

|            |                                         |
|------------|-----------------------------------------|
| 【表紙】       |                                         |
| 【提出書類】     | 有価証券報告書                                 |
| 【提出先】      | 関東財務局長                                  |
| 【提出日】      | 平成24年8月10日                              |
| 【計算期間】     | 第11特定期間<br>（自 平成23年11月12日 至 平成24年5月11日） |
| 【ファンド名】    | マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>                    |
| 【発行者名】     | D I A Mアセットマネジメント株式会社                   |
| 【代表者の役職氏名】 | 代表取締役社長 中島 敬雄                           |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号                       |
| 【事務連絡者氏名】  | 大楽 信雄                                   |
| 【連絡場所】     | 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号                       |
| 【電話番号】     | 03-3287-3110                            |
| 【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】

当ファンドは、マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、債券および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。

当ファンドは、契約型の追加型株式投資信託に属します。

当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

当ファンドの信託金の限度額は、3,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

#### ■世界の6資産（国内外の株式・債券・リート）に分散投資を行うことにより、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。



#### ●各資産への投資は各資産の市場を代表する指数に連動する投資成果をめざすファンド（マザーファンド）を通じて行います。

| 投資対象のマザーファンド                | ベンチマーク                                       |
|-----------------------------|----------------------------------------------|
| 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | 東証株価指数(TOPIX) (配当込み)                         |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド       | MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)         |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド       | NOMURA-BPI総合                                 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド       | シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)         |
| J-REITインデックスファンド・マザーファンド    | 東証REIT指数(配当込み)                               |
| グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド  | S&P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) |

※不動産投信等をリート(REIT)と呼びます。また、リート(REIT)はReal Estate Investment Trustの略であり、不動産を中心に運用を行っている投資法人あるいは投資信託を一般的に総称するものです。

※パッシブ・ファンドとは市場(インデックス)そのものに連動する投資成果をめざすファンドです。インデックス・ファンドとも呼ばれます。

※グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用指図等に関する権限は、DIAM International Ltdに委託します。

※当ファンドはファミリーファンド方式により運用しますので、上記マザーファンドには信託報酬はかかりません。

**② 基本資産配分比率は、各資産のリターン、リスク等を推計し、証券投資理論に基づいて決定します。なお、基本資産配分比率は原則として年1回見直します。**

●基本資産配分比率は、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの投資助言を受けます。

※基本資産配分比率決定のプロセスは、期待リターン（期待収益率）、リスク（標準偏差）、相関係数を推計し、代表的な証券投資理論の1つである平均分散アプローチにより効率的フロンティアを描き、一定のリスク水準から導きます。

※分散投資の観点から各資産の基本配分比率は一定の範囲内とします。また、為替リスクの観点から外貨建資産への基本配分比率は50%以下にします。

※時価変動による基本資産配分比率からの乖離分については、原則としてリバランスを行いません。

※ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった時等、やむを得ない事情が発生した場合には、随時基本資産配分比率を見直すこととします。

**③ 購入時手数料、換金手数料がかからないノーロードファンドです。信託報酬率は信託財産の純資産総額に対して年率0.9975%（税抜0.95%）と、1%を下回る水準に設定しました。**

●換金価額は、基準価額から信託財産留保額（換金申込日の翌営業日の基準価額の0.3%）を差し引いた価額となります。

**④ 「隔月分配型」（分配金受取専用）のファンドです。**

決算ごとに分配することを重視します。隔月（奇数月）に利子・配当等収益を中心とした分配と、さらに5月・11月に売買益（評価益を含みます。）等を加えた分配をめざします。

※決算は原則として年6回（毎年1月、3月、5月、7月、9月、11月の各11日。休業日の場合は翌営業日。）です。

・将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

・分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

## 投資信託の収益分配金に関するご説明

投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。なお、分配金の有無や金額は確定したものではありません。

### 投資信託から分配金が支払われるイメージ



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

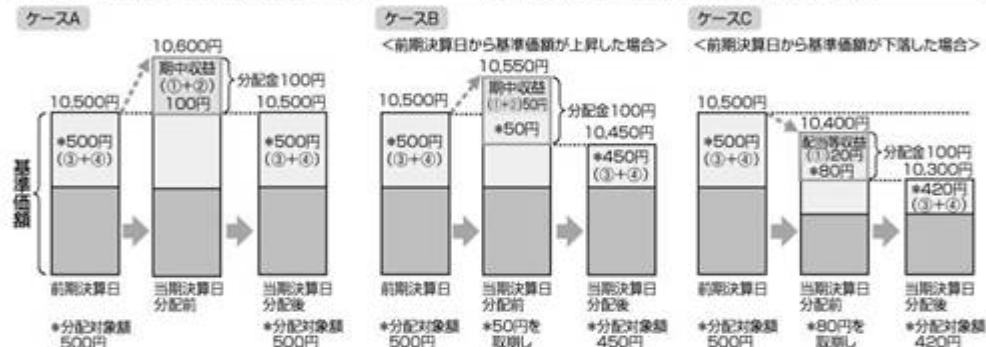
### 分配金額と基準価額の関係（イメージ）

分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

①配当等収益（経費控除後）、②有価証券売買益・評価益（経費控除後）、③分配準備積立金、④収益調整金

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



上図のそれぞれのケースにおいて、前期決算日から当期決算日まで保有した場合の損益を見ると、次の通りとなります。

- ケースA：分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差0円=100円
- ケースB：分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲50円=50円
- ケースC：分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲200円=▲100円

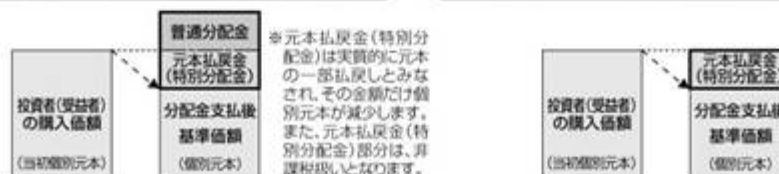
★A、B、Cのケースにおいては、分配金受取額はすべて同額ですが、基準価額の増減により、投資信託の損益状況はそれぞれ異なった結果となっています。このように、投資信託の収益については、分配金だけに注目するのではなく、「分配金の受取額」と「投資信託の基準価額の増減額」の合計額でご判断ください。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではないのでご注意ください。

投資者（受益者）のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりがかさった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



普通分配金：個別元本（投資者（受益者）のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金（特別分配金）：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者（受益者）の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

**5 実質組入外貨建資産の為替リスクに対しては、原則として対円での為替ヘッジを行いません。**

・商品分類表

| 単位型投信<br>追加型投信 | 投資対象地域 | 投資対象資産<br>(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<br>( )      |         |
|                |        | 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。

・商品分類定義

単位型投信・追加型投信

「追加型投信」とは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。

投資対象地域

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

投資対象資産

「資産複合」とは目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

補足分類

「インデックス型」とは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。

## ・属性区分表

| 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<br>一般<br>大型株<br>中小型株                         | 年1回<br>年2回<br>年4回           | グローバル<br>(日本を含む)<br>日本               |               |           | 日経225                                                                             |
| 債券<br>一般<br>公債<br>社債<br>その他債券<br>クレジット属性<br>( ) | 年6回<br>(隔月)<br>年12回<br>(毎月) | 北米<br>欧州<br>アジア<br>オセアニア             | ファミリー<br>ファンド | あり<br>( ) | TOPIX                                                                             |
| 不動産投信                                           | 日々<br>その他<br>( )            | 中南米<br>アフリカ<br>中近東<br>(中東)<br>エマージング | ファンド・オブ・ファンズ  | なし        | その他<br>(MSCIコクサイ・インデックス、NOMURA-BPI総合、シティグループ世界国債インデックス、東証REIT指数、S&P先進国REITインデックス) |
| その他資産<br>(投資信託証券(資産複合(株式、債券、不動産投信、)資産配分変更型))    |                             |                                      |               |           |                                                                                   |
| 資産複合<br>( )<br>資産配分固定型<br>資産配分変更型               |                             |                                      |               |           |                                                                                   |

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

(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。

## ・属性区分定義

## 投資対象資産

「その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））」とは目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券、不動産投信）へ実質的に投資する旨の記載があるものをいいます。

(注) 商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））に分類されます。

## 決算頻度

「年6回（隔月）」とは目論見書または投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。

## 投資対象地域

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

## 投資形態

「ファミリーファンド」とは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く。）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」とは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う旨の記載がないものをいいます。



## 販売会社

当ファンドの募集の取扱いおよび販売、投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の交付、一部解約に関する事務、収益分配金、一部解約金および償還金の支払いに関する事務等を行います。

## 投資顧問会社：

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社

委託会社との投資顧問契約に基づき、当ファンドの信託財産の運用助言等を行います。

## DIAM International Ltd

委託会社との投資一任契約に基づき、グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの信託財産の運用指図等を行います。

### ・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。

当該契約の内容は、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものであります。

### ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

### ・「投資顧問契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社）との間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。当該契約の内容は、投資顧問サービスの内容、助言の基本方針、運用の責任等について規定したものであります。

### ・「投資一任契約」の概要

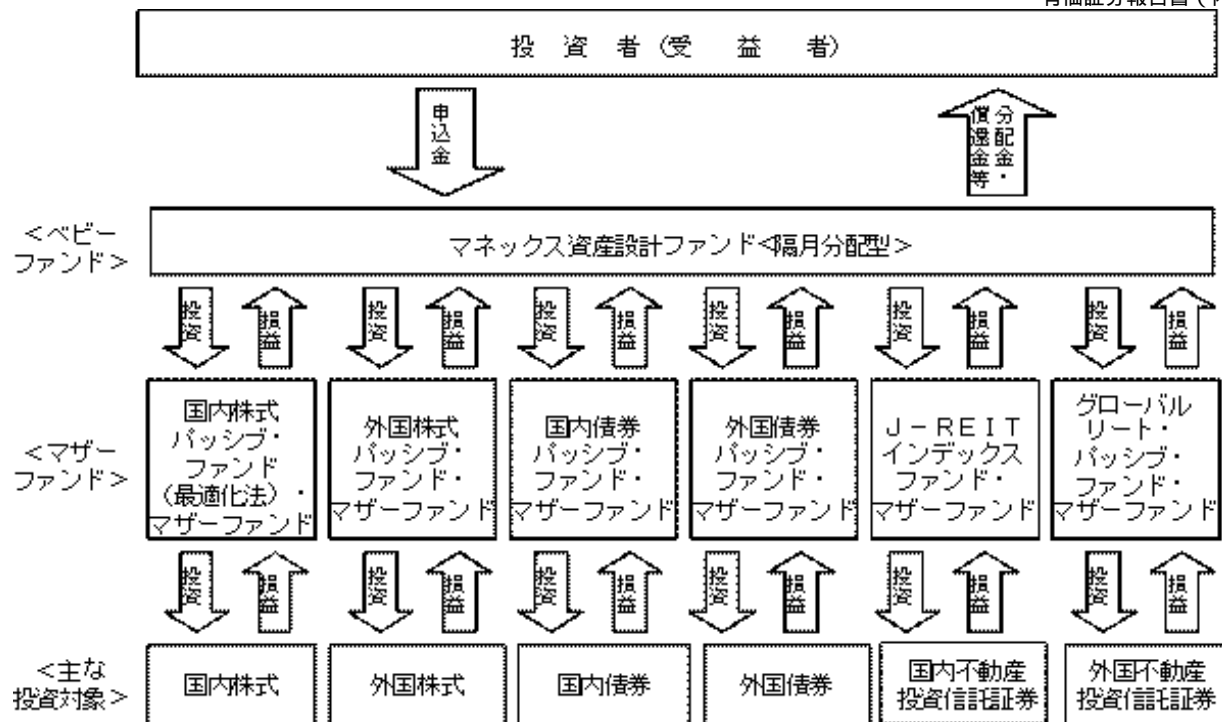
委託会社と投資顧問会社（DIAM International Ltd）との間においては、グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用の指図に関する権限を委託する契約を締結しております。

当該契約の内容は、運用指図の権限委任、投資一任契約に基づく業務の内容、運用の責任等について規定したものであります。

### ●ファミリーファンド方式とは●

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金の全部または一部をマザーファンド受益証券に投資して、その実質的な運用を各マザーファンドにて行います。



## ○委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

### 資本金の額

20億円（平成24年5月31日現在）

### 委託会社の沿革

|             |                                                                                              |
|-------------|----------------------------------------------------------------------------------------------|
| 昭和60年7月 1日  | 会社設立                                                                                         |
| 平成10年3月 31日 | 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得                                                                |
| 平成10年12月 1日 | 証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可                                                                 |
| 平成11年10月 1日 | 第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社及び日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。 |
| 平成20年1月 1日  | 「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更                                       |

### 大株主の状況

（平成24年5月31日現在）

| 株主名                | 住所                 | 所有株数    | 所有比率  |
|--------------------|--------------------|---------|-------|
| 第一生命保険株式会社         | 東京都千代田区有楽町一丁目13番1号 | 12,000株 | 50.0% |
| 株式会社みずほフィナンシャルグループ | 東京都千代田区丸の内二丁目5番1号  | 12,000株 | 50.0% |

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### <基本方針>

この投資信託は、マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、債券および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。

#### <投資態度>

主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、J-REITインデックスファンド・マザーファンドおよびグローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの各受益証券への投資を通じ、国内外の株式、債券、不動産投資信託証券（不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。）の計6資産への分散投資を行います。

基本資産配分比率は原則として年1回見直すこととします。また、この期間において時価変動による基本資産配分からの乖離分については、原則として見直しを行いません。ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった時等、やむを得ない事情が発生した場合には、随時基本資産配分を見直すこととします。

基本資産配分比率の決定については、イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の投資助言を受けます。

分散投資の観点から、各資産への配分は一定の範囲内に制限します。

実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

リート（REIT）とは

- ・リート（REIT）とは、不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券をいいます。（以下同じ。）
- ・REIT（リート）とは、Real Estate Investment Trustの略であり、不動産を中心に運用を行っている投資法人あるいは投資信託を一般的に総称するものです。なお、主に豪州市場に上場するリートについては、LPT（Listed Property Trust）と呼ばれる場合があります。
- ・リート（REIT）は、不特定多数の投資家から集めた資金などで不動産等を購入し、当該不動産をテナントに賃貸し、主にそのテナントから得る賃料から収入を得ます。多くのリート（REIT）は、一定の適格要件を満たすことにより、法人税の課税が免除されています。このため、リート（REIT）は、不動産の維持・管理費用や金利などを支払った後に残った収益について、そのほとんどをリート（REIT）に投資する投資家が、配当金（もしくは分配金）として享受する仕組みになっています。

投資対象の詳細は、約款をご覧ください。

### (2)【投資対象】

#### 1. 投資の対象とする資産（約款第15条）

この信託において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)次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ.有価証券

ロ.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23条、第24条および第25条に定めるものに限り。)

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2)次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

## 2. 有価証券の指図範囲（約款第16条第1項）

委託会社は、信託金を、主として次に掲げる1)から6)までのD I A Mアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された親投資信託の受益証券ならびに7)から28)までの有価証券(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。 )に投資することを指図します。

- 1) 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
  - 2) 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
  - 3) 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
  - 4) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
  - 5) J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド
  - 6) グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
  - 7) 株券または新株引受権証書
  - 8) 国債証券
  - 9) 地方債証券
  - 10) 特別の法律により法人の発行する債券
  - 11) 社債券（新株引受権証券と社債券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。）
  - 12) 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（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。）
  - 13) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
  - 14) 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
  - 15) 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
  - 16) コマーシャル・ペーパー
  - 17) 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
  - 18) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、5)から15)までの証券または証書の性質を有するもの
  - 19) 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、振替投資信託受益権を含みます。）
  - 20) 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。）
  - 21) 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。）
  - 22) 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。）
  - 23) 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。）
  - 24) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  - 25) 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。 )
  - 26) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。 )
  - 27) 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
  - 28) 外国の者に対する権利で上記27)の有価証券の性質を有するもの
- なお、7)の証券または証書、18)ならびに23)の証券または証書のうち7)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、8)から12)までの証券および18)ならびに23)の証券または証書のうち8)から12)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、19)の証券および20)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

## 3. 金融商品の指図範囲（約款第16条第2項）

委託会社は、信託金を、上記2. に掲げる有価証券のほか、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を指図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

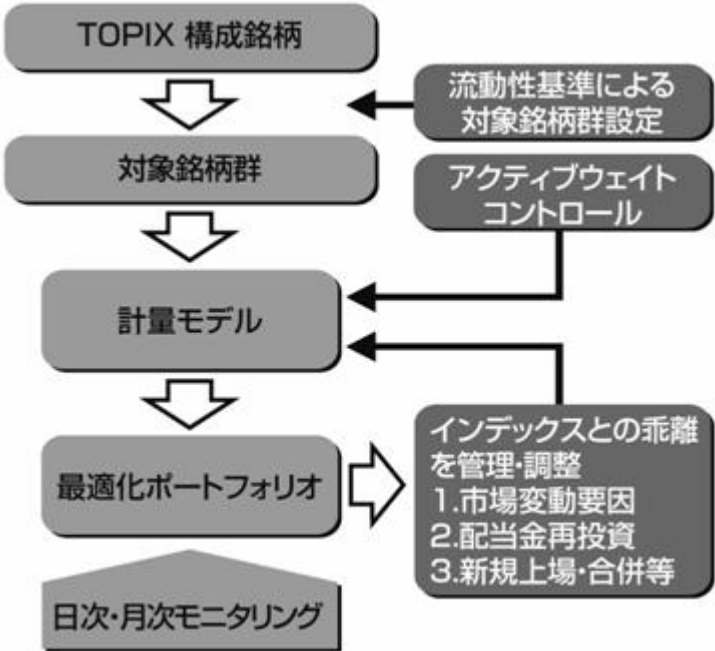
5)貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6)外国の者に対する権利で上記5)の権利の性質を有するもの

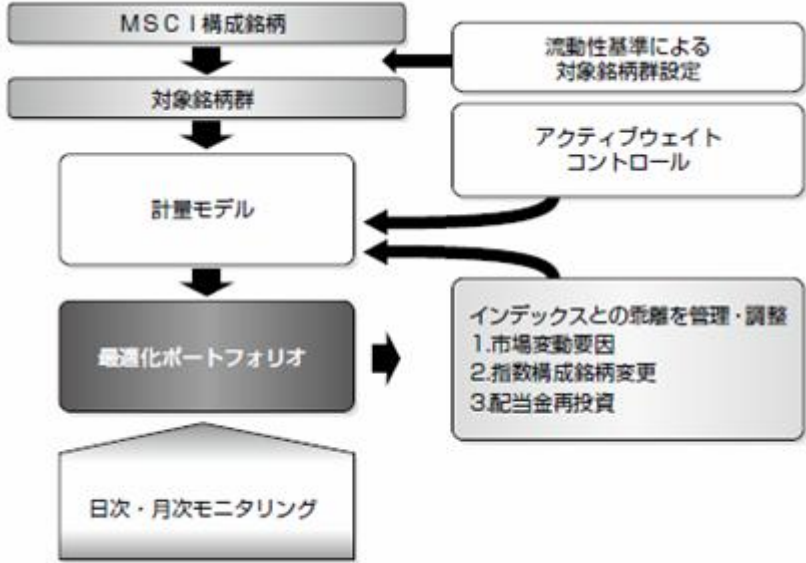
4. 上記2. の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は信託金を上記3. の1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。(約款第16条第3項)

(参考) 当ファンドが投資するマザーファンドの概要

| ファンド名  | 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基本方針   | <p>この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）(注)に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>（注）TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。</p> <p>㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>㈱東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。</p> <p>当マザーファンドはTOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用していますが、当マザーファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。</p> <p>当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。</p> <p>㈱東京証券取引所は、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p> <p>㈱東京証券取引所は、当社又は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p> <p>以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p> |
| 主な投資対象 | 東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |

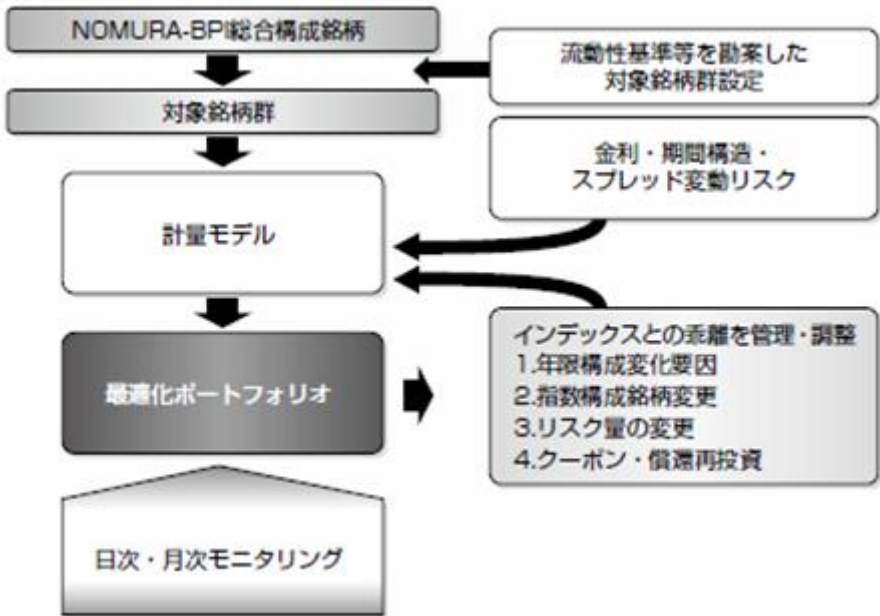
|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投資態度   | <p>1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。</p> <p>3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。</p> <p>5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。</p> <p>6. 信託財産に属する資産の効率的な運用のため、有価証券先物取引等を行うことがあります。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 運用プロセス | <p>流動性基準による対象銘柄群設定<br/>マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>最適化法によるポートフォリオの構築<br/>インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>インデックスとの乖離を管理<br/>日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施</li> <li>・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定</li> <li>・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施</li> </ul>  <pre> graph TD     A[TOPIX 構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     C[流動性基準による対象銘柄群設定] --&gt; B     B --&gt; D[計量モデル]     E[アクティブウェイトコントロール] --&gt; D     D --&gt; F[最適化ポートフォリオ]     F --&gt; G[インデックスとの乖離を管理・調整&lt;br/&gt;1.市場変動要因&lt;br/&gt;2.配当金再投資&lt;br/&gt;3.新規上場・合併等]     G --&gt; H[日次・月次モニタリング]   </pre> |
| 主な投資制限 | 株式への投資割合には、制限を設けません。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |

|        |                                         |
|--------|-----------------------------------------|
| ファンド名  | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド                   |
| 基本方針   | この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。 |
| 主な投資対象 | 海外の株式を主要投資対象とします。                       |

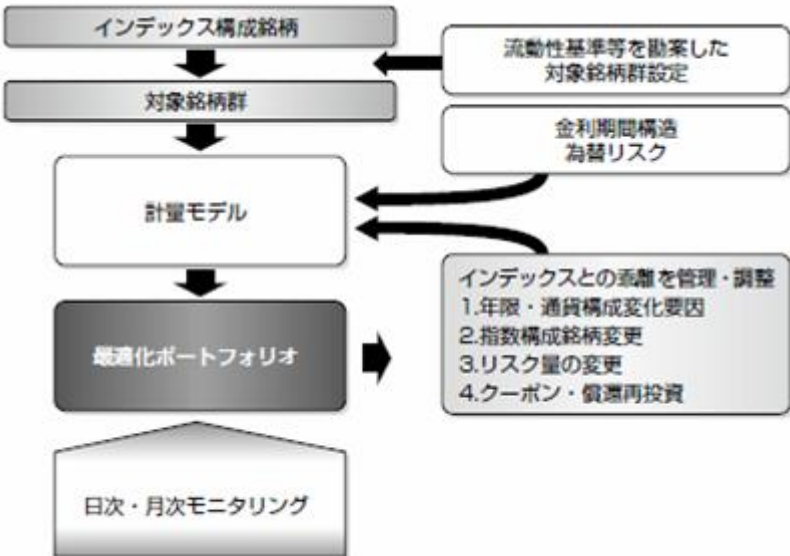
|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投資態度   | <p>主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）（注）に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin: 10px 0;"> <p>（注）MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に属しており、また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</p> </div> <p>株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 運用プロセス |  <pre> graph TD     A[MSCI構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     B --&gt; C[計量モデル]     C --&gt; D[最適化ポートフォリオ]     D --&gt; E[日次・月次モニタリング]     F[流動性基準による対象銘柄群設定] --&gt; B     G[アクティブウェイトコントロール] --&gt; C     D --&gt; H[インデックスとの乖離を管理・調整&lt;br/&gt;1.市場変動要因&lt;br/&gt;2.指数構成銘柄変更&lt;br/&gt;3.配当金再投資]     H --&gt; C     </pre> <p>流動性基準による対象銘柄群設定</p> <p>取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。</p> <p>最適化法によるポートフォリオの構築</p> <p>インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>インデックスとの乖離を管理</p> <p>日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施</li> <li>・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施</li> <li>・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施</li> </ul> |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 主な投資制限 | <p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| ファンド名  | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 基本方針   | <p>この投資信託は、NOMURA - B P I 総合(注)に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>(注)NOMURA - B P I 総合は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。</p> </div> |
| 主な投資対象 | わが国の公社債を主要投資対象とします。                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 投資態度   | <p>主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p>                                                                                                              |

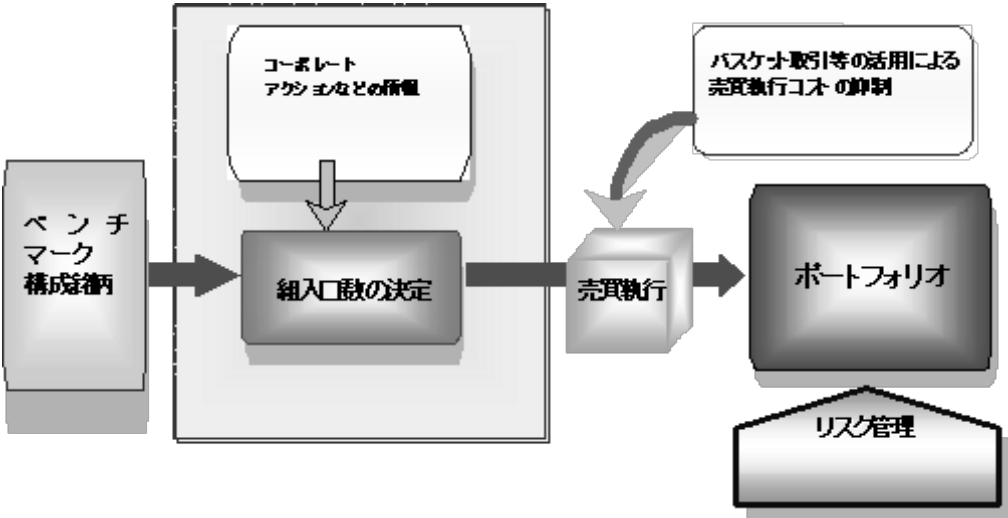
|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 運用プロセス |  <pre> graph TD     A[NOMURA-BPI総合構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     B --&gt; C[計量モデル]     C --&gt; D[最適化ポートフォリオ]     D --&gt; E[日次・月次モニタリング]     F[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --&gt; B     G[金利・期間構造・スプレッド変動リスク] --&gt; C     H[インデックスとの乖離を管理・調整<br/>1. 年限構成変化要因<br/>2. 指数構成銘柄変更<br/>3. リスク量の変更<br/>4. クーポン・償還再投資] --&gt; D           </pre> <p>流動性基準等による対象銘柄群設定<br/>NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>最適化法によるポートフォリオの構築</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因</li> <li>2. 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因</li> </ol> <p>1.、2. が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。</p> <p>インデックスとの乖離を管理<br/>日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 年限構成変化要因</li> <li>・ 指数構成銘柄変更</li> <li>・ リスク量の変更</li> <li>・ クーポン、償還再投資</li> </ul> |
| 主な投資制限 | <p>株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |

|        |                                         |
|--------|-----------------------------------------|
| ファンド名  | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド                   |
| 基本方針   | この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。 |
| 主な投資対象 | 海外の公社債を主要投資対象とします。                      |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投資態度   | <p>主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）（注）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(注)シティグループ世界国債インデックスは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した、世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。<br/>シティグループ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケット・インクに帰属します。</p> <p>外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。<br/>外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p>                                                                                               |
| 運用プロセス |  <p>流動性基準等による対象銘柄群設定<br/>シティグループ世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>最適化法によるポートフォリオの構築<br/>金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。</p> <p>インデックスとの乖離を管理<br/>日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・年限・通貨構成変化要因</li> <li>・指数構成銘柄変更</li> <li>・リスク量の変更</li> <li>・クーポン・償還再投資</li> </ul> |

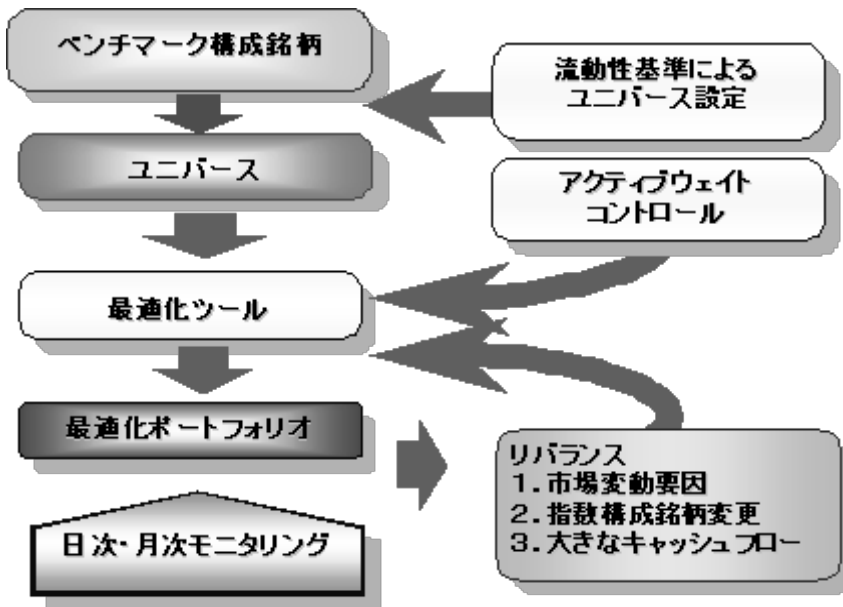
|        |                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 主な投資制限 | <p>株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限り、</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| ファンド名  | J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 基本方針   | <p>この投資信託は、東証 R E I T 指数（配当込み）（注）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>（注）東証 R E I T 指数の指数値及び東証 R E I T 指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「<small>株</small>東京証券取引所」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証 R E I T 指数に関するすべての権利及び東証 R E I T 指数の商標に関するすべての権利は<small>株</small>東京証券取引所が有しています。</p> <p><small>株</small>東京証券取引所は、東証 R E I T 指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証 R E I T 指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証 R E I T 指数の商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。</p> <p><small>株</small>東京証券取引所は、東証 R E I T 指数の商標の使用もしくは東証 R E I T 指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p><small>株</small>東京証券取引所は、東証 R E I T 指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また<small>株</small>東京証券取引所は、東証 R E I T 指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。</p> <p>当マザーファンドは東証 R E I T 指数の指数値に連動した投資成果を目標として運用を行います。当マザーファンドの基準価額と東証 R E I T 指数の指数値の動向が乖離することがあります。</p> <p>当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドは、<small>株</small>東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。</p> <p><small>株</small>東京証券取引所は、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p> <p><small>株</small>東京証券取引所は、当社又は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証 R E I T 指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p> <p>以上の項目に限らず、<small>株</small>東京証券取引所は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p> </div> |
| 主な投資対象 | <p>東京証券取引所に上場し、東証 R E I T 指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券（<small>社</small>団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投資態度   | <p>東京証券取引所に上場し、東証 R E I T 指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証 R E I T 指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</p> <p>不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証 R E I T 指数（配当込み）が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>                                                                                                                                                                                                                              |
| 運用プロセス | <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。</li> <li>・ 新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。</li> <li>・ 配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。</li> </ul>  <pre> graph LR     BM[ベンチマーク<br/>構成銘柄] --&gt; ID[組入口数の決定]     CA[コーポレート<br/>アクションなどの情報] --&gt; ID     ID --&gt; BE[売買執行]     BE --&gt; PF[ポートフォリオ]     PF --&gt; RM[リスク管理]     BE --&gt; CC[バスケット取引等の活用による<br/>売買執行コストの抑制]   </pre> |
| 主な投資制限 | <p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証 R E I T 指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証 R E I T 指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p>                                                                                                                                                                                                                            |

|       |                            |
|-------|----------------------------|
| ファンド名 | グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド |
|-------|----------------------------|

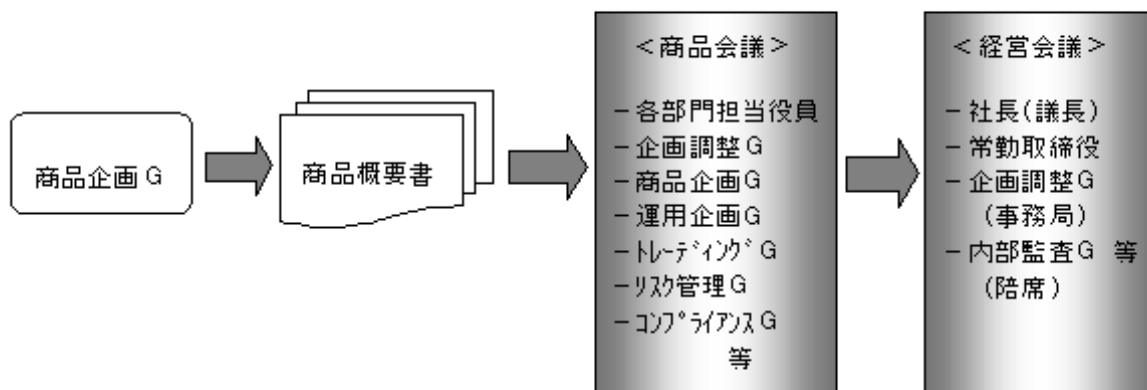
|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基本方針   | <p>この投資信託は、S &amp; P先進国REITインデックス（除く日本・円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）（注）に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 10px; margin: 10px 0;"> <p>（注）「Standard &amp; Poor's®」「S&amp;P®」「スタンダード・プアーズ」は、スタンダード・プアーズ ファイナンシャル サービスズ エル エル シーが所有する登録商標であり、D I A Mアセットマネジメント株式会社に対して利用許諾が与えられています。スタンダード・プアーズは、当ファンドを支持、推奨、販売、販売促進するものではなく、また当ファンドへの投資適合性についていかなる表明・保証・条件付け等するものではありません。</p> <p>当ファンドは、スタンダード・プアーズ及びその関連会社（以下、S&amp;P）によって支持、保証、販売又は販売促進されるものではありません。S&amp;P は、明示的にも暗示的にも、当ファンドの所有者もしくは一般の者に対して、有価証券全般または当ファンドに関する投資について、またS&amp;P 先進国 REITインデックスが市場全般のパフォーマンスに追従する能力について、何ら表明、条件付け又は保証するものではありません。S&amp;P のDIAMアセットマネジメント株式会社（以下、DIAM）に対する唯一の関係は、S&amp;P 及びS&amp;P 先進国 REITインデックスの登録商標についての利用許諾を与えることです。S&amp;P は、S&amp;P 先進国 REITインデックスに関する決定、作成及び計算において、DIAM又は当ファンドの所有者の要求等を考慮に入れずに行います。S&amp;P は当ファンドの販売に関する時期、価格の決定、又は当ファンドを現金に換算する式の決定もしくは計算に責任を負わず、また関わっていません。S&amp;P は、当ファンドの管理、マーケティング又は取引に関する義務又は責任を何ら負うものではありません。S&amp;P は、S&amp;P 先進国 REITインデックスの計算及びその元になるデータの正確性や完全性を保証するものではありません。S&amp;P は、S&amp;P 先進国 REITインデックスに含まれるいかなる誤り、欠落又は障害に対する責任を負いません。S&amp;P は、S&amp;P 先進国 REITインデックス 又はそれらに含まれるデータの使用により、DIAM、当ファンドの所有者又はその他の人や組織に生じた結果に対して、明示的にも暗示的にも保証しません。S&amp;P は、S&amp;P 先進国 REITインデックス又はそれに含まれるデータに関して、商品性の保証や適合性について何ら保証するものではないことを明示し、かつそれに関して明示もしくは暗示の保証を行いません。以上のことに関わらず、特定の、罰則的、間接的あるいは結果的な損害（利益の損失を含む）について、仮にその可能性について事前に通知されていたとしても、S&amp;P が責任を負うことはありません。</p> </div> |
| 主な投資対象 | 日本を除く世界各国の証券取引所に上場する不動産投資信託証券（不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券をいいます。）を主要投資対象とします。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 投資態度   | <p>日本を除く世界各国の証券取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S &amp; P先進国REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>運用指図に関する権限は、DIAM International Ltdに委託します。</p> <p>不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>外貨建資産については原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを実施する場合があります。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 運用プロセス |  <pre> graph TD     A[ベンチマーク構成銘柄] --&gt; B[ユニバース]     B --&gt; C[最適化ツール]     C --&gt; D[最適化ポートフォリオ]     D --&gt; E[日次・月次モニタリング]     F[流動性基準によるユニバース設定] --&gt; B     G[アクティブウェイトコントロール] --&gt; C     H[リバランス<br/>1. 市場変動要因<br/>2. 指数構成銘柄変更<br/>3. 大きなキャッシュフロー] --&gt; C     </pre> <p>流動性基準によるユニバース設定<br/>取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、S &amp; P先進国REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資ユニバースを設定します。</p> <p>最適化法によるポートフォリオの構築<br/>インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、最適化ツールを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>リバランス<br/>日次・月次レベルでリスク管理を行い、リバランスが必要とされる場合には速やかに実行します。</p> <p>リバランス要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施</li> <li>・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの</li> <li>・大きなキャッシュフローに伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施</li> </ul> |
| 主な投資制限 | <p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

### (3)【運用体制】

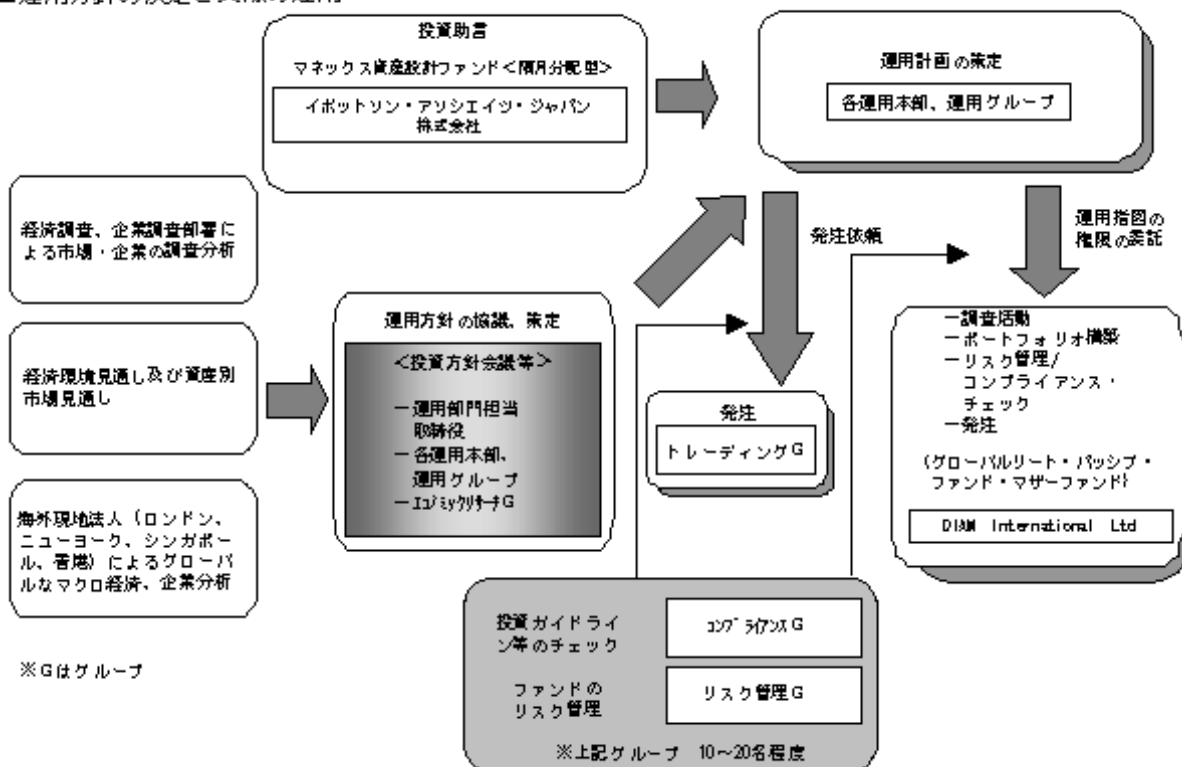
## ■ ファンドの組成時のプロセスについて



※ Gはグループ

※商品会議は各部門の担当役員、グループリーダーや実務担当者等 20 名程度が参加、経営会議は常勤取締役 8名により構成。

## ■運用方針の決定と実際の運用



※ Gはグループ

運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

### <ファンドの組成時のプロセスについて>

運用目標、運用プロセス、投資対象などの商品内容は、商品企画グループが関連各部署と協議のうえ、「商品概要書」として策定し、企画調整グループが事務局となる「商品会議」にて協議・検討致します。「商品会議」で協議・修正等された商品内容は「経営会議」で経営陣による討議を経て最終決定致します。なお、「経営会議」は、社長が議長を務め、常勤取締役を構成メンバーとし、監査役が同席のうえ、開催される会議であり、取締役会が決定した会社の基本方針に基づき全般的業務執行方針・計画および重要な業務の実施について協議・決定するとともに経営上の重要事項を審議しています。

### <運用方針の決定と実際の運用>

経済環境見通し、資産別市場見通し、基本投資方針およびファンドの運用方針は、運用部門担当取締役、各運用本部、運用グループの運用担当者、エコノミックリサーチグループ等で構成される「投資方針会議」にて協議・策定致します。

「投資方針会議」において決定された運用方針をファンドの投資方針に照らし合わせて運用計画を策定します。なお、運用計画の策定は、運用担当者およびアナリスト等の調査活動等に加え、投資助言先から得られた情報も参考にされます。

個別の有価証券等の発注は、運用部門から独立したトレーディンググループまたは、運用指図権限を委託した外部投資顧問会社で執行されます。

なお、ファンドの運用等ガイドラインチェックについては、コンプライアンスグループにて行われます。ファンドのリスク管理や分析については、リスク管理グループにて行われます。

1)当ファンドは、イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の運用助言を受けます。

2)グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

|                                                                           |                                                                                                                                                          |
|---------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは、信託財産の運用指図に関する権限をDIAM International Ltdに委託します。 |                                                                                                                                                          |
| クオンツ運用グループ                                                                | グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用はクオンツ運用グループが担当します。<br>主に日本を除く株式のクオンツ商品を運用しております。当グループでは、ユニバースの決定を行い、ポートフォリオの最適化、トレーディングを行い、主要なリスク要因はリアル・タイムで把握できる体制を敷いています。 |
| ミドル・オフィス                                                                  | 週次・月次でパフォーマンスを測定し、要因分析を社内CEO以下に向けて報告するとともに、各種リスクをモニターします。                                                                                                |
| サポート・グループ                                                                 | 決済を主に担当しており、加えて執行された売買につき委託会社や日本の信託銀行への連絡を行います。                                                                                                          |

DIAM International Ltd

株式運用 G

クオンツ  
運用 G

債券運用 G

ミドル・  
オフィス

サポート G

ビジネス・  
デベロプメン  
ト G

↓

トレーディング  
リスク・モニタリング  
助言業者、委託会社との  
コミュニケーション

↓

パフォーマンス  
測定・寄与度分  
析・リスク分析

↓

決済  
執行連絡

上記運用体制は、平成24年5月31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（原則として奇数月の各11日、休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

##### 1)分配対象額の範囲

経費控除後の利子、配当等収入および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

##### 2)分配対象額についての分配方針

原則として、利子配当等収益を中心に安定した収益分配を継続的に行うことをめざします。また、毎年5月および11月の決算時には、利子配当等収益に売買益（評価益を含みます。）等を加えた額から分配を行います。分配金額については、基準価額水準および市況動向等を勘案し委託会社の判断により決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。

3) 留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

## 収益の分配方式

a. 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理するものとします。

- 1) 信託財産に属する配当等収益（利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）と各マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
- 2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

b. 上記1)および2)におけるみなし配当等収益とは、各マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、各マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属する各マザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

c. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

## 収益分配金の支払い

収益分配金は、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

## (5)【投資制限】

マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

投資する株式等の範囲（約款第19条）

1) 委託会社が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、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式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。

2) 上記1)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、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または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。

信用取引の指図および範囲（約款第22条）

1) 委託会社は、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付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。

2) 上記1)の信用取引の指図は、次の1.～6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことがで

きるものとし、かつ次の1.～6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

先物取引等の運用指図・目的・範囲（約款第23条）

- 1) 委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行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て取扱うものとします（以下同じ。）。
- 2) 委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の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うことの指図をすることができます。
- 3) 委託会社は、わが国の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取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引の運用指図・目的・範囲（約款第24条）

- 1) 委託会社は、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。）を行うことの指図をすることができます。
- 2) 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。
- 3) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- 4) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲（約款第25条）

- 1) 委託会社は、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うことの指図をすることができます。
- 2) 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。
- 3) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 4) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

有価証券の貸付の指図および範囲（約款第26条）

- 1) 委託会社は、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1. 2. の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
  1. 株式の貸付けは、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を超えないものとします。
  2. 公社債の貸付けは、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を超えないものとします。
- 2) 上記1) 1. 2. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- 3) 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

公社債の空売りの指図および範囲（約款第27条）

- 1) 委託会社は、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。なお、当該売り付けの決済については、公社債（信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができます。
- 2) 上記1)の売り付けの指図は、当該売り付けに係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。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### 公社債の借入れ（約款第28条）

- 1) 委託会社は、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。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- 2) 上記1)の指図は、当該借入れに係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。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- 4) 上記1)の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

#### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第29条）

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### 外国為替予約の指図および範囲（約款第30条）

- 1) 委託会社は、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。
- 2) 上記1)の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産に係る売予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 3) 上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 4) 上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

#### 資金の借入れ（約款第37条）

- 1) 委託会社は、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一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）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わないものとします。
- 2) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、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償還金の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、資金借入れ額は借入指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- 3) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

#### 同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

委託会社は、同一の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う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権（株主総会において決議をすることができる事

項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含む。）の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図してはなりません。

デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

委託会社は、運用財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該運用財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含む。）を行い、または継続することを内容とした運用を行わないものとします。

### 3【投資リスク】

#### < 基準価額の主な変動要因 >

当ファンドの基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券の値動き、為替変動等により影響を受けますが、運用による損益は全て投資者の皆さまに帰属します。したがって、投資者の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、下記の変動要因により基準価額は下落し、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

また、投資信託は預貯金と異なります。

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

#### ○資産配分リスク

各資産（国内債券、外国債券、国内株式、外国株式、国内リートおよび外国リート）への資産配分は、基本資産配分比率に準じ、一定範囲内の変動に抑えます。

この資産配分が当ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、収益率の悪い資産への配分が大きい場合、複数または全ての資産価値が下落する場合には、各資産の投資成果が各資産のベンチマークと同等あるいはそれ以上のものであったとしても、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

#### ○株価変動リスク

株式市場全体の価格変動あるいは個別銘柄の価格変動により、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

#### ○金利リスク

金利リスクとは、金利変動により債券およびリートの価格が変動するリスクをいいます。金利が上昇した場合には、債券およびリートの価格は下落し、当ファンドの基準価額が下がる場合があります。

#### ○リートの価格変動リスク

一般にリートが投資対象とする不動産の価値および当該不動産から得る収入は、当該国または国際的な景気、経済、社会情勢等の変化等により変動し、リートの価格および分配金はその影響を受けることになり、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

リートは、実物資産である建物等を投資対象にしているため、火災、自然災害等に伴う損害を受けた場合は、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

リートが投資対象とする建物の用途規制等、不動産等に係る規制の強化や新たな規制がかかることにより、規制下となる不動産等の価値が低下する可能性があり、その結果、当ファンドの基準価額の下落要因となる可能性があります。

#### ○為替リスク

当ファンドでは外貨建資産の為替リスクに対して為替ヘッジを行わないことを原則としているため、為替相場が円高になった場合には、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

また外貨建資産への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。

#### ○信用リスク

債券、コマーシャルペーパーおよび短期金融商品の発行者が、経営不振、その他の理由により利息や償還金をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなる場合（債務不履行）またはそれが予想される場合には、当該債券等の価格は下落し（価格がゼロになることもあります。）、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

株式や短期金融商品等の発行者が、経営不安・倒産等に陥った場合、投資した資金が回収できなくなることがあります。また、こうした状況に陥ると予想された場合、当該株式等の価格は下落し、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

リートが、投資対象とする不動産の収益性悪化または資金繰りの悪化等により、清算される場合には、投資した資金が回収困難になる可能性があります。また、こうした状況に陥ると予想される場合、当該リーートの価格が下落する可能性があります。

#### ○流動性リスク

流動性リスクとは、市場における売買量の欠如等の理由により、当ファンドにとって最適な時期で株式等の売買ができず機会損失を被るリスクをいいます。当ファンドでは、市場規模が小さい国を投資対象とする場合がありますが、そのような市場では流動性に欠ける場合があります。また価格変動性が高いことから、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

特にリートは、市場規模や取引量が少ないため、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ない等のリスクがあります。また、金融商品取引所等が定める基準に抵触し、上場廃止等になった場合は、売買取引が困難になる可能性があります。

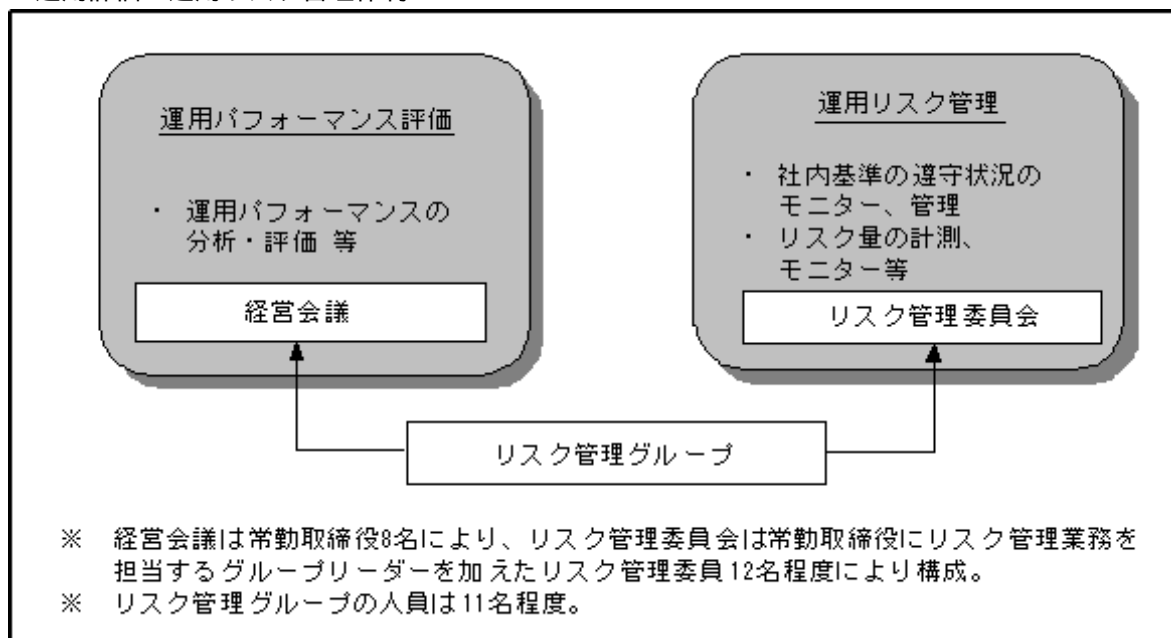
#### < 分配金に関する留意点 >

- 収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。））を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- 受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことで、受益者毎に異なります。
- 分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

## &lt;その他の留意点&gt;

- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- 当ファンドはファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。
- 資金動向、市況動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。
- 委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。
- 当ファンドは、信託財産の純資産総額が10億円を下回った場合、受益者のため有利と認める場合、その他やむを得ない事情が発生したときは、当初定められた信託期間の途中で信託を終了（繰上償還）する場合があります。
- 注意事項
  - ・当ファンドは、実質的に株式、債券、リートなど値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。
  - ・投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、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。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
  - ・投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
  - ・投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

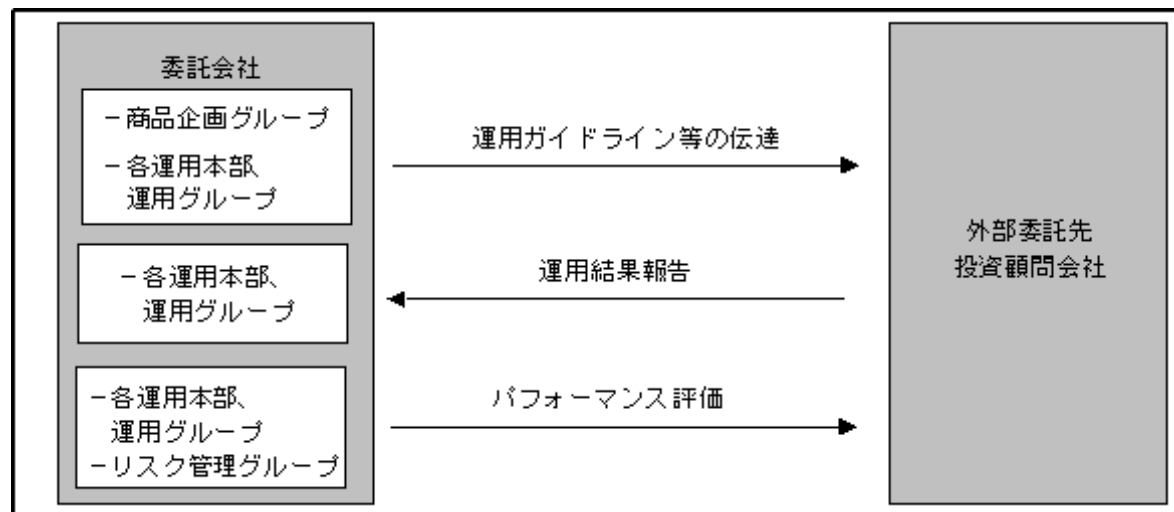
## &lt;運用評価・運用リスク管理体制&gt;



運用パフォーマンス評価は、運用部門から独立したリスク管理グループが月次で対象ファンドについて分析を行い、結果を「経営会議」に報告します。また、「経営会議」において運用パフォーマンス評価方法の協議も行い、適宜見直しを行います。

運用リスク管理は、リスク管理グループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行います。また運用リスク管理の結果については月次で「リスク管理委員会」に報告致します。

#### < 外部委託先に関する管理体制 >



マザーファンドの運用の外部委託先に対しては、投資一任契約に基づき、ファンドの運用目標、運用プロセス、投資対象などを伝達し、運用ガイドライン等の徹底を図ります。運用開始後は運用外部委託先と各運用本部、運用グループが連携し、運用を実施致します。運用内容については、リスク管理グループがパフォーマンス評価・分析等を行います。

上記体制は平成24年5月31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】

ありません。

### (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

### (3)【信託報酬等】

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以下の率を乗じて得た額とします。

| 時期 | 項目   | 費用 |                                            |
|----|------|----|--------------------------------------------|
| 毎日 | 信託報酬 | 総額 | 信託財産の純資産総額に対して年率0.9975% (税抜0.95%)          |
|    |      | 配分 | 委託会社 年率0.441% (税抜0.42%) ~ 0.546% (税抜0.52%) |
|    |      |    | 販売会社 年率0.378% (税抜0.36%) ~ 0.483% (税抜0.46%) |
|    |      |    | 受託会社 年率0.0735% (税抜0.07%)                   |

委託会社と販売会社の信託報酬の額は、各販売会社の取扱純資産額に応じ、下記の通り配分します。

| 各販売会社の取扱純資産額     | 委託会社                | 販売会社                |
|------------------|---------------------|---------------------|
| 100億円以下の部分       | 年率0.546% (税抜0.52%)  | 年率0.378% (税抜0.36%)  |
| 100億円超300億円以下の部分 | 年率0.4935% (税抜0.47%) | 年率0.4305% (税抜0.41%) |
| 300億円超の部分        | 年率0.441% (税抜0.42%)  | 年率0.483% (税抜0.46%)  |

信託報酬は日々の基準価額に反映され、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。また、信託報酬にかかる消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに信託財産中より支弁します。

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの投資顧問会社（DIAM International Ltd）が受ける報酬は、上記委託会社が受ける信託報酬の中から支弁するものとします。その報酬額は、当該マザーファンドの信託財産の純資産総額に以下の率を乗じて得た金額の合計に、当該マザーファンドの受益権総口数に占める信託財産に属する当該マザーファンドの受益権口数の割合を乗じて得た額とします。

| グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの純資産総額 | 投資顧問会社が受ける総報酬率 |
|----------------------------------|----------------|
| 25億円以下の部分                        | 年率0.20%        |
| 25億円超75億円以下の部分                   | 年率0.18%        |
| 75億円超の部分                         | 年率0.15%        |

当ファンドの投資顧問会社（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社）が受ける報酬は当ファンドまたはマザーファンドから直接的な支弁は行ないません。同社への投資顧問報酬は委託会社が受け取った上記の報酬の中から支弁するものとします。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

#### (4)【その他の手数料等】

##### 1. 信託財産留保額

解約時に、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.3%を乗じて得た額とします。

##### 2. その他の費用

当ファンドから支払われる費用には以下のものがあります。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

信託財産の財務諸表監査に要する費用は、計算期間を通じて毎日計算し、毎計算期末または信託終了のとき当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産中より支弁します。

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

実質的に投資対象とするリートには運用報酬等の費用がかかりますが、投資するリー트의銘柄は固定されていないため、事前に料率、上限額等を示すことはできません。

上記の「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。

#### (5)【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

##### ○個人の受益者に対する課税

##### 収益分配時

平成24年12月31日までの間は、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、原則として、10%（所得税7%および地方税3%）の税率で源泉徴収による申告不要制度が適用されます。なお、確定申告により、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。

上記10%の税率は平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間は、10.147%（所得税7.147%（復興特別所得税を含みます。）および地方税3%）となります。

また、上記10.147%の税率は平成26年1月1日からは、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）となる予定です。

なお、配当控除の適用はありません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

換金（解約）時および償還時

平成24年12月31日までの間は、換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、譲渡所得として、10%（所得税7%および地方税3%）の税率での申告分離課税が適用されます。また特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、10%の税率による源泉徴収が行われます。

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。

上記10%の税率は平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間は、10.147%（所得税7.147%（復興特別所得税を含みます。）および地方税3%）となります。

また、上記10.147%の税率は平成26年1月1日からは、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）となる予定です。

買取請求時の課税について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

換金（解約）時および償還時の差損（譲渡損失）については、一定の条件のもとで確定申告等により上場株式等の配当所得との通算が可能です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### ○法人の受益者に対する課税

平成24年12月31日までの間は、収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、7%（所得税7%）の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

上記7%の税率は平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間は、7.147%（所得税7.147%（復興特別所得税を含みます。））となります。

また、上記7.147%の税率は平成26年1月1日からは、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））となる予定です。

買取請求時の課税について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は、平成24年5月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容が変更になることがあります。税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

個別元本方式について

受益者毎の信託時の受益権の価額等を当該受益者の元本とする個別元本方式は次のとおりです。

#### <個別元本について>

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合については販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に個別元本の算出が行われる場合があります。

収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の<収益分配金の課税について>を参照。）

#### <収益分配金の課税について>

収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

収益分配の際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を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、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。なお、収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

平成24年5月31日現在

| 資産の種類               | 国名 | 時価合計（円）     | 投資比率(%) |
|---------------------|----|-------------|---------|
| 親投資信託受益証券           | 日本 | 664,650,605 | 98.98   |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） |    | 6,853,899   | 1.02    |
| 合 計（純資産総額）          |    | 671,504,504 | 100.00  |

（注）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の比率をいいます。

（参考）マザーファンドの投資状況

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成24年5月31日現在

| 資産の種類               | 国名 | 時価合計（円）         | 投資比率(%) |
|---------------------|----|-----------------|---------|
| 株式                  | 日本 | 239,867,990,588 | 97.11   |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） |    | 7,144,832,299   | 2.89    |
| 合 計（純資産総額）          |    | 247,012,822,887 | 100.00  |

（注）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の比率をいいます。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成24年5月31日現在

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計（円） | 投資比率(%) |
|-------|----|---------|---------|
|-------|----|---------|---------|

|                     |              |                 |        |
|---------------------|--------------|-----------------|--------|
| 株式                  | 米国           | 141,027,708,412 | 55.30  |
|                     | 英国           | 24,182,747,041  | 9.48   |
|                     | カナダ          | 13,512,738,670  | 5.30   |
|                     | スイス          | 10,805,362,044  | 4.24   |
|                     | スウェーデン       | 3,278,911,614   | 1.29   |
|                     | デンマーク        | 1,281,398,618   | 0.50   |
|                     | ノルウェー        | 792,305,750     | 0.31   |
|                     | アイルランド       | 1,702,783,367   | 0.67   |
|                     | オランダ         | 2,809,628,400   | 1.10   |
|                     | ベルギー         | 1,174,706,323   | 0.46   |
|                     | ルクセンブルク      | 474,856,502     | 0.19   |
|                     | フランス         | 9,249,780,580   | 3.63   |
|                     | ドイツ          | 8,926,007,507   | 3.50   |
|                     | ポルトガル        | 198,595,495     | 0.08   |
|                     | スペイン         | 2,677,158,269   | 1.05   |
|                     | イタリア         | 2,142,153,627   | 0.84   |
|                     | フィンランド       | 836,449,462     | 0.33   |
|                     | オーストリア       | 229,239,461     | 0.09   |
|                     | ギリシャ         | 74,916,403      | 0.03   |
|                     | 香港           | 3,019,483,095   | 1.18   |
|                     | 中国           | 13,430,707      | 0.01   |
|                     | シンガポール       | 2,049,794,085   | 0.80   |
|                     | イスラエル        | 678,261,013     | 0.27   |
|                     | オーストラリア      | 8,793,682,129   | 3.45   |
|                     | ニュージーランド     | 118,438,186     | 0.05   |
|                     | パナマ          | 175,016,307     | 0.07   |
|                     | バミューダ諸島      | 732,206,000     | 0.29   |
|                     | オランダ領キュラソー   | 1,053,583,391   | 0.41   |
|                     | ケイマン諸島       | 251,027,249     | 0.10   |
|                     | ガーンジー・チャネル諸島 | 44,031,798      | 0.02   |
|                     | ジャージー・チャネル諸島 | 754,312,987     | 0.30   |
|                     | マン島          | 81,450,009      | 0.03   |
|                     | リベリア         | 42,489,788      | 0.02   |
|                     | モーリシャス       | 33,182,260      | 0.01   |
|                     | 小計           | 243,217,836,548 | 95.38  |
| 投資信託受益証券            | シンガポール       | 68,232,544      | 0.03   |
|                     | オーストラリア      | 753,045,482     | 0.30   |
|                     | 小計           | 821,278,026     | 0.32   |
| 投資証券                | 米国           | 3,660,094,031   | 1.44   |
|                     | 英国           | 297,942,393     | 0.12   |
|                     | カナダ          | 110,034,236     | 0.04   |
|                     | オランダ         | 25,560,001      | 0.01   |
|                     | フランス         | 296,019,249     | 0.12   |
|                     | 香港           | 102,223,316     | 0.04   |
|                     | 小計           | 4,491,873,225   | 1.76   |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） |              | 6,472,520,372   | 2.54   |
| 合 計 （純資産総額）         |              | 255,003,508,172 | 100.00 |

(注) 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の比率をいいます。

#### 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成24年5月31日現在

| 資産の種類               | 国名 | 時価合計（円）         | 投資比率(%) |
|---------------------|----|-----------------|---------|
| 国債証券                | 日本 | 315,632,717,600 | 77.64   |
| 地方債証券               | 日本 | 27,443,233,358  | 6.75    |
| 特殊債券                | 日本 | 32,759,744,745  | 8.06    |
| 社債券                 | 日本 | 28,185,511,340  | 6.93    |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） |    | 2,523,671,795   | 0.62    |
| 合 計 （純資産総額）         |    | 406,544,878,838 | 100.00  |

(注) 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の比率をいいます。

#### 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成24年5月31日現在

| 資産の種類               | 国名      | 時価合計（円）         | 投資比率(%) |
|---------------------|---------|-----------------|---------|
| 国債証券                | 米国      | 151,225,236,150 | 42.40   |
|                     | 英国      | 28,409,149,763  | 7.97    |
|                     | カナダ     | 10,412,642,140  | 2.92    |
|                     | スウェーデン  | 2,129,937,888   | 0.60    |
|                     | デンマーク   | 3,148,507,593   | 0.88    |
|                     | ノルウェー   | 817,129,455     | 0.23    |
|                     | アイルランド  | 1,885,105,653   | 0.53    |
|                     | オランダ    | 9,413,833,389   | 2.64    |
|                     | ベルギー    | 8,835,603,284   | 2.48    |
|                     | フランス    | 33,645,282,015  | 9.43    |
|                     | ドイツ     | 32,092,837,598  | 9.00    |
|                     | スペイン    | 13,555,805,084  | 3.80    |
|                     | イタリア    | 29,854,751,692  | 8.37    |
|                     | フィンランド  | 2,292,588,617   | 0.64    |
|                     | ポーランド   | 2,345,017,914   | 0.66    |
|                     | オーストリア  | 6,202,233,497   | 1.74    |
|                     | シンガポール  | 1,508,113,767   | 0.42    |
|                     | マレーシア   | 1,745,867,729   | 0.49    |
|                     | オーストラリア | 5,383,468,148   | 1.51    |
|                     | メキシコ    | 3,025,842,383   | 0.85    |
|                     | 小計      | 347,928,953,756 | 97.56   |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） |         | 8,708,030,691   | 2.44    |
| 合 計 （純資産総額）         |         | 356,636,984,447 | 100.00  |

(注) 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の比率をいいます。

#### J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成24年5月31日現在

| 資産の種類               | 国名 | 時価合計（円）       | 投資比率(%) |
|---------------------|----|---------------|---------|
| 投資証券                | 日本 | 4,676,620,040 | 98.89   |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） |    | 52,473,091    | 1.11    |

|            |               |        |
|------------|---------------|--------|
| 合 計（純資産総額） | 4,729,093,131 | 100.00 |
|------------|---------------|--------|

（注）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の比率をいいます。

## グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成24年5月31日現在

| 資産の種類               | 国名       | 時価合計（円）       | 投資比率（%） |
|---------------------|----------|---------------|---------|
| 投資信託受益証券            | シンガポール   | 77,624,716    | 2.96    |
|                     | オーストラリア  | 287,324,462   | 10.97   |
|                     | 小計       | 364,949,178   | 13.94   |
| 投資証券                | 米国       | 1,707,343,950 | 65.21   |
|                     | 英国       | 147,768,923   | 5.64    |
|                     | カナダ      | 80,968,338    | 3.09    |
|                     | オランダ     | 38,454,199    | 1.47    |
|                     | ベルギー     | 19,898,457    | 0.76    |
|                     | フランス     | 120,079,157   | 4.59    |
|                     | 香港       | 49,386,236    | 1.89    |
|                     | シンガポール   | 3,486,912     | 0.13    |
|                     | ニュージーランド | 7,505,190     | 0.29    |
|                     | 小計       | 2,174,891,362 | 83.07   |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） |          | 78,305,942    | 2.99    |
| 合 計（純資産総額）          |          | 2,618,146,482 | 100.00  |

（注）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の比率をいいます。

## (2)【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

平成24年5月31日現在

| 順位 | 銘柄名                         | 種類        | 国名 | 口数          | 帳簿価額      |             | 評価額       |             | 投資比率（%） |
|----|-----------------------------|-----------|----|-------------|-----------|-------------|-----------|-------------|---------|
|    |                             |           |    |             | 単価（円）     | 金額（円）       | 単価（円）     | 金額（円）       |         |
| 1  | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 親投資信託受益証券 | 日本 | 188,713,594 | 11,525.00 | 217,492,419 | 11,557.00 | 218,096,300 | 32.48   |
| 2  | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 親投資信託受益証券 | 日本 | 133,312,601 | 11,914.00 | 158,828,635 | 11,572.00 | 154,269,341 | 22.97   |
| 3  | 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 親投資信託受益証券 | 日本 | 135,580,776 | 10,231.00 | 138,712,693 | 9,709.00  | 131,635,375 | 19.60   |
| 4  | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 親投資信託受益証券 | 日本 | 71,684,969  | 12,821.00 | 91,907,300  | 12,022.00 | 86,179,669  | 12.83   |
| 5  | J-REITインデックスファンド・マザーファンド    | 親投資信託受益証券 | 日本 | 53,184,341  | 7,811.00  | 41,542,289  | 7,770.00  | 41,324,232  | 6.15    |

|   |                                    |                   |    |            |          |            |          |            |      |
|---|------------------------------------|-------------------|----|------------|----------|------------|----------|------------|------|
| 6 | グローバルリート・パ<br>ッシブ・ファンド・マ<br>ザーファンド | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 日本 | 41,919,424 | 8,426.00 | 35,321,308 | 7,907.00 | 33,145,688 | 4.94 |
|---|------------------------------------|-------------------|----|------------|----------|------------|----------|------------|------|

(注1)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の比率をいいます。

(注2)簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3)投資有価証券は6銘柄のみです。

#### 種類別業種別投資比率

平成24年5月31日現在

| 種類        | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 98.98   |
| 合計        | 98.98   |

(注)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の比率をいいます。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## （参考）マザーファンドの投資資産

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

## 投資有価証券の主要銘柄

平成24年5月31日現在

| 順位 | 銘柄名                   | 種類 | 国名 | 業種         | 株数又は<br>券面総額 | 帳簿価額       |               | 評価額        |               | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|-----------------------|----|----|------------|--------------|------------|---------------|------------|---------------|-----------------|
|    |                       |    |    |            |              | 単価<br>(円)  | 金額<br>(円)     | 単価<br>(円)  | 金額<br>(円)     |                 |
| 1  | トヨタ自動車                | 株式 | 日本 | 輸送用<br>機器  | 3,165,600    | 2,998.86   | 9,493,196,500 | 3,040.00   | 9,623,424,000 | 3.90            |
| 2  | 三菱UFJフ<br>ィナンシャル<br>G | 株式 | 日本 | 銀行業        | 18,238,900   | 378.45     | 6,902,601,800 | 340.00     | 6,201,226,000 | 2.51            |
| 3  | 本田技研                  | 株式 | 日本 | 輸送用<br>機器  | 2,059,500    | 2,758.37   | 5,680,858,400 | 2,512.00   | 5,173,464,000 | 2.09            |
| 4  | キヤノン                  | 株式 | 日本 | 電気機<br>器   | 1,516,400    | 3,399.37   | 5,154,804,500 | 3,150.00   | 4,776,660,000 | 1.93            |
| 5  | 三井住友フィ<br>ナンシャルG      | 株式 | 日本 | 銀行業        | 1,829,300    | 2,533.56   | 4,634,646,298 | 2,289.00   | 4,187,267,700 | 1.70            |
| 6  | 日本電信電話                | 株式 | 日本 | 情報・<br>通信業 | 1,109,500    | 3,763.43   | 4,175,527,000 | 3,380.00   | 3,750,110,000 | 1.52            |
| 7  | みずほフィナ<br>ンシャルG       | 株式 | 日本 | 銀行業        | 30,988,900   | 120.94     | 3,747,804,600 | 115.00     | 3,563,723,500 | 1.44            |
| 8  | ファナック                 | 株式 | 日本 | 電気機<br>器   | 254,200      | 13,020.95  | 3,309,925,000 | 13,520.00  | 3,436,784,000 | 1.39            |
| 9  | 武田薬品                  | 株式 | 日本 | 医薬品        | 957,700      | 3,343.42   | 3,201,990,500 | 3,275.00   | 3,136,467,500 | 1.27            |
| 10 | 三菱商事                  | 株式 | 日本 | 卸売業        | 1,754,700    | 1,782.24   | 3,127,295,000 | 1,535.00   | 2,693,464,500 | 1.09            |
| 11 | ソフトバンク                | 株式 | 日本 | 情報・<br>通信業 | 1,091,500    | 2,176.59   | 2,375,749,900 | 2,450.00   | 2,674,175,000 | 1.08            |
| 12 | 日本たばこ産<br>業           | 株式 | 日本 | 食料品        | 6,064        | 409,587.15 | 2,483,736,500 | 437,000.00 | 2,649,968,000 | 1.07            |
| 13 | 日 立                   | 株式 | 日本 | 電気機<br>器   | 5,624,000    | 433.71     | 2,439,188,000 | 449.00     | 2,525,176,000 | 1.02            |
| 14 | エヌ・ティ・<br>ティ・ドコモ      | 株式 | 日本 | 情報・<br>通信業 | 19,852       | 136,713.44 | 2,714,035,200 | 125,100.00 | 2,483,485,200 | 1.01            |
| 15 | セブン&アイ<br>・H L D G S  | 株式 | 日本 | 小売業        | 1,007,800    | 2,185.14   | 2,202,184,800 | 2,359.00   | 2,377,400,200 | 0.96            |
| 16 | 日産自動車                 | 株式 | 日本 | 輸送用<br>機器  | 3,105,600    | 758.45     | 2,355,441,035 | 758.00     | 2,354,044,800 | 0.95            |
| 17 | 三井物産                  | 株式 | 日本 | 卸売業        | 2,079,800    | 1,310.44   | 2,725,455,400 | 1,104.00   | 2,296,099,200 | 0.93            |
| 18 | 小松製作所                 | 株式 | 日本 | 機械         | 1,192,300    | 2,189.91   | 2,611,033,900 | 1,878.00   | 2,239,139,400 | 0.91            |
| 19 | 三菱地所                  | 株式 | 日本 | 不動産<br>業   | 1,686,000    | 1,269.89   | 2,141,027,000 | 1,219.00   | 2,055,234,000 | 0.83            |
| 20 | 東日本旅客鉄<br>道           | 株式 | 日本 | 陸運業        | 424,500      | 4,906.02   | 2,082,606,500 | 4,665.00   | 1,980,292,500 | 0.80            |
| 21 | 信越化学                  | 株式 | 日本 | 化学         | 458,500      | 4,157.36   | 1,906,147,500 | 4,030.00   | 1,847,755,000 | 0.75            |

|    |          |    |    |        |           |            |               |            |               |      |
|----|----------|----|----|--------|-----------|------------|---------------|------------|---------------|------|
| 22 | K D D I  | 株式 | 日本 | 情報・通信業 | 3,739     | 481,379.11 | 1,799,876,500 | 484,500.00 | 1,811,545,500 | 0.73 |
| 23 | アステラス製薬  | 株式 | 日本 | 医薬品    | 567,600   | 3,203.83   | 1,818,493,500 | 3,080.00   | 1,748,208,000 | 0.71 |
| 24 | 伊 藤 忠    | 株式 | 日本 | 卸売業    | 1,922,300 | 885.34     | 1,701,885,700 | 859.00     | 1,651,255,700 | 0.67 |
| 25 | ソ ニ ー    | 株式 | 日本 | 電気機器   | 1,522,900 | 1,485.85   | 2,262,799,000 | 1,050.00   | 1,599,045,000 | 0.65 |
| 26 | 東京海上HD   | 株式 | 日本 | 保険業    | 914,600   | 2,002.03   | 1,831,053,800 | 1,707.00   | 1,561,222,200 | 0.63 |
| 27 | 東 芝      | 株式 | 日本 | 電気機器   | 5,139,000 | 318.20     | 1,635,207,000 | 295.00     | 1,516,005,000 | 0.61 |
| 28 | 国際石油開発帝石 | 株式 | 日本 | 鉱業     | 3,325     | 503,886.92 | 1,675,424,000 | 453,000.00 | 1,506,225,000 | 0.61 |
| 29 | 三菱電機     | 株式 | 日本 | 電気機器   | 2,441,000 | 669.64     | 1,634,590,000 | 617.00     | 1,506,097,000 | 0.61 |
| 30 | 住友商事     | 株式 | 日本 | 卸売業    | 1,422,200 | 1,148.10   | 1,632,821,900 | 1,053.00   | 1,497,576,600 | 0.61 |

(注)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の比率をいいます。

#### 種類別業種別投資比率

平成24年5月31日現在

| 種類 | 業種         | 投資比率（％） |
|----|------------|---------|
| 株式 | 電気機器       | 12.74   |
|    | 輸送用機器      | 10.38   |
|    | 銀行業        | 9.10    |
|    | 情報・通信業     | 6.30    |
|    | 化学         | 5.71    |
|    | 卸売業        | 5.50    |
|    | 医薬品        | 4.94    |
|    | 機械         | 4.91    |
|    | 小売業        | 4.41    |
|    | 陸運業        | 4.05    |
|    | 食料品        | 3.85    |
|    | 電気・ガス業     | 2.93    |
|    | 不動産業       | 2.39    |
|    | 建設業        | 2.33    |
|    | 保険業        | 2.06    |
|    | サービス業      | 1.93    |
|    | 鉄鋼         | 1.67    |
|    | その他製品      | 1.44    |
|    | 精密機器       | 1.42    |
|    | 非鉄金属       | 1.10    |
|    | 証券、商品先物取引業 | 0.99    |
|    | ガラス・土石製品   | 0.99    |
|    | 繊維製品       | 0.91    |
|    | その他金融業     | 0.80    |
|    | 石油・石炭製品    | 0.78    |
|    | ゴム製品       | 0.77    |
|    | 鉱業         | 0.69    |
|    | 金属製品       | 0.67    |

|    |          |       |
|----|----------|-------|
|    | 海運業      | 0.39  |
|    | パルプ・紙    | 0.33  |
|    | 空運業      | 0.28  |
|    | 倉庫・運輸関連業 | 0.23  |
|    | 水産・農林業   | 0.10  |
| 合計 |          | 97.11 |

(注)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の比率をいいます。

#### 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。

#### 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

#### 投資有価証券の主要銘柄

平成24年5月31日現在

| 順位 | 銘柄名                            | 種類 | 国名  | 業種                      | 株数又は<br>券面総額 | 帳簿価額      |               | 評価額       |               | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|--------------------------------|----|-----|-------------------------|--------------|-----------|---------------|-----------|---------------|-----------------|
|    |                                |    |     |                         |              | 単価<br>(円) | 金額<br>(円)     | 単価<br>(円) | 金額<br>(円)     |                 |
| 1  | APPLE INC                      | 株式 | 米国  | コンピ<br>ュータ<br>・周辺<br>機器 | 143,996      | 40,410.34 | 5,818,927,820 | 45,708.10 | 6,581,783,049 | 2.58            |
| 2  | EXXON MOBIL CO<br>RP           | 株式 | 米国  | 石油・<br>ガス・<br>消耗燃<br>料  | 742,822      | 6,673.48  | 4,957,206,824 | 6,297.03  | 4,677,570,042 | 1.83            |
| 3  | INTL BUSINESS<br>MACHINES CORP | 株式 | 米国  | 情報技<br>術サー<br>ビス        | 184,373      | 15,186.35 | 2,799,953,230 | 15,352.31 | 2,830,551,009 | 1.11            |
| 4  | MICROSOFT CORP                 | 株式 | 米国  | ソフト<br>ウェア              | 1,167,185    | 2,385.36  | 2,784,151,200 | 2,315.51  | 2,702,631,807 | 1.06            |
| 5  | GENERAL ELECTR<br>IC CO        | 株式 | 米国  | コング<br>ロマリ<br>ット        | 1,638,299    | 1,496.13  | 2,451,107,899 | 1,502.64  | 2,461,768,367 | 0.97            |
| 6  | AT&T INC                       | 株式 | 米国  | 各種電<br>気通信<br>サービ<br>ス  | 915,231      | 2,383.46  | 2,181,417,241 | 2,670.65  | 2,444,264,233 | 0.96            |
| 7  | CHEVRON CORP                   | 株式 | 米国  | 石油・<br>ガス・<br>消耗燃<br>料  | 305,279      | 8,389.38  | 2,561,100,819 | 7,704.96  | 2,352,162,362 | 0.92            |
| 8  | NESTLE SA-REGI<br>STERED       | 株式 | スイス | 食品                      | 510,199      | 4,412.12  | 2,251,060,564 | 4,502.91  | 2,297,381,199 | 0.90            |
| 9  | PFIZER INC                     | 株式 | 米国  | 医薬品                     | 1,204,427    | 1,686.67  | 2,031,468,005 | 1,739.40  | 2,094,976,470 | 0.82            |

|    |                             |    |     |                    |           |           |               |           |               |      |
|----|-----------------------------|----|-----|--------------------|-----------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 10 | PROCTER & GAMBLE CO         | 株式 | 米国  | 家庭用品               | 425,838   | 5,084.33  | 2,165,100,882 | 4,918.29  | 2,094,396,651 | 0.82 |
| 11 | JOHNSON & JOHNSON           | 株式 | 米国  | 医薬品                | 424,457   | 5,092.40  | 2,161,505,322 | 4,909.61  | 2,083,919,690 | 0.82 |
| 12 | WELLS FARGO & CO            | 株式 | 米国  | 商業銀行               | 774,452   | 2,406.49  | 1,863,709,920 | 2,501.76  | 1,937,496,133 | 0.76 |
| 13 | COCA-COLA CO/THE            | 株式 | 米国  | 飲料                 | 315,069   | 5,457.24  | 1,719,406,123 | 5,923.74  | 1,866,385,326 | 0.73 |
| 14 | GOOGLE INC                  | 株式 | 米国  | インターネットソフトウェア・サービス | 39,898    | 48,063.22 | 1,917,626,489 | 46,423.11 | 1,852,189,307 | 0.73 |
| 15 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 株式 | 米国  | タバコ                | 266,029   | 6,454.02  | 1,716,957,564 | 6,698.73  | 1,782,056,337 | 0.70 |
| 16 | HSBC HOLDINGS PLC           | 株式 | 英国  | 商業銀行               | 2,787,867 | 683.00    | 1,904,125,467 | 614.82    | 1,714,047,122 | 0.67 |
| 17 | VODAFONE GROUP PLC          | 株式 | 英国  | 無線通信サービス           | 7,701,822 | 212.33    | 1,635,320,234 | 209.79    | 1,615,726,574 | 0.63 |
| 18 | INTEL CORP                  | 株式 | 米国  | 半導体・半導体製造装置        | 773,812   | 2,112.10  | 1,634,371,032 | 2,062.18  | 1,595,739,321 | 0.63 |
| 19 | JPMORGAN CHASE & CO         | 株式 | 米国  | 各種金融サービス           | 589,197   | 2,977.65  | 1,754,425,104 | 2,601.20  | 1,532,621,122 | 0.60 |
| 20 | WAL-MART STORES INC         | 株式 | 米国  | 食品・生活必需品小売り        | 291,019   | 4,917.08  | 1,430,964,252 | 5,164.52  | 1,502,974,843 | 0.59 |
| 21 | NOVARTIS AG-REG SHS         | 株式 | スイス | 医薬品                | 356,187   | 4,206.46  | 1,498,285,445 | 4,108.70  | 1,463,466,952 | 0.57 |
| 22 | VERIZON COMM INC            | 株式 | 米国  | 各種電気通信サービス         | 437,899   | 3,012.04  | 1,318,969,681 | 3,268.87  | 1,431,433,328 | 0.56 |
| 23 | BP PLC                      | 株式 | 英国  | 石油・ガス・消耗燃料         | 2,933,812 | 599.99    | 1,760,254,619 | 486.36    | 1,426,900,920 | 0.56 |
| 24 | MERCK & CO. INC.            | 株式 | 米国  | 医薬品                | 470,825   | 3,013.76  | 1,418,952,040 | 2,951.61  | 1,389,690,837 | 0.54 |
| 25 | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 株式 | 英国  | 石油・ガス・消耗燃料         | 566,184   | 2,838.18  | 1,606,931,724 | 2,428.16  | 1,374,783,841 | 0.54 |
| 26 | GLAXOSMITHKLINE PLC         | 株式 | 英国  | 医薬品                | 782,161   | 1,757.93  | 1,374,986,939 | 1,720.53  | 1,345,731,387 | 0.53 |

|    |                                 |    |                 |            |         |           |               |           |               |      |
|----|---------------------------------|----|-----------------|------------|---------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 27 | ROCHE HOLDING<br>AG-GENUSSCHEIN | 株式 | スイス             | 医薬品        | 108,767 | 13,149.79 | 1,430,263,693 | 12,362.69 | 1,344,652,486 | 0.53 |
| 28 | PEPSICO INC                     | 株式 | 米国              | 飲料         | 243,386 | 5,036.07  | 1,225,709,610 | 5,383.92  | 1,310,371,337 | 0.51 |
| 29 | ORACLE CORP                     | 株式 | 米国              | ソフト<br>ウェア | 623,345 | 2,222.80  | 1,385,568,677 | 2,065.34  | 1,287,417,118 | 0.50 |
| 30 | BHP BILLITON L<br>TD            | 株式 | オース<br>トラリ<br>ア | 金属・<br>鉱業  | 498,129 | 2,752.84  | 1,371,271,233 | 2,462.29  | 1,226,538,952 | 0.48 |

(注)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の比率をいいます。

## 種類別業種別投資比率

平成24年5月31日現在

| 種類 | 業種                       | 投資比率（％） |
|----|--------------------------|---------|
| 株式 | 石油・ガス・消耗燃料               | 9.76    |
|    | 商業銀行                     | 6.83    |
|    | 医薬品                      | 6.65    |
|    | 保険                       | 3.83    |
|    | コンピュータ・周辺機器              | 3.30    |
|    | 金属・鉱業                    | 3.24    |
|    | 各種電気通信サービス               | 3.08    |
|    | 食品                       | 2.89    |
|    | 化学                       | 2.81    |
|    | メディア                     | 2.60    |
|    | ソフトウェア                   | 2.52    |
|    | 飲料                       | 2.47    |
|    | 情報技術サービス                 | 2.42    |
|    | 食品・生活必需品小売り              | 2.32    |
|    | コングロマリット                 | 2.16    |
|    | 各種金融サービス                 | 2.01    |
|    | 電力                       | 1.86    |
|    | タバコ                      | 1.81    |
|    | 機械                       | 1.78    |
|    | 航空宇宙・防衛                  | 1.78    |
|    | ホテル・レストラン・レジャー           | 1.72    |
|    | 資本市場                     | 1.70    |
|    | 半導体・半導体製造装置              | 1.62    |
|    | 家庭用品                     | 1.56    |
|    | 専門小売り                    | 1.55    |
|    | エネルギー設備・サービス             | 1.48    |
|    | 総合公益事業                   | 1.39    |
|    | ヘルスケア・プロバイダー /ヘルスケア・サービス | 1.38    |
|    | ヘルスケア機器・用品               | 1.30    |
|    | 通信機器                     | 1.27    |
|    | インターネットソフトウェア・サービス       | 1.11    |
|    | 繊維・アパレル・贅沢品              | 1.02    |
|    | バイオテクノロジー                | 0.99    |
|    | 無線通信サービス                 | 0.89    |
|    | 自動車                      | 0.89    |

|                    |       |
|--------------------|-------|
| 陸運・鉄道              | 0.87  |
| 電気設備               | 0.74  |
| 複合小売り              | 0.67  |
| 不動産管理・開発           | 0.61  |
| インターネット販売・カタログ販売   | 0.59  |
| 航空貨物・物流サービス        | 0.57  |
| 消費者金融              | 0.52  |
| 商業サービス・用品          | 0.42  |
| 専門サービス             | 0.40  |
| 自動車部品              | 0.38  |
| 建設・土木              | 0.36  |
| 電子装置・機器・部品         | 0.31  |
| ライフサイエンス・ツール/サービス  | 0.29  |
| 建設資材               | 0.28  |
| パーソナル用品            | 0.26  |
| 商社・流通業             | 0.25  |
| 家庭用耐久財             | 0.18  |
| 建設関連製品             | 0.17  |
| 紙製品・林産品            | 0.17  |
| ガス                 | 0.17  |
| 運送インフラ             | 0.16  |
| 容器・包装              | 0.16  |
| 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | 0.15  |
| 販売                 | 0.12  |
| 旅客航空輸送業            | 0.10  |
| 水道                 | 0.09  |
| 海運業                | 0.09  |
| レジャー用品             | 0.07  |
| 貯蓄・抵当・不動産金融        | 0.06  |
| ヘルスケア・テクノロジー       | 0.06  |
| 事務用電子機器            | 0.06  |
| 各種消費者サービス          | 0.04  |
| 株式 計               | 95.38 |
| 投資信託受益証券           | 0.32  |
| 投資証券               | 1.76  |
| 合計                 | 97.46 |

