
JOHNSON & JOHNSON	67,741	108.82	7,371,575.62
MALLINCKRODT PLC	2,400	93.50	224,400.00
MERCK & CO. INC.	70,163	59.57	4,179,609.91
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	740	259.79	192,244.60
MYLAN INC	9,655	53.47	516,252.85
PERRIGO CO PLC	3,039	158.50	481,681.50
PFIZER INC	152,980	30.04	4,595,519.20
PHARMACYCLICS INC	1,550	131.03	203,096.50
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	1,150	57.06	65,619.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,920	368.51	707,539.20
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	9,554	118.55	1,132,626.70
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,810	111.59	648,337.90

WATERS CORP	2,276	111.79	254,434.04
ZOETIS INC	12,480	39.27	490,089.60
BANK OF AMERICA CORP	252,459	17.34	4,377,639.06
BB&T CORP	17,778	37.91	673,963.98
CIT GROUP INC	4,465	48.73	217,579.45
CITIGROUP INC	73,067	54.02	3,947,079.34
COMERICA INC	4,300	48.29	207,647.00
FIFTH THIRD BANCORP	20,029	20.18	404,185.22
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,330	51.11	119,086.30
HUDSON CITY BANCORP INC	14,060	9.66	135,819.60
JPMORGAN CHASE & CO	90,820	61.15	5,553,643.00
KEYCORP	20,968	13.32	279,293.76
M & T BANK CORP	2,953	122.83	362,716.99
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	9,654	15.70	151,567.80
OCWEN FINANCIAL CORP	2,820	21.48	60,573.60
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	6,370	14.59	92,938.30
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	12,670	87.64	1,110,398.80
REGIONS FINANCIAL CORP	29,784	10.11	301,116.24
SUNTRUST BANKS INC	12,787	39.60	506,365.20
US BANCORP	43,581	43.52	1,896,645.12
WELLS FARGO & CO	120,490	53.53	6,449,829.70
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,220	191.23	233,300.60
ALLY FINANCIAL INC	6,720	22.43	150,729.60
AMERICAN EXPRESS CO	22,954	92.42	2,121,408.68
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,840	128.57	622,278.80
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	27,532	38.67	1,064,662.44
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	26,910	142.92	3,845,977.20
BLACKROCK INC	3,235	344.25	1,113,648.75
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	13,925	81.60	1,136,280.00
CME GROUP INC	7,500	85.77	643,275.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	11,130	64.83	721,557.90
EATON VANCE CORP	2,880	37.27	107,337.60
FRANKLIN RESOURCES INC	10,445	55.87	583,562.15
GOLDMAN SACHS GROUP INC	10,208	189.84	1,937,886.72
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	2,636	217.42	573,119.12

INVESCO LTD	10,087	40.43	407,817.41
LEGG MASON INC	2,185	53.74	117,421.90
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	23.92	174,735.60
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	6,582	90.54	595,934.28
MOODY'S CORP	4,807	99.37	477,671.59
MORGAN STANLEY	35,775	34.90	1,248,547.50
NASDAQ OMX GROUP/THE	3,055	43.74	133,625.70
NAVIENT CORP	10,792	19.62	211,739.04
NORTHERN TRUST CORP	5,440	66.29	360,617.60
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,380	56.62	191,375.60
SCHWAB (CHARLES) CORP	29,244	28.78	841,642.32
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,225	38.72	124,888.12
STATE STREET CORP	10,157	77.22	784,323.54
T ROWE PRICE GROUP INC	6,755	83.10	561,340.50
TD AMERITRADE HOLDING CORP	5,050	34.55	174,477.50
VOYA FINANCIAL INC	3,050	39.19	119,529.50
ACE LTD	8,323	110.50	919,691.50
AFLAC INC	10,542	59.79	630,306.18
ALLEGHANY CORP	400	446.64	178,656.00
ALLSTATE CORP	10,913	65.74	717,420.62
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	33,025	53.78	1,776,084.50
AON PLC	7,067	88.67	626,630.89
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,115	56.72	176,682.80
ASSURANT INC	1,530	68.59	104,942.70
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,995	49.01	146,784.95
CHUBB CORP	5,603	100.35	562,261.05
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,940	51.11	201,373.40
EVEREST RE GROUP LTD	1,014	172.65	175,067.10
FNF GROUP	5,881	29.90	175,841.90
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	11,470	14.07	161,382.90
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	10,292	39.93	410,959.56
LINCOLN NATIONAL CORP	6,703	55.79	373,960.37
LOEWS CORP	8,005	43.75	350,218.75
MARSH & MCLENNAN COS	13,683	55.47	758,996.01
METLIFE INC	22,875	54.44	1,245,315.00

PARTNERRE LTD	1,052	115.90	121,926.80
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6,780	52.83	358,187.40
PROGRESSIVE CORP	12,350	26.88	331,968.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	10,902	88.91	969,296.82
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	887	100.99	89,578.13
TORCHMARK CORP	3,106	53.75	166,947.50
TRAVELERS COS INC/THE	8,024	101.49	814,355.76
UNUM GROUP	6,098	34.31	209,222.38
WILLIS GROUP HOLDING	2,990	40.80	121,992.00
MR BERKLEY CORP	2,573	51.68	132,972.64
XL GROUP PLC	6,310	34.40	217,064.00
CBRE GROUP INC	6,610	32.08	212,048.80
REALOGY HOLDINGS CORP	3,160	41.10	129,876.00
ACCENTURE PLC-CL A	15,138	82.48	1,248,582.24
ACTIVISION BLIZZARD INC	10,200	20.83	212,466.00
ADOBE SYSTEMS INC	11,379	71.37	812,119.23
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	4,220	59.01	249,043.30
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,275	284.02	362,125.50
ANSYS INC	2,090	77.06	161,055.40
AUTODESK INC	5,210	58.32	303,847.20
AUTOMATIC DATA PROCESSING	11,626	84.30	980,071.80
CA INC	8,520	29.46	251,041.80
CITRIX SYSTEMS INC	3,628	64.41	233,679.48
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	15,378	52.40	805,807.20
COMPUTER SCIENCES CORP	3,453	60.38	208,492.14
EBAY INC	27,297	53.58	1,462,709.74
ELECTRONIC ARTS INC	6,984	40.72	284,423.40
EQUINIX INC	1,150	212.85	244,777.50
FACEBOOK INC-A	48,050	74.83	3,595,581.50
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	6,805	58.79	400,065.95
FISERV INC	5,998	69.88	419,140.24
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,740	148.51	258,407.40
GOOGLE INC-CL A	6,775	555.95	3,766,561.25
GOOGLE INC-CL C	6,860	545.92	3,745,011.20
INTL BUSINESS MACHINES CORP	23,092	161.82	3,736,747.44

INTUIT INC	6,846	88.73	607,445.58
LINKEDIN CORP - A	2,580	218.18	562,904.40
MASTERCARD INC-CLASS A	24,340	85.99	2,092,996.60
MICROSOFT CORP	188,584	47.86	9,025,630.24
NETSUITE INC	740	107.47	79,527.80
NUANCE COMMUNICATIONS INC	6,980	15.57	108,678.60
ORACLE CORP	85,613	39.29	3,363,734.77
PAYCHEX INC	7,962	47.77	380,344.74
RACKSPACE HOSTING INC	3,210	37.23	119,508.30
RED HAT INC	4,630	59.59	275,901.70
SALESFORCE.COM INC	13,900	61.91	860,549.00
SERVICENOW INC	3,030	65.55	198,616.50
SYMANTEC CORP	15,945	25.18	401,495.10
SYNOPSYS INC	3,207	41.25	132,288.75
TERADATA CORP	4,175	41.06	171,425.50
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,506	33.85	152,528.10
TWITTER INC	7,440	40.37	300,352.80
VANTIV INC - CL-A	2,410	30.27	72,950.70
VERISIGN INC	2,720	59.24	161,132.80
VISA INC-CLASS A SHARES	11,985	249.53	2,990,617.05
VMWARE INC	2,405	83.71	201,322.55
WESTERN UNION CO	13,031	17.54	228,563.74
WORKDAY INC-CLASS A	1,580	92.65	146,387.00
XEROX CORP	27,074	13.16	356,293.84
YAHOO! INC	23,835	47.46	1,131,209.10
AMPHENOL CORP-CL A	8,080	50.62	409,009.60
APPLE INC	144,952	108.86	15,779,474.72
ARROW ELECTRONICS INC	2,310	56.88	131,392.80
AVNET INC	3,460	43.60	150,856.00
CISCO SYSTEMS INC	123,030	25.15	3,094,204.50
CORNING INC	30,858	20.76	640,612.08
EMC CORP/MASS	49,269	29.04	1,430,771.76
F5 NETWORKS INC	1,775	125.42	222,620.50
FLEXTRONICS INTL LTD	14,686	10.89	159,930.54
FLIR SYSTEMS INC	3,195	34.04	108,773.77

HARRIS CORP	3,080	70.72	217,817.60
HEWLETT-PACKARD CO	45,645	36.18	1,651,436.10
JUNIPER NETWORKS INC	9,373	21.43	200,863.39
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN(N)	4,005	30.18	120,870.90
MOTOROLA SOLUTIONS INC	5,765	64.46	371,611.90
NETAPP INC	8,356	43.20	360,979.20
QUALCOMM INC	40,552	77.20	3,130,614.40
SANDISK CORP	5,293	93.95	497,277.35
SEAGATE TECHNOLOGY	7,724	63.74	492,366.38
TE CONNECTIVITY LTD	10,025	62.12	622,753.00
TRIMBLE NAVIGATION LTD	6,050	27.27	165,013.75
WESTERN DIGITAL CORP	5,255	101.28	532,226.40
AT&T INC	124,686	34.92	4,354,035.12
CENTURYLINK INC	13,716	41.65	571,271.40
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	27,924	6.58	183,739.92
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	5,700	46.84	266,988.00
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	3,010	110.41	332,334.10
SPRINT CORP	21,150	4.92	104,058.00
T-MOBILE US INC	4,362	28.54	124,491.48
VERIZON COMMUNICATIONS INC	99,627	50.34	5,015,223.18
WINDSTREAM HOLDINGS INC	17,485	10.49	183,417.65
AES CORP	17,438	13.95	243,260.10
ALLIANT ENERGY CORP	2,160	63.09	136,274.40
AMEREN CORPORATION	6,522	43.40	283,054.80
AMERICAN ELECTRIC POWER	11,428	59.74	682,708.72
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,095	52.87	216,502.65
CALPINE CORP	9,640	23.93	230,685.20
CENTERPOINT ENERGY INC	11,092	25.13	278,741.96
CMS ENERGY CORP	5,290	33.21	175,680.90
CONSOLIDATED EDISON INC	7,056	64.64	456,099.84
DOMINION RESOURCES INC/VA	14,297	74.18	1,060,551.46
DTE ENERGY COMPANY	4,478	84.16	376,868.48
DUKE ENERGY CORP	16,966	83.50	1,416,661.00
EDISON INTERNATIONAL	7,059	63.02	444,858.18
ENERGY CORP	4,147	83.70	347,103.90

EXELON CORP	20,166	37.52	756,628.32
FIRSTENERGY CORP	9,905	37.10	367,475.50
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	2,000	74.02	148,040.00
MDU RESOURCES GROUP INC	5,280	26.49	139,867.20
NEXTERA ENERGY INC	10,545	104.88	1,105,959.60
NISOURCE INC	8,025	42.67	342,426.75
NORTHEAST UTILITIES	6,900	50.83	350,727.00
NRG ENERGY INC	7,670	32.27	247,510.90
OGE ENERGY CORP	5,180	37.42	193,835.60
P G & E CORP	10,391	50.30	522,667.30
PINNACLE WEST CAPITAL	2,199	62.89	138,295.11
PPL CORPORATION	15,848	36.39	576,708.72
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	11,758	41.97	493,483.26
SCANA CORP	3,443	56.67	195,114.81
SEMPRA ENERGY	5,877	113.44	666,686.88
SOUTHERN CO	21,615	47.96	1,036,655.40
WISCONSIN ENERGY CORP	5,774	50.47	291,413.78
XCEL ENERGY INC	11,814	34.09	402,739.26
ALTERA CORPORATION	7,436	35.35	262,862.60
ANALOG DEVICES INC	7,491	50.03	374,774.73
APPLIED MATERIALS INC	29,583	22.61	668,871.63
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	6,260	86.71	542,804.60
BROADCOM CORP-CL A	12,686	41.75	529,640.50
CREE INC	3,160	32.62	103,095.00
INTEL CORP	119,182	33.76	4,023,584.32
KLA-TENCOR CORPORATION	3,779	81.28	307,157.12
LAM RESEARCH CORP	4,167	79.74	332,276.58
LINEAR TECHNOLOGY CORP	5,594	43.96	245,940.21
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	9,254	13.69	126,733.53
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	7,570	29.75	225,207.50
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5,124	43.58	223,329.54
MICRON TECHNOLOGY INC	26,237	33.71	884,449.27
NVIDIA CORP	11,505	20.13	231,595.65
TEXAS INSTRUMENTS INC	25,812	51.13	1,319,767.56
XILINX INC	6,125	44.19	270,663.75

米ドル小計		7,614,868		442,713,879.81 (50,774,854,875)
加ドル	ALTAGAS LTD	3,050	44.35	135,267.50
	ARC RESOURCES LTD	7,925	26.76	212,073.00
	ATHABASCA OIL CORP	8,020	3.20	25,664.00
	BAYTEX ENERGY CORP	3,375	32.15	108,506.25
	CAMECO CORP	10,492	19.17	201,131.64
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	26,794	38.26	1,025,138.44
	CANADIAN OIL SANDS LTD	11,160	16.79	187,376.40
	CENOVUS ENERGY INC	17,463	28.21	492,631.23
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	10,045	36.33	364,934.85
	ENBRIDGE INC	19,625	52.04	1,021,285.00
	ENCANA CORP	17,968	21.00	377,328.00
	ENERPLUS CORP	4,690	15.27	71,616.30
	HUSKY ENERGY INC	9,069	26.49	240,237.81
	IMPERIAL OIL LTD	6,942	52.99	367,856.58
	INTER PIPELINE LTD	7,180	34.82	250,007.60
	KEYERA CORP	2,060	91.95	189,417.00
	MEG ENERGY CORP	2,710	26.42	71,598.20
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	6,650	16.50	109,725.00
	PEMBINA PIPELINE CORP	8,085	44.62	360,752.70
	PENGROWTH ENERGY CORP	12,780	4.36	55,720.80
	PENN WEST PETROLEUM LTD	10,703	4.74	50,732.22
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	3,680	32.60	119,968.00
	SUNCOR ENERGY INC	35,445	38.52	1,365,341.40
	TALISMAN ENERGY INC	25,922	6.28	162,790.16
	TOURMALINE OIL CORP	4,005	40.77	163,283.85
	TRANSCANADA CORP	16,903	56.86	961,104.58
	VERMILION ENERGY INC	1,830	62.97	115,235.10
AGNICO EAGLE MINES LTD	4,695	25.17	118,173.15	
AGRIUM INC	3,765	111.41	419,458.65	
BARRICK GOLD CORP	28,214	12.50	352,675.00	
ELDORADO GOLD CORP	20,510	5.70	116,907.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	12,590	16.26	204,713.40	
FRANCO-NEVADA CORP	2,925	51.28	149,994.00	

GOLDCORP INC	20,487	20.32	416,295.84
KINROSS GOLD CORP	25,015	2.27	56,784.05
METHANEX CORP	2,330	64.27	149,749.10
NEW GOLD INC	9,550	3.91	37,340.50
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	19,467	37.46	729,233.82
SILVER WHEATON CORP	8,645	19.43	167,972.35
TECK RESOURCES LTD-CLS B	13,885	17.60	244,376.00
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	13,419	3.60	48,308.40
YAMANA GOLD INC	19,626	3.97	77,915.22
BOMBARDIER INC 'B'	34,746	3.80	132,034.80
CAE INC	6,315	14.96	94,472.40
FINNING INTERNATIONAL INC	4,625	28.51	131,858.75
SNC-LAVALIN GROUP INC	3,195	46.20	147,609.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	19,698	78.72	1,550,626.56
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	4,215	232.18	978,638.70
MAGNA INTERNATIONAL INC	5,509	116.97	644,387.73
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,070	66.49	204,124.30
TIM HORTONS INC	3,275	92.39	302,577.25
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	10,695	29.77	318,390.15
THOMSON REUTERS CORP	8,834	43.13	381,010.42
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,040	124.05	253,062.00
DOLLARAMA INC	1,660	102.40	169,984.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	9,730	38.70	376,551.00
EMPIRE CO LTD 'A'	1,000	78.53	78,530.00
LOBLAW COMPANIES LTD	4,519	58.33	263,593.27
METRO INC	1,930	78.85	152,180.50
WESTON (GEORGE) LTD	942	91.47	86,164.74
SAPUTO INC	7,040	31.13	219,155.20
CATAMARAN CORP	4,320	54.43	235,137.60
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	7,914	150.05	1,187,495.70
BANK OF MONTREAL	15,461	82.49	1,275,377.89
BANK OF NOVA SCOTIA	29,069	67.34	1,957,506.46
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	9,385	103.44	970,784.40
NATIONAL BANK OF CANADA	7,340	54.30	398,562.00
ROYAL BANK OF CANADA	34,539	81.27	2,806,984.53

