

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成21年 8月14日
【計算期間】	第6 特定期間 (自 平成20年11月18日 至 平成21年 5月18日)
【ファンド名】	日興五大陸株式ファンド
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 ビリー・ウェード・ワイルダー
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	犬伏 貴民
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## ファンドの目的

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。

## 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)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		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。

## 海外

目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

## 株式

目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

## インデックス型

目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果をめざす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	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (除く日本)			日経225
	年2回	日本			
	年4回	北米	ファミリーファンド	あり ( )	
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)	欧州			TOPIX
	年12回 (毎月)	アジア			
	日々	オセアニア			
不動産投信	その他 ( )	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし	その他 (合成指数)
その他資産 (投資信託証券(株式一般))		アフリカ			
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		中近東 (中東)			
		エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産（投資信託証券（株式 一般））

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式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、「株式」に分類されます。

年4回

目論見書または投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。

グローバル（除く日本）

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除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

ファミリーファンド

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

為替ヘッジなし

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

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

## ファンドの特色

1) 信託財産の高い成長を求め、新興国を含めた海外の株式を対象に幅広く分散投資を行いません。

日本を除く先進国に新興国を加えて、合計44の国と地域の株式を主な投資対象とします。

### < 投資対象となる企業がある国や地域 >

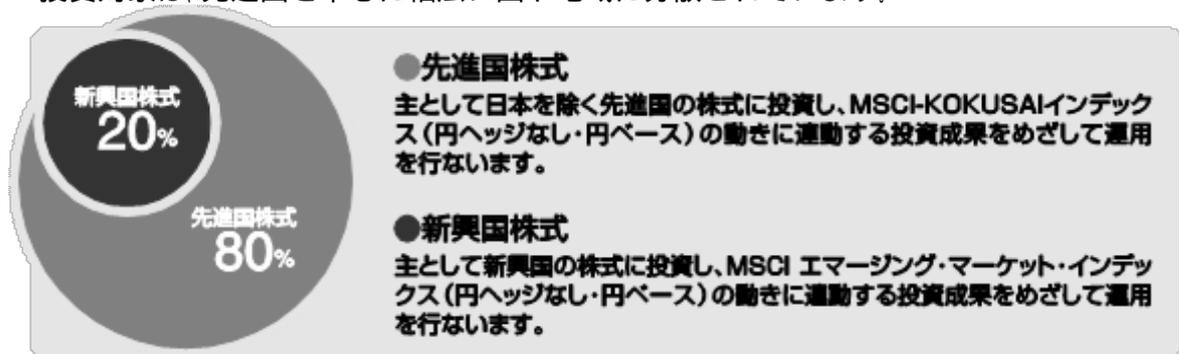


上記は2009年6月末現在のものであり、将来変更となる場合があります。

投資対象には、DR（預託証券）およびカントリーファンドなどを含みます。

実際の運用はファミリーファンド方式で行ないます。ファミリーファンド方式については、後述の「ファンドの仕組み」をご参照ください。

- 2) 基本投資比率は先進国に80%、新興国に20%とします。  
投資対象は、先進国を中心に幅広い国や地域に分散されています。



先進国株式

MSCI-KOKUSAIインデックス(円ヘッジなし・円ベース)

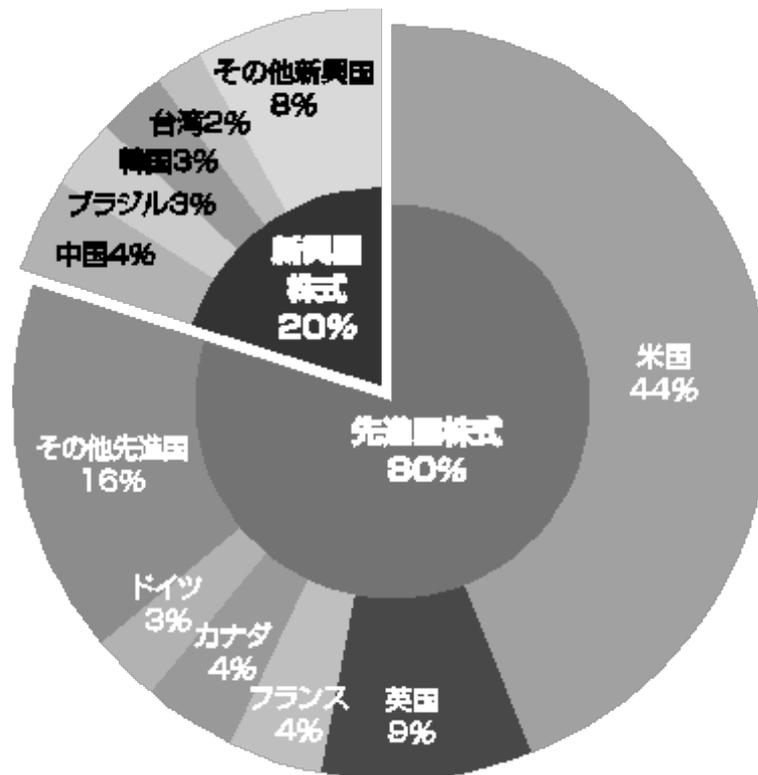
新興国株式

MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円ヘッジなし・円ベース)

あわせ持った場合

先進国株式80%と新興国株式20%を合成した指数です。当ファンドは、当該指数の動きに連動する投資成果をめざします。

## 「あわせ持った場合」の国別構成比率



(2009年6月末現在)

MSCI Inc.などのデータをもとに作成

上記グラフは過去のものであり、将来の運用成果などを約束するものではありません。

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。

## 先進国 (Developed country)

高度な工業化を達成し、技術水準や生活水準の高い、経済発展が進んだ国家のことです。国際社会では、「先進国クラブ」とよばれる経済協力開発機構 (OECD) \* 加盟国を指すことが一般的です。

- ・世界のGDPの約80%を占め、世界経済の中心となっています。
- ・金融市場においても、その経済基盤から世界の中心となっています。

## \* 経済協力開発機構 (OECD) とは

財政金融上の安定を維持しながら雇用、生活水準の向上を達成し、世界経済の発展に貢献する、発展途上国経済の健全な拡大に寄与する、世界貿易の多角的・無差別的な拡大に貢献する、などを目的として1961年に発足した機構です。

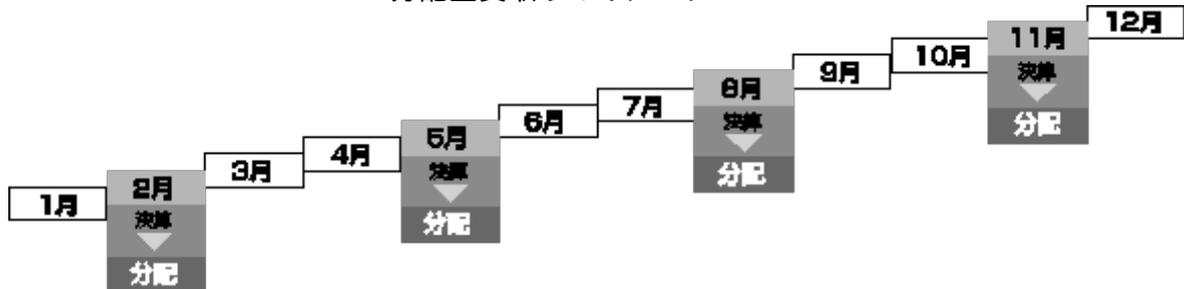
## 新興国 (Emerging country)

経済が急成長しており、今後も高い経済成長が期待される発展途上国・地域を指します。アジア通貨危機やロシア危機などの数々の困難を乗り越え、成長を続けています。

- ・人口は新興国が世界の約80%を占めています。

- 3) 年4回、実績に応じた収益分配を行なうことをめざします。
- ・投資する株式の配当収益・売却益などを原資として、年4回分配することをめざします。
  - ・2月、5月、8月、11月の各16日(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。
  - ・分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。

< 分配金受取りのイメージ >



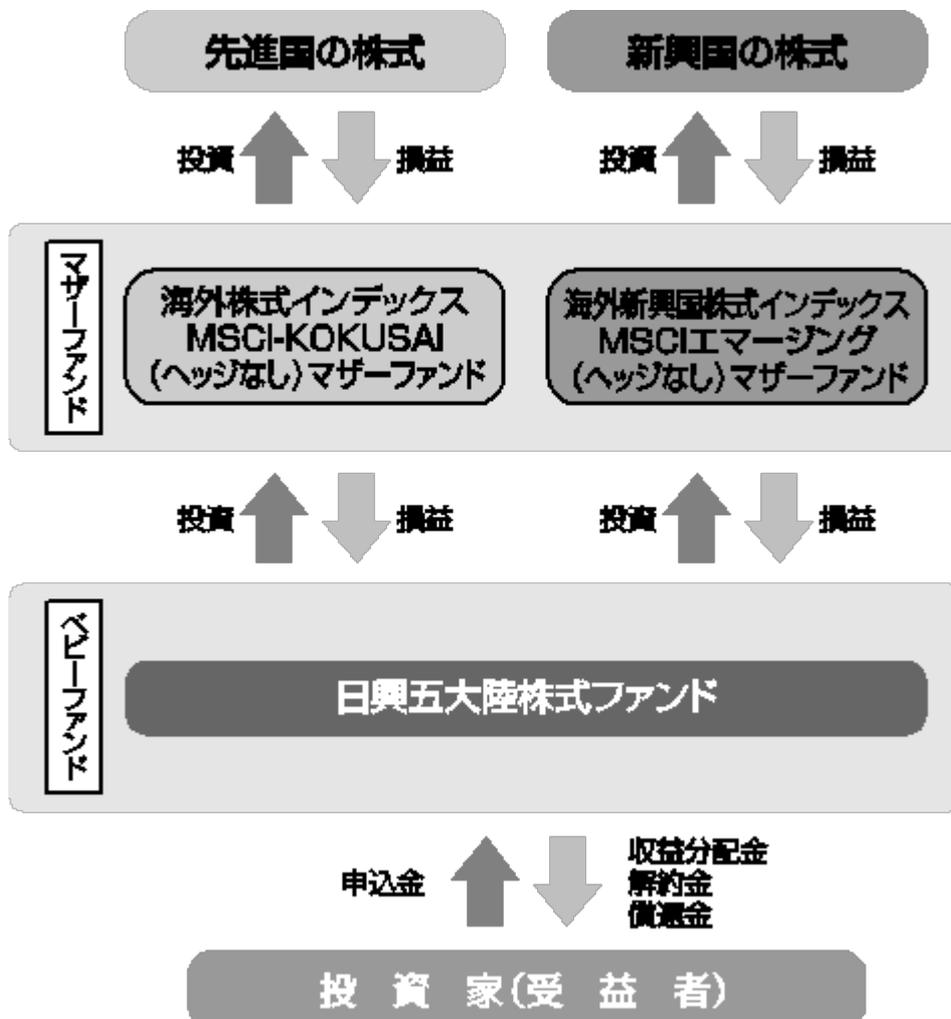
上図はイメージであり、将来の分配金の支払いを約束するものではありません。

< 分配金再投資コース > の場合、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。

## ファンドの仕組み

「日興五大陸株式ファンド」は、主に「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券および「海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券に投資し、各マザーファンドが先進国の株式あるいは新興国の株式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。

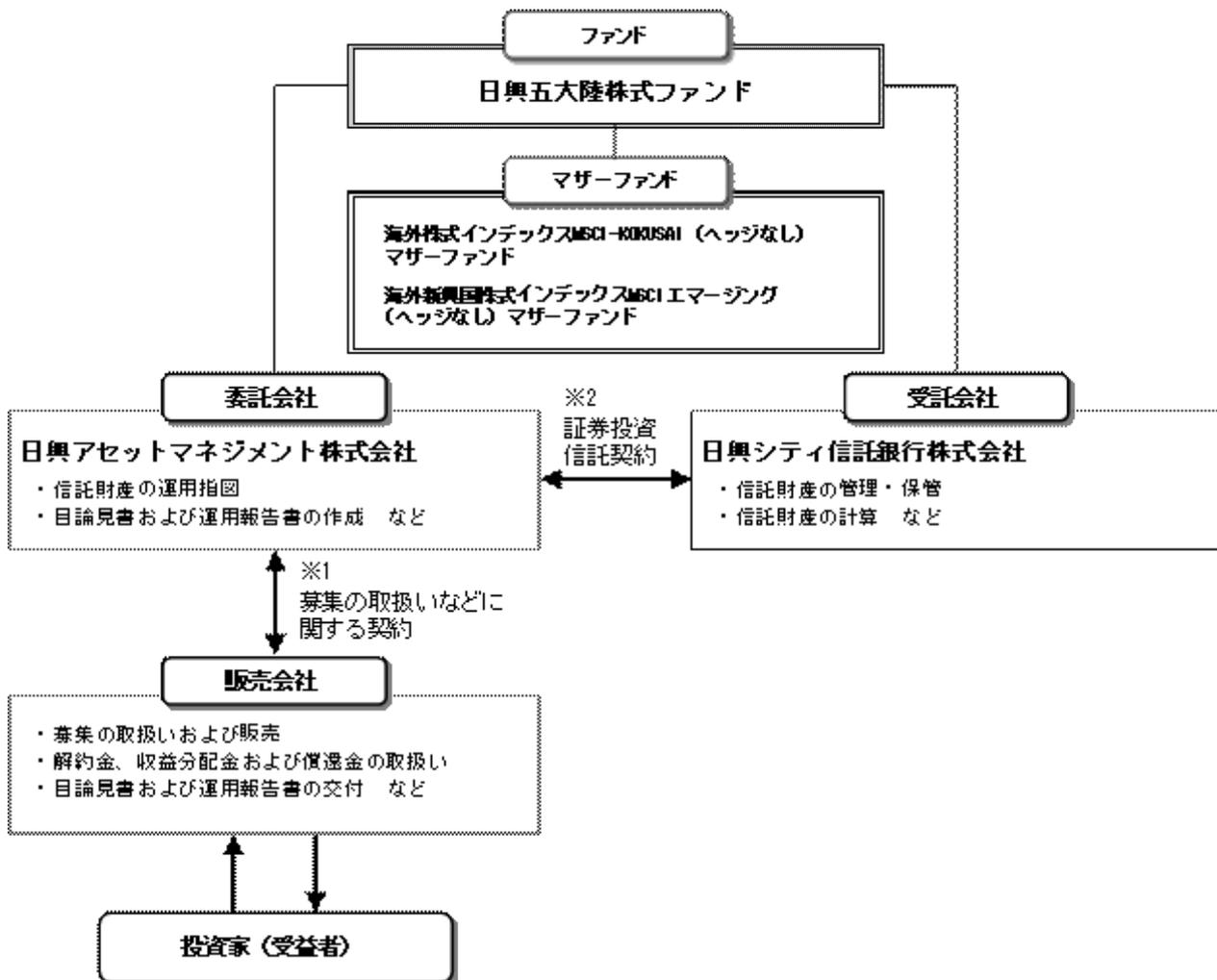
ファミリーファンド方式とは、投資家から投資された資金をまとめてベビーファンドとし、その資金を主としてマザーファンド受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。



## 信託金限度額

- ・ 2兆5,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ 委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

(2) 【ファンドの仕組み】  
ファンドの仕組み



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

## 委託会社の概況（平成21年6月末現在）

## 1) 資本金

16,403百万円

## 2) 沿革

昭和34年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

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

## 3) 大株主の状況

名称	住所	所有株数	所有比率
日興シティNAMホールディングス合同会社	東京都千代田区丸の内一丁目5番1号	107,570,100株	58.14%
NAMホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内二丁目7番3号	69,170,000株	37.38%

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

- ・主として、「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券および「海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券に投資を行ない、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）とMSCIエマージング・マーケット・インデックス（円ヘッジなし・円ベース）をそれぞれ80%と20%の配分で合成した指数の動きに連動する投資成果をめざします。
- ・マザーファンド受益証券の組入比率は高位を保つことを原則とします。なお、資金動向などによっては組入比率を引き下げることがあります。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

## (2)【投資対象】

## &lt;日興五大陸株式ファンド&gt;

「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券および「海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド」受益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) 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24条、第25条および第26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「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券および「海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド」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) 株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)～8)の証券または証書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、マザーファンドの受益証券を除きます。）
- 11) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で12)に定めるもの以外のもの
- 12) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
- 13) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

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

< 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド >  
日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。  
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
  - 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限ります。)
  - 3) 金銭債権
  - 4) 約束手形
  - 5) 為替手形
- 主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。 )に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券(短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。 )を除きます。 )には投資しません。
- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
  - 2) 国債証券
  - 3) 地方債証券
  - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
  - 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。 )の新株引受権証券を除きます。 )
  - 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。 )
  - 7) コマーシャル・ペーパー
  - 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。 )および新株予約権証券
  - 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)~7)の証券の性質を有するもの
  - 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。 )
  - 11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。 )で12)に定めるもの以外のもの
  - 12) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。 )または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
  - 13) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。 )

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

< 海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし)マザーファンド >

新興国の株式(DR(預託証券)およびカントリーファンドなどを含みます。)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17条、第18条および第19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。
- 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証券または証書で、1)~8)の証券または証書の性質を有するもの
  - 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
  - 11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)で12)に定めるもの以外のもの
  - 12) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
  - 13) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)

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

## 投資対象とするマザーファンドの概要

## &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。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	日興シティ信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成12年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

## &lt; 海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし)マザーファンド &gt;

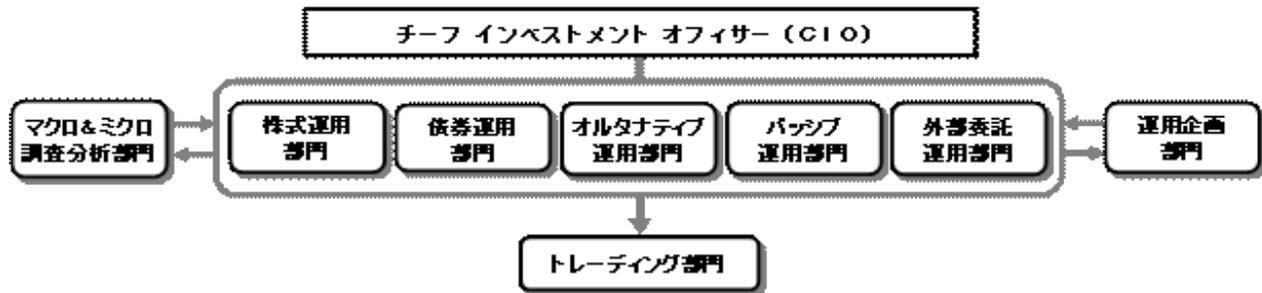
運用の基本方針	
基本方針	主として金融商品取引所に上場されている新興国の株式に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円ヘッジなし・円ベース) <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。
主な投資対象	新興国の株式(DR(預託証券)およびカンントリーファンドなどを含まず。)を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>主として、新興国の株式(DR(預託証券)およびカンントリーファンドなどを含まず。)に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円ヘッジなし・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いません。</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>株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含まず。)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割合は、信託財産の総額の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まず。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	日興シティ信託銀行株式会社
信託期間	無期限(平成18年5月17日設定)
決算日	毎年5月16日(休業日の場合は翌営業日)

\* MSCI エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が発表している、世界の新興国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。(円ヘッジなし・円ベース)とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。

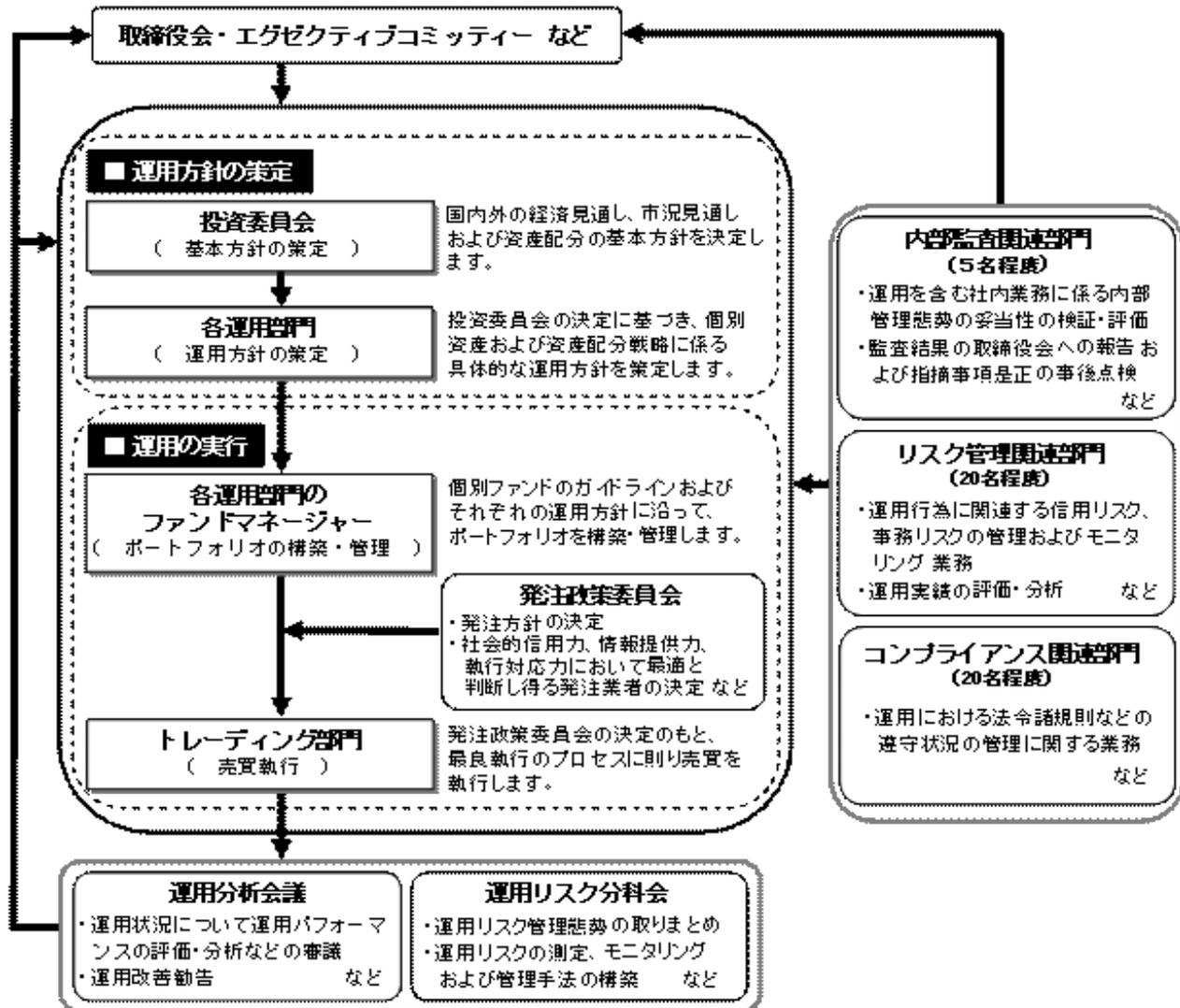
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

## (3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



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

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

上記体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## (4) 【分配方針】

## 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

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

## 収益分配金の支払い

## &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; 日興五大陸株式ファンド &gt;

- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、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。以下同じ。）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。また、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、投資することを指図することができるものとします。
- 3) 投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、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、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

- ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 15) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て(解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
- イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
- ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
- ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
- ニ) 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。

< 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

たつては、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つては、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。

#### < 海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(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。以下同じ。)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。また、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、投資することを指図することができるものとします。
- 3) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資割合には、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つては、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つては、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

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。

#### 法令による投資制限

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律)

同一法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行なう投資信託全体で、当該株式の議決権の過半数を保有することとなる取引は行ないません。

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

- ・当ファンド(マザーファンドを含みます。)は、主に株式など値動きのある証券(外貨建証券は為替変動リスクもあります。)を投資対象としているため、基準価額は変動します。特に投資する新興国の株式は、先進国の株式に比べて価格変動が大きくなる傾向があり、基準価額にも大きな影響を与える場合があります。したがって、元金を割り込むことがあります。
- ・当ファンドは、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはなりません。
- ・信託財産に生じた利益および損失はすべて受益者に帰属します。取得申込者は、ファンドの投資目的およびリスク要因を十分に認識することが求められます。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 価格変動リスク

一般に株式の価格は、国内および国外の経済・政治情勢などの影響を受け変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。

#### 流動性リスク

- ・市場規模や取引量が少ない場合、組入銘柄を売却する際に市場実勢から期待される価格で売却できず、不測の損失を被るリスクがあります。
- ・一般に新興国の株式は、先進国の株式と比較して、市場規模や取引量が少ないため、相対的に流動性リスクが高いと考えられます。

#### 信用リスク

一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。

#### 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。

#### カントリー・リスク

- ・投資対象国である新興国における非常事態など(金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など)を含む市況動向や資金動向などによっては、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあり、投資方針に従った運用ができない場合があります。
- ・情報の開示などの基準が先進国とは異なることから、投資判断に際して正確な情報を十分に確保できない場合があります。
- ・ファンドの投資対象株式が上場または取引されている諸国の税制が先進国と異なる場合があります。また、それらの諸国における税制が一方的に変更されたり、新たな税制が適用されたりすることもあります。以上のような要因は、ファンドの信託財産の価値に影響を与える可能

性があります。

<その他の留意事項>

・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により閉鎖されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。また、一時的に取得・換金ができなくなることもあります。

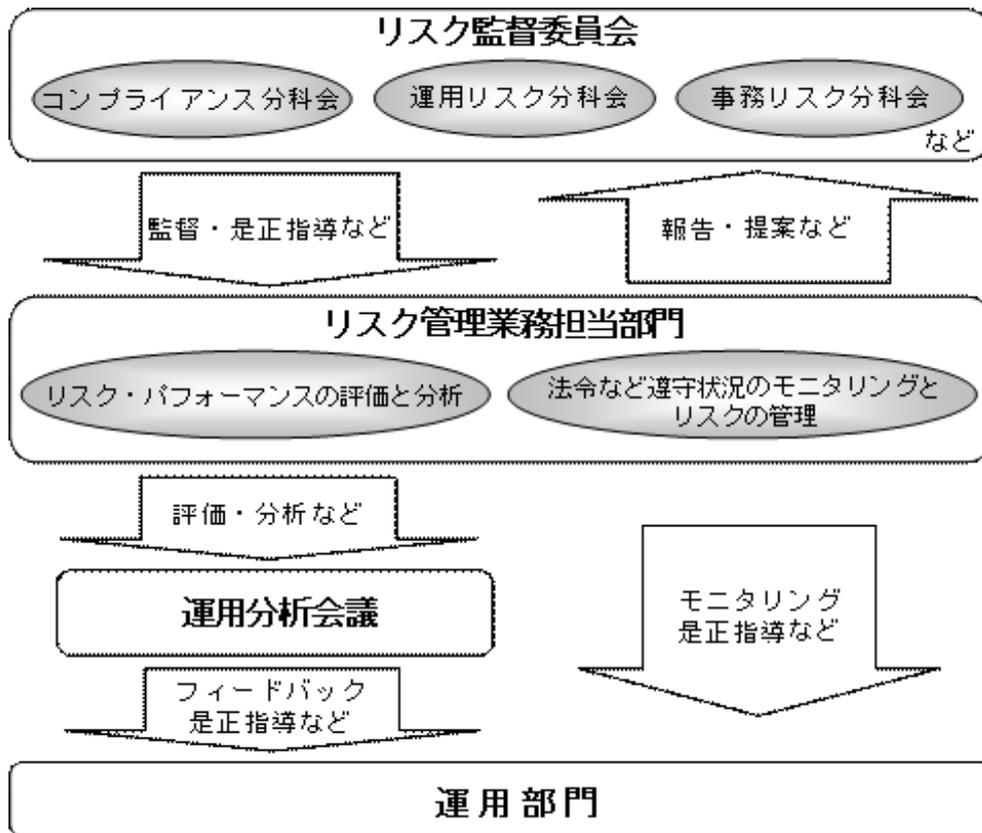
・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

## (2) リスク管理体制



## 全体的リスク管理

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

## リスク・パフォーマンスの評価と分析

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

## 法令など遵守状況のモニタリングとリスクの管理

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

上記体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

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2.1%（税抜2%）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。
- ・償還乗換、乗換優遇に関わる手数料の取扱いについては、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0.3%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1.155%（税抜1.1%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分は、以下の通りとします。

信託報酬率（年率）			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
1.1550%	0.5040%	0.5775%	0.0735%
（1.10%）	（0.48%）	（0.55%）	（0.07%）

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。

振替受益権に係る費用ならびに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。）。

この信託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。

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

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

<投資対象とするマザーファンドに係る費用>

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

\* 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】

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、平成23年12月31日までは軽減税率が適用され、10%（所得税7%および地方税3%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税のいずれかを選択することもできます。
- ・なお、平成24年1月1日以降は、上記の10%の税率は20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

##### 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、平成23年12月31日までは軽減税率が適用され、10%（所得税7%および地方税3%）の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座（源泉徴収選択口座）を選択している場合は、10%（所得税7%および地方税3%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。
- \* 解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益
- ・なお、平成24年1月1日以降は、上記の10%の税率は20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

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

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、平成23年12月31日までは軽減税率が適用され、7%（所得税のみ）の税率による源泉徴収が行なわれます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。
- ・なお、平成24年1月1日以降は、上記の7%の税率は15%（所得税のみ）となる予定です。

##### 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。

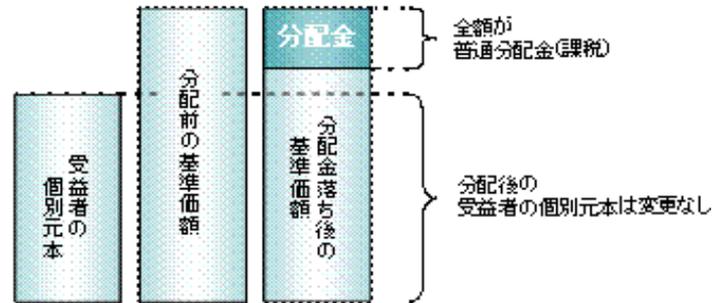
普通分配金と特別分配金

- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「特別分配金」（元本

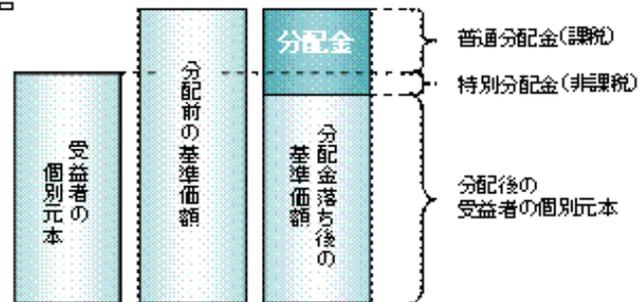
- の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
- イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
  - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が特別分配金となり、収益分配金から特別分配金を控除した金額が普通分配金となります。
  - ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から特別分配金を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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。

## 5【運用状況】

以下の運用状況は平成21年5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】

投資資産の種類	時価(千円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	22,131,248	100.00
日本	22,131,248	100.00
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	855	0.00
純資産総額	22,130,392	100.00

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ 評価額上位銘柄明細

## &lt; 親投資信託受益証券 &gt;

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
日本円 日本	親投資信託受益証券 -	海外株式インデックスMSCI-KOKUSA I (ヘッジなし)マザーファンド	23,345,371,451	0.7033 0.7502	16,417,926,316 17,513,697,662	79.14
日本円 日本	親投資信託受益証券 -	海外新興国株式インデックスMSCIエマ ージング(ヘッジなし)マザーファンド	5,072,001,951	0.8246 0.9104	4,182,566,286 4,617,550,576	20.87

## ロ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】  
【純資産の推移】

期別	1口当たりの純資産額(円)		純資産総額(百万円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
設定時(2006年6月12日)	1.0000	1.0000	100	100
第1特定期間末(2006年11月16日)	1.1444	1.1804	6,861	7,009
第2特定期間末(2007年5月16日)	1.2419	1.3079	23,156	24,176
第3特定期間末(2007年11月16日)	1.1508	1.2048	33,280	34,717
第4特定期間末(2008年5月16日)	1.0503	1.0683	34,522	35,103
第5特定期間末(2008年11月17日)	0.5149	0.5269	17,928	18,341
第6特定期間末(2009年5月18日)	0.5469	0.5589	20,346	20,785

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

	1口当たりの純資産額(円)	純資産総額(百万円)
2008年5月末日	1.0433	34,658
2008年6月末日	0.9616	32,277
2008年7月末日	0.9590	32,459
2008年8月末日	0.9385	32,019
2008年9月末日	0.7511	25,677
2008年10月末日	0.5745	19,851
2008年11月末日	0.5156	18,157
2008年12月末日	0.4993	17,758
2009年1月末日	0.4667	16,791
2009年2月末日	0.4593	16,708
2009年3月末日	0.4858	17,819
2009年4月末日	0.5490	20,348
2009年5月末日	0.5877	22,130

## 【分配の推移】

	1口当たり税込み分配金(円)
第1特定期間(2006年6月12日～2006年11月16日)	0.0360
第2特定期間(2006年11月17日～2007年5月16日)	0.0660
第3特定期間(2007年5月17日～2007年11月16日)	0.0540
第4特定期間(2007年11月17日～2008年5月16日)	0.0180
第5特定期間(2008年5月17日～2008年11月17日)	0.0120
第6特定期間(2008年11月18日～2009年5月18日)	0.0120

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間(2006年6月12日～2006年11月16日)	18.04
第2特定期間(2006年11月17日～2007年5月16日)	14.29
第3特定期間(2007年5月17日～2007年11月16日)	2.99
第4特定期間(2007年11月17日～2008年5月16日)	7.17
第5特定期間(2008年5月17日～2008年11月17日)	49.83
第6特定期間(2008年11月18日～2009年5月18日)	8.55

(注) 各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額(分配付の額)から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額(分配落ちの額、以下、「前期末基準価額」といいます。)を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

