

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成24年3月15日
【計算期間】	第13特定期間 (自平成23年6月16日 至 平成23年12月15日)
【ファンド名】	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式) 毎月分配型
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 ビリー・ウェード・ワイルダー
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	雄谷 敦史
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

国内外の不動産、債券、株式に分散投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざします。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券、不動産投信）））
当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式、債券および不動産投信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12回（毎月）
目論見書または投資信託約款において、年12回（毎月）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。

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

ファンドの特色

主として国内外の不動産、債券および株式に投資を行ないます。

国内外の不動産、債券および株式の3つの異なる資産へ投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざします。

2

国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

投資信託証券(マザーファンド)への投資を通じて、原則として国内外の各3資産へそれぞれ純資産総額の6分の1を基本に国際分散投資を行ないます。

3

原則として、毎月、安定した収益分配を行なうことをめざします。

インカム収益に加え、キャピタル収益を原資として、毎月の安定的な分配をめざします。

毎月15日(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

※毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として安定した分配を継続的行なうことをめざします。

※分配金額は収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により分配金額を変更する場合や、分配を行わない場合があります。

「財産3分法」とは?

財産を「不動産・現金(預金)・株式」の3つの資産に分けて保管・運用することを「財産3分法」といいます。

先達の知恵として、財産を3つの資産に分散することで、安定性・流動性・収益性を保ちながら資産形成が行なわれてきました。



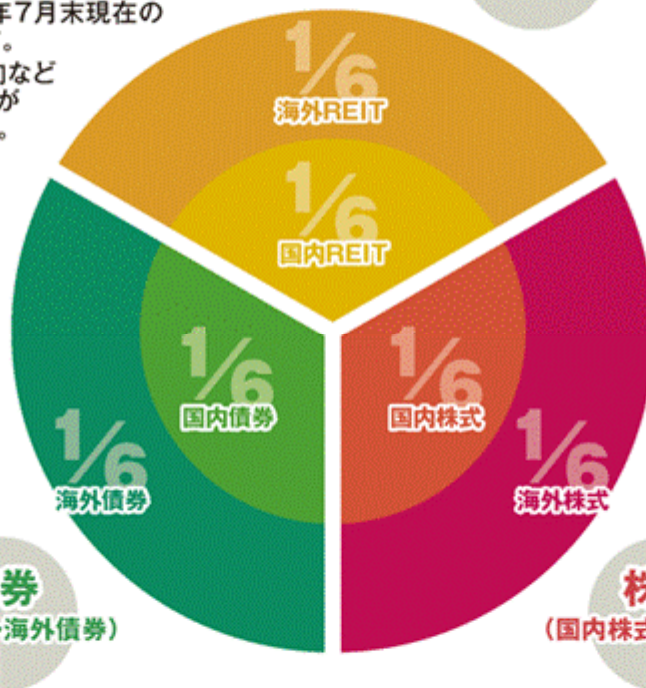
※市況動向および資金動向などにより上記のような運用ができない場合があります。

1

主として国内外の不動産、債券および株式に投資を行いません。

【世界の財産3分法ファンド】
基本組入比率

※右記組入比率は2011年7月末現在の目標とする組入比率です。
※市況動向および資金動向などにより右記のような運用ができない場合があります。



国内の不動産投資信託市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

東証REIT指数(配当込み)

海外の不動産投資信託市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

S&P先進国REIT指数
(除く日本、ヘッジなし・円ベース)

不動産投信
(国内REIT・海外REIT)

債券

(国内債券・海外債券)

国内の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

日興債券パフォーマンスインデックス(総合)

海外の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

シティグループ世界国債インデックス
(除く日本、ヘッジなし・円ベース)

株式

(国内株式・海外株式)

国内の株式市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

TOPIX(東証株価指数)

海外の株式市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

MSCI-KOKUSAI インデックス
(円ヘッジなし・円ベース)

2

国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

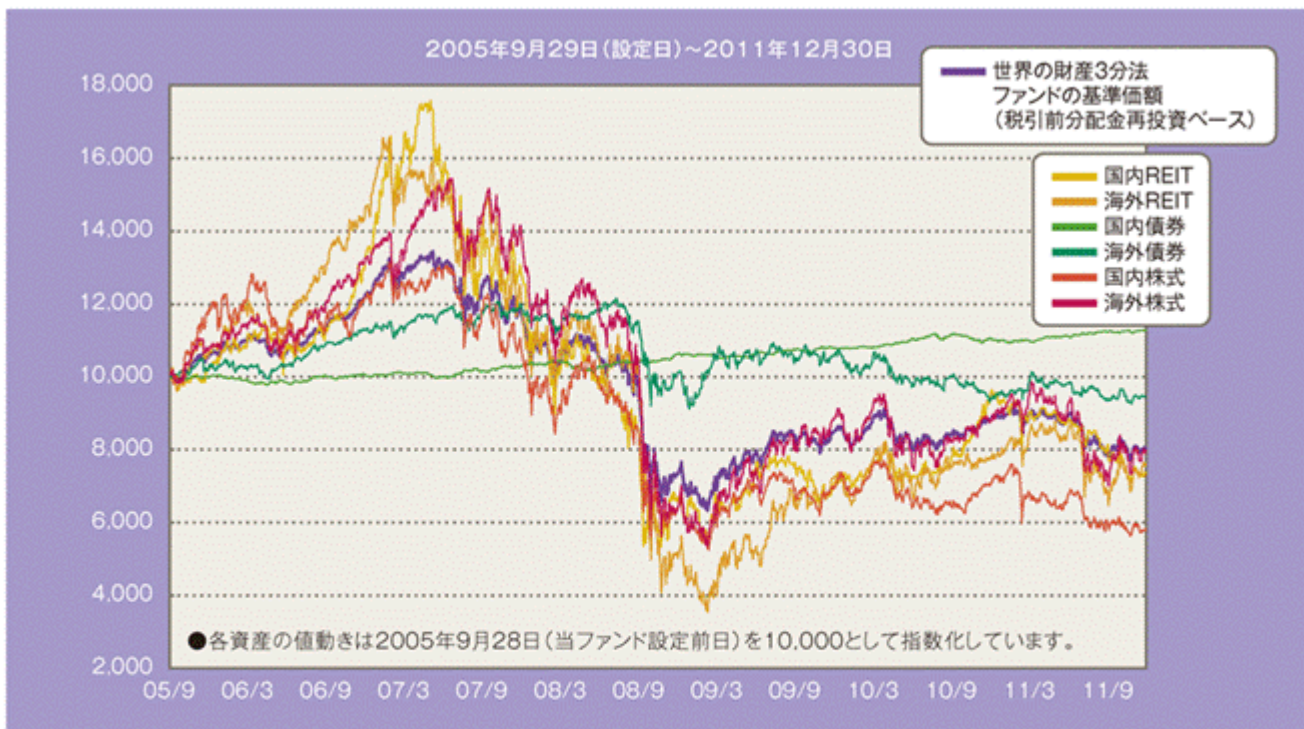
それぞれの資産は、異なる値動きをする傾向があります。

<各資産の値動きの特徴>

資産	REIT (不動産投資)	債券	株式
景気が良くなると	空室率の低下や賃料水準が改善の傾向 価格 ↑ は上がる傾向	金利は上がる傾向 債券価格 ↓ は下がる傾向	企業業績が改善する傾向 株価 ↑ は上がる傾向
景気が悪くなると	空室率の上昇や賃料水準が悪化の傾向 価格 ↓ は下がる傾向	金利は下がる傾向 債券価格 ↑ は上がる傾向	企業業績が悪化する傾向 株価 ↓ は下がる傾向

● 価格変動などに関する説明は一般論であり、実際はこれと異なる動きをする場合があります。

(ご参考) 設定来の各資産の推移(マザーファンドベース)

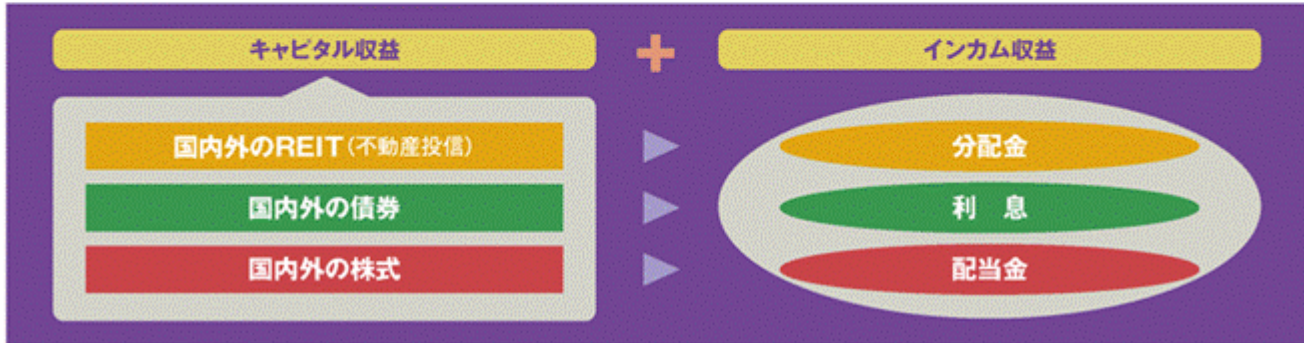


- 上記グラフは過去のものであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。
- 各資産の値動きは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの値動きを示しています。
- 基準価額は信託報酬(年率0.9975%(税抜0.95%))控除後の税引前分配金再投資ベースの1万口当たりの値です。
- 税引前分配金再投資ベースとは、税引前分配金を再投資したものとして計算した理論上のものであることにご留意ください。

3

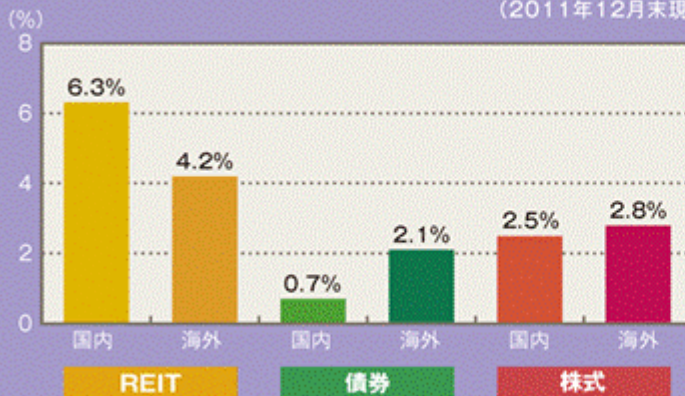
インカム収益(投資した資産から生じる利息、配当金、分配金収入など)に加え、キャピタル収益(投資した資産自体の値上がり益)を原資として、毎月の安定的な分配をめざします。

- 毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として安定した分配を継続的に行なうことをめざします。
- 分配金額は収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により分配金額を変更する場合や、分配を行わない場合があります。



<(ご参考)各指数の利回り>

(2011年12月末現在)



- ◆ REIT:実績分配金利回り
国内:東証REIT指数(配当込み)
海外:S&P先進国REIT指数(除く日本)
- ◆ 債券:最終利回りなど
国内:日興債券パフォーマンスインデックス(総合)
海外:シティグループ世界国債インデックス(除く日本)
- ◆ 株式:実績配当利回りなど
国内:TOPIX(東証株価指数)
海外:MSCI-KOKUSAIインデックス

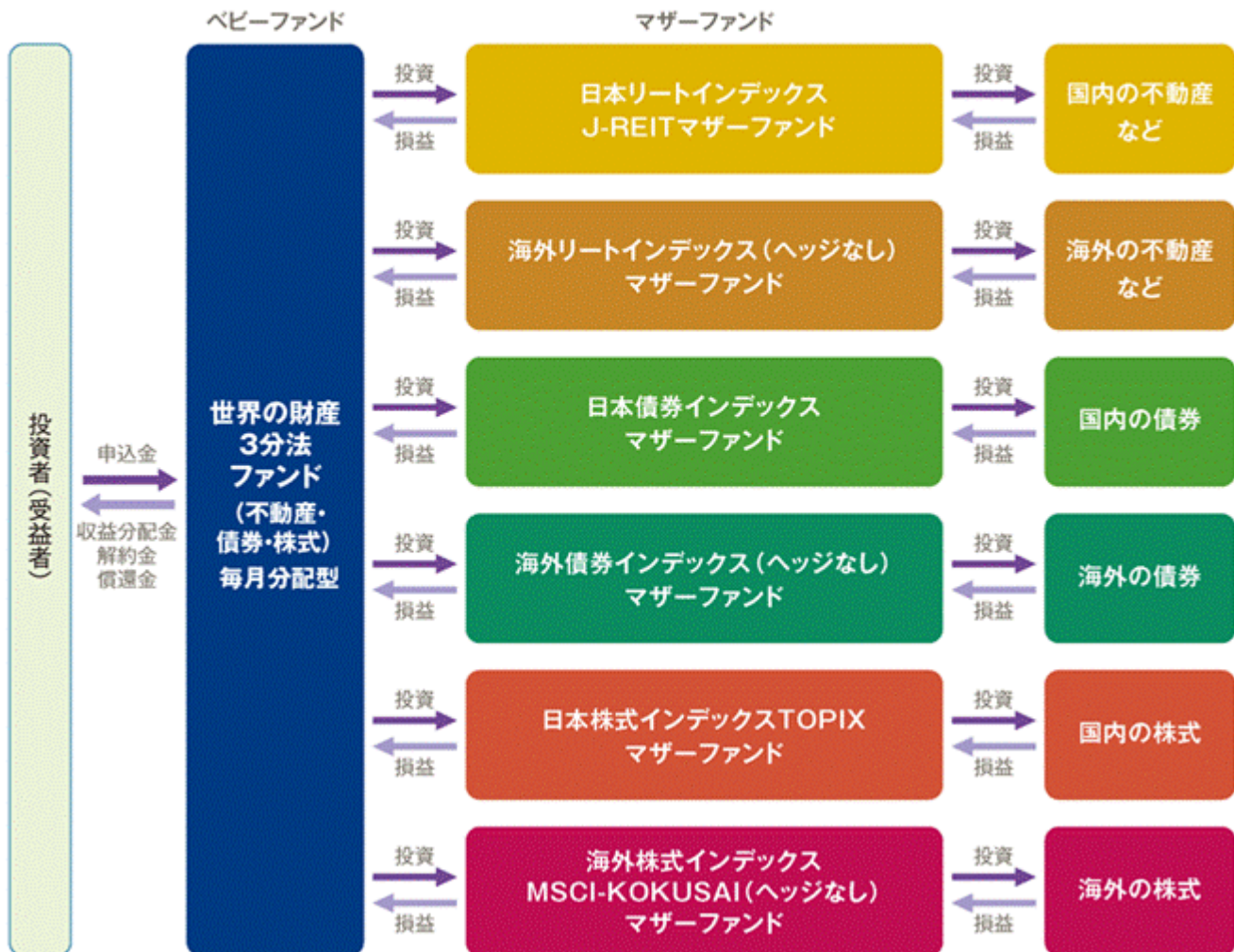
●上記は過去の各指数の利回りであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。

各指数(インデックス)の著作権などの権利について

- **東証REIT指数(配当込み)** 同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社東京証券取引所に帰属します。また、株式会社東京証券取引所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。
- **S&P先進国REIT指数(除く日本、ヘッジなし・円ベース)** 同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はスタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービスズ エル エル シー(S&P)社に帰属します。また、S&P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。
- **日興債券パフォーマンスインデックス(総合)** 同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はSMBC日興証券株式会社に帰属します。また、SMBC日興証券株式会社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
- **シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)** 同指数に関する著作権、知的財産権およびその他の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。
- **TOPIX(東証株価指数)** TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。
- **MSCI-KOKUSAI インデックス(円ヘッジなし・円ベース)** 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。

■ファンドの仕組み

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



(主な投資制限)

- ・ 投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
- ・ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

(分配方針)

- ・ 毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。
- ※ 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。

収益分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

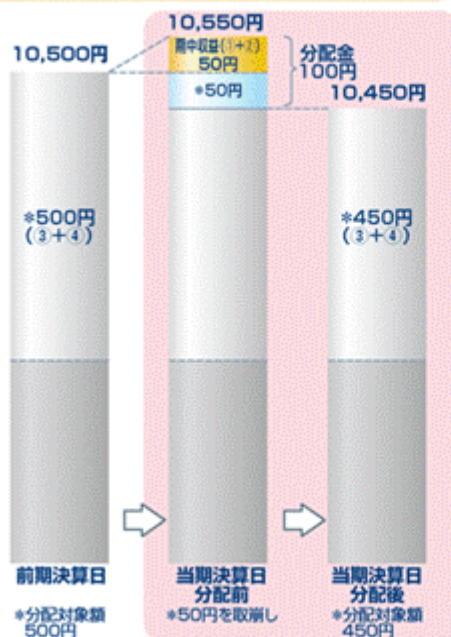
投資信託で分配金が支払われるイメージ



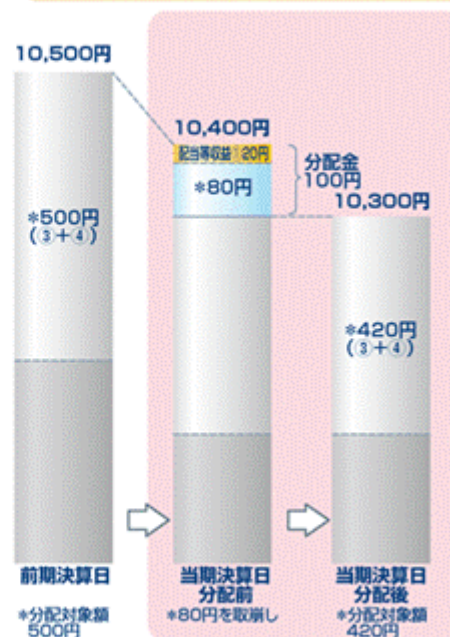
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算から基準価額が上昇した場合



前期決算から基準価額が下落した場合



(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※上記はイメージであり、将来の分配金の支払いおよび金額ならびに基準価額について示唆、保証するものではありません。

- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり率が小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



※元本払戻金（特別分配金）は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金（特別分配金）部分は非課税扱いとなります。

- ・ 普通分配金：個別元本（投資者のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。
- ・ 元本払戻金：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、（特別分配金）元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

信託金限度額

- ・30兆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17年9月29日 ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

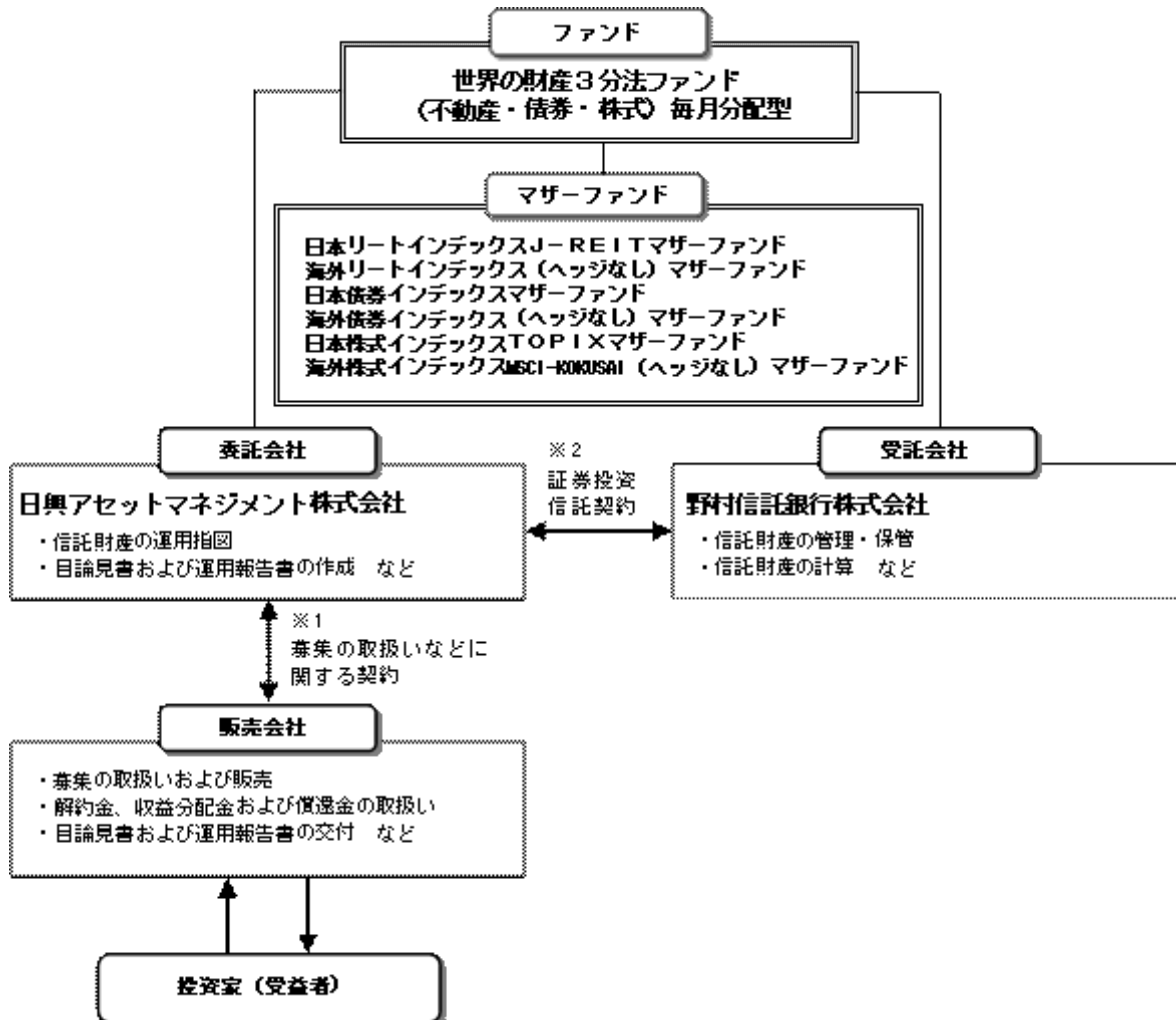
平成18年3月9日 ファンド名称変更

新名称：世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型

旧名称：世界の財産3分法ファンド（バランス重視）毎月分配型

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

委託会社の概況（平成23年12月末現在）

1) 資本金

17,363百万円

2) 沿革

昭和34年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

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

3) 大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

- ・主として、以下に掲げる各投資信託証券に投資を行ない、安定した収益の確保と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。
- ・各マザーファンドへの投資比率は、原則として、信託財産の純資産総額の6分の1を基本としますが、資金動向やその見通しなどによっては5%から25%の範囲内で組入比率を変更する場合があります。

証券投資信託「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」

証券投資信託「海外リートインデックス（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」

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」

- ・特に「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」や「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」においては、投資対象としている資産の流動性が他のマザーファンドと比べて相対的に低い場合、資金の流出入に備える場合や純資産規模が大きくなった場合などには両マザーファンドの組入比率をそれぞれ5%を下限として引き下げる場合があります。両マザーファンドの組入比率を引き下げた場合には、現金の比率を高くする場合や他のマザーファンドの組入比率をそれぞれ25%を上限に引き上げる場合があります。

また、組入比率はファンド全体として国内資産の実質組入比率と海外資産の実質組入比率が概ね50%程度ずつになるように決定します。

- ・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。

(2)【投資対象】

<世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型>

投資信託証券（投資信託または外国投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。）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) 金銭債権

3) 約束手形

4) 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「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」

2) 証券投資信託「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

3) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」

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」

5) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

6) 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」

7) 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。）およびコマーシャル・ペーパー

8) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)の証券の性質を有するもの

9) 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。)

10) 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、)のうち投資法人債券(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、)に類する証券以外のもの

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。)

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

次の取引ができます。

1) 外国為替予約取引

2) 資金の借入

<日本リートインデックスJ-REITマザーファンド>

わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券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) 金銭債権

3) 約束手形

4) 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。

1) 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。)

2) 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。)

3) 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、)のうち投資法人債券(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、)に類する証券以外のもの

4) 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。)

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

<海外リートインデックス(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に上場する不動産投資信託証券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) 金銭債権

3) 約束手形

4) 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。

1) 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。)

2) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)の証券の性質を有するもの

3) 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。)

4) 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、)のうち投資法人債券(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、)に類する証券以外のもの

5) 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。)

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
次の取引ができます。
- 1) 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。)

- 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、)
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

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

<日本株式インデックストップIX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、)
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形

5) 為替手形

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

- 1) 株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)～8)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
- 11) オプションを表示する証券または証券（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- 12) 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 13) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 14) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

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

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)~7)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))で12)に定めるもの以外のもの
- 12) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
- 13) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 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

投資対象とする投資信託証券の概要

<日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の金融商品取引所に上場する不動産投信（社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。）の投資信託証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）に投資を行ない、東証R E I T指数（配当込み） [*] の動きに連動する投資成果を目標と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に上場する不動産投資信託証券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、東京証券取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、東証R E I T指数（配当込み）の動きに連動した投資成果をめざします。 不動産投資信託証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。 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"> 投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。 有価証券先物取引等の派生商品取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 同一銘柄の投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証R E I T指数（配当込み）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、当該不動産投資信託証券への投資を東証R E I T指数（配当込み）における構成割合の範囲内で行なうことができるものとします。 外貨建資産への投資は行ないません。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入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17年6月30日設定）
決算日	毎年6月15日（休業日の場合は翌営業日）

* 東証R E I T指数（配当込み）は、株式会社東京証券取引所が発表している、東京証券取引所に上場しているJ - R E I T全銘柄に投資した場合の投資成果（市場における価格の変動と配当金の受取りを合わせた投資成果）を表す指数です。東京証券取引所に上場しているJ - R E I T全銘柄の時価総額加重平均を2003年3月31日を1,000として指数化したものです。

同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社東京証券取引所に帰属します。また、株式会社東京証券取引所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。

< 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投信（社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。）の投資信託証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）に投資を行ない、S & P先進国REIT指数（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目標と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に上場する不動産投資信託証券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金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、S & P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動した投資成果をめざします。 不動産投資信託証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。 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は行ないません。 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"> 投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。 有価証券先物取引等の派生商品取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 同一銘柄の投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、S & P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、当該不動産投資信託証券への投資をS & P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）における構成割合の範囲内で行なうことができるものとします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入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17年6月30日設定）
決算日	毎年6月15日（休業日の場合は翌営業日）

^{*} S & P先進国REIT指数（除く日本）は、スタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービスズ エル エル シー（S & P社）が発表している、日本を除く世界の主要国の不動産投信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S & P社に帰属します。また、S & P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。

<日本債券インデックスマザーファンド>

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

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

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

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

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

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

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

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

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

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

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

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

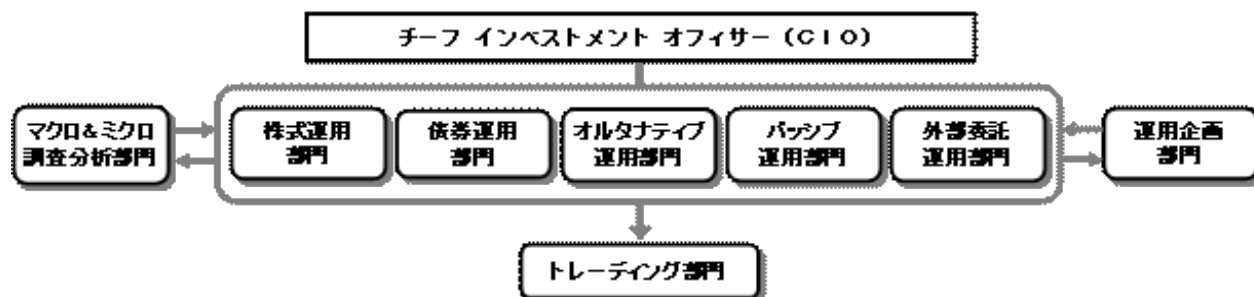
運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカンントリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効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

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

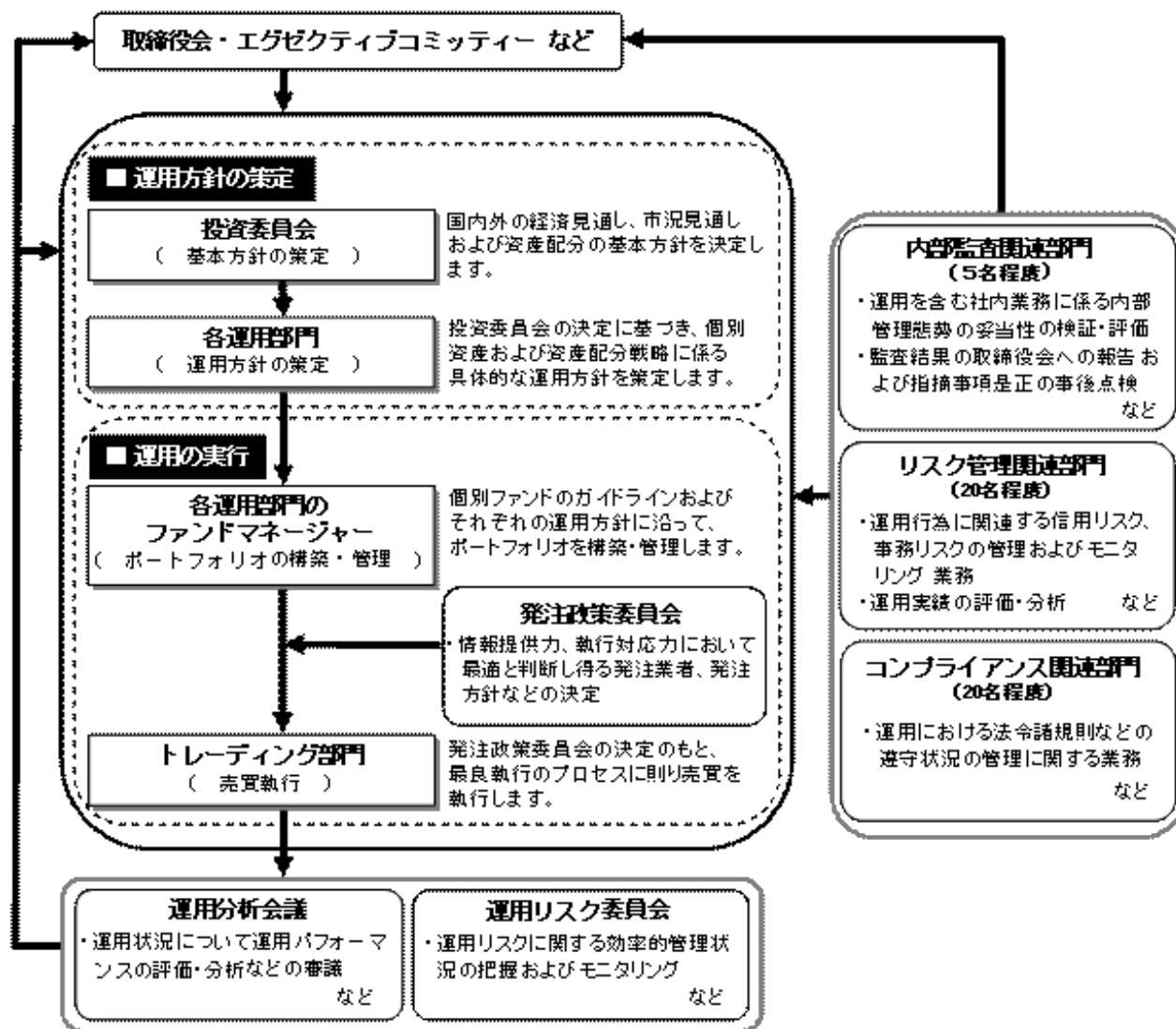
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

(3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

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

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

- 1) 分配対象額の範囲
経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。
- 2) 分配対象額についての分配方針
分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。
- 3) 留保益の運用方針
収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行ないます。

収益分配金の支払い

< 分配金再投資コース >

原則として、収益分配金は税金を差し引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。

< 分配金受取りコース >

毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日まで）から収益分配金を支払います。支払いは販売会社において行なわれます。

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

< 世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型 >

- 1) 投資信託証券、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。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
- 2) 有価証券先物取引等の派生商品取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。
- 3) 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
- 4) 同一銘柄の投資信託証券への実質投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の50%以下とします。ただし、不動産投信（社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。）の投資信託証券については、同一銘柄への実質投資割合を、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- 5) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 6) 信託財産に属する外貨建資産の時価総額と投資信託証券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との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- 7) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
 - イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
 - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
 - ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
- 二) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
- ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。

< 日本リートインデックスJ - REITマザーファンド >

- 1) 投資信託証券、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。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
- 2) 有価証券先物取引等の派生商品取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。

- 3) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- 4) 同一銘柄の投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証REIT指数（配当込み）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、当該不動産投資信託証券への投資を東証REIT指数（配当込み）における構成割合の範囲内で行なうことができるものとします。
- 5) 外貨建資産への投資は行ないません。

< 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

- 1) 投資信託証券、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。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
- 2) 有価証券先物取引等の派生商品取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。
- 3) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- 4) 同一銘柄の投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、当該不動産投資信託証券への投資をS&P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）における構成割合の範囲内で行なうことができるものとします。
- 5) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

< 日本債券インデックスマザーファンド >

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

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 3) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこ

これらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

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

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

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

- 8) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

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

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

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、主に不動産投信、債券および株式を実質的な投資対象としますので、不動産投信、債券および株式の価格の下落や、不動産投信、債券および株式の発行体の財務状況や業績の悪化、不動産の市況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。

投資対象とする投資信託証券の主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

- ・ 一般に不動産投信は、不動産や不動産証券化商品に投資して得られる収入や売却益などを収益源としており、不動産を取り巻く環境や規制、賃料水準、稼働率、不動産市況や長短の金利動向、マクロ経済の変化など様々な要因により価格が変動します。また、不動産の老朽化や立地条件の変化、火災、自然災害などに伴う不動産の滅失・毀損などにより、その価格に影響を受ける可能性もあります。不動産投信の財務状況、業績や市況環境が悪化する場合、不動産投信の分配金や価格は下がり、ファンドに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。
- ・ 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。

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

- ・ 不動産投信が支払不能や債務超過の状態になった場合、またはそうなることが予想される場合、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。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不動産投信の価格は下がり、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。
- ・ 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。
- ・ 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。

ファンドが投資対象とする投資信託証券は、これらの影響を受けて価格が変動しますので、ファンド自身にもこれらのリスクがあります。

<その他の留意事項>

・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

・投資対象とする投資信託証券に関する事項

諸事情により、投資対象とする投資信託証券（マザーファンドが投資対象とする投資信託証券を含みます。）にかかる投資や換金ができない場合があります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができなくなる場合があります。また、一時的にファンドの取得・換金ができなくなることもあります。

・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

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

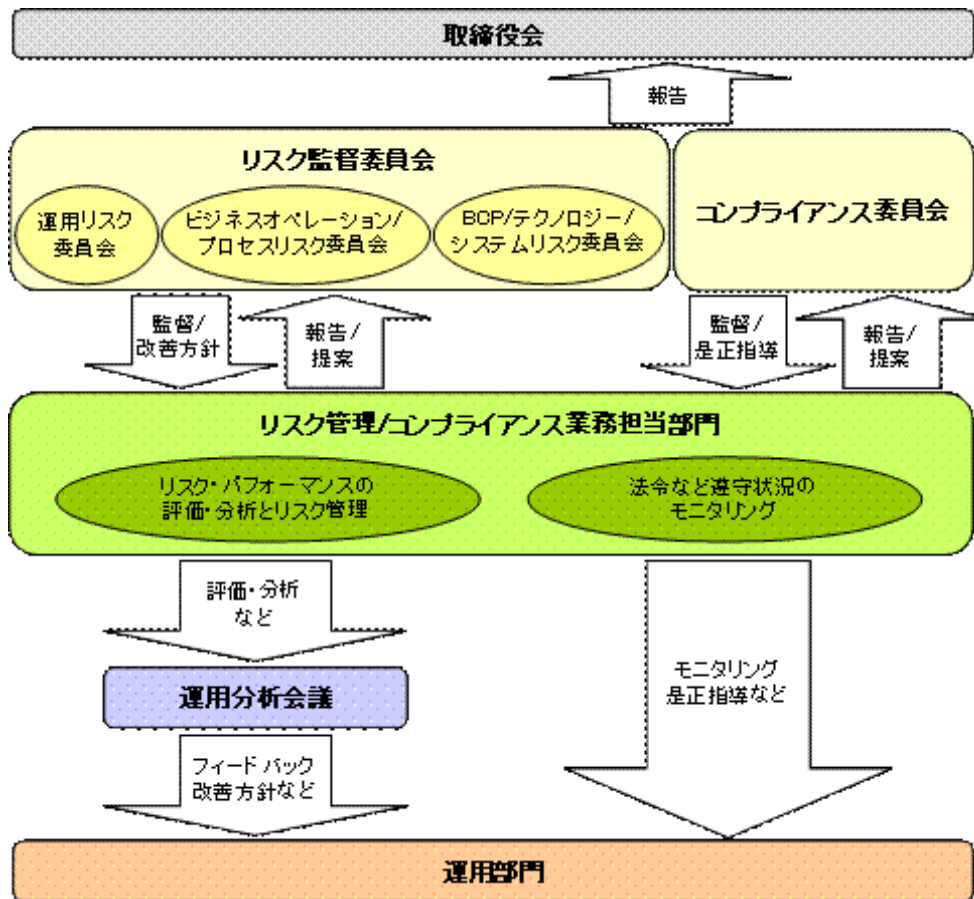
・運用制限や規制上の制限に関する事項

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

・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

(2) リスク管理体制



全社的リスク管理

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

リスク・パフォーマンスの評価・分析とリスク管理

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

法令など遵守状況のモニタリング

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

- ・販売会社における申込手数料率は3.15%（税抜3%）が上限となっております。
- ・申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
- ・＜分配金再投資コース＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
- ・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(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0.9975%（税抜0.95%）の率を乗じて得た額とします。

この他に、投資対象とする「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」および「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」の主要投資対象である不動産投信には運用などに係る費用がかかりますが、投資する不動産投信の銘柄は固定されていないため、事前に料率、上限額などを表示することができません。

信託報酬の配分

信託報酬の配分は、以下の通りとします。

信託報酬率（年率）			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.9975%	0.4200%	0.5250%	0.0525%
(0.95%)	(0.40%)	(0.50%)	(0.05%)

括弧内は税抜です。

支払時期

信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、毎計算期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】

以下の諸費用およびそれに付随する消費税等相当額について、委託会社は、その支払いをファンドのために行ない、支払金額の支弁を信託財産から受けることができます。また、実際に支払う金額の支弁を受ける代わりに、その金額をあらかじめ合理的に見積もった上で、見積額に基づいて見積率を算出し、かかる見積率を信託財産の純資産総額に乘じて得た額をかかる諸費用の合計額とみなして、信託財産から支弁を受けることができます。ただし、委託会社は、信託財産の規模などを考慮して、信託の設定時または期中に、かかる諸費用の見積率を見直し、年率0.1%を上限として、これを変更することができます。これら諸費用は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に応じて計上し、委託会社が定めた時期に、信託財産から支払います。

やむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合における発行および管理事務に係る費用。

有価証券届出書、有価証券報告書および臨時報告書（これらの訂正に係る書類を含みます。）の作成、印刷および提出に係る費用。

目論見書および仮目論見書（これらの訂正事項分を含みます。）の作成、印刷および交付に係る費用（これらを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。

信託約款の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。

運用報告書の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。

ファンドの受益者に対して行なう公告に係る費用ならびに信託約款の変更または信託契約の解約に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用。

格付の取得に要する費用。

ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。

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、

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。

< 投資対象とする投資信託証券に係る費用 >

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

* 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。

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、10% (所得税7%および地方税3%) の税率による源泉徴収 (原則として、確定申告は不要です。) が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税 (配当控除の適用はありません。) のいずれかを選択することもできます。
- ・ なお、上記の10%の税率は、平成25年1月1日から平成25年12月31日までは10.147% (所得税7.147%および地方税3%)、平成26年1月1日以降は20.315% (所得税15.315%および地方税5%) の税率となる予定です。

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、10% (所得税7%および地方税3%) の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座 (源泉徴収選択口座) を選択している場合は、10% (所得税7%および地方税3%) の税率による源泉徴収 (原則として、確定申告は不要です。) が行なわれます。
- * 解約価額および償還価額から取得費用 (申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。) を控除した利益
- ・ なお、上記の10%の税率は、平成25年1月1日から平成25年12月31日までは10.147% (所得税7.147%および地方税3%)、平成26年1月1日以降は20.315% (所得税15.315%および地方税5%) の税率となる予定です。

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

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、7% (所得税のみ) の税率による源泉徴収が行なわれます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。
- ・ なお、上記の7%の税率は、平成25年1月1日から平成25年12月31日までは7.147% (所得税のみ)、平成26年1月1日以降は15.315% (所得税のみ) の税率となる予定です。

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

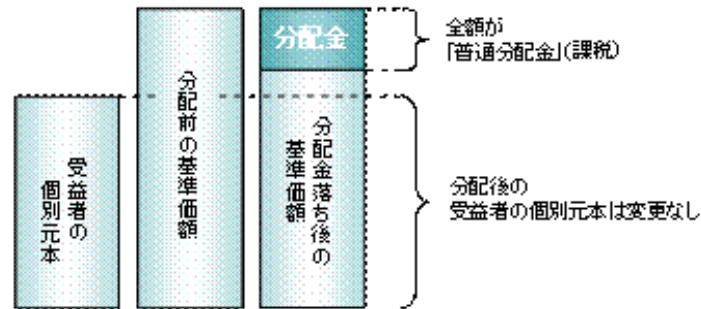
どにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

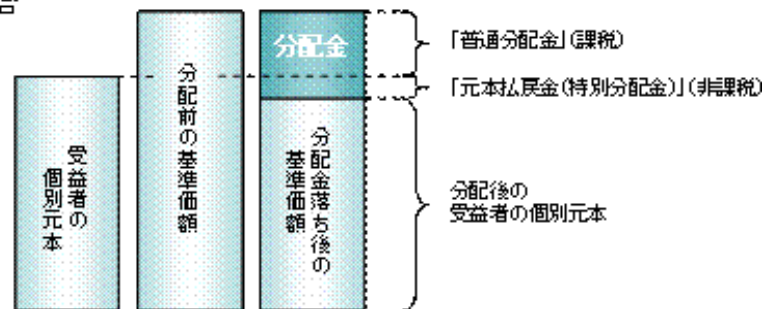
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
- 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



上記は本書提出日現在のものであり、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。

税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

以下の運用状況は2011年12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	59,419,717,838	98.68
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	796,375,508	1.32
合計(純資産総額)		60,216,093,346	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	海外リートインデックス(ヘッジなし)マ ザーファンド	12,755,074,291	0.7535	9,610,948,479	0.7909	10,087,988,256	16.75
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	12,261,882,242	0.7856	9,632,934,690	0.8132	9,971,362,639	16.56
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	8,004,166,122	1.2324	9,864,334,329	1.2334	9,872,338,494	16.39
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	7,024,332,349	1.3981	9,820,719,058	1.4017	9,846,006,653	16.35
日本	親投資信託 受益証券	日本リートインデックスJ-REITマ ザーファンド	13,519,286,831	0.7214	9,752,813,520	0.7266	9,823,113,811	16.31
日本	親投資信託 受益証券	日本株式インデックスTOPIXマザー ファンド	17,308,140,288	0.5638	9,758,329,495	0.5673	9,818,907,985	16.31

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.68
合計	98.68

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】
【純資産の推移】

期別		純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
		分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1特定期間末	2005年12月15日	1	1	1.0510	1.0510
第2特定期間末	2006年 6月15日	1	1	1.0370	1.0420
第3特定期間末	2006年12月15日	37,382	37,574	1.1544	1.1604
第4特定期間末	2007年 6月15日	128,203	128,925	1.2070	1.2140
第5特定期間末	2007年12月17日	162,250	163,339	1.0419	1.0489
第6特定期間末	2008年 6月16日	148,710	149,840	0.9212	0.9282
第7特定期間末	2008年12月15日	93,015	94,145	0.5762	0.5832
第8特定期間末	2009年 6月15日	97,568	98,553	0.5942	0.6002
第9特定期間末	2009年12月15日	99,747	100,783	0.5778	0.5838
第10特定期間末	2010年 6月15日	96,496	97,363	0.5569	0.5619
第11特定期間末	2010年12月15日	88,713	89,187	0.5612	0.5642
第12特定期間末	2011年 6月15日	76,898	77,323	0.5427	0.5457
第13特定期間末	2011年12月15日	59,790	60,171	0.4709	0.4739
	2010年12月末日	87,541	-	0.5594	-
	2011年 1月末日	86,511	-	0.5617	-
	2月末日	85,571	-	0.5678	-
	3月末日	82,964	-	0.5615	-
	4月末日	82,483	-	0.5667	-
	5月末日	79,603	-	0.5560	-
	6月末日	76,617	-	0.5471	-
	7月末日	73,241	-	0.5318	-
	8月末日	68,739	-	0.5072	-
	9月末日	64,596	-	0.4849	-
	10月末日	65,573	-	0.5019	-
	11月末日	60,777	-	0.4742	-
	12月末日	60,216	-	0.4785	-