	TORONTO-DOMINION BANK	44,100	55.98	2,468,718.00	
	CI FINANCIAL CORP	3,410	33.10	112,871.00	
	IGM FINANCIAL INC	2,535	44.69	113,289.15	
	ONEX CORPORATION	1,905	64.07	122,053.35	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	490	548.19	268,613.10	
	GREAT-WEST LIFE CO INC	7,724	32.09	247,863.16	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	2,905	42.96	124,798.80	
	INTACT FINANCIAL CORP	3,045	77.99	237,479.55	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	46,211	21.48	992,612.28	
	POWER CORP OF CANADA	7,800	29.86	232,908.00	
	POWER FINANCIAL CORP	5,715	33.29	190,252.35	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	13,864	40.53	561,907.92	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	13,642	55.46	756,585.32	
	CGI GROUP INC - CL A	5,870	39.55	232,158.50	
	OPEN TEXT CORP	3,070	65.22	200,225.40	
	BLACKBERRY LTD	13,928	11.53	160,589.84	
	BCE INC	6,470	51.08	330,487.60	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	9,235	43.40	400,799.00	
	TELUS CORP	4,366	41.37	180,621.42	
	ATCO LTD -CLASS I	1,920	44.89	86,188.80	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,590	37.13	96,166.70	
	FORTIS INC	4,785	37.60	179,916.00	
	TRANSALTA CORP	7,950	10.51	83,554.50	
加ドル小計		954,290		35,794,079.18	(3,599,452,602)
ユーロ	ENI SPA	60,826	16.45	1,000,587.70	
	FUGRO NV-CVA	1,660	10.07	16,724.50	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	9,315	11.08	103,256.77	
	NESTE OIL OYJ	3,590	17.84	64,045.60	
	OMV AG	3,490	24.77	86,447.30	
	REPSOL SA	24,031	17.38	417,658.78	
	SAIPEM SPA	7,220	11.92	86,062.40	
	TECHNIP SA	2,468	57.35	141,539.80	
	TENARIS SA	12,625	15.37	194,046.25	
	TOTAL SA	51,417	46.28	2,379,835.84	

VOPAK	1,890	39.84	75,307.05
AIR LIQUIDE SA	7,984	96.43	769,897.12
AKZO NOBEL NV	5,768	54.29	313,144.72
ARCELORMITTAL	26,441	9.83	260,152.99
ARKEMA	1,615	49.78	80,394.70
BASF SE	21,995	69.86	1,536,570.70
CRH PLC	18,570	17.88	332,031.60
FUCHS PETROLUB SE-PRF	1,720	31.95	54,962.60
HEIDELBERGCEMENT AG	3,245	54.75	177,663.75
IMERYS SA	910	57.31	52,152.10
K+S AG	3,880	22.27	86,427.00
KONINKLIJKE DSM NV	3,442	49.90	171,755.80
LAFARGE SA	4,738	54.21	256,846.98
LANXESS AG	1,935	41.93	81,144.22
LINDE AG	4,585	145.85	668,722.25
SOLVAY ET CIE SA -A	1,271	109.25	138,856.75
STORA ENSO OYJ-R SHS	12,085	6.63	80,183.97
THYSSENKRUPP AG	9,395	18.80	176,626.00
UMICORE	2,120	31.38	66,536.20
UPM-KYMMENE OYJ	12,618	12.68	159,996.24
VOESTALPINE AG	2,509	31.03	77,854.27
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4,176	29.32	122,461.20
AIRBUS GROUP NV	13,718	47.82	655,994.76
ALSTOM	5,800	27.80	161,240.00
ANDRITZ AG	1,980	38.73	76,695.30
BOSKALIS WESTMINSTER	1,695	42.29	71,690.02
BOUYGUES SA	4,210	28.11	118,364.15
BRENTAG AG	3,765	40.44	152,275.42
CNH INDUSTRIAL NV	24,730	6.33	156,664.55
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	10,846	34.37	372,831.25
FERROVIAL SA	9,975	15.95	159,101.25
FERROVIAL SA -RTS	9,975	0.38	3,840.37
FINMECCANICA SPA	9,630	7.03	67,747.05
GEA GROUP AG	5,040	36.49	183,934.80
HOCHTIEF AG	625	58.73	36,706.25

KONE OYJ-B	7,854	33.97	266,800.38
KONINKLIJKE PHILIPS NV	23,851	22.20	529,611.45
LEGRAND SA	6,498	42.07	273,403.35
MAN SE	1,054	92.15	97,126.10
METSO OYJ	3,260	25.48	83,064.80
OCI NV	2,300	28.47	65,492.50
OSRAM LICHT AG	2,332	28.46	66,380.38
PRYSMIAN SPA	5,635	13.64	76,861.40
REXEL SA	4,200	13.35	56,070.00
SAFRAN SA	6,190	50.40	311,976.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	12,858	62.70	806,196.60
SIEMENS AG-REG	18,996	89.08	1,692,163.68
THALES SA	2,345	39.89	93,542.05
VALLOUREC	2,495	28.88	72,068.07
VINCI SA	12,010	45.79	549,937.90
WARTSILA OYJ ABP	3,660	36.45	133,407.00
ZARDOYA OTIS SA	4,249	9.19	39,048.31
ZODIAC AEROSPACE	4,550	24.91	113,340.50
BUREAU VERITAS SA	5,650	19.84	112,124.25
EDENRED	6,096	21.96	133,868.16
RANDSTAD HOLDING NV	2,865	34.87	99,916.87
SOCIETE BIC SA	735	101.90	74,896.50
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	10,531	16.19	170,496.89
ADP	650	95.08	61,802.00
ATLANTIA SPA	9,360	18.68	174,844.80
BOLLORE	110	390.15	42,916.50
DEUTCHE LUFTHANSA	5,680	12.45	70,716.00
DEUTSCHE POST AG-REG	22,413	25.09	562,454.23
FRAPORT AG	980	50.24	49,235.20
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	13,280	10.15	134,792.00
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	23,442	5.27	123,656.55
TNT EXPRESS NV	9,060	4.73	42,935.34
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	8,085	83.85	677,927.25
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,190	62.09	73,887.10
CONTINENTAL AG	2,725	157.40	428,915.00

DAIMLER AG	23,072	62.50	1,442,000.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	23,867	8.93	213,132.31
MICHELIN (CGDE)-B	4,149	68.70	285,036.30
NOKIAN RENKAAT OYJ	2,915	22.28	64,946.20
PEUGEOT SA	7,500	9.40	70,560.00
PIRELLI & C.	5,506	10.64	58,583.84
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	3,490	65.51	228,629.90
RENAULT SA	4,597	59.41	273,107.77
VALEO SA	1,880	90.55	170,234.00
VOLKSWAGEN AG	771	172.60	133,074.60
VOLKSWAGEN AG-PFD	3,853	170.90	658,477.70
ADIDAS AG	5,361	56.76	304,290.36
CHRISTIAN DIOR	1,420	141.50	200,930.00
HUGO BOSS AG -ORD	900	102.55	92,295.00
KERING	1,807	156.65	283,066.55
LUXOTTICA GROUP SPA	3,976	40.50	161,028.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	6,679	134.00	894,986.00
ACCOR SA	3,686	33.63	123,960.18
SODEXO	2,330	77.33	180,178.90
ALTICE SA	1,280	50.15	64,192.00
AXEL SPRINGER SE	995	44.30	44,083.47
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	26.00	98,670.00
JC DECAUX SA .	1,910	26.08	49,822.35
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	460	109.80	50,508.00
LAGARDERE S.C.A.	2,980	19.24	57,350.10
NUMERICABLE GROUP	2,250	27.47	61,807.50
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-REG	4,805	31.77	152,678.87
PUBLICIS GROUPE	4,725	55.12	260,442.00
REED ELSEVIER NV	17,968	18.51	332,587.68
RTL GROUP	920	75.21	69,193.20
SES	7,690	27.17	208,937.30
SKY DEUTSCHLAND AG	10,300	6.27	64,611.90
TELENET GROUP HOLDING NV	1,440	45.48	65,498.40
WOLTERS KLUWER	7,557	21.70	164,024.68
INDITEX	26,975	21.83	588,999.12

CARREFOUR SA	14,353	23.67	339,735.51
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,344	83.51	112,237.44
COLRUYT SA	2,035	36.10	73,473.67
DELHAIZE GROUP	2,426	54.75	132,823.50
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	16,598	5.12	85,064.75
JERONIMO MARTINS	5,075	7.50	38,062.50
KONINKLIJKE AHOLD NV	23,791	13.54	322,130.14
METRO AG	3,260	25.49	83,113.70
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	19,301	87.89	1,696,364.89
DANONE	13,904	54.31	755,126.24
HEINEKEN HOLDING NV	2,595	51.58	133,850.10
HEINEKEN NV	5,563	60.35	335,727.05
KERRY GROUP PLC-A	3,750	55.15	206,812.50
PERNOD-RICARD SA	4,796	90.62	434,613.52
REMY COINTREAU	470	55.71	26,183.70
UNILEVER NV-CVA	38,975	31.03	1,209,589.12
BEIERSDORF AG	2,655	64.16	170,344.80
HENKEL AG & CO KGAA	2,920	72.29	211,086.80
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	4,463	79.83	356,281.29
L'OREAL	5,996	125.40	751,898.40
CELESIO AG	960	26.21	25,166.40
ESSILOR INTERNATIONAL	5,205	87.79	456,946.95
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	4,683	58.78	275,266.74
FRESENIUS SE & CO KGAA	9,345	41.20	385,014.00
BAYER AG	19,830	113.80	2,256,654.00
GRIFOLS SA	3,810	33.98	129,463.80
MERCK KGAA	2,930	72.18	211,487.40
ORION OYJ-CLASS B	2,590	27.61	71,509.90
QIAGEN N.V.	5,145	18.93	97,394.85
SANOFI	28,466	73.31	2,086,842.46
UCB SA	2,798	65.26	182,597.48
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	97,234	0.69	67,188.69
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	142,213	8.72	1,240,239.57
BANCO COMERCIAL PORTUGUES	750,000	0.08	62,850.00
BANCO DE SABADELL SA	84,803	2.16	183,259.28

BANCO POPOLARE SC	5,500	11.33	62,315.00
BANCO POPULAR ESPANOL	39,339	4.32	170,180.51
BANCO SANTANDER SA	289,517	6.83	1,978,559.17
BANK OF IRELAND	558,550	0.30	168,682.10
BANKIA SA	95,000	1.34	128,155.00
BNP PARIBAS	25,332	49.66	1,258,113.78
CAIXABANK S.A	42,940	4.19	180,262.12
COMMERZBANK AG	23,524	11.98	281,817.52
CREDIT AGRICOLE SA	26,092	11.66	304,363.18
ERSTE GROUP BANK AG	7,118	19.80	140,936.40
ING GROEP NV-CVA	92,195	11.52	1,062,547.37
INTESA SANPAOLO	293,243	2.25	661,556.20
KBC GROEP NV	6,119	42.46	259,843.33
NATIXIS	27,130	5.42	147,261.64
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	2,770	16.65	46,120.50
SOCIETE GENERALE	17,819	38.00	677,211.09
UBI BANCA SCPA	22,584	5.97	134,939.40
UNICREDIT SPA	110,413	5.74	634,322.68
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	32,225	24.72	796,763.12
DEUTSCHE BOERSE AG	4,720	54.72	258,278.40
EURAZEO	870	52.60	45,762.00
EXOR SPA	1,714	33.40	57,247.60
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,882	70.58	132,831.56
MEDIOBANCA SPA	11,670	7.00	81,748.35
WENDEL	750	89.13	66,847.50
AEGON NV	44,779	6.50	291,421.73
AGEAS	5,954	27.76	165,312.81
ALLIANZ SE-REG	10,908	126.70	1,382,043.60
ASSICURAZIONI GENERALI	27,848	16.41	456,985.68
AXA	44,392	18.24	809,932.04
CNP ASSURANCES	3,530	14.93	52,720.55
DELTA LLOYD NV	3,600	18.35	66,060.00
HANNOVER RUECK SE-REG	1,355	67.95	92,072.25
MAPFRE SA	20,814	2.82	58,882.80
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,976	157.15	624,828.40

SAMPO OYJ-A SHS	10,779	38.75	417,686.25
SCOR SE	4,142	24.47	101,375.45
UNIPOLSAI SPA	23,000	2.09	48,254.00
VIENNA INSURANCE GROUP	1,120	38.27	42,862.40
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	7,800	18.16	141,687.00
IMMOEAST AG-TEMPORARY	16,150	-	-
IMMOFINANZ AG	25,580	2.42	61,929.18
IMMOFINANZ AG-TEMPORARY	13,000	-	-
AMADEUS IT HOLDING SA	10,060	29.29	294,707.70
ATOS	1,650	55.39	91,393.50
CAP GEMINI SA	3,209	52.19	167,477.71
DASSAULT SYSTEMES SA	3,530	50.23	177,311.90
GEMALTO	1,850	62.36	115,366.00
SAP SE	22,042	53.90	1,188,063.80
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2,930	32.19	94,316.70
ALCATEL-LUCENT	70,000	2.60	182,420.00
NOKIA OYJ	90,536	6.61	598,442.96
BELGACOM SA	3,780	30.38	114,855.30
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	76,166	12.03	916,657.81
ELISA OYJ	4,205	22.21	93,393.05
ILIAD SA	730	183.60	134,028.00
KONINKLIJKE KPN NV	80,906	2.59	209,951.07
ORANGE S.A.	45,434	12.70	577,238.97
TELECOM ITALIA SPA	266,883	0.90	240,995.34
TELECOM ITALIA-RSP	125,887	0.71	89,757.43
TELEFONICA SA	98,058	11.99	1,176,205.71
VIVENDI	29,610	19.60	580,504.05
ZIGGO NV	4,030	39.00	157,170.00
E.ON SE	48,539	13.60	660,130.40
EDF	6,885	22.80	156,978.00
ENAGAS	4,190	26.30	110,197.00
ENEL GREEN POWER SPA	43,650	1.90	83,240.55
ENEL SPA	165,284	3.97	656,177.48
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	49,221	3.27	161,297.21
FORTUM OYJ	9,825	18.37	180,485.25

	GAS NATURAL SDG SA	9,162	22.61	207,152.82	
	GDF SUEZ	35,164	18.77	660,204.10	
	IBERDROLA SA	115,162	5.56	640,761.36	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	3,040	68.31	207,662.40	
	RWE AG	12,505	28.67	358,580.87	
	SNAM SPA	47,520	4.04	192,170.88	
	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	6,199	13.66	84,709.33	
	TERNA SPA	43,127	3.80	164,055.10	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	9,184	13.63	125,223.84	
	ASML HOLDING NV	8,542	79.79	681,566.18	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	29,335	7.74	227,140.90	
	STMICROELECTRONICS NV	16,783	5.47	91,886.92	
ユーロ小計		5,829,359		71,587,776.00 (10,240,631,356)	
英ポンド	AMEC PLC	8,850	10.13	89,650.50	
	BG GROUP PLC	82,014	10.15	832,852.17	
	BP PLC	444,378	4.40	1,955,929.76	
	PETROFAC LTD	6,995	10.55	73,797.25	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	94,808	21.64	2,051,645.12	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	58,524	22.59	1,322,057.16	
	TULLOW OIL PLC	19,950	4.89	97,655.25	
	ANGLO AMERICAN PLC	33,914	13.29	450,886.63	
	ANTOFAGASTA PLC	11,360	6.98	79,292.80	
	BHP BILLITON PLC	51,031	16.19	826,447.04	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	3,900	22.76	88,764.00	
	FRESNILLO PLC	5,160	6.84	35,320.20	
	GLENCORE PLC	256,733	3.15	808,708.95	
	JOHNSON MATTHEY PLC	5,517	29.84	164,627.28	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	2,250	37.65	84,712.50	
	REXAM PLC	19,752	4.81	95,184.88	
	RIO TINTO PLC	30,745	29.88	918,660.60	
	BAE SYSTEMS PLC ORD	71,015	4.54	322,976.22	
	BUNZL PLC	7,276	17.09	124,346.84	
	COBHAM PLC	23,225	2.89	67,236.37	
	IMI PLC	6,116	12.00	73,392.00	