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

以下の運用状況は平成21年5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。
- ・有価証券指数等先物取引の金額は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。
- ・為替予約取引の金額は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(1) 投資状況

投資資産の種類	時価(千円)	投資比率(%)
株式	60,568,838	96.41
アメリカ	32,586,449	51.87
イギリス	6,697,925	10.66
カナダ	3,281,520	5.22
フランス	3,239,235	5.16
ドイツ	2,623,345	4.18
スイス	2,586,985	4.12
オーストラリア	2,025,565	3.22
スペイン	1,406,466	2.24
イタリア	1,158,226	1.84
香港	792,163	1.26
オランダ	763,770	1.22
スウェーデン	750,125	1.19
フィンランド	445,560	0.71
シンガポール	423,627	0.67
ベルギー	304,549	0.48
デンマーク	294,687	0.47
ノルウェー	223,762	0.36
バミューダ諸島	187,314	0.30
ギリシャ	186,555	0.30
ルクセンブルグ	183,263	0.29
ポルトガル	104,767	0.17
オーストリア	102,817	0.16
アイルランド	91,828	0.15
ジャージー	64,066	0.10
ニュージーランド	27,983	0.04
ケイマン諸島	12,038	0.02
中国	4,237	0.01
投資証券	752,055	1.20
アメリカ	358,593	0.57
オーストラリア	116,202	0.18
カナダ	86,604	0.14
フランス	76,810	0.12
イギリス	73,568	0.12
香港	17,939	0.03
シンガポール	11,997	0.02
オランダ	10,339	0.02
有価証券指数等先物取引(買建)	(1,550,731)	(2.47)
アメリカ	(938,733)	(1.49)
ドイツ	(611,997)	(0.97)
為替予約取引(買建)	(959,044)	(1.53)
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	1,502,027	2.39
純資産総額	62,822,921	100.00

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ 評価額上位銘柄明細

## &lt; 株式 &gt;

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
アメリカ アメリカ	株式 石油・ガス	EXXON MOBIL CORPORATION	208,699	6,724 6,679	1,403,320,842 1,393,965,401	2.22
アメリカ アメリカ	株式 ソフトウェア	MICROSOFT CORP	328,329	2,088 1,973	685,448,395 647,798,370	1.03
アメリカ アメリカ	株式 化粧品パーソナルケア	PROCTER & GAMBLE COMPANY	120,843	5,661 5,074	684,092,466 613,143,268	0.98
イギリス イギリス	株式 石油・ガス	BP PLC	767,888	685 782	526,000,795 600,288,247	0.96
アメリカ アメリカ	株式 ヘルスケア製品	JOHNSON & JOHNSON	113,774	5,814 5,261	661,463,397 598,571,203	0.95
イギリス イギリス	株式 銀行	HSBC HOLDINGS PLC	704,051	835 839	587,998,828 590,451,684	0.94
アメリカ アメリカ	株式 通信	AT&T INC	241,656	2,391 2,376	577,739,955 574,247,733	0.91
アメリカ アメリカ	株式 コンピューター	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	55,087	7,938 10,100	437,258,083 556,405,759	0.89
アメリカ アメリカ	株式 その他製造	GENERAL ELECTRIC COMPANY	433,798	1,676 1,273	727,081,661 552,038,841	0.88
スイス スイス	株式 食品	NESTLE SA	157,030	3,847 3,502	604,167,808 549,922,672	0.88
アメリカ アメリカ	株式 銀行	JPMORGAN CHASE & CO	153,870	3,293 3,536	506,637,486 544,083,089	0.87
アメリカ アメリカ	株式 石油・ガス	CHEVRON CORPORATION	83,311	6,226 6,349	518,712,788 528,970,598	0.84
アメリカ アメリカ	株式 コンピューター	APPLE INC	36,441	9,207 13,032	335,516,744 474,882,845	0.76
ユーロ フランス	株式 石油・ガス	TOTAL SA	87,452	4,886 5,395	427,317,442 471,840,751	0.75
アメリカ アメリカ	株式 小売り	WAL-MART STORES INC	96,767	4,958 4,781	479,796,418 462,602,772	0.74
アメリカ アメリカ	株式 通信	CISCO SYSTEMS INC	240,025	1,567 1,786	376,090,776 428,647,398	0.68
アメリカ アメリカ	株式 銀行	WELLS FARGO & COMPANY	178,940	2,824 2,390	505,318,970 427,632,530	0.68
アメリカ アメリカ	株式 医薬品	PFIZER INC	276,332	1,593 1,417	440,127,020 391,642,912	0.62
イギリス イギリス	株式 通信	VODAFONE GROUP PLC	2,158,965	163 180	351,522,840 389,186,517	0.62
アメリカ アメリカ	株式 インターネット	GOOGLE INC-CL A	9,816	32,300 39,612	317,059,358 388,829,366	0.62
アメリカ アメリカ	株式 飲料	COCA-COLA COMPANY	85,331	4,024 4,525	343,365,414 386,115,266	0.61
スイス スイス	株式 医薬品	NOVARTIS AG-REG SHS	98,035	4,815 3,823	472,001,483 374,770,061	0.60
スイス スイス	株式 医薬品	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	28,978	14,907 12,823	431,970,796 371,582,837	0.59
イギリス イギリス	株式 石油・ガス	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	145,283	2,297 2,530	333,751,262 367,591,342	0.59
オーストラリア オーストラリア	株式 鉱業	BHP BILLITON LTD	138,491	1,883 2,581	260,735,946 357,505,875	0.57
ユーロ スペイン	株式 通信	TELEFONICA S.A.	173,503	1,834 2,056	318,253,137 356,740,473	0.57
イギリス イギリス	株式 医薬品	GLAXOSMITHKLINE PLC	214,341	1,740 1,617	373,003,273 346,491,465	0.55
アメリカ アメリカ	株式 半導体	INTEL CORP	227,927	1,371 1,517	312,470,658 345,689,040	0.55
アメリカ アメリカ	株式 銀行	BANK OF AMERICA CORP	313,159	1,742 1,090	545,415,729 341,413,458	0.54
ユーロ スペイン	株式 銀行	BANCO SANTANDER SA	337,216	847 1,011	285,712,952 341,000,069	0.54

## &lt; 投資証券 &gt;

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
オーストラリア オーストラリア	投資証券 -	WESTFIELD GROUP	84,870	986 810	83,664,333 68,714,113	0.11
ユーロ フランス	投資証券 -	UNIBAIL-RODAMCO SE	3,535	14,633 15,127	51,727,157 53,472,464	0.09
アメリカ アメリカ	投資証券 -	SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	9,823	5,042 4,997	49,532,161 49,082,576	0.08
アメリカ アメリカ	投資証券 -	PUBLIC STORAGE	5,459	6,652 6,324	36,310,752 34,524,157	0.05

アメリカドル アメリカ	投資証券 -	VORNADO REALTY TRUST	6,059	5,294 4,491	32,075,604 27,211,841	0.04
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	11,170	2,879 2,261	32,152,873 25,260,857	0.04
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	PLUM CREEK TIMBER CO	7,618	3,016 3,250	22,972,267 24,761,633	0.04
カナダドル カナダ	投資証券 -	CANADIAN OIL SANDS TRUST	10,095	2,361 2,408	23,838,955 24,305,990	0.04
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	BOSTON PROPERTIES INC	5,282	5,654 4,553	29,863,354 24,048,371	0.04
イギリスポンド イギリス	投資証券 -	LAND SECURITIES GROUP PLC	31,634	994 749	31,458,161 23,707,760	0.04
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	HCP INC	10,850	2,547 2,151	27,633,163 23,333,350	0.04
イギリスポンド イギリス	投資証券 -	BRITISH LAND COMPANY PLC	37,816	616 587	23,310,830 22,189,867	0.04
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,575	5,985 5,703	21,395,067 20,387,985	0.03
カナダドル カナダ	投資証券 -	PENN WEST ENERGY TRUST	15,498	1,720 1,287	26,652,241 19,939,789	0.03
香港ドル 香港	投資証券 -	LINK REIT	94,500	157 190	14,821,335 17,939,351	0.03
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	VENTAS INC	6,200	3,012 2,880	18,675,011 17,855,554	0.03
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	HOST HOTELS & RESORTS INC	20,198	727 865	14,691,183 17,479,866	0.03
カナダドル カナダ	投資証券 -	ENERPLUS RESOURCES FUND	7,630	2,332 2,236	17,789,796 17,062,041	0.03
オーストラリアドル オーストラリア	投資証券 -	STOCKLAND	71,210	291 225	20,725,176 15,994,108	0.03
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	HEALTH CARE REIT INC	4,910	3,624 3,209	17,793,823 15,755,821	0.03
イギリスポンド イギリス	投資証券 -	HAMMERSON PLC	28,610	470 441	13,440,987 12,629,447	0.02
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	2,435	4,901 4,993	11,933,679 12,157,565	0.02
シンガポールドル シンガポール	投資証券 -	CAPITAMALL TRUST	136,800	83 88	11,312,775 11,997,469	0.02
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	KIMCO REALTY CORPORATION	10,375	1,654 1,116	17,163,821 11,581,339	0.02
ユーロ オランダ	投資証券 -	CORIO NV	2,210	4,657 4,678	10,291,759 10,339,295	0.02
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	REGENCY CENTERS CORPORATION	2,910	3,172 3,322	9,231,284 9,666,457	0.02
ユーロ フランス	投資証券 -	KLEPIERRE	3,895	2,055 2,461	8,002,485 9,587,161	0.02
ユーロ フランス	投資証券 -	ICADE	1,215	6,097 7,870	7,408,114 9,562,405	0.02
イギリスポンド イギリス	投資証券 -	SEGRO PLC	235,780	41 40	9,746,829 9,338,320	0.01
オーストラリアドル オーストラリア	投資証券 -	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	77,145	135 119	10,448,163 9,190,407	0.01

## □ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率（％）
株式	96.41
銀行	11.57
石油・ガス	11.32
通信	6.73
医薬品	5.92
小売り	4.16
保険	4.09
食品	3.87
電力	3.67
コンピューター	3.30
鉱業	3.04
化学	2.60
ヘルスケア製品	2.45
その他製造	2.42
ソフトウェア	2.39
メディア	2.14
飲料	2.07
農業	1.55
航空宇宙・防衛	1.49
商業サービス	1.43
化粧品パーソナルケア	1.41
半導体	1.37
運輸関連	1.36
その他金融	1.27
インターネット	1.27
バイオテクノロジー	1.15
石油・ガス サービス	1.12
エンジニアリング建設	0.90
自動車 製造	0.79
ヘルスケア・サービス	0.77
ガス	0.66
不動産	0.62
機械 その他	0.51
鉄鋼	0.51
多角産業	0.51
生活用品	0.49
建築資材	0.47
電子機器	0.47
電気部品・電気機械	0.47
繊維製品	0.44
パイプライン	0.39
金属 加工・鉱業用	0.25
機械 建設・鉱業用	0.22
宿泊施設	0.22
自動車 部品・機器	0.22
木材・紙	0.20
水道	0.18
レジャー	0.16
環境ビジネス	0.16
流通・卸売業	0.15
投資会社	0.14
その他資源	0.13
包装・容器	0.13
石炭	0.13
エンターテインメント	0.13
工具・工作機械	0.12
広告	0.12

航空	0.12
貯蓄貸付（S & L）	0.10
食品サービス	0.09
O A 機器	0.08
玩具・娯楽	0.05
住宅建設	0.05
家具・家電製品	0.04
繊維	0.03
家庭用品	0.02
造船	0.02
ベンチャーキャピタル	0.01
投資証券	1.20
合計	97.61

投資不動産物件  
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの  
< 有価証券指数等先物取引 >

国・地域	銘柄名	種類	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
アメリカ	S&P 500 FUTURES 2009-06	買建	43	928,077,300	938,733,516	1.49
ドイツ	DJ STOXX 50 FUTURES 2009-06	買建	215	598,248,604	611,997,715	0.97
合計			-	1,526,325,904	1,550,731,231	2.47

< 為替予約取引 >

名称	種類	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
アメリカドル	買建	645,214,018	651,783,590	1.04
ユーロ	買建	300,479,864	307,260,920	0.49
合計		945,693,882	959,044,510	1.53

(参考) 海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は平成21年5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。
- ・有価証券指数等先物取引の金額は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。
- ・為替予約取引の金額は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(1) 投資状況

投資資産の種類	時価(千円)	投資比率(%)
株式	5,493,876	97.51
ブラジル	841,844	14.94
韓国	686,837	12.19
台湾	656,245	11.65
中国	604,574	10.73
インド	418,631	7.43
南アフリカ	401,743	7.13
ロシア	379,775	6.74
香港	341,194	6.06
メキシコ	249,725	4.43
イスラエル	158,212	2.81
マレーシア	148,813	2.64
インドネシア	84,925	1.51
トルコ	77,990	1.38
チリ	75,935	1.35
タイ	68,776	1.22
ポーランド	57,377	1.02
エジプト	33,331	0.59
チェコ	33,003	0.59
ペルー	31,244	0.55
ハンガリー	30,004	0.53
コロンビア	29,204	0.52
フィリピン	26,400	0.47
モロッコ	21,363	0.38
ケイマン諸島	21,036	0.37
バミューダ諸島	10,772	0.19
アルゼンチン	4,913	0.09
有価証券指数等先物取引(買建)	(62,932)	(1.12)
アメリカ	(62,932)	(1.12)
為替予約取引(売建)	(14,208)	(0.25)
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	140,015	2.49
純資産総額	5,633,892	100.00

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ 評価額上位銘柄明細

## &lt; 株式 &gt;

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
香港ドル 香港	株式 通信	CHINA MOBILE LTD/HK	143,200	898 930	128,617,658 133,160,248	2.36
アメリカドル ロシア	株式 石油・ガス	GAO GAZPROM-SPON ADR REG S	56,570	2,012 2,134	113,796,665 120,728,164	2.14
ブラジルリアル ブラジル	株式 石油・ガス	PETROLEO BRASILEIRO SA PREF	71,200	1,499 1,659	106,703,453 118,123,790	2.10
ブラジルリアル ブラジル	株式 石油・ガス	PETROLEO BRASILEIRO SA	56,360	1,866 2,083	105,188,185 117,385,481	2.08
韓国ウォン 韓国	株式 半導体	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	2,650	42,624 42,931	112,953,600 113,767,680	2.02
新台湾ドル 台湾	株式 半導体	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	583,438	163 179	95,206,865 104,309,379	1.85
イスラエルシェケル イスラエル	株式 医薬品	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	21,935	4,495 4,457	98,606,116 97,754,687	1.74
メキシコペソ メキシコ	株式 通信	AMERICA MOVIL SAB DE CV	468,000	171 188	79,807,104 88,074,792	1.56
ブラジルリアル ブラジル	株式 鉱業	VALE SA-PREF A	51,350	1,492 1,575	76,635,746 80,889,190	1.44
インドルピー インド	株式 石油・ガス	RELIANCE INDUSTRIES LTD	15,045	4,018 4,574	60,457,460 68,820,840	1.22
香港ドル 中国	株式 銀行	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,056,000	60 62	62,924,506 65,945,933	1.17
ブラジルリアル ブラジル	株式 銀行	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	40,357	1,359 1,532	54,857,803 61,833,381	1.10
香港ドル 中国	株式 銀行	INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA	1,006,000	58 60	58,193,076 60,195,418	1.07
香港ドル 中国	株式 保険	CHINA LIFE INSURANCE CO	169,000	343 345	57,920,018 58,340,490	1.04
新台湾ドル 台湾	株式 電子機器	HON HAI PRECISION INDUSTRY	159,962	318 364	50,899,908 58,238,965	1.03
南アフリカランド 南アフリカ	株式 通信	MTN GROUP LTD	37,515	1,366 1,428	51,241,176 53,572,358	0.95
香港ドル 中国	株式 石油・ガス	PETROCHINA CO LTD-H	487,000	101 108	49,011,485 52,767,619	0.94
アメリカドル ロシア	株式 石油・ガス	LUKOIL-SPON ADR	10,685	4,535 4,795	48,451,774 51,235,173	0.91
韓国ウォン 韓国	株式 鉄鋼	POSCO	1,635	30,950 31,181	50,603,904 50,980,608	0.90
香港ドル 香港	株式 石油・ガス	CNOOC LTD	397,000	124 122	49,288,026 48,349,677	0.86
香港ドル 中国	株式 銀行	BANK OF CHINA LTD	1,200,000	36 40	42,992,640 48,217,440	0.86
南アフリカランド 南アフリカ	株式 石油・ガス	SASOL LTD	13,700	3,501 3,431	47,970,132 47,009,125	0.83
ブラジルリアル ブラジル	株式 銀行	BANCO BRADESCO SA	31,300	1,302 1,455	40,763,117 45,543,791	0.81
ユーロ ロシア	株式 銀行	SBERBANK-GDR	2,070	15,889 21,746	32,889,609 45,014,168	0.80
ブラジルリアル ブラジル	株式 鉱業	VALE SA	23,200	1,752 1,857	40,655,866 43,077,444	0.76
インドルピー インド	株式 コンピューター	INFOSYS TECHNOLOGIES LTD	11,615	3,281 3,253	38,110,766 37,780,575	0.67
香港ドル 中国	株式 石油・ガス	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORPORATION-H	427,000	76 80	32,402,468 34,102,270	0.61
南アフリカランド 南アフリカ	株式 鉱業	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	13,580	1,975 2,193	26,825,049 29,778,564	0.53
インドルピー インド	株式 銀行	ICICI BANK LTD	19,265	1,184 1,504	22,807,487 28,982,613	0.51
新台湾ドル 台湾	株式 半導体	MEDIATEK INC	22,442	1,134 1,184	25,442,047 26,571,328	0.47

## ロ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率(%)
株式	97.51
石油・ガス	15.39
銀行	13.58
通信	10.78
鉱業	6.04
半導体	5.68
その他金融	4.45

鉄鋼	3.54
電力	2.96
コンピューター	2.64
多角産業	2.56
保険	2.50
化学	2.20
電子機器	2.09
医薬品	2.04
エンジニアリング建設	1.78
小売り	1.70
不動産	1.50
電気部品・電気機械	1.32
食品	1.11
飲料	1.05
自動車 製造	1.04
建築資材	1.03
農業	1.03
メディア	0.91
石炭	0.90
インターネット	0.78
運輸関連	0.75
造船	0.61
木材・紙	0.55
ガス	0.48
流通・卸売業	0.45
自動車 部品・機器	0.39
商業サービス	0.33
宿泊施設	0.31
ヘルスケア製品	0.28
投資会社	0.24
航空宇宙・防衛	0.23
住宅建設	0.22
繊維製品	0.22
その他製造	0.21
化粧品パーソナルケア	0.20
生活用品	0.19
航空	0.18
機械 その他	0.17
ソフトウェア	0.14
機械 建設・鉱業用	0.14
金属 加工・鉱業用	0.10
ヘルスケア・サービス	0.09
レジャー	0.08
石油・ガス サービス	0.08
水道	0.08
環境ビジネス	0.08
家具・家電製品	0.07
エンターテインメント	0.06
合計	97.51

投資不動産物件  
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの  
< 有価証券指数等先物取引 >

国・地域	銘柄名	種類	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
アメリカ	E-MINI MSCI EMERGING FUTURES 2009-06	買建	17	60,745,255	62,932,939	1.12

合計	-	60,745,255	62,932,939	1.12
----	---	------------	------------	------

## &lt;為替予約取引&gt;

名称	種類	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
南アフリカランド	売建	13,883,730	14,208,600	0.25
合計		13,883,730	14,208,600	0.25

## 第二部【ファンドの詳細情報】

### 第1【ファンドの沿革】

平成18年6月12日 ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

### 第2【手続等】

#### 1【申込（販売）手続等】

##### (1) 申込方法

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。

＜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（わが国の金融商品取引所が半休日となる場合は午前11時）までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

##### (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 0120-86-2514（ハロー、ニッコウでトウシン）

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

（半休日となる場合は午前9時～正午）

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

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

##### (10) 償還乗換

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

・この措置の適用を受ける受益者は、販売会社から、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求められることがあります。

##### (11) 乗換優遇

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

#### 2【換金（解約）手続等】

## &lt; 解約請求による換金 &gt;

- (1) 解約の受付  
販売会社の営業日に受け付けます。
- (2) 取扱時間  
原則として、午後3時(わが国の金融商品取引所が半休日となる場合は午前11時)までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
- (3) 解約請求不可日  
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0.3%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 0120-86-2514 (ハロー、ニッコウでトウシン)

午前9時~午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(半休日となる場合は午前9時~正午)

- (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。
- (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、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。

## 第3【管理及び運営】

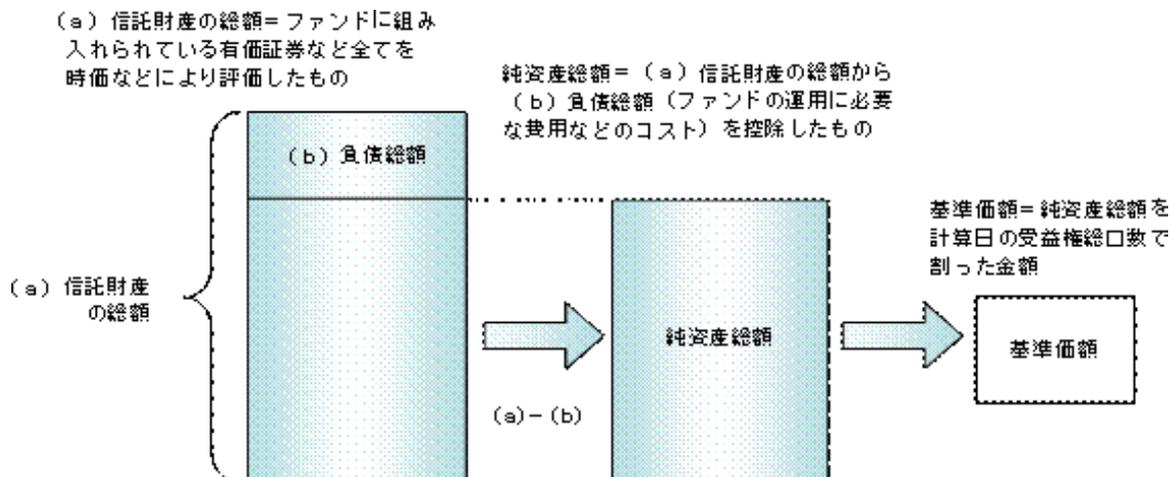
## 1【資産管理等の概要】

## (1)【資産の評価】

## 基準価額の算出

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

## &lt; 基準価額算出の流れ &gt;



## 有価証券などの評価基準

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

## &lt; 主な資産の評価方法 &gt;

## マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

## 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 0120-86-2514（ハロー、ニコウでトウシン）

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

（半休日となる場合は午前9時～正午）

## (2)【保管】

該当事項はありません。

## (3)【信託期間】

無期限とします（平成18年6月12日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

## (4)【計算期間】

毎年2月17日から5月16日まで、5月17日から8月16日まで、8月17日から11月16日までおよび11月17日から翌年2月16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純資産総額が10億円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

- 八) 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ないません。
  - 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。

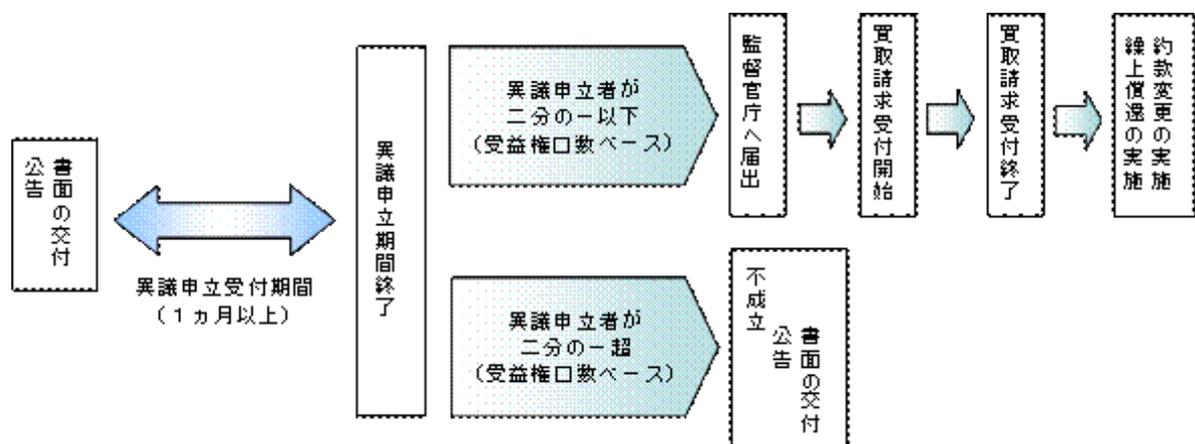
#### 信託約款の変更

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

#### 異議の申立て

- 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。
- 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ないません。
- 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



#### 公告

公告は日本経済新聞に掲載します。  
運用報告書の作成

委託会社は、年2回(5月、11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、あらかじめ届出を受けた住所に販売会社よりお届けします。

関係法人との契約について

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

## 2【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

### (1) 収益分配金・償還金受領権

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

### (2) 解約請求権

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

### (3) 帳簿閲覧権

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

#### 第4【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「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20年5月17日から平成20年11月17日までの特定期間と平成20年11月18日から平成21年5月18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】  
日興五大陸株式ファンド  
(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 平成20年11月17日現在	当期 平成21年5月18日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	110,613,313	71,581,836
親投資信託受益証券	17,913,620,278	20,327,191,078
未収入金	203,917,000	237,828,000
流動資産合計	18,228,150,591	20,636,600,914
<b>資産合計</b>		
	18,228,150,591	20,636,600,914
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	208,919,961	222,833,420
未払解約金	3,213,754	6,209,974
未払受託者報酬	4,579,539	3,418,466
未払委託者報酬	67,385,154	50,300,764
その他未払費用	15,296,310	7,490,535
流動負債合計	299,394,718	290,253,159
<b>負債合計</b>		
	299,394,718	290,253,159
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	34,822,103,994	37,203,830,492
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	16,893,348,121	16,857,482,737
(分配準備積立金)	-	-
元本等合計	17,928,755,873	20,346,347,755
<b>純資産合計</b>		
	17,928,755,873	20,346,347,755
<b>負債純資産合計</b>		
	18,228,150,591	20,636,600,914

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期	当期
	自 平成20年5月17日 至 平成20年11月17日	自 平成20年11月18日 至 平成21年5月18日
<b>営業収益</b>		
受取利息	195,671	21,939
有価証券売買等損益	17,671,900,068	1,787,064,800
営業収益合計	17,671,704,397	1,787,086,739
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	10,786,210	6,591,159
委託者報酬	158,712,348	96,985,053
その他費用	3,984,129	7,778,061
営業費用合計	173,482,687	111,354,273
営業利益又は営業損失( )	17,845,187,084	1,675,732,466
経常利益又は経常損失( )	17,845,187,084	1,675,732,466
当期純利益又は当期純損失( )	17,845,187,084	1,675,732,466
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	202,378,036	2,698,898
期首剰余金又は期首欠損金( )	1,654,507,899	16,893,348,121
剰余金増加額又は欠損金減少額	23,226,386	343,945,149
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	23,226,386	343,945,149
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	515,821,229	1,547,707,764
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	515,821,229	1,547,707,764
分配金	412,452,129	438,803,365
期末剰余金又は期末欠損金( )	16,893,348,121	16,857,482,737

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

期別 項目	前期 自 平成20年5月17日 至 平成20年11月17日	当期 自 平成20年11月18日 至 平成21年5月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年2月17日から5月16日まで、5月17日から8月16日まで、8月17日から11月16日まで及び、11月17日から翌年2月16日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものとしたしますので、当特定期間は平成20年5月17日から平成20年11月17日までとなっております。	当ファンドの計算期間は原則として、毎年2月17日から5月16日まで、5月17日から8月16日まで、8月17日から11月16日まで及び、11月17日から翌年2月16日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものとしたしますので、当特定期間は平成20年11月18日から平成21年5月18日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

前期 平成20年11月17日現在		当期 平成21年5月18日現在	
1.	期首元本額 32,867,522,999 円	1.	期首元本額 34,822,103,994 円
	期中追加設定元本額 3,292,804,918 円		期中追加設定元本額 3,061,658,541 円
	期中解約元本額 1,338,223,923 円		期中解約元本額 679,932,043 円
2.	当特定期間末日における 受益権の総数 34,822,103,994 口	2.	当特定期間末日における 受益権の総数 37,203,830,492 口
3.	元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、 その差額は16,893,348,121円であります。	3.	元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、 その差額は16,857,482,737円であります。

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 平成20年5月17日 至 平成20年11月17日		当期 自 平成20年11月18日 至 平成21年5月18日	
分配金の計算過程		1. 分配金の計算過程	
	自 平成20年5月17日 至 平成20年8月18日		自 平成20年11月18日 至 平成21年2月16日
A	計算期末における費用控除 後の配当等収益 138,273,818 円	A	計算期末における費用控除 後の配当等収益 41,785,189 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 3,847,338,370 円	C	信託約款に定める収益調整 金 3,882,479,225 円
D	信託約款に定める分配準備 積立金 0 円	D	信託約款に定める分配準備 積立金 0 円
E	分配対象収益(A + B + C + D) 3,985,612,188 円	E	分配対象収益(A + B + C + D) 3,924,264,414 円
F	分配対象収益(1口当 たり) 0.1173 円	F	分配対象収益(1口当 たり) 0.1090 円
	(1万口当たり) 1,173 円		(1万口当たり) 1,090 円
G	分配金額 203,532,168 円	G	分配金額 215,969,945 円
H	分配金額(1口当 たり) 0.0060 円	H	分配金額(1口当 たり) 0.0060 円
	(1万口当たり) 60 円		(1万口当たり) 60 円
	分配金に加算した外国支払 税 172,097 円		分配金に加算した外国支払 税 25,489 円
	自 平成20年8月19日 至 平成20年11月17日		自 平成21年2月17日 至 平成21年5月18日
A	計算期末における費用控除 後の配当等収益 84,025,063 円	A	計算期末における費用控除 後の配当等収益 189,582,847 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 3,879,924,675 円	C	信託約款に定める収益調整 金 3,833,368,467 円
D	信託約款に定める分配準備 積立金 0 円	D	信託約款に定める分配準備 積立金 0 円
E	分配対象収益(A + B + C + D) 3,963,949,738 円	E	分配対象収益(A + B + C + D) 4,022,951,314 円
F	分配対象収益(1口当 たり) 0.1138 円	F	分配対象収益(1口当 たり) 0.1081 円
	(1万口当たり) 1,138 円		(1万口当たり) 1,081 円
G	分配金額 208,919,961 円	G	分配金額 222,833,420 円
H	分配金額(1口当 たり) 0.0060 円	H	分配金額(1口当 たり) 0.0060 円
	(1万口当たり) 60 円		(1万口当たり) 60 円
	分配金に加算した外国支払 税 12,662 円		分配金に加算した外国支払 税 389,562 円
		2.	その他費用の内訳 信託事務費用 7,778,061 円

## (有価証券に関する注記)

前期(自平成20年5月17日 至 平成20年11月17日)

## 売買目的有価証券

(単位:円)

種類	貸借対照表計上額	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	17,913,620,278	14,133,787,197
合計	17,913,620,278	14,133,787,197

当期(自平成20年11月18日 至 平成21年5月18日)

## 売買目的有価証券

(単位:円)

種類	貸借対照表計上額	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	20,327,191,078	3,042,646,407
合計	20,327,191,078	3,042,646,407

## (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20年11月17日現在	当期 平成21年5月18日現在
1口当たり純資産額	0.5149 円	1口当たり純資産額 0.5469 円
(1万口当たり純資産額)	(5,149 円)	(1万口当たり純資産額) (5,469 円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

## (親投資信託受益証券)

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	22,804,983,941	16,022,781,716	
	海外新興国株式インデックスMSCIエマージング (ヘッジなし)マザーファンド	5,219,996,802	4,304,409,362	
合計		28,024,980,743	20,327,191,078	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド」「海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(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. 「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20年11月17日現在	平成21年5月18日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		62,162,362	281,790,935
コール・ローン		912,694,562	470,256,188
株式		49,852,137,999	56,833,208,662
投資証券		640,810,289	680,953,728
派生商品評価勘定		20,324,376	10,235,231
未収入金		1,233,430,551	28,243,902
未収配当金		128,994,459	145,756,345
差入委託証拠金		498,291,520	110,456,695
流動資産合計		53,348,846,118	58,560,901,686
資産合計		53,348,846,118	58,560,901,686
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		170,846,202	20,397,490
未払金		867,548	39,118,818
未払解約金		163,807,600	213,284,848
流動負債合計		335,521,350	272,801,156
負債合計		335,521,350	272,801,156
純資産の部			
元本等			
元本		78,695,212,642	82,958,212,009
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		25,681,887,874	24,670,111,479
元本等合計		53,013,324,768	58,288,100,530
純資産合計		53,013,324,768	58,288,100,530
負債純資産合計		53,348,846,118	58,560,901,686

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

項目	対象期間 自 平成20年5月17日 至 平成20年11月17日	自 平成20年11月18日 至 平成21年5月18日
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）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>株式、投資証券及び新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券  同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券  同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券  同左</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>(1)デリバティブ取引  個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p> <p>(2)為替予約取引  原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>	<p>(1)デリバティブ取引  同左</p> <p>(2)為替予約取引  同左</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>同左</p>