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間末の分配金を加算した金額です。

【分配の推移】

特定期間	期間	1口当たりの分配金(円)
第1特定期間	2005年 9月29日～2005年12月15日	0
第2特定期間	2005年12月16日～2006年 6月15日	0.0180
第3特定期間	2006年 6月16日～2006年12月15日	0.0340
第4特定期間	2006年12月16日～2007年 6月15日	0.0410
第5特定期間	2007年 6月16日～2007年12月17日	0.0420
第6特定期間	2007年12月18日～2008年 6月16日	0.0420
第7特定期間	2008年 6月17日～2008年12月15日	0.0420
第8特定期間	2008年12月16日～2009年 6月15日	0.0380
第9特定期間	2009年 6月16日～2009年12月15日	0.0360
第10特定期間	2009年12月16日～2010年 6月15日	0.0310
第11特定期間	2010年 6月16日～2010年12月15日	0.0240
第12特定期間	2010年12月16日～2011年 6月15日	0.0180
第13特定期間	2011年 6月16日～2011年12月15日	0.0180

【収益率の推移】

特定期間	期間	収益率（％）
第1特定期間	2005年9月29日～2005年12月15日	5.10
第2特定期間	2005年12月16日～2006年6月15日	0.38
第3特定期間	2006年6月16日～2006年12月15日	14.60
第4特定期間	2006年12月16日～2007年6月15日	8.11
第5特定期間	2007年6月16日～2007年12月17日	10.20
第6特定期間	2007年12月18日～2008年6月16日	7.55
第7特定期間	2008年6月17日～2008年12月15日	32.89
第8特定期間	2008年12月16日～2009年6月15日	9.72
第9特定期間	2009年6月16日～2009年12月15日	3.30
第10特定期間	2009年12月16日～2010年6月15日	1.75
第11特定期間	2010年6月16日～2010年12月15日	5.08
第12特定期間	2010年12月16日～2011年6月15日	0.09
第13特定期間	2011年6月16日～2011年12月15日	9.91

(注)各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落ち）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（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】

特定期間	期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第1特定期間	2005年9月29日～2005年12月15日	1,000,000	0
第2特定期間	2005年12月16日～2006年6月15日	11,260	0
第3特定期間	2006年6月16日～2006年12月15日	33,010,586,394	630,171,330
第4特定期間	2006年12月16日～2007年6月15日	76,066,618,738	2,229,048,280
第5特定期間	2007年6月16日～2007年12月17日	54,714,957,440	5,205,100,126
第6特定期間	2007年12月18日～2008年6月16日	12,763,529,850	7,059,736,699
第7特定期間	2008年6月17日～2008年12月15日	9,808,484,367	9,822,577,811
第8特定期間	2008年12月16日～2009年6月15日	8,688,609,761	5,897,243,897
第9特定期間	2009年6月16日～2009年12月15日	14,406,774,226	5,986,832,540
第10特定期間	2009年12月16日～2010年6月15日	10,739,262,952	10,086,629,772
第11特定期間	2010年6月16日～2010年12月15日	3,738,112,212	18,933,404,132
第12特定期間	2010年12月16日～2011年6月15日	1,451,825,844	17,852,733,674
第13特定期間	2011年6月16日～2011年12月15日	1,137,780,912	15,842,664,215

(注)第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(参考)日本リートインデックスJ-REITマザーファンド

以下の運用状況は2011年12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	9,656,293,440	97.54
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	244,017,231	2.46
合計(純資産総額)		9,900,310,671	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	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	1,900	814,000.00	1,546,600,000	630,000.00	1,197,000,000	12.09
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	1,607	784,000.00	1,259,888,000	600,000.00	964,200,000	9.74
日本	投資証券	日本リートールファンド投資法人 投資証券	6,176	124,346.98	767,966,948	114,000.00	704,064,000	7.11
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	6,909	92,495.81	639,053,551	87,300.00	603,155,700	6.09
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	795	802,000.00	637,590,000	628,000.00	499,260,000	5.04
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,219	169,600.00	545,942,400	148,500.00	478,021,500	4.83
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,349	227,000.00	533,223,000	181,300.00	425,873,700	4.30
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	637	735,000.00	468,195,000	624,000.00	397,488,000	4.01
日本	投資証券	野村不動産オフィスファンド投資法人 投資証券	1,002	537,000.00	538,074,000	395,500.00	396,291,000	4.00
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	640	601,000.00	384,640,000	518,000.00	331,520,000	3.35
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	486	734,000.00	356,724,000	667,000.00	324,162,000	3.27
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	934	427,049.90	398,864,606	317,500.00	296,545,000	3.00
日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人 投資証券	527	525,364.71	276,867,207	478,000.00	251,906,000	2.54
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	556	543,000.00	301,908,000	386,500.00	214,894,000	2.17
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	1,300	270,400.00	351,520,000	163,200.00	212,160,000	2.14
日本	投資証券	ケネディクス不動産投資法人 投資証券	941	307,157.65	289,035,348	224,000.00	210,784,000	2.13
日本	投資証券	福岡リート投資法人 投資証券	404	582,000.00	235,128,000	507,000.00	204,828,000	2.07
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	760	283,900.00	215,764,000	251,800.00	191,368,000	1.93
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	620	433,500.00	268,770,000	302,500.00	187,550,000	1.89
日本	投資証券	トップリート投資法人 投資証券	509	450,000.00	229,050,000	345,500.00	175,859,500	1.78
日本	投資証券	野村不動産レジデンシャル投資法人 投資証券	496	426,705.02	211,645,690	331,500.00	164,424,000	1.66
日本	投資証券	プレミア投資法人 投資証券	646	329,156.70	212,635,232	249,800.00	161,370,800	1.63
日本	投資証券	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	318	692,000.00	220,056,000	502,000.00	159,636,000	1.61

日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	4,371	37,550.00	164,131,050	34,300.00	149,925,300	1.51
日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	308	417,500.00	128,590,000	379,500.00	116,886,000	1.18
日本	投資証券	積水ハウス・S I投資法人 投資証券	378	356,500.00	134,757,000	293,300.00	110,867,400	1.12
日本	投資証券	M I Dリート投資法人 投資証券	603	230,700.00	139,112,100	182,400.00	109,987,200	1.11
日本	投資証券	阪急リート投資法人 投資証券	281	413,000.00	116,053,000	326,500.00	91,746,500	0.93
日本	投資証券	平和不動産リート投資法人 投資証券	2,286	46,200.00	105,613,200	36,900.00	84,353,400	0.85
日本	投資証券	いちご不動産投資法人 投資証券	2,768	32,866.55	90,974,610	30,450.00	84,285,600	0.85

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.54
合 計	97.54

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) 海外リートインデックス(ヘッジなし) マザーファンド

以下の運用状況は2011年12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	7,819,209,860	65.60
	カナダ	374,601,972	3.14
	ドイツ	19,133,126	0.16
	イタリア	9,613,139	0.08
	フランス	597,198,044	5.01
	オーストラリア	1,348,232,734	11.31
	イギリス	643,876,597	5.40
	香港	226,195,750	1.90
	シンガポール	384,485,659	3.23
	ニュージーランド	45,458,604	0.38
	オランダ	168,181,097	1.41
	ベルギー	75,134,196	0.63
	小計	11,711,320,778	98.25
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	208,435,605	1.75
合計(純資産総額)		11,919,756,383	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約先物取引	売建		44,763,800	0.38

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	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	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	79,593	8,808.72	701,112,403	10,092.98	803,330,891	6.74
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	38,446	8,697.55	334,386,053	10,510.45	404,084,683	3.39
アメリカ	投資証券	HCP INC	110,450	2,821.96	311,685,702	3,246.42	358,567,354	3.01
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	80,351	4,626.31	371,728,425	4,441.29	356,861,787	2.99
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD GROUP	575,211	697.05	400,949,216	614.76	353,618,094	2.97
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	24,817	15,555.67	386,044,978	13,741.88	341,032,223	2.86
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	77,987	4,096.90	319,504,784	4,299.02	335,267,828	2.81
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	39,994	8,010.33	320,365,122	7,776.33	311,006,630	2.61
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	50,001	7,140.42	357,028,090	5,979.76	298,994,019	2.51
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	124,163	2,602.74	323,163,410	2,221.03	275,769,971	2.31
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	25,756	10,285.00	264,900,511	10,194.82	262,577,876	2.20
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	191,436	1,246.95	238,711,043	1,146.66	219,512,960	1.84
アメリカ	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	51,407	3,994.28	205,334,013	4,247.71	218,362,213	1.83
アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	159,715	1,237.62	197,666,606	1,162.21	185,622,849	1.56
香港	投資証券	LINK REIT	611,100	270.80	165,485,880	284.50	173,857,950	1.46
オーストラリア	投資証券	STOCKLAND	647,221	272.17	176,155,951	257.14	166,426,407	1.40

イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	211,527	1,001.61	211,867,896	754.80	159,661,214	1.34
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD RETAIL TRUST	761,462	208.88	159,051,745	198.59	151,219,652	1.27
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	28,429	4,819.10	137,002,267	5,219.46	148,384,130	1.24
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORPORATION	110,280	1,349.57	148,830,182	1,284.26	141,628,722	1.19
アメリカ	投資証券	THE MACERICH COMPANY	35,719	3,954.63	141,255,564	3,949.97	141,088,956	1.18
イギリス	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	241,467	704.48	170,109,348	547.65	132,239,766	1.11
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	17,056	6,478.07	110,490,033	7,090.67	120,938,389	1.01
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	23,263	6,388.67	148,619,704	5,189.14	120,715,080	1.01
アメリカ	投資証券	UDR INC	59,253	1,944.28	115,204,268	1,961.38	116,217,660	0.98
オーストラリア	投資証券	GPT GROUP	466,786	248.44	115,966,820	245.27	114,489,535	0.96
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,293	10,505.01	97,623,022	10,928.69	101,560,308	0.85
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	35,749	2,566.97	91,766,782	2,740.33	97,964,235	0.82
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	19,225	5,026.67	96,637,699	4,847.09	93,185,286	0.78
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	16,721	6,017.08	100,611,527	5,385.05	90,043,417	0.76

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.25
合計	98.25

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

<為替予約取引>

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約先物取引	米ドル	売建	400,000	31,148,000	31,092,000	0.26
	豪ドル	売建	50,000	3,913,000	3,953,500	0.03
	ニュージーランドドル	売建	60,000	3,601,020	3,606,600	0.03
	シンガポールドル	売建	50,000	2,988,600	2,987,500	0.03
	香港ドル	売建	160,000	1,599,520	1,600,000	0.01
	加ドル	売建	20,000	1,523,000	1,524,200	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) 日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2011年12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	23,920,749,650	75.72
地方債証券	日本	2,203,447,000	6.97
特殊債券	日本	2,908,196,000	9.21
社債券	日本	2,250,346,000	7.12
	オーストラリア	198,407,000	0.63
	小計	2,448,753,000	7.75
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	110,829,465	0.35
合計(純資産総額)		31,591,975,115	100.00

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	1.300	2019/03/20	750,000,000	104.98	787,395,000	105.05	787,860,000	2.49
日本	国債証券	第69回利付国債(5年)	0.900	2012/12/20	633,000,000	100.75	637,759,930	100.75	637,759,930	2.02
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	1.400	2022/12/20	545,000,000	102.97	561,219,200	103.29	562,908,700	1.78
日本	国債証券	第81回利付国債(5年)	0.800	2014/03/20	494,000,000	101.50	501,423,080	101.45	501,148,180	1.59
日本	国債証券	第290回利付国債(10年)	1.400	2018/03/20	446,000,000	105.69	471,413,080	105.70	471,413,080	1.49
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	1.400	2019/09/20	361,000,000	105.46	380,739,480	105.58	381,140,190	1.21
日本	国債証券	第268回利付国債(10年)	1.500	2015/03/20	361,000,000	104.28	376,454,410	104.10	375,801,000	1.19
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	1.300	2019/12/20	358,000,000	104.49	374,102,840	104.64	374,604,040	1.19
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	1.300	2021/03/20	340,000,000	103.37	351,461,400	103.49	351,852,400	1.11
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	2.300	2026/06/20	300,000,000	111.13	333,402,000	111.22	333,657,000	1.06
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	1.700	2017/03/20	286,000,000	106.95	305,873,920	106.87	305,639,620	0.97
日本	国債証券	第93回利付国債(5年)	0.500	2015/12/20	300,000,000	100.85	302,574,000	100.88	302,637,000	0.96
日本	国債証券	第291回利付国債(10年)	1.300	2018/03/20	287,000,000	105.04	301,482,020	105.06	301,530,810	0.95
日本	国債証券	第282回利付国債(10年)	1.700	2016/09/20	274,000,000	106.53	291,914,120	106.42	291,590,800	0.92
日本	国債証券	第250回利付国債(10年)	0.500	2013/06/20	285,000,000	100.59	286,695,750	100.55	286,567,500	0.91
日本	国債証券	第261回利付国債(10年)	1.800	2014/06/20	270,000,000	104.26	281,510,100	104.02	280,848,600	0.89
日本	国債証券	第29回利付国債(30年)	2.400	2038/09/20	246,000,000	110.57	272,002,200	111.53	274,351,500	0.87
日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	1.000	2020/09/20	268,000,000	101.23	271,320,520	101.46	271,918,160	0.86
日本	国債証券	第289回利付国債(10年)	1.500	2017/12/20	254,000,000	106.23	269,844,520	106.18	269,697,200	0.85
日本	国債証券	第292回利付国債(10年)	1.700	2018/03/20	241,000,000	107.58	259,289,490	107.51	259,091,870	0.82
日本	国債証券	第50回利付国債(20年)	1.900	2021/03/22	237,000,000	108.70	257,628,480	108.78	257,803,860	0.82
日本	国債証券	第33回利付国債(20年)	3.800	2016/09/20	200,000,000	116.77	233,550,000	116.21	232,416,000	0.74
日本	国債証券	第298回利付国債(10年)	1.300	2018/12/20	221,000,000	105.04	232,138,400	105.06	232,178,180	0.73
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	2.400	2034/03/20	208,000,000	110.72	230,299,680	111.10	231,094,240	0.73

日本	国債証券	第252回利付国債(10年)	1.000	2013/06/20	228,000,000	101.41	231,217,080	101.28	230,907,000	0.73
日本	国債証券	第251回利付国債(10年)	0.900	2013/06/20	227,000,000	101.24	229,832,960	101.13	229,565,100	0.73
日本	国債証券	第70回利付国債(5年)	0.800	2013/03/20	227,000,000	100.93	229,115,640	100.81	228,847,780	0.72
日本	国債証券	第92回利付国債(20年)	2.100	2026/12/20	210,000,000	108.13	227,083,500	108.39	227,612,700	0.72
日本	国債証券	第88回利付国債(5年)	0.500	2015/03/20	225,000,000	100.92	227,070,000	100.91	227,036,250	0.72
日本	国債証券	第95回利付国債(5年)	0.600	2016/03/20	220,000,000	101.25	222,758,800	101.27	222,783,000	0.71

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	75.72
地方債証券	6.97
特殊債券	9.21
社債券	7.75
合計	99.65

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) 海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド

以下の運用状況は2011年12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	175,822,935,902	41.00
	カナダ	12,945,624,853	3.02
	ドイツ	41,474,300,079	9.67
	イタリア	36,693,470,578	8.56
	フランス	41,364,212,534	9.65
	オーストラリア	6,119,952,796	1.43
	イギリス	37,056,066,164	8.64
	スイス	1,924,855,090	0.45
	シンガポール	1,610,006,284	0.38
	マレーシア	2,256,016,774	0.53
	オランダ	12,062,135,988	2.81
	スペイン	17,631,530,621	4.11
	ベルギー	10,694,355,298	2.49
	スウェーデン	2,608,837,866	0.61
	ノルウェー	1,250,988,696	0.29
	オーストリア	8,034,376,991	1.87
	フィンランド	2,976,342,156	0.69
	デンマーク	3,642,345,256	0.85
	メキシコ	3,614,053,283	0.84
	ポーランド	2,994,614,700	0.70
	小計	422,777,021,909	98.59
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	6,041,817,272	1.41
合計(純資産総額)		428,818,839,181	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約先物取引	売建		746,815,540	0.17

(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。

[次へ](#)

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	利率 (%)	償還期限	数量又は額面総額	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2020/02/15	46,300,000	8,859.93	4,102,147,879	9,005.69	4,169,635,916	0.97
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2021/02/15	40,000,000	8,830.64	3,532,254,402	9,004.48	3,601,791,374	0.84
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2013/05/15	43,200,000	8,183.35	3,535,207,065	8,140.84	3,516,840,990	0.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.125	2013/08/31	41,100,000	8,183.96	3,363,606,339	8,144.48	3,347,381,151	0.78
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2015/08/15	37,200,000	8,828.35	3,284,145,735	8,795.55	3,271,945,413	0.76
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2020/05/15	34,500,000	8,780.98	3,029,436,698	8,931.60	3,081,401,029	0.72
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.000	2014/02/15	36,280,000	8,429.93	3,058,379,057	8,389.85	3,043,836,332	0.71
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2016/02/15	33,500,000	8,989.90	3,011,617,232	8,980.18	3,008,361,869	0.70
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2013/08/15	34,400,000	8,331.54	2,866,050,297	8,280.52	2,848,500,492	0.66
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB . DEUTSCHLAND	3.500	2016/01/04	24,500,000	11,079.48	2,714,471,446	11,240.91	2,754,022,901	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2015/11/15	30,400,000	8,941.31	2,718,159,665	8,926.74	2,713,728,485	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.750	2014/05/15	30,550,000	8,638.86	2,639,170,966	8,589.06	2,623,956,397	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.375	2013/06/30	31,650,000	8,183.96	2,590,222,399	8,145.09	2,577,920,044	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5.125	2016/05/15	27,000,000	9,252.27	2,498,114,165	9,240.13	2,494,834,509	0.58
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3.250	2016/04/25	22,700,000	10,589.14	2,403,735,204	10,665.56	2,421,082,489	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2012/12/31	29,800,000	8,092.86	2,411,670,929	8,044.88	2,397,372,843	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.375	2019/11/15	27,000,000	8,709.31	2,351,513,531	8,844.14	2,387,917,715	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2019/08/15	26,200,000	8,852.64	2,319,392,335	8,987.47	2,354,717,876	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.125	2013/09/30	27,400,000	8,200.36	2,246,897,355	8,162.70	2,236,579,800	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2014/06/30	26,700,000	8,236.43	2,199,126,766	8,213.72	2,193,062,405	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.750	2041/02/15	20,300,000	10,199.49	2,070,496,064	10,669.82	2,165,972,445	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2039/08/15	21,000,000	9,784.31	2,054,704,640	10,242.25	2,150,871,450	0.50
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB . DEUTSCHLAND	4.500	2013/01/04	20,300,000	10,554.75	2,142,614,947	10,528.65	2,137,316,033	0.50

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.250	2016/07/31	24,200,000	8,626.61	2,087,639,832	8,637.64	2,090,309,560	0.49
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3.750	2021/04/25	19,500,000	10,581.74	2,063,439,853	10,622.05	2,071,299,724	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.750	2017/08/15	22,000,000	9,300.86	2,046,189,681	9,353.09	2,057,680,625	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2017/11/15	22,400,000	9,095.58	2,037,409,920	9,170.89	2,054,279,500	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.125	2019/05/15	23,400,000	8,564.62	2,004,120,097	8,702.02	2,036,272,972	0.47
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.250	2013/08/01	20,150,000	10,030.61	2,021,166,951	9,997.74	2,014,545,324	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.125	2015/05/15	23,100,000	8,744.54	2,019,987,656	8,708.09	2,011,569,872	0.47

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.59
合計	98.59

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

< 為替予約取引 >

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約先物取引	ユーロ	売建	2,090,000	211,103,093	210,463,000	0.05
	英ポンド	売建	1,561,000	187,436,963	186,987,290	0.04
	メキシコペソ	売建	32,019,000	177,567,768	177,705,450	0.04
	米ドル	売建	1,300,000	101,131,550	101,049,000	0.02
	加ドル	売建	468,000	35,651,538	35,666,280	0.01
	豪ドル	売建	442,000	34,616,600	34,944,520	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) 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2011年12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	24,626,470,220	99.68
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	78,682,861	0.32
合計(純資産総額)		24,705,153,081	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	80,080,000	0.32

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	318,600	2,528.44	805,562,415	2,565.00	817,209,000	3.31
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,853,200	331.00	613,417,420	327.00	605,996,400	2.45
日本	株式	キヤノン	電気機器	154,100	3,508.54	540,666,370	3,410.00	525,481,000	2.13
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	209,200	2,329.43	487,318,166	2,348.00	491,201,600	1.99
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	112,700	3,852.63	434,192,512	3,935.00	443,474,500	1.80
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	185,100	2,126.33	393,584,136	2,144.00	396,854,400	1.61
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	97,300	3,506.43	341,175,752	3,380.00	328,874,000	1.33
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	3,144,500	107.93	339,391,516	104.00	327,028,000	1.32
日本	株式	ファナック	電気機器	25,800	12,506.50	322,667,954	11,780.00	303,924,000	1.23
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	2,017	135,844.88	273,999,138	141,500.00	285,405,500	1.16
日本	株式	三菱商事	卸売業	178,300	1,526.49	272,174,340	1,555.00	277,256,500	1.12
日本	株式	三井物産	卸売業	211,300	1,108.11	234,144,080	1,197.00	252,926,100	1.02
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	110,900	2,427.56	269,216,996	2,267.00	251,410,300	1.02
日本	株式	日立製作所	電気機器	557,000	423.84	236,082,000	404.00	225,028,000	0.91
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	616	378,422.88	233,108,498	362,000.00	222,992,000	0.90
日本	株式	小松製作所	機械	123,100	1,843.62	226,950,832	1,799.00	221,456,900	0.90
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	102,400	2,085.47	213,552,255	2,145.00	219,648,000	0.89
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	313,400	690.04	216,261,072	692.00	216,872,800	0.88
日本	株式	ソニー	電気機器	154,800	1,575.01	243,813,013	1,382.00	213,933,600	0.87
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	43,100	4,528.23	195,166,859	4,900.00	211,190,000	0.85
日本	株式	三菱地所	不動産業	171,000	1,327.55	227,011,900	1,150.00	196,650,000	0.80
日本	株式	KDDI	情報・通信業	380	561,242.97	213,272,331	495,000.00	188,100,000	0.76
日本	株式	パナソニック	電気機器	283,400	780.56	221,213,150	654.00	185,343,600	0.75
日本	株式	三菱電機	電気機器	248,000	729.71	180,970,180	738.00	183,024,000	0.74
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	57,700	2,821.90	162,823,927	3,130.00	180,601,000	0.73
日本	株式	信越化学工業	化学	46,600	3,954.32	184,271,502	3,790.00	176,614,000	0.71
日本	株式	東芝	電気機器	522,000	350.35	182,887,830	315.00	164,430,000	0.67
日本	株式	国際石油開発帝石	鉱業	338	523,813.38	177,048,925	485,000.00	163,930,000	0.66
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	92,900	1,809.78	168,128,735	1,705.00	158,394,500	0.64
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	195,300	768.24	150,038,280	782.00	152,724,600	0.62

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.74
		建設業	2.39
		食料品	3.69
		繊維製品	0.95
		パルプ・紙	0.41
		化学	6.08
		医薬品	5.17
		石油・石炭製品	0.92
		ゴム製品	0.79
		ガラス・土石製品	1.18
		鉄鋼	1.88
		非鉄金属	1.14
		金属製品	0.68
		機械	5.02
		電気機器	13.70
		輸送用機器	9.50
		精密機器	1.37
		その他製品	1.63
		電気・ガス業	3.21
		陸運業	4.23
		海運業	0.39
		空運業	0.29
		倉庫・運輸関連業	0.24
		情報・通信業	6.76
		卸売業	5.53
		小売業	4.37
		銀行業	9.29
		証券、商品先物取引業	0.93
		保険業	2.14
		その他金融業	0.79
不動産業	2.19		
サービス業	1.96		
合 計			99.68

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
 < 有価証券先物取引等 >

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	日本	東京証券取引所	東証株価指数先物 2012年03 月	買建	11	日本円	80,767,128	80,080,000	0.32

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

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

以下の運用状況は2011年12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	32,984,988,018	54.28
	カナダ	3,308,157,057	5.44
	ドイツ	2,128,910,944	3.50
	イタリア	587,589,545	0.97
	フランス	2,311,542,970	3.80
	オーストラリア	2,179,834,441	3.59
	イギリス	6,091,997,450	10.03
	スイス	2,438,958,784	4.01
	バミューダ	123,777,849	0.20
	香港	683,369,498	1.12
	シンガポール	446,603,421	0.73
	ニュージーランド	31,072,961	0.05
	オランダ	705,113,483	1.16
	スペイン	887,885,806	1.46
	ベルギー	258,464,780	0.43
	スウェーデン	809,553,482	1.33
	ノルウェー	206,108,644	0.34
	オーストリア	69,567,867	0.11
	ルクセンブルグ	130,417,278	0.21
	フィンランド	228,842,069	0.38
	デンマーク	284,372,703	0.47
	アイルランド	357,332,019	0.59
	ギリシャ	21,439,885	0.04
	イスラエル	173,435,865	0.29
	ポルトガル	56,166,068	0.09
	中国	3,762,000	0.01
	ケイマン島	53,400,185	0.09
	モーリシャス	9,465,984	0.02
	ジャージー	136,351,263	0.22
	ガーンジー	15,502,843	0.03
小計	57,723,985,162	94.99	
投資証券	アメリカ	749,406,232	1.23
	カナダ	10,556,088	0.02
	フランス	70,951,901	0.12
	オーストラリア	166,504,669	0.27
	イギリス	66,244,547	0.11
	香港	24,609,250	0.04
	シンガポール	14,176,087	0.02
	オランダ	6,509,461	0.01
	小計	1,108,958,235	1.82
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	1,934,664,108	3.18
合計(純資産総額)		60,767,607,505	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	1,295,191,157	2.13
	買建	ドイツ	621,033,250	1.02

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約先物取引	買建		1,480,426,340	2.44

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	179,966	6,175.67	1,111,409,835	6,628.89	1,192,974,781	1.96
アメリカ	株式	APPLE COMPUTER INC	テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	34,316	30,915.64	1,060,901,212	31,494.03	1,080,749,092	1.78
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービ ス	44,202	14,021.19	619,764,481	14,473.63	639,763,534	1.05
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	74,136	8,123.83	602,268,260	8,354.72	619,385,358	1.02
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービ ス	279,099	2,084.99	581,917,730	2,022.79	564,560,005	0.93
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	392,358	1,260.94	494,740,995	1,404.76	551,169,530	0.91
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	122,143	4,217.19	515,100,238	4,432.18	541,360,250	0.89
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用 品	101,714	5,015.01	510,096,462	5,206.25	529,548,288	0.87
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	101,429	4,951.26	502,201,411	5,121.51	519,469,759	0.85
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	219,346	2,208.59	484,446,127	2,345.42	514,457,574	0.85
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	288,785	1,466.95	423,634,253	1,687.74	487,392,667	0.80
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービ ス	9,411	45,343.41	426,726,829	49,940.18	469,986,996	0.77
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	76,486	5,204.69	398,086,148	5,454.24	417,172,878	0.69
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	1,881,450	208.47	392,224,752	214.40	403,382,869	0.66
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	185,655	1,986.26	368,758,543	2,158.06	400,655,074	0.66
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	65,013	5,351.62	347,924,975	6,149.23	399,780,150	0.66
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	660,571	629.00	415,500,810	589.47	389,383,616	0.64
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	701,158	547.53	383,906,231	552.14	387,140,452	0.64
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	133,953	2,672.96	358,051,158	2,847.88	381,482,565	0.63
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノ ロジー・ライフサイエ ンス	86,383	4,142.77	357,864,814	4,403.24	380,365,296	0.63
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	144,320	2,603.51	375,738,938	2,598.07	374,953,577	0.62
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装 置	194,362	1,914.74	372,151,957	1,908.52	370,943,181	0.61

スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	26,003	11,675.83	303,606,555	13,155.98	342,094,921	0.56
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	114,033	2,558.42	291,744,695	2,933.13	334,473,636	0.55
イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	187,821	1,655.77	310,989,166	1,765.40	331,579,258	0.55
アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC	食品・生活必需品小売り	70,167	4,408.64	309,340,720	4,663.62	327,232,406	0.54
アメリカ	株式	V E R I Z O N COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	104,788	2,813.41	294,811,669	3,113.49	326,256,075	0.54
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	118,871	2,940.89	349,586,582	2,729.64	324,475,036	0.53
フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	78,567	3,799.79	298,537,967	3,953.37	310,604,502	0.51
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	58,576	4,805.89	281,509,625	5,172.82	303,003,080	0.50

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	12.37
		素材	6.96
		資本財	7.14
		商業・専門サービス	0.82
		運輸	1.78
		自動車・自動車部品	1.16
		耐久消費財・アパレル	1.14
		消費者サービス	1.72
		メディア	2.46
		小売	2.65
		食品・生活必需品小売り	2.37
		食品・飲料・タバコ	6.96
		家庭用品・パーソナル用品	1.82
		ヘルスケア機器・サービス	2.65
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.91
		銀行	6.86
		各種金融	4.10
		保険	3.78
		不動産	0.59
		ソフトウェア・サービス	5.69
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.33		
電気通信サービス	4.26		
公益事業	3.86		
半導体・半導体製造装置	1.62		
投資証券		-	1.82
合計			96.82

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
< 有価証券先物取引等 >

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500 1203	買建	53	米ドル	16,114,763	1,295,191,157	2.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1203	買建	265	ユーロ	5,995,720	621,033,250	1.02

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

< 為替予約取引 >

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率(%)
為替予約先物取引	米ドル	買建	13,159,000	1,024,922,065	1,022,048,500	1.68
	ユーロ	買建	4,554,000	467,958,516	458,377,840	0.75

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(参考情報)

運用実績

2011年12月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額……………4,785円

純資産総額……………602.16億円

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

分配の推移(税引前、1万口当たり)

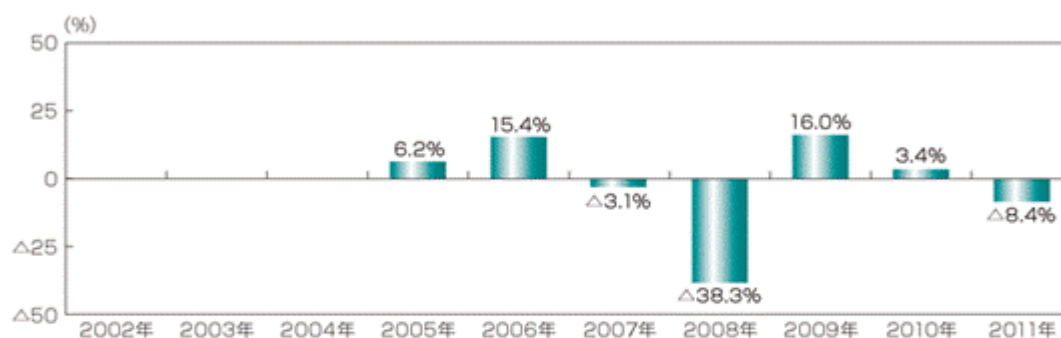
2011年8月	2011年9月	2011年10月	2011年11月	2011年12月	直近1年間累計	設定来累計
30円	30円	30円	30円	30円	360円	3,840円

主要な資産の状況

組入資産	投資対象	比率*1	組入上位銘柄	国名	比率*2
日本リートインデックス J-REITマザーファンド	日本リート	16.3%	日本ビルファンド投資法人 投資証券	日本	12.1%
			ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	日本	9.7%
			日本リテールファンド投資法人 投資証券	日本	7.1%
			ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	日本	6.1%
			森トラスト総合リート投資法人 投資証券	日本	5.0%
海外リートインデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外リート	16.8%	SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	アメリカ	6.7%
			PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.4%
			HCP INC	アメリカ	3.0%
			EQUITY RESIDENTIAL-REIT	アメリカ	3.0%
			WESTFIELD GROUP	オーストラリア	3.0%
日本債券インデックス マザーファンド	日本債券	16.4%	第299回利付国債(10年)	日本	2.5%
			第69回利付国債(5年)	日本	2.0%
			第60回利付国債(20年)	日本	1.8%
			第81回利付国債(5年)	日本	1.6%
			第290回利付国債(10年)	日本	1.5%
海外債券インデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外債券	16.4%	US TREASURY N/B(クーポン3.625%)	アメリカ	1.0%
			US TREASURY N/B(クーポン3.625%)	アメリカ	0.8%
			US TREASURY N/B(クーポン3.625%)	アメリカ	0.8%
			US TREASURY N/B(クーポン3.125%)	アメリカ	0.8%
			US TREASURY N/B(クーポン4.25%)	アメリカ	0.8%
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	日本株式	16.3%	トヨタ自動車	日本	3.3%
			三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	2.5%
			キヤノン	日本	2.1%
			本田技研工業	日本	2.0%
			日本電信電話	日本	1.8%
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	海外株式	16.6%	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	2.0%
			APPLE COMPUTER INC	アメリカ	1.8%
			INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ	1.1%
			CHEVRON CORP	アメリカ	1.0%
			MICROSOFT CORP	アメリカ	0.9%
現金その他		1.3%			

※1:当ファンドの対純資産総額比です。※2: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。

※2005年は設定時から2005年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。

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

(2) コースの選択

収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース＞と＜分配金受取りコース＞の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。

＜分配金再投資コース＞

- ・収益分配金を自動的に再投資するコースです。
- ・なお、販売会社によっては、収益分配金を定期的に受け取るための「定期引出契約」を結ぶことができる場合があります。

＜分配金受取りコース＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

(3) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(4) 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。

(5) 取得申込不可日

販売会社の営業日であっても、取得申込日がニューヨーク証券取引所の休業日またはニューヨークの銀行休業日に該当する場合は、取得の申込みの受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(6) 申込金額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。

(7) 申込単位

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

＜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。

(8) 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。

(9) 受付の中止および取消

委託会社は、投資対象とする投資信託証券（マザーファンドが投資対象とする投資信託証券を含みます。）への投資ができない場合、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。

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

(10) 償還乗換

- ・受益者は、証券投資信託の償還金額（手取額）の範囲内（単位型証券投資信託については、償還金額（手取額）とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する口数に係る申込手数料を徴収されない措置の適用を受けることができる場合があります。この償還乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・この措置の適用を受ける受益者は、販売会社から、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求められることがあります。

(11) 乗換優遇

受益者は、信託期間終了日の1年前以内などの一定の要件を満たした証券投資信託を解約または買取請求により換金した際の代金をもって、換金を行なった販売会社において、取得申込みをする場合の手数料率が割引となる措置の適用を受けることができます。この乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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) 解約請求不可日

販売会社の営業日であっても、解約請求日がニューヨーク証券取引所の休業日またはニューヨークの銀行休業日に該当する場合は、解約請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(4) 解約制限

ファンドの規模および商品性格などに基つき、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。

(5) 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。

(6) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額から所得税および地方税を差し引いた金額となります。税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(7) 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。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(8) 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。

(9) 受付の中止および取消

・委託会社は、投資対象とする投資信託証券(マザーファンドが投資対象とする投資信託証券を含みます。)からの換金ができない場合、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(この計算日が解約請求を受け付けられない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。)に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

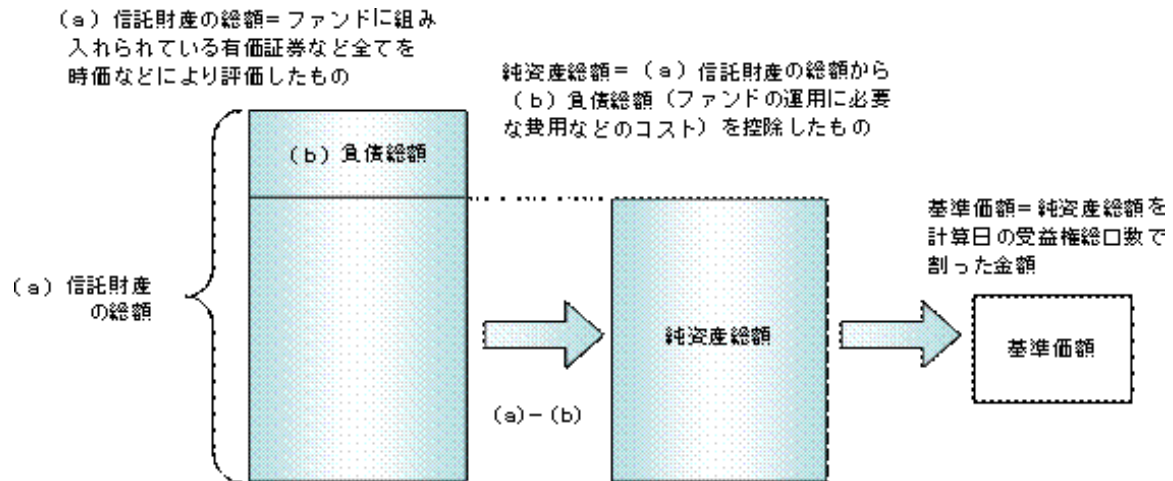
3【資産管理等の概要】

(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を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額(純資産総額)を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

< 主な資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場不動産投信

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。

海外上場不動産投信

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

公社債（国内・外国）

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

a) 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

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

c) 価格情報会社の提供する価額

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

^{*} 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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。

- 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17年9月29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】

毎月16日から翌月15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) 受益者の解約により受益権の口数が10億口を下回るようになった場合
 - ロ) 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
 - ハ) 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。

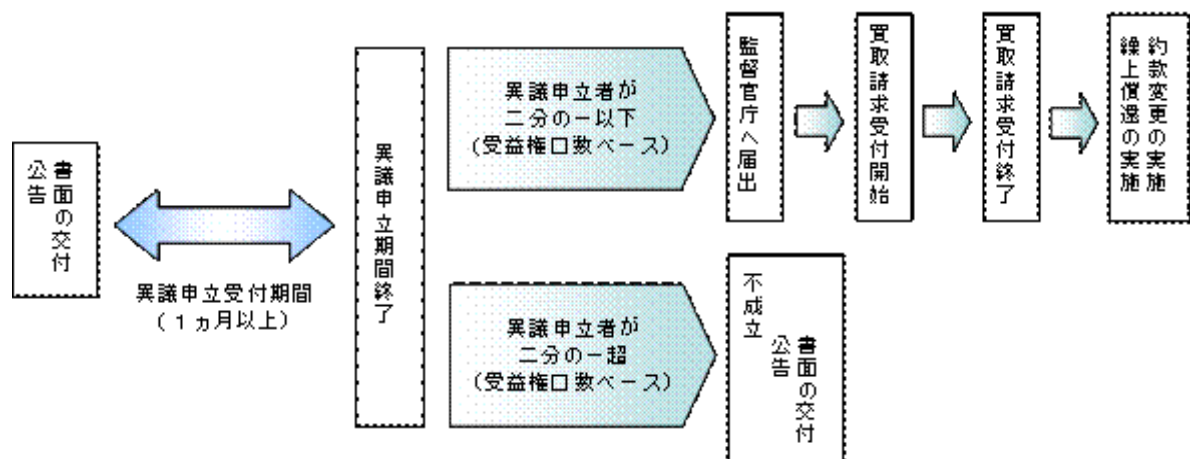
信託約款の変更

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

< 繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ >



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

委託会社は、年2回（6月、12月）および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。運用報告書は原則として知れている受益者に対して交付されます。

関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は、6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。

(3) 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、平成23年6月16日から平成23年12月15日までの特定期間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】

世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 平成23年6月15日現在	当期 平成23年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,602,792,108	1,213,672,230
親投資信託受益証券	75,806,900,981	59,015,495,429
未収入金	104,470,368	97,353,798
未収利息	2,399	2,250
流動資産合計	77,514,165,856	60,326,523,707
資産合計	77,514,165,856	60,326,523,707
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	425,058,884	380,944,234
未払解約金	110,399,669	97,905,075
未払受託者報酬	3,402,379	2,627,733
未払委託者報酬	61,243,033	47,299,371
その他未払費用	15,309,054	6,931,731
流動負債合計	615,413,019	535,708,144
負債合計	615,413,019	535,708,144
純資産の部		
元本等		
元本	141,686,294,783	126,981,411,480
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	64,787,541,946	67,190,595,917
（分配準備積立金）	125,884	99,433
元本等合計	76,898,752,837	59,790,815,563
純資産合計	76,898,752,837	59,790,815,563
負債純資産合計	77,514,165,856	60,326,523,707

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期	当期
	自 平成22年12月16日 至 平成23年 6月15日	自 平成23年 6月16日 至 平成23年12月15日
営業収益		
受取利息	442,628	341,021
有価証券売買等損益	449,869,782	6,969,423,567
営業収益合計	450,312,410	6,969,082,546
営業費用		
受託者報酬	21,971,513	17,822,929
委託者報酬	395,488,424	320,813,870
その他費用	6,782,167	8,420,808
営業費用合計	424,242,104	347,057,607
営業利益又は営業損失()	26,070,306	7,316,140,153
経常利益又は経常損失()	26,070,306	7,316,140,153
当期純利益又は当期純損失()	26,070,306	7,316,140,153
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()	36,353,657	60,472,786
期首剰余金又は期首欠損金()	69,373,638,378	64,787,541,946
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,908,771,111	7,806,185,624
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,908,771,111	7,806,185,624
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	641,427,224	559,510,139
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	641,427,224	559,510,139
分配金	2,670,964,104	2,394,062,089
期末剰余金又は期末欠損金()	64,787,541,946	67,190,595,917

(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。
-----------------	--

(追加情報)

当期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

前期 平成23年 6月15日現在		当期 平成23年12月15日現在	
1. 期首元本額	158,087,202,613円	1. 期首元本額	141,686,294,783円
期中追加設定元本額	1,451,825,844円	期中追加設定元本額	1,137,780,912円
期中一部解約元本額	17,852,733,674円	期中一部解約元本額	15,842,664,215円
2. 当特定期間末日における 受益権の総数	141,686,294,783口	2. 当特定期間末日における 受益権の総数	126,981,411,480口
3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回って おり、その差額は64,787,541,946円であります。		3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っ ており、その差額は67,190,595,917円でありま す。	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 平成22年12月16日 至 平成23年 6月15日		当期 自 平成23年 6月16日 至 平成23年12月15日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
	自 平成22年12月16日 至 平成23年1月17日		自 平成23年6月16日 至 平成23年7月15日
A 計算期末における費用控除 後の配当等収益	223,217,941円	A 計算期末における費用控除 後の配当等収益	138,303,808円
B 費用控除後、繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益	0円
C 信託約款に定める収益調整 金	6,414,417,353円	C 信託約款に定める収益調整 金	4,242,432,129円
D 信託約款に定める分配準備 積立金	973,883円	D 信託約款に定める分配準備 積立金	577,331円
E 分配対象収益(A+B+C+D)	6,638,609,177円	E 分配対象収益(A+B+C+D)	4,381,313,268円
F 分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0426円 426円	F 分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0315円 315円
G 分配金額	466,943,796円	G 分配金額	416,084,598円
H 分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0.0030円 30円	H 分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0.0030円 30円
	自 平成23年1月18日 至 平成23年2月15日		自 平成23年7月16日 至 平成23年8月15日
A 計算期末における費用控除 後の配当等収益	169,052,765円	A 計算期末における費用控除 後の配当等収益	76,752,061円
B 費用控除後、繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益	0円
C 信託約款に定める収益調整 金	6,042,089,334円	C 信託約款に定める収益調整 金	3,904,904,728円
D 信託約款に定める分配準備 積立金	1,191,719円	D 信託約款に定める分配準備 積立金	528,346円
E 分配対象収益(A+B+C+D)	6,212,333,818円	E 分配対象収益(A+B+C+D)	3,982,185,135円

F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0407円 407円	F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0291円 291円
G	分配金額	457,134,789円	G	分配金額	409,748,816円
H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0.0030円 30円	H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0.0030円 30円
		自 平成23年2月16日 至 平成23年3月15日			自 平成23年8月16日 至 平成23年9月15日
A	計算期末における費用控除 後の配当等収益	128,909,406円	A	計算期末における費用控除 後の配当等収益	116,636,862円
B	費用控除後、繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整 金	5,625,199,316円	C	信託約款に定める収益調整 金	3,520,399,136円
D	信託約款に定める分配準備 積立金	1,543,469円	D	信託約款に定める分配準備 積立金	252,335円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	5,755,652,191円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	3,637,288,333円
F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0386円 386円	F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0270円 270円
G	分配金額	446,801,778円	G	分配金額	403,779,573円
H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0.0030円 30円	H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0.0030円 30円
		自 平成23年3月16日 至 平成23年4月15日			自 平成23年9月16日 至 平成23年10月17日
A	計算期末における費用控除 後の配当等収益	321,524,728円	A	計算期末における費用控除 後の配当等収益	202,989,589円
B	費用控除後、繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整 金	5,232,613,989円	C	信託約款に定める収益調整 金	3,168,348,911円
D	信託約款に定める分配準備 積立金	524,769円	D	信託約款に定める分配準備 積立金	630,769円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	5,554,663,486円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	3,371,969,269円
F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0378円 378円	F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0255円 255円
G	分配金額	440,381,707円	G	分配金額	395,637,405円
H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0.0030円 30円	H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0.0030円 30円
		自 平成23年4月16日 至 平成23年5月16日			自 平成23年10月18日 至 平成23年11月15日
A	計算期末における費用控除 後の配当等収益	155,144,547円	A	計算期末における費用控除 後の配当等収益	80,532,367円
B	費用控除後、繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整 金	5,047,673,357円	C	信託約款に定める収益調整 金	2,917,821,323円
D	信託約款に定める分配準備 積立金	851,393円	D	信託約款に定める分配準備 積立金	505,240円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	5,203,669,297円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	2,998,858,930円
F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0359円 359円	F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0231円 231円
G	分配金額	434,643,150円	G	分配金額	387,867,463円
H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0.0030円 30円	H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0.0030円 30円
		自 平成23年5月17日 至 平成23年6月15日			自 平成23年11月16日 至 平成23年12月15日
A	計算期末における費用控除 後の配当等収益	94,160,460円	A	計算期末における費用控除 後の配当等収益	72,078,780円
B	費用控除後、繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益	0円