MEGGITT PLC	20,865	4.73	98,733.18
MELROSE INDUSTRIES PLC	22,516	2.52	56,920.44
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	45,385	8.54	387,587.90
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-PRF-C	4,084,650	0.00	4,084.65
SMITHS GROUP PLC	8,813	11.85	104,434.05
TRAVIS PERKINS PLC	6,600	16.56	109,296.00
WEIR GROUP PLC/THE	5,660	21.87	123,784.20
WOLSELEY PLC	6,074	33.53	203,661.22
AGGREKO PLC	6,006	14.89	89,429.34
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,275	10.68	67,017.00
CAPITA PLC	15,309	10.80	165,337.20
EXPERIAN PLC	23,618	9.40	222,009.20
G4S PLC	42,539	2.58	110,005.85
INTERTEK GROUP PLC	3,545	27.03	95,821.35
EASYJET PLC	3,840	15.70	60,288.00
ROYAL MAIL PLC	14,990	4.43	66,450.67
GKN PLC	33,065	3.19	105,675.74
BURBERRY GROUP PLC	11,004	15.08	165,940.32
PERSIMMON PLC	8,190	14.62	119,737.80
CARNIVAL PLC	5,300	25.06	132,818.00
COMPASS GROUP PLC	40,967	10.08	412,947.36
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	5,768	24.25	139,874.00
TUI TRAVEL PLC	8,505	4.07	34,674.88
WHITBREAD PLC	4,140	43.41	179,717.40
WILLIAM HILL PLC	23,300	3.51	81,969.40
BRITISH SKY BROADCASTING GRO	25,734	8.92	229,675.95
ITV PLC	89,555	2.02	181,527.98
PEARSON PLC	20,339	11.75	238,983.25
REED ELSEVIER PLC	29,206	10.32	301,405.92
WPP PLC	33,094	12.30	407,056.20
ASOS PLC	1,250	26.22	32,775.00
DIXONS CARPHONE PLC	22,000	3.99	87,890.00
KINGFISHER PLC	62,157	2.85	177,147.45
MARKS & SPENCER GROUP PLC	42,080	4.44	186,877.28
NEXT PLC	3,697	65.05	240,489.85

SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	5,460	6.45	35,217.00
SAINSBURY (J) PLC	34,011	2.47	84,109.20
TESCO PLC	201,304	1.75	353,791.78
WM MORRISON SUPERMARKETS	37,925	1.62	61,590.20
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	8,695	29.42	255,806.90
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	44,927	35.77	1,607,263.42
COCA-COLA HBC AG-CDI	5,000	13.79	68,950.00
DIAGEO PLC	60,162	18.17	1,093,444.35
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	23,832	28.22	672,539.04
SABMILLER PLC	23,061	35.26	813,246.16
TATE & LYLE PLC	12,180	6.09	74,176.20
UNILEVER PLC	30,697	25.13	771,415.61
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	15,555	51.85	806,526.75
SMITH & NEPHEW PLC	22,326	10.68	238,441.68
ASTRAZENECA PLC	30,263	46.20	1,398,150.60
GLAXOSMITHKLINE PLC	116,461	14.36	1,672,379.96
SHIRE PLC	13,785	41.55	572,766.75
BARCLAYS PLC	392,411	2.38	934,134.38
HSBC HOLDINGS PLC	456,481	6.33	2,891,350.65
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,370,516	0.77	1,058,860.66
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	57,230	3.82	219,076.44
STANDARD CHARTERED PLC	58,899	9.36	551,294.64
3I GROUP PLC	20,499	3.97	81,504.02
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	22,730	4.42	100,466.60
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,720	10.06	57,543.20
ICAP PLC	12,270	4.33	53,141.37
INVESTEC PLC	13,185	5.74	75,747.82
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	5,177	20.75	107,422.75
SCHRODERS PLC	2,231	24.50	54,659.50
ADMIRAL GROUP PLC	4,925	12.96	63,828.00
AVIVA PLC	71,090	5.27	374,644.30
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	32,000	2.79	89,408.00
FRIENDS LIFE GROUP LTD	37,353	3.28	122,517.84
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	136,881	2.37	325,092.37
OLD MUTUAL PLC	120,149	1.92	231,166.67

	PRUDENTIAL PLC	61,362	14.41	884,226.42	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	24,738	4.84	119,756.65	
	STANDARD LIFE PLC	60,295	3.95	238,707.90	
	SAGE GROUP PLC/THE	27,620	3.78	104,624.56	
	BT GROUP PLC	191,592	3.71	711,381.09	
	INMARSAT PLC	10,010	6.90	69,069.00	
	VODAFONE GROUP PLC	633,078	2.08	1,319,967.63	
	CENTRICA PLC	114,215	3.00	342,873.43	
	NATIONAL GRID PLC	89,325	9.25	826,256.25	
	SEVERN TRENT PLC	6,283	19.65	123,460.95	
	SSE PLC	22,937	15.81	362,633.97	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	18,525	8.65	160,333.87	
	ARM HOLDINGS PLC	34,530	8.75	302,137.50	
英債券小計		10,829,450		39,523,291.58	(7,233,948,057)
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	7,955	27.60	219,558.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	240	340.50	81,720.00	
	GIVAUDAN-REG	213	1,598.00	340,374.00	
	HOLCIM LTD-REG	5,743	67.25	386,216.75	
	SIKA AG-BR	47	3,493.00	164,171.00	
	SYNGENTA AG-REG	2,188	296.10	647,866.80	
	ABB LTD-REG	52,525	21.29	1,118,257.25	
	GEBERIT AG-REG	925	329.40	304,695.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	620	129.60	80,352.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,090	134.60	146,714.00	
	SULZER AG-REG	520	108.60	56,472.00	
	ADECCO SA-REG	3,557	64.50	229,426.50	
	SGS SA-REG	133	2,130.00	283,290.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,020	125.70	128,214.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	12,469	79.10	986,297.90	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	740	444.90	329,226.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	930	82.25	76,492.50	
	ARYZTA AG	2,110	81.85	172,703.50	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	25	4,810.00	120,250.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	3	57,555.00	172,665.00	

	NESTLE SA-REG	77,633	70.50	5,473,126.50	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,510	150.90	227,859.00	
	ACTELION LTD-REG	2,560	113.60	290,816.00	
	LONZA GROUP AG-REG	1,250	109.10	136,375.00	
	NOVARTIS AG-REG	55,333	89.40	4,946,770.20	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	16,868	286.50	4,832,682.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	37,468	24.86	931,454.48	
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,960	42.50	253,300.00	
	PARGESA HOLDING SA-BR	655	74.00	48,470.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	500	259.00	129,500.00	
	UBS AG-REG	87,412	16.64	1,454,535.68	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,390	122.50	170,275.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	850	220.00	187,000.00	
	SWISS RE AG	8,669	78.05	676,615.45	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,711	293.80	1,090,291.80	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,370	73.60	100,832.00	
	SWISSCOM AG-REG	584	574.50	335,508.00	
	スイスフラン小計	396,776		27,330,373.31 (3,248,761,475)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	6,180	106.50	658,170.00	
	BOLIDEN AB	7,620	119.30	909,066.00	
	ALFA LAVAL AB	7,470	153.90	1,149,633.00	
	ASSA ABLOY AB-B	8,310	389.50	3,236,745.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	15,265	213.10	3,252,971.50	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	8,620	193.70	1,669,694.00	
	SANDVIK AB	25,500	80.20	2,045,100.00	
	SKANSKA AB-B SHS	10,520	152.30	1,602,196.00	
	SKF AB-B SHARES-B	10,209	146.50	1,495,618.50	
	VOLVO AB-B SHS-B	35,630	84.80	3,021,424.00	
	SECURITAS AB-B SHS	7,249	86.15	624,501.35	
	ELECTROLUX AB - B	6,765	210.00	1,420,650.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	8,480	54.80	464,704.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	22,808	294.00	6,705,552.00	
	SWEDISH MATCH AB	4,860	243.70	1,184,382.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	13,015	169.30	2,203,439.50	

	ELEKTA AB-B SHS	10,440	74.15	774,126.00	
	GETINGE AB-B SHS	5,730	169.40	970,662.00	
	NORDEA BANK AB	71,288	93.45	6,661,863.60	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	39,350	94.30	3,710,705.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	12,750	353.00	4,500,750.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	20,930	194.10	4,062,513.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,630	129.50	340,585.00	
	INVESTOR AB-B SHS	11,795	265.50	3,131,572.50	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	5,505	236.30	1,300,831.50	
	ERICSSON LM-B SHS	73,075	86.65	6,331,948.75	
	HEXAGON AB-B SHS	6,960	246.80	1,717,728.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,370	602.00	824,740.00	
	TELE2 AB-B SHS	8,705	96.15	836,985.75	
	TELIASONERA AB	59,180	51.90	3,071,442.00	
	スウェーデンクローナ小計	528,209		69,880,299.95	(1,086,638,664)
ノルウェークローネ	AKER SOLUTIONS HOLDING ASA	4,430	41.38	183,313.40	
	SEADRILL LTD	9,735	142.80	1,390,158.00	
	STATOIL ASA	27,274	150.20	4,096,554.80	
	SUBSEA 7 SA	7,505	71.30	535,106.50	
	NORSK HYDRO A S	20,410	38.08	777,212.80	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,560	311.00	1,418,160.00	
	ORKLA ASA	19,380	52.10	1,009,698.00	
	DNB ASA	24,335	124.50	3,029,707.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,200	126.40	530,880.00	
	TELENOR ASA	17,535	154.90	2,716,171.50	
	ノルウェークローネ小計	139,364		15,686,962.50	(263,227,230)
デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,645	273.90	1,546,165.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	5,260	202.70	1,066,202.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	65	12,650.00	822,250.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	165	13,010.00	2,146,650.00	
	DSV A/S	5,060	177.50	898,150.00	
	PANDORA A/S	2,660	495.00	1,316,700.00	
	CARLSBERG AS-B	2,390	514.00	1,228,460.00	

	COLOPLAST-B	2,545	515.00	1,310,675.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	600	440.00	264,000.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	48,155	262.00	12,616,610.00	
	DANSKE BANK A/S	16,385	163.00	2,670,755.00	
	TRYG A/S	615	674.00	414,510.00	
	TDC A/S	14,545	45.00	654,525.00	
	デンマーククローネ小計	104,090		26,955,652.50 (518,357,197)	
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	2,735	30.98	84,730.30	
	ORIGIN ENERGY LTD	26,670	14.13	376,847.10	
	SANTOS LTD	23,715	12.51	296,674.65	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	16,528	40.04	661,781.12	
	WORLEYPARSONS LTD	4,340	12.70	55,118.00	
	ALUMINA LTD	68,742	1.66	114,111.72	
	AMCOR LIMITED	29,730	11.86	352,597.80	
	BHP BILLITON LTD	77,466	33.82	2,619,900.12	
	BORAL LTD	17,115	4.88	83,521.20	
	FORTECUE METALS GROUP LTD	46,275	3.31	153,170.25	
	ILUKA RESOURCES LTD	12,115	6.90	83,593.50	
	INCITEC PIVOT LTD	31,550	2.98	94,019.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	10,985	12.05	132,369.25	
	NEWCREST MINING LTD	20,969	8.78	184,107.82	
	ORICA LIMITED	10,785	20.27	218,611.95	
	RIO TINTO LTD	10,718	60.16	644,794.88	
	LEIGHTON HOLDINGS LTD	1,867	21.96	40,999.32	
	ALS LTD	8,301	5.46	45,323.46	
	BRAMBLES LTD	37,828	9.62	363,905.36	
	SEEK LTD	8,040	16.58	133,303.20	
	ASCIANO LTD	24,833	6.34	157,441.22	
	AURIZON HOLDINGS LTD	46,150	4.67	215,520.50	
	QANTAS AIRWAYS LTD	19,655	1.71	33,708.32	
	SYDNEY AIRPORT	13,366	4.49	60,013.34	
	TOLL HOLDINGS LTD	16,805	5.55	93,267.75	
	TRANSURBAN GROUP	43,195	8.18	353,335.10	
	CROWN RESORTS LTD	10,705	14.20	152,011.00	

	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	1,640	41.17	67,518.80	
	TABCORP HOLDINGS LTD	14,157	4.15	58,751.55	
	TATTS GROUP LTD	42,460	3.41	144,788.60	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	15,840	3.81	60,350.40	
	METCASH LTD	18,890	2.81	53,080.90	
	WESFARMERS LTD	27,013	43.93	1,186,681.09	
	WOOLWORTHS LTD	31,312	34.13	1,068,678.56	
	COCA-COLA AMATIL LTD	15,150	9.40	142,410.00	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	14,070	4.70	66,129.00	
	COCHLEAR LTD	1,277	72.84	93,016.68	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,935	52.71	154,703.85	
	SONIC HEALTHCARE LTD	9,830	19.02	186,966.60	
	CSL LTD	11,932	79.23	945,372.36	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	66,239	33.79	2,238,215.81	
	BANK OF QUEENSLAND LIMITED	8,120	12.36	100,363.20	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	10,478	12.65	132,546.70	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	39,067	81.56	3,186,304.52	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	56,843	34.42	1,956,536.06	
	WESTPAC BANKING CORP	75,001	34.59	2,594,284.59	
	ASX LTD	4,995	36.63	182,966.85	
	MACQUARIE GROUP LTD	7,574	61.75	467,694.50	
	AMP LTD	70,127	5.93	415,853.11	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	50,298	6.59	331,463.82	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	31,820	11.56	367,839.20	
	SUNCORP GROUP LTD	33,060	14.82	489,949.20	
	COMPUTERSHARE LTD	11,490	12.30	141,327.00	
	TELSTRA CORPORATION LTD	110,214	5.63	620,504.82	
	AGL ENERGY LTD	15,301	13.71	209,776.71	
	AUSNET SERVICES	49,750	1.39	69,401.25	
豪ドル小計		1,488,066		25,538,252.96 (2,508,111,823)	
ニュージーランド ドル	FLETCHER BUILDING LTD	19,060	8.45	161,057.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	27,855	3.85	107,241.75	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	45,157	3.10	139,986.70	
	CONTACT ENERGY LIMITED	9,430	6.39	60,257.70	

ニュージーランドドル小計		101,502		468,543.15 (41,334,876)
香港ドル	HUTCHISON WHAMPOA LTD	52,823	96.60	5,102,701.80
	NWS HOLDINGS LTD	28,500	14.20	404,700.00
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	25,000	14.70	367,500.00
	MTR CORP	39,500	30.70	1,212,650.00
	LI & FUNG LTD	138,000	9.22	1,272,360.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	29,000	23.95	694,550.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	14,500	25.45	369,025.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	50,000	50.85	2,542,500.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	28,000	24.30	680,400.00
	SANDS CHINA LTD	60,600	45.25	2,742,150.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD	28,000	10.72	300,160.00
	SJM HOLDINGS LTD	57,000	15.60	889,200.00
	WYNN MACAU LTD	44,600	26.40	1,177,440.00
	BANK OF EAST ASIA	36,440	32.35	1,178,834.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	93,000	25.70	2,390,100.00
	HANG SENG BANK LTD	19,700	130.90	2,578,730.00
	FIRST PACIFIC CO	44,250	8.38	370,815.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	26,800	172.60	4,625,680.00
	AIA GROUP LTD	290,200	43.05	12,493,110.00
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	32,682	134.30	4,389,192.60
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	57,000	23.45	1,336,650.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	22,184	51.95	1,152,458.80
	HYSAN DEVELOPMENT CO	15,000	35.20	528,000.00
	KERRY PROPERTIES LTD	16,950	26.40	447,480.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	134,666	9.55	1,286,060.30
	SINO LAND CO	63,050	12.62	795,691.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	40,480	114.50	4,634,960.00
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	18,017	102.00	1,837,734.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	23,200	24.55	569,560.00	
WHARF HOLDINGS LTD	35,800	55.20	1,976,160.00	
WHEELLOCK & CO LTD	19,600	37.00	725,200.00	
HKT TRUST AND HKT LTD	67,000	9.37	627,790.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	15,000	56.00	840,000.00	

	CLP HOLDINGS LTD	48,000	67.00	3,216,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	146,881	18.16	2,667,358.96	
	POWER ASSETS HOLDINGS	34,000	75.35	2,561,900.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	81.10	527,150.00	
香港ドル小計		1,901,923		71,511,951.46 (1,057,661,762)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	34,660	9.49	328,923.40	
	NOBLE GROUP LTD	82,854	1.18	98,181.99	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	21,000	4.82	101,220.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	16,000	3.68	58,880.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,000	3.65	120,450.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	42,010	1.16	48,731.60	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,000	2.58	118,680.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	15,800	10.13	160,054.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	172,000	1.05	181,460.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	45,050	4.28	192,814.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,000	39.70	79,400.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	12,000	2.11	25,320.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	130,000	0.50	65,650.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	53,000	3.13	165,890.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	39,215	19.20	752,928.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	62,240	10.07	626,756.80	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	31,700	23.40	741,780.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	20,000	7.07	141,400.00	
	CAPITALAND LTD	71,000	3.18	225,780.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	10,000	9.41	94,100.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	60,000	2.69	161,400.00		
KEPPEL LAND LTD	18,000	3.36	60,480.00		
UOL GROUP LTD	12,250	6.46	79,135.00		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	188,280	3.77	709,815.60		
シンガポールドル小計		1,218,059		5,339,230.39 (472,949,027)	
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	9,770	26.19	255,876.30	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	78	1,845.00	143,910.00	
	TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	21,270	220.40	4,687,908.00	

	BANK HAPOALIM BM	27,725	19.94	552,836.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	29,355	13.37	392,476.35	
	NICE SYSTEMS LTD	1,385	168.90	233,926.50	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	48,790	6.56	320,062.40	
イスラエルシュケル小計		138,373		6,586,996.05 (198,795,540)	
合 計		31,244,329		81,244,724,484 (81,244,724,484)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	8,720	195,328.00	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	18,644	162,389.24	
		AMERICAN TOWER CORP	9,879	964,684.35	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	20,020	227,026.80	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,005	475,120.55	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,747	482,800.95	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,200	168,960.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	8,060	639,480.40	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,735	254,913.75	
		DUKE REALTY CORPORATION	6,875	134,337.50	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	8,110	568,186.60	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,400	283,752.00	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,825	246,229.00	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	11,315	295,774.10	
		HCP INC	11,005	489,612.45	
		HEALTH CARE REIT INC	6,990	500,274.30	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	17,919	409,986.72	
		IRON MOUNTAIN INC	3,064	110,641.04	
		KIMCO REALTY CORPORATION	8,795	220,490.65	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	110,885.06	