## (貸借対照表に関する注記)

平成20年11月17日現在		平成21年5月18日現在			
1.	期首 期首元本額 期首からの追加設定元本額 期首からの解約元本額	平成20年5月17日 65,035,902,509 円 19,621,565,263 円 5,962,255,130 円	1. 期首 期首元本額 期首からの追加設定元本額 期首からの解約元本額	平成20年11月18日 78,695,212,642 円 11,314,361,352 円 7,051,361,985 円	
	平成20年11月17日現在の元本の内訳		平成21年5月18日現在の元本の内訳		
	インデックスファンド海外 株式ヘッジなし(DC専用)	7,173,372,799 円	インデックスファンド海外 株式ヘッジなし(DC専用)	8,227,329,340 円	
	DCインデックスバランス (株式20)	42,411,548 円	DCインデックスバランス (株式20)	40,671,145 円	
	DCインデックスバランス (株式40)	146,323,053 円	DCインデックスバランス (株式40)	145,081,210 円	
	DCインデックスバランス (株式60)	268,422,178 円	DCインデックスバランス (株式60)	277,879,139 円	
	DCインデックスバランス (株式80)	272,467,927 円	DCインデックスバランス (株式80)	315,104,696 円	
	世界の財産3分法ファンド (不動産・債券・株式)毎月分配型	22,174,677,439 円	世界の財産3分法ファンド (不動産・債券・株式)毎月分配型	22,065,805,133 円	
	日興五大陸株式ファンド	21,001,808,212 円	日興五大陸株式ファンド	22,804,983,941 円	
	グローバルコレクション (債券/株式/不動産・資源・食料等)隔月分配型	24,175,570 円	全世界株式債券ファンド (日本・先進国・新興国)毎月分配型	82,841,720 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	52,694,414 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)	240,482,014 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)	211,671,425 円	アセット・ナビゲーション ・ファンド(株式80)	28,966,128 円	
	アセット・ナビゲーション ・ファンド(株式80)	25,744,063 円	アセット・ナビゲーション ・ファンド(株式60)	24,027,960 円	
	アセット・ナビゲーション ・ファンド(株式60)	25,238,021 円	アセット・ナビゲーション ・ファンド(株式40)	43,991,323 円	
	アセット・ナビゲーション ・ファンド(株式40)	47,037,996 円	アセット・ナビゲーション ・ファンド(株式20)	61,404,492 円	
	アセット・ナビゲーション ・ファンド(株式20)	67,065,061 円	国際分散型ファンド40(適 格機関投資家向け)	20,350,254,541 円	
	国際分散型ファンド40(適 格機関投資家向け)	20,685,559,450 円	3資産バランスファンド (適格機関投資家向け)	461,625,339 円	
	3資産バランスファンド (適格機関投資家向け)	483,220,143 円	グローバルバランスファン ド35(適格機関投資家向 け)	25,483,687 円	
	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド(株 式20)	41,460,070 円	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド(株 式20)	45,001,410 円	
	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド(株 式40)	115,851,740 円	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド(株 式40)	112,815,533 円	
	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド(株 式60)	143,610,575 円	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド(株 式60)	144,083,805 円	
	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド(株 式80)	132,162,178 円	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド(株 式80)	150,389,088 円	
	年金積立 インデックスファ ンド海外株式(ヘッジな し)	5,560,238,780 円	年金積立 インデックスファ ンド海外株式(ヘッジな し)	7,309,990,365 円	
	(合計)	78,695,212,642 円	(合計)	82,958,212,009 円	
2.	本報告書における開示対象 ファンドの特定期間末日に おける当該親投資信託の受 益権の総数	78,695,212,642 円	2.	本報告書における開示対象 ファンドの特定期間末日に おける当該親投資信託の受 益権の総数	82,958,212,009 円
3.	元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、そ の差額は25,681,887,874円であります。		3.	元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、そ の差額は24,670,111,479円であります。	

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

## （有価証券に関する注記）

対象期間（自 平成20年5月17日 至 平成20年11月17日）

## 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	49,852,137,999	740,219,800
投資証券	640,810,289	33,089,655
合計	50,492,948,288	707,130,145

対象期間（自 平成20年11月18日 至 平成21年5月18日）

## 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	56,833,208,662	2,259,972,899
投資証券	680,953,728	130,082,614
合計	57,514,162,390	2,129,890,285

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

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 取引の状況に関する事項

	自 平成20年5月17日 至 平成20年11月17日	自 平成20年11月18日 至 平成21年5月18日
取引の内容	当投資信託が利用することができるデリバティブ取引等は、内外の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨先物取引、通貨オプション取引、金利先物取引、金利オプション取引、スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引、および為替予約取引であります。	同左
取引の利用目的及び取引に対する取組方針	市場動向を勘案し、デリバティブ取引を行う方針であります。また信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。	同左
取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引には、有価証券、為替、金利等の市場価格が変動することによって発生するリスクがあります。	同左
取引に係るリスク管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門が執行し、リスク管理業務担当部門が日常的にこれを監視しております。	同左

## 取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(単位:円)

区分	種類	平成20年11月17日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,613,086,073	-	2,504,927,306	108,158,767
		合計	2,613,086,073	-	2,504,927,306

(単位:円)

区分	種類	平成21年5月18日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	816,166,993	-	814,612,860	1,554,133
		合計	816,166,993	-	814,612,860

(注)時価の算定方法

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

## (通貨関連)

(単位:円)

区分	種類	平成20年11月17日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,115,714,319	-	2,073,351,260	42,363,059
	アメリカドル	1,366,058,667	-	1,349,042,480	17,016,187
	ユーロ	749,655,652	-	724,308,780	25,346,872
	合計	2,115,714,319	-	2,073,351,260	42,363,059

(単位:円)

区分	種類	平成21年5月18日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	498,566,846	-	489,958,720	8,608,126
	アメリカドル	401,765,228	-	395,884,800	5,880,428
	オーストラリアドル	3,394,128	-	3,393,600	528
	ユーロ	93,407,490	-	90,680,320	2,727,170
合計	498,566,846	-	489,958,720	8,608,126	

## (注)時価の算定方法

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

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

平成20年11月17日現在		平成21年5月18日現在	
1口当たり純資産額	0.6737円	1口当たり純資産額	0.7026円
(1万口当たり純資産額)	(6,737円)	(1万口当たり純資産額)	(7,026円)

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

外国株式(アメリカドル)

(単位:株、アメリカドル)

銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
00105510	AFLAC INC	19,467	32.14000	625,669.38	
00108410	AGCO CORP	3,845	25.22000	96,970.90	
00130H10	AES CORPORATION	25,938	8.55000	221,769.90	
00282410	ABBOTT LABORATORIES	63,547	43.32000	2,752,856.04	
00289620	ABERCROMBIE&FITCH CO-CL A	3,501	26.10000	91,376.10	
00493020	ACTIVISION BLIZZARD INC	24,400	11.60000	283,040.00	
00724F10	ADOBE SYSTEMS INC	22,184	25.92000	575,009.28	
00751Y10	ADVANCE AUTO PARTS, INC.	3,993	40.66000	162,355.38	
00790310	ADVANCED MICRO DEVICES INC	26,706	4.01000	107,091.06	
00811710	AETNA INC	19,243	25.76000	495,699.68	
00819010	AFFILIATED COMPUTER SERVICES INC-A	3,633	45.00000	163,485.00	
00846U10	AGILENT TECHNOLOGIES INC	14,445	17.65000	254,954.25	
00915810	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8,730	61.59000	537,680.70	
00971T10	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	7,700	20.74000	159,698.00	
01381710	ALCOA INC	33,834	9.03000	305,521.02	
01736110	ALLEGHENY ENERGY INC	7,190	25.78000	185,358.20	
01741R10	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	3,675	32.58000	119,731.50	
01849010	ALLERGAN INC	12,885	45.44000	585,494.40	
01858110	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,830	38.82000	109,860.60	
01880210	ALLIANT ENERGY CORP	4,465	23.57000	105,240.05	
02000210	ALLSTATE CORP	20,998	24.30000	510,251.40	
02076X10	ALPHA NATURAL RESOURCES INC	3,005	25.46000	76,507.30	
02144110	ALTERA CORPORATION	12,031	15.20000	182,871.20	
02313510	AMAZON.COM INC	14,235	73.60000	1,047,696.00	
02355110	HESS CORP	12,665	58.18000	736,849.70	
02360810	AMEREN CORPORATION	8,557	23.21000	198,607.97	
02364J10	TIME WARNER INC	49,513	23.52000	1,164,545.76	
02553710	AMERICAN ELECTRIC POWER	16,883	24.94000	421,062.02	
02553E10	AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	7,627	13.85000	105,633.95	
02581610	AMERICAN EXPRESS CO	42,794	24.23000	1,036,898.62	
02660910	WYETH	54,512	44.30000	2,414,881.60	
02687410	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	35,000	1.72000	60,200.00	
02991220	AMERICAN TOWER CORP	16,859	28.21000	475,592.39	
03073E10	AMERISOURCEBERGEN CORP	6,772	34.99000	236,952.28	
03076C10	AMERIPRISE FINANCIAL INC	9,360	25.40000	237,744.00	
03110010	AMETEK INC	4,695	29.99000	140,803.05	
03116210	AMGEN INC	43,366	48.16000	2,088,506.56	
03209510	AMPHENOL CORPORATION-CL A	7,400	31.80000	235,320.00	
03251110	ANADARKO PETROLEUM CORP	19,378	42.67000	826,859.26	
03265410	ANALOG DEVICES INC	12,066	19.46000	234,804.36	
03674B10	WELLPOINT INC	21,261	46.88000	996,715.68	
03738910	AON CORP	9,262	36.62000	339,174.44	
03741110	APACHE CORP	13,654	76.61000	1,046,032.94	
03760410	APOLLO GROUP INC-CL A	5,707	63.70000	363,535.90	
03783310	APPLE INC	36,441	122.42000	4,461,107.22	
03822210	APPLIED MATERIALS INC	55,658	10.71000	596,097.18	
03836W10	AQUA AMERICA INC	5,920	16.46000	97,443.20	
03938010	ARCH COAL INC	5,690	16.12000	91,722.80	
03948310	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	22,493	25.17000	566,148.81	
04273510	ARROW ELECTRONICS INC	5,280	21.20000	111,936.00	
04548710	ASSOCIATED BANC-CORP	5,414	15.66000	84,783.24	
04621X10	ASSURANT INC	4,665	22.58000	105,335.70	
05276910	AUTODESK INC	9,580	19.00000	182,020.00	
05301510	AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	21,231	35.79000	759,857.49	
05333210	AUTOZONE INC	1,827	158.01000	288,684.27	
05361110	AVERY DENNISON CORP	4,000	26.68000	106,720.00	

05380710	AVNET INC	6,970	20.94000	145,951.80	
05430310	AVON PRODUCTS INC	17,908	22.94000	410,809.52	
05493710	BB&T CORPORATION	26,083	21.63000	564,175.29	
05548210	BJ SERVICES CO	11,313	14.28000	161,549.64	
05592110	BMC SOFTWARE INC	7,584	34.41000	260,965.44	
05722410	BAKER HUGHES INC	12,816	35.32000	452,661.12	
05849810	BALL CORP	4,129	39.21000	161,898.09	
06405710	BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE	47,782	27.68000	1,322,605.76	
06605F10	BANK OF AMERICA CORP	268,159	10.67000	2,861,256.53	
06738310	C.R. BARD INC	4,294	70.81000	304,058.14	
07181310	BAXTER INTERNATIONAL INC	25,334	49.78000	1,261,126.52	
07581110	BECKMAN COULTER INC	2,773	52.43000	145,388.39	
07588710	BECTON DICKINSON & CO	9,486	65.16000	618,107.76	
07589610	BED BATH & BEYOND INC	10,292	27.83000	286,426.36	
07785310	VERIZON COMMUNICATIONS INC	116,398	29.61000	3,446,544.78	
08442310	W.R. BERKLEY CORPORATION	6,018	23.79000	143,168.22	
08467020	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	449	2,899.80000	1,302,010.20	
08651610	BEST BUY CO INC	14,659	35.41000	519,075.19	
09062X10	BIOGEN IDEC INC	11,362	49.07000	557,533.34	
09179710	BLACK & DECKER CORP	2,325	31.58000	73,423.50	
09367110	H&R BLOCK INC	14,360	13.94000	200,178.40	
09702310	BOEING CO	28,907	43.00000	1,243,001.00	
09972410	BORGWARNER INC	4,810	27.65000	132,996.50	
10113710	BOSTON SCIENTIFIC CORP	57,203	8.76000	501,098.28	
11012210	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	80,949	20.01000	1,619,789.49	
11132010	BROADCOM CORP-CL A	18,226	20.83000	379,647.58	
1150G111	ACCENTURE LTD-CL A	25,678	28.83000	740,296.74	
11563720	BROWN-FORMAN CORP -CL B	3,205	46.03000	147,526.15	
12189T10	BURLINGTON NORTHERN SANTA FE CORPORATION	14,376	67.14000	965,204.64	
12485720	CBS CORP	23,838	6.70000	159,714.60	
12526910	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,290	79.75000	182,627.50	
12541W20	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,905	50.73000	350,290.65	
12550910	CIGNA CORP	11,500	21.66000	249,090.00	
12640810	CSX CORP	16,751	27.67000	463,500.17	
12665010	CVS CAREMARK CORP	58,767	30.80000	1,810,023.60	
12686C10	CABLEVISION SYSTEM CORPORATION	9,160	18.27000	167,353.20	
12709710	CABOT OIL & GAS CORP	4,145	30.82000	127,748.90	
13442910	CAMPBELL SOUP CO	9,480	26.89000	254,917.20	
14040H10	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	18,515	24.54000	454,358.10	
14149Y10	CARDINAL HEALTH INC	14,920	34.88000	520,409.60	
14313010	CARMAX INC	9,244	10.53000	97,339.32	
14365810	CARNIVAL CORP	18,017	25.00000	450,425.00	
14912310	CATERPILLAR INC	25,021	35.74000	894,250.54	
15087010	CELANESE CORP	6,205	18.74000	116,281.70	
15102010	CELGENE CORPORATION	18,112	39.79000	720,676.48	
15670010	CENTURYTEL INC	4,365	30.19000	131,779.35	
15670810	CEPHALON INC	2,845	66.47000	189,107.15	
15688010	FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC	7,785	18.33000	142,699.05	
15986410	CHARLES RIVER LABORATORIES INTERNATIONAL INC	3,120	28.01000	87,391.20	
16161A10	JPMORGAN CHASE & CO	153,870	34.91000	5,371,601.70	
16516710	CHESAPEAKE ENERGY CORPORATION	24,435	19.95000	487,478.25	
16675110	CHEVRON CORPORATION	83,311	65.88000	5,488,528.68	
16776010	CME GROUP INC	2,541	277.30000	704,619.30	
17123210	CHUBB CORP	14,698	38.94000	572,340.12	
17134010	CHURCH & DWIGHT CO INC	3,245	52.80000	171,336.00	
17179810	CIMAREX ENERGY CO	3,405	27.55000	93,807.75	
17206210	CINCINNATI FINANCIAL CORPORATION	6,340	22.06000	139,860.40	
17275R10	CISCO SYSTEMS INC	240,025	17.92000	4,301,248.00	
17290810	CINTAS CORP	5,682	24.94000	141,709.08	
17296710	CITIGROUP INC	229,953	3.48000	800,236.44	
17737610	CITRIX SYSTEMS INC	7,163	27.62000	197,842.06	

18589610	CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	4,165	21.52000	89,630.80	
18905410	CLOROX COMPANY	5,961	51.11000	304,666.71	
18975410	COACH INC	13,066	23.14000	302,347.24	
19121610	COCA-COLA COMPANY	85,331	44.96000	3,836,481.76	
19121910	COCA-COLA ENTERPRISES	12,210	16.73000	204,273.30	
19244610	COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	12,044	25.76000	310,253.44	
19416210	COLGATE-PALMOLIVE CO	20,615	63.49000	1,308,846.35	
20030010	COMCAST CORP-CL A	81,441	14.42000	1,174,379.22	
20030020	COMCAST CORP-SPECIAL CL A	34,426	13.50000	464,751.00	
20034010	COMERICA INC	6,145	20.45000	125,665.25	
20491210	CA INC	16,975	18.04000	306,229.00	
20536310	COMPUTER SCIENCES CORP	6,273	36.29000	227,647.17	
20588710	CONAGRA FOODS INC	19,095	17.66000	337,217.70	
20854P10	CONSOL ENERGY INC	7,633	34.39000	262,498.87	
20911110	CONSOLIDATED EDISON INC	11,626	34.86000	405,282.36	
21036P10	CONSTELLATION BRANDS INC-A	9,140	11.90000	108,766.00	
21037110	CONSTELLATION ENERGY GROUP INC	7,810	24.80000	193,688.00	
21664010	CAMERON INTERNATIONAL CORP	9,101	27.55000	250,732.55	
21666910	COOPER INDUSTRIES LTD-CL A	7,098	32.56000	231,110.88	
21935010	CORNING INC	65,488	13.88000	908,973.44	
22160Q10	COSTCO WHOLESALE CORP	17,109	44.75000	765,627.75	
22281610	COVANCE INC	2,480	39.15000	97,092.00	
22286210	COVENTRY HEALTH CARE INC	6,405	19.09000	122,271.45	
22822710	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	11,710	21.90000	256,449.00	
23102110	CUMMINS INC	8,095	29.55000	239,207.25	
23331A10	DR HORTON INC	11,641	8.99000	104,652.59	
23332610	DST SYSTEMS INC	1,724	37.65000	64,908.60	
23333110	DTE ENERGY COMPANY	6,843	29.44000	201,457.92	
23585110	DANAHER CORP	10,582	57.84000	612,062.88	
23719410	DARDEN RESTAURANTS INC	5,223	34.10000	178,104.30	
23918K10	DAVITA INC	4,319	44.52000	192,281.88	
23975310	TARGET CORP	29,940	40.37000	1,208,677.80	
24237010	DEAN FOODS CO	6,427	18.53000	119,092.31	
24419910	DEERE & CO	17,635	41.91000	739,082.85	
24702510	DELL INC	74,536	10.98000	818,405.28	
24791620	DENBURY RESOURCES INC	10,025	15.50000	155,387.50	
24903010	DENTSPLY INTERNATIONAL INC	6,312	29.53000	186,393.36	
25179M10	DEVON ENERGY CORPORATION	17,811	58.50000	1,041,943.50	
25189310	DEVRY INC	2,625	45.67000	119,883.75	
25271C10	DIAMOND OFFSHORE DRILLING, INC	2,805	72.48000	203,306.40	
25468710	THE WALT DISNEY CO.	72,948	23.41000	1,707,712.68	
25468Y10	DISCOVERY COMMUNICATIONS INC	5,675	19.29000	109,470.75	
25470910	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	17,195	8.59000	147,705.05	
25470F30	DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	5,670	18.09000	102,570.30	
25674710	DOLLAR TREE INC	3,745	42.20000	158,039.00	
25747010	DOMINION RESOURCES INC/VA	24,387	30.52000	744,291.24	
25786710	RR DONNELLEY & SONS CO	8,950	12.37000	110,711.50	
26000310	DOVER CORP	7,370	31.15000	229,575.50	
26054310	DOW CHEMICAL COMPANY	38,068	16.47000	626,979.96	
26138E10	DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	9,854	22.07000	217,477.78	
26353410	E. I. DU PONT DE NEMOURS AND COMPANY	37,058	26.93000	997,971.94	
26439910	DUKE ENERGY CORP	50,423	13.48000	679,702.04	
26483E10	DUN & BRADSTREET CORPORATION	2,337	80.48000	188,081.76	
26817G10	DYNEGY INC	16,930	1.77000	29,966.10	
26864810	EMC CORP	84,369	11.94000	1,007,365.86	
26874Q10	ENSCO INTERNATIONAL INC	5,530	30.55000	168,941.50	
27743210	EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,140	38.02000	119,382.80	
27746110	EASTMAN KODAK CO	10,577	2.47000	26,125.19	
27805810	EATON CORP	6,453	45.31000	292,385.43	
27864210	EBAY INC	45,467	16.91000	768,846.97	
27876210	DISH NETWORK CORP-A	8,249	15.71000	129,591.79	
27886510	ECOLAB INC	10,195	36.26000	369,670.70	
28102010	EDISON INTERNATIONAL	13,004	28.36000	368,793.44	

28390510	EL PASO CORP	30,330	8.35000	253,255.50	
28551210	ELECTRONIC ARTS INC	13,499	21.03000	283,883.97	
29078E10	EMBARQ CORP	5,982	40.88000	244,544.16	
29101110	EMERSON ELECTRIC CO	31,905	33.75000	1,076,793.75	
29265N10	ENERGEN CORP	2,705	35.50000	96,027.50	
29266R10	ENERGIZER HOLDINGS INC	3,506	51.89000	181,926.34	
29356210	EOG RESOURCES INC	10,606	68.25000	723,859.50	
29364G10	ENTERGY CORP	7,807	73.42000	573,189.94	
29442910	EQUIFAX INC	5,569	27.57000	153,537.33	
29454910	EQT CORP	5,345	35.56000	190,068.20	
30161N10	EXELON CORPORATION	27,294	47.22000	1,288,822.68	
30212P10	EXPEDIA INC	6,900	13.85000	95,565.00	
30213010	EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON INC	8,762	32.11000	281,347.82	
30218210	EXPRESS SCRIPTS INC	8,691	58.67000	509,900.97	
30231G10	EXXON MOBIL CORPORATION	208,699	69.11000	14,423,187.89	
30244510	FLIR SYSTEMS INC	5,565	24.65000	137,177.25	
30249U10	FMC TECHNOLOGIES INC	7,135	35.59000	253,934.65	
30257110	FPL GROUP INC	15,385	54.44000	837,559.40	
30294110	FTI CONSULTING INC	2,295	52.18000	119,753.10	
30700010	FAMILY DOLLAR STORES	5,308	30.29000	160,779.32	
31190010	FASTENAL COMPANY	5,509	33.59000	185,047.31	
31304N10	FEDEX CORP	12,463	52.98000	660,289.74	
31410H10	MACY'S INC	16,104	11.33000	182,458.32	
31620R10	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL, INC.	8,541	15.00000	128,115.00	
31677310	FIFTH THIRD BANCORP	20,774	7.10000	147,495.40	
31852230	FIRST AMERICAN CORP	3,035	23.94000	72,657.90	
33643310	FIRST SOLAR INC	1,710	177.43000	303,405.30	
33773810	FISERV INC	6,424	40.04000	257,216.96	
33793210	FIRSTENERGY CORP	12,833	36.47000	468,019.51	
34354P10	FLOWERVE CORP	3,355	67.25000	225,623.75	
34386110	FLUOR CORP	7,623	43.25000	329,694.75	
34537010	FORD MOTOR CO	73,490	5.49000	403,460.10	
34583810	FOREST LABORATORIES INC	12,800	22.91000	293,248.00	
34609170	FOREST OIL CORP	4,315	17.38000	74,994.70	
34963110	FORTUNE BRANDS INC	5,661	36.20000	204,928.20	
35461310	FRANKLIN RESOURCES INC	6,600	60.10000	396,660.00	
35671D85	FREEPORT-MCMORAN COPPER-B	15,909	45.17000	718,609.53	
36467W10	GAMESTOP CORP	6,535	26.47000	172,981.45	
36473010	GANNETT CO	8,945	4.36000	39,000.20	
36476010	GAP INC	19,716	15.16000	298,894.56	
36955010	GENERAL DYNAMICS CORP	13,512	55.01000	743,295.12	
36960410	GENERAL ELECTRIC COMPANY	433,798	12.86000	5,578,642.28	
37033410	GENERAL MILLS INC	13,127	52.61000	690,611.47	
37246010	GENUINE PARTS CO	6,956	32.07000	223,078.92	
37291710	GENZYME CORP - GENL DIVISION	10,549	58.57000	617,854.93	
37555810	GILEAD SCIENCES INC	37,242	43.75000	1,629,337.50	
38141G10	GOLDMAN SACHS GROUP INC	19,668	134.40000	2,643,379.20	
38238810	GOODRICH CORP	4,860	43.31000	210,486.60	
38255010	GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	9,190	11.24000	103,295.60	
38259P50	GOOGLE INC-CL A	9,816	390.00000	3,828,240.00	
38480210	WW GRAINGER INC	2,792	77.71000	216,966.32	
40621610	HALLIBURTON CO	37,447	21.17000	792,752.99	
41131010	HANSEN NATURAL CORP	3,005	42.61000	128,043.05	
41282210	HARLEY-DAVIDSON INC	8,894	17.48000	155,467.12	
41387510	HARRIS CORP	5,795	29.68000	171,995.60	
41457P10-1	HARRIS STRATEX NETWORKS INC(新)	1,439	5.57000	8,015.23	
41586410	HARSCO CORP	3,365	27.82000	93,614.30	
41651510	HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP	12,237	14.60000	178,660.20	
41805610	HASBRO INC	4,903	22.93000	112,425.79	
42222G10	HEALTH NET INC	3,941	16.28000	64,159.48	
42307410	HJ HEINZ CO	13,425	35.14000	471,754.50	
42345210	HELMERICH & PAYNE INC	4,105	29.72000	122,000.60	
42786610	HERSHEY COMPANY	6,780	35.28000	239,198.40	

42823610	HEWLETT-PACKARD CO	100,365	35.01000	3,513,778.65	
43644010	HOLOGIC INC	10,133	11.71000	118,657.43	
43707610	HOME DEPOT INC	70,400	24.40000	1,717,760.00	
43850610	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	28,676	31.95000	916,198.20	
44045210	HORMEL FOODS CORP	3,430	32.59000	111,783.70	
44106010	HOSPIRA INC	6,641	33.04000	219,418.64	
44368310	HUDSON CITY BANCORP INC	19,870	12.28000	244,003.60	

[次へ](#)

44441810	THE DIRECTV GROUP INC	22,511	24.23000	545,441.53	
44485910	HUMANA INC	7,140	31.58000	225,481.20	
44565810	JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	3,075	26.90000	82,717.50	
44615010	HUNTINGTON BANCSHARES INC	13,195	4.63000	61,092.85	
44993410	IMS HEALTH INC	9,360	12.50000	117,000.00	
45068810	ITT EDUCATIONAL SERVICES INC	1,575	101.73000	160,224.75	
45091110	ITT CORPORATION	7,048	40.77000	287,346.96	
45230810	ILLINOIS TOOL WORKS	16,825	33.01000	555,393.25	
45232710	ILLUMINA INC	5,280	35.64000	188,179.20	
45686610	INGERSOLL-RAND CO-CL A	12,571	20.55000	258,334.05	
45814010	INTEL CORP	227,927	15.19000	3,462,211.13	
45822P10	WPS RESOURCES CORP	3,600	27.65000	99,540.00	
45865V10	INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	2,325	96.92000	225,339.00	
45920010	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	55,087	101.37000	5,584,169.19	
45950610	INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	3,759	30.00000	112,770.00	
45990210	INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY	11,686	13.60000	158,929.60	
46014610	INTERNATIONAL PAPER CO	14,895	12.49000	186,038.55	
46069010	INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES INC	20,306	5.09000	103,357.54	
46120210	INTUIT INC	12,576	23.98000	301,572.48	
46120E60	INTUITIVE SURGICAL INC	1,595	149.92000	239,122.40	
46284610	IRON MOUNTAIN INC	7,807	26.95000	210,398.65	
46815R10	LIFE TECHNOLOGIES CORP	7,726	36.21000	279,758.46	
46981410	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,220	38.58000	201,387.60	
47816010	JOHNSON & JOHNSON	113,774	55.41000	6,304,217.34	
47836610	JOHNSON CONTROLS INC	24,663	18.25000	450,099.75	
48116510	JOY GLOBAL INC	4,425	28.19000	124,740.75	
48203R10	JUNIPER NETWORKS INC	22,083	21.56000	476,109.48	
48242W10	KBR INC	7,335	16.99000	124,621.65	
48248010	KLA-TENCOR CORPORATION	6,579	25.24000	166,053.96	
48783610	KELLOGG CO	11,058	43.19000	477,595.02	
49326710	KEYCORP	20,128	5.80000	116,742.40	
49436810	KIMBERLY-CLARK CORP	16,378	50.49000	826,925.22	
50025510	KOHL'S CORP	12,122	41.33000	501,002.26	
50075N10	KRAFT FOODS INC-A	60,050	24.80000	1,489,240.00	
50104410	KROGER CO	25,930	21.80000	565,274.00	
50216110	LSI CORP	27,520	3.79000	104,300.80	
50242410	L-3 COMMUNICATIONS	4,981	74.69000	372,030.89	
50540R40	LABORATORY CORPORATION OF AMERICAN HOLDINGS	4,830	61.66000	297,817.80	
51280710	LAM RESEARCH CORPORATION	5,822	24.39000	141,998.58	
51783410	LAS VEGAS SANDS CORP	12,095	9.23000	111,636.85	
51843910	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,275	32.08000	137,142.00	
52466010	LEGGITT & PLATT INC	6,503	14.69000	95,529.07	
52490110	LEGG MASON INC	5,770	18.53000	106,918.10	
52728810	LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	19.84000	144,931.20	
52977110	LEXMARK INTERNATIONAL INC	3,305	17.12000	56,581.60	
53055530	LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	5,543	14.34000	79,486.62	
53071910	LIBERTY GLOBAL INC-A	6,058	14.46000	87,598.68	
53071M10	LIBERTY MEDIA HOLDING CORP-INTERACTIVE A	20,745	5.47000	113,475.15	
53071M50	LIBERTY MEDIA CORP - ENTERTAINMENT	20,161	23.92000	482,251.12	
53245710	ELI LILLY & CO	41,823	34.17000	1,429,091.91	
53271610	LIMITED BRANDS	12,153	11.01000	133,804.53	
53418710	LINCOLN NATIONAL CORP	9,838	16.12000	158,588.56	
53567810	LINEAR TECHNOLOGY CORP	8,904	20.66000	183,956.64	
53983010	LOCKHEED MARTIN CORP	14,261	79.93000	1,139,881.73	
54042410	LOEWS CORP	12,955	25.21000	326,595.55	
54414710	LORILLARD INC	6,430	69.39000	446,177.70	
54866110	LOWE'S COS INC	60,769	18.45000	1,121,188.05	
55261F10	M & T BANK CORP	2,798	46.16000	129,155.68	
55269010	MDU RESOURCES GROUP INC	6,650	16.85000	112,052.50	

55271510	MEMC ELECTRONIC MATERIALS INC	8,695	15.84000	137,728.80	
56418H10	MANPOWER INC	3,217	41.80000	134,470.60	
57174810	MARSH & MCLENNAN COMPANIES INC	21,723	19.13000	415,560.99	
57183410	MARSHALL & ILSLEY CORP	9,132	8.01000	73,147.32	
57190310	MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,731	21.57000	231,467.67	
57328410	MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	1,635	81.08000	132,565.80	
57459910	MASCO CORP	15,919	9.54000	151,867.26	
57636Q10	MASTERCARD INC-A	3,730	173.13000	645,774.90	
57708110	MATTEL INC	14,664	13.94000	204,416.16	
57978020	MCCORMIK & CO-NON VTG SHRS	5,285	31.17000	164,733.45	
58003710	MCDERMOTT INTERNATIONAL INC	9,085	18.48000	167,890.80	
58013510	MCDONALD'S CORPORATION	46,026	53.46000	2,460,549.96	
58064510	MCGRAW-HILL COMPANIES INC	13,097	30.12000	394,481.64	
58155Q10	MCKESSON CORPORATION	11,574	38.46000	445,136.04	
58333410	MEADWESTVACO CORP	5,859	14.47000	84,779.73	
58405U10	MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	19,762	44.74000	884,151.88	
58505510	MEDTRONIC INC	46,127	33.40000	1,540,641.80	
58933110	MERCK & CO. INC.	86,533	25.47000	2,203,995.51	
59156R10	METLIFE INC	32,970	29.39000	968,988.30	
59170810	METROPCS COMMUNICATIONS INC	12,715	16.73000	212,721.95	
59491810	MICROSOFT CORP	328,329	20.22000	6,638,812.38	
59501710	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	7,429	20.16000	149,768.64	
59511210	MICRON TECHNOLOGY INC	29,277	4.28000	125,305.56	
60107310	MILLIPORE CORP	2,505	64.82000	162,374.10	
60405910	3M CO	27,321	57.92000	1,582,432.32	
60467510	MIRANT CORP	8,230	13.98000	115,055.40	
60819010	MOHAWK INDUSTRIES INC	2,203	39.77000	87,613.31	
60871R20	MOLSON COORS BREWING COMPANY-B	6,295	41.96000	264,138.20	
61166W10	MONSANTO CO	22,736	89.95000	2,045,103.20	
61536910	MOODY'S CORPORATION	8,597	28.40000	244,154.80	
61744644	MORGAN STANLEY	45,200	26.13000	1,181,076.00	
61945A10	MOSAIC CO/THE	6,415	51.30000	329,089.50	
62007610	MOTOROLA INC	95,680	5.91000	565,468.80	
62671710	MURPHY OIL CORPORATION	7,535	52.33000	394,306.55	
62853010	MYLAN INC	12,415	12.76000	158,415.40	
62913F20	NII HOLDINGS INC	6,562	17.36000	113,916.32	
62937750	NRG ENERGY INC	9,360	19.58000	183,268.80	
62940M10	VIRGIN MEDIA INC	9,840	6.91000	67,994.40	
62949W10	NYSE EURONEXT	5,370	24.19000	129,900.30	
62956810	NABORS INDUSTRIES LTD	10,741	16.06000	172,500.46	
63110310	NASDAQ STOCK MARKET INC	5,680	17.88000	101,558.40	
63707110	NATIONAL-OILWELL VARCO INC	17,111	32.67000	559,016.37	
63764010	NATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	10,270	11.95000	122,726.50	
64093810	MCAFEE INC	6,335	38.04000	240,983.40	
64120L10	NETAPP INC	14,311	17.57000	251,444.27	
64944510	NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	12,954	10.47000	135,628.38	
65119210	NEWELL RUBBERMAID INC	9,710	10.39000	100,886.90	
65129010	NEWFIELD EXPLORATION COMPANY	5,285	31.03000	163,993.55	
65163910	NEWMONT MINING CORP	19,870	42.64000	847,256.80	
65248770	NEWS CORP INC-CL B WHEN ISS	14,409	9.96000	143,513.64	
65248780	NEWS CORP-CL A	77,717	8.60000	668,366.20	
65410610	NIKE INC -CL B	15,562	49.75000	774,209.50	
65473P10	NISOURCE INC	11,580	10.64000	123,211.20	
65489410	NOBLE ENERGY INC	7,201	51.97000	374,235.97	
65504210	NOBLE CORP	11,017	27.92000	307,594.64	
65566410	NORDSTROM INC	6,435	22.58000	145,302.30	
65584410	NORFOLK SOUTHERN CORP	15,450	35.08000	541,986.00	
66439710	NORTHEAST UTILITIES	6,920	20.58000	142,413.60	
66577210	XCEL ENERGY INC	19,129	17.20000	329,018.80	
66585910	NORTHERN TRUST CORP	8,440	53.55000	451,962.00	
66680710	NORTHROP GRUMMAN CORP	12,889	48.09000	619,832.01	
67019E10	NSTAR	5,005	28.83000	144,294.15	
67034610	NUCOR CORP	13,254	38.90000	515,580.60	
67066G10	NVIDIA CORP	22,340	8.74000	195,251.60	

