

## 【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9月14日
【計算期間】	第14特定期間 (自 平成23年12月16日 至 平成24年6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】	代表取締役 村上 雅彦
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	雄谷 敦史
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## ファンドの目的

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券、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いません。  
 よって、商品分類の「投資対象資産（収益の源泉）」においては、「資産複合」に分類されます。  
 「資産配分固定型」とは、目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比  
 率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。  
 年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。  
 属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記  
 載しております。

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

## ファンドの特色

**1 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。

**「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2012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。

債券  
(国内債券・海外債券)株式  
(国内株式・海外株式)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)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)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)

## 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。

## &lt;各資産の値動きの特徴&gt;

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 <b>は上がる</b> 傾向	金利は上がる傾向 債券価格 <b>は下がる</b> 傾向	企業業績が改善する傾向 株価 <b>は上がる</b> 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 <b>は下がる</b> 傾向	金利は下がる傾向 債券価格 <b>は上がる</b> 傾向	企業業績が悪化する傾向 株価 <b>は下がる</b> 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>

(2012年7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。

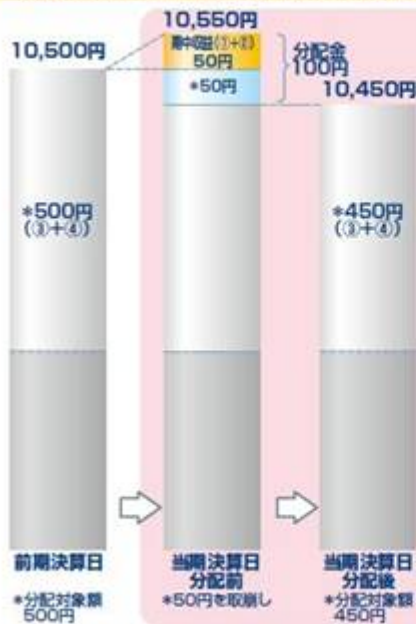
### 投資信託で分配金が支払われるイメージ



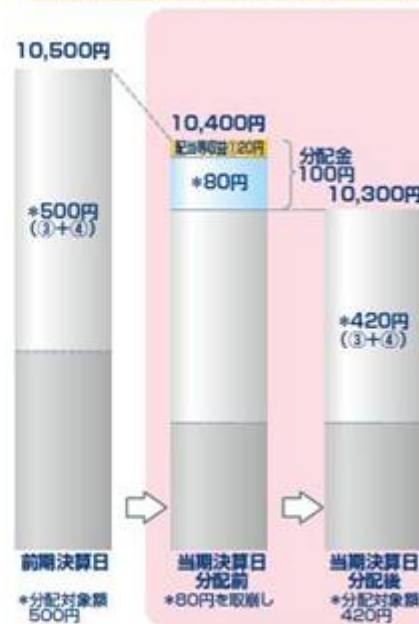
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

### 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

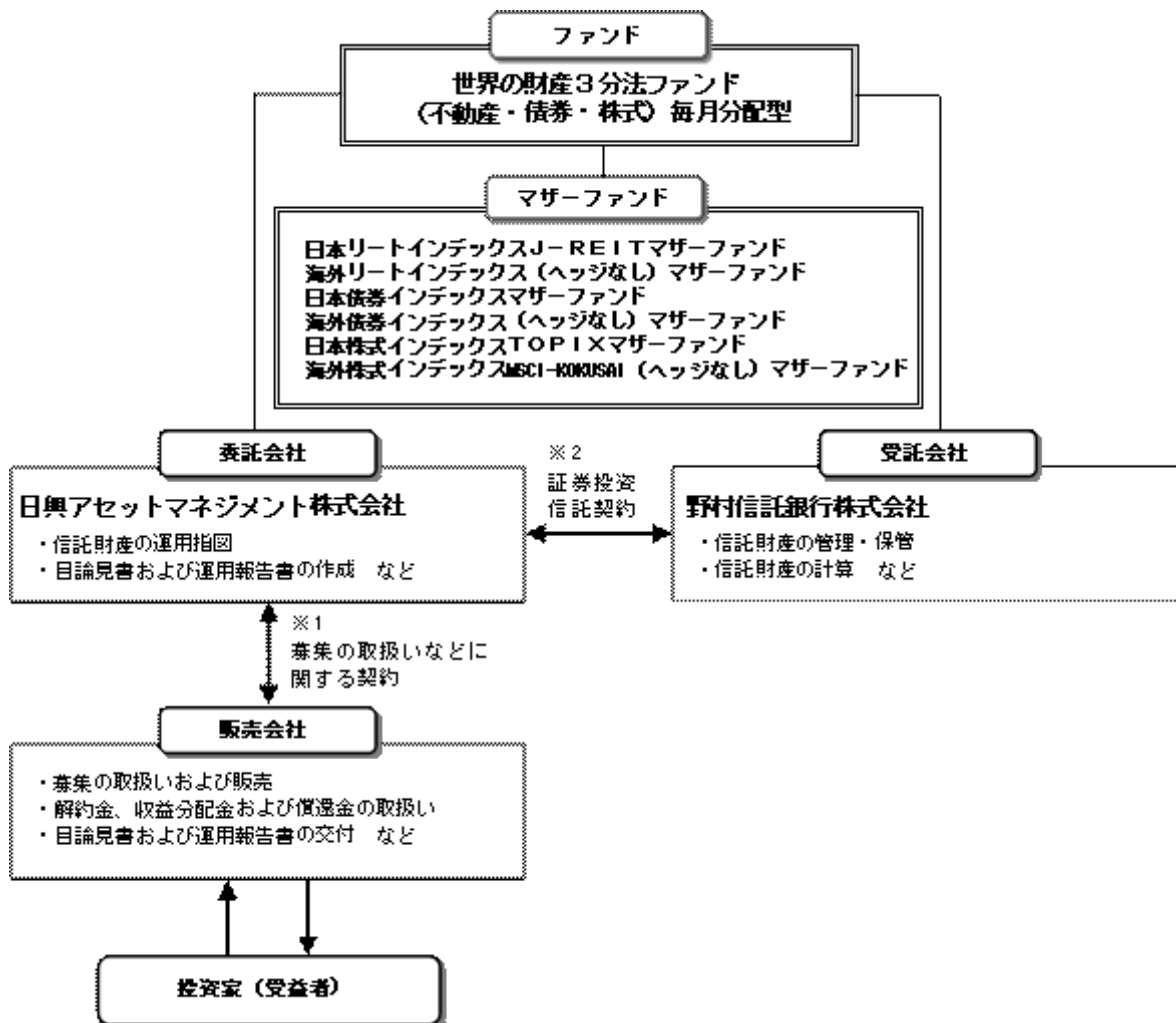
・ファンド名称変更

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を、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を、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24年6月末現在）

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

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

- ・主として、以下に掲げる各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ため、資金の流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ます。）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ます。）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」-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。）およびコマーシャル・ペーパー
- 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ます。）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ます。）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。）およびコマーシャル・ペーパー
- 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ます。）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ます。）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せん。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行

された有価証券(短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。))を除きます。))には投資しません。

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

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

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

#### < 海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド >

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

- 8) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)で投資法人債券に類する証券
  - 9) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
  - 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  - 11) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
  - 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  - 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの  
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
    - 1) 預金
    - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
    - 3) コール・ローン
    - 4) 手形割引市場において売買される手形
    - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
    - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの  
次の取引ができます。
      - 1) 先物取引等
      - 2) スワップ取引
      - 3) 金利先渡取引
      - 4) 為替先渡取引
      - 5) 有価証券の貸付
      - 6) 公社債の空売
      - 7) 公社債の借入
      - 8) 外国為替予約取引
- <日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>  
わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。  
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
  - 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限り、)
  - 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) 株券または新株引受権証書
  - 2) 国債証券
  - 3) 地方債証券
  - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
  - 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
  - 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
  - 7) コマーシャル・ペーパー
  - 8) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)  
および新株予約権証券
  - 9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)~8)の証券の性質を有するもの
  - 10) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)で投資法人債券に類する証券
  - 11) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限り、)
  - 12) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  - 13) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信

託の受益証券に限ります。)

- 14) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

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

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 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、)
  - 15) 預託証券(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証券
  - 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

## &lt;日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド&gt;

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） <sup>*</sup> 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"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>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。</li> <li>外貨建資産への投資は行ないません。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入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）

<sup>\*</sup>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。

## &lt; 海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド &gt;

運用の基本方針	
基本方針	世界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"> <li>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 &amp; 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。</li> <li>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。</li> <li>外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジは行ないません。</li> <li>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>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 &amp; 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 &amp; 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。</li> <li>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%(1口当たり)
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など、 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限(平成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。

## &lt;日本債券インデックスマザーファンド&gt;

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

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

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

## &lt; 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド &gt;

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

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

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

## &lt; 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド &gt;

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

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

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

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

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

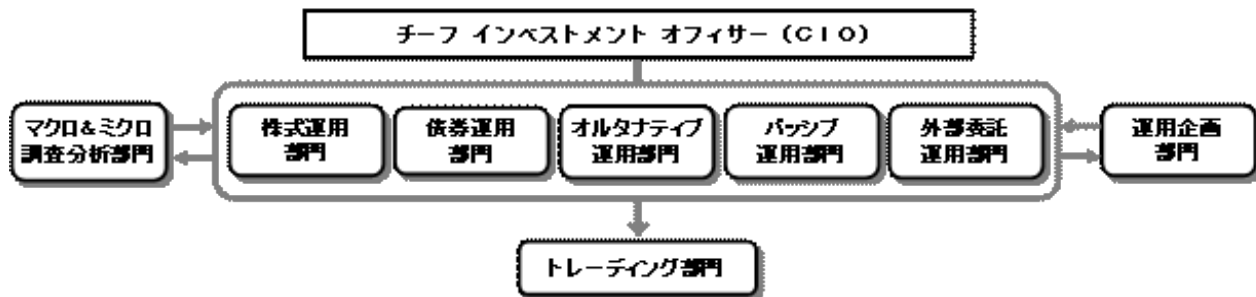
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3% (1口当たり)
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
<b>その他</b>	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限(平成12年5月17日設定)
決算日	毎年10月26日(休業日の場合は翌営業日)

\* 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。

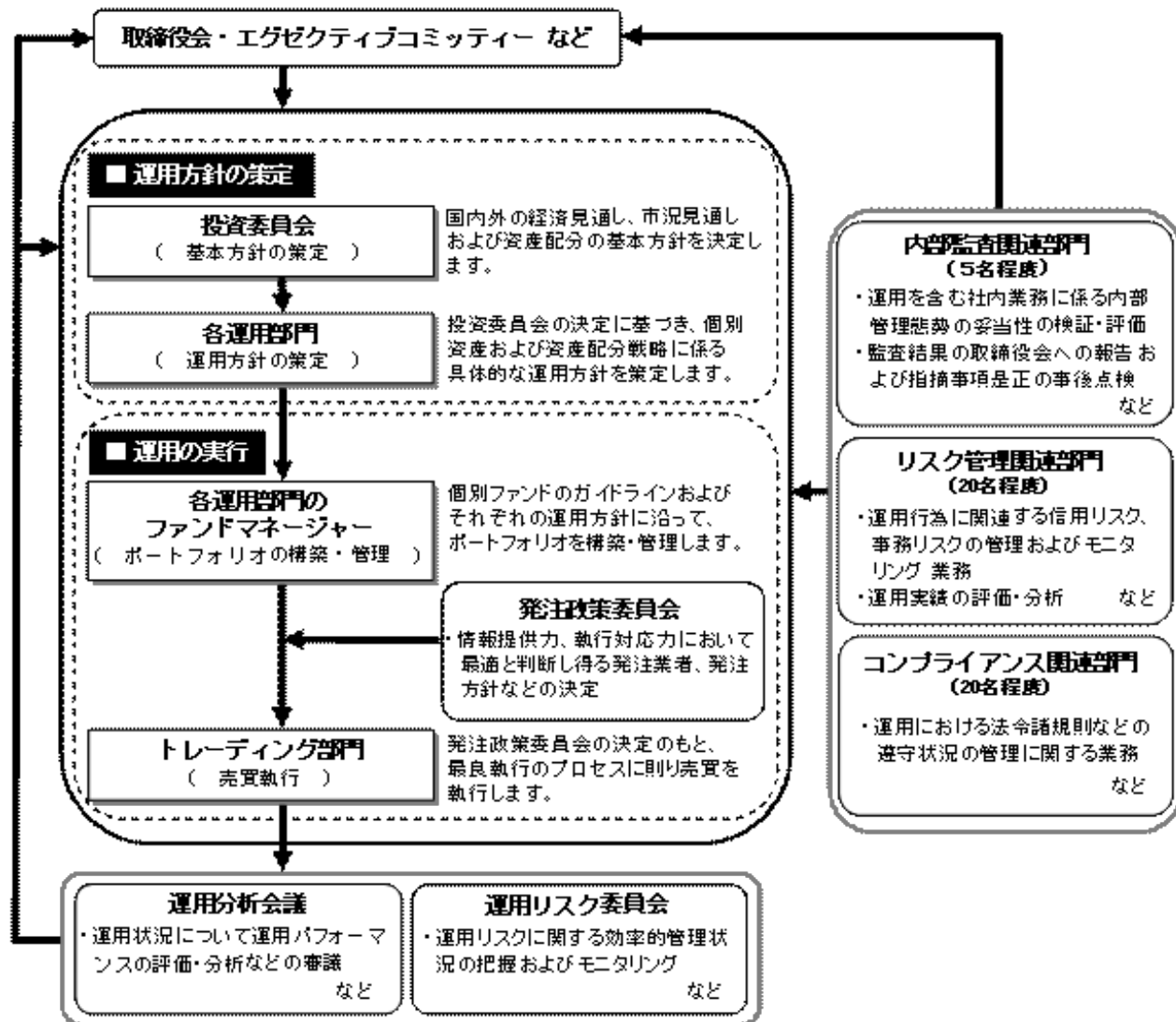
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

### (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、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合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24年6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

## &lt; 分配金再投資コース &gt;

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。

## &lt; 分配金受取りコース &gt;

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

## &lt; 世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型 &gt;

- 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。

## &lt; 日本リートインデックスJ-REITマザーファンド &gt;

- 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。

- 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は、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。

## &lt;その他の留意事項&gt;

## ・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。

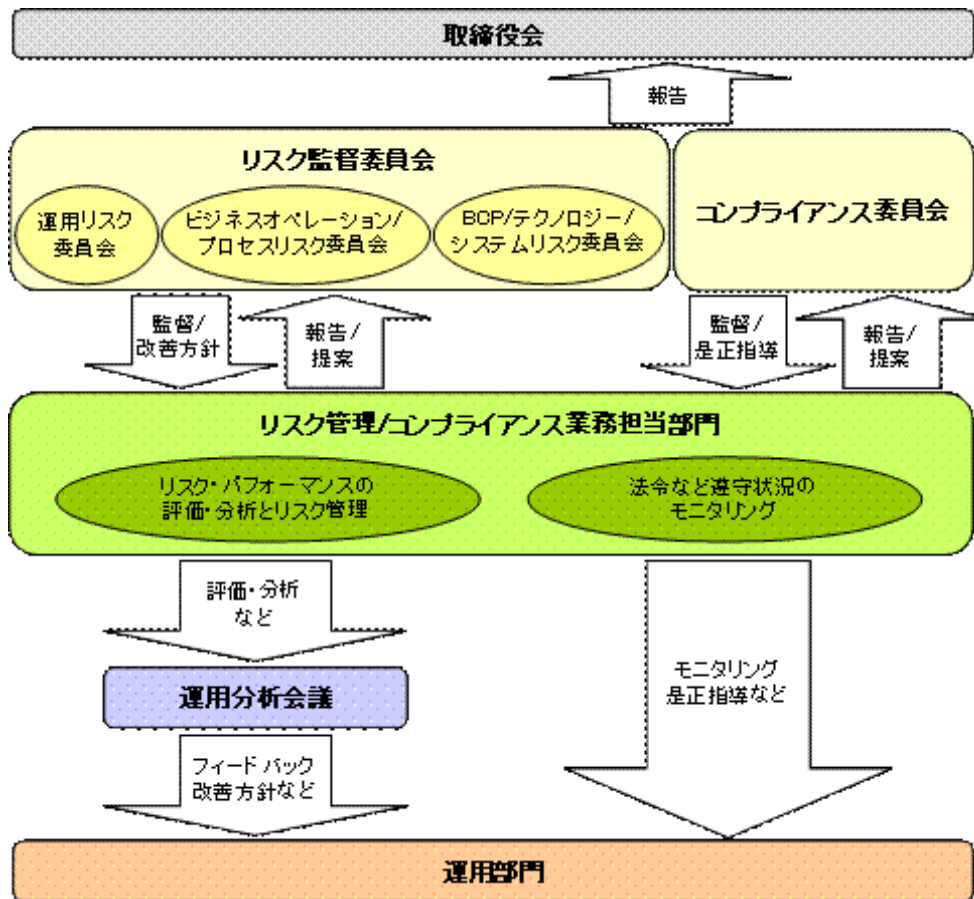
## ・運用制限や規制上の制限に関する事項

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24年6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乗じて得た額をかかるとの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

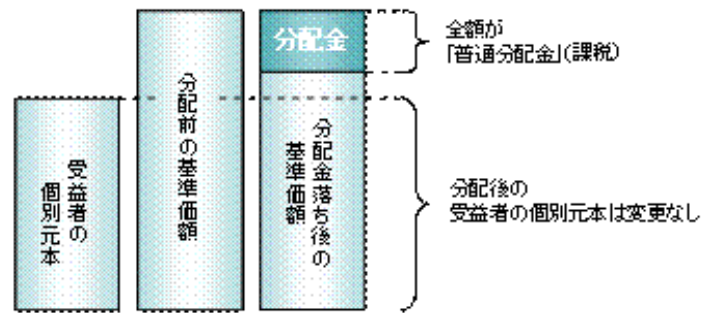
- 1) 各受益者の買付時の基準価額(申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。)が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

## 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

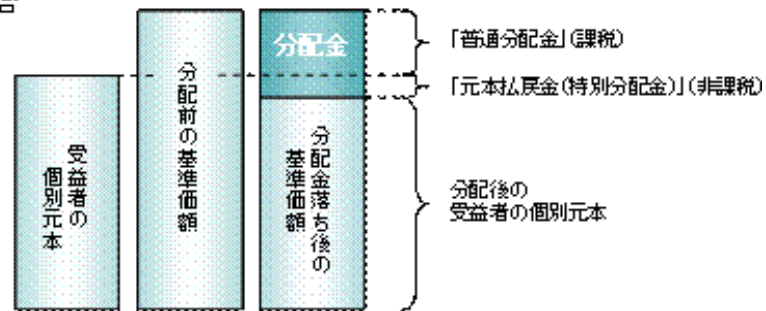
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
  - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
  - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
-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

## &lt;分配金に関するイメージ図&gt;

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は平成24年9月14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2012年6月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	55,732,332,044	98.34
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	940,682,440	1.66
合計(純資産総額)		56,673,014,484	100.00

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	日本リートインデックスJ-REITマザー ファンド	11,174,691,795	0.8076	9,024,681,094	0.8561	9,566,653,645	16.88
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	15,411,643,629	0.5722	8,818,542,484	0.6070	9,354,867,682	16.51
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	10,371,660,602	0.8873	9,202,774,453	0.8987	9,321,011,383	16.45
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	7,386,764,076	1.2490	9,226,068,331	1.2502	9,234,932,447	16.30
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	6,335,909,151	1.4510	9,193,404,179	1.4436	9,146,518,450	16.14
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	10,619,503,833	0.8593	9,125,339,644	0.8577	9,108,348,437	16.07

## 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	98.34
合計	98.34

## 【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
第14特定期間末	2012年 6月15日	55,918	56,146	0.4910	0.4930
	2011年 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	-
	2012年 1月末日	60,149	-	0.4859	-
	2月末日	63,099	-	0.5227	-
	3月末日	62,669	-	0.5332	-
	4月末日	60,824	-	0.5236	-
	5月末日	56,052	-	0.4890	-
	6月末日	56,673	-	0.5010	-

(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
第14特定期間	2011年12月16日～2012年 6月15日	0.0130

## 【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
第14特定期間	2011年12月16日～2012年6月15日	7.03

(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
第14特定期間	2011年12月16日～2012年6月15日	787,842,918	13,892,127,349

(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2012年6月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1) 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	9,460,958,960	98.25
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	168,647,205	1.75
合計(純資産総額)		9,629,606,165	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	1,658	740,000	1,226,920,000	771,000	1,278,318,000	13.27
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	1,485	677,000	1,005,345,000	731,000	1,085,535,000	11.27
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人 投資証券	5,086	118,800	604,216,800	126,500	643,379,000	6.68
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	5,690	82,000	466,580,000	85,900	488,771,000	5.08
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	2,976	153,000	455,328,000	154,900	460,982,400	4.79
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	655	627,000	410,685,000	699,000	457,845,000	4.75
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	1,934	220,600	426,640,400	224,200	433,602,800	4.50
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	825	409,500	337,837,500	449,500	370,837,500	3.85
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	525	653,000	342,825,000	640,000	336,000,000	3.49
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	400	687,000	274,800,000	707,000	282,800,000	2.94
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	769	325,500	250,309,500	358,000	275,302,000	2.86

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	527	488,500	257,439,500	517,000	272,459,000	2.83
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	434	525,000	227,850,000	557,000	241,738,000	2.51
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	1,071	189,300	202,740,300	210,100	225,017,100	2.34
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	626	311,000	194,686,000	344,000	215,344,000	2.24
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	510	396,500	202,215,000	397,000	202,470,000	2.10
日本	投資証券	ケネディクス不動産投資法人 投資証券	775	237,200	183,830,000	257,300	199,407,500	2.07
日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	380	483,500	183,730,000	515,000	195,700,000	2.03
日本	投資証券	トップリート投資法人 投資証券	419	421,500	176,608,500	445,500	186,664,500	1.94
日本	投資証券	福岡リート投資法人 投資証券	333	528,000	175,824,000	549,000	182,817,000	1.90
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	458	371,000	169,918,000	391,000	179,078,000	1.86
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	408	392,000	159,936,000	409,000	166,872,000	1.73
日本	投資証券	プレミアム投資法人 投資証券	532	269,000	143,108,000	279,900	148,906,800	1.55
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	3,600	37,500	135,000,000	38,050	136,980,000	1.42
日本	投資証券	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	262	475,500	124,581,000	517,000	135,454,000	1.41
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	5,030	20,650	103,869,500	21,250	106,887,500	1.11
日本	投資証券	積水ハウス・S I投資法人 投資証券	311	333,000	103,563,000	338,500	105,273,500	1.09
日本	投資証券	M I Dリート投資法人 投資証券	497	199,100	98,952,700	201,700	100,244,900	1.04
日本	投資証券	平和不動産リート投資法人 投資証券	1,883	43,300	81,533,900	46,400	87,371,200	0.91
日本	投資証券	いちご不動産投資法人 投資証券	2,280	36,250	82,650,000	36,650	83,562,000	0.87

#### 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

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2012年6月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1) 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	7,383,918,495	66.14
	カナダ	359,896,085	3.22
	ドイツ	16,425,012	0.15
	イタリア	7,736,087	0.07
	フランス	497,734,008	4.46
	オーストラリア	1,245,188,262	11.15
	イギリス	620,955,034	5.56
	香港	209,670,350	1.88
	シンガポール	387,331,294	3.47
	ニュージーランド	35,441,883	0.32
	オランダ	132,624,681	1.19
	ベルギー	62,217,156	0.56
	小計	10,959,138,347	98.16
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	205,112,914	1.84
合計(純資産総額)		11,164,251,261	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	買建		767,500	0.01
	売建		15,198,800	0.14

(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	67,548	11,757.7075	794,209,626	12,031.3270	812,692,076	7.28
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	31,722	10,886.8837	345,353,724	11,180.3307	354,662,450	3.18
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD GROUP	465,310	739.1520	343,934,817	755.8785	351,717,824	3.15
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	67,033	4,910.8752	329,190,697	4,800.6343	321,800,919	2.88
アメリカ	投資証券	HCP INC	93,525	3,374.6405	315,613,252	3,434.1230	321,176,353	2.88
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	64,433	4,703.8761	303,084,848	4,905.3235	316,064,709	2.83

フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	20,358	13,660.6790	278,104,103	13,868.0330	282,325,415	2.53
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	33,417	8,185.5851	273,537,697	8,316.4466	277,910,696	2.49
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	41,430	6,443.1444	266,939,472	6,460.5926	267,662,351	2.40
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	102,695	2,518.8856	258,676,956	2,503.0236	257,048,008	2.30
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,260	11,143.8481	236,918,210	10,945.5731	232,702,884	2.08
アメリカ	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	47,710	4,488.1529	214,129,774	4,552.3940	217,194,717	1.95
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	160,310	1,209.4775	193,891,338	1,207.0982	193,509,912	1.73
アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	131,861	1,365.7182	180,084,967	1,394.2698	183,849,810	1.65
香港	投資証券	LINK REIT	504,600	329.0840	166,055,786	321.4190	162,188,027	1.45
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	173,202	893.8512	154,816,815	896.9292	155,349,931	1.39
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD RETAIL TRUST	625,508	219.0375	137,009,708	231.7815	144,981,182	1.30
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	24,320	5,799.9403	141,054,548	5,838.0091	141,980,381	1.27
アメリカ	投資証券	THE MACERICH COMPANY	29,495	4,436.6014	130,857,558	4,561.1181	134,530,178	1.21
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORPORATION	90,901	1,464.8557	133,156,847	1,463.2695	133,012,660	1.19
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	19,939	5,861.0090	116,862,658	6,126.6975	122,160,221	1.09
オーストラリア	投資証券	STOCKLAND	494,290	256.4730	126,772,039	246.9150	122,047,615	1.09
イギリス	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	198,035	598.3632	118,496,856	615.6000	121,910,346	1.09
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	14,171	7,865.9658	111,468,601	8,100.7234	114,795,351	1.03
アメリカ	投資証券	UDR INC	55,695	2,058.8876	114,669,744	1,991.4741	110,915,149	0.99
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	29,568	3,157.3311	93,355,965	3,269.9513	96,685,920	0.87
オーストラリア	投資証券	GPT GROUP	370,865	255.6765	94,821,465	259.6590	96,298,435	0.86
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	17,822	5,272.5288	93,967,008	5,260.6323	93,754,988	0.84
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,815	12,041.6372	94,105,395	11,952.8100	93,411,210	0.84
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	305,710	266.8275	81,571,835	293.1120	89,607,269	0.80

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.16
合計	98.16

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

## &lt; 為替予約取引 &gt;

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	加ドル	買建	10,000	776,900	767,500	0.01
	米ドル	売建	110,000	8,745,000	8,723,000	0.08
	シンガポールドル	売建	60,000	3,716,520	3,716,400	0.03
	香港ドル	売建	270,000	2,758,617	2,759,400	0.02

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## (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2012年6月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1) 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	24,081,988,173	76.47
地方債証券	日本	2,104,385,276	6.68
特殊債券	日本	2,906,384,000	9.23
社債券	日本	2,087,456,436	6.63
	オーストラリア	201,854,000	0.64
	小計	2,289,310,436	7.27
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	111,439,916	0.35
合計(純資産総額)		31,493,507,801	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	105.92	794,377,500	2.52
日本	国債証券	第81回利付国債(5年)	0.800	2014/03/20	574,000,000	101.49	582,561,480	101.20	580,865,040	1.84
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	105.24	573,530,750	1.82
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	106.33	474,213,960	1.51
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	1.700	2017/03/20	391,000,000	106.92	418,077,520	107.05	418,573,320	1.33
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	106.64	384,966,790	1.22
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	103.79	374,667,460	1.19
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	1.300	2019/12/20	343,000,000	104.49	358,400,700	105.87	363,137,530	1.15
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	105.27	357,924,800	1.14
日本	国債証券	第101回利付国債(5年)	0.400	2016/12/20	350,000,000	100.37	351,295,300	101.00	353,489,500	1.12
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	113.43	340,281,000	1.08
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	105.76	303,542,680	0.96
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	106.49	291,793,560	0.93
日本	国債証券	第289回利付国債(10年)	1.500	2017/12/20	269,000,000	106.24	285,807,500	106.74	287,130,600	0.91
日本	国債証券	第250回利付国債(10年)	0.500	2013/06/20	285,000,000	100.38	286,104,054	100.39	286,104,054	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	103.33	278,996,400	0.89
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	103.13	276,393,760	0.88
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	111.48	274,243,260	0.87
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	110.36	261,548,460	0.83
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	108.01	260,313,740	0.83
日本	国債証券	第311回利付国債(2年)	0.200	2013/12/15	250,000,000	100.13	250,347,500	100.14	250,360,000	0.79
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	105.91	234,052,260	0.74
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	112.08	233,122,240	0.74
日本	国債証券	第286回利付国債(10年)	1.800	2017/06/20	216,000,000	107.69	232,622,700	107.84	232,930,080	0.74
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	115.32	230,634,000	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	100.77	228,758,172	100.77	228,758,172	0.73
日本	国債証券	第93回利付国債(5年)	0.500	2015/12/20	225,000,000	100.85	226,912,500	101.36	228,069,000	0.72
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	2.300	2026/09/20	200,000,000	110.95	221,902,000	113.22	226,442,000	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	101.77	223,902,800	0.71
日本	国債証券	第314回利付国債(2年)	0.100	2014/03/15	220,000,000	99.97	219,945,000	100.00	220,000,000	0.70

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	76.47
地方債証券	6.68
特殊債券	9.23
社債券	7.27
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2012年6月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1) 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	112,097,092,802	42.93
	カナダ	7,757,232,550	2.97
	ドイツ	23,631,196,214	9.05
	イタリア	21,884,597,863	8.38
	フランス	24,798,983,010	9.50
	オーストラリア	3,821,937,989	1.46
	イギリス	21,037,576,391	8.06
	スイス	1,069,632,825	0.41
	シンガポール	1,036,496,254	0.40
	マレーシア	1,384,488,953	0.53
	オランダ	7,007,085,577	2.68
	スペイン	9,837,333,280	3.77
	ベルギー	6,642,131,445	2.54
	スウェーデン	1,541,973,425	0.59
	ノルウェー	635,335,998	0.24
	オーストリア	4,638,746,758	1.78
	フィンランド	1,856,555,789	0.71
	デンマーク	2,268,984,184	0.87
	メキシコ	2,444,980,628	0.94
ポーランド	1,775,706,605	0.68	
	小計	257,168,068,540	98.50
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	3,923,359,743	1.50
合計(純資産総額)		261,091,428,283	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		685,801,000	0.26

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

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2021/02/15	40,000,000	9,008.98	3,603,590,129	9,411.87	3,764,746,562	1.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.750	2014/05/15	40,550,000	8,784.83	3,562,249,177	8,585.93	3,481,593,442	1.33

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2014/08/15	35,700,000	8,750.90	3,124,071,836	8,587.79	3,065,839,579	1.17
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.000	2014/02/15	36,280,000	8,600.18	3,120,144,623	8,403.76	3,048,884,836	1.17
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2014/11/15	33,800,000	8,828.81	2,984,138,878	8,658.42	2,926,546,435	1.12
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5.125	2016/05/15	31,000,000	9,438.48	2,925,929,041	9,326.36	2,891,171,696	1.11
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2013/08/15	34,400,000	8,499.80	2,923,931,683	8,286.66	2,850,609,588	1.09
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2013/11/15	32,500,000	8,516.33	2,767,807,100	8,362.25	2,717,730,640	1.04
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.000	2015/02/15	26,700,000	8,826.70	2,356,728,136	8,677.01	2,316,761,586	0.89
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2016/02/15	25,500,000	9,171.41	2,338,709,142	9,071.08	2,313,125,718	0.89
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.125	2013/09/30	27,400,000	8,365.97	2,292,274,624	8,213.54	2,250,510,473	0.86
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2017/11/15	22,400,000	9,279.27	2,078,556,480	9,373.45	2,099,652,940	0.80
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.125	2015/05/15	23,100,000	8,921.14	2,060,782,365	8,769.33	2,025,715,572	0.78
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.875	2016/08/15	21,700,000	9,394.63	2,038,633,903	9,317.07	2,021,803,359	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.750	2017/08/15	20,500,000	9,488.65	1,945,172,922	9,532.69	1,954,201,497	0.75
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.375	2040/05/15	17,700,000	9,808.27	1,736,063,382	10,757.04	1,903,995,789	0.73
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.625	2040/02/15	16,800,000	10,178.65	1,710,012,427	11,169.70	1,876,509,298	0.72
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.250	2014/01/04	17,800,000	10,629.49	1,892,048,968	10,498.90	1,868,804,689	0.72
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3.250	2016/04/25	16,900,000	10,381.52	1,754,477,488	10,646.59	1,799,273,567	0.69
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3.750	2021/04/25	16,500,000	10,374.61	1,711,810,947	10,842.57	1,789,024,422	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2013/11/30	21,900,000	8,210.35	1,798,067,058	8,123.08	1,778,954,280	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.250	2016/05/31	20,100,000	8,777.58	1,764,293,281	8,763.14	1,761,390,212	0.67
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.125	2013/08/31	21,100,000	8,348.96	1,761,631,340	8,195.57	1,729,265,945	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.000	2018/08/15	17,900,000	9,208.63	1,648,345,580	9,413.11	1,684,945,906	0.65
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	5.000	2016/10/25	14,600,000	11,168.88	1,630,656,957	11,401.86	1,664,671,027	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2039/05/15	15,300,000	9,599.68	1,468,751,407	10,539.56	1,612,551,986	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2018/02/15	17,700,000	8,936.65	1,581,787,191	9,097.10	1,610,187,556	0.62
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.250	2021/07/04	13,800,000	10,955.61	1,511,874,386	11,470.04	1,582,865,421	0.61

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.750	2018/11/15	16,500,000	9,078.52	1,497,955,232	9,325.12	1,538,644,980	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2020/02/15	16,300,000	9,038.17	1,473,221,318	9,375.31	1,528,175,440	0.59

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.50
合計	98.50

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

##### <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	4,200,000	333,481,250	333,060,000	0.13
	ユーロ	売建	2,700,000	267,301,620	266,571,000	0.10
	英ポンド	売建	700,000	86,138,500	86,170,000	0.03

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

[次へ](#)

## 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」を結ぶことができます場合があります。  
＜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づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (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。

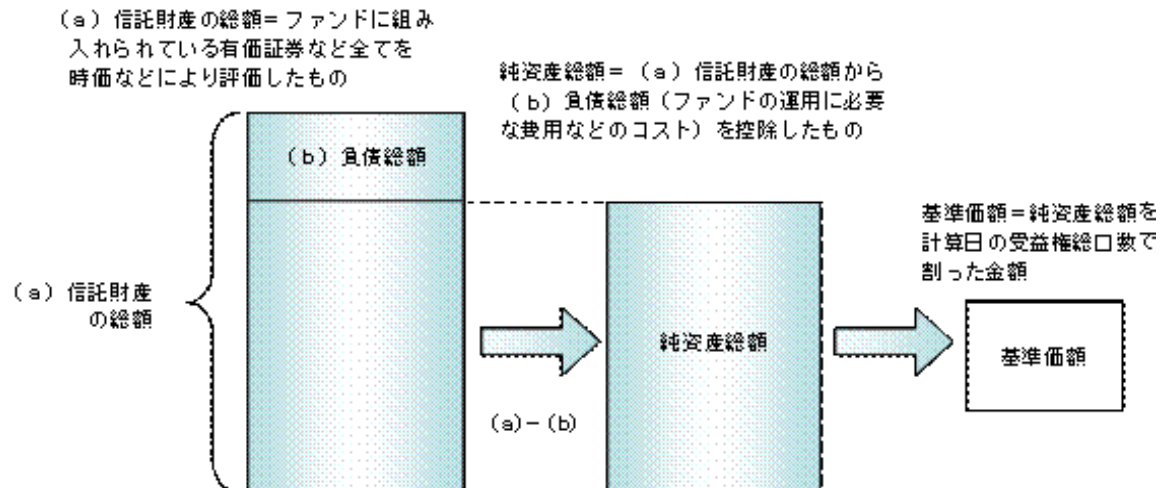
### 3【資産管理等の概要】

#### (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。

## &lt;基準価額算出の流れ&gt;



## 有価証券などの評価基準

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

## &lt;主な資産の評価方法&gt;

## マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

## 国内上場株式

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

## 外国株式

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

## 公社債（国内・外国）

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

- ・ 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

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

- ・ 価格情報会社の提供する価額

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

- \* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

## 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。

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

## 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

## &lt;委託会社の照会先&gt;

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

## (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。

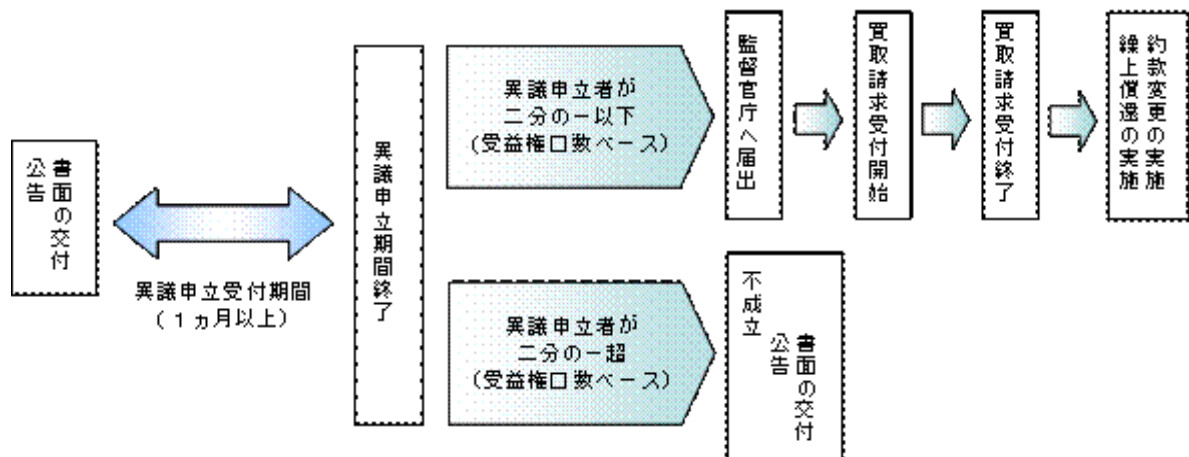
## 信託約款の変更

- 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。

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



## 公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

## 運用報告書の作成

委託会社は、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12月16日から平成24年6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12月15日現在	当期 平成24年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,213,672,230	1,001,848,305
親投資信託受益証券	59,015,495,429	54,976,402,061
未収入金	97,353,798	294,977,690
未収利息	2,250	1,823
流動資産合計	60,326,523,707	56,273,229,879
資産合計	60,326,523,707	56,273,229,879
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	380,944,234	227,754,254
未払解約金	97,905,075	65,042,881
未払受託者報酬	2,627,733	2,504,219
未払委託者報酬	47,299,371	45,076,136
その他未払費用	6,931,731	14,598,532
流動負債合計	535,708,144	354,976,022
負債合計	535,708,144	354,976,022
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	126,981,411,480	113,877,127,049
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	67,190,595,917	57,958,873,192
(分配準備積立金)	99,433	56,238
元本等合計	59,790,815,563	55,918,253,857
純資産合計	59,790,815,563	55,918,253,857
負債純資産合計	60,326,523,707	56,273,229,879

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期	当期
	自 平成23年 6月16日 至 平成23年12月15日	自 平成23年12月16日 至 平成24年 6月15日
<b>営業収益</b>		
受取利息	341,021	316,275
有価証券売買等損益	6,969,423,567	4,598,520,001
営業収益合計	6,969,082,546	4,598,836,276
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	17,822,929	15,860,031
委託者報酬	320,813,870	285,481,630
その他費用	8,420,808	9,233,137
営業費用合計	347,057,607	310,574,798
営業利益又は営業損失（ ）	7,316,140,153	4,288,261,478
経常利益又は経常損失（ ）	7,316,140,153	4,288,261,478
当期純利益又は当期純損失（ ）	7,316,140,153	4,288,261,478
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（ ）	60,472,786	73,290,973
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	64,787,541,946	67,190,595,917
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,806,185,624	6,962,636,144
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,806,185,624	6,962,636,144
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	559,510,139	394,227,536
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	559,510,139	394,227,536
分配金	2,394,062,089	1,551,656,388
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	67,190,595,917	57,958,873,192