(注) 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の比率をいいます。

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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成24年5月31日現在

| 順位 | 銘柄名                             | 種類       | 国名 | 株数又は<br>券面総額  | 帳簿価額      |               | 評価額       |               | 利率<br>(%) | 償還<br>期限       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|---------------------------------|----------|----|---------------|-----------|---------------|-----------|---------------|-----------|----------------|-----------------|
|    |                                 |          |    |               | 単価<br>(円) | 金額<br>(円)     | 単価<br>(円) | 金額<br>(円)     |           |                |                 |
| 1  | 3 1 3 回 利<br>付国庫債券<br>( 1 0 年 ) | 国債<br>証券 | 日本 | 5,500,000,000 | 103.75    | 5,706,305,000 | 105.10    | 5,780,445,000 | 1.30      | 2021/<br>3/20  | 1.42            |
| 2  | 8 1 回 利付<br>国庫債券 ( 5<br>年 )     | 国債<br>証券 | 日本 | 5,700,000,000 | 101.41    | 5,780,610,000 | 101.25    | 5,771,364,000 | 0.80      | 2014/<br>3/20  | 1.42            |
| 3  | 2 8 5 回 利<br>付国庫債券<br>( 1 0 年 ) | 国債<br>証券 | 日本 | 5,000,000,000 | 106.82    | 5,341,150,000 | 107.09    | 5,354,700,000 | 1.70      | 2017/<br>3/20  | 1.32            |
| 4  | 7 5 回 利付<br>国庫債券 ( 5<br>年 )     | 国債<br>証券 | 日本 | 4,600,000,000 | 101.56    | 4,671,852,000 | 101.29    | 4,659,524,000 | 1.10      | 2013/<br>9/20  | 1.15            |
| 5  | 3 1 0 回 利<br>付国庫債券<br>( 1 0 年 ) | 国債<br>証券 | 日本 | 4,500,000,000 | 101.69    | 4,576,005,000 | 103.00    | 4,634,910,000 | 1.00      | 2020/<br>9/20  | 1.14            |
| 6  | 3 1 7 回 利<br>付国庫債券<br>( 1 0 年 ) | 国債<br>証券 | 日本 | 4,500,000,000 | 101.50    | 4,567,320,000 | 103.00    | 4,634,820,000 | 1.10      | 2021/<br>9/20  | 1.14            |
| 7  | 2 9 3 回 利<br>付国庫債券<br>( 1 0 年 ) | 国債<br>証券 | 日本 | 4,200,000,000 | 108.22    | 4,545,114,000 | 108.71    | 4,565,820,000 | 1.80      | 2018/<br>6/20  | 1.12            |
| 8  | 3 0 5 回 利<br>付国庫債券<br>( 1 0 年 ) | 国債<br>証券 | 日本 | 4,300,000,000 | 104.73    | 4,503,390,000 | 105.78    | 4,548,454,000 | 1.30      | 2019/<br>12/20 | 1.12            |
| 9  | 9 7 回 利付<br>国庫債券 ( 5<br>年 )     | 国債<br>証券 | 日本 | 4,500,000,000 | 100.49    | 4,522,140,000 | 101.00    | 4,545,180,000 | 0.40      | 2016/<br>6/20  | 1.12            |
| 10 | 2 8 6 回 利<br>付国庫債券<br>( 1 0 年 ) | 国債<br>証券 | 日本 | 4,100,000,000 | 107.55    | 4,409,618,000 | 107.85    | 4,422,014,000 | 1.80      | 2017/<br>6/20  | 1.09            |
| 11 | 3 1 2 回 利<br>付国庫債券<br>( 1 0 年 ) | 国債<br>証券 | 日本 | 4,200,000,000 | 103.13    | 4,331,502,000 | 104.45    | 4,386,984,000 | 1.20      | 2020/<br>12/20 | 1.08            |
| 12 | 2 9 6 回 利<br>付国庫債券<br>( 1 0 年 ) | 国債<br>証券 | 日本 | 4,000,000,000 | 106.38    | 4,255,120,000 | 107.02    | 4,280,720,000 | 1.50      | 2018/<br>9/20  | 1.05            |
| 13 | 3 0 6 回 利<br>付国庫債券<br>( 1 0 年 ) | 国債<br>証券 | 日本 | 4,000,000,000 | 105.36    | 4,214,240,000 | 106.47    | 4,258,800,000 | 1.40      | 2020/<br>3/20  | 1.05            |
| 14 | 3 1 5 回 利<br>付国庫債券<br>( 1 0 年 ) | 国債<br>証券 | 日本 | 4,000,000,000 | 102.62    | 4,104,960,000 | 104.03    | 4,161,240,000 | 1.20      | 2021/<br>6/20  | 1.02            |
| 15 | 3 2 1 回 利<br>付国庫債券<br>( 1 0 年 ) | 国債<br>証券 | 日本 | 4,000,000,000 | 101.45    | 4,057,835,000 | 101.63    | 4,065,240,000 | 1.00      | 2022/<br>3/20  | 1.00            |

|    |                             |          |    |               |        |               |        |               |      |                |      |
|----|-----------------------------|----------|----|---------------|--------|---------------|--------|---------------|------|----------------|------|
| 16 | 9 3 回 利付<br>国庫債券（5<br>年）    | 国債<br>証券 | 日本 | 4,000,000,000 | 100.97 | 4,038,670,000 | 101.38 | 4,055,080,000 | 0.50 | 2015/<br>12/20 | 1.00 |
| 17 | 8 8 回 利付<br>国庫債券（5<br>年）    | 国債<br>証券 | 日本 | 4,000,000,000 | 101.00 | 4,040,095,000 | 101.11 | 4,044,520,000 | 0.50 | 2015/<br>3/20  | 0.99 |
| 18 | 9 9 回 利付<br>国庫債券（5<br>年）    | 国債<br>証券 | 日本 | 4,000,000,000 | 100.41 | 4,016,280,000 | 100.98 | 4,039,200,000 | 0.40 | 2016/<br>9/20  | 0.99 |
| 19 | 9 2 回 利付<br>国庫債券（5<br>年）    | 国債<br>証券 | 日本 | 4,000,000,000 | 100.30 | 4,011,980,000 | 100.64 | 4,025,600,000 | 0.30 | 2015/<br>9/20  | 0.99 |
| 20 | 1 0 2 回 利<br>付国庫債券<br>（5年）  | 国債<br>証券 | 日本 | 4,000,000,000 | 100.02 | 4,000,840,000 | 100.50 | 4,019,800,000 | 0.30 | 2016/<br>12/20 | 0.99 |
| 21 | 2 8 8 回 利<br>付国庫債券<br>（10年） | 国債<br>証券 | 日本 | 3,600,000,000 | 107.19 | 3,858,984,000 | 107.58 | 3,872,808,000 | 1.70 | 2017/<br>9/20  | 0.95 |
| 22 | 8 7 回 利付<br>国庫債券（5<br>年）    | 国債<br>証券 | 日本 | 3,800,000,000 | 100.95 | 3,835,948,000 | 101.02 | 3,838,570,000 | 0.50 | 2014/<br>12/20 | 0.94 |
| 23 | 8 9 回 利付<br>国庫債券（5<br>年）    | 国債<br>証券 | 日本 | 3,800,000,000 | 100.64 | 3,824,470,000 | 100.91 | 3,834,580,000 | 0.40 | 2015/<br>6/20  | 0.94 |
| 24 | 2 8 9 回 利<br>付国庫債券<br>（10年） | 国債<br>証券 | 日本 | 3,400,000,000 | 106.18 | 3,610,256,000 | 106.69 | 3,627,460,000 | 1.50 | 2017/<br>12/20 | 0.89 |
| 25 | 2 8 2 回 利<br>付国庫債券<br>（10年） | 国債<br>証券 | 日本 | 3,400,000,000 | 106.34 | 3,615,458,000 | 106.55 | 3,622,598,000 | 1.70 | 2016/<br>9/20  | 0.89 |
| 26 | 2 9 9 回 利<br>付国庫債券<br>（10年） | 国債<br>証券 | 日本 | 3,400,000,000 | 105.05 | 3,571,718,000 | 105.78 | 3,596,384,000 | 1.30 | 2019/<br>3/20  | 0.88 |
| 27 | 8 5 回 利付<br>国庫債券（5<br>年）    | 国債<br>証券 | 日本 | 3,500,000,000 | 101.43 | 3,550,085,000 | 101.37 | 3,548,090,000 | 0.70 | 2014/<br>9/20  | 0.87 |
| 28 | 7 8 回 利付<br>国庫債券（5<br>年）    | 国債<br>証券 | 日本 | 3,500,000,000 | 101.44 | 3,550,400,000 | 101.23 | 3,543,190,000 | 0.90 | 2013/<br>12/20 | 0.87 |
| 29 | 1 0 3 回 利<br>付国庫債券<br>（5年）  | 国債<br>証券 | 日本 | 3,500,000,000 | 100.36 | 3,512,535,000 | 100.43 | 3,514,910,000 | 0.30 | 2017/<br>3/20  | 0.86 |
| 30 | 2 9 7 回 利<br>付国庫債券<br>（10年） | 国債<br>証券 | 日本 | 3,200,000,000 | 105.71 | 3,382,592,000 | 106.41 | 3,405,184,000 | 1.40 | 2018/<br>12/20 | 0.84 |

(注)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の比率をいいます。

種類別業種別投資比率

平成24年5月31日現在

| 種類    | 投資比率（％） |
|-------|---------|
| 国債証券  | 77.64   |
| 地方債証券 | 6.75    |
| 特殊債券  | 8.06    |
| 社債券   | 6.93    |
| 合計    | 99.38   |

(注)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の比率をいいます。

#### 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。

#### 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

#### 投資有価証券の主要銘柄

平成24年5月31日現在

| 順位 | 銘柄名                           | 種類       | 国名 | 株数又は<br>券面総額  | 帳簿価額      |               | 評価額       |               | 利率<br>(%) | 償還<br>期限       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|-------------------------------|----------|----|---------------|-----------|---------------|-----------|---------------|-----------|----------------|-----------------|
|    |                               |          |    |               | 単価<br>(円) | 金額<br>(円)     | 単価<br>(円) | 金額<br>(円)     |           |                |                 |
| 1  | US T N/B 4.0<br>02/15/14      | 国債<br>証券 | 米国 | 3,156,800,000 | 107.34    | 3,388,351,280 | 106.35    | 3,357,162,096 | 4.00      | 2014/<br>2/15  | 0.94            |
| 2  | US T N/B 4.25<br>11/15/13     | 国債<br>証券 | 米国 | 3,156,800,000 | 106.84    | 3,372,567,280 | 105.82    | 3,340,399,488 | 4.25      | 2013/<br>11/15 | 0.94            |
| 3  | US T N/B 1.0<br>07/15/13      | 国債<br>証券 | 米国 | 3,156,800,000 | 101.04    | 3,189,693,856 | 100.86    | 3,184,043,184 | 1.00      | 2013/<br>7/15  | 0.89            |
| 4  | US T N/B 4.75<br>05/15/14     | 国債<br>証券 | 米国 | 2,762,200,000 | 109.84    | 3,033,862,370 | 108.70    | 3,002,483,778 | 4.75      | 2014/<br>5/15  | 0.84            |
| 5  | US T N/B 4.25<br>08/15/13     | 国債<br>証券 | 米国 | 2,762,200,000 | 105.88    | 2,924,672,604 | 104.84    | 2,895,862,858 | 4.25      | 2013/<br>8/15  | 0.81            |
| 6  | US T N/B<br>0.125<br>08/31/13 | 国債<br>証券 | 米国 | 2,762,200,000 | 99.79     | 2,756,371,758 | 99.89     | 2,759,051,092 | 0.13      | 2013/<br>8/31  | 0.77            |
| 7  | US T N/B 3.5<br>05/31/13      | 国債<br>証券 | 米国 | 2,525,440,000 | 104.25    | 2,632,846,963 | 103.28    | 2,608,198,669 | 3.50      | 2013/<br>5/31  | 0.73            |
| 8  | US T N/B 4.25<br>11/15/14     | 国債<br>証券 | 米国 | 2,367,600,000 | 110.55    | 2,617,287,096 | 109.56    | 2,593,895,208 | 4.25      | 2014/<br>11/15 | 0.73            |
| 9  | US T N/B<br>2.625<br>06/30/14 | 国債<br>証券 | 米国 | 2,367,600,000 | 105.34    | 2,494,006,164 | 104.89    | 2,483,280,936 | 2.63      | 2014/<br>6/30  | 0.70            |
| 10 | US T N/B 4.25<br>08/15/14     | 国債<br>証券 | 米国 | 2,209,760,000 | 109.66    | 2,423,134,426 | 108.65    | 2,400,948,435 | 4.25      | 2014/<br>8/15  | 0.67            |
| 11 | US T N/B 0.5<br>10/15/13      | 国債<br>証券 | 米国 | 2,367,600,000 | 100.37    | 2,376,289,092 | 100.34    | 2,375,626,164 | 0.50      | 2013/<br>10/15 | 0.67            |
| 12 | US T N/B<br>2.375<br>09/30/14 | 国債<br>証券 | 米国 | 2,209,760,000 | 105.16    | 2,323,695,226 | 104.80    | 2,315,740,090 | 2.38      | 2014/<br>9/30  | 0.65            |

|    |                                 |          |      |               |        |               |        |               |      |                |      |
|----|---------------------------------|----------|------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|------|----------------|------|
| 13 | US T N/B 3.25<br>06/30/16       | 国債<br>証券 | 米国   | 1,973,000,000 | 110.76 | 2,185,235,610 | 110.80 | 2,186,005,080 | 3.25 | 2016/<br>6/30  | 0.61 |
| 14 | DEUTSCHLAND<br>4.25<br>01/04/14 | 国債<br>証券 | ドイツ  | 1,952,400,000 | 107.46 | 2,097,951,420 | 106.77 | 2,084,577,480 | 4.25 | 2014/<br>1/4   | 0.58 |
| 15 | US T N/B 2.25<br>01/31/15       | 国債<br>証券 | 米国   | 1,973,000,000 | 105.23 | 2,076,128,710 | 105.01 | 2,071,867,030 | 2.25 | 2015/<br>1/31  | 0.58 |
| 16 | US T N/B<br>2.125<br>11/30/14   | 国債<br>証券 | 米国   | 1,973,000,000 | 104.72 | 2,066,086,140 | 104.44 | 2,060,620,930 | 2.13 | 2014/<br>11/30 | 0.58 |
| 17 | US T N/B<br>4.625<br>02/15/17   | 国債<br>証券 | 米国   | 1,736,240,000 | 118.23 | 2,052,754,974 | 118.33 | 2,054,458,067 | 4.63 | 2017/<br>2/15  | 0.58 |
| 18 | US T N/B 1.75<br>03/31/14       | 国債<br>証券 | 米国   | 1,973,000,000 | 103.04 | 2,032,880,550 | 102.70 | 2,026,172,350 | 1.75 | 2014/<br>3/31  | 0.57 |
| 19 | US T N/B 0.75<br>12/15/13       | 国債<br>証券 | 米国   | 1,973,000,000 | 100.83 | 1,989,336,440 | 100.75 | 1,987,856,690 | 0.75 | 2013/<br>12/15 | 0.56 |
| 20 | US T N/B<br>2.375<br>02/28/15   | 国債<br>証券 | 米国   | 1,815,160,000 | 105.80 | 1,920,366,674 | 105.46 | 1,914,267,736 | 2.38 | 2015/<br>2/28  | 0.54 |
| 21 | FRANCE OAT<br>4.0 10/25/14      | 国債<br>証券 | フランス | 1,757,160,000 | 107.80 | 1,894,156,589 | 108.22 | 1,901,598,552 | 4.00 | 2014/<br>10/25 | 0.53 |
| 22 | US T N/B<br>3.625<br>02/15/20   | 国債<br>証券 | 米国   | 1,578,400,000 | 115.22 | 1,818,600,912 | 118.11 | 1,864,232,456 | 3.63 | 2020/<br>2/15  | 0.52 |
| 23 | US T N/B 3.75<br>11/15/18       | 国債<br>証券 | 米国   | 1,578,400,000 | 115.63 | 1,825,025,000 | 117.83 | 1,859,797,152 | 3.75 | 2018/<br>11/15 | 0.52 |
| 24 | US T N/B<br>2.625<br>11/15/20   | 国債<br>証券 | 米国   | 1,657,320,000 | 106.89 | 1,771,509,348 | 110.20 | 1,826,350,067 | 2.63 | 2020/<br>11/15 | 0.51 |
| 25 | DEUTSCHLAND<br>3.75<br>01/04/15 | 国債<br>証券 | ドイツ  | 1,659,540,000 | 109.53 | 1,817,694,162 | 109.58 | 1,818,440,955 | 3.75 | 2015/<br>1/4   | 0.51 |
| 26 | DEUTSCHLAND<br>4.25<br>07/04/14 | 国債<br>証券 | ドイツ  | 1,659,540,000 | 109.27 | 1,813,296,381 | 108.85 | 1,806,409,290 | 4.25 | 2014/<br>7/4   | 0.51 |
| 27 | FRANCE OAT<br>3.25<br>04/25/16  | 国債<br>証券 | フランス | 1,659,540,000 | 106.56 | 1,768,405,824 | 108.41 | 1,799,157,100 | 3.25 | 2016/<br>4/25  | 0.50 |
| 28 | FRANCE OAT<br>3.0 10/25/15      | 国債<br>証券 | フランス | 1,659,540,000 | 105.50 | 1,750,881,082 | 107.14 | 1,778,047,751 | 3.00 | 2015/<br>10/25 | 0.50 |
| 29 | US T N/B 3.25<br>12/31/16       | 国債<br>証券 | 米国   | 1,578,400,000 | 111.42 | 1,758,669,064 | 111.77 | 1,764,098,760 | 3.25 | 2016/<br>12/31 | 0.49 |
| 30 | US T N/B 3.0<br>02/28/17        | 国債<br>証券 | 米国   | 1,578,400,000 | 110.38 | 1,742,269,488 | 110.85 | 1,749,672,184 | 3.00 | 2017/<br>2/28  | 0.49 |

(注)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の比率をいいます。

種類別業種別投資比率

平成24年5月31日現在

| 種類   | 投資比率（％） |
|------|---------|
| 国債証券 | 97.56   |
| 合計   | 97.56   |

(注)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の比率をいいます。

#### 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。

### J-REITインデックスファンド・マザーファンド

#### 投資有価証券の主要銘柄

平成24年5月31日現在

| 順位 | 銘柄名                | 種類   | 国名 | 口数    | 帳簿価額       |             | 評価額        |             | 投資比率<br>(%) |
|----|--------------------|------|----|-------|------------|-------------|------------|-------------|-------------|
|    |                    |      |    |       | 単価<br>(円)  | 金額<br>(円)   | 単価<br>(円)  | 金額<br>(円)   |             |
| 1  | 日本ビルファンド投資法人       | 投資証券 | 日本 | 846   | 778,006.31 | 658,193,337 | 715,000.00 | 604,890,000 | 12.79       |
| 2  | ジャパンリアルエステイト投資法人   | 投資証券 | 日本 | 758   | 741,302.02 | 561,906,934 | 692,000.00 | 524,536,000 | 11.09       |
| 3  | 日本リテールファンド投資法人     | 投資証券 | 日本 | 2,595 | 123,835.36 | 321,352,764 | 123,300.00 | 319,963,500 | 6.77        |
| 4  | ユナイテッド・アーバン投資法人    | 投資証券 | 日本 | 2,903 | 92,166.42  | 267,559,121 | 84,700.00  | 245,884,100 | 5.20        |
| 5  | 森トラスト総合リート投資法人     | 投資証券 | 日本 | 334   | 757,417.84 | 252,977,557 | 669,000.00 | 223,446,000 | 4.72        |
| 6  | 日本プライムリアルティ投資法人    | 投資証券 | 日本 | 987   | 217,483.64 | 214,656,350 | 223,800.00 | 220,890,600 | 4.67        |
| 7  | アドバンス・レジデンス投資法人    | 投資証券 | 日本 | 1,518 | 159,214.48 | 241,687,585 | 144,600.00 | 219,502,800 | 4.64        |
| 8  | 野村不動産オフィスファンド投資法人  | 投資証券 | 日本 | 421   | 493,486.99 | 207,758,021 | 437,000.00 | 183,977,000 | 3.89        |
| 9  | フロンティア不動産投資法人      | 投資証券 | 日本 | 268   | 706,557.19 | 189,357,326 | 671,000.00 | 179,828,000 | 3.80        |
| 10 | 日本ロジスティクスファンド投資法人  | 投資証券 | 日本 | 204   | 715,525.20 | 145,967,140 | 695,000.00 | 141,780,000 | 3.00        |
| 11 | オリックス不動産投資法人       | 投資証券 | 日本 | 393   | 388,201.84 | 152,563,323 | 350,000.00 | 137,550,000 | 2.91        |
| 12 | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 投資証券 | 日本 | 269   | 567,474.01 | 152,650,508 | 511,000.00 | 137,459,000 | 2.91        |
| 13 | 大和ハウス・レジデンシャル投資法人  | 投資証券 | 日本 | 222   | 522,761.14 | 116,052,974 | 534,000.00 | 118,548,000 | 2.51        |
| 14 | ジャパンエクセレント投資法人     | 投資証券 | 日本 | 260   | 410,133.97 | 106,634,832 | 418,000.00 | 108,680,000 | 2.30        |
| 15 | 大和証券オフィス投資法人       | 投資証券 | 日本 | 546   | 239,575.68 | 130,808,324 | 194,500.00 | 106,197,000 | 2.25        |

|    |                  |      |    |       |            |             |            |             |      |
|----|------------------|------|----|-------|------------|-------------|------------|-------------|------|
| 16 | 森ヒルズリート投資法人      | 投資証券 | 日本 | 320   | 285,843.29 | 91,469,853  | 318,500.00 | 101,920,000 | 2.16 |
| 17 | ケネディクス不動産投資法人    | 投資証券 | 日本 | 396   | 283,304.09 | 112,188,420 | 257,200.00 | 101,851,200 | 2.15 |
| 18 | 福岡リート投資法人        | 投資証券 | 日本 | 170   | 568,989.79 | 96,728,265  | 566,000.00 | 96,220,000  | 2.03 |
| 19 | 産業ファンド投資法人       | 投資証券 | 日本 | 194   | 434,116.28 | 84,218,559  | 486,500.00 | 94,381,000  | 2.00 |
| 20 | トップリート投資法人       | 投資証券 | 日本 | 214   | 446,193.85 | 95,485,483  | 440,000.00 | 94,160,000  | 1.99 |
| 21 | 東急リアル・エステート投資法人  | 投資証券 | 日本 | 234   | 470,483.07 | 110,093,038 | 391,500.00 | 91,611,000  | 1.94 |
| 22 | 野村不動産レジデンシャル投資法人 | 投資証券 | 日本 | 208   | 412,084.62 | 85,713,601  | 390,000.00 | 81,120,000  | 1.72 |
| 23 | プレミア投資法人         | 投資証券 | 日本 | 272   | 309,898.57 | 84,292,412  | 289,600.00 | 78,771,200  | 1.67 |
| 24 | グローバル・ワン不動産投資法人  | 投資証券 | 日本 | 134   | 631,923.02 | 84,677,685  | 511,000.00 | 68,474,000  | 1.45 |
| 25 | 日本賃貸住宅投資法人       | 投資証券 | 日本 | 1,837 | 35,388.89  | 65,009,388  | 36,500.00  | 67,050,500  | 1.42 |
| 26 | M I D リート投資法人    | 投資証券 | 日本 | 253   | 220,434.78 | 55,769,999  | 210,200.00 | 53,180,600  | 1.12 |
| 27 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 投資証券 | 日本 | 2,566 | 17,963.64  | 46,094,698  | 20,350.00  | 52,218,100  | 1.10 |
| 28 | 積水ハウス・S I 投資法人   | 投資証券 | 日本 | 159   | 337,110.78 | 53,600,614  | 328,000.00 | 52,152,000  | 1.10 |
| 29 | 阪急リート投資法人        | 投資証券 | 日本 | 118   | 397,017.43 | 46,848,057  | 358,500.00 | 42,303,000  | 0.89 |
| 30 | 平和不動産リート投資法人     | 投資証券 | 日本 | 961   | 45,511.41  | 43,736,463  | 43,300.00  | 41,611,300  | 0.88 |

(注)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の比率をいいます。

#### 種類別業種別投資比率

平成24年5月31日現在

| 種類   | 投資比率（％） |
|------|---------|
| 投資証券 | 98.89   |
| 合計   | 98.89   |

(注)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の比率をいいます。

#### 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。

#### グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

#### 投資有価証券の主要銘柄

| 順位 | 銘柄名                           | 種類           | 国名      | 口数      | 帳簿価額      |             | 評価額       |             | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|-------------------------------|--------------|---------|---------|-----------|-------------|-----------|-------------|-----------------|
|    |                               |              |         |         | 単価<br>(円) | 金額<br>(円)   | 単価<br>(円) | 金額<br>(円)   |                 |
| 1  | SIMON PROPERTY GROUP INC      | 投資証券         | 米国      | 16,814  | 10,198.87 | 171,483,839 | 11,536.53 | 193,975,141 | 7.41            |
| 2  | PUBLIC STORAGE                | 投資証券         | 米国      | 8,158   | 9,850.79  | 80,362,781  | 10,455.32 | 85,294,514  | 3.26            |
| 3  | WESTFIELD GROUP               | 投資信託<br>受益証券 | オーストラリア | 116,200 | 603.35    | 70,109,728  | 697.28    | 81,023,866  | 3.09            |
| 4  | EQUITY RESIDENTIAL            | 投資証券         | 米国      | 15,700  | 4,614.45  | 72,446,903  | 4,780.18  | 75,048,895  | 2.87            |
| 5  | VENTAS INC                    | 投資証券         | 米国      | 15,302  | 4,285.36  | 65,574,518  | 4,565.52  | 69,861,618  | 2.67            |
| 6  | UNIBAIL-RODAMCO SE            | 投資証券         | フランス    | 5,230   | 13,554.54 | 70,890,229  | 13,100.60 | 68,516,159  | 2.62            |
| 7  | VORNADO REALTY TRUST          | 投資証券         | 米国      | 10,429  | 6,353.06  | 66,256,063  | 6,447.76  | 67,243,731  | 2.57            |
| 8  | HCP INC                       | 投資証券         | 米国      | 20,900  | 3,008.79  | 62,883,747  | 3,201.78  | 66,917,294  | 2.56            |
| 9  | PROLOGIS INC                  | 投資証券         | 米国      | 25,729  | 2,309.99  | 59,433,692  | 2,508.87  | 64,550,634  | 2.47            |
| 10 | BOSTON PROPERTIES INC         | 投資証券         | 米国      | 7,780   | 7,798.09  | 60,669,103  | 8,102.72  | 63,039,134  | 2.41            |
| 11 | AVALONBAY COMMUNITIES INC     | 投資証券         | 米国      | 4,798   | 10,316.75 | 49,499,760  | 10,928.05 | 52,432,795  | 2.00            |
| 12 | HOST HOTELS & RESORTS INC     | 投資証券         | 米国      | 41,168  | 1,147.50  | 47,240,148  | 1,196.43  | 49,254,515  | 1.88            |
| 13 | HEALTH CARE REIT INC          | 投資証券         | 米国      | 11,201  | 3,946.00  | 44,199,146  | 4,319.29  | 48,380,385  | 1.85            |
| 14 | GENERAL GROWTH PROPERTIES INC | 投資証券         | 米国      | 34,963  | 1,117.88  | 39,084,387  | 1,326.65  | 46,383,496  | 1.77            |
| 15 | LINK REIT/THE                 | 投資証券         | 香港      | 135,000 | 275.34    | 37,170,360  | 303.78    | 41,010,840  | 1.57            |
| 16 | LAND SECURITIES GROUP PLC     | 投資証券         | 英国      | 43,200  | 843.78    | 36,451,300  | 859.65    | 37,137,070  | 1.42            |
| 17 | STOCKLAND                     | 投資信託<br>受益証券 | オーストラリア | 130,140 | 247.22    | 32,173,757  | 245.69    | 31,974,539  | 1.22            |
| 18 | WESTFIELD RETAIL TRUST        | 投資信託<br>受益証券 | オーストラリア | 151,200 | 193.65    | 29,279,305  | 209.72    | 31,709,604  | 1.21            |
| 19 | FEDERAL REALTY INVS TRUST     | 投資証券         | 米国      | 4,030   | 7,046.77  | 28,398,470  | 7,702.59  | 31,041,446  | 1.19            |
| 20 | DIGITAL REALTY TRUST INC      | 投資証券         | 米国      | 5,510   | 5,020.10  | 27,660,758  | 5,525.98  | 30,448,141  | 1.16            |
| 21 | KIMCO REALTY                  | 投資証券         | 米国      | 21,199  | 1,366.89  | 28,976,794  | 1,406.35  | 29,813,307  | 1.14            |
| 22 | UDR INC                       | 投資証券         | 米国      | 13,779  | 1,946.96  | 26,827,112  | 2,040.08  | 28,110,290  | 1.07            |
| 23 | THE MACERICH COMPANY          | 投資証券         | 米国      | 6,020   | 3,964.94  | 23,868,944  | 4,497.65  | 27,075,858  | 1.03            |
| 24 | BRITISH LAND CO PLC           | 投資証券         | 英国      | 45,200  | 618.49    | 27,955,619  | 597.00    | 26,984,210  | 1.03            |
| 25 | REALTY INCOME CORP            | 投資証券         | 米国      | 8,100   | 2,643.82  | 21,414,942  | 3,002.12  | 24,317,146  | 0.93            |
| 26 | ESSEX PROPERTY TRUST INC      | 投資証券         | 米国      | 2,060   | 10,888.59 | 22,430,500  | 11,763.03 | 24,231,834  | 0.93            |
| 27 | GOODMAN GROUP                 | 投資信託<br>受益証券 | オーストラリア | 89,152  | 237.28    | 21,153,547  | 261.77    | 23,337,034  | 0.89            |
| 28 | CFS RETAIL PROPERTY           | 投資信託<br>受益証券 | オーストラリア | 153,300 | 140.07    | 21,472,455  | 147.34    | 22,587,145  | 0.86            |

|    |           |              |            |        |          |            |          |            |      |
|----|-----------|--------------|------------|--------|----------|------------|----------|------------|------|
| 29 | SL GREEN  | 投資証券         | 米国         | 3,825  | 5,544.29 | 21,206,919 | 5,832.19 | 22,308,119 | 0.85 |
| 30 | GPT GROUP | 投資信託<br>受益証券 | オースト<br>リア | 86,000 | 237.27   | 20,405,564 | 244.93   | 21,063,808 | 0.80 |

(注)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の比率をいいます。

#### 種類別業種別投資比率

平成24年5月31日現在

| 種類       | 投資比率（％） |
|----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 13.94   |
| 投資証券     | 83.07   |
| 合計       | 97.01   |

(注)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の比率をいいます。

#### 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】

直近日（平成24年5月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

|         |                      | 純資産総額<br>（百万円） |       | 1口当たり純資産額<br>（円） |        |
|---------|----------------------|----------------|-------|------------------|--------|
|         |                      | 分配落            | 分配付   | 分配落              | 分配付    |
| 第1特定期間  | 第1期末（平成19年5月11日現在）   | 1,285          | 1,326 | 1.0111           | 1.0436 |
| 第2特定期間  | 第2期末（平成19年7月11日現在）   | 1,757          | 1,761 | 0.9978           | 1.0003 |
|         | 第3期末（平成19年9月11日現在）   | 1,731          | 1,736 | 0.9083           | 0.9108 |
|         | 第4期末（平成19年11月12日現在）  | 1,696          | 1,700 | 0.9051           | 0.9076 |
| 第3特定期間  | 第5期末（平成20年1月11日現在）   | 1,565          | 1,569 | 0.8744           | 0.8769 |
|         | 第6期末（平成20年3月11日現在）   | 1,387          | 1,391 | 0.8086           | 0.8111 |
|         | 第7期末（平成20年5月12日現在）   | 1,426          | 1,430 | 0.8458           | 0.8483 |
| 第4特定期間  | 第8期末（平成20年7月11日現在）   | 1,355          | 1,360 | 0.8187           | 0.8212 |
|         | 第9期末（平成20年9月11日現在）   | 1,249          | 1,253 | 0.7757           | 0.7782 |
|         | 第10期末（平成20年11月11日現在） | 964            | 968   | 0.6215           | 0.6240 |
| 第5特定期間  | 第11期末（平成21年1月13日現在）  | 920            | 923   | 0.5989           | 0.6014 |
|         | 第12期末（平成21年3月11日現在）  | 878            | 882   | 0.5763           | 0.5788 |
|         | 第13期末（平成21年5月11日現在）  | 972            | 976   | 0.6435           | 0.6460 |
| 第6特定期間  | 第14期末（平成21年7月13日現在）  | 938            | 942   | 0.6209           | 0.6234 |
|         | 第15期末（平成21年9月11日現在）  | 995            | 998   | 0.6680           | 0.6705 |
|         | 第16期末（平成21年11月11日現在） | 966            | 970   | 0.6528           | 0.6553 |
| 第7特定期間  | 第17期末（平成22年1月12日現在）  | 981            | 985   | 0.6746           | 0.6771 |
|         | 第18期末（平成22年3月11日現在）  | 943            | 946   | 0.6580           | 0.6605 |
|         | 第19期末（平成22年5月11日現在）  | 927            | 930   | 0.6634           | 0.6659 |
| 第8特定期間  | 第20期末（平成22年7月12日現在）  | 880            | 883   | 0.6328           | 0.6353 |
|         | 第21期末（平成22年9月13日現在）  | 851            | 854   | 0.6238           | 0.6263 |
|         | 第22期末（平成22年11月11日現在） | 861            | 863   | 0.6399           | 0.6414 |
| 第9特定期間  | 第23期末（平成23年1月11日現在）  | 856            | 858   | 0.6487           | 0.6502 |
|         | 第24期末（平成23年3月11日現在）  | 840            | 842   | 0.6513           | 0.6528 |
|         | 第25期末（平成23年5月11日現在）  | 823            | 825   | 0.6487           | 0.6502 |
| 第10特定期間 | 第26期末（平成23年7月11日現在）  | 795            | 797   | 0.6454           | 0.6469 |
|         | 第27期末（平成23年9月12日現在）  | 722            | 724   | 0.5988           | 0.6003 |
|         | 第28期末（平成23年11月11日現在） | 712            | 714   | 0.5956           | 0.5971 |
| 第11特定期間 | 第29期末（平成24年1月11日現在）  | 682            | 683   | 0.5921           | 0.5936 |
|         | 第30期末（平成24年3月12日現在）  | 726            | 728   | 0.6433           | 0.6448 |
|         | 第31期末（平成24年5月11日現在）  | 692            | 694   | 0.6202           | 0.6217 |
|         | 平成23年5月末             | 815            | -     | 0.6453           | -      |
|         | 6月末                  | 807            | -     | 0.6428           | -      |
|         | 7月末                  | 764            | -     | 0.6298           | -      |
|         | 8月末                  | 739            | -     | 0.6114           | -      |
|         | 9月末                  | 717            | -     | 0.5962           | -      |
|         | 10月末                 | 732            | -     | 0.6120           | -      |
|         | 11月末                 | 703            | -     | 0.5896           | -      |
|         | 12月末                 | 693            | -     | 0.5953           | -      |
|         | 平成24年1月末             | 685            | -     | 0.6023           | -      |

|  |     |     |   |        |   |
|--|-----|-----|---|--------|---|
|  | 2月末 | 726 | - | 0.6404 | - |
|  | 3月末 | 731 | - | 0.6491 | - |
|  | 4月末 | 713 | - | 0.6379 | - |
|  | 5月末 | 671 | - | 0.6027 | - |

## 【分配の推移】

|         |      | 1口当たりの分配額（円） |
|---------|------|--------------|
| 第1特定期間  | 第1期  | 0.0325       |
| 第2特定期間  | 第2期  | 0.0025       |
|         | 第3期  | 0.0025       |
|         | 第4期  | 0.0025       |
| 第3特定期間  | 第5期  | 0.0025       |
|         | 第6期  | 0.0025       |
|         | 第7期  | 0.0025       |
| 第4特定期間  | 第8期  | 0.0025       |
|         | 第9期  | 0.0025       |
|         | 第10期 | 0.0025       |
| 第5特定期間  | 第11期 | 0.0025       |
|         | 第12期 | 0.0025       |
|         | 第13期 | 0.0025       |
| 第6特定期間  | 第14期 | 0.0025       |
|         | 第15期 | 0.0025       |
|         | 第16期 | 0.0025       |
| 第7特定期間  | 第17期 | 0.0025       |
|         | 第18期 | 0.0025       |
|         | 第19期 | 0.0025       |
| 第8特定期間  | 第20期 | 0.0025       |
|         | 第21期 | 0.0025       |
|         | 第22期 | 0.0015       |
| 第9特定期間  | 第23期 | 0.0015       |
|         | 第24期 | 0.0015       |
|         | 第25期 | 0.0015       |
| 第10特定期間 | 第26期 | 0.0015       |
|         | 第27期 | 0.0015       |
|         | 第28期 | 0.0015       |
| 第11特定期間 | 第29期 | 0.0015       |
|         | 第30期 | 0.0015       |
|         | 第31期 | 0.0015       |

## 【収益率の推移】

|        |     | 収益率（％） |
|--------|-----|--------|
| 第1特定期間 | 第1期 | 4.36   |
| 第2特定期間 | 第2期 | 1.07   |
|        | 第3期 | 8.72   |
|        | 第4期 | 0.08   |
| 第3特定期間 | 第5期 | 3.12   |
|        | 第6期 | 7.24   |
|        | 第7期 | 4.91   |

|         |      |       |
|---------|------|-------|
| 第4特定期間  | 第8期  | 2.91  |
|         | 第9期  | 4.95  |
|         | 第10期 | 19.56 |
| 第5特定期間  | 第11期 | 3.23  |
|         | 第12期 | 3.36  |
|         | 第13期 | 12.09 |
| 第6特定期間  | 第14期 | 3.12  |
|         | 第15期 | 7.99  |
|         | 第16期 | 1.90  |
| 第7特定期間  | 第17期 | 3.72  |
|         | 第18期 | 2.09  |
|         | 第19期 | 1.20  |
| 第8特定期間  | 第20期 | 4.24  |
|         | 第21期 | 1.03  |
|         | 第22期 | 2.82  |
| 第9特定期間  | 第23期 | 1.61  |
|         | 第24期 | 0.63  |
|         | 第25期 | 0.17  |
| 第10特定期間 | 第26期 | 0.28  |
|         | 第27期 | 6.99  |
|         | 第28期 | 0.28  |
| 第11特定期間 | 第29期 | 0.34  |
|         | 第30期 | 8.90  |
|         | 第31期 | 3.36  |

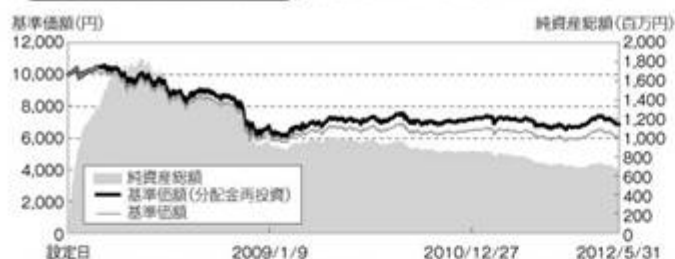
(注)収益率 = ( 当期分配付き基準価額—前期分配落ち基準価額 ) ÷ 前期分配落ち基準価額 × 100

## &lt; 参考情報 &gt;

データの基準日：2012年5月31日

## 基準価額・純資産の推移

(設定日(2007年1月26日)～2012年5月31日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定後の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日：2007年1月26日)  
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

## 分配の推移(税引前)

|         |              |      |
|---------|--------------|------|
| 第27期    | (2011.09.12) | 15円  |
| 第28期    | (2011.11.11) | 15円  |
| 第29期    | (2012.01.11) | 15円  |
| 第30期    | (2012.03.12) | 15円  |
| 第31期    | (2012.05.11) | 15円  |
| 直近1年間累計 |              | 90円  |
| 設定来累計   |              | 975円 |

(注)分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

## 組入銘柄一覧

(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

| 順位 | 銘柄名                         | 投資比率(%) |
|----|-----------------------------|---------|
| 1  | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 32.48   |
| 2  | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 22.97   |
| 3  | 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | 19.60   |
| 4  | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド       | 12.83   |
| 5  | J-REITインデックスファンド・マザーファンド    | 6.15    |
| 6  | グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド  | 4.94    |

## ■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## ポートフォリオの状況

| 資産の種類               | 国名 | 投資比率(%) |
|---------------------|----|---------|
| 株式                  | 日本 | 97.11   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |    | 2.89    |
| 合 計(純資産総額)          |    | 100.00  |

## 組入上位5銘柄

| 順位 | 銘柄名           | 国名 | 業種    | 投資比率(%) |
|----|---------------|----|-------|---------|
| 1  | トヨタ自動車        | 日本 | 輸送用機器 | 3.90    |
| 2  | 三菱UFJフィナンシャルG | 日本 | 銀行業   | 2.51    |
| 3  | 本田技研          | 日本 | 輸送用機器 | 2.09    |
| 4  | キヤノン          | 日本 | 電気機器  | 1.93    |
| 5  | 三井住友フィナンシャルG  | 日本 | 銀行業   | 1.70    |

## 組入上位5業種(株式)

| 順位 | 業種     | 投資比率(%) |
|----|--------|---------|
| 1  | 電気機器   | 12.74   |
| 2  | 輸送用機器  | 10.38   |
| 3  | 銀行業    | 9.10    |
| 4  | 情報・通信業 | 6.30    |
| 5  | 化学     | 5.71    |

## ■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## ポートフォリオの状況

| 資産の種類               | 国名      | 投資比率(%) |
|---------------------|---------|---------|
| 株式                  | 米国      | 55.30   |
|                     | 英国      | 9.48    |
|                     | カナダ     | 5.30    |
|                     | スイス     | 4.24    |
|                     | フランス    | 3.63    |
|                     | その他     | 17.43   |
|                     | 小計      | 95.38   |
| 投資信託受益証券            | オーストラリア | 0.30    |
|                     | シンガポール  | 0.03    |
|                     | 小計      | 0.32    |
| 投資証券                | 米国      | 1.44    |
|                     | 英国      | 0.12    |
|                     | フランス    | 0.12    |
|                     | カナダ     | 0.04    |
|                     | 香港      | 0.04    |
|                     | その他     | 0.01    |
|                     | 小計      | 1.76    |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |         | 2.54    |
| 合 計(純資産総額)          |         | 100.00  |

## 組入上位5銘柄

| 順位 | 銘柄名                         | 種類 | 国名 | 業種          | 投資比率(%) |
|----|-----------------------------|----|----|-------------|---------|
| 1  | APPLE INC                   | 株式 | 米国 | コンピュータ・周辺機器 | 2.58    |
| 2  | EXXON MOBIL CORP            | 株式 | 米国 | 石油・ガス・消耗燃料  | 1.83    |
| 3  | INTL BUSINESS MACHINES CORP | 株式 | 米国 | 情報技術サービス    | 1.11    |
| 4  | MICROSOFT CORP              | 株式 | 米国 | ソフトウェア      | 1.06    |
| 5  | GENERAL ELECTRIC CO         | 株式 | 米国 | コングロマリット    | 0.97    |

## 組入上位5業種(株式)

| 順位 | 業種          | 投資比率(%) |
|----|-------------|---------|
| 1  | 石油・ガス・消耗燃料  | 9.76    |
| 2  | 商業銀行        | 6.83    |
| 3  | 医薬品         | 6.65    |
| 4  | 保険          | 3.83    |
| 5  | コンピュータ・周辺機器 | 3.30    |

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。  
 ○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日: 2012年5月31日

## 主要な資産の状況

## ■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## ポートフォリオの状況

| 資産の種類               | 国名 | 投資比率(%) |
|---------------------|----|---------|
| 国債証券                | 日本 | 77.64   |
| 地方債証券               | 日本 | 6.75    |
| 特殊債証券               | 日本 | 8.06    |
| 社債証券                | 日本 | 6.93    |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |    | 0.62    |
| 合 計(純資産総額)          |    | 100.00  |

## 組入上位5銘柄

| 順位 | 銘柄名              | 種類   | 国名 | 利率(%) | 償還期限      | 投資比率(%) |
|----|------------------|------|----|-------|-----------|---------|
| 1  | 313回 利付国庫債券(10年) | 国債証券 | 日本 | 1.30  | 2021/3/20 | 1.42    |
| 2  | 81回 利付国庫債券(5年)   | 国債証券 | 日本 | 0.80  | 2014/3/20 | 1.42    |
| 3  | 285回 利付国庫債券(10年) | 国債証券 | 日本 | 1.70  | 2017/3/20 | 1.32    |
| 4  | 75回 利付国庫債券(5年)   | 国債証券 | 日本 | 1.10  | 2013/9/20 | 1.15    |
| 5  | 310回 利付国庫債券(10年) | 国債証券 | 日本 | 1.00  | 2020/9/20 | 1.14    |

## ■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## ポートフォリオの状況

| 資産の種類               | 国名   | 投資比率(%) |
|---------------------|------|---------|
| 国債証券                | 米国   | 42.40   |
|                     | フランス | 9.43    |
|                     | ドイツ  | 9.00    |
|                     | イタリア | 8.37    |
|                     | 英国   | 7.97    |
|                     | その他  | 20.39   |
|                     | 小計   | 97.56   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |      | 2.44    |
| 合 計(純資産総額)          |      | 100.00  |

## 組入上位5銘柄

| 順位 | 銘柄名                    | 種類   | 国名 | 利率(%) | 償還期限       | 投資比率(%) |
|----|------------------------|------|----|-------|------------|---------|
| 1  | US T N/B 4.0 02/15/14  | 国債証券 | 米国 | 4.00  | 2014/2/15  | 0.94    |
| 2  | US T N/B 4.25 11/15/13 | 国債証券 | 米国 | 4.25  | 2013/11/15 | 0.94    |
| 3  | US T N/B 1.0 07/15/13  | 国債証券 | 米国 | 1.00  | 2013/7/15  | 0.89    |
| 4  | US T N/B 4.75 05/15/14 | 国債証券 | 米国 | 4.75  | 2014/5/15  | 0.84    |
| 5  | US T N/B 4.25 08/15/13 | 国債証券 | 米国 | 4.25  | 2013/8/15  | 0.81    |

## ■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## ポートフォリオの状況

| 資産の種類               | 国名 | 投資比率(%) |
|---------------------|----|---------|
| 投資証券                | 日本 | 98.89   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |    | 1.11    |
| 合 計(純資産総額)          |    | 100.00  |

## 組入上位5銘柄

| 順位 | 銘柄名              | 国名 | 投資比率(%) |
|----|------------------|----|---------|
| 1  | 日本ビルファンド投資法人     | 日本 | 12.79   |
| 2  | ジャッパリアルエステイト投資法人 | 日本 | 11.09   |
| 3  | 日本リテールファンド投資法人   | 日本 | 6.77    |
| 4  | ユナイテッドアーノン投資法人   | 日本 | 5.20    |
| 5  | 森トラスト総合リート投資法人   | 日本 | 4.72    |

## ■グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

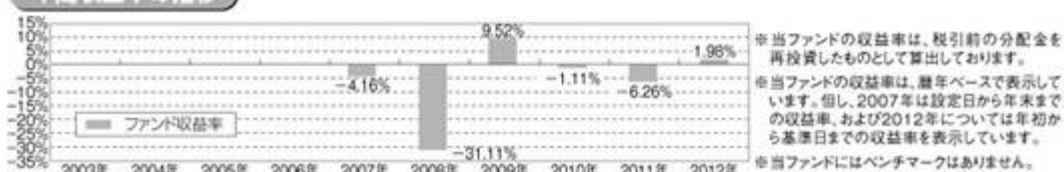
## ポートフォリオの状況

| 資産の種類               | 国名      | 投資比率(%) |
|---------------------|---------|---------|
| 投資信託受益証券            | オーストラリア | 10.97   |
|                     | シンガポール  | 2.96    |
| 投資証券                | 小計      | 13.94   |
|                     | 米国      | 65.21   |
|                     | 英国      | 5.64    |
|                     | フランス    | 4.59    |
|                     | カナダ     | 3.09    |
|                     | 香港      | 1.89    |
|                     | その他     | 2.65    |
|                     | 小計      | 83.07   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |         | 2.99    |
| 合 計(純資産総額)          |         | 100.00  |

## 組入上位5銘柄

| 順位 | 銘柄名                      | 国名      | 投資比率(%) |
|----|--------------------------|---------|---------|
| 1  | SIMON PROPERTY GROUP INC | 米国      | 7.41    |
| 2  | PUBLIC STORAGE           | 米国      | 3.26    |
| 3  | WESTFIELD GROUP          | オーストラリア | 3.09    |
| 4  | EQUITY RESIDENTIAL       | 米国      | 2.87    |
| 5  | VENTAS INC               | 米国      | 2.67    |