67459910	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	33,136	60.03000	1,989,154.08
68022310	OLD REPUBLIC INTERNATIONAL CORP	9,528	9.74000	92,802.72
68190410	OMNICARE INC	4,820	26.05000	125,561.00
68191910	OMNICOM GROUP INC	12,977	30.97000	401,897.69
68267810	ONEOK INC	5,880	26.47000	155,643.60
68389X10	ORACLE CORP	168,950	18.42000	3,112,059.00
68609110	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,205	36.17000	188,264.85
69076840	OWENS-ILLINOIS INC	6,475	25.32000	163,947.00
69331C10	P G & E CORP	14,016	35.58000	498,689.28
69347510	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	17,655	41.79000	737,802.45
69349910	PPL CORPORATION	15,828	31.37000	496,524.36
69350610	PPG INDUSTRIES INC	7,047	42.20000	297,383.40
69371810	PACCAR INTERNATIONAL INC	14,019	28.88000	404,868.72
69525710	PACTIV CORPORATION	5,804	21.40000	124,205.60
69642930	PALL CORP	5,116	25.27000	129,281.32
70109410	PARKER HANNIFIN CORP	6,635	43.66000	289,684.10
70341210	PATTERSON COS INC	4,587	22.08000	101,280.96
70348110	PATTERSON-UTI ENERGY INC	5,197	12.16000	63,195.52
70432610	PAYCHEX INC	13,352	26.72000	356,765.44
70454910	PEABODY ENERGY CORPORATION	11,300	28.94000	327,022.00
70816010	J.C. PENNEY CO INC (HOLDING CO)	8,461	26.54000	224,554.94
70963110	PENTAIR INC	4,104	25.26000	103,667.04
71019810	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	14,980	16.09000	241,028.20
71340910	PEPSI BOTTLING GROUP INC	5,315	32.28000	171,568.20
71344810	PEPSICO INC	63,633	50.32000	3,202,012.56
71429010	PERRIGO CO	3,470	26.57000	92,197.90
71649510	PETROHAWK ENERGY CORP	10,750	22.30000	239,725.00
71676810	PETSMART INC	5,125	21.96000	112,545.00
71708110	PFIZER INC	276,332	15.01000	4,147,743.32
71712410	PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVELOPMENT INC	4,310	20.34000	87,665.40
71815410	ALTRIA GROUP INC	84,208	16.98000	1,429,851.84
71817210	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	82,873	43.17000	3,577,627.41
71850710	CONOCOPHILLIPS	57,990	43.93000	2,547,500.70
72348410	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	4,079	26.10000	106,461.90
72378710	PIONEER NATURAL RESOURCES COMPANY	5,260	24.39000	128,291.40
72447910	PITNEY BOWES INC	8,543	21.34000	182,307.62
72650510	PLAINS EXPLORATION & PRODUCTION CO	4,405	21.30000	93,826.50
73157210	POLO RALPH LAUREN CORP	2,350	46.73000	109,815.50
73767910	PEPCO HOLDINGS INC	8,712	11.89000	103,585.68
74005P10	PRAXAIR INC	12,975	70.50000	914,737.50
74018910	PRECISION CASTPARTS CORP	5,845	77.31000	451,876.95
74147710	T ROWE PRICE GROUP INC	10,070	36.95000	372,086.50
74150340	PRICELINE.COM INC	1,635	99.66000	162,944.10
74153Q10	PRIDE INTERNATIONAL INC	6,670	20.12000	134,200.40
74251V10	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,520	18.58000	195,461.60
74271810	PROCTER & GAMBLE COMPANY	120,843	50.67000	6,123,114.81
74326310	PROGRESS ENERGY INC	11,638	34.07000	396,506.66
74331510	PROGRESSIVE CORP	27,255	16.00000	436,080.00
74432010	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	17,032	37.75000	642,958.00
74457310	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	21,318	31.69000	675,567.42
74586710	PULTE HOMES INC	13,499	9.63000	129,995.37
74752510	QUALCOMM INC	67,812	40.72000	2,761,304.64
74762E10	QUANTA SERVICES INC	8,315	21.87000	181,849.05
74834L10	QUEST DIAGNOSTICS INC	7,181	50.40000	361,922.40
74835610	QUESTAR CORPORATION	7,365	32.96000	242,750.40
74912110	QWEST COMMUNICATIONS INTERNATIONAL INC	65,293	4.09000	267,048.37
75102510	RALCORP HOLDINGS INC	2,415	60.63000	146,421.45
75281A10	RANGE RESOURCES CORP	6,505	39.93000	259,744.65
75511140	RAYTHEON COMPANY	17,702	46.07000	815,531.14
75894010	REGIONS FINANCIAL CORP	26,609	4.85000	129,053.65
75952B10	RRI ENERGY INC	14,970	4.49000	67,215.30
75952J10	CENTERPOINT ENERGY INC	13,697	10.05000	137,654.85

76075910	REPUBLIC SERVICES INC	14,900	22.17000	330,333.00	
76182K10	REYNOLDS AMERICAN INC	7,165	39.96000	286,313.40	
77032310	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	6,240	21.96000	137,030.40	
77390310	ROCKWELL AUTOMATION INC	5,878	31.20000	183,393.60	
77434110	ROCKWELL COLLINS INC.	6,270	38.22000	239,639.40	
77669610	ROPER INDUSTRIES INC	3,990	42.98000	171,490.20	
77829610	ROSS STORES INC	5,483	35.19000	192,946.77	
77938210	ROWAN COMPANIES INC	3,895	17.12000	66,682.40	
78387G10	AT&T INC	241,656	24.88000	6,012,401.28	
78390X10	SAIC INC	7,890	17.83000	140,678.70	
78411710	SEI INVESTMENTS CO	6,180	14.76000	91,216.80	
78463510	SPX CORP	2,277	42.99000	97,888.23	
78651420	SAFEWAY INC	18,228	19.23000	350,524.44	
79084910	ST JUDE MEDICAL INC	14,275	37.11000	529,745.25	
79286010	TRAVELERS COS INC/THE	23,849	39.76000	948,236.24	
79466L30	SALESFORCE.COM INC	4,700	40.20000	188,940.00	
80004C10	SANDISK CORPORATION	10,323	13.90000	143,489.70	
80311110	SARA LEE CORP	30,403	9.22000	280,315.66	
80589M10	SCANA CORP	4,853	28.78000	139,669.34	
80640710	HENRY SCHEIN INC	4,060	44.23000	179,573.80	
80660510	SCHERING-PLOUGH CORP	66,495	23.35000	1,552,658.25	
80685710	SCHLUMBERGER LTD	48,977	52.05000	2,549,252.85	
80851310	CHARLES SCHWAB CORP	40,559	16.91000	685,852.69	
81106510	SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	3,345	27.47000	91,887.15	
81211K10	SEALED AIR CORP	5,646	18.73000	105,749.58	
81235010	SEARS HOLDINGS CORPORATION	2,871	49.87000	143,176.77	
81685110	SEMPRA ENERGY	9,527	44.25000	421,569.75	
82434810	SHERWIN-WILLIAMS CO	4,042	53.61000	216,691.62	
82655210	SIGMA ALDRICH CORP	5,485	45.27000	248,305.95	
83211010	SMITH INTERNATIONAL INC	8,676	26.76000	232,169.76	
83269640	JM SMUCKER CO/THE	5,110	39.75000	203,122.50	
84258710	SOUTHERN CO	30,765	28.12000	865,111.80	
84474110	SOUTHWEST AIRLINES COMPANY	6,100	6.89000	42,029.00	
84546710	SOUTHWESTERN ENERGY CO	13,310	39.05000	519,755.50	
84756010	SPECTRA ENERGY CORP	26,769	14.83000	396,984.27	
85206110	SPRINT NEXTEL CORPORATION	115,162	5.05000	581,568.10	
85461610	STANLEY WORKS	2,642	33.94000	89,669.48	
85503010	STAPLES INC	29,634	19.19000	568,676.46	
85524410	STARBUCKS CORP	29,757	12.94000	385,055.58	
85590520	STARWOOD HOTELS & RESORTS WORLDWIDE INC	6,957	19.85000	138,096.45	
85747710	STATE STREET CORP	18,477	38.51000	711,549.27	
85981210	STERICYCLE INC	3,555	52.09000	185,179.95	
86366710	STRYKER CORP	11,638	38.99000	453,765.62	
86676210	SUNOCO INC	5,078	28.17000	143,047.26	
86681010	SUN MICROSYSTEMS INC	29,386	9.00000	264,474.00	
86765210	SUNPOWER CORP-CLASS A	2,440	25.05000	61,122.00	
86791410	SUNTRUST BANKS INC	14,417	15.05000	216,975.85	
86853610	SUPERVALU INC	8,880	15.45000	137,196.00	
87150310	SYMANTEC CORP	35,200	14.82000	521,664.00	
87160710	SYNOPSIS INC	5,697	20.63000	117,529.11	
87161C10	SYNOVUS FINANCIAL CORP	10,565	3.70000	39,090.50	
87182910	SYSCO CORP	23,321	22.82000	532,185.22	
87236Y10	TD AMERITRADE HOLDING CORP	9,050	15.90000	143,895.00	
87240R10	TFS FINANCIAL CORP	4,255	11.56000	49,187.80	
87254010	TJX COMPANIES INC	17,204	26.84000	461,755.36	
87943310	TELEPHONE AND DATA SYSTEMS	2,240	30.02000	67,244.80	
88076W10	TERADATA CORP	7,150	20.60000	147,290.00	
88077910	TEREX CORP	3,205	14.43000	46,248.15	
88250810	TEXAS INSTRUMENTS INC	53,807	17.63000	948,617.41	
88320310	TEXTRON INC	9,791	10.82000	105,938.62	
88355610	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	17,399	35.14000	611,400.86	
88654710	TIFFANY & CO	5,030	25.48000	128,164.40	
88706M10	TIM HORTONS INC	7,404	24.40000	180,657.60	

88732J10	TIME WARNER CABLE INC	14,837	31.01000	460,095.37	
88947810	TOLL BROTHERS INC	5,526	18.57000	102,617.82	
89102710	TORCHMARK CORP	4,181	35.34000	147,756.54	
89190610	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	6,661	13.00000	86,593.00	
89595310	YUM! BRANDS INC	19,174	33.16000	635,809.84	
90212410	TYCO INTERNATIONAL LTD	19,505	25.50000	497,377.50	
90249410	TYSON FOODS INC	11,206	12.56000	140,747.36	
90290582	MARATHON OIL CORPORATION	29,247	28.63000	837,341.61	
90297310	US BANCORP	77,816	17.67000	1,375,008.72	

[次へ](#)

90319210	UNUM GROUP	13,988	16.27000	227,584.76	
90337T10	UNITED STATES STEEL CORP	4,537	27.13000	123,088.81	
90390U10	SLM CORP	19,052	5.55000	105,738.60	
90391410	ULTRA PETROLEUM CORP	6,379	45.06000	287,437.74	
90781810	UNION PACIFIC CORP	21,028	46.58000	979,484.24	
91058110	UNITEDHEALTH GROUP INC	50,250	27.51000	1,382,377.50	
91131210	UNITED PARCEL SERVICE INC-CL B	27,697	51.99000	1,439,967.03	
91301710	UNITED TECHNOLOGIES CORP	37,075	51.28000	1,901,206.00	
91704710	URBAN OUTFITTERS INC	4,770	18.76000	89,485.20	
91820410	VF CORP	3,830	54.39000	208,313.70	
91913Y10	VALERO ENERGY CORPORATION	21,917	20.84000	456,750.28	
92220P10	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	5,339	35.01000	186,918.39	
92343E10	VERISIGN INC	7,695	22.98000	176,831.10	
92532F10	VERTEX PHARMACEUTICA	6,860	28.54000	195,784.40	
92552430	VIACOM INC-CLASS B	21,643	20.29000	439,136.47	
92826C83	VISA INC	14,870	65.07000	967,590.90	
92916010	VULCAN MATERIALS CO	4,443	41.38000	183,851.34	
93114210	WAL-MART STORES INC	96,767	48.15000	4,659,331.05	
93142210	WALGREEN CO	40,407	29.78000	1,203,320.46	
93964010	THE WASHINGTON POST COMPANY	247	358.71000	88,601.37	
94106L10	WASTE MANAGEMENT INC	20,339	26.83000	545,695.37	
94184810	WATERS CORP	4,046	43.48000	175,920.08	
94707410	WEATHERFORD INTERNATIONAL LTD	28,484	17.84000	508,154.56	
94974610	WELLS FARGO & COMPANY	178,940	24.87000	4,450,237.80	
95810210	WESTERN DIGITAL CORP	9,920	23.16000	229,747.20	
95980210	WESTERN UNION CO/THE	29,946	16.36000	489,916.56	
96216610	WEYERHAEUSER CO	8,495	31.45000	267,167.75	
96332010	WHIRLPOOL CORP	2,934	41.98000	123,169.32	
96683710	WHOLE FOODS MARKET INC	7,010	19.61000	137,466.10	
96945710	THE WILLIAMS COMPANIES INC	23,919	15.05000	359,980.95	
97428010	WINDSTREAM CORPORATION	20,465	8.24000	168,631.60	
97665710	WISCONSIN ENERGY CORP	5,127	37.28000	191,134.56	
98313410	WYNN RESORTS LIMITED	2,420	37.90000	91,718.00	
98385X10	XTO ENERGY INC	23,247	39.99000	929,647.53	
98391910	XILINX INC	11,600	18.92000	219,472.00	
98412110	XEROX CORP	34,421	6.23000	214,442.83	
98433210	YAHOO! INC	55,575	14.91000	828,623.25	
98956P10	ZIMMER HOLDINGS INC	9,412	43.71000	411,398.52	
98970110	ZIONS BANCORPORATION	5,807	15.05000	87,395.35	
99990000	FLEXTRONICS INTERNATIONAL LTD	30,311	3.50000	106,088.50	
G0070K10	ACE LTD	14,028	43.12000	604,887.36	
G0450A10	ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,815	57.70000	104,725.50	
G0692U10	AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	5,885	24.39000	143,535.15	
G1696210	BUNGE LIMITED	5,132	55.62000	285,441.84	
G2552X10	COVIDIEN LTD	21,265	36.40000	774,046.00	
G3223R10	EVEREST RE GROUP LTD	2,684	68.76000	184,551.84	
G3653513	FOSTER WHEELER AG	6,295	23.13000	145,603.35	
G3726010	GARMIN LTD	4,625	20.74000	95,922.50	
G491BT10	INVESCO LTD	16,357	14.39000	235,377.23	
G5876H10	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	22,854	10.69000	244,309.26	
G6852T10	PARTNERRE LTD	2,372	66.39000	157,477.08	
G7496G10	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,362	46.22000	109,171.64	
G7945J10	SEAGATE TECHNOLOGY	20,539	7.25000	148,907.75	
G9007810	TRANSOCEAN LTD	13,410	68.36000	916,707.60	
G9144P10	TYCO ELECTRONICS LTD	18,890	16.80000	317,352.00	
G9618E10	WHITE MOUNTAINS INSURANCE GROUP LTD	315	212.24000	66,855.60	
G9665510	WILLIS GROUP HOLDINGS LTD	6,770	26.27000	177,847.90	
V7780T10	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	5,188	14.30000	74,188.40	
アメリカドル 計		12,064,762		330,973,527.30	
(邦貨換算額)				(31,389,529,329)	

外国株式(カナダドル)

(単位:株,カナダドル)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
ABX	BARRICK GOLD CORP	36,149	39.46000	1,426,439.54	
ACM/A	ASTRAL MEDIA INC	2,140	28.60000	61,204.00	
AER	GROUPE AEROPLAN INC	7,455	7.30000	54,421.50	
AGE	AGNICO-EAGLE MINES	6,060	61.32000	371,599.20	
AGU	AGRIUM INC	6,500	56.82000	369,330.00	
ATD/B	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	6,060	13.26000	80,355.60	
AXC	ADDAX PETROLEUM CORP	3,745	32.66000	122,311.70	
BBDB	BOMBARDIER INC 'B'	57,241	3.77000	215,798.57	
BCE	BCE INC	11,310	23.96000	270,987.60	
BMO	BANK OF MONTREAL	22,711	41.79000	949,092.69	
BNNA	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	22,282	20.21000	450,319.22	
BNS	BANK OF NOVA SCOTIA	41,164	35.00000	1,440,740.00	
BPO	BROOKFIELD PROPERTIES CORP	8,959	8.42000	75,434.78	
BVF	BIOVAIL CORPORATION	5,759	12.89000	74,233.51	
CAE	CAE INC	10,210	7.26000	74,124.60	
CCO	CAMECO CORP CORPORATION	15,572	28.83000	448,940.76	
CIXF	CI FINANCIAL CORP	7,240	16.40000	118,736.00	
CM	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	15,655	56.01000	876,836.55	
CNQ	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	22,447	57.96000	1,301,028.12	
CNR	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	19,384	46.05000	892,633.20	
CPZ	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,970	41.23000	287,373.10	
CTR/A	CANADIAN TIRE CORPORATION LIMITED -CL A	3,340	46.72000	156,044.80	
CU	CANADIAN UTILITIES LTD-A	3,725	34.75000	129,443.75	
ECA	ENCANA CORP	30,648	59.23000	1,815,281.04	
ELD	ELDORADO GOLD CORP	15,315	9.63000	147,483.45	
ENB	ENBRIDGE INC	15,895	36.86000	585,889.70	
ESI	ENSIGN ENERGY SERVICES INC	4,520	13.70000	61,924.00	
FFH	FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD	737	305.06000	224,829.22	
FM	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	2,875	45.51000	130,841.25	
FTS	FORTIS INC	7,570	23.00000	174,110.00	
FTT	FINNING INTERNATIONAL INC	7,120	13.36000	95,123.20	
G	GOLDCORP INC	30,602	39.01000	1,193,784.02	
GIB/A	CGI GROUP INC	11,525	10.25000	118,131.25	
GIL	GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,920	15.85000	62,132.00	
GWO	GREAT WEST LIFECO INC	11,049	21.17000	233,907.33	
HSE	HUSKY ENERGY INC	9,239	31.16000	287,887.24	
IAG	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	3,025	23.87000	72,206.75	
IGI	IGM FINANCIAL INC	5,215	36.10000	188,261.50	
IMG	IAMGOLD CORP	12,045	11.44000	137,794.80	
IMN	INMET MINING CORP	1,500	41.70000	62,550.00	
IMO	IMPERIAL OIL LTD	11,667	40.66000	474,380.22	
IVN	IVANHOE MINES LTD	15,050	7.05000	106,102.50	
K	KINROSS GOLD CORP	27,133	19.81000	537,504.73	
L	LOBLAW COMPANIES LTD	4,479	35.25000	157,884.75	
MDS	MDS INC	4,622	6.19000	28,610.18	
MFC	MANULIFE FINANCIAL CORP	61,481	21.00000	1,291,101.00	
MGA	MAGNA INTERNATIONAL INC-CL A	4,522	36.28000	164,058.16	
MRU/A	METRO INC-A	5,930	36.21000	214,725.30	
MX	METHANEX CORPORATION	5,840	13.71000	80,066.40	
NA	NATIONAL BANK OF CANADA	6,455	46.40000	299,512.00	
NKO	NIKO RESOURCES LTD	1,905	73.56000	140,131.80	
NXY	NEXEN INC	19,790	22.63000	447,847.70	
OCX	ONEX CORPORATION	3,840	21.25000	81,600.00	
PAA	PAN AMERICAN SILVER CORP	3,410	22.00000	75,020.00	
PCA	PETRO-CANADA	20,500	41.60000	852,800.00	
PD	PRECISION DRILLING TRUST	3,795	5.67000	21,517.65	
PD-R	PRECISION DRILLING TRUST-RTS	3,795	0.39000	1,480.05	
POT	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC	12,544	125.80000	1,578,035.20	
POW	POWER CORP OF CANADA	13,675	23.68000	323,824.00	
PWF	POWER FINANCIAL CORPORATION	9,705	24.38000	236,607.90	

RBA	RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	4,365	26.81000	117,025.65	
RCI/B	ROGERS COMMUNICATIONS INC-CL B	21,795	29.60000	645,132.00	
RIM	RESEARCH IN MOTION	21,143	85.23000	1,802,017.89	
RY	ROYAL BANK OF CANADA	55,549	41.94000	2,329,725.06	
SAP	SAPUTO INC	6,845	21.85000	149,563.25	
SC	SHOPPERS DRUG MART CORP	8,820	44.65000	393,813.00	
SHER	SHERRITT INTERNATIONAL CORP	18,000	4.99000	89,820.00	
SJRB	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	14,495	18.75000	271,781.25	
SLC	SUN LIFE FINANCIAL INC	23,099	27.01000	623,903.99	
SLW	SILVER WHEATON CORP	11,515	10.00000	115,150.00	
SNC	SNC-LAVALIN GROUP INC	5,800	39.00000	226,200.00	
SU	SUNCOR ENERGY INC	38,768	33.67000	1,305,318.56	
T	TELUS CORP	1,440	30.35000	43,704.00	
T/A	TELUS CORPORATION -NON VOTE	4,348	29.20000	126,961.60	
TA	TRANSALTA CORP	9,680	20.25000	196,020.00	
TCW	TRICAN WELL SERVICE LTD	4,075	8.55000	34,841.25	
TD	TORONTO-DOMINION BANK	33,145	47.73000	1,582,010.85	
TEK/B	TECK RESOURCES LTD-CLS B	16,840	14.28000	240,475.20	
TLM	TALISMAN ENERGY INC	42,987	16.10000	692,090.70	
TOC	THOMSON REUTERS CORP	9,009	33.58000	302,522.22	
TRE	SINO-FOREST CORP	5,205	12.40000	64,542.00	
TRP	TRANSCANADA CORP	24,438	30.67000	749,513.46	
WN	GEORGE WESTON LTD	2,187	64.20000	140,405.40	
X	TMX GROUP INC	3,590	31.18000	111,936.20	
YRI	YAMANA GOLD INC	27,866	10.33000	287,855.78	
カナダドル 計		1,170,020		35,594,704.39	
(邦貨換算額)				(2,860,034,498)	

## 外国株式(オーストラリアドル)

(単位:株、オーストラリアドル)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
AGK	AGL ENERGY LTD	22,765	14.22000	323,718.30	
ALL	ARISTOCRAT LEISURE LTD	11,305	3.70000	41,828.50	
AMC	AMCOR LTD	35,775	4.82000	172,435.50	
AMP	AMP LIMITED	81,862	5.17000	423,226.54	
ANZ	AUSTRALIA AND NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD	84,577	15.27000	1,291,490.79	
ASX	ASX LTD	7,235	32.95000	238,393.25	
BBG	BILLABONG INTERNATIONAL LTD	6,630	10.62000	70,410.60	
BEN	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	11,913	6.66000	79,340.58	
BHP	BHP BILLITON LTD	138,491	33.34000	4,617,289.94	
BOR	BORAL LIMITED	22,060	4.18000	92,210.80	
BSL	BLUESCOPE STEEL LIMITED	37,076	1.94000	71,927.44	
BXBAU	BRAMBLES LTD	54,838	6.00000	329,028.00	
CBA	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	61,012	35.82000	2,185,449.84	
CCL	COCA-COLA AMATIL LIMITED	21,315	8.46000	180,324.90	
COH	COCHLEAR LIMITED	2,157	49.98000	107,806.86	
CPU	COMPUTERSHARE LIMITED	17,960	8.81000	158,227.60	
CSL	CSL LIMITED	24,917	31.49000	784,636.33	
CSR	CSR LIMITED	52,528	1.45000	76,165.60	
CTX	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	6,935	9.99000	69,280.65	
CWN	CROWN LTD	17,690	6.97000	123,299.30	
FBG	FOSTER'S GROUP LTD	77,620	5.18000	402,071.60	
FMG	FORTESCUE METALS GROUP LTD	49,920	2.66000	132,787.20	
FXJ	FAIRFAX MEDIA LTD	57,250	1.04500	59,826.25	
GFF	GOODMAN FIELDER LTD	81,745	1.25000	102,181.25	
HVN	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	25,515	3.05000	77,820.75	
IPL	INCITEC PIVOT LTD	64,675	2.35000	151,986.25	
JHX	JAMES HARDIE INDUSTRIES NW	16,765	4.48000	75,107.20	
LEI	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	5,795	22.80000	132,126.00	
LLC	LEND LEASE CORP LIMITED	21,287	6.82000	145,177.34	
LNN	LION NATHAN LIMITED	18,130	11.64000	211,033.20	
MAP	MACQUARIE AIRPORTS	22,500	1.85500	41,737.50	
MBL	MACQUARIE GROUP LIMITED	11,166	34.60000	386,343.60	

MIG	MACQUARIE INFRASTRUCTURE GROUP	95,017	1.40000	133,023.80	
MTS	METCASH LTD	31,160	4.15000	129,314.00	
NAB	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	77,583	21.47000	1,665,707.01	
NCM	NEWCREST MINING LIMITED	20,224	29.51000	596,810.24	
NMH	AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS	34,590	3.90000	134,901.00	
NRM	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	84,608	3.56000	301,204.48	
ORG	ORIGIN ENERGY LIMITED	37,670	15.49000	583,508.30	
ORI	ORICA LTD	14,920	18.45000	275,274.00	
OST	ONESTEEL LIMITED	33,285	2.25000	74,891.25	
PPT	PERPETUAL LTD	2,260	32.01000	72,342.60	
QAN	QANTAS AIRWAYS LIMITED	46,470	1.91000	88,757.70	
QBE	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	40,350	20.60000	831,210.00	
RIO	RIO TINTO LIMITED	11,920	61.88000	737,609.60	
SGM	SIMS METAL MANAGEMENT LTD	6,495	22.12000	143,669.40	
SHL	SONIC HEALTHCARE LTD	14,760	12.26000	180,957.60	
STO	SANTOS LTD	28,970	14.13000	409,346.10	
SUN	SUNCORP-METWAY LIMITED	54,345	6.28000	341,286.60	
TAH	TABCORP HOLDINGS LIMITED	21,580	7.23000	156,023.40	
TCL	TRANSURBAN GROUP	49,780	4.11000	204,595.80	
TLS	TELSTRA CORP LTD	179,639	3.18000	571,252.02	
TOL	TOLL HOLDINGS LIMITED	24,745	6.60000	163,317.00	
TTS	TATTS GROUP LTD	45,070	2.54000	114,477.80	
WBC	WESTPAC BANKING CORPORATION	114,286	20.45000	2,337,148.70	
WES	WESFARMERS LIMITED	42,425	22.39000	949,895.75	
WESN	WESFARMERS LTD-PPS	4,957	22.65000	112,276.05	
WMC	ALUMINA LIMITED	68,772	1.15500	79,431.66	
WOR	WORLEYPARSONS LTD	6,770	22.00000	148,940.00	
WOW	WOOLWORTHS LIMITED	49,962	25.84000	1,291,018.08	
WPL	WOODSIDE PETROLEUM LTD	20,978	43.49000	912,333.22	
オーストラリアドル 計		2,435,000		27,095,212.62	
(邦貨換算額)				(1,916,173,436)	

## 外国株式(イギリスポンド)

(単位:株、イギリスポンド)

銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
AAL	ANGLO AMERICAN PLC	54,824	14.65000	803,171.60	
ABF	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	14,855	7.46000	110,818.30	
ADM	ADMIRAL GROUP PLC	6,965	8.92000	62,127.80	
AMEC	AMEC PLC	12,860	6.31500	81,210.90	
ANTO	ANTOFAGASTA PLC	16,090	5.70500	91,793.45	
AU	AUTONOMY CORP PLC	8,700	13.76000	119,712.00	
AZN	ASTRAZENECA PLC	59,658	25.59000	1,526,648.22	
BA	BAE SYSTEMS PLC	147,150	3.73000	548,869.50	
BATS	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	78,252	17.08000	1,336,544.16	
BAW	BRITISH AIRWAYS PLC	22,875	1.54600	35,364.75	
BCS	BARCLAYS PLC	348,821	2.67750	933,968.22	
BG	BG GROUP PLC	137,374	10.92000	1,500,124.08	
BICC	BALFOUR BEATTY PLC	20,945	3.56000	74,564.20	
BKG	BERKELEY GROUP HOLDINGS PLC	2,781	8.88000	24,695.28	
BLT	BHP BILLITON PLC	91,471	14.10000	1,289,741.10	
BNZL	BUNZL PLC	13,836	5.15000	71,255.40	
BP	BP PLC	767,888	5.01000	3,847,118.88	
BRBY	BURBERRY GROUP PLC	18,569	3.98000	73,904.62	
BSY	BRITISH SKY BROADCASTING GROUP PLC	45,779	4.67000	213,787.93	
BT	BT GROUP PLC	319,742	0.85000	271,780.70	
CBRY	CADBURY SCHWEPPE'S PLC	57,120	5.42000	309,590.40	
CGU	AVIVA PLC	107,985	3.12750	337,723.08	
CNA	CENTRICA PLC	218,025	2.37500	517,809.37	
CNE	CAIRN ENERGY PLC	5,690	23.36000	132,918.40	
COB	COBHAM PLC	44,635	1.93200	86,234.82	
CPG	COMPASS GROUP PLC	76,948	3.52750	271,434.07	
CPI	CAPITA GROUP PLC	25,499	7.15000	182,317.85	
CPW	CARPHONE WAREHOUSE GROUP	13,490	1.60500	21,651.45	
CW	CABLE & WIRELESS PLC	103,336	1.57100	162,340.85	

DGE	DIAGEO PLC	104,017	8.64500	899,226.96	
DMGT	DAILY MAIL&GENERAL TRUST-A NV	11,040	2.99750	33,092.40	
DRX	DRAX GROUP PLC	12,800	4.88250	62,496.00	
EMG	MAN GROUP PLC	69,121	2.31000	159,669.51	
ENRC	EURASIAN NATURAL RESOURCES CORP	13,335	5.92500	79,009.87	
EXPN	EXPERIAN PLC	41,513	4.83000	200,507.79	
FGP	FIRSTGROUP PLC	18,545	3.77000	69,914.65	
FPLN	FRIENDS PROVIDENT PLC	92,704	0.71700	66,468.76	
GFS	G4S PLC	68,629	2.13250	146,351.34	
GLXO	GLAXOSMITHKLINE PLC	214,341	10.51000	2,252,723.91	

[次へ](#)

HAS	HAYS PLC	58,637	0.84250	49,401.67
HG	LADBROKES PLC	23,232	2.04750	47,567.52
HOME	HOME RETAIL GROUP	37,193	2.39500	89,077.23
HSBA	HSBC HOLDINGS PLC	704,051	5.32000	3,745,551.32
IAP	ICAP PLC	20,840	3.82250	79,660.90
IHG	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP	9,602	6.39000	61,356.78
III	3I GROUP PLC	14,691	3.80750	55,935.98
IMI	IMI PLC	14,790	3.13000	46,292.70
IMT	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	42,122	16.20000	682,376.40
INVP	INVESTEC PLC	18,405	3.14500	57,883.72
ITV	ITV PLC	203,943	0.30750	62,712.47
JMAT	JOHNSON MATTHEY PLC	8,484	11.99000	101,723.16
KAZ	KAZAKHMYS PLC	7,345	6.33500	46,530.57
KGF	KINGFISHER PLC	98,082	1.77900	174,487.87
LGEN	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	232,476	0.59000	137,160.84
LLOY	LLOYDS BANKING GROUP PLC	400,627	0.89200	357,359.28
LMI	LONMIN PLC	5,290	11.71000	61,945.90
LMIN	LONMIN PLC-RTS	1,175	2.76250	3,245.93
LOG	LOGICA PLC	60,742	0.74750	45,404.64
LSE	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	5,408	6.75000	36,504.00
MGGT	MEGGITT PLC	29,315	1.70250	49,908.78
MKS	MARKS & SPENCER GROUP PLC	64,120	3.27500	209,993.00
MRW	WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	96,955	2.44500	237,054.97
NGG	NATIONAL GRID PLC	101,940	5.86000	597,368.40
NPW	INTERNATIONAL POWER PLC	61,825	2.74750	169,864.18
NXT	NEXT PLC	7,872	15.15000	119,260.80
OML	OLD MUTUAL PLC	213,005	0.67100	142,926.35
POC	CARNIVAL PLC	6,710	17.02000	114,204.20
PRU	PRUDENTIAL PLC	102,157	4.37000	446,426.09
PERSON	PEARSON PLC	31,904	6.96000	222,051.84
RB/	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	24,715	26.81000	662,609.15
RBOS	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	683,034	0.39500	269,798.43
RDSA	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	145,283	16.03000	2,328,886.49
RDSB	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	110,399	16.00000	1,766,384.00
REED	REED ELSEVIER PLC	43,666	5.13500	224,224.91
REX	REXAM PLC	28,945	3.03500	87,848.07
RIO	RIO TINTO PLC	41,468	26.64000	1,104,707.52
RR	ROLLS-ROYCE GROUP PLC	74,265	3.37500	250,644.37
RRC/N09	ROLLS-ROYCE GROUP PLC-C	6,371,937	0.00100	6,371.93
RSA	RSA INSURANCE GROUP PLC	136,577	1.25400	171,267.55
RTRS	THOMSON REUTERS PLC	7,455	16.79000	125,169.45
SAB	SABMILLER PLC	37,376	12.17000	454,865.92
SBRY	J SAINSBURY PLC	49,036	3.40500	166,967.58
SDR	SCHRODERS PLC	4,981	8.78000	43,733.18
SGC	STAGECOACH GROUP PLC	19,901	1.27750	25,423.52
SGL	SAGE GROUP PLC	73,695	1.84800	136,188.36
SHP	SHIRE PLC	23,470	8.75000	205,362.50
SL/	STANDARD LIFE PLC	87,275	1.82700	159,451.42
SMIN	SMITHS GROUP PLC	15,713	7.30000	114,704.90
SMU	SMITH & NEPHEW PLC	37,036	4.50000	166,662.00
SRP	SERCO GROUP PLC	19,635	3.94750	77,509.16
SSE	SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY PLC	38,042	11.34000	431,396.28
STAN	STANDARD CHARTERED PLC	78,415	11.75000	921,376.25
SVT	SEVERN TRENT PLC	9,513	11.22000	106,735.86
TATL	TATE & LYLE PLC	19,236	2.69500	51,841.02
TCG	THOMAS COOK GROUP PLC	15,475	2.23750	34,625.31
TLW	TULLOW OIL PLC	34,215	9.19000	314,435.85
TOMK	TOMKINS PLC	36,844	1.57750	58,121.41
TSCO	TESCO PLC	325,669	3.55400	1,157,427.62
TT	TUI TRAVEL PLC	22,990	2.51500	57,819.85
UBM	UNITED BUSINESS MEDIA LTD	8,998	4.24750	38,219.00
ULVR	UNILEVER PLC	53,197	15.06000	801,146.82
UU	UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,735	5.44000	145,438.40