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

		前期 平成23年12月15日現在	当期 平成24年 6月15日現在
1.	期首元本額	141,686,294,783円	126,981,411,480円
	期中追加設定元本額	1,137,780,912円	787,842,918円
	期中一部解約元本額	15,842,664,215円	13,892,127,349円
2.	受益権の総数	126,981,411,480口	113,877,127,049口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	67,190,595,917円	57,958,873,192円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 平成23年 6月16日 至 平成23年12月15日		当期 自 平成23年12月16日 至 平成24年 6月15日
分配金の計算過程		分配金の計算過程
	自 平成23年6月16日 至 平成23年7月15日	自 平成23年12月16日 至 平成24年1月16日
A	計算期末における費用控除後の配当等収益 138,303,808円	A 計算期末における費用控除後の配当等収益 163,745,775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 4,242,432,129円	C 信託約款に定める収益調整金 2,225,302,734円
D	信託約款に定める分配準備積立金 577,331円	D 信託約款に定める分配準備積立金 208,393円
E	分配対象収益(A+B+C+D) 4,381,313,268円	E 分配対象収益(A+B+C+D) 2,389,256,902円
F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり) 0.0315円 315円	F 分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり) 0.0190円 190円
G	分配金額 416,084,598円	G 分配金額 375,753,890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7月16日 至 平成23年8月15日	自 平成24年1月17日 至 平成24年2月15日
A	計算期末における費用控除後の配当等収益 76,752,061円	A 計算期末における費用控除後の配当等収益 128,353,806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 3,904,904,728円	C 信託約款に定める収益調整金 1,972,944,087円
D	信託約款に定める分配準備積立金 528,346円	D 信託約款に定める分配準備積立金 86,692円
E	分配対象収益(A+B+C+D) 3,982,185,135円	E 分配対象収益(A+B+C+D) 2,101,384,585円
F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり) 0.0291円 291円	F 分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり) 0.0171円 171円
G	分配金額 409,748,816円	G 分配金額 245,447,332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) 0.0020円 20円
	自 平成23年8月16日 至 平成23年9月15日	自 平成24年2月16日 至 平成24年3月15日
A	計算期末における費用控除後の配当等収益 116,636,862円	A 計算期末における費用控除後の配当等収益 170,581,989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	3,520,399,136円	C	信託約款に定める収益調整金	1,799,905,279円
D	信託約款に定める分配準備積立金	252,335円	D	信託約款に定める分配準備積立金	289,899円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	3,637,288,333円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,970,777,167円
F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0270円 270円	F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0165円 165円
G	分配金額	403,779,573円	G	分配金額	238,035,769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)	0.0020円 20円
		自 平成23年9月16日 至 平成23年10月17日			自 平成24年3月16日 至 平成24年4月16日
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	202,989,589円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	193,064,614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	3,168,348,911円	C	信託約款に定める収益調整金	1,701,329,101円
D	信託約款に定める分配準備積立金	630,769円	D	信託約款に定める分配準備積立金	740,310円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	3,371,969,269円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,895,134,025円
F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0255円 255円	F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0162円 162円
G	分配金額	395,637,405円	G	分配金額	233,720,938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)	0.0020円 20円
		自 平成23年10月18日 至 平成23年11月15日			自 平成24年4月17日 至 平成24年5月15日
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	80,532,367円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	124,362,408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	2,917,821,323円	C	信託約款に定める収益調整金	1,641,703,456円
D	信託約款に定める分配準備積立金	505,240円	D	信託約款に定める分配準備積立金	182,541円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	2,998,858,930円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,766,248,405円
F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0231円 231円	F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0152円 152円
G	分配金額	387,867,463円	G	分配金額	230,944,205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)	0.0020円 20円
		自 平成23年11月16日 至 平成23年12月15日			自 平成24年5月16日 至 平成24年6月15日
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	72,078,780円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	77,173,191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	2,564,356,701円	C	信託約款に定める収益調整金	1,514,075,923円
D	信託約款に定める分配準備積立金	527,038円	D	信託約款に定める分配準備積立金	319,493円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	2,636,962,519円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,591,568,607円
F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0207円 207円	F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0139円 139円
G	分配金額	380,944,234円	G	分配金額	227,754,254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)	0.0020円 20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23年 6月16日 至 平成23年12月15日	当期 自 平成23年12月16日 至 平成24年 6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12月15日現在	当期 平成24年 6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)

前期（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

当期(平成24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	1,038,768,037
合計	1,038,768,037

(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12月15日現在		当期 平成24年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	0.4709円	1口当たり純資産額	0.4910円
(1万口当たり純資産額)	(4,709円)	(1万口当たり純資産額)	(4,910円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	10,649,443,405	9,151,066,717	
	日本債券インデックスマザーファンド	7,425,175,648	9,274,044,384	
	海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	6,361,636,889	9,230,735,125	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	15,411,643,629	8,818,542,484	
	日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	11,376,087,632	9,187,328,371	
	海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド	10,497,785,395	9,314,684,980	
親投資信託受益証券 合計		61,721,772,598	54,976,402,061	
合計		61,721,772,598	54,976,402,061	

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

1. 「日本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12月15日現在	平成24年 6月15日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		112,708,595	92,677,608
投資証券		9,651,159,440	9,126,396,390
未収入金			1,772,540
未収配当金		80,028,965	70,119,683
未収利息		208	168
流動資産合計		9,843,897,208	9,290,966,389
資産合計			
		9,843,897,208	9,290,966,389
負債の部			
流動負債			
未払解約金		81,202	43,945,493
流動負債合計		81,202	43,945,493
負債合計			
		81,202	43,945,493
純資産の部			
元本等			
元本		13,646,043,791	11,449,866,634
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		3,802,227,785	2,202,845,738
元本等合計		9,843,816,006	9,247,020,896
純資産合計			
		9,843,816,006	9,247,020,896
負債純資産合計			
		9,843,897,208	9,290,966,389

## (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>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>
-----------------	---

## (貸借対照表に関する注記)

		平成23年12月15日現在	平成24年 6月15日現在
1.	期首	平成23年 6月16日	平成23年12月16日
	期首元本額	14,650,552,738円	13,646,043,791円
	期首からの追加設定元本額	8,421,279円	13,501,448円
	期首からの一部解約元本額	1,012,930,226円	2,209,678,605円
	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	13,540,254,836円	11,376,087,632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	8,647,989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	34,392,344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	30,738,669円
	計	13,646,043,791円	11,449,866,634円
2.	受益権の総数	13,646,043,791口	11,449,866,634口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	3,802,227,785円	2,202,845,738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23年 6月16日 至 平成23年12月15日	自 平成23年12月16日 至 平成24年 6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12月15日現在	平成24年 6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

(平成24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	1,218,208,480
合計	1,218,208,480

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成23年12月15日現在		平成24年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	0.7214円	1口当たり純資産額	0.8076円
(1万口当たり純資産額)	(7,214円)	(1万口当たり純資産額)	(8,076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

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	535	261,347,500	
	M I Dリート投資法人 投資証券	505	100,545,500	
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	636	197,796,000	
	野村不動産レジデンシャル投資法人 投資証券	415	162,680,000	
	産業ファンド投資法人 投資証券	387	187,114,500	
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,024	462,672,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人 投資証券	207	35,479,800	
	日本ビルファンド投資法人 投資証券	1,685	1,246,900,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	1,509	1,021,593,000	
	日本リートファンド投資法人 投資証券	5,169	614,077,200	
	オリックス不動産投資法人 投資証券	782	254,541,000	
	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	1,966	433,699,600	
	プレミアム投資法人 投資証券	541	145,529,000	
	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	466	172,886,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	266	126,483,000	
	野村不動産オフィスファンド投資法人 投資証券	839	343,570,500	
	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	5,783	474,206,000	
	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	665	416,955,000	
	インヴィンシブル投資法人 投資証券	3,688	23,713,840	
	フロンティア不動産投資法人 投資証券	533	348,049,000	
	平和不動産リート投資法人 投資証券	1,913	82,832,900	
	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	407	279,609,000	
	福岡リート投資法人 投資証券	338	178,464,000	
	ケネディクス不動産投資法人 投資証券	788	186,913,600	
	積水ハウス・S I投資法人 投資証券	316	105,228,000	
	いちご不動産投資法人 投資証券	2,317	83,991,250	
	大和証券オフィス投資法人 投資証券	1,088	205,958,400	
	阪急リート投資法人 投資証券	235	81,545,000	
	スターツプロシード投資法人 投資証券	297	32,373,000	
	トップリート投資法人 投資証券	426	179,559,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人 投資証券	441	231,525,000		
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	5,112	105,562,800		
日本賃貸住宅投資法人 投資証券	3,659	137,212,500		
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	519	205,783,500		
投資証券 合計		47,457	9,126,396,390	
	合計	47,457	9,126,396,390	

(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12月15日現在	平成24年 6月15日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		132,529,106	85,177,770
コール・ローン		17,905,988	49,646,533
投資証券		11,400,429,648	10,927,143,264
派生商品評価勘定			1,040
未収入金		18,644,707	100,704,304
未収配当金		24,516,888	20,479,106
未収利息		33	90
流動資産合計		11,594,026,370	11,183,152,107
資産合計		11,594,026,370	11,183,152,107
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		3,600	14,920
未払解約金		17,116,245	50,254,186
流動負債合計		17,119,845	50,269,106
負債合計		17,119,845	50,269,106
純資産の部			
元本等			
元本		15,365,168,469	12,546,958,109
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		3,788,261,944	1,414,075,108
元本等合計		11,576,906,525	11,132,883,001
純資産合計		11,576,906,525	11,132,883,001
負債純資産合計		11,594,026,370	11,183,152,107

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

## (貸借対照表に関する注記)

		平成23年12月15日現在	平成24年 6月15日現在
1.	期首	平成23年 6月16日	平成23年12月16日
	期首元本額	16,702,853,632円	15,365,168,469円
	期首からの追加設定元本額	245,061,585円	81,188,443円
	期首からの一部解約元本額	1,582,746,748円	2,899,398,803円
	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	13,048,506,406円	10,497,785,395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	18,442,906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	2,002,017,236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	28,712,572円
	計	15,365,168,469円	12,546,958,109円
2.	受益権の総数	15,365,168,469口	12,546,958,109口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	3,788,261,944円	1,414,075,108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23年 6月16日 至 平成23年12月15日	自 平成23年12月16日 至 平成24年 6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、為替予約取引があり、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12月15日現在	平成24年 6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

(平成24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	248,933,958
合計	248,933,958

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

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## (通貨関連)

(平成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	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

(平成24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	11,766,320		11,780,200	13,880
	香港ドル	2,457,840		2,457,600	240
	シンガポールドル	8,065,880		8,080,800	14,920
	ニュージーランドドル	1,242,600		1,241,800	800
	合計	11,766,320		11,780,200	13,880

## (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12月15日現在		平成24年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	0.7535円	1口当たり純資産額	0.8873円
(1万口当たり純資産額)	(7,535円)	(1万口当たり純資産額)	(8,873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	9,559	218,231.97	
		AGREE REALTY CORPORATION	2,451	53,799.45	
		ALEXANDER'S INC	460	188,600.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	14,039	990,451.45	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,412	171,217.20	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	16,637	732,028.00	
		APARTMENT INVT&MGMT CO -A	29,664	810,420.48	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	15,670	129,434.20	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY CORPORATION	9,439	145,171.82	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,442	3,012,815.42	
		BIOMED REALTY TRUST INC	34,750	636,967.50	
		BOSTON PROPERTIES INC	33,396	3,446,801.16	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	32,450	372,850.50	
		BRE PROPERTIES-CL A	16,999	832,101.05	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	17,709	1,177,117.23	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	6,638	72,818.86	
		CAPLEASE INC	16,323	68,883.06	
		CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	33,335	616,364.15	
		CEDAR REALTY TRUST INC	13,477	64,689.60	
		CHATHAM LODGING TRUST	2,106	28,725.84	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	7,390	130,064.00	
		COLONIAL PROPERTIES TRUST	19,882	436,608.72	
		COMMONWEALTH REIT	19,112	340,958.08	
		CORESITE REALTY CORP	4,943	119,521.74	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST	16,224	360,172.80	
		COUSINS PROPERTIES INC	23,101	166,096.19	
		CUBESMART	27,559	308,660.80	
		DCT INDUSTRIAL TRUST INC	55,792	342,004.96	
		DDR CORP	52,031	733,116.79	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	37,955	385,243.25	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	24,146	1,765,555.52	
		DOUGLAS EMMETT INC	31,714	701,196.54	
		DUKE REALTY CORPORATION	57,989	810,686.22	
		DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	14,434	379,469.86	
		EASTGROUP PROPERTIES INC	6,232	311,101.44	
		EDUCATION REALTY TRUST INC	20,213	218,906.79	
		ENTERTAINMENT PROPERTIES TRUST	10,522	436,347.34	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	9,221	633,574.91	
		EQUITY ONE INC	13,350	272,206.50	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	67,632	4,187,773.44	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,827	1,188,373.41	
		EXCEL TRUST INC	8,083	90,529.60	
EXTRA SPACE STORAGE INC	22,941	663,453.72			
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	14,308	1,419,067.44			
FELCOR LODGING TRUST INC	28,933	127,305.20			
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	19,260	237,283.20			
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	11,740	141,936.60			
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	17,048	169,627.60			
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	132,753	2,286,006.66			
GETTY REALTY CORPORATION	5,870	98,146.40			
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	1,767	29,261.52			
GLIMCHER REALTY TRUST	31,040	298,604.80			
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	7,774	165,197.50			
HCP INC	92,193	3,922,812.15			

HEALTH CARE REIT INC	47,349	2,679,479.91	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	17,860	410,244.20	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	40,923	214,027.29	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	16,332	535,852.92	
HOME PROPERTIES INC	10,928	664,203.84	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	28,027	647,143.43	
HOST HOTELS & RESORTS INC	159,383	2,430,590.75	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	7,760	126,720.80	
INLAND REAL ESTATE CORPORATION	18,256	154,263.20	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	20,440	152,891.20	
KILROY REALTY CORPORATION	15,381	717,677.46	
KIMCO REALTY CORPORATION	91,675	1,693,237.25	
KITE REALTY GROUP TRUST	14,045	67,416.00	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	19,532	534,395.52	
LEXINGTON REALTY TRUST	31,313	258,332.25	
LIBERTY PROPERTY TRUST	26,056	915,868.40	
LTC PROPERTIES INC	6,902	229,698.56	
MACK-CALI REALTY CORPORATION	19,721	543,313.55	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	30,168	266,081.76	
MID AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	9,210	622,688.10	
MISSION WEST PROPERTIES INC	3,085	26,901.20	
MONMOUTH RE INVST CORP	9,237	98,281.68	
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	6,188	310,947.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	23,712	647,100.48	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	23,287	501,136.24	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,593	46,233.19	
PARKWAY PROPERTIES INC	5,228	55,730.48	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	11,299	252,871.62	
PENNSYLVANIA RE INVST TR	12,245	168,001.40	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	38,960	653,359.20	
POST PROPERTIES INC	11,965	579,225.65	
PROLOGIS INC	103,363	3,282,808.88	
PS BUSINESS PARKS INC	4,132	274,984.60	
PUBLIC STORAGE	32,016	4,394,836.32	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES TRUST	10,587	131,914.02	
REALTY INCOME CORP	29,909	1,190,677.29	
REGENCY CENTERS CORPORATION	20,396	917,208.12	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	10,900	132,762.00	
RLJ LODGING TRUST	6,433	114,443.07	
ROUSE PROPERTIES INC	4,837	63,219.59	
SAUL CENTERS INC	2,643	110,715.27	
SENIOR HOUSING PROPERTIES TRUST	36,623	774,942.68	
SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	68,978	10,225,988.50	
SL GREEN REALTY CORP	19,461	1,437,778.68	
SOVRAN SELF STORAGE INC	6,489	325,682.91	
STAG INDUSTRIAL INC	2,771	39,486.75	
STRATEGIC HOTELS & RESORTS INC	39,812	240,862.60	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	6,873	58,420.50	
SUN COMMUNITIES INC	6,108	257,207.88	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	26,383	273,327.88	
TANGER FACTORY OUTLET CENTERS INC	20,431	632,339.45	
TAUBMAN CENTERS INC	13,036	952,410.16	
TERRENO REALTY CORP	1,982	26,558.80	
THE MACERICH COMPANY	29,735	1,663,375.90	

		UDR INC	54,588	1,417,104.48	
		UMH PROPERTIES INC	2,450	24,671.50	
		UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	3,092	121,237.32	
		URSTADT BIDDLE PROPERTIES- CL A	5,445	104,271.75	
		VENTAS INC	65,047	3,857,937.57	
		VORNADO REALTY TRUST	41,687	3,386,651.88	
		WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,099	414,165.57	
		WEINGARTEN REALTY INVESTORS	27,513	690,026.04	
		WINTHROP REALTY TRUST	6,462	75,153.06	
	投資証券小計		2,759,276	92,463,446.18 (7,350,843,971)	
米ドル合計				92,463,446.18 (7,350,843,971)	
加ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	6,112	172,602.88	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11,978	192,845.80	
		BOARDWALK EQUITIES INC	5,772	342,799.08	
		BROOKFIELD CANADA OFFICE PRO	3,155	87,519.70	
		CALLOWAY REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11,848	331,270.08	
		CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	10,509	244,018.98	
		CANADIAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,446	296,499.72	
		CHARTWELL SENIORS HOUSING RE INVST TR	15,972	142,629.96	
		COMINAR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11,670	277,746.00	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,245	75,580.45	
		DUNDEE INTERNATIONAL REAL ES	7,063	70,276.85	
		DUNDEE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,229	346,825.82	
		EXTENDICARE REIT	10,001	75,107.51	
		H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19,097	459,091.88	
		INNVEST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11,852	55,230.32	
		MORGUARD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,730	110,506.60	
		NORTHERN PROPERTY RE INVST TR	3,319	109,427.43	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	4,380	56,589.60	
		PRIMARIS RETAIL RE INVST TR	9,905	230,588.40	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	30,151	780,910.90	
TRANSGLOBE APARTMENT REAL ES	6,860	97,137.60			
	投資証券小計		208,294	4,555,205.56 (353,666,159)	
加ドル合計				4,555,205.56 (353,666,159)	
豪ドル	投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	63,699	121,983.58	
		ALE PROPERTY GROUP	33,237	72,456.66	
		ASPEN GROUP	152,092	66,160.02	
		ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	13,250	37,497.50	
		AUSTRALAND PROPERTY GROUP	55,398	138,495.00	
		BWP TRUST	87,439	165,259.71	
		CENTRO RETAIL AUSTRALIA	300,000	598,500.00	
		CFS RETAIL PROPERTY TRUST GR	528,040	1,016,477.00	
		CHALLENGER DIVERSIFIED PROPERTY GROUP	92,607	51,396.88	
		CHARTER HALL GROUP	54,400	119,680.00	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	55,975	190,315.00	
		COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	548,057	539,836.14	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	206,778	144,744.60	
		DEXUS PROPERTY GROUP	1,089,300	996,709.50	
		GOODMAN GROUP	310,576	1,040,429.60	

		GPT GROUP	375,107	1,204,093.47	
		INVESTA OFFICE FUND	151,075	401,859.50	
		MIRVAC GROUP	768,735	949,387.72	
		STOCKLAND	521,409	1,678,936.98	
		WESTFIELD GROUP	476,766	4,424,388.48	
		WESTFIELD RETAIL TRUST	632,088	1,738,242.00	
	投資証券小計		6,516,028	15,696,849.34 (1,248,841,333)	
豪ドル合計				15,696,849.34 (1,248,841,333)	
英ポンド	投資証券	BIG YELLOW GROUP PLC	26,458	74,161.77	
		BRITISH LAND COMPANY PLC	200,181	974,681.28	
		CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	135,505	423,995.14	
		DERWENT LONDON PLC	18,304	326,360.32	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	69,628	261,801.28	
		HAMMERSON PLC	159,532	657,112.30	
		HANSTEEN HOLDINGS PLC	147,000	109,809.00	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	175,133	1,272,341.24	
		LONDON & STAMFORD PROPERTY PLC	125,690	134,488.30	
		METRIC PROPERTY INVESTMENTS PLC	47,602	43,317.82	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	17,166	53,901.24	
		SEGRO PLC	166,527	352,038.07	
		SHAFTESBURY PLC	55,812	277,720.51	
		WORKSPACE GROUP PLC	25,393	57,578.62	
	投資証券小計		1,369,931	5,019,306.89 (620,235,752)	
英ポンド合計				5,019,306.89 (620,235,752)	
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	612,000	1,891,080.00	
		FORTUNE REIT	273,000	1,201,200.00	
		LINK REIT	509,600	16,409,120.00	
		PROSPERITY REIT	255,000	433,500.00	
		REGAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	141,000	243,930.00	
		RREEF CHINA COMMERCIAL TRUST	201,000	874,350.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	268,000	667,320.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	147,000	521,850.00	
	投資証券小計		2,406,600	22,242,350.00 (227,984,087)	
香港ドル合計				22,242,350.00 (227,984,087)	

[次へ](#)

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2012年6月29日現在です。

## 【純資産額計算書】

資産総額	56,776,155,798 円
負債総額	103,141,314 円
純資産総額( - )	56,673,014,484 円
発行済口数	113,129,192,946 口
1口当たり純資産額( / )	0.5010 円

## (参考)日本リートインデックスJ-REITマザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	9,672,916,055 円
負債総額	43,309,890 円
純資産総額( - )	9,629,606,165 円
発行済口数	11,248,205,359 口
1口当たり純資産額( / )	0.8561 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	11,187,563,637 円
負債総額	23,312,376 円
純資産総額( - )	11,164,251,261 円
発行済口数	12,422,501,469 口
1口当たり純資産額( / )	0.8987 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	31,569,067,849 円
負債総額	75,560,048 円
純資産総額( - )	31,493,507,801 円
発行済口数	25,190,607,817 口
1口当たり純資産額( / )	1.2502 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	261,860,761,594 円
負債総額	769,333,311 円
純資産総額( - )	261,091,428,283 円
発行済口数	180,867,018,915 口

1口当たり純資産額( / )

1.4436 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	25,170,075,961 円
負債総額	97,178,811 円
純資産総額( - )	25,072,897,150 円
発行済口数	41,306,983,001 口
1口当たり純資産額( / )	0.6070 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	60,373,104,059 円
負債総額	59,326,676 円
純資産総額( - )	60,313,777,383 円
発行済口数	70,324,382,107 口
1口当たり純資産額( / )	0.8577 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24年6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20年6月23日	16,403,045,900円（16,287,728,400円）
平成21年10月1日	17,363,045,900円（16,403,045,900円）

##### (2) 会社の意思決定機関

###### ・株主総会

取締役・監査役の選任および定款変更に係る決議などを行いません。

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

###### ・取締役会

当社の業務執行を決定し、取締役の職務の執行について監督します。

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

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

###### ・監査役会

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

（平成24年6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24年6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24年6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	428	68,068
株式投資信託	362	54,660
単位型	42	1,071
追加型	320	53,588
公社債投資信託	66	13,408
単位型	49	586
追加型	17	12,822
投資法人合計	1	28

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第53期事業年度(平成23年4月1日から平成24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52期 (平成23年 3月31日)		第53期 (平成24年 3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	21,290	3	17,352
前払費用		330		332
未収入金		4		1
未収委託者報酬		6,173		5,872
未収収益	3	422	3	543
関係会社短期貸付金		-		33
立替金		504		1,094
繰延税金資産		1,142		1,084
その他	2	30	2	30
流動資産合計		29,897		26,345
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	67	1	66
器具備品	1	147	1	137
有形固定資産合計		215		203
無形固定資産				
ソフトウェア		101		72
無形固定資産合計		101		72
投資その他の資産				
投資有価証券		7,030		3,002
関係会社株式		16,225		24,320
関係会社長期貸付金		60		60
長期差入保証金		962		774
繰延税金資産		868		723
投資その他の資産合計		25,147		28,880
固定資産合計		25,463		29,156
資産合計		55,361		55,502

	第52期 (平成23年3月31日)		第53期 (平成24年3月31日)	
<b>負債の部</b>				
<b>流動負債</b>				
預り金		150		194
未払金		3,354		3,086
未払収益分配金		8		7
未払償還金		181		129
未払手数料	3	2,870	3	2,486
その他未払金		294		462
未払費用	3	3,253	3	2,807
未払法人税等		945		1,295
未払消費税等		108		281
賞与引当金		2,149		2,039
役員賞与引当金		237		105
流動負債合計		10,199		9,809
<b>固定負債</b>				
退職給付引当金		818		907
その他		55		55
固定負債合計		874		963
負債合計		11,073		10,773
<b>純資産の部</b>				
<b>株主資本</b>				
資本金		17,363		17,363
資本剰余金				
資本準備金		5,220		5,220
その他資本剰余金		4		-
資本剰余金合計		5,225		5,220
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		21,703		22,172
利益剰余金合計		21,703		22,172
自己株式		68		68
株主資本合計		44,224		44,687
<b>評価・換算差額等</b>				
その他有価証券評価差額金		63		42
評価・換算差額等合計		63		42
純資産合計		44,287		44,729
負債純資産合計		55,361		55,502

## ( 2 ) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第52期 (自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)	第53期 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)
営業収益		
委託者報酬	52,650	56,698
その他営業収益	2,581	2,025
営業収益合計	55,231	58,724
営業費用		
支払手数料	26,518	29,251
広告宣伝費	803	673
公告費	13	3
調査費	11,373	11,397
調査費	698	719
委託調査費	10,654	10,660
図書費	20	18
委託計算費	335	348
営業雑経費	557	577
通信費	176	206
印刷費	287	247
協会費	41	43
諸会費	8	9
その他	43	70
営業費用計	39,601	42,252
一般管理費		
給料	7,045	6,991
役員報酬	239	237
役員賞与引当金繰入額	237	105
給料・手当	4,391	4,508
賞与	27	101
賞与引当金繰入額	2,149	2,039
交際費	73	74
寄付金	140	111
旅費交通費	389	328
租税公課	133	145
不動産賃借料	921	749
退職給付費用	305	307
退職金	12	8
固定資産減価償却費	175	143
諸経費	2,953	3,110
一般管理費計	12,149	11,971
営業利益	3,480	4,500

	第52期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)		第53期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		2		15
受取配当金	1	1,071	1	757
有価証券償還益		29		19
時効成立分配金・償還金		8		35
その他		10		18
営業外収益合計		1,121		846
営業外費用				
支払利息		10		10
時効成立後支払分配金・償還金		34		77
支払源泉所得税		106		74
為替差損		1		35
弁護士報酬等		-		180
その他		0		4
営業外費用合計		153		381
経常利益		4,448		4,965
特別利益				
投資有価証券売却益		49		1
子会社投資損失引当金戻入額		576		-
その他		23		-
特別利益合計		649		1
特別損失				
投資有価証券売却損		0		0
固定資産処分損		4		6
役員退職一時金		-		369
過年度敷金償却費用		58		-
特別損失合計		62		376
税引前当期純利益		5,034		4,590
法人税、住民税及び事業税		1,134		1,795
法人税等調整額		705		224
法人税等合計		1,839		2,020
当期純利益		3,195		2,570

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：百万円)

	第52期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	17,363	17,363
当期末残高	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	5,220	5,220
当期末残高	5,220	5,220
その他資本剰余金		
当期首残高	4	4
当期変動額		
自己株式の処分	-	4
当期変動額合計	-	4
当期末残高	4	-
資本剰余金合計		
当期首残高	5,225	5,225
当期変動額		
自己株式の処分	-	4
当期変動額合計	-	4
当期末残高	5,225	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		
当期首残高	18,814	21,703
当期変動額		
剰余金の配当	305	1,502
当期純利益	3,195	2,570
自己株式の処分	-	599
当期変動額合計	2,889	468
当期末残高	21,703	22,172
利益剰余金合計		
当期首残高	18,814	21,703
当期変動額		
剰余金の配当	305	1,502
当期純利益	3,195	2,570
自己株式の処分	-	599
当期変動額合計	2,889	468
当期末残高	21,703	22,172

	第52期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第53期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
<b>自己株式</b>		
当期首残高	53	68
当期変動額		
自己株式の取得	14	8,700
自己株式の処分	-	8,700
当期変動額合計	14	-
当期末残高	68	68
<b>株主資本合計</b>		
当期首残高	41,349	44,224
当期変動額		
剰余金の配当	305	1,502
当期純利益	3,195	2,570
自己株式の取得	14	8,700
自己株式の処分	-	8,095
当期変動額合計	2,874	463
当期末残高	44,224	44,687
<b>評価・換算差額等</b>		
<b>その他有価証券評価差額金</b>		
当期首残高	121	63
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	57	21
当期変動額合計	57	21
当期末残高	63	42
<b>評価・換算差額等合計</b>		
当期首残高	121	63
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	57	21
当期変動額合計	57	21
当期末残高	63	42
<b>純資産合計</b>		
当期首残高	41,470	44,287
当期変動額		
剰余金の配当	305	1,502
当期純利益	3,195	2,570
自己株式の取得	14	8,700
自己株式の処分	-	8,095
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	57	21
当期変動額合計	2,817	441
当期末残高	44,287	44,729

## 重要な会計方針

	第53期 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24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
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とおりであります。 建物 4年～5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。
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。
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。

## 追加情報

第53期 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」等の適用 当事業年度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。

## 注記事項

## （貸借対照表関係）

第52期 (平成23年3月31日)	第53期 (平成24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 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 Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務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>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>  建物 1,012百万円</p> <p>  器具備品 590百万円</p> <p>2 信託資産</p> <p>その他流動資産の30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 5,802百万円</p> <p>未収収益 217百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 42百万円</p> <p>未払費用 259百万円</p> <p>4 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務110百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワーアソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務138百万円に対して保証を行っております。</p>

## （損益計算書関係）

第52期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24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 1,066百万円</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 743百万円</p>

## (株主資本等変動計算書関係)

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	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 新株予約権等に関する事項

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)
			当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
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

## 第53期(自平成23年4月1日至平成24年3月31日)

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

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

## 3 新株予約権等に関する事項

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)
			当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
提出会社	平成21年度ストックオプション(1)	普通株式	19,328,100	-	112,200	19,215,900	-
	平成21年度ストックオプション(2)	普通株式	1,702,800	-	26,400	1,676,400	-
	平成22年度ストックオプション(1)	普通株式	2,310,000	-	-	2,310,000	-
	第1回新株予約権	普通株式	-	2,955,200	-	2,955,200	-
	平成23年度ストックオプション(1)	普通株式	-	6,101,700	9,900	6,091,800	-
合計			23,340,900	9,056,900	148,500	32,249,300	-

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

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

4 平成23年度ストックオプション(1)の増加は、新株予約権の発行によるものであり、減少は新株予約権の失効によるものであります。

5 平成21年度ストックオプション(1)9,837,300株、平成21年度ストックオプション(2)871,200株、平成22年度ストックオプション(1)1,155,000株、第1回新株予約権2,955,200株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成23年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来していません。

## 4 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

## (リース取引関係)

第52期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)		第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料		オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	731百万円	1年内	740百万円
1年超	2,234百万円	1年超	1,548百万円
合計	2,966百万円	合計	2,288百万円

## （金融商品関係）

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、株式は市場価格、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

3 子会社株式（貸借対照表計上額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

第53期(自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)

## 1 金融商品の状況に関する事項

### (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

#### 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

#### 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

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

( )負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、株式は市場価格、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

## (有価証券関係)

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

## 第53期(自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)

## 1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時 価	差 額
関連会社株式	1,404	1,615	210
合 計	1,404	1,615	210

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

## 2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種 類	貸借対照表計上額	取 得 原 価	差 額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株 式	35	7	28
	そ の 他	1,177	999	177
	小 計	1,212	1,006	206
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	そ の 他	1,642	1,784	141
	小 計	1,642	1,784	141
合 計		2,854	2,790	64

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

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

## 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種 類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	112	1	0
合 計	112	1	0

## (持分法損益等)

第52期 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	第53期 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24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 4,703 (3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,054	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円) (1) 関連会社に対する投資の金額 4,407 (2) 持分法を適用した場合の投資の金額 6,834 (3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 927

## (退職給付関係)

第52期 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	第53期 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)																																																
<p>1 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュ バランスプラン型退職金制度を設けております。</p> <p>2 退職給付債務に関する事項 (単位：百万円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">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 (単位：百万円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">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 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>ニ 確定拠出型企業年金への掛金</td> <td style="text-align: right;">165</td> </tr> <tr> <td>ホ 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%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">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 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 数理計算上の差異の費用処理額	30	ニ 確定拠出型企業年金への掛金	165	ホ 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 数理計算上の差異の処理年数	10年	<p>1 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュ バランスプラン型退職金制度を設けております。</p> <p>2 退職給付債務に関する事項 (単位：百万円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">イ 退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">985</td> </tr> <tr> <td>ロ 未積立退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">985</td> </tr> <tr> <td>ハ 未認識数理計算上の差異</td> <td style="text-align: right;">77</td> </tr> <tr> <td>ニ 退職給付引当金残高</td> <td style="text-align: right;">907</td> </tr> </table> <p>3 退職給付費用に関する事項 (単位：百万円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">イ 勤務費用</td> <td style="text-align: right;">97</td> </tr> <tr> <td>ロ 利息費用</td> <td style="text-align: right;">14</td> </tr> <tr> <td>ハ 数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">27</td> </tr> <tr> <td>ニ 確定拠出型企業年金への掛金</td> <td style="text-align: right;">168</td> </tr> <tr> <td>ホ 退職給付費用合計</td> <td style="text-align: right;">307</td> </tr> </table> <p>4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">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;">1.4%</td> </tr> <tr> <td>ハ 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	985	ロ 未積立退職給付債務	985	ハ 未認識数理計算上の差異	77	ニ 退職給付引当金残高	907	イ 勤務費用	97	ロ 利息費用	14	ハ 数理計算上の差異の費用処理額	27	ニ 確定拠出型企業年金への掛金	168	ホ 退職給付費用合計	307	イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例	ロ 割引率	1.4%	ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年
イ 退職給付債務	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 数理計算上の差異の費用処理額	30																																																
ニ 確定拠出型企業年金への掛金	165																																																
ホ 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 数理計算上の差異の処理年数	10年																																																
イ 退職給付債務	985																																																
ロ 未積立退職給付債務	985																																																
ハ 未認識数理計算上の差異	77																																																
ニ 退職給付引当金残高	907																																																
イ 勤務費用	97																																																
ロ 利息費用	14																																																
ハ 数理計算上の差異の費用処理額	27																																																
ニ 確定拠出型企業年金への掛金	168																																																
ホ 退職給付費用合計	307																																																
イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例																																																
ロ 割引率	1.4%																																																
ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年																																																

## (ストックオプション等関係)

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

## 1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

## (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

	平成22年度ストックオプション(1)
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)	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。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
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) 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) 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

## 第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24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)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定条件	平成24年1月22日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	同左
権利行使期間	平成24年1月22日から 平成32年1月21日まで	同左

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

## ストックオプション(新株予約権)の数

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

## 単価情報

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

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

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

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

当事業年度末における本源的価値の合計額 - 百万円

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

## (税効果会計関係)

第52期 (平成23年3月31日)	第53期 (平成24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 886	賞与引当金繰入超過額 775
その他 255	その他 309
1,142	1,084
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 60	投資有価証券等評価損 52
関係会社株式評価損 185	関係会社株式評価損 205
退職給付引当金超過額 333	退職給付引当金超過額 329
固定資産減価償却超過額 234	固定資産減価償却超過額 190
その他 99	その他 28
912	806
繰延税金資産合計 2,054	繰延税金資産小計 1,890
	評価性引当金 61
繰延税金負債(固定)	繰延税金資産合計 1,829
その他有価証券評価差額金 43	繰延税金負債(固定)
繰延税金負債合計 43	その他有価証券評価差額金 22
繰延税金資産の純額 2,010	繰延税金負債合計 22
	繰延税金資産の純額 1,807
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 2.7%	交際費等永久に損金に算入されない項目 2.5%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目 7.3%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 5.6%
海外子会社の留保利益の影響額等 0.5%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正 3.8%
税効果会計適用後の法人税等の負担率 36.5%	海外子会社の留保利益の影響額等 2.7%
	税効果会計適用後の法人税等の負担率 44.0%

第52期 (平成23年3月31日)	第53期 (平成24年3月31日)
-	<p>3 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律及び東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法が平成23年12月2日に公布されたことに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算(ただし、平成24年4月1日以降解消されるものに限る)に使用した法定実効税率は、前事業年度の40.6%から、回収又は支払が見込まれる期間が平成24年4月1日から平成27年3月31日までのものは38.0%、平成27年4月1日以降のものについては35.6%にそれぞれ変更されております。</p> <p>その結果、繰延税金資産の金額(繰延税金負債を控除した金額)が170百万円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が174百万円、その他有価証券評価差額金額が4百万円、それぞれ増加しております。</p>

## （関連当事者情報）

第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

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

## 1 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

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

上記の金額のうち、取引金額には消費税が含まれておりません。

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の 名称又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (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)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール 国	252,000	アセットマ ネジメント 業	直接 100.00	-	増資の引受 (注1)	8,095	-	-
							株式売買代金 相当額の引受 (注2)	8,095	-	-

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

住友信託銀行株式会社（非上場）

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

資産合計	9,309百万円
負債合計	1,103百万円
純資産合計	8,206百万円
営業収益	7,961百万円
税引前当期純利益	2,868百万円
当期純利益	2,181百万円

## （セグメント情報等）

### セグメント情報

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

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

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

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

### 関連情報

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

#### 1 製品及びサービスごとの情報

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

#### 2 地域ごとの情報

##### （1）営業収益

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

##### （2）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

#### 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

#### 1 製品及びサービスごとの情報

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

#### 2 地域ごとの情報

##### （1）営業収益

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

##### （2）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

#### 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

## 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

該当事項はありません。

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

該当事項はありません。

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

該当事項はありません。

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

該当事項はありません。

## （ 1株当たり情報 ）

	第52期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第53期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
1株当たり純資産額	224円92銭	227円16銭
1株当たり当期純利益金額	16円22銭	13円09銭

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第52期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第53期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(百万円)	3,195	2,570
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(百万円)	3,195	2,570
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,926	196,278
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1)19,328,100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	平成21年度ストックオプション(1)19,215,900株、平成21年度ストックオプション(2)1,676,400株、平成22年度ストックオプション(1)2,310,000株、第1回新株予約権2,955,200株、平成23年度ストックオプション(1)6,091,800株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第52期 (平成23年3月31日)	第53期 (平成24年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	44,287	44,729
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-	-
普通株式に係る期末の純資産額(百万円)	44,287	44,729
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数(千株)	196,903	196,903

## （ 重要な後発事象 ）

該当事項はありません。

#### 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24年3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24年3月末現在)	事業の内容	
S M B C日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。	
株式会社S B I証券	47,937百万円		
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	7,495百万円		
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	23,066百万豪ドル		
株式会社香川銀行	12,014百万円		
株式会社佐賀共栄銀行	2,679百万円		
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)	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12月27日	臨時報告書
平成24年1月17日	有価証券報告書の訂正報告書
平成24年1月17日	有価証券届出書の訂正届出書
平成24年3月15日	有価証券報告書
平成24年3月15日	有価証券届出書の訂正届出書
平成24年3月29日	臨時報告書

## (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2012年6月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1) 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	24,920,384,850	99.39
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	152,512,300	0.61
合計(純資産総額)		25,072,897,150	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	146,110,000	0.58

(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	307,500	2,550.15	784,172,476	3,190.00	980,925,000	3.91
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,771,800	331.54	587,438,100	378.00	669,740,400	2.67
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	200,100	2,340.09	468,252,745	2,749.00	550,074,900	2.19
日本	株式	キヤノン	電気機器	147,300	3,499.43	515,467,440	3,165.00	466,204,500	1.86
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	177,700	2,135.45	379,470,045	2,612.00	464,152,400	1.85
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	3,010,200	108.29	326,004,640	134.00	403,366,800	1.61
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	107,800	3,835.87	413,507,653	3,700.00	398,860,000	1.59
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	93,000	3,497.97	325,311,270	3,615.00	336,195,000	1.34
日本	株式	ファナック	電気機器	24,700	12,540.25	309,744,400	12,950.00	319,865,000	1.28
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	106,000	2,425.91	257,147,240	2,953.00	313,018,000	1.25
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	117,800	1,901.09	223,949,004	2,361.00	278,125,800	1.11
日本	株式	三菱商事	卸売業	170,400	1,528.56	260,468,319	1,596.00	271,958,400	1.08
日本	株式	日立製作所	電気機器	546,000	427.68	233,515,400	487.00	265,902,000	1.06
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	1,928	135,489.36	261,223,503	132,700.00	255,845,600	1.02
日本	株式	三井物産	卸売業	202,000	1,108.78	223,974,163	1,174.00	237,148,000	0.95
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	97,900	2,097.72	205,367,039	2,397.00	234,666,300	0.94
日本	株式	三菱地所	不動産業	164,000	1,324.52	217,221,350	1,418.00	232,552,000	0.93
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	301,600	692.57	208,879,116	748.00	225,596,800	0.90
日本	株式	小松製作所	機械	115,800	1,846.02	213,770,058	1,878.00	217,472,400	0.87
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	41,200	4,535.59	186,866,585	5,000.00	206,000,000	0.82
日本	株式	信越化学工業	化学	44,500	3,961.12	176,270,032	4,360.00	194,020,000	0.77
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	55,100	2,833.49	156,125,820	3,465.00	190,921,500	0.76