		MACERICH CO/THE	3,250	229,905.00
		PLUM CREEK TIMBER CO	4,548	188,605.56
		PROLOGIS INC	11,862	494,052.30
		PUBLIC STORAGE	3,669	686,286.45
		RAYONIER INC	3,507	118,922.37
		REALTY INCOME CORP	5,400	255,258.00
		REGENCY CENTERS CORPORATION	2,355	146,716.50
		SIMON PROPERTY GROUP INC	7,554	1,372,108.56
		SL GREEN REALTY CORP	2,260	263,968.00
		UDR INC	5,820	177,510.00
		VENTAS INC	7,205	497,937.55
		VORNADO REALTY TRUST	3,941	440,603.80
		WEYERHAEUSER CO	11,876	408,296.88
米ドル小計			231,668	12,221,044.43 (1,401,631,585)
加ドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	4,000	89,600.00
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,380	89,603.80
加ドル小計			7,380	179,203.80 (18,020,734)
ユーロ	投資証券	CORIO NV	1,998	77,862.06
		FONCIERE DES REGIONS	595	43,649.20
		GECINA SA	580	62,495.00
		ICADE	685	43,107.05
		KLEPIERRE	2,445	84,890.40
		UNIBAIL-RODAMCO SE-NA	2,440	499,102.00
ユーロ小計			8,743	811,105.71 (116,028,671)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	21,701	159,936.37
		HAMMERSON PLC	15,295	93,681.87
		INTU PROPERTIES PLC	19,860	67,960.92
		LAND SECURITIES GROUP PLC	18,919	212,838.75
		SEGRO PLC	20,223	77,393.42
英ポンド小計			95,998	611,811.33 (111,979,827)
豪ドル	投資証券	APA GROUP	19,805	157,449.75

		DEXUS PROPERTY GROUP(N)	18,487	137,728.15	
		FEDERATION CENTRES	35,990	97,892.80	
		GOODMAN GROUP	43,442	244,144.04	
		GPT GROUP	47,615	196,649.95	
		LEND LEASE GROUP	12,197	194,542.15	
		MIRVAC GROUP	108,455	193,049.90	
		NOVION PROPERTY GROUP	44,830	94,591.30	
		SCENTRE GROUP	116,381	421,299.22	
		STOCKLAND	55,310	233,961.30	
		WESTFIELD CORP	48,945	391,560.00	
豪ドル小計			551,457	2,362,868.56	(232,057,321)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	59,500	2,713,200.00	
香港ドル小計			59,500	2,713,200.00	(40,128,228)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	39,000	86,970.00	
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	40,000	67,200.00	
		CAPITAMALL TRUST	71,800	140,369.00	
シンガポールドル小計			150,800	294,539.00	(26,090,264)
合計				1,945,936,630	(1,945,936,630)

(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 588銘柄	97.3%		61.3%
	投資証券 33銘柄		2.7%	1.7%
加ドル	株式 91銘柄	99.5%		4.3%
	投資証券 2銘柄		0.5%	0.0%
ユーロ	株式 232銘柄	98.9%		12.3%

	投資証券	6銘柄		1.1%	0.1%
英ポンド	株式	104銘柄	98.5%		8.7%
	投資証券	5銘柄		1.5%	0.1%
スイスフラン	株式	37銘柄	100.0%		3.9%
スウェーデンクローナ	株式	30銘柄	100.0%		1.3%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	100.0%		0.3%
デンマーククローネ	株式	13銘柄	100.0%		0.6%
豪ドル	株式	56銘柄	91.5%		3.0%
	投資証券	11銘柄		8.5%	0.3%
ニュージーランドドル	株式	4銘柄	100.0%		0.0%
香港ドル	株式	37銘柄	96.3%		1.3%
	投資証券	1銘柄		3.7%	0.0%
シンガポールドル	株式	24銘柄	94.8%		0.6%
	投資証券	3銘柄		5.2%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	7銘柄	100.0%		0.2%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成25年11月 6日現在	平成26年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	20,903,095	220,838,438
国債証券	27,143,528,160	27,740,474,560
地方債証券	2,316,085,000	2,327,953,000
特殊債証券	2,476,553,000	2,400,040,000
社債券	2,278,648,000	1,989,276,000
未収入金	137,754,700	-
未収利息	105,563,980	102,490,254
前払費用	1,993,040	2,395,902
流動資産合計	34,481,028,975	34,783,468,154

	平成25年11月 6日現在	平成26年11月 6日現在
資産合計	34,481,028,975	34,783,468,154
負債の部		
流動負債		
未払金	104,968,000	181,193,450
未払解約金	45,726,278	23,227,044
流動負債合計	150,694,278	204,420,494
負債合計	150,694,278	204,420,494
純資産の部		
元本等		
元本	26,748,043,185	26,334,764,871
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	7,582,291,512	8,244,282,789
元本等合計	34,330,334,697	34,579,047,660
純資産合計	34,330,334,697	34,579,047,660
負債純資産合計	34,481,028,975	34,783,468,154

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年11月 6日現在	平成26年11月 6日現在
1. 期首	平成24年11月 7日	平成25年11月 7日
期首元本額	25,160,170,820円	26,748,043,185円
期首からの追加設定元本額	4,333,512,979円	1,985,138,999円
期首からの一部解約元本額	2,745,640,614円	2,398,417,313円
元本の内訳		
DCインデックスバランス（株式20）	551,331,180円	675,827,589円
DCインデックスバランス（株式40）	727,438,960円	897,888,395円
DCインデックスバランス（株式60）	514,807,475円	625,014,738円
DCインデックスバランス（株式80）	92,747,038円	107,010,121円

インデックスファンド日本債券(DC専用)	1,169,515,432円	1,288,608,000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	7,301,021,244円	6,342,386,330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	8,143,932円	5,537,922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)	56,145,692円	49,251,969円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	7,755,850円	5,685,583円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	37,660,144円	31,824,994円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	162,191,397円	126,483,603円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	592,012,952円	455,383,965円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	7,401,918,468円	7,115,585,801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)	103,067,299円	74,641,991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)	200,848,757円	166,512,029円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	33,295,646円	33,729,967円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	1,021,270,981円	1,087,568,396円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	1,001,385,092円	1,097,914,737円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	519,933,222円	573,660,625円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	79,324,896円	85,246,317円
インデックスファンド日本債券(1年決算型)	5,002,290,178円	5,306,486,255円
日本債券インデックスファンド(個人型年金向け)	163,937,350円	182,515,544円
計	26,748,043,185円	26,334,764,871円
2. 受益権の総数	26,748,043,185口	26,334,764,871口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 平成24年11月 7日 至 平成25年11月 6日	自 平成25年11月 7日 至 平成26年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成25年11月 6日現在	平成26年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成25年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

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

(平成26年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	70,799,160
地方債証券	492,000
特殊債券	1,331,000
社債券	66,000
合計	69,042,160

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成25年11月 6日現在		平成26年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	1.2835円	1口当たり純資産額	1.3131円
(1万口当たり純資産額)	(12,835円)	(1万口当たり純資産額)	(13,131円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第334回利付国債(2年)	420,000,000	420,382,200	
	第336回利付国債(2年)	70,000,000	70,070,000	
	第341回利付国債(2年)	100,000,000	100,127,000	
	第93回利付国債(5年)	445,000,000	447,394,100	
	第94回利付国債(5年)	70,000,000	70,454,300	
	第95回利付国債(5年)	200,000,000	201,572,000	
	第96回利付国債(5年)	150,000,000	150,975,000	
	第97回利付国債(5年)	350,000,000	352,135,000	
	第98回利付国債(5年)	100,000,000	100,450,000	
	第99回利付国債(5年)	60,000,000	60,423,600	
	第100回利付国債(5年)	60,000,000	60,312,000	
	第101回利付国債(5年)	170,000,000	171,343,000	
	第102回利付国債(5年)	280,000,000	281,621,200	
	第103回利付国債(5年)	90,000,000	90,571,500	
	第104回利付国債(5年)	50,000,000	50,200,000	
	第105回利付国債(5年)	110,000,000	110,457,600	
	第106回利付国債(5年)	420,000,000	421,919,400	
	第107回利付国債(5年)	705,000,000	708,391,050	
	第109回利付国債(5年)	100,000,000	100,167,000	
	第111回利付国債(5年)	40,000,000	40,468,800	
	第112回利付国債(5年)	160,000,000	161,928,000	
	第114回利付国債(5年)	90,000,000	90,796,500	
	第116回利付国債(5年)	110,000,000	110,517,000	
	第117回利付国債(5年)	370,000,000	371,602,100	
	第118回利付国債(5年)	200,000,000	200,824,000	
	第121回利付国債(5年)	100,000,000	99,903,000	
	第1回利付国債(40年)	25,000,000	30,169,750	
	第2回利付国債(40年)	165,000,000	190,322,550	
	第3回利付国債(40年)	20,000,000	23,048,000	
	第4回利付国債(40年)	115,000,000	132,381,100	
	第5回利付国債(40年)	35,000,000	38,318,000	

第6回利付国債(40年)	55,000,000	58,573,350	
第7回利付国債(40年)	20,000,000	20,094,600	
第274回利付国債(10年)	43,000,000	43,708,210	
第276回利付国債(10年)	35,000,000	35,615,300	
第278回利付国債(10年)	80,000,000	81,930,400	
第279回利付国債(10年)	30,000,000	30,805,200	
第280回利付国債(10年)	156,000,000	160,714,320	
第281回利付国債(10年)	142,000,000	146,519,860	
第282回利付国債(10年)	24,000,000	24,749,760	
第283回利付国債(10年)	25,000,000	25,827,500	
第284回利付国債(10年)	462,000,000	478,313,220	
第285回利付国債(10年)	261,000,000	271,262,520	
第286回利付国債(10年)	186,000,000	194,554,140	
第287回利付国債(10年)	35,000,000	36,700,650	
第288回利付国債(10年)	18,000,000	18,853,560	
第289回利付国債(10年)	199,000,000	207,990,820	
第290回利付国債(10年)	406,000,000	424,363,380	
第291回利付国債(10年)	287,000,000	299,019,560	
第292回利付国債(10年)	331,000,000	349,297,680	
第293回利付国債(10年)	96,000,000	102,013,440	
第294回利付国債(10年)	32,000,000	33,889,280	
第295回利付国債(10年)	13,000,000	13,673,920	
第296回利付国債(10年)	74,000,000	78,058,900	
第297回利付国債(10年)	148,000,000	155,969,800	
第298回利付国債(10年)	221,000,000	231,994,750	
第299回利付国債(10年)	750,000,000	789,202,500	
第300回利付国債(10年)	36,000,000	38,194,200	
第301回利付国債(10年)	223,000,000	237,265,310	
第302回利付国債(10年)	94,000,000	99,581,720	
第303回利付国債(10年)	581,000,000	617,080,100	
第304回利付国債(10年)	60,000,000	63,436,200	
第305回利付国債(10年)	673,000,000	712,962,740	
第306回利付国債(10年)	93,000,000	99,255,180	
第308回利付国債(10年)	140,000,000	149,035,600	
第309回利付国債(10年)	34,000,000	35,815,940	

第310回利付国債(10年)	88,000,000	92,344,560	
第311回利付国債(10年)	23,000,000	23,868,250	
第312回利付国債(10年)	205,000,000	217,833,000	
第313回利付国債(10年)	380,000,000	406,744,400	
第315回利付国債(10年)	65,000,000	69,261,400	
第316回利付国債(10年)	35,000,000	37,066,400	
第317回利付国債(10年)	105,000,000	111,282,150	
第318回利付国債(10年)	155,000,000	163,225,850	
第319回利付国債(10年)	165,000,000	174,979,200	
第320回利付国債(10年)	110,000,000	115,883,900	
第321回利付国債(10年)	215,000,000	226,483,150	
第322回利付国債(10年)	105,000,000	109,849,950	
第323回利付国債(10年)	45,000,000	47,078,100	
第324回利付国債(10年)	75,000,000	77,904,750	
第325回利付国債(10年)	270,000,000	280,365,300	
第326回利付国債(10年)	30,000,000	30,900,900	
第327回利付国債(10年)	65,000,000	67,466,100	
第328回利付国債(10年)	275,000,000	280,808,000	
第329回利付国債(10年)	210,000,000	217,805,700	
第330回利付国債(10年)	210,000,000	217,652,400	
第331回利付国債(10年)	80,000,000	81,543,200	
第333回利付国債(10年)	70,000,000	71,134,000	
第334回利付国債(10年)	220,000,000	223,242,800	
第335回利付国債(10年)	130,000,000	130,427,700	
第14回利付国債(30年)	208,000,000	249,953,600	
第15回利付国債(30年)	162,000,000	197,307,900	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	42,639,100	
第18回利付国債(30年)	170,000,000	200,756,400	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	66,866,800	
第24回利付国債(30年)	158,000,000	192,072,700	
第26回利付国債(30年)	30,000,000	35,902,500	
第27回利付国債(30年)	29,000,000	35,288,070	
第28回利付国債(30年)	14,000,000	17,055,640	
第29回利付国債(30年)	276,000,000	330,686,640	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	173,230,680	

第3 1 回利付国債(30年)	60,000,000	69,492,600	
第3 2 回利付国債(30年)	40,000,000	47,222,400	
第3 3 回利付国債(30年)	50,000,000	55,801,500	
第3 4 回利付国債(30年)	165,000,000	191,332,350	
第3 5 回利付国債(30年)	120,000,000	133,662,000	
第3 6 回利付国債(30年)	310,000,000	345,082,700	
第3 7 回利付国債(30年)	70,000,000	76,250,300	
第3 8 回利付国債(30年)	30,000,000	31,949,100	
第3 9 回利付国債(30年)	75,000,000	81,576,750	
第4 0 回利付国債(30年)	90,000,000	95,726,700	
第4 1 回利付国債(30年)	30,000,000	31,184,100	
第4 2 回利付国債(30年)	65,000,000	67,511,600	
第4 3 回利付国債(30年)	125,000,000	129,726,250	
第4 4 回利付国債(30年)	30,000,000	31,108,800	
第3 1 回利付国債(20年)	40,000,000	41,888,000	
第3 3 回利付国債(20年)	200,000,000	214,038,000	
第3 4 回利付国債(20年)	85,000,000	91,933,450	
第3 7 回利付国債(20年)	63,000,000	68,507,460	
第3 9 回利付国債(20年)	86,000,000	93,346,980	
第4 1 回利付国債(20年)	27,000,000	28,633,230	
第4 2 回利付国債(20年)	178,000,000	197,300,540	
第4 3 回利付国債(20年)	73,000,000	82,825,800	
第4 4 回利付国債(20年)	51,000,000	57,429,060	
第4 7 回利付国債(20年)	21,000,000	23,501,940	
第4 8 回利付国債(20年)	99,000,000	113,056,020	
第4 9 回利付国債(20年)	57,000,000	63,903,270	
第5 0 回利付国債(20年)	237,000,000	262,721,610	
第5 1 回利付国債(20年)	39,000,000	43,622,670	
第5 4 回利付国債(20年)	15,000,000	17,067,000	
第5 5 回利付国債(20年)	66,000,000	74,345,700	
第5 7 回利付国債(20年)	137,000,000	153,646,870	
第5 8 回利付国債(20年)	135,000,000	151,703,550	
第5 9 回利付国債(20年)	33,000,000	36,628,350	
第6 0 回利付国債(20年)	545,000,000	591,755,550	
第6 1 回利付国債(20年)	27,000,000	28,459,350	

第63回利付国債(20年)	31,000,000	34,785,100	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	61,140,420	
第65回利付国債(20年)	100,000,000	113,433,000	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	38,250,680	
第67回利付国債(20年)	34,000,000	38,599,180	
第68回利付国債(20年)	38,000,000	44,188,300	
第70回利付国債(20年)	104,000,000	123,130,800	
第72回利付国債(20年)	112,000,000	129,631,040	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	129,873,160	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	136,759,640	
第75回利付国債(20年)	50,000,000	58,077,000	
第76回利付国債(20年)	71,000,000	81,025,910	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	46,043,600	
第79回利付国債(20年)	90,000,000	103,756,500	
第88回利付国債(20年)	260,000,000	309,647,000	
第90回利付国債(20年)	156,000,000	184,349,880	
第91回利付国債(20年)	260,000,000	310,312,600	
第92回利付国債(20年)	110,000,000	128,772,600	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	58,627,500	
第95回利付国債(20年)	32,000,000	38,309,120	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	114,960,860	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	53,372,700	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	110,307,120	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	137,410,650	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	35,626,800	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	80,046,120	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	98,291,880	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	13,211,330	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	38,764,110	
第105回利付国債(20年)	127,000,000	149,180,550	
第106回利付国債(20年)	122,000,000	144,937,220	
第107回利付国債(20年)	80,000,000	93,959,200	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	153,759,640	
第109回利付国債(20年)	107,000,000	122,708,670	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	115,071,600	