VED	VEDANTA RESOURCES PLC	6,350	13.16000	83,566.00	
VOD	VODAFONE GROUP PLC	2,158,965	1.23200	2,659,844.88	
WOS	WOLSELEY PLC	1,200	11.84000	14,208.00	
WPP	WPP PLC	46,799	4.68500	219,253.31	
WTB	WHITBREAD PLC	6,705	8.51000	57,059.55	
XTA	XSTRATA PLC	77,605	6.15500	477,658.77	
イギリスポンド 計		17,173,961		43,438,874.65	
(邦貨換算額)				(6,231,306,569)	

## 外国株式(スイスフラン)

(単位:株、スイスフラン)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
ABBN	ABB LTD	91,315	16.80000	1,534,092.00	
ADEN	ADECCO SA-REG	4,757	44.86000	213,399.02	
ARYN	ARYZTA AG	4,875	34.80000	169,650.00	
ATLN	ACTELION LTD	4,185	53.15000	222,432.75	
BAER	JULIUS BAER HOLDING AG	8,125	41.26000	335,237.50	
BALN	BALOISE HOLDING -R	1,850	85.15000	157,527.50	
BKWN	BKW FMB ENERGIE AG	595	80.00000	47,600.00	
CS	CREDIT SUISSE GROUP AG	44,285	44.28000	1,960,939.80	
EFGN	EFG INTERNATIONAL AG	3,165	13.25000	41,936.25	
GEBN	GEBERIT AG-REG	2,125	127.30000	270,512.50	
GIVN	GIVAUDAN-REG	254	693.00000	176,022.00	
HOL	HOLCIM LTD-REG	7,423	52.80000	391,934.40	
HOLN1	HOLCIM LTD-RTS	7,423	2.66000	19,745.18	
KNI	KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL AG	2,115	81.90000	173,218.50	
LISN	LINDT & SPRUENGLI AG-REG.	5	23,460.00000	117,300.00	
LISP	LINDT & SPRUENGLI-PC	30	1,986.00000	59,580.00	
LOGN	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	5,665	14.96000	84,748.40	
LONN	LONZA GROUP AG-REG	2,025	109.30000	221,332.50	
NESZ	NESTLE SA	157,030	40.36000	6,337,730.80	
NOBE	NOBEL BIOCARE HOLDING AG	5,930	24.32000	144,217.60	
NOVN	NOVARTIS AG-REG SHS	98,035	44.08000	4,321,382.80	
PARG	PARGESA HOLDING SA-BEARER	1,045	70.15000	73,306.75	
PHBN	SONOVA HOLDING AG	1,940	78.75000	152,775.00	
RAN	SCHWEIZERISCHE LEBENSVERSICHERUNGS-UND RENTENANSTALT/SWISS LIFE-RE	2,145	90.00000	193,050.00	
RIFZ	COMPAGNIE FINANCIERE RICHEMONT AG	20,929	22.62000	473,413.98	
ROCZ	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	28,978	145.70000	4,222,094.60	
RUZK	SWISS REINSURANCE COMPANY LTD	13,669	36.00000	492,084.00	
SCHP	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,140	62.60000	196,564.00	
SCMZ	SWISSCOM AG-REG	1,004	304.75000	305,969.00	
SGSN	SGS SOCIETE GENERALE DE SURVEILLANCE HOLDINGS SA	181	1,286.00000	232,766.00	
STMN	STRAUMANN HOLDING AG-REG	291	208.00000	60,528.00	
SUN	SULZER AG-REG	900	62.40000	56,160.00	
SYNN	SYNGENTA AG	4,071	261.00000	1,062,531.00	
SYST	SYNTHES INC	2,409	116.40000	280,407.60	
UBSZ	UBS AG-REGISTERED	121,712	15.04000	1,830,548.48	
UHR	SWATCH GROUP AG-B	1,385	164.90000	228,386.50	
UHRN	SWATCH GROUP AG-REG	3,160	34.25000	108,230.00	
ZURN	ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	5,906	195.70000	1,155,804.20	
スイスフラン 計		664,077		28,125,158.61	
(邦貨換算額)				(2,370,669,619)	

## 外国株式(香港ドル)

(単位:株、香港ドル)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
AP	HANG LUNG PROPERTIES LTD	89,000	22.00000	1,958,000.00	
ASMP	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	36.40000	236,600.00	
BKEA	BANK OF EAST ASIA	66,440	22.55000	1,498,222.00	
BOC	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	150,000	11.00000	1,650,000.00	
CATH	CATHAY PACIFIC AIRWAYS LTD	39,000	10.24000	399,360.00	

CGK	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	57,682	83.15000	4,796,258.30	
CHES	CHINESE ESTATES HOLDINGS LTD	33,000	11.90000	392,700.00	
CHL	CLP HOLDINGS LTD	86,000	52.00000	4,472,000.00	
CKIZ	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	17,000	28.15000	478,550.00	
EPA	ESPRIT HOLDINGS LTD	42,500	48.90000	2,078,250.00	
FOXCON	FOXCONN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	65,000	5.17000	336,050.00	
HAC	HONG KONG AIRCRAFT ENGINEERG	2,000	91.20000	182,400.00	
HCG	HONG KONG & CHINA GAS CO LTD	167,981	15.56000	2,613,784.36	
HEL	HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS	59,500	42.35000	2,519,825.00	
HKEX	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	42,700	103.70000	4,427,990.00	
HL	HANG LUNG GROUP LIMITED	39,000	30.65000	1,195,350.00	
HNDH	HENDERSON LAND DEVELOPMENT CO LTD	49,426	37.20000	1,838,647.20	
HPWH	HOPEWELL HOLDINGS	29,000	20.75000	601,750.00	
HSGH	HANG SENG BANK LTD	31,300	99.05000	3,100,265.00	
HTW	HUTCHISON WHAMPOA LTD	82,823	50.25000	4,161,855.75	
HWD	NEW WORLD DEVELOPMENT CO LTD	104,000	11.94000	1,241,760.00	
HYS	HYSAN DEVELOPMENT CO LTD	22,000	15.00000	330,000.00	
KERP	KERRY PROPERTIES LTD	27,950	27.60000	771,420.00	
KING	KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS LTD	19,500	19.34000	377,130.00	
LIFE	LIFESTYLE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	26,500	8.86000	234,790.00	
LIFU	LI & FUNG LTD	98,000	21.25000	2,082,500.00	
MTRC	MTR CORP	50,000	20.55000	1,027,500.00	
NWC	MONGOLIA ENERGY CO LTD	152,000	2.53000	384,560.00	
ORIO	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	13,500	24.40000	329,400.00	
PACBS	PACIFIC BASIN SHIPPING LTD	102,000	4.32000	440,640.00	
PAP	NWS HOLDINGS LTD	27,000	13.86000	374,220.00	
SHGH	SHANGRI-LA ASIA LTD.	52,000	11.30000	587,600.00	
SHK	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	58,480	81.60000	4,771,968.00	
SINO	SINO LAND CO	71,500	10.86000	776,490.00	
SWPA	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	35,517	67.90000	2,411,604.30	
TVB	TELEVISION BROADCASTS LTD	12,000	29.30000	351,600.00	
WHB	WING HANG BANK LIMITED	7,500	61.50000	461,250.00	
WHEL	WHEELLOCK&CO LTD	40,000	19.24000	769,600.00	
WHH	WHARF HOLDINGS LTD	53,800	26.45000	1,423,010.00	
YYN	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	36,000	15.98000	575,280.00	
香港ドル計		2,165,099		58,660,179.91	
(邦貨換算額)				(718,000,602)	

## 外国株式(スウェーデンクローナ)

(単位:株、スウェーデンクローナ)

銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
ALFA	ALFA LAVAL AB	15,145	72.50000	1,098,012.50	
ASSA	ASSA ABLOY AB-B	12,755	100.00000	1,275,500.00	
ATCOA	ATLAS COPCO AB-A SHS	26,370	73.25000	1,931,602.50	
ATCOB	ATLAS COPCO AB-B SHS	15,745	65.50000	1,031,297.50	
ELUX	ELECTROLUX AB-SER B	10,295	92.50000	952,287.50	
GETIB	GETINGE AB-B SHS	8,670	94.50000	819,315.00	
HMB	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	21,429	360.00000	7,714,440.00	
HUSQB	HUSQVARNA AB	11,315	43.90000	496,728.50	
INVEB	INVESTOR AB	18,940	115.75000	2,192,305.00	
LMEB	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON AB-B SHS	124,375	66.90000	8,320,687.50	
LUPE	LUNDIN PETROLEUM AB	8,410	63.25000	531,932.50	
MIC	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA-SDR	2,990	425.00000	1,270,750.00	
MODO	HOLMEN AB-B SHARES	2,005	191.00000	382,955.00	
MTGB	MODERN TIMES GROUP-B SHS	1,870	227.50000	425,425.00	
NBH	NORDEA BANK AB	133,603	60.20000	8,042,900.60	
NCOMB	TELE2 AB -B SHS	12,765	73.75000	941,418.75	
SAND	SANDVIK AB	41,040	58.25000	2,390,580.00	
SCAB	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	23,220	85.25000	1,979,505.00	
SCVB	SCANIA AB-B SHS	13,665	79.75000	1,089,783.75	

SEBA	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	63,290	34.10000	2,158,189.00	
SECB	SECURITAS AB-B SHS	14,469	62.75000	907,929.75	
SHBA	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	18,560	144.00000	2,672,640.00	
SKAB	SKANSKA AB-B SHS	14,850	83.00000	1,232,550.00	
SKFB	SKF AB-B SHS	14,784	87.75000	1,297,296.00	
SSABA	SSAB SVENSKT STAL AB-SER A	6,295	89.25000	561,828.75	
SSABB	SSAB SVENSKT STAL AB	2,765	82.25000	227,421.25	
SWEDA	SWEDBANK AB	11,850	50.25000	595,462.50	
SWMA	SWEDISH MATCH AB	10,915	118.50000	1,293,427.50	
TLIA	TELIASONERA AB	93,040	39.10000	3,637,864.00	
VOLV	VOLVO AB-B SHS	44,205	49.90000	2,205,829.50	
VOLVA	VOLVO AB-A SHS	16,585	49.70000	824,274.50	
スウェーデンクローナ 計		816,215		60,502,139.35	
(邦貨換算額)				(719,975,458)	

## 外国株式(シンガポールドル)

(単位:株、シンガポールドル)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
CAPL	CAPITALAND LTD	112,000	3.11000	348,320.00	
CD	COMFORTDELGRO CORP	77,000	1.32000	101,640.00	
COS	COSCO CORP SINGAPORE LIMITED	55,000	1.22000	67,100.00	
CYCM	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,000	15.72000	78,600.00	
CYDM	CITY DEVELOPMENTS LTD	23,000	7.75000	178,250.00	
DBS	DBS GROUP HOLDINGS LTD	68,625	11.20000	768,600.00	
FN	FRASER AND NEAVE LTD	43,000	3.40000	146,200.00	
GIL	GENTING SINGAPORE PLC	111,000	0.72500	80,475.00	
JRSS	SEBACORP MARINE LTD	28,000	2.48000	69,440.00	
KPL	KEPPEL CORP LTD	66,600	6.32000	420,912.00	
NEPS	NEPTUNE ORIENT LINES LTD	24,000	1.31000	31,440.00	
NOBL	NOBLE GROUP LIMITED	72,200	1.47000	106,134.00	
OCBM	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	106,240	6.88000	730,931.20	
SAL	SINGAPORE AIRLINES LTD	21,800	11.60000	252,880.00	
SCIL	SEBACORP INDUSTRIES LTD	45,000	2.85000	128,250.00	
SGX	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,000	7.01000	245,350.00	
SPR	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	69,050	2.91000	200,935.50	
STEG	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	64,000	2.29000	146,560.00	
TELE	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LTD	325,810	2.80000	912,268.00	
UOBH	UNITED OVERSEAS BANK LTD	50,300	14.36000	722,308.00	
UTOS	UOL GROUP LIMITED	32,250	2.78000	89,655.00	
WIL	WILMAR INTERNATIONAL LTD	23,000	4.49000	103,270.00	
シンガポールドル 計		1,457,875		5,929,518.70	
(邦貨換算額)				(381,742,414)	

## 外国株式(ニュージーランドドル)

(単位:株、ニュージーランドドル)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
AIA	AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT LTD	42,170	1.68000	70,845.60	
CEN	CONTACT ENERGY LTD	13,415	5.99000	80,355.85	
FBU	FLETCHER BUILDING LTD	17,570	6.63000	116,489.10	
SKC	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	19,990	2.87000	57,371.30	
TEL	TELECOM CORPORATION OF NEW ZEALAND LIMITED	60,962	2.60000	158,501.20	
ニュージーランドドル 計		154,107		483,563.05	
(邦貨換算額)				(26,770,050)	

## 外国株式(デンマーククローネ)

(単位:株、デンマーククローネ)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
BRYB	CARLSBERG AS-B	2,405	330.00000	793,650.00	
CPLCB	COLOPLAST A/S	1,041	400.00000	416,400.00	
DANS	DANSKE BANK A/S	16,535	88.00000	1,455,080.00	
DSAC	A P MOLLER MAERSK A/S-B	46	32,100.00000	1,476,600.00	
DSC	DANISCO A/S	1,868	187.00000	349,316.00	

DSVB	DSV DE SAMMENSLUT VOGN	7,370	68.00000	501,160.00	
FLSB	FLSMIDTH & CO A/S	1,685	194.00000	326,890.00	
JYSK	JYSKE BANK	1,780	155.50000	276,790.00	
MAERSKA	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	21	31,700.00000	665,700.00	
NOVO	NOVO NORDISK A/S-B	18,785	277.50000	5,212,837.50	
NZYMB	NOVOZYMES A/S-B SHARES	1,810	412.00000	745,720.00	
TDP	TOPDANMARK A/S	655	650.00000	425,750.00	
TRYG	TRYGVESTA AS	1,045	313.00000	327,085.00	
VWS	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	7,755	400.00000	3,102,000.00	
WDH	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,000	294.00000	294,000.00	
デンマーククローネ 計		63,801		16,368,978.50	
(邦貨換算額)				(280,236,912)	

## 外国株式(ノルウェークローネ)

(単位:株、ノルウェークローネ)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
AKVER	AKER SOLUTIONS ASA	4,795	41.15000	197,314.25	
DNBNOR	DNB NOR ASA	31,955	47.70000	1,524,253.50	
NHY	NORSK HYDRO ASA	28,400	31.85000	904,540.00	
ORK	ORKLA ASA	33,185	48.30000	1,602,835.50	
REC	RENEWABLE ENERGY CORP AS	5,750	64.00000	368,000.00	
SDRL	SEADRILL LTD	11,455	79.90000	915,254.50	
STL	STATOILHYDRO ASA	52,370	131.40000	6,881,418.00	
TEL	TELENOR ASA	37,285	49.10000	1,830,693.50	
YAR	YARA INTERNATIONAL ASA	7,565	207.00000	1,565,955.00	
ノルウェークローネ 計		212,760		15,790,264.25	
(邦貨換算額)				(228,169,318)	

## 外国株式(ユーロ)

(単位:株、ユーロ)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
AC	ACCOR SA	7,586	31.58000	239,565.88	
ACA	CREDIT AGRICOLE SA	35,922	10.36500	372,331.53	
ACED	ABERTIS INFRASTRUCTU-RTS	10,841	0.66000	7,155.06	
ACRX	ACERINOX SA	5,862	11.72000	68,702.64	
ACS	ACS ACTIVIDADES CONSTRUCTION Y SERVICIOS SA	7,616	36.10000	274,937.60	
ACSA	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	10,841	13.30000	144,185.30	
ACUM	UMICORE	7,380	15.69000	115,792.20	
ADP	AEROPORTS DE PARIS	1,175	47.41000	55,706.75	
ADS	ADIDAS AG	8,191	23.99000	196,502.09	
AEGO	AEGON NV	59,769	4.13000	246,845.97	
AEM	A2A SPA	50,790	1.28500	65,265.15	
AGL	AUTOGRILL SPA	4,025	6.07500	24,451.87	
AHLN	KONINKLIJKE AHOLD NV	49,779	8.58000	427,103.82	
AI	AIR LIQUIDE	10,452	61.96500	647,658.18	
AIRF	AIR FRANCE-KLM	5,240	9.59600	50,283.04	
AKZO	AKZO NOBEL NV	10,373	32.88500	341,116.10	
AL	ALLEANZA ASSICURAZIONI	25,285	5.33500	134,895.47	
ALO	ALSTOM-NEW	8,795	44.92500	395,115.37	
ALPHA	ALPHA BANK A.E.	15,998	8.05000	128,783.90	
ALV	ALLIANZ SE-REG	18,763	68.89000	1,292,583.07	
ARR	SOCIETE DES AUTOROUTES PARIS-RHIN-RHONE	850	48.50000	41,225.00	
ASML	ASML HOLDING NV	17,862	14.31000	255,605.22	
AUTO	ATLANTIA SPA	9,919	14.28000	141,643.32	
BAK	BANKINTER SA	11,065	8.95000	99,031.75	
BASF	BASF SE	38,435	27.90000	1,072,336.50	
BAYE	BAYER AG	31,340	36.99000	1,159,266.60	
BBV	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	149,938	8.20000	1,229,491.60	
BCP	BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	105,242	0.75400	79,352.46	
BCSA	BANCO SANTANDER SA	337,216	6.81000	2,296,440.96	
BEI	BEIERSDORF AG	3,780	32.80000	123,984.00	
BELG	BELGACOM SA	7,190	23.47500	168,785.25	

BESNN	BANCO ESPIRITO SANTO SA	10,630	3.99000	42,413.70
BI	INTESA SANPAOLO SPA	319,998	2.48000	793,595.04
BICP	SOCIETE BIC SA	1,175	38.04000	44,697.00
BINR	INTESA SANPAOLO SPA	30,675	1.79800	55,153.65
BMPS	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA	98,905	1.28600	127,191.83
BMW	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,945	24.62000	343,325.90
BMW3	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG-PFD	2,005	15.85000	31,779.25
BNP	BNP PARIBAS SA	34,072	43.62500	1,486,391.00
BOUY	BOUYGUES SA	9,800	30.15000	295,470.00
BP	BANCO POPOLARE SPA	25,264	5.93500	149,941.84
BPE	BANCO POPULAR ESPANOL SA	32,819	6.04000	198,226.76
BPM	BANCA POPOLARE DI MILANO SCRL	16,037	4.59750	73,730.10
BPU	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	25,899	9.91000	256,659.09
BRISA	BRISA-PRIV SHR	12,975	4.93300	64,005.67
BSN	DANONE	17,306	38.77500	671,040.15
BULG	BULGARI SPA	5,960	3.66500	21,843.40
BVA	BANCO DE VALENCIA SA	9,305	6.65000	61,878.25
CAP	CAP GEMINI SA	5,469	26.00500	142,221.34
CAR	CARREFOUR SA	25,893	28.91000	748,566.63
CCB	COCA-COLA HELLENIC BOTTLING COMPANY SA	6,448	13.40000	86,403.20
CGE	ALCATEL LUCENT	96,574	1.65900	160,216.26
CIMP	CIMPOR CIMENTOS DE PORTUGAL SGPS SA	10,985	4.57700	50,278.34
CIN	CINTRA CONCESIONES DE INFRAESTRUCTURAS DE TRANSPORTE SA	7,985	4.28000	34,175.80
CNPP	CNP ASSURANCES	1,395	61.64000	85,987.80
CO	CASINO GUICHARD- PERRACHON SA	1,819	49.02000	89,167.38
COLR	COLRUYT NV	672	166.30000	111,753.60
COM	COMMERZBANK AG	27,978	5.13500	143,667.03
CRDI	UNICREDIT SPA	504,957	1.88600	952,348.90
CRG	BANCA CARIGE SPA	28,825	2.54000	73,215.50
CRH	CRH PLC	27,765	18.00000	499,770.00
CRIS	CRITERIA CAIXACORP SA	44,055	2.89000	127,318.95
CTG	GAS NATURAL SDG SA	7,860	12.70000	99,822.00
CUBE	ACCIONA S.A.	1,146	81.50000	93,399.00
DAST	DASSAULT SYSTEMES SA	4,050	29.90500	121,115.25
DB1	DEUTSCHE BOERSE AG	8,314	60.17000	500,253.38
DBK	DEUTSCHE BANK AG -REG	22,490	40.16000	903,198.40
DCXG	DAIMLER AG-REG	36,452	25.04500	912,940.34
DECX	JC DECAUX S.A.	2,520	10.48500	26,422.20
DELB	DELHAIZE GROUP	4,201	51.75000	217,401.75
DESC	ERSTE GROUP BANK AG	7,638	16.85000	128,700.30
DEX	DEXIA	19,999	4.50000	89,995.50
DG	VINCI S.A.	17,740	34.02000	603,514.80
DPB	DEUTSCHE POSTBANK AG	5,060	16.01000	81,010.60
DPW	DEUTSCHE POST AG-REG	35,973	9.36000	336,707.28
DSMN	KONINKLIJKE DSM NV	5,767	24.02000	138,523.34
DTEG	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	115,871	8.28500	959,991.23
EAD	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE AND SPACE CO	13,738	11.45000	157,300.10
EDF	ELECTRICITE DE FRANCE	7,595	36.34000	276,002.30
EDPP	ENERGIAS DE PORTUGAL,S.A.	76,571	2.80800	215,011.36
ELIAY	ELISA CORP-A SHARES	6,040	10.00000	60,400.00
ELN	ELAN CORPORATION PLC	10,000	4.91500	49,150.00
ELSN	REED ELSEVIER NV	25,748	8.53000	219,630.44
ENEL	ENEL SPA	181,779	4.17750	759,381.77
ENG	ENAGAS	7,585	12.79000	97,012.15
ENI	ENI SPA	106,851	17.06000	1,822,878.06
ERCK	MERCK KGAA	2,325	62.34000	144,940.50
ERMT	ERAMET	190	182.19500	34,617.05
ESSI	ESSILOR INTERNATIONAL SA	8,615	34.15500	294,245.32
ETE	NATIONAL BANK OF GREECE SA	20,322	16.90000	343,441.80
ETL	EUTELSAT COMMUNICATIONS	4,400	17.31500	76,186.00
EURB	EFG EUROBANK ERGASIAS	14,360	7.40000	106,264.00

EX	VIVENDI SA	48,607	19.17500	932,039.22
EXHO	SODEXO	3,690	36.01500	132,895.35
EXO	EXOR SPA	2,604	11.96000	31,143.84
FCC	FOMENTO DE CONSTRUCCIONES Y CONTRATAS SA-FCC	1,465	27.25000	39,921.25
FER	GRUPO FERROVIAL SA	2,515	25.16000	63,277.40
FGR	EIFFAGE SA	1,525	42.24000	64,416.00
FIA	FIAT SPA	26,775	7.28500	195,055.87
FME	FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	8,443	29.90000	252,445.70
FOR/CRTS	FORTIS -RTS COUPON 42	69,259	0.00000	0.00
FORB	FORTIS	69,259	2.40000	166,221.60
FQDA	CHRISTIAN DIOR SA	1,835	51.66000	94,796.10
FRA	FRAPORT AG	1,350	29.27000	39,514.50
FRE	FRESENIUS SE-PRF	4,375	40.17000	175,743.75
FSA	FONDIARIA-SAI SPA	3,030	11.61000	35,178.30
FTE	FRANCE TELECOM SA	74,854	17.01000	1,273,266.54
FUGR	FUGRO NV	2,640	27.50000	72,600.00
FUM1V	FORTUM OYJ	18,475	16.51000	305,022.25
G1A	GEA GROUP AG	6,055	10.42000	63,093.10
GA	CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITAS	8,045	10.93500	87,972.07
GALP	GALP ENERGIA SGPS SA	8,465	10.21000	86,427.65
GAM	GAMESA CORPORACION TECNOLOGICA S.A.	7,555	15.24000	115,138.20
GASI	ASSICURAZIONI GENERALI	43,475	16.00000	695,600.00
GAZ	GDF SUEZ	44,819	26.36500	1,181,652.93
GBL	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,127	55.53500	173,657.94
GEHG	CELESIO AG	3,845	18.52000	71,209.40
GRF	GRIFOLS SA	5,210	13.03000	67,886.30
HEI	HEIDELBERGCEMENT AG	790	30.67000	24,229.30
HEIN	HEINEKEN NV	10,228	25.05500	256,262.54
HEIO	HEINEKEN HOLDING NV	3,380	20.81000	70,337.80
HEN	HENKEL AG & CO KGAA	7,428	21.86000	162,376.08
HEN1	HENKEL KGAA	5,425	20.37000	110,507.25
HNRG	HANNOVER RUECKVERSICHERUNGS AG	2,455	26.27000	64,492.85
HNSY	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA	10,724	58.02000	622,206.48
HO	THALES SA	3,835	31.70000	121,569.50
HOC	HOCHTIEF AG	1,610	36.05000	58,040.50
HTO	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	10,545	11.22000	118,314.90
IBER	IBERDROLA SA	142,985	5.91000	845,041.35
IBLA	IBERIA LINEAS AEREAS DE ESPANA SA	19,515	1.50000	29,272.50
IBR	IBERDROLA RENOVABLES	27,425	3.21000	88,034.25
IDR	INDRA SISTEMAS SA	4,864	15.85000	77,094.40
IHC	SBM OFFSHORE NV	8,844	11.78000	104,182.32
ING	ING GROEP NV-CVA	81,310	7.31100	594,457.41
INTB	ANHEUSER-BUSCH IN BEV NV	30,246	24.09500	728,777.37
ITAI	ITALCEMENTI SPA	1,930	8.63000	16,655.90
ITR	ITALCEMENTI SPA RNC	3,125	4.31000	13,468.75
ITX	INDITEX	8,530	32.64000	278,419.20
KBC	KBC GROUP	5,849	12.55000	73,404.95
KESBV	KESKO OYJ-B SHS	2,910	19.77000	57,530.70
KN	NATIXIS	15,000	1.45700	21,855.00
KONBS	KONE OYJ	6,032	21.38000	128,964.16
KPN	KONINKLIJKE KPN NV	74,396	9.54500	710,109.82
KSZ	K+S AG	6,245	47.99000	299,697.55
KYGA	KERRY GROUP PLC-A	6,445	16.95000	109,242.75
LAFA	LAFARGE SA	7,668	44.19000	338,848.92
LEGP	LEGRAND S.A.	4,050	14.87000	60,223.50
LHA	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,250	9.22000	85,285.00
LIN	LINDE AG	5,710	58.17000	332,150.70
LTO	LOTTOMATICA SPA	2,425	15.53000	37,660.25
LUX	LUXOTTICA GROUP SPA	5,436	15.37000	83,551.32
MAN	MAN AG	4,549	46.23000	210,300.27
MAP	MAPFRE SA	26,725	2.30000	61,467.50
MB	MEDIOBANCA SPA	20,400	8.08000	164,832.00
MCNB	MICHELIN (CGDE)-B	5,969	37.90000	226,225.10

MED	MEDIOLANUM SPA	8,725	3.33500	29,097.87	
MEOG	METRO AG	5,035	33.08000	166,557.80	
MF	WENDEL	1,210	29.01500	35,108.15	
MIDI	AXA	64,352	12.02500	773,832.80	
MIG	MARFIN INVESTMENT GROUP SA	36,465	3.21000	117,052.65	
MMBP	LAGARDERE S.C.A.	5,040	23.24500	117,154.80	
MMT	M6-METROPOLE TELEVISION	2,845	13.80000	39,261.00	
MOBB	MOBISTAR SA	1,539	44.60000	68,639.40	
MS	MEDIASET SPA	32,361	4.58500	148,375.18	
MT	ARCELORMITTAL	36,646	19.35000	709,100.10	
MUVG	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	8,431	95.50000	805,160.50	
NAT	NATIONALE A PORTEFEUILLE	1,545	34.34000	53,055.30	
NEO	NEOPOST SA	1,392	60.64000	84,410.88	
NEST	NESTE OIL OYJ	6,515	10.47000	68,212.05	
NK	IMERYS SA	985	30.64500	30,185.32	
NKDS	IMERYS SA-RTS	985	1.92000	1,891.20	

[次へ](#)

NOKS	NOKIA OYJ	157,461	10.52000	1,656,489.72
NOR1V	NOKIAN RENKAAT OYJ	6,545	12.64000	82,728.80
OEEW	OESTERREICHISCHE ELEKTRIZITAETSWIRTSCHAFTS AG-A	3,050	34.00000	103,700.00
OKOAS	POHJOLA BANK PLC	5,105	5.77000	29,455.85
OMV	OMV AG	7,205	25.31000	182,358.55
OPAP	OPAP SA	8,710	21.50000	187,265.00
ORL	L'OREAL SA	9,476	55.68500	527,671.06
ORNBV	ORION OYJ	4,485	11.12000	49,873.20
OUTO	OUTOKUMPU OYJ	4,060	11.76000	47,745.60
PAJ	PAGESJAUNES GROUPE SA	4,850	8.29300	40,221.05
PC	PIRELLI&C.	136,655	0.27250	37,238.48
PERP	PERNOD-RICARD SA	7,997	44.80000	358,265.60
PHG	PHILIPS ELECTRONICS NV	40,481	13.82000	559,447.42
PLT	PARMALAT SPA	72,660	1.64900	119,816.34
POR	PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PFD	3,555	41.25000	146,643.75
PPC	PUBLIC POWER CORP	3,916	14.10000	55,215.60
PRE	TUI AG	8,370	6.00500	50,261.85
PRTP	PPR	3,177	55.96000	177,784.92
PRYS	PRYSMIAN SPA	6,680	9.34500	62,424.60
PSAF	PEUGEOT SA	7,062	17.19000	121,395.78
PTCO	PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	28,203	6.55000	184,729.65
PTM	ZON MULTIMEDIA SERVICOS DE TELECOMUNICACOES E MULTIMEDIA SGPS SA	10,823	3.91000	42,317.93
PUB	PUBLICIS GROUPE	5,530	22.98000	127,079.40
PUM	PUMA AG	296	151.24000	44,767.04
QCE	Q-CELLS SE	2,540	17.51000	44,475.40
QGEN	QIAGEN N.V.	7,635	12.16000	92,841.60
REE	RED ELECTRICA CORP SA	4,400	31.67000	139,348.00
RENA	RENAULT SA	7,372	23.98000	176,780.56
RF	EURAZEO	1,399	30.25500	42,326.74
RIBH	RAIFFEISEN INTERNATIONAL BANK HOLDING AG	1,930	26.25000	50,662.50
RMS	HERMES INTERNATIONAL	2,159	99.46000	214,734.14
RPSL	REPSOL YPF SA	28,521	14.90000	424,962.90
RSTD	RANDSTAD HOLDING N.V.	4,040	19.73500	79,729.40
RTRKS	RAUTARUUKKI OYJ	3,645	14.90000	54,310.50
RWE	RWE AG	18,180	58.89000	1,070,620.20
RWEP	RWE AG-NON VTG PFD	1,125	50.35000	56,643.75
RYA	RYANAIR HOLDINGS PLC	16,845	3.28400	55,318.98
SAB	BANCO DE SABADELL SA	36,695	4.54000	166,595.30
SAG	SAFRAN SA	7,770	9.07400	70,504.98
SAMAS	SAMPO OYJ-A SHS	17,564	13.80000	242,383.20
SAP	SAP AG	35,372	29.57500	1,046,126.90
SCG	SOCIETE GENERALE-A	19,373	35.75500	692,681.61
SCHN	SCHNEIDER ELECTRIC SA	9,364	52.50500	491,656.82
SCRR	SCOR SE	7,142	15.08000	107,701.36
SEGN	ATOS ORIGIN	3,065	21.35000	65,437.75
SESF	SES GROBAL-FDR	12,005	13.73000	164,828.65
SEV	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	11,434	12.50500	142,982.17
SIF	FINMECCANICA SPA	17,085	10.49000	179,221.65
SM	SIEMENS AG-REG	35,832	50.51000	1,809,874.32
SNAM	SNAM RETE GAS SPA	32,170	3.30000	106,161.00
SOFP	SANOFI-AVENTIS SA	43,076	44.22000	1,904,820.72
SOLV	SOLVAY SA	2,351	61.21000	143,904.71
SPM	SAIPEM	11,025	17.65000	194,591.25
STER	STORA ENSO OYJ-R SHS	22,520	4.38000	98,637.60
STGO	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	15,016	26.08500	391,692.36
STM	STMICROELECTRONICS NV	33,633	4.72100	158,781.39
SWS1V	SANOMA OYJ	3,275	10.53000	34,485.75
SWV	SOLARWORLD AG	3,440	21.16000	72,790.40
SZG	SALZGITTER AG	1,610	53.46000	86,070.60