C	信託約款に定める収益調整金	4,653,139,515円	C	信託約款に定める収益調整金	2,564,356,701円
D	信託約款に定める分配準備積立金	11,663,399円	D	信託約款に定める分配準備積立金	527,038円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	4,758,963,374円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	2,636,962,519円
F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0335円 335円	F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0207円 207円
G	分配金額	425,058,884円	G	分配金額	380,944,234円
H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0.0030円 30円	H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0.0030円 30円

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

	前期 自 平成22年12月16日 至 平成23年 6月15日	当期 自 平成23年 6月16日 至 平成23年12月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	前期 平成23年 6月15日現在	当期 平成23年12月15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。	(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 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。	(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)

前期(平成23年6月15日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	最終の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	531,185,693
合計	531,185,693

当期(平成23年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	最終の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	822,256,122
合計	822,256,122

(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)

前期 平成23年 6月15日現在		当期 平成23年12月15日現在	
1口当たり純資産額	0.5427円	1口当たり純資産額	0.4709円
(1万口当たり純資産額)	(5,427円)	(1万口当たり純資産額)	(4,709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-KOKUSA I (ヘッジなし) マザーファンド	12,369,331,206	9,717,346,595	
	日本債券インデックスマザーファンド	8,103,620,132	9,986,901,450	
	海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド	7,105,744,372	9,934,541,206	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	17,340,753,396	9,776,716,764	
	日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	13,540,254,836	9,767,939,838	
	海外リートインデックス(ヘッジなし) マザーファンド	13,048,506,406	9,832,049,576	
親投資信託受益証券 合計		71,508,210,348	59,015,495,429	
合計		71,508,210,348	59,015,495,429	

(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。

(参考)

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

1. 「日本リートインデックス」-REITマザーファンドの状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

日本リートインデックス」-REITマザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

科目	対象年月日	平成23年 6月15日現在	平成23年12月15日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		84,933,303	112,708,595
投資証券		12,580,798,700	9,651,159,440
未収配当金		84,896,593	80,028,965
未収利息		127	208
流動資産合計		12,750,628,723	9,843,897,208
資産合計		12,750,628,723	9,843,897,208
負債の部			
流動負債			
未払解約金		9,032,007	81,202
流動負債合計		9,032,007	81,202
負債合計		9,032,007	81,202
純資産の部			
元本等			
元本		14,650,552,738	13,646,043,791
剰余金			
剰余金又は欠損金()		1,908,956,022	3,802,227,785
元本等合計		12,741,596,716	9,843,816,006
純資産合計		12,741,596,716	9,843,816,006
負債純資産合計		12,750,628,723	9,843,897,208

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

（追加情報）

当期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

平成23年 6月15日現在		平成23年12月15日現在	
1. 期首	平成22年12月16日	1. 期首	平成23年 6月16日
期首元本額	16,719,903,160円	期首元本額	14,650,552,738円
期首からの追加設定元本額	122,530,649円	期首からの追加設定元本額	8,421,279円
期首からの一部解約元本額	2,191,881,071円	期首からの一部解約元本額	1,012,930,226円
平成23年 6月15日現在の元本の内訳		平成23年12月15日現在の元本の内訳	
世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	14,551,064,025円	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	13,540,254,836円
財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	7,504,085円	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	10,392,007円
日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（代替資産）	26,847,033円	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（代替資産）	26,029,320円
3資産バランスファンド（適格機関投資家向け）	65,137,595円	3資産バランスファンド（適格機関投資家向け）	69,367,628円
計	14,650,552,738円	計	13,646,043,791円
2. 本報告書における開示対象ファンドの当特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	14,650,552,738口	2. 本報告書における開示対象ファンドの当特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	13,646,043,791口
3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,908,956,022円であります。		3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,802,227,785円であります。	

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

	自 平成22年12月16日 至 平成23年 6月15日	自 平成23年 6月16日 至 平成23年12月15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。当該有価証券の性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成23年 6月15日現在	平成23年12月15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) 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) 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23年6月15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
投資証券	1,545,996,335
合計	1,545,996,335

（平成23年12月15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
投資証券	2,306,712,162
合計	2,306,712,162

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成23年 6月15日現在		平成23年12月15日現在	
1口当たり純資産額	0.8697円	1口当たり純資産額	0.7214円
（1万口当たり純資産額）	（8,697円）	（1万口当たり純資産額）	（7,214円）

（3）附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	640	328,960,000	
	MIDリート投資法人 投資証券	603	115,293,600	
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	760	191,520,000	
	野村不動産レジデンシャル投資法人 投資証券	490	162,680,000	
	産業ファンド投資法人 投資証券	308	119,196,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,219	450,660,000	
	日本ビルファンド投資法人 投資証券	1,900	1,299,600,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	1,607	980,270,000	
	日本リテールファンド投資法人 投資証券	6,176	695,417,600	
	オリックス不動産投資法人 投資証券	934	301,682,000	
	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,349	445,840,200	

プレミア投資法人 投資証券	634	158,246,400	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	556	208,500,000	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	318	153,276,000	
野村不動産オフィスファンド投資法人 投資証券	1,002	395,289,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	6,909	556,174,500	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	795	475,410,000	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	3,688	25,189,040	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	637	423,605,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	2,286	82,296,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	486	309,096,000	
福岡リート投資法人 投資証券	404	205,232,000	
ケネディクス不動産投資法人 投資証券	941	203,538,300	
積水ハウス・S I 投資法人 投資証券	378	108,788,400	
いちご不動産投資法人 投資証券	2,768	73,352,000	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	1,300	207,350,000	
阪急リート投資法人 投資証券	281	92,589,500	
スタートプロシード投資法人 投資証券	355	35,145,000	
ジャパン・ホテル・アンド・リゾート投資法人 投資証券	347	57,844,900	
トップリート投資法人 投資証券	509	170,769,500	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人 投資証券	527	253,487,000	
日本ホテルファンド投資法人 投資証券	191	34,609,200	
日本賃貸住宅投資法人 投資証券	4,371	136,812,300	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	620	193,440,000	
投資証券 合計	49,289	9,651,159,440	
合計	49,289	9,651,159,440	

(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。

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

海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

科目	対象年月日	平成23年 6月15日現在	平成23年12月15日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		105,088,567	132,529,106
コール・ローン		7,603,949	17,905,988
投資証券		14,432,572,659	11,400,429,648
未収入金			18,644,707
未収配当金		20,312,679	24,516,888
未収利息		11	33
流動資産合計		14,565,577,865	11,594,026,370
資産合計		14,565,577,865	11,594,026,370
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定			3,600
未払解約金		4,506,286	17,116,245
流動負債合計		4,506,286	17,119,845
負債合計		4,506,286	17,119,845
純資産の部			
元本等			
元本		16,702,853,632	15,365,168,469
剰余金			
剰余金又は欠損金()		2,141,782,053	3,788,261,944
元本等合計		14,561,071,579	11,576,906,525
純資産合計		14,561,071,579	11,576,906,525
負債純資産合計		14,565,577,865	11,594,026,370

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

（追加情報）

当期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

平成23年 6月15日現在		平成23年12月15日現在	
1. 期首	平成22年12月16日	1. 期首	平成23年 6月16日
期首元本額	20,252,596,073円	期首元本額	16,702,853,632円
期首からの追加設定元本額	357,883,860円	期首からの追加設定元本額	245,061,585円
期首からの一部解約元本額	3,907,626,301円	期首からの一部解約元本額	1,582,746,748円
平成23年 6月15日現在の元本の内訳		平成23年12月15日現在の元本の内訳	
世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	14,484,590,603円	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	13,048,506,406円
日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（代替資産）	19,150,443円	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（代替資産）	19,010,227円
海外先進国REITインデックスファンド（適格機関投資家向け）	2,134,597,954円	海外先進国REITインデックスファンド（適格機関投資家向け）	2,228,594,067円
3資産バランスファンド（適格機関投資家向け）	64,514,632円	3資産バランスファンド（適格機関投資家向け）	69,057,769円
計	16,702,853,632円	計	15,365,168,469円
2. 本報告書における開示対象ファンドの当特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	16,702,853,632口	2. 本報告書における開示対象ファンドの当特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	15,365,168,469口
3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,141,782,053円であります。		3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,788,261,944円であります。	

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

	自 平成22年12月16日 至 平成23年 6月15日	自 平成23年 6月16日 至 平成23年12月15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為替予約があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成23年 6月15日現在	平成23年12月15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 「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 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23年6月15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
投資証券	1,858,341,409
合計	1,858,341,409

(平成23年12月15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
投資証券	1,240,303,862
合計	1,240,303,862

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(平成23年6月15日現在)

該当事項はありません。

(平成23年12月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	2,339,100		2,342,700	3,600
	米ドル	2,339,100		2,342,700	3,600
	合計	2,339,100		2,342,700	3,600

(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23年 6月15日現在		平成23年12月15日現在	
1口当たり純資産額	0.8718円	1口当たり純資産額	0.7535円
(1万口当たり純資産額)	(8,718円)	(1万口当たり純資産額)	(7,535円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ACADIA REALTY TRUST	11,972	227,707.44	
		AGREE REALTY CORPORATION	2,986	73,963.22	
		ALEXANDER'S INC	567	201,840.66	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	17,247	1,110,706.80	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	9,265	185,022.05	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	19,251	756,179.28	
		APARTMENT INVT&MGMT CO -A	33,522	711,336.84	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	19,508	151,382.08	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY CORPORATION	11,481	175,544.49	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	26,149	3,275,162.25	
		BIOMED REALTY TRUST INC	42,629	739,613.15	
		BOSTON PROPERTIES INC	40,848	3,825,415.20	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	38,060	320,845.80	
		BRE PROPERTIES-CL A	20,792	981,590.32	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	19,816	1,125,746.96	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	9,067	90,307.32	
		CAPLEASE INC	20,643	85,255.59	
		CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	41,131	607,916.18	
		CEDAR REALTY TRUST INC	17,256	70,231.92	
		CHATHAM LODGING TRUST	3,156	33,800.76	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	9,105	137,303.40	
		COGDELL SPENCER INC	15,734	58,687.82	
		COLONIAL PROPERTIES TRUST	24,054	459,671.94	
		COMMONWEALTH REIT	23,115	377,467.95	
		CORESITE REALTY CORP	5,913	100,580.13	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST	20,225	428,567.75	
		COUSINS PROPERTIES INC	28,442	166,954.54	
		CUBESMART	34,474	340,258.38	
		DCT INDUSTRIAL TRUST INC	68,990	317,354.00	
		DDR CORP	60,624	677,170.08	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	46,995	420,135.30	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	27,638	1,758,329.56	
		DOUGLAS EMMETT INC	35,364	624,528.24	
		DUKE REALTY CORPORATION	70,243	786,721.60	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	17,156	395,788.92			
EASTGROUP PROPERTIES INC	7,507	304,709.13			
EDUCATION REALTY TRUST INC	25,856	238,909.44			
ENTERTAINMENT PROPERTIES TRUST	12,888	544,002.48			
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	11,271	702,746.85			

EQUITY ONE INC	16,564	262,373.76	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	82,437	4,510,952.64	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,114	1,211,615.16	
EXCEL TRUST INC	8,321	98,603.85	
EXTRA SPACE STORAGE INC	26,179	603,164.16	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	17,446	1,561,940.38	
FELCOR LODGING TRUST INC	36,721	95,474.60	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	24,051	218,383.08	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	13,776	165,312.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	19,594	201,230.38	
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	169,440	2,380,632.00	
GETTY REALTY CORPORATION	7,938	103,749.66	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	3,471	60,707.79	
GLIMCHER REALTY TRUST	29,925	255,858.75	
HCP INC	113,155	4,366,651.45	
HEALTH CARE REIT INC	52,349	2,652,523.83	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	21,712	376,703.20	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	43,430	195,435.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	19,973	570,428.88	
HOME PROPERTIES INC	13,013	704,523.82	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	34,260	737,960.40	
HOST HOTELS & RESORTS INC	196,459	2,693,452.89	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	5,149	68,224.25	
INLAND REAL ESTATE CORPORATION	21,293	154,587.18	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	22,405	158,179.30	
KILROY REALTY CORPORATION	16,159	577,684.25	
KIMCO REALTY CORPORATION	113,250	1,755,375.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	19,464	84,473.76	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	23,530	524,013.10	
LEXINGTON REALTY TRUST	38,444	276,796.80	
LIBERTY PROPERTY TRUST	32,154	940,826.04	
LTC PROPERTIES INC	8,394	244,265.40	
MACK-CALI REALTY CORPORATION	24,037	603,809.44	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	31,230	289,189.80	
MID AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	10,254	595,039.62	
MISSION WEST PROPERTIES INC	4,720	36,013.60	
MONMOUTH RE INVST CORP	9,233	81,804.38	
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	7,729	334,047.38	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	28,034	697,205.58	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	28,428	523,643.76	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3,409	57,850.73	
PARKWAY PROPERTIES INC	6,715	63,993.95	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	14,112	256,838.40	
PENNSYLVANIA RE INVST TR	15,275	146,334.50	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	47,801	775,332.22	
POST PROPERTIES INC	13,933	570,277.69	
PROLOGIS INC	127,639	3,442,423.83	
PS BUSINESS PARKS INC	5,290	276,984.40	
PUBLIC STORAGE	39,374	5,000,498.00	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES TRUST	11,553	107,096.31	
REALTY INCOME CORP	35,219	1,187,936.87	
REGENCY CENTERS CORPORATION	24,974	881,332.46	
SAUL CENTERS INC	3,426	115,113.60	
SENIOR HOUSING PROPERTIES TRUST	44,763	957,928.20	

		SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	81,649	9,839,520.99	
		SL GREEN REALTY CORP	23,809	1,508,300.15	
		SOVRAN SELF STORAGE INC	7,760	309,313.60	
		STAG INDUSTRIAL INC	2,771	31,229.17	
		STRATEGIC HOTELS & RESORTS INC	45,314	221,132.32	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	8,180	75,092.40	
		SUN COMMUNITIES INC	6,022	203,061.84	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	32,425	231,190.25	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTERS INC	23,757	659,494.32	
		TAUBMAN CENTERS INC	16,126	983,202.22	
		TERRENO REALTY CORP	1,551	21,651.96	
		THE MACERICH COMPANY	36,697	1,772,832.07	
		UDR INC	61,019	1,434,556.69	
		UMH PROPERTIES INC	2,450	22,050.00	
		UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	3,471	127,767.51	
		URSTADT BIDDLE PROPERTIES- CL A	6,217	106,497.21	
		VENTAS INC	80,024	4,135,640.32	
		VORNADO REALTY TRUST	51,284	3,712,448.76	
		WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,132	477,596.88	
		WEINGARTEN REALTY INVESTORS	33,495	686,982.45	
		WINTHROP REALTY TRUST	7,823	72,832.13	
	投資証券小計		3,297,634	96,034,646.54 (7,500,305,894)	
米ドル合計				96,034,646.54 (7,500,305,894)	
加ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	6,735	166,691.25	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11,133	154,526.04	
		BOARDWALK EQUITIES INC	7,196	371,817.32	
		BROOKFIELD OFFICE PROPERTI-U	3,778	92,523.22	
		CALLOWAY REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	13,799	366,087.47	
		CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	11,779	258,549.05	
		CANADIAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,175	320,207.50	
		CANMARC REAL ESTATE INVESTMENT	7,418	118,762.18	
		CHARTWELL SENIORS HOUSING RE INVST TR	19,312	157,006.56	
		COMINAR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,293	202,587.40	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,245	71,069.75	
		DUNDEE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,372	272,508.60	
		EXTENDICARE REIT	11,741	83,243.69	
		H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	22,826	541,660.98	
		INNVEST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,240	57,244.80	
		MORGUARD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,625	121,542.50	
		NORTHERN PROPERTY RE INVST TR	3,916	117,714.96	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	5,406	59,466.00	
		PRIMARIS RETAIL RE INVST TR	10,819	223,087.78	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	36,619	927,925.46	
		TRANSGLOBE APARTMENT REAL ES	8,390	96,904.50	
		WHITEROCK REAL ESTATE INVEST	5,130	66,895.20	
	投資証券小計		239,947	4,848,022.21 (364,328,869)	
加ドル合計				4,848,022.21 (364,328,869)	

豪ドル	投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	72,546	139,651.05	
		ALE PROPERTY GROUP	39,682	81,348.10	
		ASPEN GROUP	190,794	84,903.33	
		ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	16,250	35,750.00	
		AUSTRALAND PROPERTY GROUP	66,366	173,878.92	
		BWP TRUST	112,141	197,928.86	
		CFS RETAIL PROPERTY TRUST	657,073	1,209,014.32	
		CHALLENGER DIVERSIFIED PROPERTY GROUP	142,307	71,865.03	
		CHARTER HALL GROUP	67,021	134,042.00	
		CHARTER HALL OFFICE REIT	116,635	415,220.60	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	69,394	228,306.26	
		COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	683,530	659,606.45	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	214,809	142,847.98	
		DEXUS PROPERTY GROUP	1,355,117	1,192,502.96	
		GOODMAN GROUP	1,841,520	1,058,874.00	
		GPT GROUP	478,282	1,530,502.40	
		INVESTA OFFICE FUND	805,914	483,548.40	
		MIRVAC GROUP	955,197	1,193,996.25	
		STOCKLAND	664,135	2,191,645.50	
		TISHMAN SPEYER OFFICE FUND	56,945	27,903.05	
	WESTFIELD GROUP	589,821	4,753,957.26		
WESTFIELD RETAIL TRUST	783,622	2,013,908.54			
	投資証券小計	9,979,101	18,021,201.26 (1,393,038,857)		
豪ドル合計			18,021,201.26 (1,393,038,857)		
英ポンド	投資証券	BIG YELLOW GROUP PLC	29,707	73,376.29	
		BRITISH LAND COMPANY PLC	246,698	1,095,339.12	
		CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	165,999	489,365.05	
		DERWENT LONDON PLC	23,007	343,954.65	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	88,201	279,332.56	
		HAMMERSON PLC	198,450	691,995.15	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	215,723	1,321,303.37	
		LONDON & STAMFORD PROPERTY PLC	153,120	159,397.92	
		METRIC PROPERTY INVESTMENTS PLC	56,599	49,382.62	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	20,777	64,824.24	
		SEGRO PLC	205,584	414,251.76	
		SHAFTESBURY PLC	69,331	321,349.18	
	WORKSPACE GROUP PLC	28,796	63,639.16		
	投資証券小計	1,501,992	5,367,511.07 (648,502,687)		
英ポンド合計			5,367,511.07 (648,502,687)		
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	729,000	2,128,680.00	
		FORTUNE REIT	337,000	1,233,420.00	
		LINK REIT	625,600	17,892,160.00	
		PROSPERITY REIT	255,000	377,400.00	
		REGAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	256,000	455,680.00	
		RREEF CHINA COMMERCIAL TRUST	201,000	874,350.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	356,000	783,200.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	178,000	605,200.00		
	投資証券小計	2,937,600	24,350,090.00 (244,231,402)		

香港ドル合計				24,350,090.00 (244,231,402)	
シンガポールドル	投資証券	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	118,000	110,330.00	
		ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	472,000	892,080.00	
		ASCOTT RESIDENCE TRUST	181,000	174,665.00	
		CACHE LOGISTICS TRUST	170,000	161,500.00	
		CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	315,320	149,777.00	
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	569,600	598,080.00	
		CAPITAMALL TRUST	731,200	1,199,168.00	
		CAPITARETAIL CHINA TRUST	123,000	140,220.00	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	181,000	288,695.00	
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	124,000	94,240.00	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	137,000	204,130.00	
		K-REIT ASIA	172,000	141,900.00	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	380,000	136,800.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	304,000	259,920.00	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	279,160	302,888.60	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	408,040	344,793.80	
		PARKWAY LIFE RE INVST TR	107,000	182,970.00	
		SAIZEN REIT	268,000	37,520.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	392,000	221,480.00	
	SUNTEC REIT	631,000	694,100.00		
	投資証券小計	6,063,320		6,335,257.40 (377,961,456)	
シンガポールドル合計				6,335,257.40 (377,961,456)	
ニュージーランドドル	投資証券	ARGOSY PROPERTY TRUST	145,013	115,285.33	
		DNZ PROPERTY FUND LTD	76,942	95,023.37	
		GOODMAN PROPERTY TRUST	216,644	211,227.90	
		KIWI INCOME PROPERTY TRUST	272,476	279,287.90	
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	71,193	77,600.37	
		投資証券小計	782,268		778,424.87 (45,561,207)
ニュージーランドドル合計				778,424.87 (45,561,207)	
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	1,919	84,148.15	
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	14,887	122,520.01	
		ALTAREA	391	46,138.00	
		ANF IMMOBILIER	3,056	80,984.00	
		BEFIMMO S.C.A.	4,011	189,740.35	
		BENI STABILI SPA	223,405	69,568.31	
		COFINIMMO	3,968	334,899.20	
		CORIO NV	25,741	783,813.45	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	10,084	228,503.44	
		FONCIERE DES REGIONS	10,855	475,069.07	
		GECINA SA	7,264	392,837.12	
		HAMBORNER REIT AG	9,046	57,089.30	
		ICADE	6,488	333,548.08	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	43,765	31,445.15	
		INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	1,507	27,864.43	
		KLEPIERRE	25,943	496,549.02	
		MERCIALYS	12,640	291,352.00	
		NIEUWE STEEN INVESTMENTS NV	14,772	125,562.00	
		SILIC	2,406	159,878.70	
		SOCIETE DE LA TOUR EIFFEL	1,751	59,534.00	

	UNIBAIL-RODAMCO SE	25,412	3,234,947.60	
	VASTNED RETAIL NV	5,183	148,181.97	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	2,484	89,175.60	
	WERELDHAVE NV	5,985	284,317.42	
	投資証券小計	462,963	8,147,666.37 (826,499,276)	
ユーロ合計			8,147,666.37 (826,499,276)	
合計			11,400,429,648 (11,400,429,648)	

(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	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 114銘柄	100.0%	65.9%
加ドル	投資証券 22銘柄	100.0%	3.2%
豪ドル	投資証券 22銘柄	100.0%	12.2%
英ポンド	投資証券 13銘柄	100.0%	5.7%
香港ドル	投資証券 8銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	投資証券 20銘柄	100.0%	3.3%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.0%	0.4%
ユーロ	投資証券 24銘柄	100.0%	7.2%

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。

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

日本債券インデックスマザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

科目	対象年月日	平成23年 6月15日現在	平成23年12月15日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		14,159,906	7,251,833
国債証券		26,208,376,170	23,864,637,050
地方債証券		2,401,190,000	2,204,429,000
特殊債証券		3,313,802,000	2,909,127,000
社債券		2,649,623,274	2,442,669,000
未収入金		25,443,900	20,180,600
未収利息		162,091,941	147,738,201
前払費用		4,013,914	2,180,951
流動資産合計		34,778,701,105	31,598,213,635
資産合計		34,778,701,105	31,598,213,635
負債の部			
流動負債			
未払解約金		32,740,956	23,862,664
流動負債合計		32,740,956	23,862,664
負債合計		32,740,956	23,862,664
純資産の部			
元本等			
元本		28,668,484,650	25,620,877,691
剰余金			
剰余金又は欠損金()		6,077,475,499	5,953,473,280
元本等合計		34,745,960,149	31,574,350,971
純資産合計		34,745,960,149	31,574,350,971
負債純資産合計		34,778,701,105	31,598,213,635

(2) 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られた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
-----------------	---

(追加情報)

当期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成23年 6月15日現在		平成23年12月15日現在	
1. 期首	平成22年12月16日	1. 期首	平成23年 6月16日
期首元本額	30,578,827,659円	期首元本額	28,668,484,650円
期首からの追加設定元本額	1,125,259,914円	期首からの追加設定元本額	690,490,696円
期首からの一部解約元本額	3,035,602,923円	期首からの一部解約元本額	3,738,097,655円
平成23年 6月15日現在の元本の内訳		平成23年12月15日現在の元本の内訳	
DCインデックスバランス(株式20)	419,644,882円	DCインデックスバランス(株式20)	433,848,015円
DCインデックスバランス(株式40)	525,720,501円	DCインデックスバランス(株式40)	515,017,547円
DCインデックスバランス(株式60)	376,337,204円	DCインデックスバランス(株式60)	355,547,367円
DCインデックスバランス(株式80)	62,268,175円	DCインデックスバランス(株式80)	58,915,442円
インデックスファンド日本債券(DC専用)	910,066,728円	インデックスファンド日本債券(DC専用)	959,984,903円
世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	10,402,240,794円	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	8,103,620,132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	10,066,311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	9,112,432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)	109,802,521円	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(債券資産)	106,928,217円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	8,380,323円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	7,538,772円

アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	52,754,083円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	45,492,795円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	224,957,634円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	198,839,706円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	828,433,846円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	752,222,676円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	8,071,974,311円	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	7,194,291,889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)	143,334,341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)	119,565,483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)	217,168,311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)	199,022,072円
3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	48,473,384円	3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	39,958,345円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	34,512,963円	グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	31,065,660円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	857,288,026円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	857,629,620円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	784,822,076円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	766,880,552円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	381,001,440円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	365,528,784円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	57,477,828円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	53,224,677円
年金積立インデックスファンド日本債券	4,031,109,649円	年金積立インデックスファンド日本債券	4,329,049,335円
日本債券インデックスファンド(個人型年金向け)	110,649,319円	日本債券インデックスファンド(個人型年金向け)	117,593,270円
計	28,668,484,650円	計	25,620,877,691円
2. 本報告書における開示対象ファンドの当特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	28,668,484,650円	2. 本報告書における開示対象ファンドの当特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	25,620,877,691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)

I 金融商品の状況に関する事項

	自 平成22年12月16日 至 平成23年 6月15日	自 平成23年 6月16日 至 平成23年12月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成23年 6月15日現在	平成23年12月15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23年6月15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	345,959,770
地方債証券	27,910,000
特殊債券	34,350,000
社債券	77,329,000
合計	485,548,770

（平成23年12月15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	18,861,350
地方債証券	1,186,000
特殊債券	2,056,000
社債券	9,173,000
合計	24,792,350

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成23年 6月15日現在		平成23年12月15日現在	
1口当たり純資産額	1.2120円	1口当たり純資産額	1.2324円
（1万口当たり純資産額）	（12,120円）	（1万口当たり純資産額）	（12,324円）

（3）附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第301回利付国債（2年）	70,000,000	70,060,200	
	第302回利付国債（2年）	120,000,000	120,110,400	
	第304回利付国債（2年）	70,000,000	70,072,800	
	第307回利付国債（2年）	40,000,000	40,049,200	
	第308回利付国債（2年）	220,000,000	219,903,200	
	第310回利付国債（2年）	40,000,000	40,056,800	
	第68回利付国債（5年）	170,000,000	171,671,100	
	第69回利付国債（5年）	633,000,000	637,962,720	
	第70回利付国債（5年）	227,000,000	228,920,420	
	第71回利付国債（5年）	45,000,000	45,660,600	

第72回利付国債(5年)	30,000,000	30,619,200
第74回利付国債(5年)	57,000,000	57,750,120
第75回利付国債(5年)	176,000,000	179,013,120
第76回利付国債(5年)	138,000,000	140,602,680
第78回利付国債(5年)	113,000,000	114,746,980
第79回利付国債(5年)	143,000,000	144,640,210
第81回利付国債(5年)	494,000,000	501,301,320
第83回利付国債(5年)	62,000,000	63,156,920
第84回利付国債(5年)	27,000,000	27,369,630
第85回利付国債(5年)	47,000,000	47,681,970
第87回利付国債(5年)	20,000,000	20,184,800
第88回利付国債(5年)	225,000,000	227,065,500
第89回利付国債(5年)	210,000,000	211,201,200
第90回利付国債(5年)	50,000,000	50,112,500
第91回利付国債(5年)	80,000,000	80,430,400
第92回利付国債(5年)	15,000,000	15,025,050
第93回利付国債(5年)	300,000,000	302,670,000
第94回利付国債(5年)	70,000,000	70,899,500
第95回利付国債(5年)	220,000,000	222,813,800
第97回利付国債(5年)	220,000,000	220,877,800
第98回利付国債(5年)	55,000,000	54,963,150
第99回利付国債(5年)	150,000,000	150,490,500
第100回利付国債(5年)	50,000,000	49,941,500
第2回利付国債(40年)	205,000,000	210,826,100
第4回利付国債(40年)	30,000,000	30,678,300
第245回利付国債(10年)	160,000,000	161,254,400
第247回利付国債(10年)	17,000,000	17,143,820
第250回利付国債(10年)	285,000,000	286,618,800
第251回利付国債(10年)	227,000,000	229,646,820
第252回利付国債(10年)	228,000,000	231,000,480
第253回利付国債(10年)	35,000,000	35,904,750
第254回利付国債(10年)	52,000,000	53,162,720
第256回利付国債(10年)	88,000,000	90,237,840
第258回利付国債(10年)	40,000,000	41,038,800
第259回利付国債(10年)	7,000,000	7,213,150
第261回利付国債(10年)	270,000,000	281,053,800
第262回利付国債(10年)	85,000,000	88,691,550
第264回利付国債(10年)	141,000,000	146,133,810
第265回利付国債(10年)	100,000,000	103,907,000
第266回利付国債(10年)	118,000,000	122,258,620
第268回利付国債(10年)	361,000,000	376,013,990
第269回利付国債(10年)	90,000,000	93,162,600
第270回利付国債(10年)	88,000,000	91,267,440
第271回利付国債(10年)	146,000,000	150,914,360
第272回利付国債(10年)	178,000,000	185,605,940
第273回利付国債(10年)	111,000,000	116,154,840
第274回利付国債(10年)	73,000,000	76,552,910
第276回利付国債(10年)	35,000,000	36,842,050
第278回利付国債(10年)	80,000,000	85,067,200

第279回利付国債(10年)	70,000,000	75,036,500	
第280回利付国債(10年)	156,000,000	167,077,560	
第281回利付国債(10年)	182,000,000	195,731,900	
第282回利付国債(10年)	274,000,000	291,692,180	
第283回利付国債(10年)	50,000,000	53,462,500	
第284回利付国債(10年)	107,000,000	114,154,020	
第285回利付国債(10年)	216,000,000	230,962,320	
第286回利付国債(10年)	156,000,000	167,976,120	
第287回利付国債(10年)	35,000,000	37,875,250	
第288回利付国債(10年)	18,000,000	19,309,860	
第289回利付国債(10年)	254,000,000	269,816,580	
第290回利付国債(10年)	446,000,000	471,453,220	
第291回利付国債(10年)	287,000,000	301,637,000	
第292回利付国債(10年)	241,000,000	259,224,420	
第293回利付国債(10年)	96,000,000	103,985,280	
第294回利付国債(10年)	32,000,000	34,460,160	
第295回利付国債(10年)	13,000,000	13,831,220	
第296回利付国債(10年)	196,000,000	208,594,960	
第297回利付国債(10年)	148,000,000	156,584,000	
第298回利付国債(10年)	221,000,000	232,248,900	
第299回利付国債(10年)	750,000,000	788,100,000	
第300回利付国債(10年)	31,000,000	33,029,260	
第301回利付国債(10年)	148,000,000	157,614,080	
第302回利付国債(10年)	79,000,000	83,564,620	
第303回利付国債(10年)	361,000,000	381,400,110	
第305回利付国債(10年)	358,000,000	374,840,320	
第306回利付国債(10年)	115,000,000	121,086,950	
第308回利付国債(10年)	140,000,000	146,034,000	
第309回利付国債(10年)	59,000,000	60,552,880	
第310回利付国債(10年)	268,000,000	272,049,480	
第311回利付国債(10年)	93,000,000	92,809,350	
第312回利付国債(10年)	15,000,000	15,438,900	
第313回利付国債(10年)	340,000,000	352,209,400	
第315回利付国債(10年)	85,000,000	87,078,250	
第316回利付国債(10年)	35,000,000	35,534,800	
第317回利付国債(10年)	165,000,000	167,133,450	
第318回利付国債(10年)	150,000,000	150,534,000	
第14回利付国債(30年)	208,000,000	230,757,280	
第15回利付国債(30年)	162,000,000	182,941,740	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	62,233,050	
第24回利付国債(30年)	158,000,000	178,464,160	
第26回利付国債(30年)	140,000,000	155,524,600	
第27回利付国債(30年)	134,000,000	151,704,080	
第28回利付国債(30年)	54,000,000	61,173,900	
第29回利付国債(30年)	246,000,000	273,638,100	
第30回利付国債(30年)	127,000,000	138,480,800	
第31回利付国債(30年)	20,000,000	21,342,200	
第32回利付国債(30年)	40,000,000	43,460,000	
第33回利付国債(30年)	50,000,000	50,977,000	

第34回利付国債(30年)	110,000,000	116,751,800	
第35回利付国債(30年)	40,000,000	40,605,600	
第23回利付国債(20年)	100,000,000	109,398,000	
第26回利付国債(20年)	37,000,000	41,389,310	
第27回利付国債(20年)	16,000,000	18,117,440	
第29回利付国債(20年)	110,000,000	126,203,000	
第31回利付国債(20年)	40,000,000	45,408,400	
第33回利付国債(20年)	200,000,000	232,732,000	
第34回利付国債(20年)	85,000,000	98,895,800	
第37回利付国債(20年)	63,000,000	72,602,460	
第39回利付国債(20年)	86,000,000	97,263,420	
第41回利付国債(20年)	27,000,000	28,757,430	
第42回利付国債(20年)	178,000,000	203,498,500	
第43回利付国債(20年)	73,000,000	85,403,430	
第44回利付国債(20年)	51,000,000	58,156,830	
第47回利付国債(20年)	21,000,000	23,443,350	
第48回利付国債(20年)	99,000,000	113,085,720	
第49回利付国債(20年)	57,000,000	63,110,970	
第50回利付国債(20年)	237,000,000	258,121,440	
第51回利付国債(20年)	39,000,000	42,829,800	
第54回利付国債(20年)	15,000,000	16,735,200	
第55回利付国債(20年)	66,000,000	72,370,980	
第57回利付国債(20年)	137,000,000	148,784,740	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	146,438,550	
第59回利付国債(20年)	33,000,000	35,080,320	
第60回利付国債(20年)	545,000,000	562,418,200	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	26,663,040	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	33,181,160	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	58,282,740	
第65回利付国債(20年)	140,000,000	150,991,400	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	36,291,940	
第67回利付国債(20年)	54,000,000	58,160,160	
第68回利付国債(20年)	38,000,000	42,214,960	
第70回利付国債(20年)	49,000,000	55,480,740	
第72回利付国債(20年)	42,000,000	46,078,200	
第73回利付国債(20年)	13,000,000	14,082,380	
第74回利付国債(20年)	78,000,000	85,461,480	
第76回利付国債(20年)	206,000,000	220,339,660	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	333,747,000	
第90回利付国債(20年)	156,000,000	171,361,320	
第91回利付国債(20年)	200,000,000	222,278,000	
第92回利付国債(20年)	210,000,000	227,516,100	
第94回利付国債(20年)	100,000,000	108,183,000	
第95回利付国債(20年)	182,000,000	201,575,920	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	105,792,960	
第97回利付国債(20年)	195,000,000	212,932,200	
第98回利付国債(20年)	44,000,000	47,454,000	
第99回利付国債(20年)	97,000,000	104,441,840	
第100回利付国債(20年)	140,000,000	152,502,000	

第101回利付国債(20年)	96,000,000	107,355,840	
第102回利付国債(20年)	106,000,000	118,460,300	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	12,139,710	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	35,431,110	
第105回利付国債(20年)	82,000,000	87,938,440	
第106回利付国債(20年)	142,000,000	154,273,060	
第107回利付国債(20年)	30,000,000	32,112,000	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	139,464,520	
第109回利付国債(20年)	119,000,000	123,657,660	
第110回利付国債(20年)	148,000,000	158,214,960	
第111回利付国債(20年)	90,000,000	97,448,400	
第113回利付国債(20年)	20,000,000	21,323,400	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	55,362,320	
第116回利付国債(20年)	185,000,000	199,689,000	
第117回利付国債(20年)	30,000,000	31,915,500	
第118回利付国債(20年)	70,000,000	73,264,100	
第119回利付国債(20年)	50,000,000	50,775,000	
第120回利付国債(20年)	70,000,000	68,869,500	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	22,657,800	
第122回利付国債(20年)	80,000,000	81,079,200	
第123回利付国債(20年)	55,000,000	58,411,100	
第124回利付国債(20年)	50,000,000	52,266,500	
第125回利付国債(20年)	80,000,000	86,175,200	
第126回利付国債(20年)	25,000,000	26,106,500	
第128回利付国債(20年)	20,000,000	20,540,600	
第129回利付国債(20年)	20,000,000	20,233,600	
第130回利付国債(20年)	80,000,000	80,824,000	
第131回利付国債(20年)	25,000,000	24,834,750	
国債証券 合計	22,634,000,000	23,864,637,050	
地方債証券			
第597回東京都公募公債	100,000,000	100,600,000	
第598回東京都公募公債	100,000,000	100,485,000	
第636回東京都公募公債	100,000,000	107,463,000	
第682回東京都公募公債	100,000,000	104,182,000	
第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	113,730,000	
第123回神奈川県公募公債	100,000,000	102,533,000	
第1回大阪府公募公債(7年)	100,000,000	102,604,000	
第261回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,480,000	
平成19年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	107,662,000	
平成15年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	102,240,000	
平成19年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	107,094,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	104,681,000	
平成18年度第1回広島県公募公債	100,000,000	107,924,000	
平成16年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	103,009,000	
平成16年度第3回千葉県公募公債	100,000,000	104,443,000	
平成17年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	103,532,000	
第55回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,790,000	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,078,000	
平成16年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	103,662,000	
第12回め号名古屋市公募公債	100,000,000	104,044,000	

	平成18年度第1回鹿児島県公募公債 (10年)	100,000,000	107,193,000	
地方債証券 合計		2,100,000,000	2,204,429,000	
特殊債券	第5回政府保証株式会社日本政策投資 銀行社債	100,000,000	105,496,000	
	第21回政府保証日本政策投資銀行債 券	100,000,000	106,652,000	
	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,828,000	
	第2回政府保証日本高速道路保有・債 務返済機構債券	100,000,000	107,772,000	
	第332回政府保証道路債券	100,000,000	103,566,000	
	第335回政府保証道路債券	100,000,000	103,501,000	
	第336回政府保証道路債券	100,000,000	103,582,000	
	第338回政府保証道路債券	100,000,000	104,048,000	
	第343回政府保証道路債券	100,000,000	103,591,000	
	第4回政府保証地方公営企業等金融機 構債券	100,000,000	104,813,000	
	第12回公営企業債券	100,000,000	103,431,000	
	第20回公営企業債券	100,000,000	107,282,000	
	第858回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,737,000	
	第199回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	104,066,000	
	第176回政府保証中小企業債券	100,000,000	102,511,000	
	第25回国際協力銀行債券	100,000,000	106,813,000	
	第14回政府保証国民生活債券	100,000,000	103,521,000	
	第8回農林漁業金融公庫債券	200,000,000	207,070,000	
	第3回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	102,934,000	
	第5回沖縄振興開発金融公庫債券	200,000,000	206,422,000	
	い第709号農林債	100,000,000	101,978,000	
	い第714号農林債	100,000,000	101,487,000	
	い第722号農林債	100,000,000	100,368,000	
	第227回信金中金債(5年)	100,000,000	102,157,000	
	第231回信金中金債(5年)	100,000,000	102,375,000	
	第234回信金中金債(5年)	100,000,000	102,126,000	
特殊債券 合計		2,800,000,000	2,909,127,000	

社債券	第324回東京交通債券	100,000,000	114,655,000	
	第5回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債(2010)	100,000,000	99,706,000	
	第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債(2011)	100,000,000	97,914,000	
	第32回住友化学株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	104,585,000	
	第6回株式会社資生堂無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,517,000	
	第16回太平洋セメント株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,289,000	
	第49回新日本製鐵株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,848,000	
	第20回三菱マテリアル株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,854,000	
	第15回株式会社豊田自動織機無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	104,657,000	
	第15回ダイキン工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	104,299,000	
	第11回パナソニック株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,511,000	

[次へ](#)

第17回三菱重工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,697,000	
第26回三井不動産株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	106,974,000	
第65回三菱地所株式会社無担保社債(担保提供制限等財務上特約無)	100,000,000	100,427,000	
第31回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,942,000	
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	108,201,000	
第25回日本郵船株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	111,930,000	
第47回日本電信電話株式会社電信電話債券(一般担保付)	100,000,000	100,819,000	
第7回KDDI株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	104,564,000	
第510回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	85,210,000	
第523回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	71,139,000	
第461回中部電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,685,000	
第306回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	113,641,000	
第257回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,605,000	
社債券 合計	2,400,000,000	2,442,669,000	
合計	29,934,000,000	31,420,862,050	

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

4. 「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

科目	対象年月日	平成23年 6月15日現在	平成23年12月15日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		58,567,665	18,247,723
コール・ローン		51,040,955	47,455,780
国債証券		527,637,499,649	425,973,071,719
派生商品評価勘定		20,670	2,938,530
未収入金		625,471,021	804,858,120
未収利息		7,114,577,795	5,336,539,367
前払費用		358,554,148	176,043,555
流動資産合計		535,845,731,903	432,359,154,794
資産合計		535,845,731,903	432,359,154,794
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,415,970	449,822
未払解約金		281,930,241	652,110,557
流動負債合計		283,346,211	652,560,379
負債合計		283,346,211	652,560,379
純資産の部			
元本等			
元本		367,182,282,134	308,777,721,673
剰余金			
剰余金又は欠損金()		168,380,103,558	122,928,872,742
元本等合計		535,562,385,692	431,706,594,415
純資産合計		535,562,385,692	431,706,594,415
負債純資産合計		535,845,731,903	432,359,154,794

(2) 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>

(追加情報)

当期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成23年 6月15日現在		平成23年12月15日現在	
1. 期首	平成22年12月16日	1. 期首	平成23年 6月16日
期首元本額	405,114,641,397円	期首元本額	367,182,282,134円
期首からの追加設定元本額	7,708,488,058円	期首からの追加設定元本額	1,002,705,836円
期首からの一部解約元本額	45,640,847,321円	期首からの一部解約元本額	59,407,266,297円
平成23年 6月15日現在の元本の内訳		平成23年12月15日現在の元本の内訳	
インデックスファンド海外債券ヘッジなし(DC専用)	9,390,380,096円	インデックスファンド海外債券ヘッジなし(DC専用)	9,717,747,025円
DCインデックスバランス(株式20)	53,552,829円	DCインデックスバランス(株式20)	58,705,371円
DCインデックスバランス(株式40)	96,660,230円	DCインデックスバランス(株式40)	101,761,036円
DCインデックスバランス(株式60)	124,106,771円	DCインデックスバランス(株式60)	126,144,162円
DCインデックスバランス(株式80)	103,167,894円	DCインデックスバランス(株式80)	103,347,068円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	211,131,055,606円	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	173,294,160,767円
世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	8,649,667,766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	7,105,744,372円
日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	117,458,336,101円	日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	100,040,243,465円
全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	51,796,189円	全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	49,758,961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)	1,467,679,641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)	1,411,087,492円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	8,701,907円	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	10,492,563円
日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(債券資産)	76,005,988円	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(債券資産)	76,715,712円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	6,952,756円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	6,589,961円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	8,759,543円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	8,012,496円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	20,759,806円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	19,411,414円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	52,739,802円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	50,621,389円

世界国債インデックス ファンド(適格機関投資 家向け)	2,686,860,273円	世界国債インデックス ファンド(適格機関投資 家向け)	1,387,686,464円
国際分散型ファンド40 (適格機関投資家向け)	2,194,026,244円	国際分散型ファンド40 (適格機関投資家向け)	2,114,722,674円
世界アセットバランス ファンド40(適格機関投 資家向け)	166,154,164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)	147,157,497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)	205,481,413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)	199,949,809円
3資産バランスファンド (適格機関投資家向け)	38,834,570円	3資産バランスファンド (適格機関投資家向け)	35,721,062円
グローバルバランスファ ンド35(適格機関投資家 向け)	64,122,725円	グローバルバランスファ ンド35(適格機関投資家 向け)	61,049,211円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式20)	54,663,698円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式20)	58,405,763円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式40)	72,290,862円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式40)	74,860,428円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式60)	63,495,645円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式60)	63,978,820円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式80)	47,408,596円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式80)	46,724,175円
年金積立 インデックス ファンド海外債券(ヘッ ジなし)	12,676,487,313円	年金積立 インデックス ファンド海外債券(ヘッ ジなし)	12,184,632,638円
海外債券インデックス ファンド(個人型年金向 け)	212,133,706円	海外債券インデックス ファンド(個人型年金向 け)	222,289,878円
計	367,182,282,134円	計	308,777,721,673円
2. 本報告書における開示対 象ファンドの当特定期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	367,182,282,134口	2. 本報告書における開示対 象ファンドの当特定期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	308,777,721,673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）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 平成22年12月16日 至 平成23年 6月15日	自 平成23年 6月16日 至 平成23年12月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成23年 6月15日現在	平成23年12月15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23年6月15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	20,125,923,661
合計	20,125,923,661