第111回利付国債(20年)	25,000,000	29,694,250	
第113回利付国債(20年)	240,000,000	281,623,200	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	60,989,240	
第116回利付国債(20年)	145,000,000	171,938,100	
第117回利付国債(20年)	30,000,000	35,141,400	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	11,560,800	
第119回利付国債(20年)	50,000,000	56,351,000	
第120回利付国債(20年)	70,000,000	76,863,500	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	25,088,140	
第122回利付国債(20年)	80,000,000	90,055,200	
第123回利付国債(20年)	85,000,000	99,420,250	
第124回利付国債(20年)	50,000,000	57,738,000	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	59,225,000	
第126回利付国債(20年)	25,000,000	28,859,000	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	73,963,500	
第129回利付国債(20年)	115,000,000	129,021,950	
第130回利付国債(20年)	80,000,000	89,621,600	
第131回利付国債(20年)	55,000,000	60,773,350	
第132回利付国債(20年)	90,000,000	99,349,200	
第133回利付国債(20年)	30,000,000	33,579,900	
第134回利付国債(20年)	30,000,000	33,524,400	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	33,032,400	
第136回利付国債(20年)	180,000,000	195,393,600	
第137回利付国債(20年)	140,000,000	153,980,400	
第138回利付国債(20年)	50,000,000	53,383,000	
第140回利付国債(20年)	280,000,000	307,370,000	
第141回利付国債(20年)	195,000,000	213,474,300	
第142回利付国債(20年)	25,000,000	27,789,500	
第143回利付国債(20年)	115,000,000	123,781,400	
第144回利付国債(20年)	40,000,000	42,378,800	
第145回利付国債(20年)	125,000,000	136,163,750	
第146回利付国債(20年)	75,000,000	81,582,750	
第147回利付国債(20年)	110,000,000	117,386,500	
第148回利付国債(20年)	120,000,000	125,654,400	
第149回利付国債(20年)	130,000,000	135,759,000	

	第150回利付国債(20年)	90,000,000	92,221,200	
国債証券 合計		25,736,000,000	27,740,474,560	
地方債証券	第636回東京都公募公債	100,000,000	103,227,000	
	第682回東京都公募公債	100,000,000	106,167,000	
	第708回東京都公募公債	100,000,000	104,317,000	
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	119,307,000	
	平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	208,854,000	
	平成19年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	104,812,000	
	平成19年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	104,370,000	
	平成21年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	105,867,000	
	平成18年度第1回広島県公募公債	100,000,000	103,668,000	
	平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	105,478,000	
	平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	103,668,000	
	平成23年度第4回福岡県公募公債	100,000,000	100,566,000	
	平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	102,766,000	
	第10回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	102,039,000	
	第55回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,286,000	
	第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,020,000	
	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	103,610,000	
	第4回京都市公募公債(20年)	100,000,000	120,291,000	
	平成23年度第14回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	109,912,000	
	平成18年度第1回鹿児島県公募公債(10年)	100,000,000	103,630,000	
平成23年度第2回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	105,098,000		
地方債証券 合計		2,200,000,000	2,327,953,000	
特殊債券	第1回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	103,626,000	
	第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	104,153,000	
	第5回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,196,000	
	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	105,300,000	
	第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	105,628,000	
	第6回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	105,324,000	
	第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,427,000	
	第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,791,000	
	第21回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,019,000	
	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,351,000	
	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,713,000	

	第3 1 回株式会社日本政策投資銀行無担保社債(社債間限定同順位特約)	100,000,000	102,985,000	
	第3 6 回日本政策投資銀行債券	100,000,000	117,055,000	
	第2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,737,000	
	第4 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,986,000	
	第2 0 回公営企業債券	100,000,000	103,160,000	
	第8 5 8 回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,661,000	
	第2 5 回国際協力銀行債券	100,000,000	102,638,000	
	第2 9 回国際協力銀行債券	200,000,000	209,560,000	
	い第7 4 5 号農林債	100,000,000	100,497,000	
	第2 6 7 回信金中金債(5年)	100,000,000	100,760,000	
	第2 7 2 回信金中金債(5年)	100,000,000	100,473,000	
	特殊債券 合計	2,300,000,000	2,400,040,000	
社債券	第3 2 4 回東京交通債券	100,000,000	107,400,000	
	第9 回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債(2012)	100,000,000	102,282,000	
	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	100,921,000	
	第6 回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	106,143,000	
	第2 8 回東レ株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,689,000	
	第3 2 回住友化学株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,560,000	
	第1 2 回武田薬品工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,689,000	
	第2 回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,288,000	
	第1 5 回ダイキン工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,208,000	
	第1 1 回パナソニック株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,913,000	
	第1 8 回株式会社ニコン無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,549,000	
	第2 6 回三井不動産株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,463,000	
	第6 5 回三菱地所株式会社無担保社債(担保提供制限等財務上特約無)	100,000,000	111,392,000	

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	108,002,000	
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	117,067,000	
第523回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,847,000	
第306回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	106,679,000	
第281回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,851,000	
第19回沖縄電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	106,333,000	
社債券 合計	1,900,000,000	1,989,276,000	
合計	32,136,000,000	34,457,743,560	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成25年11月 6日現在	平成26年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
預金	285,318,523	708,337,234
コール・ローン	96,159,517	67,334,368
国債証券	219,287,892,695	212,090,079,103
派生商品評価勘定	1,283,738	1,853,417
未収入金	2,765,670,244	2,034,704,146
未収利息	2,862,780,547	2,490,694,871
前払費用	72,711,311	42,859,200
流動資産合計	225,371,816,575	217,435,862,339
資産合計	225,371,816,575	217,435,862,339
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,961,258	2,671,352
未払金	2,314,600,113	1,854,235,435
未払解約金	277,247,296	204,791,429
流動負債合計	2,594,808,667	2,061,698,216

	平成25年11月 6日現在	平成26年11月 6日現在
負債合計	2,594,808,667	2,061,698,216
純資産の部		
元本等		
元本	116,345,973,411	94,218,596,068
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	106,431,034,497	121,155,568,055
元本等合計	222,777,007,908	215,374,164,123
純資産合計	222,777,007,908	215,374,164,123
負債純資産合計	225,371,816,575	217,435,862,339

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年11月 6日現在	平成26年11月 6日現在
1. 期首	平成24年11月 7日	平成25年11月 7日
期首元本額	148,279,610,523円	116,345,973,411円
期首からの追加設定元本額	2,772,383,801円	1,456,387,187円
期首からの一部解約元本額	34,706,020,913円	23,583,764,530円
元本の内訳		
インデックスファンド海外債券ヘッジなし（DC専用）	10,205,661,248円	10,642,802,419円
DCインデックスバランス（株式20）	56,597,935円	62,159,333円
DCインデックスバランス（株式40）	107,928,273円	119,135,388円
DCインデックスバランス（株式60）	137,934,008円	149,300,125円

DCインデックスバランス(株式80)	123,944,252円	128,919,197円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	35,926,482,795円	29,189,560,112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	4,874,615,227円	3,813,424,019円
日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	50,499,604,192円	37,690,590,172円
全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	42,551,474円	30,627,453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)	1,254,566,473円	1,088,902,819円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	22,001,531円	68,869,190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)	30,677,238円	23,801,229円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	5,173,164円	3,422,636円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	5,037,923円	3,802,152円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	12,039,475円	8,400,442円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	30,379,477円	20,334,817円
世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	903,337,358円	830,417,717円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	1,669,941,958円	1,431,073,374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)	95,668,549円	62,487,280円
世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け)	152,197,488円	113,790,990円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	50,784,130円	45,360,390円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	52,296,099円	49,843,469円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	74,470,138円	72,773,610円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	69,230,600円	68,321,865円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	53,117,165円	51,278,223円
インデックスファンド海外債券(ヘッジなし)1年決算型	9,666,500,092円	8,203,115,070円
海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	223,235,149円	246,082,577円
計	116,345,973,411円	94,218,596,068円
2. 受益権の総数	116,345,973,411口	94,218,596,068口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自平成24年11月7日 至平成25年11月6日	自平成25年11月7日 至平成26年11月6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成25年11月 6日現在	平成26年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成25年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

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

(平成26年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	104,863,885
合計	104,863,885

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(平成25年11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	422,337,131	-	422,774,930	437,799
	加ドル	75,302,000	-	75,448,000	146,000
	メキシコペソ	10,816,670	-	10,755,640	61,030
	英ポンド	228,557,142	-	229,691,880	1,134,738
	スウェーデンクローナ	9,871,019	-	9,851,720	19,299
	ノルウェークローネ	5,461,301	-	5,444,950	16,351
	デンマーククローネ	28,004,793	-	27,910,400	94,393
	ポーランドズロチ	37,540,621	-	37,377,940	162,681
	南アフリカランド	26,783,585	-	26,294,400	489,185
	売建	818,342,581	-	820,457,900	2,115,319
	米ドル	776,471,150	-	778,466,000	1,994,850
	シンガポールドル	41,871,431	-	41,991,900	120,469
	合計	1,240,679,712	-	1,243,232,830	1,677,520

（平成26年11月 6日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益	
			うち1年超			
市場取引以外の取引	為替予約取引					
	買建	263,989,567	-	265,447,960	1,458,393	
	加ドル	76,185,460	-	76,518,550	333,090	
	メキシコペソ	38,093,636	-	38,386,780	293,144	
	ユーロ	16,349,366	-	16,450,750	101,384	
	英ポンド	7,450,220	-	7,503,820	53,600	
	スウェーデンクローナ	28,120,498	-	28,453,740	333,242	
	ノルウェークローネ	13,847,803	-	13,885,560	37,757	
	デンマーククローネ	24,888,733	-	25,056,690	167,957	
	シンガポールドル	33,052,237	-	33,213,750	161,513	
	南アフリカランド	26,001,614	-	25,978,320	23,294	
	売建	1,145,909,209	-	1,148,185,537	2,276,328	
	米ドル	564,578,550	-	566,519,200	1,940,650	
	ユーロ	308,964,240	-	308,988,000	23,760	
	デンマーククローネ	11,457,504	-	11,461,080	3,576	
	ポーランドズロチ	130,419,738	-	131,071,410	651,672	
	豪ドル	59,892,325	-	59,607,400	284,925	
	マレーシアリンギット	70,596,852	-	70,538,447	58,405	
	合計		1,409,898,776	-	1,413,633,497	817,935

（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25年11月 6日現在		平成26年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	1.9148円	1口当たり純資産額	2.2859円
(1万口当たり純資産額)	(19,148円)	(1万口当たり純資産額)	(22,859円)

附属明細表

第 1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-4.5%-15/11/15	10,600,000.00	11,070,375.00	
		US TREASURY N/B-1.375%-15/11/30	9,000,000.00	9,115,312.50	
		US TREASURY N/B-2.125%-15/12/31	14,300,000.00	14,615,046.87	
		US TREASURY N/B-2.0%-16/01/31	10,000,000.00	10,217,968.75	
		US TREASURY N/B-4.5%-16/02/15	17,700,000.00	18,656,906.25	
		US TREASURY N/B-2.625%-16/02/29	8,500,000.00	8,760,312.50	
		US TREASURY N/B-2.25%-16/03/31	12,100,000.00	12,431,804.68	
		US TREASURY N/B-2.625%-16/04/30	2,000,000.00	2,067,343.75	
		US TREASURY N/B-5.125%-16/05/15	18,200,000.00	19,516,656.25	
		US TREASURY N/B-7.25%-16/05/15	9,000,000.00	9,936,562.50	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/05/31	11,500,000.00	12,014,804.68	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/06/30	10,000,000.00	10,465,625.00	
		US TREASURY N/B-1.5%-16/06/30	5,000,000.00	5,089,453.12	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/07/31	4,200,000.00	4,400,812.50	

US TREASURY N/B-4.875%-16/08/15	8,000,000.00	8,620,625.00	
US TREASURY N/B-3.0%-16/08/31	10,000,000.00	10,449,218.75	
US TREASURY N/B-3.0%-16/09/30	5,200,000.00	5,442,125.00	
US TREASURY N/B-3.125%-16/10/31	6,900,000.00	7,249,312.50	
US TREASURY N/B-4.625%-16/11/15	6,000,000.00	6,489,843.75	
US TREASURY N/B-7.5%-16/11/15	9,700,000.00	11,053,453.12	
US TREASURY N/B-2.75%-16/11/30	7,000,000.00	7,312,265.61	
US TREASURY N/B-3.25%-16/12/31	8,700,000.00	9,185,976.56	
US TREASURY N/B-3.125%-17/01/31	9,000,000.00	9,492,890.62	
US TREASURY N/B-4.625%-17/02/15	9,250,000.00	10,075,996.09	
US TREASURY N/B-3.0%-17/02/28	5,400,000.00	5,686,031.25	
US TREASURY N/B-3.25%-17/03/31	8,800,000.00	9,323,187.50	
US TREASURY N/B-3.125%-17/04/30	7,000,000.00	7,403,046.87	
US TREASURY N/B-4.5%-17/05/15	8,800,000.00	9,616,062.50	
US TREASURY N/B-8.75%-17/05/15	8,000,000.00	9,591,875.00	
US TREASURY N/B-2.75%-17/05/31	8,800,000.00	9,231,062.50	
US TREASURY N/B-2.5%-17/06/30	4,000,000.00	4,172,187.50	
US TREASURY N/B-4.75%-17/08/15	8,600,000.00	9,497,625.00	
US TREASURY N/B-1.875%-17/09/30	7,000,000.00	7,182,656.25	
US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	9,800,000.00	10,741,718.75	
US TREASURY N/B-2.25%-17/11/30	3,500,000.00	3,627,695.30	
US TREASURY N/B-2.75%-17/12/31	8,600,000.00	9,047,468.75	
US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	9,800,000.00	10,546,484.37	
US TREASURY N/B-2.75%-18/02/28	9,500,000.00	9,993,554.68	
US TREASURY N/B-2.875%-18/03/31	2,500,000.00	2,641,992.18	
US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	7,550,000.00	8,243,656.25	
US TREASURY N/B-2.375%-18/06/30	7,000,000.00	7,273,984.37	
US TREASURY N/B-2.25%-18/07/31	9,600,000.00	9,929,250.00	
US TREASURY N/B-1.375%-18/07/31	2,500,000.00	2,506,054.68	
US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	9,200,000.00	10,117,843.75	
US TREASURY N/B-1.75%-18/10/31	3,000,000.00	3,042,421.87	
US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	15,200,000.00	16,606,000.00	
US TREASURY N/B-1.5%-18/12/31	11,500,000.00	11,523,359.37	
US TREASURY N/B-8.875%-19/02/15	5,000,000.00	6,543,359.37	
US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	5,600,000.00	5,892,687.50	

US TREASURY N/B-1.375%-19/02/28	3,000,000.00	2,983,828.12	
US TREASURY N/B-1.5%-19/02/28	4,000,000.00	4,000,937.50	
US TREASURY N/B-1.625%-19/03/31	2,000,000.00	2,008,593.75	
US TREASURY N/B-1.625%-19/04/30	5,000,000.00	5,017,968.75	
US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	4,400,000.00	4,701,812.50	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	3,000,000.00	3,278,203.12	
US TREASURY N/B-8.125%-19/08/15	9,000,000.00	11,714,765.62	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	13,000,000.00	14,085,703.12	
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	14,800,000.00	16,237,218.75	
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	10,000,000.00	10,915,625.00	
US TREASURY N/B-1.375%-20/05/31	300,000.00	293,179.68	
US TREASURY N/B-2.0%-20/07/31	10,000,000.00	10,098,437.50	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	7,950,000.00	10,983,421.87	
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	5,000,000.00	5,211,718.75	
US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	3,500,000.00	3,642,460.93	
US TREASURY N/B-2.375%-20/12/31	3,000,000.00	3,076,406.25	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	15,900,000.00	17,480,062.50	
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	4,500,000.00	4,812,890.62	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	1,000,000.00	1,005,703.12	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	12,000,000.00	16,710,937.50	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	1,500,000.00	1,491,914.06	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	9,300,000.00	9,148,875.00	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	8,500,000.00	8,168,632.81	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,500,000.00	5,606,132.81	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	4,000,000.00	4,057,187.49	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	2,000,000.00	2,003,906.25	
US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,700,000.00	3,821,343.75	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	3,100,000.00	4,316,992.18	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,000,000.00	1,307,656.25	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	3,700,000.00	5,383,210.93	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	3,500,000.00	4,728,007.81	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	2,900,000.00	3,929,046.87	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	2,700,000.00	3,358,757.81	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	3,200,000.00	4,052,500.00	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	2,900,000.00	3,554,539.06	