TECF	TECHNIP S.A.	4,043	31.95000	129,173.85	
TEN	TENARIS SA	19,310	9.96000	192,327.60	
TFFP	TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	4,790	6.95400	33,309.66	
TITI	TELECOM ITALIA SPA	415,613	0.96400	400,650.93	
TITR	TELECOM ITALIA RNC	252,797	0.68850	174,050.73	
TKA	THYSSENKRUPP AG	15,380	15.98000	245,772.40	
TKAV	TELEKOM AUSTRIA AG	14,020	10.25000	143,705.00	
TL5	GESTEVISION TELECINCO SA	6,845	6.87000	47,025.15	
TNE	TELEFONICA S.A.	173,503	14.55000	2,524,468.65	
TOL	TOTAL SA	87,452	40.47000	3,539,182.44	
TP	TNT NV	15,820	13.90000	219,898.00	
TPEI	BANK OF PIRAEUS	13,315	8.05000	107,185.75	
TRN	TERNA SPA	53,152	2.54250	135,138.96	
TTNR	TITAN CEMENT CO. S.A.	2,075	19.30000	40,047.50	
UCB	UCB SA	4,063	22.90500	93,063.01	
UN11	UNIPOL GRUPPO FINANZIARIO SPA	29,785	0.96000	28,593.60	
UNIP	UNIPOL GRUPPO FINANZIARIO SPA-PFD	32,420	0.62950	20,408.39	
UNL	UNILEVER NV-CVA	67,710	17.56000	1,188,987.60	
UPM1	UPM-KYMMENE OYJ	19,943	6.99000	139,401.57	
VALH	SACYR VALLEHERMOSO SA	4,705	9.49000	44,650.45	
VAST	VOESTALPINE AG	4,649	16.31000	75,825.19	
VEB	E.ON AG	78,484	23.59000	1,851,437.56	
VIE	VEOLIA ENVIRONNEMENT	15,894	20.60500	327,495.87	
VK	VALLOUREC	2,135	85.79500	183,172.32	
VLMT	METSO OYJ	5,480	12.33000	67,568.40	
VLOF	VALEO	3,007	14.34000	43,120.38	
VOW	VOLKSWAGEN AG	3,671	220.31000	808,758.01	
VOWG	VOLKSWAGEN AG PFD	4,225	48.15000	203,433.75	
WBG	WIENERBERGER AG	2,770	8.61000	23,849.70	
WCH	WACKER CHEMIE AG	580	76.87000	44,584.60	
WLSN	WOLTERS KLUWER NV	12,502	13.67000	170,902.34	
WRTBV	WARTSILA OYJ	3,270	25.88000	84,627.60	
WST	VIENNA INSURANCE GROUP	1,410	28.18000	39,733.80	
ZODC	ZODIAC AEROSPACE	2,012	21.11000	42,473.32	
ZRDY	ZARDOYA OTIS SA	4,735	15.09000	71,451.15	
ユーロ計		6,994,456		76,191,451.21	
(邦貨換算額)				(9,710,600,457)	

(単位：円)

総合計			(56,833,208,662)	
			56,833,208,662	

(注) 総合計の( )内の金額は外国株式の邦貨換算額合計であります。

## (2) 株式以外の有価証券

## (外国投資証券)

外国投資証券（アメリカドル）

（単位：アメリカドル）

銘柄	券面総額	評価額	備考
00163T10	AMB PROPERTY CORPORATION	3,550	57,936.00
05348410	AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,575	192,442.25
10112110	BOSTON PROPERTIES INC	5,282	237,531.54
13313110	CAMDEN PROPERTY TRUST	2,575	69,422.00
26441150	DUKE REALTY CORPORATION	5,375	44,075.00
29476L10	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	11,170	246,186.80
31374720	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	2,435	123,137.95
42191510	HCP INC	10,850	223,510.00
42217K10	HEALTH CARE REIT INC	4,910	157,512.80
44107P10	HOST HOTELS & RESORTS INC	20,198	154,918.66
49446R10	KIMCO REALTY CORPORATION	10,375	104,372.50
53117210	LIBERTY PROPERTY TRUST	4,193	93,923.20
55438210	THE MACERICH COMPANY	2,470	37,099.40
72925110	PLUM CREEK TIMBER CO	7,618	244,309.26
74341010	PROLOGIS	10,731	78,336.30
74460D10	PUBLIC STORAGE	5,459	335,182.60
75884910	REGENCY CENTERS CORPORATION	2,910	89,773.50
82880610	SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	9,823	460,895.16
91019710	UDR INC	5,690	52,860.10
92276F10	VENTAS INC	6,200	167,462.00
92904210	VORNADO REALTY TRUST	6,059	268,656.06
アメリカドル 計		141,448	3,439,543.08
(邦貨換算額)			(326,206,266)

外国投資証券（カナダドル）

（単位：カナダドル）

銘柄	券面総額	評価額	備考
AET-U	ARC ENERGY TRUST	5,470	86,535.40
COS-U	CANADIAN OIL SANDS TRUST	10,095	242,986.65
ERF-U	ENERPLUS RESOURCES FUND	7,630	186,935.00
HTE-U	HARVEST ENERGY TRUST	5,060	35,420.00
PVE-U	PROVIDENT ENERGY TRUST	13,930	78,843.80
PWT-U	PENN WEST ENERGY TRUST	15,498	207,208.26
REI-U	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,250	72,187.50
YLO-U	YELLOW PAGES INCOME FUND	7,750	47,430.00
カナダドル 計		70,683	957,546.61
(邦貨換算額)			(76,938,870)

外国投資証券（オーストラリアドル）

（単位：オーストラリアドル）

銘柄	券面総額	評価額	備考
DRT	DEXUS PROPERTY GROUP	144,615	97,615.12
GAN	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	77,145	110,703.07
GPT	GPT GROUP	174,035	71,354.35
MGQ	GOODMAN GROUP	111,050	33,315.00
MGR	MIRVAC GROUP	64,765	55,374.07
SGP	STOCKLAND	71,210	205,084.80
WDC	WESTFIELD GROUP	84,870	814,752.00
オーストラリアドル 計		727,690	1,388,198.41
(邦貨換算額)			(98,173,392)

外国投資証券（イギリスポンド）

（単位：イギリスポンド）

銘柄	券面総額	評価額	備考
BLND	BRITISH LAND COMPANY PLC	37,816	148,144.18
HMSO	HAMMERSON PLC	28,610	79,750.37
LAND	LAND SECURITIES GROUP PLC	31,634	149,786.99
LII	LIBERTY INTERNATIONAL PLC	10,445	37,758.67

SLOU	SEGRO PLC	235,780	55,997.75	
イギリスポンド 計		344,285	471,437.96	
(邦貨換算額)			(67,627,775)	

## 外国投資証券(香港ドル)

(単位:香港ドル)

銘柄		券面総額	評価額	備考
LINK	LINK REIT	94,500	1,447,740.00	
香港ドル 計		94,500	1,447,740.00	
(邦貨換算額)			(17,720,338)	

## 外国投資証券(シンガポールドル)

(単位:シンガポールドル)

銘柄		券面総額	評価額	備考
CT	CAPITAMALL TRUST	136,800	181,944.00	
シンガポールドル 計		136,800	181,944.00	
(邦貨換算額)			(11,713,555)	

## 外国投資証券(ユーロ)

(単位:ユーロ)

銘柄		券面総額	評価額	備考
CORA	CORIO NV	2,210	76,974.30	
EMGP	ICADE	1,215	72,183.15	
GFC	GECINA SA	560	28,000.00	
LI	KLEPIERRE	3,895	72,602.80	
UL	UNIBAIL-RODAMCO	3,535	398,129.37	
ユーロ 計		11,415	647,889.62	
(邦貨換算額)			(82,573,532)	

(単位:円)

総合計			(680,953,728) 680,953,728	
-----	--	--	------------------------------	--

(注1) 総合計の( )内の金額は外国投資証券の邦貨換算額合計であります。

(注2) 投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率 (%)	組入投資証券時価比率 (%)	合計額に対する比率 (%)
アメリカドル	株式 565銘柄	99.0	-	54.7
アメリカドル	投資証券 21銘柄	-	1.0	0.6
カナダドル	株式 85銘柄	97.4	-	5.0
カナダドル	投資証券 8銘柄	-	2.6	0.1
オーストラリアドル	株式 61銘柄	95.1	-	3.3
オーストラリアドル	投資証券 7銘柄	-	4.9	0.2
イギリスポンド	株式 108銘柄	98.9	-	10.8
イギリスポンド	投資証券 5銘柄	-	1.1	0.1
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0	-	4.1
香港ドル	株式 40銘柄	97.6	-	1.2
香港ドル	投資証券 1銘柄	-	2.4	0.0
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	100.0	-	1.3
シンガポールドル	株式 22銘柄	97.0	-	0.7
シンガポールドル	投資証券 1銘柄	-	3.0	0.0
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.0	-	0.0
デンマーククローネ	株式 15銘柄	100.0	-	0.5
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0	-	0.4
ユーロ	株式 265銘柄	99.2	-	16.9
ユーロ	投資証券 5銘柄	-	0.8	0.1

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

2. 「海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(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。

海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(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20年11月17日現在	平成21年5月18日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		43,851,339	65,716,632
コール・ローン		158,174,090	71,531,077
株式		4,186,083,102	5,093,505,872
派生商品評価勘定		-	306,215
未収入金		311,967	-
未収配当金		2,362,162	4,965,930
差入委託証拠金		-	10,176,806
流動資産合計		4,390,782,660	5,246,202,532
資産合計		4,390,782,660	5,246,202,532
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	562,401
未払解約金		40,787,274	24,619,983
流動負債合計		40,787,274	25,182,384
負債合計		40,787,274	25,182,384
純資産の部			
元本等			
元本		6,899,315,946	6,331,476,745
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		2,549,320,560	1,110,456,597
元本等合計		4,349,995,386	5,221,020,148
純資産合計		4,349,995,386	5,221,020,148
負債純資産合計		4,390,782,660	5,246,202,532

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

項目	対象期間 自 平成20年5月17日 至 平成20年11月17日	自 平成20年11月18日 至 平成21年5月18日
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）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券  同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券  同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券  同左</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>-</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>	<p>(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  同左</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準  「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>	<p>外貨建取引等の処理基準  同左</p>

## （貸借対照表に関する注記）

平成20年11月17日現在		平成21年5月18日現在	
1. 期首	平成20年5月17日	1. 期首	平成20年11月18日
期首元本額	5,781,823,099 円	期首元本額	6,899,315,946 円
期首からの追加設定元本額	2,067,965,671 円	期首からの追加設定元本額	461,832,490 円
期首からの解約元本額	950,472,824 円	期首からの解約元本額	1,029,671,691 円
平成20年11月17日現在の元本の内訳		平成21年5月18日現在の元本の内訳	
日興五大陸株式ファンド	5,970,978,725 円	日興五大陸株式ファンド	5,219,996,802 円
グローバルコレクション （債券／株式／不動産・資源・食料等）隔月分配型	14,488,926 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	36,728,419 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	27,572,166 円	年金積立 インデックスファ ンド海外新興国（エマー ジ ング）株式	1,028,328,202 円
年金積立 インデックスファ ンド海外新興国（エマー ジ ング）株式	793,413,363 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）	46,423,322 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）	92,862,766 円	（合計）	6,331,476,745 円
（合計）	6,899,315,946 円	2. 本報告書における開示対象 ファンドの特定期間末日に おける当該親投資信託の受 益権の総数	6,331,476,745 口
2. 本報告書における開示対象 ファンドの特定期間末日に おける当該親投資信託の受 益権の総数	6,899,315,946 口	3. 元本の欠損	
3. 元本の欠損		貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,110,456,597円であります。	
貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,549,320,560円あります。			

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

## （有価証券に関する注記）

対象期間（自 平成20年5月17日 至 平成20年11月17日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	4,186,083,102	3,480,401,921
合計	4,186,083,102	3,480,401,921

対象期間（自 平成20年11月18日 至 平成21年5月18日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	5,093,505,872	2,044,100,224
合計	5,093,505,872	2,044,100,224

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

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 取引の状況に関する事項

	自 平成20年5月17日 至 平成20年11月17日	自 平成20年11月18日 至 平成21年5月18日
取引の内容	当投資信託が利用することができるデリバティブ取引等は、内外の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨先物取引、通貨オプション取引、金利先物取引、金利オプション取引、スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引、および為替予約取引であります。	同左
取引の利用目的及び取引に対する取組方針	市場動向を勘案し、デリバティブ取引を行う方針であります。また信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。	同左
取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引には、有価証券、為替、金利等の市場価格が変動することによって発生するリスクがあります。	同左
取引に係るリスク管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門が執行し、リスク管理業務担当部門が日常的にこれを監視しております。	同左

## 取引の時価等に関する事項

（株式関連）

平成20年11月17日現在

該当事項はありません。

（単位：円）

区分	種類	平成21年5月18日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	13,821,033	-	13,258,632	562,401
	合計	13,821,033	-	13,258,632	562,401

（注）時価の算定方法

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

(通貨関連)

平成20年11月17日現在

該当事項はありません。

(単位:円)

区分	種類	平成21年5月18日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	20,795,215	-	20,489,000	306,215
	韓国ウォン	10,599,400	-	10,444,000	155,400
	新台幣ドル	10,195,815	-	10,045,000	150,815
	合計	20,795,215	-	20,489,000	306,215

(注)時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成20年11月17日現在		平成21年5月18日現在	
1口当たり純資産額	0.6305 円	1口当たり純資産額	0.8246 円
(1万口当たり純資産額)	(6,305 円)	(1万口当たり純資産額)	(8,246 円)

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

外国株式(アメリカドル)

(単位:株、アメリカドル)

銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
00090163	CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD	3,515	22.31000	78,419.65	
03849620	ARACRUZ CELULOSE SA-SPON ADR	825	15.05000	12,416.25	
05946030	BANCO BRADESCO SA-SPONSORED ADR	7,930	12.89000	102,217.70	
05960220	ITAU UNIBANCO BANCO MULTIPLO SA-ADR	2,750	13.36000	36,740.00	
05961W10	BANCO MACRO BANSUD SA B-ADR	1,070	14.40000	15,408.00	
05968L10	BANCOLOMBIA SA -ADR	3,350	26.59000	89,076.50	
10553210	BRASKEM SA PREF-ADR	1,780	7.70000	13,706.00	
2017122L	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK GDR	8,560	7.94000	67,966.40	
20440960	CEMIG SA -SPONS ADR	4,295	12.75000	54,761.25	
20440960-1	CEMIG SA -SPONS ADR(新)	1,073	12.75000	13,680.75	
20440T20	BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GROUP PAO DE ACUCAR-SP ADR	1,190	33.63000	40,019.70	
20440W10	CIA SIDERURGICA NACIONAL-SP ADR	5,085	19.16000	97,428.60	
20441220	CIA VALE DO RIO DOCE-ADR	11,800	17.37000	204,966.00	
20441A10	SABESP-ADR	1,030	27.40000	28,222.00	
20441B40	CIA PARANAENSE DE ENERGIA-COPEL PREF.B-ADR	3,675	12.82000	47,113.50	
20444810	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA -ADR	4,650	25.56000	118,854.00	
25030W10	DESARROLLADORA HOMEX SA DE CV-ADR	585	22.34000	13,068.90	
27915810	ECOPETROL SA-ADR	4,800	20.48000	98,304.00	
29081M10	EMPRESA BRASILEIRA DE AERONAUTICA S.A. -ADR	1,870	17.47000	32,668.90	
29244810	EMPRESAS ICA SAB DE CV-ADR	2,310	7.68000	17,740.80	
29244T10	EMPRESA NAC ELEC-CHIL ADR	680	41.83000	28,444.40	
29274F10	ENERSIS SA/CHILE -ADR	1,560	15.82000	24,679.20	
34441910	FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV-ADR	1,200	31.15000	37,380.00	
36260730	GAFISA SA-ADR	1,000	16.44000	16,440.00	
37373710	GERDAU SA -SPON ADR	3,600	8.06000	29,016.00	
40049J20	GRUPO TELEVISA SA-SPONS ADR	4,000	16.93000	67,720.00	
46626D10	NORILSK NICKEL-ADR	24,530	9.91000	243,092.30	
46630Q20	VTB BANK OJSC	26,330	2.59000	68,194.70	
47972P20	COMSTAR UNITED TELESYSTEMS-GDR	4,585	4.50000	20,632.50	
48122U20	AFK SISTEMA-REG S SPONS GDR	2,515	9.40000	23,641.00	
50172310	LAN AIRLINES SA -ADR	3,880	10.58000	41,050.40	
58384010	MECHEL OAO-ADR	1,380	7.32000	10,101.60	
60740910	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	4,925	34.00000	167,450.00	
64109T10	NET SERVICOS DE COMUNICACAO SA PRF-ADR	5,020	8.62000	43,272.40	
66988810	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	1,976	38.00000	75,088.00	
67011E20	NOVOLIPETSK STEEL-GDR	2,110	17.25000	36,397.50	
67812910	POLYUS GOLD CO. -ADR	3,200	22.50000	72,000.00	
67812M20	ROSNEFT OIL CO. -GDR	27,540	5.47000	150,643.80	
68370R10	VIMPEL-COMMUNICATIONS OAO-SP ADR	11,955	10.62000	126,962.10	
68554N10	ORASCOM CONSTRUCTION INDUSTRIES GDR	2,200	34.01000	74,822.00	
71361V30	PERDIGAO SA-ADR	1,545	34.03000	52,576.35	
71646M10	PETROBRAS ENERGIA PARTICIPACIONES SA ADR	3,640	6.03000	21,949.20	
71654V10	PETROLEO BRASILEIRO PREF-ADR	1,950	29.75000	58,012.50	
75331720	OAO GAZPROM-SPON ADR REG S	56,570	20.85000	1,179,484.50	
77852910	ROSTELECOM -ADR	1,625	48.60000	78,975.00	
78632610	SADIA SA-ADR	2,566	6.42000	16,473.72	
81815030	SEVERSTAL JSC-GDR	6,470	4.45000	28,791.50	
83363510	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA-ADR	1,600	34.85000	55,760.00	

84265V10	SOUTHERN COPPER CORP	3,385	18.19000	61,573.15	
85655220	STATE BANK OF INDIA-GDR	930	55.00000	51,150.00	
87260R20	TMK OAO-GDR	1,860	9.60000	17,856.00	
87484D10	TAM SA -PREF ADR	1,015	8.96000	9,094.40	
87923810	TIM PARTICIPACOES SA ADR	1,095	16.79000	18,385.05	
87923910	BRASIL TELECOM PARTICIPACOES SA PRF-ADR	1,225	39.61000	48,522.25	
87924610	TELE NORTE LESTE PARTICIPACOES SA -ADR	3,050	15.92000	48,556.00	
87927320	TELECOM ARGENTINA SA -ADR	1,825	9.64000	17,593.00	
87940378	TELEFONOS DE MEXICO SA DE CV -ADR	2,540	16.49000	41,884.60	
87952L10	VIVO PARTICIPACOES -ADR	2,532	18.01000	45,601.32	
91688E20	URALKALI-SPON GDR	5,660	18.60000	105,276.00	
92906P10	VOTORANTIM CELULOSE E PAPE. SA-SPON ADR	2,180	10.29000	22,432.20	
97263M10	WIMM-BILL-DANN FOODS-ADR	570	44.14000	25,159.80	
ATAD	TATNEFT-GDR	5,449	23.40000	127,506.60	
EKHO	EGYPTIAN KUWAITI HOLDING CO	18,150	1.57000	28,495.50	
G2519Y10	CREDICORP LIMITED	2,160	52.20000	112,752.00	
GAZP	OAO GAZPROM	3,000	5.18000	15,540.00	
LKOD	LUKOIL-SPON ADR	10,685	47.00000	502,195.00	
MONG	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	6,600	4.40500	29,073.00	
SGGD	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	25,500	7.93000	202,215.00	
SZPM	SHANGHAI ZHENHUA PORT MACHINERY CO. LTD-B	19,500	1.05000	20,475.00	
アメリカドル 計		401,206		5,583,165.44	
(邦貨換算額)				(529,507,410)	

## 外国株式(香港ドル)

(単位:株、香港ドル)

銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
1398HK	INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA	1,006,000	4.65000	4,677,900.00	
1688HK	ALIBABA.COM LTD	24,500	12.76000	312,620.00	
1800HK	CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD-H	114,000	9.85000	1,122,900.00	
1898HK	CHINA COAL ENERGY CO	59,000	8.28000	488,520.00	
2007HK	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	90,000	3.31000	297,900.00	
203HK	DENWAY MOTORS LIMITED	161,000	3.46000	557,060.00	
3323HK	CHINA NATIONAL BUILDING MATERIAL CO LTD	18,000	17.20000	309,600.00	
336HK	HUABAO INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	45,000	6.88000	309,600.00	
3968HK	CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	55,500	17.86000	991,230.00	
998HK	CHINA CITIC BANK	125,000	4.00000	500,000.00	
ACC	ANHUI CONCH CEMENT COMPANY LIMITED-H	11,000	52.90000	581,900.00	
AGST	ANGANG STEEL CO LTD	24,000	10.86000	260,640.00	
AIRCHINA	AIR CHINA LIMITED-H	58,000	3.85000	223,300.00	
ALCP	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	39,000	7.01000	273,390.00	
APH	AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	42,000	7.68000	322,560.00	
BCIA	BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT COMPANY LTD-H	60,000	5.33000	319,800.00	
BELL	BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	67,000	5.89000	394,630.00	
BENT	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD	12,000	34.15000	409,800.00	
BOCH	BANK OF CHINA LTD	1,200,000	2.88000	3,456,000.00	
BOCM	BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD-H	133,000	6.77000	900,410.00	
CHAODA	CHAODA MODERN AGRICULTURE	54,756	4.80000	262,828.80	
CHE	CHINA EVERBRIGHT LTD	18,000	17.54000	315,720.00	
CHINACON	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,056,000	4.79000	5,058,240.00	
CHINARES	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO	47,000	15.92000	748,240.00	
CHPC	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORPORATION-H	427,000	6.10000	2,604,700.00	
CHR	CHINA RESOURCES ENTERPRISES LTD	37,000	15.90000	588,300.00	
CHT	CHINA TRAVEL INTERNATIONAL INV HK	66,000	1.76000	116,160.00	
CHU	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	158,882	8.95000	1,421,993.90	

CHVA	CHINA VANKE CO LTD	23,360	8.83000	206,268.80	
CIMC	CHINA INTERNATIONAL MARINE CONTAINERS-B	26,876	5.77000	155,074.52	

[次へ](#)

CITI	CITIC PACIFIC LTD	29,000	14.16000	410,640.00	
CLI	CHINA LIFE INSURANCE CO	169,000	27.55000	4,655,950.00	
CMCD	CHINA MERCHANTS HOLDINGS INTERNATIONAL CO LTD	35,000	20.45000	715,750.00	
CNOOC	CNOOC LTD	397,000	9.98000	3,962,060.00	
CNPC	CNPC HONG KONG LTD	80,000	4.90000	392,000.00	
COLI	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD	86,320	14.70000	1,268,904.00	
COMM	CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD -H	50,000	4.58000	229,000.00	
COSCO	CHINA COSCO HOLDINGS-H	65,825	7.84000	516,068.00	
COSH	CHINA OILFIELD SERVICES-H	44,000	7.52000	330,880.00	
CRBL	CHINA RESOURCES LAND LTD	44,000	14.72000	647,680.00	
CSE	CHINA SHENHUA ENERGY COMPANY LIMITED - H	67,000	23.20000	1,554,400.00	
CTCL	CHINA TELECOM CORP LTD-H	304,000	3.54000	1,076,160.00	
CTEL	CHINA MOBILE LTD/HK	151,700	72.20000	10,952,740.00	
CYFG	CHINA YURUN FOOD GROUP LTD	31,000	10.16000	314,960.00	
DATA	DATANG INTERNATIONAL POWER GENERATION CO LTD-H	23,000	3.72000	85,560.00	
DFE	DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	6,000	25.45000	152,700.00	
DMG	DONGFENG MOTOR GROUP CO LTD	82,000	6.27000	514,140.00	
FLGL	COSCO PACIFIC LIMITED	30,000	8.00000	240,000.00	
GOME	GOME ELECTRICAL APPLIANCES HOLDINGS LTD	162,000	1.12000	181,440.00	
GSRW	GUANGSHEN RAILWAY CO LTD	67,000	3.78000	253,260.00	
GUD	GUANGDONG INVESTMENT LTD	62,000	3.51000	217,620.00	
HBP	HARBIN POWER EQUIPMENT	14,000	7.17000	100,380.00	
HENG	HENGAN INTERNATIONAL GROUP CO LTD	25,000	35.05000	876,250.00	
HNP	HUANENG POWER INTERNATIONAL INC-H	106,000	4.95000	524,700.00	
HSPE	CHINA HIGH SPEED TRANSMISSION EQUIPMENT GROUP CO LTD	28,000	13.28000	371,840.00	
INSU	CHINA INSURANCE INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	14,000	13.00000	182,000.00	
LGND	LENOVO GROUP LTD	104,000	2.88000	299,520.00	
LINING	LI NING CO LTD	24,000	18.36000	440,640.00	
MENGNU	CHINA MENGNIU DAIRY CO LTD	15,000	15.24000	228,600.00	
MIS	MAANSHAN IRON & STEEL COMPANY LIMITED-H	52,000	4.10000	213,200.00	
PARK	PARKSON RETAIL GROUP LTD	44,000	10.70000	470,800.00	
PFPRO	GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	26,400	14.72000	388,608.00	
PICC	PICC PROPERTY & CASUALTY CO LTD-H	54,000	4.69000	253,260.00	
PING	PING AN INSURANCE GROUP COMPANY-H	33,000	49.35000	1,628,550.00	
PTR	PETROCHINA CO LTD-H	539,000	8.09000	4,360,510.00	
RAIL	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	100,000	5.53000	553,000.00	
RAWY	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP -H	46,000	10.38000	477,480.00	
SCHEM	SINOFERT HOLDING LTD	40,000	3.55000	142,000.00	
SGP	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL CO LTD	43,000	2.61000	112,230.00	
SHELEC	SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD-H	70,000	3.16000	221,200.00	
SHIMA	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	37,500	11.24000	421,500.00	
SHIP	CHINA SHIPPING CONTAINER LINES CO LTD-H	100,750	1.99000	200,492.50	
SHUL	SHUI ON LAND LTD	39,000	4.68000	182,520.00	
SHXS	CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	36,000	10.66000	383,760.00	
SIIZ	SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	23,000	27.20000	625,600.00	
SIOC	SINO-OCEAN LAND HOLDINGS LTD	65,000	7.56000	491,400.00	
TENC	TENCENT HOLDINGS LTD	27,800	79.55000	2,211,490.00	
TING	TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	36,000	10.64000	383,040.00	
WANT	WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	82,000	3.80000	311,600.00	
YACO	YANZHOU COAL MINING CO LTD-H	50,000	8.71000	435,500.00	
ZHE	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	43,000	5.58000	239,940.00	
ZIMIN	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	98,500	6.34000	624,490.00	
ZTE	ZTE CORP-H	9,240	25.45000	235,158.00	

ZTE-1	ZTE CORP-H(新)	2,772	25.45000	70,547.40	
香港ドル 計		9,272,681		75,521,003.92	
(邦貨換算額)				(924,377,088)	

## 外国株式(マレーシアリングット)

(単位:株,マレーシアリングット)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
AMMB	AMMB HOLDINGS BHD	52,600	3.18000	167,268.00	
BSTB	BERJAYA SPORTS TOTO BHD	24,500	4.66000	114,170.00	
COMM	BUMIPUTRA-COMMERCE HOLDINGS BHD	53,900	9.00000	485,100.00	
DCB	RHB CAPITAL BHD	31,000	4.14000	128,340.00	
DIGI	DIGI.COM BHD	10,700	22.20000	237,540.00	
GAMU	GAMUDA BHD	56,000	2.48000	138,880.00	
GENT	GENTING BHD	45,300	4.72000	213,816.00	
HLBK	HONG LEONG BANK BHD	26,500	5.65000	149,725.00	
IOIB	IOI CORP BHD	91,675	4.44000	407,037.00	
KLKK	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	16,000	11.10000	177,600.00	
MBBM	MALAYAN BANKING BHD	72,150	5.00000	360,750.00	
MISM	MISC BHD FOREIGN	31,000	8.25000	255,750.00	
PLUS	PLUS EXPRESSWAYS BHD	51,600	3.18000	164,088.00	
PTG	PETRONAS GAS BHD	20,000	9.50000	190,000.00	
PUBM	PUBLIC BANK BHD-FOREIGN MKT	32,700	8.50000	277,950.00	
ROT	BRITISH AMERICAN TOBACCO MALAYSIA BHD	5,100	41.75000	212,925.00	
RWD	RESORTS WORLD BHD	96,500	2.39000	230,635.00	
SIME	SIME DARBY BHD	64,720	6.60000	427,152.00	
SPSB	SP SETIA BHD	44,650	3.88000	173,242.00	
TENA	TENAGA NASIONAL BHD	37,700	7.40000	278,980.00	
TI	AXIATA GROUP BHD	34,900	2.17000	75,733.00	
TJPC	TANJONG PLC	15,400	14.10000	217,140.00	
YTLS	YTL CORP BHD	26,600	7.00000	186,200.00	
マレーシアリングット 計		941,195		5,270,021.00	
(邦貨換算額)				(140,604,160)	

## 外国株式(タイパーツ)

(単位:株,タイパーツ)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
ADVANC	ADVANCED INFO SERVICE PCL-NVDR	28,600	77.75000	2,223,650.00	
BANPUR	BANPU PCL-NVDR	5,100	297.00000	1,514,700.00	
BAY-R	BANK OF AYUDHYA PCL-NVDR	94,000	12.40000	1,165,600.00	
BKB	BANGKOK BANK PCL FOREIGN	32,040	92.00000	2,947,680.00	
IRPCR	IRPC PCL-NVDR	191,800	3.68000	705,824.00	
KBANK/F	KASIKORNBANK PCL FOREIGN	54,200	60.25000	3,265,550.00	
KTBR	KRUNG THAI BANK PCL-NVDR	129,700	6.90000	894,930.00	
LHF	LAND AND HOUSES PCL-FOREIGN	119,400	4.78000	570,732.00	
PTTAR-R	PTT AROMATICS & REFINING PCL-NVDR	39,987	17.70000	707,769.90	
PTTEPR	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL-NVDR	30,700	117.00000	3,591,900.00	
PTTR	PTT PCL-NVDR	22,100	209.00000	4,618,900.00	
SCBR	SIAM COMMERCIAL BANK PCL-NVDR	36,300	70.25000	2,550,075.00	
SCE	SIAM CEMENT PCL FOREIGN	18,100	134.00000	2,425,400.00	
タイパーツ 計		802,027		27,182,710.90	
(邦貨換算額)				(74,480,628)	

## 外国株式(フィリピンペソ)

(単位:株,フィリピンペソ)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
AC	AYALA CORP	7,869	257.50000	2,026,267.50	
ALIB	AYALA LAND INC	177,960	7.40000	1,316,904.00	
ALIPR	AYALA LAND INC-PRF	177,960	0.10000	17,796.00	
BPI	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	57,312	46.50000	2,665,008.00	
PLDT	PHILIPPINE LONG DISTANCE TELEPHONE CO	1,810	2,310.00000	4,181,100.00	
SM	SM INVESTMENTS CORP	4,410	267.50000	1,179,675.00	

SMPH	SM PRIME HOLDINGS INC	174,168	8.30000	1,445,594.40	
フィリピンペソ 計		601,489		12,832,344.90	
(邦貨換算額)				(25,408,043)	

## 外国株式(インドネシアルピア)

(単位:株、インドネシアルピア)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
ANTM	ANEKA TAMBANG TBK PT	92,500	1,690.00000	156,325,000.00	
BBCA	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	404,000	3,250.00000	1,313,000,000.00	
BBRI	BANK RAKYAT INDONESIA	217,000	5,600.00000	1,215,200,000.00	
BDMN	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	48,000	3,325.00000	159,600,000.00	
BMRI	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	197,000	2,650.00000	522,050,000.00	
BUMI	BUMI RESOURCES TBK PT	450,000	1,790.00000	805,500,000.00	
IFSM	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	136,000	1,450.00000	197,200,000.00	
INCO	INTERNATIONAL NICKEL INDONESIA TBK PT	45,000	3,325.00000	149,625,000.00	
INDO	INDOSAT TBK PT	75,000	4,950.00000	371,250,000.00	
PGAS	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	413,500	2,450.00000	1,013,075,000.00	
PTA	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	20,000	18,300.00000	366,000,000.00	
PTBA	TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM TBK PT	25,000	9,650.00000	241,250,000.00	
TLKM	TELEKOMUNIKASI INDONESIA TBK PT	263,000	7,050.00000	1,854,150,000.00	
UTS	UNITED TRACTORS TBK PT	53,500	9,300.00000	497,550,000.00	
インドネシアルピア 計		2,439,500		8,861,775,000.00	
(邦貨換算額)				(81,528,330)	