## 年間収益率の推移



○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

**(4)【設定及び解約の実績】**

下記計算期間の設定及び解約口数は次の通りです。

|         |      | 設定口数          | 解約口数        |
|---------|------|---------------|-------------|
| 第1特定期間  | 第1期  | 1,341,630,000 | 70,590,000  |
| 第2特定期間  | 第2期  | 577,890,000   | 87,930,000  |
|         | 第3期  | 296,160,000   | 150,910,000 |
|         | 第4期  | 93,840,000    | 126,280,000 |
| 第3特定期間  | 第5期  | 41,330,000    | 125,160,000 |
|         | 第6期  | 25,480,000    | 99,450,000  |
|         | 第7期  | 21,320,000    | 50,420,000  |
| 第4特定期間  | 第8期  | 16,370,000    | 47,060,000  |
|         | 第9期  | 6,940,000     | 52,110,000  |
|         | 第10期 | 11,770,000    | 70,550,000  |
| 第5特定期間  | 第11期 | 10,070,000    | 26,080,000  |
|         | 第12期 | 6,950,000     | 18,250,000  |
|         | 第13期 | 4,240,000     | 17,240,000  |
| 第6特定期間  | 第14期 | 13,950,000    | 14,090,000  |
|         | 第15期 | 9,650,000     | 31,860,000  |
|         | 第16期 | 8,370,000     | 17,600,000  |
| 第7特定期間  | 第17期 | 7,650,000     | 32,970,000  |
|         | 第18期 | 3,830,000     | 25,630,000  |
|         | 第19期 | 4,950,000     | 40,920,000  |
| 第8特定期間  | 第20期 | 3,350,000     | 9,540,000   |
|         | 第21期 | 2,930,000     | 28,830,000  |
|         | 第22期 | 5,840,000     | 24,430,000  |
| 第9特定期間  | 第23期 | 1,400,000     | 27,550,000  |
|         | 第24期 | 13,800,000    | 43,680,000  |
|         | 第25期 | 6,010,000     | 27,510,000  |
| 第10特定期間 | 第26期 | 3,470,000     | 39,180,000  |
|         | 第27期 | 2,200,000     | 29,470,000  |
|         | 第28期 | 1,450,000     | 11,270,000  |
| 第11特定期間 | 第29期 | 720,000       | 44,790,000  |
|         | 第30期 | 6,040,000     | 28,440,000  |
|         | 第31期 | 4,040,000     | 17,230,000  |

(注)本邦外における設定及び解約はございません。

**第2【管理及び運営】****1【申込（販売）手続等】**

## ・お申込みの方法

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、フランクフルトの銀行、オランダの銀行、フランスの銀行、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、オーストラリア証券取引所のいずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」といいます。）には、お申込みの受付は行いません。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとしま

す。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

・お申込価額（発行価格）

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口当たり1円に換算した基準価額で表示することがあります。）

・お申込手数料

ありません。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

お申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うものとし、各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

## 2【換金（解約）手続等】

- ・受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に各販売会社の定める単位をもって解約の請求をすることができます。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。解約の受付は、原則として販売会社の営業日の午後3時までに解約の請求が行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。また、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

海外休業日には、解約の受付を行いません。

解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。なお、解約の請求を受益者がするときは、振替受益権をもって行うものとし、

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額から、信託財産留保額として当該基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を控除した価額とします。

信託財産留保額は、解約に際して生じる売買手数料等の費用について、受益者間の公平性を確保するため解約者から一定の金額を徴収し、信託財産に繰り入れるものです。

解約価額は委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

- ・解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して6営業日目から販売会社の営業所等において支払います。
- ・委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求を取り消すことができます。解約の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとします。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

基準価額とは純資産総額（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。）を法令および社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額を、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、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）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電信売買相場の仲値によって計算します。予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額（1万口当たり）は、毎営業日、委託会社にて計算されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。したがって、委託会社は受益証券を発行しません。

#### (3)【信託期間】

信託期間は平成19年1月26日から無期限です。ただし、下記(5)イ.の場合には信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

#### (4)【計算期間】

a. 計算期間は原則として毎奇数月の12日から翌奇数月の11日までとします。

各計算期間の終了日が休業日の場合には翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

b. 上記a.の規定にかかわらず、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、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

#### (5)【その他】

##### イ.償還規定

- a. 委託会社は、信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、信託期間中においてこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

- c. 委託会社は、上記a. およびb. の事項について、あらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- d. 委託会社は上記c. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- e. 上記d. に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- f. 委託会社は、上記e. の規定により、信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- g. 上記d. からf. の規定は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あって、上記d. の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- h. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- i. 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は、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、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投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ. 信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- j. 受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更」の規定に従い、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- k. 上記d. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し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することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、新聞公告または書面に付記します。

#### ロ. 信託約款の変更

- a. 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、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、上記a. の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c. 委託会社は上記b. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べることを旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記c. に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。
- e. 委託会社は信託約款の変更しないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 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、上記a. ～e. の規定に従います。
- g. 上記c. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し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することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、新聞広告または書面に付記します。
- h. 上記b. に該当しない場合の約款変更のお知らせは、当ファンドの計算期間末に作成しております「運用報告書」にてお知らせいたします。

#### 八. 関係法人との契約の更改

証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約について、委託会社と販売会社との間の当該契約は、原則として3ヵ月前までに、当事者間の別段の意思表示がない限り、1年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。投資一任契約および投資顧問契約について、委託会社と投資顧問会社との間の当該契約は、いずれの当事者からも別段の意思表示がない限り、当ファンドおよびマザーファンドの信託終了日まで存続します。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

## 二. 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

## ホ. 運用報告書

委託会社は、毎年5月11日、11月11日（休業日の場合は翌営業日。）および償還時に運用報告書を作成し、当該信託財産に係る知られたる受益者に対して交付します。運用報告書は委託会社のホームページにおいても開示します。

（URL <http://www.diam.co.jp/>）

## 4【受益者の権利等】

### 収益分配金受領権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。

受益者は分配金支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属するものとします。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に、原則として決算日（休業日の場合は翌営業日。）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

### 償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

受益者が、信託終了による償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属するものとします。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に、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営業日までにお支払いを開始します。

### 一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることができます。

解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

### 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内に当該受益者にかかる信託財産に関する帳簿書類の閲覧または謄写を請求することができます。

### 第3【ファンドの経理状況】

- （１）当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第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）に基づいて作成しております。  
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ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ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、第11特定期間（平成23年11月12日から平成24年5月11日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：円 )

|                     | 前期<br>平成23年11月11日現在 | 当期<br>平成24年 5 月11日現在 |
|---------------------|---------------------|----------------------|
| 資産の部                |                     |                      |
| 流動資産                |                     |                      |
| コール・ローン             | 11,845,130          | 10,308,551           |
| 親投資信託受益証券           | 702,445,496         | 685,484,586          |
| 未収入金                | 1,264,000           | 512,000              |
| 流動資産合計              | 715,554,626         | 696,305,137          |
| 資産合計                | 715,554,626         | 696,305,137          |
| 負債の部                |                     |                      |
| 流動負債                |                     |                      |
| 未払収益分配金             | 1,794,420           | 1,674,930            |
| 未払解約金               | 42,293              | 881,110              |
| 未払受託者報酬             | 86,596              | 86,942               |
| 未払委託者報酬             | 1,088,853           | 1,093,134            |
| その他未払費用             | 5,844               | 5,866                |
| 流動負債合計              | 3,018,006           | 3,741,982            |
| 負債合計                | 3,018,006           | 3,741,982            |
| 純資産の部               |                     |                      |
| 元本等                 |                     |                      |
| 元本                  | 1,196,280,000       | 1,116,620,000        |
| 剰余金                 |                     |                      |
| 期末剰余金又は期末欠損金 (    ) | *3 483,743,380      | *3 424,056,845       |
| ( 分配準備積立金 )         | 7,275,224           | 8,633,715            |
| 元本等合計               | 712,536,620         | 692,563,155          |
| 純資産合計               | 712,536,620         | 692,563,155          |
| 負債純資産合計             | 715,554,626         | 696,305,137          |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|                                           | 前期<br>自 平成23年 5 月12日<br>至 平成23年11月11日 | 当期<br>自 平成23年11月12日<br>至 平成24年 5 月11日 |
|-------------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業収益                                      |                                       |                                       |
| 受取利息                                      | 3,744                                 | 3,520                                 |
| 有価証券売買等損益                                 | 55,548,937                            | 36,919,090                            |
| 営業収益合計                                    | 55,545,193                            | 36,922,610                            |
| 営業費用                                      |                                       |                                       |
| 受託者報酬                                     | 280,268                               | 258,931                               |
| 委託者報酬                                     | * <sub>1</sub> 3,523,840              | * <sub>1</sub> 3,255,602              |
| その他費用                                     | 18,929                                | 17,480                                |
| 営業費用合計                                    | 3,823,037                             | 3,532,013                             |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             | 59,368,230                            | 33,390,597                            |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             | 59,368,230                            | 33,390,597                            |
| 当期純利益又は当期純損失（ ）                           | 59,368,230                            | 33,390,597                            |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ） | 866,340                               | 360,281                               |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           | 445,859,327                           | 483,743,380                           |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 28,736,972                            | 35,856,880                            |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 28,736,972                            | 35,856,880                            |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 2,665,510                             | 4,102,701                             |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 2,665,510                             | 4,102,701                             |
| 分配金                                       | * <sub>2</sub> 5,453,625              | * <sub>2</sub> 5,097,960              |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）                           | 483,743,380                           | 424,056,845                           |

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                    |                                                                                 |
|--------------------|---------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |
|--------------------|---------------------------------------------------------------------------------|

(貸借対照表に関する注記)

| 区分                  | 前期<br>平成23年11月11日現在                             | 当期<br>平成24年5月11日現在                              |
|---------------------|-------------------------------------------------|-------------------------------------------------|
| *1 期首元本額            | 1,269,080,000円                                  | 1,196,280,000円                                  |
| 期中追加設定元本額           | 7,120,000円                                      | 10,800,000円                                     |
| 期中解約元本額             | 79,920,000円                                     | 90,460,000円                                     |
| *2 特定期間末日における受益権の総数 | 1,196,280,000口                                  | 1,116,620,000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483,743,380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424,056,845円であります。 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 区分                                                                            | 前期<br>自平成23年5月12日<br>至平成23年11月11日  | 当期<br>自平成23年11月12日<br>至平成24年5月11日   |
|-------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|
| *1 当ファンドの主要投資対象であるグローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に関わる権限を委託する為に要する費用 | 37,310円                            | 34,942円                             |
| *2 分配金の計算過程                                                                   | (平成23年5月12日から平成23年7月11日までの分配金計算期間) | (平成23年11月12日から平成24年1月11日までの分配金計算期間) |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,865,882円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（2,210,183円）及び分配準備積立金（7,194,154円）より分配対象収益は11,270,219円（1万口当たり91.38円）であり、うち1,850,055円（1万口当たり15円）を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。（以下、各期間において同じ。）</p> <p>（平成23年7月12日から平成23年9月12日までの分配金計算期間）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,358,990円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（2,175,040円）及び分配準備積立金（7,037,784円）より分配対象収益は10,571,814円（1万口当たり87.65円）であり、うち1,809,150円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p> <p>（平成23年9月13日から平成23年11月11日までの分配金計算期間）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,543,539円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（2,166,338円）及び分配準備積立金（6,526,105円）より分配対象収益は11,235,982円（1万口当たり93.92円）であり、うち1,794,420円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p> | <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,379,882円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（2,091,424円）及び分配準備積立金（7,002,961円）より分配対象収益は10,474,267円（1万口当たり90.91円）であり、うち1,728,315円（1万口当たり15円）を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。（以下、各期間において同じ。）</p> <p>（平成24年1月12日から平成24年3月12日までの分配金計算期間）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,418,224円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（2,088,820円）及び分配準備積立金（6,490,694円）より分配対象収益は10,997,738円（1万口当たり97.34円）であり、うち1,694,715円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p> <p>（平成24年3月13日から平成24年5月11日までの分配金計算期間）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（3,204,225円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（2,096,891円）及び分配準備積立金（7,104,420円）より分配対象収益は12,405,536円（1万口当たり111.10円）であり、うち1,674,930円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p> |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

| 区分                       | 前期<br>自平成23年5月12日<br>至平成23年11月11日                                                                                                                                                     | 当期<br>自平成23年11月12日<br>至平成24年5月11日 |
|--------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。                                                                                                           | 同左                                |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 | 同左                                |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | 運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。                                                                        | 同左                                |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                   | 前期<br>平成23年11月11日現在                                                                                                                       | 当期<br>平成24年5月11日現在                                 |
|----------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。                                                                                    | 同左                                                 |
| 2. 時価の算定方法           | (1)親投資信託受益証券<br>「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。<br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 | (1)親投資信託受益証券<br>同左<br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>同左 |

|                            |                                                                                                                       |    |
|----------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左 |
|----------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

|           | 前期<br>平成23年11月11日現在       | 当期<br>平成24年5月11日現在        |
|-----------|---------------------------|---------------------------|
| 種 類       | 最終計算期間の損益に<br>含まれた評価差額(円) | 最終計算期間の損益に<br>含まれた評価差額(円) |
| 親投資信託受益証券 | 921,256                   | 23,219,455                |
| 合計        | 921,256                   | 23,219,455                |

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## （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口当たり情報に関する注記）

|              | 前期<br>平成23年11月11日現在 | 当期<br>平成24年5月11日現在 |
|--------------|---------------------|--------------------|
| 1口当たり純資産額    | 0.5956円             | 0.6202円            |
| （1万口当たり純資産額） | (5,956円)            | (6,202円)           |

## (4)【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成24年5月11日現在

| 種類        | 銘柄                            | 口数          | 評価額（円）      | 備考 |
|-----------|-------------------------------|-------------|-------------|----|
| 親投資信託受益証券 | 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド   | 135,861,366 | 138,999,763 |    |
| 親投資信託受益証券 | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド         | 189,055,349 | 217,886,289 |    |
| 親投資信託受益証券 | J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド | 53,285,219  | 41,621,084  |    |
| 親投資信託受益証券 | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド         | 71,924,768  | 92,214,745  |    |
| 親投資信託受益証券 | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド         | 133,733,796 | 159,330,444 |    |
| 親投資信託受益証券 | グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド    | 42,051,106  | 35,432,261  |    |
| 合 計       |                               | 625,911,604 | 685,484,586 |    |

## 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「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」、「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券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、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りです。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

| 科目          | 注記<br>番号 | 平成23年11月11日現在   | 平成24年5月11日現在    |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
|             |          | 金額<br>(円)       | 金額<br>(円)       |
| 資産の部        |          |                 |                 |
| 流動資産        |          |                 |                 |
| コール・ローン     |          | 5,788,703,647   | 2,998,068,713   |
| 株式          | *2       | 232,766,713,017 | 242,326,225,031 |
| 派生商品評価勘定    |          | 1,072,039       | -               |
| 未収配当金       |          | 2,366,414,923   | 2,991,069,336   |
| 前払金         |          | 205,189,000     | 616,840,000     |
| 流動資産合計      |          | 241,128,092,626 | 248,932,203,080 |
| 資産合計        |          | 241,128,092,626 | 248,932,203,080 |
| 負債の部        |          |                 |                 |
| 流動負債        |          |                 |                 |
| 派生商品評価勘定    |          | 233,669,360     | 693,239,699     |
| 未払金         |          | 535,173         | -               |
| 未払解約金       |          | 131,262,000     | 157,271,000     |
| 流動負債合計      |          | 365,466,533     | 850,510,699     |
| 負債合計        |          | 365,466,533     | 850,510,699     |
| 純資産の部       |          |                 |                 |
| 元本等         |          |                 |                 |
| 元本          |          | 247,855,496,173 | 242,476,888,988 |
| 剰余金         |          |                 |                 |
| 剰余金又は欠損金（ ） | *4       | 7,092,870,080   | 5,604,803,393   |
| 元本等合計       |          | 240,762,626,093 | 248,081,692,381 |
| 純資産合計       |          | 240,762,626,093 | 248,081,692,381 |
| 負債純資産合計     |          | 241,128,092,626 | 248,932,203,080 |

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                            |                                                                                                                            |
|----------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 株式<br>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法      | 先物取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。                         |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 計算期間の取扱い<br>当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年2月8日から平成24年2月7日まで及び平成24年2月8日から平成25年2月7日までとなっております。                  |

## （貸借対照表に関する注記）

| 区分                                            | 平成23年11月11日現在    | 平成24年5月11日現在     |
|-----------------------------------------------|------------------|------------------|
| *1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における<br>当該親投資信託の元本額 | 238,161,295,577円 | 247,855,496,173円 |
| 同期中追加設定元本額                                    | 28,283,273,132円  | 22,248,858,744円  |
| 同期中解約元本額                                      | 18,589,072,536円  | 27,627,465,929円  |
| 同期末における元本の内訳                                  |                  |                  |
| D I A M D C 国内株式インデックスファンド                    | 2,001,968,096円   | 3,071,101,694円   |
| D I A M国内株式パッシブ・ファンド                          | 1,107,810,227円   | 951,598,204円     |
| D I A M国内株式インデックスファンド＜D C年金＞                  | 33,474,588,948円  | 35,086,609,054円  |
| D I A Mバランス・ファンド＜D C年金＞ 1 安定型                 | 886,615,267円     | 885,719,560円     |
| D I A Mバランス・ファンド＜D C年金＞ 2 安定・成長型              | 3,188,190,756円   | 3,326,186,331円   |
| D I A Mバランス・ファンド＜D C年金＞ 3 成長型                 | 3,214,215,307円   | 3,402,461,782円   |
| D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド               | 505,311,526円     | 481,898,969円     |

|                                                  |                 |                 |
|--------------------------------------------------|-----------------|-----------------|
| D I A M D C バランス 5 0 イ<br>ンデックスファンド              | 1,502,524,838円  | 1,501,111,292円  |
| D I A M D C バランス 7 0 イ<br>ンデックスファンド              | 1,135,261,225円  | 1,168,180,895円  |
| マネックス資産設計ファンド<<br>隔月分配型>                         | 137,999,575円    | 135,861,366円    |
| マネックス資産設計ファンド<<br>育成型>                           | 1,442,846,477円  | 1,552,916,223円  |
| マネックス資産設計ファンド エ<br>ボリューション                       | 19,725,278円     | 20,199,214円     |
| D I A Mワールドバランス 2 5<br>V A（適格機関投資家限定）            | 273,108,368円    | 252,386,143円    |
| D I A Mグローバル・バランス<br>ファンド 2 5 V A（適格機関投<br>資家限定） | 11,129,211,000円 | 10,479,599,064円 |
| D I A Mグローバル・バランス<br>ファンド 5 0 V A（適格機関投<br>資家限定） | 1,826,318,810円  | 1,769,830,116円  |
| D I A M国際分散バランスファ<br>ンド 3 0 V A（適格機関投資家<br>限定）   | 217,373,414円    | 210,246,070円    |
| D I A M国際分散バランスファ<br>ンド 5 0 V A（適格機関投資家<br>限定）   | 834,966,854円    | 808,417,927円    |
| D I A M国内重視バランスファ<br>ンド 3 0 V A（適格機関投資家<br>限定）   | 225,642,197円    | 217,157,143円    |
| D I A M国内重視バランスファ<br>ンド 5 0 V A（適格機関投資家<br>限定）   | 300,612,095円    | 294,804,413円    |
| D I A M世界バランスファンド<br>4 0 V A（適格機関投資家限<br>定）      | 20,814,523,018円 | 20,106,152,214円 |
| D I A M世界バランスファンド<br>5 0 V A（適格機関投資家限<br>定）      | 6,894,479,039円  | 6,680,266,071円  |
| D I A Mバランスファンド 2 5<br>V A（適格機関投資家限定）            | 5,404,067,938円  | 5,133,321,584円  |
| D I A Mバランスファンド 3<br>7 . 5 V A（適格機関投資家限<br>定）    | 3,569,598,858円  | 3,354,851,251円  |
| D I A Mバランスファンド 5 0<br>V A（適格機関投資家限定）            | 8,261,677,880円  | 7,810,934,621円  |
| D I A Mグローバル・アセット<br>・バランス V A（適格機関投資<br>家限定）    | 1,260,106,197円  | 1,193,856,926円  |
| D I A Mグローバル・アセット<br>・バランス V A 2（適格機関投<br>資家限定）  | 2,747,767,918円  | 2,598,581,283円  |

|                                               |                  |                  |
|-----------------------------------------------|------------------|------------------|
| D I A M アクサ グローバル バランスファンド 3 0 V A（適格機関投資家限定） | 2,813,520,200円   | 2,625,842,041円   |
| D I A M世界アセットバランスファンド V A（適格機関投資家向け）          | 15,380,907,437円  | 14,787,788,592円  |
| D I A Mグローバルβ 私募ファンド（適格機関投資家向け）               | 222,287,324円     | 195,248,008円     |
| D I A M世界バランスファンド 5 5 V A（適格機関投資家限定）          | 5,088,611,566円   | 4,836,662,141円   |
| D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド 3 5 V A（適格機関投資家限定）    | 9,598,988,779円   | 9,168,068,072円   |
| D I A Mグローバル分散ファンド V A（適格機関投資家限定）             | 488,514,372円     | 464,973,729円     |
| D I A M世界アセットバランスファンド 2 V A（適格機関投資家限定）        | 43,277,058,571円  | 41,627,484,331円  |
| D I A M世界アセットバランスファンド 4 0 V A（適格機関投資家限定）      | 2,834,843,976円   | 2,660,054,789円   |
| D I A M世界アセットバランスファンド 2 5 V A（適格機関投資家限定）      | 5,321,649,222円   | 5,105,404,930円   |
| D I A M世界アセットバランスファンド 3 V A（適格機関投資家限定）        | 26,432,071,837円  | 25,400,926,586円  |
| D I A Mバランス 3 0 V A（適格機関投資家限定）                | 305,541,383円     | 286,177,645円     |
| D I A Mバランス 5 0 V A（適格機関投資家限定）                | 104,598円         | 103,361円         |
| D I A Mバランス 7 0 V A（適格機関投資家限定）                | 161,414円         | 161,209円         |
| D I A M世界アセットバランスファンド 4 V A（適格機関投資家限定）        | 23,130,047,733円  | 22,213,429,170円  |
| D I A M世界バランス 2 5 V A（適格機関投資家限定）              | 258,089,667円     | 297,203,780円     |
| D I A M国内バランス 3 0 V A（適格機関投資家限定）              | 92,459,986円      | 93,125,486円      |
| D I A Mバランス 2 0 V A（適格機関投資家限定）                | 233,878,920円     | 219,740,956円     |
| D I A Mバランス 4 0 V A（適格機関投資家限定）                | 99,089円          | 96,839円          |
| D I A Mバランス 6 0 V A（適格機関投資家限定）                | 148,993円         | 147,913円         |
| （合 計）                                         | 247,855,496,173円 | 242,476,888,988円 |

|                                          |                                                   |                   |
|------------------------------------------|---------------------------------------------------|-------------------|
| *2 差入代用有価証券                              | 株式 1,227,000,000円                                 | 株式 1,617,500,000円 |
| *3 本有価証券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受益権の総数 | 247,855,496,173口                                  | 242,476,888,988口  |
| *4 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7,092,870,080円であります。 | _____             |

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

| 区分                       | 自平成23年5月12日<br>至平成23年11月11日                                                                                                                                                                                                                                                                    | 自平成23年11月12日<br>至平成24年5月11日 |
|--------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。                                                                                                                                                                                                                    | 同左                          |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。<br>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。 | 同左                          |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | 運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。                                                                                                                                                                                 | 同左                          |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                         | 平成23年11月11日現在                                                                                                                                                                                              | 平成24年5月11日現在                                                     |
|----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。                                                                                                                                                     | 同左                                                               |
| 2. 時価の算定方法                 | (1)株式<br>「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。<br>(2)派生商品評価勘定<br>「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。<br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。                     | (1)株式<br>同左<br>(2)派生商品評価勘定<br>同左<br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>同左 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左                                                               |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

|     | 平成23年11月11日現在         | 平成24年5月11日現在          |
|-----|-----------------------|-----------------------|
| 種 類 | 当期の損益に含まれた<br>評価差額(円) | 当期の損益に含まれた<br>評価差額(円) |
| 株式  | 61,734,512,242        | 4,882,984,198         |
| 合計  | 61,734,512,242        | 4,882,984,198         |

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの特定期間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）

（株式関連）

| 平成23年11月11日現在 |                            |               |       |               |             |
|---------------|----------------------------|---------------|-------|---------------|-------------|
| 区分            | 種 類                        | 契約額等（円）       |       | 時価（円）         | 評価損益（円）     |
|               |                            |               | うち1年超 |               |             |
| 市場取引          | 株価指数先物取引<br>買建<br>TOPIX 先物 | 8,194,521,000 | -     | 7,962,440,000 | 232,597,321 |
| 合 計           |                            | 8,194,521,000 | -     | 7,962,440,000 | 232,597,321 |

| 平成24年5月11日現在 |                            |               |       |               |             |
|--------------|----------------------------|---------------|-------|---------------|-------------|
| 区分           | 種 類                        | 契約額等（円）       |       | 時価（円）         | 評価損益（円）     |
|              |                            |               | うち1年超 |               |             |
| 市場取引         | 株価指数先物取引<br>買建<br>TOPIX 先物 | 6,430,780,000 | -     | 5,738,040,000 | 693,239,699 |
| 合 計          |                            | 6,430,780,000 | -     | 5,738,040,000 | 693,239,699 |

（注）1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として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おります。

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（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口当たり情報に関する注記）

|              | 平成23年11月11日現在 | 平成24年5月11日現在 |
|--------------|---------------|--------------|
| 1口当たり純資産額    | 0.9714円       | 1.0231円      |
| （1万口当たり純資産額） | (9,714円)      | (10,231円)    |

[次へ](#)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

株 式

平成24年5月11日現在

| 銘 柄            | 株数        | 評価額（円）  |               | 備考 |
|----------------|-----------|---------|---------------|----|
|                |           | 単価      | 金額            |    |
| 極 洋            | 106,000   | 176     | 18,656,000    |    |
| 日本水産           | 304,400   | 248     | 75,491,200    |    |
| マルハニチロホールディングス | 523,000   | 128     | 66,944,000    |    |
| ハウスイ           | 20,000    | 100     | 2,000,000     |    |
| サカタのタネ         | 39,300    | 1,101   | 43,269,300    |    |
| ホクト            | 26,900    | 1,651   | 44,411,900    |    |
| ショーボンドHD       | 23,400    | 1,951   | 45,653,400    |    |
| ミライト・ホールディングス  | 75,300    | 559     | 42,092,700    |    |
| 住石ホールディングス     | 76,200    | 81      | 6,172,200     |    |
| 日鉄鉱業           | 67,000    | 311     | 20,837,000    |    |
| 三井松島           | 171,000   | 131     | 22,401,000    |    |
| 国際石油開発帝石       | 3,188     | 484,500 | 1,544,586,000 |    |
| 日本海洋掘削         | 6,500     | 2,116   | 13,754,000    |    |
| 関東天然瓦斯         | 27,000    | 409     | 11,043,000    |    |
| 石油資源開発         | 37,400    | 3,300   | 123,420,000   |    |
| ダイセキ環境ソリューション  | 22        | 147,000 | 3,234,000     |    |
| 間組             | 94,500    | 180     | 17,010,000    |    |
| 東急建設           | 93,720    | 175     | 16,401,000    |    |
| コムシスホールディングス   | 128,100   | 784     | 100,430,400   |    |
| ミサワホーム         | 25,300    | 928     | 23,478,400    |    |
| 高松コンストラクションGP  | 20,100    | 1,302   | 26,170,200    |    |
| 東建コーポレーション     | 9,810     | 2,755   | 27,026,550    |    |
| ヤマウラ           | 8,500     | 241     | 2,048,500     |    |
| 大成建設           | 1,329,000 | 183     | 243,207,000   |    |
| 大 林 組          | 787,000   | 315     | 247,905,000   |    |
| 清水建設           | 804,000   | 274     | 220,296,000   |    |
| 飛島建設           | 160,900   | 79      | 12,711,100    |    |
| 長谷工コーポレーション    | 1,637,500 | 53      | 86,787,500    |    |
| 松井建設           | 2,000     | 329     | 658,000       |    |
| 鹿島建設           | 1,231,000 | 208     | 256,048,000   |    |
| 不動テトラ          | 187,100   | 112     | 20,955,200    |    |
| 大末建設           | 100,000   | 45      | 4,500,000     |    |
| 鉄建建設           | 148,000   | 100     | 14,800,000    |    |
| 安藤建設           | 89,000    | 99      | 8,811,000     |    |
| 太平工業           | 46,000    | 385     | 17,710,000    |    |
| 西松建設           | 344,000   | 133     | 45,752,000    |    |
| 三井住友建設         | 167,400   | 52      | 8,704,800     |    |
| 大豊建設           | 69,000    | 91      | 6,279,000     |    |
| 前田建設           | 162,000   | 307     | 49,734,000    |    |
| 佐田建設           | 90,000    | 59      | 5,310,000     |    |

|           |         |       |             |  |
|-----------|---------|-------|-------------|--|
| ナカノフドー建設  | 20,500  | 147   | 3,013,500   |  |
| 奥 村 組     | 251,000 | 271   | 68,021,000  |  |
| 大和小田急建設   | 13,500  | 189   | 2,551,500   |  |
| 東鉄工業      | 34,000  | 875   | 29,750,000  |  |
| イチケン      | 29,000  | 137   | 3,973,000   |  |
| 浅沼組       | 81,000  | 59    | 4,779,000   |  |
| 戸田建設      | 283,000 | 230   | 65,090,000  |  |
| 熊 谷 組     | 190,000 | 71    | 13,490,000  |  |
| 青木あすなろ建設  | 19,000  | 423   | 8,037,000   |  |
| 北野建設      | 59,000  | 165   | 9,735,000   |  |
| 植 木 組     | 34,000  | 159   | 5,406,000   |  |
| 三井ホーム     | 35,000  | 410   | 14,350,000  |  |
| 矢作建設      | 33,100  | 359   | 11,882,900  |  |
| ピーエス三菱    | 16,700  | 336   | 5,611,200   |  |
| 大東建託      | 99,600  | 7,060 | 703,176,000 |  |
| 新日本建設     | 31,600  | 200   | 6,320,000   |  |
| N I P P O | 61,000  | 774   | 47,214,000  |  |
| 東亜道路      | 50,000  | 211   | 10,550,000  |  |
| 前田道路      | 76,000  | 889   | 67,564,000  |  |
| 日本道路      | 78,000  | 277   | 21,606,000  |  |
| 東亜建設      | 231,000 | 129   | 29,799,000  |  |
| 若築建設      | 143,000 | 77    | 11,011,000  |  |
| 東洋建設      | 408,000 | 67    | 27,336,000  |  |
| 五洋建設      | 333,500 | 210   | 70,035,000  |  |
| 大林道路      | 32,000  | 215   | 6,880,000   |  |
| 世紀東急      | 69,000  | 53    | 3,657,000   |  |
| 福 田 組     | 40,000  | 255   | 10,200,000  |  |
| 住友林業      | 180,900 | 694   | 125,544,600 |  |
| 日本基礎技術    | 29,600  | 286   | 8,465,600   |  |
| 日成ビルド工業   | 77,000  | 124   | 9,548,000   |  |
| エス・バイ・エル  | 133,000 | 153   | 20,349,000  |  |
| 巴コーポレーション | 34,000  | 291   | 9,894,000   |  |
| パナホーム     | 99,000  | 515   | 50,985,000  |  |
| 大和ハウス     | 654,000 | 986   | 644,844,000 |  |
| ライト工業     | 55,200  | 395   | 21,804,000  |  |
| 積水ハウス     | 738,000 | 695   | 512,910,000 |  |
| 日特建設      | 65,000  | 87    | 5,655,000   |  |
| 北陸電気工事    | 15,000  | 216   | 3,240,000   |  |
| ユアテック     | 37,000  | 330   | 12,210,000  |  |
| 西部電気工業    | 1,000   | 335   | 335,000     |  |
| 四電工       | 6,000   | 314   | 1,884,000   |  |
| 中電工       | 38,700  | 807   | 31,230,900  |  |
| 関 電 工     | 121,000 | 340   | 41,140,000  |  |
| きんでん      | 176,000 | 532   | 93,632,000  |  |
| 東京エネシス    | 27,000  | 414   | 11,178,000  |  |
| トーエネック    | 36,000  | 441   | 15,876,000  |  |
| 住友電設      | 18,400  | 547   | 10,064,800  |  |
| 日本電設工業    | 48,000  | 761   | 36,528,000  |  |

|                |         |         |             |  |
|----------------|---------|---------|-------------|--|
| 協和エクシオ         | 86,400  | 717     | 61,948,800  |  |
| 新日本空調          | 21,600  | 448     | 9,676,800   |  |
| 日本工営           | 83,000  | 277     | 22,991,000  |  |
| 日本電話施設         | 44,000  | 236     | 10,384,000  |  |
| 九電工            | 50,000  | 456     | 22,800,000  |  |
| 三機工業           | 61,000  | 416     | 25,376,000  |  |
| 日 揮            | 245,000 | 2,201   | 539,245,000 |  |
| 中外炉工業          | 85,000  | 249     | 21,165,000  |  |
| ヤマト            | 16,000  | 300     | 4,800,000   |  |
| 太平電業           | 34,000  | 635     | 21,590,000  |  |
| 高砂熱学           | 76,000  | 630     | 47,880,000  |  |
| 三晃金属           | 29,000  | 240     | 6,960,000   |  |
| N E C ネットズエスアイ | 22,300  | 1,264   | 28,187,200  |  |
| 朝日工業社          | 28,000  | 318     | 8,904,000   |  |
| アタカ大機          | 16,000  | 250     | 4,000,000   |  |
| 大 気 社          | 40,400  | 1,535   | 62,014,000  |  |
| ダイダン           | 25,000  | 469     | 11,725,000  |  |
| 日比谷総合設         | 32,800  | 832     | 27,289,600  |  |
| 東芝プラントシステム     | 43,000  | 872     | 37,496,000  |  |
| 日本製粉           | 162,000 | 342     | 55,404,000  |  |
| 日清製粉G本社        | 238,000 | 952     | 226,576,000 |  |
| 日東富士製粉         | 8,000   | 285     | 2,280,000   |  |
| 昭和産業           | 111,000 | 240     | 26,640,000  |  |
| 鳥越製粉           | 24,100  | 660     | 15,906,000  |  |
| 協同飼料           | 96,000  | 86      | 8,256,000   |  |
| 中部飼料           | 23,700  | 494     | 11,707,800  |  |
| 日本配合飼料         | 82,000  | 102     | 8,364,000   |  |
| 東洋精糖           | 42,000  | 87      | 3,654,000   |  |
| 日本甜菜糖          | 147,000 | 160     | 23,520,000  |  |
| 三井製糖           | 93,000  | 241     | 22,413,000  |  |
| ネクスト           | 9,500   | 368     | 3,496,000   |  |
| 日本M & A センター   | 9,700   | 2,395   | 23,231,500  |  |
| ノバレーゼ          | 63      | 52,600  | 3,313,800   |  |
| アコーディア・ゴルフ     | 994     | 56,000  | 55,664,000  |  |
| パソナグループ        | 242     | 68,400  | 16,552,800  |  |
| リンクアンドモチベーション  | 49      | 67,600  | 3,312,400   |  |
| エス・エム・エス       | 45      | 113,500 | 5,107,500   |  |
| テンプホールディングス    | 33,500  | 792     | 26,532,000  |  |
| クックパッド         | 4,800   | 2,208   | 10,598,400  |  |
| 森永製菓           | 261,000 | 180     | 46,980,000  |  |
| 中 村 屋          | 60,000  | 379     | 22,740,000  |  |
| 江崎グリコ          | 95,000  | 906     | 86,070,000  |  |
| 名糖産業           | 12,300  | 1,001   | 12,312,300  |  |
| 不 二 家          | 150,000 | 189     | 28,350,000  |  |
| 山崎製パン          | 192,000 | 1,134   | 217,728,000 |  |
| 第一屋製パン         | 39,000  | 79      | 3,081,000   |  |
| モロゾフ           | 42,000  | 272     | 11,424,000  |  |
| カルビー           | 19,000  | 4,530   | 86,070,000  |  |

|                   |           |         |             |
|-------------------|-----------|---------|-------------|
| 森永乳業              | 223,000   | 280     | 62,440,000  |
| ヤクルト              | 140,700   | 2,933   | 412,673,100 |
| 明治ホールディングス        | 77,800    | 3,405   | 264,909,000 |
| 雪印メグミルク           | 56,700    | 1,430   | 81,081,000  |
| プリマハム             | 147,000   | 141     | 20,727,000  |
| 日本ハム              | 200,000   | 1,000   | 200,000,000 |
| 伊藤ハム              | 145,000   | 313     | 45,385,000  |
| 林兼産業              | 86,000    | 70      | 6,020,000   |
| 丸大食品              | 126,000   | 307     | 38,682,000  |
| 米 久               | 23,400    | 813     | 19,024,200  |
| S F o o d s       | 17,000    | 688     | 11,696,000  |
| 学情                | 8,100     | 395     | 3,199,500   |
| スタジオアリス           | 11,200    | 1,363   | 15,265,600  |
| シミックホールディングス      | 9,300     | 1,289   | 11,987,700  |
| システナ              | 245       | 56,500  | 13,842,500  |
| N E C フィールドイング    | 19,800    | 969     | 19,186,200  |
| 新日鉄ソリューションズ       | 15,300    | 1,569   | 24,005,700  |
| 総合警備保障            | 89,100    | 985     | 87,763,500  |
| 日本駐車場開発           | 2,547     | 4,105   | 10,455,435  |
| コア                | 9,100     | 667     | 6,069,700   |
| カカクコム             | 37,900    | 2,398   | 90,884,200  |
| アイロムホールディングス      | 542       | 2,200   | 1,192,400   |
| ルネサンス             | 11,400    | 443     | 5,050,200   |
| 新日本科学             | 15,100    | 211     | 3,186,100   |
| ツクイ               | 7,400     | 1,044   | 7,725,600   |
| エムスリー             | 192       | 359,500 | 69,024,000  |
| ベストブライダル          | 53        | 86,800  | 4,600,400   |
| ディー・エヌ・エー         | 108,200   | 1,978   | 214,019,600 |
| 博報堂 D Y H L D G S | 31,060    | 4,800   | 149,088,000 |
| ぐるなび              | 17,000    | 863     | 14,671,000  |
| 一休                | 179       | 35,200  | 6,300,800   |
| ジャパンベストレスキュー S    | 37        | 73,100  | 2,704,700   |
| ジェイコムホールディングス     | 4,400     | 725     | 3,190,000   |
| P G M ホールディングス    | 344       | 60,000  | 20,640,000  |
| サッポロホールディングス      | 431,000   | 250     | 107,750,000 |
| アサヒグループホールディン     | 492,200   | 1,724   | 848,552,800 |
| キリン H D           | 1,052,000 | 926     | 974,152,000 |
| 宝ホールディングス         | 222,000   | 503     | 111,666,000 |
| オエノンホールディングス      | 70,000    | 192     | 13,440,000  |
| 養 命 酒             | 3,000     | 708     | 2,124,000   |
| 三国コカ・コ - ラ        | 28,400    | 699     | 19,851,600  |
| コカ・コーラウエスト        | 89,000    | 1,395   | 124,155,000 |
| コカコーラセントラルジャパン    | 30,200    | 1,018   | 30,743,600  |
| ダイドードリンコ          | 12,300    | 3,270   | 40,221,000  |
| 伊 藤 園             | 73,100    | 1,386   | 101,316,600 |
| キーコーヒー            | 23,500    | 1,445   | 33,957,500  |
| ユニカフェ             | 6,100     | 360     | 2,196,000   |
| ジャパンフーズ           | 3,700     | 864     | 3,196,800   |

|                |           |         |             |  |
|----------------|-----------|---------|-------------|--|
| 日清オイリオグループ     | 102,000   | 323     | 32,946,000  |  |
| 不二製油           | 64,000    | 1,060   | 67,840,000  |  |
| J - オイルミルズ     | 100,000   | 222     | 22,200,000  |  |
| ローソン           | 72,800    | 5,320   | 387,296,000 |  |
| インターニックス       | 9,500     | 347     | 3,296,500   |  |
| サンエー           | 7,900     | 3,110   | 24,569,000  |  |
| キリン堂           | 10,300    | 560     | 5,768,000   |  |
| ダイユーエイト        | 4,200     | 621     | 2,608,200   |  |
| カワチ薬品          | 16,100    | 1,783   | 28,706,300  |  |
| エービーシー・マート     | 32,800    | 2,826   | 92,692,800  |  |
| ハードオフコーポレーション  | 11,100    | 547     | 6,071,700   |  |
| 高千穂交易          | 10,200    | 846     | 8,629,200   |  |
| アスクル           | 15,800    | 1,065   | 16,827,000  |  |
| ゲオホールディングス     | 355       | 96,200  | 34,151,000  |  |
| ポイント           | 19,450    | 3,005   | 58,447,250  |  |
| シー・ヴィ・エス・バイエリア | 15,000    | 188     | 2,820,000   |  |
| 伊藤忠食品          | 5,900     | 2,948   | 17,393,200  |  |
| くらコーポレーション     | 12,000    | 1,063   | 12,756,000  |  |
| キャンドゥ          | 124       | 102,500 | 12,710,000  |  |
| エレマテック         | 15,400    | 1,105   | 17,017,000  |  |
| パル             | 6,700     | 3,635   | 24,354,500  |  |
| J A L U X      | 7,100     | 816     | 5,793,600   |  |
| エディオン          | 91,700    | 412     | 37,780,400  |  |
| あらた            | 52,000    | 414     | 21,528,000  |  |
| サーラコーポレーション    | 19,500    | 482     | 9,399,000   |  |
| トーマンデバイス       | 3,300     | 1,952   | 6,441,600   |  |
| J Pホールディングス    | 7,400     | 750     | 5,550,000   |  |
| あみやき亭          | 35        | 214,500 | 7,507,500   |  |
| 東京エレクトロンデバイス   | 48        | 140,000 | 6,720,000   |  |
| ひらまつ           | 95        | 73,100  | 6,944,500   |  |
| 双日             | 1,548,800 | 121     | 187,404,800 |  |
| ゲンキー           | 2,200     | 2,135   | 4,697,000   |  |
| アルフレッサホールディングス | 60,400    | 3,875   | 234,050,000 |  |
| ハニーズ           | 20,240    | 1,531   | 30,987,440  |  |
| キッコーマン         | 215,000   | 958     | 205,970,000 |  |
| 味の素            | 691,000   | 1,086   | 750,426,000 |  |
| キューピー          | 133,600   | 1,185   | 158,316,000 |  |
| ハウス食品          | 93,400    | 1,323   | 123,568,200 |  |
| カゴメ            | 101,700   | 1,576   | 160,279,200 |  |
| 焼津水産化工         | 13,100    | 740     | 9,694,000   |  |
| アリアケジャパン       | 24,200    | 1,644   | 39,784,800  |  |
| ニチレイ           | 295,000   | 351     | 103,545,000 |  |
| 横浜冷凍           | 58,300    | 598     | 34,863,400  |  |
| 東洋水産           | 113,000   | 2,032   | 229,616,000 |  |
| 日清食品H D        | 102,500   | 2,990   | 306,475,000 |  |
| 永谷園            | 7,000     | 891     | 6,237,000   |  |
| フジッコ           | 29,000    | 972     | 28,188,000  |  |
| ロックフィールド       | 13,800    | 1,432   | 19,761,600  |  |

|                 |           |         |               |  |
|-----------------|-----------|---------|---------------|--|
| 日本たばこ産業         | 5,814     | 434,500 | 2,526,183,000 |  |
| ケンコーマヨネーズ       | 7,900     | 627     | 4,953,300     |  |
| わらべや日洋          | 14,500    | 1,279   | 18,545,500    |  |
| なとり             | 13,200    | 852     | 11,246,400    |  |
| 片倉工業            | 31,100    | 700     | 21,770,000    |  |
| グ ン ゼ           | 183,000   | 202     | 36,966,000    |  |
| 昭 栄             | 42,300    | 269     | 11,378,700    |  |
| 神 栄             | 30,000    | 121     | 3,630,000     |  |
| 山下医科器械          | 2,200     | 1,017   | 2,237,400     |  |
| ラサ商事            | 10,500    | 415     | 4,357,500     |  |
| アルベン            | 17,600    | 1,586   | 27,913,600    |  |
| アルコニックス         | 6,000     | 1,623   | 9,738,000     |  |
| ビックカメラ          | 873       | 39,000  | 34,047,000    |  |
| D C Mホールディングス   | 119,300   | 580     | 69,194,000    |  |
| M o n o t a R O | 13,100    | 1,267   | 16,597,700    |  |
| あい ホールディングス     | 37,000    | 490     | 18,130,000    |  |
| J . フロント リテイリング | 545,000   | 386     | 210,370,000   |  |
| ドトール・日レスHD      | 36,900    | 1,027   | 37,896,300    |  |
| マツモトキヨシHLDGS    | 42,800    | 1,699   | 72,717,200    |  |
| スタートトゥデイ        | 41,800    | 1,165   | 48,697,000    |  |
| 物語コーポレーション      | 3,000     | 1,486   | 4,458,000     |  |
| ココカラファイン        | 24,000    | 2,504   | 60,096,000    |  |
| 三越伊勢丹HD         | 459,000   | 822     | 377,298,000   |  |
| 東洋紡績            | 1,037,000 | 107     | 110,959,000   |  |
| ユニチカ            | 545,000   | 42      | 22,890,000    |  |
| 富士紡ホールディングス     | 102,000   | 166     | 16,932,000    |  |
| 日清紡ホールディングス     | 156,000   | 684     | 106,704,000   |  |
| 倉敷紡績            | 253,000   | 143     | 36,179,000    |  |
| ダイワボウHD         | 224,000   | 146     | 32,704,000    |  |
| シキボウ            | 158,000   | 98      | 15,484,000    |  |
| 日東紡績            | 180,000   | 259     | 46,620,000    |  |
| トヨタ紡織           | 81,800    | 973     | 79,591,400    |  |
| クリエイトSDH        | 9,700     | 2,228   | 21,611,600    |  |
| バイタルKSKHD       | 43,500    | 662     | 28,797,000    |  |
| 八洲電機            | 15,800    | 345     | 5,451,000     |  |
| UKCホールディングス     | 13,700    | 1,095   | 15,001,500    |  |
| 丸善CHIHD         | 7,100     | 203     | 1,441,300     |  |
| TOKAIホールディングス   | 112,900   | 349     | 39,402,100    |  |
| 日本毛織            | 84,000    | 576     | 48,384,000    |  |
| 大東紡織            | 37,000    | 61      | 2,257,000     |  |
| トーア紡コーポレーション    | 111,000   | 52      | 5,772,000     |  |
| ダイドーリミテッド       | 30,800    | 595     | 18,326,000    |  |
| 東京建物不動産販        | 9,200     | 229     | 2,106,800     |  |
| 野村不動産HLDGS      | 110,700   | 1,294   | 143,245,800   |  |
| 常和ホールディングス      | 4,500     | 1,345   | 6,052,500     |  |
| ヒューリック          | 75,000    | 824     | 61,800,000    |  |
| 帝国繊維            | 26,000    | 619     | 16,094,000    |  |
| ブックオフコーポレーション   | 12,700    | 677     | 8,597,900     |  |