日本	株式	KDDI	情報・通信業	363	558,361.02	202,685,053	513,000.00	186,219,000	0.74
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	88,900	1,810.16	160,924,100	1,986.00	176,555,400	0.70
日本	株式	パナソニック	電気機器	271,000	770.39	208,777,908	643.00	174,253,000	0.69
日本	株式	ソニー	電気機器	148,000	1,555.22	230,172,716	1,123.00	166,204,000	0.66
日本	株式	三井不動産	不動産業	104,000	1,281.24	133,249,980	1,530.00	159,120,000	0.63
日本	株式	デンソー	輸送用機器	58,600	2,321.64	136,048,651	2,693.00	157,809,800	0.63
日本	株式	三菱電機	電気機器	237,000	725.08	171,846,170	660.00	156,420,000	0.62
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	186,700	771.58	144,054,364	832.00	155,334,400	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	0.09
		鉱業	0.65
		建設業	2.49
		食料品	3.93
		繊維製品	0.91
		パルプ・紙	0.33
		化学	5.75
		医薬品	5.16
		石油・石炭製品	0.76
		ゴム製品	0.80
		ガラス・土石製品	1.00
		鉄鋼	1.65
		非鉄金属	1.11
		金属製品	0.71
		機械	4.90
		電気機器	12.78
		輸送用機器	10.50
		精密機器	1.46
		その他製品	1.47
		電気・ガス業	2.86
		陸運業	4.10
		海運業	0.38
		空運業	0.29
		倉庫・運輸関連業	0.23
		情報・通信業	6.64
		卸売業	5.50
		小売業	4.34
銀行業	9.76		
証券、商品先物取引業	1.09		
保険業	2.28		
その他金融業	0.85		
不動産業	2.66		
サービス業	1.97		
合計			99.39

## 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09月	買建	19	日本円	134,147,937	146,110,000	0.58

(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2012年6月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	33,663,553,787	55.81
	カナダ	3,114,310,910	5.16
	ドイツ	2,052,003,390	3.40
	イタリア	518,473,804	0.86
	フランス	2,180,477,504	3.62
	オーストラリア	2,088,189,595	3.46
	イギリス	5,975,377,541	9.91
	スイス	2,366,247,917	3.92
	バミューダ	126,695,174	0.21
	香港	714,534,842	1.18
	シンガポール	480,815,989	0.80
	ニュージーランド	33,248,514	0.06
	オランダ	693,219,652	1.15
	スペイン	673,206,279	1.12
	ベルギー	287,085,662	0.48
	スウェーデン	776,870,814	1.29
	ノルウェー	188,932,142	0.31
	オーストリア	68,570,249	0.11
	ルクセンブルグ	113,594,090	0.19
	フィンランド	188,640,389	0.31
	デンマーク	297,240,822	0.49
	アイルランド	376,879,630	0.62
	ギリシャ	4,109,051	0.01
	イスラエル	156,144,217	0.26
	ポルトガル	41,869,356	0.07
	中国	2,174,816	0.00
	ケイマン島	51,577,694	0.09
	モーリシャス	8,995,140	0.01
	ジャージー	132,518,665	0.22
	ガーンジー	12,151,623	0.02
小計	57,387,709,258	95.15	
投資証券	アメリカ	944,075,827	1.57
	カナダ	11,039,334	0.02
	フランス	66,499,544	0.11
	オーストラリア	199,679,003	0.33
	イギリス	76,542,226	0.13
	香港	23,945,715	0.04
	シンガポール	16,533,277	0.03
	オランダ	6,637,570	0.01
	小計	1,344,952,496	2.23
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	1,581,115,629	2.62
合計(純資産総額)		60,313,777,383	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(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,127,455,098	1.87
	買建	ドイツ	492,302,829	0.82

(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		1,350,089,700	2.24
	売建		36,930,000	0.06

(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	APPLE COMPUTER INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	33,136	31,610.59	1,047,448,400	45,131.36	1,495,472,595	2.48
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	167,551	6,300.39	1,055,636,041	6,590.66	1,104,271,841	1.83
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	269,924	2,129.47	574,796,005	2,372.16	640,303,482	1.06
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	376,393	1,286.41	484,195,041	1,602.06	603,004,922	1.00
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	39,102	14,304.35	559,328,756	15,179.93	593,565,779	0.98
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	211,276	2,253.20	476,046,470	2,806.78	593,005,441	0.98
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	70,211	8,287.89	581,901,395	8,205.41	576,110,224	0.96
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	117,653	4,192.71	493,284,909	4,599.65	541,162,562	0.90
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	97,641	5,027.34	490,874,341	5,309.01	518,377,182	0.86
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	267,640	1,496.58	400,544,590	1,786.85	478,233,684	0.79
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	98,089	5,116.29	501,851,583	4,781.60	469,022,352	0.78
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	178,610	2,026.37	361,930,035	2,575.99	460,097,359	0.76
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	72,876	5,309.80	386,957,312	6,072.77	442,558,946	0.73
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	637,031	646.38	411,764,097	687.26	437,803,274	0.73
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	61,928	5,459.70	338,108,326	6,790.52	420,523,458	0.70
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	9,126	46,259.14	422,160,945	44,755.43	408,438,018	0.68
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	1,792,435	214.23	383,991,199	222.60	398,997,751	0.66
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	135,470	2,656.09	359,820,769	2,845.64	385,499,230	0.64
アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC	食品・生活必需品小売り	67,582	4,497.67	303,961,540	5,416.87	366,083,111	0.61
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	177,242	1,953.41	346,225,462	2,048.58	363,093,937	0.60

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	81,583	4,118.72	336,017,615	4,336.58	353,791,002	0.59
アメリカ	株式	V E R I Z O N COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	100,933	2,870.23	289,700,813	3,487.26	351,979,684	0.58
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	108,663	2,610.09	283,620,437	3,226.33	350,582,783	0.58
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	676,088	562.66	380,406,592	507.75	343,281,572	0.57
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	129,818	2,746.81	356,585,017	2,613.84	339,323,169	0.56
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	25,048	11,608.05	290,758,486	13,392.01	335,443,041	0.56
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	143,883	2,567.26	369,385,746	2,234.16	321,458,031	0.53
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	179,971	1,701.52	306,223,967	1,780.32	320,405,106	0.53
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	55,741	4,902.94	273,295,012	5,519.98	307,688,982	0.51
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	114,496	2,960.59	338,975,769	2,447.64	280,245,504	0.46

## 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	11.12
		素材	6.52
		資本財	7.04
		商業・専門サービス	0.81
		運輸	1.79
		自動車・自動車部品	1.15
		耐久消費財・アパレル	1.20
		消費者サービス	1.70
		メディア	2.69
		小売	2.97
		食品・生活必需品小売り	2.34
		食品・飲料・タバコ	7.17
		家庭用品・パーソナル用品	1.79
		ヘルスケア機器・サービス	2.74
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.09
		銀行	7.04
		各種金融	4.27
		保険	3.85
		不動産	0.64
		ソフトウェア・サービス	6.04
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.74		
電気通信サービス	4.13		
公益事業	3.74		

		半導体・半導体製造装置	1.56
投資証券		-	2.23
合計			97.38

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

## &lt; 有価証券先物取引等 &gt;

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 1209	買建	43	米ドル	14,108,213	1,127,455,098	1.87
	ドイツ	ユーレックス・ド イツ金融先物取引 所	DJSTX5 1209	買建	215	ユーロ	4,936,300	492,302,829	0.82

(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。

## &lt; 為替予約取引 &gt;

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	12,160,000	965,915,245	963,615,190	1.60
	ユーロ	買建	3,916,000	395,699,807	386,474,510	0.64
	英ポンド	売建	300,000	36,916,500	36,930,000	0.06

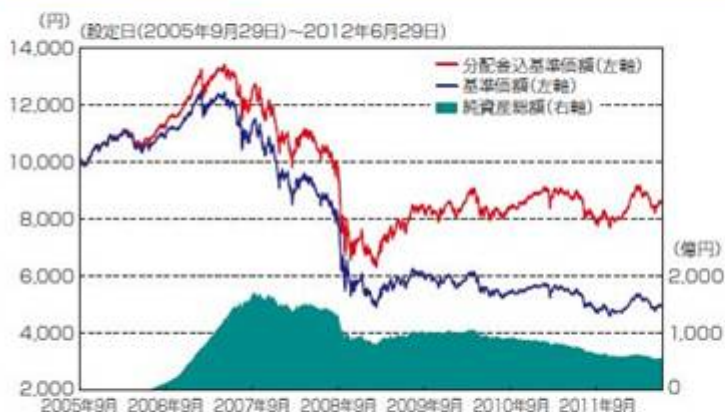
(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(参考情報)

## 運用実績

2012年6月29日現在

## 基準価額・純資産の推移



基準価額……………5,010円

純資産総額……………566.73億円

※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)

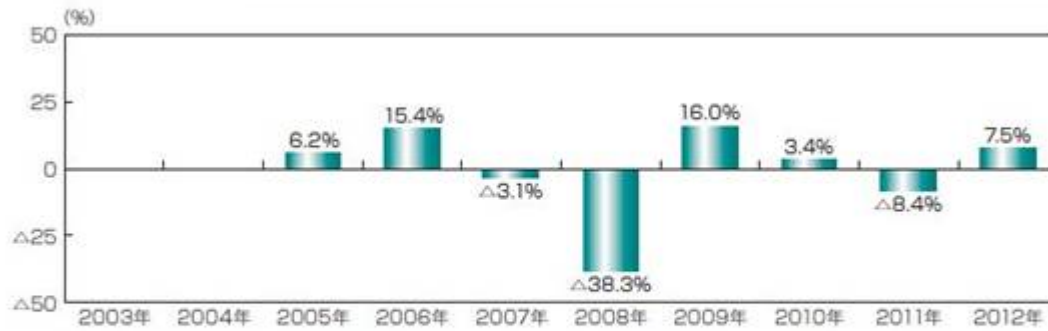
2012年2月	2012年3月	2012年4月	2012年5月	2012年6月	直近1年間累計	設定来累計
20円	20円	20円	20円	20円	310円	3,970円

## 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	16.9%	日本ビルファンド投資法人 投資証券	日本	13.3%
			ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	日本	11.3%
			日本リテールファンド投資法人 投資証券	日本	6.7%
			ユナイテッドアーバン投資法人 投資証券	日本	5.1%
			アドバンスレジデンス投資法人 投資証券	日本	4.8%
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	16.4%	SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	アメリカ	7.3%
			PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.2%
			WESTFIELD GROUP	オーストラリア	3.2%
			EQUITY RESIDENTIAL-REIT	アメリカ	2.9%
			HCP INC	アメリカ	2.9%
日本債券インデックス マザーファンド	日本債券	16.3%	第299回利付国債(10年)	日本	2.5%
			第81回利付国債(5年)	日本	1.8%
			第60回利付国債(20年)	日本	1.8%
			第290回利付国債(10年)	日本	1.5%
			第285回利付国債(10年)	日本	1.3%
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	16.1%	US TREASURY N/B	アメリカ	1.4%
			US TREASURY N/B	アメリカ	1.3%
			US TREASURY N/B	アメリカ	1.2%
			US TREASURY N/B	アメリカ	1.2%
			US TREASURY N/B	アメリカ	1.1%
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	日本株式	16.5%	トヨタ自動車	日本	3.9%
			三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	2.7%
			本田技研工業	日本	2.2%
			キヤノン	日本	1.9%
			三井住友フィナンシャルグループ	日本	1.9%
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	16.1%	APPLE COMPUTER INC	アメリカ	2.5%
			EXXON MOBIL CORP	アメリカ	1.8%
			MICROSOFT CORP	アメリカ	1.1%
			GENERAL ELECTRIC CO.	アメリカ	1.0%
			INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ	1.0%
現金その他		1.7%			

※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。

※2012年は2012年6月末までの騰落率です。

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

※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。

シンガポールドル	投資証券	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	100,000	114,000.00		
		ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	413,000	834,260.00		
		ASCOTT RESIDENCE TRUST	136,000	145,520.00		
		CACHE LOGISTICS TRUST	146,000	150,380.00		
		CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	284,320	152,111.20		
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	459,600	556,116.00		
		CAPITAMALL TRUST	617,200	1,107,874.00		
		CAPITARETAIL CHINA TRUST	103,000	132,870.00		
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	151,000	285,390.00		
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	124,000	107,880.00		
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	112,000	184,800.00		
		K-REIT ASIA	152,000	150,480.00		
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	282,000	109,980.00		
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	245,000	233,975.00		
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	229,160	268,117.20		
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	327,040	317,228.80		
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	84,000	155,820.00		
		SAIZEN REIT	268,000	37,252.00		
		STARHILL GLOBAL REIT	319,000	202,565.00		
	SUNTEC REIT	505,000	656,500.00			
	投資証券小計	5,057,320	5,903,119.20	(366,996,920)		
シンガポールドル合計				5,903,119.20	(366,996,920)	
ニュージーランドドル	投資証券	DNZ PROPERTY FUND LTD	52,797	76,027.68		
		GOODMAN PROPERTY TRUST	177,840	177,840.00		
		KIWI INCOME PROPERTY TRUST	216,737	228,657.53		
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	71,193	86,855.46		
		投資証券小計	518,567	569,380.67	(35,364,233)	
ニュージーランドドル合計				569,380.67	(35,364,233)	
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	1,705	81,976.40		
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	13,770	107,543.70		
		ALTAREA	244	24,522.00		
		ANF IMMOBILIER	2,714	85,979.52		
		BEFIMMO S.C.A.	3,416	156,230.76		
		BENI STABILI SPA	197,931	64,763.02		
		COFINIMMO	3,430	289,457.70		
		CORIO NV	20,927	670,501.08		
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	7,937	196,718.54		
		FONCIERE DES REGIONS	9,267	469,466.22		
		GECINA SA	5,848	401,933.04		
		HAMBORNER REIT AG	7,564	53,023.64		
		ICADE	5,219	318,359.00		
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	25,367	15,093.36		
		INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	1,107	20,280.24		
		KLEPIERRE	22,111	557,971.08		
		MERCIALYS	10,133	146,573.84		
		NIEUWE STEEN INVESTMENTS NV	12,515	76,892.16		
		SILIC	1,985	152,348.75		
		SOCIETE DE LA TOUR EIFFEL	1,192	41,720.00		
		UNIBAIL-RODAMCO SE	20,568	2,845,582.80		
		VASTNED RETAIL NV	4,071	117,143.02		

	WAREHOUSES DE PAUW SCA	2,194	82,867.38	
	WERELDHAVE NV	4,945	232,810.60	
	投資証券小計	386,160	7,209,757.85 (723,210,809)	
ユーロ合計			7,209,757.85 (723,210,809)	
合計			10,927,143,264 (10,927,143,264)	

(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 117銘柄	100.0%	67.3%
加ドル	投資証券 21銘柄	100.0%	3.2%
豪ドル	投資証券 21銘柄	100.0%	11.4%
英ポンド	投資証券 14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%	3.4%
ニュージーランドドル	投資証券 4銘柄	100.0%	0.3%
ユーロ	投資証券 24銘柄	100.0%	6.6%

#### 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12月15日現在	平成24年 6月15日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		7,251,833	130,550,913
国債証券		23,864,637,050	24,033,869,160
地方債証券		2,204,429,000	2,104,556,000
特殊債券		2,909,127,000	2,907,070,000
社債券		2,442,669,000	2,286,012,224
未収入金		20,180,600	10,011,500
未収利息		147,738,201	141,998,651
前払費用		2,180,951	4,756,755
流動資産合計		31,598,213,635	31,618,825,203
資産合計		31,598,213,635	31,618,825,203
負債の部			
流動負債			
未払解約金		23,862,664	131,413,392
流動負債合計		23,862,664	131,413,392
負債合計		23,862,664	131,413,392
純資産の部			
元本等			
元本		25,620,877,691	25,210,414,221
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		5,953,473,280	6,276,997,590
元本等合計		31,574,350,971	31,487,411,811
純資産合計		31,574,350,971	31,487,411,811
負債純資産合計		31,598,213,635	31,618,825,203

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

## (貸借対照表に関する注記)

		平成23年12月15日現在	平成24年 6月15日現在
1.	期首	平成23年 6月16日	平成23年12月16日
	期首元本額	28,668,484,650円	25,620,877,691円
	期首からの追加設定元本額	690,490,696円	1,093,252,491円
	期首からの一部解約元本額	3,738,097,655円	1,503,715,961円
	元本の内訳		
	D C インデックスバランス(株式20)	433,848,015円	457,166,924円
	D C インデックスバランス(株式40)	515,017,547円	550,442,294円
	D C インデックスバランス(株式60)	355,547,367円	372,135,113円
	D C インデックスバランス(株式80)	58,915,442円	60,190,068円
	インデックスファンド日本債券(D C 専用)	959,984,903円	1,068,587,510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	7,425,175,648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	8,242,700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	100,314,762円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	7,538,772円	7,486,772円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	45,492,795円	43,340,970円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	198,839,706円	191,176,918円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	752,222,676円	701,190,978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	7,009,185,030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	110,611,814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	193,455,903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	19,301,370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	29,716,765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	869,261,336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	790,004,572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	364,518,757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	52,451,416円
	年金積立 インデックスファンド日本債券	4,329,049,335円	4,653,645,804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	132,810,797円
	計	25,620,877,691円	25,210,414,221円
2.	受益権の総数	25,620,877,691口	25,210,414,221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23年 6月16日 至 平成23年12月15日	自 平成23年12月16日 至 平成24年 6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12月15日現在	平成24年 6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
----	------------

(平成24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	175,339,700
地方債証券	415,000
特殊債券	4,113,000
社債券	27,633,000
合計	198,444,700

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

(関連当事者との取引に関する注記)  
 該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成23年12月15日現在		平成24年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	1.2324円	1口当たり純資産額	1.2490円
(1万口当たり純資産額)	(12,324円)	(1万口当たり純資産額)	(12,490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307回利付国債(2年)	30,000,000	30,034,500	
	第308回利付国債(2年)	140,000,000	140,000,000	
	第310回利付国債(2年)	40,000,000	40,056,000	
	第311回利付国債(2年)	250,000,000	250,370,000	
	第312回利付国債(2年)	40,000,000	40,000,000	
	第313回利付国債(2年)	40,000,000	40,000,000	
	第314回利付国債(2年)	220,000,000	220,000,000	
	第72回利付国債(5年)	30,000,000	30,420,600	
	第74回利付国債(5年)	17,000,000	17,153,170	
	第75回利付国債(5年)	176,000,000	178,205,280	
	第76回利付国債(5年)	138,000,000	139,901,640	
	第78回利付国債(5年)	113,000,000	114,357,130	
	第79回利付国債(5年)	143,000,000	144,288,430	
	第81回利付国債(5年)	574,000,000	581,020,020	
	第83回利付国債(5年)	62,000,000	62,990,760	
	第84回利付国債(5年)	77,000,000	77,923,230	
	第85回利付国債(5年)	47,000,000	47,634,030	
	第87回利付国債(5年)	20,000,000	20,199,800	
	第89回利付国債(5年)	110,000,000	110,987,800	
	第90回利付国債(5年)	50,000,000	50,299,000	
第91回利付国債(5年)	80,000,000	80,778,400		
第92回利付国債(5年)	15,000,000	15,097,200		

第93回利付国債(5年)	225,000,000	228,062,250	
第94回利付国債(5年)	70,000,000	71,197,000	
第95回利付国債(5年)	220,000,000	223,858,800	
第97回利付国債(5年)	140,000,000	141,391,600	
第98回利付国債(5年)	55,000,000	55,327,800	
第99回利付国債(5年)	150,000,000	151,456,500	
第100回利付国債(5年)	50,000,000	50,274,500	
第101回利付国債(5年)	350,000,000	353,279,500	
第102回利付国債(5年)	80,000,000	80,392,800	
第104回利付国債(5年)	50,000,000	49,976,000	
第2回利付国債(40年)	185,000,000	193,656,150	
第4回利付国債(40年)	55,000,000	57,027,850	
第250回利付国債(10年)	285,000,000	286,140,000	
第251回利付国債(10年)	227,000,000	228,818,270	
第252回利付国債(10年)	128,000,000	129,153,280	
第253回利付国債(10年)	35,000,000	35,657,650	
第254回利付国債(10年)	52,000,000	52,847,080	
第256回利付国債(10年)	148,000,000	150,888,960	
第258回利付国債(10年)	40,000,000	40,838,800	
第259回利付国債(10年)	7,000,000	7,171,220	
第261回利付国債(10年)	270,000,000	279,171,900	
第262回利付国債(10年)	85,000,000	88,057,450	
第264回利付国債(10年)	141,000,000	145,440,090	
第265回利付国債(10年)	50,000,000	51,748,000	
第266回利付国債(10年)	118,000,000	121,831,460	
第268回利付国債(10年)	361,000,000	374,862,400	
第269回利付国債(10年)	90,000,000	92,961,900	
第270回利付国債(10年)	88,000,000	91,160,960	
第271回利付国債(10年)	146,000,000	150,807,780	
第272回利付国債(10年)	178,000,000	185,506,260	
第273回利付国債(10年)	111,000,000	116,040,510	
第274回利付国債(10年)	73,000,000	76,541,960	
第276回利付国債(10年)	35,000,000	36,820,350	
第278回利付国債(10年)	80,000,000	85,002,400	
第279回利付国債(10年)	70,000,000	74,913,300	
第280回利付国債(10年)	156,000,000	166,895,040	
第281回利付国債(10年)	182,000,000	195,435,240	
第282回利付国債(10年)	274,000,000	291,768,900	
第283回利付国債(10年)	50,000,000	53,454,000	
第284回利付国債(10年)	57,000,000	60,857,190	
第285回利付国債(10年)	391,000,000	418,499,030	
第286回利付国債(10年)	216,000,000	232,886,880	
第287回利付国債(10年)	35,000,000	37,909,550	
第288回利付国債(10年)	18,000,000	19,363,680	
第289回利付国債(10年)	269,000,000	287,020,310	
第290回利付国債(10年)	446,000,000	473,999,880	
第291回利付国債(10年)	287,000,000	303,393,440	
第292回利付国債(10年)	241,000,000	260,219,750	
第293回利付国債(10年)	96,000,000	104,398,080	

第294回利付国債(10年)	32,000,000	34,610,880	
第295回利付国債(10年)	13,000,000	13,903,370	
第296回利付国債(10年)	176,000,000	188,386,880	
第297回利付国債(10年)	148,000,000	157,581,520	
第298回利付国債(10年)	221,000,000	233,904,190	
第299回利付国債(10年)	750,000,000	793,845,000	
第300回利付国債(10年)	51,000,000	54,669,450	
第301回利付国債(10年)	138,000,000	147,987,060	
第302回利付国債(10年)	29,000,000	30,901,530	
第303回利付国債(10年)	361,000,000	384,822,390	
第305回利付国債(10年)	343,000,000	362,976,320	
第306回利付国債(10年)	115,000,000	122,448,550	
第308回利付国債(10年)	140,000,000	147,821,800	
第309回利付国債(10年)	59,000,000	61,369,440	
第310回利付国債(10年)	268,000,000	276,104,320	
第311回利付国債(10年)	93,000,000	94,314,090	
第312回利付国債(10年)	125,000,000	130,592,500	
第313回利付国債(10年)	340,000,000	357,408,000	
第315回利付国債(10年)	85,000,000	88,486,700	
第316回利付国債(10年)	35,000,000	36,139,600	
第317回利付国債(10年)	165,000,000	169,996,200	
第318回利付国債(10年)	175,000,000	178,708,250	
第319回利付国債(10年)	180,000,000	185,013,000	
第320回利付国債(10年)	100,000,000	101,856,000	
第321回利付国債(10年)	160,000,000	162,600,000	
第322回利付国債(10年)	170,000,000	171,149,200	
第14回利付国債(30年)	208,000,000	232,783,200	
第15回利付国債(30年)	162,000,000	184,226,400	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	62,340,850	
第24回利付国債(30年)	158,000,000	179,244,680	
第26回利付国債(30年)	100,000,000	111,514,000	
第27回利付国債(30年)	134,000,000	152,000,220	
第28回利付国債(30年)	14,000,000	15,891,960	
第29回利付国債(30年)	246,000,000	274,516,320	
第30回利付国債(30年)	127,000,000	138,967,210	
第31回利付国債(30年)	20,000,000	21,462,600	
第32回利付国債(30年)	40,000,000	43,782,000	
第33回利付国債(30年)	50,000,000	51,439,000	
第34回利付国債(30年)	110,000,000	118,000,300	
第35回利付国債(30年)	120,000,000	123,066,000	
第36回利付国債(30年)	140,000,000	143,479,000	
第23回利付国債(20年)	100,000,000	106,767,000	
第26回利付国債(20年)	37,000,000	40,666,700	
第27回利付国債(20年)	16,000,000	17,765,920	
第29回利付国債(20年)	110,000,000	124,643,200	
第31回利付国債(20年)	40,000,000	45,051,600	
第33回利付国債(20年)	200,000,000	230,814,000	
第34回利付国債(20年)	85,000,000	98,269,350	
第37回利付国債(20年)	63,000,000	72,368,730	

第39回利付国債(20年)	86,000,000	97,291,800	
第41回利付国債(20年)	27,000,000	28,923,480	
第42回利付国債(20年)	178,000,000	203,874,080	
第43回利付国債(20年)	73,000,000	85,654,550	
第44回利付国債(20年)	51,000,000	58,588,800	
第47回利付国債(20年)	21,000,000	23,671,410	
第48回利付国債(20年)	99,000,000	114,085,620	
第49回利付国債(20年)	57,000,000	63,846,840	
第50回利付国債(20年)	237,000,000	261,325,680	
第51回利付国債(20年)	39,000,000	43,313,010	
第54回利付国債(20年)	15,000,000	16,937,100	
第55回利付国債(20年)	66,000,000	73,231,620	
第57回利付国債(20年)	137,000,000	150,678,080	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	148,509,450	
第59回利付国債(20年)	33,000,000	35,636,040	
第60回利付国債(20年)	545,000,000	571,972,050	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	27,184,680	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	33,708,780	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	59,246,100	
第65回利付国債(20年)	140,000,000	153,553,400	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	36,920,260	
第67回利付国債(20年)	54,000,000	59,141,340	
第68回利付国債(20年)	38,000,000	42,884,900	
第70回利付国債(20年)	49,000,000	56,351,470	
第72回利付国債(20年)	42,000,000	46,838,820	
第73回利付国債(20年)	13,000,000	14,333,280	
第74回利付国債(20年)	78,000,000	86,860,020	
第76回利付国債(20年)	151,000,000	164,414,840	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	339,357,000	
第90回利付国債(20年)	156,000,000	174,245,760	
第91回利付国債(20年)	200,000,000	225,954,000	
第92回利付国債(20年)	110,000,000	121,256,300	
第94回利付国債(20年)	100,000,000	110,037,000	
第95回利付国債(20年)	32,000,000	36,017,280	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	107,639,280	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	49,996,350	
第98回利付国債(20年)	44,000,000	48,265,800	
第99回利付国債(20年)	97,000,000	106,326,550	
第100回利付国債(20年)	140,000,000	155,254,400	
第101回利付国債(20年)	96,000,000	109,163,520	
第102回利付国債(20年)	106,000,000	120,408,580	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	12,334,520	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	36,067,020	
第105回利付国債(20年)	82,000,000	89,481,680	
第106回利付国債(20年)	142,000,000	157,042,060	
第107回利付国債(20年)	30,000,000	32,705,700	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	142,124,420	
第109回利付国債(20年)	119,000,000	126,047,180	
第110回利付国債(20年)	148,000,000	161,180,880	

第111回利付国債(20年)	90,000,000	99,206,100	
第113回利付国債(20年)	20,000,000	21,719,200	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	56,364,360	
第116回利付国債(20年)	185,000,000	203,294,650	
第117回利付国債(20年)	30,000,000	32,500,200	
第118回利付国債(20年)	70,000,000	74,643,800	
第119回利付国債(20年)	50,000,000	51,759,000	
第120回利付国債(20年)	70,000,000	70,245,000	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	23,079,100	
第122回利付国債(20年)	80,000,000	82,668,800	
第123回利付国債(20年)	55,000,000	59,349,400	
第124回利付国債(20年)	50,000,000	53,120,500	
第125回利付国債(20年)	95,000,000	103,894,850	
第126回利付国債(20年)	25,000,000	26,538,000	
第128回利付国債(20年)	35,000,000	36,529,850	
第129回利付国債(20年)	115,000,000	118,178,600	
第130回利付国債(20年)	80,000,000	82,052,800	
第131回利付国債(20年)	25,000,000	25,219,500	
第132回利付国債(20年)	90,000,000	90,730,800	
第133回利付国債(20年)	30,000,000	30,732,000	
第134回利付国債(20年)	60,000,000	61,386,000	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	30,200,700	
第136回利付国債(20年)	210,000,000	207,816,000	
国債証券 合計	22,687,000,000	24,033,869,160	
地方債証券			
第598回東京都公募公債	100,000,000	100,359,000	
第636回東京都公募公債	100,000,000	107,314,000	
第682回東京都公募公債	100,000,000	105,421,000	
第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	115,544,000	
第123回神奈川県公募公債	100,000,000	101,942,000	
第1回大阪府公募公債(7年)	100,000,000	101,902,000	
第261回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,949,000	
平成19年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	107,962,000	
平成15年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	101,697,000	
平成19年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	107,309,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	105,795,000	
平成18年度第1回広島県公募公債	100,000,000	107,835,000	
平成16年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	102,497,000	
平成16年度第3回千葉県公募公債	100,000,000	103,814,000	
平成17年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	103,546,000	
第55回共同発行市場公募地方債	100,000,000	108,157,000	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,540,000	
平成16年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	103,307,000	
第12回め号名古屋市公募公債	100,000,000	103,440,000	
平成18年度第1回鹿児島県公募公債(10年)	100,000,000	107,226,000	
地方債証券 合計	2,000,000,000	2,104,556,000	

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	106,255,000	
	第21回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,169,000	
	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,895,000	
	第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,111,000	
	第332回政府保証道路債券	100,000,000	103,108,000	
	第335回政府保証道路債券	100,000,000	103,169,000	
	第336回政府保証道路債券	100,000,000	103,290,000	
	第338回政府保証道路債券	100,000,000	103,766,000	
	第343回政府保証道路債券	100,000,000	103,514,000	
	第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,583,000	
	第12回公営企業債券	100,000,000	103,039,000	
	第20回公営企業債券	100,000,000	107,187,000	
	第858回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,738,000	
	第199回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	104,025,000	
	第176回政府保証中小企業債券	100,000,000	101,840,000	
	第25回国際協力銀行債券	100,000,000	106,655,000	
	第14回政府保証国民生活債券	100,000,000	103,064,000	
	第8回農林漁業金融公庫債券	200,000,000	206,648,000	
	第3回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	102,369,000	
	第5回沖縄振興開発金融公庫債券	200,000,000	206,098,000	
	い第709号農林債	100,000,000	101,820,000	
	い第714号農林債	100,000,000	101,510,000	
	い第722号農林債	100,000,000	100,835,000	
第227回信金中金債(5年)	100,000,000	101,662,000		
第231回信金中金債(5年)	100,000,000	101,916,000		
第234回信金中金債(5年)	100,000,000	101,804,000		
特殊債券 合計		2,800,000,000	2,907,070,000	
社債券	第324回東京交通債券	100,000,000	114,036,000	
	第5回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債(2010)	100,000,000	101,242,000	
	第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債(2011)	100,000,000	100,598,000	
	第8回帝人株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	104,461,000	
	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	104,553,000	
	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	100,887,000	
	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	100,581,224	
	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	104,568,000	
	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	103,927,000	
	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	102,162,000	
	第17回三菱重工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,582,000	
	第18回株式会社ニコン無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,855,000	
	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	106,951,000	

[次へ](#)

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	101,625,000	
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	102,416,000	
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	109,112,000	
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	112,878,000	
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	104,339,000	
第523回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	87,483,000	
第306回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	113,229,000	
第257回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,647,000	
第19回沖縄電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,880,000	
社債券 合計	2,200,000,000	2,286,012,224	
合計	29,687,000,000	31,331,507,384	

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12月15日現在	平成24年 6月15日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		18,247,723	3,093,017
コール・ローン		47,455,780	35,935,867
国債証券		425,973,071,719	322,085,862,546
派生商品評価勘定		2,938,530	165,750
未収入金		804,858,120	1,209,441,707
未収利息		5,336,539,367	4,058,338,384
前払費用		176,043,555	131,587,443
流動資産合計		432,359,154,794	327,524,424,714
資産合計		432,359,154,794	327,524,424,714
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		449,822	3,350,660
未払解約金		652,110,557	670,547,011
流動負債合計		652,560,379	673,897,671
負債合計		652,560,379	673,897,671
純資産の部			
元本等			
元本		308,777,721,673	225,256,866,242
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		122,928,872,742	101,593,660,801
元本等合計		431,706,594,415	326,850,527,043
純資産合計		431,706,594,415	326,850,527,043
負債純資産合計		432,359,154,794	327,524,424,714

## (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>

## (貸借対照表に関する注記)

		平成23年12月15日現在	平成24年 6月15日現在
1.	期首	平成23年 6月16日	平成23年12月16日
	期首元本額	367,182,282,134円	308,777,721,673円
	期首からの追加設定元本額	1,002,705,836円	916,658,189円
	期首からの一部解約元本額	59,407,266,297円	84,437,513,620円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外債券ヘッジなし（DC専用）	9,717,747,025円	10,026,573,384円
	DCインデックスバランス（株式20）	58,705,371円	60,200,409円
	DCインデックスバランス（株式40）	101,761,036円	105,172,872円
	DCインデックスバランス（株式60）	126,144,162円	127,956,362円
	DCインデックスバランス（株式80）	103,347,068円	103,846,298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	106,043,024,716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	6,361,636,889円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	100,040,243,465円	84,840,347,575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	47,819,961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）	1,411,087,492円	1,375,450,157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	9,392,407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	70,323,881円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	6,589,961円	6,406,374円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	8,012,496円	7,429,593円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	19,411,414円	18,256,456円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	50,621,389円	46,340,356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	1,230,537,999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	2,002,157,195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	134,970,532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	192,766,349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	16,861,000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	57,512,217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	57,309,028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	74,878,903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	63,673,578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	45,737,896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	11,910,300,278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	219,983,577円
計	308,777,721,673円	225,256,866,242円
2. 受益権の総数	308,777,721,673口	225,256,866,242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)

1 金融商品の状況に関する事項

	自 平成23年 6月16日 至 平成23年12月15日	自 平成23年12月16日 至 平成24年 6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12月15日現在	平成24年 6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

(平成24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	5,324,192,700
合計	5,324,192,700

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(平成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	

(平成24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	1,186,787,410		1,189,972,320	3,184,910
	米ドル	452,906,850		453,093,000	186,150
	加ドル	70,194,852		70,634,200	439,348
	英ポンド	126,098,800		126,031,200	67,600
	スウェーデンクローナ	48,735,308		48,743,920	8,612
	ユーロ	488,851,600		491,470,000	2,618,400
合計	1,186,787,410		1,189,972,320	3,184,910	

(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12月15日現在		平成24年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	1.3981円	1口当たり純資産額	1.4510円
(1万口当たり純資産額)	(13,981円)	(1万口当たり純資産額)	(14,510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-3.375%-13/06/30	19,650,000	20,290,160.15	
		US TREASURY N/B-1.0%-13/07/15	8,500,000	8,569,062.50	
		US TREASURY N/B-3.375%-13/07/31	36,000,000	37,260,000.00	
		US TREASURY N/B-4.25%-13/08/15	34,400,000	35,999,062.50	
		US TREASURY N/B-3.125%-13/08/31	41,100,000	42,525,656.25	
		US TREASURY N/B-3.125%-13/09/30	27,400,000	28,403,953.12	
		US TREASURY N/B-2.75%-13/10/31	10,500,000	10,856,015.62	
		US TREASURY N/B-4.25%-13/11/15	32,500,000	34,315,429.68	
		US TREASURY N/B-2.0%-13/11/30	21,900,000	22,443,222.66	
		US TREASURY N/B-1.5%-13/12/31	16,600,000	16,905,414.07	
		US TREASURY N/B-1.75%-14/01/31	13,800,000	14,123,437.50	
		US TREASURY N/B-4.0%-14/02/15	36,280,000	38,502,150.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-14/02/28	11,300,000	11,600,156.25	
		US TREASURY N/B-1.75%-14/03/31	9,700,000	9,948,562.50	
		US TREASURY N/B-1.875%-14/04/30	4,000,000	4,116,562.50	
		US TREASURY N/B-4.75%-14/05/15	40,550,000	43,984,078.12	
		US TREASURY N/B-2.25%-14/05/31	3,600,000	3,735,843.75	
		US TREASURY N/B-2.625%-14/07/31	5,500,000	5,768,125.00	
		US TREASURY N/B-4.25%-14/08/15	35,700,000	38,717,765.62	
		US TREASURY N/B-2.375%-14/08/31	27,500,000	28,733,203.12	
		US TREASURY N/B-2.375%-14/09/30	21,100,000	22,085,765.62	
		US TREASURY N/B-2.375%-14/10/31	21,200,000	22,211,968.75	
		US TREASURY N/B-4.25%-14/11/15	33,800,000	36,958,187.50	
		US TREASURY N/B-2.125%-14/11/30	10,700,000	11,160,601.56	
		US TREASURY N/B-2.625%-14/12/31	16,000,000	16,915,000.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-15/01/31	16,800,000	17,616,375.00	

US TREASURY N/B-11.25%-15/02/15	3,000,000	3,866,250.00	
US TREASURY N/B-4.0%-15/02/15	26,700,000	29,249,015.62	
US TREASURY N/B-2.375%-15/02/28	17,300,000	18,219,062.50	
US TREASURY N/B-2.5%-15/03/31	10,000,000	10,584,375.00	
US TREASURY N/B-2.5%-15/04/30	8,000,000	8,476,250.00	
US TREASURY N/B-4.125%-15/05/15	23,100,000	25,570,617.18	
US TREASURY N/B-2.125%-15/05/31	9,500,000	9,975,742.18	
US TREASURY N/B-4.25%-15/08/15	24,700,000	27,642,773.43	
US TREASURY N/B-4.5%-15/11/15	10,900,000	12,375,757.81	
US TREASURY N/B-4.5%-16/02/15	33,500,000	38,315,625.00	
US TREASURY N/B-5.125%-16/05/15	31,000,000	36,444,375.00	
US TREASURY N/B-7.25%-16/05/15	9,000,000	11,311,875.00	
US TREASURY N/B-3.25%-16/05/31	20,100,000	22,188,515.62	
US TREASURY N/B-3.25%-16/06/30	12,000,000	13,265,625.00	
US TREASURY N/B-3.25%-16/07/31	24,200,000	26,790,156.25	
US TREASURY N/B-4.875%-16/08/15	21,700,000	25,482,242.18	
US TREASURY N/B-3.0%-16/08/31	9,800,000	10,756,265.62	
US TREASURY N/B-3.0%-16/09/30	10,700,000	11,762,476.56	
US TREASURY N/B-3.125%-16/10/31	11,900,000	13,158,796.87	
US TREASURY N/B-4.625%-16/11/15	26,000,000	30,468,750.00	
US TREASURY N/B-7.5%-16/11/15	10,200,000	13,220,156.25	
US TREASURY N/B-2.75%-16/11/30	1,600,000	1,746,125.00	
US TREASURY N/B-3.25%-16/12/31	13,400,000	14,929,484.37	
US TREASURY N/B-3.125%-17/01/31	10,400,000	11,544,812.50	
US TREASURY N/B-4.625%-17/02/15	13,250,000	15,625,683.59	
US TREASURY N/B-3.0%-17/02/28	5,400,000	5,969,953.12	
US TREASURY N/B-3.25%-17/03/31	11,200,000	12,525,625.00	
US TREASURY N/B-3.125%-17/04/30	7,000,000	7,796,250.00	
US TREASURY N/B-4.5%-17/05/15	14,100,000	16,654,523.43	
US TREASURY N/B-8.75%-17/05/15	8,000,000	11,093,750.00	
US TREASURY N/B-2.75%-17/05/31	11,100,000	12,179,648.43	
US TREASURY N/B-2.5%-17/06/30	12,500,000	13,556,640.62	
US TREASURY N/B-4.75%-17/08/15	20,500,000	24,616,015.62	
US TREASURY N/B-8.875%-17/08/15	4,000,000	5,645,937.50	
US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	22,400,000	26,458,250.00	
US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	22,400,000	25,639,250.00	
US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	25,550,000	29,925,437.50	
US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	17,900,000	21,212,898.43	
US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	16,500,000	19,360,429.68	
US TREASURY N/B-8.875%-19/02/15	5,000,000	7,549,218.75	
US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	5,600,000	6,230,437.50	
US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	2,400,000	2,733,000.00	
US TREASURY N/B-8.125%-19/08/15	9,000,000	13,398,750.00	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	5,000,000	5,803,906.25	
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	16,300,000	19,251,828.12	
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	28,000,000	32,821,250.00	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	7,950,000	12,590,812.50	
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	2,000,000	2,207,812.50	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	40,000,000	47,359,375.00	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	12,000,000	18,935,625.00	
US TREASURY N/B-7.25%-22/08/15	4,000,000	6,139,375.00	
US TREASURY N/B-7.125%-23/02/15	8,000,000	12,290,625.00	
US TREASURY N/B-6.25%-23/08/15	7,300,000	10,654,578.12	
US TREASURY N/B-7.5%-24/11/15	6,500,000	10,574,179.68	