## 外国株式(メキシコペソ)

(単位:株、メキシコペソ)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
ALFA	ALFA SAB DE CV	10,800	27.78000	300,024.00	
AMXL	AMERICA MOVIL SAB DE CV	468,000	23.36000	10,932,480.00	
CGTA	CARSO GLOBAL TELECOM SAB DE CV	18,000	51.81000	932,580.00	
CIFV	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	77,100	38.66000	2,980,686.00	
CMXC	CEMEX SA DE CV	166,800	11.75000	1,959,900.00	
EKT	GRUPO ELEKTRA SA DE CV	1,500	591.35000	887,025.00	
FEMD	FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	41,700	41.35000	1,724,295.00	
GFINBURO	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	22,000	39.54000	869,880.00	
GFNB	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	41,400	27.55000	1,140,570.00	
GMOC	GRUPO MODELO SAB DE CV	17,600	43.03000	757,328.00	
GPCA	GRUPO CARSO SAB DE CV	22,600	38.79000	876,654.00	
GXOB	GRUPO MEXICO SA DE CV	105,483	11.70000	1,234,151.10	
HOMEX	DESARROLLADORA HOMEX SA DE CV	2,600	49.10000	127,660.00	
ICA	EMPRESAS ICA SAB DE CV	2,100	25.61000	53,781.00	
KMMA	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE C. V.	22,890	52.07000	1,191,882.30	
KOFL	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	8,100	51.34000	415,854.00	
PEO	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	2,500	192.88000	482,200.00	
TELINTL	TELMEX INTERNACIONAL SAB DE CV	63,800	7.38000	470,844.00	
TLVA	GRUPO TELEVISIA SA	43,100	44.93000	1,936,483.00	
TMXA	TELEFONOS DE MEXICO SAB DE CV	109,800	10.99000	1,206,702.00	
URBI*	URBI DESARROLLOS URBANOS SA DE CV	12,700	18.28000	232,156.00	
メキシコペソ 計		1,260,573		30,713,135.40	
(邦貨換算額)				(219,598,918)	

## 外国株式(アルゼンチンペソ)

(単位:株、アルゼンチンペソ)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
SID	SIDERAR SAIC	4,600	10.80000	49,680.00	
アルゼンチンペソ 計		4,600		49,680.00	
(邦貨換算額)				(1,263,859)	

## 外国株式(ブラジルリアル)

(単位:株、ブラジルリアル)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	

ALLL11	ALL AMERICA LATINA LOGISTICA SA-UNIT	12,500	11.90000	148,750.00	
AMBV	COMPANHIA DE BEBIDAS DAS AMERICAS-PREF RIGHTS	12	30.50000	366.00	
AMBV4	COMPANHIA DE BEBIDAS DAS AMERICAS-PREF	4,000	121.45000	485,800.00	
ARCZ6	ARACRUZ CELULOSE SA	2,100	3.13000	6,573.00	
BBAS3	BANCO DO BRASIL SA	10,000	19.74000	197,400.00	
BBDC4	BANCO BRADESCO SA	31,300	27.20000	851,360.00	
BRAP4	BRADESPAR SA	5,600	27.15000	152,040.00	
BRKM5	BRASKEM SA	1,000	8.14000	8,140.00	
BRT04	BRASIL TELECOM SA -PREF.	3,700	13.49000	49,913.00	
B RTP4	BRASIL TELECOM PARTICIPACOES SA -PRF	1,600	16.60000	26,560.00	
BVMF3	BM&F BOVESPA SA	31,573	10.70000	337,831.10	
CCRO3	CIA DE CONCESSOES RODOVIARIAS	4,900	28.75000	140,875.00	
CESP6	CIA ENERGETICA DE SAO PAULO-PRF B	5,700	17.56000	100,092.00	
CMIG4	COMPANHIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	3,825	26.87000	102,777.75	
CPFE3	CPFL ENERGIA SA	3,400	32.89000	111,826.00	
CRUZ3	SOUZA CRUZ SA	2,300	47.90000	110,170.00	
CSAN3	COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	1,400	14.25000	19,950.00	
CSNA3	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	3,900	40.15000	156,585.00	
CYRE3	CYRELA BRAZIL REALTY SA	6,700	13.15000	88,105.00	
DURA4	DURATEX SA-PREF	2,300	17.00000	39,100.00	
ELET3	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	5,880	25.80000	151,704.00	
ELET6	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA PREF	2,300	25.00000	57,500.00	
ELPL6	ELETROPAULO METROPOLITANA DE SAO PAULO SA-PREF B	2,640	30.60000	80,784.00	
EMBR3	EMPRESA BRASILEIRA DE AERONAUTICA SA	7,400	9.19000	68,006.00	
GISA3	GAFISA SA	3,000	17.20000	51,600.00	
GGBR4	GERDAU SA PREFERENCE	12,600	16.86000	212,436.00	
GOAU4	METALURGICA GERDAU SA -PREF	7,100	22.36000	158,756.00	
GVTT3	GVT HOLDING SA	2,100	30.91000	64,911.00	
ITAU4	ITAU UNIBANCO BANCO MULTIPLO SA	40,357	28.39000	1,145,735.23	
ITSA2	INVESTIMENTOS ITAU SA PREF-RTS	941	2.35000	2,211.35	
ITSA4	INVESTIMENTOS ITAU SA -PREF	51,799	8.12000	420,607.88	
KLBN4	KLABIN SA-PREF	15,300	3.23000	49,419.00	
LAME4	LOJAS AMERICANAS SA	11,700	9.70000	113,490.00	
LREN3	LOJAS RENNER SA	3,300	21.43000	70,719.00	
MRVE3	MRV ENGENHARIA E PARTICIPACOES SA	1,900	22.57000	42,883.00	
NATU3	NATURA COSMETICOS SA	5,300	27.70000	146,810.00	
OGXP3	OGX PETROLEO E GAS PARTICIPACOES SA	300	849.99000	254,997.00	
PETR3	PETROLEO BRASILEIRO SA	56,360	38.98000	2,196,912.80	
PETR4	PETROLEO BRASILEIRO SA PREF	71,200	31.30000	2,228,560.00	
RDCD3	REDECARD SA	4,200	26.50000	111,300.00	
SBSP3	COMPANHIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	720	28.96000	20,851.20	
SDIA4	SADIA SA PREFERENCE	3,000	4.42000	13,260.00	
SUBA3	B2W COMPANHIA GLOBAL DO VAREJO	1,600	35.10000	56,160.00	
SUZB5	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	3,600	15.18000	54,648.00	
TAMM4	TAM SA-PREF	1,100	18.68000	20,548.00	
TBLE3	TRACTEBEL ENERGIA SA	3,700	18.50000	68,450.00	
TCSL4	TIM PARTICIPACOES SA	3,100	3.57000	11,067.00	
TMAR5	TELEMAR NORTE LESTE SA-PRF	1,200	54.47000	65,364.00	
TNLP3	TELE NORTE LESTE PARTICIPACOES SA TELEMAR	1,400	41.60000	58,240.00	
TNLP4	TELE NORTE LESTE PARTICIPACOES SA TELEMAR PREF	2,700	33.69000	90,963.00	
TSPP4	VIVO PARTICIPACOES SA -PREF	600	37.29000	22,374.00	
UGPA4	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA -PREF.	1,700	61.00000	103,700.00	

USIM3	USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS SA	2,000	29.86000	59,720.00	
USIM5	USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS SA	6,300	31.95000	201,285.00	
VALE3	CIA VALE DO RIO DOCE	23,200	36.60000	849,120.00	
VALE5	CIA VALE DO RIO DOCE PREF	54,850	31.17000	1,709,674.50	
VCPA4	VOTORANTIM CELULOSE E PAPEL SA-PREF	600	21.50000	12,900.00	
ブラジルリアル 計		554,857		14,181,880.81	
(邦貨換算額)				(636,766,448)	

## 外国株式(チリペソ)

(単位:株,チリペソ)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
BSAN	BANCO SANTANDER CHILE SA	747,000	20.87000	15,589,890.00	
CAP	CAP SA	2,045	10,550.00000	21,574,750.00	
CENCOSUD	CENTROS COMERCIALES SUDAMERICANOS SA	19,150	1,419.60000	27,185,340.00	
CMPC	EMPRESAS CMPC SA	3,700	14,691.00000	54,356,700.00	
COLBUN	COLBUN SA	268,000	124.45000	33,352,600.00	
COPEC	EMPRESAS COPEC SA	11,490	6,714.40000	77,148,456.00	
ENDESA	EMPRESA NACIONAL DE ELECTRICIDAD SA	57,700	791.42000	45,664,934.00	
ENERSIS	ENERSIS SA	269,500	180.51000	48,647,445.00	
ENTEL	EMPRESA NACIONAL DE TELECOMUNICACIONES SA	2,700	7,400.00000	19,980,000.00	
チリペソ 計		1,381,285		343,500,115.00	
(邦貨換算額)				(58,051,519)	

## 外国株式(コロンビアペソ)

(単位:株,コロンビアペソ)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
CEMARGOS	CEMENTOS ARGOS SA	8,890	7,180.00000	63,830,200.00	
ECOPETL	ECOPETROL SA	25,000	2,275.00000	56,875,000.00	
INVARGOS	INVERSIONES ARGOS SA	8,660	10,900.00000	94,394,000.00	
コロンビアペソ 計		42,550		215,099,200.00	
(邦貨換算額)				(9,055,676)	

## 外国株式(チェココルナ)

(単位:株,チェココルナ)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
CETV	CENTRAL EUROPEAN MEDIA ENTERPRISES LTD	1,395	350.00000	488,250.00	
CEZ	CEZ	5,430	859.10000	4,664,913.00	
KOMB	KOMERCNI BANKA AS	360	2,630.00000	946,800.00	
SPTT	TELEFONICA O2 CZECH REPUBLIC	1,925	426.00000	820,050.00	
チェココルナ 計		9,110		6,920,013.00	
(邦貨換算額)				(33,146,862)	

## 外国株式(エジプトポンド)

(単位:株,エジプトポンド)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
EFGH	EGYPTIAN FINANCIAL GROUP-HERMES HOLDING	5,300	21.95000	116,335.00	
EMOB	EGYPTIAN CO FOR MOBILE SERVICES	1,570	192.16000	301,691.20	
ORAT	ORASCOM TELECOM HOLDING SAE	13,000	34.96000	454,480.00	
SWDY	ELSWEDY CABLES HOLDING CO	1,570	59.47000	93,367.90	
エジプトポンド 計		21,440		965,874.10	
(邦貨換算額)				(16,303,955)	

## 外国株式(ハンガリーフォリント)

(単位:株,ハンガリーフォリント)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
MOL	MOL MAGYAR OLAJ- ES GAZIPARI RT	1,520	12,900.00000	19,608,000.00	

MTEL	MAGYAR TELEKOM TELECOMMUNICATIONS PLC	13,420	580.00000	7,783,600.00	
OTP	OTP BANK RT	6,885	2,835.00000	19,518,975.00	
RICHT	GEDEON RICHTER RT	320	29,500.00000	9,440,000.00	
ハンガリーフォロント 計		22,145		56,350,575.00	
(邦貨換算額)				(25,357,759)	

## 外国株式(インドルピー)

(単位:株,インドルピー)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
ABB	ABB LTD INDIA	1,325	492.20000	652,165.00	
ACC	ASSOCIATED CEMENT CO LTD	1,330	634.95000	844,483.50	
BHEL	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	3,630	1,706.65000	6,195,139.50	
CAIR	CAIRN INDIA LTD	7,140	199.20000	1,422,288.00	
CIPLA	CIPLA LTD	7,650	230.90000	1,766,385.00	
DRRD	DR REDDY'S LABORATORIES LTD	3,740	573.55000	2,145,077.00	
GAIL	GAIL INDIA LTD	10,875	269.90000	2,935,162.50	
GAMB	AMBUJA CEMENTS LTD	10,970	76.00000	833,720.00	
GNP	GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	2,700	173.35000	468,045.00	
GRASIM	GRASIM INDUSTRIES LTD	650	1,878.40000	1,220,960.00	
HDFC	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	4,115	1,938.55000	7,977,133.25	
HDFCB	HDFC BANK LTD	6,055	1,184.95000	7,174,872.25	
HH	HERO HONDA MOTORS LTD	1,000	1,221.90000	1,221,900.00	
HLVR	HINDUSTAN UNILEVER LTD	22,520	224.30000	5,051,236.00	
HNDL	HINDALCO INDUSTRIES LTD	14,280	70.45000	1,006,026.00	
ICICIB	ICICI BANK LTD	19,265	574.70000	11,071,595.50	
IDFC	INFRASTRUCTURE DEVELOPMENT FINANCE CO LTD	17,300	94.80000	1,640,040.00	
IH	INDIAN HOTELS CO LTD	12,050	51.80000	624,190.00	
INFO	INFOSYS TECHNOLOGIES LTD	11,615	1,592.80000	18,500,372.00	
ITCL	ITC LTD	25,255	186.05000	4,698,692.75	
JSP	JINDAL STEEL & POWER LTD	2,250	1,604.10000	3,609,225.00	
JSTL	JSW STEEL LTD	2,000	418.60000	837,200.00	
KMB	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	2,905	506.05000	1,470,075.25	
LT	LARSEN & TOUBRO LTD	2,570	989.00000	2,541,730.00	
MM	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	2,400	513.45000	1,232,280.00	
MUL	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,105	848.20000	1,785,461.00	
NATP	NTPC LTD	25,850	187.55000	4,848,167.50	
NDLFU	DLF LTD	4,900	258.05000	1,264,445.00	
NESOIL	ESSAR OIL LTD	7,780	131.75000	1,025,015.00	
NGMRI	GMR INFRASTRUCTURE LTD	11,490	113.40000	1,302,966.00	
NJPA	JAIPRAKASH ASSOCIATES LTD	12,040	140.65000	1,693,426.00	
NRCFT	RELIANCE CAPITAL LTD	3,510	591.55000	2,076,340.50	
NRNR	RELIANCE NATURAL RESOURCES LTD	13,100	57.90000	758,490.00	
NRPET	RELIANCE PETROLEUM LTD	14,850	120.55000	1,790,167.50	
NSAIL	STEEL AUTHORITY OF INDIA LTD	10,620	122.25000	1,298,295.00	
NSIEM	SIEMENS INDIA LTD	1,890	367.40000	694,386.00	
NSTLT	STERLITE INDUSTRIES INDIA LTD	6,150	460.30000	2,830,845.00	
ONGC	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	9,365	813.15000	7,615,149.75	
RBXY	RANBAXY LABORATORIES LTD	4,755	199.80000	950,049.00	
RCVL	RELIANCE COMMUNICATION LTD	19,055	232.50000	4,430,287.50	
RELE	RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	2,940	820.20000	2,411,388.00	
RIL	RELIANCE INDUSTRIES LTD	15,045	1,950.70000	29,348,281.50	
TATA	TATA STEEL LTD	5,416	272.00000	1,473,152.00	
TCS	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	4,675	644.05000	3,010,933.75	
TPWR	TATA POWER CO LTD	2,600	908.60000	2,362,360.00	
TTMT	TATA MOTORS LTD	7,200	265.25000	1,909,800.00	
UNIT	UNITECH LTD	8,030	50.95000	409,128.50	
UNSP	UNITED SPIRITS LTD	1,330	675.55000	898,481.50	
UTIB	AXIS BANK LTD	6,160	659.60000	4,063,136.00	
WPRO	WIPRO LTD	7,300	377.60000	2,756,480.00	
Z	ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	6,390	143.25000	915,367.50	
インドルピー 計		410,136		171,061,993.00	
(邦貨換算額)				(333,570,886)	

## 外国株式(イスラエルシケル)

(単位:株、イスラエルシケル)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
BEZQ	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	26,360	6.62800	174,714.08	
CHIM	ISRAEL CHEMICALS LTD	8,485	40.55000	344,066.75	
DSCT	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	20,820	4.83000	100,560.60	
ESLT	ELBIT SYSTEMS LTD	1,085	228.20000	247,597.00	
ILCO	THE ISRAEL CORP LTD	65	1,991.00000	129,415.00	
KOR	KOOR INDUSTRIES LTD	550	97.32000	53,526.00	
LUMI	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	27,750	10.17000	282,217.50	
MAIN	MAKHTESHIM-AGAN INDUSTRIES LTD	9,845	20.21000	198,967.45	
MZTF	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,200	22.40000	138,880.00	
NICE	NICE SYSTEMS LTD	1,735	93.60000	162,396.00	
POLI	BANK HAPUALIM BM	10,000	9.68800	96,880.00	
PTNR	PARTNER COMMUNICATIONS	1,800	69.35000	124,830.00	

[次へ](#)

TEVA	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	22,935	185.30000	4,249,855.50	
イスラエルシケル 計		137,630		6,303,905.88	
(邦貨換算額)				(143,729,054)	

## 外国株式(韓国ウォン)

(単位:株,韓国ウォン)

銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
036460	KOREA GAS CORP	710	47,100.00000	33,441,000.00	
097230	HANJIN HEAVY INDUSTRIES & CONSTRUCTION CO LTD	715	39,350.00000	28,135,250.00	
097950	CJ CHEILJEDANG CORP	194	162,500.00000	31,525,000.00	
AMOR	AMOREPACIFIC CORP	90	620,000.00000	55,800,000.00	
CHIN	CHEIL INDUSTRIES INC	1,240	44,100.00000	54,684,000.00	
CONF	LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	25	1,012,000	25,300,000.00	
DAEG	DAEGU BANK	4,140	10,650.00000	44,091,000.00	
DAEN	DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	3,686	11,700.00000	43,126,200.00	
DAEW	DAEWOO INTERNATIONAL CORP	1,390	30,050.00000	41,769,500.00	
DAIN	DAELIM INDUSTRIAL CO	610	68,000.00000	41,480,000.00	
DASE	DAEWOO SECURITIES CO LTD	2,930	22,300.00000	65,339,000.00	
DASH	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE ENGINEERING CO LTD	2,340	22,600.00000	52,884,000.00	
DCC	OCI CO LTD	320	219,000.00000	70,080,000.00	
DOCO	DOOSAN CORP	230	115,000.00000	26,450,000.00	
DOHI	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	800	77,400.00000	61,920,000.00	
DONG	DONGKUK STEEL MILL CO LTD	1,090	33,400.00000	36,406,000.00	
DOOS	DOOSAN INFRACORE CO LTD	2,030	17,800.00000	36,134,000.00	
GSEN	GS ENGINEERING & CONSTRUCTION CORP	910	75,700.00000	68,887,000.00	
GSHD	GS HOLDINGS CORP	1,270	33,100.00000	42,037,000.00	
HANA	HANA FINANCIAL GROUP INC	3,800	26,100.00000	99,180,000.00	
HANK	HANKOOK TIRE CO LTD	2,620	14,650.00000	38,383,000.00	
HANWA	HANWHA CORP	1,160	36,700.00000	42,572,000.00	
HID	HYUNDAI DEVELOPMENT CO	1,595	44,600.00000	71,137,000.00	
HITEBR	HITE BREWERY CO LTD	150	182,000.00000	27,300,000.00	
HJSH	HANJIN SHIPPING CO LTD	1,320	20,550.00000	27,126,000.00	
HM2P	HYUNDAI MOTOR CO PREFERENCE	850	26,200.00000	22,270,000.00	
HPC	HONAM PETROCHEMICAL CORP	370	69,800.00000	25,826,000.00	
HYEN	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	1,110	69,300.00000	76,923,000.00	
HYHE	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	945	234,000.00000	221,130,000.00	
HYMI	HYUNDAI MIPO DOCKYARD	245	143,500.00000	35,157,500.00	
HYMO	HYUNDAI MOBIS	1,520	104,000.00000	158,080,000.00	
HYOS	HYOSUNG CORP	550	84,500.00000	46,475,000.00	
HYSE	HYUNDAI SECURITIES CO	3,610	15,950.00000	57,579,500.00	
HYUD	HYUNDAI MOTOR CO	4,000	63,500.00000	254,000,000.00	
HYUS	HYUNDAI STEEL CO	1,730	63,100.00000	109,163,000.00	
HYX	HYNIX SEMICONDUCTOR INC	4,930	13,300.00000	65,569,000.00	
INDU	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	4,640	9,200.00000	42,688,000.00	
KA	KOREAN AIR LINES CO LTD	1,073	40,700.00000	43,671,100.00	
KANG	KANGWON LAND INC	2,770	15,950.00000	44,181,500.00	
KBFG	KB FINANCIAL GROUP INC	7,405	44,300.00000	328,041,500.00	
KCC	KCC CORP	120	380,500.00000	45,660,000.00	
KEBK	KOREA EXCHANGE BANK	6,540	8,390.00000	54,870,600.00	
KEP	KOREA ELECTRIC POWER CORP	7,390	29,750.00000	219,852,500.00	
KIA	KIA MOTORS CORP	5,490	12,500.00000	68,625,000.00	
KIH	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	955	35,950.00000	34,332,250.00	
KLINE	KOREA LINE CORP	190	78,300.00000	14,877,000.00	
KT	KT CORP	2,245	36,900.00000	82,840,500.00	
KTF	KT FREETEL CO LTD	2,200	26,250.00000	57,750,000.00	
KTG	KT&G CORP	3,295	71,000.00000	233,945,000.00	
LGCL	LG CHEM LTD	1,462	130,500.00000	190,791,000.00	
LGCO	LG CORP	2,000	54,600.00000	109,200,000.00	
LGE	LG ELECTRONICS INC	2,545	110,500.00000	281,222,500.00	

LGHH	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	375	178,500.00000	66,937,500.00	
LGHL	LG HAUSYS LTD	197	95,000.00000	18,715,000.00	
LGPH	LG DISPLAY CO LTD	4,560	29,400.00000	134,064,000.00	
LOTT	LOTTE SHOPPING CO LTD	215	250,000.00000	53,750,000.00	
LSC	LS CABLE LTD	650	99,700.00000	64,805,000.00	
MIRAE	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	570	76,400.00000	43,548,000.00	
NHN	NHN CORP	1,005	180,000.00000	180,900,000.00	
PHIS	POSCO	1,635	403,000.00000	658,905,000.00	
PUSA	BUSAN BANK	4,549	8,000.00000	36,392,000.00	
SACA	SAMSUNG CARD CO	690	40,950.00000	28,255,500.00	
SAEP	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	350	352,000.00000	123,200,000.00	
SAME	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	1,680	50,200.00000	84,336,000.00	
SASE	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,355	66,700.00000	90,378,500.00	
SENG	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	835	81,500.00000	68,052,500.00	
SFGL	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	8,040	31,950.00000	256,878,000.00	
SFM	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE CO	1,025	188,000.00000	192,700,000.00	
SHCL	SHINSEGAE CO LTD	420	472,000.00000	198,240,000.00	
SKC	SK HOLDINGS CO LTD	882	116,500.00000	102,753,000.00	
SKE	SK ENERGY CO LTD	1,562	103,000.00000	160,886,000.00	
SKNET	SK NETWORKS CO LTD	1,950	14,150.00000	27,592,500.00	
SKT	SK TELECOM CO LTD	990	180,000.00000	178,200,000.00	
SMC	SAMSUNG C&T CORP	3,410	42,450.00000	144,754,500.00	
SMDD	SAMSUNG SDI CO LTD	970	90,100.00000	87,397,000.00	
SMHI	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	3,690	28,800.00000	106,272,000.00	
SOR	S-OIL CORP	1,215	60,400.00000	73,386,000.00	
SSET	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	2,650	555,000.00000	1,470,750,000.00	
STECH	SAMSUNG TECHWIN CO LTD	841	62,400.00000	52,478,400.00	
STX	STX OFFSHORE & SHIPBUILDING CO LTD	925	20,200.00000	18,685,000.00	
STXP	STX PAN OCEAN CO LTD	2,670	11,850.00000	31,639,500.00	
WOFI	WOORI FINANCE HOLDINGS CO LTD	5,950	11,100.00000	66,045,000.00	
WOONG	WOONGJIN COWAY CO LTD	2,090	29,550.00000	61,759,500.00	
WOOR	WOORI INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	2,340	18,150.00000	42,471,000.00	
ZINC	KOREA ZINC CO LTD	295	143,000.00000	42,185,000.00	
韓国ウォン計		166,126		9,057,219,800.00	
(邦貨換算額)				(675,668,597)	

## 外国株式(モロッコディルハム)

(単位:株,モロッコディルハム)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
ADH	DOUJA PROMOTION GROUPE ADDOHA SA	3,700	141.50000	523,550.00	
BCE	BANQUE MAROCAINE DU COMMERCE EXTERIEUR	1,500	241.00000	361,500.00	
モロッコディルハム計		5,200		885,050.00	
(邦貨換算額)				(10,098,421)	

## 外国株式(ペルーヌエボソル)

(単位:株,ペルーヌエボソル)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
MILPOC1	CIA MINERA MILPO SAA	17,000	6.20000	105,400.00	
ペルーヌエボソル計		17,000		105,400.00	
(邦貨換算額)				(3,307,452)	

## 外国株式(ポーランドズロチ)

(単位:株,ポーランドズロチ)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
BRE	BRE BANK SA	230	149.00000	34,270.00	
BZW	BANK ZACHODNI WBK SA	665	91.90000	61,113.50	
GTC	GLOBE TRADE CENTRE SA	3,640	17.60000	64,064.00	
GTN	GETIN HOLDING SA	9,300	5.69000	52,917.00	
KGH	KGHM POLSKA MIEDZ SA	3,910	67.00000	261,970.00	
PBG	PBG SA	325	206.00000	66,950.00	
PEO	BANK PEKAO SA	3,152	114.00000	359,328.00	
PGN	POLISH OIL & GAS CO	37,985	3.79000	143,963.15	

PKN	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN SA	9,130	26.62000	243,040.60	
PKO	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	16,445	26.75000	439,903.75	
PXM	POLIMEX MOSTOSTAL SA	8,693	3.65000	31,729.45	
SFT	ASSECO POLAND SA	2,400	52.00000	124,800.00	
TPS	TELEKOMUNIKACJA POLSKA SA	14,105	17.72000	249,940.60	
ポーランドズロチ 計		109,980		2,133,990.05	
(邦貨換算額)				(61,693,652)	

## 外国株式(南アフリカランド)

(単位:株,南アフリカランド)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
AEG	AVENG LTD	15,626	29.00000	453,154.00	
AMSJ	ANGLO AMERICAN PLATINUM CORP	1,060	487.00000	516,220.00	
ANGJ	ANGLOGOLD LTD	6,770	324.00000	2,193,480.00	
APN	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	7,591	51.51000	391,012.41	
ARI	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	4,400	125.45000	551,980.00	
ASAJ	ABSA GROUP LIMITED	6,900	99.60000	687,240.00	
BARJ	BARLOWORLD LTD	6,105	37.25000	227,411.25	
BVTJ	BIDVEST GROUP LTD	8,722	94.25000	822,048.50	
EXX	EXXARO RESOURCES LTD	3,510	74.00000	259,740.00	
FOS	FOSCHINI LTD	6,775	46.00000	311,650.00	
FSRJ	FIRSTRAND LTD	76,870	13.12000	1,008,534.40	
GFIJ	GOLD FIELDS LTD	15,090	107.45000	1,621,420.50	
HAR	HARMONY GOLD MINING CO LTD	6,200	93.00000	576,600.00	
IMPJ	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	13,580	165.30000	2,244,774.00	
INL	INVESTEC LTD	6,500	41.68000	270,920.00	
IPLA	IMPERIAL HOLDINGS LTD	3,655	55.60000	203,218.00	
KIO	KUMBA IRON ORE LTD	1,680	182.98000	307,406.40	
MLA	ARCELORMITTAL SOUTH AFRICA LTD	4,945	86.00000	425,270.00	
MSM	MASSMART HOLDINGS LTD	5,590	75.25000	420,647.50	
MTNJ	MTN GROUP LTD	37,515	114.30000	4,287,964.50	
MUR	MURRAY & ROBERTS HOLDINGS LTD	7,930	46.17000	366,128.10	
NEDJ	NEDCOR LTD	1,550	85.65000	132,757.50	
NPN	NASPERS LTD	8,610	199.99000	1,721,913.90	
NTC	NETCARE LTD	41,150	9.50000	390,925.00	
PPC	PRETORIA PORTLAND CEMENT CO LTD	14,010	30.60000	428,706.00	
REM	REMGRO LTD	8,040	71.20000	572,448.00	
RLO	REUNERT LTD	6,010	41.68000	250,496.80	
RMH	RMB HOLDINGS LTD	19,830	21.90000	434,277.00	
SAPJ	SAPPI LIMITED	8,415	24.95000	209,954.25	
SASO	SASOL LTD	15,300	293.01000	4,483,053.00	
SBCJ	STANDARD BANK GROUP LTD	29,116	81.80000	2,381,688.80	
SHF	STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	25,460	11.40000	290,244.00	
SHP	SHOPRITE HOLDINGS LTD	12,210	50.50000	616,605.00	
SLMJ	SANLAM LTD	55,835	17.26000	963,712.10	
TBS	TIGER BRANDS LTD	5,490	129.00000	708,210.00	
THEJ	AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	18,069	27.40000	495,090.60	
TKGJ	TELKOM SA LTD	9,035	113.00000	1,020,955.00	
TRU	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	13,420	35.26000	473,189.20	
WHL	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	21,905	12.00000	262,860.00	
南アフリカランド 計		560,469		33,983,905.71	
(邦貨換算額)				(368,045,699)	

## 外国株式(新台幣ドル)

(単位:株,新台幣ドル)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
1101TT	TAIWAN CEMENT CORP	46,637	32.55000	1,518,034.35	
1216TT	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	37,249	34.75000	1,294,402.75	
1303TT	NAN YA PLASTICS CORP	130,930	46.35000	6,068,605.50	
1433TT	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	74,510	53.70000	4,001,187.00	
1605TT	WALSIN LIHWA CORP	116,000	9.56000	1,108,960.00	
1722TT	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	20,000	100.00000	2,000,000.00	

2105TT	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO LTD	34,000	52.60000	1,788,400.00	
2201TT	YULON MOTOR CO LTD	35,020	31.80000	1,113,636.00	
2301TT	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	72,761	26.00000	1,891,786.00	
2323TT	CMC MAGNETICS CORP	97,000	7.07000	685,790.00	
2353TT	ACER INC	59,031	58.60000	3,459,216.60	
2354TT	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	14,764	98.60000	1,455,730.40	
2371TT	TATUNG CO LTD	110,000	9.04000	994,400.00	
2379TT	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	11,245	66.50000	747,792.50	
2395TT	ADVANTECH CO LTD	9,922	50.30000	499,076.60	
2408TT	NANYA TECHNOLOGY CORP	60,000	6.26000	375,600.00	
2412TT	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	115,465	60.60000	6,997,179.00	
2454TT	MEDIATEK INC	22,442	383.00000	8,595,286.00	
2474	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	14,005	92.00000	1,288,460.00	
2475TT	CHUNGHWA PICTURE TUBES LTD	169,000	5.51000	931,190.00	
2498TT	HIGH TECH COMPUTER CORP	17,196	460.00000	7,910,160.00	
2603TT	EVERGREEN MARINE CORP TAIWAN LTD	40,700	16.50000	671,550.00	
2609TT	YANG MING MARINE TRANSPORT	47,676	12.10000	576,879.60	
2801TT	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	109,000	13.95000	1,520,550.00	
2880TT	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	109,320	18.90000	2,066,148.00	
2883TT	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING CORP	245,809	8.54000	2,099,208.86	
2884TT	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	96,033	9.98000	958,409.34	
2885TT	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	196,370	24.00000	4,712,880.00	
2886TT	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	110,000	14.40000	1,584,000.00	
2887TT	TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	224,000	8.52000	1,908,480.00	
2888TT	SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO LTD	96,948	13.45000	1,303,950.60	
2890TT	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	187,000	9.38000	1,754,060.00	
2892TT	FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	112,204	19.05000	2,137,486.20	
3008TT	LARGAN PRECISION CO LTD	3,173	324.50000	1,029,638.50	
3009TT	CHI MEI OPTOELECTRONICS CORP	94,907	17.75000	1,684,599.25	
3045TT	TAIWAN MOBILE CO LTD	51,321	52.50000	2,694,352.50	
3474TT	INOTERA MEMORIES INC	78,440	17.70000	1,388,388.00	
4904TT	FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	27,000	37.00000	999,000.00	
5346TT	POWERCHIP SEMICONDUCTOR CORP	191,908	4.79000	919,239.32	
6116TT	HANNSTAR DISPLAY CORP	105,921	8.69000	920,453.49	
6244TT	MOTECH INDUSTRIES INC	6,598	93.60000	617,572.80	
9904TT	POU CHEN CORP	72,032	20.45000	1,473,054.40	
ASE	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING	105,011	18.90000	1,984,707.90	
ASUS	ASUSTEK COMPUTER INC	86,160	46.00000	3,963,360.00	
AU	AU OPTRONICS CORP	142,927	34.60000	4,945,274.20	
CFH	CHINATRUST FINANCIAL HOLDING CO LTD	215,829	20.00000	4,316,580.00	
CLI	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	143,368	46.00000	6,594,928.00	
COMPCO	COMPAL COMMUNICATIONS INC	11,205	26.70000	299,173.50	
CPAL	COMPAL ELECTRONICS INC	109,243	28.85000	3,151,660.55	
CSC	CHINA STEEL CORP	242,738	26.90000	6,529,652.20	
DELT	DELTA ELECTRONICS INC	39,627	75.10000	2,975,987.70	
EPIS	EPISTAR CORP	10,292	88.50000	910,842.00	
FET	FAR EASTERN TEXTILE CO LTD	21,112	37.95000	801,200.40	
FPC	FORMOSA PLASTICS CORP	106,690	62.70000	6,689,463.00	
FPET	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	19,000	81.50000	1,548,500.00	
FUBON	FUBON FINANCIAL HOLDING CO	144,000	30.40000	4,377,600.00	
HHP	HON HAI PRECISION INDUSTRY	159,962	107.50000	17,195,915.00	
INNLL	INNOLUX DISPLAY CORP	76,471	43.45000	3,322,664.95	
MACR	MACRONIX INTERNATIONAL	90,440	15.20000	1,374,688.00	
MITA	MITAC INTERNATIONAL	23,569	15.70000	370,033.30	
NOVA	NOVATEK MICROELECTRONICS CORP LTD	12,460	84.00000	1,046,640.00	
NPCB	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	5,132	98.60000	506,015.20	
PRE	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	18,000	85.20000	1,533,600.00	
QUAN	QUANTA COMPUTER INC	62,789	51.30000	3,221,075.70	
RICHT	RICHTEK TECHNOLOGY CORP	5,000	212.00000	1,060,000.00	
SILI	SILICONWARE PRECISION INDUSTRIES CO	92,082	41.90000	3,858,235.80	