|               |           |         |               |  |
|---------------|-----------|---------|---------------|--|
| 日本コークス工業      | 197,000   | 101     | 19,897,000    |  |
| ミタチ産業         | 3,800     | 405     | 1,539,000     |  |
| あさひ           | 13,300    | 1,538   | 20,455,400    |  |
| 日本調剤          | 2,920     | 3,090   | 9,022,800     |  |
| コスモス薬品        | 10,200    | 4,640   | 47,328,000    |  |
| シップヘルスケアHD    | 30,000    | 2,068   | 62,040,000    |  |
| ソフトクリエイト      | 2,700     | 1,138   | 3,072,600     |  |
| セブン＆アイ・HLDGS  | 966,200   | 2,365   | 2,285,063,000 |  |
| ツルハホールディングス   | 19,000    | 4,790   | 91,010,000    |  |
| サンマルクホールディングス | 6,600     | 3,000   | 19,800,000    |  |
| フェリシモ         | 6,700     | 1,066   | 7,142,200     |  |
| トリドール         | 19,900    | 1,004   | 19,979,600    |  |
| クスリのアオキ       | 3,400     | 2,024   | 6,881,600     |  |
| 帝人            | 1,001,000 | 249     | 249,249,000   |  |
| 東レ            | 1,778,000 | 573     | 1,018,794,000 |  |
| クラレ           | 389,800   | 1,097   | 427,610,600   |  |
| 旭化成           | 1,427,000 | 473     | 674,971,000   |  |
| サカイオーベックス     | 69,000    | 129     | 8,901,000     |  |
| 稲葉製作所         | 11,600    | 1,015   | 11,774,000    |  |
| 宮地エンジニアリングG   | 76,000    | 127     | 9,652,000     |  |
| 三協・立山HLDGS    | 331,000   | 147     | 48,657,000    |  |
| トーカロ          | 13,800    | 1,360   | 18,768,000    |  |
| アルファCO        | 8,300     | 975     | 8,092,500     |  |
| SUMCO         | 149,800   | 707     | 105,908,600   |  |
| 川田テクノロジーズ     | 5,600     | 1,122   | 6,283,200     |  |
| 住江織物          | 62,000    | 145     | 8,990,000     |  |
| 日本フェルト        | 15,200    | 397     | 6,034,400     |  |
| イチカワ          | 14,000    | 152     | 2,128,000     |  |
| 日本バイリン        | 31,000    | 346     | 10,726,000    |  |
| エコナックホールディングス | 71,000    | 39      | 2,769,000     |  |
| 日東製網          | 28,000    | 133     | 3,724,000     |  |
| 芦森工業          | 59,000    | 95      | 5,605,000     |  |
| アツギ           | 192,000   | 92      | 17,664,000    |  |
| ダイニック         | 48,000    | 144     | 6,912,000     |  |
| 共和レザー         | 13,400    | 292     | 3,912,800     |  |
| セーレン          | 61,200    | 588     | 35,985,600    |  |
| 東海染工          | 34,000    | 84      | 2,856,000     |  |
| 小松精練          | 38,000    | 385     | 14,630,000    |  |
| ワコールホールディングス  | 146,000   | 880     | 128,480,000   |  |
| ホギメディカル       | 15,500    | 3,630   | 56,265,000    |  |
| レナウン          | 53,300    | 117     | 6,236,100     |  |
| クラウディア        | 2,900     | 955     | 2,769,500     |  |
| TSIホールディングス   | 109,200   | 361     | 39,421,200    |  |
| デジタルハーツ       | 25        | 169,400 | 4,235,000     |  |
| ITホールディングス    | 70,100    | 1,030   | 72,203,000    |  |
| ブライムワークス      | 50        | 60,200  | 3,010,000     |  |
| グリー           | 117,000   | 1,440   | 168,480,000   |  |
| コーエーテクモHD     | 45,900    | 642     | 29,467,800    |  |

|                |           |         |               |  |
|----------------|-----------|---------|---------------|--|
| 三菱総合研究所        | 9,000     | 1,653   | 14,877,000    |  |
| ボルテージ          | 3,600     | 926     | 3,333,600     |  |
| ネクソン           | 157,100   | 1,466   | 230,308,600   |  |
| 特種東海製紙         | 155,000   | 193     | 29,915,000    |  |
| ドワンゴ           | 119       | 102,200 | 12,161,800    |  |
| ベリサーブ          | 13        | 128,000 | 1,664,000     |  |
| マクロミル          | 22,500    | 824     | 18,540,000    |  |
| ティーガイア         | 148       | 137,600 | 20,364,800    |  |
| GMOペイメントゲートウェイ | 38        | 266,200 | 10,115,600    |  |
| ザッパラス          | 128       | 74,300  | 9,510,400     |  |
| インターネットイニシアティブ | 135       | 288,400 | 38,934,000    |  |
| ソネットエンタテインメント  | 130       | 313,500 | 40,755,000    |  |
| S R Aホールディングス  | 12,200    | 881     | 10,748,200    |  |
| 朝日ネット          | 20,000    | 368     | 7,360,000     |  |
| 王子製紙           | 1,083,000 | 344     | 372,552,000   |  |
| 三菱製紙           | 353,000   | 71      | 25,063,000    |  |
| 北越紀州製紙         | 152,000   | 480     | 72,960,000    |  |
| 中越パルプ          | 94,000    | 146     | 13,724,000    |  |
| 巴川製紙           | 41,000    | 162     | 6,642,000     |  |
| 大王製紙           | 103,000   | 438     | 45,114,000    |  |
| 日本製紙G本社        | 118,300   | 1,471   | 174,019,300   |  |
| レンゴー           | 197,000   | 576     | 113,472,000   |  |
| トーモク           | 78,000    | 244     | 19,032,000    |  |
| ザ・パック          | 14,500    | 1,346   | 19,517,000    |  |
| コ - プケミカル      | 38,000    | 95      | 3,610,000     |  |
| 昭和電工           | 1,524,000 | 174     | 265,176,000   |  |
| 住友化学           | 1,684,000 | 290     | 488,360,000   |  |
| 日本化成           | 48,000    | 118     | 5,664,000     |  |
| 住友精化           | 46,000    | 320     | 14,720,000    |  |
| 日産化学           | 186,800   | 694     | 129,639,200   |  |
| ラサ工業           | 99,000    | 102     | 10,098,000    |  |
| クレハ            | 159,000   | 351     | 55,809,000    |  |
| テイカ            | 43,000    | 271     | 11,653,000    |  |
| 石原産業           | 412,000   | 72      | 29,664,000    |  |
| 片倉チツカリン        | 13,000    | 206     | 2,678,000     |  |
| 日本曹達           | 146,000   | 313     | 45,698,000    |  |
| 東ソー            | 656,000   | 219     | 143,664,000   |  |
| トクヤマ           | 381,000   | 225     | 85,725,000    |  |
| セントラル硝子        | 235,000   | 313     | 73,555,000    |  |
| 東亜合成           | 307,000   | 318     | 97,626,000    |  |
| ダイソー           | 99,000    | 234     | 23,166,000    |  |
| 関東電化           | 55,000    | 233     | 12,815,000    |  |
| 電気化学           | 515,000   | 300     | 154,500,000   |  |
| イビデン           | 153,400   | 1,499   | 229,946,600   |  |
| 信越化学           | 439,600   | 4,185   | 1,839,726,000 |  |
| 日本カ - バイド      | 77,000    | 113     | 8,701,000     |  |
| 堺 化 学          | 77,000    | 258     | 19,866,000    |  |
| エア・ウォーター       | 202,000   | 967     | 195,334,000   |  |

|                 |           |         |             |  |
|-----------------|-----------|---------|-------------|--|
| 大陽日酸            | 322,000   | 498     | 160,356,000 |  |
| 日本化学工業          | 100,000   | 120     | 12,000,000  |  |
| 日本パ - カライジング    | 58,000    | 1,192   | 69,136,000  |  |
| 高压ガス            | 36,000    | 488     | 17,568,000  |  |
| チタン工業           | 27,000    | 262     | 7,074,000   |  |
| 四国化成            | 35,000    | 438     | 15,330,000  |  |
| 戸田工業            | 32,000    | 438     | 14,016,000  |  |
| ステラ ケミファ        | 11,700    | 1,762   | 20,615,400  |  |
| 保土谷化学           | 50,000    | 225     | 11,250,000  |  |
| 日本触媒            | 178,000   | 878     | 156,284,000 |  |
| 大日精化            | 89,000    | 346     | 30,794,000  |  |
| カネカ             | 305,000   | 468     | 142,740,000 |  |
| 協和発酵キリン         | 335,000   | 824     | 276,040,000 |  |
| 三菱瓦斯化学          | 421,000   | 537     | 226,077,000 |  |
| 三井化学            | 1,040,000 | 216     | 224,640,000 |  |
| J S R           | 223,100   | 1,520   | 339,112,000 |  |
| 東京応化工業          | 44,000    | 1,791   | 78,804,000  |  |
| 大阪有機化学          | 15,700    | 396     | 6,217,200   |  |
| 三菱ケミカルH L D G S | 1,532,500 | 384     | 588,480,000 |  |
| 日本合成化学          | 50,000    | 471     | 23,550,000  |  |
| ダイセル            | 318,000   | 515     | 163,770,000 |  |
| 住友ベ - クライト      | 210,000   | 415     | 87,150,000  |  |
| 積水化学            | 510,000   | 719     | 366,690,000 |  |
| 日本ゼオン           | 228,000   | 680     | 155,040,000 |  |
| アイカ工業           | 64,200    | 1,207   | 77,489,400  |  |
| 宇部興産            | 1,027,000 | 205     | 210,535,000 |  |
| 積水樹脂            | 35,000    | 792     | 27,720,000  |  |
| タキロン            | 58,000    | 260     | 15,080,000  |  |
| 旭有機材            | 89,000    | 198     | 17,622,000  |  |
| 日立化成            | 105,900   | 1,391   | 147,306,900 |  |
| ニチバン            | 22,000    | 250     | 5,500,000   |  |
| リケンテクノス         | 40,000    | 231     | 9,240,000   |  |
| 大倉工業            | 59,000    | 229     | 13,511,000  |  |
| 積水化成品           | 63,000    | 262     | 16,506,000  |  |
| 群栄化学            | 65,000    | 200     | 13,000,000  |  |
| タイガース ポリマー      | 11,900    | 312     | 3,712,800   |  |
| 日本カ - リット       | 20,600    | 391     | 8,054,600   |  |
| 日本化薬            | 173,000   | 764     | 132,172,000 |  |
| イーピーエス          | 145       | 186,100 | 26,984,500  |  |
| パナソニック電工I S     | 5,200     | 1,982   | 10,306,400  |  |
| フェイス            | 780       | 8,500   | 6,630,000   |  |
| アミューズ           | 6,800     | 1,016   | 6,908,800   |  |
| 野村総合研究所         | 130,700   | 1,737   | 227,025,900 |  |
| ドリームインキュベータ     | 77        | 71,500  | 5,505,500   |  |
| サイバネットシステム      | 188       | 20,000  | 3,760,000   |  |
| T A C           | 13,200    | 157     | 2,072,400   |  |
| ケネディクス          | 2,660     | 10,540  | 28,036,400  |  |
| 電通              | 222,400   | 2,366   | 526,198,400 |  |

|               |       |        |            |  |
|---------------|-------|--------|------------|--|
| インテージ         | 6,900 | 1,657  | 11,433,300 |  |
| テイクアンドギヴニーズ   | 1,042 | 8,910  | 9,284,220  |  |
| びあ            | 7,600 | 870    | 6,612,000  |  |
| シンプレクスホールディング | 385   | 27,700 | 10,664,500 |  |

[次へ](#)

平成24年5月11日現在

| 銘 柄             | 株数      | 評価額（円） |               | 備考 |
|-----------------|---------|--------|---------------|----|
|                 |         | 単価     | 金額            |    |
| イオンファンタジー       | 8,000   | 1,210  | 9,680,000     |    |
| ソースネクスト         | 59      | 16,490 | 972,910       |    |
| ネクシィーズ          | 952     | 1,883  | 1,792,616     |    |
| メディカルシステムネットワーク | 7,600   | 1,270  | 9,652,000     |    |
| 日本精化            | 21,100  | 525    | 11,077,500    |    |
| A D E K A       | 106,000 | 693    | 73,458,000    |    |
| 日油              | 191,000 | 387    | 73,917,000    |    |
| ミヨシ油脂           | 88,000  | 100    | 8,800,000     |    |
| ハリマ化成           | 21,200  | 479    | 10,154,800    |    |
| 花 王             | 650,200 | 2,100  | 1,365,420,000 |    |
| 第一工業製薬          | 45,000  | 225    | 10,125,000    |    |
| 三洋化成            | 78,000  | 493    | 38,454,000    |    |
| 武田薬品            | 918,200 | 3,400  | 3,121,880,000 |    |
| アステラス製薬         | 544,200 | 3,190  | 1,735,998,000 |    |
| 大日本住友製薬         | 173,800 | 786    | 136,606,800   |    |
| 塩野義製薬           | 382,900 | 1,000  | 382,900,000   |    |
| 田辺三菱製薬          | 244,700 | 1,122  | 274,553,400   |    |
| わかもと製薬          | 7,000   | 210    | 1,470,000     |    |
| あすか製薬           | 28,000  | 454    | 12,712,000    |    |
| 日本新薬            | 51,000  | 930    | 47,430,000    |    |
| 中外製薬            | 284,800 | 1,460  | 415,808,000   |    |
| 科研製薬            | 97,000  | 952    | 92,344,000    |    |
| エーザイ            | 301,900 | 3,195  | 964,570,500   |    |
| ロート製薬           | 103,000 | 975    | 100,425,000   |    |
| 小野薬品            | 119,900 | 4,460  | 534,754,000   |    |
| 久光製薬            | 76,100  | 3,515  | 267,491,500   |    |
| 有機合成薬品          | 18,000  | 206    | 3,708,000     |    |
| 持田製薬            | 84,000  | 918    | 77,112,000    |    |
| 参天製薬            | 82,300  | 2,921  | 240,398,300   |    |
| 扶桑薬品            | 84,000  | 221    | 18,564,000    |    |
| 日本ケミファ          | 37,000  | 419    | 15,503,000    |    |
| ツムラ             | 66,900  | 2,044  | 136,743,600   |    |
| 日医工             | 41,500  | 1,586  | 65,819,000    |    |
| テ ル モ           | 165,600 | 3,240  | 536,544,000   |    |
| みらかホールディングス     | 63,800  | 3,115  | 198,737,000   |    |
| キッセイ薬品工業        | 45,700  | 1,408  | 64,345,600    |    |
| 生化学工業           | 47,300  | 809    | 38,265,700    |    |
| 栄研化学            | 19,300  | 1,091  | 21,056,300    |    |
| 日水製薬            | 10,700  | 742    | 7,939,400     |    |
| 鳥居薬品            | 17,000  | 1,530  | 26,010,000    |    |
| 東和薬品            | 12,500  | 3,675  | 45,937,500    |    |
| 沢井製薬            | 16,100  | 8,330  | 134,113,000   |    |
| ゼリア新薬工業         | 35,000  | 1,434  | 50,190,000    |    |
| 第一三共            | 824,600 | 1,308  | 1,078,576,800 |    |

|                |         |         |               |
|----------------|---------|---------|---------------|
| キョーリン製薬HD      | 60,000  | 1,631   | 97,860,000    |
| 大幸薬品           | 11,500  | 747     | 8,590,500     |
| ダイト            | 6,900   | 1,171   | 8,079,900     |
| 大塚ホールディングス     | 486,400 | 2,393   | 1,163,955,200 |
| 大正製薬HD         | 59,000  | 6,480   | 382,320,000   |
| 大日本塗料          | 142,000 | 85      | 12,070,000    |
| 日本ペイント         | 232,000 | 639     | 148,248,000   |
| 関西ペイント         | 277,000 | 840     | 232,680,000   |
| トウベ            | 22,000  | 85      | 1,870,000     |
| 中国塗料           | 75,000  | 411     | 30,825,000    |
| 日本特殊塗料         | 18,700  | 324     | 6,058,800     |
| 藤倉化成           | 31,300  | 414     | 12,958,200    |
| 太陽ホールディングス     | 20,200  | 2,027   | 40,945,400    |
| D I C          | 935,000 | 166     | 155,210,000   |
| サカタインクス        | 46,000  | 373     | 17,158,000    |
| 東洋インキSCホールディン  | 221,000 | 295     | 65,195,000    |
| アルプス技研         | 11,200  | 606     | 6,787,200     |
| サニックス          | 35,100  | 215     | 7,546,500     |
| ダイオーズ          | 4,700   | 501     | 2,354,700     |
| 日本空調サービス       | 6,600   | 725     | 4,785,000     |
| オリエンタルランド      | 66,100  | 8,930   | 590,273,000   |
| ダスキン           | 72,400  | 1,544   | 111,785,600   |
| パーク24          | 120,100 | 1,160   | 139,316,000   |
| 明光ネットワークジャパン   | 22,400  | 761     | 17,046,400    |
| ファルコSDホールディングス | 13,400  | 883     | 11,832,200    |
| クレスコ           | 5,300   | 634     | 3,360,200     |
| フジ・メディア・HD     | 2,405   | 132,600 | 318,903,000   |
| 秀英予備校          | 5,000   | 305     | 1,525,000     |
| 田谷             | 4,300   | 671     | 2,885,300     |
| ラウンドワン         | 76,200  | 452     | 34,442,400    |
| リゾートトラスト       | 37,600  | 1,277   | 48,015,200    |
| オービック          | 7,230   | 16,170  | 116,909,100   |
| ティーディーシーソフトウェア | 4,700   | 735     | 3,454,500     |
| ヤフー            | 16,914  | 23,920  | 404,582,880   |
| ビー・エム・エル       | 16,000  | 2,077   | 33,232,000    |
| ワタベウェディング      | 7,400   | 697     | 5,157,800     |
| トレンドマイクロ       | 101,900 | 2,276   | 231,924,400   |
| もしもしホットライン     | 40,500  | 760     | 30,780,000    |
| 東急コミュニティー      | 6,400   | 2,542   | 16,268,800    |
| リソー教育          | 2,517   | 5,250   | 13,214,250    |
| 日本オラクル         | 46,100  | 3,020   | 139,222,000   |
| アルファシステムズ      | 7,600   | 1,161   | 8,823,600     |
| フューチャーアーキテクト   | 279     | 34,350  | 9,583,650     |
| ウェアハウス         | 5,100   | 220     | 1,122,000     |
| シーエーシー         | 15,900  | 662     | 10,525,800    |
| ソフトバンク・テクノ     | 5,400   | 816     | 4,406,400     |
| トーセ            | 6,000   | 537     | 3,222,000     |
| ユー・エス・エス       | 31,870  | 8,430   | 268,664,100   |

|                |         |         |             |
|----------------|---------|---------|-------------|
| オービックビジネスC     | 5,850   | 3,800   | 22,230,000  |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 27,200  | 3,870   | 105,264,000 |
| アイティフォー        | 26,100  | 291     | 7,595,100   |
| 東京個別指導学院       | 12,500  | 157     | 1,962,500   |
| 東計電算           | 4,200   | 1,047   | 4,397,400   |
| エクスネット         | 18      | 116,500 | 2,097,000   |
| テー・オー・ダブリュー    | 8,500   | 522     | 4,437,000   |
| 大塚商会           | 18,400  | 6,730   | 123,832,000 |
| 総合メディカル        | 5,600   | 3,110   | 17,416,000  |
| サイボウズ          | 421     | 23,920  | 10,070,320  |
| ソフトブレーン        | 337     | 8,210   | 2,766,770   |
| アグレックス         | 6,600   | 741     | 4,890,600   |
| セントラルスポーツ      | 7,800   | 1,051   | 8,197,800   |
| 電通国際情報S        | 14,200  | 595     | 8,449,000   |
| ウェザーニューズ       | 6,000   | 2,500   | 15,000,000  |
| C I J          | 23,300  | 340     | 7,922,000   |
| WOWOW          | 71      | 165,800 | 11,771,800  |
| フルキャストホールディングス | 223     | 15,000  | 3,345,000   |
| 富士フイルムHLDGS    | 523,500 | 1,635   | 855,922,500 |
| コニカミノルタHLDGS   | 618,000 | 634     | 391,812,000 |
| 資生堂            | 407,000 | 1,320   | 537,240,000 |
| ライオン           | 284,000 | 458     | 130,072,000 |
| 高砂香料           | 81,000  | 393     | 31,833,000  |
| マンダム           | 24,600  | 2,100   | 51,660,000  |
| ミルボン           | 13,200  | 2,343   | 30,927,600  |
| ファンケル          | 61,800  | 997     | 61,614,600  |
| コーセー           | 39,600  | 1,804   | 71,438,400  |
| ドクターシーラボ       | 166     | 338,500 | 56,191,000  |
| ポーラ・オルビスHD     | 25,000  | 2,329   | 58,225,000  |
| エスター           | 15,400  | 952     | 14,660,800  |
| コニシ            | 17,900  | 1,077   | 19,278,300  |
| 長谷川香料          | 31,500  | 1,107   | 34,870,500  |
| 小林製薬           | 34,000  | 4,320   | 146,880,000 |
| 荒川化学工業         | 19,600  | 671     | 13,151,600  |
| メック            | 17,700  | 289     | 5,115,300   |
| 日本高純度化学        | 71      | 198,000 | 14,058,000  |
| 荏原ユージライト       | 3,400   | 2,275   | 7,735,000   |
| アース製薬          | 17,700  | 2,884   | 51,046,800  |
| イハラケミカル        | 42,000  | 311     | 13,062,000  |
| 北興化学           | 11,000  | 231     | 2,541,000   |
| 大成ラミック         | 7,000   | 2,429   | 17,003,000  |
| クミアイ化学         | 57,000  | 330     | 18,810,000  |
| 日本農薬           | 56,000  | 342     | 19,152,000  |
| 昭和シェル石油        | 219,400 | 473     | 103,776,200 |
| コスモ石油          | 678,000 | 213     | 144,414,000 |
| 富士興産           | 82,000  | 62      | 5,084,000   |
| ニチレキ           | 33,000  | 363     | 11,979,000  |
| 東燃ゼネラル石油       | 370,000 | 723     | 267,510,000 |

|               |           |       |               |  |
|---------------|-----------|-------|---------------|--|
| ユシロ化学         | 13,500    | 811   | 10,948,500    |  |
| ビーピー・カストロール   | 9,800     | 333   | 3,263,400     |  |
| A O Cホールディングス | 56,900    | 406   | 23,101,400    |  |
| M O R E S C O | 5,400     | 860   | 4,644,000     |  |
| 出光興産          | 29,000    | 7,400 | 214,600,000   |  |
| J Xホールディングス   | 2,720,100 | 426   | 1,158,762,600 |  |
| 横浜ゴム          | 299,000   | 568   | 169,832,000   |  |
| 東洋ゴム          | 185,000   | 249   | 46,065,000    |  |
| ブリヂストン        | 768,200   | 1,815 | 1,394,283,000 |  |
| 住友ゴム          | 191,100   | 1,027 | 196,259,700   |  |
| 藤倉ゴム          | 15,100    | 280   | 4,228,000     |  |
| オカモト          | 88,000    | 320   | 28,160,000    |  |
| アキレス          | 200,000   | 102   | 20,400,000    |  |
| フ コ ク         | 10,300    | 831   | 8,559,300     |  |
| ニッタ           | 24,200    | 1,452 | 35,138,400    |  |
| クリエートメディック    | 7,000     | 804   | 5,628,000     |  |
| 東海ゴム工業        | 45,300    | 861   | 39,003,300    |  |
| 三ツ星ベルト        | 65,000    | 422   | 27,430,000    |  |
| バンドー化学        | 84,000    | 291   | 24,444,000    |  |
| 鬼怒川ゴム         | 54,000    | 517   | 27,918,000    |  |
| 旭 硝 子         | 1,207,000 | 578   | 697,646,000   |  |
| 日本板硝子         | 1,051,000 | 99    | 104,049,000   |  |
| 石塚硝子          | 31,000    | 133   | 4,123,000     |  |
| 有沢製作所         | 40,900    | 266   | 10,879,400    |  |
| 日本山村硝子        | 99,000    | 181   | 17,919,000    |  |
| 日本電気硝子        | 470,000   | 551   | 258,970,000   |  |
| オハラ           | 9,400     | 881   | 8,281,400     |  |
| 住友大阪セメント      | 497,000   | 224   | 111,328,000   |  |
| 太平洋セメント       | 1,439,000 | 174   | 250,386,000   |  |
| デイ・シイ         | 22,900    | 320   | 7,328,000     |  |
| リゾートソリューション   | 22,000    | 160   | 3,520,000     |  |
| 日本ヒュ - ム      | 25,000    | 333   | 8,325,000     |  |
| 日本コンクリ - ト    | 38,000    | 235   | 8,930,000     |  |
| 東海カーボン        | 213,000   | 380   | 80,940,000    |  |
| 日本カーボン        | 112,000   | 197   | 22,064,000    |  |
| 東洋炭素          | 12,100    | 2,675 | 32,367,500    |  |
| ノリタケ          | 127,000   | 219   | 27,813,000    |  |
| T O T O       | 379,000   | 547   | 207,313,000   |  |
| 日本碍子          | 319,000   | 891   | 284,229,000   |  |
| 日本特殊陶業        | 211,000   | 1,083 | 228,513,000   |  |
| ダントーホールディングス  | 37,000    | 81    | 2,997,000     |  |
| M A R U W A   | 7,200     | 2,796 | 20,131,200    |  |
| 品川リフラクトリーズ    | 62,000    | 191   | 11,842,000    |  |
| 黒崎播磨          | 53,000    | 209   | 11,077,000    |  |
| 東京窯業          | 31,000    | 187   | 5,797,000     |  |
| ニッカトー         | 9,000     | 479   | 4,311,000     |  |
| フジインコーポレーテッド  | 22,400    | 964   | 21,593,600    |  |
| エーアンドエーマテリアル  | 52,000    | 73    | 3,796,000     |  |

|                 |           |       |               |  |
|-----------------|-----------|-------|---------------|--|
| ニチアス            | 110,000   | 374   | 41,140,000    |  |
| 新日本製鐵           | 6,431,000 | 185   | 1,189,735,000 |  |
| 住友金属工業          | 4,541,000 | 134   | 608,494,000   |  |
| 神戸製鋼所           | 3,395,000 | 101   | 342,895,000   |  |
| 日新製鋼            | 868,000   | 107   | 92,876,000    |  |
| 中山製鋼所           | 123,000   | 60    | 7,380,000     |  |
| 合同製鐵            | 137,000   | 170   | 23,290,000    |  |
| J F Eホールディングス   | 580,400   | 1,343 | 779,477,200   |  |
| 東京製鐵            | 124,000   | 521   | 64,604,000    |  |
| 共英製鋼            | 26,100    | 1,428 | 37,270,800    |  |
| 大和工業            | 55,700    | 2,120 | 118,084,000   |  |
| 東京鐵鋼            | 48,000    | 240   | 11,520,000    |  |
| 大阪製鐵            | 15,400    | 1,353 | 20,836,200    |  |
| 淀川製鋼所           | 175,000   | 307   | 53,725,000    |  |
| 東洋鋼鈑            | 59,000    | 266   | 15,694,000    |  |
| 住友鋼管            | 14,200    | 710   | 10,082,000    |  |
| 丸一鋼管            | 75,200    | 1,704 | 128,140,800   |  |
| モリ工業            | 36,000    | 248   | 8,928,000     |  |
| 大同特殊鋼           | 410,000   | 515   | 211,150,000   |  |
| 日本高周波           | 97,000    | 91    | 8,827,000     |  |
| 日本金属工業          | 191,000   | 59    | 11,269,000    |  |
| 日本冶金工           | 180,000   | 116   | 20,880,000    |  |
| 山陽特殊製鋼          | 121,000   | 330   | 39,930,000    |  |
| 愛知製鋼            | 130,000   | 344   | 44,720,000    |  |
| 日立金属            | 160,000   | 947   | 151,520,000   |  |
| 日本金属            | 58,000    | 132   | 7,656,000     |  |
| 大平洋金属           | 171,000   | 354   | 60,534,000    |  |
| 日本電工            | 88,000    | 320   | 28,160,000    |  |
| 栗本鉄工所           | 117,000   | 170   | 19,890,000    |  |
| 日本鑄鉄管           | 26,000    | 168   | 4,368,000     |  |
| 日本製鋼所           | 378,000   | 456   | 172,368,000   |  |
| 三菱製鋼            | 148,000   | 211   | 31,228,000    |  |
| 日亜鋼業            | 38,000    | 202   | 7,676,000     |  |
| 日本精線            | 17,000    | 379   | 6,443,000     |  |
| 日本軽金属           | 555,000   | 110   | 61,050,000    |  |
| 大紀アルミニウム        | 38,000    | 220   | 8,360,000     |  |
| 三井金属            | 666,000   | 181   | 120,546,000   |  |
| 東邦亜鉛            | 138,000   | 305   | 42,090,000    |  |
| 三菱マテリアル         | 1,529,000 | 228   | 348,612,000   |  |
| 住友鉱山            | 634,000   | 978   | 620,052,000   |  |
| D O W Aホールディングス | 293,000   | 502   | 147,086,000   |  |
| 古河機金            | 416,000   | 69    | 28,704,000    |  |
| 大阪チタニウム         | 24,000    | 2,360 | 56,640,000    |  |
| 東邦チタニウム         | 39,700    | 1,008 | 40,017,600    |  |
| 住友軽金属           | 591,000   | 81    | 47,871,000    |  |
| 古河スカイ           | 99,000    | 226   | 22,374,000    |  |
| 古河電工            | 770,000   | 178   | 137,060,000   |  |
| 住友電工            | 865,500   | 1,034 | 894,927,000   |  |

|                 |         |       |             |  |
|-----------------|---------|-------|-------------|--|
| フジクラ            | 368,000 | 219   | 80,592,000  |  |
| 昭和電線H L D G S   | 319,000 | 69    | 22,011,000  |  |
| 東京特殊電線          | 33,000  | 79    | 2,607,000   |  |
| タツタ電線           | 46,000  | 436   | 20,056,000  |  |
| 日立電線            | 191,000 | 182   | 34,762,000  |  |
| 沖 電 線           | 27,000  | 147   | 3,969,000   |  |
| カナレ電気           | 3,300   | 1,365 | 4,504,500   |  |
| 平河ヒューテック        | 4,400   | 752   | 3,308,800   |  |
| リョービ            | 137,000 | 270   | 36,990,000  |  |
| アサヒH D          | 34,300  | 1,559 | 53,473,700  |  |
| 東洋製罐            | 173,300 | 1,010 | 175,033,000 |  |
| ホッカンホールディングス    | 60,000  | 229   | 13,740,000  |  |
| コロナ             | 11,300  | 1,046 | 11,819,800  |  |
| 横河ブリッジH L D G S | 51,000  | 512   | 26,112,000  |  |
| 日本橋梁            | 8,950   | 282   | 2,523,900   |  |
| 駒井ハルテック         | 47,000  | 221   | 10,387,000  |  |
| サクラダ            | 227,000 | 16    | 3,632,000   |  |
| 高田機工            | 22,000  | 166   | 3,652,000   |  |
| 三和ホールディングス      | 244,000 | 299   | 72,956,000  |  |
| 文化シャッター -       | 64,000  | 326   | 20,864,000  |  |
| 東洋シャッター -       | 7,200   | 378   | 2,721,600   |  |
| 住生活グループ         | 318,500 | 1,471 | 468,513,500 |  |
| 日本フィルコン         | 17,500  | 383   | 6,702,500   |  |
| ノーリツ            | 48,200  | 1,384 | 66,708,800  |  |
| 長府製作所           | 23,700  | 1,766 | 41,854,200  |  |
| リンナイ            | 39,400  | 5,620 | 221,428,000 |  |
| ユニプレス           | 37,500  | 2,387 | 89,512,500  |  |
| ダイニチ工業          | 12,500  | 691   | 8,637,500   |  |
| 日東精工            | 31,000  | 235   | 7,285,000   |  |
| 三洋工業            | 32,000  | 166   | 5,312,000   |  |
| 岡 部             | 48,400  | 510   | 24,684,000  |  |
| 日立ツール           | 14,400  | 783   | 11,275,200  |  |
| 中国工業            | 39,000  | 91    | 3,549,000   |  |
| 東 プ レ           | 47,400  | 742   | 35,170,800  |  |
| 高周波熱錬           | 32,700  | 709   | 23,184,300  |  |
| 東京製綱            | 154,000 | 148   | 22,792,000  |  |
| バイオラックス         | 10,500  | 1,917 | 20,128,500  |  |
| 日本発条            | 177,200 | 899   | 159,302,800 |  |
| 中央発條            | 28,000  | 291   | 8,148,000   |  |
| アドバネクス          | 48,000  | 79    | 3,792,000   |  |
| 三浦工業            | 36,500  | 2,032 | 74,168,000  |  |
| タ ク マ           | 83,000  | 333   | 27,639,000  |  |
| ツ ガ ミ           | 64,000  | 838   | 53,632,000  |  |
| オークマ            | 147,000 | 576   | 84,672,000  |  |
| 東芝機械            | 133,000 | 417   | 55,461,000  |  |
| ア マ ダ           | 346,000 | 511   | 176,806,000 |  |
| アイダエンジニア        | 63,400  | 436   | 27,642,400  |  |
| 牧野フライス          | 122,000 | 494   | 60,268,000  |  |

|               |           |        |               |  |
|---------------|-----------|--------|---------------|--|
| オーエスジー        | 107,900   | 1,179  | 127,214,100   |  |
| ダイジェット        | 29,000    | 167    | 4,843,000     |  |
| 旭ダイヤモンド       | 60,100    | 818    | 49,161,800    |  |
| 森精機製作所        | 129,100   | 772    | 99,665,200    |  |
| ディスコ          | 24,700    | 4,845  | 119,671,500   |  |
| 日東工器          | 14,400    | 1,769  | 25,473,600    |  |
| 豊田自動織機        | 213,100   | 2,256  | 480,753,600   |  |
| 豊和工業          | 128,000   | 82     | 10,496,000    |  |
| 大阪機工          | 95,000    | 111    | 10,545,000    |  |
| 石川製作所         | 53,000    | 71     | 3,763,000     |  |
| 東洋機械金属        | 18,200    | 227    | 4,131,400     |  |
| 津田駒工業         | 59,000    | 152    | 8,968,000     |  |
| エンシュウ         | 61,000    | 87     | 5,307,000     |  |
| 島精機製作所        | 32,000    | 1,301  | 41,632,000    |  |
| 日阪製作所         | 31,000    | 832    | 25,792,000    |  |
| やまびこ          | 9,600     | 1,200  | 11,520,000    |  |
| ペガサスミシン製造     | 22,700    | 185    | 4,199,500     |  |
| ナプテスコ         | 101,600   | 1,758  | 178,612,800   |  |
| 三井海洋開発        | 20,200    | 1,604  | 32,400,800    |  |
| レオン自動機        | 21,000    | 185    | 3,885,000     |  |
| S M C         | 73,100    | 13,110 | 958,341,000   |  |
| 新川            | 19,100    | 388    | 7,410,800     |  |
| ホソカワミクロン      | 41,000    | 447    | 18,327,000    |  |
| ユニオンツール       | 13,500    | 1,372  | 18,522,000    |  |
| オイレス工業        | 26,100    | 1,672  | 43,639,200    |  |
| サト - ホールディングス | 25,600    | 1,173  | 30,028,800    |  |
| 日本エアーテック      | 6,800     | 351    | 2,386,800     |  |
| 日精樹脂工業        | 19,600    | 392    | 7,683,200     |  |
| ワイエイシイ        | 9,800     | 601    | 5,889,800     |  |
| 小松製作所         | 1,143,100 | 2,052  | 2,345,641,200 |  |
| 住友重機械         | 625,000   | 377    | 235,625,000   |  |
| 日立建機          | 125,000   | 1,554  | 194,250,000   |  |
| 日 工           | 33,000    | 275    | 9,075,000     |  |
| 巴工業           | 9,200     | 1,747  | 16,072,400    |  |
| 井関農機          | 251,000   | 181    | 45,431,000    |  |
| T O W A       | 21,700    | 391    | 8,484,700     |  |
| 丸山製作所         | 56,000    | 149    | 8,344,000     |  |
| 北川鉄工所         | 113,000   | 139    | 15,707,000    |  |
| シンニッタン        | 21,000    | 491    | 10,311,000    |  |
| クボタ           | 1,121,000 | 719    | 805,999,000   |  |
| 荏原実業          | 6,200     | 1,254  | 7,774,800     |  |
| 東洋エンジニア       | 140,000   | 339    | 47,460,000    |  |
| 三菱化工機         | 76,000    | 148    | 11,248,000    |  |
| 月島機械          | 37,000    | 668    | 24,716,000    |  |
| 帝国電機製作所       | 8,300     | 1,450  | 12,035,000    |  |
| 東京機械          | 79,000    | 49     | 3,871,000     |  |
| 新東工業          | 53,500    | 839    | 44,886,500    |  |
| 渋谷工業          | 15,700    | 894    | 14,035,800    |  |

|               |         |        |             |  |
|---------------|---------|--------|-------------|--|
| アイチ コーポレーション  | 41,100  | 326    | 13,398,600  |  |
| 小森コーポレーション    | 69,500  | 662    | 46,009,000  |  |
| 鶴見製作所         | 14,000  | 670    | 9,380,000   |  |
| 住友精密          | 35,000  | 357    | 12,495,000  |  |
| 酒井重工業         | 46,000  | 293    | 13,478,000  |  |
| 荏原製作所         | 399,000 | 332    | 132,468,000 |  |
| 石井鉄工所         | 37,000  | 160    | 5,920,000   |  |
| 西島製作所         | 28,300  | 877    | 24,819,100  |  |
| 千代田化工建        | 208,000 | 935    | 194,480,000 |  |
| ダイキン工業        | 298,200 | 2,082  | 620,852,400 |  |
| オルガノ          | 47,000  | 500    | 23,500,000  |  |
| ト - ヨ - カネツ   | 131,000 | 168    | 22,008,000  |  |
| 栗田工業          | 135,100 | 1,838  | 248,313,800 |  |
| 椿本チエイン        | 125,000 | 458    | 57,250,000  |  |
| 大同工業          | 47,000  | 137    | 6,439,000   |  |
| 日本コンベヤ        | 78,000  | 75     | 5,850,000   |  |
| 日 機 装         | 76,000  | 809    | 61,484,000  |  |
| 木村化工機         | 22,600  | 296    | 6,689,600   |  |
| 新興プランテック      | 53,800  | 618    | 33,248,400  |  |
| アネスト岩田        | 37,000  | 374    | 13,838,000  |  |
| ダイフク          | 107,500 | 397    | 42,677,500  |  |
| 加藤製作所         | 55,000  | 381    | 20,955,000  |  |
| 油研工業          | 43,000  | 162    | 6,966,000   |  |
| タダノ           | 113,000 | 556    | 62,828,000  |  |
| フジテック         | 68,000  | 527    | 35,836,000  |  |
| シーケーディ        | 65,500  | 570    | 37,335,000  |  |
| キトー           | 99      | 63,800 | 6,316,200   |  |
| 平和            | 50,700  | 1,601  | 81,170,700  |  |
| 理想科学工業        | 16,800  | 1,171  | 19,672,800  |  |
| S A N K Y O   | 70,900  | 3,880  | 275,092,000 |  |
| 日本金銭機械        | 21,700  | 684    | 14,842,800  |  |
| マースエンジニアリング   | 13,200  | 1,802  | 23,786,400  |  |
| 福島工業          | 6,600   | 1,105  | 7,293,000   |  |
| オーイズミ         | 8,200   | 251    | 2,058,200   |  |
| ダイコク電機        | 10,800  | 1,123  | 12,128,400  |  |
| ア マ ノ         | 71,100  | 689    | 48,987,900  |  |
| J U K I       | 141,000 | 146    | 20,586,000  |  |
| サンデン          | 122,000 | 274    | 33,428,000  |  |
| 蛇の目ミシン        | 227,000 | 63     | 14,301,000  |  |
| ブラザー工業        | 302,400 | 965    | 291,816,000 |  |
| マックス          | 37,000  | 951    | 35,187,000  |  |
| モリタホールディングス   | 38,000  | 545    | 20,710,000  |  |
| グローリー         | 69,900  | 1,622  | 113,377,800 |  |
| 大和冷機工業        | 34,000  | 385    | 13,090,000  |  |
| セガサミーホールディングス | 251,500 | 1,585  | 398,627,500 |  |
| 日本ピストンリング     | 85,000  | 170    | 14,450,000  |  |
| リ ケ ン         | 85,000  | 333    | 28,305,000  |  |
| T P R         | 25,900  | 1,239  | 32,090,100  |  |

|              |           |         |               |  |
|--------------|-----------|---------|---------------|--|
| ホシザキ電機       | 47,200    | 1,913   | 90,293,600    |  |
| 大豊工業         | 16,500    | 957     | 15,790,500    |  |
| 日本精工         | 521,000   | 520     | 270,920,000   |  |
| N T N        | 542,000   | 281     | 152,302,000   |  |
| ジェイテクト       | 223,700   | 797     | 178,288,900   |  |
| 不二越          | 235,000   | 367     | 86,245,000    |  |
| ミネベア         | 348,000   | 336     | 116,928,000   |  |
| 日本トムソン       | 75,000    | 417     | 31,275,000    |  |
| T H K        | 155,500   | 1,585   | 246,467,500   |  |
| ユースン精機       | 11,700    | 1,778   | 20,802,600    |  |
| 前澤給装工業       | 9,200     | 1,050   | 9,660,000     |  |
| イーグル工業       | 29,000    | 721     | 20,909,000    |  |
| 前澤工業         | 17,200    | 223     | 3,835,600     |  |
| 日本ピラ - 工業    | 24,000    | 700     | 16,800,000    |  |
| キッツ          | 96,300    | 326     | 31,393,800    |  |
| 日立           | 5,393,000 | 501     | 2,701,893,000 |  |
| 東芝           | 4,927,000 | 314     | 1,547,078,000 |  |
| 三菱電機         | 2,341,000 | 636     | 1,488,876,000 |  |
| 富士電機         | 706,000   | 198     | 139,788,000   |  |
| 東洋電機製造       | 46,000    | 287     | 13,202,000    |  |
| 安川電機         | 275,000   | 649     | 178,475,000   |  |
| シンフォニアテクノロジー | 141,000   | 153     | 21,573,000    |  |
| 明電舎          | 232,000   | 261     | 60,552,000    |  |
| オリジン電気       | 34,000    | 303     | 10,302,000    |  |
| デンヨー         | 21,400    | 1,001   | 21,421,400    |  |
| 日立工機         | 62,700    | 666     | 41,758,200    |  |
| 三桜工業         | 29,800    | 620     | 18,476,000    |  |
| マキタ          | 152,600   | 2,978   | 454,442,800   |  |
| 東芝テック        | 147,000   | 306     | 44,982,000    |  |
| 芝浦メカトロニクス    | 42,000    | 190     | 7,980,000     |  |
| マブチモーター      | 31,900    | 3,235   | 103,196,500   |  |
| 日本電産         | 126,500   | 6,470   | 818,455,000   |  |
| 宮越ホールディングス   | 7,800     | 343     | 2,675,400     |  |
| 高岳製作所        | 92,000    | 170     | 15,640,000    |  |
| ダイヘン         | 138,000   | 244     | 33,672,000    |  |
| ヤーマン         | 1,800     | 1,200   | 2,160,000     |  |
| J V C ケンウッド  | 140,900   | 299     | 42,129,100    |  |
| 第一精工         | 7,300     | 1,658   | 12,103,400    |  |
| 日新電機         | 47,000    | 458     | 21,526,000    |  |
| 大崎電気         | 34,000    | 821     | 27,914,000    |  |
| オムロン         | 260,600   | 1,734   | 451,880,400   |  |
| 日東工業         | 34,400    | 1,108   | 38,115,200    |  |
| I D E C      | 30,800    | 756     | 23,284,800    |  |
| ジーエス・ユアサコーポ  | 451,000   | 360     | 162,360,000   |  |
| サクサホールディングス  | 59,000    | 144     | 8,496,000     |  |
| メルコホールディングス  | 12,900    | 1,779   | 22,949,100    |  |
| テクノメディカ      | 13        | 348,000 | 4,524,000     |  |
| 日本電気         | 3,218,000 | 123     | 395,814,000   |  |

|              |           |       |             |  |
|--------------|-----------|-------|-------------|--|
| 富士通          | 2,256,000 | 369   | 832,464,000 |  |
| 沖電気          | 903,000   | 121   | 109,263,000 |  |
| 岩崎通信機        | 105,000   | 68    | 7,140,000   |  |
| 電気興業         | 72,000    | 347   | 24,984,000  |  |
| サンケン電気       | 118,000   | 327   | 38,586,000  |  |
| ナカヨ通信機       | 23,000    | 327   | 7,521,000   |  |
| アイホン         | 13,800    | 1,545 | 21,321,000  |  |
| ルネサスエレクトロニクス | 60,500    | 325   | 19,662,500  |  |

[前へ](#) [次へ](#)