		US TREASURY N/B-7.625%-25/02/15	3,000,000	4,944,843.75	
		US TREASURY N/B-6.875%-25/08/15	5,000,000	7,863,671.87	
		US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	4,100,000	6,050,382.81	
		US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,700,000	4,194,914.06	
		US TREASURY N/B-6.625%-27/02/15	4,000,000	6,302,500.00	
		US TREASURY N/B-6.375%-27/08/15	4,000,000	6,215,000.00	
		US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	6,700,000	10,219,593.75	
		US TREASURY N/B-5.5%-28/08/15	3,870,000	5,622,686.71	
		US TREASURY N/B-6.125%-29/08/15	5,100,000	7,957,593.75	
		US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	7,100,000	11,315,070.31	
		US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	3,500,000	5,151,015.62	
		US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	5,100,000	6,919,664.06	
		US TREASURY N/B-4.75%-37/02/15	7,200,000	10,137,375.00	
		US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	10,500,000	15,302,929.68	
		US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	8,400,000	11,260,593.75	
		US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	12,600,000	17,224,593.75	
		US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	15,300,000	20,175,679.68	
		US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	11,500,000	15,754,101.56	
		US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	19,000,000	25,547,578.12	
		US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	18,300,000	25,558,523.43	
		US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	17,700,000	23,813,414.06	
		US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	4,900,000	6,090,164.06	
		US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	11,000,000	14,524,296.87	
		US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,600,000	2,281,375.00	
		US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	8,500,000	11,457,070.31	
		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	6,000,000	7,302,656.25	
	国債証券小計		1,512,300,000	1,757,079,238.83 (139,687,799,486)	
米ドル合計				1,757,079,238.83 (139,687,799,486)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-5.25%-13/06/01	10,550,000	10,973,371.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-13/09/01	6,300,000	6,411,636.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-14/06/01	7,600,000	7,888,268.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-14/06/01	10,400,000	11,195,704.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-14/12/01	5,300,000	5,419,091.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-15/06/01	2,300,000	2,392,391.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.5%-15/06/01	6,850,000	7,522,738.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-15/12/01	2,550,000	2,706,621.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-16/06/01	11,150,000	12,338,478.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-17/06/01	3,900,000	4,402,944.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	3,900,000	4,534,491.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	6,800,000	7,815,036.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	5,150,000	5,886,450.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	1,600,000	1,808,656.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-9.0%-25/06/01	1,430,000	2,572,741.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	2,800,000	4,917,416.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	2,500,000	3,741,300.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	3,750,000	5,853,825.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	4,600,000	6,832,840.00	
	CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	5,900,000	7,911,900.00		
CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,300,000	1,640,340.00			
	国債証券小計		106,630,000	124,766,239.10 (9,686,850,803)	
加ドル合計				124,766,239.10 (9,686,850,803)	

豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-13/12/15	3,150,000	3,291,353.10	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.25%-14/06/15	2,800,000	3,004,982.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-14/10/21	2,300,000	2,407,610.10	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.25%-15/04/15	7,900,000	8,730,455.90	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-16/06/15	4,700,000	5,109,807.10	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.0%-17/02/15	5,200,000	6,000,389.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-17/07/21	1,200,000	1,294,896.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-18/01/21	2,100,000	2,409,638.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	6,100,000	7,037,911.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	5,400,000	6,017,695.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	5,500,000	6,699,874.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	2,950,000	3,634,485.55	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	2,500,000	3,036,442.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	950,000	1,100,113.30	
			国債証券小計	52,750,000	59,775,655.15 (4,755,751,123)
豪ドル合計				59,775,655.15 (4,755,751,123)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-8.0%-13/09/27	2,800,000	3,077,179.47	
		UK TREASURY-2.25%-14/03/07	4,400,000	4,548,437.82	
		UK TREASURY-5.0%-14/09/07	12,550,000	13,862,354.50	
		UK TREASURY-2.75%-15/01/22	1,400,000	1,485,020.26	
		UK TREASURY-4.75%-15/09/07	6,930,000	7,886,060.99	
		UK TREASURY-8.0%-15/12/07	6,600,000	8,321,993.32	
		UK TREASURY-2.0%-16/01/22	400,000	419,913.60	
		UK TREASURY-4.0%-16/09/07	12,100,000	13,774,609.87	
		UK TREASURY-8.75%-17/08/25	4,100,000	5,740,259.44	
		UK TREASURY-5.0%-18/03/07	5,300,000	6,476,888.90	
		UK TREASURY-4.5%-19/03/07	6,100,000	7,399,482.14	
		UK TREASURY-3.75%-19/09/07	2,150,000	2,511,038.87	
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	9,500,000	11,824,764.00	
		UK TREASURY-3.75%-20/09/07	2,400,000	2,814,401.83	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	8,700,000	13,410,541.57	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	3,200,000	3,774,080.00	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	5,800,000	6,976,700.86	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	6,240,000	8,284,226.12	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	3,750,000	4,657,523.43	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	6,300,000	9,395,341.64	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	4,900,000	6,416,563.03	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	4,850,000	5,946,537.85	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	7,750,000	9,779,358.42	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,050,000	1,277,014.12	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	4,550,000	5,953,845.89	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	7,000,000	8,468,434.52	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	6,550,000	7,917,847.30	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	4,850,000	6,126,307.13	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	6,550,000	7,962,425.69	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	3,100,000	3,769,049.50	
UK TREASURY-4.25%-55/12/07	5,900,000	7,251,528.81			
UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,700,000	2,007,107.44			
	国債証券小計	169,470,000	209,516,838.33 (25,889,995,712)		
英ポンド合計				209,516,838.33 (25,889,995,712)	

スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-4.25%-14/01/06	1,590,000	1,708,100.43		
		SWITZERLAND-2.5%-16/03/12	3,010,000	3,318,055.44		
		SWITZERLAND-3.0%-18/01/08	3,260,000	3,794,421.58		
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	4,670,000	6,313,952.08		
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	790,000	1,152,955.23		
	国債証券小計		13,320,000	16,287,484.76	(1,360,330,727)	
スイスフラン合計					16,287,484.76	(1,360,330,727)
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-13/07/01	2,610,000	2,666,637.00		
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.625%-14/07/01	1,930,000	2,066,000.66		
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.375%-14/10/01	600,000	616,350.00		
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-15/07/01	1,750,000	1,888,775.00		
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.75%-16/09/01	1,730,000	1,974,045.33		
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-17/04/01	1,000,000	1,088,450.00		
		SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	1,450,000	1,735,408.32		
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01	800,000	877,440.00		
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	1,850,000	2,119,668.33		
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	1,540,000	1,759,373.00		
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	1,000,000	1,122,800.00		
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	1,200,000	1,407,480.00		
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	600,000	656,700.00		
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	740,000	759,647.00		
	国債証券小計		18,800,000	20,738,774.64	(1,289,329,619)	
シンガポールドル合計					20,738,774.64	(1,289,329,619)
マレーシアリングット	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT-3.21%-13/05/31	2,400,000	2,404,800.00		
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.461%-13/07/31	4,400,000	4,422,670.07		
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.094%-14/04/30	9,500,000	9,859,733.36		
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.741%-15/02/27	4,000,000	4,070,800.00		
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.835%-15/08/12	2,000,000	2,044,200.00		
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.72%-15/09/30	4,700,000	4,924,847.57		
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.262%-16/09/15	3,800,000	3,961,753.34		
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.814%-17/02/15	4,500,000	4,604,615.91		
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.012%-17/09/15	3,400,000	3,520,700.00		
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	6,500,000	6,782,750.00		
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	3,800,000	4,336,123.95		
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	5,900,000	6,235,415.00		
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	5,500,000	5,757,400.00		
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	3,200,000	3,400,800.00		
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	1,750,000	1,681,144.20		
MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	1,050,000	1,215,065.12				
	国債証券小計		66,400,000	69,222,818.52	(1,732,647,147)	
マレーシアリングット合計					69,222,818.52	(1,732,647,147)
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-6.75%-14/05/05	24,100,000	26,717,380.50		
		SWEDISH GOVERNMENT-4.5%-15/08/12	16,980,000	18,807,693.24		
		SWEDISH GOVERNMENT-3.0%-16/07/12	15,300,000	16,456,511.70		
		SWEDISH GOVERNMENT-3.75%-17/08/12	14,700,000	16,574,191.20		
		SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	22,400,000	26,609,049.60		
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	20,300,000	25,938,731.00		
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	18,000,000	21,344,328.00		
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	12,400,000	16,002,795.20		

	国債証券小計		144,180,000	168,450,680.44 (1,908,546,209)	
スウェーデンクローナ合計				168,450,680.44 (1,908,546,209)	
ノルウェーク ローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-5.0%-15/05/15	17,000,000	18,714,297.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.25%-17/05/19	15,200,000	17,053,123.20	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	11,100,000	13,045,796.70	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	9,550,000	10,969,989.50	
	国債証券小計		52,850,000	59,783,206.40 (798,703,637)	

[次へ](#)

ノルウェークローネ合計				59,783,206.40 (798,703,637)	
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-5.0%-13/11/15	23,500,000	25,166,596.50	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-15/11/15	34,000,000	38,338,944.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-17/11/15	23,600,000	27,759,334.80	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	37,700,000	45,747,404.30	
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	15,550,000	24,759,036.55	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	33,250,000	49,644,245.00	
	国債証券小計	167,600,000	211,415,561.15 (2,854,110,075)		
デンマーククローネ合計				211,415,561.15 (2,854,110,075)	
メキシコペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-13/12/19	66,500,000	69,807,557.71	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-9.5%-14/12/18	55,500,000	61,833,500.16	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-15/12/17	40,900,000	45,170,813.58	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%-16/12/15	41,200,000	45,138,242.90	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-17/12/14	19,800,000	22,433,595.62	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	54,200,000	62,631,792.64	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	52,500,000	70,728,847.87	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	63,000,000	74,366,656.56	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	20,900,000	27,814,411.37	
	MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	29,400,000	33,968,862.01		
国債証券小計	443,900,000	513,894,280.42 (2,934,336,341)			
メキシコペソ合計				513,894,280.42 (2,934,336,341)	
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-13/10/24	14,400,000	14,446,080.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-14/04/25	11,700,000	11,910,015.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-15/04/25	8,000,000	8,158,800.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.25%-15/10/24	10,700,000	11,184,710.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-16/04/25	7,400,000	7,442,550.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	12,200,000	12,387,880.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	8,000,000	8,195,200.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	10,100,000	10,146,965.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	3,200,000	3,311,040.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	7,900,000	8,175,315.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	2,100,000	2,148,762.00	
	国債証券小計	95,700,000	97,507,317.00 (2,283,621,364)		
ポーランドズロチ合計				97,507,317.00 (2,283,621,364)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.25%-13/09/28	3,300,000	3,444,774.63	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-14/03/28	4,600,000	4,841,905.26	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-14/09/28	4,900,000	5,238,309.72	
		BELGIUM KINGDOM-3.5%-15/03/28	1,150,000	1,214,082.71	
		BELGIUM KINGDOM-8.0%-15/03/28	3,300,000	3,888,782.70	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-15/09/28	5,200,000	5,562,779.56	
		BELGIUM KINGDOM-2.75%-16/03/28	1,500,000	1,553,912.85	
		BELGIUM KINGDOM-3.25%-16/09/28	2,840,000	2,993,022.04	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-17/03/28	6,000,000	6,502,111.20	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-17/09/28	3,600,000	4,157,573.04	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-18/03/28	4,100,000	4,440,095.41	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	3,150,000	3,401,945.50	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	6,000,000	6,324,709.80	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	4,800,000	5,214,792.96	

BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	3,500,000	3,733,496.55	
BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,500,000	1,623,351.30	
BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	1,900,000	2,104,183.50	
BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	6,650,000	8,151,351.88	
BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	4,900,000	5,816,763.05	
BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	3,450,000	3,728,347.03	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-13/07/30	6,200,000	6,169,401.76	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.5%-13/10/31	1,000,000	970,277.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.25%-14/01/31	9,200,000	9,099,914.12	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.75%-14/07/30	7,800,000	7,727,180.76	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.3%-14/10/31	5,000,000	4,783,109.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%-15/01/31	7,300,000	7,124,192.64	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.0%-15/04/30	1,300,000	1,213,447.69	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%-15/07/30	5,200,000	4,948,723.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%-16/01/31	10,300,000	9,386,125.29	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.25%-16/10/31	5,700,000	5,282,331.36	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%-17/01/31	6,150,000	5,553,402.03	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-17/07/30	3,750,000	3,610,434.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%-18/07/30	3,700,000	3,257,617.64	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%-19/07/30	6,300,000	5,590,471.95	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%-19/10/31	7,100,000	6,148,188.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%-20/04/30	5,200,000	4,366,395.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%-20/10/31	9,300,000	8,164,822.47	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-21/04/30	4,200,000	3,828,290.76	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%-24/01/31	7,300,000	6,010,813.43	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%-25/07/30	4,100,000	3,247,300.45	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%-26/07/30	2,200,000	1,952,337.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31	4,350,000	3,843,224.56	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%-32/07/30	4,500,000	3,809,963.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	4,400,000	2,936,799.36	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%-40/07/30	4,500,000	3,280,909.05	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	3,100,000	2,197,246.52	
BUNDES OBLIGATION-4.0%-13/10/11	9,800,000	10,307,220.56	
BUNDES OBLIGATION-2.25%-14/04/11	6,700,000	6,963,744.16	
BUNDES OBLIGATION-2.5%-14/10/10	1,500,000	1,582,901.85	
BUNDES OBLIGATION-2.5%-15/02/27	5,000,000	5,314,689.00	
BUNDES OBLIGATION-2.25%-15/04/10	4,500,000	4,761,258.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-13/07/04	9,500,000	9,866,360.85	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-14/01/04	17,800,000	18,956,862.94	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-14/07/04	11,500,000	12,475,887.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-15/01/04	7,400,000	8,079,715.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-15/07/04	8,600,000	9,395,088.92	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%-16/01/04	20,200,000	22,492,998.96	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.0%-16/06/20	8,900,000	10,839,666.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-16/07/04	7,160,000	8,199,662.78	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-17/01/04	6,500,000	7,452,590.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-17/07/04	8,750,000	10,334,008.12	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-18/01/04	3,400,000	4,009,532.28	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-18/07/04	8,900,000	10,706,048.52	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-19/01/04	1,900,000	2,242,366.51	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%-19/07/04	9,600,000	11,223,606.72	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-20/01/04	6,400,000	7,398,983.04	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%-20/07/04	12,400,000	14,136,784.92	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-21/07/04	13,800,000	16,060,731.18	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	8,600,000	12,699,337.06	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%-27/07/04	7,600,000	11,974,746.96	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	2,200,000	3,223,453.42	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-28/07/04	1,780,000	2,410,154.88	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-30/01/04	4,650,000	7,404,845.53	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	5,750,000	8,618,684.77	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-34/07/04	7,000,000	10,076,609.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04	7,300,000	9,765,167.66	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-39/07/04	3,800,000	5,371,905.72	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-40/07/04	4,900,000	7,484,911.21	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-42/07/04	5,100,000	6,266,166.51	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-13/08/01	13,850,000	13,849,271.49	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-13/12/15	7,500,000	7,423,863.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-14/06/01	5,500,000	5,373,914.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-14/08/01	18,400,000	18,171,188.64	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-15/02/01	16,000,000	15,696,579.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%-15/04/15	1,700,000	1,603,585.52	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%-15/06/15	1,600,000	1,504,467.52	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-15/08/01	20,200,000	19,351,084.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-16/08/01	20,200,000	18,983,624.68	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-17/02/01	8,600,000	8,076,151.64	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-17/08/01	11,500,000	11,254,389.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-18/02/01	4,200,000	3,946,907.58	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-18/08/01	9,900,000	9,215,169.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-19/02/01	6,300,000	5,745,157.11	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-19/03/01	5,000,000	4,602,850.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-19/09/01	9,390,000	8,479,508.97	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-20/02/01	9,700,000	8,849,017.06	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-20/03/01	3,300,000	2,955,559.53	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-20/09/01	9,650,000	8,480,338.94	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-21/08/01	18,000,000	15,306,987.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-21/09/01	6,900,000	6,335,455.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-22/03/01	2,400,000	2,232,959.52	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-23/08/01	7,500,000	6,719,253.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%-23/11/01	8,210,000	9,856,666.56	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-25/03/01	4,300,000	3,827,448.49	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-26/11/01	7,000,000	7,490,751.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	10,600,000	10,507,597.68	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	8,700,000	7,728,611.94	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01	5,700,000	5,400,242.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%-33/02/01	6,700,000	6,148,377.61	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	8,500,000	7,095,941.95	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	5,400,000	3,966,175.26	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-39/08/01	7,500,000	6,165,275.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	3,200,000	2,620,376.00	
FINNISH GOVERNMENT-5.375%-13/07/04	2,150,000	2,266,541.18	
FINNISH GOVERNMENT-3.125%-14/09/15	2,050,000	2,180,328.75	
FINNISH GOVERNMENT-4.25%-15/07/04	2,550,000	2,835,931.75	
FINNISH GOVERNMENT-1.75%-16/04/15	1,180,000	1,228,441.47	
FINNISH GOVERNMENT-3.875%-17/09/15	2,400,000	2,735,595.60	
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	2,600,000	3,090,372.74	
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	2,550,000	2,863,931.77	
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	1,200,000	1,361,476.56	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	3,490,000	4,170,065.58	

FRANCE (GOVT OF) -4.0%-13/10/25	12,200,000	12,798,041.56	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-14/04/25	13,600,000	14,485,705.44	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-14/10/25	11,900,000	12,846,729.49	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-15/04/25	18,550,000	19,979,375.81	
FRANCE (GOVT OF) -3.0%-15/10/25	14,460,000	15,425,764.60	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-16/04/25	16,900,000	18,219,251.18	
FRANCE (GOVT OF) -5.0%-16/10/25	14,600,000	16,852,817.96	
FRANCE (GOVT OF) -3.75%-17/04/25	10,000,000	11,032,652.00	
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-17/10/25	10,600,000	11,984,464.94	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-18/04/25	4,900,000	5,490,025.17	
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-18/10/25	7,800,000	8,863,055.76	
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-19/04/25	9,800,000	11,141,543.56	
FRANCE (GOVT OF) -8.5%-19/10/25	6,550,000	9,347,124.44	
FRANCE (GOVT OF) -3.75%-19/10/25	5,600,000	6,179,984.72	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-20/04/25	6,400,000	6,935,664.00	
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-20/10/25	2,300,000	2,311,627.88	
FRANCE (GOVT OF) -3.75%-21/04/25	17,000,000	18,656,031.20	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-21/10/25	5,500,000	5,795,625.55	
FRANCE (GOVT OF) -3.0%-22/04/25	2,300,000	2,361,290.40	
FRANCE (GOVT OF) -8.5%-23/04/25	9,000,000	13,784,521.50	
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-23/10/25	8,000,000	9,077,870.40	
FRANCE (GOVT OF) -6.0%-25/10/25	9,800,000	12,912,531.94	
FRANCE (GOVT OF) -5.5%-29/04/25	1,370,000	1,752,791.83	
FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	9,900,000	13,279,340.25	
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	4,800,000	5,773,718.40	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	3,250,000	3,540,043.00	
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	8,100,000	9,557,087.94	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	6,600,000	7,210,616.16	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	3,600,000	3,936,326.40	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-26/04/25	5,400,000	5,618,183.22	
FRENCH TREASURY NOTE-4.5%-13/07/12	4,800,000	5,013,276.96	
FRENCH TREASURY NOTE-2.5%-14/01/12	3,610,000	3,728,421.35	
FRENCH TREASURY NOTE-3.0%-14/07/12	3,700,000	3,888,596.03	
FRENCH TREASURY NOTE-2.5%-15/01/15	1,200,000	1,255,589.16	
FRENCH TREASURY NOTE-2.0%-15/07/12	1,600,000	1,655,114.72	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.25%-13/07/15	8,150,000	8,512,827.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-14/07/15	6,650,000	7,117,975.13	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-15/01/15	5,750,000	6,081,277.05	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-15/07/15	3,820,000	4,125,092.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-16/07/15	7,800,000	8,753,901.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.5%-17/07/15	4,800,000	5,569,410.72	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	4,200,000	4,814,139.96	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	5,700,000	6,594,112.26	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	7,700,000	8,704,057.67	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	1,500,000	1,669,452.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	2,900,000	3,354,245.27	
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	4,700,000	7,114,900.89	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	4,600,000	6,451,057.48	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	4,250,000	5,438,830.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	3,950,000	5,020,639.99	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-13/10/20	3,100,000	3,241,209.96	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-14/07/15	3,600,000	3,877,161.84	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-14/10/20	3,300,000	3,514,593.39	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-15/07/15	3,950,000	4,268,076.51	

	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.0%-16/09/15	5,000,000	5,574,802.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.2%-17/02/20	2,200,000	2,380,576.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-17/09/15	1,550,000	1,763,440.11	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	4,300,000	4,977,795.24	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	4,000,000	4,607,460.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	5,080,000	5,734,039.84	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	4,100,000	4,522,468.51	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	3,400,000	3,780,265.86	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	2,950,000	3,658,314.17	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	1,650,000	2,339,614.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	3,900,000	4,630,654.86	
	国債証券小計	1,181,890,000	1,265,116,541.76 (126,903,840,303)	
ユーロ合計			1,265,116,541.76 (126,903,840,303)	
合計			322,085,862,546 (322,085,862,546)	

(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 106銘柄	100.0%	43.5%
加ドル	国債証券 21銘柄	100.0%	3.0%
豪ドル	国債証券 14銘柄	100.0%	1.5%
英ポンド	国債証券 32銘柄	100.0%	8.0%
スイスフラン	国債証券 5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%
マレーシアリングギット	国債証券 16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 4銘柄	100.0%	0.2%
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 187銘柄	100.0%	39.4%

### 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。

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12月15日現在	平成24年 6月15日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		55,423,498	86,577,361
株式		24,351,426,960	23,469,601,460
派生商品評価勘定			10,939,209
未収入金		80,331,035	
未収配当金		3,490,900	247,270,437
未収利息		102	157
前払金		329,000	
流動資産合計		24,491,001,495	23,814,388,624
資産合計		24,491,001,495	23,814,388,624
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,841,332	
前受金			11,925,000
未払解約金		40,148,619	5,497,035
流動負債合計		41,989,951	17,422,035
負債合計		41,989,951	17,422,035
純資産の部			
元本等			
元本		43,362,058,829	41,590,335,629
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		18,913,047,285	17,793,369,040
元本等合計		24,449,011,544	23,796,966,589
純資産合計		24,449,011,544	23,796,966,589
負債純資産合計		24,491,001,495	23,814,388,624

## (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>

## (貸借対照表に関する注記)

		平成23年12月15日現在	平成24年 6月15日現在
1.	期首	平成23年 6月16日	平成23年12月16日
	期首元本額	45,027,017,801円	43,362,058,829円
	期首からの追加設定元本額	1,750,857,500円	2,078,962,859円
	期首からの一部解約元本額	3,415,816,472円	3,850,686,059円
	元本の内訳		
	D C インデックスバランス（株式20）	216,204,285円	227,716,907円
	D C インデックスバランス（株式40）	747,371,185円	804,651,422円
	D C インデックスバランス（株式60）	1,395,199,400円	1,468,690,202円
	D C インデックスバランス（株式80）	1,509,813,404円	1,592,642,569円
	インデックスファンド日本株式（D C 専用）	881,676,744円	956,542,768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	15,411,643,629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	18,030,638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	119,575,290円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	192,255,971円	196,328,640円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	176,957,741円	171,110,573円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	283,710,194円	275,509,809円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	368,386,630円	350,477,159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	15,159,942,349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	97,423,717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	121,968,482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	44,013,426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	79,264,857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	439,027,016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	1,135,754,908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	1,491,064,317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	1,428,956,951円
	計	43,362,058,829円	41,590,335,629円
2.	受益権の総数	43,362,058,829口	41,590,335,629口

3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	18,913,047,285円	17,793,369,040円
4.	担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。 株式	203,549,000円	211,784,000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

[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23年 6月16日 至 平成23年12月15日	自 平成23年12月16日 至 平成24年 6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12月15日現在	平成24年 6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

（平成24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	624,814,040
合計	624,814,040

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成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

(平成24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	315,000,000		326,025,000	11,025,000
合計		315,000,000		326,025,000	11,025,000

(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12月15日現在		平成24年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	0.5638円	1口当たり純資産額	0.5722円
(1万口当たり純資産額)	(5,638円)	(1万口当たり純資産額)	(5,722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	10,000	177.00	1,770,000	
1332	日本水産	30,700	202.00	6,201,400	
1334	マルハニチロホールディングス	52,000	114.00	5,928,000	
1377	サカタのタネ	3,900	1,069.00	4,169,100	
1379	ホクト	2,700	1,561.00	4,214,700	

1514	住石ホールディングス	8,300	75.00	622,500	
1515	日鉄鉱業	7,000	298.00	2,086,000	
1518	三井松島産業	17,000	125.00	2,125,000	
1605	国際石油開発帝石	322	430,000.00	138,460,000	
1606	日本海洋掘削	700	2,192.00	1,534,400	
1661	関東天然瓦斯開発	3,000	386.00	1,158,000	
1662	石油資源開発	3,800	2,939.00	11,168,200	
1414	ショーボンドホールディングス	2,400	2,159.00	5,181,600	
1417	ミライト・ホールディングス	7,500	519.00	3,892,500	
1712	ダイセキ環境ソリューション	3	128,600.00	385,800	
1719	間組	9,700	168.00	1,629,600	
1720	東急建設	9,520	152.00	1,447,040	
1721	コムシスホールディングス	12,900	876.00	11,300,400	
1722	ミサワホーム	2,600	1,048.00	2,724,800	
1762	高松コンストラクショングループ	2,000	1,120.00	2,240,000	
1766	東建コーポレーション	990	2,980.00	2,950,200	
1780	ヤマウラ	1,500	216.00	324,000	
1801	大成建設	134,000	199.00	26,666,000	
1802	大林組	80,000	325.00	26,000,000	
1803	清水建設	81,000	256.00	20,736,000	
1808	長谷工コーポレーション	166,500	52.00	8,658,000	
1810	松井建設	3,000	282.00	846,000	
1812	鹿島建設	125,000	205.00	25,625,000	
1813	不動テトラ	19,200	105.00	2,016,000	
1814	大末建設	11,000	43.00	473,000	
1815	鉄建建設	15,000	93.00	1,395,000	
1816	安藤建設	9,000	87.00	783,000	
1819	太平工業	5,000	340.00	1,700,000	
1820	西松建設	35,000	132.00	4,620,000	
1821	三井住友建設	17,500	51.00	892,500	
1822	大豊建設	7,000	84.00	588,000	
1824	前田建設工業	16,000	338.00	5,408,000	
1827	ナカノフドー建設	2,000	129.00	258,000	
1833	奥村組	25,000	246.00	6,150,000	
1834	大和小田急建設	1,500	181.00	271,500	
1835	東鉄工業	4,000	861.00	3,444,000	
1847	イチケン	3,000	165.00	495,000	
1852	浅沼組	8,000	51.00	408,000	
1860	戸田建設	28,000	220.00	6,160,000	
1861	熊谷組	19,000	75.00	1,425,000	
1865	青木あすなる建設	2,000	382.00	764,000	
1866	北野建設	6,000	175.00	1,050,000	
1867	植木組	4,000	151.00	604,000	
1868	三井ホーム	3,000	395.00	1,185,000	
1870	矢作建設工業	3,300	330.00	1,089,000	
1871	ピーエス三菱	1,800	348.00	626,400	
1878	大東建託	10,100	6,960.00	70,296,000	
1879	新日本建設	3,200	183.00	585,600	
1881	N I P P O	6,000	848.00	5,088,000	

1882	東亜道路工業	5,000	203.00	1,015,000	
1883	前田道路	8,000	920.00	7,360,000	
1884	日本道路	8,000	271.00	2,168,000	
1885	東亜建設工業	23,000	126.00	2,898,000	
1888	若築建設	15,000	75.00	1,125,000	
1890	東洋建設	42,000	65.00	2,730,000	
1893	五洋建設	34,000	174.00	5,916,000	
1896	大林道路	3,000	198.00	594,000	
1899	福田組	4,000	253.00	1,012,000	
1911	住友林業	18,200	666.00	12,121,200	
1914	日本基礎技術	3,100	284.00	880,400	
1916	日成ビルド工業	8,000	115.00	920,000	
1919	エス・バイ・エル	14,000	155.00	2,170,000	
1921	巴コーポレーション	3,400	272.00	924,800	
1924	パナホーム	10,000	456.00	4,560,000	
1925	大和ハウス工業	66,000	1,027.00	67,782,000	
1926	ライト工業	5,600	295.00	1,652,000	
1928	積水ハウス	74,000	674.00	49,876,000	
1929	日特建設	7,000	77.00	539,000	
1930	北陸電気工事	2,000	230.00	460,000	
1934	ユアテック	4,000	290.00	1,160,000	
1937	西部電気工業	2,000	321.00	642,000	
1939	四電工	2,000	307.00	614,000	
1941	中電工	3,900	779.00	3,038,100	
1942	関電工	12,000	360.00	4,320,000	
1944	きんでん	18,000	505.00	9,090,000	
1945	東京エネシス	3,000	369.00	1,107,000	
1946	トーエネック	4,000	425.00	1,700,000	
1949	住友電設	1,900	527.00	1,001,300	
1950	日本電設工業	5,000	724.00	3,620,000	
1951	協和エクシオ	8,600	748.00	6,432,800	
1952	新日本空調	2,100	420.00	882,000	
1956	日本電話施設	5,000	239.00	1,195,000	
1959	九電工	5,000	463.00	2,315,000	
1961	三機工業	6,000	370.00	2,220,000	
1963	日揮	25,000	2,212.00	55,300,000	
1964	中外炉工業	8,000	219.00	1,752,000	
1967	ヤマト	3,000	283.00	849,000	
1968	太平電業	3,000	501.00	1,503,000	
1969	高砂熱学工業	7,600	615.00	4,674,000	
1972	三晃金属工業	3,000	213.00	639,000	
1975	朝日工業社	3,000	294.00	882,000	
1979	大気社	4,100	1,517.00	6,219,700	
1980	ダイダン	3,000	493.00	1,479,000	
1982	日比谷総合設備	3,200	830.00	2,656,000	
1983	東芝プラントシステム	4,000	854.00	3,416,000	
6330	東洋エンジニアリング	14,000	324.00	4,536,000	
6366	千代田化工建設	21,000	1,016.00	21,336,000	
6379	新興プランテック	5,400	655.00	3,537,000	

2001	日本製粉	16,000	331.00	5,296,000	
2002	日清製粉グループ本社	24,000	872.00	20,928,000	
2003	日東富士製粉	2,000	284.00	568,000	
2004	昭和産業	11,000	244.00	2,684,000	
2009	鳥越製粉	2,300	597.00	1,373,100	
2052	協同飼料	10,000	83.00	830,000	
2053	中部飼料	2,400	498.00	1,195,200	
2056	日本配合飼料	9,000	95.00	855,000	
2107	東洋精糖	5,000	86.00	430,000	
2108	日本甜菜製糖	15,000	158.00	2,370,000	
2109	三井製糖	9,000	252.00	2,268,000	
2201	森永製菓	26,000	178.00	4,628,000	
2204	中村屋	6,000	355.00	2,130,000	
2206	江崎グリコ	10,000	852.00	8,520,000	
2207	名糖産業	1,200	1,010.00	1,212,000	
2211	不二家	15,000	183.00	2,745,000	
2212	山崎製パン	19,000	1,040.00	19,760,000	
2215	第一屋製パン	4,000	74.00	296,000	
2217	モロゾフ	4,000	269.00	1,076,000	
2220	亀田製菓	1,500	1,910.00	2,865,000	
2229	カルビー	1,900	4,705.00	8,939,500	
2264	森永乳業	23,000	282.00	6,486,000	
2267	ヤクルト本社	14,200	2,850.00	40,470,000	
2269	明治ホールディングス	7,800	3,380.00	26,364,000	
2270	雪印メグミルク	5,700	1,364.00	7,774,800	
2281	プリマハム	15,000	128.00	1,920,000	
2282	日本ハム	20,000	988.00	19,760,000	
2284	伊藤ハム	15,000	316.00	4,740,000	
2286	林兼産業	9,000	65.00	585,000	
2288	丸大食品	13,000	272.00	3,536,000	
2290	米久	2,300	799.00	1,837,700	
2292	S F o o d s	1,500	673.00	1,009,500	
2501	サッポロホールディングス	44,000	242.00	10,648,000	
2502	アサヒグループホールディングス	49,700	1,664.00	82,700,800	
2503	キリンホールディングス	106,000	910.00	96,460,000	
2531	宝ホールディングス	22,000	479.00	10,538,000	
2533	オエノンホールディングス	7,000	190.00	1,330,000	
2540	養命酒製造	2,000	692.00	1,384,000	
2572	三国コカ・コーラボトリング	2,700	702.00	1,895,400	
2579	コカ・コーラウエスト	9,000	1,316.00	11,844,000	
2580	コカ・コーラ セントラル ジャパン	3,000	1,063.00	3,189,000	
2590	ダイドードリンコ	1,200	3,305.00	3,966,000	
2593	伊藤園	7,400	1,445.00	10,693,000	
2594	キーコーヒー	2,300	1,450.00	3,335,000	
2597	ユニカフェ	800	377.00	301,600	
2599	ジャパンフーズ	400	819.00	327,600	
2602	日清オイリオグループ	10,000	304.00	3,040,000	
2607	不二製油	6,400	1,006.00	6,438,400	
2613	J - オイルミルズ	10,000	235.00	2,350,000	

2801	キッコーマン	22,000	951.00	20,922,000	
2802	味の素	70,000	1,101.00	77,070,000	
2809	キユーピー	13,400	1,100.00	14,740,000	
2810	ハウス食品	9,400	1,269.00	11,928,600	
2811	カゴメ	10,300	1,557.00	16,037,100	
2812	焼津水産化学工業	1,300	771.00	1,002,300	
2815	アリアケジャパン	2,400	1,629.00	3,909,600	
2871	ニチレイ	30,000	373.00	11,190,000	
2875	東洋水産	11,000	2,095.00	23,045,000	
2897	日清食品ホールディングス	10,400	2,922.00	30,388,800	
2899	永谷園	2,000	760.00	1,520,000	
2908	フジッコ	3,000	1,010.00	3,030,000	
2910	ロック・フィールド	1,400	1,450.00	2,030,000	
2914	日本たばこ産業	588	446,500.00	262,542,000	
2915	ケンコーマヨネーズ	800	610.00	488,000	
2918	わらべや日洋	1,500	1,292.00	1,938,000	
2922	なとり	1,300	835.00	1,085,500	
4404	ミヨシ油脂	9,000	94.00	846,000	
3001	片倉工業	3,100	680.00	2,108,000	
3002	ゲンゼ	19,000	205.00	3,895,000	
3101	東洋紡績	105,000	105.00	11,025,000	
3103	ユニチカ	56,000	40.00	2,240,000	
3104	富士紡ホールディングス	10,000	167.00	1,670,000	
3105	日清紡ホールディングス	16,000	571.00	9,136,000	
3106	倉敷紡績	25,000	136.00	3,400,000	
3109	シキボウ	16,000	92.00	1,472,000	
3201	日本毛織	8,000	566.00	4,528,000	
3202	大東紡織	4,000	59.00	236,000	
3204	トーア紡コーポレーション	12,000	51.00	612,000	
3205	ダイドーリミテッド	3,100	526.00	1,630,600	
3302	帝国繊維	2,000	575.00	1,150,000	
3401	帝人	102,000	241.00	24,582,000	
3402	東レ	180,000	521.00	93,780,000	
3408	サカイオーベックス	7,000	101.00	707,000	
3501	住江織物	6,000	139.00	834,000	
3512	日本フェルト	1,400	388.00	543,200	
3513	イチカワ	2,000	144.00	288,000	
3514	日本バイリーン	3,000	354.00	1,062,000	
3524	日東製網	3,000	134.00	402,000	
3526	芦森工業	6,000	95.00	570,000	
3529	アツギ	19,000	98.00	1,862,000	
3551	ダイニック	5,000	137.00	685,000	
3569	セーレン	6,200	560.00	3,472,000	
3577	東海染工	4,000	85.00	340,000	
3580	小松精練	4,000	357.00	1,428,000	
3591	ワコールホールディングス	15,000	894.00	13,410,000	
3593	ホギメディカル	1,500	3,265.00	4,897,500	
3606	レナウン	5,700	110.00	627,000	
3607	クラウディア	300	998.00	299,400	

3608	T S Iホールディングス	11,100	383.00	4,251,300	
8011	三陽商会	12,000	243.00	2,916,000	
8013	ナイガイ	8,000	49.00	392,000	
8016	オンワードホールディングス	15,000	596.00	8,940,000	
8029	ルック	4,000	359.00	1,436,000	
8111	ゴールドウイン	6,000	460.00	2,760,000	
8114	デサント	6,000	440.00	2,640,000	
8127	ヤマトインターナショナル	1,400	369.00	516,600	
3708	特種東海製紙	16,000	170.00	2,720,000	
3861	王子製紙	109,000	270.00	29,430,000	
3864	三菱製紙	36,000	73.00	2,628,000	
3865	北越紀州製紙	15,500	380.00	5,890,000	
3877	中越パルプ工業	9,000	136.00	1,224,000	
3878	巴川製紙所	4,000	147.00	588,000	
3880	大王製紙	11,000	410.00	4,510,000	
3893	日本製紙グループ本社	12,000	1,163.00	13,956,000	
3941	レンゴー	20,000	433.00	8,660,000	
3946	トーモク	8,000	202.00	1,616,000	
3950	ザ・バック	1,400	1,292.00	1,808,800	
3405	クラレ	39,300	1,009.00	39,653,700	
3407	旭化成	144,000	407.00	58,608,000	
3553	共和レザー	1,500	266.00	399,000	
4003	コープケミカル	4,000	96.00	384,000	
4004	昭和電工	154,000	155.00	23,870,000	
4005	住友化学	170,000	239.00	40,630,000	
4007	日本化成	5,000	112.00	560,000	
4008	住友精化	5,000	286.00	1,430,000	
4021	日産化学工業	18,900	710.00	13,419,000	
4022	ラサ工業	11,000	80.00	880,000	
4023	クレハ	16,000	322.00	5,152,000	
4027	テイカ	4,000	250.00	1,000,000	
4028	石原産業	42,000	67.00	2,814,000	
4031	片倉チッカリン	2,000	210.00	420,000	
4041	日本曹達	15,000	296.00	4,440,000	
4042	東ソー	66,000	208.00	13,728,000	
4043	トクヤマ	39,000	186.00	7,254,000	
4044	セントラル硝子	24,000	298.00	7,152,000	
4045	東亜合成	31,000	298.00	9,238,000	
4046	ダイソー	10,000	219.00	2,190,000	
4047	関東電化工業	6,000	247.00	1,482,000	
4061	電気化学工業	52,000	273.00	14,196,000	
4063	信越化学工業	44,400	4,220.00	187,368,000	
4064	日本カーバイド工業	8,000	105.00	840,000	
4078	堺化学工業	8,000	261.00	2,088,000	
4088	エア・ウォーター	20,000	884.00	17,680,000	
4091	大陽日酸	33,000	445.00	14,685,000	
4092	日本化学工業	10,000	114.00	1,140,000	
4095	日本パーカライジング	6,000	1,105.00	6,630,000	
4097	高圧ガス工業	4,000	460.00	1,840,000	

4099	四国化成工業	3,000	443.00	1,329,000	
4100	戸田工業	3,000	372.00	1,116,000	
4109	ステラ ケミファ	1,200	1,271.00	1,525,200	
4112	保土谷化学工業	5,000	215.00	1,075,000	
4114	日本触媒	18,000	912.00	16,416,000	
4116	大日精化工業	9,000	320.00	2,880,000	
4118	カネカ	31,000	419.00	12,989,000	
4182	三菱瓦斯化学	43,000	467.00	20,081,000	
4183	三井化学	105,000	193.00	20,265,000	
4185	J S R	22,600	1,319.00	29,809,400	
4186	東京応化工業	4,400	1,715.00	7,546,000	
4187	大阪有機化学工業	1,500	418.00	627,000	
4188	三菱ケミカルホールディングス	155,000	340.00	52,700,000	
4201	日本合成化学工業	5,000	484.00	2,420,000	
4202	ダイセル	32,000	463.00	14,816,000	
4203	住友ベークライト	21,000	374.00	7,854,000	
4204	積水化学工業	51,000	678.00	34,578,000	
4205	日本ゼオン	23,000	566.00	13,018,000	
4206	アイカ工業	6,400	1,123.00	7,187,200	
4208	宇部興産	104,000	169.00	17,576,000	
4212	積水樹脂	3,000	808.00	2,424,000	
4215	タキロン	6,000	250.00	1,500,000	
4216	旭有機材工業	9,000	186.00	1,674,000	
4217	日立化成工業	10,700	1,226.00	13,118,200	
4218	ニチバン	3,000	243.00	729,000	
4220	リケンテクノス	4,000	211.00	844,000	
4221	大倉工業	6,000	195.00	1,170,000	
4228	積水化成品工業	6,000	252.00	1,512,000	
4229	群栄化学工業	7,000	204.00	1,428,000	
4231	タイガースポリマー	1,200	303.00	363,600	
4271	日本カーリット	2,000	383.00	766,000	
4272	日本化薬	18,000	695.00	12,510,000	
4362	日本精化	2,000	504.00	1,008,000	
4401	A D E K A	10,700	658.00	7,040,600	
4403	日油	19,000	387.00	7,353,000	
4410	ハリマ化成	2,100	395.00	829,500	
4452	花王	65,700	2,068.00	135,867,600	
4461	第一工業製薬	5,000	224.00	1,120,000	
4471	三洋化成工業	8,000	456.00	3,648,000	
4611	大日本塗料	14,000	83.00	1,162,000	
4612	日本ペイント	23,000	607.00	13,961,000	
4613	関西ペイント	28,000	804.00	22,512,000	
4614	トウペ	3,000	72.00	216,000	
4617	中国塗料	8,000	362.00	2,896,000	
4619	日本特殊塗料	2,000	288.00	576,000	
4620	藤倉化成	3,100	383.00	1,187,300	