SISL	SINO-AMERICAN SILICON PRODUCTS INC	5,249	81.40000	427,268.60	
SYN	SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	25,300	52.40000	1,325,720.00	
TCB	TAIWAN COOPERATIVE BANK	98,000	19.00000	1,862,000.00	
TSMC	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	520,438	54.80000	28,520,002.40	
UEI	CHENG UEI PRECISION INDUSTRY CO LTD	6,615	51.90000	343,318.50	
UMC	UNITED MICROELECTRONICS CORP	288,592	13.50000	3,895,992.00	
WIST	WISTRON CORP	34,470	44.05000	1,518,403.50	
新台湾ドル 計		6,395,308		208,215,295.96	
(邦貨換算額)				(597,577,899)	

## 外国株式(トルコリラ)

(単位:株,トルコリラ)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
AEFES	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	5,581	12.20000	68,088.20	
AKBNK	AKBANK TAS	22,320	6.15000	137,268.00	
ARCLK	ARCELIK A.S.	7,021	2.21000	15,516.41	
DOHOL	DOGAN SIRKETLER GRUBU HOLDINGS	29,141	0.80000	23,312.80	
ENKAI	ENKA INSAAT VE SANAYI AS	6,600	7.65000	50,490.00	
EREGL	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	15,105	4.16000	62,836.80	
GARAN	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	54,240	3.50000	189,840.00	
HALKB	TURKIYE HALK BANKASI AS	14,660	5.75000	84,295.00	
KCHOL	KOC HOLDING AS	9,623	3.40000	32,718.20	
SAHOL	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	13,030	4.50000	58,635.00	
TCELL	TURKCELL ILETISIM HIZMETLERI AS	17,056	8.20000	139,859.20	
TTKOM	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	17,300	4.52000	78,196.00	
TUPR	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINERILERI A.S.	3,470	17.40000	60,378.00	
TURK	TURKIYE IS BANKASI	24,446	4.88000	119,296.48	
VAKBN	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	19,682	2.07000	40,741.74	
YAPI	YAPI VE KREDI BANKASI	29,033	2.29000	66,485.57	
トルコリラ 計		288,308		1,227,957.40	
(邦貨換算額)				(74,647,530)	

## 外国株式(ユーロ)

(単位:株,ユーロ)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
IAM	MAROC TELECOM	5,890	14.34000	84,462.60	
SBNA	SBERBANK-GDR	2,590	118.00000	305,620.00	
ユーロ 計		8,480		390,082.60	
(邦貨換算額)				(49,716,027)	

(単位:円)

総合計			(5,093,505,872)	5,093,505,872	
-----	--	--	-----------------	---------------	--

(注) 総合計の( )内の金額は外国株式の邦貨換算額合計であります。

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率(%)	合計額に対する比率(%)
アメリカドル	株式 69銘柄	100.0	10.4
香港ドル	株式 84銘柄	100.0	18.1
マレーシアリングット	株式 23銘柄	100.0	2.8
タイバーツ	株式 13銘柄	100.0	1.5
フィリピンペソ	株式 7銘柄	100.0	0.5
インドネシアルピア	株式 14銘柄	100.0	1.6
メキシコペソ	株式 21銘柄	100.0	4.3

アルゼンチンペソ	株式 1銘柄	100.0	0.0
ブラジルリアル	株式 57銘柄	100.0	12.5
チリペソ	株式 9銘柄	100.0	1.1
コロンビアペソ	株式 3銘柄	100.0	0.2
チェココルナ	株式 4銘柄	100.0	0.7
エジプトポンド	株式 4銘柄	100.0	0.3
ハンガリーフォリント	株式 4銘柄	100.0	0.5
インドルピー	株式 51銘柄	100.0	6.5
イスラエルシェケル	株式 13銘柄	100.0	2.8
韓国ウォン	株式 85銘柄	100.0	13.3
モロッコディルハム	株式 2銘柄	100.0	0.2
ペルーヌエボソル	株式 1銘柄	100.0	0.1
ポーランドズロチ	株式 13銘柄	100.0	1.2
南アフリカランド	株式 39銘柄	100.0	7.2
新台湾ドル	株式 73銘柄	100.0	11.7
トルコリラ	株式 16銘柄	100.0	1.5
ユーロ	株式 2銘柄	100.0	1.0

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は平成21年5月29日現在です。

## 【純資産額計算書】

資産総額	22,159,953,210	円
負債総額	29,560,751	円
純資産総額( - )	22,130,392,459	円
発行済数量	37,656,502,223	口
1単位当たり純資産額( / )	0.5877	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	62,844,501,540	円
負債総額	21,580,112	円
純資産総額( - )	62,822,921,428	円
発行済数量	83,743,236,846	口
1単位当たり純資産額( / )	0.7502	円

## (参考) 海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし)マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	5,645,005,240	円
負債総額	11,112,528	円
純資産総額( - )	5,633,892,712	円
発行済数量	6,188,435,827	口
1単位当たり純資産額( / )	0.9104	円

## 第5【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1特定期間(2006年6月12日～2006年11月16日)	6,045,892,542	50,474,489
第2特定期間(2006年11月17日～2007年5月16日)	13,332,484,941	681,362,969
第3特定期間(2007年5月17日～2007年11月16日)	11,670,374,417	1,398,573,389
第4特定期間(2007年11月17日～2008年5月16日)	5,015,364,278	1,066,182,332
第5特定期間(2008年5月17日～2008年11月17日)	3,292,804,918	1,338,223,923
第6特定期間(2008年11月18日～2009年5月18日)	3,061,658,541	679,932,043

(注) 第1特定期間の設定数量には、当初設定数量を含みません。

### 第三部【特別情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1) 資本金の額

平成21年6月末現在	資本金	16,403,045,900円
	発行可能株式総数	220,000,000株
	発行済株式総数	185,012,500株

###### 過去5年間における主な資本金の増減

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

###### (2) 会社の意思決定機構

###### ・株主総会

取締役・監査役などの選任、定款変更などに係る決議などを行ないます。

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

###### ・取締役会

当社の業務執行を決定し、取締役の職務の執行について監督します。

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

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

###### ・監査役会

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

（平成21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業務担当部門が担当し、これを運用部門にフィードバックすることにより、精度の高い運用体制を維持できるように努めています。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、平成21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	356	64,039
株式投資信託	275	51,207
単位型	41	976
追加型	234	50,230
公社債投資信託	81	12,832
単位型	64	1,007
追加型	17	11,824
投資法人合計	1	43

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、第49期事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）については、改正前の「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、改正前の「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて、第50期事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）については、改正後の財務諸表等規則並びに同規則第2条の規定により、改正後の「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第49期事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）及び第50期事業年度（平成20年4月1日から平成21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49期 (平成20年3月31日)		第50期 (平成21年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		35,432		27,759
有価証券		337		
前払費用		407		393
未収入金		7		3,869
未収委託者報酬		10,138		5,506
未収収益	3	712	3	582
立替金		190		222
繰延税金資産		1,901		862
その他	2	30	2	30
流動資産合計		49,158		39,226
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	843	1	313
器具備品	1	548	1	346
有形固定資産合計		1,391		660
無形固定資産				
ソフトウェア		109		73
電話加入権等		21		21
無形固定資産合計		131		94
投資その他の資産				
投資有価証券		4,274		1,243
関係会社株式		8,154		7,719
関係会社長期貸付金		60		60
長期差入保証金		1,062		1,037
繰延税金資産		661		1,218
その他		2		0
子会社投資損失引当金		576		576
投資その他の資産合計		13,639		10,702
固定資産合計		15,162		11,458
資産合計		64,321		50,684

(単位:百万円)

	第49期 (平成20年3月31日)	第50期 (平成21年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	150	181
未払金	5,073	2,811
未払収益分配金	7	7
未払償還金	353	187
未払手数料	4,378	2,391
その他未払金	333	225
未払費用	3 6,697	3 3,701
未払法人税等	5,651	
未払消費税等	424	
賞与引当金	2,855	1,821
役員賞与引当金	320	191
その他	212	16
<b>流動負債合計</b>	<b>21,384</b>	<b>8,723</b>
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	624	612
その他	102	102
<b>固定負債合計</b>	<b>727</b>	<b>714</b>
<b>負債合計</b>	<b>22,112</b>	<b>9,438</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	16,287	16,403
資本剰余金		
資本準備金	4,157	4,272
その他資本剰余金	4	4
<b>資本剰余金合計</b>	<b>4,161</b>	<b>4,277</b>
<b>利益剰余金</b>		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	21,660	20,593
<b>利益剰余金合計</b>	<b>21,660</b>	<b>20,593</b>
<b>株主資本合計</b>	<b>42,109</b>	<b>41,273</b>
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	99	26
<b>評価・換算差額等合計</b>	<b>99</b>	<b>26</b>
<b>純資産合計</b>	<b>42,208</b>	<b>41,246</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>64,321</b>	<b>50,684</b>

## (2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	87,292	56,567
その他営業収益	3,894	2,962
営業収益計	91,186	59,529
営業費用		
支払手数料	36,598	27,877
広告宣伝費	4,770	1,298
公告費	42	17
受益証券発行費	13	
調査費	17,679	12,861
調査費	868	854
委託調査費	16,792	11,990
図書費	19	15
委託計算費	554	491
営業雑経費	1,002	714
通信費	237	190
印刷費	430	340
協会費	44	49
諸会費	9	7
その他	280	126
営業費用計	60,661	43,260
一般管理費		
給料	8,005	7,124
役員報酬	220	228
役員賞与引当金繰入額	320	191
給料・手当	4,578	4,879
賞与	31	4
賞与引当金繰入額	2,855	1,821
交際費	100	79
寄付金	19	33
旅費交通費	446	264
租税公課	341	255
不動産賃借料	1,164	921
退職給付費用	327	336
退職金	231	14
固定資産減価償却費	446	801
諸経費	3,806	2,992
一般管理費計	14,890	12,824
営業利益	15,634	3,444

(単位：百万円)

	第49期 (自 平成19年 4月 1日 至 平成20年 3月31日)		第50期 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日)	
営業外収益				
受取利息	1		2	
受取配当金	63	1	710	
有価証券売却益			160	
有価証券償還益			73	
時効成立分配金・償還金	689		106	
その他	71		122	
営業外収益計	826		1,176	
営業外費用				
支払利息	16		15	
有価証券売却損			51	
有価証券償還損			200	
時効成立後支払分配金・償還金	90		129	
弁護士報酬等	31		37	
その他	12		2	
営業外費用計	150		438	
経常利益	16,310		4,182	
特別利益				
投資有価証券売却益	560		38	
特別利益計	560		38	
特別損失				
投資有価証券売却損	390		226	
投資有価証券評価損			569	
関係会社株式評価損	2,618		454	
固定資産処分損	46		0	
移転費用	110			
割増退職金			433	
その他	7			
特別損失計	3,172		1,685	
税引前当期純利益	13,697		2,535	
法人税、住民税及び事業税	7,266		273	
法人税等調整額	1,581		568	
法人税等合計	5,685		842	
当期純利益	8,012		1,693	

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：百万円)

	第49期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	第50期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	16,223	16,287
当期変動額		
新株の発行	64	115
当期変動額合計	64	115
当期末残高	16,287	16,403
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	4,092	4,157
当期変動額		
新株の発行	64	115
当期変動額合計	64	115
当期末残高	4,157	4,272
その他資本剰余金		
前期末残高	4	4
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	4	4
資本剰余金合計		
前期末残高	4,097	4,161
当期変動額		
新株の発行	64	115
当期変動額合計	64	115
当期末残高	4,161	4,277
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		
前期末残高	20,616	21,660
当期変動額		
剰余金の配当	6,969	2,760
当期純利益	8,012	1,693
当期変動額合計	1,043	1,067
当期末残高	21,660	20,593
利益剰余金合計		
前期末残高	20,616	21,660
当期変動額		
剰余金の配当	6,969	2,760
当期純利益	8,012	1,693
当期変動額合計	1,043	1,067
当期末残高	21,660	20,593

(単位:百万円)

	第49期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	第50期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
<b>株主資本合計</b>		
前期末残高	40,937	42,109
当期変動額		
新株の発行	129	230
剰余金の配当	6,969	2,760
当期純利益	8,012	1,693
当期変動額合計	1,172	836
当期末残高	42,109	41,273
<b>評価・換算差額等</b>		
<b>その他有価証券評価差額金</b>		
前期末残高	682	99
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	582	126
当期変動額合計	582	126
当期末残高	99	26
<b>評価・換算差額等合計</b>		
前期末残高	682	99
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	582	126
当期変動額合計	582	126
当期末残高	99	26
<b>純資産合計</b>		
前期末残高	41,619	42,208
当期変動額		
新株の発行	129	230
剰余金の配当	6,969	2,760
当期純利益	8,012	1,693
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	582	126
当期変動額合計	589	962
当期末残高	42,208	41,246

## 重要な会計方針

	第49期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	第50期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時 価法(評価差額は、全部純資産直入 法により処理し、売却原価は、総平 均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 同左 その他有価証券 時価のあるもの 同左  時価のないもの 同左
2 固定資産の減価償却の方 法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。 なお、主な耐用年数は以下の通りで あります。 建物 4年 器具備品 4年～20年 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。た だし、ソフトウェア(自社利用分)に ついては、社内における利用可能期 間(5年)に基づく定額法によってお ります。	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。 なお、主な耐用年数は以下の通りで あります。 建物 4年 器具備品 4年～20年 (2) 無形固定資産 同左
3 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充て るため、支払見込額に基づき当事業 年度の負担額を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てる ため、支払見込額に基づき当事業年 度の負担額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当 事業年度末における退職給付債務及 び年金資産の見込額に基づき計上し ております。 数理計算上の差異は、各事業年度の 発生時における従業員の平均残存勤 務期間以内の一定の年数(10年)按分 した額をそれぞれ発生の翌事業年度 から費用処理することとしておりま す。	(1) 賞与引当金 同左  (2) 役員賞与引当金 同左  (3) 退職給付引当金 同左

	第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
4 リース取引の処理方法	(4) 子会社投資損失引当金 子会社株式の実質価額の低下による損失に備えて、純資産価額等を勘案して必要と認められる額を計上しております。 リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。	(4) 子会社投資損失引当金 同左
5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。	消費税等の会計処理 同左

## 会計方針の変更

第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
(固定資産の減価償却の方法) 法人税法の改正((所得税法等の一部を改正する法律 平成19年3月30日 法律第6号)及び(法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年3月30日 政令第83号))に伴い、当事業年度より、平成19年4月1日以降に取得したのものについては、改正後の法人税法に基づく方法に変更しております。これにより、従来の方法によった場合に比べて、営業利益、経常利益、税引前当期純利益が63百万円、当期純利益が37百万円それぞれ減少しております。	

## 表示方法の変更

第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)の別紙様式に基づき、前事業年度において「現金」及び「預金」として掲記されていたものは、当事業年度より「現金・預金」と表示しております。	

## 注記事項

## （貸借対照表関係）

第49期 (平成20年3月31日)	第50期 (平成21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 166百万円</p> <p>    器具備品 210百万円</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、日興シティ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通りであります。</p> <p>    (流動資産)</p> <p>        未収収益 77百万円</p> <p>    (流動負債)</p> <p>        未払費用 693百万円</p> <p>4 保証債務</p> <p>    当社は、Nikko Asset Management Europe Limited がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務138百万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 704百万円</p> <p>    器具備品 424百万円</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、日興シティ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通りであります。</p> <p>    (流動資産)</p> <p>        未収収益 28百万円</p> <p>    (流動負債)</p> <p>        未払費用 272百万円</p> <p>4 保証債務</p> <p>    当社は、Nikko Asset Management Europe Limited がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務64百万円に対して保証を行っております。</p>

## （損益計算書関係）

第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21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、次の通りであります。</p> <p>    受取配当金 703百万円</p>

## (株主資本等変動計算書関係)

第49期(自平成19年4月1日至平成20年3月31日)

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

区分	新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年 度末残高 (百万円)
			前事業 年度末	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
提出 会社	平成16年度 ストックオプション(1)	普通株式	6,000,000	-	-	6,000,000	-
	平成16年度 ストックオプション(2)	普通株式	6,000,000	-	-	6,000,000	-
	平成16年度 ストックオプション(3)	普通株式	6,520,000	-	520,000	6,000,000	-
	平成17年度 ストックオプション	普通株式	3,450,000	-	310,000	3,140,000	-
	平成18年度 ストックオプション	普通株式	1,550,000	-	80,000	1,470,000	-
	平成19年度 ストックオプション(1)	普通株式	-	4,250,000	110,000	4,140,000	-
	平成19年度 ストックオプション(2)	普通株式	-	30,000	-	30,000	-
合計			23,520,000	4,280,000	1,020,000	26,780,000	-

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

## 4 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

## 第50期（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	前事業年度末 株式数(株)	当事業年度 増加株式数(株)	当事業年度 減少株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
普通株式	184,047,500	965,000		185,012,500

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

区分	新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高 (百万円)
			前事業 年度末	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
提出 会社	平成16年度 ストックオプション(1)	普通株式	6,000,000	-	-	6,000,000	-
	平成16年度 ストックオプション(2)	普通株式	6,000,000	-	-	6,000,000	-
	平成16年度 ストックオプション(3)	普通株式	6,000,000	-	670,000	5,330,000	-
	平成17年度 ストックオプション	普通株式	3,140,000	-	300,000	2,840,000	-
	平成18年度 ストックオプション	普通株式	1,470,000	-	150,000	1,320,000	-
	平成19年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,140,000	-	530,000	3,610,000	-
	平成19年度 ストックオプション(2)	普通株式	30,000	-	-	30,000	-
合計			26,780,000	-	1,650,000	25,130,000	-

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

## 4 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

- (2) 基準日が当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現時点で未定であります。

## (リース取引関係)

第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
1 リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 当事業年度中にリース契約が終了し、金額が僅少であるため、注記を省略しております。	1 ファイナンス・リース取引
2 オペレーティング・リース取引 未経過リース料	2 オペレーティング・リース取引 未経過リース料
1年内 906百万円	1年内 906百万円
1年超 1,849百万円	1年超 942百万円
合計 2,755百万円	合計 1,849百万円

## (有価証券関係)

第49期(自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)

## 1 その他有価証券で時価のあるもの

(単位：百万円)

	種 類	取 得 原 価	貸借対照表計上額	差 額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株 式	7	27	19
	そ の 他	2,667	3,071	403
	小 計	2,675	3,098	423
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	そ の 他	1,545	1,289	255
	小 計	1,545	1,289	255
合 計		4,220	4,388	167

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

## 2 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

売 却 額	売 却 益 の 合 計 額	売 却 損 の 合 計 額
8,079	560	390

## 3 時価評価されていない有価証券

## その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

## 4 その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額

(単位:百万円)

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

## 5 子会社株式及び関連会社株式で時価のあるもの

(単位:百万円)

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

第50期(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

## 1 その他有価証券で時価のあるもの

(単位:百万円)

	種類	取得原価	貸借対照表計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株式	7	12	5
	その他	273	299	25
	小計	280	312	31
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	その他	836	759	76
	小計	836	759	76
合計		1,117	1,072	45

(注) 表中の「取得原価」は減損処理後の帳簿価額であります。当事業年度については、269百万円の減損処理を行っております。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。

## 2 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
3,196	199	278

## 3 時価評価されていない有価証券

## その他有価証券

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
非上場株式	121
その他 投資証券	50
合計	171

(注) 当事業年度において、その他有価証券で時価評価されていない投資証券につき、投資証券の実質価額の低下を考慮し、50百万円の減損処理を行っております。

## 4 その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
その他有価証券 その他 投資信託	-	-	504	442
合計	-	-	504	442

## 5 子会社株式及び関連会社株式で時価のあるもの

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
子会社株式	500	499	1
合計	500	499	1

(注) 当事業年度において、時価のある子会社株式につき、時価が著しく下落し回復する見込があると認められないため、404百万円の減損処理を行っております。

## (持分法損益等)

第49期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	第50期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位:百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位:百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額 2,892	(1) 関連会社に対する投資の金額 2,892
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 4,201	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 4,495
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,519	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,019

## (退職給付関係)

第49期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	第50期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
1 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定拠出型企業年金制度、キャッシュバランスプラン型退職金制度、適格退職年金制度及び退職一時金制度を設けております。	1 採用している退職給付制度の概要 同左
2 退職給付債務に関する事項 (単位:百万円)	2 退職給付債務に関する事項 (単位:百万円)
イ 退職給付債務 1,502	イ 退職給付債務 1,429
ロ 年金資産 688	ロ 年金資産 676
ハ 未積立退職給付債務 813	ハ 未積立退職給付債務 753
ニ 未認識数理計算上の差異 188	ニ 未認識数理計算上の差異 141
ホ 退職給付引当金残高 624	ホ 退職給付引当金残高 612
3 退職給付費用に関する事項 (単位:百万円)	3 退職給付費用に関する事項 (単位:百万円)
イ 勤務費用 96	イ 勤務費用 107
ロ 利息費用 29	ロ 利息費用 30
ハ 期待運用収益 5	ハ 期待運用収益 5
ニ 数理計算上の差異の費用処理額 32	ニ 数理計算上の差異の費用処理額 34
ホ 確定拠出型企業年金への掛金 174	ホ 確定拠出型企業年金への掛金 169
ヘ 退職給付費用合計 327	ヘ 退職給付費用合計 336

4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項	4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項
イ 退職給付見込額の期間配分方法 勤続期間比例	イ 退職給付見込額の期間配分方法 勤続期間比例
ロ 割引率 2.0%	ロ 割引率 2.0%
ハ 期待運用収益率 0.7%	ハ 期待運用収益率 0.7%
ニ 数理計算上の差異の処理年数 10年	ニ 数理計算上の差異の処理年数 10年
	5 割増退職金に関する事項
	(単位:百万円)
	イ 流動負債 16
	ロ 割増退職金 433

## (ストックオプション等関係)

第49期(自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)

## 1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

## (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

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

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

## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

## ストックオプション(新株予約権)の数

	平成16年度ストックオプション(1)	平成16年度ストックオプション(2)
付与日	平成16年8月31日	平成16年8月31日
権利確定前(株)		
期首		680,000
付与		0
失効		0
権利確定		680,000
権利未確定残		0
権利確定後(株)		
期首	6,000,000	5,320,000
権利確定	0	680,000
権利行使	0	0
失効	0	0
権利未行使残	6,000,000	6,000,000

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

	平成18年度ストックオプション	
付与日	平成18年4月28日	平成18年7月18日
権利確定前(株)		
期首	1,220,000	330,000
付与	0	0
失効	80,000	0
権利確定	0	0
権利未確定残	1,140,000	330,000
権利確定後(株)		
期首		
権利確定		
権利行使		
失効		
権利未行使残		

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

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

## 単価情報

	平成16年度ストックオプション(1)	平成16年度ストックオプション(2)
付与日	平成16年 8 月31日	平成16年 8 月31日
権利行使価格(円) (注) 1	15,823(分割後159)	同左
付与日における公正な評価単価(円) (注) 2、3		

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

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

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

- (注) 1 株式数に換算して記載しております。なお当社は、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。
- 2 平成16年度ストックオプション(1)(2)(3)、平成17年度ストックオプション及び平成18年度ストックオプションのうち平成18年4月28日付与ストックオプションについては、会社法の施行日前に付与されたストックオプションであるため、記載しておりません。
- 3 平成18年度ストックオプションのうち平成18年7月18日付与ストックオプション、平成19年度ストックオプション(1)及び平成19年度ストックオプション(2)については、公正な評価単価に代え、本源的価値(DCF法による評価額と行使価格との差額)の見積りによっております。

第50期(自 平成20年4月1日至 平成21年3月31日)

## 1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

## (1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

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

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

## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

## ストックオプション(新株予約権)の数

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

	平成16年度ストックオプション(3)	平成17年度ストックオプション
付与日	平成17年1月11日、平成17年1月28日 平成17年5月24日、平成17年6月22日	平成18年2月14日
権利確定前(株)		
期首	6,000,000	3,140,000
付与	0	0
失効	670,000	300,000
権利確定	0	0
権利未確定残	5,330,000	2,840,000
権利確定後(株)		
期首		
権利確定		
権利行使		
失効		
権利未行使残		

	平成18年度ストックオプション	
付与日	平成18年4月28日	平成18年7月18日
権利確定前(株)		
期首	1,140,000	330,000
付与	0	0
失効	120,000	30,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,020,000	300,000
権利確定後(株)		
期首		
権利確定		
権利行使		
失効		
権利未行使残		

	平成19年度ストックオプション(1)	平成19年度ストックオプション(2)
付与日	平成19年7月27日	平成20年3月31日
権利確定前(株)		
期首	4,140,000	30,000
付与	0	0
失効	530,000	0
権利確定	0	0
権利未確定残	3,610,000	30,000
権利確定後(株)		
期首		
権利確定		
権利行使		
失効		
権利未行使残		

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

## 単価情報

	平成16年度ストックオプション(1)	平成16年度ストックオプション(2)
付与日	平成16年 8 月31日	平成16年 8 月31日
権利行使価格(円) (注) 1	15,823(分割後159)	同左
付与日における公正な評価単価(円) (注) 2、3		

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

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

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

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

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

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

4 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 169百万円

## (税効果会計関係)

第49期 (平成20年3月31日)	第50期 (平成21年3月31日)																																								
<p>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</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <p>繰延税金資産(流動)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>賞与引当金繰入超過額</td> <td style="text-align: right;">1,161</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">551</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">188</td> </tr> <tr> <td></td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,901</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産(固定)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>退職給付引当金超過額</td> <td style="text-align: right;">254</td> </tr> <tr> <td>子会社投資損失引当金</td> <td style="text-align: right;">234</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">240</td> </tr> <tr> <td></td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">729</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産合計</p> <p style="text-align: right;">2,630</p> <p>繰延税金負債(固定)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">68</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債合計</p> <p style="text-align: right;">68</p> <p>繰延税金資産の純額</p> <p style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,562</p>	賞与引当金繰入超過額	1,161	未払事業税	551	その他	188		1,901	退職給付引当金超過額	254	子会社投資損失引当金	234	その他	240		729	その他有価証券評価差額金	68	<p>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</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <p>繰延税金資産(流動)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>賞与引当金繰入超過額</td> <td style="text-align: right;">895</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">182</td> </tr> <tr> <td></td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,078</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産(固定)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>投資有価証券等評価損</td> <td style="text-align: right;">171</td> </tr> <tr> <td>関係会社株式評価損</td> <td style="text-align: right;">185</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金超過額</td> <td style="text-align: right;">249</td> </tr> <tr> <td>子会社投資損失引当金</td> <td style="text-align: right;">234</td> </tr> <tr> <td>固定資産減価償却超過額</td> <td style="text-align: right;">215</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">162</td> </tr> <tr> <td></td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,218</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産合計</p> <p style="text-align: right;">2,297</p> <p>繰延税金負債(流動)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>事業税中間納付還付予定額</td> <td style="text-align: right;">216</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債合計</p> <p style="text-align: right;">216</p> <p>繰延税金資産の純額</p> <p style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,080</p>	賞与引当金繰入超過額	895	その他	182		1,078	投資有価証券等評価損	171	関係会社株式評価損	185	退職給付引当金超過額	249	子会社投資損失引当金	234	固定資産減価償却超過額	215	その他	162		1,218	事業税中間納付還付予定額	216
賞与引当金繰入超過額	1,161																																								
未払事業税	551																																								
その他	188																																								
	1,901																																								
退職給付引当金超過額	254																																								
子会社投資損失引当金	234																																								
その他	240																																								
	729																																								
その他有価証券評価差額金	68																																								
賞与引当金繰入超過額	895																																								
その他	182																																								
	1,078																																								
投資有価証券等評価損	171																																								
関係会社株式評価損	185																																								
退職給付引当金超過額	249																																								
子会社投資損失引当金	234																																								
固定資産減価償却超過額	215																																								
その他	162																																								
	1,218																																								
事業税中間納付還付予定額	216																																								
<p>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</p> <p>法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の百分の五以下であるため注記を省略しております。</p>	<p>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</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>法定実効税率</td> <td style="text-align: right;">40.6%</td> </tr> <tr> <td>(調整)</td> <td></td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">3.6%</td> </tr> <tr> <td>外国税額控除の影響額等</td> <td style="text-align: right;">11.0%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">33.2%</td> </tr> </table>	法定実効税率	40.6%	(調整)		交際費等永久に損金に算入されない項目	3.6%	外国税額控除の影響額等	11.0%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	33.2%																														
法定実効税率	40.6%																																								
(調整)																																									
交際費等永久に損金に算入されない項目	3.6%																																								
外国税額控除の影響額等	11.0%																																								
税効果会計適用後の法人税等の負担率	33.2%																																								

## ( 関連当事者情報 )

第49期(自 平成19年 4 月 1 日 至 平成20年 3 月31日)

## ( 追加情報 )

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

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

## 1 関連当事者との取引

## (1) 関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社

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

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

Citigroup Inc.(ニューヨーク証券取引所等に上場)

シティグループ・ジャパン・ホールディングス株式会社

株式会社日興コーディアルグループ

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下の通りであります。なお、下記数値は平成19年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	8,817百万円
負債合計	2,727百万円
純資産合計	6,090百万円
営業収益	13,173百万円
税引前当期純利益	5,719百万円
当期純利益	4,873百万円

第50期(自 平成20年4月1日 至 平成21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) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社を持つ会社	日興コーディアル証券株式会社	東京都千代田区	100,000	証券業	なし	投資信託受益証券の募集販売	信託約款に定める受益者に対する収益分配金及び償還金の支払委託に係る代行手数料の支払(注1)	13,541	未払手数料	1,406

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

Citigroup Inc.(ニューヨーク証券取引所等に上場)

日興シティホールディングス株式会社

## (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

報は以下の通りであります。なお、下記数値は平成20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	6,747百万円
負債合計	1,977百万円
純資産合計	4,769百万円

営業収益	10,700百万円
税引前当期純利益	3,968百万円
当期純利益	3,255百万円

(1株当たり情報)

第49期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)		第50期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	
1株当たり純資産額	229円33銭	1株当たり純資産額	222円93銭
1株当たり当期純利益	43円54銭	1株当たり当期純利益	9円16銭
<p>なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、新株予約権の残高はありますが、当社株式が非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載しておりません。</p>		<p>なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、新株予約権の残高はありますが、当社株式が非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載しておりません。</p>	

(注) 算定上の基礎

1 1株当たり純資産額

項目	第49期 (平成20年3月31日)	第50期 (平成21年3月31日)
貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円)	-	41,246
普通株式に係る純資産額(百万円)	-	41,246
差額の主な内訳(百万円)		
新株予約権	-	-
普通株式の発行済株式数(千株)	-	185,013
普通株式の自己株式数(千株)	-	-
1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数(千株)	-	185,013

(注) 当事業年度より、1株当たり純資産額の算定上の基礎を記載しております。

## 2 1株当たり当期純利益金額及び潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎

項目	第49期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	第50期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
当期純利益(百万円)	8,012	1,693
普通株式に係る当期純利益(百万円)	8,012	1,693
普通株主に帰属しない金額(百万円)		
普通株式の期中平均株式数(千株)	184,023	184,790
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成16年度ストックオプション(1)6,000,000株、平成16年度ストックオプション(2)6,000,000株、平成16年度ストックオプション(3)6,000,000株、平成17年度ストックオプション3,140,000株、平成18年度ストックオプション1,470,000株、平成19年度ストックオプション(1)4,140,000株、平成19年度ストックオプション(2)30,000株。	平成16年度ストックオプション(1)6,000,000株、平成16年度ストックオプション(2)6,000,000株、平成16年度ストックオプション(3)5,330,000株、平成17年度ストックオプション2,840,000株、平成18年度ストックオプション1,320,000株、平成19年度ストックオプション(1)3,610,000株、平成19年度ストックオプション(2)30,000株。

## (重要な後発事象)

第49期(自平成19年4月1日至平成20年3月31日)

## 1 新株発行に対する払込

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

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

第50期(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

## 1 投資有価証券の繰上償還

当社が投資有価証券として保有しているグローバルコレクション(隔月分配型)(121百万円 当事業年度末現在)が平成21年5月14日に繰上償還されることを、平成21年5月11日に金融庁に届出ております。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

##### (1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1) 受託会社

名 称	資本金の額 (平成21年3月末現在)	事業の内容
日興シティ信託銀行株式会社	20,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## (2) 販売会社

名 称	資本金の額 (平成21年3月末現在)	事業の内容
株式会社ゆうちょ銀行	3,500,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

## (1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

## (2) 販売会社

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

## 3【資本関係】

## (1) 受託会社

該当事項はありません。

## (2) 販売会社

該当事項はありません。

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
平成20年11月27日	臨時報告書
平成21年2月16日	有価証券報告書
平成21年2月16日	有価証券届出書の訂正届出書
平成21年2月26日	臨時報告書

## 独立監査人の監査報告書

平成20年12月25日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日興五大陸株式ファンドの平成20年5月17日から平成20年11月17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。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興五大陸株式ファンドの平成20年11月17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。

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21年6月17日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日興五大陸株式ファンドの平成20年11月18日から平成21年5月18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。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興五大陸株式ファンドの平成21年5月18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。

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20年6月23日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## あらた監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成19年4月1日から平成20年3月31日までの第49期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

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

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

以上

---

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

独立監査人の監査報告書

平成21年6月19日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅  
業務執行社員指定社員 公認会計士 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20年4月1日から平成21年3月31日までの第50期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成21年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

---

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