平成24年5月11日現在

| 銘 柄           | 株数        | 評価額（円）  |               | 備考 |
|---------------|-----------|---------|---------------|----|
|               |           | 単価      | 金額            |    |
| セイコーエプソン      | 159,600   | 922     | 147,151,200   |    |
| ワコム           | 461       | 185,700 | 85,607,700    |    |
| アルバック         | 46,600    | 451     | 21,016,600    |    |
| アクセル          | 10,900    | 1,553   | 16,927,700    |    |
| ピクセラ          | 9,700     | 172     | 1,668,400     |    |
| ナナオ           | 19,900    | 1,626   | 32,357,400    |    |
| 日本信号          | 54,600    | 503     | 27,463,800    |    |
| 京三製作所         | 51,000    | 328     | 16,728,000    |    |
| 能美防災          | 30,000    | 510     | 15,300,000    |    |
| ホーチキ          | 19,000    | 382     | 7,258,000     |    |
| 日本無線          | 50,000    | 177     | 8,850,000     |    |
| パナソニック        | 2,674,000 | 570     | 1,524,180,000 |    |
| シャープ          | 1,130,000 | 390     | 440,700,000   |    |
| アンリツ          | 120,000   | 950     | 114,000,000   |    |
| 富士通ゼネラル       | 55,000    | 660     | 36,300,000    |    |
| 日立国際電気        | 54,000    | 738     | 39,852,000    |    |
| ソ ニ ー         | 1,460,200 | 1,135   | 1,657,327,000 |    |
| T D K         | 122,400   | 3,690   | 451,656,000   |    |
| 帝国通信工業        | 57,000    | 122     | 6,954,000     |    |
| ミツミ電機         | 82,600    | 559     | 46,173,400    |    |
| タムラ製作所        | 78,000    | 207     | 16,146,000    |    |
| アルプス電気        | 184,600   | 629     | 116,113,400   |    |
| 池上通信機         | 76,000    | 61      | 4,636,000     |    |
| パイオニア         | 331,600   | 344     | 114,070,400   |    |
| 日本電波工業        | 18,100    | 988     | 17,882,800    |    |
| 日本トリム         | 2,700     | 1,941   | 5,240,700     |    |
| ローランド ディー．ジー． | 10,500    | 862     | 9,051,000     |    |
| 日本コロムビア       | 227,000   | 28      | 6,356,000     |    |
| フオスタ - 電機     | 22,100    | 1,290   | 28,509,000    |    |
| クラリオン         | 143,000   | 183     | 26,169,000    |    |
| S M K         | 75,000    | 244     | 18,300,000    |    |
| ヨコオ           | 18,300    | 454     | 8,308,200     |    |
| 東 光           | 106,000   | 231     | 24,486,000    |    |
| ティアック         | 127,000   | 31      | 3,937,000     |    |
| ホシデン          | 63,500    | 511     | 32,448,500    |    |
| ヒロセ電機         | 40,700    | 7,840   | 319,088,000   |    |
| 日本航空電子        | 54,000    | 731     | 39,474,000    |    |
| T O A         | 26,000    | 578     | 15,028,000    |    |
| ユニデン          | 69,000    | 226     | 15,594,000    |    |
| アルパイン         | 45,700    | 936     | 42,775,200    |    |
| スミダコーポレーション   | 14,600    | 426     | 6,219,600     |    |
| アイコム          | 13,100    | 1,906   | 24,968,600    |    |
| リオン           | 5,300     | 678     | 3,593,400     |    |
| 船井電機          | 21,000    | 1,394   | 29,274,000    |    |

|                     |         |        |               |  |
|---------------------|---------|--------|---------------|--|
| 横河電機                | 254,000 | 736    | 186,944,000   |  |
| 新電元工業               | 83,000  | 289    | 23,987,000    |  |
| アズビル                | 60,100  | 1,635  | 98,263,500    |  |
| 日本光電工業              | 46,600  | 2,301  | 107,226,600   |  |
| チ ノ ー               | 42,000  | 207    | 8,694,000     |  |
| 共和電業                | 3,000   | 253    | 759,000       |  |
| 日本電子材料              | 9,100   | 378    | 3,439,800     |  |
| 堀場製作所               | 43,300  | 2,908  | 125,916,400   |  |
| アドバンテスト             | 174,000 | 1,303  | 226,722,000   |  |
| 小野測器                | 26,000  | 310    | 8,060,000     |  |
| エスベック               | 24,200  | 688    | 16,649,600    |  |
| パナソニック電工 S U N X    | 20,900  | 366    | 7,649,400     |  |
| キーエンス               | 57,400  | 18,270 | 1,048,698,000 |  |
| 日置電機                | 11,400  | 1,466  | 16,712,400    |  |
| シスメックス              | 82,400  | 3,125  | 257,500,000   |  |
| メガチップス              | 19,200  | 1,634  | 31,372,800    |  |
| O B A R A G R O U P | 16,700  | 936    | 15,631,200    |  |
| 日本電産コパル電子           | 24,500  | 441    | 10,804,500    |  |
| ミヤチテクノス             | 10,700  | 572    | 6,120,400     |  |
| 東京電波                | 7,000   | 354    | 2,478,000     |  |
| 澤藤電機                | 13,000  | 224    | 2,912,000     |  |
| デンソー                | 578,200 | 2,553  | 1,476,144,600 |  |
| コーセル                | 34,100  | 1,165  | 39,726,500    |  |
| 日立メディコ              | 17,000  | 1,153  | 19,601,000    |  |
| 新日本無線               | 14,000  | 206    | 2,884,000     |  |
| オブテックス              | 16,200  | 1,131  | 18,322,200    |  |
| 千代田インテグレ            | 11,500  | 985    | 11,327,500    |  |
| 東光電気                | 15,000  | 316    | 4,740,000     |  |
| スタンレー電気             | 156,900 | 1,244  | 195,183,600   |  |
| 岩崎電気                | 86,000  | 142    | 12,212,000    |  |
| ウシオ電機               | 142,000 | 963    | 136,746,000   |  |
| 岡谷電機                | 13,200  | 306    | 4,039,200     |  |
| ヘリオステクノH            | 20,000  | 132    | 2,640,000     |  |
| 日本セラミック             | 15,400  | 1,316  | 20,266,400    |  |
| 日本デジタル研究所           | 19,700  | 846    | 16,666,200    |  |
| 古河電池                | 17,000  | 457    | 7,769,000     |  |
| 双信電機                | 11,700  | 322    | 3,767,400     |  |
| 山一電機                | 23,800  | 180    | 4,284,000     |  |
| 図 研                 | 15,500  | 590    | 9,145,000     |  |
| 日本電子                | 88,000  | 224    | 19,712,000    |  |
| カ シ オ               | 223,000 | 499    | 111,277,000   |  |
| ファナック               | 243,700 | 13,360 | 3,255,832,000 |  |
| 日本シイエムケイ            | 50,300  | 344    | 17,303,200    |  |
| エンプラス               | 11,800  | 2,138  | 25,228,400    |  |
| ロ ー ム               | 115,300 | 3,340  | 385,102,000   |  |
| 浜松ホトニクス             | 91,300  | 2,994  | 273,352,200   |  |
| 三井ハイテック             | 30,900  | 438    | 13,534,200    |  |
| 新光電気工業              | 78,400  | 679    | 53,233,600    |  |

|            |           |       |               |   |
|------------|-----------|-------|---------------|---|
| 京 セ ラ      | 194,600   | 7,370 | 1,434,202,000 |   |
| 協栄産業       | 29,000    | 139   | 4,031,000     |   |
| 太陽誘電       | 105,000   | 757   | 79,485,000    |   |
| 村田製作所      | 245,500   | 4,300 | 1,055,650,000 |   |
| ユーシン       | 32,600    | 562   | 18,321,200    |   |
| 双葉電子工業     | 40,100    | 1,209 | 48,480,900    |   |
| 日東電工       | 202,000   | 3,320 | 670,640,000   |   |
| 北陸電気工業     | 96,000    | 97    | 9,312,000     |   |
| 東海理化電機     | 54,800    | 1,420 | 77,816,000    |   |
| ニチコン       | 73,600    | 808   | 59,468,800    |   |
| 日本ケミコン     | 134,000   | 245   | 32,830,000    |   |
| K O A      | 29,500    | 744   | 21,948,000    |   |
| 三井造船       | 906,000   | 112   | 101,472,000   |   |
| 日立造船       | 926,000   | 101   | 93,526,000    |   |
| 佐世保重工業     | 153,000   | 111   | 16,983,000    |   |
| 三菱重工業      | 3,923,000 | 330   | 1,294,590,000 |   |
| 川崎重工業      | 1,700,000 | 209   | 355,300,000   |   |
| I H I      | 1,599,000 | 170   | 271,830,000   |   |
| 日本車輛       | 86,000    | 285   | 24,510,000    |   |
| 日本輸送機      | 30,000    | 231   | 6,930,000     |   |
| 近畿車輛       | 35,000    | 268   | 9,380,000     |   |
| 島根銀行       | 5,100     | 1,104 | 5,630,400     |   |
| 日産自動車      | 2,977,800 | 804   | 2,394,151,200 |   |
| いすゞ自動車     | 1,480,000 | 464   | 686,720,000   |   |
| トヨタ自動車     | 3,035,100 | 3,235 | 9,818,548,500 | * |
| 日野自動車      | 334,000   | 560   | 187,040,000   |   |
| 三菱自動車工業    | 5,235,000 | 83    | 434,505,000   |   |
| エフテック      | 8,100     | 1,440 | 11,664,000    |   |
| 武蔵精密工業     | 22,700    | 1,802 | 40,905,400    |   |
| 日産車体       | 69,000    | 813   | 56,097,000    |   |
| 新明和工業      | 105,000   | 361   | 37,905,000    |   |
| 極東開発工業     | 40,400    | 740   | 29,896,000    |   |
| 日信工業       | 42,800    | 1,251 | 53,542,800    |   |
| トピー工業      | 175,000   | 240   | 42,000,000    |   |
| ティラド       | 85,000    | 289   | 24,565,000    |   |
| 曙ブレーキ      | 118,800   | 365   | 43,362,000    |   |
| タチエス       | 30,600    | 1,429 | 43,727,400    |   |
| N O K      | 113,200   | 1,619 | 183,270,800   |   |
| フタバ産業      | 66,500    | 395   | 26,267,500    |   |
| カヤバ工業      | 162,000   | 417   | 67,554,000    |   |
| シロキ工業      | 52,000    | 243   | 12,636,000    |   |
| 市光工業       | 57,000    | 144   | 8,208,000     |   |
| 大同メタル工業    | 36,000    | 892   | 32,112,000    |   |
| プレス工業      | 108,000   | 456   | 49,248,000    |   |
| カルソニックカンセイ | 139,000   | 453   | 62,967,000    |   |
| 太平洋工業      | 48,000    | 490   | 23,520,000    |   |
| ケーヒン       | 48,300    | 1,346 | 65,011,800    |   |
| 河西工業       | 29,000    | 474   | 13,746,000    |   |

|            |           |       |               |  |
|------------|-----------|-------|---------------|--|
| アイシン精機     | 192,700   | 2,740 | 527,998,000   |  |
| 富士機工       | 27,000    | 282   | 7,614,000     |  |
| マ ッ ダ      | 3,139,000 | 114   | 357,846,000   |  |
| ダイハツ       | 217,000   | 1,492 | 323,764,000   |  |
| 今仙電機製作所    | 17,200    | 1,100 | 18,920,000    |  |
| 本田技研       | 1,974,700 | 2,752 | 5,434,374,400 |  |
| スズキ        | 489,300   | 1,780 | 870,954,000   |  |
| 富士重工業      | 739,000   | 638   | 471,482,000   |  |
| ヤマハ発動機     | 381,200   | 916   | 349,179,200   |  |
| ショーワ       | 49,700    | 679   | 33,746,300    |  |
| 小糸製作所      | 117,000   | 1,157 | 135,369,000   |  |
| T B K      | 24,000    | 530   | 12,720,000    |  |
| エクセディ      | 31,800    | 1,987 | 63,186,600    |  |
| ミツバ        | 43,000    | 598   | 25,714,000    |  |
| 豊田合成       | 66,100    | 1,635 | 108,073,500   |  |
| 愛三工業       | 24,300    | 739   | 17,957,700    |  |
| ヨ ロ ズ      | 14,100    | 1,532 | 21,601,200    |  |
| エフ・シー・シー   | 38,300    | 1,614 | 61,816,200    |  |
| 新家工業       | 53,000    | 118   | 6,254,000     |  |
| シマノ        | 87,600    | 4,900 | 429,240,000   |  |
| タカタ        | 42,300    | 1,837 | 77,705,100    |  |
| テイ・エス テック  | 49,400    | 1,551 | 76,619,400    |  |
| 小 野 建      | 20,300    | 600   | 12,180,000    |  |
| はるやま商事     | 9,800     | 550   | 5,390,000     |  |
| 佐島電機       | 17,600    | 479   | 8,430,400     |  |
| カップクリエイト   | 17,000    | 1,701 | 28,917,000    |  |
| エコートレーディング | 5,900     | 702   | 4,141,800     |  |
| 伯東         | 14,300    | 751   | 10,739,300    |  |
| コンドーテック    | 16,600    | 512   | 8,499,200     |  |
| 中山福        | 13,900    | 599   | 8,326,100     |  |
| ライトオン      | 17,200    | 636   | 10,939,200    |  |
| ナガイレーベン    | 30,600    | 1,206 | 36,903,600    |  |
| ジーンズメイト    | 7,800     | 205   | 1,599,000     |  |
| 三菱食品       | 21,200    | 1,910 | 40,492,000    |  |
| 良品計画       | 24,400    | 4,190 | 102,236,000   |  |
| 三城ホールディングス | 28,700    | 443   | 12,714,100    |  |
| 松田産業       | 17,100    | 1,170 | 20,007,000    |  |
| メディバルHD    | 248,700   | 1,034 | 257,155,800   |  |
| アドヴァン      | 14,100    | 806   | 11,364,600    |  |
| S P K      | 5,800     | 1,385 | 8,033,000     |  |
| アズワン       | 15,100    | 1,651 | 24,930,100    |  |
| スズデン       | 8,000     | 497   | 3,976,000     |  |
| 尾家産業       | 6,800     | 804   | 5,467,200     |  |
| シモジマ       | 14,300    | 971   | 13,885,300    |  |
| ドウシシャ      | 11,000    | 2,226 | 24,486,000    |  |
| コナカ        | 27,100    | 868   | 23,522,800    |  |
| 高速         | 13,900    | 700   | 9,730,000     |  |
| ハウス ローゼ    | 2,900     | 1,240 | 3,596,000     |  |

|                |         |         |             |  |
|----------------|---------|---------|-------------|--|
| G - 7 ホールディングス | 6,000   | 400     | 2,400,000   |  |
| イオン北海道         | 14,900  | 357     | 5,319,300   |  |
| コジマ            | 30,800  | 420     | 12,936,000  |  |
| コーナン商事         | 25,000  | 1,092   | 27,300,000  |  |
| 黒田電気           | 28,600  | 829     | 23,709,400  |  |
| ネットワンシステムズ     | 104,100 | 1,130   | 117,633,000 |  |
| エコス            | 8,900   | 505     | 4,494,500   |  |
| ワタミ            | 27,300  | 1,645   | 44,908,500  |  |
| マルシェ           | 6,400   | 726     | 4,646,400   |  |
| ドン・キホーテ        | 61,600  | 2,918   | 179,748,800 |  |
| 丸文             | 18,500  | 367     | 6,789,500   |  |
| メガネトップ         | 33,000  | 912     | 30,096,000  |  |
| 西松屋チェーン        | 50,500  | 642     | 32,421,000  |  |
| ゼンショーホールディングス  | 87,900  | 1,018   | 89,482,200  |  |
| ハピネット          | 12,200  | 781     | 9,528,200   |  |
| 幸楽苑            | 14,500  | 1,212   | 17,574,000  |  |
| トーメンエレクトロニクス   | 10,600  | 1,136   | 12,041,600  |  |
| ハークスレイ         | 5,700   | 496     | 2,827,200   |  |
| サイゼリヤ          | 34,100  | 1,197   | 40,817,700  |  |
| エクセル           | 10,700  | 740     | 7,918,000   |  |
| マルカキカイ         | 7,600   | 869     | 6,604,400   |  |
| アルゴグラフィックス     | 8,700   | 1,112   | 9,674,400   |  |
| ガリバーインターナショナル  | 7,020   | 2,833   | 19,887,660  |  |
| 日本エム・ディ・エム     | 19,600  | 232     | 4,547,200   |  |
| ポプラ            | 6,700   | 485     | 3,249,500   |  |
| ユナイテッドアローズ     | 24,800  | 1,776   | 44,044,800  |  |
| 進和             | 14,000  | 916     | 12,824,000  |  |
| エスケイジャパン       | 5,500   | 251     | 1,380,500   |  |
| ダイトエレクトロン      | 10,800  | 378     | 4,082,400   |  |
| ハイデイ日高         | 12,200  | 1,205   | 14,701,000  |  |
| シークス           | 14,600  | 1,239   | 18,089,400  |  |
| 京都きもの友禅        | 15,500  | 945     | 14,647,500  |  |
| コロワイド          | 77,000  | 583     | 44,891,000  |  |
| 田中商事           | 7,700   | 442     | 3,403,400   |  |
| オーハシテクニカ       | 12,700  | 553     | 7,023,100   |  |
| 壱番屋            | 9,400   | 2,474   | 23,255,600  |  |
| マクニカ           | 11,800  | 1,853   | 21,865,400  |  |
| 白銅             | 7,900   | 722     | 5,703,800   |  |
| トップカルチャー       | 8,700   | 372     | 3,236,400   |  |
| スギホールディングス     | 41,400  | 2,519   | 104,286,600 |  |
| 島津製作所          | 280,000 | 712     | 199,360,000 |  |
| J M S          | 36,000  | 255     | 9,180,000   |  |
| クボテック          | 52      | 18,700  | 972,400     |  |
| モリテックス         | 5,300   | 272     | 1,441,600   |  |
| 長野計器           | 16,800  | 678     | 11,390,400  |  |
| ブイ・テクノロジー      | 41      | 204,000 | 8,364,000   |  |
| スター精密          | 37,800  | 848     | 32,054,400  |  |
| 東京計器           | 81,000  | 157     | 12,717,000  |  |

|                |           |         |               |
|----------------|-----------|---------|---------------|
| 愛知時計           | 26,000    | 290     | 7,540,000     |
| 日本電産トーソク       | 11,400    | 738     | 8,413,200     |
| 東京精密           | 42,000    | 1,598   | 67,116,000    |
| ニコン            | 407,800   | 2,474   | 1,008,897,200 |
| トプコン           | 54,000    | 606     | 32,724,000    |
| オリンパス          | 276,000   | 1,130   | 311,880,000   |
| 理研計器           | 19,400    | 541     | 10,495,400    |
| 大日本スクリーン       | 221,000   | 665     | 146,965,000   |
| キヤノン電子         | 21,500    | 1,887   | 40,570,500    |
| タムロン           | 20,000    | 2,482   | 49,640,000    |
| HOYA           | 569,000   | 1,788   | 1,017,372,000 |
| ノーリツ鋼機         | 21,400    | 395     | 8,453,000     |
| エー・アンド・デイ      | 23,000    | 299     | 6,877,000     |
| キヤノン           | 1,453,900 | 3,465   | 5,037,763,500 |
| リコー            | 704,000   | 642     | 451,968,000   |
| 日本電産コパル        | 18,400    | 881     | 16,210,400    |
| 日本電産サンキョー      | 56,000    | 439     | 24,584,000    |
| シチズンホールディングス   | 280,100   | 469     | 131,366,900   |
| リズム時計          | 107,000   | 128     | 13,696,000    |
| 大研医器           | 3,100     | 892     | 2,765,200     |
| パラマウントベッドHD    | 20,100    | 2,460   | 49,446,000    |
| SHO-BI         | 4,900     | 479     | 2,347,100     |
| 永大産業           | 31,000    | 328     | 10,168,000    |
| ダンロップスポーツ      | 15,000    | 941     | 14,115,000    |
| バンダイナムコHLDGS   | 241,900   | 975     | 235,852,500   |
| 共立印刷           | 27,100    | 230     | 6,233,000     |
| フランスベッドHLDGS   | 157,000   | 145     | 22,765,000    |
| パイロットコーポレーション  | 205       | 149,500 | 30,647,500    |
| エイベックス・グループHD  | 43,600    | 952     | 41,507,200    |
| トッパン・フォームズ     | 50,100    | 656     | 32,865,600    |
| フジシールインターナショナル | 26,200    | 1,542   | 40,400,400    |
| タカラトミー         | 76,900    | 558     | 42,910,200    |
| 廣済堂            | 19,800    | 395     | 7,821,000     |
| アーク            | 80,000    | 76      | 6,080,000     |
| レック            | 7,300     | 1,034   | 7,548,200     |
| タカノ            | 9,200     | 426     | 3,919,200     |
| プロネクス          | 26,300    | 483     | 12,702,900    |
| ホクシン           | 17,600    | 188     | 3,308,800     |
| ウッドワン          | 40,000    | 317     | 12,680,000    |
| 大建工業           | 96,000    | 241     | 23,136,000    |
| きもと            | 20,000    | 445     | 8,900,000     |
| 凸版印刷           | 712,000   | 495     | 352,440,000   |
| 大日本印刷          | 713,000   | 637     | 454,181,000   |
| 図書印刷           | 38,000    | 143     | 5,434,000     |
| 共同印刷           | 79,000    | 198     | 15,642,000    |
| 日本写真印刷         | 39,300    | 831     | 32,658,300    |
| 光村印刷           | 3,000     | 250     | 750,000       |
| 藤森工業           | 17,700    | 1,441   | 25,505,700    |

|                   |           |       |               |  |
|-------------------|-----------|-------|---------------|--|
| 宝印刷               | 13,700    | 633   | 8,672,100     |  |
| 前澤化成工業            | 17,400    | 890   | 15,486,000    |  |
| アシックス             | 217,800   | 815   | 177,507,000   |  |
| ツ ツ ミ             | 11,700    | 2,247 | 26,289,900    |  |
| ジェイ エス ピー         | 16,000    | 1,091 | 17,456,000    |  |
| ニ チ ハ             | 27,200    | 954   | 25,948,800    |  |
| ローランド             | 24,200    | 705   | 17,061,000    |  |
| エフピコ              | 10,900    | 5,010 | 54,609,000    |  |
| 小松ウオール工業          | 8,900     | 975   | 8,677,500     |  |
| ヤマハ               | 172,000   | 749   | 128,828,000   |  |
| 河合楽器              | 87,000    | 171   | 14,877,000    |  |
| クリナップ             | 27,400    | 519   | 14,220,600    |  |
| ビジョン              | 20,600    | 3,130 | 64,478,000    |  |
| 天馬                | 19,600    | 844   | 16,542,400    |  |
| 兼松日産農林            | 37,000    | 140   | 5,180,000     |  |
| キングジム             | 19,900    | 671   | 13,352,900    |  |
| リンテック             | 44,400    | 1,453 | 64,513,200    |  |
| T A S A K I       | 5,000     | 345   | 1,725,000     |  |
| 信越ポリマー            | 48,200    | 372   | 17,930,400    |  |
| 東 リ               | 62,000    | 148   | 9,176,000     |  |
| イトーキ              | 49,000    | 479   | 23,471,000    |  |
| 任 天 堂             | 133,800   | 9,750 | 1,304,550,000 |  |
| 三菱鉛筆              | 19,400    | 1,383 | 26,830,200    |  |
| 松 風               | 11,800    | 900   | 10,620,000    |  |
| タカラスタンダ - ド       | 108,000   | 566   | 61,128,000    |  |
| コ ク ヨ             | 121,900   | 588   | 71,677,200    |  |
| ナカバヤシ             | 50,000    | 182   | 9,100,000     |  |
| ニ フ コ             | 54,700    | 2,084 | 113,994,800   |  |
| グローブライド           | 114,000   | 93    | 10,602,000    |  |
| 岡村製作所             | 82,000    | 564   | 46,248,000    |  |
| 日本バルカー            | 96,000    | 216   | 20,736,000    |  |
| M U T O Hホールディングス | 24,000    | 233   | 5,592,000     |  |
| 伊 藤 忠             | 1,843,000 | 882   | 1,625,526,000 |  |
| 丸 紅               | 2,021,000 | 532   | 1,075,172,000 |  |
| スクロール             | 30,100    | 300   | 9,030,000     |  |
| 高 島               | 40,000    | 256   | 10,240,000    |  |
| F & A アクアホールディングス | 17,900    | 837   | 14,982,300    |  |
| 三陽商会              | 119,000   | 252   | 29,988,000    |  |
| 長瀬産業              | 130,800   | 984   | 128,707,200   |  |
| ナイガイ              | 67,000    | 46    | 3,082,000     |  |
| 蝶 理               | 145,000   | 105   | 15,225,000    |  |
| 豊田通商              | 257,500   | 1,519 | 391,142,500   |  |
| オンワ - ドホールディングス   | 151,000   | 591   | 89,241,000    |  |
| 三共生興              | 39,900    | 257   | 10,254,300    |  |
| 兼 松               | 492,000   | 91    | 44,772,000    |  |
| 美 津 濃             | 116,000   | 381   | 44,196,000    |  |
| ツカモトコーポレーション      | 41,000    | 142   | 5,822,000     |  |
| ファミリーマート          | 70,900    | 3,510 | 248,859,000   |  |

|                |           |       |               |  |
|----------------|-----------|-------|---------------|--|
| ルック            | 40,000    | 290   | 11,600,000    |  |
| 三井物産           | 1,994,100 | 1,110 | 2,213,451,000 |  |
| 日本紙パルプ         | 121,000   | 270   | 32,670,000    |  |
| 東京エレクトロン       | 196,800   | 3,960 | 779,328,000   |  |
| 日立ハイテクノロジーズ    | 70,000    | 1,898 | 132,860,000   |  |
| カメイ            | 30,000    | 790   | 23,700,000    |  |
| 東都水産           | 39,000    | 128   | 4,992,000     |  |
| スターゼン          | 80,000    | 234   | 18,720,000    |  |
| セイコーHD         | 135,000   | 218   | 29,430,000    |  |
| 山 善            | 89,100    | 694   | 61,835,400    |  |
| 椿本興業           | 23,000    | 235   | 5,405,000     |  |
| 住友商事           | 1,363,500 | 1,090 | 1,486,215,000 |  |
| 日本ユニシス         | 55,600    | 595   | 33,082,000    |  |
| 内田洋行           | 51,000    | 241   | 12,291,000    |  |
| 三菱商事           | 1,682,400 | 1,649 | 2,774,277,600 |  |
| 第一実業           | 49,000    | 379   | 18,571,000    |  |
| キヤノンマーケティングJPN | 76,900    | 972   | 74,746,800    |  |
| 西華産業           | 84,000    | 219   | 18,396,000    |  |
| 佐藤商事           | 20,700    | 566   | 11,716,200    |  |
| 菱洋エレクトロ        | 25,300    | 883   | 22,339,900    |  |
| 東京産業           | 23,500    | 290   | 6,815,000     |  |
| ユアサ商事          | 237,000   | 128   | 30,336,000    |  |
| 神鋼商事           | 59,000    | 178   | 10,502,000    |  |
| 阪和興業           | 232,000   | 312   | 72,384,000    |  |
| カナデン           | 2,000     | 500   | 1,000,000     |  |
| 菱電商事           | 35,000    | 453   | 15,855,000    |  |
| ニプロ            | 121,600   | 511   | 62,137,600    |  |
| フルサト工業         | 13,700    | 764   | 10,466,800    |  |
| 岩谷産業           | 258,000   | 284   | 73,272,000    |  |
| すてきナイスグループ     | 101,000   | 221   | 22,321,000    |  |
| 昭光通商           | 86,000    | 122   | 10,492,000    |  |
| ニチモウ           | 34,000    | 228   | 7,752,000     |  |
| 極東貿易           | 27,000    | 154   | 4,158,000     |  |
| イワキ            | 36,000    | 187   | 6,732,000     |  |
| 兼松エレクトロニクス     | 14,800    | 866   | 12,816,800    |  |
| 三愛石油           | 55,000    | 345   | 18,975,000    |  |
| 稲畑産業           | 61,900    | 491   | 30,392,900    |  |
| G S Iクレオス      | 56,000    | 107   | 5,992,000     |  |
| 明和産業           | 18,200    | 709   | 12,903,800    |  |
| J F E 商事       | 154,900   | 356   | 55,144,400    |  |
| ゴ - ルドウイン      | 56,000    | 492   | 27,552,000    |  |
| ユニ・チャーム        | 135,300   | 4,500 | 608,850,000   |  |
| デサント           | 61,000    | 422   | 25,742,000    |  |
| ヤマトインタ - ナショナル | 15,200    | 380   | 5,776,000     |  |
| 東邦ホールディングス     | 73,900    | 1,498 | 110,702,200   |  |
| サンゲツ           | 41,000    | 1,951 | 79,991,000    |  |
| ミツウロコグループ      | 37,600    | 499   | 18,762,400    |  |
| シナネン           | 51,000    | 334   | 17,034,000    |  |

|                 |         |       |             |  |
|-----------------|---------|-------|-------------|--|
| 伊藤忠エネクス         | 51,300  | 443   | 22,725,900  |  |
| サンリオ            | 58,200  | 3,180 | 185,076,000 |  |
| サンワ テクノス        | 11,300  | 717   | 8,102,100   |  |
| リョーサン           | 37,700  | 1,444 | 54,438,800  |  |
| 新光商事            | 25,600  | 633   | 16,204,800  |  |
| トーホー            | 49,000  | 307   | 15,043,000  |  |
| 三信電気            | 33,100  | 542   | 17,940,200  |  |
| 東陽テクニカ          | 34,100  | 869   | 29,632,900  |  |
| モスフード サービス      | 30,500  | 1,541 | 47,000,500  |  |
| 加賀電子            | 25,200  | 821   | 20,689,200  |  |
| 三益半導体           | 20,700  | 680   | 14,076,000  |  |
| ソーダニツカ          | 2,000   | 334   | 668,000     |  |
| 立花エレテック         | 14,100  | 687   | 9,686,700   |  |
| 木曽路             | 26,600  | 1,543 | 41,043,800  |  |
| 千 趣 会           | 41,700  | 523   | 21,809,100  |  |
| タカキュー           | 18,000  | 174   | 3,132,000   |  |
| ケーヨー            | 43,600  | 471   | 20,535,600  |  |
| アデランス           | 29,300  | 839   | 24,582,700  |  |
| 上新電機            | 50,000  | 773   | 38,650,000  |  |
| 日本瓦斯            | 22,100  | 1,143 | 25,260,300  |  |
| ベスト電器           | 72,000  | 176   | 12,672,000  |  |
| マルエツ            | 46,000  | 290   | 13,340,000  |  |
| ロイヤルホールディングス    | 39,000  | 939   | 36,621,000  |  |
| 東 天 紅           | 17,000  | 137   | 2,329,000   |  |
| いなげや            | 26,100  | 912   | 23,803,200  |  |
| 島 忠             | 52,200  | 1,718 | 89,679,600  |  |
| チヨダ             | 30,200  | 1,788 | 53,997,600  |  |
| ライフコーポレーション     | 14,600  | 1,354 | 19,768,400  |  |
| カ ス ミ           | 47,600  | 533   | 25,370,800  |  |
| リンガーハット         | 21,200  | 1,055 | 22,366,000  |  |
| さ が 美           | 18,000  | 104   | 1,872,000   |  |
| M R M A X       | 22,800  | 303   | 6,908,400   |  |
| テンアライド          | 18,500  | 260   | 4,810,000   |  |
| A O K Iホールディングス | 20,300  | 1,615 | 32,784,500  |  |
| オークワ            | 33,000  | 1,060 | 34,980,000  |  |
| コメリ             | 31,500  | 2,147 | 67,630,500  |  |
| 青山商事            | 63,600  | 1,610 | 102,396,000 |  |
| しまむら            | 26,800  | 8,990 | 240,932,000 |  |
| C F Sコーポレーション   | 15,500  | 363   | 5,626,500   |  |
| 高 島 屋           | 313,000 | 573   | 179,349,000 |  |
| 松 屋             | 46,400  | 613   | 28,443,200  |  |
| エイチ・ツー・オーリテイリング | 120,000 | 646   | 77,520,000  |  |
| 丸 栄             | 39,000  | 96    | 3,744,000   |  |
| ニッセンHD          | 46,000  | 380   | 17,480,000  |  |
| パ ル コ           | 41,900  | 744   | 31,173,600  |  |
| 丸井グループ          | 301,400 | 595   | 179,333,000 |  |
| クレディセゾン         | 188,700 | 1,573 | 296,825,100 |  |
| 原信ナルスH L D G S  | 13,000  | 1,366 | 17,758,000  |  |

|       |         |       |             |  |
|-------|---------|-------|-------------|--|
| 井 筒 屋 | 123,000 | 47    | 5,781,000   |  |
| ダイエー  | 143,100 | 242   | 34,630,200  |  |
| イズミヤ  | 81,000  | 412   | 33,372,000  |  |
| イオン   | 814,200 | 1,001 | 815,014,200 |  |
| ユ ニ ー | 173,200 | 882   | 152,762,400 |  |
| イ ズ ミ | 69,200  | 1,615 | 111,758,000 |  |
| 東武ストア | 30,000  | 262   | 7,860,000   |  |
| 平 和 堂 | 42,600  | 1,118 | 47,626,800  |  |

[前へ](#) [次へ](#)

平成24年5月11日現在

| 銘 柄             | 株数         | 評価額（円） |               | 備考 |
|-----------------|------------|--------|---------------|----|
|                 |            | 単価     | 金額            |    |
| フ ジ             | 25,900     | 1,769  | 45,817,100    |    |
| ヤオコー            | 10,200     | 2,707  | 27,611,400    |    |
| ゼビオ             | 27,800     | 2,027  | 56,350,600    |    |
| ケースホールディングス     | 57,500     | 2,020  | 116,150,000   |    |
| P a l t a c     | 24,300     | 1,136  | 27,604,800    |    |
| O L Y M P I C   | 15,400     | 777    | 11,965,800    |    |
| 日産東京販売H D       | 34,000     | 227    | 7,718,000     |    |
| 新生銀行            | 1,799,000  | 98     | 176,302,000   |    |
| あおぞら銀行          | 721,000    | 194    | 139,874,000   |    |
| 三菱U F JフィナンシャルG | 17,486,600 | 351    | 6,137,796,600 |    |
| りそなホールディングス     | 2,010,400  | 329    | 661,421,600   |    |
| 三井住友トラストH D     | 4,528,000  | 225    | 1,018,800,000 |    |
| 三井住友フィナンシャルG    | 1,753,900  | 2,355  | 4,130,434,500 |    |
| 第四銀行            | 297,000    | 242    | 71,874,000    |    |
| 北越銀行            | 238,000    | 155    | 36,890,000    |    |
| 西日本シティ銀行        | 810,000    | 196    | 158,760,000   |    |
| 札幌北洋ホール         | 347,500    | 253    | 87,917,500    |    |
| 千葉銀行            | 911,000    | 466    | 424,526,000   |    |
| 横浜銀行            | 1,483,000  | 368    | 545,744,000   |    |
| 常陽銀行            | 883,000    | 334    | 294,922,000   |    |
| 群馬銀行            | 522,000    | 383    | 199,926,000   |    |
| 武蔵野銀行           | 37,200     | 2,475  | 92,070,000    |    |
| 千葉興業銀行          | 43,900     | 400    | 17,560,000    |    |
| 筑波銀行            | 96,000     | 240    | 23,040,000    |    |
| 東京都民銀行          | 43,800     | 855    | 37,449,000    |    |
| 七十七銀行           | 362,000    | 302    | 109,324,000   |    |
| 青森銀行            | 174,000    | 232    | 40,368,000    |    |
| 秋田銀行            | 159,000    | 245    | 38,955,000    |    |
| 山形銀行            | 141,000    | 352    | 49,632,000    |    |
| 岩手銀行            | 15,600     | 3,385  | 52,806,000    |    |
| 東邦銀行            | 195,000    | 250    | 48,750,000    |    |
| 東北銀行            | 126,000    | 120    | 15,120,000    |    |
| みちのく銀行          | 116,000    | 144    | 16,704,000    |    |
| ふくおかフィナンシャルG    | 937,000    | 314    | 294,218,000   |    |
| 静岡銀行            | 697,000    | 826    | 575,722,000   |    |
| 十六銀行            | 290,000    | 235    | 68,150,000    |    |
| スルガ銀行           | 225,000    | 771    | 173,475,000   |    |
| 八十二銀行           | 426,000    | 407    | 173,382,000   |    |
| 山梨中央銀行          | 141,000    | 310    | 43,710,000    |    |
| 大垣共立銀行          | 308,000    | 265    | 81,620,000    |    |
| 福井銀行            | 199,000    | 233    | 46,367,000    |    |
| 北國銀行            | 268,000    | 271    | 72,628,000    |    |
| 清水銀行            | 7,900      | 2,805  | 22,159,500    |    |
| 滋賀銀行            | 217,000    | 430    | 93,310,000    |    |

|               |            |        |               |  |
|---------------|------------|--------|---------------|--|
| 南都銀行          | 215,000    | 338    | 72,670,000    |  |
| 百五銀行          | 209,000    | 312    | 65,208,000    |  |
| 京都銀行          | 413,000    | 653    | 269,689,000   |  |
| 三重銀行          | 96,000     | 176    | 16,896,000    |  |
| ほくほくフィナンシャルG  | 1,618,000  | 131    | 211,958,000   |  |
| 広島銀行          | 681,000    | 306    | 208,386,000   |  |
| 山陰合同銀行        | 135,000    | 550    | 74,250,000    |  |
| 中国銀行          | 178,000    | 993    | 176,754,000   |  |
| 鳥取銀行          | 74,000     | 147    | 10,878,000    |  |
| 伊予銀行          | 247,000    | 619    | 152,893,000   |  |
| 百十四銀行         | 254,000    | 314    | 79,756,000    |  |
| 四国銀行          | 167,000    | 255    | 42,585,000    |  |
| 阿波銀行          | 203,000    | 455    | 92,365,000    |  |
| 鹿児島銀行         | 149,000    | 461    | 68,689,000    |  |
| 大分銀行          | 149,000    | 218    | 32,482,000    |  |
| 宮崎銀行          | 154,000    | 192    | 29,568,000    |  |
| 肥後銀行          | 177,000    | 427    | 75,579,000    |  |
| 佐賀銀行          | 140,000    | 199    | 27,860,000    |  |
| 十八銀行          | 148,000    | 202    | 29,896,000    |  |
| 沖縄銀行          | 17,500     | 3,280  | 57,400,000    |  |
| 琉球銀行          | 48,600     | 1,026  | 49,863,600    |  |
| 八千代銀行         | 11,900     | 1,700  | 20,230,000    |  |
| セブン銀行         | 867,600    | 189    | 163,976,400   |  |
| みずほフィナンシャルG   | 29,708,600 | 115    | 3,416,489,000 |  |
| 紀陽ホールディングス    | 922,000    | 111    | 102,342,000   |  |
| 山口フィナンシャルG    | 230,000    | 642    | 147,660,000   |  |
| フィデック         | 124        | 11,210 | 1,390,040     |  |
| 芙蓉総合リース       | 22,000     | 2,378  | 52,316,000    |  |
| 興銀リース         | 32,100     | 1,995  | 64,039,500    |  |
| 東京センチュリーリース   | 61,900     | 1,500  | 92,850,000    |  |
| S B Iホールディングス | 24,455     | 5,650  | 138,170,750   |  |
| 日本証券金融        | 95,400     | 371    | 35,393,400    |  |
| 大阪証券金融        | 27,400     | 159    | 4,356,600     |  |
| アイフル          | 209,600    | 154    | 32,278,400    |  |
| 日本アジア投資       | 166,000    | 54     | 8,964,000     |  |
| ポケットカード       | 23,300     | 340    | 7,922,000     |  |
| 長野銀行          | 77,000     | 146    | 11,242,000    |  |
| 名古屋銀行         | 209,000    | 239    | 49,951,000    |  |
| 愛知銀行          | 8,400      | 4,070  | 34,188,000    |  |
| 第三銀行          | 132,000    | 152    | 20,064,000    |  |
| 中京銀行          | 97,000     | 183    | 17,751,000    |  |
| 東日本銀行         | 111,000    | 161    | 17,871,000    |  |
| 大光銀行          | 82,000     | 213    | 17,466,000    |  |
| 愛媛銀行          | 146,000    | 223    | 32,558,000    |  |
| トマト銀行         | 91,000     | 127    | 11,557,000    |  |
| みなと銀行         | 209,000    | 146    | 30,514,000    |  |
| 京葉銀行          | 190,000    | 366    | 69,540,000    |  |
| 関西アーバン銀行      | 322,000    | 107    | 34,454,000    |  |

|                 |           |        |               |  |
|-----------------|-----------|--------|---------------|--|
| 栃木銀行            | 116,000   | 271    | 31,436,000    |  |
| 北日本銀行           | 7,300     | 1,991  | 14,534,300    |  |
| 東和銀行            | 231,000   | 82     | 18,942,000    |  |
| 福島銀行            | 266,000   | 59     | 15,694,000    |  |
| 大東銀行            | 148,000   | 62     | 9,176,000     |  |
| リコーリース          | 15,900    | 1,862  | 29,605,800    |  |
| イオン クレジットサービス   | 102,600   | 1,313  | 134,713,800   |  |
| ア コ ム           | 46,410    | 1,474  | 68,408,340    |  |
| ジャックス           | 140,000   | 242    | 33,880,000    |  |
| オ リ コ           | 445,500   | 86     | 38,313,000    |  |
| 日立キャピタル         | 45,400    | 1,225  | 55,615,000    |  |
| オリックス           | 120,160   | 7,140  | 857,942,400   |  |
| 三菱ＵＦＪリース        | 58,560    | 3,165  | 185,342,400   |  |
| ジャフコ            | 28,100    | 1,597  | 44,875,700    |  |
| トモニホールディングス     | 177,100   | 339    | 60,036,900    |  |
| 大和証券Ｇ本社         | 2,288,000 | 267    | 610,896,000   |  |
| 野村ホールディングス      | 4,999,700 | 275    | 1,374,917,500 |  |
| 岡三証券グループ        | 197,000   | 288    | 56,736,000    |  |
| 丸三証券            | 78,100    | 267    | 20,852,700    |  |
| 東洋証券            | 86,000    | 159    | 13,674,000    |  |
| 東海東京ＨＤ          | 265,000   | 257    | 68,105,000    |  |
| 光世証券            | 55,000    | 72     | 3,960,000     |  |
| 水戸証券            | 67,000    | 169    | 11,323,000    |  |
| いちよし証券          | 51,900    | 406    | 21,071,400    |  |
| 松井証券            | 137,100   | 430    | 58,953,000    |  |
| ＮＫＳＪホールディングス    | 483,000   | 1,503  | 725,949,000   |  |
| だいこう証券ビジ        | 13,900    | 265    | 3,683,500     |  |
| マネックスＧ          | 1,787     | 14,040 | 25,089,480    |  |
| カブドットコム証券       | 94,300    | 223    | 21,028,900    |  |
| 極東証券            | 31,000    | 629    | 19,499,000    |  |
| 岩井コスモホールディング    | 21,900    | 297    | 6,504,300     |  |
| フィデアホール         | 132,700   | 174    | 23,089,800    |  |
| 池田泉州ＨＤ          | 953,300   | 106    | 101,049,800   |  |
| ＭＳ＆ＡＤ           | 690,300   | 1,337  | 922,931,100   |  |
| ＳＯＮＹ ＦＨ         | 221,300   | 1,148  | 254,052,400   |  |
| 小林洋行            | 5,200     | 178    | 925,600       |  |
| 第一生命            | 12,353    | 87,000 | 1,074,711,000 |  |
| 東京海上ＨＤ          | 876,900   | 1,866  | 1,636,295,400 |  |
| アサックス           | 32        | 82,600 | 2,643,200     |  |
| ＮＥＣキャピタルソリューション | 7,800     | 999    | 7,792,200     |  |
| Ｔ＆Ｄホールディングス     | 841,800   | 768    | 646,502,400   |  |
| 三井不動産           | 1,025,000 | 1,298  | 1,330,450,000 |  |
| 三菱地所            | 1,617,000 | 1,266  | 2,047,122,000 |  |
| 平和不動産           | 219,500   | 184    | 40,388,000    |  |
| 東京建物            | 440,000   | 264    | 116,160,000   |  |
| ダイビル            | 68,100    | 595    | 40,519,500    |  |
| 東急不動産           | 465,000   | 356    | 165,540,000   |  |
| 京阪神ビルディング       | 28,300    | 354    | 10,018,200    |  |

|                |           |         |               |  |
|----------------|-----------|---------|---------------|--|
| 住友不動産          | 554,000   | 1,737   | 962,298,000   |  |
| 東宝不動産          | 24,800    | 411     | 10,192,800    |  |
| 太平洋興発          | 80,000    | 83      | 6,640,000     |  |
| 大京             | 355,000   | 176     | 62,480,000    |  |
| テーオーシー         | 89,700    | 431     | 38,660,700    |  |
| 東京楽天地          | 27,000    | 305     | 8,235,000     |  |
| レオパレス 2 1      | 178,300   | 228     | 40,652,400    |  |
| フジ住宅           | 29,700    | 388     | 11,523,600    |  |
| 空港施設           | 24,400    | 338     | 8,247,200     |  |
| 明和地所           | 11,700    | 410     | 4,797,000     |  |
| 住友不動産販売        | 8,330     | 3,585   | 29,863,050    |  |
| ゴールドクレスト       | 20,820    | 1,134   | 23,609,880    |  |
| 東栄住宅           | 15,700    | 770     | 12,089,000    |  |
| リロ・ホールディング     | 7,500     | 2,194   | 16,455,000    |  |
| 日本エスリード        | 9,100     | 683     | 6,215,300     |  |
| 東急リバブル         | 21,000    | 791     | 16,611,000    |  |
| 飯田産業           | 21,800    | 587     | 12,796,600    |  |
| 日神不動産          | 13,400    | 480     | 6,432,000     |  |
| アーネストワン        | 38,100    | 852     | 32,461,200    |  |
| タカラレーベン        | 26,600    | 626     | 16,651,600    |  |
| サンヨーハウジ 名古屋    | 122       | 76,100  | 9,284,200     |  |
| イオンモール         | 105,300   | 1,618   | 170,375,400   |  |
| フージャースコーポレーション | 354       | 55,300  | 19,576,200    |  |
| タクトホーム         | 122       | 72,700  | 8,869,400     |  |
| ランド            | 24,700    | 12      | 296,400       |  |
| トーセイ           | 298       | 28,450  | 8,478,100     |  |
| エヌ・ティ・ティ都市開発   | 1,435     | 59,200  | 84,952,000    |  |
| サンフロンティア不動産    | 188       | 14,260  | 2,680,880     |  |
| ランドビジネス        | 160       | 15,790  | 2,526,400     |  |
| グランディハウス       | 4,900     | 516     | 2,528,400     |  |
| 東武鉄道           | 1,329,000 | 397     | 527,613,000   |  |
| 相鉄ホールディングス     | 376,000   | 248     | 93,248,000    |  |
| 東京急行           | 1,378,000 | 361     | 497,458,000   |  |
| 京浜急行           | 601,000   | 664     | 399,064,000   |  |
| 小田急電鉄          | 750,000   | 728     | 546,000,000   |  |
| 京王電鉄           | 654,000   | 564     | 368,856,000   |  |
| 京成電鉄           | 376,000   | 633     | 238,008,000   |  |
| 富士急行           | 65,000    | 467     | 30,355,000    |  |
| 新京成電鉄          | 23,000    | 347     | 7,981,000     |  |
| 東日本旅客鉄道        | 407,000   | 4,780   | 1,945,460,000 |  |
| 西日本旅客鉄道        | 203,500   | 3,220   | 655,270,000   |  |
| 東海旅客鉄道         | 2,031     | 641,000 | 1,301,871,000 |  |
| 西日本鉄道          | 304,000   | 368     | 111,872,000   |  |
| ハマキョウレックス      | 6,700     | 2,811   | 18,833,700    |  |
| サカイ引越センター      | 4,300     | 1,645   | 7,073,500     |  |
| 近畿日本鉄道         | 2,115,000 | 274     | 579,510,000   |  |
| 阪急阪神 H L D G S | 1,571,000 | 367     | 576,557,000   |  |
| 南海電鉄           | 489,000   | 332     | 162,348,000   |  |