		US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	4,400,000.00	5,590,062.50	
		US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	4,950,000.00	6,186,726.56	
		US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	6,300,000.00	8,169,820.31	
		US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	5,900,000.00	7,391,593.75	
		US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	4,900,000.00	5,688,210.93	
		US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	5,900,000.00	7,261,148.43	
		US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,600,000.00	2,122,750.00	
		US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	4,800,000.00	6,034,500.00	
		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	5,100,000.00	5,806,031.25	
		US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	2,022,968.75	
		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	5,800,000.00	5,582,953.12	
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	5,700,000.00	6,321,656.25	
		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	2,000,000.00	2,267,812.50	
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	3,000,000.00	3,327,890.62	
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,500,000.00	2,650,000.00	
		US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	6,100,000.00	6,169,578.12	
	米ドル小計		666,900,000.00	729,494,238.03 (83,665,694,159)	
加ドル	国債証券	CANADA GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	370,000.00	387,160.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-15/11/01	1,100,000.00	1,100,001.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-15/12/01	2,350,000.00	2,399,632.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-16/02/01	1,000,000.00	1,002,960.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-16/06/01	4,400,000.00	4,604,028.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-16/06/01	1,200,000.00	1,218,444.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-16/08/01	380,000.00	379,950.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-16/09/01	700,000.00	721,875.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-17/02/01	370,000.00	373,600.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-17/03/01	2,000,000.00	2,021,280.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-17/06/01	3,040,000.00	3,267,726.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-17/08/01	380,000.00	381,083.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-17/09/01	1,000,000.00	1,009,230.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/03/01	1,670,000.00	1,669,565.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	1,520,000.00	1,675,663.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/09/01	650,000.00	647,406.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/03/01	1,350,000.00	1,367,941.50	

		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	2,600,000.00	2,863,406.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/09/01	650,000.00	656,695.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-20/03/01	220,000.00	218,820.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	1,720,000.00	1,894,855.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	1,450,000.00	1,589,475.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	1,600,000.00	1,702,048.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,900,000.00	1,832,911.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,520,000.00	1,579,888.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	790,000.00	1,288,813.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	1,300,000.00	1,843,816.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	1,460,000.00	2,169,866.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	1,720,000.00	2,435,657.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	2,010,000.00	2,550,267.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	2,070,000.00	2,469,096.00	
			44,490,000.00	49,323,165.30	
				(4,959,937,502)	
加ドル小計					
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-15/12/17	21,100,000.00	22,210,344.24	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.25%- 16/06/16	12,700,000.00	13,242,661.47	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%- 16/12/15	24,500,000.00	26,259,651.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-17/06/15	9,000,000.00	9,220,817.70	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 17/12/14	17,000,000.00	18,653,286.55	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-4.75%- 18/06/14	15,300,000.00	15,342,465.15	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-18/12/13	5,500,000.00	6,261,445.30	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	25,700,000.00	29,133,946.62	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	5,000,000.00	5,272,169.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	5,000,000.00	5,242,108.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	4,000,000.00	4,597,717.20	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	27,500,000.00	36,030,489.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	6,000,000.00	6,644,629.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	23,000,000.00	27,438,120.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	11,200,000.00	12,538,391.04	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-34/11/23	1,200,000.00	1,345,663.74	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	11,900,000.00	16,327,093.93	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	17,000,000.00	20,433,745.85	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	8,900,000.00	9,916,428.06	
メキシコペソ小計			251,500,000.00	286,111,174.85 (2,411,917,203)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-2.75%-16/03/28	1,400,000.00	1,453,386.06	
		BELGIUM KINGDOM-3.25%-16/09/28	1,700,000.00	1,804,250.63	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-17/03/28	2,090,000.00	2,288,846.57	
		BELGIUM KINGDOM-3.5%-17/06/28	410,000.00	447,704.29	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-17/09/28	1,940,000.00	2,246,812.74	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-18/03/28	2,600,000.00	2,946,695.70	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	1,950,000.00	2,276,049.36	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	2,620,000.00	3,128,951.76	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	2,170,000.00	2,706,894.23	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	2,050,000.00	2,537,149.49	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,500,000.00	1,895,475.00	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	700,000.00	775,162.99	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	1,100,000.00	1,246,707.00	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	1,300,000.00	1,725,690.33	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	2,190,000.00	3,224,218.08	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	1,060,000.00	1,392,244.49	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	810,000.00	937,985.82	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	2,440,000.00	3,648,686.20	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,860,000.00	2,619,126.63	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	750,000.00	985,847.55	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.75%-15/10/31	2,000,000.00	2,068,204.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%-16/01/31	3,700,000.00	3,824,270.42	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.25%-16/04/30	3,350,000.00	3,488,009.95	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.25%-16/10/31	3,900,000.00	4,186,055.25	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 17/01/31	2,550,000.00	2,731,900.68	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.1%- 17/04/30	1,500,000.00	1,551,997.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 17/07/30	3,050,000.00	3,441,955.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.5%- 18/01/31	1,900,000.00	2,121,497.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%- 18/07/30	3,700,000.00	4,133,906.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.75%- 18/10/31	1,600,000.00	1,785,910.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 19/04/30	900,000.00	968,793.21	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%- 19/07/30	2,900,000.00	3,373,992.24	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%- 19/10/31	3,000,000.00	3,464,676.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 20/01/31	800,000.00	809,325.76	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%- 20/04/30	3,000,000.00	3,437,467.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%- 20/10/31	2,800,000.00	3,366,310.36	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	3,350,000.00	4,196,533.27	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	1,600,000.00	2,065,535.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%- 23/01/31	2,000,000.00	2,542,956.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	1,250,000.00	1,497,598.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	3,100,000.00	3,821,137.81	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	2,500,000.00	2,868,354.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	1,800,000.00	1,890,496.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,500,000.00	1,829,460.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,700,000.00	2,274,827.46	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	900,000.00	1,135,712.97	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	2,430,000.00	3,311,884.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	2,190,000.00	3,006,322.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	2,180,000.00	2,483,024.36	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,780,000.00	2,231,627.65	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,650,000.00	2,000,827.45	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	700,000.00	900,230.31	
BUNDESobligation-2.0%-16/02/26	1,700,000.00	1,745,334.75	
BUNDESobligation-2.75%-16/04/08	4,000,000.00	4,158,069.60	
BUNDESobligation-1.25%-16/10/14	200,000.00	205,010.98	
BUNDESobligation-1.0%-18/10/12	2,100,000.00	2,181,795.21	
BUNDESobligation-1.0%-19/02/22	3,000,000.00	3,122,070.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%- 16/01/04	3,050,000.00	3,175,593.81	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.0%- 16/06/20	1,900,000.00	2,084,943.72	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 16/07/04	4,160,000.00	4,438,707.52	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 17/01/04	5,450,000.00	5,895,765.31	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 17/07/04	5,650,000.00	6,294,502.84	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 18/01/04	5,400,000.00	6,089,173.92	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 18/07/04	4,800,000.00	5,548,685.76	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 19/01/04	3,100,000.00	3,581,191.61	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%- 19/07/04	4,200,000.00	4,870,306.56	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 20/01/04	4,000,000.00	4,640,996.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%- 20/07/04	4,350,000.00	5,036,751.46	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	8,150,000.00	9,724,914.15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 21/09/04	1,200,000.00	1,353,796.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	2,000,000.00	2,224,267.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 22/07/04	2,250,000.00	2,455,580.25
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	600,000.00	644,734.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	1,000,000.00	1,073,482.90
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	1,000,000.00	1,072,230.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	450,000.00	501,010.02
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	1,950,000.00	2,918,361.81
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	900,000.00	980,489.97
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	200,000.00	213,108.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,800,000.00	2,956,996.26
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,700,000.00	2,627,064.91
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	1,730,000.00	2,505,068.89
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	1,490,000.00	2,510,936.67
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	2,350,000.00	3,749,385.75
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	2,900,000.00	4,476,629.66
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	3,140,000.00	4,518,062.16
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	2,340,000.00	3,541,904.49
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	3,050,000.00	4,981,186.19
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	1,500,000.00	2,007,250.80

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,450,000.00	1,706,016.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	650,000.00	765,567.85	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-15/12/11	1,900,000.00	1,900,903.26	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 15/11/01	700,000.00	717,543.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 16/04/15	3,850,000.00	4,022,766.82	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 16/08/01	7,400,000.00	7,797,374.08	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 16/09/15	1,200,000.00	1,289,976.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.75%- 16/11/15	1,100,000.00	1,145,042.58	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 17/02/01	4,900,000.00	5,254,472.86	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 17/05/01	1,700,000.00	1,865,231.16	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 17/06/01	1,700,000.00	1,872,568.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 17/08/01	5,900,000.00	6,603,702.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 17/11/01	1,700,000.00	1,832,047.84	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/02/01	4,200,000.00	4,674,504.24	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/06/01	1,000,000.00	1,086,904.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/08/01	4,200,000.00	4,732,592.34	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/12/01	2,600,000.00	2,851,365.14	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/02/01	4,000,000.00	4,521,760.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 19/03/01	3,750,000.00	4,285,545.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 19/05/01	1,400,000.00	1,481,069.38	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/09/01	3,590,000.00	4,097,736.21	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-	2,800,000.00	3,251,189.76	

20/02/01		
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 20/03/01	3,100,000.00	3,565,491.04
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	3,600,000.00	4,108,554.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	1,000,000.00	1,128,694.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/05/01	1,000,000.00	1,124,756.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	5,100,000.00	5,738,836.71
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 21/09/01	4,900,000.00	5,829,466.79
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 21/12/15	130,000.00	132,434.04
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	2,400,000.00	2,899,665.84
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,500,000.00	1,870,120.05
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	2,000,000.00	2,495,621.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	500,000.00	589,240.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,000,000.00	1,201,462.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	5,310,000.00	8,244,505.12
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,000,000.00	1,182,005.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,200,000.00	1,339,800.84
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	850,000.00	856,577.81
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	3,400,000.00	4,162,193.98
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	400,000.00	470,633.92
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	2,950,000.00	4,304,091.59
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	4,500,000.00	6,243,240.15
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-	4,700,000.00	5,907,611.42

29/11/01		
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	4,100,000.00	5,595,566.43
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	2,100,000.00	2,810,942.61
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	2,700,000.00	3,320,230.77
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	3,200,000.00	3,462,518.72
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	3,250,000.00	3,981,566.55
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	3,200,000.00	3,890,756.16
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,300,000.00	1,522,177.80
FINNISH GOVERNMENT-1.75%-16/04/15	830,000.00	850,853.16
FINNISH GOVERNMENT-1.875%-17/04/15	50,000.00	52,287.05
FINNISH GOVERNMENT-3.875%-17/09/15	1,220,000.00	1,354,827.81
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-18/09/15	160,000.00	166,428.48
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	1,050,000.00	1,253,906.64
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	1,120,000.00	1,305,038.00
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	900,000.00	1,072,697.76
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	300,000.00	321,046.14
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	620,000.00	655,826.57
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	550,000.00	602,216.61
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	1,030,000.00	1,330,574.90
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	500,000.00	585,121.45
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	440,000.00	519,911.34
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-15/11/25	900,000.00	902,274.39
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-16/04/25	7,300,000.00	7,646,032.41
FRANCE (GOVT OF)-5.0%-16/10/25	6,710,000.00	7,369,609.77
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-17/04/25	6,000,000.00	6,551,257.20
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-17/10/25	5,050,000.00	5,681,446.95
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-18/04/25	4,950,000.00	5,623,800.93
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-18/05/25	3,700,000.00	3,818,840.67
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-18/10/25	2,300,000.00	2,675,603.80
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-18/11/25	600,000.00	620,495.58
	4,900,000.00	5,783,972.25

FRANCE (GOVT OF) -4.25%-19/04/25		
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-19/05/25	620,000.00	641,773.53
FRANCE (GOVT OF) -8.5%-19/10/25	1,050,000.00	1,476,793.81
FRANCE (GOVT OF) -3.75%-19/10/25	4,500,000.00	5,272,588.80
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-20/04/25	6,200,000.00	7,250,131.82
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-20/10/25	3,600,000.00	4,033,795.68
FRANCE (GOVT OF) -3.75%-21/04/25	4,970,000.00	5,981,651.94
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-21/10/25	5,200,000.00	6,127,096.04
FRANCE (GOVT OF) -3.0%-22/04/25	4,350,000.00	5,070,279.52
FRANCE (GOVT OF) -2.25%-22/10/25	900,000.00	999,060.03
FRANCE (GOVT OF) -8.5%-23/04/25	3,200,000.00	5,199,108.80
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-23/05/25	1,400,000.00	1,496,549.74
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-23/10/25	4,150,000.00	5,316,225.94
FRANCE (GOVT OF) -2.25%-24/05/25	2,200,000.00	2,429,863.92
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-24/11/25	1,900,000.00	1,999,550.50
FRANCE (GOVT OF) -6.0%-25/10/25	2,400,000.00	3,553,481.04
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-26/04/25	4,400,000.00	5,376,228.88
FRANCE (GOVT OF) -2.75%-27/10/25	2,780,000.00	3,160,670.40
FRANCE (GOVT OF) -5.5%-29/04/25	3,220,000.00	4,793,378.61
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-30/05/25	400,000.00	432,668.00
FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	4,200,000.00	6,668,400.06
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	2,850,000.00	4,154,396.55
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	3,250,000.00	4,369,687.40
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	3,390,000.00	4,952,374.72
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	1,400,000.00	1,688,810.62
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	2,110,000.00	3,012,473.79
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	1,150,000.00	1,656,202.51
FRENCH TREASURY NOTE -2.25%-16/02/25	2,100,000.00	2,161,289.76
FRENCH TREASURY NOTE -2.5%-16/07/25	4,100,000.00	4,274,988.00
FRENCH TREASURY NOTE -1.75%-17/02/25	400,000.00	416,024.00
FRENCH TREASURY NOTE -1.0%-17/07/25	300,000.00	307,987.23
IRISH TREASURY -4.6%-16/04/18	970,000.00	1,032,614.08
IRISH TREASURY -5.5%-17/10/18	800,000.00	919,224.00
IRISH TREASURY -4.5%-18/10/18	1,100,000.00	1,268,199.79
IRISH TREASURY -4.4%-19/06/18	1,000,000.00	1,172,156.00

IRISH TREASURY-5.9%-19/10/18	800,000.00	1,002,264.00	
IRISH TREASURY-4.5%-20/04/18	1,450,000.00	1,729,675.13	
IRISH TREASURY-5.0%-20/10/18	1,100,000.00	1,356,755.62	
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	650,000.00	767,897.13	
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	950,000.00	1,082,523.84	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	1,460,000.00	1,923,807.98	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-16/04/15	1,300,000.00	1,299,970.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-16/07/15	2,150,000.00	2,294,663.61	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-17/01/15	2,000,000.00	2,108,951.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.5%-17/07/15	3,440,000.00	3,853,661.03	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-18/01/15	620,000.00	644,055.81	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	3,320,000.00	3,800,906.98	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-19/01/15	800,000.00	837,797.28	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	2,600,000.00	3,064,479.34	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-20/01/15	400,000.00	400,007.72	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	2,350,000.00	2,770,217.83	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	2,100,000.00	2,479,787.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	500,000.00	559,528.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	2,100,000.00	2,602,101.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	1,100,000.00	1,693,926.41	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	1,000,000.00	1,076,883.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	380,000.00	415,799.19	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	2,020,000.00	3,049,238.07	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	500,000.00	573,524.25	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	2,060,000.00	2,950,079.85	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	2,200,000.00	3,155,732.58	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	380,000.00	466,044.04	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.0%-16/09/15	1,440,000.00	1,546,583.04	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.2%-17/02/20	1,200,000.00	1,287,587.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-17/09/15	960,000.00	1,077,586.84	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	1,520,000.00	1,744,198.32	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.15%-18/10/19	660,000.00	687,911.59	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	2,120,000.00	2,507,642.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.95%-19/06/18	320,000.00	346,128.41	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-19/10/18	350,000.00	350,268.34	

		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	1,580,000.00	1,896,743.39	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	1,710,000.00	2,054,160.07	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	1,100,000.00	1,340,405.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	1,200,000.00	1,450,631.16	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	890,000.00	957,519.58	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	550,000.00	582,357.54	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	1,100,000.00	1,533,939.33	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	900,000.00	1,428,150.42	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	450,000.00	504,622.35	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,490,000.00	2,148,548.85	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	630,000.00	811,672.84	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	500,000.00	789,745.00	
ユーロ小計			532,900,000.00	637,355,165.63	(91,173,656,443)
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-8.0%-15/12/07	2,880,000.00	3,116,214.43	
		UK TREASURY-2.0%-16/01/22	400,000.00	406,800.00	
		UK TREASURY-4.0%-16/09/07	3,640,000.00	3,859,350.76	
		UK TREASURY-1.75%-17/01/22	2,150,000.00	2,193,716.59	
		UK TREASURY-8.75%-17/08/25	2,980,000.00	3,622,079.14	
		UK TREASURY-1.0%-17/09/07	1,150,000.00	1,148,735.00	
		UK TREASURY-5.0%-18/03/07	3,100,000.00	3,487,977.71	
		UK TREASURY-1.25%-18/07/22	2,250,000.00	2,243,943.45	
		UK TREASURY-4.5%-19/03/07	3,650,000.00	4,119,922.53	
		UK TREASURY-1.75%-19/07/22	1,700,000.00	1,713,917.38	
		UK TREASURY-3.75%-19/09/07	2,150,000.00	2,370,655.79	
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	3,160,000.00	3,660,575.60	
		UK TREASURY-2.0%-20/07/22	100,000.00	101,378.55	
		UK TREASURY-3.75%-20/09/07	2,200,000.00	2,446,880.26	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	2,150,000.00	2,974,830.08	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	2,300,000.00	2,579,191.02	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	2,500,000.00	2,855,874.25	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	1,500,000.00	1,470,441.15	
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	1,800,000.00	1,815,147.72	
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	1,500,000.00	1,564,744.65	
UK TREASURY-5.0%-25/03/07	2,390,000.00	2,995,075.10			