[次へ](#)

4626	太陽ホールディングス	2,000	1,902.00	3,804,000	
4631	D I C	95,000	142.00	13,490,000	
4633	サカタインクス	5,000	358.00	1,790,000	
4634	東洋インキS Cホールディングス	22,000	276.00	6,072,000	
4901	富士フイルムホールディングス	52,900	1,439.00	76,123,100	
4911	資生堂	41,100	1,191.00	48,950,100	
4912	ライオン	29,000	427.00	12,383,000	
4914	高砂香料工業	8,000	376.00	3,008,000	
4917	マンダム	2,500	1,931.00	4,827,500	
4919	ミルボン	1,300	2,364.00	3,073,200	
4921	ファンケル	6,200	939.00	5,821,800	
4922	コーセー	4,000	1,747.00	6,988,000	
4924	ドクターシーラボ	17	266,800.00	4,535,600	
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	2,500	2,352.00	5,880,000	
4951	エステー	1,500	884.00	1,326,000	
4956	コニシ	1,800	1,070.00	1,926,000	
4958	長谷川香料	3,100	966.00	2,994,600	
4963	星光P M C	1,000	296.00	296,000	
4967	小林製薬	3,400	4,140.00	14,076,000	
4968	荒川化学工業	1,900	643.00	1,221,700	
4971	メック	1,800	238.00	428,400	
4973	日本高純度化学	7	178,500.00	1,249,500	
4975	荏原ユーザライト	400	2,179.00	871,600	
4985	アース製薬	1,800	2,868.00	5,162,400	
4989	イハラケミカル工業	4,000	325.00	1,300,000	
4992	北興化学工業	3,000	205.00	615,000	
4994	大成ラミック	700	2,346.00	1,642,200	
4996	クミアイ化学工業	6,000	311.00	1,866,000	
4997	日本農薬	6,000	348.00	2,088,000	
5142	アキレス	20,000	103.00	2,060,000	
5208	有沢製作所	4,200	230.00	966,000	
6988	日東電工	20,400	3,250.00	66,300,000	
7874	レック	800	978.00	782,400	
7908	きもと	2,000	405.00	810,000	
7917	藤森工業	1,800	1,374.00	2,473,200	
7925	前澤化成工業	1,700	786.00	1,336,200	
7942	J S P	1,600	1,083.00	1,732,800	
7947	エフピコ	1,100	4,765.00	5,241,500	
7958	天馬	2,000	829.00	1,658,000	
7970	信越ポリマー	4,900	360.00	1,764,000	
7971	東リ	7,000	139.00	973,000	
7988	ニフコ	5,500	1,852.00	10,186,000	
7995	日本パルカー工業	9,000	207.00	1,863,000	
8113	ユニ・チャーム	13,700	4,225.00	57,882,500	
4151	協和発酵キリン	34,000	787.00	26,758,000	
4502	武田薬品工業	92,800	3,340.00	309,952,000	代用有価証券10,000株
4503	アステラス製薬	55,000	3,175.00	174,625,000	
4506	大日本住友製薬	17,500	746.00	13,055,000	

4507	塩野義製薬	38,700	1,008.00	39,009,600	
4508	田辺三菱製薬	24,700	1,059.00	26,157,300	
4512	わかもと製薬	3,000	191.00	573,000	
4514	あすか製薬	3,000	465.00	1,395,000	
4516	日本新薬	5,000	897.00	4,485,000	
4519	中外製薬	28,800	1,413.00	40,694,400	
4521	科研製薬	10,000	1,041.00	10,410,000	
4523	エーザイ	30,500	3,275.00	99,887,500	
4527	ロート製薬	10,000	916.00	9,160,000	
4528	小野薬品工業	12,100	4,460.00	53,966,000	
4530	久光製薬	7,700	3,580.00	27,566,000	
4531	有機合成薬品工業	2,000	191.00	382,000	
4534	持田製薬	8,000	854.00	6,832,000	
4536	参天製薬	8,300	2,888.00	23,970,400	
4538	扶桑薬品工業	8,000	208.00	1,664,000	
4539	日本ケミファ	4,000	370.00	1,480,000	
4540	ツムラ	6,800	1,932.00	13,137,600	
4541	日医工	4,200	1,440.00	6,048,000	
4547	キッセイ薬品工業	4,600	1,318.00	6,062,800	
4548	生化学工業	4,700	767.00	3,604,900	
4549	栄研化学	1,900	1,047.00	1,989,300	
4550	日水製薬	1,000	745.00	745,000	
4551	鳥居薬品	1,700	1,550.00	2,635,000	
4553	東和薬品	1,300	4,215.00	5,479,500	
4555	沢井製薬	1,600	8,530.00	13,648,000	
4559	ゼリア新薬工業	4,000	1,256.00	5,024,000	
4568	第一三共	83,300	1,229.00	102,375,700	
4569	キョーリン製薬ホールディングス	6,000	1,590.00	9,540,000	
4574	大幸薬品	1,200	662.00	794,400	
4577	ダイト	700	984.00	688,800	
4578	大塚ホールディングス	49,100	2,375.00	116,612,500	
4581	大正製薬ホールディングス	6,000	6,050.00	36,300,000	
3315	日本コークス工業	20,500	100.00	2,050,000	
5002	昭和シェル石油	22,200	463.00	10,278,600	
5007	コスモ石油	68,000	189.00	12,852,000	
5011	ニチレキ	3,000	386.00	1,158,000	
5012	東燃ゼネラル石油	37,000	706.00	26,122,000	
5013	ユシロ化学工業	1,400	760.00	1,064,000	
5015	ビーピー・カストロール	900	330.00	297,000	
5017	AOCホールディングス	5,800	327.00	1,896,600	
5018	MORESCO	500	827.00	413,500	
5019	出光興産	2,900	6,550.00	18,995,000	
5020	JXホールディングス	274,800	375.00	103,050,000	
5101	横浜ゴム	30,000	542.00	16,260,000	
5105	東洋ゴム工業	19,000	238.00	4,522,000	
5108	ブリヂストン	77,600	1,691.00	131,221,600	
5110	住友ゴム工業	19,300	962.00	18,566,600	
5121	藤倉ゴム工業	1,600	265.00	424,000	
5122	オカモト	9,000	308.00	2,772,000	

5185	フコク	1,000	722.00	722,000	
5186	ニッタ	2,400	1,211.00	2,906,400	
5191	東海ゴム工業	4,600	802.00	3,689,200	
5192	三ツ星ベルト	7,000	360.00	2,520,000	
5195	バンドー化学	8,000	292.00	2,336,000	
3110	日東紡績	18,000	230.00	4,140,000	
5201	旭硝子	122,000	531.00	64,782,000	
5202	日本板硝子	107,000	78.00	8,346,000	
5204	石塚硝子	3,000	128.00	384,000	
5210	日本山村硝子	10,000	162.00	1,620,000	
5214	日本電気硝子	48,000	449.00	21,552,000	
5218	オハラ	900	772.00	694,800	
5232	住友大阪セメント	50,000	233.00	11,650,000	
5233	太平洋セメント	146,000	165.00	24,090,000	
5234	デイ・シイ	2,300	252.00	579,600	
5262	日本ヒューム	3,000	329.00	987,000	
5269	日本コンクリート工業	4,000	230.00	920,000	
5301	東海カーボン	21,000	337.00	7,077,000	
5302	日本カーボン	11,000	184.00	2,024,000	
5310	東洋炭素	1,200	2,301.00	2,761,200	
5331	ノリタケカンパニーリミテド	13,000	202.00	2,626,000	
5332	TOTO	38,000	539.00	20,482,000	
5333	日本碍子	32,000	820.00	26,240,000	
5334	日本特殊陶業	22,000	1,003.00	22,066,000	
5337	ダントーホールディングス	4,000	78.00	312,000	
5344	MARUWA	700	2,527.00	1,768,900	
5351	品川リフラクトリーズ	6,000	179.00	1,074,000	
5352	黒崎播磨	5,000	177.00	885,000	
5363	東京窯業	3,000	167.00	501,000	
5367	ニッカトー	900	466.00	419,400	
5384	フジインコーポレーテッド	2,200	1,133.00	2,492,600	
5391	エーアンドエーマテリアル	6,000	68.00	408,000	
5393	ニチアス	12,000	378.00	4,536,000	
7943	ニチハ	2,700	760.00	2,052,000	
5401	新日本製鐵	650,000	174.00	113,100,000	
5405	住友金属工業	459,000	125.00	57,375,000	
5406	神戸製鋼所	343,000	92.00	31,556,000	
5407	日新製鋼	88,000	102.00	8,976,000	
5408	中山製鋼所	13,000	49.00	637,000	
5410	合同製鐵	14,000	163.00	2,282,000	
5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	58,700	1,286.00	75,488,200	
5423	東京製鐵	12,600	452.00	5,695,200	
5440	共英製鋼	2,600	1,308.00	3,400,800	
5444	大和工業	5,600	2,153.00	12,056,800	
5445	東京鐵鋼	5,000	222.00	1,110,000	
5449	大阪製鐵	1,500	1,426.00	2,139,000	
5451	淀川製鋼所	18,000	278.00	5,004,000	
5453	東洋鋼鈑	6,000	281.00	1,686,000	
5457	住友鋼管	1,400	703.00	984,200	

5463	丸一鋼管	7,600	1,613.00	12,258,800	
5464	モリ工業	4,000	229.00	916,000	
5471	大同特殊鋼	42,000	452.00	18,984,000	
5476	日本高周波鋼業	10,000	84.00	840,000	
5479	日本金属工業	20,000	55.00	1,100,000	
5480	日本冶金工業	18,500	102.00	1,887,000	
5481	山陽特殊製鋼	12,000	324.00	3,888,000	
5482	愛知製鋼	13,000	295.00	3,835,000	
5486	日立金属	16,000	918.00	14,688,000	
5491	日本金属	6,000	123.00	738,000	
5541	大平洋金属	17,000	320.00	5,440,000	
5563	日本電工	9,000	284.00	2,556,000	
5602	栗本鐵工所	12,000	188.00	2,256,000	
5612	日本鑄鉄管	3,000	165.00	495,000	
5632	三菱製鋼	15,000	190.00	2,850,000	
5658	日亜鋼業	4,000	199.00	796,000	
5659	日本精線	2,000	367.00	734,000	
6319	シンニッタン	2,100	355.00	745,500	
7305	新家工業	6,000	105.00	630,000	
5701	日本軽金属	56,000	104.00	5,824,000	
5702	大紀アルミニウム工業所	4,000	218.00	872,000	
5706	三井金属鋳業	67,000	178.00	11,926,000	
5707	東邦亜鉛	14,000	292.00	4,088,000	
5711	三菱マテリアル	155,000	221.00	34,255,000	
5713	住友金属鋳山	64,000	894.00	57,216,000	
5714	DOWAホールディングス	29,000	472.00	13,688,000	
5715	古河機械金属	42,000	66.00	2,772,000	
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	2,400	2,474.00	5,937,600	
5727	東邦チタニウム	4,000	821.00	3,284,000	
5738	住友軽金属工業	60,000	81.00	4,860,000	
5741	古河スカイ	10,000	215.00	2,150,000	
5801	古河電気工業	78,000	176.00	13,728,000	
5802	住友電気工業	87,500	915.00	80,062,500	
5803	フジクラ	37,000	234.00	8,658,000	
5805	昭和電線ホールディングス	32,000	66.00	2,112,000	
5809	タツタ電線	5,000	485.00	2,425,000	
5812	日立電線	19,000	180.00	3,420,000	
5815	沖電線	3,000	133.00	399,000	
5819	カナレ電気	300	1,328.00	398,400	
5821	平河ヒューテック	400	682.00	272,800	
5851	リョービ	14,000	230.00	3,220,000	
5857	アサヒホールディングス	3,400	1,510.00	5,134,000	
3421	稲葉製作所	1,100	1,030.00	1,133,000	
3431	宮地エンジニアリンググループ	8,000	129.00	1,032,000	
3432	三協・立山ホールディングス	33,000	122.00	4,026,000	
3433	トーカロ	1,400	1,168.00	1,635,200	
3434	アルファC o	800	846.00	676,800	
3436	SUMCO	15,200	764.00	11,612,800	
3443	川田テクノロジーズ	600	1,022.00	613,200	

5901	東洋製罐	17,500	900.00	15,750,000	
5902	ホッカホールディングス	6,000	243.00	1,458,000	
5909	コロナ	1,100	966.00	1,062,600	
5911	横河ブリッジホールディングス	5,000	482.00	2,410,000	
5915	駒井ハルテック	5,000	219.00	1,095,000	
5923	高田機工	2,000	164.00	328,000	
5929	三和ホールディングス	25,000	309.00	7,725,000	
5930	文化シャッター	6,000	326.00	1,956,000	
5936	東洋シャッター	800	420.00	336,000	
5938	住生活グループ	32,200	1,532.00	49,330,400	
5942	日本ファイルコン	1,800	386.00	694,800	
5943	ノーリツ	4,800	1,427.00	6,849,600	
5946	長府製作所	2,400	1,782.00	4,276,800	
5947	リンナイ	4,000	5,070.00	20,280,000	
5951	ダイニチ工業	1,300	658.00	855,400	
5957	日東精工	3,000	218.00	654,000	
5958	三洋工業	3,000	144.00	432,000	
5959	岡部	4,900	450.00	2,205,000	
5974	中国工業	4,000	83.00	332,000	
5975	東プレ	4,700	666.00	3,130,200	
5976	高周波熱錬	3,300	618.00	2,039,400	
5981	東京製綱	16,000	133.00	2,128,000	
5988	パイオラックス	1,000	1,721.00	1,721,000	
5991	日本発條	17,900	856.00	15,322,400	
5992	中央発條	3,000	263.00	789,000	
5998	アドバネクス	5,000	73.00	365,000	
8155	三益半導体工業	2,100	673.00	1,413,300	
1978	アタカ大機	2,000	234.00	468,000	
5631	日本製鋼所	38,000	394.00	14,972,000	
5963	日立ツール	1,400	720.00	1,008,000	
6005	三浦工業	3,700	2,018.00	7,466,600	
6013	タクマ	8,000	349.00	2,792,000	
6101	ツガミ	7,000	507.00	3,549,000	
6103	オークマ	15,000	512.00	7,680,000	
6104	東芝機械	13,000	397.00	5,161,000	
6113	アマダ	35,000	442.00	15,470,000	
6118	アイダエンジニアリング	6,400	443.00	2,835,200	
6135	牧野フライス製作所	12,000	462.00	5,544,000	
6136	オーエスジー	10,900	1,117.00	12,175,300	
6138	ダイジェット工業	3,000	145.00	435,000	
6140	旭ダイヤモンド工業	6,100	849.00	5,178,900	
6141	森精機製作所	13,100	654.00	8,567,400	
6146	ディスコ	2,500	4,540.00	11,350,000	
6151	日東工器	1,400	1,565.00	2,191,000	
6203	豊和工業	13,000	66.00	858,000	
6205	大阪機工	10,000	99.00	990,000	
6210	東洋機械金属	1,900	192.00	364,800	
6217	津田駒工業	6,000	135.00	810,000	
6222	島精機製作所	3,200	1,232.00	3,942,400	

6247	日阪製作所	3,000	731.00	2,193,000	
6250	やまびこ	1,000	940.00	940,000	
6262	ペガサスミシン製造	2,400	161.00	386,400	
6268	ナプテスコ	10,300	1,779.00	18,323,700	
6269	三井海洋開発	2,000	1,386.00	2,772,000	
6272	レオン自動機	2,000	175.00	350,000	
6273	S M C	7,400	13,240.00	97,976,000	
6274	新川	2,000	400.00	800,000	
6277	ホソカワミクロン	4,000	393.00	1,572,000	
6278	ユニオンツール	1,400	1,185.00	1,659,000	
6282	オイレス工業	2,600	1,553.00	4,037,800	
6287	サトーホールディングス	2,600	1,154.00	3,000,400	
6291	日本エアーテック	800	335.00	268,000	
6293	日精樹脂工業	2,000	324.00	648,000	
6298	ワイエイシイ	1,000	579.00	579,000	
6301	小松製作所	115,500	1,885.00	217,717,500	
6302	住友重機械工業	63,000	319.00	20,097,000	
6305	日立建機	12,700	1,479.00	18,783,300	
6306	日工	4,000	284.00	1,136,000	
6309	巴工業	900	1,498.00	1,348,200	
6310	井関農機	25,000	171.00	4,275,000	
6315	T O W A	2,200	528.00	1,161,600	
6316	丸山製作所	6,000	147.00	882,000	
6317	北川鉄工所	11,000	121.00	1,331,000	
6326	クボタ	113,000	673.00	76,049,000	
6328	荏原実業	600	1,265.00	759,000	
6331	三菱化工機	8,000	124.00	992,000	
6332	月島機械	4,000	660.00	2,640,000	
6333	帝国電機製作所	800	1,524.00	1,219,200	
6339	新東工業	5,400	733.00	3,958,200	
6340	澁谷工業	1,500	850.00	1,275,000	
6345	アイチ コーポレーション	4,100	346.00	1,418,600	
6349	小森コーポレーション	7,100	502.00	3,564,200	
6351	鶴見製作所	2,000	590.00	1,180,000	
6355	住友精密工業	3,000	441.00	1,323,000	
6358	酒井重工業	5,000	255.00	1,275,000	
6361	荏原製作所	40,000	274.00	10,960,000	
6362	石井鐵工所	4,000	149.00	596,000	
6363	西島製作所	2,900	834.00	2,418,600	
6367	ダイキン工業	30,200	2,035.00	61,457,000	
6368	オルガノ	5,000	502.00	2,510,000	
6369	トーヨーカネツ	13,000	149.00	1,937,000	
6370	栗田工業	13,700	1,754.00	24,029,800	
6371	椿本チエイン	13,000	423.00	5,499,000	
6373	大同工業	5,000	140.00	700,000	
6375	日本コンベヤ	8,000	71.00	568,000	
6378	木村化工機	2,300	302.00	694,600	
6381	アネスト岩田	4,000	364.00	1,456,000	
6383	ダイフク	11,000	466.00	5,126,000	

6390	加藤製作所	6,000	381.00	2,286,000	
6393	油研工業	5,000	152.00	760,000	
6395	タダノ	11,000	568.00	6,248,000	
6406	フジテック	7,000	485.00	3,395,000	
6407	シーケーディ	6,600	545.00	3,597,000	
6409	キトー	10	61,900.00	619,000	
6412	平和	5,100	1,389.00	7,083,900	
6413	理想科学工業	1,700	1,324.00	2,250,800	
6417	SANKYO	7,200	3,815.00	27,468,000	
6418	日本金銭機械	2,200	645.00	1,419,000	
6419	マースエンジニアリング	1,300	1,661.00	2,159,300	
6420	福島工業	700	1,001.00	700,700	
6428	オーイズミ	900	214.00	192,600	
6430	ダイコク電機	1,100	1,483.00	1,631,300	
6436	アマノ	7,100	643.00	4,565,300	
6440	JUKI	15,000	117.00	1,755,000	
6444	サンデン	12,000	283.00	3,396,000	
6445	蛇の目ミシン工業	24,000	63.00	1,512,000	
6454	マックス	4,000	926.00	3,704,000	
6457	グローリー	7,000	1,512.00	10,584,000	
6459	大和冷機工業	3,000	384.00	1,152,000	
6460	セガサミーホールディングス	25,400	1,549.00	39,344,600	
6461	日本ピストンリング	9,000	148.00	1,332,000	
6462	リケン	8,000	304.00	2,432,000	
6463	T P R	2,600	1,239.00	3,221,400	
6465	ホシザキ電機	4,700	1,936.00	9,099,200	
6470	大豊工業	1,700	941.00	1,599,700	
6471	日本精工	53,000	492.00	26,076,000	
6472	NTN	55,000	243.00	13,365,000	
6473	ジェイテクト	22,600	798.00	18,034,800	
6474	不二越	24,000	321.00	7,704,000	
6480	日本トムソン	8,000	362.00	2,896,000	
6481	THK	15,800	1,530.00	24,174,000	
6482	ユースン精機	1,200	1,544.00	1,852,800	
6485	前澤給装工業	900	1,010.00	909,000	
6486	イーグル工業	3,000	674.00	2,022,000	
6489	前澤工業	1,800	205.00	369,000	
6490	日本ピラー工業	2,000	674.00	1,348,000	
6498	キッツ	9,800	321.00	3,145,800	
6581	日立工機	6,300	620.00	3,906,000	
6586	マキタ	15,400	2,752.00	42,380,800	
7004	日立造船	93,500	89.00	8,321,500	
7011	三菱重工業	396,000	318.00	125,928,000	
7013	I H I	162,000	160.00	25,920,000	
4062	イビデン	15,500	1,428.00	22,134,000	
4902	コニカミノルタホールディングス	62,500	595.00	37,187,500	
6448	ブラザー工業	30,600	871.00	26,652,600	
6479	ミネベア	35,000	335.00	11,725,000	
6501	日立製作所	545,000	466.00	253,970,000	

6502	東芝	498,000	293.00	145,914,000	
6503	三菱電機	237,000	613.00	145,281,000	
6504	富士電機	71,000	185.00	13,135,000	
6505	東洋電機製造	5,000	236.00	1,180,000	
6506	安川電機	28,000	587.00	16,436,000	
6507	シンフォニアテクノロジー	14,000	149.00	2,086,000	
6508	明電舎	23,000	277.00	6,371,000	
6513	オリジン電気	4,000	297.00	1,188,000	

[次へ](#)

6517	デンヨー	2,100	996.00	2,091,600	
6588	東芝テック	15,000	270.00	4,050,000	
6590	芝浦メカトロニクス	4,000	173.00	692,000	
6592	マブチモーター	3,200	3,035.00	9,712,000	
6594	日本電産	12,800	6,620.00	84,736,000	
6620	宮越ホールディングス	800	311.00	248,800	
6621	高岳製作所	9,000	160.00	1,440,000	
6622	ダイヘン	14,000	223.00	3,122,000	
6630	ヤーマン	200	1,182.00	236,400	
6632	JVCケンウッド	14,400	249.00	3,585,600	
6640	第一精工	800	1,407.00	1,125,600	
6641	日新電機	5,000	412.00	2,060,000	
6644	大崎電気工業	4,000	671.00	2,684,000	
6645	オムロン	26,300	1,610.00	42,343,000	
6651	日東工業	3,500	1,235.00	4,322,500	
6652	I D E C	3,100	681.00	2,111,100	
6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	46,000	347.00	15,962,000	
6675	サクサホールディングス	6,000	163.00	978,000	
6676	メルコホールディングス	1,300	1,638.00	2,129,400	
6678	テクノメディカ	2	315,500.00	631,000	
6701	日本電気	326,000	125.00	40,750,000	
6702	富士通	228,000	360.00	82,080,000	
6703	沖電気工業	91,000	113.00	10,283,000	
6704	岩崎通信機	11,000	69.00	759,000	
6706	電気興業	7,000	362.00	2,534,000	
6707	サンケン電気	12,000	313.00	3,756,000	
6715	ナカヨ通信機	2,000	290.00	580,000	
6718	アイホン	1,300	1,600.00	2,080,000	
6723	ルネサスエレクトロニクス	6,200	320.00	1,984,000	
6724	セイコーエプソン	16,200	797.00	12,911,400	
6727	ワコム	46	166,300.00	7,649,800	
6728	アルバック	4,800	618.00	2,966,400	
6730	アクセル	1,100	1,500.00	1,650,000	
6737	ナナオ	2,000	1,525.00	3,050,000	
6741	日本信号	5,500	498.00	2,739,000	
6742	京三製作所	5,000	305.00	1,525,000	
6744	能美防災	3,000	445.00	1,335,000	
6745	ホーチキ	2,000	412.00	824,000	
6751	日本無線	5,000	178.00	890,000	
6752	パナソニック	270,300	572.00	154,611,600	
6753	シャープ	114,000	412.00	46,968,000	
6754	アンリツ	12,000	810.00	9,720,000	
6755	富士通ゼネラル	6,000	576.00	3,456,000	
6756	日立国際電気	5,000	642.00	3,210,000	
6758	ソニー	147,600	1,029.00	151,880,400	
6762	T D K	12,400	3,645.00	45,198,000	
6763	帝国通信工業	6,000	126.00	756,000	
6767	ミツミ電機	8,400	575.00	4,830,000	
6768	タムラ製作所	8,000	196.00	1,568,000	

6770	アルプス電気	18,500	583.00	10,785,500	
6771	池上通信機	8,000	50.00	400,000	
6773	パイオニア	33,600	286.00	9,609,600	
6779	日本電波工業	1,800	928.00	1,670,400	
6788	日本トリム	300	1,868.00	560,400	
6789	ローランド ディー . ジー .	1,100	867.00	953,700	
6794	フォスター電機	2,300	1,195.00	2,748,500	
6796	クラリオン	15,000	165.00	2,475,000	
6798	S M K	8,000	258.00	2,064,000	
6800	ヨコオ	1,900	404.00	767,600	
6801	東光	11,000	219.00	2,409,000	
6803	ティアック	14,000	27.00	378,000	
6804	ホシデン	6,400	510.00	3,264,000	
6806	ヒロセ電機	4,100	7,470.00	30,627,000	
6807	日本航空電子工業	5,000	695.00	3,475,000	
6809	T O A	2,000	640.00	1,280,000	
6815	ユニデン	7,000	206.00	1,442,000	
6816	アルパイン	4,600	866.00	3,983,600	
6817	スミダコーポレーション	1,500	385.00	577,500	
6820	アイコム	1,300	1,965.00	2,554,500	
6823	リオン	500	532.00	266,000	
6839	船井電機	2,100	1,090.00	2,289,000	
6841	横河電機	25,600	766.00	19,609,600	
6844	新電元工業	8,000	250.00	2,000,000	
6845	アズビル	6,000	1,535.00	9,210,000	
6849	日本光電工業	4,700	2,190.00	10,293,000	
6850	チノー	4,000	200.00	800,000	
6853	共和電業	3,000	230.00	690,000	
6855	日本電子材料	1,000	365.00	365,000	
6856	堀場製作所	4,400	2,646.00	11,642,400	
6857	アドバンテスト	17,600	1,199.00	21,102,400	
6858	小野測器	3,000	308.00	924,000	
6859	エスベック	2,500	748.00	1,870,000	
6860	パナソニック電工 S U N X	2,000	349.00	698,000	
6861	キーエンス	5,800	18,580.00	107,764,000	
6866	日置電機	1,100	1,465.00	1,611,500	
6869	シスメックス	8,300	2,977.00	24,709,100	
6875	メガチップス	1,900	1,676.00	3,184,400	
6877	O B A R A G R O U P	1,700	945.00	1,606,500	
6883	日本電産コパル電子	2,400	434.00	1,041,600	
6885	ミヤチテクノス	1,100	555.00	610,500	
6900	東京電波	700	320.00	224,000	
6901	澤藤電機	2,000	214.00	428,000	
6905	コーセル	3,400	992.00	3,372,800	
6910	日立メディコ	2,000	1,079.00	2,158,000	
6911	新日本無線	2,000	163.00	326,000	
6914	オプテックス	1,600	945.00	1,512,000	
6915	千代田インテグレ	1,200	904.00	1,084,800	
6921	東光電気	2,000	301.00	602,000	

6923	スタンレー電気	15,900	1,087.00	17,283,300	
6924	岩崎電気	9,000	154.00	1,386,000	
6925	ウシオ電機	14,400	905.00	13,032,000	
6926	岡谷電機産業	1,300	287.00	373,100	
6927	ヘリオス テクノ ホールディング	2,200	151.00	332,200	
6929	日本セラミック	1,500	1,274.00	1,911,000	
6935	日本デジタル研究所	2,000	831.00	1,662,000	
6937	古河電池	2,000	421.00	842,000	
6938	双信電機	1,200	307.00	368,400	
6941	山一電機	2,500	152.00	380,000	
6947	函研	1,500	595.00	892,500	
6951	日本電子	9,000	180.00	1,620,000	
6952	カシオ計算機	22,500	475.00	10,687,500	
6954	ファナック	24,600	13,300.00	327,180,000	
6958	日本シイエムケイ	5,100	309.00	1,575,900	
6961	エンブラス	1,200	1,909.00	2,290,800	
6963	ローム	11,700	2,884.00	33,742,800	
6965	浜松ホトニクス	9,200	2,596.00	23,883,200	
6966	三井ハイテック	3,200	412.00	1,318,400	
6967	新光電気工業	8,000	630.00	5,040,000	
6971	京セラ	19,700	6,500.00	128,050,000	
6976	太陽誘電	10,700	809.00	8,656,300	
6981	村田製作所	24,800	4,270.00	105,896,000	
6985	ユースン	3,300	438.00	1,445,400	
6986	双葉電子工業	4,100	1,176.00	4,821,600	
6989	北陸電気工業	10,000	88.00	880,000	
6996	ニチコン	7,500	800.00	6,000,000	
6997	日本ケミコン	14,000	232.00	3,248,000	
6999	K O A	3,000	765.00	2,295,000	
7244	市光工業	6,000	128.00	768,000	
7276	小糸製作所	12,000	1,018.00	12,216,000	
7280	ミツバ	4,000	576.00	2,304,000	
7718	スター精密	3,800	780.00	2,964,000	
7735	大日本スクリーン製造	22,000	612.00	13,464,000	
7739	キャノン電子	2,100	1,649.00	3,462,900	
7751	キャノン	146,900	3,195.00	469,345,500	代用有価証券10,000株
7752	リコー	71,000	625.00	44,375,000	
7757	日本電産サンキョー	6,000	448.00	2,688,000	
7999	M U T O Hホールディングス	4,000	205.00	820,000	
8035	東京エレクトロン	19,900	3,725.00	74,127,500	
3116	トヨタ紡織	8,300	852.00	7,071,600	
5196	鬼怒川ゴム工業	6,000	475.00	2,850,000	
5949	ユニプレス	3,800	2,029.00	7,710,200	
6201	豊田自動織機	21,500	2,121.00	45,601,500	
6455	モリタホールディングス	4,000	538.00	2,152,000	
6584	三櫻工業	3,000	628.00	1,884,000	
6902	デンソー	58,400	2,435.00	142,204,000	
6995	東海理化電機製作所	5,500	1,267.00	6,968,500	

7003	三井造船	92,000	113.00	10,396,000	
7007	佐世保重工業	15,000	83.00	1,245,000	
7012	川崎重工業	172,000	205.00	35,260,000	
7102	日本車輛製造	9,000	252.00	2,268,000	
7105	日本輸送機	3,000	234.00	702,000	
7122	近畿車輛	4,000	248.00	992,000	
7201	日産自動車	300,900	740.00	222,666,000	
7202	いすゞ自動車	150,000	408.00	61,200,000	
7203	トヨタ自動車	306,700	2,996.00	918,873,200	代用有価証券35,000株
7205	日野自動車	34,000	534.00	18,156,000	
7211	三菱自動車工業	529,000	77.00	40,733,000	
7212	エフテック	800	1,156.00	924,800	
7220	武蔵精密工業	2,300	1,499.00	3,447,700	
7222	日産車体	7,000	798.00	5,586,000	
7224	新明和工業	11,000	355.00	3,905,000	
7226	極東開発工業	4,100	677.00	2,775,700	
7230	日信工業	4,300	1,014.00	4,360,200	
7231	トピー工業	18,000	216.00	3,888,000	
7236	ティラド	8,000	266.00	2,128,000	
7238	曙ブレーキ工業	12,000	374.00	4,488,000	
7239	タチエス	3,100	1,373.00	4,256,300	
7240	NOK	11,400	1,660.00	18,924,000	
7241	フタバ産業	6,800	363.00	2,468,400	
7242	カヤバ工業	16,000	312.00	4,992,000	
7243	シロキ工業	5,000	205.00	1,025,000	
7245	大同メタル工業	4,000	824.00	3,296,000	
7246	プレス工業	11,000	359.00	3,949,000	
7248	カルソニックカンセイ	14,000	434.00	6,076,000	
7250	太平洋工業	5,000	467.00	2,335,000	
7251	ケーヒン	4,900	1,140.00	5,586,000	
7256	河西工業	3,000	444.00	1,332,000	
7259	アイシン精機	19,500	2,460.00	47,970,000	
7260	富士機工	3,000	274.00	822,000	
7261	マツダ	318,000	100.00	31,800,000	
7262	ダイハツ工業	22,000	1,309.00	28,798,000	
7266	今仙電機製作所	1,700	1,080.00	1,836,000	
7267	本田技研工業	199,600	2,533.00	505,586,800	
7269	スズキ	49,400	1,617.00	79,879,800	
7270	富士重工業	75,000	596.00	44,700,000	
7272	ヤマハ発動機	38,600	757.00	29,220,200	
7274	ショーワ	5,000	632.00	3,160,000	
7277	T B K	2,000	422.00	844,000	
7278	エクセディ	3,200	1,604.00	5,132,800	
7282	豊田合成	6,700	1,636.00	10,961,200	
7283	愛三工業	2,500	648.00	1,620,000	
7294	ヨロズ	1,400	1,158.00	1,621,200	
7296	エフ・シー・シー	3,900	1,319.00	5,144,100	
7309	シマノ	8,900	4,885.00	43,476,500	

7312	タカタ	4,300	1,585.00	6,815,500	
7313	テイ・エス テック	5,000	1,365.00	6,825,000	
7728	日本電産トーンク	1,100	645.00	709,500	
4543	テルモ	16,700	2,889.00	48,246,300	
5187	クリエートメディック	700	805.00	563,500	
6376	日機装	8,000	804.00	6,432,000	
7701	島津製作所	28,000	654.00	18,312,000	
7702	JMS	4,000	241.00	964,000	
7714	モリテックス	600	254.00	152,400	
7715	長野計器	1,700	592.00	1,006,400	
7717	ブイ・テクノロジー	4	179,800.00	719,200	
7721	東京計器	8,000	124.00	992,000	
7723	愛知時計電機	3,000	288.00	864,000	
7729	東京精密	4,200	1,443.00	6,060,600	
7731	ニコン	41,200	2,313.00	95,295,600	
7732	トプコン	5,500	596.00	3,278,000	
7733	オリンパス	27,900	1,219.00	34,010,100	
7734	理研計器	1,900	490.00	931,000	
7740	タムロン	2,000	2,263.00	4,526,000	
7741	HOYA	57,500	1,710.00	98,325,000	
7744	ノーリツ鋼機	2,200	353.00	776,600	
7745	エー・アンド・デイ	2,400	277.00	664,800	
7756	日本電産コパル	1,800	737.00	1,326,600	
7762	シチズンホールディングス	28,400	460.00	13,064,000	
7769	リズム時計工業	11,000	121.00	1,331,000	
7775	大研医器	300	972.00	291,600	
7979	松風	1,200	845.00	1,014,000	
8050	セイコーホールディングス	14,000	237.00	3,318,000	
8086	ニプロ	12,300	447.00	5,498,100	
7817	パラマウントベッドホールディングス	2,000	2,304.00	4,608,000	
7819	SHO-BI	500	458.00	229,000	
7822	永大産業	3,000	320.00	960,000	
7825	ダンロップスポーツ	1,500	941.00	1,411,500	
7832	バンダイナムコホールディングス	24,500	998.00	24,451,000	
7838	共立印刷	2,900	250.00	725,000	
7840	フランスベッドホールディングス	16,000	167.00	2,672,000	
7846	パイロットコーポレーション	21	141,700.00	2,975,700	
7862	トッパン・フォームズ	5,100	626.00	3,192,600	
7864	フジシールインターナショナル	2,700	1,388.00	3,747,600	
7867	タカラトミー	7,800	501.00	3,907,800	
7868	廣済堂	2,100	290.00	609,000	
7885	タカノ	1,000	406.00	406,000	
7893	プロネクサス	2,600	494.00	1,284,400	
7897	ホクシン	1,800	270.00	486,000	
7898	ウッドワン	4,000	257.00	1,028,000	
7905	大建工業	10,000	214.00	2,140,000	
7911	凸版印刷	72,000	468.00	33,696,000	
7912	大日本印刷	72,000	578.00	41,616,000	
7913	図書印刷	4,000	127.00	508,000	

7914	共同印刷	8,000	183.00	1,464,000	
7915	日本写真印刷	4,000	749.00	2,996,000	
7916	光村印刷	3,000	247.00	741,000	
7921	宝印刷	1,400	551.00	771,400	
7936	アシックス	22,100	907.00	20,044,700	
7937	ツツミ	1,200	1,891.00	2,269,200	
7944	ローランド	2,500	616.00	1,540,000	
7949	小松ウオール工業	900	936.00	842,400	
7951	ヤマハ	17,500	732.00	12,810,000	
7952	河合楽器製作所	9,000	181.00	1,629,000	
7955	クリナップ	2,800	495.00	1,386,000	
7956	ビジョン	2,100	3,395.00	7,129,500	
7961	兼松日産農林	4,000	134.00	536,000	
7962	キングジム	1,900	636.00	1,208,400	
7966	リンテック	4,500	1,381.00	6,214,500	
7968	T A S A K I	600	274.00	164,400	
7972	イトーキ	5,000	379.00	1,895,000	
7974	任天堂	13,500	8,960.00	120,960,000	
7976	三菱鉛筆	2,000	1,290.00	2,580,000	
7981	タカラスタンダード	11,000	569.00	6,259,000	
7984	コクヨ	12,400	540.00	6,696,000	
7987	ナカバヤシ	5,000	168.00	840,000	
7994	岡村製作所	8,000	520.00	4,160,000	
8022	美津濃	12,000	396.00	4,752,000	
8170	アデランス	3,000	962.00	2,886,000	
9501	東京電力	189,200	161.00	30,461,200	
9502	中部電力	78,000	1,201.00	93,678,000	
9503	関西電力	96,600	1,042.00	100,657,200	
9504	中国電力	32,700	1,196.00	39,109,200	
9505	北陸電力	23,200	1,133.00	26,285,600	
9506	東北電力	59,100	768.00	45,388,800	
9507	四国電力	21,300	1,654.00	35,230,200	
9508	九州電力	52,300	913.00	47,749,900	
9509	北海道電力	22,200	921.00	20,446,200	
9511	沖縄電力	1,400	2,468.00	3,455,200	
9513	電源開発	14,700	1,941.00	28,532,700	
9531	東京瓦斯	285,000	372.00	106,020,000	
9532	大阪瓦斯	229,000	308.00	70,532,000	
9533	東邦瓦斯	60,000	461.00	27,660,000	
9534	北海道瓦斯	4,000	242.00	968,000	
9536	西部瓦斯	27,000	195.00	5,265,000	
9543	静岡瓦斯	6,000	483.00	2,898,000	
9001	東武鉄道	135,000	373.00	50,355,000	
9003	相鉄ホールディングス	38,000	251.00	9,538,000	
9005	東京急行電鉄	139,000	344.00	47,816,000	
9006	京浜急行電鉄	61,000	679.00	41,419,000	
9007	小田急電鉄	76,000	731.00	55,556,000	
9008	京王電鉄	66,000	535.00	35,310,000	
9009	京成電鉄	38,000	632.00	24,016,000	

9010	富士急行	6,000	449.00	2,694,000	
9020	東日本旅客鉄道	41,100	4,655.00	191,320,500	
9021	西日本旅客鉄道	20,600	3,070.00	63,242,000	
9022	東海旅客鉄道	205	621,000.00	127,305,000	
9031	西日本鉄道	31,000	330.00	10,230,000	
9037	ハマキョウレックス	700	2,555.00	1,788,500	
9039	サカイ引越センター	400	1,590.00	636,000	
9041	近畿日本鉄道	214,000	293.00	62,702,000	

[次へ](#)

9042	阪急阪神ホールディングス	159,000	378.00	60,102,000	
9044	南海電気鉄道	49,000	332.00	16,268,000	
9045	京阪電気鉄道	53,000	353.00	18,709,000	
9047	名糖運輸	1,000	567.00	567,000	
9048	名古屋鉄道	83,000	210.00	17,430,000	
9062	日本通運	94,000	303.00	28,482,000	
9064	ヤマトホールディングス	48,100	1,202.00	57,816,200	
9065	山九	28,000	268.00	7,504,000	
9067	丸運	1,300	185.00	240,500	
9068	丸全昭和運輸	8,000	232.00	1,856,000	
9069	センコー	9,000	342.00	3,078,000	
9070	トナミホールディングス	5,000	151.00	755,000	
9072	日本梱包運輸倉庫	7,100	900.00	6,390,000	
9074	日本石油輸送	3,000	187.00	561,000	
9075	福山通運	14,000	389.00	5,446,000	
9076	セイノーホールディングス	18,000	506.00	9,108,000	
9081	神奈川中央交通	3,000	418.00	1,254,000	
9086	日立物流	4,900	1,330.00	6,517,000	
9101	日本郵船	187,000	211.00	39,457,000	
9104	商船三井	124,000	283.00	35,092,000	
9107	川崎汽船	73,000	151.00	11,023,000	
9110	NSユニテッド海運	11,000	113.00	1,243,000	
9113	乾汽船	2,700	244.00	658,800	
9115	明治海運	2,200	282.00	620,400	
9119	飯野海運	11,500	347.00	3,990,500	
9130	共栄タンカー	2,000	194.00	388,000	
9132	第一中央汽船	16,000	89.00	1,424,000	
9202	全日本空輸	316,000	222.00	70,152,000	
9232	パスコ	2,000	220.00	440,000	
9066	日新	9,000	200.00	1,800,000	
9301	三菱倉庫	17,000	787.00	13,379,000	
9302	三井倉庫	11,000	276.00	3,036,000	
9303	住友倉庫	17,000	333.00	5,661,000	
9304	澁澤倉庫	6,000	225.00	1,350,000	
9306	東陽倉庫	4,000	177.00	708,000	
9310	日本トランスシティ	5,000	244.00	1,220,000	
9312	ケイヒン	5,000	93.00	465,000	
9324	安田倉庫	1,800	487.00	876,600	
9351	東洋埠頭	7,000	136.00	952,000	
9358	宇徳	1,600	233.00	372,800	
9364	上組	26,000	610.00	15,860,000	
9366	サンリツ	700	491.00	343,700	
9368	キムラユニティー	500	699.00	349,500	
9369	キューソー流通システム	700	856.00	599,200	
9370	郵船ロジスティクス	1,900	962.00	1,827,800	
9375	近鉄エクスプレス	2,100	2,456.00	5,157,600	
9380	東海運	1,500	212.00	318,000	
9381	エーアイテイー	200	1,151.00	230,200	
1973	NECネットエスアイ	2,200	1,173.00	2,580,600	