|              |           |       |             |  |
|--------------|-----------|-------|-------------|--|
| 京阪電鉄         | 525,000   | 362   | 190,050,000 |  |
| 名糖運輸         | 10,400    | 591   | 6,146,400   |  |
| 名古屋鉄道        | 818,000   | 213   | 174,234,000 |  |
| 日本通運         | 927,000   | 314   | 291,078,000 |  |
| ヤマトホールディングス  | 476,100   | 1,229 | 585,126,900 |  |
| 山 九          | 284,000   | 287   | 81,508,000  |  |
| 日 新          | 89,000    | 208   | 18,512,000  |  |
| 丸 運          | 12,500    | 195   | 2,437,500   |  |
| 丸全昭和運輸       | 79,000    | 241   | 19,039,000  |  |
| センコー         | 94,000    | 348   | 32,712,000  |  |
| トナミホールディングス  | 48,000    | 163   | 7,824,000   |  |
| 日本梱包運輸       | 70,100    | 1,001 | 70,170,100  |  |
| 日石輸送         | 28,000    | 190   | 5,320,000   |  |
| 福山通運         | 142,000   | 425   | 60,350,000  |  |
| セイノーホールディングス | 181,000   | 526   | 95,206,000  |  |
| 神奈川中央交通      | 25,000    | 421   | 10,525,000  |  |
| 日立物流         | 48,700    | 1,468 | 71,491,600  |  |
| 日本郵船         | 1,853,000 | 204   | 378,012,000 |  |
| 商船三井         | 1,227,000 | 272   | 333,744,000 |  |
| 川崎汽船         | 723,000   | 139   | 100,497,000 |  |
| N S ユナイテッド海運 | 100,000   | 106   | 10,600,000  |  |
| 乾 汽 船        | 25,400    | 275   | 6,985,000   |  |
| 明治海運         | 20,700    | 300   | 6,210,000   |  |
| 飯野海運         | 113,300   | 375   | 42,487,500  |  |
| 共栄タンカー       | 19,000    | 192   | 3,648,000   |  |
| 第一中央汽船       | 152,000   | 97    | 14,744,000  |  |
| 全日本空輸        | 3,120,000 | 218   | 680,160,000 |  |
| パスコ          | 22,000    | 253   | 5,566,000   |  |
| 三菱倉庫         | 166,000   | 805   | 133,630,000 |  |
| 三井倉庫         | 109,000   | 317   | 34,553,000  |  |
| 住友倉庫         | 171,000   | 353   | 60,363,000  |  |
| 渋沢倉庫         | 55,000    | 231   | 12,705,000  |  |
| ヤマタネ         | 116,000   | 109   | 12,644,000  |  |
| 東陽倉庫         | 38,000    | 176   | 6,688,000   |  |
| 日本トランスシティ    | 50,000    | 268   | 13,400,000  |  |
| ケイヒン         | 43,000    | 100   | 4,300,000   |  |
| 安田倉庫         | 19,100    | 483   | 9,225,300   |  |
| 東洋埠頭         | 68,000    | 130   | 8,840,000   |  |
| 宇徳           | 15,700    | 248   | 3,893,600   |  |
| 上 組          | 259,000   | 625   | 161,875,000 |  |
| サンリツ         | 1,700     | 507   | 861,900     |  |
| キムラユニティー     | 5,900     | 722   | 4,259,800   |  |
| キューソー流通システム  | 8,100     | 869   | 7,038,900   |  |
| 郵船ロジスティクス    | 18,400    | 1,111 | 20,442,400  |  |
| 近鉄エクスプレス     | 20,900    | 2,679 | 55,991,100  |  |
| 東海運          | 15,400    | 218   | 3,357,200   |  |
| エーアイティー      | 2,000     | 1,171 | 2,342,000   |  |
| 東京放送H D      | 138,500   | 1,001 | 138,638,500 |  |

|                 |           |         |               |  |
|-----------------|-----------|---------|---------------|--|
| 日本テレビ放送網        | 20,280    | 11,790  | 239,101,200   |  |
| テレビ朝日           | 586       | 114,800 | 67,272,800    |  |
| スカパーＪＳＡＴＨＤ      | 1,759     | 33,400  | 58,750,600    |  |
| テレビ東京ＨＤ         | 14,900    | 987     | 14,706,300    |  |
| アイ・ティー・シーネットワーク | 20,600    | 524     | 10,794,400    |  |
| イー・アクセス         | 1,757     | 14,530  | 25,529,210    |  |
| ＮＥＣモバイルリング      | 8,400     | 2,911   | 24,452,400    |  |
| 日本電信電話          | 1,063,800 | 3,500   | 3,723,300,000 |  |
| K D D I         | 3,585     | 504,000 | 1,806,840,000 |  |
| 光通信             | 21,200    | 2,488   | 52,745,600    |  |
| エヌ・ティ・ティ・ドコモ    | 19,033    | 130,000 | 2,474,290,000 |  |
| G M Oインターネット    | 68,500    | 412     | 28,222,000    |  |
| 学研ホールディングス      | 70,000    | 170     | 11,900,000    |  |
| ゼンリン            | 33,600    | 781     | 26,241,600    |  |
| 昭文社             | 13,100    | 570     | 7,467,000     |  |
| 角川グループＨＬＤＧＳ     | 21,800    | 2,098   | 45,736,400    |  |
| インプレスホールディングス   | 18,500    | 111     | 2,053,500     |  |
| 東京電力            | 1,868,200 | 185     | 345,617,000   |  |
| 中部電力            | 771,400   | 1,250   | 964,250,000   |  |
| 関西電力            | 955,200   | 1,078   | 1,029,705,600 |  |
| 中国電力            | 323,600   | 1,321   | 427,475,600   |  |
| 北陸電力            | 229,300   | 1,286   | 294,879,800   |  |
| 東北電力            | 584,700   | 755     | 441,448,500   |  |
| 四国電力            | 210,800   | 1,965   | 414,222,000   |  |
| 九州電力            | 517,000   | 962     | 497,354,000   |  |
| 北海道電力           | 219,100   | 1,008   | 220,852,800   |  |
| 沖縄電力            | 14,000    | 3,070   | 42,980,000    |  |
| 電源開発            | 145,200   | 2,127   | 308,840,400   |  |
| 東京瓦斯            | 2,824,000 | 389     | 1,098,536,000 |  |
| 大阪瓦斯            | 2,271,000 | 322     | 731,262,000   |  |
| 東邦瓦斯            | 595,000   | 475     | 282,625,000   |  |
| 北海道瓦斯           | 43,000    | 250     | 10,750,000    |  |
| 西部瓦斯            | 265,000   | 201     | 53,265,000    |  |
| 静岡瓦斯            | 61,000    | 552     | 33,672,000    |  |
| アイネット           | 10,400    | 495     | 5,148,000     |  |
| 松 竹             | 152,000   | 758     | 115,216,000   |  |
| 東 宝             | 165,000   | 1,359   | 224,235,000   |  |
| エイチ・アイ・エス       | 24,900    | 2,662   | 66,283,800    |  |
| 東 映             | 97,000    | 393     | 38,121,000    |  |
| 葵プロモーション        | 7,500     | 510     | 3,825,000     |  |
| N T Tデータ        | 1,426     | 240,300 | 342,667,800   |  |
| 共立メンテナンス        | 12,100    | 1,667   | 20,170,700    |  |
| イチネンホールディングス    | 26,000    | 415     | 10,790,000    |  |
| 建設技術研究所         | 13,700    | 498     | 6,822,600     |  |
| アインファーマシーズ      | 12,700    | 4,260   | 54,102,000    |  |
| 燦ホールディングス       | 5,500     | 1,555   | 8,552,500     |  |
| スバル興業           | 3,000     | 250     | 750,000       |  |
| 東京テアトル          | 95,000    | 110     | 10,450,000    |  |

|                 |         |       |             |  |
|-----------------|---------|-------|-------------|--|
| よみうりランド         | 50,000  | 248   | 12,400,000  |  |
| 東京都競馬           | 190,000 | 111   | 21,090,000  |  |
| 常磐興産            | 78,000  | 88    | 6,864,000   |  |
| カナモト            | 31,000  | 805   | 24,955,000  |  |
| 東京ドーム           | 195,000 | 237   | 46,215,000  |  |
| D T S           | 23,800  | 1,045 | 24,871,000  |  |
| スクウェア・エニックス・H D | 75,500  | 1,486 | 112,193,000 |  |
| シーイーシー          | 14,400  | 411   | 5,918,400   |  |
| カプコン            | 44,200  | 1,789 | 79,073,800  |  |
| アゴーラ・ホスピタリティーG  | 98,000  | 20    | 1,960,000   |  |
| 日本空港ビルデング       | 73,800  | 996   | 73,504,800  |  |
| トランス・コスモス       | 31,800  | 1,223 | 38,891,400  |  |
| 乃村工藝社           | 48,000  | 282   | 13,536,000  |  |
| ジャステック          | 15,600  | 482   | 7,519,200   |  |
| S C S K         | 46,900  | 1,194 | 55,998,600  |  |
| 藤田観光            | 63,000  | 282   | 17,766,000  |  |
| 近畿日本ツーリスト       | 77,000  | 105   | 8,085,000   |  |
| 日本管財            | 9,200   | 1,461 | 13,441,200  |  |
| トーカイ            | 9,800   | 1,751 | 17,159,800  |  |
| 白 洋 舎           | 5,000   | 212   | 1,060,000   |  |
| セコム             | 237,300 | 3,575 | 848,347,500 |  |
| 日本システムウエア       | 7,800   | 310   | 2,418,000   |  |
| セントラル警備保障       | 11,500  | 775   | 8,912,500   |  |
| アイネス            | 27,900  | 578   | 16,126,200  |  |
| 丹青社             | 23,000  | 222   | 5,106,000   |  |
| メイテック           | 37,900  | 1,574 | 59,654,600  |  |
| T K C           | 21,400  | 1,614 | 34,539,600  |  |
| アサツー ディ・ケイ      | 40,400  | 2,238 | 90,415,200  |  |
| 富士ソフト           | 30,300  | 1,400 | 42,420,000  |  |
| 応用地質            | 25,900  | 892   | 23,102,800  |  |
| 船井総合研究所         | 26,000  | 546   | 14,196,000  |  |
| N S D           | 42,900  | 654   | 28,056,600  |  |
| 進学会             | 12,300  | 279   | 3,431,700   |  |
| 丸紅建材リース         | 23,000  | 145   | 3,335,000   |  |
| コナミ             | 104,200 | 1,970 | 205,274,000 |  |
| ベネッセホールディングス    | 75,700  | 3,690 | 279,333,000 |  |
| イオンディライト        | 27,500  | 1,825 | 50,187,500  |  |
| ナック             | 6,300   | 1,612 | 10,155,600  |  |
| 福井コンピュータ        | 1,500   | 408   | 612,000     |  |
| ニチイ学館           | 47,700  | 1,056 | 50,371,200  |  |
| ダイセキ            | 39,300  | 1,316 | 51,718,800  |  |
| 日鐵商事            | 51,000  | 224   | 11,424,000  |  |
| 元気寿司            | 7,400   | 986   | 7,296,400   |  |
| トラスコ中山          | 29,100  | 1,759 | 51,186,900  |  |
| ヤマダ電機           | 112,270 | 4,100 | 460,307,000 |  |
| オートバックスセブン      | 27,400  | 4,025 | 110,285,000 |  |
| アークランドサカモト      | 15,000  | 1,202 | 18,030,000  |  |
| ニトリホールディングス     | 45,700  | 7,120 | 325,384,000 |  |

|                 |             |         |                 |  |
|-----------------|-------------|---------|-----------------|--|
| グルメ杵屋           | 17,000      | 441     | 7,497,000       |  |
| 愛 眼             | 18,700      | 338     | 6,320,600       |  |
| 吉野家ホールディングス     | 627         | 102,700 | 64,392,900      |  |
| 加藤産業            | 33,400      | 1,611   | 53,807,400      |  |
| イノテック           | 18,600      | 445     | 8,277,000       |  |
| イエローハット         | 21,700      | 1,315   | 28,535,500      |  |
| 富士エレクトロニクス      | 11,900      | 1,135   | 13,506,500      |  |
| 松屋フーズ           | 11,200      | 1,509   | 16,900,800      |  |
| J B C Cホールディングス | 18,600      | 528     | 9,820,800       |  |
| J Kホールディングス     | 20,000      | 370     | 7,400,000       |  |
| サガミチェーン         | 26,000      | 627     | 16,302,000      |  |
| 日 伝             | 9,600       | 2,077   | 19,939,200      |  |
| 北沢産業            | 11,000      | 171     | 1,881,000       |  |
| 杉本商事            | 12,900      | 742     | 9,571,800       |  |
| 因幡電機産業          | 27,300      | 2,280   | 62,244,000      |  |
| 住金物産            | 109,000     | 201     | 21,909,000      |  |
| ブレナス            | 25,800      | 1,486   | 38,338,800      |  |
| ミニストップ          | 17,200      | 1,378   | 23,701,600      |  |
| アークス            | 31,700      | 1,690   | 53,573,000      |  |
| バ ロ ー           | 45,900      | 1,356   | 62,240,400      |  |
| ミスミグループ本社       | 85,600      | 1,866   | 159,729,600     |  |
| 江守商事            | 4,900       | 988     | 4,841,200       |  |
| アルテック           | 11,400      | 215     | 2,451,000       |  |
| ベ ル ク           | 11,400      | 1,162   | 13,246,800      |  |
| 大 庄             | 11,100      | 1,021   | 11,333,100      |  |
| タキヒヨー           | 34,000      | 443     | 15,062,000      |  |
| ファーストリテイリング     | 46,200      | 16,450  | 759,990,000     |  |
| ソフトバンク          | 1,046,500   | 2,368   | 2,478,112,000   |  |
| スズケン            | 88,800      | 2,435   | 216,228,000     |  |
| サンドラッグ          | 43,900      | 2,443   | 107,247,700     |  |
| 東京デリカ           | 7,600       | 776     | 5,897,600       |  |
| ジェコス            | 16,800      | 366     | 6,148,800       |  |
| ヤマザワ            | 6,200       | 1,390   | 8,618,000       |  |
| や ま や           | 3,900       | 1,370   | 5,343,000       |  |
| ベルーナ            | 28,750      | 591     | 16,991,250      |  |
| 合計              | 360,152,787 |         | 242,326,225,031 |  |

\*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

| 銘柄     | 株数      |
|--------|---------|
| トヨタ自動車 | 500,000 |

株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

## 「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

| 科目          | 注記<br>番号 | 平成23年11月11日現在   | 平成24年5月11日現在    |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
|             |          | 金額<br>(円)       | 金額<br>(円)       |
| 資産の部        |          |                 |                 |
| 流動資産        |          |                 |                 |
| 預金          |          | 2,803,625,857   | 5,433,580,293   |
| コール・ローン     |          | 23,671,901      | 123,788,201     |
| 株式          |          | 244,980,050,118 | 250,721,656,544 |
| 投資信託受益証券    |          | 818,414,531     | 879,908,487     |
| 投資証券        |          | 3,615,329,400   | 4,472,807,123   |
| 派生商品評価勘定    |          | 85,714,519      | 3,853,651       |
| 未収入金        |          | 1,933,540       | 15,484,851      |
| 未収配当金       |          | 471,901,264     | 745,908,053     |
| 差入委託証拠金     |          | 1,406,552,748   | 1,493,225,305   |
| 流動資産合計      |          | 254,207,193,878 | 263,890,212,508 |
| 資産合計        |          | 254,207,193,878 | 263,890,212,508 |
| 負債の部        |          |                 |                 |
| 流動負債        |          |                 |                 |
| 派生商品評価勘定    |          | 97,372,493      | 220,488,960     |
| 未払金         |          | -               | 25,675,174      |
| 未払解約金       |          | 101,751,000     | 144,100,000     |
| 流動負債合計      |          | 199,123,493     | 390,264,134     |
| 負債合計        |          | 199,123,493     | 390,264,134     |
| 純資産の部       |          |                 |                 |
| 元本等         |          |                 |                 |
| 元本          |          | 219,132,408,137 | 205,519,391,149 |
| 剰余金         |          |                 |                 |
| 剰余金又は欠損金（ ） |          | 34,875,662,248  | 57,980,557,225  |
| 元本等合計       |          | 254,008,070,385 | 263,499,948,374 |
| 純資産合計       |          | 254,008,070,385 | 263,499,948,374 |
| 負債純資産合計     |          | 254,207,193,878 | 263,890,212,508 |

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                    |                                                                                                                                           |
|--------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式、投資信託受益証券及び投資証券<br>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 |
|--------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|                            |                                                                                                                                                                                                                                                        |
|----------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法      | <p>(1)先物取引<br/>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引<br/>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によって計算しております。</p>                                                                       |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>(1)外貨建取引等の処理基準<br/>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「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条及び同第61条にしたがって換算しております。</p> <p>(2)計算期間の取扱い<br/>当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年2月16日から平成24年2月15日まで及び平成24年2月16日から平成25年2月15日までとなっております。</p> |

## （貸借対照表に関する注記）

| 区分                                        | 平成23年11月11日現在    | 平成24年5月11日現在     |
|-------------------------------------------|------------------|------------------|
| *1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 206,783,830,759円 | 219,132,408,137円 |
| 同期中追加設定元本額                                | 38,603,627,885円  | 20,451,365,872円  |
| 同期中解約元本額                                  | 26,255,050,507円  | 34,064,382,860円  |
| 同期末における元本の内訳                              |                  |                  |
| D I A M 外国株式パッシブ・ファンド                     | 1,219,254,799円   | 1,023,017,904円   |
| D I A M 外国株式インデックスファンド< D C 年金 >          | 31,719,411,718円  | 33,427,707,088円  |
| D I A M バランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型         | 202,885,755円     | 197,104,199円     |
| D I A M バランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型      | 1,096,543,600円   | 1,116,104,061円   |
| D I A M バランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型         | 1,339,202,654円   | 1,332,611,143円   |
| D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド           | 213,387,982円     | 199,582,151円     |
| D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド           | 545,764,320円     | 542,479,928円     |

|                                                     |                 |                 |
|-----------------------------------------------------|-----------------|-----------------|
| D I A M D C バランス 7 0 イ<br>ンデックスファンド                 | 393,590,836円    | 382,404,170円    |
| マネックス資産設計ファンド<<br>隔月分配型>                            | 76,996,368円     | 71,924,768円     |
| マネックス資産設計ファンド<<br>育成型>                              | 805,292,083円    | 820,821,075円    |
| マネックス資産設計ファンド エ<br>ポリューション                          | 145,931,992円    | 162,545,452円    |
| D I A M外国株式インデックス<br>ファンド V A（適格機関投資家<br>専用）        | 592,339,971円    | 580,964,877円    |
| D I A M外国株式パッシブ私募<br>ファンド（適格機関投資家向<br>け）            | 6,000,868,582円  | 5,728,162,994円  |
| D I A M為替リスクコントロー<br>ル型グローバル株式私募ファン<br>ド（適格機関投資家限定） | 16,543,915,689円 | 12,465,698,200円 |
| D I A Mワールドバランス 2 5<br>V A（適格機関投資家限定）               | 96,706,040円     | 86,958,645円     |
| D I A Mグローバル・バランス<br>ファンド 2 5 V A（適格機関投<br>資家限定）    | 9,208,853,391円  | 8,431,160,752円  |
| D I A Mグローバル・バランス<br>ファンド 5 0 V A（適格機関投<br>資家限定）    | 1,511,252,642円  | 1,423,841,395円  |
| D I A M国際分散バランスファ<br>ンド 3 0 V A（適格機関投資家<br>限定）      | 179,847,872円    | 169,140,733円    |
| D I A M国際分散バランスファ<br>ンド 5 0 V A（適格機関投資家<br>限定）      | 1,036,585,522円  | 975,660,598円    |
| D I A M国内重視バランスファ<br>ンド 3 0 V A（適格機関投資家<br>限定）      | 93,173,275円     | 87,294,784円     |
| D I A M国内重視バランスファ<br>ンド 5 0 V A（適格機関投資家<br>限定）      | 165,765,525円    | 158,066,060円    |
| D I A M世界バランスファンド<br>4 0 V A（適格機関投資家限<br>定）         | 17,221,667,903円 | 16,176,419,236円 |
| D I A M世界バランスファンド<br>5 0 V A（適格機関投資家限<br>定）         | 8,563,572,299円  | 8,062,661,136円  |
| D I A Mバランスファンド 2 5<br>V A（適格機関投資家限定）               | 2,979,637,983円  | 2,752,388,330円  |
| D I A Mバランスファンド 3<br>7 . 5 V A（適格機関投資家限<br>定）       | 2,591,867,013円  | 2,361,522,101円  |
| D I A Mバランスファンド 5 0<br>V A（適格機関投資家限定）               | 6,835,681,832円  | 6,284,306,565円  |

|                                            |                  |                  |
|--------------------------------------------|------------------|------------------|
| D I A Mグローバル・アセット・バランスV A（適格機関投資家限定）       | 5,226,085,029円   | 4,890,413,916円   |
| D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2（適格機関投資家限定）     | 6,851,767,047円   | 6,384,619,540円   |
| D I A M アクサ グローバル バランスファンド30V A（適格機関投資家限定） | 4,662,186,236円   | 4,229,040,633円   |
| D I A M世界アセットバランスファンドV A（適格機関投資家向け）        | 4,229,012,926円   | 3,956,084,868円   |
| D I A Mグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）             | 57,674,003円      | 49,161,702円      |
| D I A M世界バランスファンド55V A（適格機関投資家限定）          | 19,081,560,082円  | 17,806,807,729円  |
| D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド35V A（適格機関投資家限定）    | 3,198,492,340円   | 2,995,642,524円   |
| D I A Mグローバル分散ファンドV A（適格機関投資家限定）           | 147,447,723円     | 123,063,915円     |
| D I A M世界アセットバランスファンド2V A（適格機関投資家限定）       | 23,853,858,855円  | 22,323,284,877円  |
| D I A M世界アセットバランスファンド40V A（適格機関投資家限定）      | 2,344,969,890円   | 2,140,077,053円   |
| D I A M世界アセットバランスファンド25V A（適格機関投資家限定）      | 4,402,861,238円   | 4,107,298,733円   |
| D I A M世界アセットバランスファンド3V A（適格機関投資家限定）       | 14,559,572,911円  | 13,622,087,677円  |
| D I A Mバランス50V A（適格機関投資家限定）                | 174,275円         | 167,314円         |
| D I A Mバランス70V A（適格機関投資家限定）                | 268,252円         | 260,677円         |
| D I A M世界アセットバランスファンド4V A（適格機関投資家限定）       | 19,136,233,639円  | 17,870,595,192円  |
| D I A Mバランス40V A（適格機関投資家限定）                | 81,305円          | 77,914円          |
| D I A Mバランス60V A（適格機関投資家限定）                | 164,740円         | 158,540円         |
| （合 計）                                      | 219,132,408,137円 | 205,519,391,149円 |
| *2 本有価証券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受益権の総数   | 219,132,408,137口 | 205,519,391,149口 |

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

| 区分                       | 自平成23年5月12日<br>至平成23年11月11日                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 自平成23年11月12日<br>至平成24年5月11日 |
|--------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。                                                                                                                                                                                                                                          | 同左                          |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。<br>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引及び株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場及び株価の変動によるリスクを有しております。 | 同左                          |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | 運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。                                                                                                                                                                                                       | 同左                          |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                   | 平成23年11月11日現在                                          | 平成24年5月11日現在 |
|----------------------|--------------------------------------------------------|--------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左           |

|                            |                                                                                                                                                                                                                           |                                                                                                   |
|----------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 2. 時価の算定方法                 | <p>(1)株式、投資信託受益証券及び投資証券<br/>「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)派生商品評価勘定<br/>「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>   | <p>(1)株式、投資信託受益証券及び投資証券<br/>同左</p> <p>(2)派生商品評価勘定<br/>同左</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>同左</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> | 同左                                                                                                |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

|          | 平成23年11月11日現在         | 平成24年5月11日現在          |
|----------|-----------------------|-----------------------|
| 種 類      | 当期の損益に含まれた<br>評価差額(円) | 当期の損益に含まれた<br>評価差額(円) |
| 株式       | 27,681,738,848        | 4,995,710,612         |
| 投資信託受益証券 | 93,719,973            | 71,818,729            |
| 投資証券     | 141,698,014           | 185,839,414           |
| 合計       | 27,917,156,835        | 4,738,052,469         |

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの特定期間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）

## （株式関連）

|               |
|---------------|
| 平成23年11月11日現在 |
|---------------|

| 区分   | 種 類                          | 契約額等（円）       |       | 時価（円）         | 評価損益（円）    |
|------|------------------------------|---------------|-------|---------------|------------|
|      |                              |               | うち1年超 |               |            |
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>買建               |               |       |               |            |
|      | オーストラリアドル<br>SPI 200 FUTURES | 182,041,107   | -     | 184,356,172   | 2,315,065  |
|      | カナダドル<br>S&P/TSE 60 IX FUT   | 305,980,564   | -     | 303,542,484   | 2,438,080  |
|      | ユーロ<br>DJ EURO STOXX 50      | 893,575,763   | -     | 857,796,215   | 35,779,548 |
|      | 英ポンド<br>FTSE 100 INDEX       | 490,924,746   | -     | 482,407,168   | 8,517,578  |
|      | FUTURE<br>米ドル                |               |       |               |            |
|      | S&P 500 FUTURE               | 2,535,963,199 | -     | 2,568,263,916 | 32,300,717 |
| 合 計  |                              | 4,408,485,379 | -     | 4,396,365,955 | 12,119,424 |

| 平成24年5月11日現在 |                              |               |       |               |             |
|--------------|------------------------------|---------------|-------|---------------|-------------|
| 区分           | 種 類                          | 契約額等（円）       |       | 時価（円）         | 評価損益（円）     |
|              |                              |               | うち1年超 |               |             |
| 市場取引         | 株価指数先物取引<br>買建               |               |       |               |             |
|              | オーストラリアドル<br>SPI 200 FUTURES | 280,417,276   | -     | 277,190,848   | 3,226,428   |
|              | カナダドル<br>S&P/TSE 60 IX FUT   | 452,196,124   | -     | 433,961,458   | 18,234,666  |
|              | ユーロ<br>DJ EURO STOXX 50      | 1,364,153,785 | -     | 1,298,447,808 | 65,705,977  |
|              | 英ポンド<br>FTSE 100 INDEX       | 782,025,055   | -     | 755,810,772   | 26,214,283  |
|              | FUTURE<br>米ドル                |               |       |               |             |
|              | S&P 500 FUTURE               | 4,444,308,267 | -     | 4,341,061,760 | 103,246,507 |
| 合 計          |                              | 7,323,100,507 | -     | 7,106,472,646 | 216,627,861 |

## （注）1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として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おります。

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## （通貨関連）

| 平成23年11月11日現在 |  |         |  |
|---------------|--|---------|--|
|               |  | 契約額等（円） |  |

| 区分        | 種 類          |             | うち1年超 | 時価（円）       | 評価損益（円） |
|-----------|--------------|-------------|-------|-------------|---------|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引<br>売建 |             |       |             |         |
|           | ユーロ          | 63,609,800  | -     | 63,246,000  | 363,800 |
|           | 英ポンド         | 12,345,950  | -     | 12,345,000  | 950     |
|           | 米ドル          | 54,402,700  | -     | 54,306,000  | 96,700  |
| 合 計       |              | 130,358,450 | -     | 129,897,000 | 461,450 |

| 平成24年5月11日現在 |              |            |       |            |         |
|--------------|--------------|------------|-------|------------|---------|
| 区分           | 種 類          | 契約額等（円）    |       | 時価（円）      | 評価損益（円） |
|              |              |            | うち1年超 |            |         |
| 市場取引以外の取引    | 為替予約取引<br>売建 |            |       |            |         |
|              | カナダドル        | 15,936,240 | -     | 15,934,000 | 2,240   |
|              | スイスフラン       | 30,948,000 | -     | 31,014,000 | 66,000  |
|              | スウェーデンクローネ   | 14,079,422 | -     | 14,030,000 | 49,422  |
|              | デンマーククローネ    | 4,163,940  | -     | 4,173,000  | 9,060   |
|              | ノルウェークローネ    | 9,567,390  | -     | 9,541,000  | 26,390  |
|              | 香港ドル         | 6,161,880  | -     | 6,174,000  | 12,120  |
|              | 米ドル          | 15,987,680 | -     | 15,986,000 | 1,680   |
| 合 計          |              | 96,844,552 | -     | 96,852,000 | 7,448   |

## （注）時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

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

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

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

2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## （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口当たり情報に関する注記）

|              | 平成23年11月11日現在 | 平成24年5月11日現在 |
|--------------|---------------|--------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.1592円       | 1.2821円      |
| （1万口当たり純資産額） | （11,592円）     | （12,821円）    |

[前へ](#) [次へ](#)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

株 式

平成24年5月11日現在

| 通貨  | 銘柄                            | 株数      | 評価額     |                | 備考 |
|-----|-------------------------------|---------|---------|----------------|----|
|     |                               |         | 単価      | 金額             |    |
| 米ドル | EVEREST RE GROUP LTD          | 8,102   | 102.430 | 829,887.860    |    |
|     | PARTNERRE LTD                 | 7,570   | 73.180  | 553,972.600    |    |
|     | AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD     | 12,784  | 34.650  | 442,965.600    |    |
|     | RENAISSANCERE HOLDINGS LTD    | 8,493   | 79.440  | 674,683.920    |    |
|     | ARCH CAPITAL GROUP LTD        | 21,239  | 39.240  | 833,418.360    |    |
|     | BUNGE LTD                     | 19,670  | 64.420  | 1,267,141.400  |    |
|     | INVESCO LTD                   | 65,700  | 22.740  | 1,494,018.000  |    |
|     | ULTRA PETROLEUM CORP          | 22,514  | 20.600  | 463,788.400    |    |
|     | ACE LTD                       | 52,602  | 75.960  | 3,995,647.920  |    |
|     | TYCO INTERNATIONAL LTD        | 69,164  | 55.060  | 3,808,169.840  |    |
|     | WEATHERFORD INTL LTD          | 113,841 | 13.230  | 1,506,116.430  |    |
|     | NOBLE CORP                    | 40,324  | 35.030  | 1,412,549.720  |    |
|     | GARMIN LTD                    | 20,043  | 45.390  | 909,751.770    |    |
|     | TE CONNECTIVITY LTD           | 65,610  | 33.410  | 2,192,030.100  |    |
|     | SCHLUMBERGER LTD              | 196,935 | 69.440  | 13,675,166.400 |    |
|     | ROWAN COS PLC                 | 21,239  | 32.250  | 684,957.750    |    |
|     | AON PLC                       | 46,043  | 48.160  | 2,217,430.880  |    |
|     | SEAGATE TECHNOLOGY            | 62,318  | 31.470  | 1,961,147.460  |    |
|     | COOPER INDUSTRIES PLC-CL A    | 22,783  | 60.880  | 1,387,029.040  |    |
|     | XL GROUP PLC                  | 53,089  | 22.090  | 1,172,736.010  |    |
|     | INGERSOLL-RAND PLC            | 42,735  | 43.620  | 1,864,100.700  |    |
|     | ACCENTURE PLC-CL A            | 97,895  | 58.700  | 5,746,436.500  |    |
|     | WILLIS GROUP HOLDINGS PLC     | 25,010  | 36.050  | 901,610.500    |    |
|     | WARNER CHILCOTT PLC - CLASS A | 27,146  | 21.340  | 579,295.640    |    |
|     | COVIDIEN PLC                  | 71,814  | 54.740  | 3,931,098.360  |    |
|     | HERBALIFE LTD                 | 16,408  | 46.000  | 754,768.000    |    |
|     | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD   | 22,377  | 26.140  | 584,934.780    |    |
|     | LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV  | 43,628  | 40.460  | 1,765,188.880  |    |
|     | NIELSEN HOLDINGS NV           | 16,327  | 28.680  | 468,258.360    |    |
|     | CARNIVAL CORP COMMON PAIRED   | 69,475  | 31.370  | 2,179,430.750  |    |
|     | FLEXTRONICS INTL LTD          | 110,408 | 6.650   | 734,213.200    |    |
|     | AVAGO TECHNOLOGIES LTD        | 34,354  | 30.880  | 1,060,851.520  |    |
|     | HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST | 713,000 | 0.755   | 538,315.000    |    |
|     | AMAZON.COM INC                | 53,409  | 226.690 | 12,107,286.210 |    |
|     | ABBOTT LABORATORIES           | 236,044 | 62.220  | 14,686,657.680 |    |
|     | AES CORP                      | 99,276  | 12.370  | 1,228,044.120  |    |
|     | ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A   | 14,815  | 47.540  | 704,305.100    |    |
|     | INTL BUSINESS MACHINES CORP   | 175,373 | 200.600 | 35,179,823.800 |    |
|     | ADVANCED MICRO DEVICES        | 93,282  | 6.780   | 632,451.960    |    |
|     | ADOBE SYSTEMS INC             | 72,416  | 31.920  | 2,311,518.720  |    |

|  |                              |         |         |                |  |
|--|------------------------------|---------|---------|----------------|--|
|  | AGCO CORP                    | 14,077  | 43.170  | 607,704.090    |  |
|  | AIRGAS INC                   | 8,926   | 92.490  | 825,565.740    |  |
|  | AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 31,407  | 83.040  | 2,608,037.280  |  |
|  | ENERGEN CORP                 | 12,554  | 46.990  | 589,912.460    |  |
|  | ALLEGHANY CORP               | 1,956   | 340.650 | 666,311.400    |  |
|  | ALLERGAN INC                 | 44,159  | 92.830  | 4,099,279.970  |  |
|  | DU PONT (E.I.) DE NEMOURS    | 137,673 | 52.020  | 7,161,749.460  |  |
|  | RALPH LAUREN CORP            | 9,673   | 158.470 | 1,532,880.310  |  |
|  | ALLSTATE CORP                | 76,609  | 34.600  | 2,650,671.400  |  |
|  | HONEYWELL INTERNATIONAL INC  | 110,304 | 58.570  | 6,460,505.280  |  |
|  | ALTERA CORPORATION           | 50,199  | 33.480  | 1,680,662.520  |  |
|  | ALCOA INC                    | 165,402 | 9.100   | 1,505,158.200  |  |
|  | AMGEN INC                    | 115,631 | 70.090  | 8,104,576.790  |  |
|  | HESS CORP                    | 42,488  | 48.550  | 2,062,792.400  |  |
|  | BEAM INC                     | 19,343  | 58.470  | 1,130,985.210  |  |
|  | AMERICAN EXPRESS CO          | 154,757 | 59.420  | 9,195,660.940  |  |
|  | AMERICAN ELECTRIC POWER      | 68,227  | 38.360  | 2,617,187.720  |  |
|  | AFLAC INC                    | 65,258  | 43.090  | 2,811,967.220  |  |
|  | AMERICAN INTL GROUP          | 87,209  | 32.140  | 2,802,897.260  |  |
|  | ANALOG DEVICES               | 41,618  | 37.130  | 1,545,276.340  |  |
|  | ANADARKO PETROLEUM CORP      | 72,388  | 69.270  | 5,014,316.760  |  |
|  | ALEXION PHARMACEUTICALS INC  | 27,690  | 86.220  | 2,387,431.800  |  |
|  | NABORS INDUSTRIES LTD        | 49,134  | 15.500  | 761,577.000    |  |
|  | ARCH COAL INC                | 33,405  | 8.300   | 277,261.500    |  |
|  | TIME WARNER                  | 145,202 | 35.870  | 5,208,395.740  |  |
|  | VALERO ENERGY CORP           | 88,182  | 22.560  | 1,989,385.920  |  |
|  | APOLLO GROUP INC             | 16,586  | 32.440  | 538,049.840    |  |
|  | APACHE CORP                  | 55,089  | 87.870  | 4,840,670.430  |  |
|  | APPLE INC                    | 138,078 | 570.520 | 78,776,260.560 |  |
|  | APPLIED MATERIALS INC        | 179,493 | 11.060  | 1,985,192.580  |  |
|  | ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO    | 99,776  | 33.500  | 3,342,496.000  |  |
|  | PINNACLE WEST CAPITAL CORP   | 18,364  | 48.970  | 899,285.080    |  |
|  | AMEREN CORP                  | 39,448  | 32.840  | 1,295,472.320  |  |
|  | ARROW ELECTRONICS INC        | 17,437  | 37.180  | 648,307.660    |  |
|  | AUTOLIV INC                  | 14,963  | 59.830  | 895,236.290    |  |
|  | AUTODESK INC                 | 32,299  | 36.180  | 1,168,577.820  |  |
|  | AUTOMATIC DATA PROCESSING    | 72,819  | 53.540  | 3,898,729.260  |  |
|  | AUTOZONE INC                 | 3,428   | 385.730 | 1,322,282.440  |  |
|  | AVERY DENNISON CORP          | 15,202  | 30.680  | 466,397.360    |  |
|  | AVNET INC                    | 22,835  | 33.550  | 766,114.250    |  |
|  | AVON PRODUCTS INC            | 61,411  | 20.890  | 1,282,875.790  |  |
|  | BMC SOFTWARE INC             | 21,537  | 40.280  | 867,510.360    |  |
|  | BAKER HUGHES INC             | 64,277  | 41.670  | 2,678,422.590  |  |
|  | BALL CORP                    | 20,878  | 41.260  | 861,426.280    |  |
|  | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  | 138,375 | 81.780  | 11,316,307.500 |  |
|  | BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 181,697 | 22.230  | 4,039,124.310  |  |
|  | CR BARD INC                  | 10,675  | 101.700 | 1,085,647.500  |  |
|  | BAXTER INTERNATIONAL INC     | 85,958  | 54.420  | 4,677,834.360  |  |

|  |                              |         |        |                |  |
|--|------------------------------|---------|--------|----------------|--|
|  | BED BATH &BEYOND INC         | 33,444  | 68.750 | 2,299,275.000  |  |
|  | BECTON DICKINSON & CO        | 31,810  | 76.620 | 2,437,282.200  |  |
|  | AMETEK INC                   | 25,735  | 50.180 | 1,291,382.300  |  |
|  | NII HOLDINGS INC             | 31,218  | 12.600 | 393,346.800    |  |
|  | VERIZON COMM INC             | 423,060 | 40.550 | 17,155,083.000 |  |
|  | WR BERKLEY CORP              | 18,150  | 39.000 | 707,850.000    |  |
|  | BEST BUY CO INC              | 47,734  | 19.940 | 951,815.960    |  |
|  | YUM! BRANDS INC              | 69,520  | 71.360 | 4,960,947.200  |  |
|  | FIRSTENERGY CORP             | 59,395  | 47.600 | 2,827,202.000  |  |
|  | SLM CORP                     | 73,611  | 13.880 | 1,021,720.680  |  |
|  | H&R BLOCK INC                | 42,326  | 14.580 | 617,113.080    |  |
|  | BOEING CO                    | 107,106 | 73.800 | 7,904,422.800  |  |
|  | ROBERT HALF INTL INC         | 24,240  | 28.890 | 700,293.600    |  |
|  | BORGWARNER INC               | 16,519  | 77.290 | 1,276,753.510  |  |
|  | BOSTON SCIENTIFIC CORP       | 208,603 | 6.280  | 1,310,026.840  |  |
|  | C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC  | 21,464  | 60.520 | 1,299,001.280  |  |
|  | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      | 255,433 | 33.190 | 8,477,821.270  |  |
|  | ONEOK INC                    | 15,305  | 86.720 | 1,327,249.600  |  |
|  | SEMPRA ENERGY                | 35,687  | 64.970 | 2,318,584.390  |  |
|  | FEDEX CORP                   | 45,491  | 86.650 | 3,941,795.150  |  |
|  | VERISIGN INC                 | 21,938  | 40.160 | 881,030.080    |  |
|  | AMPHENOL CORP                | 24,477  | 54.220 | 1,327,142.940  |  |
|  | BROWN-FORMAN CORP            | 13,755  | 86.580 | 1,190,907.900  |  |
|  | QUANTA SERVICES INC          | 33,320  | 23.040 | 767,692.800    |  |
|  | LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC   | 25,732  | 24.400 | 627,860.800    |  |
|  | SIRIUS XM RADIO INC          | 614,899 | 2.175  | 1,337,405.320  |  |
|  | CSX CORP                     | 153,427 | 21.680 | 3,326,297.360  |  |
|  | CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A | 37,409  | 12.490 | 467,238.410    |  |
|  | CABOT OIL & GAS CORP         | 33,398  | 36.170 | 1,208,005.660  |  |
|  | CAMPBELL SOUP CO             | 30,602  | 34.430 | 1,053,626.860  |  |
|  | WHITING PETROLEUM CORP       | 17,265  | 49.250 | 850,301.250    |  |
|  | CONSTELLATION BRANDS INC     | 21,923  | 20.170 | 442,186.910    |  |
|  | CARDINAL HEALTH INC          | 46,778  | 42.240 | 1,975,902.720  |  |
|  | CATERPILLAR INC              | 94,953  | 95.440 | 9,062,314.320  |  |
|  | CELGENE CORP                 | 67,991  | 70.650 | 4,803,564.150  |  |
|  | CITRIX SYSTEMS INC           | 27,277  | 78.350 | 2,137,152.950  |  |
|  | CHESAPEAKE ENERGY CORP       | 101,910 | 17.180 | 1,750,813.800  |  |
|  | CENTURYLINK INC              | 92,807  | 39.530 | 3,668,660.710  |  |
|  | CERNER CORP                  | 20,155  | 79.120 | 1,594,663.600  |  |
|  | JPMORGAN CHASE & CO          | 563,103 | 40.740 | 22,940,816.220 |  |
|  | CHUBB CORP                   | 44,763  | 73.680 | 3,298,137.840  |  |
|  | CHURCH & DWIGHT CO INC       | 23,516  | 53.190 | 1,250,816.040  |  |
|  | CIGNA CORP                   | 38,955  | 44.910 | 1,749,469.050  |  |
|  | CINCINNATI FINANCIAL CORP    | 23,804  | 36.160 | 860,752.640    |  |
|  | CINTAS CORP                  | 13,173  | 38.550 | 507,819.150    |  |
|  | FRONTIER COMMUNICATIONS CORP | 164,569 | 3.500  | 575,991.500    |  |
|  | CISCO SYSTEMS INC            | 795,838 | 16.830 | 13,393,953.540 |  |
|  | CLIFFS NATURAL RESOURCES INC | 21,907  | 56.460 | 1,236,869.220  |  |