		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	1,800,000.00	2,156,016.24	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	1,510,000.00	2,138,504.43	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	2,400,000.00	3,060,775.20	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	2,800,000.00	3,397,556.68	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	2,950,000.00	3,709,915.87	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,900,000.00	2,323,453.19	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,850,000.00	2,451,194.13	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,950,000.00	2,413,235.56	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	2,900,000.00	3,598,458.91	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	3,150,000.00	4,095,146.79	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,220,000.00	1,286,132.90	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	2,800,000.00	3,552,433.92	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	2,170,000.00	2,789,556.91	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,620,000.00	1,910,562.54	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	2,660,000.00	3,498,574.57	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,700,000.00	2,152,497.33	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	650,000.00	745,521.33	
英ポンド小計			81,680,000.00	96,026,987.66	(17,575,819,551)
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-2.5%-16/03/12	1,200,000.00	1,242,518.40	
		SWITZERLAND-4.25%-17/06/05	820,000.00	911,922.00	
		SWITZERLAND-3.0%-18/01/08	200,000.00	219,260.00	
		SWITZERLAND-3.0%-19/05/12	170,000.00	192,712.00	
		SWITZERLAND-2.25%-20/07/06	400,000.00	447,320.00	
		SWITZERLAND-2.0%-21/04/28	100,000.00	111,425.00	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	2,080,000.00	2,700,360.00	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	230,000.00	326,289.50	
スイスフラン小計			5,200,000.00	6,151,806.90	(731,265,286)
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-3.0%-16/07/12	6,900,000.00	7,248,795.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.75%-17/08/12	7,700,000.00	8,479,394.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	12,300,000.00	14,392,414.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	8,600,000.00	10,835,871.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	9,000,000.00	10,723,950.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	5,550,000.00	5,751,687.00	

		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	4,100,000.00	4,621,233.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	6,430,000.00	8,561,287.80	
スウェーデンクローナ小計			60,580,000.00	70,614,632.30	(1,098,057,532)
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-4.25%-17/05/19	8,050,000.00	8,658,974.45	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	7,250,000.00	8,233,832.25	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	7,850,000.00	8,872,847.15	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	5,850,000.00	5,906,739.15	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	5,400,000.00	5,866,565.40	
ノルウェークローネ小計			34,400,000.00	37,538,958.40	(629,903,721)
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-4.0%-15/11/15	10,850,000.00	11,299,949.50	
		KINGDOM OF DENMARK-2.5%-16/11/15	600,000.00	630,510.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-17/11/15	10,900,000.00	12,215,085.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	16,650,000.00	19,833,480.00	
		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	5,000,000.00	5,880,495.00	
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	8,000,000.00	8,501,600.00	
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	4,050,000.00	6,477,979.05	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	4,650,000.00	4,983,400.35	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	15,070,000.00	23,507,693.00	
デンマーククローネ小計			75,770,000.00	93,330,191.90	(1,794,739,590)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-16/01/25	2,230,000.00	2,181,816.10	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-16/04/25	3,850,000.00	4,028,255.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-16/07/25	600,000.00	581,565.90	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-16/10/25	2,800,000.00	2,959,600.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-17/04/25	2,100,000.00	2,245,845.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	4,200,000.00	4,604,460.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-18/04/25	1,500,000.00	1,589,100.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-18/07/25	2,700,000.00	2,747,790.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-19/07/25	1,500,000.00	1,577,850.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	2,400,000.00	2,783,520.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	2,500,000.00	2,925,375.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	1,970,000.00	2,405,961.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	2,900,000.00	3,591,650.00	

		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	3,150,000.00	3,524,850.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	1,000,000.00	1,059,000.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	1,000,000.00	1,355,699.00	
ポーランドズロチ小計			36,400,000.00	40,162,337.00	(1,357,486,991)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-16/06/15	2,850,000.00	2,950,462.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.0%-17/02/15	2,870,000.00	3,091,543.91	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-17/07/21	2,150,000.00	2,246,750.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-18/01/21	2,600,000.00	2,833,121.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-18/10/21	870,000.00	889,158.27	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	2,220,000.00	2,452,214.22	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-19/10/21	600,000.00	598,576.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	2,650,000.00	2,868,943.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	2,730,000.00	3,173,766.96	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	2,200,000.00	2,592,904.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	2,660,000.00	3,112,354.28	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	2,150,000.00	2,057,949.90	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	1,550,000.00	1,536,395.65	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	1,420,000.00	1,531,665.96	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,530,000.00	1,724,567.04	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	950,000.00	913,793.60	
AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,000,000.00	1,102,057.00			
AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	920,000.00	898,481.20			
豪ドル小計			33,920,000.00	36,574,705.49	(3,592,001,826)
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-1.125%-16/04/01	900,000.00	909,000.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.75%-16/09/01	880,000.00	932,072.85	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-17/04/01	570,000.00	594,058.78	
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-18/04/01	350,000.00	344,734.14	
		SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	770,000.00	851,826.12	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01	700,000.00	733,852.70	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-19/10/01	200,000.00	201,103.02	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	950,000.00	1,028,415.66	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	220,000.00	224,869.45	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	580,000.00	624,979.87	

		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	200,000.00	209,077.84	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	571,226.41	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	760,000.00	837,695.63	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	180,000.00	184,139.10	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	500,000.00	508,037.20	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	350,000.00	378,629.30	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	410,000.00	394,131.60	
シンガポールドル小計			9,060,000.00	9,527,849.67	(843,976,923)
マレーシア リング ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	200,000.00	203,460.20	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	500,000.00	525,683.33	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.172%-16/07/15	1,100,000.00	1,094,150.10	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.262%-16/09/15	2,900,000.00	2,941,213.72	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.814%-17/02/15	1,900,000.00	1,911,995.82	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.012%-17/09/15	3,050,000.00	3,088,063.42	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	3,500,000.00	3,573,150.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.26%-18/03/01	200,000.00	197,976.20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.58%-18/09/28	500,000.00	499,827.38	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	1,700,000.00	1,856,081.67	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	3,800,000.00	3,929,057.57	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	2,700,000.00	2,764,697.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	650,000.00	633,423.54	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,750,000.00	1,709,312.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	550,000.00	565,759.70	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,820,000.00	1,884,376.62	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	442,958.13	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	1,300,000.00	1,225,141.82	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	430,000.00	414,014.59	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000.00	839,078.86	
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	760,000.00	791,094.12			
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	950,000.00	933,609.06			
MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	600,000.00	570,899.40			
マレーシアリングギット小計			32,060,000.00	32,595,025.25	(1,118,009,366)

南アフリカ ランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 17/09/15	10,300,000.00	10,674,728.93	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 18/12/21	10,000,000.00	10,306,922.50	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	10,200,000.00	10,153,228.92	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	11,000,000.00	10,578,286.40	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	6,500,000.00	6,501,639.62	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	18,800,000.00	22,348,869.42	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	2,000,000.00	1,919,638.60	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	11,150,000.00	9,683,722.03	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	1,500,000.00	1,452,231.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	11,300,000.00	8,662,790.18	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	2,800,000.00	2,736,106.80	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	9,400,000.00	7,224,726.26	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	1,600,000.00	1,588,032.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	7,000,000.00	6,939,574.94	
南アフリカランド小計			113,550,000.00	110,770,497.60	(1,137,613,010)
合計				212,090,079,103	(212,090,079,103)

(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 100銘柄	100.0%	39.4%

加ドル	国債証券	31銘柄	100.0%	2.3%
メキシコペソ	国債証券	19銘柄	100.0%	1.1%
ユーロ	国債証券	243銘柄	100.0%	43.3%
英ポンド	国債証券	38銘柄	100.0%	8.3%
スイスフラン	国債証券	8銘柄	100.0%	0.3%
スウェーデンクローナ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.5%
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	9銘柄	100.0%	0.8%
ポーランドズロチ	国債証券	16銘柄	100.0%	0.6%
豪ドル	国債証券	18銘柄	100.0%	1.7%
シンガポールドル	国債証券	17銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	23銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券	14銘柄	100.0%	0.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2014年11月28日現在です。

【DCインデックスバランス(株式40)】

【純資産額計算書】

資産総額	2,689,451,816円
負債総額	2,217,110円
純資産総額(-)	2,687,234,706円
発行済口数	1,618,792,681口
1口当たり純資産額(/)	1.6600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	29,164,114,208円
負債総額	115,502,815円
純資産総額(-)	29,048,611,393円
発行済口数	24,809,919,570口
1口当たり純資産額(/)	1.1708円

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	87,621,202,334円
負債総額	772,144,402円
純資産総額(-)	86,849,057,932円
発行済口数	43,494,121,572口
1口当たり純資産額(/)	1.9968円

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	35,244,615,616円
負債総額	160,061,116円
純資産総額（ - ）	35,084,554,500円
発行済口数	26,589,178,865口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3195円

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	219,080,983,552円
負債総額	421,261,341円
純資産総額（ - ）	218,659,722,211円
発行済口数	91,894,055,577口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3795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26年11月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（平成26年11月末現在）

・株主総会

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

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

・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。

当社の取締役会は10名以内の取締役で構成され、取締役の任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。取締役会はその決議をもって、代表取締役若干名を選定します。

・監査役会

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

(3) 運用の意思決定プロセス（平成26年11月末現在）

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

2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、平成26年11月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	546	106,167

株式投資信託		490	81,061
単位型		80	2,285
追加型		410	78,776
公社債投資信託		56	25,105
単位型		40	393
追加型		16	24,712
投資法人合計		1	41

3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

また、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。

なお、当事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表に含まれる比較情報については、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」（平成24年9月21日内閣府令第61号）附則第2条第2項により、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成していません。

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55期事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第56期中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：百万円）

	第54期 (平成25年3月31日)		第55期 (平成26年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	15,820	3	17,805
有価証券		-		234
前払費用	3	380	3	419
未収入金		4		37
未収委託者報酬		7,472		7,162
未収収益	3	342	3	608
関係会社短期貸付金		606		240
立替金		335		303
繰延税金資産		869		984
その他	2	30	2	30
流動資産合計		25,862		27,826
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	48	1	47
器具備品	1	124	1	134

有形固定資産合計	172	181
無形固定資産		
ソフトウェア	70	91
無形固定資産合計	70	91
投資その他の資産		
投資有価証券	7,170	7,290
関係会社株式	22,935	21,702
関係会社長期貸付金	60	60
長期差入保証金	706	692
繰延税金資産	500	525
投資その他の資産合計	31,373	30,271
固定資産合計	31,616	30,544
資産合計	57,478	58,371

(単位：百万円)

	第54期 (平成25年3月31日)	第55期 (平成26年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	305	329
未払金	3,862	3,404
未払収益分配金	6	6
未払償還金	115	112
未払手数料	3 3,195	3 2,743
その他未払金	545	542
未払費用	3 3,282	3 3,239
未払法人税等	589	2,286
未払消費税等	4 123	4 356
賞与引当金	1,770	1,935
役員賞与引当金	80	150
流動負債合計	10,012	11,702
固定負債		
退職給付引当金	1,001	1,081
その他	55	55
固定負債合計	1,057	1,137
負債合計	11,070	12,840
純資産の部		
株主資本		
資本金	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金	5,220	5,220
資本剰余金合計	5,220	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	23,530	22,694
利益剰余金合計	23,530	22,694

自己株式	68	68
株主資本合計	46,045	45,209
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	362	321
評価・換算差額等合計	362	321
純資産合計	46,408	45,531
負債純資産合計	57,478	58,371

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	52,848	63,120
その他営業収益	1,922	2,557
営業収益合計	54,771	65,678
営業費用		
支払手数料	26,955	31,207
広告宣伝費	649	1,081
公告費	7	2
調査費	10,797	13,405
調査費	691	712
委託調査費	10,089	12,669
図書費	17	23
委託計算費	406	465
営業雑経費	530	558
通信費	188	186
印刷費	214	252
協会費	46	43
諸会費	16	11
その他	64	65
営業費用計	39,347	46,721
一般管理費		
給料	6,759	7,171
役員報酬	256	316
役員賞与引当金繰入額	80	150
給料・手当	4,565	4,719
賞与	87	50
賞与引当金繰入額	1,770	1,935
交際費	100	108
寄付金	66	54
旅費交通費	313	448
租税公課	188	209
不動産賃借料	753	755
退職給付費用	312	313
退職金	83	32
固定資産減価償却費	124	109
諸経費	3,061	3,364
一般管理費計	11,764	12,568
営業利益	3,659	6,388

(単位：百万円)

	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)		第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
	営業外収益			
受取利息		12		17
受取配当金	1	601	1	1,774
時効成立分配金・償還金		4		4
為替差益		64		26
その他		16		19
営業外収益合計		699		1,842
営業外費用				
支払利息		19		19
有価証券償還損		1		-
時効成立後支払分配金・償還金		15		22
支払源泉所得税		55		57
その他		2		13
営業外費用合計		93		114
経常利益		4,265		8,116
特別利益				
投資有価証券売却益		226		135
関係会社株式売却益		239		-
特別利益合計		465		135
特別損失				
投資有価証券売却損		84		12
関係会社株式評価損		-		4,500
固定資産処分損		3		0
割増退職金		-		59
役員退職一時金		75		235
特別損失合計		163		4,807
税引前当期純利益		4,568		3,445
法人税、住民税及び事業税		1,480		3,020
法人税等調整額		260		119
法人税等合計		1,740		2,900
当期純利益		2,827		544

(3) 【株主資本等変動計算書】

第54期（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

(単位：百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余 金合計		

当期首残高	17,363	5,220	5,220	22,172	22,172	68	44,687
当期変動額							
剰余金の配当				1,468	1,468		1,468
当期純利益				2,827	2,827		2,827
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)							
当期変動額合計	-	-	-	1,358	1,358	-	1,358
当期末残高	17,363	5,220	5,220	23,530	23,530	68	46,045

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券評 価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	42	42	44,729
当期変動額			
剰余金の配当			1,468
当期純利益			2,827
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	320	320	320
当期変動額合計	320	320	1,678
当期末残高	362	362	46,408

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余 金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	23,530	23,530	68	46,045
当期変動額							
剰余金の配当				1,380	1,380		1,380
当期純利益				544	544		544
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)							
当期変動額合計	-	-	-	836	836	-	836
当期末残高	17,363	5,220	5,220	22,694	22,694	68	45,209

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券評 価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	362	362	46,408
当期変動額			
剰余金の配当			1,380
当期純利益			544
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	40	40	40
当期変動額合計	40	40	876

当期末残高	321	321	45,531
-------	-----	-----	--------

注記事項

(重要な会計方針)

項目	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券 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</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。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 3年～5年 器具備品 4年～20年</p> <p>(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。</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、当事業年度の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、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。 数理計算上の差異の費用処理方法 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)による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p>
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>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>

(表示方法の変更)

第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

「退職給付に関する会計基準」(企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。)及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日。以下「退職給付適用指針」という。)を当事業年度より適用し(ただし、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めを除く。)、(退職給付関係)注記の表示方法を変更しております。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っており、(退職給付関係)の注記の組替えは行っておりません。

(貸借対照表関係)

第54期 (平成25年3月31日)	第55期 (平成26年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,054百万円</p> <p>器具備品 618百万円</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,091百万円</p> <p>器具備品 625百万円</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。</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。</p>
<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 3,818百万円</p> <p>前払費用 2百万円</p> <p>未収収益 58百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 143百万円</p> <p>未払費用 297百万円</p>	<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 6,249百万円</p> <p>前払費用 2百万円</p> <p>未収収益 74百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 98百万円</p> <p>未払費用 274百万円</p>
<p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p>	<p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p>
<p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務87百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワーアソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務243百万円に対して保証を行っております。</p>	<p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務65百万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159百万円に対して保証を行っております。</p>

(損益計算書関係)

第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p>受取配当金 552百万円</p>	<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p>受取配当金 1,290百万円</p>

(株主資本等変動計算書関係)

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
平成21年度ストックオプション(1)	普通株式	19,215,900	-	2,237,400	16,978,500	-
平成21年度ストックオプション(2)	普通株式	1,676,400	-	49,500	1,626,900	-
平成22年度ストックオプション(1)	普通株式	2,310,000	-	-	2,310,000	-
第1回新株予約権	普通株式	2,955,200	-	-	2,955,200	-
平成23年度ストックオプション(1)	普通株式	6,091,800	-	161,700	5,930,100	-
合計		32,249,300	-	2,448,600	29,800,700	-

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

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

3 平成21年度ストックオプション(1)13,625,700株、平成21年度ストックオプション(2)1,287,000株、平成22年度ストックオプション(1)1,732,500株及び第1回新株予約権2,955,200株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成23年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

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24年5月28日取締役会	普通株式	1,468	7.46	平成24年3月31日	平成24年6月19日

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成25年5月27日取締役会	普通株式	利益剰余金	1,380	7.01	平成25年3月31日	平成25年6月18日