(平成23年12月15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	2,407,129,943
合計	2,407,129,943

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（平成23年6月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	532,089,000		533,484,300	1,395,300
	米ドル	257,637,580		257,824,000	186,420
	英ポンド	69,209,700		69,221,250	11,550
	スウェーデンクローナ	43,737,720		43,717,050	20,670
	ユーロ	161,504,000		162,722,000	1,218,000
合計		532,089,000		533,484,300	1,395,300

（平成23年12月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	827,657,768		825,169,060	2,488,708
	米ドル	335,371,400		335,787,000	415,600
	加ドル	32,362,859		32,230,770	132,089
	英ポンド	92,910,054		92,654,290	255,764
	デンマーククローネ	24,995,195		24,706,500	288,695
	ユーロ	342,018,260		339,790,500	2,227,760
合計		827,657,768		825,169,060	2,488,708

（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23年 6月15日現在		平成23年12月15日現在	
1口当たり純資産額	1.4586円	1口当たり純資産額	1.3981円
（1万口当たり純資産額）	（14,586円）	（1万口当たり純資産額）	（13,981円）

（3）附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-3.0%-16/08/31	9,800,000	10,807,562.50	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/01/31	10,400,000	11,553,750.00	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/12/31	13,400,000	14,959,843.75	
		US TREASURY N/B-2.75%-16/11/30	1,600,000	1,747,000.00	
		US TREASURY N/B-7.5%-16/11/15	10,200,000	13,487,906.25	
		US TREASURY N/B-4.625%-16/11/15	15,000,000	17,732,812.50	
		US TREASURY N/B-5.25%-29/02/15	4,700,000	6,488,203.12	
		US TREASURY N/B-3.0%-16/09/30	10,700,000	11,800,093.75	
		US TREASURY N/B-3.25%-17/03/31	14,200,000	15,886,250.00	
		US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	10,500,000	14,754,140.62	
		US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	10,200,000	13,165,968.75	
		US TREASURY N/B-6.375%-27/08/15	4,000,000	6,061,875.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-13/11/30	21,900,000	22,640,835.93	
		US TREASURY N/B-4.25%-13/11/15	22,000,000	23,674,062.50	
		US TREASURY N/B-2.75%-13/10/31	10,500,000	10,988,906.25	
		US TREASURY N/B-3.125%-16/10/31	11,900,000	13,205,281.25	
		US TREASURY N/B-1.875%-14/04/30	4,000,000	4,148,750.00	
		US TREASURY N/B-6.125%-29/08/15	5,600,000	8,470,875.00	
		US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	7,100,000	10,970,609.37	
		US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	4,500,000	6,403,359.37	
		US TREASURY N/B-4.75%-37/02/15	7,200,000	9,763,875.00	
		US TREASURY N/B-2.625%-14/07/31	17,000,000	18,013,359.37	
		US TREASURY N/B-2.625%-14/06/30	26,700,000	28,256,109.37	
		US TREASURY N/B-4.625%-17/02/15	13,250,000	15,742,656.25	
		US TREASURY N/B-4.75%-14/05/15	30,550,000	33,810,257.81	
		US TREASURY N/B-3.0%-17/02/28	5,400,000	5,969,531.25	
		US TREASURY N/B-1.75%-14/03/31	9,700,000	10,022,828.12	
		US TREASURY N/B-1.875%-14/02/28	11,300,000	11,691,968.75	
		US TREASURY N/B-4.0%-14/02/15	36,280,000	39,188,068.75	
		US TREASURY N/B-1.75%-14/01/31	13,800,000	14,226,937.50	
		US TREASURY N/B-1.5%-13/12/31	16,600,000	17,018,890.62	
		US TREASURY N/B-4.25%-13/08/15	34,400,000	36,689,750.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-14/05/31	6,600,000	6,911,953.12	
		US TREASURY N/B-1.375%-13/01/15	20,600,000	20,862,328.12	
		US TREASURY N/B-3.125%-13/09/30	27,400,000	28,814,953.12	
		US TREASURY N/B-1.75%-13/04/15	16,500,000	16,836,445.31	
		US TREASURY N/B-2.5%-13/03/31	12,800,000	13,179,000.00	
		US TREASURY N/B-1.375%-13/03/15	10,000,000	10,146,093.75	
		US TREASURY N/B-2.75%-13/02/28	10,900,000	11,233,812.50	
		US TREASURY N/B-3.875%-13/02/15	17,050,000	17,777,289.06	
		US TREASURY N/B-3.625%-13/05/15	43,200,000	45,279,000.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-13/01/31	10,000,000	10,301,562.50	
		US TREASURY N/B-1.375%-13/05/15	11,500,000	11,686,875.00	
		US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	18,300,000	24,633,515.62	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	17,700,000	22,935,328.12			
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	9,700,000	11,596,046.87			
US TREASURY N/B-3.375%-12/11/30	13,350,000	13,758,843.75			
US TREASURY N/B-1.125%-12/12/15	11,000,000	11,103,125.00			

US TREASURY N/B-3.625%-12/12/31	29,800,000	30,870,937.50	
US TREASURY N/B-1.375%-13/02/15	21,100,000	21,386,828.12	
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	20,300,000	27,909,328.12	
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	7,300,000	9,534,484.36	
US TREASURY N/B-3.375%-13/07/31	12,500,000	13,145,507.81	
US TREASURY N/B-1.0%-13/07/15	8,500,000	8,601,601.56	
US TREASURY N/B-3.375%-13/06/30	31,650,000	33,200,355.46	
US TREASURY N/B-1.125%-13/06/15	9,500,000	9,626,914.06	
US TREASURY N/B-3.5%-13/05/31	22,900,000	23,993,117.18	
US TREASURY N/B-3.125%-13/04/30	14,600,000	15,182,859.37	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	10,500,000	13,638,515.62	
US TREASURY N/B-3.125%-13/08/31	41,100,000	43,129,312.50	
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	19,500,000	24,804,609.37	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	12,600,000	16,578,843.75	
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	4,450,000	4,995,820.31	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	16,800,000	21,328,125.00	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	21,000,000	27,710,156.25	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	19,000,000	24,619,843.75	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	6,000,000	7,035,937.50	
US TREASURY N/B-3.25%-16/05/31	10,600,000	11,787,531.25	
US TREASURY N/B-7.5%-24/11/15	6,500,000	10,363,437.50	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	27,000,000	30,750,468.75	
US TREASURY N/B-8.125%-19/08/15	9,000,000	13,401,562.50	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	26,200,000	30,301,937.50	
US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	23,400,000	26,218,968.75	
US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	16,400,000	17,937,500.00	
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	34,500,000	39,685,781.25	
US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	16,500,000	19,173,515.62	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	7,950,000	12,558,515.62	
US TREASURY N/B-7.25%-16/05/15	9,000,000	11,581,875.00	
US TREASURY N/B-5.125%-16/05/15	27,000,000	32,205,937.50	
US TREASURY N/B-4.25%-14/08/15	13,000,000	14,348,750.00	
US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,700,000	4,095,140.62	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	5,100,000	7,021,265.62	
US TREASURY N/B-6.875%-25/08/15	5,000,000	7,699,218.75	
US TREASURY N/B-7.625%-25/02/15	3,000,000	4,849,218.75	
US TREASURY N/B-8.875%-19/02/15	5,000,000	7,592,187.50	
US TREASURY N/B-4.5%-15/11/15	30,400,000	35,045,500.00	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	40,000,000	46,343,749.99	
US TREASURY N/B-4.875%-16/08/15	12,000,000	14,270,625.00	
US TREASURY N/B-3.25%-16/07/31	24,200,000	26,952,750.00	
US TREASURY N/B-3.25%-16/06/30	11,000,000	12,240,937.50	
US TREASURY N/B-2.625%-16/04/30	6,800,000	7,365,250.00	
US TREASURY N/B-2.375%-16/03/31	9,200,000	9,864,125.00	
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	46,300,000	53,708,000.00	
US TREASURY N/B-4.5%-16/02/15	33,500,000	38,802,421.87	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	7,900,000	11,382,171.87	
US TREASURY N/B-4.25%-15/08/15	37,200,000	42,280,125.00	
US TREASURY N/B-1.75%-15/07/31	3,000,000	3,136,875.00	
US TREASURY N/B-1.875%-15/06/30	11,000,000	11,546,562.50	
US TREASURY N/B-2.125%-15/05/31	14,300,000	15,112,195.31	
US TREASURY N/B-4.125%-15/05/15	23,100,000	25,987,500.00	
US TREASURY N/B-2.5%-15/04/30	15,000,000	16,033,593.75	
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	2,000,000	2,153,750.00	

		US TREASURY N/B-2.625%-16/02/29	8,700,000	9,416,390.62	
		US TREASURY N/B-8.75%-17/05/15	8,000,000	11,310,000.00	
		US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	17,900,000	21,071,656.25	
		US TREASURY N/B-6.625%-27/02/15	4,000,000	6,154,375.00	
		US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	22,400,000	25,522,000.00	
		US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	22,400,000	26,488,000.00	
		US TREASURY N/B-8.875%-17/08/15	4,000,000	5,745,625.00	
		US TREASURY N/B-4.75%-17/08/15	22,000,000	26,554,687.50	
		US TREASURY N/B-2.375%-14/09/30	23,100,000	24,395,765.62	
		US TREASURY N/B-2.75%-17/05/31	11,100,000	12,137,156.25	
		US TREASURY N/B-2.375%-14/08/31	24,000,000	25,308,750.00	
		US TREASURY N/B-4.5%-17/05/15	14,100,000	16,728,328.12	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/04/30	7,000,000	7,788,593.75	
		US TREASURY N/B-7.25%-22/08/15	4,000,000	6,048,750.00	
		US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	12,000,000	18,744,375.00	
		US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	6,700,000	9,954,734.37	
		US TREASURY N/B-5.5%-28/08/15	4,870,000	6,868,982.81	
		US TREASURY N/B-2.5%-17/06/30	15,200,000	16,427,875.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-15/02/28	19,600,000	20,823,468.75	
		US TREASURY N/B-6.25%-23/08/15	9,300,000	13,293,187.50	
		US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	17,550,000	20,445,750.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-15/03/31	12,500,000	13,348,632.81	
		US TREASURY N/B-4.0%-15/02/15	17,000,000	18,915,156.25	
		US TREASURY N/B-11.25%-15/02/15	3,000,000	4,022,812.50	
		US TREASURY N/B-2.25%-15/01/31	18,100,000	19,137,921.87	
		US TREASURY N/B-2.625%-14/12/31	18,000,000	19,216,406.25	
		US TREASURY N/B-4.25%-14/11/15	22,800,000	25,361,437.50	
		US TREASURY N/B-2.375%-14/10/31	21,200,000	22,419,000.00	
		US TREASURY N/B-2.125%-14/11/30	10,700,000	11,249,210.93	
		US TREASURY N/B-7.125%-23/02/15	8,000,000	12,083,750.00	
	国債証券小計		1,994,050,000	2,284,473,313.05 (178,417,365,749)	
米ドル合計				2,284,473,313.05 (178,417,365,749)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-16/06/01	12,350,000	13,844,350.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	5,300,000	6,194,004.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-13/03/01	3,800,000	3,840,508.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-14/06/01	9,700,000	10,194,118.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	7,400,000	9,642,200.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-12/12/01	2,000,000	2,011,860.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-13/09/01	6,300,000	6,476,715.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.25%-13/06/01	14,500,000	15,422,345.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.5%-15/06/01	8,850,000	9,885,627.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	7,700,000	8,820,119.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-17/06/01	5,400,000	6,148,062.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-15/06/01	2,300,000	2,413,206.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-15/12/01	2,900,000	3,109,438.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-14/06/01	9,800,000	10,775,296.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-13/06/01	10,100,000	10,486,729.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-14/12/01	5,700,000	5,869,233.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	1,000,000	1,112,000.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-23/06/01	2,900,000	4,642,523.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-9.0%-25/06/01	1,430,000	2,558,827.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	4,200,000	7,295,316.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	2,800,000	4,108,776.00	

[次へ](#)

		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	6,350,000	9,697,085.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	7,350,000	10,661,175.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	5,450,000	6,156,538.00	
	国債証券小計		145,580,000	171,366,050.70 (12,878,158,710)	
加ドル合計				171,366,050.70 (12,878,158,710)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	3,900,000	4,489,527.90	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	6,250,000	7,178,187.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	7,300,000	7,688,469.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	6,900,000	7,611,666.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-18/01/21	1,300,000	1,442,027.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.0%-17/02/15	8,700,000	9,764,436.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.5%-13/05/15	7,600,000	7,940,822.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.25%-15/04/15	8,000,000	8,773,184.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-14/10/21	2,700,000	2,801,339.10	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.25%-14/06/15	6,200,000	6,664,708.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-13/12/15	4,400,000	4,600,666.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	1,800,000	2,037,774.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,450,000	1,533,431.55	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-16/06/15	4,700,000	4,988,138.20		
	国債証券小計		71,200,000	77,514,379.25 (5,991,861,516)	
豪ドル合計				77,514,379.25 (5,991,861,516)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-4.0%-16/09/07	12,100,000	13,825,563.57	
		UK TREASURY-2.0%-16/01/22	1,900,000	1,993,031.60	
		UK TREASURY-8.0%-15/12/07	6,600,000	8,493,680.91	
		UK TREASURY-4.75%-15/09/07	10,330,000	11,899,498.98	
		UK TREASURY-8.75%-17/08/25	5,300,000	7,511,564.81	
		UK TREASURY-5.0%-14/09/07	12,550,000	14,113,153.82	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	8,700,000	13,218,517.43	
		UK TREASURY-2.25%-14/03/07	10,000,000	10,423,755.10	
		UK TREASURY-8.0%-13/09/27	2,800,000	3,179,081.61	
		UK TREASURY-2.75%-15/01/22	10,000,000	10,679,804.90	
		UK TREASURY-5.0%-18/03/07	5,300,000	6,465,398.55	
		UK TREASURY-4.5%-19/03/07	9,300,000	11,185,304.55	
		UK TREASURY-3.75%-19/09/07	9,500,000	10,927,993.83	
		UK TREASURY-3.75%-20/09/07	4,400,000	5,058,897.40	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	3,200,000	3,663,600.00	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	5,800,000	6,776,249.67	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	8,440,000	10,867,932.35	
		UK TREASURY-4.5%-13/03/07	13,200,000	13,869,240.00	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	6,300,000	9,131,308.70	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	8,700,000	10,453,116.12	
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	11,000,000	13,513,441.92	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	8,900,000	10,708,380.23	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,700,000	2,064,486.80	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	5,900,000	7,429,271.68	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	8,400,000	10,397,370.73	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	9,150,000	11,238,565.82	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	7,450,000	8,912,725.40	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	7,900,000	10,051,929.42	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	8,950,000	11,309,059.88	

		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	8,750,000	10,550,260.96	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	7,000,000	8,429,631.98	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	8,100,000	10,531,646.16	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	7,750,000	9,607,589.05	
	国債証券小計		255,370,000	308,481,053.93 (37,270,680,935)	
英債券合計				308,481,053.93 (37,270,680,935)	
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-3.0%-18/01/08	2,200,000	2,552,594.00	
		SWITZERLAND-4.0%-13/02/11	890,000	931,621.74	
		SWITZERLAND-2.5%-16/03/12	5,700,000	6,285,977.10	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	4,350,000	5,786,330.85	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	1,330,000	1,889,421.94	
		SWITZERLAND-3.0%-19/05/12	1,600,000	1,885,564.80	
		SWITZERLAND-4.25%-14/01/06	3,640,000	3,956,851.08	
	国債証券小計		19,710,000	23,288,361.51 (1,908,248,342)	
スイスフラン合計				23,288,361.51 (1,908,248,342)	
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-13/07/01	3,000,000	3,089,600.01	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	1,650,000	1,883,805.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	1,000,000	1,097,866.67	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	1,950,000	2,181,205.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	2,150,000	2,427,421.65	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01	800,000	861,066.66	
		SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	2,300,000	2,709,860.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	1,470,000	1,574,541.49	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-15/07/01	2,350,000	2,537,608.32	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.375%-14/10/01	600,000	614,140.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.625%-14/07/01	2,770,000	2,991,230.67	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-17/04/01	1,000,000	1,077,166.67	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-13/04/01	1,300,000	1,321,655.82	
	SINGAPORE GOVERNMENT-3.75%-16/09/01	2,750,000	3,129,316.65		
国債証券小計		25,090,000	27,496,484.61 (1,640,440,271)		
シンガポールドル合計				27,496,484.61 (1,640,440,271)	
マレーシアリンギット	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT-4.012%-17/09/15	4,000,000	4,124,000.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.461%-13/07/31	5,000,000	5,056,500.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	2,800,000	2,636,786.60	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	4,000,000	4,194,200.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	4,800,000	4,971,200.01	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	6,900,000	7,246,725.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	9,000,000	9,516,119.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.814%-17/02/15	4,500,000	4,587,297.79	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.72%-15/09/30	6,200,000	6,529,938.33	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.835%-15/08/12	2,000,000	2,043,333.34	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.741%-15/02/27	4,000,000	4,075,600.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.094%-14/04/30	13,300,000	13,939,046.24	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.702%-13/02/25	6,500,000	6,574,641.64	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.21%-13/05/31	3,900,000	3,926,325.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	3,800,000	4,329,015.02	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.262%-16/09/15	6,000,000	6,262,800.00	
MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	2,650,000	3,052,800.00			

	国債証券小計		89,350,000	93,066,328.37 (2,272,679,738)	
マレーシアリングット合計				93,066,328.37 (2,272,679,738)	
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-6.75%-14/05/05	34,100,000	38,497,700.60	
		SWEDISH GOVERNMENT-4.5%-15/08/12	26,180,000	29,272,240.30	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.0%-16/07/12	19,900,000	21,518,338.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.75%-17/08/12	23,200,000	26,057,957.35	
		SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	29,400,000	34,519,844.03	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	29,500,000	37,258,811.78	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	18,300,000	23,720,931.35	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	18,000,000	21,316,968.00	
	国債証券小計		198,580,000	232,162,791.91 (2,593,258,385)	
スウェーデンクローナ合計				232,162,791.91 (2,593,258,385)	
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	13,150,000	15,009,212.75	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-6.5%-13/05/15	26,200,000	28,201,260.80	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.25%-17/05/19	15,200,000	16,930,580.26	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-5.0%-15/05/15	22,400,000	25,207,190.40	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	12,300,000	14,398,355.40	
	国債証券小計		89,250,000	99,746,599.61 (1,301,693,124)	
ノルウェークローネ合計				99,746,599.61 (1,301,693,124)	
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-5.0%-13/11/15	34,100,000	37,099,333.70	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	45,600,000	53,455,329.60	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	44,200,000	65,287,024.40	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-15/11/15	54,300,000	60,965,325.00	
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	13,750,000	21,180,706.25	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-17/11/15	25,600,000	29,593,651.20	
	国債証券小計		217,550,000	267,581,370.15 (3,652,485,702)	
デンマーククローネ合計				267,581,370.15 (3,652,485,702)	
メキシコペ ソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-13/12/19	73,000,000	77,519,450.44	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-9.0%-12/12/20	84,000,000	89,165,480.62	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	71,000,000	90,767,045.39	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	59,500,000	65,684,603.14	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-9.5%-14/12/18	69,000,000	77,556,509.91	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	31,700,000	39,019,524.92	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-17/12/14	45,800,000	50,349,155.99	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	33,200,000	35,475,294.26	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%-16/12/15	41,200,000	44,174,208.22	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	81,300,000	89,330,099.36	
	国債証券小計		589,700,000	659,041,372.25 (3,710,402,925)	
メキシコペソ合計				659,041,372.25 (3,710,402,925)	

ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	11,100,000	10,601,055.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	5,000,000	4,857,200.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-14/04/25	13,800,000	14,033,220.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-13/10/24	14,300,000	14,345,045.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.25%-15/10/24	12,900,000	13,357,305.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-15/04/25	10,600,000	10,713,950.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-16/04/25	11,500,000	11,364,300.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	13,500,000	13,322,475.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-13/04/25	21,200,000	21,328,260.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	8,300,000	8,176,330.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	11,000,000	10,814,650.00	
国債証券小計			133,200,000	132,913,790.00 (2,962,648,379)	
ポーランドズロチ合計				132,913,790.00 (2,962,648,379)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-3.5%-15/03/28	2,650,000	2,629,035.58	
		BELGIUM KINGDOM-8.0%-12/12/24	4,400,000	4,666,798.84	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-13/03/28	4,800,000	4,876,636.32	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-13/09/28	6,600,000	6,716,755.98	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	3,350,000	3,180,221.33	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-14/03/28	5,400,000	5,456,222.10	
		BELGIUM KINGDOM-3.25%-16/09/28	7,340,000	7,157,762.48	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	1,900,000	1,898,831.50	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-17/03/28	6,000,000	5,974,948.80	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-14/09/28	5,300,000	5,392,608.48	
		BELGIUM KINGDOM-2.75%-16/03/28	1,500,000	1,440,483.60	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	6,550,000	6,967,587.39	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-15/09/28	5,200,000	5,221,145.28	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-18/03/28	4,100,000	4,063,904.42	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-17/09/28	5,600,000	5,971,477.68	
		BELGIUM KINGDOM-8.0%-15/03/28	3,300,000	3,720,192.30	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	7,000,000	7,726,096.70	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	4,950,000	4,876,149.46	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	6,500,000	6,216,595.45	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	4,800,000	4,712,977.44	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	5,800,000	5,602,482.16	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.75%-14/07/30	9,100,000	9,206,230.67	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-3.0%-15/04/30	1,300,000	1,245,503.61	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-2.3%-13/04/30	4,500,000	4,392,962.55	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.2%-13/07/30	8,950,000	8,960,826.81	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-2.5%-13/10/31	1,000,000	972,023.50	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.25%-14/01/31	9,700,000	9,706,783.21	
B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-6.15%-13/01/31	9,750,000	9,963,689.77			
B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.0%-20/04/30	5,200,000	4,716,273.64			
B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.7%-41/07/30	4,200,000	3,269,481.60			

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%-40/07/30	7,000,000	5,604,151.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	7,500,000	5,497,308.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%-32/07/30	7,000,000	6,512,801.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31	7,850,000	7,548,579.62	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%-26/07/30	2,200,000	2,117,891.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%-24/01/31	8,300,000	7,413,726.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%-20/10/31	9,300,000	8,862,891.63	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.3%-14/10/31	7,000,000	6,810,748.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%-19/10/31	7,100,000	6,634,287.57	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%-19/07/30	6,300,000	6,031,819.08	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%-18/07/30	6,700,000	6,309,629.19	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-17/07/30	8,050,000	8,210,751.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%-17/01/31	8,150,000	7,728,736.28	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%-25/07/30	4,100,000	3,546,937.88	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%-15/01/31	13,100,000	13,111,618.39	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%-16/01/31	13,300,000	12,587,723.82	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-21/04/30	4,200,000	4,133,736.18	
BUNDES OBLIGATION-2.25%-15/04/10	5,500,000	5,806,616.75	
BUNDES OBLIGATION-2.5%-14/10/10	5,750,000	6,084,260.72	
BUNDES OBLIGATION-2.5%-15/02/27	8,900,000	9,453,117.20	
BUNDES OBLIGATION-2.25%-14/04/11	7,000,000	7,329,717.50	
BUNDES OBLIGATION-4.0%-13/10/11	9,800,000	10,464,944.70	
BUNDES OBLIGATION-3.5%-13/04/12	18,500,000	19,312,277.65	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-13/07/04	14,300,000	15,082,890.67	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-14/01/04	12,800,000	13,842,282.24	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-17/07/04	8,750,000	10,239,883.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.5%-13/01/04	20,300,000	21,241,676.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%-19/07/04	11,200,000	12,740,271.04	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%-16/01/04	26,100,000	29,033,044.92	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.0%-16/06/20	4,400,000	5,380,620.08	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-15/07/04	12,700,000	13,888,520.61	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-17/01/04	8,800,000	10,018,865.12	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-18/01/04	10,200,000	11,859,008.58	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-18/07/04	8,900,000	10,531,367.33	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-14/07/04	11,500,000	12,634,230.05	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-19/01/04	11,300,000	13,020,188.83	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-39/07/04	7,000,000	9,523,089.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-40/07/04	6,600,000	9,735,126.72	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-16/07/04	10,860,000	12,410,765.64	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04	9,800,000	12,539,709.56	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-20/01/04	12,900,000	14,450,439.39	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-15/01/04	14,500,000	15,924,343.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	6,550,000	9,439,153.91	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-21/07/04	12,500,000	14,008,083.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-34/07/04	9,000,000	12,433,282.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%-20/07/04	13,600,000	14,984,172.64	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-30/01/04	4,650,000	7,119,642.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	7,400,000	10,578,586.38	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%-27/07/04	7,600,000	11,582,205.44	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	6,700,000	9,470,385.68	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-28/07/04	4,780,000	6,213,437.39	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-42/07/04	5,500,000	6,520,616.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	10,600,000	9,584,669.46	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-23/08/01	8,500,000	6,918,704.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-17/08/01	11,500,000	10,700,447.55	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-39/08/01	10,600,000	8,046,577.66	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	8,700,000	5,881,837.71	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	9,800,000	7,481,725.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%-33/02/01	7,700,000	6,298,728.59	

BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	8,400,000	6,380,554.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-18/08/01	10,900,000	9,592,388.04	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%-15/06/15	1,600,000	1,437,196.64	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-15/08/01	18,700,000	17,130,164.92	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-16/08/01	20,200,000	17,952,939.88	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-15/02/01	16,000,000	15,103,084.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-14/08/01	15,300,000	14,610,350.97	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-14/06/01	5,500,000	5,167,773.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-13/12/15	19,300,000	18,516,005.05	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-13/08/01	20,150,000	19,659,740.42	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01	14,700,000	12,427,459.38	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-13/04/15	12,300,000	12,025,796.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	10,800,000	8,548,489.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-17/02/01	9,600,000	8,530,339.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%-15/04/15	6,700,000	6,041,921.98	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-18/02/01	10,500,000	9,319,580.55	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-19/02/01	10,400,000	8,960,229.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-19/03/01	10,600,000	9,225,900.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-19/09/01	10,290,000	8,735,655.36	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-20/02/01	9,700,000	8,332,531.83	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-20/03/01	10,300,000	8,728,332.27	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-20/09/01	10,350,000	8,514,064.21	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-21/08/01	18,800,000	14,934,357.16	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-21/09/01	7,700,000	6,645,354.87	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-13/06/01	2,900,000	2,745,672.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%-23/11/01	8,210,000	8,851,400.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-25/03/01	15,000,000	12,189,225.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-26/11/01	7,000,000	6,944,936.60	

BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-12/12/15	3,800,000	3,672,900.64	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-13/02/01	11,500,000	11,373,165.35	
FINNISH GOVERNMENT-5.375%-13/07/04	3,350,000	3,601,689.18	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	4,350,000	4,952,983.08	
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	1,200,000	1,304,811.84	
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	2,550,000	2,742,368.94	
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	2,900,000	3,315,376.28	
FINNISH GOVERNMENT-3.875%-17/09/15	3,550,000	3,934,632.56	
FINNISH GOVERNMENT-3.125%-14/09/15	3,100,000	3,294,250.03	
FINNISH GOVERNMENT-1.75%-16/04/15	1,180,000	1,201,940.09	
FINNISH GOVERNMENT-4.25%-15/07/04	4,550,000	5,040,793.94	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-13/04/25	9,600,000	10,021,780.80	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	9,570,000	11,999,055.48	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-12/12/26	4,360,000	4,700,760.59	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-13/10/25	19,400,000	20,446,781.32	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-14/04/25	12,000,000	12,747,399.60	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-14/10/25	11,900,000	12,723,740.61	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	3,600,000	3,910,778.64	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	7,500,000	8,091,396.00	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	7,600,000	8,898,991.24	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	9,650,000	10,402,069.85	
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	10,700,000	14,111,456.39	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	9,800,000	12,598,262.60	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	11,600,000	12,683,575.72	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	9,000,000	13,399,057.80	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	6,000,000	6,019,122.00	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-18/04/25	10,500,000	11,313,268.05	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	2,300,000	2,197,094.09	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	7,800,000	9,288,605.04	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	19,500,000	20,446,916.10	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-19/10/25	6,550,000	9,084,564.42	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-15/04/25	16,850,000	17,829,244.49	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-18/10/25	8,400,000	9,154,750.92	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	13,900,000	14,372,834.91	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	9,200,000	9,714,083.12	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-17/10/25	10,600,000	11,575,814.80	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-17/04/25	10,000,000	10,666,057.00	
FRANCE (GOVT OF)-5.0%-16/10/25	14,600,000	16,435,980.66	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-16/04/25	22,700,000	23,793,926.62	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-15/10/25	18,360,000	19,097,214.58	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25	10,800,000	11,767,879.80	
FRANCE(GOVT OF)-3.5%-26/04/25	7,000,000	7,066,412.50	
FRENCH TREASURY NOTE-3.75%-13/01/12	6,700,000	6,918,956.67	
FRENCH TREASURY NOTE-4.5%-13/07/12	12,900,000	13,633,683.63	
FRENCH TREASURY NOTE-2.5%-14/01/12	8,810,000	9,046,501.80	
FRENCH TREASURY NOTE-3.0%-14/07/12	7,300,000	7,592,735.11	
FRENCH TREASURY NOTE-2.0%-15/07/12	1,600,000	1,611,155.20	
FRENCH TREASURY NOTE-2.5%-15/01/15	7,100,000	7,282,543.84	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	4,450,000	5,626,991.18	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	5,650,000	7,157,026.19	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-15/01/15	7,550,000	7,960,104.67	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.5%-17/07/15	7,800,000	8,965,788.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-15/07/15	7,120,000	7,663,281.63	

	NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	6,800,000	7,731,398.72	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	4,600,000	6,333,121.30	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-4.25%-13/07/15	10,500,000	11,132,840.25	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-14/07/15	8,450,000	9,093,994.78	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-13/01/15	5,100,000	5,180,270.43	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-16/07/15	8,100,000	9,059,841.09	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	7,200,000	8,136,611.28	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	9,800,000	10,815,673.96	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	2,000,000	2,163,620.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	4,400,000	4,960,660.32	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	5,500,000	8,197,726.90	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-14/07/15	5,150,000	5,515,144.78	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	5,700,000	6,207,233.31	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-15/07/15	5,700,000	6,014,914.17	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.0%-16/09/15	5,000,000	5,404,094.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.2%-17/02/20	2,700,000	2,797,236.45	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-17/09/15	3,550,000	3,867,529.04	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-14/10/20	5,600,000	5,884,541.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	6,280,000	6,672,294.01	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	6,300,000	6,545,215.53	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	3,400,000	3,542,299.18	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	3,550,000	4,165,632.83	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	5,350,000	6,081,969.34	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	5,600,000	6,208,811.84	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-13/10/20	5,500,000	5,761,210.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	3,600,000	4,850,631.36	
	国債証券小計	1,625,610,000	1,689,404,060.96 (171,373,147,943)	
ユーロ合計			1,689,404,060.96 (171,373,147,943)	
合計			425,973,071,719 (425,973,071,719)	

(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 132銘柄	100.0%	42.0%
加ドル	国債証券 24銘柄	100.0%	3.0%
豪ドル	国債証券 14銘柄	100.0%	1.4%
英ポンド	国債証券 33銘柄	100.0%	8.7%
スイスフラン	国債証券 7銘柄	100.0%	0.4%
シンガポールドル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 17銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.9%
メキシコペソ	国債証券 10銘柄	100.0%	0.9%
ポーランドズロチ	国債証券 11銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 196銘柄	100.0%	40.2%

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。

[次へ](#)

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

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

科目	対象年月日	平成23年 6月15日現在	平成23年12月15日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		101,863,536	55,423,498
株式		28,189,407,645	24,351,426,960
派生商品評価勘定		6,755,875	
前払金			329,000
未収入金		21,744,240	80,331,035
未収配当金		267,475,799	3,490,900
未収利息		152	102
流動資産合計		28,587,247,247	24,491,001,495
資産合計		28,587,247,247	24,491,001,495
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定			1,841,332
前受金		5,640,000	
未払解約金		37,589,257	40,148,619
流動負債合計		43,229,257	41,989,951
負債合計		43,229,257	41,989,951
純資産の部			
元本等			
元本		45,027,017,801	43,362,058,829
剰余金			
剰余金又は欠損金()		16,482,999,811	18,913,047,285
元本等合計		28,544,017,990	24,449,011,544
純資産合計		28,544,017,990	24,449,011,544
負債純資産合計		28,587,247,247	24,491,001,495

(2) 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>

(追加情報)

当期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成23年 6月15日現在		平成23年12月15日現在	
1. 期首	平成22年12月16日	1. 期首	平成23年 6月16日
期首元本額	46,429,117,830円	期首元本額	45,027,017,801円
期首からの追加設定元本額	3,956,039,383円	期首からの追加設定元本額	1,750,857,500円
期首からの一部解約元本額	5,358,139,412円	期首からの一部解約元本額	3,415,816,472円
平成23年 6月15日現在の元本の内訳		平成23年12月15日現在の元本の内訳	
DCインデックスバランス(株式20)	185,847,387円	DCインデックスバランス(株式20)	216,204,285円
DCインデックスバランス(株式40)	667,528,406円	DCインデックスバランス(株式40)	747,371,185円
DCインデックスバランス(株式60)	1,284,278,751円	DCインデックスバランス(株式60)	1,395,199,400円
DCインデックスバランス(株式80)	1,420,820,685円	DCインデックスバランス(株式80)	1,509,813,404円
インデックスファンド日本株式(DC専用)	828,274,870円	インデックスファンド日本株式(DC専用)	881,676,744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	20,158,016,123円	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	17,340,753,396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	19,331,197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	19,553,782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)	127,486,326円	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(株式資産)	118,365,522円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	194,103,070円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	192,255,971円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	182,105,187円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	176,957,741円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	285,418,160円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	283,710,194円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	361,660,780円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	368,386,630円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	14,942,605,343円	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	15,407,737,370円
世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け)	107,776,664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)	103,443,856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)	116,591,298円	世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け)	122,967,723円
3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	90,100,162円	3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	89,641,490円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	81,372,148円	グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	82,879,530円

年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式20)	376,887,024円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式20)	430,655,536円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式40)	994,721,014円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式40)	1,095,010,079円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式60)	1,302,046,390円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式60)	1,409,352,903円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式80)	1,300,046,816円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式80)	1,370,122,088円
計	45,027,017,801円	計	43,362,058,829円
2. 本報告書における開示対 象ファンドの当特定期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	45,027,017,801口	2. 本報告書における開示対 象ファンドの当特定期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	43,362,058,829口
3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、そ の差額は16,482,999,811円であります。		3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、 その差額は18,913,047,285円であります。	
4. 担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券 として担保に供している資産は次のとおりであります。		4. 担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券 として担保に供している資産は次のとおりでありま す。	
株式	235,813,000円	株式	203,549,000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）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 平成22年12月16日 至 平成23年 6月15日	自 平成23年 6月16日 至 平成23年12月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成23年 6月15日現在	平成23年12月15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23年6月15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	181,585,705
合計	181,585,705

(平成23年12月15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	725,580,256
合計	725,580,256

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成23年6月15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	322,960,000		329,800,000	6,840,000
	合計	322,960,000		329,800,000	6,840,000

(平成23年12月15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	81,344,000		79,530,000	1,814,000
	合計	81,344,000		79,530,000	1,814,000

(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23年 6月15日現在		平成23年12月15日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.6339円 (6,339円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.5638円 (5,638円)

(3) 附属明細表
第1 有価証券明細表
(1) 株式

(単位:円)

	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
1301	極洋	11,000	175.00	1,925,000	
1332	日本水産	32,100	256.00	8,217,600	
1334	マルハニチロホールディングス	55,000	133.00	7,315,000	
1377	サカタのタネ	4,100	1,075.00	4,407,500	
1379	ホクト	2,800	1,696.00	4,748,800	
1514	住石ホールディングス	8,800	70.00	616,000	
1515	日鉄鉱業	7,000	304.00	2,128,000	
1518	三井松島産業	18,000	140.00	2,520,000	
1605	国際石油開発帝石	336	479,500.00	161,112,000	
1606	日本海洋掘削	700	2,285.00	1,599,500	
1661	関東天然瓦斯開発	3,000	387.00	1,161,000	
1662	石油資源開発	4,000	3,015.00	12,060,000	
1414	ショーボンドホールディングス	2,500	1,694.00	4,235,000	
1417	ミライト・ホールディングス	7,800	575.00	4,485,000	
1712	ダイセキ環境ソリューション	3	153,100.00	459,300	
1719	間組	10,200	175.00	1,785,000	
1720	東急建設	9,610	194.00	1,864,340	
1721	コムシスホールディングス	13,400	800.00	10,720,000	
1722	ミサワホーム	2,700	649.00	1,752,300	
1762	高松コンストラクショングループ	2,100	1,252.00	2,629,200	
1766	東建コーポレーション	1,030	2,552.00	2,628,560	
1780	ヤマウラ	1,500	227.00	340,500	
1801	大成建設	140,000	193.00	27,020,000	
1802	大林組	83,000	328.00	27,224,000	
1803	清水建設	84,000	313.00	26,292,000	
1808	長谷工コーポレーション	173,000	51.00	8,823,000	
1810	松井建設	3,000	306.00	918,000	
1812	鹿島建設	130,000	230.00	29,900,000	
1813	不動テトラ	19,900	146.00	2,905,400	
1814	大末建設	12,000	41.00	492,000	
1815	鉄建建設	16,000	90.00	1,440,000	
1816	安藤建設	10,000	99.00	990,000	
1819	太平工業	5,000	414.00	2,070,000	
1820	西松建設	36,000	130.00	4,680,000	
1821	三井住友建設	17,800	51.00	907,800	
1822	大豊建設	7,000	94.00	658,000	
1824	前田建設工業	17,000	273.00	4,641,000	
1827	ナカノフドー建設	2,000	168.00	336,000	
1833	奥村組	26,000	307.00	7,982,000	
1834	大和小田急建設	1,500	198.00	297,000	
1835	東鉄工業	4,000	617.00	2,468,000	
1852	浅沼組	9,000	62.00	558,000	
1860	戸田建設	30,000	271.00	8,130,000	

1861	熊谷組	20,000	67.00	1,340,000	
1865	青木あすなる建設	2,000	400.00	800,000	
1866	北野建設	6,000	172.00	1,032,000	
1867	植木組	4,000	168.00	672,000	
1868	三井ホーム	3,000	385.00	1,155,000	
1870	矢作建設工業	3,400	383.00	1,302,200	
1871	ピーエス三菱	2,000	221.00	442,000	
1878	大東建託	10,500	6,520.00	68,460,000	
1879	新日本建設	3,300	191.00	630,300	
1881	N I P P O	6,000	721.00	4,326,000	
1882	東亜道路工業	5,000	148.00	740,000	
1883	前田道路	8,000	808.00	6,464,000	
1884	日本道路	8,000	205.00	1,640,000	
1885	東亜建設工業	24,000	128.00	3,072,000	
1888	若築建設	15,000	100.00	1,500,000	
1890	東洋建設	42,000	70.00	2,940,000	
1893	五洋建設	35,500	226.00	8,023,000	
1896	大林道路	4,000	183.00	732,000	
1899	福田組	4,000	244.00	976,000	
1911	住友林業	19,000	658.00	12,502,000	
1914	日本基礎技術	3,300	235.00	775,500	
1916	日成ビルド工業	8,000	188.00	1,504,000	
1919	エス・バイ・エル	14,000	179.00	2,506,000	
1921	巴コーポレーション	3,600	272.00	979,200	
1924	パナホーム	10,000	538.00	5,380,000	
1925	大和ハウス工業	69,000	919.00	63,411,000	
1926	ライト工業	5,900	381.00	2,247,900	
1928	積水ハウス	78,000	687.00	53,586,000	
1929	日特建設	7,000	102.00	714,000	
1930	北陸電気工事	2,000	212.00	424,000	
1934	ユアテック	4,000	381.00	1,524,000	
1937	西部電気工業	3,000	342.00	1,026,000	
1939	四電工	2,000	326.00	652,000	
1941	中電工	4,000	842.00	3,368,000	
1942	関電工	13,000	372.00	4,836,000	
1944	きんでん	18,000	620.00	11,160,000	
1945	東京エネシス	3,000	429.00	1,287,000	
1946	トーエネック	4,000	383.00	1,532,000	
1949	住友電設	2,000	431.00	862,000	
1950	日本電設工業	5,000	736.00	3,680,000	
1951	協和エクシオ	9,000	726.00	6,534,000	
1952	新日本空調	2,200	416.00	915,200	
1956	日本電話施設	5,000	252.00	1,260,000	
1959	九電工	5,000	493.00	2,465,000	
1961	三機工業	6,000	394.00	2,364,000	
1963	日揮	26,000	1,848.00	48,048,000	
1964	中外炉工業	9,000	265.00	2,385,000	
1967	ヤマト	3,000	306.00	918,000	
1968	太平電業	4,000	597.00	2,388,000	
1969	高砂熱学工業	7,900	649.00	5,127,100	
1972	三晃金属工業	3,000	226.00	678,000	
1975	朝日工業社	3,000	339.00	1,017,000	
1979	大気社	4,200	1,613.00	6,774,600	

[次へ](#)

1980	ダイダン	4,000	522.00	2,088,000	
1982	日比谷総合設備	3,400	774.00	2,631,600	
1983	東芝プラントシステム	4,000	756.00	3,024,000	
6330	東洋エンジニアリング	15,000	273.00	4,095,000	
6366	千代田化工建設	22,000	785.00	17,270,000	
6379	新興ブランテック	5,600	648.00	3,628,800	
2001	日本製粉	17,000	334.00	5,678,000	
2002	日清製粉グループ本社	25,000	914.00	22,850,000	
2003	日東富士製粉	2,000	296.00	592,000	
2004	昭和産業	11,000	234.00	2,574,000	
2009	鳥越製粉	2,400	697.00	1,672,800	
2052	協同飼料	10,000	92.00	920,000	
2053	中部飼料	2,500	471.00	1,177,500	
2056	日本配合飼料	9,000	112.00	1,008,000	
2107	東洋精糖	5,000	97.00	485,000	
2108	日本甜菜製糖	15,000	152.00	2,280,000	
2109	三井製糖	10,000	271.00	2,710,000	
2201	森永製菓	27,000	178.00	4,806,000	
2204	中村屋	6,000	393.00	2,358,000	
2206	江崎グリコ	10,000	837.00	8,370,000	
2207	名糖産業	1,300	980.00	1,274,000	
2211	不二家	16,000	164.00	2,624,000	
2212	山崎製パン	20,000	1,009.00	20,180,000	
2215	第一屋製パン	5,000	90.00	450,000	
2217	モロゾフ	5,000	269.00	1,345,000	
2229	カルビー	1,500	3,565.00	5,347,500	
2264	森永乳業	23,000	290.00	6,670,000	
2267	ヤクルト本社	14,800	2,319.00	34,321,200	
2269	明治ホールディングス	8,100	3,130.00	25,353,000	
2270	雪印メグミルク	5,900	1,456.00	8,590,400	
2281	プリマハム	16,000	126.00	2,016,000	
2282	日本ハム	21,000	946.00	19,866,000	
2284	伊藤ハム	15,000	303.00	4,545,000	
2286	林兼産業	10,000	70.00	700,000	
2288	丸大食品	13,000	274.00	3,562,000	
2290	米久	2,500	712.00	1,780,000	
2292	S F o o d s	1,500	635.00	952,500	
2501	サッポロホールディングス	45,000	299.00	13,455,000	
2502	アサヒグループホールディングス	51,800	1,678.00	86,920,400	
2503	麒麟ホールディングス	111,000	933.00	103,563,000	
2531	宝ホールディングス	23,000	474.00	10,902,000	
2533	オエノンホールディングス	7,000	187.00	1,309,000	
2540	養命酒製造	2,000	717.00	1,434,000	
2572	三国コカ・コーラボトリング	2,800	693.00	1,940,400	
2579	コカ・コーラウエスト	9,300	1,345.00	12,508,500	
2580	コカ・コーラ セントラル ジャパン	3,100	1,001.00	3,103,100	
2590	ダイドードリンコ	1,300	3,055.00	3,971,500	
2593	伊藤園	8,300	1,307.00	10,848,100	
2594	キーコーヒー	2,400	1,381.00	3,314,400	
2597	ユニカフェ	800	344.00	275,200	
2599	ジャパンフーズ	400	768.00	307,200	