2317	システナ	25	58,900.00	1,472,500	
2327	新日鉄ソリューションズ	1,600	1,355.00	2,168,000	
2359	コア	900	645.00	580,500	
3371	ソフトクリエイト	300	1,106.00	331,800	
3620	デジタルハーツ	2	159,800.00	319,600	
3626	I Tホールディングス	7,100	883.00	6,269,300	
3627	ネオス	5	48,050.00	240,250	
3632	グリー	12,000	1,710.00	20,520,000	
3635	コーエーテクモホールディングス	4,600	644.00	2,962,400	
3636	三菱総合研究所	900	1,687.00	1,518,300	
3639	ボルテージ	400	826.00	330,400	
3659	ネクソン	15,900	1,394.00	22,164,600	
3715	ドワンゴ	12	100,800.00	1,209,600	
3724	ベリサーブ	2	123,900.00	247,800	
3730	マクロミル	2,300	829.00	1,906,700	
3738	ティーガイア	15	138,700.00	2,080,500	
3769	GMOペイメントゲートウェイ	4	277,500.00	1,110,000	
3770	ザッパラス	13	69,100.00	898,300	
3774	インターネットイニシアティブ	14	301,500.00	4,221,000	
3789	ソネットエンタテインメント	13	286,500.00	3,724,500	
3817	S R Aホールディングス	1,200	850.00	1,020,000	
3820	J B I Sホールディングス	1,500	308.00	462,000	
3834	朝日ネット	2,000	343.00	686,000	
4283	パナソニック電工インフォメーションシステムズ	600	1,905.00	1,143,000	
4295	フェイス	80	8,050.00	644,000	
4307	野村総合研究所	13,200	1,659.00	21,898,800	
4312	サイバネットシステム	20	20,930.00	418,600	
4326	インテージ	700	1,458.00	1,020,600	
4340	シンプレクス・ホールディングス	40	24,930.00	997,200	
4344	ソースネクスト	8	14,720.00	117,760	
4674	クレスコ	500	618.00	309,000	
4676	フジ・メディア・ホールディングス	243	125,700.00	30,545,100	
4684	オービック	730	14,700.00	10,731,000	
4687	ティーディーシーソフトウェアエンジニアリ	500	745.00	372,500	
4689	ヤフー	1,708	23,280.00	39,762,240	
4704	トレンドマイクロ	10,300	2,136.00	22,000,800	
4716	日本オラクル	4,700	2,965.00	13,935,500	
4719	アルファシステムズ	800	1,040.00	832,000	
4722	フューチャーアーキテクト	28	31,600.00	884,800	
4725	シーエーシー	1,600	621.00	993,600	
4726	ソフトバンク・テクノロジー	600	710.00	426,000	
4728	トーセ	600	515.00	309,000	
4733	オービックビジネスコンサルタント	600	3,890.00	2,334,000	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	2,800	3,430.00	9,604,000	
4743	アイティフォー	2,600	273.00	709,800	
4746	東計電算	400	1,014.00	405,600	
4762	エクスネット	2	116,000.00	232,000	

4768	大塚商会	1,800	6,290.00	11,322,000	
4776	サイボウズ	43	22,500.00	967,500	
4779	ソフトブレーン	37	7,030.00	260,110	
4799	アグレックス	700	725.00	507,500	
4812	電通国際情報サービス	1,400	600.00	840,000	
4825	ウェザーニューズ	600	2,331.00	1,398,600	
4826	C I J	2,300	325.00	747,500	
4839	WOWOW	7	171,000.00	1,197,000	
6791	日本コロムビア	25,000	25.00	625,000	
7518	ネットワンシステムズ	10,500	1,003.00	10,531,500	
7595	アルゴグラフィックス	800	1,052.00	841,600	
7860	エイバックス・グループ・ホールディングス	4,400	1,138.00	5,007,200	
8056	日本ユニシス	5,700	486.00	2,770,200	
8096	兼松エレクトロニクス	1,400	873.00	1,222,200	
9401	東京放送ホールディングス	14,000	881.00	12,334,000	
9404	日本テレビ放送網	2,050	10,860.00	22,263,000	
9409	テレビ朝日	59	109,800.00	6,478,200	
9412	スカパーJ S A Tホールディングス	176	31,400.00	5,526,400	
9413	テレビ東京ホールディングス	1,500	888.00	1,332,000	
9422	アイ・ティー・シーネットワーク	2,100	570.00	1,197,000	
9427	イー・アクセス	180	15,670.00	2,820,600	
9430	N E C モバイルリング	900	3,140.00	2,826,000	
9432	日本電信電話	107,500	3,380.00	363,350,000	代用有価証券12,300株
9433	K D D I	362	491,000.00	177,742,000	
9435	光通信	2,100	3,370.00	7,077,000	
9437	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	1,923	124,900.00	240,182,700	
9449	G M O インターネット	6,900	352.00	2,428,800	
9470	学研ホールディングス	7,000	151.00	1,057,000	
9474	ゼンリン	3,400	770.00	2,618,000	
9475	昭文社	1,300	524.00	681,200	
9477	角川グループホールディングス	2,200	1,942.00	4,272,400	
9479	インプレスホールディングス	2,100	116.00	243,600	
9600	アイネット	1,000	490.00	490,000	
9601	松竹	15,000	743.00	11,145,000	
9602	東宝	16,600	1,247.00	20,700,200	
9605	東映	10,000	345.00	3,450,000	
9607	葵プロモーション	1,000	502.00	502,000	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	144	222,600.00	32,054,400	
9682	D T S	2,400	926.00	2,222,400	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,600	1,226.00	9,317,600	
9692	シーイーシー	1,400	406.00	568,400	
9697	カプコン	4,500	1,582.00	7,119,000	
9717	ジャステック	1,500	460.00	690,000	
9719	S C S K	4,800	1,028.00	4,934,400	
9739	日本システムウエア	800	299.00	239,200	
9742	アイネス	2,800	507.00	1,419,600	
9746	T K C	2,200	1,554.00	3,418,800	

9749	富士ソフト	3,100	1,181.00	3,661,100	
9759	N S D	4,300	651.00	2,799,300	
9766	コナミ	10,500	1,737.00	18,238,500	
9790	福井コンピュータ	400	407.00	162,800	
9889	J B C Cホールディングス	1,800	530.00	954,000	
9984	ソフトバンク	105,800	2,574.00	272,329,200	
1352	ハウスイ	2,000	100.00	200,000	
2657	インターニックス	900	336.00	302,400	
2676	高千穂交易	1,000	822.00	822,000	
2692	伊藤忠食品	600	2,874.00	1,724,400	
2715	エレマテック	1,500	983.00	1,474,500	
2729	J A L U X	700	802.00	561,400	
2733	あらた	5,000	380.00	1,900,000	
2737	トーメンデバイス	300	1,980.00	594,000	
2760	東京エレクトロン デバイス	5	137,800.00	689,000	
2768	双日	156,500	123.00	19,249,500	
2784	アルフレッサ ホールディングス	6,100	3,850.00	23,485,000	
2874	横浜冷凍	5,700	564.00	3,214,800	
3004	神栄	3,000	115.00	345,000	
3022	山下医科器械	200	967.00	193,400	
3023	ラサ商事	1,000	399.00	399,000	
3036	アルコニックス	600	1,423.00	853,800	
3076	あい ホールディングス	3,700	396.00	1,465,200	
3107	ダイワボウホールディングス	23,000	148.00	3,404,000	
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	4,400	656.00	2,886,400	
3153	八洲電機	1,600	331.00	529,600	
3156	U K Cホールディングス	1,400	976.00	1,366,400	
3167	T O K A Iホールディングス	11,300	321.00	3,627,300	
3321	ミタチ産業	600	387.00	232,200	
3360	シップヘルスケアホールディングス	3,000	1,693.00	5,079,000	
5009	富士興産	9,000	59.00	531,000	
6973	協栄産業	3,000	139.00	417,000	
7414	小野建	2,000	635.00	1,270,000	
7420	佐鳥電機	1,700	396.00	673,200	
7427	エコートレーディング	600	694.00	416,400	
7433	伯東	1,400	774.00	1,083,600	
7438	コンドーテック	1,600	469.00	750,400	
7442	中山福	1,400	620.00	868,000	
7447	ナガイレーベン	3,000	1,135.00	3,405,000	
7451	三菱食品	2,100	1,797.00	3,773,700	
7456	松田産業	1,700	1,140.00	1,938,000	
7459	メディパルホールディングス	25,100	1,007.00	25,275,700	
7463	アドヴァン	1,400	790.00	1,106,000	
7466	S P K	500	1,341.00	670,500	
7476	アズワン	1,500	1,520.00	2,280,000	
7480	スズデン	800	468.00	374,400	
7482	シモジマ	1,400	907.00	1,269,800	
7483	ドウシシャ	1,100	2,001.00	2,201,100	

7504	高速	1,400	642.00	898,800	
7517	黒田電気	2,800	848.00	2,374,400	
7537	丸文	1,800	326.00	586,800	
7552	ハピネット	1,200	774.00	928,800	
7558	トーマンエレクトロニクス	1,000	1,120.00	1,120,000	
7591	エクセル	1,100	720.00	792,000	
7594	マルカキカイ	800	908.00	726,400	
7599	ガリバーインターナショナル	710	2,444.00	1,735,240	
7600	日本エム・ディ・エム	2,000	229.00	458,000	
7607	進和	1,400	878.00	1,229,200	
7608	エスケイジャパン	700	248.00	173,600	
7609	ダイトエレクトロン	1,100	341.00	375,100	
7613	シークス	1,500	936.00	1,404,000	
7619	田中商事	700	460.00	322,000	
7628	オーハシテクニカ	1,300	568.00	738,400	
7631	マクニカ	1,200	1,660.00	1,992,000	
7637	白銅	700	696.00	487,200	
8001	伊藤忠商事	186,200	798.00	148,587,600	
8002	丸紅	204,000	492.00	100,368,000	
8007	高島	4,000	321.00	1,284,000	
8008	F & A アクアホールディングス	1,800	936.00	1,684,800	
8012	長瀬産業	13,200	896.00	11,827,200	
8014	蝶理	15,000	98.00	1,470,000	
8015	豊田通商	26,000	1,430.00	37,180,000	
8018	三共生興	3,900	257.00	1,002,300	
8020	兼松	50,000	82.00	4,100,000	
8025	ツカモトコーポレーション	5,000	119.00	595,000	
8031	三井物産	201,500	1,121.00	225,881,500	
8032	日本紙パルプ商事	12,000	257.00	3,084,000	
8036	日立ハイテクノロジーズ	7,100	1,891.00	13,426,100	
8037	カメイ	3,000	707.00	2,121,000	
8038	東都水産	4,000	122.00	488,000	
8043	スターゼン	8,000	223.00	1,784,000	
8051	山善	8,900	617.00	5,491,300	
8052	椿本興業	3,000	223.00	669,000	
8053	住友商事	137,700	1,059.00	145,824,300	
8057	内田洋行	5,000	233.00	1,165,000	
8058	三菱商事	170,000	1,506.00	256,020,000	
8059	第一実業	5,000	362.00	1,810,000	
8060	キヤノンマーケティングジャパン	7,800	960.00	7,488,000	
8061	西華産業	8,000	229.00	1,832,000	
8065	佐藤商事	2,100	502.00	1,054,200	
8068	菱洋エレクトロ	2,500	786.00	1,965,000	
8070	東京産業	2,500	250.00	625,000	
8074	ユアサ商事	24,000	126.00	3,024,000	
8075	神鋼商事	6,000	166.00	996,000	
8078	阪和興業	23,000	285.00	6,555,000	
8081	カナデン	2,000	483.00	966,000	
8084	菱電商事	3,000	467.00	1,401,000	

8087	フルサト工業	1,400	799.00	1,118,600	
8088	岩谷産業	26,000	295.00	7,670,000	
8089	すてきナイスグループ	10,000	189.00	1,890,000	
8090	昭光通商	9,000	111.00	999,000	
8091	ニチモウ	4,000	170.00	680,000	
8093	極東貿易	3,000	141.00	423,000	
8095	イワキ	4,000	168.00	672,000	
8097	三愛石油	6,000	340.00	2,040,000	
8098	稲畑産業	6,200	465.00	2,883,000	
8101	G S Iクレオス	6,000	102.00	612,000	
8103	明和産業	1,900	622.00	1,181,800	
8110	J F E 商事	15,600	342.00	5,335,200	
8129	東邦ホールディングス	7,500	1,463.00	10,972,500	
8130	サンゲツ	4,100	1,873.00	7,679,300	
8131	ミツウロコグループホールディングス	3,700	506.00	1,872,200	
8132	シナネン	5,000	340.00	1,700,000	
8133	伊藤忠エネクス	5,100	428.00	2,182,800	
8136	サンリオ	5,900	2,360.00	13,924,000	
8137	サンワテクノス	1,100	634.00	697,400	
8140	リョーサン	3,800	1,392.00	5,289,600	
8141	新光商事	2,500	617.00	1,542,500	
8142	トーホー	5,000	306.00	1,530,000	
8150	三信電気	3,300	534.00	1,762,200	
8151	東陽テクニカ	3,300	817.00	2,696,100	
8153	モスフードサービス	3,000	1,538.00	4,614,000	
8154	加賀電子	2,500	774.00	1,935,000	
8158	ソーダニッカ	2,000	333.00	666,000	
8159	立花エレテック	1,400	693.00	970,200	
8283	P a l t a c	2,400	1,040.00	2,496,000	
8835	太平洋興発	8,000	78.00	624,000	
9305	ヤマタネ	12,000	100.00	1,200,000	
9763	丸紅建材リース	3,000	130.00	390,000	
9810	日鐵商事	5,000	196.00	980,000	
9830	トラスコ中山	2,900	1,594.00	4,622,600	
9832	オートバックスセブン	2,800	3,900.00	10,920,000	
9869	加藤産業	3,300	1,500.00	4,950,000	
9880	イノテック	1,900	375.00	712,500	
9882	イエローハット	2,200	1,300.00	2,860,000	
9883	富士エレクトロニクス	1,200	1,030.00	1,236,000	
9896	J K ホールディングス	2,000	341.00	682,000	
9902	日伝	1,000	2,036.00	2,036,000	
9930	北沢産業	2,000	155.00	310,000	
9932	杉本商事	1,300	736.00	956,800	
9934	因幡電機産業	2,700	2,090.00	5,643,000	
9938	住金物産	11,000	184.00	2,024,000	
9962	ミスミグループ本社	8,700	1,788.00	15,555,600	
9963	江守商事	400	831.00	332,400	
9972	アルテック	1,200	216.00	259,200	
9982	タキヒヨー	4,000	423.00	1,692,000	

9987	スズケン	9,000	2,477.00	22,293,000	
9991	ジェコス	1,700	356.00	605,200	
2651	ローソン	7,400	5,270.00	38,998,000	
2659	サンエー	800	2,850.00	2,280,000	
2660	キリン堂	1,100	520.00	572,000	
2662	ダイユーエイト	500	593.00	296,500	
2664	カワチ薬品	1,600	1,609.00	2,574,400	
2670	エービーシー・マート	3,300	2,760.00	9,108,000	
2674	ハードオフコーポレーション	1,200	502.00	602,400	
2678	アスクル	1,600	870.00	1,392,000	

[次へ](#)

2681	ゲオホールディングス	36	86,600.00	3,117,600	
2685	ポイント	1,980	2,665.00	5,276,700	
2687	シー・ヴィ・エス・ベイエリア	4,000	80.00	320,000	
2695	くらコーポレーション	1,200	1,119.00	1,342,800	
2698	キャンドウ	13	95,500.00	1,241,500	
2726	パル	700	3,825.00	2,677,500	
2730	エディオン	9,300	383.00	3,561,900	
2734	サーラコーポレーション	2,000	520.00	1,040,000	
2753	あみやき亭	4	187,000.00	748,000	
2764	ひらまつ	8	72,300.00	578,400	
2772	ゲンキー	300	2,013.00	603,900	
2792	ハニーズ	2,050	1,540.00	3,157,000	
3028	アルペン	1,800	1,496.00	2,692,800	
3048	ビックカメラ	88	37,500.00	3,300,000	
3050	D C Mホールディングス	12,100	502.00	6,074,200	
3064	M o n o t a R O	1,300	1,447.00	1,881,100	
3086	J . フロント リテイリング	55,000	364.00	20,020,000	
3087	ドトール・日レスホールディングス	3,700	1,015.00	3,755,500	
3088	マツモトキヨシホールディングス	4,300	1,695.00	7,288,500	
3092	スタートトゥデイ	4,200	1,077.00	4,523,400	
3097	物語コーポレーション	300	1,452.00	435,600	
3098	ココカラファイン	2,400	2,465.00	5,916,000	
3099	三越伊勢丹ホールディングス	46,400	790.00	36,656,000	
3141	グローウェルホールディングス	800	2,527.00	2,021,600	
3148	クリエイトSDホールディングス	1,000	2,105.00	2,105,000	
3159	丸善C H Iホールディングス	800	200.00	160,000	
3313	ブックオフコーポレーション	1,300	648.00	842,400	
3333	あさひ	1,300	1,126.00	1,463,800	
3341	日本調剤	290	2,885.00	836,650	
3349	コスモス薬品	1,000	4,895.00	4,895,000	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	97,700	2,277.00	222,462,900	
3391	ツルハホールディングス	1,900	4,555.00	8,654,500	
3395	サンマルクホールディングス	700	2,903.00	2,032,100	
3396	フェリシモ	700	1,020.00	714,000	
3397	トリドール	2,000	1,107.00	2,214,000	
3398	クスリのアオキ	400	2,253.00	901,200	
4350	メディカルシステムネットワーク	1,400	475.00	665,000	
4775	総合メディカル	600	2,843.00	1,705,800	
7416	はるやま商事	1,000	430.00	430,000	
7421	カップ・クリエイト	1,700	1,693.00	2,878,100	
7445	ライトオン	1,800	666.00	1,198,800	
7448	ジーンズメイト	900	176.00	158,400	
7453	良品計画	2,500	4,275.00	10,687,500	
7455	三城ホールディングス	3,000	410.00	1,230,000	
7494	コナカ	2,700	905.00	2,443,500	
7506	ハウス オブ ローゼ	300	1,218.00	365,400	
7508	G - 7ホールディングス	700	386.00	270,200	
7512	イオン北海道	1,600	344.00	550,400	
7513	コジマ	3,200	299.00	956,800	

7516	コーナン商事	2,600	998.00	2,594,800	
7520	エコス	900	509.00	458,100	
7522	ワタミ	2,800	1,601.00	4,482,800	
7524	マルシェ	600	727.00	436,200	
7532	ドン・キホーテ	6,200	2,745.00	17,019,000	
7541	メガネトップ	3,300	875.00	2,887,500	
7545	西松屋チェーン	5,100	665.00	3,391,500	
7550	ゼンショーホールディングス	8,900	950.00	8,455,000	
7554	幸楽苑	1,400	1,199.00	1,678,600	
7561	ハークスレイ	600	537.00	322,200	
7581	サイゼリヤ	3,500	1,204.00	4,214,000	
7601	ポプラ	700	494.00	345,800	
7606	ユナイテッドアローズ	2,500	1,881.00	4,702,500	
7611	ハイデイ日高	1,200	1,245.00	1,494,000	
7615	京都きもの友禅	1,500	981.00	1,471,500	
7616	コロワイド	8,000	598.00	4,784,000	
7630	壱番屋	900	2,300.00	2,070,000	
7640	トップカルチャー	900	351.00	315,900	
7649	スギホールディングス	4,200	2,475.00	10,395,000	
8005	スクロール	3,100	295.00	914,500	
8028	ファミリーマート	7,200	3,390.00	24,408,000	
8160	木曽路	2,700	1,577.00	4,257,900	
8165	千趣会	4,200	519.00	2,179,800	
8166	タカキュー	2,000	145.00	290,000	
8168	ケーヨー	4,400	490.00	2,156,000	
8173	上新電機	5,000	780.00	3,900,000	
8174	日本瓦斯	2,200	909.00	1,999,800	
8175	ベスト電器	7,500	143.00	1,072,500	
8178	マルエツ	5,000	286.00	1,430,000	
8179	ロイヤルホールディングス	3,900	945.00	3,685,500	
8181	東天紅	2,000	127.00	254,000	
8182	いなげや	2,700	922.00	2,489,400	
8184	島忠	5,300	1,619.00	8,580,700	
8185	チヨダ	3,100	1,618.00	5,015,800	
8194	ライフコーポレーション	1,500	1,483.00	2,224,500	
8196	カスミ	4,800	530.00	2,544,000	
8200	リンガーハット	2,100	1,053.00	2,211,300	
8201	さが美	2,000	104.00	208,000	
8203	Mr Max	2,400	296.00	710,400	
8207	テンアライド	2,000	260.00	520,000	
8214	AOKIホールディングス	2,000	1,495.00	2,990,000	
8217	オークワ	3,000	973.00	2,919,000	
8218	コメリ	3,200	2,019.00	6,460,800	
8219	青山商事	6,400	1,546.00	9,894,400	
8227	しまむら	2,700	8,540.00	23,058,000	
8229	CFSコーポレーション	1,600	369.00	590,400	
8233	高島屋	32,000	554.00	17,728,000	
8237	松屋	4,700	593.00	2,787,100	
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	12,000	714.00	8,568,000	

8245	丸栄	4,000	76.00	304,000	
8248	ニッセンホールディングス	4,700	357.00	1,677,900	
8251	パルコ	4,300	771.00	3,315,300	
8252	丸井グループ	30,500	530.00	16,165,000	
8255	原信ナルスホールディングス	1,300	1,363.00	1,771,900	
8263	ダイエー	14,800	204.00	3,019,200	
8266	イズミヤ	8,000	383.00	3,064,000	
8267	イオン	82,300	955.00	78,596,500	
8270	ユニー	17,500	788.00	13,790,000	
8273	イズミ	7,000	1,541.00	10,787,000	
8274	東武ストア	3,000	253.00	759,000	
8276	平和堂	4,300	1,048.00	4,506,400	
8278	フジ	2,600	1,736.00	4,513,600	
8279	ヤオコー	1,000	2,729.00	2,729,000	
8281	ゼビオ	2,800	1,756.00	4,916,800	
8282	ケーズホールディングス	5,800	2,140.00	12,412,000	
8289	O l y m p i c	1,600	866.00	1,385,600	
8291	日産東京販売ホールディングス	4,000	264.00	1,056,000	
9627	アインファーマシーズ	1,300	4,550.00	5,915,000	
9828	元気寿司	800	980.00	784,000	
9831	ヤマダ電機	11,360	3,590.00	40,782,400	
9842	アークランドサカモト	1,500	1,196.00	1,794,000	
9843	ニトリホールディングス	4,600	6,650.00	30,590,000	
9854	愛眼	2,000	278.00	556,000	
9861	吉野家ホールディングス	63	100,300.00	6,318,900	
9887	松屋フーズ	1,100	1,451.00	1,596,100	
9900	サガミチェーン	3,000	651.00	1,953,000	
9945	ブレナス	2,600	1,422.00	3,697,200	
9946	ミニストップ	1,800	1,291.00	2,323,800	
9948	アークス	3,200	1,576.00	5,043,200	
9956	パロー	4,600	1,247.00	5,736,200	
9974	ベルク	1,200	1,050.00	1,260,000	
9979	大庄	1,100	1,006.00	1,106,600	
9983	ファーストリテイリング	4,700	15,490.00	72,803,000	
9989	サンドラッグ	4,400	2,387.00	10,502,800	
9990	東京デリカ	800	705.00	564,000	
9993	ヤマザワ	600	1,350.00	810,000	
9994	やまや	400	1,279.00	511,600	
9997	ベルーナ	2,900	585.00	1,696,500	
7150	島根銀行	600	1,016.00	609,600	
8303	新生銀行	182,000	85.00	15,470,000	
8304	あおぞら銀行	73,000	169.00	12,337,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,767,400	356.00	629,194,400	
8308	りそなホールディングス	203,300	302.00	61,396,600	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	454,000	214.00	97,156,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	177,300	2,449.00	434,207,700	
8324	第四銀行	30,000	232.00	6,960,000	
8325	北越銀行	24,000	150.00	3,600,000	
8327	西日本シティ銀行	82,000	174.00	14,268,000	

8328	札幌北洋ホールディングス	35,400	235.00	8,319,000	
8331	千葉銀行	92,000	443.00	40,756,000	
8332	横浜銀行	149,000	351.00	52,299,000	
8333	常陽銀行	89,000	327.00	29,103,000	
8334	群馬銀行	53,000	354.00	18,762,000	
8336	武蔵野銀行	3,800	2,163.00	8,219,400	
8337	千葉興業銀行	4,500	420.00	1,890,000	
8338	筑波銀行	9,800	265.00	2,597,000	
8339	東京都民銀行	4,500	724.00	3,258,000	
8341	七十七銀行	37,000	301.00	11,137,000	
8342	青森銀行	18,000	248.00	4,464,000	
8343	秋田銀行	16,000	204.00	3,264,000	
8344	山形銀行	14,000	323.00	4,522,000	
8345	岩手銀行	1,600	3,155.00	5,048,000	
8346	東邦銀行	20,000	221.00	4,420,000	
8349	東北銀行	13,000	112.00	1,456,000	
8350	みちのく銀行	12,000	158.00	1,896,000	
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	95,000	285.00	27,075,000	
8355	静岡銀行	71,000	769.00	54,599,000	
8356	十六銀行	29,000	245.00	7,105,000	
8358	スルガ銀行	23,000	751.00	17,273,000	
8359	八十二銀行	43,000	368.00	15,824,000	
8360	山梨中央銀行	14,000	299.00	4,186,000	
8361	大垣共立銀行	31,000	259.00	8,029,000	
8362	福井銀行	20,000	176.00	3,520,000	
8363	北國銀行	27,000	302.00	8,154,000	
8364	清水銀行	800	2,162.00	1,729,600	
8366	滋賀銀行	22,000	418.00	9,196,000	
8367	南都銀行	22,000	311.00	6,842,000	
8368	百五銀行	21,000	302.00	6,342,000	
8369	京都銀行	42,000	564.00	23,688,000	
8374	三重銀行	10,000	171.00	1,710,000	
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	164,000	118.00	19,352,000	
8379	広島銀行	69,000	256.00	17,664,000	
8381	山陰合同銀行	14,000	491.00	6,874,000	
8382	中国銀行	18,000	934.00	16,812,000	
8383	鳥取銀行	7,000	146.00	1,022,000	
8385	伊予銀行	25,000	601.00	15,025,000	
8386	百十四銀行	26,000	285.00	7,410,000	
8387	四国銀行	17,000	194.00	3,298,000	
8388	阿波銀行	20,000	472.00	9,440,000	
8390	鹿児島銀行	15,000	446.00	6,690,000	
8392	大分銀行	15,000	245.00	3,675,000	
8393	宮崎銀行	16,000	200.00	3,200,000	
8394	肥後銀行	18,000	388.00	6,984,000	
8395	佐賀銀行	14,000	196.00	2,744,000	
8396	十八銀行	15,000	196.00	2,940,000	
8397	沖縄銀行	1,800	3,405.00	6,129,000	
8399	琉球銀行	4,900	963.00	4,718,700	

8409	八千代銀行	1,300	1,510.00	1,963,000	
8410	セブン銀行	87,500	183.00	16,012,500	
8411	みずほフィナンシャルグループ	3,002,700	122.00	366,329,400	
8415	紀陽ホールディングス	93,000	109.00	10,137,000	
8418	山口フィナンシャルグループ	23,000	632.00	14,536,000	
8521	長野銀行	8,000	146.00	1,168,000	
8522	名古屋銀行	21,000	235.00	4,935,000	
8527	愛知銀行	800	3,645.00	2,916,000	
8529	第三銀行	13,000	138.00	1,794,000	
8530	中京銀行	10,000	179.00	1,790,000	
8536	東日本銀行	11,000	164.00	1,804,000	
8537	大光銀行	8,000	185.00	1,480,000	
8541	愛媛銀行	15,000	200.00	3,000,000	
8542	トマト銀行	9,000	134.00	1,206,000	
8543	みなと銀行	21,000	134.00	2,814,000	
8544	京葉銀行	19,000	343.00	6,517,000	
8545	関西アーバン銀行	33,000	109.00	3,597,000	
8550	栃木銀行	12,000	249.00	2,988,000	
8551	北日本銀行	700	2,070.00	1,449,000	
8558	東和銀行	24,000	68.00	1,632,000	
8562	福島銀行	28,000	51.00	1,428,000	
8563	大東銀行	16,000	56.00	896,000	
8600	トモニホールディングス	17,900	299.00	5,352,100	
8713	フィデアホールディングス	13,500	144.00	1,944,000	
8714	池田泉州ホールディングス	96,400	98.00	9,447,200	
8473	S B Iホールディングス	2,484	5,450.00	13,537,800	
8595	ジャフコ	2,900	1,479.00	4,289,100	
8601	大和証券グループ本社	231,000	261.00	60,291,000	
8604	野村ホールディングス	505,500	271.00	136,990,500	
8609	岡三証券グループ	20,000	288.00	5,760,000	
8613	丸三証券	8,000	260.00	2,080,000	
8614	東洋証券	9,000	158.00	1,422,000	
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	27,000	266.00	7,182,000	
8617	光世証券	6,000	81.00	486,000	
8622	水戸証券	7,000	173.00	1,211,000	
8624	いちよし証券	5,300	425.00	2,252,500	
8628	松井証券	13,800	430.00	5,934,000	
8692	だいこう証券ビジネス	1,400	280.00	392,000	
8698	マネックスグループ	178	13,090.00	2,330,020	
8703	カブドットコム証券	9,600	231.00	2,217,600	
8706	極東証券	3,100	569.00	1,763,900	
8707	岩井コスモホールディングス	2,300	332.00	763,600	
8742	小林洋行	800	165.00	132,000	
8630	N K S Jホールディングス	48,800	1,548.00	75,542,400	
8725	M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	69,800	1,276.00	89,064,800	
8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	22,400	1,175.00	26,320,000	
8750	第一生命保険	1,249	85,800.00	107,164,200	

8766	東京海上ホールディングス	88,600	1,856.00	164,441,600	
8795	T & Dホールディングス	85,100	784.00	66,718,400	
8253	クレディセゾン	19,100	1,526.00	29,146,600	
8424	芙蓉総合リース	2,200	2,237.00	4,921,400	
8425	興銀リース	3,300	1,800.00	5,940,000	
8439	東京センチュリーリース	6,300	1,337.00	8,423,100	
8511	日本証券金融	9,800	367.00	3,596,600	
8512	大阪証券金融	3,200	145.00	464,000	
8515	アイフル	21,500	136.00	2,924,000	
8519	ポケットカード	2,500	304.00	760,000	
8566	リコーリース	1,700	1,727.00	2,935,900	
8570	イオンクレジットサービス	9,600	1,311.00	12,585,600	
8572	アコム	4,710	1,381.00	6,504,510	
8584	ジャックス	14,000	221.00	3,094,000	
8585	オリエントコーポレーション	45,500	93.00	4,231,500	
8586	日立キャピタル	4,600	1,196.00	5,501,600	
8591	オリックス	12,150	6,900.00	83,835,000	
8593	三菱UFJリース	5,930	2,998.00	17,778,140	
8772	アサックス	4	85,000.00	340,000	
8793	NECキャピタルソリューション	800	928.00	742,400	
2353	日本駐車場開発	254	4,115.00	1,045,210	
3003	昭栄	4,400	345.00	1,518,000	
3225	東京建物不動産販売	1,000	242.00	242,000	
3231	野村不動産ホールディングス	11,200	1,297.00	14,526,400	
3258	常和ホールディングス	400	1,339.00	535,600	
3265	ヒューリック	7,500	1,047.00	7,852,500	
4666	パーク24	12,100	1,068.00	12,922,800	
8801	三井不動産	104,000	1,356.00	141,024,000	
8802	三菱地所	163,000	1,268.00	206,684,000	
8803	平和不動産	22,000	169.00	3,718,000	
8804	東京建物	45,000	275.00	12,375,000	
8806	ダイビル	6,900	558.00	3,850,200	
8815	東急不動産	47,000	365.00	17,155,000	
8818	京阪神ビルディング	2,800	350.00	980,000	
8830	住友不動産	56,000	1,710.00	95,760,000	
8833	東宝不動産	2,500	408.00	1,020,000	
8840	大京	36,000	185.00	6,660,000	
8841	テーオーシー	9,000	426.00	3,834,000	
8842	東京楽天地	4,000	297.00	1,188,000	
8848	レオパレス21	18,100	256.00	4,633,600	
8860	フジ住宅	2,900	396.00	1,148,400	
8864	空港施設	2,500	331.00	827,500	
8869	明和地所	1,200	387.00	464,400	
8870	住友不動産販売	840	3,545.00	2,977,800	
8871	ゴールドクレスト	2,130	1,127.00	2,400,510	
8875	東栄住宅	1,600	742.00	1,187,200	
8876	リロ・ホールディング	700	2,403.00	1,682,100	
8877	日本エスリード	900	635.00	571,500	
8879	東急リバブル	2,100	735.00	1,543,500	

8880	飯田産業	2,200	623.00	1,370,600	
8881	日神不動産	1,400	443.00	620,200	
8895	アーネストワン	3,800	886.00	3,366,800	
8897	タカラレーベン	2,700	568.00	1,533,600	
8904	サンヨーハウジング名古屋	12	76,000.00	912,000	
8905	イオンモール	10,600	1,566.00	16,599,600	
8907	フージャースコーポレーション	36	47,500.00	1,710,000	
8915	タクトホーム	12	64,800.00	777,600	
8918	ランド	5,200	10.00	52,000	
8923	トーセイ	31	28,580.00	885,980	
8933	エヌ・ティ・ティ都市開発	145	56,600.00	8,207,000	
8934	サンフロンティア不動産	20	15,570.00	311,400	
8944	ランドビジネス	17	16,270.00	276,590	
8999	グランディハウス	600	496.00	297,600	
9706	日本空港ビルデング	7,400	854.00	6,319,600	
1954	日本工営	8,000	256.00	2,048,000	
2120	ネクスト	1,000	355.00	355,000	
2127	日本M&Aセンター	1,000	2,208.00	2,208,000	
2128	ノバレーゼ	6	51,800.00	310,800	
2131	アコーディア・ゴルフ	101	47,600.00	4,807,600	
2168	パソナグループ	25	52,600.00	1,315,000	
2170	リンクアンドモチベーション	5	57,100.00	285,500	
2175	エス・エム・エス	5	150,500.00	752,500	
2181	テンプホールディングス	3,400	944.00	3,209,600	
2193	クックパッド	500	1,879.00	939,500	
2301	学情	900	317.00	285,300	
2305	スタジオアリス	1,100	1,319.00	1,450,900	
2309	シミックホールディングス	1,000	1,188.00	1,188,000	
2322	NECフィールディング	2,000	949.00	1,898,000	
2331	総合警備保障	9,000	1,031.00	9,279,000	
2371	カカコム	3,800	2,716.00	10,320,800	
2378	ルネサンス	1,100	445.00	489,500	
2398	ツクイ	800	1,050.00	840,000	
2413	エムスリー	19	364,000.00	6,916,000	
2418	ベストブライダル	5	82,000.00	410,000	
2432	ディー・エヌ・エー	11,100	1,993.00	22,122,300	
2433	博報堂DYホールディングス	3,150	4,890.00	15,403,500	
2440	ぐるなび	1,700	834.00	1,417,800	
2450	一休	18	33,750.00	607,500	
2453	ジャパンベストレスキューシステム	4	76,000.00	304,000	
2462	ジェイコムホールディングス	500	617.00	308,500	
2466	PGMホールディングス	35	62,200.00	2,177,000	
2749	J Pホールディングス	700	752.00	526,400	
4282	イーピーエス	15	200,500.00	3,007,500	
4301	アミューズ	700	1,006.00	704,200	
4310	ドリームインキュベータ	8	67,900.00	543,200	
4319	TAC	1,500	127.00	190,500	
4321	ケネディクス	269	10,130.00	2,724,970	
4324	電通	22,500	2,194.00	49,365,000	

4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	107	7,120.00	761,840	
4337	びあ	800	895.00	716,000	
4343	イオンファンタジー	800	1,088.00	870,400	
4544	みらかホールディングス	6,500	2,999.00	19,493,500	
4641	アルプス技研	1,100	587.00	645,700	
4651	サニックス	3,800	228.00	866,400	
4653	ダイオーズ	500	502.00	251,000	
4658	日本空調サービス	600	701.00	420,600	
4661	オリエンタルランド	6,700	8,580.00	57,486,000	
4665	ダスキン	7,300	1,445.00	10,548,500	
4668	明光ネットワークジャパン	2,200	723.00	1,590,600	
4671	ファルコSDホールディングス	1,300	947.00	1,231,100	
4678	秀英予備校	500	295.00	147,500	
4679	田谷	400	662.00	264,800	
4680	ラウンドワン	7,800	430.00	3,354,000	
4681	リゾートトラスト	3,800	1,304.00	4,955,200	
4694	ビー・エム・エル	1,600	1,891.00	3,025,600	
4696	ワタベウェディング	700	699.00	489,300	
4708	もしもしホットライン	4,100	717.00	2,939,700	
4711	東急コミュニティー	600	2,417.00	1,450,200	
4714	リソー教育	247	5,100.00	1,259,700	
4724	ウェアハウス	500	215.00	107,500	
4732	ユー・エス・エス	3,220	7,850.00	25,277,000	
4745	東京個別指導学院	1,300	142.00	184,600	
4767	テー・オー・ダブリュー	900	522.00	469,800	
4801	セントラルスポーツ	800	1,069.00	855,200	
5261	リゾートソリューション	2,000	157.00	314,000	
9603	エイチ・アイ・エス	2,500	2,696.00	6,740,000	
9616	共立メンテナンス	1,200	1,579.00	1,894,800	
9619	イチネンホールディングス	2,600	406.00	1,055,600	
9621	建設技術研究所	1,400	497.00	695,800	
9628	燦ホールディングス	500	1,354.00	677,000	
9632	スバル興業	2,000	252.00	504,000	
9633	東京テアトル	10,000	105.00	1,050,000	
9671	よみうりランド	5,000	241.00	1,205,000	
9672	東京都競馬	19,000	109.00	2,071,000	
9675	常磐興産	8,000	86.00	688,000	
9678	カナモト	3,000	749.00	2,247,000	
9681	東京ドーム	20,000	214.00	4,280,000	
9715	トランス・コスモス	3,200	1,037.00	3,318,400	
9716	乃村工藝社	5,000	235.00	1,175,000	
9722	藤田観光	6,000	260.00	1,560,000	
9726	近畿日本ツーリスト	8,000	95.00	760,000	
9728	日本管財	900	1,458.00	1,312,200	
9729	トーカイ	1,000	1,790.00	1,790,000	
9731	白洋舎	3,000	211.00	633,000	
9735	セコム	24,000	3,335.00	80,040,000	
9740	セントラル警備保障	1,200	783.00	939,600	
9743	丹青社	3,000	225.00	675,000	

9744	メイテック	3,800	1,609.00	6,114,200	
9747	アサツー ディ・ケイ	4,100	2,099.00	8,605,900	
9755	応用地質	2,600	851.00	2,212,600	
9757	船井総合研究所	2,600	525.00	1,365,000	
9760	進学会	1,200	282.00	338,400	
9783	ベネッセホールディングス	7,600	3,395.00	25,802,000	
9787	イオンディライト	2,800	1,770.00	4,956,000	
9788	ナック	600	1,860.00	1,116,000	
9792	ニチイ学館	4,800	719.00	3,451,200	
9793	ダイセキ	4,000	1,311.00	5,244,000	
	合計	36,342,328		23,469,601,460	