第55期（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
平成21年度ストックオプション(1)	普通株式	16,978,500	-	1,075,800	15,902,700	-
平成21年度ストックオプション(2)	普通株式	1,626,900	-	59,400	1,567,500	-
平成22年度ストックオプション(1)	普通株式	2,310,000	-	-	2,310,000	-
第1回新株予約権	普通株式	2,955,200	-	-	2,955,200	-
平成23年度ストックオプション(1)	普通株式	5,930,100	-	541,200	5,388,900	-
合計		29,800,700	-	1,676,400	28,124,300	-

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

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

3 平成21年度ストックオプション(1)15,902,700株、平成21年度ストックオプション(2)1,567,500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株及び平成23年度ストックオプション(1)2,887,500株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成25年5月27日取締役会	普通株式	1,380	7.01	平成25年3月31日	平成25年6月18日

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

該当事項はありません。

(リース取引関係)

第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)		第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料		オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	750百万円	1年内	751百万円
1年超	807百万円	1年超	77百万円
合計	1,558百万円	合計	828百万円

（金融商品関係）

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

当社は、原則、為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また投資有価証券に関しては、毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュー・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25年3月31日（当事業年度の決算日）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・預金	15,820	15,820	-
(2) 未収委託者報酬	7,472	7,472	-
(3) 未収収益	342	342	-
(4) 投資有価証券			
其他有価証券	7,091	7,091	-
(5) 未払金	(3,862)	(3,862)	-
(6) 未払費用	(3,282)	(3,282)	-

()負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(5) 未払金及び(6) 未払費用

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	15,820	-	-	-
未収委託者報酬	7,472	-	-	-
未収収益	342	-	-	-
投資有価証券				
投資信託	-	385	1,299	920
合計	23,635	385	1,299	920

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26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せぬ。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ぬ。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26年3月31日（当事業年度の決算日）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ぬ。

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額()	時価()	差額
(1) 現金・預金	17,805	17,805	-
(2) 未収委託者報酬	7,162	7,162	-
(3) 未収収益	608	608	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	7,457	7,457	-
(5) 未払金	(3,404)	(3,404)	-
(6) 未払費用	(3,239)	(3,239)	-

()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・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) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(5) 未払金及び(6) 未払費用

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

- 2 非上場株式等(貸借対照表計上額66百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 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18,809百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額2,892百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。
- 4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	17,805	-	-	-
未収委託者報酬	7,162	-	-	-
未収収益	608	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	234	315	1,166	973
合計	25,811	315	1,166	973

(有価証券関係)

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	貸借対照表計上 額
子会社株式	20,042
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位:百万円)

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

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

- 2 非上場株式等(貸借対照表計上額 79百万円)については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
株式	43	35	67
投資信託	1,099	190	17
合計	1,143	226	84

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26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
子会社株式	18,809
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	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	投資信託	3,819	3,188	631
	小計	3,819	3,188	631
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	3,637	3,768	130
	小計	3,637	3,768	130
合計		7,457	6,957	500

(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 66百万円）については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

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	23	11	-
投資信託	1,734	124	12
合計	1,758	135	12

(持分法損益等)

第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額 3,069	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,065
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 6,280	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 7,660
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,159	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,379

(退職給付関係)

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバランスプラン型退職金制度を設けております。

2 退職給付債務に関する事項

(単位：百万円)

イ 退職給付債務	1,101
ロ 未積立退職給付債務	1,101
ハ 未認識数理計算上の差異	99
ニ 退職給付引当金残高	1,001

3 退職給付費用に関する事項

(単位：百万円)

イ 勤務費用	102
ロ 利息費用	13
ハ 数理計算上の差異の費用処理額	24
ニ 確定拠出型企業年金への掛金	171
ホ 退職給付費用合計	312

4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例
ロ 割引率	0.9%
ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバランスプラン型退職金制度を設けております。

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	1,101	百万円
勤務費用	110	"
利息費用	9	"
数理計算上の差異の発生額	9	"
退職給付の支払額	56	"
退職給付債務の期末残高	1,174	"

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

退職給付債務	1,174	百万円
未積立退職給付債務	1,174	"
未認識数理計算上の差異	92	"
貸借対照表に計上された負債の額	1,081	"

退職給付引当金	1,081	百万円
貸借対照表に計上された負債の額	1,081	"

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	110	百万円
利息費用	9	"
数理計算上の差異の費用処理額	16	"
確定給付制度に係る退職給付費用	137	"

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.8%
-----	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、176百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社の従業員 1名	当社及び関係会社 の取締役・従業員 186名

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(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	19,215,900	1,676,400
付与	0	0
失効	2,237,400	49,500
権利確定	0	0
権利未確定残	16,978,500	1,626,900
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日
権利確定前(株)		
期首	2,310,000	6,091,800
付与	0	0
失効	0	161,700
権利確定	0	0
権利未確定残	2,310,000	5,930,100
権利確定後(株)		

期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

- 2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 - 百万円
- 3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するよう調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第55期(自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

（注） 株式数に換算して記載しております。

(2) スtockオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション（新株予約権）の数

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定前(株)		
期首	16,978,500	1,626,900
付与	0	0
失効	1,075,800	59,400
権利確定	0	0
権利未確定残	15,902,700	1,567,500
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日
権利確定前(株)		
期首	2,310,000	5,930,100
付与	0	0
失効	0	541,200
権利確定	0	0
権利未確定残	2,310,000	5,388,900
権利確定後(株)		

期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

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

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

(税効果会計関係)

第54期 (平成25年3月31日)	第55期 (平成26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	672	賞与引当金繰入超過額	689
その他	196	その他	294
小計	869	小計	984
繰延税金資産(固定)		繰延税金資産(固定)	
投資有価証券評価損	149	投資有価証券評価損	148
退職給付引当金超過額	361	関係会社株式評価損	1,665
固定資産減価償却超過額	174	退職給付引当金超過額	385
その他	75	固定資産減価償却超過額	158
小計	760	その他	34
繰延税金資産小計	1,630	小計	2,391
評価性引当金	61	繰延税金資産小計	3,375
繰延税金資産合計	1,568	評価性引当金	1,665
		繰延税金資産合計	1,710
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	199	その他有価証券評価差額金	200
繰延税金負債合計	199	繰延税金負債合計	200
繰延税金資産の純額	1,369	繰延税金資産の純額	1,510
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	
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。		法定実効税率	38.0%
		(調整)	
		評価性引当金の増減	46.6%
		交際費等永久に損金に算入されない項目	3.7%
		受取配当金等永久に益金に算入されない項目	12.9%
		税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.9%
		海外子会社の留保利益の影響額等	6.9%
		税効果会計適用後の法人税等の負担率	84.2%

第54期
(平成25年3月31日)

第55期
(平成26年3月31日)

	<p>3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」(平成26年法律第10号)の施行に伴い、「復興特別法人税に関する政令の一部を改正する政令」(平成26年政令第151号)が平成26年3月31日に公布されたことにより、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、平成26年4月1日に開始する事業年度において解消が見込まれる一時差異について、当社が使用した法定実効税率は38.0%から35.6%に変更されております。この結果、繰延税金資産の金額(繰延税金負債の金額を控除した金額)は65百万円減少し、その他有価証券評価差額金の金額が1百万円、法人税等調整額の金額が63百万円、それぞれ増加しております。</p>
--	--

(関連当事者情報)

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千SGD)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	252,000	アセットマネジメント業	直接100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	525 (千SGD 8,000)	関係会社短期貸付金	606 (千SGD 8,000)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	5 (千SGD 76)	未収収益	5 (千SGD 76)

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社(非上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成24年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	10,930百万円
負債合計	1,103百万円

純資産合計	9,826百万円
営業収益	7,917百万円
税引前当期純利益	2,801百万円
当期純利益	2,091百万円

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千SGD)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	292,000	アセットマネジメント業	直接 100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	398 (千 SGD 5,059) (注2)	関係会社 短期貸付金	240 (千 SGD 2,940)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	15 (千 SGD 192)	未収収益	5 (千 SGD 64)
							-	増資の引受(注3)	3,266 (千 SGD 40,000)	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠SGD11百万、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 資金の貸付に係る取引金額 398百万円(5,059千 SGD)の内訳は、貸付240百万円(2,940千 SGD)及び返済 638百万円(8,000千 SGD)であります。
- Nikko Asset Management International Limitedの行った40,000,000株の新株発行増資を、1株につき1シンガポールドルで当社が引受けたものであります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社(非上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロンドン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成25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	15,790百万円
負債合計	1,713百万円
純資産合計	14,076百万円

営業収益	11,350百万円
税引前当期純利益	4,212百万円
当期純利益	3,096百万円

（セグメント情報等）

セグメント情報

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

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

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

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

関連情報

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

該当事項はありません。

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

該当事項はありません。

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

該当事項はありません。

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
1株当たり純資産額	235円69銭	231円23銭
1株当たり当期純利益金額	14円35銭	2円76銭

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
当期純利益(百万円)	2,827	544
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(百万円)	2,827	544
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,903	196,903
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1) 16,978,500株、平成21年度ストックオプション(2) 1,626,900株、平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株、第1回新株予約権2,955,200株、平成23年度ストックオプション(1) 5,930,100株	平成21年度ストックオプション(1) 15,902,700株、平成21年度ストックオプション(2) 1,567,500株、平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株、第1回新株予約権2,955,200株、平成23年度ストックオプション(1) 5,388,900株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第54期 (平成25年3月31日)	第55期 (平成26年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	46,408	45,531

純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-	-
普通株式に係る期末の純資産額(百万円)	46,408	45,531
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数(千株)	196,903	196,903

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		第56期中間会計期間 (平成26年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		15,789
有価証券		226
未収委託者報酬		6,584
未収収益		938
関係会社短期貸付金		258
繰延税金資産		487
その他	2	2,365
流動資産合計		26,649
固定資産		
有形固定資産	1	235
無形固定資産		92
投資その他の資産		
投資有価証券		9,667
関係会社株式		21,702
関係会社長期貸付金		60
長期差入保証金		683
繰延税金資産		357
投資その他の資産合計		32,471
固定資産合計		32,799
資産合計		59,448

(単位:百万円)

		第56期中間会計期間 (平成26年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		3,203

未払費用		3,470
未払法人税等		871
未払消費税等	3	550
賞与引当金		875
役員賞与引当金		120
その他		671
流動負債合計		9,763
固定負債		
退職給付引当金		1,071
固定負債合計		1,071
負債合計		10,834
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		25,511
利益剰余金合計		25,511
自己株式		68
株主資本合計		48,026
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		587
評価・換算差額等合計		587
純資産合計		48,614
負債純資産合計		59,448

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

		第56期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		30,757
その他営業収益		1,678
営業収益合計		32,435
営業費用及び一般管理費	1	29,279
営業利益		3,156
営業外収益	2	862
営業外費用	3	86
経常利益		3,931
特別利益	4	174
特別損失	5	3
税引前中間純利益		4,102

法人税、住民税及び事業税	831
法人税等調整額	495
中間純利益	2,775

(3) 中間株主資本等変動計算書

第56期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

(単位：百万円)

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益 剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	22,694	22,694	68	45,209
会計方針の変更による 累積的影響額				41	41		41
会計方針の変更を反映した 当期首残高	17,363	5,220	5,220	22,735	22,735	68	45,250
当中間期変動額							
剰余金の配当							
中間純利益				2,775	2,775		2,775
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純 額）							
当中間期変動額合計	-	-	-	2,775	2,775	-	2,775
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	25,511	25,511	68	48,026

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	321	321	45,531
会計方針の変更による 累積的影響額			41
会計方針の変更を反映した 当期首残高	321	321	45,572
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			2,775
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純 額）	265	265	265
当中間期変動額合計	265	265	3,041
当中間期末残高	587	587	48,614

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第56期中間会計期間 (自 平成26年 4月 1日 至 平成26年 9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法</p> <p>その他有価証券 時価のあるもの 中間決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定)</p> <p>時価のないもの 総平均法による原価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 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)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>
4 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。</p>

（会計方針の変更）

<p>第56期中間会計期間 (自 平成26年 4月 1日 至 平成26年 9月30日)</p>

「退職給付に関する会計基準」(企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。)及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日。以下「退職給付適用指針」という。)を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めについて当中間会計期間より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更、割引率の決定方法を平均残存勤務年数に対応した高格付社債の流通利回りを基礎とする方法から退職給付の支払見込期間及び期間毎の金額を反映した単一の加重平均割引率を使用する方法へ変更いたしました。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従って、当中間会計期間の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。

この結果、当中間会計期間の期首の退職給付引当金が63百万円減少、繰延税金資産が22百万円減少、繰越利益剰余金が41百万円増加しております。また、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益への影響は軽微であります。なお、1株当たり純資産額及び1株当たり中間純利益金額に対する影響額は、軽微であります。

(中間貸借対照表関係)

第56期中間会計期間 (平成26年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 1,750百万円
2	信託資産 その他流動資産のうち180百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
3	消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
4	保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務47百万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113百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

第56期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
1	減価償却実施額 有形固定資産 50百万円 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 761百万円
3	営業外費用のうち主要なもの 支払利息 10百万円 時効成立後支払分配金・償還金 4百万円 支払源泉所得税 71百万円
4	特別利益のうち主要なもの 投資有価証券売却益 174百万円
5	特別損失のうち主要なもの 投資有価証券売却損 3百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第56期中間会計期間（自平成26年4月1日至平成26年9月30日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会 計期間末 残高 (百万円)
		当事業 年度期首	当中間 会計期間 増加	当中間 会計期間 減少	当中間 会計期間末	
平成21年度 ストックオプション(1)	普通株式	15,902,700	-	-	15,902,700	-
平成21年度 ストックオプション(2)	普通株式	1,567,500	-	-	1,567,500	-
平成22年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,310,000	-	-	2,310,000	-
第1回新株予約権	普通株式	2,955,200	-	-	2,955,200	-
平成23年度 ストックオプション(1)	普通株式	5,388,900	-	330,000	5,058,900	-
合計		28,124,300	-	330,000	27,794,300	-

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

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

3 平成21年度ストックオプション(1)15,902,700株、平成21年度ストックオプション(2)1,567,500株、平成22年度ストックオプション(1)2,310,000株、平成23年度ストックオプション(1)2,887,500株及び第1回新株予約権2,955,200株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

該当事項はありません。

(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56期中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)
オペレーティング・リース取引

解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	766百万円
1年超	3,502百万円
合計	4,268百万円

(金融商品関係)

第56期中間会計期間(平成26年9月30日)

1 金融商品の時価等に関する事項

平成26年9月30日(当中間決算日)における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位:百万円)

	中間貸借対照表 計上額()	時価()	差額
(1) 現金及び預金	15,789	15,789	-
(2) 未収委託者報酬	6,584	6,584	-
(3) 未収収益	938	938	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	9,864	9,864	-
(5) 未払金	(3,203)	(3,203)	-
(6) 未払費用	(3,470)	(3,470)	-

()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) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(5) 未払金及び(6) 未払費用

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

2 非上場株式等(中間貸借対照表計上額30百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式(中間貸借対照表計上額18,809百万円)及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額2,892百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

(有価証券関係)

第56期中間会計期間(平成26年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	18,809
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	8,573	7,543	1,029
	小計	8,573	7,543	1,029
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	1,291	1,407	116
	小計	1,291	1,407	116
合計		9,864	8,951	913

(注) 1 減損処理にあたっては、中間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 30百万円)については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(持分法損益等)

第56期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	3,075百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	7,780百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	762百万円

(ストックオプション等関係)

第56期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

セグメント情報

第56期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

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

関連情報

第56期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第56期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第56期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第56期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

該当事項はありません。

(1 株当たり情報)

項目	第56期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
1株当たり純資産額	246円89銭
1株当たり中間純利益金額	14円09銭

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

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第56期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
中間純利益(百万円)	2,775
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)	2,775
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,903
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1)15,902,700株、平成21年度ストックオプション(2)1,567,500株、平成22年度ストックオプション(1)2,310,000株、第1回新株予約権2,955,200株、平成23年度ストックオプション(1)5,058,900株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第56期中間会計期間 (平成26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)	48,614

純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額(百万円)	48,614
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数(千株)	196,903

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常の実行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26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26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	
損保ジャパン日本興亜D C証券株式会 社	3,000百万円	
株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	銀行法に基づき銀行業を 営んでいます。
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を 営むとともに、金融機関 の信託業務の兼営等に關 する法律に基づき信託業 務を営んでいます。
日本生命保険相互会社	200,000百万円 (基金の総額)	保険業法に基づき生命保 険業を営んでいます。
東京海上日動火災保険株式会社	101,994百万円	保険業法に基づき損害保 険業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

三井住友信託銀行株式会社は、日興アセットマネジメント株式会社の発行済株式総数の91.29%を保有して
おります。(平成26年9月末現在)

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26年 2月 6日	有価証券届出書
平成26年 2月 6日	有価証券報告書
平成26年 8月 6日	有価証券届出書の訂正届出書
平成26年 8月 6日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

平成26年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 秋 宗 勝 彦
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第55期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成26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。

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)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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成26年12月17日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 鶴田 光夫
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、「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40）の平成25年11月7日から平成26年11月6日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCインデックスバランス（株式40）の平成26年11月6日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成26年12月5日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 秋 宗 勝 彦
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第56期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26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26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26年4月1日から平成26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) 1. 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。
2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。