2602	日清オイリオグループ	10,000	320.00	3,200,000	
2607	不二製油	6,700	1,089.00	7,296,300	
2613	J - オイルミルズ	10,000	212.00	2,120,000	
2801	キッコーマン	23,000	854.00	19,642,000	
2802	味の素	73,000	909.00	66,357,000	
2809	キューピー	14,000	1,072.00	15,008,000	
2810	ハウス食品	9,800	1,446.00	14,170,800	
2811	カゴメ	10,700	1,500.00	16,050,000	
2812	焼津水産化学工業	1,300	699.00	908,700	
2815	アリアケジャパン	2,500	1,441.00	3,602,500	
2871	ニチレイ	31,000	367.00	11,377,000	
2875	東洋水産	12,000	1,852.00	22,224,000	
2897	日清食品ホールディングス	10,800	2,960.00	31,968,000	
2899	永谷園	3,000	868.00	2,604,000	
2908	フジッコ	3,000	941.00	2,823,000	
2910	ロック・フィールド	1,300	1,273.00	1,654,900	
2914	日本たばこ産業	612	357,500.00	218,790,000	
2918	わらべや日洋	1,500	985.00	1,477,500	
2922	なとり	1,300	822.00	1,068,600	
4404	ミヨシ油脂	9,000	105.00	945,000	
3001	片倉工業	3,300	705.00	2,326,500	
3002	グンゼ	19,000	223.00	4,237,000	
3101	東洋紡績	109,000	107.00	11,663,000	
3103	ユニチカ	58,000	42.00	2,436,000	
3104	富士紡ホールディングス	11,000	166.00	1,826,000	
3105	日清紡ホールディングス	16,000	678.00	10,848,000	
3106	倉敷紡績	27,000	147.00	3,969,000	
3109	シキボウ	17,000	105.00	1,785,000	
3201	日本毛織	9,000	535.00	4,815,000	
3202	大東紡織	5,000	69.00	345,000	
3204	トーア紡コーポレーション	12,000	56.00	672,000	
3205	ダイドーリミテッド	3,200	673.00	2,153,600	
3302	帝国繊維	3,000	509.00	1,527,000	
3401	帝人	106,000	247.00	26,182,000	
3402	東レ	187,000	552.00	103,224,000	
3408	サカイオーベックス	8,000	120.00	960,000	
3501	住江織物	7,000	145.00	1,015,000	
3512	日本フェルト	1,400	380.00	532,000	
3513	イチカワ	2,000	144.00	288,000	
3514	日本バイリーン	3,000	332.00	996,000	
3524	日東製網	4,000	161.00	644,000	
3526	芦森工業	6,000	107.00	642,000	
3529	アツギ	20,000	96.00	1,920,000	
3551	ダイニック	5,000	136.00	680,000	
3569	セーレン	6,400	450.00	2,880,000	
3577	東海染工	4,000	87.00	348,000	
3580	小松精練	4,000	336.00	1,344,000	
3591	ワコールホールディングス	15,000	1,025.00	15,375,000	
3593	ホギメディカル	1,600	3,220.00	5,152,000	
3606	レナウン	5,900	143.00	843,700	
3607	クラウディア	300	987.00	296,100	
3608	T S Iホールディングス	11,500	370.00	4,255,000	
8011	三陽商会	12,000	196.00	2,352,000	

8013	ナイガイ	8,000	48.00	384,000	
8016	オンワードホールディングス	16,000	548.00	8,768,000	
8029	ルック	5,000	199.00	995,000	
8111	ゴールドウイン	6,000	296.00	1,776,000	
8114	デサント	6,000	404.00	2,424,000	
8127	ヤマトインターナショナル	1,500	356.00	534,000	
3708	特種東海製紙	16,000	177.00	2,832,000	
3861	王子製紙	114,000	376.00	42,864,000	
3864	三菱製紙	37,000	71.00	2,627,000	
3865	北越紀州製紙	16,000	507.00	8,112,000	
3877	中越パルプ工業	10,000	128.00	1,280,000	
3878	巴川製紙所	4,000	165.00	660,000	
3880	大王製紙	11,000	530.00	5,830,000	
3893	日本製紙グループ本社	12,500	1,548.00	19,350,000	
3941	レンゴー	21,000	551.00	11,571,000	
3946	トーモク	8,000	201.00	1,608,000	
3950	ザ・バック	1,500	1,162.00	1,743,000	
3405	クラレ	41,000	1,086.00	44,526,000	
3407	旭化成	150,000	460.00	69,000,000	
3553	共和レザー	1,700	265.00	450,500	
4003	コープケミカル	4,000	114.00	456,000	
4004	昭和電工	160,000	156.00	24,960,000	
4005	住友化学	177,000	288.00	50,976,000	
4007	日本化成	5,000	148.00	740,000	
4008	住友精化	5,000	336.00	1,680,000	
4021	日産化学工業	19,700	728.00	14,341,600	
4022	ラサ工業	11,000	123.00	1,353,000	
4023	クレハ	17,000	359.00	6,103,000	
4027	テイカ	5,000	283.00	1,415,000	
4028	石原産業	44,000	91.00	4,004,000	
4031	片倉チッカリン	2,000	192.00	384,000	
4041	日本曹達	15,000	336.00	5,040,000	
4042	東ソー	69,000	215.00	14,835,000	
4043	トクヤマ	40,000	264.00	10,560,000	
4044	セントラル硝子	25,000	352.00	8,800,000	
4045	東亜合成	32,000	324.00	10,368,000	
4046	ダイソー	10,000	246.00	2,460,000	
4047	関東電化工業	6,000	301.00	1,806,000	
4061	電気化学工業	54,000	290.00	15,660,000	
4063	信越化学工業	46,300	3,665.00	169,689,500	
4064	日本カーバイド工業	8,000	112.00	896,000	
4078	堺化学工業	8,000	294.00	2,352,000	
4088	エア・ウォーター	21,000	997.00	20,937,000	
4091	太陽日酸	34,000	547.00	18,598,000	
4092	日本化学工業	10,000	132.00	1,320,000	
4095	日本パーカライジング	6,000	949.00	5,694,000	
4097	高圧ガス工業	4,000	457.00	1,828,000	
4099	四国化成工業	4,000	416.00	1,664,000	
4100	戸田工業	3,000	617.00	1,851,000	
4109	ステラ ケミファ	1,200	2,336.00	2,803,200	
4112	保土谷化学工業	5,000	247.00	1,235,000	
4114	日本触媒	19,000	818.00	15,542,000	
4116	大日精化工業	9,000	327.00	2,943,000	

4118	カネカ	32,000	407.00	13,024,000	
4182	三菱瓦斯化学	44,000	448.00	19,712,000	
4183	三井化学	110,000	242.00	26,620,000	
4185	J S R	23,500	1,414.00	33,229,000	
4186	東京応化工業	4,600	1,557.00	7,162,200	
4188	三菱ケミカルホールディングス	161,500	435.00	70,252,500	
4201	日本合成化学工業	5,000	427.00	2,135,000	
4202	ダイセル	34,000	440.00	14,960,000	
4203	住友ベークライト	22,000	429.00	9,438,000	
4204	積水化学工業	54,000	620.00	33,480,000	
4205	日本ゼオン	24,000	638.00	15,312,000	
4206	アイカ工業	6,900	1,038.00	7,162,200	
4208	宇部興産	108,000	200.00	21,600,000	
4212	積水樹脂	4,000	736.00	2,944,000	
4215	タキロン	6,000	268.00	1,608,000	
4216	旭有機材工業	9,000	196.00	1,764,000	
4217	日立化成工業	11,200	1,375.00	15,400,000	
4218	ニチバン	3,000	248.00	744,000	
4220	リケンテクノス	4,000	216.00	864,000	
4221	大倉工業	6,000	238.00	1,428,000	
4228	積水化成成品工業	7,000	282.00	1,974,000	
4229	群栄化学工業	7,000	201.00	1,407,000	
4231	タイガースポリマー	1,300	287.00	373,100	
4271	日本カーリット	2,100	390.00	819,000	
4272	日本化薬	18,000	758.00	13,644,000	
4362	日本精化	2,200	511.00	1,124,200	
4401	A D E K A	11,100	728.00	8,080,800	
4403	日油	20,000	381.00	7,620,000	
4410	ハリマ化成	2,200	632.00	1,390,400	
4452	花王	68,400	1,963.00	134,269,200	
4461	第一工業製薬	5,000	220.00	1,100,000	
4471	三洋化成工業	8,000	502.00	4,016,000	
4611	大日本塗料	15,000	82.00	1,230,000	
4612	日本ペイント	24,000	552.00	13,248,000	
4613	関西ペイント	29,000	700.00	20,300,000	
4614	トウベ	3,000	94.00	282,000	
4617	中国塗料	8,000	487.00	3,896,000	
4619	日本特殊塗料	2,000	307.00	614,000	
4620	藤倉化成	3,200	370.00	1,184,000	
4626	太陽ホールディングス	2,100	1,918.00	4,027,800	
4631	D I C	99,000	132.00	13,068,000	
4633	サカティンクス	5,000	336.00	1,680,000	
4634	東洋インキ S C ホールディングス	23,000	286.00	6,578,000	
4901	富士フイルムホールディングス	55,100	1,841.00	101,439,100	
4911	資生堂	42,800	1,360.00	58,208,000	
4912	ライオン	30,000	448.00	13,440,000	
4914	高砂香料工業	8,000	363.00	2,904,000	
4917	マンダム	2,600	1,944.00	5,054,400	
4919	ミルボン	1,400	2,403.00	3,364,200	
4921	ファンケル	6,500	1,070.00	6,955,000	
4922	コーセー	4,200	1,807.00	7,589,400	
4924	ドクターシーラボ	16	375,500.00	6,008,000	

4927	ポーラ・オルビスホールディングス	2,600	1,943.00	5,051,800	
4951	エステー	1,600	972.00	1,555,200	
4956	コニシ	1,900	1,027.00	1,951,300	
4958	長谷川香料	3,300	1,168.00	3,854,400	
4967	小林製薬	3,600	3,890.00	14,004,000	
4968	荒川化学工業	2,000	676.00	1,352,000	
4971	メック	1,900	277.00	526,300	
4973	日本高純度化学	7	217,500.00	1,522,500	
4975	荏原ユージライト	400	1,930.00	772,000	
4985	アース製薬	1,800	2,920.00	5,256,000	
4989	イハラケミカル工業	5,000	287.00	1,435,000	
4992	北興化学工業	3,000	213.00	639,000	
4994	大成ラミック	700	2,411.00	1,687,700	
4996	クミアイ化学工業	6,000	295.00	1,770,000	
4997	日本農薬	6,000	330.00	1,980,000	
5142	アキレス	21,000	105.00	2,205,000	
5208	有沢製作所	4,300	292.00	1,255,600	
6988	日東電工	21,300	2,905.00	61,876,500	
7874	レック	800	1,096.00	876,800	
7908	きもと	2,100	525.00	1,102,500	
7917	藤森工業	1,900	1,084.00	2,059,600	
7925	前澤化成工業	1,800	772.00	1,389,600	
7942	J S P	1,700	1,079.00	1,834,300	
7947	エフピコ	1,100	5,160.00	5,676,000	
7958	天馬	2,100	714.00	1,499,400	
7970	信越ポリマー	5,000	334.00	1,670,000	
7971	東リ	7,000	145.00	1,015,000	
7988	ニフコ	5,800	2,082.00	12,075,600	
7995	日本バルカー工業	10,000	203.00	2,030,000	
8113	ユニ・チャーム	14,200	3,630.00	51,546,000	
4151	協和発酵キリン	35,000	922.00	32,270,000	
4502	武田薬品工業	96,600	3,215.00	310,569,000	代用有価証券10,000株
4503	アステラス製薬	57,300	3,040.00	174,192,000	
4506	大日本住友製薬	18,300	838.00	15,335,400	
4507	塩野義製薬	40,300	973.00	39,211,900	
4508	田辺三菱製薬	25,700	1,216.00	31,251,200	
4512	わかもと製薬	3,000	239.00	717,000	
4514	あすか製薬	3,000	454.00	1,362,000	
4516	日本新薬	5,000	914.00	4,570,000	
4519	中外製薬	29,900	1,237.00	36,986,300	
4521	科研製薬	10,000	992.00	9,920,000	
4523	エーザイ	31,700	3,070.00	97,319,000	
4527	ロート製薬	11,000	960.00	10,560,000	
4528	小野薬品工業	12,600	4,045.00	50,967,000	
4530	久光製薬	8,000	3,170.00	25,360,000	
4531	有機合成薬品工業	2,000	172.00	344,000	
4534	持田製薬	9,000	845.00	7,605,000	
4536	参天製薬	8,700	2,997.00	26,073,900	
4538	扶桑薬品工業	9,000	193.00	1,737,000	
4539	日本ケミファ	4,000	292.00	1,168,000	
4540	ツムラ	7,100	2,212.00	15,705,200	
4541	日医工	4,400	1,834.00	8,069,600	

4547	キッセイ薬品工業	4,800	1,541.00	7,396,800	
4548	生化学工業	4,900	818.00	4,008,200	
4549	栄研化学	2,000	1,024.00	2,048,000	
4550	日水製薬	1,100	672.00	739,200	
4551	鳥居薬品	1,800	1,426.00	2,566,800	
4553	東和薬品	1,300	3,280.00	4,264,000	
4555	沢井製薬	1,700	7,820.00	13,294,000	
4559	ゼリア新薬工業	4,000	1,298.00	5,192,000	
4568	第一三共	86,700	1,440.00	124,848,000	
4569	キョーリン製薬ホールディングス	6,000	1,322.00	7,932,000	
4574	大幸薬品	1,200	799.00	958,800	
4577	ダイト	700	1,110.00	777,000	
4578	大塚ホールディングス	51,100	2,145.00	109,609,500	
4581	大正製薬ホールディングス	6,200	5,660.00	35,092,000	
3315	日本コークス工業	21,000	99.00	2,079,000	
5002	昭和シェル石油	23,100	533.00	12,312,300	
5007	コスモ石油	71,000	207.00	14,697,000	
5011	ニチレキ	3,000	363.00	1,089,000	
5012	東燃ゼネラル石油	39,000	872.00	34,008,000	
5013	ユシロ化学工業	1,400	854.00	1,195,600	
5015	ビーピー・カストロール	900	344.00	309,600	
5017	AOCホールディングス	6,000	476.00	2,856,000	
5018	MORESCO	600	700.00	420,000	
5019	出光興産	3,100	8,210.00	25,451,000	
5020	JXホールディングス	286,200	463.00	132,510,600	
5101	横浜ゴム	31,000	418.00	12,958,000	
5105	東洋ゴム工業	19,000	176.00	3,344,000	
5108	ブリヂストン	80,800	1,687.00	136,309,600	
5110	住友ゴム工業	20,100	882.00	17,728,200	
5121	藤倉ゴム工業	1,500	289.00	433,500	
5122	オカモト	9,000	310.00	2,790,000	
5185	フコク	1,100	670.00	737,000	
5186	ニッタ	2,500	1,388.00	3,470,000	
5191	東海ゴム工業	4,800	875.00	4,200,000	
5192	三ツ星ベルト	7,000	391.00	2,737,000	
5195	バンドー化学	9,000	306.00	2,754,000	
3110	日東紡績	19,000	315.00	5,985,000	
5201	旭硝子	127,000	649.00	82,423,000	
5202	日本板硝子	111,000	146.00	16,206,000	
5204	石塚硝子	4,000	140.00	560,000	
5210	日本山村硝子	10,000	198.00	1,980,000	
5214	日本電気硝子	49,000	761.00	37,289,000	
5218	オハラ	1,000	752.00	752,000	
5232	住友大阪セメント	53,000	236.00	12,508,000	
5233	太平洋セメント	152,000	147.00	22,344,000	
5234	デイ・シイ	2,600	219.00	569,400	
5262	日本ヒューム	3,000	288.00	864,000	
5269	日本コンクリート工業	4,000	175.00	700,000	
5301	東海カーボン	22,000	409.00	8,998,000	
5302	日本カーボン	12,000	220.00	2,640,000	
5310	東洋炭素	1,400	3,380.00	4,732,000	
5331	ノリタケカンパニーリミテド	13,000	230.00	2,990,000	

5332	TOTO	40,000	593.00	23,720,000	
5333	日本碍子	33,000	891.00	29,403,000	
5334	日本特殊陶業	22,000	929.00	20,438,000	
5337	ダントーホールディングス	4,000	77.00	308,000	
5344	MARUWA	800	3,505.00	2,804,000	
5351	品川リフラクトリーズ	6,000	211.00	1,266,000	
5352	黒崎播磨	6,000	240.00	1,440,000	
5363	東京窯業	3,000	182.00	546,000	
5367	ニッカトー	900	473.00	425,700	
5384	フジインコーポレーテッド	2,300	884.00	2,033,200	
5391	エーアンドエーマテリアル	6,000	72.00	432,000	
5393	ニチアス	11,000	419.00	4,609,000	
7943	ニチハ	2,900	817.00	2,369,300	
5401	新日本製鐵	676,000	191.00	129,116,000	
5405	住友金属工業	478,000	137.00	65,486,000	
5406	神戸製鋼所	357,000	123.00	43,911,000	
5407	日新製鋼	91,000	110.00	10,010,000	
5408	中山製鋼所	13,000	74.00	962,000	
5410	合同製鐵	14,000	193.00	2,702,000	
5411	ジェイ エフ イー ホールディ ングス	61,100	1,438.00	87,861,800	
5423	東京製鐵	13,100	671.00	8,790,100	
5440	共英製鋼	2,800	1,456.00	4,076,800	
5444	大和工業	5,900	2,061.00	12,159,900	
5445	東京製鋼	5,000	230.00	1,150,000	
5449	大阪製鐵	1,600	1,368.00	2,188,800	
5451	淀川製鋼所	18,000	335.00	6,030,000	
5453	東洋鋼鈹	6,000	264.00	1,584,000	
5457	住友鋼管	1,500	576.00	864,000	
5463	丸一鋼管	7,900	1,703.00	13,453,700	
5464	モリ工業	4,000	265.00	1,060,000	
5471	大同特殊鋼	43,000	471.00	20,253,000	
5476	日本高周波鋼業	11,000	86.00	946,000	
5479	日本金属工業	20,000	66.00	1,320,000	
5480	日本冶金工業	19,000	126.00	2,394,000	
5481	山陽特殊製鋼	13,000	408.00	5,304,000	
5482	愛知製鋼	14,000	370.00	5,180,000	
5486	日立金属	17,000	822.00	13,974,000	
5491	日本金属	6,000	143.00	858,000	
5541	大平洋金属	18,000	383.00	6,894,000	
5563	日本電工	9,000	357.00	3,213,000	
5602	栗本鐵工所	13,000	154.00	2,002,000	
5606	旭テック	23,000	25.00	575,000	
5612	日本鑄鉄管	3,000	154.00	462,000	
5632	三菱製鋼	16,000	204.00	3,264,000	
5658	日亜鋼業	4,000	202.00	808,000	
5659	日本精線	2,000	386.00	772,000	
6319	シンニッタン	2,300	335.00	770,500	
7305	新家工業	6,000	124.00	744,000	
5701	日本軽金属	59,000	102.00	6,018,000	
5702	大紀アルミニウム工業所	4,000	321.00	1,284,000	
5706	三井金属鉱業	70,000	200.00	14,000,000	
5707	東邦亜鉛	15,000	283.00	4,245,000	

5711	三菱マテリアル	161,000	208.00	33,488,000	
5713	住友金属鉱山	67,000	985.00	65,995,000	

[次へ](#)

5714	DOWAホールディングス	31,000	481.00	14,911,000	
5715	古河機械金属	43,000	66.00	2,838,000	
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	2,500	3,400.00	8,500,000	
5727	東邦チタニウム	4,200	1,320.00	5,544,000	
5738	住友軽金属工業	63,000	72.00	4,536,000	
5741	古河スカイ	11,000	178.00	1,958,000	
5801	古河電気工業	81,000	178.00	14,418,000	
5802	住友電気工業	91,100	831.00	75,704,100	
5803	フジクラ	39,000	230.00	8,970,000	
5805	昭和電線ホールディングス	34,000	72.00	2,448,000	
5809	タツタ電線	5,000	312.00	1,560,000	
5812	日立電線	20,000	159.00	3,180,000	
5815	沖電線	3,000	159.00	477,000	
5819	カナレ電気	300	1,300.00	390,000	
5821	平河ビューテック	500	726.00	363,000	
5851	リョービ	14,000	284.00	3,976,000	
5857	アサヒホールディングス	3,600	1,482.00	5,335,200	
3421	稲葉製作所	1,300	911.00	1,184,300	
3431	宮地エンジニアリンググループ	9,000	146.00	1,314,000	
3432	三協・立山ホールディングス	35,000	103.00	3,605,000	
3433	トーカロ	1,500	1,594.00	2,391,000	
3434	アルファC o	900	822.00	739,800	
3436	SUMCO	15,800	578.00	9,132,400	
3443	川田テクノロジーズ	600	1,052.00	631,200	
5901	東洋製罐	18,200	1,042.00	18,964,400	
5902	ホッカンホールディングス	6,000	222.00	1,332,000	
5909	コロナ	1,200	1,241.00	1,489,200	
5911	横河ブリッジホールディングス	5,000	505.00	2,525,000	
5915	駒井ハルテック	5,000	183.00	915,000	
5929	三和ホールディングス	26,000	232.00	6,032,000	
5930	文化シャッター	7,000	256.00	1,792,000	
5936	東洋シャッター	800	360.00	288,000	
5938	住生活グループ	33,500	1,423.00	47,670,500	
5942	日本ファイルコン	1,900	389.00	739,100	
5943	ノーリツ	5,100	1,376.00	7,017,600	
5946	長府製作所	2,500	1,942.00	4,855,000	
5947	リンナイ	4,100	5,540.00	22,714,000	
5951	ダイニチ工業	1,400	733.00	1,026,200	
5957	日東精工	3,000	212.00	636,000	
5958	三洋工業	4,000	152.00	608,000	
5959	岡部	5,100	394.00	2,009,400	
5974	中国工業	5,000	86.00	430,000	
5975	東プレ	4,900	737.00	3,611,300	
5976	高周波熱錬	3,400	574.00	1,951,600	
5981	東京製綱	16,000	154.00	2,464,000	
5988	パイオラックス	1,100	1,689.00	1,857,900	
5991	日本発條	18,700	679.00	12,697,300	
5992	中央発條	3,000	260.00	780,000	
5998	アドバネクス	6,000	69.00	414,000	
8155	三益半導体工業	2,200	617.00	1,357,400	
1978	アタカ大機	2,000	238.00	476,000	
5631	日本製鋼所	40,000	519.00	20,760,000	

5963	日立ツール	1,500	828.00	1,242,000	
6005	三浦工業	3,800	2,165.00	8,227,000	
6013	タクマ	9,000	323.00	2,907,000	
6101	ツガミ	6,000	473.00	2,838,000	
6103	オークマ	15,000	527.00	7,905,000	
6104	東芝機械	14,000	376.00	5,264,000	
6113	アマダ	36,000	483.00	17,388,000	
6118	アイダエンジニアリング	6,700	362.00	2,425,400	
6135	牧野フライス製作所	13,000	502.00	6,526,000	
6136	オーエスジー	11,400	924.00	10,533,600	
6138	ダイジェット工業	3,000	150.00	450,000	
6140	旭ダイヤモンド工業	6,400	1,002.00	6,412,800	
6141	森精機製作所	13,600	688.00	9,356,800	
6146	ディスコ	2,600	4,030.00	10,478,000	
6151	日東工器	1,500	1,746.00	2,619,000	
6203	豊和工業	14,000	65.00	910,000	
6205	大阪機工	11,000	88.00	968,000	
6210	東洋機械金属	2,000	199.00	398,000	
6217	津田駒工業	7,000	164.00	1,148,000	
6222	島精機製作所	3,400	1,278.00	4,345,200	
6247	日阪製作所	3,000	856.00	2,568,000	
6250	やまびこ	1,000	818.00	818,000	
6262	ペガサスミシン製造	2,500	208.00	520,000	
6268	ナブテスコ	10,700	1,451.00	15,525,700	
6269	三井海洋開発	2,100	1,277.00	2,681,700	
6272	レオン自動機	3,000	177.00	531,000	
6273	S M C	7,700	12,060.00	92,862,000	
6274	新川	2,100	408.00	856,800	
6277	ホソカワミクロン	4,000	370.00	1,480,000	
6278	ユニオンツール	1,400	1,383.00	1,936,200	
6282	オイレス工業	2,900	1,454.00	4,216,600	
6287	サトーホールディングス	2,700	950.00	2,565,000	
6291	日本エアータック	800	354.00	283,200	
6293	日精樹脂工業	2,100	300.00	630,000	
6298	ワイエイシイ	1,100	639.00	702,900	
6301	小松製作所	122,300	1,855.00	226,866,500	
6302	住友重機械工業	66,000	429.00	28,314,000	
6305	日立建機	13,200	1,298.00	17,133,600	
6306	日工	4,000	271.00	1,084,000	
6309	巴工業	1,000	1,298.00	1,298,000	
6310	井関農機	26,000	169.00	4,394,000	
6315	T O W A	2,300	379.00	871,700	
6316	丸山製作所	6,000	169.00	1,014,000	
6317	北川鉄工所	12,000	141.00	1,692,000	
6326	クボタ	118,000	624.00	73,632,000	
6328	荏原実業	600	1,227.00	736,200	
6331	三菱化工機	8,000	134.00	1,072,000	
6332	月島機械	4,000	610.00	2,440,000	
6333	帝国電機製作所	900	1,366.00	1,229,400	
6339	新東工業	5,600	651.00	3,645,600	
6340	澁谷工業	1,500	806.00	1,209,000	
6345	アイチ コーポレーション	4,300	313.00	1,345,900	
6349	小森コーポレーション	7,400	506.00	3,744,400	

6351	鶴見製作所	2,000	545.00	1,090,000	
6355	住友精密工業	4,000	508.00	2,032,000	
6358	酒井重工業	5,000	137.00	685,000	
6361	荏原製作所	42,000	272.00	11,424,000	
6362	石井鐵工所	4,000	152.00	608,000	
6363	西島製作所	3,000	1,003.00	3,009,000	
6367	ダイキン工業	31,400	2,133.00	66,976,200	
6368	オルガノ	5,000	580.00	2,900,000	
6369	トーヨーカネツ	14,000	148.00	2,072,000	
6370	栗田工業	14,200	1,963.00	27,874,600	
6371	椿本チエイン	13,000	402.00	5,226,000	
6373	大同工業	5,000	127.00	635,000	
6375	日本コンベヤ	8,000	75.00	600,000	
6378	木村化工機	2,400	311.00	746,400	
6381	アネスト岩田	4,000	314.00	1,256,000	
6383	ダイフク	11,500	421.00	4,841,500	
6390	加藤製作所	6,000	224.00	1,344,000	
6393	油研工業	5,000	154.00	770,000	
6395	タダノ	12,000	491.00	5,892,000	
6406	フジテック	7,000	425.00	2,975,000	
6407	シーケーディ	7,000	558.00	3,906,000	
6409	キトー	11	56,000.00	616,000	
6412	平和	5,300	1,341.00	7,107,300	
6413	理想科学工業	1,800	1,154.00	2,077,200	
6417	SANKYO	7,400	3,845.00	28,453,000	
6418	日本金銭機械	2,300	585.00	1,345,500	
6419	マースエンジニアリング	1,400	1,316.00	1,842,400	
6420	福島工業	700	905.00	633,500	
6428	オーイズミ	1,000	266.00	266,000	
6430	ダイコク電機	1,200	731.00	877,200	
6436	アマノ	7,400	693.00	5,128,200	
6440	JUKI	15,000	185.00	2,775,000	
6444	サンデン	13,000	222.00	2,886,000	
6445	蛇の目マシン工業	25,000	56.00	1,400,000	
6454	マックス	4,000	936.00	3,744,000	
6457	グローリー	7,300	1,604.00	11,709,200	
6459	大和冷機工業	3,000	397.00	1,191,000	
6460	セガサミーホールディングス	26,500	1,636.00	43,354,000	
6461	日本ビストンリング	9,000	163.00	1,467,000	
6462	リケン	9,000	291.00	2,619,000	
6463	T P R	2,700	875.00	2,362,500	
6465	ホシザキ電機	4,900	1,819.00	8,913,100	
6470	大豊工業	1,700	640.00	1,088,000	
6471	日本精工	55,000	488.00	26,840,000	
6472	N T N	57,000	300.00	17,100,000	
6473	ジェイテクト	23,600	718.00	16,944,800	
6474	不二越	25,000	332.00	8,300,000	
6480	日本トムソン	8,000	447.00	3,576,000	
6481	T H K	16,400	1,455.00	23,862,000	
6482	ユーシン精機	1,200	1,390.00	1,668,000	
6485	前澤給装工業	900	1,039.00	935,100	
6486	イーグル工業	3,000	627.00	1,881,000	
6489	前澤工業	2,000	179.00	358,000	

6490	日本ビラー工業	2,000	521.00	1,042,000	
6498	キッツ	10,100	318.00	3,211,800	
6581	日立工機	6,600	574.00	3,788,400	
6586	マキタ	16,100	2,420.00	38,962,000	
7004	日立造船	97,500	99.00	9,652,500	
7011	三菱重工業	413,000	323.00	133,399,000	
7013	I H I	168,000	181.00	30,408,000	
4062	イビデン	16,200	1,653.00	26,778,600	
4902	コニカミノルタホールディングス	65,000	578.00	37,570,000	
6448	ブラザー工業	31,900	955.00	30,464,500	
6479	ミネベア	37,000	314.00	11,618,000	
6501	日立製作所	553,000	410.00	226,730,000	
6502	東芝	519,000	328.00	170,232,000	
6503	三菱電機	246,000	718.00	176,628,000	
6504	富士電機	75,000	218.00	16,350,000	
6505	東洋電機製造	4,000	292.00	1,168,000	
6506	安川電機	29,000	642.00	18,618,000	
6507	シンフォニアテクノロジー	15,000	167.00	2,505,000	
6508	明電舎	24,000	262.00	6,288,000	
6513	オリジン電気	4,000	233.00	932,000	
6517	デンヨー	2,300	1,032.00	2,373,600	
6588	東芝テック	15,000	272.00	4,080,000	
6590	芝浦メカトロニクス	5,000	212.00	1,060,000	
6592	マブチモーター	3,400	3,315.00	11,271,000	
6594	日本電産	13,300	6,610.00	87,913,000	
6621	高岳製作所	10,000	176.00	1,760,000	
6622	ダイヘン	15,000	281.00	4,215,000	
6632	JVCケンウッド	15,000	283.00	4,245,000	
6640	第一精工	600	2,250.00	1,350,000	
6641	日新電機	5,000	431.00	2,155,000	
6644	大崎電気工業	3,000	734.00	2,202,000	
6645	オムロン	27,400	1,620.00	44,388,000	
6651	日東工業	3,700	861.00	3,185,700	
6652	I D E C	3,200	776.00	2,483,200	
6665	エルピーダメモリ	33,400	404.00	13,493,600	
6674	ジーエス・ユアサコーポレーション	48,000	413.00	19,824,000	
6675	サクサホールディングス	7,000	118.00	826,000	
6676	メルコホールディングス	1,400	2,119.00	2,966,600	
6678	テクノメディカ	2	290,000.00	580,000	
6701	日本電気	339,000	161.00	54,579,000	
6702	富士通	237,000	413.00	97,881,000	
6703	沖電気工業	96,000	69.00	6,624,000	
6704	岩崎通信機	11,000	72.00	792,000	
6706	電気興業	7,000	339.00	2,373,000	
6707	サンケン電気	12,000	263.00	3,156,000	
6715	ナカヨ通信機	2,000	263.00	526,000	
6718	アイホン	1,400	1,433.00	2,006,200	
6723	ルネサスエレクトロニクス	6,400	502.00	3,212,800	
6724	セイコーエプソン	16,800	1,031.00	17,320,800	
6727	ワコム	49	118,200.00	5,791,800	
6728	アルバック	4,500	1,020.00	4,590,000	

6730	アクセル	1,100	1,533.00	1,686,300	
6737	ナナオ	2,100	1,517.00	3,185,700	
6741	日本信号	5,700	447.00	2,547,900	
6742	京三製作所	5,000	305.00	1,525,000	
6744	能美防災	3,000	521.00	1,563,000	
6745	ホーチキ	2,000	384.00	768,000	
6751	日本無線	5,000	181.00	905,000	
6752	パナソニック	281,500	674.00	189,731,000	
6753	シャープ	119,000	691.00	82,229,000	
6754	アンリツ	12,000	815.00	9,780,000	
6755	富士通ゼネラル	6,000	422.00	2,532,000	
6756	日立国際電気	6,000	630.00	3,780,000	
6758	ソニー	153,700	1,345.00	206,726,500	
6762	T D K	12,900	3,335.00	43,021,500	
6763	帝国通信工業	6,000	122.00	732,000	
6767	ミツミ電機	8,700	602.00	5,237,400	
6768	タムラ製作所	8,000	195.00	1,560,000	
6770	アルプス電気	19,500	534.00	10,413,000	
6771	池上通信機	9,000	52.00	468,000	
6773	パイオニア	35,100	337.00	11,828,700	
6779	日本電波工業	1,900	978.00	1,858,200	
6788	日本トリム	300	1,869.00	560,700	
6789	ローランド ディー . ジー .	1,100	860.00	946,000	
6794	フォスター電機	2,300	1,093.00	2,513,900	
6796	クラリオン	15,000	130.00	1,950,000	
6798	S M K	8,000	252.00	2,016,000	
6800	ヨコオ	1,900	399.00	758,100	
6801	東光	12,000	140.00	1,680,000	
6803	ティアック	15,000	28.00	420,000	
6804	ホシデン	6,700	546.00	3,658,200	
6806	ヒロセ電機	4,300	6,870.00	29,541,000	
6807	日本航空電子工業	6,000	532.00	3,192,000	
6809	T O A	3,000	471.00	1,413,000	
6815	ユニデン	7,000	267.00	1,869,000	
6816	アルパイン	4,800	871.00	4,180,800	
6817	スミダコーポレーション	1,500	509.00	763,500	
6820	アイコム	1,400	2,010.00	2,814,000	
6839	船井電機	2,200	1,746.00	3,841,200	
6841	横河電機	26,800	704.00	18,867,200	
6844	新電元工業	9,000	308.00	2,772,000	
6845	山武	6,300	1,612.00	10,155,600	
6849	日本光電工業	4,900	1,773.00	8,687,700	
6850	チノー	4,000	188.00	752,000	
6853	共和電業	2,000	238.00	476,000	
6855	日本電子材料	1,000	362.00	362,000	
6856	堀場製作所	4,600	2,258.00	10,386,800	
6857	アドバンテスト	18,400	762.00	14,020,800	
6858	小野測器	3,000	207.00	621,000	
6859	エスベック	2,600	474.00	1,232,400	
6860	パナソニック電工 S U N X	2,100	384.00	806,400	
6861	キーエンス	5,500	18,830.00	103,565,000	
6866	日置電機	1,200	1,335.00	1,602,000	
6869	シスメックス	8,700	2,529.00	22,002,300	

6875	メガチップス	2,000	1,186.00	2,372,000	
6877	O B A R A G R O U P	1,800	888.00	1,598,400	
6883	日本電産コパル電子	2,500	471.00	1,177,500	
6885	ミヤチテクノス	1,200	644.00	772,800	
6900	東京電波	800	358.00	286,400	
6901	澤藤電機	2,000	229.00	458,000	
6905	コーセル	3,600	1,036.00	3,729,600	
6910	日立メディコ	2,000	760.00	1,520,000	
6911	新日本無線	2,000	120.00	240,000	
6914	オブテックス	1,700	1,010.00	1,717,000	
6915	千代田インテグレ	1,200	962.00	1,154,400	
6921	東光電気	1,000	316.00	316,000	
6923	スタンレー電気	16,500	1,092.00	18,018,000	
6924	岩崎電気	9,000	166.00	1,494,000	
6925	ウシオ電機	14,900	1,141.00	17,000,900	
6926	岡谷電機産業	1,300	330.00	429,000	
6927	ヘリオス テクノ ホールディング	2,200	147.00	323,400	
6929	日本セラミック	1,600	1,489.00	2,382,400	
6934	新神戸電機	2,000	1,704.00	3,408,000	
6935	日本デジタル研究所	2,100	725.00	1,522,500	
6937	古河電池	2,000	361.00	722,000	
6938	双信電機	1,300	338.00	439,400	
6941	山一電機	2,600	173.00	449,800	
6947	図研	1,600	544.00	870,400	
6951	日本電子	9,000	200.00	1,800,000	
6952	カシオ計算機	23,500	470.00	11,045,000	
6954	ファナック	25,700	12,070.00	310,199,000	
6958	日本シイエムケイ	5,400	257.00	1,387,800	
6961	エンプラス	1,300	1,373.00	1,784,900	
6963	ローム	12,100	3,410.00	41,261,000	
6965	浜松ホトニクス	9,600	2,661.00	25,545,600	
6966	三井ハイテック	3,200	327.00	1,046,400	
6967	新光電気工業	8,300	561.00	4,656,300	
6971	京セラ	20,500	6,310.00	129,355,000	
6976	太陽誘電	11,100	616.00	6,837,600	
6981	村田製作所	25,900	4,025.00	104,247,500	
6985	ユーション	3,500	635.00	2,222,500	
6986	双葉電子工業	4,200	1,222.00	5,132,400	
6989	北陸電気工業	10,000	109.00	1,090,000	
6996	ニチコン	7,800	862.00	6,723,600	
6997	日本ケミコン	14,000	281.00	3,934,000	
6999	K O A	3,100	681.00	2,111,100	
7244	市光工業	6,000	131.00	786,000	
7276	小糸製作所	12,000	1,038.00	12,456,000	
7280	ミツバ	4,000	550.00	2,200,000	
7718	スター精密	4,000	701.00	2,804,000	
7735	大日本スクリーン製造	23,000	588.00	13,524,000	
7739	キヤノン電子	2,200	1,957.00	4,305,400	
7751	キヤノン	153,000	3,395.00	519,435,000	代用有価証券10,000株
7752	リコー	74,000	666.00	49,284,000	
7757	日本電産サンキョー	6,000	482.00	2,892,000	
7999	M U T O Hホールディングス	2,000	203.00	406,000	

8035	東京エレクトロン	20,700	3,925.00	81,247,500	
3116	トヨタ紡織	8,600	801.00	6,888,600	
5196	鬼怒川ゴム工業	6,000	660.00	3,960,000	
5949	ユニプレス	3,900	2,055.00	8,014,500	
6201	豊田自動織機	22,400	2,032.00	45,516,800	
6455	モリタホールディングス	4,000	419.00	1,676,000	
6584	三櫻工業	3,100	509.00	1,577,900	
6902	デンソー	60,900	2,083.00	126,854,700	
6995	東海理化電機製作所	5,800	1,116.00	6,472,800	
7003	三井造船	95,000	124.00	11,780,000	
7007	佐世保重工業	16,000	131.00	2,096,000	
7012	川崎重工業	179,000	195.00	34,905,000	
7102	日本車輛製造	9,000	291.00	2,619,000	
7105	日本輸送機	3,000	210.00	630,000	
7122	近畿車輛	4,000	238.00	952,000	
7201	日産自動車	311,200	670.00	208,504,000	
7202	いすゞ自動車	156,000	340.00	53,040,000	
7203	トヨタ自動車	316,500	2,546.00	805,809,000	代用有価証券35,000株
7205	日野自動車	35,000	443.00	15,505,000	
7211	三菱自動車工業	550,000	89.00	48,950,000	
7212	エフテック	900	899.00	809,100	
7220	武蔵精密工業	2,400	1,612.00	3,868,800	
7221	トヨタ車体	4,500	1,146.00	5,157,000	
7222	日産車体	7,000	731.00	5,117,000	
7223	関東自動車工業	3,800	636.00	2,416,800	
7224	新明和工業	11,000	310.00	3,410,000	
7226	極東開発工業	4,300	473.00	2,033,900	
7230	日信工業	4,500	1,048.00	4,716,000	
7231	トビー工業	18,000	195.00	3,510,000	
7236	ティラド	9,000	249.00	2,241,000	
7238	曙ブレーキ工業	12,500	324.00	4,050,000	
7239	タチエス	3,200	1,212.00	3,878,400	
7240	N O K	11,900	1,287.00	15,315,300	
7241	フタバ産業	7,000	436.00	3,052,000	
7242	カヤバ工業	17,000	347.00	5,899,000	
7243	シロキ工業	5,000	208.00	1,040,000	
7245	大同メタル工業	4,000	811.00	3,244,000	
7246	プレス工業	11,000	365.00	4,015,000	
7248	カルソニックカンセイ	15,000	438.00	6,570,000	
7250	太平洋工業	5,000	359.00	1,795,000	
7251	ケーヒン	5,100	1,222.00	6,232,200	
7256	河西工業	3,000	381.00	1,143,000	
7259	アイシン精機	20,300	2,108.00	42,792,400	
7260	富士機工	3,000	212.00	636,000	
7261	マツダ	205,000	138.00	28,290,000	
7262	ダイハツ工業	23,000	1,316.00	30,268,000	
7263	愛知機械工業	6,000	213.00	1,278,000	
7266	今仙電機製作所	1,800	868.00	1,562,400	
7267	本田技研工業	207,800	2,290.00	475,862,000	
7269	スズキ	51,500	1,573.00	81,009,500	
7270	富士重工業	78,000	442.00	34,476,000	
7272	ヤマハ発動機	40,100	991.00	39,739,100	
7274	ショーワ	5,300	415.00	2,199,500	

7277	T B K	3,000	358.00	1,074,000	
7278	エクセディ	3,300	2,166.00	7,147,800	

[次へ](#)

7282	豊田合成	7,000	1,228.00	8,596,000	
7283	愛三工業	2,600	596.00	1,549,600	
7294	ヨロズ	1,500	1,638.00	2,457,000	
7296	エフ・シー・シー	4,000	1,532.00	6,128,000	
7309	シマノ	9,300	3,590.00	33,387,000	
7312	タカタ	4,400	1,527.00	6,718,800	
7313	テイ・エス テック	5,200	1,101.00	5,725,200	
7728	日本電産トーソク	1,200	877.00	1,052,400	
4543	テルモ	19,400	3,715.00	72,071,000	
5187	クリエートメディック	700	810.00	567,000	
6376	日機装	8,000	668.00	5,344,000	
7701	島津製作所	29,000	617.00	17,893,000	
7702	JMS	4,000	232.00	928,000	
7714	モリテックス	600	337.00	202,200	
7715	長野計器	1,700	725.00	1,232,500	
7717	バイ・テクノロジー	3	340,500.00	1,021,500	
7721	東京計器	9,000	141.00	1,269,000	
7723	愛知時計電機	3,000	265.00	795,000	
7729	東京精密	4,400	1,465.00	6,446,000	
7731	ニコン	43,000	1,671.00	71,853,000	
7732	トプコン	5,700	363.00	2,069,100	
7733	オリンパス	29,100	1,041.00	30,293,100	
7734	理研計器	2,000	548.00	1,096,000	
7740	タムロン	2,200	1,949.00	4,287,800	
7741	HOYA	59,900	1,647.00	98,655,300	
7744	ノーリツ鋼機	2,300	355.00	816,500	
7745	エー・アンド・デイ	2,400	280.00	672,000	
7756	日本電産コパル	1,900	848.00	1,611,200	
7762	シチズンホールディングス	29,600	438.00	12,964,800	
7769	リズム時計工業	11,000	141.00	1,551,000	
7775	大研医器	300	795.00	238,500	
8050	セイコーホールディングス	14,000	168.00	2,352,000	
8086	ニプロ	9,800	638.00	6,252,400	
7817	パラマウントベッドホールディングス	2,100	2,180.00	4,578,000	
7819	SHO-BI	400	449.00	179,600	
7825	SRIスポーツ	1,500	851.00	1,276,500	
7832	バンダイナムコホールディングス	26,500	1,084.00	28,726,000	
7838	共立印刷	3,100	214.00	663,400	
7840	フランスベッドホールディングス	17,000	119.00	2,023,000	
7846	パイロットコーポレーション	22	158,300.00	3,482,600	
7862	トッパン・フォームズ	5,200	572.00	2,974,400	
7864	フジシールインターナショナル	2,800	1,336.00	3,740,800	
7867	タカラトミー	8,100	556.00	4,503,600	
7868	廣済堂	2,300	196.00	450,800	
7885	タカノ	1,000	420.00	420,000	
7893	プロネクサス	2,700	387.00	1,044,900	
7897	ホクシン	2,000	149.00	298,000	
7898	ウッドワン	4,000	268.00	1,072,000	
7905	大建工業	10,000	220.00	2,200,000	
7911	凸版印刷	75,000	569.00	42,675,000	