(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12月15日現在	平成24年 6月15日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		74,233,457	100,927,066
コール・ローン		578,004,228	1,174,394,502
株式		55,824,941,184	57,563,703,051
投資証券		1,059,946,429	1,321,287,370
派生商品評価勘定		426,755	15,163,592
未収入金		983,425,850	12,138,962
未収配当金		131,930,993	135,380,979
未収利息		1,071	2,137
差入委託証拠金		283,570,880	174,079,858
流動資産合計		58,936,480,847	60,497,077,517
資産合計		58,936,480,847	60,497,077,517
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		21,440,017	12,167,826
未払金		7,501,044	866,551
未払解約金		119,742,451	28,323,527
流動負債合計		148,683,512	41,357,904
負債合計		148,683,512	41,357,904
純資産の部			
元本等			
元本		74,828,443,055	70,354,330,459
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		16,040,645,720	9,898,610,846
元本等合計		58,787,797,335	60,455,719,613
純資産合計		58,787,797,335	60,455,719,613
負債純資産合計		58,936,480,847	60,497,077,517

[次へ](#)

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

## (貸借対照表に関する注記)

		平成23年12月15日現在	平成24年 6月15日現在
1.	期首	平成23年 6月16日	平成23年12月16日
	期首元本額	74,374,163,489円	74,828,443,055円
	期首からの追加設定元本額	6,496,887,493円	2,491,353,611円
	期首からの一部解約元本額	6,042,607,927円	6,965,466,207円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外株式ヘッジなし（DC専用）	13,234,231,760円	13,938,915,799円
	DCインデックスバランス（株式20）	52,176,172円	50,717,803円
	DCインデックスバランス（株式40）	180,230,339円	178,834,289円
	DCインデックスバランス（株式60）	343,388,318円	325,864,527円
	DCインデックスバランス（株式80）	360,680,944円	356,621,588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	10,649,443,405円
	日興五大陸株式ファンド	20,668,046,160円	19,040,633,362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	81,098,231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	103,425,603円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	23,146,701円	22,111,769円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	20,816,474円	19,407,763円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	33,791,964円	30,707,695円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	43,446,679円	39,135,938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	16,964,439,879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	29,770,220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	21,325,568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	48,882,761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	126,413,885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	167,610,384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	160,760,713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	7,998,209,277円
計	74,828,443,055円	70,354,330,459円
2. 受益権の総数	74,828,443,055口	70,354,330,459口
3. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	16,040,645,720円	9,898,610,846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23年 6月16日 至 平成23年12月15日	自 平成23年12月16日 至 平成24年 6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12月15日現在	平成24年 6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

（平成24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	1,776,608,467
投資証券	126,381,173
合計	1,902,989,640

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（平成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

（平成24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	1,539,387,443		1,550,769,976	11,382,533
	合計	1,539,387,443		1,550,769,976	11,382,533

（注）1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (通貨関連)

(平成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

(平成24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				
	買建	1,311,827,947		1,303,441,180	8,386,767
	米ドル	933,530,368		929,458,060	4,072,308
	ユーロ	378,297,579		373,983,120	4,314,459
合計	1,311,827,947		1,303,441,180	8,386,767	

## (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12月15日現在		平成24年 6月15日現在
1口当たり純資産額	0.7856円	1口当たり純資産額	0.8593円
(1万口当たり純資産額)	(7,856円)	(1万口当たり純資産額)	(8,593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	8.55	70,794.00	
ANADARKO PETROLEUM CORP	17,593	63.96	1,125,248.28	
APACHE CORP	13,514	86.01	1,162,339.14	
BAKER HUGHES INC	15,965	39.54	631,256.10	
CABOT OIL & GAS CORP	7,900	35.04	276,816.00	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	8,451	44.90	379,449.90	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	22,240	17.33	385,419.20	
CHEVRON CORP	70,211	101.92	7,155,905.12	
CIMAREX ENERGY CO	3,355	48.03	161,140.65	
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	5,000	21.87	109,350.00	
CONCHO RESOURCES INC	3,645	89.77	327,211.65	
CONOCOPHILLIPS	42,980	54.68	2,350,146.40	
CONSOL ENERGY INC	8,638	27.58	238,236.04	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,630	70.01	114,116.30	
CORE LABORATORIES N.V.	1,470	117.84	173,224.80	
DENBURY RESOURCES INC	15,145	14.57	220,662.65	
DEVON ENERGY CORPORATION	13,321	56.70	755,300.70	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	2,585	59.31	153,316.35	
ENERGEN CORP	2,310	44.35	102,448.50	
EOG RESOURCES INC	9,376	94.46	885,656.96	
EQT CORP	5,345	47.50	253,887.50	
EXXON MOBIL CORP	167,551	82.13	13,760,963.63	
FMC TECHNOLOGIES INC	8,285	41.48	343,661.80	
HALLIBURTON CO	33,157	28.68	950,942.76	
HELMERICH & PAYNE	4,100	43.64	178,924.00	
HESS CORP	10,830	43.95	475,978.50	
HOLLYFRONTIER CORP	7,800	32.06	250,068.00	
KINDER MORGAN INC	14,010	31.47	440,894.70	
MARATHON OIL CORP	25,317	24.61	623,051.37	
MARATHON PETROLEUM CORP	13,426	39.40	528,984.40	
MURPHY OIL CORP	6,965	44.55	310,290.75	
NABORS INDUSTRIES LTD	10,741	12.70	136,410.70	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	14,921	66.81	996,872.01	
NEWFIELD EXPLORATION CO	4,950	26.62	131,769.00	
NOBLE CORP	9,482	31.25	296,312.50	
NOBLE ENERGY INC	6,471	82.98	536,963.58	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	28,941	83.48	2,415,994.68	
PEABODY ENERGY CORP	9,290	23.18	215,342.20	
PHILLIPS 66	22,485	33.53	753,922.05	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,600	88.17	317,412.00	
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	4,725	35.64	168,399.00	
QEP RESOURCES INC	6,820	26.43	180,252.60	
RANGE RESOURCES CORP	6,030	57.23	345,096.90	
ROWAN COMPANIES PLC	4,980	31.36	156,172.80	
SCHLUMBERGER LTD	47,849	65.38	3,128,367.62	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	12,765	26.94	343,889.10	
SPECTRA ENERGY CORP	24,064	27.71	666,813.44	
SUNOCO INC	3,378	47.07	159,002.46	
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	5,500	19.31	106,205.00	

ULTRA PETROLEUM CORP	5,524	18.96	104,735.04
VALERO ENERGY CORP	18,992	21.89	415,734.88
WEATHERFORD INTL LTD	24,599	12.54	308,471.46
WHITING PETROLEUM CORP	4,285	40.18	172,171.30
WILLIAMS COS INC	21,944	29.45	646,250.80
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	7,325	78.45	574,646.25
AIRGAS INC	2,650	83.40	221,010.00
ALBEMARLE CORP	2,650	57.93	153,514.50
ALCOA INC	39,339	8.65	340,282.35
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	4,010	29.03	116,410.30
BALL CORP	5,073	41.56	210,833.88
CELANESE CORP-SERIES A	6,010	36.54	219,605.40
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,230	163.81	365,296.30
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	5,350	47.62	254,767.00
CROWN HOLDINGS INC	6,195	34.04	210,877.80
DOW CHEMICAL	41,843	32.00	1,338,976.00
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	32,928	49.55	1,631,582.40
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,675	46.74	218,509.50
ECOLAB INC	10,900	66.86	728,774.00
FMC CORP	4,430	50.01	221,544.30
FREEMPORT-MCMORAN COPPER	33,413	33.90	1,132,700.70
INTERNATIONAL PAPER CO	15,520	28.78	446,665.60
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,224	55.78	179,834.72
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,450	37.60	392,920.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,445	66.22	95,687.90
MEADWESTVACO CORP	6,889	27.86	191,927.54
MONSANTO CO	19,081	78.69	1,501,483.89
MOSAIC CO/THE	11,390	47.59	542,050.10
NEWMONT MINING CORP	18,190	50.69	922,051.10
NUCOR CORP	11,649	36.53	425,537.97
OWENS-ILLINOIS INC	6,475	18.75	121,406.25
PPG INDUSTRIES INC	5,397	101.76	549,198.72
PRAXAIR INC	10,820	104.53	1,131,014.60
ROCK-TENN COMPANY-CL A	2,500	53.20	133,000.00
SEALED AIR CORP	4,356	15.52	67,605.12
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,327	129.32	430,247.64
SIGMA-ALDRICH	4,395	71.19	312,880.05
UNITED STATES STEEL CORP	5,237	18.72	98,036.64
VULCAN MATERIALS CO	4,443	33.45	148,618.35
WALTER ENERGY INC	2,240	45.23	101,315.20
3M CO	23,726	86.86	2,060,840.36
AGCO CORP	3,790	40.94	155,162.60
AMETEK INC	5,442	50.74	276,127.08
BOEING CO	25,162	71.85	1,807,889.70
CATERPILLAR INC	23,046	85.89	1,979,420.94
COOPER INDUSTRIES PLC	5,008	67.94	340,243.52
CUMMINS INC	6,525	93.15	607,803.75
DANAHER CORP	21,329	51.41	1,096,523.89
DEERE & CO	13,440	74.71	1,004,102.40
DOVER CORP	6,340	55.00	348,700.00
EATON CORP	11,196	39.48	442,018.08
EMERSON ELECTRIC CO	26,060	46.49	1,211,529.40
FASTENAL CO	10,363	39.03	404,467.89
FLOWSERVE CORP	1,825	106.16	193,742.00

FLUOR CORP	5,893	47.13	277,737.09
GENERAL DYNAMICS CORP	11,152	64.01	713,839.52
GENERAL ELECTRIC CO.	376,393	19.72	7,422,469.96
GOODRICH CORP	4,615	126.40	583,336.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	26,306	55.22	1,452,617.32
ILLINOIS TOOL WORKS	15,120	54.08	817,689.60
INGERSOLL-RAND PLC	10,266	39.21	402,529.86
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,810	35.58	171,139.80
JOY GLOBAL INC	3,935	55.51	218,431.85
KBR INC	5,860	25.26	148,023.60
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	3,081	71.35	219,829.35
LOCKHEED MARTIN CORP	9,961	83.33	830,050.13
MASCO CORP	14,899	13.30	198,156.70
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,414	60.53	509,299.42
PACCAR INC	10,674	39.01	416,392.74
PALL CORP	3,666	53.54	196,277.64
PARKER HANNIFIN CORP	5,290	78.46	415,053.40
PENTAIR INC	3,864	38.98	150,618.72
PRECISION CASTPARTS CORP	5,050	166.71	841,885.50
QUANTA SERVICES INC	8,315	22.88	190,247.20
RAYTHEON COMPANY	12,662	53.09	672,225.58
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,933	68.76	339,193.08
ROCKWELL COLLINS INC.	4,795	50.07	240,085.65
ROPER INDUSTRIES INC	3,180	99.98	317,936.40
SPX CORP	2,087	66.31	138,388.97
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,436	62.02	337,140.72
TEXTRON INC	10,336	24.29	251,061.44
TRANSDIGM GROUP INC	1,460	124.49	181,755.40
TYCO INTERNATIONAL LTD	16,935	53.01	897,724.35
UNITED TECHNOLOGIES CORP	30,675	74.14	2,274,244.50
URS CORP	3,410	34.29	116,928.90
WW GRAINGER INC	2,157	177.10	382,004.70
XYLEM INC	6,518	25.00	162,950.00
AVERY DENNISON CORP	3,790	27.06	102,557.40
CINTAS CORP	4,727	36.68	173,386.36
DUN & BRADSTREET CORP	2,082	68.29	142,179.78
EQUIFAX INC	4,084	47.78	195,133.52
IHS INC-CLASS A	1,710	103.76	177,429.60
IRON MOUNTAIN INC	4,302	32.79	141,062.58
MANPOWERGROUP	2,657	35.06	93,154.42
NIELSEN HOLDINGS NV	3,245	27.37	88,815.65
PITNEY BOWES INC	8,543	14.64	125,069.52
REPUBLIC SERVICES INC	9,240	25.85	238,854.00
ROBERT HALF INTL INC	5,715	28.38	162,191.70
STERICYCLE INC	3,025	88.02	266,260.50
VERISK ANALYTICS INC	4,000	48.08	192,320.00
WASTE MANAGEMENT INC	16,164	32.36	523,067.04
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,250	58.02	304,605.00
CSX CORP	35,673	21.93	782,308.89

[次へ](#)

DELTA AIR LINES INC	6,905	10.45	72,157.25
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,907	39.52	312,484.64
FEDEX CORP	10,708	86.84	929,882.72
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	9,780	12.58	123,032.40
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,080	57.53	177,192.40
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	200,000	0.68	137,000.00
KANSAS CITY SOUTHERN	4,130	66.71	275,512.30
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,830	68.20	875,006.00
SOUTHWEST AIRLINES CO	7,030	9.20	64,676.00
UNION PACIFIC CORP	17,218	113.64	1,956,653.52
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	2,495	22.83	56,960.85
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	25,787	77.37	1,995,140.19
AUTOLIV INC	2,610	52.21	136,268.10
BORGWARNER INC	4,135	63.17	261,207.95
FORD MOTOR COMPANY	125,715	10.41	1,308,693.15
GENERAL MOTORS CORP	28,115	21.80	612,907.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	9,385	10.62	99,668.70
HARLEY-DAVIDSON INC	7,689	49.43	380,067.27
JOHNSON CONTROLS INC	24,848	27.98	695,247.04
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	3,805	36.66	139,491.30
COACH INC	10,686	59.93	640,411.98
DR HORTON INC	12,086	15.65	189,145.90
FOSSIL INC	2,035	71.69	145,889.15
GARMIN LTD	4,625	37.45	173,206.25
HASBRO INC	4,458	34.06	151,839.48
LEGGETT & PLATT INC	4,468	20.30	90,700.40
LULULEMON ATHLETICA INC	3,600	60.72	218,592.00
MATTEL INC	11,459	32.13	368,177.67
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,318	66.31	153,706.58
NEWELL RUBBERMAID INC	11,190	18.41	206,007.90
NIKE INC -CL B	12,617	100.02	1,261,952.34
PVH CORP	2,030	77.31	156,939.30
RALPH LAUREN CORP	2,095	142.72	298,998.40
TOLL BROTHERS INC	4,501	25.28	113,785.28
VF CORP	2,975	139.75	415,756.25
WHIRLPOOL CORP	2,934	58.04	170,289.36
APOLLO GROUP INC-CL A	4,612	32.95	151,965.40
CARNIVAL CORP	14,907	34.56	515,185.92
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,155	398.25	459,978.75
DARDEN RESTAURANTS INC	4,383	50.13	219,719.79
H&R BLOCK INC	12,000	15.36	184,320.00
INTL GAME TECHNOLOGY	11,686	15.12	176,692.32
LAS VEGAS SANDS CORP	13,660	45.69	624,125.40
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	9,466	37.65	356,394.90
MCDONALD'S CORP	36,481	89.72	3,273,075.32
MGM RESORTS INTERNATIONAL	14,000	11.10	155,400.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,908	24.04	117,988.32
STARBUCKS CORP	26,422	52.33	1,382,663.26
STARWOOD HOTELS & RESORTS	6,567	51.00	334,917.00
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	4,550	51.24	233,142.00
WYNN RESORTS LTD	3,060	100.49	307,499.40
YUM! BRANDS INC	16,414	64.42	1,057,389.88
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	8,425	12.19	102,700.75
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	20,888	31.73	662,776.24

COMCAST CORP-CLASS A	74,576	30.71	2,290,228.96
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	24,091	30.17	726,825.47
DIRECTV-CLASS A	24,974	43.97	1,098,106.78
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	4,960	50.06	248,297.60
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	4,635	46.97	217,705.95
DISH NETWORK CORP-A	7,659	27.22	208,477.98
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,846	10.34	163,847.64
LIBERTY GLOBAL INC-A	4,473	46.40	207,547.20
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	4,683	45.04	210,922.32
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-A	4,085	84.44	344,937.40
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	9,912	42.50	421,260.00
NEWS CORP-CL A	60,972	19.86	1,210,903.92
NEWS CORP-CLASS B	15,779	20.04	316,211.16
OMNICOM GROUP	9,457	47.12	445,613.84
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	3,320	56.16	186,451.20
SIRIUS XM RADIO INC	135,530	1.85	250,730.50
THE WALT DISNEY CO.	60,823	47.18	2,869,629.14
TIME WARNER CABLE	11,207	77.92	873,249.44
TIME WARNER INC	35,608	35.43	1,261,591.44
VIACOM INC-CLASS B	17,408	46.77	814,172.16
VIRGIN MEDIA INC	9,025	22.19	200,264.75
WASHINGTON POST-CLASS B	212	370.01	78,442.12
ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	3,321	30.54	101,423.34
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,708	70.66	191,347.28
AMAZON.COM INC	12,965	214.45	2,780,344.25
AUTOZONE INC	1,232	385.75	475,244.00
BED BATH & BEYOND INC	8,292	72.01	597,106.92
BEST BUY CO INC	11,434	19.81	226,507.54
CARMAX INC	8,679	27.34	237,283.86
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,770	45.83	126,949.10
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	7,440	50.55	376,092.00
DOLLAR TREE INC	3,972	107.91	428,618.52
EXPEDIA INC	3,642	47.53	173,104.26
FAMILY DOLLAR STORES	3,343	72.85	243,537.55
GAMESTOP CORP-CLASS A	5,150	17.74	91,361.00
GAP INC/THE	10,356	26.42	273,605.52
GENUINE PARTS CO	5,771	60.78	350,761.38
HOME DEPOT INC	54,960	52.16	2,866,713.60
J.C. PENNEY CO INC	6,061	24.29	147,221.69
KOHL'S CORP	8,052	43.83	352,919.16
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	18,970	16.41	311,297.70
LIMITED INC/THE	9,518	42.29	402,516.22
LOWE'S COS INC	44,792	27.77	1,243,873.84
MACY'S INC	14,969	35.82	536,189.58
NETFLIX INC	1,830	62.66	114,667.80
NORDSTROM INC	5,840	48.17	281,312.80
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,665	98.34	458,756.10
PETSMART INC	4,460	66.56	296,857.60
PRICELINE.COM INC	1,750	640.32	1,120,560.00
ROSS STORES INC	8,656	65.52	567,141.12
STAPLES INC	25,644	12.63	323,883.72
TARGET CORP	22,740	58.55	1,331,427.00
TIFFANY & CO	4,560	53.54	244,142.40
TJX COMPANIES INC	26,853	42.06	1,129,437.18

TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,220	86.78	192,651.60
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	1,770	92.98	164,574.60
URBAN OUTFITTERS INC	4,770	26.62	126,977.40
COSTCO WHOLESALE CORP	15,379	89.83	1,381,495.57
CVS CAREMARK CORP	46,387	45.81	2,124,988.47
KROGER CO	19,915	22.58	449,680.70
SAFEWAY INC	13,113	18.20	238,656.60
SYSCO CORP	19,986	28.98	579,194.28
WALGREEN CO	30,722	31.67	972,965.74
WAL-MART STORES INC	67,582	67.63	4,570,570.66
WHOLE FOODS MARKET INC	5,545	91.54	507,589.30
ALTRIA GROUP INC	73,288	33.68	2,468,339.84
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	24,373	31.26	761,899.98
BEAM INC	5,276	62.84	331,543.84
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,145	91.02	286,257.90
BUNGE LTD	4,657	58.39	271,922.23
CAMPBELL SOUP CO	7,215	31.69	228,643.35
COCA COLA HELLENIC BTLNG-ADR	3,000	16.99	50,970.00
COCA-COLA CO/THE	72,876	75.74	5,519,628.24
COCA-COLA ENTERPRISES	10,930	26.26	287,021.80
CONAGRA FOODS INC	14,060	24.85	349,391.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	5,580	19.58	109,256.40
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	6,909	42.87	296,188.83
GENERAL MILLS INC	22,629	38.09	861,938.61
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	4,875	20.15	98,231.25
HERSHEY CO/THE	6,065	68.92	417,999.80
HJ HEINZ CO	10,670	54.33	579,701.10
HORMEL FOODS CORP	5,800	29.47	170,926.00
JM SMUCKER CO/THE	4,230	75.70	320,211.00
KELLOGG CO	9,318	49.13	457,793.34
KRAFT FOODS INC-CLASS A	59,815	38.72	2,316,036.80
LORILLARD INC	4,660	125.06	582,779.60
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,005	56.64	226,843.20
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	7,191	85.72	616,412.52
MOLSON COORS BREWING CO -B	5,920	39.38	233,129.60
MONSTER BEVERAGE CORP	5,650	76.31	431,151.50
PEPSICO INC	55,741	69.27	3,861,179.07
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	61,928	87.34	5,408,791.52
RALCORP HOLDINGS INC	1,820	64.02	116,516.40
REYNOLDS AMERICAN INC	13,220	42.49	561,717.80
SARA LEE CORP	20,968	19.06	399,650.08
TYSON FOODS INC-CL A	11,206	18.73	209,888.38
AVON PRODUCTS	15,953	15.64	249,504.92
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,515	53.70	296,155.50
CLOROX COMPANY	4,926	73.06	359,893.56
COLGATE-PALMOLIVE CO	17,250	101.32	1,747,770.00
ENERGIZER HOLDINGS INC	2,061	74.54	153,626.94
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	8,340	54.30	452,862.00
HERBALIFE LTD	4,450	45.93	204,388.50
KIMBERLY-CLARK CORP	14,373	82.57	1,186,778.61
PROCTER & GAMBLE CO	98,089	63.18	6,197,263.02
AETNA INC	12,283	41.50	509,744.50
AMERISOURCEBERGEN CORP	9,014	36.96	333,157.44
BAXTER INTERNATIONAL INC	19,939	49.03	977,609.17

BECTON DICKINSON AND CO	7,216	73.14	527,778.24
BOSTON SCIENTIFIC CORP	52,468	5.80	304,314.40
CARDINAL HEALTH INC	11,805	41.82	493,685.10
CAREFUSION CORP	8,275	24.54	203,068.50
CERNER CORP	5,335	81.53	434,962.55
CIGNA CORP	10,330	45.12	466,089.60
COVENTRY HEALTH CARE INC	5,075	32.73	166,104.75
COVIDIEN PLC	16,755	52.52	879,972.60
CR BARD INC	3,174	98.95	314,067.30
DAVITA INC	3,499	88.11	308,296.89
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	4,562	37.47	170,938.14
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,300	96.88	416,584.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	27,454	54.23	1,488,830.42
HCA HOLDINGS INC	6,715	26.40	177,276.00
HENRY SCHEIN INC	3,010	75.66	227,736.60
HOLOGIC INC	8,758	17.11	149,849.38
HUMANA INC	5,785	79.02	457,130.70
INTUITIVE SURGICAL INC	1,340	527.98	707,493.20
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,685	87.09	320,926.65
MCKESSON CORP	8,464	89.84	760,405.76
MEDTRONIC INC	37,522	37.49	1,406,699.78
OMNICARE INC	3,640	30.65	111,566.00
PATTERSON COS INC	3,142	32.74	102,869.08
QUEST DIAGNOSTICS	5,866	56.16	329,434.56
ST JUDE MEDICAL INC	10,490	35.59	373,339.10
STRYKER CORP	9,683	52.34	506,808.22
UNITEDHEALTH GROUP INC	37,990	59.25	2,250,907.50
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,304	59.39	255,614.56
WELLPOINT INC	12,086	69.80	843,602.80
ZIMMER HOLDINGS INC	5,762	60.63	349,350.06
ABBOTT LABORATORIES	55,537	62.14	3,451,069.18
AGILENT TECHNOLOGIES INC	12,200	39.35	480,070.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	6,820	92.96	633,987.20
ALLERGAN INC	11,055	91.64	1,013,080.20
AMGEN INC	28,281	70.42	1,991,548.02
BIOGEN IDEC INC	8,267	138.66	1,146,302.22
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	60,391	34.55	2,086,509.05
CELGENE CORP	15,582	65.91	1,027,009.62
ELI LILLY & CO	37,333	41.81	1,560,892.73
FOREST LABORATORIES INC	9,545	34.89	333,025.05
GILEAD SCIENCES INC	26,597	50.09	1,332,243.73
HOSPIRA INC	6,181	32.36	200,017.16
ILLUMINA INC	4,745	39.26	186,288.70
JOHNSON & JOHNSON	97,359	65.45	6,372,146.55
JOHNSON & JOHNSON(N)	4,282	65.45	280,256.90
LIFE TECHNOLOGIES CORP	6,776	41.87	283,711.12
MERCK & CO. INC.	108,663	38.79	4,215,037.77
MYLAN INC	14,505	21.03	305,040.15
PERRIGO CO	3,180	110.41	351,103.80
PFIZER INC	267,640	22.56	6,037,958.40
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,350	110.89	260,591.50
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	12,914	50.64	653,964.96
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	7,990	55.94	446,960.60
WARNER CHILCOTT PLC	4,500	18.21	81,945.00

WATERS CORP	3,106	80.32	249,473.92
WATSON PHARMACEUTICALS INC	4,705	68.09	320,363.45
BB&T CORP	25,818	29.38	758,532.84
CIT GROUP INC	7,175	33.82	242,658.50
COMERICA INC	7,190	29.60	212,824.00
FIFTH THIRD BANCORP	31,889	13.04	415,832.56
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,330	31.75	73,977.50
HUDSON CITY BANCORP INC	19,870	6.10	121,207.00
KEYCORP	34,838	7.28	253,620.64
M & T BANK CORP	4,273	80.27	342,993.71
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	16,064	12.21	196,141.44
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	10,750	11.60	124,700.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	19,370	57.90	1,121,523.00
REGIONS FINANCIAL CORP	45,874	6.33	290,382.42
SUNTRUST BANKS INC	18,667	22.13	413,100.71
US BANCORP	68,011	31.01	2,109,021.11
WELLS FARGO & CO	178,610	32.03	5,720,878.30
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,540	102.49	157,834.60
AMERICAN EXPRESS CO	37,254	55.05	2,050,832.70
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,140	47.92	390,068.80
BANK OF AMERICA CORPORATION	377,789	7.66	2,893,863.74
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	42,492	20.90	888,082.80
BLACKROCK INC	4,415	172.69	762,426.35
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	17,185	53.01	910,976.85
CITIGROUP INC	104,237	27.91	2,909,254.67
CME GROUP INC	2,306	272.89	629,284.34
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	19,360	32.37	626,683.20
EATON VANCE CORP	3,790	24.74	93,764.60
FRANKLIN RESOURCES INC	5,525	105.64	583,661.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,668	93.82	1,563,791.76
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	2,760	128.79	355,460.40
INVESCO LTD	17,037	21.91	373,280.67
JPMORGAN CHASE & CO	135,470	34.65	4,694,035.50
LEGG MASON INC	5,775	24.95	144,086.25
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	20.74	151,505.70
MOODY'S CORP	7,797	35.08	273,518.76
MORGAN STANLEY	52,185	13.93	726,937.05
NASDAQ OMX GROUP/THE	5,095	21.27	108,370.65
NORTHERN TRUST CORP	7,340	43.64	320,317.60
NYSE EURONEXT	9,700	24.25	235,225.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	36,334	12.36	449,088.24
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,325	18.20	78,715.00
SLM CORP	19,832	14.53	288,158.96
STATE STREET CORP	17,917	43.30	775,806.10
T ROWE PRICE GROUP INC	8,825	59.76	527,382.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	8,530	16.81	143,389.30
ACE LTD	12,083	72.61	877,346.63
AFLAC INC	16,432	41.63	684,064.16
ALLEGHANY CORP	400	331.99	132,796.00
ALLSTATE CORP	18,543	34.44	638,620.92
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	20,435	31.03	634,098.05
AON PLC	10,247	46.43	475,768.21
ARCH CAPITAL GROUP LTD	5,295	37.65	199,356.75
ASSURANT INC	3,640	33.71	122,704.40

AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	4,795	32.51	155,885.45
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	32,330	81.72	2,642,007.60
CHUBB CORP	10,453	71.33	745,612.49
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,340	36.44	231,029.60
EVEREST RE GROUP LTD	2,074	103.51	214,679.74
FIDELITY NATIONAL FINL-A	5,881	19.41	114,150.21
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	18,645	5.17	96,394.65
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	14,002	16.88	236,353.76
LINCOLN NATIONAL CORP	9,373	21.21	198,801.33
LOEWS CORP	10,945	39.71	434,625.95
MARSH & MCLENNAN COS	19,203	31.86	611,807.58
METLIFE INC	29,705	29.17	866,494.85
PARTNERRE LTD	2,372	71.81	170,333.32
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,290	25.32	260,542.80
PROGRESSIVE CORP	22,020	20.77	457,355.40
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	16,462	47.80	786,883.60
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,497	74.20	111,077.40
TORCHMARK CORP	3,101	47.98	148,785.98
TRAVELERS COS INC/THE	15,224	63.12	960,938.88
UNUM GROUP	10,918	19.09	208,424.62
WILLIS GROUP HOLDING	6,260	35.11	219,788.60
WR BERKLEY CORP	4,253	38.28	162,804.84
XL GROUP PLC	9,680	20.27	196,213.60
CBRE GROUP INC	11,490	15.88	182,461.20
ACCENTURE PLC-CL A	22,708	57.84	1,313,430.72
ACTIVISION BLIZZARD INC	19,170	11.53	221,030.10
ADOBE SYSTEMS INC	18,109	31.67	573,512.03
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	7,210	29.95	215,939.50
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,595	126.70	202,086.50
ANSYS INC	2,800	62.53	175,084.00
AUTODESK INC	7,690	32.08	246,695.20
AUTOMATIC DATA PROCESSING	17,046	54.42	927,643.32
BMC SOFTWARE INC	6,394	43.00	274,942.00
CA INC	12,770	25.82	329,721.40
CITRIX SYSTEMS INC	6,488	76.75	497,954.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	10,309	59.14	609,674.26
COMPUTER SCIENCES CORP	5,583	24.31	135,722.73
EBAY INC	41,077	40.13	1,648,420.01
ELECTRONIC ARTS INC	12,614	12.32	155,404.48
EQUINIX INC	1,450	169.73	246,108.50
FACEBOOK INC-A	14,000	28.29	396,060.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	9,055	32.59	295,102.45
FISERV INC	5,139	69.73	358,342.47
GOOGLE INC-CL A	9,126	559.05	5,101,890.30
INTL BUSINESS MACHINES CORP	39,102	195.10	7,628,800.20
INTUIT INC	9,976	57.37	572,323.12
LINKEDIN CORP - A	1,210	98.29	118,930.90
MASTERCARD INC-CLASS A	3,890	419.05	1,630,104.50
MICROSOFT CORP	269,924	29.34	7,919,570.16
NUANCE COMMUNICATIONS INC	9,350	20.68	193,358.00
ORACLE CORP	143,883	26.91	3,871,891.53
PAYCHEX INC	11,862	31.72	376,262.64
RACKSPACE HOSTING INC	3,210	41.30	132,573.00
RED HAT INC	7,270	54.15	393,670.50

SAIC INC	10,745	11.65	125,179.25	
SALESFORCE.COM INC	4,690	129.36	606,698.40	
SYMANTEC CORP	27,165	14.56	395,522.40	
SYNOPSIS INC	4,627	28.84	133,442.68	
TERADATA CORP	5,595	69.29	387,677.55	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,506	23.53	106,026.18	

[次へ](#)

VERIFONE SYSTEMS INC	3,110	30.35	94,388.50
VERISIGN INC	5,190	42.01	218,031.90
VISA INC-CLASS A SHARES	18,585	116.49	2,164,966.65
VMWARE INC	3,115	88.60	275,989.00
WESTERN UNION CO	20,081	16.08	322,902.48
YAHOO! INC	44,155	15.36	678,220.80
AMPHENOL CORP-CL A	6,280	54.41	341,694.80
APPLE COMPUTER INC	33,136	571.53	18,938,218.08
ARROW ELECTRONICS INC	4,490	33.42	150,055.80
AVNET INC	4,620	30.75	142,065.00
CISCO SYSTEMS INC	191,660	16.92	3,242,887.20
CORNING INC	57,428	13.02	747,712.56
DELL INC	56,836	12.34	701,356.24
DOLBY LABORATORIES INC CLASS A	2,100	42.09	88,389.00
EMC CORP/MASS	72,699	23.98	1,743,322.02
F5 NETWORKS INC	3,005	100.51	302,032.55
FLEXTRONICS INTL LTD	27,456	6.30	172,972.80
FLIR SYSTEMS INC	5,565	19.95	111,021.75
HARRIS CORP	4,560	40.79	186,002.40
HEWLETT-PACKARD CO	70,815	21.59	1,528,895.85
JUNIPER NETWORKS INC	19,573	16.20	317,082.60
MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,375	47.35	443,906.25
NETAPP INC	13,486	30.09	405,793.74
QUALCOMM INC	59,932	56.79	3,403,538.28
SANDISK CORP	8,963	35.55	318,634.65
SEAGATE TECHNOLOGY	15,444	23.44	362,007.36
TE CONNECTIVITY LTD	14,455	32.16	464,872.80
TRIMBLE NAVIGATION LTD	3,770	45.44	171,308.80
WESTERN DIGITAL CORP	8,555	30.20	258,361.00
XEROX CORP	45,964	7.62	350,245.68
AT&T INC	211,276	35.69	7,540,440.44
CENTURYLINK INC	22,876	37.71	862,653.96
CROWN CASTLE INTL CORP	10,700	57.50	615,250.00
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	39,734	3.72	147,810.48
METROPCS COMMUNICATIONS INC	8,725	5.80	50,605.00
NII HOLDINGS INC	6,497	11.15	72,441.55
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	4,610	53.57	246,957.70
SPRINT NEXTEL CORP	111,942	3.10	347,020.20
VERIZON COMMUNICATIONS INC	100,933	43.75	4,415,818.75
WINDSTREAM CORP	20,465	9.47	193,803.55
AES CORP	24,528	12.62	309,543.36
ALLIANT ENERGY CORP	3,610	45.11	162,847.10
AMEREN CORPORATION	8,922	33.23	296,478.06
AMERICAN ELECTRIC POWER	17,008	39.84	677,598.72
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5,875	33.98	199,632.50
CALPINE CORP	12,490	16.37	204,461.30
CENTERPOINT ENERGY INC	14,762	20.41	301,292.42
CMS ENERGY CORP	7,820	23.66	185,021.20
CONSOLIDATED EDISON INC	10,856	62.58	679,368.48
DOMINION RESOURCES INC/VA	19,857	53.72	1,066,718.04
DTE ENERGY COMPANY	5,638	59.47	335,291.86
DUKE ENERGY CORP	49,023	23.14	1,134,392.22
EDISON INTERNATIONAL	10,619	46.06	489,111.14
ENERGY CORP	6,547	66.10	432,756.70

EXELON CORP	31,176	37.79	1,178,141.04	
FIRSTENERGY CORP	14,755	48.04	708,830.20	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	2,420	56.27	136,173.40	
MDU RESOURCES GROUP INC	5,280	21.78	114,998.40	
NEXTERA ENERGY INC	14,755	67.51	996,110.05	
NISOURCE INC	10,915	25.32	276,367.80	
NORTHEAST UTILITIES	11,400	38.10	434,340.00	
NRG ENERGY INC	9,360	15.09	141,242.40	
ONEOK INC	6,490	42.36	274,916.40	
P G & E CORP	14,601	45.24	660,549.24	
PEPCO HOLDINGS INC	7,192	19.37	139,309.04	
PINNACLE WEST CAPITAL	3,569	51.58	184,089.02	
PPL CORPORATION	21,108	27.73	585,324.84	
PROGRESS ENERGY INC	9,848	60.30	593,834.40	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	16,738	32.06	536,620.28	
SCANA CORP	4,853	47.85	232,216.05	
SEMPRA ENERGY	7,777	67.49	524,869.73	
SOUTHERN CO	30,735	47.62	1,463,600.70	
WISCONSIN ENERGY CORP	7,644	38.94	297,657.36	
XCEL ENERGY INC	18,014	28.75	517,902.50	
ADVANCED MICRO DEVICES	23,671	5.76	136,344.96	
ALTERA CORPORATION	11,116	32.60	362,381.60	
ANALOG DEVICES INC	10,261	36.44	373,910.84	
APPLIED MATERIALS INC	43,833	10.78	472,519.74	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	8,140	33.31	271,143.40	
BROADCOM CORP-CL A	17,556	33.89	594,972.84	
CREE INC	3,840	22.91	87,974.40	
INTEL CORP	177,242	26.98	4,781,989.16	
KLA-TENCOR CORPORATION	6,269	47.31	296,586.39	
LAM RESEARCH CORP	7,027	36.53	256,696.31	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	7,544	29.61	223,377.84	
LSI CORP	20,595	6.19	127,483.05	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	18,834	11.60	218,474.40	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	9,910	25.92	256,867.20	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6,334	31.83	201,611.22	
MICRON TECHNOLOGY INC	32,857	5.76	189,256.32	
NVIDIA CORP	22,805	12.04	274,572.20	
TEXAS INSTRUMENTS INC	40,482	27.73	1,122,565.86	
XILINX INC	9,885	32.08	317,110.80	
米ドル小計	10,946,376		433,173,176.67 (34,437,267,545)	
加ドル				
ARC RESOURCES LTD	10,615	19.71	209,221.65	
ATHABASCA OIL CORP	11,180	10.07	112,582.60	
BAYTEX ENERGY CORP	4,425	43.01	190,319.25	
BONAVISTA ENERGY CORP	4,985	14.00	69,790.00	
CAMECO CORP	13,702	20.45	280,205.90	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	38,714	27.28	1,056,117.92	
CANADIAN OIL SANDS LTD	17,840	19.00	338,960.00	
CENOVUS ENERGY INC	27,213	31.54	858,298.02	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	9,325	38.97	363,395.25	
ENBRIDGE INC	27,035	39.46	1,066,801.10	
ENCANA CORP	24,748	21.39	529,359.72	
ENERPLUS CORP	6,630	12.98	86,057.40	
HUSKY ENERGY INC	10,659	24.17	257,628.03	

IMPERIAL OIL LTD	10,992	43.21	474,964.32
MEG ENERGY CORP	4,510	35.30	159,203.00
NEXEN INC	18,090	16.74	302,826.60
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	9,390	24.60	230,994.00
PEMBINA PIPELINE CORP	10,105	26.62	268,995.10
PENGROWTH ENERGY CORP	12,780	7.02	89,715.60
PENN WEST PETROLEUM LTD	17,873	14.07	251,473.11
PRECISION DRILLING CORP	8,865	7.22	64,005.30
PROGRESS ENERGY RESOURCES CORP	6,275	10.85	68,083.75
SUNCOR ENERGY INC	56,105	28.52	1,600,114.60
TALISMAN ENERGY INC	37,632	11.42	429,757.44
TOURMALINE OIL CORP	4,005	23.95	95,919.75
TRANSCANADA CORP	25,343	42.43	1,075,303.49
VERMILION ENERGY INC	3,000	42.95	128,850.00
AGNICO-EAGLE MINES LTD	6,375	43.11	274,826.25
AGRIUM INC	5,415	83.63	452,856.45
BARRICK GOLD CORP	35,644	39.84	1,420,056.96
CENTERRA GOLD INC	6,530	11.82	77,184.60
ELDORADO GOLD CORP	20,510	12.92	264,989.20
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	17,720	18.95	335,794.00
FRANCO-NEVADA CORP	4,495	47.08	211,624.60
GOLDCORP INC	28,737	40.57	1,165,860.09
IAMGOLD CORP	14,165	12.87	182,303.55
INMET MINING CORPORATION	2,100	41.85	87,885.00
IVANHOE MINES LTD	9,940	10.66	105,960.40
KINROSS GOLD CORP	42,395	8.92	378,163.40
NEW GOLD INC	16,160	10.34	167,094.40
OSISKO MINING CORP	13,590	8.33	113,204.70
PAN AMERICAN SILVER CORP	4,115	18.68	76,868.20
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	30,267	38.77	1,173,451.59
SILVER WHEATON CORP	12,035	28.82	346,848.70
TECK RESOURCES LTD-CLS B	20,625	32.54	671,137.50
YAMANA GOLD INC	24,996	16.71	417,683.16
BOMBARDIER INC 'B'	52,816	3.81	201,228.96
CAE INC	10,675	9.67	103,227.25
FINNING INTERNATIONAL INC	6,675	22.75	151,856.25
SNC-LAVALIN GROUP INC	5,715	39.98	228,485.70
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3,295	19.90	65,570.50
CANADIAN NATL RAILWAY CO	15,814	82.67	1,307,343.38
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,245	72.72	454,136.40
MAGNA INTERNATIONAL INC	7,039	39.63	278,955.57
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,920	27.90	109,368.00
TIM HORTONS INC	6,045	54.10	327,034.50
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	13,305	19.16	254,923.80
THOMSON REUTERS CORP	13,504	28.18	380,542.72
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,970	66.81	198,425.70
ALIMENTATION COUCHE SUB VTG	4,700	41.10	193,170.00
EMPIRE CO LTD 'A'	1,000	54.21	54,210.00
LOBLAW COMPANIES LTD	3,849	32.21	123,976.29
METRO INC	3,090	49.72	153,634.80
SHOPPERS DRUG MART INC	7,155	39.81	284,840.55
WESTON (GEORGE) LTD	1,872	57.66	107,939.52
SAPUTO INC	5,200	40.99	213,148.00
SXC HEALTH SOLUTIONS CORP	1,880	97.18	182,698.40

VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	10,754	47.06	506,083.24	
BANK OF MONTREAL	22,811	54.75	1,248,902.25	
BANK OF NOVA SCOTIA	38,829	52.00	2,019,108.00	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	14,655	71.05	1,041,237.75	
NATIONAL BANK OF CANADA	5,470	73.00	399,310.00	
ROYAL BANK OF CANADA	51,279	50.85	2,607,537.15	
TORONTO-DOMINION BANK	32,160	78.79	2,533,886.40	
CI FINANCIAL CORP	5,690	21.44	121,993.60	
IGM FINANCIAL INC	4,295	39.01	167,547.95	
ONEX CORPORATION	3,845	38.54	148,186.30	
TMX GROUP INC	2,295	45.85	105,225.75	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	752	394.65	296,776.80	
GREAT-WEST LIFECO INC	11,084	21.20	234,980.80	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	2,905	21.42	62,225.10	
INTACT FINANCIAL CORP	4,025	60.39	243,069.75	
MANULIFE FINANCIAL CORP	62,111	10.57	656,513.27	
POWER CORP OF CANADA	12,990	23.22	301,627.80	
POWER FINANCIAL CORP	9,735	25.39	247,171.65	
SUN LIFE FINANCIAL INC	21,564	21.80	470,095.20	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	19,852	32.60	647,175.20	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES CORP	8,664	17.23	149,280.72	
CGI GROUP INC - CL A	8,920	23.12	206,230.40	
OPEN TEXT CORPORATION	2,255	47.50	107,112.50	
RESEARCH IN MOTION	16,878	10.61	179,075.58	
BCE INC	8,930	41.46	370,237.80	
BELL ALIANT INC	2,800	24.58	68,824.00	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	13,665	35.41	483,877.65	
TELUS CORP	1,615	59.27	95,721.05	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	5,628	57.85	325,579.80	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	3,115	66.25	206,368.75	
FORTIS INC	7,035	33.21	233,632.35	
TRANSALTA CORP	7,950	17.18	136,581.00	
加ドル小計	1,349,170		40,578,627.50 (3,150,524,639)	
豪ドル				
CALTEX AUSTRALIA LTD	4,575	13.36	61,122.00	
ORIGIN ENERGY LTD	40,210	12.75	512,677.50	
SANTOS LTD	33,605	11.58	389,145.90	
WHITEHAVEN COAL LTD	15,000	4.19	62,850.00	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	23,318	32.04	747,108.72	
WORLEYPARSONS LTD	7,260	25.19	182,879.40	
ALUMINA LTD	94,332	0.91	86,313.78	
AMCOR LIMITED	44,030	7.46	328,463.80	
BHP BILLITON LTD	114,496	31.80	3,640,972.80	
BORAL LTD	28,545	3.38	96,482.10	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	46,275	4.69	217,029.75	
ILUKA RESOURCES LTD	15,185	11.78	178,879.30	
INCITEC PIVOT LTD	53,090	2.63	139,626.70	
JAMES HARDIE INDUSTRIES SE	13,935	7.57	105,487.95	
LYNAS CORP LTD	61,300	0.91	56,089.50	
NEWCREST MINING LTD	27,889	24.42	681,049.38	
ORICA LIMITED	13,435	23.77	319,349.95	
OZ MINERALS LTD	10,381	8.25	85,643.25	
RIO TINTO LTD	15,088	54.27	818,825.76	
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	6,495	9.75	63,326.25	

LEIGHTON HOLDINGS LTD	5,867	16.65	97,685.55	
BRAMBLES LTD	53,968	6.15	331,903.20	
BRAMBLES LTD-RTS	2,698	0.26	714.97	
CAMPBELL BROTHERS LTD	2,540	52.33	132,918.20	
ASCIANO LTD	36,333	4.27	155,141.91	
QANTAS AIRWAYS LTD	34,245	1.14	39,039.30	
QR NATIONAL LTD	59,950	3.34	200,233.00	
SYDNEY AIRPORT	16,920	2.94	49,744.80	
TOLL HOLDINGS LTD	24,745	4.24	104,918.80	
TRANSURBAN GROUP	47,535	5.68	269,998.80	
CROWN LTD	10,705	8.58	91,848.90	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	23,977	4.49	107,656.73	
TABCORP HOLDINGS LTD	23,977	2.94	70,492.38	
TATTS GROUP LTD	42,460	2.66	112,943.60	
FAIRFAX MEDIA LTD	69,685	0.60	41,811.00	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	15,840	1.87	29,700.00	
METCASH LTD	31,790	4.00	127,160.00	
WESFARMERS LTD	35,260	28.97	1,021,482.20	
WOOLWORTHS LTD	43,332	26.39	1,143,531.48	
COCA-COLA AMATIL LTD	20,630	13.15	271,284.50	
COCHLEAR LTD	2,157	62.91	135,696.87	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	4,895	21.87	107,053.65	
SONIC HEALTHCARE LTD	14,760	12.54	185,090.40	
CSL LTD	17,982	39.20	704,894.40	
AUST AND NZ BANKING GROUP	93,899	21.36	2,005,682.64	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	15,708	7.29	114,511.32	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	56,197	50.57	2,841,882.29	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	78,553	22.06	1,732,879.18	
WESTPAC BANKING CORP	108,011	20.29	2,191,543.19	
ASX LTD	6,590	29.34	193,350.60	
MACQUARIE GROUP LTD	11,946	25.14	300,322.44	
AMP LTD	96,747	3.81	368,606.07	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	73,478	3.30	242,477.40	
QBE INSURANCE GROUP LTD	40,780	12.37	504,448.60	
SUNCORP GROUP LTD	46,700	7.91	369,397.00	
COMPUTERSHARE LTD	17,960	7.80	140,088.00	
TELSTRA CORPORATION LTD	165,734	3.60	596,642.40	
AGL ENERGY LTD	14,290	15.13	216,207.70	
AGL ENERGY LTD-RTS	2,381	3.47	8,262.07	
豪ドル小計	2,139,669		26,132,569.33 (2,079,107,215)	
英ポンド				
AMEC PLC	13,270	9.52	126,396.75	
BG GROUP PLC	120,994	12.26	1,483,386.44	
BP PLC	676,088	4.16	2,817,258.69	
PETROFAC LTD	9,765	14.57	142,276.05	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	129,818	20.88	2,710,599.84	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	94,914	21.71	2,060,582.94	
TULLOW OIL PLC	33,380	14.27	476,332.60	
ANGLO AMERICAN PLC	47,164	20.92	986,670.88	
ANTOFAGASTA PLC	14,880	10.54	156,835.20	
BHP BILLITON PLC	75,271	17.76	1,337,189.31	
CRODA INTERNATIONAL PLC	3,900	22.05	85,995.00	
EURASIAN NATURAL RESOURCES	10,270	3.90	40,135.16	
FRESNILLO PLC	6,750	14.52	98,010.00	

GLENCORE INTERNATIONAL-WI	50,495	3.41	172,541.41
JOHNSON MATTHEY PLC	7,174	22.25	159,621.50
KAZAKHMYS PLC-	7,325	6.95	50,945.37
LONMIN PLC	5,310	7.19	38,205.45
RANDGOLD RESOURCES LTD	3,050	58.85	179,492.50
REXAM PLC	32,225	4.03	129,898.97
RIO TINTO PLC	48,905	28.66	1,401,617.30
VEDANTA RESOURCES PLC	3,810	9.03	34,404.30
XSTRATA PLC	73,160	8.99	658,147.36
BAE SYSTEMS PLC ORD	108,535	2.77	300,859.02
BALFOUR BEATTY PLC	18,710	2.79	52,331.87
BUNZL PLC	10,376	10.35	107,391.60
COBHAM PLC	34,695	2.36	81,880.20
IMI PLC	9,210	8.37	77,133.75
INVENSYS PLC	27,080	1.99	54,024.60
MEGGITT PLC	29,235	3.64	106,620.04
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	65,155	8.31	541,438.05
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-C ENT S	6,906,430	0.00	6,906.43
SMITHS GROUP PLC	14,563	9.87	143,809.62
WEIR GROUP PLC/THE	6,800	14.00	95,200.00
WOLSELEY PLC	9,330	21.53	200,874.90
AGGREKO PLC	10,021	21.60	216,453.60
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	9,775	8.79	85,971.12
CAPITA PLC	23,289	6.50	151,378.50
EXPERIAN PLC	34,088	9.36	319,234.12
G4S PLC	55,329	2.74	151,933.43
INTERTEK GROUP PLC	6,595	26.11	172,195.45
SERCO GROUP PLC	19,895	5.46	108,626.70
GKN PLC	58,715	1.75	102,927.39
BURBERRY GROUP PLC	16,414	12.98	213,053.72
CARNIVAL PLC	6,710	21.76	146,009.60
COMPASS GROUP PLC	63,908	6.36	406,454.88
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	8,967	14.95	134,056.65
TUI TRAVEL PLC	21,725	1.58	34,521.02
WHITBREAD PLC	6,950	18.24	126,768.00
BRITISH SKY BROADCASTING GRO	41,474	6.71	278,290.54
ITV PLC	147,795	0.71	106,116.81
PEARSON PLC	27,619	11.84	327,008.96
REED ELSEVIER PLC	39,836	4.84	192,846.07
WPP PLC	46,044	7.44	342,797.58
KINGFISHER PLC	77,657	2.71	210,994.06
MARKS & SPENCER GROUP PLC	58,200	3.23	187,986.00
NEXT PLC	6,637	31.10	206,410.70
SAINSBURY (J) PLC	44,131	2.84	125,729.21
TESCO PLC	282,324	3.05	861,794.01
WM MORRISON SUPERMARKETS	79,475	2.77	220,543.12
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,365	12.10	161,716.50
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	70,217	31.37	2,203,058.37
DIAGEO PLC	89,042	15.99	1,423,781.58
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	35,722	23.85	851,969.70
SABMILLER PLC	33,961	24.39	828,308.79
TATE & LYLE PLC	17,580	6.47	113,830.50
UNILEVER PLC	45,327	20.98	950,960.46
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	22,925	34.40	788,620.00

SMITH & NEPHEW PLC	33,686	6.11	205,989.89	
ASTRAZENECA PLC	46,433	26.99	1,253,458.83	
GLAXOSMITHKLINE PLC	179,971	14.59	2,626,676.74	
SHIRE PLC	19,855	18.94	376,053.70	
BARCLAYS PLC	409,411	1.92	789,139.70	
HSBC HOLDINGS PLC	637,031	5.45	3,475,004.10	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,500,886	0.29	446,513.58	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	68,120	2.29	156,267.28	
STANDARD CHARTERED PLC	84,869	13.75	1,166,948.75	
3I GROUP PLC	39,379	1.78	70,370.27	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	22,730	2.47	56,211.29	
ICAP PLC	23,340	3.50	81,690.00	
INVESTEC PLC	13,185	3.49	46,028.83	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	4,068	9.84	40,029.12	
MAN GROUP PLC	68,256	0.69	47,199.02	
SCHRODERS PLC	4,981	12.43	61,913.83	
ADMIRAL GROUP PLC	6,965	11.40	79,401.00	
AVIVA PLC	98,450	2.64	260,498.70	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	198,871	1.19	237,650.84	
OLD MUTUAL PLC	166,919	1.49	249,376.98	
PRUDENTIAL PLC	89,372	7.10	634,541.20	
RESOLUTION LTD	51,593	1.97	101,689.80	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	123,607	1.01	125,337.49	
STANDARD LIFE PLC	87,275	2.19	191,481.35	
SAGE GROUP PLC/THE	43,845	2.47	108,604.06	
BT GROUP PLC	278,462	2.01	561,657.85	
INMARSAT PLC	16,910	4.75	80,339.41	
VODAFONE GROUP PLC	1,792,435	1.75	3,151,100.73	
CENTRICA PLC	176,265	3.12	550,828.12	
INTERNATIONAL POWER PLC	58,505	4.16	243,790.33	
NATIONAL GRID PLC	125,425	6.60	827,805.00	
SEVERN TRENT PLC	9,623	17.96	172,829.08	
SSE PLC	34,057	13.90	473,392.30	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,735	6.80	181,931.67	
ARM HOLDINGS PLC	50,630	5.02	254,162.60	
英ボンド小計	16,821,894		49,253,273.68 (6,086,227,028)	
スイスフラン				
TRANSOCEAN LTD	11,995	40.42	484,837.90	
GIVAUDAN-REG	328	914.50	299,956.00	
HOLCIM LIMITED-REG SHRS	8,463	49.53	419,172.39	
SIKA AG-BR	85	1,778.00	151,130.00	
SYNGENTA AG-REG	3,271	310.00	1,014,010.00	
ABB LTD-REG	78,125	15.27	1,192,968.75	
GEBERIT AG-REG	1,525	176.40	269,010.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	780	107.70	84,006.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,900	106.30	201,970.00	
SULZER AG-REG	870	108.40	94,308.00	
ADECCO SA-REG	4,757	38.11	181,289.27	
SGS SA-REG	201	1,781.00	357,981.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,020	103.20	208,464.00	
CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	18,579	52.05	967,036.95	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,065	356.00	379,140.00	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,520	62.05	94,316.00	
ARYZTA AG	2,630	44.60	117,298.00	

LINDT & SPRUENGLI AG-PC	25	2,970.00	74,250.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	35,600.00	142,400.00	
NESTLE SA-REG	117,653	55.95	6,582,685.35	
SONOVA HOLDING AG-REG	1,940	92.00	178,480.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	211	147.10	31,038.10	
ACTELION LTD-REG	4,640	36.43	169,035.20	
LONZA GROUP AG-REG	1,650	34.19	56,413.50	
NOVARTIS AG-REG	81,583	51.05	4,164,812.15	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	25,048	157.10	3,935,040.80	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	39,495	17.01	671,809.95	
GAM HOLDING LTD	5,635	10.50	59,167.50	
JULIUS BAER GROUP LTD	6,780	32.59	220,960.20	
PARGESA HOLDING SA-BR	975	53.75	52,406.25	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	500	158.70	79,350.00	
UBS AG-REG	129,702	11.12	1,442,286.24	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,390	61.15	84,998.50	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	850	78.00	66,300.00	
SWISS RE LTD	12,679	55.85	708,122.15	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,241	205.80	1,078,597.80	
SWISS PRIME SITE-REG	1,370	78.75	107,887.50	
SWISSCOM AG-REG	894	368.30	329,260.20	
スイスフラン小計	576,379		26,752,195.65 (2,234,343,380)	
香港ドル				
HOPEWELL HOLDINGS	29,000	19.94	578,260.00	
HUTCHISON WHAMPOA LTD	78,823	63.35	4,993,437.05	
NWS HOLDINGS LTD	48,500	11.24	545,140.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	37,000	11.90	440,300.00	
MTR CORP	54,500	24.90	1,357,050.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	6,000	38.00	228,000.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	24,500	23.60	578,200.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	45,000	18.82	846,900.00	
SANDS CHINA LTD	92,600	25.45	2,356,670.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	48,000	14.88	714,240.00	
SJM HOLDINGS LTD	57,000	13.86	790,020.00	
WYNN MACAU LTD	58,200	18.46	1,074,372.00	
LI & FUNG LTD	210,000	14.82	3,112,200.00	
LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	15,500	16.88	261,640.00	
BANK OF EAST ASIA	50,640	25.35	1,283,724.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	137,500	22.20	3,052,500.00	
HANG SENG BANK LTD	28,600	102.60	2,934,360.00	
WING HANG BANK LTD	7,500	74.70	560,250.00	
FIRST PACIFIC CO	80,000	7.98	638,400.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	34,900	109.50	3,821,550.00	
AIA GROUP LTD	355,600	25.85	9,192,260.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	47,682	89.50	4,267,539.00	
HANG LUNG GROUP LTD	33,000	45.75	1,509,750.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	90,000	25.20	2,268,000.00	
HENDERSON LAND DVLP CO LTD	37,426	40.15	1,502,653.90	
HYSAN DEVELOPMENT CO	22,000	30.35	667,700.00	
KERRY PROPERTIES LTD	27,950	29.90	835,705.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	131,000	8.96	1,173,760.00	
SINO LAND CO	105,050	10.92	1,147,146.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	51,480	89.00	4,581,720.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	24,017	86.45	2,076,269.65	

WHARF HOLDINGS LTD	57,800	41.95	2,424,710.00	
WHEELLOCK & CO LTD	34,000	26.35	895,900.00	
FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	76,000	3.19	242,440.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	15,000	42.80	642,000.00	
CLP HOLDINGS LTD	72,000	63.20	4,550,400.00	
HONG KONG & CHINA GAS	165,156	16.28	2,688,739.68	
HONG KONG & CHINA GAS(N)	16,515	16.28	268,864.20	
POWER ASSETS HOLDINGS	52,500	55.40	2,908,500.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	93.00	604,500.00	
香港ドル小計	2,564,439		74,615,770.48 (764,811,647)	
シンガポールドル				
COSCO CORP SINGAPORE LTD	4,000	0.96	3,860.00	
FRASER AND NEAVE LTD	37,000	6.71	248,270.00	
KEPPEL CORP LTD	49,660	10.02	497,593.20	
NOBLE GROUP LTD	141,854	1.12	158,876.48	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	32,000	4.91	157,120.00	
SEMBCORP MARINE LTD	27,000	4.39	118,530.00	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	64,000	2.91	186,240.00	
YANGZIJANG SHIPBUILDING	71,000	0.99	70,645.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	77,000	1.47	113,190.00	
NEPTUNE ORIENT LINES LTD	30,000	1.05	31,650.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	20,800	10.10	210,080.00	
GENTING SINGAPORE PLC	222,000	1.43	318,570.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	55,050	3.75	206,437.50	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,000	42.57	170,280.00	
OLAM INTERNATIONAL LTD	47,000	1.80	84,600.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	220,000	0.63	139,700.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	74,000	3.41	252,340.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	60,625	13.28	805,100.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	96,240	8.45	813,228.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	45,300	17.71	802,263.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	28,000	6.18	173,040.00	
CAPITALAND LTD	101,000	2.62	264,620.00	
CAPITAMALLS ASIA LTD	50,000	1.42	71,250.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	20,000	10.22	204,400.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	60,000	2.12	127,200.00	
KEPPEL LAND LTD	30,000	2.95	88,500.00	
UOL GROUP LTD	12,250	4.69	57,452.50	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	276,810	3.14	869,183.40	
シンガポールドル小計	1,956,589		7,244,219.08 (450,373,100)	
ニュージーランドドル				
FLETCHER BUILDING LTD	23,390	6.15	143,848.50	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	43,390	2.47	107,390.25	
SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	19,990	3.47	69,365.30	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	72,897	2.40	174,952.80	
CONTACT ENERGY LIMITED	9,430	4.69	44,226.70	
ニュージーランドドル小計	169,097		539,783.55 (33,525,956)	
スウェーデンクローナ				
LUNDIN PETROLEUM AB	8,370	127.50	1,067,175.00	
BOLIDEN AB	7,620	91.65	698,373.00	
HOLMEN AB-B SHS	1,885	185.00	348,725.00	
SSAB AB-A SHARES	6,295	52.30	329,228.50	

SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	21,345	104.50	2,230,552.50	
ALFA LAVAL AB	12,110	115.20	1,395,072.00	
ASSA ABLOY AB-B	11,670	180.00	2,100,600.00	
ATLAS COPCO AB-A SHS	22,945	138.30	3,173,293.50	

[次へ](#)

ATLAS COPCO AB-B SHS	14,760	122.80	1,812,528.00	
SANDVIK AB	34,950	85.25	2,979,487.50	
SCANIA AB-B SHS	12,030	116.60	1,402,698.00	
SKANSKA AB-B SHS	14,750	96.55	1,424,112.50	
SKF AB-B SHS	12,949	131.50	1,702,793.50	
VOLVO AB-B SHARES	50,800	76.85	3,903,980.00	
SECURITAS AB-B SHS	12,199	53.00	646,547.00	
ELECTROLUX AB - B	8,875	125.20	1,111,150.00	
HUSQVARNA AB-B SHS	14,220	29.63	421,338.60	
MODERN TIMES GROUP-B SHS	1,325	292.90	388,092.50	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	33,298	220.00	7,325,560.00	
SWEDISH MATCH AB	6,530	276.50	1,805,545.00	
ELEKTA AB-B SHS	2,610	327.00	853,470.00	
GETINGE AB-B SHS	7,610	178.70	1,359,907.00	
NORDEA BANK AB	96,108	56.00	5,382,048.00	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	44,630	42.32	1,888,741.60	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	18,130	210.50	3,816,365.00	
SWEDBANK AB - A SHARES	30,470	106.90	3,257,243.00	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,390	84.45	370,735.50	
INVESTOR AB-B SHS	14,365	126.10	1,811,426.50	
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	6,715	128.00	859,520.00	
RATOS AB-B SHS	7,000	61.10	427,700.00	
ERICSSON LM-B SHS	104,455	62.00	6,476,210.00	
HEXAGON AB-B SHS	8,970	118.60	1,063,842.00	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2,970	636.50	1,890,405.00	
TELE2 AB-B SHS	12,235	104.20	1,274,887.00	
TELIASONERA AB	80,590	43.96	3,542,736.40	
スウェーデンクローナ小計	750,174		70,542,089.10 (799,241,869)	
ノルウェークローネ				
AKER SOLUTIONS ASA	6,800	73.80	501,840.00	
SEADRILL LTD	11,325	197.70	2,238,952.50	
STATOIL ASA	41,084	135.70	5,575,098.80	
SUBSEA 7 SA	10,615	116.70	1,238,770.50	
NORSK HYDRO A S	34,250	25.97	889,472.50	
YARA INTERNATIONAL ASA	6,300	230.30	1,450,890.00	
ORKLA ASA	28,690	41.19	1,181,741.10	
DNB ASA	31,955	55.00	1,757,525.00	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,250	67.15	486,837.50	
TELENOR ASA	23,945	93.65	2,242,449.25	
ノルウェークローネ小計	202,214		17,563,577.15 (234,649,390)	
デンマーククローネ				
NOVOZYMES A/S-B SHARES	8,275	158.50	1,311,587.50	
A P MOLLER - MAERSK A/S - A	23	34,660.00	797,180.00	
A P MOLLER - MAERSK A/S - B	43	36,280.00	1,560,040.00	
DSV A/S	7,370	109.90	809,963.00	
CARLSBERG AS-B	3,930	427.90	1,681,647.00	
COLOPLAST-B	881	1,039.00	915,359.00	
WILLIAM DEMANT HOLDING	1,000	525.00	525,000.00	
NOVO NORDISK A/S-B	14,395	806.50	11,609,567.50	
DANSKE BANK A/S	23,595	79.60	1,878,162.00	
TRYG A/S	1,045	327.90	342,655.50	
TDC A/S	14,545	37.69	548,201.05	

デンマーククローネ小計	75,102		21,979,362.55 (296,721,394)	
イスラエルシュケル				
ISRAEL CHEMICALS LTD	18,570	38.64	717,544.80	
ISRAEL CORP LIMITED/THE	108	2,105.00	227,340.00	
TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	33,720	149.00	5,024,280.00	
BANK HAPOALIM BM	45,645	12.66	577,865.70	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	50,135	10.24	513,382.40	
NICE SYSTEMS LTD	2,325	141.70	329,452.50	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	68,880	4.36	300,316.80	
イスラエルシュケル小計	219,383		7,690,182.20 (158,263,949)	
ユーロ				
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	4,720	18.44	87,060.40	
ENI SPA	85,646	16.04	1,373,761.84	
FUGRO NV-CVA	2,640	44.92	118,602.00	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	9,315	8.50	79,177.50	
NESTE OIL OYJ	3,590	7.60	27,284.00	
OMV AG	6,300	22.13	139,450.50	
REPSOL YPF SA	28,101	12.43	349,435.93	
SAIPEM SPA	8,980	30.90	277,482.00	
SBM OFFSHORE NV	6,700	10.06	67,402.00	
TECHNIP SA	3,748	75.41	282,636.68	
TENARIS SA	17,925	12.88	230,874.00	
TOTAL SA	75,677	34.87	2,639,235.37	
ACERINOX SA	4,717	7.90	37,273.73	
AIR LIQUIDE	10,197	87.55	892,747.35	
AIR LIQUIDE(N)	1,019	87.55	89,213.45	
AKZO NOBEL NV	8,668	36.97	320,499.30	
ARCELORMITTAL	30,061	10.94	328,867.34	
ARKEMA	2,005	51.01	102,275.05	
BASF SE	32,745	55.10	1,804,249.50	
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	5,550	5.51	30,580.50	
CRH PLC	24,440	13.65	333,606.00	
HEIDELBERGCEMENT AG	5,055	33.09	167,295.22	
IMERYS SA	910	38.32	34,871.20	
K+S AG	5,420	30.67	166,258.50	
KONINKLIJKE DSM NV	5,682	38.04	216,143.28	
LAFARGE SA	7,458	31.81	237,238.98	
LANXESS AG	2,765	48.75	134,793.75	
LINDE AG	6,035	119.60	721,786.00	
SALZGITTER AG	1,685	34.05	57,374.25	
SOLVAY ET CIE SA -A	2,181	80.46	175,483.26	
STORA ENSO OYJ-R SHS	20,375	4.49	91,606.00	
THYSSENKRUPP AG	13,275	11.58	153,724.50	
UMICORE	3,460	36.36	125,822.90	
UPM-KYMMENE OYJ	18,648	8.39	156,456.72	
VOESTALPINE AG	4,239	20.71	87,789.69	
WACKER CHEMIE AG	580	50.94	29,545.20	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	5,146	14.00	72,044.00	
ALSTOM	7,390	23.30	172,187.00	
ANDRITZ AG	1,980	40.33	79,853.40	
BOSKALIS WESTMINSTER	2,855	24.50	69,947.50	
BOUYGUES SA	6,820	19.24	131,250.90	
BRENNTAG AG	1,125	87.98	98,977.50	

COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	13,616	26.38	359,190.08
EADS NV	14,968	26.14	391,338.36
FERROVIAL SA	13,715	8.16	111,928.11
FIAT INDUSTRIAL	28,270	7.31	206,795.05
FINMECCANICA SPA	14,290	2.73	39,097.44
GEA GROUP AG	6,740	19.95	134,496.70
HOCHTIEF AG	1,655	37.30	61,731.50
KONE OYJ-B	5,907	43.96	259,671.72
KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRON	35,731	14.35	512,739.85
LEGRAND SA	7,405	24.91	184,458.55
LEGRAND SA(N)	23	24.91	572.93
MAN SE	2,414	79.78	192,588.92
METSO OYJ	4,900	25.95	127,155.00
PRYSMIAN SPA	5,635	10.82	60,970.70
SAFRAN SA	6,190	26.62	164,808.75
SCHNEIDER ELECTRIC SA	18,018	40.71	733,512.78
SIEMENS AG-REG	29,336	64.84	1,902,146.24
THALES SA	3,505	23.47	82,262.35
VALLOUREC	4,265	25.89	110,442.17
VINCI SA	15,550	32.38	503,509.00
WARTSILA OYJ	6,100	24.30	148,230.00
ZARDOYA OTIS SA	5,219	8.47	44,204.93
ZARDOYA OTIS SA-RTS	5,219	0.42	2,202.41
ZODIAC AEROSPACE	910	79.56	72,399.60
BUREAU VERITAS SA	1,770	68.83	121,829.10
EDENRED	6,096	21.16	129,021.84
RANDSTAD HOLDING NV	4,405	22.41	98,738.07
SOCIETE BIC SA	1,265	79.85	101,010.25
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	14,551	10.01	145,728.26
ADP	1,210	58.09	70,288.90
ATLANTIA SPA	12,070	9.28	112,009.60
DEUTCHE LUFTHANSA	7,870	8.02	63,125.27
DEUTSCHE POST AG	28,343	13.25	375,544.75
FRAPORT AG	980	40.19	39,386.20
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	17,530	6.22	109,089.19
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	31,722	1.77	56,147.94
RYANAIR HOLDINGS PLC	8,345	3.83	31,994.73
TNT EXPRESS NV	13,270	8.94	118,633.80
VOPAK	2,440	49.82	121,573.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	11,825	56.29	665,629.25
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,090	37.29	77,936.10
CONTINENTAL AG	2,915	63.48	185,044.20
DAIMLER AG	32,302	33.59	1,085,185.69
FIAT SPA	26,775	3.46	92,802.15
MICHELIN (CGDE)-B	6,179	46.38	286,612.91
NOKIAN RENKAAT OYJ	4,245	27.97	118,732.65
PEUGEOT SA	8,372	7.34	61,458.85
PIRELLI & C.	9,236	7.69	71,071.02
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,740	40.57	232,871.80
RENAULT SA	6,797	30.55	207,648.35
VOLKSWAGEN AG	1,151	114.90	132,249.90
VOLKSWAGEN AG-PFD	5,133	121.25	622,376.25
ADIDAS AG	7,721	56.46	435,927.66
CHRISTIAN DIOR	2,000	104.50	209,000.00

LUXOTTICA GROUP SPA	3,976	26.10	103,773.60
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	8,989	117.55	1,056,656.95
ACCOR SA	5,606	22.39	125,518.34
AUTOGRILL SPA	3,115	6.53	20,340.95
SODEXO	3,470	59.38	206,048.60
AXEL SPRINGER AG	1,665	32.70	54,445.50
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	21.86	82,977.67
JC DECAUX SA .	2,520	16.76	42,247.80
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	3,080	46.87	144,375.00
LAGARDERE S.C.A.	5,040	18.96	95,583.60
MEDIASET SPA	25,926	1.19	31,033.42
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	2,855	17.12	48,891.87
PUBLICIS GROUPE	4,725	36.80	173,880.00
REED ELSEVIER NV	25,748	8.39	216,128.71
SES	11,190	17.80	199,182.00
WOLTERS KLUWER	11,107	11.61	129,007.80
INDITEX	8,045	76.64	616,568.80
PPR	2,667	110.70	295,236.90
CARREFOUR SA	21,653	13.68	296,213.04
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,004	65.05	130,360.20
COLRUYT SA	2,725	31.81	86,695.87
DELHAIZE GROUP	3,666	26.11	95,719.26
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	22,688	3.48	79,158.43
JERONIMO MARTINS	7,685	13.91	106,936.77
KESKO OYJ-B SHS	2,230	19.49	43,462.70
KONINKLIJKE AHOLD NV	40,664	9.07	368,822.48
METRO AG	4,940	22.17	109,544.50
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	28,611	56.48	1,615,949.28
DANONE	20,644	52.30	1,079,681.20
HEINEKEN HOLDING NV	4,275	32.25	137,890.12
HEINEKEN NV	9,673	38.02	367,767.46
KERRY GROUP PLC-A	5,390	34.93	188,299.65
PERNOD-RICARD SA	7,036	79.43	558,869.48
SUEDZUCKER AG	2,400	25.26	60,636.00
UNILEVER NV-CVA	58,055	25.56	1,484,176.07
BEIERSDORF AG	3,745	52.60	196,987.00
HENKEL AG & CO KGAA	5,110	43.60	222,796.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	5,873	51.51	302,518.23
L'OREAL	8,836	92.22	814,855.92
CELESIO AG	3,620	11.64	42,136.80
ESSILOR INTERNATIONAL	7,395	73.20	541,314.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	7,383	53.26	393,218.58
FRESENIUS SE & CO KGAA	3,985	80.90	322,386.50
BAYER AG	29,470	52.16	1,537,155.20
ELAN CORP PLC	18,000	10.60	190,800.00
GRIFOLS SA	5,290	20.49	108,392.10
MERCK KGAA	2,405	74.66	179,557.30
ORION OYJ-CLASS B	2,590	13.91	36,026.90
QIAGEN N.V.	7,635	13.10	100,018.50
SANOFI	42,526	55.63	2,365,721.38
UCB SA	3,708	38.76	143,722.08
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	153,605	0.18	28,816.29
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	165,663	5.25	871,221.71
BANCO DE SABADELL SA	69,154	1.40	97,023.06

BANCO ESPIRITO SANTO-REG	21,145	0.50	10,678.22
BANCO POPOLARE SCARL	62,764	0.93	58,464.66
BANCO POPULAR ESPANOL	36,697	1.66	60,990.41
BANCO SANTANDER SA	328,137	4.96	1,630,184.61
BNP PARIBAS	34,432	28.27	973,392.64
CAIXABANK	26,440	2.42	64,037.68
COMMERZBANK AG	134,443	1.34	180,691.39
CREDIT AGRICOLE SA	37,252	3.09	115,108.68
ERSTE GROUP BANK AG	7,118	13.95	99,296.10
INTESA SANPAOLO	339,823	1.02	347,299.10
INTESA SANPAOLO-RSP	31,990	0.83	26,775.63
KBC GROEP NV	6,119	15.18	92,886.42
NATIXIS	32,490	1.96	63,907.83
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	1,470	23.10	33,957.00
SOCIETE GENERALE	23,749	16.93	402,070.57
UBI BANCA SCPA	28,684	2.37	68,210.55
UNICREDIT SPA	150,673	2.51	379,093.26
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	32,795	27.81	912,192.92
DEUTSCHE BOERSE AG	7,280	39.45	287,232.40
EURAZEO	1,442	31.50	45,423.00
EURAZEO(N)	72	31.50	2,268.00
EXOR SPA	1,714	16.27	27,886.78
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,912	51.79	150,812.48
ING GROEP NV-CVA	136,975	4.69	643,234.60
MEDIOBANCA SPA	19,150	3.01	57,794.70
POHJOLA BANK PLC	3,875	8.65	33,538.12
WENDEL	1,190	51.58	61,380.20
AEGON NV	56,759	3.24	184,182.95
AGEAS	84,144	1.29	109,218.91
ALLIANZ SE-REG	16,198	73.10	1,184,073.80
ASSICURAZIONI GENERALI	43,088	9.34	402,441.92
AXA	60,722	9.50	577,101.88
CNP ASSURANCES	6,070	8.43	51,194.38
DELTA LLOYD NV	3,600	9.45	34,020.00
HANNOVER RUECKVERSICHERUNGS	2,455	44.00	108,020.00
MAPFRE SA	26,034	1.61	42,096.97
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,536	102.85	672,227.60
SAMPO OYJ-A SHS	15,819	18.92	299,295.48
SCOR SE	6,822	18.08	123,341.76
VIENNA INSURANCE GROUP	1,410	28.84	40,664.40
IMMOEAST AG-TEMPORARY	16,150		
IMMOFINANZ AG	25,580	2.29	58,603.78
IMMOFINANZ AG-TEMPORARY	13,000		
AMADEUS IT HOLDING SA	10,060	15.62	157,137.20
ATOS	1,650	43.61	71,956.50
CAP GEMINI SA	5,469	27.06	147,991.14
DASSAULT SYSTEMES SA	2,315	71.22	164,874.30
SAP AG-COMMON	32,792	45.66	1,497,446.68
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,720	12.95	61,124.00
ALCATEL-LUCENT	91,534	1.18	108,193.18
GEMALTO	2,370	52.30	123,951.00
NOKIA OYJ	137,696	1.82	251,708.28
BELGACOM SA	5,820	21.96	127,807.20
DEUTSCHE TELEKOM AG	101,686	8.10	824,063.34

ELISA OYJ	4,205	15.70	66,018.50	
FRANCE TELECOM SA	66,774	9.72	649,176.82	
ILIAD SA	815	105.50	85,982.50	
KONINKLIJKE KPN NV	54,906	7.91	434,306.46	
MOBISTAR SA	1,279	26.25	33,573.75	
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	27,363	3.26	89,449.64	
TELECOM ITALIA SPA	354,593	0.69	245,023.76	
TELECOM ITALIA-RSP	234,007	0.56	131,511.93	
TELEFONICA SA	146,388	9.93	1,453,632.84	
TELEKOM AUSTRIA AG	14,020	8.03	112,664.72	
VIVENDI	45,840	13.73	629,612.40	
ACCIONA SA	976	40.66	39,689.04	
E.ON AG	63,559	15.02	954,656.18	
ELECTRICITE DE FRANCE	8,795	15.78	138,785.10	
ENAGAS	7,050	13.45	94,857.75	
ENEL GREEN POWER SPA	64,340	1.11	71,610.42	
ENEL SPA	241,704	2.40	581,056.41	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	71,841	1.71	122,848.11	
FORTUM OYJ	16,355	14.23	232,731.65	
GAS NATURAL SDG SA	11,902	9.15	108,903.30	
GDF SUEZ	43,064	16.77	722,183.28	
IBERDROLA SA	129,702	3.40	442,154.11	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,050	33.40	135,270.00	
RWE AG	17,965	29.14	523,589.92	
RWE AG-NON VTG PFD	1,060	26.27	27,846.20	
SNAM SPA	58,840	3.31	194,760.40	
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	10,319	9.12	94,140.23	
TERNA SPA	43,127	2.75	118,944.26	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	13,334	9.53	127,139.69	
VERBUND AG	2,370	19.37	45,906.90	
ASML HOLDING NV	14,652	39.12	573,186.24	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	37,545	5.95	223,693.11	
STMICROELECTRONICS NV	23,623	4.00	94,633.73	
ユーロ小計	6,081,301		68,175,116.53 (6,838,645,939)	
合計	43,851,787		57,563,703,051 (57,563,703,051)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

## (2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	9,660	324,382.80	
		AMERICAN TOWER CORP	13,629	915,868.80	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	34,640	585,069.60	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,475	488,272.25	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,397	557,024.37	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,735	273,103.20	
		DUKE REALTY CORPORATION	6,875	96,112.50	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	10,300	637,776.00	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	2,475	245,470.50	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	13,915	239,616.30	
		HCP INC	14,985	637,611.75	
		HEALTH CARE REIT INC	6,530	369,532.70	

		HOST HOTELS & RESORTS INC	26,659	406,549.75	
		KIMCO REALTY CORPORATION	15,255	281,759.85	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	109,421.95	
		PLUM CREEK TIMBER CO	6,458	241,529.20	
		PROLOGIS INC	17,042	541,253.92	
		PUBLIC STORAGE	5,389	739,748.03	
		RAYONIER INC	5,057	218,361.26	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	2,805	126,140.85	
		SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	10,474	1,552,770.50	
		SL GREEN REALTY CORP	2,650	195,782.00	
		THE MACERICH COMPANY	4,370	244,457.80	
		UDR INC	7,800	202,488.00	
		VENTAS INC	10,295	610,596.45	
		VORNADO REALTY TRUST	5,821	472,898.04	
		WEYERHAEUSER CO	20,336	418,514.88	
	投資証券小計		269,140	11,732,113.25 (932,703,003)	
米ドル合計				11,732,113.25 (932,703,003)	
加ドル	投資証券	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,250	135,975.00	
	投資証券小計		5,250	135,975.00 (10,557,099)	
加ドル合計				135,975.00 (10,557,099)	
豪ドル	投資証券	APA GROUP	19,805	100,015.25	
		CFS RETAIL PROPERTY TRUST GR	67,010	128,994.25	
		DEXUS PROPERTY GROUP	163,705	149,790.07	
		GOODMAN GROUP	54,772	183,486.20	
		GPT GROUP	63,695	204,460.95	
		LEND LEASE GROUP	21,287	155,395.10	
		MIRVAC GROUP	108,455	133,941.92	
		STOCKLAND	86,100	277,242.00	
		WESTFIELD GROUP	80,385	745,972.80	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	107,475	295,556.25		
	投資証券小計		772,689	2,374,854.79 (188,943,447)	
豪ドル合計				2,374,854.79 (188,943,447)	
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	32,561	158,539.50	
		CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	24,090	75,377.61	
		HAMMERSON PLC	30,035	123,714.16	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	28,889	209,878.58	
	SEGRO PLC	20,223	42,751.42		
	投資証券小計		135,798	610,261.27 (75,409,985)	
英ポンド合計				610,261.27 (75,409,985)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	74,500	2,398,900.00	
	投資証券小計		74,500	2,398,900.00 (24,588,725)	
香港ドル合計				2,398,900.00 (24,588,725)	
シンガポ ルドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	62,000	125,240.00	
		CAPITAMALL TRUST	71,800	128,881.00	

	投資証券小計		133,800	254,121.00 (15,798,702)	
シンガポールドル合計				254,121.00 (15,798,702)	
ユーロ	投資証券	CORIO NV	1,998	64,015.92	
		FONCIERE DES REGIONS	1,005	50,913.30	
		GECINA SA	740	50,860.20	
		ICADE	685	41,785.00	
		KLEPIERRE	3,895	98,290.32	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	3,070	424,734.50	
	投資証券小計		11,393	730,599.24 (73,286,409)	
ユーロ合計				730,599.24 (73,286,409)	
合計				1,321,287,370 (1,321,287,370)	

(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 575銘柄	97.4%		58.5%
	投資証券 27銘柄		2.6%	1.6%
加ドル	株式 99銘柄	99.7%		5.4%
	投資証券 1銘柄		0.3%	0.0%
豪ドル	株式 59銘柄	91.7%		3.5%
	投資証券 10銘柄		8.3%	0.3%
英ポンド	株式 102銘柄	98.8%		10.3%
	投資証券 5銘柄		1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%		3.8%
香港ドル	株式 40銘柄	96.9%		1.3%
	投資証券 1銘柄		3.1%	0.0%
シンガポールドル	株式 28銘柄	96.6%		0.8%
	投資証券 2銘柄		3.4%	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 35銘柄	100.0%		1.4%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%		0.4%
デンマーククローネ	株式 11銘柄	100.0%		0.5%
イスラエルシェケル	株式 7銘柄	100.0%		0.3%
ユーロ	株式 237銘柄	98.9%		11.6%
	投資証券 6銘柄		1.1%	0.1%

### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

## 独立監査人の監査報告書

平成24年7月24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12月16日から平成24年6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24年6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XBR Lデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成24年6月15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期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以 上

(注) 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。