7912	大日本印刷	75,000	759.00	56,925,000	
7913	図書印刷	4,000	130.00	520,000	
7914	共同印刷	8,000	184.00	1,472,000	
7915	日本写真印刷	4,200	986.00	4,141,200	
7916	光村印刷	3,000	242.00	726,000	
7921	宝印刷	1,400	564.00	789,600	
7936	アシックス	23,000	880.00	20,240,000	
7937	ツツミ	1,200	1,790.00	2,148,000	
7944	ローランド	2,600	687.00	1,786,200	
7949	小松ウオール工業	1,000	818.00	818,000	
7951	ヤマハ	18,200	703.00	12,794,600	
7952	河合楽器製作所	9,000	146.00	1,314,000	
7955	クリナップ	2,900	507.00	1,470,300	
7956	ビジョン	2,200	2,962.00	6,516,400	
7961	兼松日産農林	4,000	149.00	596,000	
7962	キングジム	2,100	551.00	1,157,100	
7966	リンテック	4,700	1,415.00	6,650,500	
7968	田崎真珠	6,000	48.00	288,000	
7972	イトーキ	5,400	169.00	912,600	
7974	任天堂	14,100	10,900.00	153,690,000	
7976	三菱鉛筆	2,100	1,382.00	2,902,200	
7981	タカラスタンダード	11,000	577.00	6,347,000	
7984	コクヨ	12,800	547.00	7,001,600	
7987	ナカバヤシ	6,000	194.00	1,164,000	
7994	岡村製作所	9,000	548.00	4,932,000	
8022	美津濃	12,000	394.00	4,728,000	
8170	アデランス	3,100	907.00	2,811,700	
9501	東京電力	196,800	226.00	44,476,800	
9502	中部電力	81,200	1,432.00	116,278,400	
9503	関西電力	100,500	1,116.00	112,158,000	
9504	中国電力	34,000	1,302.00	44,268,000	
9505	北陸電力	24,100	1,408.00	33,932,800	
9506	東北電力	61,600	764.00	47,062,400	
9507	四国電力	22,700	2,083.00	47,284,100	
9508	九州電力	54,400	1,081.00	58,806,400	
9509	北海道電力	23,100	1,079.00	24,924,900	
9511	沖縄電力	1,500	3,315.00	4,972,500	
9513	電源開発	15,300	1,945.00	29,758,500	
9531	東京瓦斯	297,000	348.00	103,356,000	
9532	大阪瓦斯	239,000	302.00	72,178,000	
9533	東邦瓦斯	63,000	471.00	29,673,000	
9534	北海道瓦斯	4,000	261.00	1,044,000	
9536	西部瓦斯	28,000	210.00	5,880,000	
9543	静岡瓦斯	6,500	499.00	3,243,500	
9001	東武鉄道	140,000	383.00	53,620,000	
9003	相鉄ホールディングス	39,000	235.00	9,165,000	
9005	東京急行電鉄	145,000	378.00	54,810,000	
9006	京浜急行電鉄	63,000	678.00	42,714,000	
9007	小田急電鉄	79,000	733.00	57,907,000	
9008	京王電鉄	69,000	537.00	37,053,000	
9009	京成電鉄	40,000	560.00	22,400,000	
9010	富士急行	7,000	466.00	3,262,000	
9020	東日本旅客鉄道	42,900	4,890.00	209,781,000	

9021	西日本旅客鉄道	21,400	3,320.00	71,048,000	
9022	東海旅客鉄道	214	651,000.00	139,314,000	
9031	西日本鉄道	32,000	367.00	11,744,000	
9037	ハマキョウレックス	700	2,400.00	1,680,000	
9039	サカイ引越センター	400	1,594.00	637,600	
9041	近畿日本鉄道	223,000	294.00	65,562,000	
9042	阪急阪神ホールディングス	165,000	323.00	53,295,000	
9044	南海電気鉄道	51,000	333.00	16,983,000	
9045	京阪電気鉄道	55,000	368.00	20,240,000	
9047	名糖運輸	1,100	604.00	664,400	
9048	名古屋鉄道	86,000	202.00	17,372,000	
9062	日本通運	97,000	291.00	28,227,000	
9064	ヤマトホールディングス	50,100	1,254.00	62,825,400	
9065	山九	30,000	288.00	8,640,000	
9067	丸運	1,300	188.00	244,400	
9068	丸全昭和運輸	8,000	244.00	1,952,000	
9069	センコー	10,000	300.00	3,000,000	
9070	トナミホールディングス	5,000	158.00	790,000	
9072	日本梱包運輸倉庫	7,400	770.00	5,698,000	
9074	日本石油輸送	3,000	185.00	555,000	
9075	福山通運	15,000	455.00	6,825,000	
9076	セイノーホールディングス	19,000	560.00	10,640,000	
9081	神奈川中央交通	3,000	415.00	1,245,000	
9086	日立物流	5,100	1,280.00	6,528,000	
9101	日本郵船	195,000	187.00	36,465,000	
9104	商船三井	129,000	273.00	35,217,000	
9107	川崎汽船	76,000	140.00	10,640,000	
9110	N S ユナイテッド海運	11,000	118.00	1,298,000	
9113	乾汽船	2,800	280.00	784,000	
9115	明治海運	2,300	217.00	499,100	
9119	飯野海運	12,000	342.00	4,104,000	
9130	共栄タンカー	2,000	124.00	248,000	
9132	第一中央汽船	16,000	105.00	1,680,000	
9202	全日本空輸	329,000	225.00	74,025,000	
9232	パスコ	3,000	267.00	801,000	
9234	国際航業ホールディングス	2,000	202.00	404,000	
9066	日新	9,000	181.00	1,629,000	
9301	三菱倉庫	17,000	829.00	14,093,000	
9302	三井倉庫	11,000	282.00	3,102,000	
9303	住友倉庫	18,000	357.00	6,426,000	
9304	澁澤倉庫	6,000	212.00	1,272,000	
9306	東陽倉庫	4,000	166.00	664,000	
9310	日本トランスシティ	5,000	244.00	1,220,000	
9312	ケイヒン	5,000	91.00	455,000	
9324	安田倉庫	1,900	460.00	874,000	
9351	東洋埠頭	7,000	121.00	847,000	
9358	宇徳	1,800	240.00	432,000	
9364	上組	27,000	659.00	17,793,000	
9366	サンリツ	800	511.00	408,800	
9368	キムラユニティー	500	661.00	330,500	
9369	キューソー流通システム	700	854.00	597,800	
9370	郵船ロジスティクス	1,900	972.00	1,846,800	
9375	近鉄エクスプレス	2,200	2,284.00	5,024,800	

9380	東海運	1,700	187.00	317,900	
1973	N E C ネットズエスアイ	2,300	1,165.00	2,679,500	
2317	システナ	29	53,500.00	1,551,500	
2327	新日鉄ソリューションズ	1,600	1,594.00	2,550,400	
2359	コア	1,000	634.00	634,000	
3371	ソフトクリエイト	300	1,051.00	315,300	
3620	デジタルハーツ	2	153,100.00	306,200	
3626	I T ホールディングス	7,400	928.00	6,867,200	
3632	グリー	10,700	2,487.00	26,610,900	
3635	コーエーテクモホールディングス	4,800	621.00	2,980,800	
3636	三菱総合研究所	900	1,360.00	1,224,000	
3639	ボルテージ	300	991.00	297,300	
3715	ドワンゴ	12	126,700.00	1,520,400	
3724	ベリサーブ	2	134,900.00	269,800	
3730	マクロミル	2,800	804.00	2,251,200	
3738	ティーガイア	16	150,400.00	2,406,400	
3769	G M O ペイメントゲートウェイ	5	327,500.00	1,637,500	
3770	ザッパラス	13	74,200.00	964,600	
3774	インターネットイニシアティブ	14	265,600.00	3,718,400	
3789	ソネットエンタテインメント	14	274,400.00	3,841,600	
3817	S R A ホールディングス	1,300	781.00	1,015,300	
3820	J B I S ホールディングス	2,600	231.00	600,600	
3834	朝日ネット	2,000	370.00	740,000	
4283	パナソニック電工インフォメーションシステム	600	1,995.00	1,197,000	
4295	フェイス	85	8,200.00	697,000	
4307	野村総合研究所	13,700	1,731.00	23,714,700	
4312	サイバネットシステム	21	19,170.00	402,570	
4326	インテージ	700	1,406.00	984,200	
4340	シンプレクス・ホールディングス	41	28,040.00	1,149,640	
4344	ソースネクスト	8	15,020.00	120,160	
4674	クレスコ	700	587.00	410,900	
4676	フジ・メディア・ホールディングス	253	112,700.00	28,513,100	
4684	オービック	760	14,170.00	10,769,200	
4687	ティーディーシーソフトウェアエンジニアリ	500	765.00	382,500	
4689	ヤフー	1,778	24,500.00	43,561,000	
4704	トレンドマイクロ	10,700	2,406.00	25,744,200	
4716	日本オラクル	3,900	2,619.00	10,214,100	
4719	アルファシステムズ	600	1,144.00	686,400	
4722	フューチャーアーキテクト	28	30,800.00	862,400	
4725	シーエーシー	1,700	623.00	1,059,100	
4726	ソフトバンク・テクノロジー	600	605.00	363,000	
4728	トーセ	600	497.00	298,200	
4733	オービックビジネスコンサルタント	600	3,625.00	2,175,000	
4738	日立ビジネスソリューション	800	1,004.00	803,200	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	2,900	3,430.00	9,947,000	
4743	アイティフォー	2,800	267.00	747,600	
4746	東計電算	400	1,120.00	448,000	
4762	エックスネット	2	114,400.00	228,800	

4768	大塚商会	1,900	5,330.00	10,127,000	
4776	サイボウズ	46	22,800.00	1,048,800	
4779	ソフトブレーン	40	6,240.00	249,600	
4799	アグレックス	700	733.00	513,100	
4812	電通国際情報サービス	1,500	737.00	1,105,500	
4825	ウェザーニューズ	800	2,117.00	1,693,600	
4826	C I J	2,400	311.00	746,400	
4839	WOWOW	7	178,800.00	1,251,600	
6791	日本コロムビア	26,000	28.00	728,000	
7518	ネットワンシステムズ	55	188,900.00	10,389,500	
7595	アルゴグラフィックス	900	992.00	892,800	
7860	エイベックス・グループ・ホールディングス	4,600	908.00	4,176,800	
8056	日本ユニシス	5,900	507.00	2,991,300	
8096	兼松エレクトロニクス	1,500	790.00	1,185,000	
9401	東京放送ホールディングス	14,600	942.00	13,753,200	
9404	日本テレビ放送網	2,130	11,300.00	24,069,000	
9409	テレビ朝日	62	124,200.00	7,700,400	
9412	スカパーJ S A Tホールディングス	185	37,850.00	7,002,250	
9413	テレビ東京ホールディングス	1,500	1,014.00	1,521,000	
9422	アイ・ティー・シーネットワーク	2,200	481.00	1,058,200	
9427	イー・アクセス	186	18,830.00	3,502,380	
9430	N E C モバイルリング	900	2,564.00	2,307,600	
9432	日本電信電話	111,900	3,930.00	439,767,000	代用有価証券12,300株
9433	K D D I	378	489,000.00	184,842,000	
9435	光通信	2,200	1,931.00	4,248,200	
9437	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	2,003	136,200.00	272,808,600	
9449	G M O インターネット	7,300	291.00	2,124,300	
9470	学研ホールディングス	8,000	141.00	1,128,000	
9474	ゼンリン	3,500	674.00	2,359,000	
9475	昭文社	1,400	580.00	812,000	
9477	角川グループホールディングス	2,300	2,639.00	6,069,700	
9479	インプレスホールディングス	2,300	102.00	234,600	
9600	アイネット	1,100	450.00	495,000	
9601	松竹	16,000	717.00	11,472,000	
9602	東宝	17,300	1,342.00	23,216,600	
9605	東映	10,000	348.00	3,480,000	
9607	葵プロモーション	1,000	391.00	391,000	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	150	246,300.00	36,945,000	
9682	D T S	2,500	879.00	2,197,500	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	8,000	1,535.00	12,280,000	
9692	シーイーシー	1,500	356.00	534,000	
9697	カブコン	4,700	1,814.00	8,525,800	
9717	ジャステック	1,600	444.00	710,400	
9719	S C S K	5,000	1,238.00	6,190,000	
9739	日本システムウエア	800	297.00	237,600	
9742	アイネス	3,000	531.00	1,593,000	
9746	T K C	2,000	1,574.00	3,148,000	
9749	富士ソフト	3,300	1,332.00	4,395,600	
9759	N S D	4,700	589.00	2,768,300	

9766	コナミ	11,000	2,215.00	24,365,000	
9790	福井コンピュータ	400	345.00	138,000	
9889	J B C C ホールディングス	1,900	510.00	969,000	
9984	ソフトバンク	110,200	2,351.00	259,080,200	
1352	ハウスイ	2,000	124.00	248,000	
2657	インターニックス	1,000	357.00	357,000	
2676	高千穂交易	1,000	820.00	820,000	
2692	伊藤忠食品	600	2,712.00	1,627,200	
2715	エレマテック	1,900	1,267.00	2,407,300	
2729	J A L U X	700	710.00	497,000	
2737	トーメンデバイス	300	1,669.00	500,700	
2760	東京エレクトロン デバイス	5	141,800.00	709,000	
2768	双日	162,800	120.00	19,536,000	
2784	アルフレッサ ホールディングス	6,400	3,085.00	19,744,000	
2874	横浜冷凍	5,600	609.00	3,410,400	
3004	神栄	3,000	164.00	492,000	
3022	山下医科器械	200	936.00	187,200	
3023	ラサ商事	1,100	341.00	375,100	
3036	アルコニックス	700	1,548.00	1,083,600	
3076	あい ホールディングス	4,300	336.00	1,444,800	
3107	ダイワボウホールディングス	24,000	180.00	4,320,000	
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	4,600	574.00	2,640,400	
3156	U K C ホールディングス	1,400	703.00	984,200	
3167	T O K A I ホールディングス	11,800	384.00	4,531,200	
3321	ミタチ産業	500	371.00	185,500	
3332	J F E 商事ホールディングス	16,000	323.00	5,168,000	
3360	シップヘルスケアホールディングス	3,200	1,719.00	5,500,800	
5009	富士興産	9,000	71.00	639,000	
6973	協栄産業	3,000	146.00	438,000	
7414	小野建	2,000	615.00	1,230,000	
7420	佐島電機	1,700	458.00	778,600	
7427	エコートレーディング	600	697.00	418,200	
7433	伯東	1,400	730.00	1,022,000	
7438	コンドーテック	900	893.00	803,700	
7442	中山福	1,300	584.00	759,200	
7447	ナガイレーベン	3,200	990.00	3,168,000	
7451	三菱食品	2,200	2,034.00	4,474,800	
7456	松田産業	1,800	1,159.00	2,086,200	
7459	メディパルホールディングス	26,200	774.00	20,278,800	
7463	アドヴァン	1,500	670.00	1,005,000	
7466	S P K	600	1,300.00	780,000	
7476	アズワン	1,600	1,556.00	2,489,600	
7480	スズデン	800	500.00	400,000	
7482	シモジマ	1,500	960.00	1,440,000	
7483	ドウシシャ	1,200	2,121.00	2,545,200	
7504	高速	1,500	590.00	885,000	
7517	黒田電気	3,000	818.00	2,454,000	
7537	丸文	1,900	310.00	589,000	
7552	ハピネット	1,300	690.00	897,000	
7558	トーメンエレクトロニクス	1,100	910.00	1,001,000	

7591	エクセル	1,100	724.00	796,400	
7594	マルカキカイ	800	655.00	524,000	
7599	ガリバーインターナショナル	740	3,070.00	2,271,800	

[次へ](#)

7600	日本エム・ディ・エム	2,200	165.00	363,000	
7607	進和	1,400	872.00	1,220,800	
7608	エスケイジャパン	700	237.00	165,900	
7609	ダイトエレクトロン	1,100	457.00	502,700	
7613	シークス	1,500	954.00	1,431,000	
7619	田中商事	800	396.00	316,800	
7628	オーハシテクニカ	1,300	582.00	756,600	
7631	マクニカ	1,200	1,630.00	1,956,000	
7637	白銅	800	763.00	610,400	
8001	伊藤忠商事	193,900	789.00	152,987,100	
8002	丸紅	213,000	473.00	100,749,000	
8007	高島	4,000	195.00	780,000	
8008	F & A アクアホールディングス	1,800	741.00	1,333,800	
8012	長瀬産業	13,700	830.00	11,371,000	
8014	蝶理	14,000	86.00	1,204,000	
8015	豊田通商	27,100	1,328.00	35,988,800	
8018	三共生興	4,100	260.00	1,066,000	
8020	兼松	51,000	72.00	3,672,000	
8025	ツカモトコーポレーション	5,000	88.00	440,000	
8031	三井物産	209,800	1,178.00	247,144,400	
8032	日本紙パルプ商事	12,000	277.00	3,324,000	
8036	日立ハイテクノロジーズ	7,400	1,647.00	12,187,800	
8037	カメイ	3,000	735.00	2,205,000	
8038	東都水産	5,000	138.00	690,000	
8043	スターゼン	8,000	233.00	1,864,000	
8051	山善	9,400	555.00	5,217,000	
8052	椿本興業	3,000	205.00	615,000	
8053	住友商事	143,400	1,031.00	147,845,400	
8057	内田洋行	6,000	213.00	1,278,000	
8058	三菱商事	177,100	1,555.00	275,390,500	
8059	第一実業	5,000	309.00	1,545,000	
8060	キャノンマーケティングジャパン	8,100	919.00	7,443,900	
8061	西華産業	9,000	216.00	1,944,000	
8065	佐藤商事	2,100	442.00	928,200	
8068	菱洋エレクトロ	2,700	847.00	2,286,900	
8070	東京産業	2,500	245.00	612,500	
8074	ユアサ商事	25,000	114.00	2,850,000	
8075	神鋼商事	6,000	179.00	1,074,000	
8078	阪和興業	24,000	344.00	8,256,000	
8081	カナデン	2,000	516.00	1,032,000	
8084	菱電商事	4,000	441.00	1,764,000	
8087	フルサト工業	1,500	599.00	898,500	
8088	岩谷産業	27,000	256.00	6,912,000	
8089	すてきナイスグループ	11,000	160.00	1,760,000	
8090	昭光通商	9,000	131.00	1,179,000	
8091	ニチモウ	4,000	176.00	704,000	
8093	極東貿易	3,000	217.00	651,000	
8095	イワキ	4,000	195.00	780,000	
8097	三愛石油	6,000	317.00	1,902,000	
8098	稲畑産業	6,400	464.00	2,969,600	
8101	G S Iクレオス	6,000	104.00	624,000	

8103	明和産業	2,000	211.00	422,000	
8129	東邦ホールディングス	7,800	1,031.00	8,041,800	
8130	サンゲツ	4,300	1,916.00	8,238,800	
8131	ミツウロコグループホールディングス	3,900	445.00	1,735,500	
8132	シナネン	5,000	343.00	1,715,000	
8133	伊藤忠エネクス	5,400	437.00	2,359,800	
8136	サンリオ	6,100	3,765.00	22,966,500	
8137	サンワテクノス	1,200	696.00	835,200	
8140	リョーサン	3,900	1,621.00	6,321,900	
8141	新光商事	2,600	604.00	1,570,400	
8142	トーヨー	5,000	307.00	1,535,000	
8150	三信電気	3,400	618.00	2,101,200	
8151	東陽テクニカ	3,500	776.00	2,716,000	
8153	モスフードサービス	3,200	1,514.00	4,844,800	
8154	加賀電子	2,600	790.00	2,054,000	
8158	ソーダニッカ	3,000	331.00	993,000	
8159	立花エレテック	1,400	686.00	960,400	
8283	P a l t a c	1,700	1,479.00	2,514,300	
8835	太平洋興発	9,000	73.00	657,000	
9305	ヤマタネ	13,000	113.00	1,469,000	
9763	丸紅建材リース	3,000	151.00	453,000	
9810	日鐵商事	5,000	202.00	1,010,000	
9830	トラスコ中山	3,000	1,398.00	4,194,000	
9832	オートバックスセブン	2,900	3,595.00	10,425,500	
9869	加藤産業	3,500	1,451.00	5,078,500	
9880	イノテック	1,500	510.00	765,000	
9882	イエローハット	2,300	1,260.00	2,898,000	
9883	富士エレクトロニクス	1,200	1,043.00	1,251,600	
9896	J Kホールディングス	2,100	344.00	722,400	
9902	日伝	1,000	2,612.00	2,612,000	
9930	北沢産業	2,500	159.00	397,500	
9932	杉本商事	1,300	686.00	891,800	
9934	因幡電機産業	2,800	2,145.00	6,006,000	
9938	住金物産	11,000	188.00	2,068,000	
9962	ミスミグループ本社	9,000	1,702.00	15,318,000	
9963	江守商事	400	875.00	350,000	
9972	アルテック	1,300	200.00	260,000	
9982	タキヒヨー	4,000	420.00	1,680,000	
9987	スズケン	9,300	2,080.00	19,344,000	
9991	ジェコス	1,700	305.00	518,500	
2651	ローソン	7,700	4,525.00	34,842,500	
2659	サンエー	800	3,040.00	2,432,000	
2660	キリン堂	1,100	489.00	537,900	
2662	ダイユーエイト	400	671.00	268,400	
2664	カワチ薬品	1,700	1,508.00	2,563,600	
2670	エービーシー・マート	3,500	2,927.00	10,244,500	
2674	ハードオフコーポレーション	1,200	509.00	610,800	
2678	アスクル	1,900	1,088.00	2,067,200	
2681	ゲオホールディングス	40	79,200.00	3,168,000	
2685	ポイント	2,060	3,315.00	6,828,900	
2687	シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,000	113.00	226,000	
2695	くらコーポレーション	1,300	971.00	1,262,300	

2698	キャンドウ	13	83,500.00	1,085,500	
2726	パル	700	3,095.00	2,166,500	
2730	エディオン	9,700	644.00	6,246,800	
2734	サーラコーポレーション	2,000	481.00	962,000	
2753	あみやき亭	4	187,000.00	748,000	
2764	ひらまつ	10	63,900.00	639,000	
2772	ゲンキー	200	1,764.00	352,800	
2792	ハニーズ	2,170	1,137.00	2,467,290	
3028	アルペン	1,500	1,361.00	2,041,500	
3048	ビックカメラ	92	41,550.00	3,822,600	
3050	D C Mホールディングス	12,600	587.00	7,396,200	
3064	M o n o t a R O	1,400	815.00	1,141,000	
3086	J . フロント リテイリング	58,000	360.00	20,880,000	
3087	ドトール・日レスホールディングス	3,800	976.00	3,708,800	
3088	マツモトキヨシホールディングス	4,500	1,568.00	7,056,000	
3097	物語コーポレーション	300	1,304.00	391,200	
3098	ココカラファイン	2,500	1,987.00	4,967,500	
3099	三越伊勢丹ホールディングス	48,300	776.00	37,480,800	
3148	クリエイティブSDホールディングス	1,000	1,599.00	1,599,000	
3159	丸善C H Iホールディングス	900	226.00	203,400	
3313	ブックオフコーポレーション	1,400	666.00	932,400	
3333	あさひ	1,400	1,578.00	2,209,200	
3337	サークルKサンクス	5,300	1,238.00	6,561,400	
3341	日本調剤	300	2,619.00	785,700	
3349	コスモス薬品	1,200	3,835.00	4,602,000	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	101,700	2,140.00	217,638,000	
3391	ツルハホールディングス	2,200	4,240.00	9,328,000	
3395	サンマルクホールディングス	700	2,954.00	2,067,800	
3396	フェリシモ	700	971.00	679,700	
3397	トリドール	2,100	735.00	1,543,500	
3398	クスリのアオキ	400	1,317.00	526,800	
4350	メディカルシステムネットワーク	400	783.00	313,200	
4775	総合メディカル	600	2,533.00	1,519,800	
7416	はるやま商事	1,100	380.00	418,000	
7421	カップ・クリエイティブ	1,800	1,801.00	3,241,800	
7445	ライトオン	1,900	615.00	1,168,500	
7448	ジーンズメイト	1,000	196.00	196,000	
7453	良品計画	2,600	3,505.00	9,113,000	
7455	三城ホールディングス	3,100	608.00	1,884,800	
7494	コナカ	2,900	532.00	1,542,800	
7506	ハウス オブ ローゼ	300	1,216.00	364,800	
7508	G - 7ホールディングス	700	371.00	259,700	
7512	イオン北海道	1,600	331.00	529,600	
7513	コジマ	3,300	501.00	1,653,300	
7516	コーナン商事	2,500	1,225.00	3,062,500	
7520	エコス	1,000	458.00	458,000	
7522	ワタミ	2,900	1,810.00	5,249,000	
7524	マルシェ	700	698.00	488,600	

7532	ドン・キホーテ	4,700	2,647.00	12,440,900	
7541	メガネトップ	3,500	860.00	3,010,000	
7545	西松屋チェーン	5,300	591.00	3,132,300	
7550	ゼンショーホールディングス	9,300	1,021.00	9,495,300	
7554	幸楽苑	1,500	1,190.00	1,785,000	
7561	ハークスレイ	500	522.00	261,000	
7581	サイゼリヤ	3,600	1,263.00	4,546,800	
7601	ポプラ	800	443.00	354,400	
7606	ユナイテッドアローズ	2,600	1,429.00	3,715,400	
7611	ハイデイ日高	1,000	1,222.00	1,222,000	
7615	京都きもの友禅	1,700	896.00	1,523,200	
7616	コロワイド	8,000	519.00	4,152,000	
7630	壱番屋	1,000	2,265.00	2,265,000	
7640	トップカルチャー	900	356.00	320,400	
7649	スギホールディングス	4,400	2,236.00	9,838,400	
8005	スクロール	3,200	270.00	864,000	
8028	ファミリーマート	7,500	3,055.00	22,912,500	
8160	木曽路	2,800	1,440.00	4,032,000	
8165	千趣会	4,400	519.00	2,283,600	
8166	タカキュー	2,000	132.00	264,000	
8168	ケーヨー	4,600	464.00	2,134,400	
8173	上新電機	5,000	850.00	4,250,000	
8174	日本瓦斯	2,300	1,146.00	2,635,800	
8175	ベスト電器	7,500	191.00	1,432,500	
8178	マルエツ	5,000	281.00	1,405,000	
8179	ロイヤルホールディングス	4,100	929.00	3,808,900	
8181	東天紅	2,000	115.00	230,000	
8182	いなげや	2,700	890.00	2,403,000	
8184	島忠	5,500	1,743.00	9,586,500	
8185	チヨダ	3,200	1,302.00	4,166,400	
8194	ライフコーポレーション	1,500	1,436.00	2,154,000	
8196	カスミ	5,000	487.00	2,435,000	
8200	リンガーハット	2,200	1,043.00	2,294,600	
8201	さが美	3,000	95.00	285,000	
8203	MrMax	2,500	302.00	755,000	
8207	テンアライド	2,100	262.00	550,200	
8214	AOKIホールディングス	2,200	1,157.00	2,545,400	
8217	オークワ	3,000	1,232.00	3,696,000	
8218	コメリ	3,300	2,295.00	7,573,500	
8219	青山商事	6,700	1,350.00	9,045,000	
8227	しまむら	2,800	7,470.00	20,916,000	
8229	CFSコーポレーション	1,500	339.00	508,500	
8233	高島屋	33,000	580.00	19,140,000	
8237	松屋	5,000	451.00	2,255,000	
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	13,000	600.00	7,800,000	
8245	丸栄	5,000	91.00	455,000	
8248	ニッセンホールディングス	4,900	362.00	1,773,800	
8251	パルコ	4,400	580.00	2,552,000	
8252	丸井グループ	31,900	576.00	18,374,400	
8255	原信ナルスホールディングス	1,400	1,275.00	1,785,000	
8263	ダイエー	15,300	286.00	4,375,800	
8266	イズミヤ	9,000	407.00	3,663,000	

8267	イオン	85,700	1,059.00	90,756,300	
8270	ユニー	18,300	686.00	12,553,800	
8273	イズミ	7,300	1,246.00	9,095,800	
8274	東武ストア	3,000	259.00	777,000	
8276	平和堂	4,500	958.00	4,311,000	
8278	フジ	2,700	1,826.00	4,930,200	
8279	ヤオコー	1,100	2,582.00	2,840,200	
8281	ゼビオ	2,900	1,803.00	5,228,700	
8282	ケースホールディングス	6,100	3,065.00	18,696,500	
8289	O l y m p i c	1,700	698.00	1,186,600	
8291	日産東京販売ホールディングス	4,000	141.00	564,000	
9627	アインファーマシーズ	1,300	3,565.00	4,634,500	
9828	元気寿司	800	945.00	756,000	
9831	ヤマダ電機	11,830	5,340.00	63,172,200	
9842	アークランドサカモト	1,600	1,477.00	2,363,200	
9843	ニトリホールディングス	4,800	7,200.00	34,560,000	
9854	愛眼	2,100	373.00	783,300	
9861	吉野家ホールディングス	66	103,200.00	6,811,200	
9887	松屋フーズ	1,100	1,508.00	1,658,800	
9900	サガミチェーン	3,000	520.00	1,560,000	
9945	ブレナス	2,700	1,251.00	3,377,700	
9946	ミニストップ	1,800	1,394.00	2,509,200	
9948	アークス	3,300	1,424.00	4,699,200	
9956	パロー	4,900	1,174.00	5,752,600	
9974	ベルク	1,200	1,122.00	1,346,400	
9979	大庄	1,200	978.00	1,173,600	
9983	ファーストリテイリング	5,700	12,940.00	73,758,000	
9989	サンドラッグ	4,600	2,342.00	10,773,200	
9993	ヤマザワ	600	1,290.00	774,000	
9994	やまや	400	1,007.00	402,800	
9997	ベルーナ	3,100	578.00	1,791,800	
8303	新生銀行	190,000	78.00	14,820,000	
8304	あおぞら銀行	76,000	212.00	16,112,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,840,400	329.00	605,491,600	
8308	りそなホールディングス	211,600	342.00	72,367,200	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	480,000	237.00	113,760,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	183,900	2,214.00	407,154,600	
8324	第四銀行	32,000	249.00	7,968,000	
8325	北越銀行	26,000	156.00	4,056,000	
8327	西日本シティ銀行	85,000	220.00	18,700,000	
8328	札幌北洋ホールディングス	36,700	283.00	10,386,100	
8331	千葉銀行	96,000	500.00	48,000,000	
8332	横浜銀行	156,000	372.00	58,032,000	
8333	常陽銀行	94,000	338.00	31,772,000	
8334	群馬銀行	55,000	417.00	22,935,000	
8336	武蔵野銀行	3,900	2,545.00	9,925,500	
8337	千葉興業銀行	4,700	404.00	1,898,800	
8338	筑波銀行	10,200	263.00	2,682,600	
8339	東京都民銀行	4,700	915.00	4,300,500	
8341	七十七銀行	38,000	340.00	12,920,000	

8342	青森銀行	18,000	227.00	4,086,000	
8343	秋田銀行	17,000	221.00	3,757,000	
8344	山形銀行	15,000	369.00	5,535,000	

[次へ](#)

8345	岩手銀行	1,600	3,300.00	5,280,000	
8346	東邦銀行	20,000	217.00	4,340,000	
8349	東北銀行	14,000	117.00	1,638,000	
8350	みちのく銀行	12,000	145.00	1,740,000	
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	99,000	332.00	32,868,000	
8355	静岡銀行	73,000	798.00	58,254,000	
8356	十六銀行	30,000	246.00	7,380,000	
8358	スルガ銀行	24,000	694.00	16,656,000	
8359	八十二銀行	45,000	443.00	19,935,000	
8360	山梨中央銀行	15,000	316.00	4,740,000	
8361	大垣共立銀行	33,000	252.00	8,316,000	
8362	福井銀行	21,000	233.00	4,893,000	
8363	北國銀行	29,000	268.00	7,772,000	
8364	清水銀行	800	2,975.00	2,380,000	
8366	滋賀銀行	23,000	514.00	11,822,000	
8367	南都銀行	23,000	423.00	9,729,000	
8368	百五銀行	22,000	306.00	6,732,000	
8369	京都銀行	43,000	671.00	28,853,000	
8374	三重銀行	10,000	174.00	1,740,000	
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	170,000	148.00	25,160,000	
8379	広島銀行	72,000	361.00	25,992,000	
8381	山陰合同銀行	14,000	575.00	8,050,000	
8382	中国銀行	20,000	1,052.00	21,040,000	
8383	鳥取銀行	8,000	150.00	1,200,000	
8385	伊予銀行	26,000	744.00	19,344,000	
8386	百十四銀行	27,000	349.00	9,423,000	
8387	四国銀行	18,000	289.00	5,202,000	
8388	阿波銀行	21,000	519.00	10,899,000	
8390	鹿児島銀行	16,000	533.00	8,528,000	
8392	大分銀行	16,000	228.00	3,648,000	
8393	宮崎銀行	16,000	194.00	3,104,000	
8394	肥後銀行	19,000	444.00	8,436,000	
8395	佐賀銀行	15,000	190.00	2,850,000	
8396	十八銀行	16,000	194.00	3,104,000	
8397	沖縄銀行	1,800	3,415.00	6,147,000	
8399	琉球銀行	5,100	960.00	4,896,000	
8409	八千代銀行	1,300	1,875.00	2,437,500	
8411	みずほフィナンシャルグループ	3,122,100	103.00	321,576,300	
8415	紀陽ホールディングス	97,000	118.00	11,446,000	
8418	山口フィナンシャルグループ	24,000	735.00	17,640,000	
8521	長野銀行	8,000	157.00	1,256,000	
8522	名古屋銀行	22,000	240.00	5,280,000	
8527	愛知銀行	900	4,285.00	3,856,500	
8529	第三銀行	14,000	159.00	2,226,000	
8530	中京銀行	10,000	202.00	2,020,000	
8536	東日本銀行	12,000	161.00	1,932,000	
8537	大光銀行	9,000	241.00	2,169,000	
8541	愛媛銀行	15,000	225.00	3,375,000	
8542	トマト銀行	9,000	126.00	1,134,000	
8543	みなと銀行	22,000	148.00	3,256,000	
8544	京葉銀行	20,000	375.00	7,500,000	

8545	関西アーバン銀行	34,000	127.00	4,318,000	
8550	栃木銀行	12,000	277.00	3,324,000	
8551	北日本銀行	800	1,790.00	1,432,000	
8558	東和銀行	25,000	93.00	2,325,000	
8562	福島銀行	29,000	41.00	1,189,000	
8563	大東銀行	17,000	63.00	1,071,000	
8600	トモニホールディングス	18,700	333.00	6,227,100	
8713	フィデアホールディングス	13,900	197.00	2,738,300	
8714	池田泉州ホールディングス	99,900	115.00	11,488,500	
8473	S B Iホールディングス	2,583	5,970.00	15,420,510	
8595	ジャフコ	3,100	1,307.00	4,051,700	
8601	大和証券グループ本社	241,000	247.00	59,527,000	
8604	野村ホールディングス	526,400	253.00	133,179,200	
8609	岡三証券グループ	21,000	239.00	5,019,000	
8613	丸三証券	8,300	242.00	2,008,600	
8614	東洋証券	9,000	105.00	945,000	
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	28,000	214.00	5,992,000	
8617	光世証券	7,000	57.00	399,000	
8622	水戸証券	8,000	98.00	784,000	
8624	いちよし証券	5,500	367.00	2,018,500	
8628	松井証券	14,500	378.00	5,481,000	
8692	だいこう証券ビジネス	1,400	244.00	341,600	
8698	マネックスグループ	197	12,600.00	2,482,200	
8703	カブドットコム証券	9,900	231.00	2,286,900	
8706	極東証券	3,200	408.00	1,305,600	
8707	岩井コスモホールディングス	2,400	242.00	580,800	
8742	小林洋行	900	175.00	157,500	
8630	N K S Jホールディングス	50,800	1,511.00	76,758,800	
8725	M S & A D インシュアランスグループホール	72,600	1,446.00	104,979,600	
8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	23,300	1,145.00	26,678,500	
8750	第一生命保険	1,301	77,500.00	100,827,500	
8766	東京海上ホールディングス	92,300	1,734.00	160,048,200	
8795	T & Dホールディングス	88,700	721.00	63,952,700	
8253	クレディセゾン	20,000	1,491.00	29,820,000	
8424	芙蓉総合リース	2,400	2,672.00	6,412,800	
8425	興銀リース	3,500	1,722.00	6,027,000	
8439	東京センチュリーリース	6,600	1,476.00	9,741,600	
8511	日本証券金融	10,300	354.00	3,646,200	
8512	大阪証券金融	4,200	153.00	642,600	
8519	ポケットカード	3,100	259.00	802,900	
8566	リコーリース	1,800	1,708.00	3,074,400	
8570	イオンクレジットサービス	11,000	1,148.00	12,628,000	
8572	アコム	5,030	1,351.00	6,795,530	
8574	プロミス	12,550	769.00	9,650,950	
8584	ジャックス	15,000	236.00	3,540,000	
8585	オリエントコーポレーション	37,000	70.00	2,590,000	
8586	日立キャピタル	5,000	1,020.00	5,100,000	
8591	オリックス	12,660	6,330.00	80,137,800	
8593	三菱UFJリース	6,230	2,982.00	18,577,860	
8772	アサックス	4	84,000.00	336,000	

8793	NECキャピタルソリューション	1,000	1,064.00	1,064,000	
2353	日本駐車場開発	266	3,525.00	937,650	
3003	昭栄	4,500	561.00	2,524,500	
3225	東京建物不動産販売	1,000	210.00	210,000	
3231	野村不動産ホールディングス	11,700	1,151.00	13,466,700	
3258	常和ホールディングス	400	1,243.00	497,200	
3265	ヒューリック	7,900	834.00	6,588,600	
4666	パーク24	12,500	940.00	11,750,000	
8801	三井不動産	108,000	1,160.00	125,280,000	
8802	三菱地所	170,000	1,222.00	207,740,000	
8803	平和不動産	23,000	157.00	3,611,000	
8804	東京建物	46,000	242.00	11,132,000	
8806	ダイビル	7,100	480.00	3,408,000	
8809	サンケイビル	4,200	306.00	1,285,200	
8815	東急不動産	49,000	294.00	14,406,000	
8818	京阪神ビルディング	2,900	338.00	980,200	
8830	住友不動産	58,000	1,434.00	83,172,000	
8833	東宝不動産	2,600	397.00	1,032,200	
8840	大京	38,000	151.00	5,738,000	
8841	テーオーシー	9,400	342.00	3,214,800	
8842	東京楽天地	4,000	270.00	1,080,000	
8848	レオパレス21	19,000	163.00	3,097,000	
8860	フジ住宅	3,000	361.00	1,083,000	
8864	空港施設	2,600	303.00	787,800	
8869	明和地所	1,200	333.00	399,600	
8870	住友不動産販売	870	3,055.00	2,657,850	
8871	ゴールドクレスト	2,210	1,233.00	2,724,930	
8875	東栄住宅	1,600	762.00	1,219,200	
8877	日本エスリード	900	659.00	593,100	
8879	東急リバブル	2,200	589.00	1,295,800	
8880	飯田産業	2,700	590.00	1,593,000	
8881	日神不動産	1,400	435.00	609,000	
8895	アーネストワン	4,000	790.00	3,160,000	
8897	タカラレーベン	2,800	457.00	1,279,600	
8904	サンヨーハウジング名古屋	10	73,300.00	733,000	
8905	イオンモール	11,100	1,672.00	18,559,200	
8907	フージャースコーポレーション	39	29,820.00	1,162,980	
8915	タクトホーム	12	62,500.00	750,000	
8918	ランド	5,600	14.00	78,400	
8923	トーセイ	25	19,750.00	493,750	
8933	エヌ・ティ・ティ都市開発	151	51,900.00	7,836,900	
8934	サンフロンティア不動産	22	8,160.00	179,520	
8944	ランドビジネス	18	15,320.00	275,760	
9706	日本空港ビルディング	7,800	1,005.00	7,839,000	
1954	日本工営	9,000	267.00	2,403,000	
2120	ネクスト	1,000	290.00	290,000	
2127	日本M&Aセンター	5	428,500.00	2,142,500	
2128	ノバレーゼ	5	51,100.00	255,500	
2131	アコーディア・ゴルフ	104	57,000.00	5,928,000	
2168	パソナグループ	26	76,300.00	1,983,800	
2170	リンクアンドモチベーション	6	39,900.00	239,400	
2181	テンブホールディングス	3,500	697.00	2,439,500	

2301	学情	1,000	255.00	255,000	
2305	スタジオアリス	1,200	1,201.00	1,441,200	
2309	シミック	800	1,264.00	1,011,200	
2322	NECフィールドディング	2,100	965.00	2,026,500	
2331	総合警備保障	9,400	813.00	7,642,200	
2371	カカクコム	4,000	2,776.00	11,104,000	
2378	ルネサンス	1,200	379.00	454,800	
2395	新日本科学	1,700	195.00	331,500	
2413	エムスリー	20	318,500.00	6,370,000	
2418	ベストプライダル	5	70,000.00	350,000	
2432	ディー・エヌ・エー	11,500	2,189.00	25,173,500	
2433	博報堂DYホールディングス	3,280	4,280.00	14,038,400	
2440	ぐるなび	1,800	861.00	1,549,800	
2450	一休	19	32,250.00	612,750	
2453	ジャパンベストレスキューシステム	4	70,500.00	282,000	
2462	ジェイコムホールディングス	500	690.00	345,000	
2466	PGMホールディングス	63	51,700.00	3,257,100	
4282	イーピーエス	14	153,600.00	2,150,400	
4301	アミューズ	700	958.00	670,600	
4310	ドリームインキュベータ	9	58,300.00	524,700	
4319	TAC	1,400	167.00	233,800	
4321	ケネディクス	284	11,780.00	3,345,520	
4324	電通	23,400	2,289.00	53,562,600	
4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	113	4,770.00	539,010	
4337	びあ	800	780.00	624,000	
4343	イオンファンタジー	900	1,202.00	1,081,800	
4544	みらかホールディングス	6,700	2,981.00	19,972,700	
4641	アルプス技研	1,200	742.00	890,400	
4651	サニックス	3,900	227.00	885,300	
4653	ダイオーズ	500	479.00	239,500	
4658	日本空調サービス	600	701.00	420,600	
4661	オリエンタルランド	6,900	7,970.00	54,993,000	
4665	ダスキン	7,700	1,501.00	11,557,700	
4668	明光ネットワークジャパン	2,300	670.00	1,541,000	
4671	ファルコSDホールディングス	1,400	885.00	1,239,000	
4678	秀英予備校	500	292.00	146,000	
4679	田谷	400	654.00	261,600	
4680	ラウンドワン	8,100	473.00	3,831,300	
4681	リゾートトラスト	4,000	1,101.00	4,404,000	
4694	ビー・エム・エル	1,700	1,875.00	3,187,500	
4696	ワタベウェディング	800	664.00	531,200	
4708	もしもしホットライン	4,300	709.00	3,048,700	
4711	東急コミュニティー	600	2,371.00	1,422,600	
4714	リソー教育	260	4,500.00	1,170,000	
4724	ウェアハウス	600	232.00	139,200	
4732	ユー・エス・エス	3,350	6,860.00	22,981,000	
4745	東京個別指導学院	1,300	137.00	178,100	
4767	テー・オー・ダブリュー	800	466.00	372,800	
4801	セントラルスポーツ	800	978.00	782,400	
5261	リゾートソリューション	2,000	139.00	278,000	
9603	エイチ・アイ・エス	2,600	1,995.00	5,187,000	
9616	共立メンテナンス	1,300	1,387.00	1,803,100	

9619	イチネンホールディングス	2,700	390.00	1,053,000	
9621	建設技術研究所	1,500	525.00	787,500	
9628	燦ホールディングス	500	1,383.00	691,500	
9632	スバル興業	2,000	237.00	474,000	
9633	東京テアトル	11,000	107.00	1,177,000	
9667	ホリプロ	800	627.00	501,600	
9671	よみうりランド	5,000	241.00	1,205,000	
9672	東京都競馬	20,000	106.00	2,120,000	
9675	常磐興産	8,000	79.00	632,000	
9678	カナモト	3,000	537.00	1,611,000	
9681	東京ドーム	21,000	179.00	3,759,000	
9715	トランス・コスモス	3,400	882.00	2,998,800	
9716	乃村工藝社	5,000	236.00	1,180,000	
9722	藤田観光	7,000	267.00	1,869,000	
9726	近畿日本ツーリスト	9,000	81.00	729,000	
9728	日本管財	900	1,393.00	1,253,700	
9729	トーカイ	1,000	1,645.00	1,645,000	
9731	白洋舎	3,000	215.00	645,000	
9735	セコム	25,000	3,480.00	87,000,000	
9740	セントラル警備保障	1,200	777.00	932,400	
9743	丹青社	3,000	197.00	591,000	
9744	メイテック	4,000	1,416.00	5,664,000	
9747	アサツー ディ・ケイ	4,500	2,040.00	9,180,000	
9755	応用地質	2,700	844.00	2,278,800	
9757	船井総合研究所	2,700	537.00	1,449,900	
9760	進学会	1,300	274.00	356,200	
9783	ベネッセホールディングス	7,900	3,570.00	28,203,000	
9787	イオンディライト	2,900	1,592.00	4,616,800	
9788	ナック	700	1,435.00	1,004,500	
9792	ニチイ学館	5,000	849.00	4,245,000	
9793	ダイセキ	4,100	1,342.00	5,502,200	
合計		37,613,115		24,351,426,960	

(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。

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

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

（1）貸借対照表

（単位：円）

科目	対象年月日	平成23年 6月15日現在	平成23年12月15日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		220,022,225	74,233,457
コール・ローン		1,239,153,245	578,004,228
株式		65,384,423,193	55,824,941,184
投資証券		1,156,013,940	1,059,946,429
派生商品評価勘定		11,833,405	426,755
未収入金		1,736,198	983,425,850
未収配当金		158,189,697	131,930,993
未収利息		1,855	1,071
差入委託証拠金		323,298,487	283,570,880
流動資産合計		68,494,672,245	58,936,480,847
資産合計		68,494,672,245	58,936,480,847
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		32,045,086	21,440,017
未払金		7,315,850	7,501,044
未払解約金		6,139,710	119,742,451
流動負債合計		45,500,646	148,683,512
負債合計		45,500,646	148,683,512
純資産の部			
元本等			
元本		74,374,163,489	74,828,443,055
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		5,924,991,890	16,040,645,720
元本等合計		68,449,171,599	58,787,797,335
純資産合計		68,449,171,599	58,787,797,335
負債純資産合計		68,494,672,245	58,936,480,847

（2）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、投資証券及び新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>（1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p>
--------------------	--

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

(追加情報)

当期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成23年 6月15日現在		平成23年12月15日現在	
1. 期首	平成22年12月16日	1. 期首	平成23年 6月16日
期首元本額	80,400,754,228円	期首元本額	74,374,163,489円
期首からの追加設定元本額	2,433,971,912円	期首からの追加設定元本額	6,496,887,493円
期首からの一部解約元本額	8,460,562,651円	期首からの一部解約元本額	6,042,607,927円
平成23年 6月15日現在の元本の内訳		平成23年12月15日現在の元本の内訳	
インデックスファンド海外株式ヘッジなし(DC専用)	12,471,670,183円	インデックスファンド海外株式ヘッジなし(DC専用)	13,234,231,760円
DCインデックスバランス(株式20)	41,779,079円	DCインデックスバランス(株式20)	52,176,172円
DCインデックスバランス(株式40)	148,835,280円	DCインデックスバランス(株式40)	180,230,339円
DCインデックスバランス(株式60)	287,159,229円	DCインデックスバランス(株式60)	343,388,318円
DCインデックスバランス(株式80)	316,979,992円	DCインデックスバランス(株式80)	360,680,944円
世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	13,606,527,054円	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	12,369,331,206円
日興五大陸株式ファンド	22,228,922,683円	日興五大陸株式ファンド	20,668,046,160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	80,582,232円	全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	87,568,300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)	106,747,677円	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(株式資産)	108,098,871円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	21,956,933円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	23,146,701円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	20,541,727円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	20,816,474円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	32,076,665円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	33,791,964円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	40,409,463円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	43,446,679円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	16,688,085,584円	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	18,432,958,960円
3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	58,222,476円	3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	65,758,597円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	21,759,649円	グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	23,488,100円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	41,882,104円	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	52,228,312円

年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式40)	110,882,985円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式40)	132,079,097円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式60)	147,303,192円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式60)	171,515,833円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式80)	145,201,773円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式80)	167,375,486円
年金積立 インデックス ファンド海外株式(ヘッ ジなし)	7,756,637,529円	年金積立 インデックス ファンド海外株式(ヘッ ジなし)	8,258,084,782円
計	74,374,163,489円	計	74,828,443,055円
2. 本報告書における開示対 象ファンドの当特定期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	74,374,163,489口	2. 本報告書における開示対 象ファンドの当特定期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	74,828,443,055口
3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、そ の差額は5,924,991,890円であります。		3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、 その差額は16,040,645,720円であります。	

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

[次へ](#)

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 平成22年12月16日 至 平成23年 6月15日	自 平成23年 6月16日 至 平成23年12月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成23年 6月15日現在	平成23年12月15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23年6月15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	2,693,242,662
投資証券	72,630,042
合計	2,765,872,704

(平成23年12月15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	1,497,482,264
投資証券	21,447,957
合計	1,518,930,221

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成23年6月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,919,614,414		1,910,931,478	8,682,936
	合計	1,919,614,414		1,910,931,478	8,682,936

(平成23年12月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,864,883,323		1,852,338,947	12,544,376
	合計	1,864,883,323		1,852,338,947	12,544,376

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

（平成23年6月15日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	売建	25,657,600		25,782,400	124,800
	米ドル	25,657,600		25,782,400	124,800
	買建	1,495,410,236		1,483,180,690	12,229,546
	米ドル	1,006,931,925		994,522,980	12,408,945
	ユーロ	488,478,311		488,657,710	179,399
合計		1,521,067,836		1,508,963,090	12,354,346

（平成23年12月15日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益	
市場取引以 外の取引	為替予約取引					
	買建	819,408,935		811,158,180	8,250,755	
	米ドル	443,750,610		443,880,880	130,270	
	ユーロ	375,658,325		367,277,300	8,381,025	
	売建	256,429,369		256,647,500	218,131	
	加ドル	33,784,785		33,804,000	19,215	
	豪ドル	38,590,000		38,620,000	30,000	
	英ポンド	108,605,250		108,711,000	105,750	
	スイスフラン	35,996,268		36,049,200	52,932	
	香港ドル	16,030,240		16,032,000	1,760	
	スウェーデンクローナ	11,159,100		11,160,000	900	
	ノルウェークローネ	6,128,471		6,128,800	329	
	デンマーククローネ	6,135,255		6,142,500	7,245	
	合計		1,075,838,304		1,067,805,680	8,468,886

(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23年 6月15日現在		平成23年12月15日現在	
1口当たり純資産額	0.9203円	1口当たり純資産額	0.7856円

(1万口当たり純資産額)

(9,203円)

(1万口当たり純資産額)

(7,856円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
米ドル				
ALPHA NATURAL RESOURCES INC	8,280	19.87	164,523.60	
ANADARKO PETROLEUM CORP	18,348	73.72	1,352,614.56	
APACHE CORP	14,119	87.69	1,238,095.11	
ARCH COAL INC	7,385	14.22	105,014.70	
BAKER HUGHES INC	15,965	45.96	733,751.40	
CABOT OIL & GAS CORP	3,950	73.28	289,456.00	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	9,281	46.56	432,123.36	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	24,685	22.57	557,140.45	
CHEVRON CORP	74,136	100.53	7,452,892.08	
CIMAREX ENERGY CO	3,355	60.05	201,467.75	
CONCHO RESOURCES INC	3,645	91.40	333,153.00	
CONOCOPHILLIPS	48,280	68.52	3,308,145.60	
CONSOL ENERGY INC	8,638	36.94	319,087.72	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,630	62.48	101,842.40	
DENBURY RESOURCES INC	15,145	14.32	216,876.40	
DEVON ENERGY CORPORATION	14,531	61.07	887,408.17	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	2,585	55.65	143,855.25	
EL PASO CORP	29,105	24.87	723,841.35	
ENERGEN CORP	2,310	46.36	107,091.60	
EOG RESOURCES INC	9,916	93.17	923,873.72	
EQT CORP	5,345	53.53	286,117.85	
EXXON MOBIL CORP	179,966	79.44	14,296,499.04	
FMC TECHNOLOGIES INC	9,065	47.72	432,581.80	
HALLIBURTON CO	33,807	31.00	1,048,017.00	
HELMERICH & PAYNE	4,100	54.13	221,933.00	
HESS CORP	11,580	53.82	623,235.60	
HOLLYFRONTIER CORP	7,800	21.88	170,664.00	
KINDER MORGAN INC	4,010	29.09	116,650.90	
MARATHON OIL CORP	26,707	26.99	720,821.93	
MARATHON PETROLEUM CORP	13,426	32.68	438,761.68	
MURPHY OIL CORP	6,965	51.50	358,697.50	
NABORS INDUSTRIES LTD	10,741	16.42	176,367.22	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	15,676	65.97	1,034,145.72	
NEWFIELD EXPLORATION CO	4,950	37.62	186,219.00	
NOBLE CORP	9,482	30.71	291,192.22	
NOBLE ENERGY INC	6,471	88.51	572,748.21	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	30,081	88.42	2,659,762.02	
PEABODY ENERGY CORP	10,365	33.81	350,440.65	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,990	82.84	330,531.60	
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	5,655	31.35	177,284.25	
QEP RESOURCES INC	6,820	28.25	192,665.00	
RANGE RESOURCES CORP	6,030	59.76	360,352.80	
ROWAN COMPANIES INC	4,980	30.20	150,396.00	
SCHLUMBERGER LTD	49,944	67.00	3,346,248.00	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	12,765	33.53	428,010.45	
SPECTRA ENERGY CORP	25,424	28.98	736,787.52	
SUNOCO INC	4,938	38.10	188,137.80	

ULTRA PETROLEUM CORP	5,524	29.95	165,443.80
VALERO ENERGY CORP	21,157	20.36	430,756.52
WEATHERFORD INTL LTD	28,429	13.42	381,517.18
WHITING PETROLEUM CORP	4,285	43.10	184,683.50
WILLIAMS COS INC	21,944	30.59	671,266.96
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	7,905	80.48	636,194.40
AIRGAS INC	2,650	75.05	198,882.50
ALCOA INC	39,339	8.94	351,690.66
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	4,010	43.71	175,277.10
BALL CORP	6,328	34.17	216,227.76
CELANESE CORP-SERIES A	6,010	42.07	252,840.70
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,695	129.97	350,269.15
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	5,350	62.58	334,803.00
CROWN HOLDINGS INC	6,195	32.23	199,664.85
DOW CHEMICAL	44,128	25.38	1,119,968.64
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	34,328	43.22	1,483,656.16
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,510	36.15	199,186.50
ECOLAB INC	10,900	54.08	589,472.00
FMC CORP	2,780	81.54	226,681.20
FREEMPORT-MCMORAN COPPER	34,943	37.44	1,308,265.92
INTERNATIONAL PAPER CO	15,520	27.28	423,385.60
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,224	52.09	167,938.16
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,450	30.70	320,815.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,070	71.43	147,860.10
MEADWESTVACO CORP	6,889	27.85	191,858.65
MONSANTO CO	19,671	67.72	1,332,120.12
MOSAIC CO/THE	11,390	47.36	539,430.40
NEWMONT MINING CORP	18,190	61.62	1,120,867.80
NUCOR CORP	11,649	38.72	451,049.28
OWENS-ILLINOIS INC	6,475	18.20	117,845.00
PPG INDUSTRIES INC	5,937	80.20	476,147.40
PRAXAIR INC	11,085	101.88	1,129,339.80
ROCK-TENN COMPANY-CL A	2,500	54.70	136,750.00
SEALED AIR CORP	4,356	17.05	74,269.80
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,327	83.54	277,937.58
SIGMA-ALDRICH	4,395	61.70	271,171.50
UNITED STATES STEEL CORP	5,237	25.40	133,019.80
VULCAN MATERIALS CO	4,443	37.97	168,700.71
WALTER ENERGY INC	2,240	62.32	139,596.80
3M CO	24,826	78.51	1,949,089.26
AGCO CORP	3,790	41.42	156,981.80
AMETEK INC	6,317	39.99	252,616.83
BOEING CO	25,922	69.94	1,812,984.68
CATERPILLAR INC	23,801	87.00	2,070,687.00
COOPER INDUSTRIES PLC	6,093	51.85	315,922.05
CUMMINS INC	6,955	87.51	608,632.05
DANAHER CORP	21,329	45.97	980,494.13
DEERE & CO	15,225	73.81	1,123,757.25
DOVER CORP	7,065	55.10	389,281.50
EATON CORP	12,221	41.84	511,326.64
EMERSON ELECTRIC CO	27,310	48.96	1,337,097.60
FASTENAL CO	10,363	40.29	417,525.27
FLOWSERVE CORP	2,185	96.34	210,502.90
FLUOR CORP	6,508	48.31	314,401.48

GENERAL DYNAMICS CORP	11,152	63.21	704,917.92
GENERAL ELECTRIC CO.	392,358	16.61	6,517,066.38
GOODRICH CORP	4,615	122.80	566,722.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	27,321	51.55	1,408,397.55
ILLINOIS TOOL WORKS	16,100	45.82	737,702.00
INGERSOLL-RAND PLC	12,056	30.37	366,140.72
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,810	39.75	191,197.50
JOY GLOBAL INC	3,935	75.44	296,856.40
KBR INC	5,860	24.58	144,038.80
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	3,816	64.61	246,551.76
LOCKHEED MARTIN CORP	10,281	76.29	784,337.49
MASCO CORP	14,899	8.64	128,727.36
NORTHROP GRUMMAN CORP	9,524	55.15	525,248.60
PACCAR INC	11,999	37.28	447,322.72
PALL CORP	4,486	56.31	252,606.66
PARKER HANNIFIN CORP	5,785	75.95	439,370.75
PENTAIR INC	3,864	33.92	131,066.88
PRECISION CASTPARTS CORP	5,365	154.05	826,478.25
QUANTA SERVICES INC	8,315	19.93	165,717.95
RAYTHEON COMPANY	12,662	44.92	568,777.04
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,398	72.10	389,195.80
ROCKWELL COLLINS INC.	5,725	53.18	304,455.50
ROPER INDUSTRIES INC	3,660	81.42	297,997.20
SPX CORP	2,087	57.53	120,065.11
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,081	63.00	383,103.00
TEXTRON INC	10,336	17.00	175,712.00
TYCO INTERNATIONAL LTD	16,935	44.91	760,550.85
UNITED TECHNOLOGIES CORP	31,810	73.17	2,327,537.70
URS CORP	3,410	33.31	113,587.10
WW GRAINGER INC	2,157	178.09	384,140.13
XYLEM INC	6,518	23.41	152,586.38
AVERY DENNISON CORP	4,680	27.12	126,921.60
CINTAS CORP	4,727	29.62	140,013.74
DUN & BRADSTREET CORP	2,082	70.30	146,364.60
EQUIFAX INC	5,159	37.35	192,688.65
IHS INC-CLASS A	1,710	82.52	141,109.20
IRON MOUNTAIN INC	6,817	29.24	199,329.08
MANPOWERGROUP	3,767	34.22	128,906.74
NIELSEN HOLDINGS NV	3,245	27.89	90,503.05
PITNEY BOWES INC	8,543	18.24	155,824.32
REPUBLIC SERVICES INC	11,045	26.87	296,779.15
ROBERT HALF INTL INC	5,715	26.44	151,104.60
RR DONNELLEY & SONS CO	8,005	13.90	111,269.50
STERICYCLE INC	3,025	76.41	231,140.25
VERISK ANALYTICS INC	4,000	38.27	153,080.00
WASTE MANAGEMENT INC	16,164	31.62	511,105.68
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,095	66.31	404,159.45
CSX CORP	40,333	20.04	808,273.32
DELTA AIR LINES INC	6,905	8.15	56,275.75
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,907	40.04	316,596.28
FEDEX CORP	11,143	77.29	861,242.47
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	9,780	10.82	105,819.60
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,875	42.69	165,423.75
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	200,000	0.61	122,000.00

KANSAS CITY SOUTHERN	4,130	61.90	255,647.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,830	70.02	898,356.60
SOUTHWEST AIRLINES CO	7,030	8.17	57,435.10
UNION PACIFIC CORP	17,968	98.62	1,772,004.16
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	2,495	19.83	49,475.85
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	27,127	70.64	1,916,251.28
AUTOLIV INC	3,510	49.24	172,832.40
BORGWARNER INC	4,135	61.90	255,956.50
FORD MOTOR COMPANY	130,580	10.15	1,325,387.00
GENERAL MOTORS CORP	28,115	19.47	547,399.05
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	9,385	13.26	124,445.10
HARLEY-DAVIDSON INC	8,894	36.53	324,897.82
JOHNSON CONTROLS INC	24,848	28.87	717,361.76
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	3,805	30.54	116,204.70
COACH INC	10,686	59.51	635,923.86
DR HORTON INC	12,086	11.69	141,285.34
FOSSIL INC	2,035	81.53	165,913.55
GARMIN LTD	4,625	37.47	173,298.75
HASBRO INC	4,458	33.85	150,903.30
LEGGETT & PLATT INC	4,468	21.40	95,615.20
LULULEMON ATHLETICA INC	3,600	43.61	156,996.00
MATTEL INC	12,894	27.80	358,453.20
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,318	52.17	120,930.06
NEWELL RUBBERMAID INC	11,190	14.82	165,835.80
NIKE INC -CL B	13,187	94.39	1,244,720.93
RALPH LAUREN CORP	2,385	138.88	331,228.80
TOLL BROTHERS INC	4,501	19.02	85,609.02
VF CORP	3,315	130.40	432,276.00
WHIRLPOOL CORP	2,934	46.76	137,193.84
APOLLO GROUP INC-CL A	4,612	49.43	227,971.16
CARNIVAL CORP	17,087	32.92	562,504.04
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,155	321.11	370,882.05
DARDEN RESTAURANTS INC	5,223	43.13	225,267.99
DEVRY INC	2,085	32.99	68,784.15
H&R BLOCK INC	12,000	15.37	184,440.00
INTL GAME TECHNOLOGY	11,686	15.72	183,703.92
LAS VEGAS SANDS CORP	13,660	40.91	558,830.60
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,746	28.29	304,004.34
MCDONALD'S CORP	38,191	97.61	3,727,823.51
MGM RESORTS INTERNATIONAL	14,000	9.28	129,920.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,908	24.93	122,356.44
STARBUCKS CORP	27,537	43.09	1,186,569.33
STARWOOD HOTELS & RESORTS	7,417	45.08	334,358.36
WYNN RESORTS LTD	3,060	102.29	313,007.40
YUM! BRANDS INC	17,094	57.37	980,682.78
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	8,425	14.00	117,950.00
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	23,163	25.04	580,001.52
COMCAST CORP-CLASS A	76,926	23.18	1,783,144.68
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	24,091	22.99	553,852.09
DIRECTV-CLASS A	26,989	45.36	1,224,221.04
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	4,960	40.18	199,292.80
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	4,635	36.90	171,031.50
DISH NETWORK CORP-A	7,659	25.96	198,827.64
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	19,376	8.90	172,446.40

LIBERTY GLOBAL INC-A	5,413	38.02	205,802.26	
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	4,683	36.72	171,959.76	

[次へ](#)

LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-A	4,085	73.72	301,146.20
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	11,137	42.28	470,872.36
NEWS CORP-CL A	67,572	17.14	1,158,184.08
NEWS CORP-CLASS B	15,779	17.62	278,025.98
OMNICOM GROUP	10,512	42.21	443,711.52
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	3,320	41.30	137,116.00
SIRIUS XM RADIO INC	135,530	1.76	238,532.80
THE WALT DISNEY CO.	64,978	35.16	2,284,626.48
TIME WARNER CABLE	11,907	62.04	738,710.28
TIME WARNER INC	38,343	33.81	1,296,376.83
VIACOM INC-CLASS B	19,183	42.38	812,975.54
VIRGIN MEDIA INC	11,460	21.34	244,556.40
WASHINGTON POST-CLASS B	212	352.05	74,634.60
ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	3,321	46.26	153,629.46
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,708	66.90	181,165.20
AMAZON.COM INC	13,440	180.21	2,422,022.40
AUTOZONE INC	932	324.32	302,266.24
BED BATH & BEYOND INC	9,172	60.66	556,373.52
BEST BUY CO INC	11,434	23.35	266,983.90
CARMAX INC	8,679	29.82	258,807.78
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	4,840	40.94	198,149.60
DOLLAR TREE INC	4,557	81.14	369,754.98
EXPEDIA INC	7,285	27.37	199,390.45
FAMILY DOLLAR STORES	4,623	57.02	263,603.46
GAMESTOP CORP-CLASS A	5,150	23.49	120,973.50
GAP INC/THE	13,956	18.31	255,534.36
GENUINE PARTS CO	5,771	57.18	329,985.78
HOME DEPOT INC	57,640	39.14	2,256,029.60
J.C. PENNEY CO INC	6,061	32.37	196,194.57
KOHL'S CORP	9,687	49.34	477,956.58
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	22,020	15.29	336,685.80
LIMITED INC/THE	9,518	39.31	374,152.58
LOWE'S COS INC	46,132	24.48	1,129,311.36
MACY'S INC	16,209	30.82	499,561.38
NETFLIX INC	1,830	71.04	130,003.20
NORDSTROM INC	6,625	47.14	312,302.50
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,135	78.58	403,508.30
PETSMART INC	4,460	48.43	215,997.80
PRICELINE.COM INC	1,825	445.19	812,471.75
ROSS STORES INC	4,328	92.83	401,768.24
SEARS HOLDINGS CORP	1,516	51.17	77,573.72
STAPLES INC	25,644	14.20	364,144.80
TARGET CORP	23,500	52.48	1,233,280.00
TIFFANY & CO	4,560	63.65	290,244.00
TJX COMPANIES INC	13,989	62.17	869,696.13
URBAN OUTFITTERS INC	4,770	27.11	129,314.70
COSTCO WHOLESALE CORP	16,139	82.75	1,335,502.25
CVS CAREMARK CORP	49,517	37.04	1,834,109.68
KROGER CO	21,620	23.55	509,151.00
SAFEWAY INC	13,113	20.64	270,652.32
SYSCO CORP	22,006	28.90	635,973.40
WALGREEN CO	33,152	33.61	1,114,238.72
WAL-MART STORES INC	70,167	57.65	4,045,127.55
WHOLE FOODS MARKET INC	5,545	66.01	366,025.45

ALTRIA GROUP INC	76,308	28.73	2,192,328.84
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	24,373	27.43	668,551.39
BEAM INC	5,276	49.63	261,847.88
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,145	77.53	243,831.85
BUNGE LTD	5,487	57.34	314,624.58
CAMPBELL SOUP CO	7,215	32.28	232,900.20
COCA-COLA CO/THE	76,486	66.26	5,067,962.36
COCA-COLA ENTERPRISES	12,290	25.26	310,445.40
CONAGRA FOODS INC	15,880	25.26	401,128.80
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,965	19.36	154,202.40
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	8,259	37.78	312,025.02
GENERAL MILLS INC	23,974	39.73	952,487.02
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	4,875	47.72	232,635.00
HANSEN NATURAL CORPORATION	2,825	92.73	261,962.25
HERSHEY CO/THE	6,065	58.84	356,864.60
HJ HEINZ CO	11,835	52.59	622,402.65
HORMEL FOODS CORP	5,800	28.60	165,880.00
JM SMUCKER CO/THE	4,230	76.39	323,129.70
KELLOGG CO	9,318	48.69	453,693.42
KRAFT FOODS INC-CLASS A	61,820	36.16	2,235,411.20
LORILLARD INC	5,120	108.37	554,854.40
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,765	48.82	232,627.30
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	7,816	72.58	567,285.28
MOLSON COORS BREWING CO -B	5,920	40.74	241,180.80
PEPSICO INC	58,576	63.98	3,747,692.48
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	65,013	74.86	4,866,873.18
RALCORP HOLDINGS INC	1,820	84.38	153,571.60
REYNOLDS AMERICAN INC	13,220	40.35	533,427.00
SARA LEE CORP	20,968	18.33	384,343.44
TYSON FOODS INC-CL A	11,206	19.93	223,335.58
AVON PRODUCTS	15,953	16.96	270,562.88
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,515	44.04	242,880.60
CLOROX COMPANY	4,926	64.97	320,042.22
COLGATE-PALMOLIVE CO	17,900	89.30	1,598,470.00
ENERGIZER HOLDINGS INC	2,751	72.13	198,429.63
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,525	105.57	477,704.25
HERBALIFE LTD	4,450	50.84	226,238.00
KIMBERLY-CLARK CORP	14,373	70.21	1,009,128.33
PROCTER & GAMBLE CO	101,714	64.45	6,555,467.30
AETNA INC	13,803	39.28	542,181.84
AMERISOURCEBERGEN CORP	10,214	35.57	363,311.98
BAXTER INTERNATIONAL INC	20,934	48.41	1,013,414.94
BECTON DICKINSON AND CO	7,966	71.52	569,728.32
BOSTON SCIENTIFIC CORP	58,938	5.13	302,351.94
CARDINAL HEALTH INC	12,760	40.58	517,800.80
CAREFUSION CORP	8,275	24.01	198,682.75
CERNER CORP	5,335	56.69	302,441.15
CIGNA CORP	10,330	42.57	439,748.10
COVENTRY HEALTH CARE INC	5,075	30.98	157,223.50
COVIDIEN PLC	18,155	42.16	765,414.80
CR BARD INC	3,174	84.61	268,552.14
DAVITA INC	3,499	72.61	254,062.39
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	5,687	34.85	198,191.95
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,300	65.88	283,284.00

EXPRESS SCRIPTS INC	17,032	43.71	744,468.72
HCA HOLDINGS INC	6,715	20.60	138,329.00
HENRY SCHEIN INC	3,595	61.39	220,697.05
HOLOGIC INC	10,708	16.58	177,538.64
HUMANA INC	6,315	84.54	533,870.10
INTUITIVE SURGICAL INC	1,450	423.52	614,104.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,685	81.40	299,959.00
MCKESSON CORP	9,064	76.67	694,936.88
MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	14,182	54.83	777,599.06
MEDTRONIC INC	39,042	35.36	1,380,525.12
OMNICARE INC	3,640	32.22	117,280.80
PATTERSON COS INC	3,142	28.49	89,515.58
QUEST DIAGNOSTICS	5,866	55.67	326,560.22
ST JUDE MEDICAL INC	12,080	33.79	408,183.20
STRYKER CORP	10,688	46.77	499,877.76
UNITEDHEALTH GROUP INC	39,705	47.76	1,896,310.80
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,304	63.09	271,539.36
WELLPOINT INC	13,311	63.52	845,514.72
ZIMMER HOLDINGS INC	6,962	47.47	330,486.14
ABBOTT LABORATORIES	57,617	54.23	3,124,569.91
AGILENT TECHNOLOGIES INC	13,235	32.93	435,828.55
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	6,820	63.03	429,864.60
ALLERGAN INC	11,485	82.47	947,167.95
AMGEN INC	29,401	57.62	1,694,085.62
BIOGEN IDEC INC	8,617	109.63	944,681.71
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	62,946	33.74	2,123,798.04
CELGENE CORP	17,372	63.03	1,094,957.16
COVANCE INC	2,000	43.43	86,860.00
ELI LILLY & CO	38,503	40.04	1,541,660.12
FOREST LABORATORIES INC	10,990	28.55	313,764.50
GILEAD SCIENCES INC	29,542	38.76	1,145,047.92
HOSPIRA INC	6,181	28.21	174,366.01
ILLUMINA INC	4,745	27.21	129,111.45
JOHNSON & JOHNSON	101,429	63.18	6,408,284.22
LIFE TECHNOLOGIES CORP	6,776	38.32	259,656.32
MERCK & CO. INC.	114,033	35.56	4,055,013.48
MYLAN INC	16,250	19.95	324,187.50
PERRIGO CO	3,180	95.83	304,739.40
PFIZER INC	288,785	20.86	6,024,055.10
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	14,129	43.75	618,143.75
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	7,990	30.54	244,014.60
WARNER CHILCOTT PLC	4,500	14.13	63,585.00
WATERS CORP	3,526	71.84	253,307.84
WATSON PHARMACEUTICALS INC	4,705	59.97	282,158.85
BB&T CORP	25,818	23.20	598,977.60
CIT GROUP INC	7,175	33.53	240,577.75
COMERICA INC	7,190	25.02	179,893.80
FIFTH THIRD BANCORP	35,519	11.80	419,124.20
HUDSON CITY BANCORP INC	19,870	5.78	114,848.60
KEYCORP	34,838	7.11	247,698.18
M & T BANK CORP	4,273	71.22	304,323.06
NATIONAL BANK OF GREECE-ADR	20,000	1.90	38,000.00
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	16,064	11.85	190,358.40
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	14,980	12.29	184,104.20

PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	19,370	54.05	1,046,948.50
REGIONS FINANCIAL CORP	45,874	3.98	182,578.52
SUNTRUST BANKS INC	20,582	16.44	338,368.08
US BANCORP	70,746	25.78	1,823,831.88
WELLS FARGO & CO	185,655	25.86	4,801,038.30
AMERICAN EXPRESS CO	39,664	47.08	1,867,381.12
AMERIPRISE FINANCIAL INC	9,035	44.95	406,123.25
BANK OF AMERICA CORPORATION	373,269	5.23	1,952,196.87
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	45,167	18.58	839,202.86
BLACKROCK INC	3,465	166.94	578,447.10
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	17,185	44.33	761,811.05
CITIGROUP INC	108,002	26.05	2,813,452.10
CME GROUP INC	2,306	238.89	550,880.34
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	20,765	23.82	494,622.30
EATON VANCE CORP	3,790	22.69	85,995.10
FRANKLIN RESOURCES INC	5,845	94.55	552,644.75
GOLDMAN SACHS GROUP INC	17,688	93.25	1,649,406.00
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	2,760	117.25	323,610.00
INVESCO LTD	17,037	19.11	325,577.07
JPMORGAN CHASE & CO	144,320	31.51	4,547,523.20
LEGG MASON INC	5,775	23.74	137,098.50
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	22.03	160,929.15
MOODY'S CORP	7,797	32.88	256,365.36
MORGAN STANLEY	52,185	15.06	785,906.10
NASDAQ OMX GROUP/THE	5,095	24.06	122,585.70
NORTHERN TRUST CORP	8,255	39.25	324,008.75
NYSE EURONEXT	9,700	26.62	258,214.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	40,144	10.97	440,379.68
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,325	15.81	68,378.25
SLM CORP	19,832	12.98	257,419.36
STATE STREET CORP	18,822	39.23	738,387.06
T ROWE PRICE GROUP INC	9,655	54.13	522,625.15
TD AMERITRADE HOLDING CORP	8,530	15.14	129,186.85
ACE LTD	12,563	67.26	844,987.38
AFLAC INC	17,422	41.62	725,103.64
ALLSTATE CORP	18,543	26.25	486,753.75
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	17,935	22.78	408,559.30
AON CORP	11,057	45.06	498,228.42
ARCH CAPITAL GROUP LTD	5,295	36.43	192,896.85
ASSURANT INC	3,640	39.07	142,214.80
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	4,795	30.18	144,713.10
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	33,570	75.52	2,535,206.40
CHUBB CORP	10,453	67.15	701,918.95
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,340	29.58	187,537.20
EVEREST RE GROUP LTD	2,074	80.62	167,205.88
FIDELITY NATIONAL FINL-A	5,881	15.43	90,743.83
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	18,645	6.22	115,971.90
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	16,187	16.22	262,553.14
LINCOLN NATIONAL CORP	11,528	18.46	212,806.88
LOEWS CORP	12,325	37.29	459,599.25
MARSH & MCLENNAN COS	20,428	30.79	628,978.12
METLIFE INC	38,870	30.53	1,186,701.10
PARTNERRE LTD	2,372	62.42	148,060.24
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,120	23.46	284,335.20

PROGRESSIVE CORP	22,020	18.57	408,911.40
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	17,782	47.66	847,490.12
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,497	71.70	107,334.90
TORCHMARK CORP	4,271	42.30	180,663.30
TRAVELERS COS INC/THE	15,224	55.97	852,087.28
UNUM GROUP	10,918	20.26	221,198.68
WILLIS GROUP HOLDING	6,260	38.01	237,942.60
WR BERKLEY CORP	5,288	32.97	174,345.36
XL GROUP PLC	11,880	19.50	231,660.00
CBRE GROUP INC	11,490	14.54	167,064.60
ACCENTURE PLC-CL A	23,828	56.03	1,335,082.84
ACTIVISION BLIZZARD INC	19,170	11.76	225,439.20
ADOBE SYSTEMS INC	18,109	26.52	480,250.68
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	7,210	26.66	192,218.60
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,025	100.06	202,621.50
AUTODESK INC	8,720	31.25	272,500.00
AUTOMATIC DATA PROCESSING	18,036	51.11	921,819.96
BMC SOFTWARE INC	6,394	33.33	213,112.02
CA INC	14,815	20.13	298,225.95
CITRIX SYSTEMS INC	7,178	63.93	458,889.54
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	11,154	65.08	725,902.32
COMPUTER SCIENCES CORP	5,583	24.93	139,184.19
EBAY INC	42,737	30.27	1,293,648.99
ELECTRONIC ARTS INC	12,614	20.34	256,568.76
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	9,055	25.39	229,906.45
FISERV INC	5,139	57.22	294,053.58
GOOGLE INC-CL A	9,411	618.07	5,816,656.77
INTL BUSINESS MACHINES CORP	44,202	188.72	8,341,801.44
INTUIT INC	10,826	51.80	560,786.80
MASTERCARD INC-CLASS A	4,005	361.12	1,446,285.60
MICROSOFT CORP	279,099	25.59	7,142,143.41
NUANCE COMMUNICATIONS INC	9,350	23.52	219,912.00
ORACLE CORP	149,793	29.87	4,474,316.91
PAYCHEX INC	11,862	29.26	347,082.12
RED HAT INC	7,270	45.98	334,274.60
SAIC INC	10,745	12.16	130,659.20
SALESFORCE.COM INC	4,690	108.37	508,255.30
SYMANTEC CORP	27,165	15.39	418,069.35
SYNOPSYS INC	4,627	26.68	123,448.36
TERADATA CORP	6,370	48.97	311,938.90
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,506	19.29	86,920.74
VERISIGN INC	6,275	33.24	208,581.00
VISA INC-CLASS A SHARES	19,190	96.36	1,849,148.40
VMWARE INC	3,115	87.72	273,247.80
WESTERN UNION CO	23,401	17.37	406,475.37
YAHOO! INC	44,155	15.02	663,208.10
AMPHENOL CORP-CL A	6,280	41.80	262,504.00
APPLE COMPUTER INC	34,316	380.19	13,046,600.04
ARROW ELECTRONICS INC	4,490	33.77	151,627.30
AVNET INC	6,080	28.32	172,185.60
CISCO SYSTEMS INC	203,585	17.98	3,660,458.30
CORNING INC	57,428	13.14	754,603.92
DELL INC	60,546	15.05	911,217.30
DOLBY LABORATORIES INC CLASS A	2,100	31.37	65,877.00

EMC CORP/MASS	76,009	22.18	1,685,879.62	
F5 NETWORKS INC	3,005	104.65	314,473.25	
FLEXTRONICS INTL LTD	27,456	5.84	160,343.04	
FLIR SYSTEMS INC	5,565	25.10	139,681.50	
HARRIS CORP	4,560	34.23	156,088.80	

[次へ](#)

HEWLETT-PACKARD CO	76,400	26.38	2,015,432.00
JUNIPER NETWORKS INC	19,573	18.88	369,538.24
MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS I	10,493	38.78	406,918.54
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11,725	45.69	535,715.25
NETAPP INC	13,486	37.13	500,735.18
QUALCOMM INC	62,072	53.10	3,296,023.20
SANDISK CORP	8,963	48.35	433,361.05
SEAGATE TECHNOLOGY	15,444	15.47	238,918.68
TE CONNECTIVITY LTD	15,970	30.33	484,370.10
WESTERN DIGITAL CORP	8,555	30.51	261,013.05
XEROX CORP	52,349	7.79	407,798.71
AMERICAN TOWER CORP-CL A	14,624	57.99	848,045.76
AT&T INC	219,346	28.81	6,319,358.26
CENTURYLINK INC	22,876	35.35	808,666.60
CROWN CASTLE INTL CORP	10,700	42.76	457,532.00
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	39,734	4.87	193,504.58
METROPCS COMMUNICATIONS INC	11,720	8.19	95,986.80
NII HOLDINGS INC	6,497	19.70	127,990.90
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	4,610	39.89	183,892.90
SPRINT NEXTEL CORP	111,942	2.27	254,108.34
VERIZON COMMUNICATIONS INC	104,788	38.26	4,009,188.88
WINDSTREAM CORP	20,465	11.30	231,254.50
AES CORP	24,528	11.51	282,317.28
ALLIANT ENERGY CORP	3,610	41.47	149,706.70
AMEREN CORPORATION	8,922	31.67	282,559.74
AMERICAN ELECTRIC POWER	18,058	38.72	699,205.76
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,080	30.37	215,019.60
CALPINE CORP	12,490	15.04	187,849.60
CENTERPOINT ENERGY INC	14,762	18.76	276,935.12
CONSOLIDATED EDISON INC	10,856	58.80	638,332.80
CONSTELLATION ENERGY GROUP	7,245	38.96	282,265.20
DOMINION RESOURCES INC/VA	21,167	50.18	1,062,160.06
DTE ENERGY COMPANY	6,468	51.72	334,524.96
DUKE ENERGY CORP	49,023	20.85	1,022,129.55
EDISON INTERNATIONAL	11,819	38.81	458,695.39
ENTERGY CORP	6,547	70.60	462,218.20
EXELON CORP	24,439	42.94	1,049,410.66
FIRSTENERGY CORP	15,755	43.92	691,959.60
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	2,420	50.38	121,919.60
MDU RESOURCES GROUP INC	8,455	20.41	172,566.55
NEXTERA ENERGY INC	14,755	57.17	843,543.35
NISOURCE INC	10,915	21.87	238,711.05
NORTHEAST UTILITIES	6,920	34.29	237,286.80
NRG ENERGY INC	9,360	18.00	168,480.00
NSTAR	3,415	44.93	153,435.95
ONEOK INC	3,910	81.11	317,140.10
P G & E CORP	14,601	38.61	563,744.61
PEPCO HOLDINGS INC	7,192	19.30	138,805.60
PINNACLE WEST CAPITAL	4,514	45.30	204,484.20
PPL CORPORATION	21,108	28.63	604,322.04
PROGRESS ENERGY INC	11,073	54.43	602,703.39
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	18,763	31.05	582,591.15
SCANA CORP	4,853	42.43	205,912.79
SEMPRA ENERGY	8,592	51.93	446,182.56

SOUTHERN CO	31,875	44.14	1,406,962.50	
WISCONSIN ENERGY CORP	8,949	32.48	290,663.52	
XCEL ENERGY INC	18,014	25.87	466,022.18	
ADVANCED MICRO DEVICES	23,671	5.07	120,011.97	
ALTERA CORPORATION	12,226	33.90	414,461.40	
ANALOG DEVICES INC	11,196	33.69	377,193.24	
APPLIED MATERIALS INC	48,423	10.33	500,209.59	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	8,140	28.71	233,699.40	
BROADCOM CORP-CL A	17,556	28.45	499,468.20	
CREE INC	3,840	22.04	84,633.60	
FIRST SOLAR INC	2,040	33.45	68,238.00	
INTEL CORP	194,362	23.31	4,530,578.22	
KLA-TENCOR CORPORATION	6,269	46.22	289,753.18	
LAM RESEARCH CORP	4,827	39.48	190,569.96	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	8,904	28.66	255,188.64	
LSI CORP	20,595	5.40	111,213.00	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	18,834	13.49	254,070.66	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	11,295	25.07	283,165.65	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	7,429	33.69	250,283.01	
MICRON TECHNOLOGY INC	32,857	5.45	179,070.65	
NVIDIA CORP	22,805	13.58	309,691.90	
TEXAS INSTRUMENTS INC	42,522	28.04	1,192,316.88	
XILINX INC	9,885	31.19	308,313.15	
米ドル小計	11,405,386		414,004,597.75 (32,333,759,084)	
加ドル				
ARC RESOURCES LTD	10,615	24.52	260,279.80	
ATHABASCA OIL SANDS CORP	11,180	11.85	132,483.00	
BAYTEX ENERGY CORP	4,425	52.24	231,162.00	
BONAVISTA ENERGY CORP	4,985	25.04	124,824.40	
CAMECO CORP	15,332	17.79	272,756.28	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	40,359	35.01	1,412,968.59	
CANADIAN OIL SANDS LTD	17,840	21.19	378,029.60	
CENOVUS ENERGY INC	28,298	31.40	888,557.20	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	9,325	42.00	391,650.00	
ENBRIDGE INC	27,915	36.12	1,008,289.80	
ENCANA CORP	27,648	18.81	520,058.88	
ENERPLUS CORP	6,630	24.72	163,893.60	
HUSKY ENERGY INC	10,659	24.15	257,414.85	
IMPERIAL OIL LTD	10,992	42.56	467,819.52	
MEG ENERGY CORP	4,510	39.35	177,468.50	
NEXEN INC	20,125	14.63	294,428.75	
NIKO RESOURCES LTD	1,695	42.78	72,512.10	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	9,390	18.93	177,752.70	
PEMBINA PIPELINE CORP	6,305	29.40	185,367.00	
PENGROWTH ENERGY CORP	12,780	10.55	134,829.00	
PENN WEST PETROLEUM LTD	17,873	18.53	331,186.69	
PRECISION DRILLING CORP	8,865	9.66	85,635.90	
PROGRESS ENERGY RESOURCES CORP	8,615	12.71	109,496.65	
SUNCOR ENERGY INC	58,115	28.13	1,634,774.95	
TALISMAN ENERGY INC	37,632	11.80	444,057.60	
TOURMALINE OIL CORP	4,005	27.05	108,335.25	
TRANSCANADA CORP	26,368	42.61	1,123,540.48	
VERMILION ENERGY INC	3,000	44.22	132,660.00	
AGNICO-EAGLE MINES LTD	6,375	40.15	255,956.25	

AGRIUM INC	5,965	67.13	400,430.45
BARRICK GOLD CORP	36,789	46.47	1,709,584.83
CENTERRA GOLD INC	6,530	19.00	124,070.00
ELDORADO GOLD CORP	20,510	15.34	314,623.40
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	17,720	18.55	328,706.00
FRANCO-NEVADA CORP	4,495	38.86	174,675.70
GOLDCORP INC	29,632	47.31	1,401,889.92
IAMGOLD CORP	14,165	17.59	249,162.35
INMET MINING CORPORATION	2,100	62.36	130,956.00
IVANHOE MINES LTD	9,940	16.60	165,004.00
KINROSS GOLD CORP	42,395	12.30	521,458.50
NEW GOLD INC	16,160	10.11	163,377.60
OSISKO MINING CORP	13,590	9.35	127,066.50
PAN AMERICAN SILVER CORP	4,115	23.44	96,455.60
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	31,442	40.27	1,266,169.34
SILVER WHEATON CORP	13,240	30.23	400,245.20
TECK RESOURCES LTD-CLS B	21,740	35.09	762,856.60
YAMANA GOLD INC	27,931	14.52	405,558.12
BOMBARDIER INC 'B'	52,816	3.50	184,856.00
CAE INC	10,675	9.69	103,440.75
FINNING INTERNATIONAL INC	6,675	23.32	155,661.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	5,715	48.55	277,463.25
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	4,495	20.73	93,181.35
CANADIAN NATL RAILWAY CO	16,639	76.25	1,268,723.75
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,245	65.50	409,047.50
MAGNA INTERNATIONAL INC	8,149	34.14	278,206.86
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,920	19.70	77,224.00
TIM HORTONS INC	6,045	48.70	294,391.50
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	13,305	19.60	260,778.00
THOMSON REUTERS CORP	13,504	27.24	367,848.96
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,970	64.32	191,030.40
ALIMENTATION COUCHE SUB VTG	4,700	30.76	144,572.00
EMPIRE CO LTD 'A'	1,000	62.00	62,000.00
LOBLAW COMPANIES LTD	3,849	37.54	144,491.46
METRO INC -A	3,975	52.08	207,018.00
SHOPPERS DRUG MART INC	8,180	43.00	351,740.00
WESTON (GEORGE) LTD	1,872	66.20	123,926.40
SAPUTO INC	5,200	38.40	199,680.00
VITERRA INC	14,445	10.54	152,250.30
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	10,754	45.32	487,371.28
BANK OF MONTREAL	23,256	55.12	1,281,870.72
BANK OF NOVA SCOTIA	39,979	48.47	1,937,782.13
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	14,655	71.45	1,047,099.75
NATIONAL BANK OF CANADA	6,080	68.71	417,756.80
ROYAL BANK OF CANADA	53,179	48.19	2,562,696.01
TORONTO-DOMINION BANK	32,750	72.40	2,371,100.00
CI FINANCIAL CORP	5,690	20.45	116,360.50
IGM FINANCIAL INC	4,295	44.00	188,980.00
ONEX CORPORATION	3,845	32.37	124,462.65
TMX GROUP INC	2,295	41.67	95,632.65
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	752	413.96	311,297.92
GREAT-WEST LIFECO INC	11,084	19.17	212,480.28
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	3,955	25.80	102,039.00
INTACT FINANCIAL CORP	4,025	58.23	234,375.75

MANULIFE FINANCIAL CORP	66,461	10.38	689,865.18	
POWER CORP OF CANADA	12,990	22.17	287,988.30	
POWER FINANCIAL CORP	9,735	24.60	239,481.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	21,564	19.19	413,813.16	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	21,397	27.24	582,854.28	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES CORP	8,664	15.59	135,071.76	
CGI GROUP INC - CL A	8,920	18.40	164,128.00	
OPEN TEXT CORPORATION	2,255	54.14	122,085.70	
RESEARCH IN MOTION	16,878	15.69	264,815.82	
BCE INC	10,310	40.41	416,627.10	
BELL ALIANT INC	2,800	27.60	77,280.00	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	15,720	37.35	587,142.00	
TELUS CORP	2,500	56.21	140,525.00	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	5,628	53.74	302,448.72	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	3,115	59.90	186,588.50	
FORTIS INC	7,035	32.18	226,386.30	
TRANSALTA CORP	7,950	20.46	162,657.00	
加ドル小計	1,405,205		42,359,074.19 (3,183,284,425)	
豪ドル				
CALTEX AUSTRALIA LTD	6,385	12.75	81,408.75	
ORIGIN ENERGY LTD	40,210	14.23	572,188.30	
SANTOS LTD	33,605	12.90	433,504.50	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	23,318	31.63	737,548.34	
WORLEYPARSONS LTD	7,260	27.39	198,851.40	
ALUMINA LTD	94,332	1.30	123,103.26	
AMCOR LIMITED	44,030	7.36	324,060.80	
BHP BILLITON LTD	118,871	35.70	4,243,694.70	
BORAL LTD	28,545	3.64	103,903.80	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	46,275	4.69	217,029.75	
ILUKA RESOURCES LTD	15,185	16.54	251,159.90	
INCITEC PIVOT LTD	64,675	3.11	201,139.25	
JAMES HARDIE INDUSTRIES SE	13,935	6.72	93,643.20	
LYNAS CORP LTD	61,300	1.27	78,157.50	
NEWCREST MINING LTD	27,889	31.81	887,149.09	
ONESTEEL LTD	33,285	0.77	25,795.87	
ORICA LIMITED	13,435	25.61	344,070.35	
OZ MINERALS LTD	14,421	10.68	154,016.28	
RIO TINTO LTD	15,983	63.16	1,009,486.28	
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	6,495	13.31	86,448.45	
LEIGHTON HOLDINGS LTD	5,867	20.21	118,572.07	
BRAMBLES LTD	53,968	7.18	387,490.24	
CAMPBELL BROTHERS LTD	2,540	50.10	127,254.00	
ASCIANO LTD	36,333	4.70	170,765.10	
MAP GROUP(N)	16,920	2.75	46,530.00	
QANTAS AIRWAYS LTD	34,245	1.53	52,394.85	
QR NATIONAL LTD	59,950	3.51	210,424.50	
TOLL HOLDINGS LTD	24,745	4.53	112,094.85	
TRANSURBAN GROUP	47,535	5.65	268,572.75	
CROWN LTD	17,690	8.15	144,173.50	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	23,977	3.71	88,954.67	
TABCORP HOLDINGS LTD	23,977	2.75	65,936.75	
TATTS GROUP LTD	60,640	2.39	144,929.60	
FAIRFAX MEDIA LTD	100,125	0.74	74,593.12	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	25,515	2.08	53,071.20	

METCASH LTD	31,790	4.21	133,835.90	
WESFARMERS LTD	37,030	30.80	1,140,524.00	
WOOLWORTHS LTD	44,647	25.95	1,158,589.65	
COCA-COLA AMATIL LTD	20,630	11.86	244,671.80	
COCHLEAR LTD	2,157	56.10	121,007.70	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	4,895	18.61	91,095.95	
SONIC HEALTHCARE LTD	14,760	11.46	169,149.60	
CSL LTD	19,732	32.15	634,383.80	
AUST AND NZ BANKING GROUP	96,829	20.97	2,030,504.13	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	15,708	9.14	143,571.12	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	57,692	49.38	2,848,830.96	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	81,168	23.86	1,936,668.48	
WESTPAC BANKING CORP	111,671	20.80	2,322,756.80	
ASX LTD	6,590	30.69	202,247.10	
MACQUARIE GROUP LTD	13,366	24.13	322,521.58	
AMP LTD	106,402	4.33	460,720.66	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	73,478	3.11	228,516.58	
QBE INSURANCE GROUP LTD	40,780	13.71	559,093.80	
SUNCORP GROUP LTD	46,700	8.41	392,747.00	
COMPUTERSHARE LTD	17,960	7.99	143,500.40	
TELSTRA CORPORATION LTD	165,734	3.27	541,950.18	
AGL ENERGY LTD	17,300	14.46	250,158.00	
豪ドル小計	2,270,480		28,309,162.16 (2,188,298,234)	
英ボンド				
AMEC PLC	13,270	8.84	117,306.80	
BG GROUP PLC	125,474	13.28	1,666,294.72	
BP PLC	701,158	4.40	3,091,756.20	
CAIRN ENERGY PLC	54,760	2.68	147,249.64	
ESSAR ENERGY PLC	10,660	1.93	20,584.46	
PETROFAC LTD	9,765	14.03	137,002.95	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	133,953	22.57	3,023,319.21	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	99,359	23.30	2,315,561.49	
TULLOW OIL PLC	33,380	13.28	443,286.40	
ANGLO AMERICAN PLC	48,709	22.79	1,110,321.65	
ANTOFAGASTA PLC	14,880	11.20	166,656.00	
BHP BILLITON PLC	77,826	18.35	1,428,496.23	
EURASIAN NATURAL RESOURCES	10,270	6.11	62,749.70	
FRESNILLO PLC	6,750	14.94	100,845.00	
GLENCORE INTERNATIONAL-WI	32,380	3.83	124,193.49	
JOHNSON MATTHEY PLC	8,419	17.59	148,090.21	
KAZAKHMYS PLC-	7,325	8.46	62,006.12	
LONMIN PLC	7,445	9.44	70,318.02	
RANDGOLD RESOURCES LTD	3,455	63.60	219,738.00	
REXAM PLC	32,225	3.38	109,210.52	
RIO TINTO PLC	51,780	30.35	1,571,781.90	
VEDANTA RESOURCES PLC	3,810	10.65	40,576.50	
XSTRATA PLC	76,330	9.38	716,357.05	
BAE SYSTEMS PLC ORD	120,170	2.68	322,896.79	
BALFOUR BEATTY PLC	18,710	2.36	44,249.15	
BUNZL PLC	10,376	8.49	88,144.12	
COBHAM PLC	34,695	1.69	58,773.33	
INVENSYS PLC	27,080	1.95	52,833.08	
MEGGITT PLC	29,235	3.39	99,252.82	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS -C SHR	4,947,645		4,947.64	

ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	69,575	7.09	493,286.75
SMITHS GROUP PLC	14,563	8.86	129,028.18
WEIR GROUP PLC/THE	8,360	18.68	156,164.80
WOLSELEY PLC	10,805	19.00	205,295.00
AGGREKO PLC	10,021	17.98	180,177.58
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	9,775	6.91	67,594.12
CAPITA GROUP PLC	23,289	6.14	143,110.90
EXPERIAN PLC	37,623	8.16	307,003.68
G4S PLC	55,329	2.49	137,990.52
INTERTEK GROUP PLC	6,595	19.04	125,568.80
SERCO GROUP PLC	19,895	4.58	91,119.10
GKN PLC	58,715	1.70	99,991.64
BURBERRY GROUP PLC	16,414	11.39	186,955.46
CARNIVAL PLC	6,710	21.34	143,191.40
COMPASS GROUP PLC	69,263	5.77	399,993.82
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	11,647	10.68	124,389.96
TUI TRAVEL PLC	21,725	1.49	32,457.15
WHITBREAD PLC	6,950	15.08	104,806.00
BRITISH SKY BROADCASTING GRO	41,474	7.25	300,686.50
ITV PLC	147,795	0.61	90,154.95
PEARSON PLC	30,264	11.27	341,075.28
REED ELSEVIER PLC	46,281	5.06	234,413.26
WPP PLC	46,044	6.38	293,760.72
KINGFISHER PLC	88,782	2.37	210,590.90
MARKS & SPENCER GROUP PLC	58,200	3.08	179,256.00
NEXT PLC	6,637	25.85	171,566.45
SAINSBURY (J) PLC	44,131	2.88	127,362.06
TESCO PLC	295,104	3.86	1,140,134.30
WM MORRISON SUPERMARKETS	79,475	3.16	251,856.27
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,365	10.86	145,143.90
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	73,172	30.07	2,200,647.90
DIAGEO PLC	92,302	13.67	1,262,229.85
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	37,317	23.68	883,666.56
SABMILLER PLC	35,271	21.57	760,971.82
TATE & LYLE PLC	17,580	6.77	119,104.50
UNILEVER PLC	47,232	20.97	990,455.04
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	22,620	31.62	715,244.40
SMITH & NEPHEW PLC	33,686	5.83	196,389.38
ASTRAZENECA PLC	49,523	29.15	1,443,595.45
GLAXOSMITHKLINE PLC	187,821	14.38	2,700,865.98
SHIRE PLC	21,315	21.10	449,746.50
BARCLAYS PLC	425,991	1.70	725,462.67
HSBC HOLDINGS PLC	660,571	4.80	3,170,740.80
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,500,886	0.24	361,188.21
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	681,204	0.19	132,834.78
STANDARD CHARTERED PLC	87,749	13.65	1,197,773.85
3I GROUP PLC	45,264	1.75	79,393.05
ICAP PLC	23,340	3.22	75,178.14
INVESTEC PLC	13,185	3.28	43,312.72
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	4,068	7.56	30,774.42
MAN GROUP PLC	68,256	1.30	88,732.80
SCHRODERS PLC	4,981	12.66	63,059.46
ADMIRAL GROUP PLC	6,965	7.87	54,814.55
AVIVA PLC	107,165	2.87	308,420.87

LEGAL & GENERAL GROUP PLC	224,901	0.98	222,314.63	
OLD MUTUAL PLC	208,740	1.11	231,701.40	
PRUDENTIAL PLC	93,757	6.00	563,010.78	
RESOLUTION LTD	51,593	2.50	129,446.83	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	123,607	1.00	124,348.64	
STANDARD LIFE PLC	87,275	1.93	168,789.85	
SAGE GROUP PLC/THE	53,555	2.81	150,757.32	
BT GROUP PLC	293,952	1.87	549,690.24	
INMARSAT PLC	16,910	3.95	66,828.32	
VODAFONE GROUP PLC	1,881,450	1.74	3,277,485.90	
CENTRICA PLC	188,610	2.81	531,125.76	
INTERNATIONAL POWER PLC	58,505	3.23	189,322.18	
NATIONAL GRID PLC	131,805	6.05	798,079.27	
SEVERN TRENT PLC	9,623	14.67	141,169.41	
SSE PLC	34,057	12.51	426,053.07	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,735	5.91	158,003.85	
ARM HOLDINGS PLC	50,630	5.48	277,452.40	
英ボンド小計	15,889,269		50,239,108.19 (6,069,889,051)	
スイスフラン				
TRANSOCEAN LTD	11,995	38.35	460,008.25	
GIVAUDAN-REG	328	836.50	274,372.00	
HOLCIM LIMITED-REG SHRS	9,383	49.45	463,989.35	
SIKA AG-BR	85	1,640.00	139,400.00	
SYNGENTA AG-REG	3,471	261.40	907,319.40	
ABB LTD-REG	80,555	16.79	1,352,518.45	
GEBERIT AG-REG	1,525	172.90	263,672.50	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	780	106.10	82,758.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,900	104.10	197,790.00	
SULZER AG-REG	870	93.40	81,258.00	
ADECCO SA-REG	4,757	36.61	174,153.77	
SGS SA-REG	201	1,529.00	307,329.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,020	103.50	209,070.00	
CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	19,594	45.74	896,229.56	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,170	326.80	382,356.00	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,520	58.15	88,388.00	
ARYZTA AG	2,630	43.65	114,799.50	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	40	2,778.00	111,120.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	5	31,400.00	157,000.00	
NESTLE SA-REG	122,143	51.45	6,284,257.35	
SONOVA HOLDING AG-REG	1,940	93.50	181,390.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	211	167.90	35,426.90	
SYNTHESES INC	2,494	154.90	386,320.60	
ACTELION LTD-REG	4,640	31.75	147,320.00	
LONZA GROUP AG-REG	1,650	52.95	87,367.50	
NOVARTIS AG-REG	86,383	51.20	4,422,809.60	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	26,003	157.10	4,085,071.30	
CREDIT SUISSE GROUP-REG	42,085	21.52	905,669.20	
GAM HOLDING LTD	5,635	9.98	56,237.30	
JULIUS BAER GROUP LTD	8,140	33.80	275,132.00	
PARGESA HOLDING SA-BR	1,280	60.85	77,888.00	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	500	162.00	81,000.00	
UBS AG-REG	134,447	10.95	1,472,194.65	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,390	60.15	83,608.50	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	850	86.15	73,227.50	

SWISS RE LTD	12,679	46.84	593,884.36	
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	5,341	201.00	1,073,541.00	
SWISSCOM AG-REG	894	346.60	309,860.40	
スイスフラン小計	601,534		27,295,737.94 (2,236,612,766)	
香港ドル				
HUTCHISON WHAMPOA LTD	78,823	65.00	5,123,495.00	
NWS HOLDINGS LTD	48,500	10.56	512,160.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	37,000	13.16	486,920.00	
MTR CORP	54,500	24.80	1,351,600.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	10,500	41.40	434,700.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	24,500	23.45	574,525.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	45,000	14.20	639,000.00	
SANDS CHINA LTD	92,600	22.45	2,078,870.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	48,000	13.30	638,400.00	
SJM HOLDINGS LTD	57,000	12.80	729,600.00	
WYNN MACAU LTD	58,200	19.64	1,143,048.00	
LI & FUNG LTD	210,000	15.00	3,150,000.00	
LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	26,500	17.76	470,640.00	
BANK OF EAST ASIA	60,440	27.30	1,650,012.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	137,500	17.88	2,458,500.00	
HANG SENG BANK LTD	28,600	93.35	2,669,810.00	
WING HANG BANK LTD	7,500	61.35	460,125.00	
FIRST PACIFIC CO	80,000	8.66	692,800.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	38,200	125.10	4,778,820.00	
AIA GROUP LTD	311,800	23.55	7,342,890.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	51,682	88.60	4,579,025.20	
HANG LUNG GROUP LTD	33,000	43.00	1,419,000.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	90,000	22.60	2,034,000.00	
HENDERSON LAND DVLP CO LTD	37,426	36.75	1,375,405.50	
HOPEWELL HOLDINGS	29,000	20.15	584,350.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	22,000	25.50	561,000.00	
KERRY PROPERTIES LTD	27,950	25.60	715,520.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	131,000	6.29	823,990.00	
SINO LAND CO	105,050	10.12	1,063,106.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	51,480	95.35	4,908,618.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	28,017	91.15	2,553,749.55	
WHARF HOLDINGS LTD	57,800	34.80	2,011,440.00	
WHEELLOCK & CO LTD	34,000	19.16	651,440.00	
FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	76,000	4.63	351,880.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	15,000	44.00	660,000.00	
CLP HOLDINGS LTD	72,000	66.25	4,770,000.00	
HONG KONG & CHINA GAS	183,156	17.54	3,212,556.24	
POWER ASSETS HOLDINGS	52,500	57.60	3,024,000.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	86.95	565,175.00	
香港ドル小計	2,558,724		73,250,170.49 (734,699,210)	
シンガポールドル				
COSCO CORP SINGAPORE LTD	47,000	0.88	41,360.00	
FRASER AND NEAVE LTD	37,000	6.05	223,850.00	
KEPPEL CORP LTD	55,660	9.05	503,723.00	
NOBLE GROUP LTD	141,854	1.16	164,550.64	
SEBACORP INDUSTRIES LTD	32,000	3.99	127,680.00	
SEBACORP MARINE LTD	27,000	3.76	101,520.00	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	64,000	2.66	170,240.00	

YANGZIJIANG SHIPBUILDING	71,000	0.92	65,675.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	77,000	1.40	107,800.00	
NEPTUNE ORIENT LINES LTD	30,000	1.15	34,650.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	20,800	10.11	210,288.00	

[次へ](#)

GENTING SINGAPORE PLC	222,000	1.49	330,780.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	55,050	3.67	202,033.50	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,000	47.84	191,360.00	
OLAM INTERNATIONAL LTD	47,000	2.22	104,340.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	220,000	0.71	156,200.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	74,000	5.05	373,700.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	65,625	11.81	775,031.25	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	96,240	7.95	765,108.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	48,300	15.83	764,589.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,000	6.01	210,350.00	
CAPITALAND LTD	101,000	2.32	234,320.00	
CAPITAMALLS ASIA LTD	50,000	1.19	59,750.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	20,000	9.00	180,000.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	60,000	1.68	101,100.00	
KEPPEL LAND LTD	30,000	2.23	66,900.00	
UOL GROUP LTD	22,250	3.93	87,442.50	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	294,810	3.15	928,651.50	
シンガポールドル小計	2,048,589		7,282,992.39 (434,503,325)	
ニュージーランドドル				
FLETCHER BUILDING LTD	23,390	6.16	144,082.40	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	43,390	2.41	104,569.90	
SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	19,990	3.47	69,365.30	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	72,897	2.08	151,625.76	
CONTACT ENERGY LIMITED	9,430	5.37	50,639.10	
ニュージーランドドル小計	169,097		520,282.46 (30,452,132)	
スウェーデンクローナ				
LUNDIN PETROLEUM AB	8,370	159.50	1,335,015.00	
BOLIDEN AB	10,875	97.15	1,056,506.25	
HOLMEN AB-B SHS	1,885	186.50	351,552.50	
SSAB AB-A SHARES	6,295	56.35	354,723.25	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	21,345	97.90	2,089,675.50	
ALFA LAVAL AB	12,110	123.70	1,498,007.00	
ASSA ABLOY AB-B	11,670	159.70	1,863,699.00	
ATLAS COPCO AB-A SHS	24,945	138.20	3,447,399.00	
ATLAS COPCO AB-B SHS	14,760	121.90	1,799,244.00	
SANDVIK AB	37,770	79.50	3,002,715.00	
SCANIA AB-B SHS	12,030	96.35	1,159,090.50	
SKANSKA AB-B SHS	14,750	103.20	1,522,200.00	
SKF AB-B SHS	14,614	133.80	1,955,353.20	
VOLVO AB-B SHARES	50,800	71.35	3,624,580.00	
SECURITAS AB-B SHS	12,199	60.90	742,919.10	
ELECTROLUX AB - B	8,875	107.30	952,287.50	
HUSQVARNA AB-B SHS	14,220	30.65	435,843.00	
MODERN TIMES GROUP-B SHS	2,085	302.80	631,338.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	37,358	210.00	7,845,180.00	
SWEDISH MATCH AB	8,145	234.00	1,905,930.00	
GETINGE AB-B SHS	7,610	168.40	1,281,524.00	
NORDEA BANK AB	96,108	50.45	4,848,648.60	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	53,625	38.48	2,063,490.00	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	18,130	177.10	3,210,823.00	
SWEDBANK AB - A SHARES	30,470	84.80	2,583,856.00	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,390	76.50	335,835.00	

INVESTOR AB-B SHS	17,415	122.20	2,128,113.00	
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	6,715	131.60	883,694.00	
RATOS AB-B SHS	7,000	77.45	542,150.00	
ERICSSON LM-B SHS	110,650	66.55	7,363,757.50	
HEXAGON AB-B SHS	8,970	90.45	811,336.50	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2,970	705.00	2,093,850.00	
TELE2 AB-B SHS	12,235	123.60	1,512,246.00	
TELIASONERA AB	80,590	45.29	3,649,921.10	
スウェーデンクローナ小計	781,979		70,882,502.50 (791,757,552)	
ノルウェークローネ				
AKER SOLUTIONS ASA	6,800	58.85	400,180.00	
SEADRILL LTD	12,500	190.90	2,386,250.00	
STATOIL ASA	41,084	145.20	5,965,396.80	
SUBSEA 7 SA	10,615	101.60	1,078,484.00	
NORSK HYDRO A S	34,250	24.87	851,797.50	
YARA INTERNATIONAL ASA	7,150	221.00	1,580,150.00	
ORKLA ASA	28,690	41.75	1,197,807.50	
DNB ASA	36,510	51.25	1,871,137.50	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,250	65.05	471,612.50	
TELENOR ASA	27,340	92.70	2,534,418.00	
ノルウェークローネ小計	212,189		18,337,233.80 (239,300,901)	
デンマーククローネ				
NOVOZYMES A/S-B SHARES	8,275	166.00	1,373,650.00	
VESTAS WIND SYSTEMS AS	7,500	64.00	480,000.00	
A P MOLLER - MAERSK A/S - A	23	32,780.00	753,940.00	
A P MOLLER - MAERSK A/S - B	48	34,500.00	1,656,000.00	
DSV A/S	7,370	97.15	715,995.50	
CARLSBERG AS-B	3,930	394.50	1,550,385.00	
COLOPLAST-B	881	811.50	714,931.50	
WILLIAM DEMANT HOLDING	1,000	447.80	447,800.00	
NOVO NORDISK A/S-B	15,660	632.50	9,904,950.00	
DANSKE BANK A/S	23,595	70.25	1,657,548.75	
TRYG A/S	1,045	309.20	323,114.00	
TDC A/S	14,545	46.23	672,415.35	
デンマーククローネ小計	83,872		20,250,730.10 (276,422,465)	
イスラエルシュケル				
ISRAEL CHEMICALS LTD	18,570	35.60	661,092.00	
ISRAEL CORP LIMITED/THE	108	2,196.00	237,168.00	
TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	34,765	154.30	5,364,239.50	
BANK HAPOLIM BM	50,865	12.69	645,476.85	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	56,605	11.20	633,976.00	
NICE SYSTEMS LTD	2,860	126.50	361,790.00	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	81,755	7.34	600,081.70	
イスラエルシュケル小計	245,528		8,503,824.05 (175,263,813)	
ユーロ				
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	5,990	15.38	92,156.15	
ENI SPA	88,481	15.45	1,367,031.45	
FUGRO NV-CVA	2,640	40.55	107,052.00	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	9,315	11.32	105,445.80	
NESTE OIL OYJ	3,590	7.83	28,109.70	
OMV AG	6,300	23.37	147,262.50	

REPSOL YPF SA	29,891	22.28	665,971.48
SAIPEM SPA	10,135	30.88	312,968.80
SBM OFFSHORE NV	6,700	15.00	100,533.50
TECHNIP SA	3,748	65.50	245,494.00
TENARIS SA	17,925	13.15	235,713.75
TOTAL SA	78,567	37.56	2,951,369.35
ACERINOX SA	4,717	9.52	44,948.29
AIR LIQUIDE	10,412	89.36	930,416.32
AKZO NOBEL NV	8,668	33.82	293,151.76
ARCELORMITTAL	32,076	12.80	410,572.80
ARKEMA	2,005	48.09	96,420.45
BASF SE	33,845	50.58	1,711,880.10
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	5,550	5.04	27,988.65
CRH PLC	27,255	13.18	359,220.90
HEIDELBERGCEMENT AG	5,055	29.37	148,465.35
IMERYS SA	1,520	32.12	48,822.40
K+S AG	6,500	33.35	216,775.00
KONINKLIJKE DSM NV	5,682	34.30	194,921.01
LAFARGE SA	7,458	25.12	187,344.96
LANXESS AG	3,300	35.74	117,942.00
LINDE AG	6,345	107.30	680,818.50
SALZGITTER AG	1,685	35.63	60,036.55
SOLVAY ET CIE SA -A	2,181	61.47	134,066.07
STORA ENSO OYJ-R SHS	20,375	4.10	83,578.25
THYSSENKRUPP AG	14,570	16.74	243,901.80
UMICORE	4,445	29.97	133,216.65
UPM-KYMMENE OYJ	18,648	7.80	145,547.64
VOESTALPINE AG	4,239	19.25	81,621.94
WACKER CHEMIE AG	580	60.00	34,800.00
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	5,146	21.93	112,877.51
ALSTOM	7,390	22.46	165,979.40
BEKAERT NV	1,540	25.77	39,693.50
BOSKALIS WESTMINSTER	2,855	24.34	69,490.70
BOUYGUES SA	6,820	23.06	157,303.30
BRENNTAG AG	1,125	70.03	78,783.75
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	14,831	27.74	411,411.94
EADS NV	14,968	22.15	331,541.20
EIFFAGE	1,915	15.96	30,572.97
FERROVIAL SA	13,715	8.98	123,256.70
FIAT INDUSTRIAL	28,270	5.96	168,630.55
FINMECCANICA SPA	14,290	2.72	38,868.80
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	2,535	18.30	46,390.50
GEA GROUP AG	6,740	19.67	132,609.50
HOCHTIEF AG	1,655	40.01	66,216.55
KONE OYJ-B	5,907	38.16	225,411.12
KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRON	37,821	14.64	553,699.44
LEGRAND SA	7,405	23.02	170,463.10
MAN SE	2,414	60.45	145,926.30
METSO OYJ	4,900	25.02	122,598.00
PRYSMIAN SPA	8,610	9.63	82,914.30
SAFRAN SA	6,190	21.43	132,682.65
SCHNEIDER ELECTRIC SA	18,033	37.51	676,417.83
SIEMENS AG-REG	30,456	72.08	2,195,268.48
THALES SA	3,505	21.69	76,023.45

VALLOUREC	4,265	46.10	196,637.82
VINCI SA	16,635	31.48	523,752.97
WARTSILA OYJ	6,100	21.25	129,625.00
WENDEL	1,190	46.10	54,859.00
ZARDOYA OTIS SA	5,219	9.96	51,981.24
BUREAU VERITAS SA	1,770	53.69	95,031.30
EDENRED	6,096	17.79	108,447.84
RANDSTAD HOLDING NV	4,405	20.65	90,985.27
SOCIETE BIC SA	1,265	65.00	82,225.00
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	14,551	11.75	171,047.00
ADP	1,210	51.30	62,073.00
ATLANTIA SPA	11,496	11.34	130,364.64
DEUTCHE LUFTHANSA	7,870	8.60	67,682.00
DEUTSCHE POST AG	31,433	10.66	335,075.78
FRAPORT AG	1,740	38.10	66,294.00
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	22,420	4.96	111,404.98
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	31,722	1.70	53,927.40
RYANAIR HOLDINGS PLC	8,345	3.73	31,126.85
TNT EXPRESS NV	13,270	5.45	72,321.50
VOPAK	2,440	39.34	96,001.80
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	12,430	50.25	624,607.50
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,090	35.58	74,362.20
CONTINENTAL AG	2,915	46.98	136,946.70
DAIMLER AG	33,262	31.65	1,052,908.61
FIAT SPA	26,775	3.55	95,051.25
MICHELIN (CGDE)-B	6,704	44.77	300,138.08
NOKIAN RENKAAT OYJ	4,245	22.72	96,446.40
PEUGEOT SA	5,872	11.84	69,553.84
PIRELLI & C.	9,236	6.59	60,911.42
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,740	40.00	229,600.00
RENAULT SA	6,797	26.00	176,722.00
VOLKSWAGEN AG	1,151	102.00	117,402.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	5,343	114.95	614,177.85
ADIDAS AG	7,721	48.00	370,608.00
CHRISTIAN DIOR	2,000	88.70	177,400.00
LUXOTTICA GROUP SPA	3,976	20.54	81,667.04
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	9,369	105.90	992,177.10
ACCOR SA	5,606	17.03	95,470.18
AUTOGRILL SPA	6,045	7.19	43,463.55
OPAP SA	8,450	6.80	57,460.00
SODEXO	3,470	51.98	180,370.60
AXEL SPRINGER AG	1,665	31.80	52,955.32
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	28.61	108,574.95
JC DECAUX SA .	2,520	17.70	44,616.60
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	3,080	39.88	122,830.40
LAGARDERE S.C.A.	5,040	17.89	90,190.80
MEDIASET SPA	25,926	2.00	52,007.55
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	2,855	13.05	37,272.02
PUBLICIS GROUPE	4,725	34.11	161,169.75
REED ELSEVIER NV	25,748	8.55	220,325.63
SANOMA OYJ	3,275	7.92	25,954.37
SES	11,190	17.83	199,573.65
TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	5,550	7.16	39,738.00
WOLTERS KLUWER	11,107	12.62	140,170.34

INDITEX	8,045	62.75	504,823.75
PPR	2,892	105.40	304,816.80
CARREFOUR SA	21,653	16.61	359,764.59
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,004	61.79	123,827.16
COLRUYT SA	2,725	27.60	75,210.00
DELHAIZE GROUP	3,666	42.67	156,428.22
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	22,688	3.22	73,123.42
JERONIMO MARTINS	7,685	12.38	95,140.30
KESKO OYJ-B SHS	2,230	23.55	52,516.50
KONINKLIJKE AHOLD NV	44,169	9.65	426,319.18
METRO AG	4,940	27.39	135,306.60
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	29,551	44.26	1,307,927.26
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	6,798	11.94	81,168.12
DANONE	21,559	46.90	1,011,224.89
HEINEKEN HOLDING NV	4,275	29.20	124,830.00
HEINEKEN NV	9,673	34.00	328,882.00
KERRY GROUP PLC-A	5,390	27.42	147,793.80
PERNOD-RICARD SA	7,436	68.31	507,953.16
SUEDZUCKER AG	2,400	23.00	55,200.00
UNILEVER NV-CVA	59,995	25.32	1,519,073.40
BEIERSDORF AG	3,745	42.06	157,514.70
HENKEL AG & CO KGAA	5,110	35.69	182,375.90
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,493	43.08	279,718.44
L'OREAL	8,836	76.73	677,986.28
CELESIO AG	3,620	12.01	43,476.20
ESSILOR INTERNATIONAL	7,395	52.17	385,797.15
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	7,933	50.71	402,282.43
FRESENIUS SE & CO KGAA	4,370	69.02	301,617.40
BAYER AG	30,530	44.80	1,367,744.00
ELAN CORP PLC	18,000	8.75	157,500.00
GRIFOLS SA	5,290	12.10	64,009.00
MERCK KGAA	2,405	73.44	176,623.20
ORION OYJ-CLASS B	4,485	14.47	64,897.95
QIAGEN N.V.	7,635	10.62	81,083.70
SANOFI	42,421	51.81	2,197,832.01
UCB SA	3,708	31.24	115,837.92
BANCA CARIGE SPA	28,825	1.35	38,971.40
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	153,605	0.24	37,740.74
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	168,658	6.01	1,014,309.21
BANCO DE SABADELL SA	41,782	2.89	120,917.10
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	21,145	0.99	20,933.55
BANCO POPOLARE SCARL	62,764	0.90	56,707.27
BANCO POPULAR ESPANOL	36,697	3.23	118,531.31
BANCO SANTANDER SA	311,022	5.50	1,710,932.02
BANKIA SAU	27,425	3.59	98,455.75
BANKINTER SA	13,435	4.15	55,876.16
BNP PARIBAS	35,552	27.87	990,834.24
CAIXABANK	26,440	3.70	97,828.00
COMMERZBANK AG	134,443	1.22	165,096.00
CREDIT AGRICOLE SA	37,252	4.22	157,389.70
ERSTE GROUP BANK AG	7,118	11.26	80,184.27
INTESA SANPAOLO	377,913	1.19	450,850.20
INTESA SANPAOLO-RSP	31,990	0.95	30,422.49
KBC GROEP NV	6,119	9.39	57,469.64

NATIONAL BANK OF GREECE	22,263	1.52	33,839.76
NATIXIS	32,490	1.86	60,658.83
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	2,310	17.47	40,355.70
SOCIETE GENERALE	23,749	16.30	387,227.44
UBI BANCA SCPA	28,684	2.85	81,749.40
UNICREDIT SPA	506,731	0.70	355,218.43
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	34,205	27.24	931,915.22
DEUTSCHE BOERSE AG-SHARES	7,280	42.46	309,145.20
EURAZEO	1,442	25.77	37,167.55
EXOR SPA	1,714	14.44	24,750.16
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,912	49.50	144,144.00
ING GROEP NV-CVA	141,655	5.06	717,340.92
MEDIOBANCA SPA	19,150	4.32	82,766.30
POHJOLA BANK PLC	6,535	7.00	45,745.00
AEGON NV	66,229	2.94	194,911.94
AGEAS	84,144	1.18	99,458.20
ALLIANZ SE-REG	16,768	71.53	1,199,415.04
ASSICURAZIONI GENERALI	43,088	11.23	483,878.24
AXA	64,167	9.69	621,778.23
CNP ASSURANCES	6,070	9.34	56,693.80
DELTA LLOYD NV	3,600	12.53	45,108.00
HANNOVER RUECKVERSICHERUNGS	2,455	35.98	88,343.17
MAPFRE SA	26,034	2.28	59,409.58
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,536	89.77	586,736.72
SAMPO OYJ-A SHS	15,819	18.05	285,532.95
SCOR SE	6,822	17.19	117,304.29
VIENNA INSURANCE GROUP	1,410	26.05	36,730.50
IMMOEAST AG-TEMPORARY	16,150		
IMMOFINANZ AG	37,225	2.17	80,964.37
IMMOFINANZ AG-TEMPORARY	13,000		
AMADEUS IT HOLDING SA	10,060	11.84	119,110.40
ATOS	1,650	32.79	54,103.50
CAP GEMINI SA	5,469	24.80	135,631.20
DASSAULT SYSTEMES SA	2,315	58.80	136,122.00
INDRA SISTEMAS SA	4,269	9.76	41,703.86
SAP AG-COMMON	33,902	43.12	1,462,023.75
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,720	13.51	63,767.20
ALCATEL-LUCENT	91,534	1.18	108,467.79
NEOPOST SA	867	48.42	41,984.47
NOKIA OYJ	137,696	3.84	529,578.81
BELGACOM SA	5,820	23.20	135,053.10
DEUTSCHE TELEKOM AG	103,906	9.07	943,154.76
ELISA OYJ	6,295	15.58	98,076.10
FRANCE TELECOM SA	69,599	11.95	832,056.04
ILIID SA	815	90.15	73,472.25
KONINKLIJKE KPN NV	54,906	8.89	488,333.96
MOBISTAR SA	1,279	38.35	49,049.65
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	27,363	4.54	124,310.10
TELECOM ITALIA SPA	354,593	0.80	283,674.40
TELECOM ITALIA-RSP	234,007	0.67	157,135.70
TELEFONICA SA	152,038	13.18	2,003,860.84
TELEKOM AUSTRIA AG	14,020	8.91	124,974.28
VIVENDI	46,457	16.17	751,209.69
A2A SPA	50,790	0.70	35,603.79

ACCIONA SA	976	64.12	62,581.12	
E.ON AG	66,359	16.33	1,083,974.26	
EDP RENOVAVEIS SA	8,115	4.35	35,308.36	
ELECTRICITE DE FRANCE	8,795	17.68	155,539.57	
ENAGAS	7,050	13.65	96,267.75	
ENEL GREEN POWER SPA	64,340	1.54	99,083.60	
ENEL SPA	241,704	2.93	709,159.53	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	71,841	2.41	173,136.81	
FORTUM OYJ	16,355	15.61	255,301.55	
GAS NATURAL SDG SA	11,902	12.56	149,489.12	
GDF SUEZ	45,409	19.62	891,151.62	
IBERDROLA SA	140,427	4.70	660,989.88	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,050	31.92	129,276.00	
RWE AG	17,965	26.04	467,808.60	
RWE AG-NON VTG PFD	1,845	24.00	44,280.00	
RWE AG-RTS(N)	17,210		36.31	
SNAM RETE GAS	58,840	3.21	188,994.08	
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	10,319	8.73	90,115.82	
TERNA SPA	43,127	2.52	108,766.29	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	13,334	8.04	107,325.36	
VERBUND AG	2,370	18.96	44,947.05	
ASML HOLDING NV	15,977	29.94	478,431.26	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	42,120	5.63	237,261.96	
STMICROELECTRONICS NV	23,623	4.20	99,405.58	
ユーロ小計	6,751,539		70,294,738.04 (7,130,698,226)	
合計	44,423,391		55,824,941,184 (55,824,941,184)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	34,640	561,860.80	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,475	435,243.75	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,397	505,429.05	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,735	237,620.70	
		DUKE REALTY CORPORATION	6,875	77,000.00	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	11,275	616,968.00	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	2,475	221,586.75	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	17,145	240,887.25	
		HCP INC	14,985	578,271.15	
		HEALTH CARE REIT INC	6,530	330,875.10	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	26,659	365,494.89	
		KIMCO REALTY CORPORATION	15,255	236,452.50	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	91,086.38	
		PLUM CREEK TIMBER CO	6,458	225,061.30	
		PROLOGIS INC	17,042	459,622.74	
		PUBLIC STORAGE	5,389	684,403.00	
		RAYONIER INC	5,057	203,341.97	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	2,805	98,988.45	
		SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	10,859	1,308,618.09	
THE MACERICH COMPANY	5,120	247,347.20			

		VENTAS INC	10,295	532,045.60	
		VORNADO REALTY TRUST	6,396	463,006.44	
		WEYERHAEUSER CO	20,336	333,917.12	
	投資証券小計		241,316	9,055,128.23 (707,205,514)	
米ドル合計				9,055,128.23 (707,205,514)	
加ドル	投資証券	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,250	133,035.00	
	投資証券小計		5,250	133,035.00 (9,997,580)	
加ドル合計				133,035.00 (9,997,580)	
豪ドル	投資証券	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	67,010	123,298.40	
		DEXUS PROPERTY GROUP	163,705	144,060.40	
		GOODMAN GROUP	273,860	157,469.50	
		GPT GROUP	63,695	203,824.00	
		LEND LEASE GROUP	21,287	157,098.06	
		MIRVAC GROUP	137,930	172,412.50	
		STOCKLAND	86,100	284,130.00	
		WESTFIELD GROUP	80,385	647,903.10	
		WESTFIELD RETAIL TRUST	107,475	276,210.75	
	投資証券小計		1,001,447	2,166,406.71 (167,463,238)	
豪ドル合計				2,166,406.71 (167,463,238)	
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	32,561	144,570.84	
		CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	24,090	71,017.32	
		HAMMERSON PLC	30,035	104,732.04	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	28,889	176,945.12	
		SEGRO PLC	20,223	40,749.34	
	投資証券小計		135,798	538,014.66 (65,002,931)	
英ポンド合計				538,014.66 (65,002,931)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	86,500	2,473,900.00	
	投資証券小計		86,500	2,473,900.00 (24,813,217)	
香港ドル合計				2,473,900.00 (24,813,217)	
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	62,000	117,180.00	
		CAPITAMALL TRUST	71,800	117,752.00	
	投資証券小計		133,800	234,932.00 (14,016,043)	
シンガポールドル合計				234,932.00 (14,016,043)	
ユーロ	投資証券	CORIO NV	1,970	59,986.50	
		FONCIERE DES REGIONS	1,005	43,983.82	
		GECINA SA	740	40,019.20	
		ICADE	1,080	55,522.80	
		KLEPIERRE	3,895	74,550.30	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	3,380	430,274.00	
	投資証券小計		12,070	704,336.62 (71,447,906)	
ユーロ合計				704,336.62 (71,447,906)	

合計		1,059,946,429 (1,059,946,429)	
----	--	----------------------------------	--

(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 563銘柄	97.9%		57.0%
	投資証券 23銘柄		2.1%	1.2%
加ドル	株式 100銘柄	99.7%		5.6%
	投資証券 1銘柄		0.3%	0.0%
豪ドル	株式 57銘柄	92.9%		3.8%
	投資証券 9銘柄		7.1%	0.3%
英ポンド	株式 101銘柄	98.9%		10.7%
	投資証券 5銘柄		1.1%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%		3.9%
香港ドル	株式 39銘柄	96.7%		1.3%
	投資証券 1銘柄		3.3%	0.0%
シンガポールドル	株式 28銘柄	96.9%		0.8%
	投資証券 2銘柄		3.1%	0.0%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.0%		0.1%
スウェーデンクローナ	株式 34銘柄	100.0%		1.4%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%		0.4%
デンマーククローネ	株式 12銘柄	100.0%		0.5%
イスラエルシェケル	株式 7銘柄	100.0%		0.3%
ユーロ	株式 246銘柄	99.0%		12.5%
	投資証券 6銘柄		1.0%	0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2011年12月30日現在です。

【純資産額計算書】

資産総額	60,424,707,985 円
負債総額	208,614,639 円
純資産総額(-)	60,216,093,346 円
発行済口数	125,842,154,424 口
1口当たり純資産額(/)	0.4785 円

(参考)日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	9,902,275,671 円
負債総額	1,965,000 円
純資産総額(-)	9,900,310,671 円
発行済口数	13,625,622,599 口
1口当たり純資産額(/)	0.7266 円

(参考) 海外リートインデックス(ヘッジなし) マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	12,020,791,676 円
負債総額	101,035,293 円
純資産総額(-)	11,919,756,383 円
発行済口数	15,071,225,628 口
1口当たり純資産額(/)	0.7909 円

(参考) 日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	31,727,758,594 円
負債総額	135,783,479 円
純資産総額(-)	31,591,975,115 円
発行済口数	25,614,323,772 口
1口当たり純資産額(/)	1.2334 円

(参考) 海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	429,607,650,109 円
負債総額	788,810,928 円
純資産総額(-)	428,818,839,181 円
発行済口数	305,926,158,961 口
1口当たり純資産額(/)	1.4017 円

(参考) 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	24,875,647,616 円
負債総額	170,494,535 円
純資産総額(-)	24,705,153,081 円
発行済口数	43,546,154,174 口
1口当たり純資産額(/)	0.5673 円

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

純資産額計算書

資産総額	60,843,930,231 円
負債総額	76,322,726 円
純資産総額(-)	60,767,607,505 円
発行済口数	74,726,712,604 口

1口当たり純資産額(/)

0.8132 円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】**(1) 名義書換**

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、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求を行なわないものとします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

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

過去5年間における主な資本金の増減

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

(2) 会社の意思決定機関

・株主総会

取締役・監査役の選任および定款変更に係る決議などを行ないます。

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

・取締役会

当社の業務執行を決定し、取締役の職務の執行について監督します。

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

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

・監査役会

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

（平成23年12月末現在）

(3) 運用の意思決定プロセス

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

（平成23年12月末現在）

2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、平成23年12月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	418	67,032
株式投資信託	352	53,652
単位型	42	1,017
追加型	310	52,635
公社債投資信託	66	13,379
単位型	49	608
追加型	17	12,771
投資法人合計	1	30

3【委託会社等の経理状況】

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

(1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

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

(単位:百万円)

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

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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

(単位:百万円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：百万円)

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

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

重要な会計方針

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

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

会計方針の変更

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

追加情報

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

注記事項

（貸借対照表関係）

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

（損益計算書関係）

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

(株主資本等変動計算書関係)

第51期（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

(注) 自己株式の増加及び減少は、自己株式の取得及び処分であります。

3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

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

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

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

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

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

第52期（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

(注) 自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

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

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

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

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

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(リース取引関係)

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

（金融商品関係）

第51期(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

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

()負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

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

()負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

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

(有価証券関係)

第51期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

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

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

2 その他有価証券

(単位:百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

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

第52期(自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

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

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

(持分法損益等)

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

(退職給付関係)

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

(ストックオプション等関係)

第51期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

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

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

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

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

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション（新株予約権）の数

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

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

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

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

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

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

単価情報

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

第52期(自 平成22年4月1日至 平成23年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 1 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション（新株予約権）の数

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

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

(注) 1 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

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

(税効果会計関係)

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

(関連当事者情報)

第51期(自 平成21年 4 月 1 日 至 平成22年 3 月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

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

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

(注) 1 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

(注) 1 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

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

(セグメント情報等)

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1 セグメント情報

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

2 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

3 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

(注) 算定上の基礎

1 1株当たり純資産額

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

2 1株当たり当期純利益又は1株当たり当期純損失

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

(重要な後発事象)

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

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

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

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第53期中間会計期間
(平成23年9月30日)

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

(単位：百万円)

第53期中間会計期間
(平成23年9月30日)

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

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第53期中間会計期間
(自平成23年4月1日
至平成23年9月30日)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：百万円)

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

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

重要な会計方針

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

追加情報

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

注記事項

(中間貸借対照表関係)

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

(中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第53期中間会計期間（自平成23年4月1日至平成23年9月30日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

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

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

2 第1回新株予約権の増加は、新株予約権の発行によるものであります。

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

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

該当事項はありません。

(リース取引関係)

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

(金融商品関係)

第53期中間会計期間（平成23年9月30日）

1 金融商品の時価等に関する事項

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

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

()負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、株式は市場価格、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

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

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

(有価証券関係)

第53期中間会計期間(平成23年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

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

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

2 その他有価証券

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

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

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

(持分法損益等)

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

(ストックオプション等関係)

第53期中間会計期間(自平成23年4月1日至平成23年9月30日)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

第53期中間会計期間(自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)

1 セグメント情報

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

2 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービスは単一であるため、記載しておりません。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

(1株当たり情報)

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

(注) 算定上の基礎

1 1株当たり純資産額

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

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

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

(重要な後発事象)

第53期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

新株予約権（ストックオプション）の付与

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

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

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (平成23年9月末現在)	事業の内容	
SMB 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SBI証券	47,937百万円		
東洋証券株式会社	13,494百万円		
野村証券株式会社 1	10,000百万円		
フィデリティ証券株式会社	5,207百万円		
楽天証券株式会社	7,795百万円		
株式会社秋田銀行	14,100百万円		銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社イオン銀行	51,250百万円		
オーストラリア・ニュージーランド銀行	22,572百万豪ドル		
株式会社香川銀行	12,014百万円		
株式会社佐賀共栄銀行	2,100百万円		
株式会社滋賀銀行	33,076百万円		
株式会社四国銀行	25,000百万円		
シティバンク銀行株式会社	123,100百万円		
株式会社新生銀行	512,204百万円		
スルガ銀行株式会社	30,043百万円		
株式会社第三銀行	37,461百万円		
株式会社東和銀行	38,653百万円		
株式会社鳥取銀行	9,061百万円		
株式会社富山銀行	6,730百万円		
株式会社八十二銀行	52,243百万円		
株式会社百十四銀行	37,322百万円		
株式会社南日本銀行	16,601百万円		
株式会社琉球銀行	54,127百万円		
みずほ信託銀行株式会社	247,369百万円	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。	
農林中央金庫	3,425,909百万円 (出資の総額)	全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。	
労働金庫連合会	120,000百万円 (出資の総額) (平成23年6月末現在)	労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。	

1 募集の取扱いを行いません。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

- (1) 受託会社
該当事項はありません。
- (2) 販売会社
該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
平成23年6月29日	臨時報告書
平成23年9月15日	有価証券報告書
平成23年9月15日	有価証券届出書
平成23年9月29日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

平成24年1月18日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司
業務執行社員

指定社員 公認会計士 和田 渉
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の平成23年6月16日から平成23年12月15日までの特定期間の財務諸表、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、世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の平成23年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年6月18日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

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

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

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

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

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成23年6月17日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

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

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

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

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

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

以 上

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

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成23年12月9日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

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

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以 上

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