|  |                                |         |         |                |  |
|--|--------------------------------|---------|---------|----------------|--|
|  | CLOROX COMPANY                 | 21,099  | 68.520  | 1,445,703.480  |  |
|  | COCA-COLA CO/THE               | 303,114 | 77.410  | 23,464,054.740 |  |
|  | COCA-COLA ENTERPRISES INC      | 49,318  | 29.770  | 1,468,196.860  |  |
|  | COLGATE-PALMOLIVE CO           | 74,150  | 99.650  | 7,389,047.500  |  |
|  | MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A    | 42,730  | 39.240  | 1,676,725.200  |  |
|  | COMCAST CORP-SPECIAL CL A      | 100,389 | 29.170  | 2,928,347.130  |  |
|  | COMERICA INC                   | 31,637  | 31.600  | 999,729.200    |  |
|  | NRG ENERGY, INC.               | 31,248  | 16.130  | 504,030.240    |  |
|  | COMCAST CORP-CL A              | 304,575 | 29.630  | 9,024,557.250  |  |
|  | CA INC                         | 53,086  | 26.410  | 1,402,001.260  |  |
|  | COMPUTER SCIENCES CORP         | 23,064  | 27.000  | 622,728.000    |  |
|  | CONAGRA FOODS INC              | 51,035  | 25.660  | 1,309,558.100  |  |
|  | CONSOLIDATED EDISON INC        | 42,306  | 60.020  | 2,539,206.120  |  |
|  | SARA LEE CORP                  | 72,906  | 21.850  | 1,592,996.100  |  |
|  | CAMERON INTERNATIONAL CORP     | 38,217  | 48.530  | 1,854,671.010  |  |
|  | MOLSON COORS BREWING CO        | 24,801  | 41.110  | 1,019,569.110  |  |
|  | CORNING INC                    | 234,255 | 13.320  | 3,120,276.600  |  |
|  | DIRECTV                        | 101,763 | 47.770  | 4,861,218.510  |  |
|  | COVANCE INC                    | 10,195  | 45.250  | 461,323.750    |  |
|  | CREE INC                       | 21,128  | 31.740  | 670,602.720    |  |
|  | COVENTRY HEALTH CARE INC       | 18,825  | 29.870  | 562,302.750    |  |
|  | SEALED AIR CORP                | 30,348  | 18.120  | 549,905.760    |  |
|  | BROADCOM CORP-CL A             | 68,456  | 33.370  | 2,284,376.720  |  |
|  | CUMMINS INC                    | 27,086  | 105.870 | 2,867,594.820  |  |
|  | L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS    | 14,299  | 71.000  | 1,015,229.000  |  |
|  | DR HORTON INC                  | 39,483  | 16.920  | 668,052.360    |  |
|  | DANAHER CORP                   | 84,482  | 53.730  | 4,539,217.860  |  |
|  | MOODY'S CORP                   | 30,243  | 38.340  | 1,159,516.620  |  |
|  | COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS | 44,752  | 61.050  | 2,732,109.600  |  |
|  | TARGET CORP                    | 96,356  | 55.310  | 5,329,450.360  |  |
|  | DIAMOND OFFSHORE DRILLING      | 9,386   | 63.430  | 595,353.980    |  |
|  | DEERE & CO                     | 62,186  | 78.960  | 4,910,206.560  |  |
|  | DELL INC                       | 240,529 | 15.550  | 3,740,225.950  |  |
|  | MORGAN STANLEY                 | 207,677 | 15.600  | 3,239,761.200  |  |
|  | REPUBLIC SERVICES INC          | 42,165  | 27.030  | 1,139,719.950  |  |
|  | THE WALT DISNEY CO             | 251,227 | 45.280  | 11,375,558.560 |  |
|  | DOLLAR TREE INC                | 18,954  | 102.250 | 1,938,046.500  |  |
|  | DOVER CORP                     | 27,697  | 58.910  | 1,631,630.270  |  |
|  | DOW CHEMICAL                   | 174,047 | 32.190  | 5,602,572.930  |  |
|  | OMNICOM GROUP                  | 42,885  | 50.520  | 2,166,550.200  |  |
|  | DTE ENERGY CO                  | 21,997  | 56.340  | 1,239,310.980  |  |
|  | DUKE ENERGY CORP               | 197,549 | 21.790  | 4,304,592.710  |  |
|  | CROWN CASTLE INTERNATIONAL COR | 42,768  | 55.560  | 2,376,190.080  |  |
|  | FLOWSERVE CORP                 | 8,844   | 111.520 | 986,282.880    |  |
|  | DARDEN RESTAURANTS INC         | 21,227  | 50.890  | 1,080,242.030  |  |
|  | EBAY INC                       | 170,495 | 41.210  | 7,026,098.950  |  |

|  |                              |           |         |                |  |
|--|------------------------------|-----------|---------|----------------|--|
|  | EMC CORP/MASS                | 297,811   | 26.140  | 7,784,779.540  |  |
|  | BANK OF AMERICA CORP         | 1,492,775 | 7.700   | 11,494,367.500 |  |
|  | EL PASO CORP                 | 120,489   | 29.610  | 3,567,679.290  |  |
|  | CITIGROUP INC                | 431,535   | 30.650  | 13,226,547.750 |  |
|  | EASTMAN CHEMICAL CO          | 16,849    | 50.000  | 842,450.000    |  |
|  | EATON CORP                   | 46,001    | 44.910  | 2,065,904.910  |  |
|  | EATON VANCE CORP             | 11,913    | 25.250  | 300,803.250    |  |
|  | DISH NETWORK CORP            | 30,117    | 30.810  | 927,904.770    |  |
|  | ECOLAB INC                   | 46,301    | 64.810  | 3,000,767.810  |  |
|  | ELECTRONIC ARTS INC          | 52,870    | 14.710  | 777,717.700    |  |
|  | SALESFORCE.COM INC           | 19,372    | 135.440 | 2,623,743.680  |  |
|  | EMERSON ELECTRIC CO          | 110,737   | 48.500  | 5,370,744.500  |  |
|  | ENTERGY CORP                 | 27,589    | 64.620  | 1,782,801.180  |  |
|  | EOG RESOURCES INC            | 40,959    | 106.510 | 4,362,543.090  |  |
|  | EQUIFAX INC                  | 15,777    | 46.080  | 727,004.160    |  |
|  | EQT CORP                     | 21,454    | 49.840  | 1,069,267.360  |  |
|  | ESTEE LAUDER COS INC/THE     | 33,570    | 59.170  | 1,986,336.900  |  |
|  | EXPEDITORS INTERNATIONAL     | 26,827    | 38.800  | 1,040,887.600  |  |
|  | EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO   | 114,357   | 54.340  | 6,214,159.380  |  |
|  | EXXON MOBIL CORP             | 712,995   | 82.840  | 59,064,505.800 |  |
|  | FMC CORP                     | 9,929     | 105.620 | 1,048,700.980  |  |
|  | NEXTERA ENERGY INC           | 62,598    | 65.090  | 4,074,503.820  |  |
|  | FAMILY DOLLAR STORES         | 12,605    | 68.460  | 862,938.300    |  |
|  | ASSURANT INC                 | 14,771    | 37.570  | 554,946.470    |  |
|  | FASTENAL CO                  | 39,611    | 44.140  | 1,748,429.540  |  |
|  | FIFTH THIRD BANCORP          | 124,158   | 14.190  | 1,761,802.020  |  |
|  | M&T BANK CORP                | 15,930    | 85.230  | 1,357,713.900  |  |
|  | TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP | 18,192    | 42.820  | 778,981.440    |  |
|  | FISERV INC                   | 18,260    | 66.470  | 1,213,742.200  |  |
|  | FLIR SYSTEMS INC             | 20,650    | 21.550  | 445,007.500    |  |
|  | MACY'S INC                   | 65,941    | 37.830  | 2,494,548.030  |  |
|  | FORD MOTOR CO                | 517,185   | 10.710  | 5,539,051.350  |  |
|  | FOREST LABORATORIES INC      | 40,759    | 33.990  | 1,385,398.410  |  |
|  | FOSSIL INC                   | 8,025     | 78.700  | 631,567.500    |  |
|  | FRANKLIN RESOURCES INC       | 21,828    | 115.000 | 2,510,220.000  |  |
|  | FREEMONT-MCMORAN COPPER&GOLD | 140,054   | 35.310  | 4,945,306.740  |  |
|  | GAP INC/THE                  | 42,827    | 28.120  | 1,204,295.240  |  |
|  | DENTSPLY INTERNATIONAL INC   | 22,388    | 39.320  | 880,296.160    |  |
|  | GENERAL DYNAMICS CORP        | 45,290    | 66.540  | 3,013,596.600  |  |
|  | GENERAL MILLS INC            | 97,221    | 39.250  | 3,815,924.250  |  |
|  | GENUINE PARTS CO             | 24,938    | 64.680  | 1,612,989.840  |  |
|  | GILEAD SCIENCES INC          | 114,280   | 51.250  | 5,856,850.000  |  |
|  | STARWOOD HOTELS&RESORTS      | 25,577    | 56.860  | 1,454,308.220  |  |
|  | GOODRICH CORP                | 19,092    | 125.000 | 2,386,500.000  |  |
|  | GOODYEAR TIRE & RUBBER CO    | 36,681    | 10.300  | 377,814.300    |  |
|  | MCKESSON CORP                | 36,546    | 89.710  | 3,278,541.660  |  |
|  | NVIDIA CORP                  | 88,899    | 12.420  | 1,104,125.580  |  |
|  | GENERAL ELECTRIC CO          | 1,568,242 | 19.090  | 29,937,739.780 |  |

|  |                                   |         |         |                |  |
|--|-----------------------------------|---------|---------|----------------|--|
|  | WW GRAINGER INC                   | 8,547   | 202.400 | 1,729,912.800  |  |
|  | GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE      | 22,545  | 26.090  | 588,199.050    |  |
|  | LIFE TECHNOLOGIES CORP            | 23,927  | 43.890  | 1,050,156.030  |  |
|  | NUANCE COMMUNICATIONS INC         | 41,880  | 23.090  | 967,009.200    |  |
|  | HALLIBURTON CO                    | 140,466 | 32.310  | 4,538,456.460  |  |
|  | MONSTER BEVERAGE CORP             | 22,576  | 71.170  | 1,606,733.920  |  |
|  | GOLDMAN SACHS GROUP INC           | 68,476  | 106.320 | 7,280,368.320  |  |
|  | HARLEY-DAVIDSON INC               | 36,670  | 50.670  | 1,858,068.900  |  |
|  | HARRIS CORP                       | 14,775  | 41.340  | 610,798.500    |  |
|  | CONSOL ENERGY INC                 | 36,761  | 34.580  | 1,271,195.380  |  |
|  | HASBRO INC                        | 17,406  | 35.480  | 617,564.880    |  |
|  | HENRY SCHEIN INC                  | 13,991  | 76.110  | 1,064,855.010  |  |
|  | DENBURY RESOURCES INC             | 55,448  | 17.420  | 965,904.160    |  |
|  | HJ HEINZ CO                       | 47,379  | 54.820  | 2,597,316.780  |  |
|  | HELMERICH & PAYNE INC             | 15,984  | 46.380  | 741,337.920    |  |
|  | HERSHEY FOODS CORP                | 25,491  | 68.670  | 1,750,466.970  |  |
|  | HEWLETT-PACKARD CO                | 302,922 | 23.510  | 7,121,696.220  |  |
|  | F5 NETWORKS INC                   | 11,354  | 124.080 | 1,408,804.320  |  |
|  | CROWN HOLDINGS INC NPR            | 20,737  | 36.800  | 763,121.600    |  |
|  | REYNOLDS AMERICAN INC             | 56,345  | 40.570  | 2,285,916.650  |  |
|  | SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A      | 12,207  | 53.030  | 647,337.210    |  |
|  | JUNIPER NETWORKS INC              | 85,477  | 18.070  | 1,544,569.390  |  |
|  | HOLLYFRONTIER CORP                | 35,010  | 30.280  | 1,060,102.800  |  |
|  | HOLOGIC INC                       | 34,080  | 17.240  | 587,539.200    |  |
|  | UNUM GROUP                        | 32,618  | 21.760  | 709,767.680    |  |
|  | HOME DEPOT INC                    | 226,458 | 50.620  | 11,463,303.960 |  |
|  | HORMEL FOODS CORP                 | 24,530  | 29.240  | 717,257.200    |  |
|  | HUDSON CITY BANCORP INC           | 86,651  | 6.670   | 577,962.170    |  |
|  | CENTERPOINT ENERGY INC            | 56,244  | 20.250  | 1,138,941.000  |  |
|  | HUMANA INC                        | 25,341  | 79.400  | 2,012,075.400  |  |
|  | JB HUNT TRANSPORT SERVICES<br>INC | 13,732  | 55.230  | 758,418.360    |  |
|  | RED HAT INC                       | 28,834  | 56.040  | 1,615,857.360  |  |
|  | BIOGEN IDEC INC                   | 34,517  | 134.310 | 4,635,978.270  |  |
|  | ILLINOIS TOOL WORKS               | 64,118  | 56.330  | 3,611,766.940  |  |
|  | INTUIT INC                        | 39,692  | 55.430  | 2,200,127.560  |  |
|  | INTEL CORP                        | 754,271 | 27.240  | 20,546,342.040 |  |
|  | INTL FLAVORS & FRAGRANCES         | 13,144  | 58.320  | 766,558.080    |  |
|  | INTL GAME TECH                    | 44,449  | 14.900  | 662,290.100    |  |
|  | INTERNATIONAL PAPER CO            | 56,416  | 31.240  | 1,762,435.840  |  |
|  | INTERPUBLIC GROUP OF COS INC      | 57,675  | 11.640  | 671,337.000    |  |
|  | JACOBS ENGINEERING GROUP INC      | 19,580  | 38.980  | 763,228.400    |  |
|  | JOHNSON & JOHNSON                 | 406,820 | 64.570  | 26,268,367.400 |  |
|  | HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP       | 63,376  | 19.750  | 1,251,676.000  |  |
|  | JOHNSON CONTROLS INC              | 100,080 | 31.790  | 3,181,543.200  |  |
|  | KLA-TENCOR CORP                   | 24,993  | 50.000  | 1,249,650.000  |  |
|  | DEVON ENERGY CORP                 | 58,245  | 64.600  | 3,762,627.000  |  |
|  | KELLOGG CO                        | 38,305  | 50.930  | 1,950,873.650  |  |

|  |                               |           |         |                |  |
|--|-------------------------------|-----------|---------|----------------|--|
|  | KEYCORP                       | 141,232   | 7.890   | 1,114,320.480  |  |
|  | KIMBERLY-CLARK CORP           | 58,054    | 79.740  | 4,629,225.960  |  |
|  | BLACKROCK INC/NEW YORK        | 15,706    | 179.680 | 2,822,054.080  |  |
|  | KOHL'S CORP                   | 35,269    | 48.660  | 1,716,189.540  |  |
|  | KROGER CO                     | 83,437    | 23.080  | 1,925,725.960  |  |
|  | LSI CORP                      | 89,888    | 7.710   | 693,036.480    |  |
|  | LAM RESEARCH CORP             | 14,115    | 40.450  | 570,951.750    |  |
|  | AKAMAI TECHNOLOGIES           | 25,490    | 31.370  | 799,621.300    |  |
|  | LEGG MASON INC                | 22,970    | 23.400  | 537,498.000    |  |
|  | LEGGETT & PLATT INC           | 19,896    | 20.810  | 414,035.760    |  |
|  | LEUCADIA NATIONAL CORP        | 30,757    | 23.390  | 719,406.230    |  |
|  | ELI LILLY & CO                | 156,475   | 41.750  | 6,532,831.250  |  |
|  | LIMITED BRANDS                | 35,739    | 48.670  | 1,739,417.130  |  |
|  | LINCOLN NATIONAL CORP         | 44,623    | 23.490  | 1,048,194.270  |  |
|  | LINEAR TECH CORP              | 29,706    | 30.760  | 913,756.560    |  |
|  | UNITED PARCEL SERVICE-CL B    | 109,367   | 76.610  | 8,378,605.870  |  |
|  | AGILENT TECHNOLOGIES INC      | 49,164    | 39.740  | 1,953,777.360  |  |
|  | LOCKHEED MARTIN CORP          | 41,863    | 86.120  | 3,605,241.560  |  |
|  | LOEWS CORP                    | 51,052    | 41.000  | 2,093,132.000  |  |
|  | RANGE RESOURCES CORP          | 23,850    | 67.220  | 1,603,197.000  |  |
|  | ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC    | 12,442    | 39.910  | 496,560.220    |  |
|  | LOWE'S COS INC                | 190,148   | 30.180  | 5,738,666.640  |  |
|  | DOMINION RESOURCES INC/VA     | 88,598    | 52.110  | 4,616,841.780  |  |
|  | IRON MOUNTAIN INC             | 18,556    | 30.830  | 572,081.480    |  |
|  | SCANA CORP                    | 17,601    | 46.610  | 820,382.610    |  |
|  | MDU RESOURCES GROUP INC       | 20,489    | 22.930  | 469,812.770    |  |
|  | MGM RESORTS INTERNATIONAL     | 40,383    | 11.660  | 470,865.780    |  |
|  | MCCORMICK & CO INC            | 19,813    | 56.880  | 1,126,963.440  |  |
|  | MCDONALD'S CORPORATION        | 152,603   | 91.870  | 14,019,637.610 |  |
|  | MCGRAW-HILL COMPANIES INC     | 45,478    | 47.400  | 2,155,657.200  |  |
|  | MANPOWER INC                  | 13,462    | 39.020  | 525,287.240    |  |
|  | EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR | 17,151    | 84.050  | 1,441,541.550  |  |
|  | MARSH & MCLENNAN COS          | 85,095    | 33.310  | 2,834,514.450  |  |
|  | ENERGIZER HOLDINGS INC        | 11,343    | 74.360  | 843,465.480    |  |
|  | MASCO CORP                    | 58,195    | 13.930  | 810,656.350    |  |
|  | MARTIN MARIETTA MATERIALS INC | 5,102     | 76.990  | 392,802.980    |  |
|  | MATTEL INC                    | 51,106    | 32.420  | 1,656,856.520  |  |
|  | METLIFE INC                   | 157,776   | 34.610  | 5,460,627.360  |  |
|  | MAXIM INTEGRATED PRODUCTS     | 42,676    | 26.860  | 1,146,277.360  |  |
|  | MEDTRONIC INC                 | 152,808   | 38.420  | 5,870,883.360  |  |
|  | ACTIVISION BLIZZARD INC       | 85,641    | 12.740  | 1,091,066.340  |  |
|  | CVS CAREMARK CORP             | 192,202   | 45.970  | 8,835,525.940  |  |
|  | MERCK & CO. INC.              | 453,711   | 38.390  | 17,417,965.290 |  |
|  | LABORATORY CRP OF AMER HLDGS  | 15,651    | 85.870  | 1,343,951.370  |  |
|  | MICROSOFT CORP                | 1,124,828 | 30.740  | 34,577,212.720 |  |
|  | MICRON TECH INC               | 123,712   | 6.290   | 778,148.480    |  |
|  | MICROCHIP TECHNOLOGY INC      | 26,818    | 31.930  | 856,298.740    |  |
|  | MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD  | 77,055    | 13.560  | 1,044,865.800  |  |

|  |                             |           |         |                |  |
|--|-----------------------------|-----------|---------|----------------|--|
|  | 3M CO                       | 98,307    | 87.130  | 8,565,488.910  |  |
|  | MOHAWK INDUSTRIES INC       | 8,958     | 73.710  | 660,294.180    |  |
|  | PROGRESS ENERGY INC         | 45,232    | 55.040  | 2,489,569.280  |  |
|  | MOTOROLA SOLUTIONS INC      | 41,067    | 49.540  | 2,034,459.180  |  |
|  | KANSAS CITY SOUTHERN        | 16,023    | 72.630  | 1,163,750.490  |  |
|  | MURPHY OIL CORPORATION      | 25,983    | 49.220  | 1,278,883.260  |  |
|  | MYLAN LABORATORIES          | 60,562    | 21.080  | 1,276,646.960  |  |
|  | ILLUMINA INC                | 20,615    | 45.110  | 929,942.650    |  |
|  | XCEL ENERGY INC             | 76,360    | 27.500  | 2,099,900.000  |  |
|  | NATIONAL OILWELL VARCO INC  | 60,552    | 68.390  | 4,141,151.280  |  |
|  | NETAPP INC                  | 56,606    | 35.700  | 2,020,834.200  |  |
|  | SEARS HOLDINGS CORP         | 6,881     | 54.960  | 378,179.760    |  |
|  | NEWFIELD EXPLORATION CO     | 20,264    | 32.860  | 665,875.040    |  |
|  | NEWELL RUBBERMAID INC       | 34,943    | 18.430  | 643,999.490    |  |
|  | DUN & BRADSTREET CORP       | 5,033     | 65.570  | 330,013.810    |  |
|  | NEWMONT MINING CORP         | 72,972    | 46.200  | 3,371,306.400  |  |
|  | NIKE INC-CL B               | 51,746    | 107.560 | 5,565,799.760  |  |
|  | NOBLE ENERGY INC            | 26,091    | 90.170  | 2,352,625.470  |  |
|  | NORDSTROM INC               | 26,726    | 53.530  | 1,430,642.780  |  |
|  | NORFOLK SOUTHERN CORP       | 54,576    | 68.170  | 3,720,445.920  |  |
|  | NORTHEAST UTILITIES         | 51,552    | 36.460  | 1,879,585.920  |  |
|  | NISOURCE INC                | 44,250    | 25.260  | 1,117,755.000  |  |
|  | COACH INC                   | 41,794    | 68.700  | 2,871,247.800  |  |
|  | NORTHERN TRUST CORP         | 31,465    | 45.370  | 1,427,567.050  |  |
|  | NORTHROP GRUMMAN CORP       | 36,493    | 60.700  | 2,215,125.100  |  |
|  | WELLS FARGO & CO            | 743,671   | 33.190  | 24,682,440.490 |  |
|  | NUCOR CORP                  | 42,219    | 37.050  | 1,564,213.950  |  |
|  | MONSANTO CO                 | 81,260    | 71.710  | 5,827,154.600  |  |
|  | CAPITAL ONE FINANCIAL CORP  | 75,600    | 54.310  | 4,105,836.000  |  |
|  | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP   | 119,534   | 85.020  | 10,162,780.680 |  |
|  | O'REILLY AUTOMOTIVE INC     | 18,841    | 103.130 | 1,943,072.330  |  |
|  | OMNICARE INC                | 18,060    | 34.460  | 622,347.600    |  |
|  | ORACLE CORP                 | 597,135   | 27.020  | 16,134,587.700 |  |
|  | OWENS-ILLINOIS INC          | 23,621    | 21.840  | 515,882.640    |  |
|  | PACCAR INC                  | 46,837    | 39.450  | 1,847,719.650  |  |
|  | PALL CORP                   | 19,300    | 57.910  | 1,117,663.000  |  |
|  | EXELON CORP                 | 123,414   | 38.940  | 4,805,741.160  |  |
|  | PARKER HANNIFIN CORP        | 20,916    | 86.210  | 1,803,168.360  |  |
|  | PATTERSON COS INC           | 12,490    | 33.520  | 418,664.800    |  |
|  | PAYCHEX INC                 | 46,374    | 29.860  | 1,384,727.640  |  |
|  | JC PENNEY CO INC HOLDING CO | 25,588    | 33.810  | 865,130.280    |  |
|  | PPL CORPORATION             | 90,174    | 27.720  | 2,499,623.280  |  |
|  | PEPSICO INC                 | 231,141   | 66.790  | 15,437,907.390 |  |
|  | PENTAIR INC                 | 14,352    | 42.680  | 612,543.360    |  |
|  | PERRIGO CO                  | 13,145    | 100.820 | 1,325,278.900  |  |
|  | PFIZER INC                  | 1,145,136 | 22.830  | 26,143,454.880 |  |
|  | CONOCOPHILLIPS              | 186,555   | 54.220  | 10,115,012.100 |  |
|  | PETSMART INC                | 18,380    | 56.720  | 1,042,513.600  |  |

|  |                                   |         |         |                |  |
|--|-----------------------------------|---------|---------|----------------|--|
|  | PG&E CORP                         | 62,245  | 44.270  | 2,755,586.150  |  |
|  | PITNEY BOWES INC                  | 24,423  | 15.170  | 370,496.910    |  |
|  | PIONEER NATURAL RESOURCES CO      | 17,254  | 104.230 | 1,798,384.420  |  |
|  | ALTRIA GROUP INC                  | 313,040 | 31.730  | 9,932,759.200  |  |
|  | PNC FINANCIAL SERVICES GROUP      | 79,818  | 65.530  | 5,230,473.540  |  |
|  | AETNA INC                         | 56,047  | 41.840  | 2,345,006.480  |  |
|  | FLUOR CORP (NEW)                  | 26,148  | 54.600  | 1,427,680.800  |  |
|  | PPG INDUSTRIES INC                | 20,737  | 105.730 | 2,192,523.010  |  |
|  | PRAXAIR INC                       | 44,618  | 111.750 | 4,986,061.500  |  |
|  | PRECISION CASTPARTS CORP          | 20,847  | 168.890 | 3,520,849.830  |  |
|  | COSTCO WHOLESALE CORP             | 65,530  | 83.880  | 5,496,656.400  |  |
|  | T ROWE PRICE GROUP INC            | 36,637  | 59.870  | 2,193,457.190  |  |
|  | QUEST DIAGNOSTICS                 | 24,069  | 57.580  | 1,385,893.020  |  |
|  | PROCTER & GAMBLE CO               | 410,196 | 64.140  | 26,309,971.440 |  |
|  | PROGRESSIVE CORP                  | 88,041  | 22.030  | 1,939,543.230  |  |
|  | PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP      | 79,277  | 31.990  | 2,536,071.230  |  |
|  | NEW YORK COMMUNITY BANCORP<br>INC | 70,124  | 12.840  | 900,392.160    |  |
|  | QUALCOMM INC                      | 248,596 | 62.480  | 15,532,278.080 |  |
|  | US BANCORP                        | 281,061 | 31.910  | 8,968,656.510  |  |
|  | RALCORP HOLDINGS INC              | 9,036   | 71.220  | 643,543.920    |  |
|  | ROSS STORES INC                   | 33,430  | 61.790  | 2,065,639.700  |  |
|  | ROCK-TENN COMPANY -CL A           | 10,158  | 57.520  | 584,288.160    |  |
|  | ROPER INDUSTRIES INC              | 12,199  | 101.660 | 1,240,150.340  |  |
|  | PEABODY ENERGY CORP               | 41,483  | 28.960  | 1,201,347.680  |  |
|  | ROCKWELL AUTOMATION INC           | 20,641  | 77.180  | 1,593,072.380  |  |
|  | RAYTHEON COMPANY                  | 51,646  | 52.370  | 2,704,701.020  |  |
|  | KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC      | 13,659  | 72.260  | 986,999.340    |  |
|  | ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP        | 8,505   | 125.800 | 1,069,929.000  |  |
|  | FMC TECHNOLOGIES INC              | 36,804  | 44.730  | 1,646,242.920  |  |
|  | KRAFT FOODS INC-A                 | 255,725 | 39.060  | 9,988,618.500  |  |
|  | SANDISK CORP                      | 38,624  | 35.580  | 1,374,241.920  |  |
|  | SAFEWAY INC                       | 56,305  | 19.160  | 1,078,803.800  |  |
|  | ROCKWELL COLLINS INC              | 23,945  | 52.260  | 1,251,365.700  |  |
|  | ST JUDE MEDICAL INC               | 49,860  | 39.130  | 1,951,021.800  |  |
|  | THE TRAVELERS COMPANIES INC       | 62,181  | 64.640  | 4,019,379.840  |  |
|  | FIDELITY NATIONAL INFORMATION     | 34,060  | 32.560  | 1,108,993.600  |  |
|  | PRICELINE.COM INC                 | 7,489   | 681.110 | 5,100,832.790  |  |
|  | SCHWAB (CHARLES) CORP             | 165,176 | 13.040  | 2,153,895.040  |  |
|  | JOY GLOBAL INC                    | 16,611  | 64.740  | 1,075,396.140  |  |
|  | ZIMMER HOLDINGS INC               | 25,985  | 62.130  | 1,614,448.050  |  |
|  | SPX CORP                          | 7,436   | 78.260  | 581,941.360    |  |
|  | SEI INVESTMENTS CO                | 15,882  | 18.990  | 301,599.180    |  |
|  | WELLPOINT INC                     | 51,689  | 65.940  | 3,408,372.660  |  |
|  | AMERISOURCEBERGEN CORP            | 37,481  | 36.580  | 1,371,054.980  |  |
|  | PRINCIPAL FINANCIAL GROUP         | 48,798  | 25.660  | 1,252,156.680  |  |
|  | SHERWIN-WILLIAMS CO/THE           | 11,895  | 122.970 | 1,462,728.150  |  |
|  | SUPERIOR ENERGY SERVICES INC      | 24,554  | 24.130  | 592,488.020    |  |

|  |                            |         |         |                |  |
|--|----------------------------|---------|---------|----------------|--|
|  | SIGMA-ALDRICH              | 17,354  | 70.560  | 1,224,498.240  |  |
|  | PRUDENTIAL FINANCIAL INC   | 69,882  | 51.640  | 3,608,706.480  |  |
|  | ADVANCE AUTO PARTS         | 12,466  | 89.070  | 1,110,346.620  |  |
|  | UNITED STATES STEEL CORP   | 20,827  | 25.850  | 538,377.950    |  |
|  | SOUTHWESTERN ENERGY CO     | 55,432  | 30.740  | 1,703,979.680  |  |
|  | EDISON INTERNATIONAL       | 46,526  | 44.110  | 2,052,261.860  |  |
|  | SOUTHERN CO                | 132,142 | 45.650  | 6,032,282.300  |  |
|  | BB&T CORP                  | 102,369 | 31.770  | 3,252,263.130  |  |
|  | SOUTHWEST AIRLINES         | 17,528  | 8.100   | 141,976.800    |  |
|  | AT&T INC                   | 884,262 | 33.130  | 29,295,600.060 |  |
|  | CHEVRON CORP               | 296,108 | 103.360 | 30,605,722.880 |  |
|  | MEADWESTVACO CORP          | 27,873  | 27.860  | 776,541.780    |  |
|  | STANLEY BLACK & DECKER INC | 24,464  | 70.900  | 1,734,497.600  |  |
|  | STAPLES INC                | 107,183 | 14.960  | 1,603,457.680  |  |
|  | STATE STREET CORP          | 73,971  | 43.900  | 3,247,326.900  |  |
|  | STARBUCKS CORP             | 112,213 | 54.850  | 6,154,883.050  |  |
|  | STRYKER CORP               | 44,084  | 53.370  | 2,352,763.080  |  |
|  | NETFLIX INC                | 7,832   | 72.420  | 567,193.440    |  |
|  | SUNOCO INC                 | 17,700  | 48.870  | 864,999.000    |  |
|  | STERICYCLE INC             | 12,270  | 83.320  | 1,022,336.400  |  |
|  | SUNTRUST BANKS INC         | 80,614  | 23.590  | 1,901,684.260  |  |
|  | SYMANTEC CORP              | 108,592 | 15.530  | 1,686,433.760  |  |
|  | SYNOPSYS INC               | 22,281  | 28.880  | 643,475.280    |  |
|  | SYSCO CORP                 | 83,330  | 27.880  | 2,323,240.400  |  |
|  | INTUITIVE SURGICAL INC     | 5,872   | 556.750 | 3,269,236.000  |  |
|  | TEXAS INSTRUMENTS INC      | 174,293 | 30.780  | 5,364,738.540  |  |
|  | TEXTRON INC                | 42,770  | 24.230  | 1,036,317.100  |  |

[前へ](#) [次へ](#)

平成24年5月11日現在

| 通貨 | 銘柄                           | 株数      | 評価額     |                | 備考 |
|----|------------------------------|---------|---------|----------------|----|
|    |                              |         | 単価      | 金額             |    |
|    | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 55,446  | 53.460  | 2,964,143.160  |    |
|    | TIFFANY & CO                 | 19,250  | 63.630  | 1,224,877.500  |    |
|    | TOLL BROTHERS INC            | 20,812  | 26.760  | 556,929.120    |    |
|    | TORCHMARK CORP               | 13,057  | 47.990  | 626,605.430    |    |
|    | TOTAL SYSTEM SERVICES INC    | 24,367  | 22.830  | 556,298.610    |    |
|    | DAVITA INC                   | 13,301  | 84.170  | 1,119,545.170  |    |
|    | TYSON FOODS INC              | 47,556  | 19.540  | 929,244.240    |    |
|    | URS CORP                     | 10,094  | 38.560  | 389,224.640    |    |
|    | MARATHON OIL CORP            | 98,800  | 26.980  | 2,665,624.000  |    |
|    | UNION PACIFIC CORP           | 70,705  | 112.410 | 7,947,949.050  |    |
|    | UNITED TECHNOLOGIES CORP     | 127,111 | 77.290  | 9,824,409.190  |    |
|    | UNITEDHEALTH GROUP INC       | 161,113 | 55.290  | 8,907,937.770  |    |
|    | SPRINT NEXTEL CORP           | 414,446 | 2.450   | 1,015,392.700  |    |
|    | VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC   | 18,206  | 64.110  | 1,167,186.660  |    |
|    | VF CORP                      | 12,611  | 139.380 | 1,757,721.180  |    |
|    | CBS CORP                     | 90,469  | 33.030  | 2,988,191.070  |    |
|    | VERTEX PHARMACEUTICALS INC   | 30,143  | 60.190  | 1,814,307.170  |    |
|    | VULCAN MATERIALS CO          | 20,011  | 39.990  | 800,239.890    |    |
|    | URBAN OUTFITTERS INC         | 19,027  | 27.690  | 526,857.630    |    |
|    | WALGREEN CO                  | 134,024 | 34.050  | 4,563,517.200  |    |
|    | WAL-MART STORES INC          | 283,903 | 59.190  | 16,804,218.570 |    |
|    | WASTE MANAGEMENT INC         | 64,451  | 33.830  | 2,180,377.330  |    |
|    | WATERS CORP                  | 12,959  | 84.290  | 1,092,314.110  |    |
|    | WASHINGTON POST              | 998     | 337.000 | 336,326.000    |    |
|    | WATSON PHARMACEUTICALS INC   | 18,235  | 72.880  | 1,328,966.800  |    |
|    | JM SMUCKER CO/THE-NEW        | 18,084  | 77.000  | 1,392,468.000  |    |
|    | WALTER INDUSTRIES INC        | 10,524  | 61.650  | 648,804.600    |    |
|    | WESTERN DIGITAL CORP         | 34,785  | 40.740  | 1,417,140.900  |    |
|    | WEYERHAEUSER CO              | 73,045  | 20.010  | 1,461,630.450  |    |
|    | WHIRLPOOL CORP               | 11,190  | 61.130  | 684,044.700    |    |
|    | WYNN RESORTS LTD             | 12,936  | 113.250 | 1,465,002.000  |    |
|    | WHOLE FOODS MARKET INC       | 21,819  | 88.160  | 1,923,563.040  |    |
|    | NASDAQ STOCK MARKET INC      | 18,704  | 23.730  | 443,845.920    |    |
|    | CME GROUP INC                | 9,764   | 261.710 | 2,555,336.440  |    |
|    | WILLIAMS COS INC             | 90,353  | 32.530  | 2,939,183.090  |    |
|    | PEPCO HOLDINGS INC           | 36,572  | 19.040  | 696,330.880    |    |
|    | ALLIANT ENERGY CORP          | 17,827  | 44.360  | 790,805.720    |    |
|    | WISCONSIN ENERGY CORP        | 35,977  | 36.890  | 1,327,191.530  |    |
|    | PLAINS EXPLORATION & PRODUCT | 23,108  | 39.520  | 913,228.160    |    |
|    | INTEGRYS ENERGY GROUP INC    | 12,983  | 54.180  | 703,418.940    |    |
|    | TD AMERITRADE HOLDING CORP   | 24,850  | 17.730  | 440,590.500    |    |
|    | CARMAX INC                   | 29,210  | 30.040  | 877,468.400    |    |
|    | XEROX CORP                   | 205,853 | 7.640   | 1,572,716.920  |    |
|    | XILINX INC                   | 36,827  | 33.330  | 1,227,443.910  |    |

|  |                                     |         |         |                |  |
|--|-------------------------------------|---------|---------|----------------|--|
|  | YAHOO! INC                          | 185,952 | 15.440  | 2,871,098.880  |  |
|  | CIMAREX ENERGY CO                   | 12,720  | 65.280  | 830,361.600    |  |
|  | TJX COMPANIES INC                   | 113,926 | 41.790  | 4,760,967.540  |  |
|  | HOSPIRA INC                         | 25,220  | 33.770  | 851,679.400    |  |
|  | GENWORTH FINANCIAL INC              | 73,428  | 5.670   | 416,336.760    |  |
|  | CBRE GROUP INC                      | 50,310  | 17.240  | 867,344.400    |  |
|  | LIBERTY GLOBAL INC                  | 17,272  | 49.530  | 855,482.160    |  |
|  | REGIONS FINANCIAL CORP              | 180,755 | 6.670   | 1,205,635.850  |  |
|  | GOOGLE INC                          | 37,961  | 613.660 | 23,295,147.260 |  |
|  | METROPCS COMMUNICATIONS INC         | 48,345  | 7.060   | 341,315.700    |  |
|  | LAS VEGAS SANDS CORP                | 56,529  | 51.740  | 2,924,810.460  |  |
|  | MOSAIC CO/THE                       | 45,346  | 48.900  | 2,217,419.400  |  |
|  | NEWS CORP CLASS B                   | 72,381  | 20.600  | 1,491,048.600  |  |
|  | NEWS CORP INC CLASS A               | 243,817 | 20.320  | 4,954,361.440  |  |
|  | DOLBY LABORATORIES INC-CL A         | 11,212  | 44.560  | 499,606.720    |  |
|  | CELANESE CORP                       | 24,956  | 44.800  | 1,118,028.800  |  |
|  | WINDSTREAM CORP                     | 73,694  | 10.090  | 743,572.460    |  |
|  | ALPHA NATURAL RESOURCES INC         | 37,286  | 13.670  | 509,699.620    |  |
|  | IHS INC-CLASS A                     | 8,495   | 97.570  | 828,857.150    |  |
|  | DISCOVERY COMMNUCATIONS-A           | 17,131  | 50.780  | 869,912.180    |  |
|  | EXPEDIA INC                         | 14,880  | 40.910  | 608,740.800    |  |
|  | CF INDUSTRIES HOLDINGS INC          | 9,581   | 172.170 | 1,649,560.770  |  |
|  | ACCO BRANDS CORP                    | 9,194   | 10.370  | 95,341.780     |  |
|  | AMERIPRISE FINANCIAL INC            | 35,319  | 50.780  | 1,793,498.820  |  |
|  | LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C         | 19,052  | 47.740  | 909,542.480    |  |
|  | FIDELITY NATIONAL FINANCIAL         | 32,655  | 19.260  | 628,935.300    |  |
|  | GAMESTOP CORP. - CL. A              | 23,332  | 21.070  | 491,605.240    |  |
|  | INTERCONTINENTALEXCHANGE INC        | 10,969  | 125.050 | 1,371,673.450  |  |
|  | VIACOM INC-CLASS B                  | 75,586  | 47.890  | 3,619,813.540  |  |
|  | CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC          | 4,577   | 407.510 | 1,865,173.270  |  |
|  | UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS<br>INC | 17,227  | 23.760  | 409,313.520    |  |
|  | NYSE EURONEXT                       | 34,329  | 25.560  | 877,449.240    |  |
|  | VIRGIN MEDIA INC                    | 36,074  | 22.340  | 805,893.160    |  |
|  | MASTERCARD INC                      | 16,104  | 422.980 | 6,811,669.920  |  |
|  | LIBERTY INTERACTIVE CORP            | 78,760  | 18.250  | 1,437,370.000  |  |
|  | WESTERN UNION CO                    | 89,216  | 17.280  | 1,541,652.480  |  |
|  | SAIC INC                            | 31,598  | 11.220  | 354,529.560    |  |
|  | KBR INC                             | 23,562  | 29.930  | 705,210.660    |  |
|  | HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC           | 37,702  | 14.790  | 557,612.580    |  |
|  | FIRST SOLAR INC                     | 11,035  | 16.090  | 177,553.150    |  |
|  | SPECTRA ENERGY CORP                 | 100,338 | 30.120  | 3,022,180.560  |  |
|  | TIME WARNER CABLE INC               | 47,695  | 77.350  | 3,689,208.250  |  |
|  | PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC       | 59,253  | 12.070  | 715,183.710    |  |
|  | DELTA AIR LINES INC                 | 41,454  | 11.030  | 457,237.620    |  |
|  | CONTINENTAL RESOURCES INC/OK        | 6,159   | 77.860  | 479,539.740    |  |
|  | DISCOVER FINANCIAL                  | 85,015  | 33.500  | 2,848,002.500  |  |

|       |                                      |            |         |                   |  |
|-------|--------------------------------------|------------|---------|-------------------|--|
|       | CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX      | 14,891     | 91.320  | 1,359,846.120     |  |
|       | LULULEMON ATHLETICA INC              | 16,598     | 73.500  | 1,219,953.000     |  |
|       | VMWARE INC                           | 12,728     | 101.180 | 1,287,819.040     |  |
|       | TERADATA CORP                        | 26,391     | 71.250  | 1,880,358.750     |  |
|       | CALPINE CORP NPR                     | 39,169     | 18.490  | 724,234.810       |  |
|       | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL          | 257,301    | 86.160  | 22,169,054.160    |  |
|       | VISA INC                             | 77,093     | 118.170 | 9,110,079.810     |  |
|       | DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC          | 32,381     | 41.180  | 1,333,449.580     |  |
|       | AMERICAN WATER WORKS CO INC          | 28,725     | 34.370  | 987,278.250       |  |
|       | LORILLARD INC                        | 20,630     | 128.120 | 2,643,115.600     |  |
|       | SCRIPPS NETWORKS INTERAC-W/I         | 11,070     | 54.250  | 600,547.500       |  |
|       | DISCOVERY COMMUNICATIONS-C           | 22,552     | 46.960  | 1,059,041.920     |  |
|       | MARATHON PETROLEUM CORP              | 53,294     | 38.200  | 2,035,830.800     |  |
|       | CAREFUSION CORP                      | 34,028     | 25.880  | 880,644.640       |  |
|       | KINDER MORGAN INC/DELAWARE           | 15,230     | 34.300  | 522,389.000       |  |
|       | XYLEM INC                            | 31,066     | 26.140  | 812,065.240       |  |
|       | HCA HOLDINGS INC                     | 24,003     | 26.270  | 630,558.810       |  |
|       | MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS INC       | 42,634     | 39.350  | 1,677,647.900     |  |
|       | VERISK ANALYTICS INC                 | 19,955     | 48.520  | 968,216.600       |  |
|       | MEAD JOHNSON NUTRITION CO            | 29,958     | 83.000  | 2,486,514.000     |  |
|       | COBALT INTERNATIONAL ENERGY INC      | 18,768     | 23.540  | 441,798.720       |  |
|       | CIT GROUP INC                        | 30,698     | 36.680  | 1,126,002.640     |  |
|       | DOLLAR GENERAL CORP                  | 24,246     | 46.950  | 1,138,349.700     |  |
|       | QEP RESOURCES INC                    | 25,069     | 29.550  | 740,788.950       |  |
|       | LIBERTY MEDIA CORP - LIBERTY CAPITAL | 16,283     | 89.570  | 1,458,468.310     |  |
|       | GENERAL MOTORS CO                    | 116,861    | 22.370  | 2,614,180.570     |  |
|       | PHILLIPS 66                          | 93,277     | 32.480  | 3,029,636.960     |  |
| 米ドル小計 | 銘柄数 : 564                            | 45,449,043 |         | 1,846,833,137.340 |  |
|       | 組入時価比率 : 56.03%                      |            |         | (147,635,840,999) |  |
|       | 合計時価比率 : 57.65%                      |            |         |                   |  |
| 英ポンド  | XSTRATA PLC                          | 307,169    | 10.880  | 3,341,998.720     |  |
|       | AMEC PLC                             | 48,992     | 10.370  | 508,047.040       |  |
|       | ANTOFAGASTA PLC                      | 58,006     | 10.470  | 607,322.820       |  |
|       | SEVERN TRENT PLC                     | 38,266     | 16.420  | 628,327.720       |  |
|       | BHP BILLITON PLC                     | 314,889    | 18.715  | 5,893,147.630     |  |
|       | BARCLAYS PLC                         | 1,736,824  | 2.088   | 3,626,488.510     |  |
|       | BALFOUR BEATTY PLC                   | 85,204     | 2.699   | 229,965.590       |  |
|       | BT GROUP PLC                         | 1,193,348  | 2.115   | 2,523,931.020     |  |
|       | BRITISH SKY BROADCASTING PLC         | 167,359    | 6.920   | 1,158,124.280     |  |
|       | AGGREKO PLC                          | 36,191     | 21.710  | 785,706.610       |  |
|       | TULLOW OIL PLC                       | 140,954    | 14.760  | 2,080,481.040     |  |
|       | BUNZL PLC                            | 38,195     | 10.030  | 383,095.850       |  |
|       | CAPITA PLC                           | 102,099    | 6.545   | 668,237.950       |  |
|       | AVIVA PLC                            | 441,178    | 3.028   | 1,335,886.980     |  |

|  |                              |           |        |                |  |
|--|------------------------------|-----------|--------|----------------|--|
|  | DIAGEO PLC                   | 364,230   | 15.350 | 5,590,930.500  |  |
|  | SCHRODERS PLC                | 22,293    | 13.140 | 292,930.020    |  |
|  | NATIONAL GRID PLC            | 523,149   | 6.700  | 3,505,098.300  |  |
|  | LONMIN                       | 24,209    | 9.480  | 229,501.320    |  |
|  | GKN PLC                      | 203,239   | 1.886  | 383,308.750    |  |
|  | KINGFISHER PLC               | 332,300   | 2.858  | 949,713.400    |  |
|  | BAE SYSTEMS PLC              | 506,678   | 2.783  | 1,410,084.870  |  |
|  | BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 290,378   | 30.920 | 8,978,487.760  |  |
|  | MAN GROUP PLC                | 309,687   | 0.859  | 266,021.130    |  |
|  | COBHAM PLC                   | 147,144   | 2.158  | 317,536.750    |  |
|  | NEXT PLC                     | 28,133    | 29.530 | 830,767.490    |  |
|  | REXAM PLC                    | 138,079   | 4.004  | 552,868.310    |  |
|  | IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC   | 153,745   | 24.970 | 3,839,012.650  |  |
|  | JOHNSON MATTHEY PLC          | 30,474    | 22.430 | 683,531.820    |  |
|  | SABMILLER PLC                | 142,461   | 24.815 | 3,535,169.710  |  |
|  | ANGLO AMERICAN PLC           | 197,428   | 21.860 | 4,315,776.080  |  |
|  | COMPASS GROUP PLC            | 265,452   | 6.350  | 1,685,620.200  |  |
|  | HSBC HOLDINGS PLC            | 2,652,307 | 5.565  | 14,760,088.450 |  |
|  | LEGAL & GENERAL GROUP PLC    | 911,820   | 1.134  | 1,034,003.880  |  |
|  | ARM HOLDINGS PLC             | 215,348   | 5.075  | 1,092,891.100  |  |
|  | CENTRICA PLC                 | 793,221   | 3.102  | 2,460,571.540  |  |
|  | UNILEVER PLC                 | 185,479   | 20.640 | 3,828,286.560  |  |
|  | MEGGITT PLC                  | 105,280   | 3.905  | 411,118.400    |  |
|  | MORRISON <WM.> SUPERMARKETS  | 294,520   | 2.764  | 814,053.280    |  |
|  | INTL POWER PLC               | 244,870   | 4.177  | 1,022,821.990  |  |
|  | UNITED UTILITIES GROUP PLC   | 105,557   | 6.300  | 665,009.100    |  |
|  | RSA INSURANCE GROUP PLC GRP  | 442,155   | 1.035  | 457,630.420    |  |
|  | ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 56,767    | 11.960 | 678,933.320    |  |
|  | PEARSON PLC                  | 125,455   | 11.630 | 1,459,041.650  |  |
|  | PRUDENTIAL PLC               | 383,863   | 7.220  | 2,771,490.860  |  |
|  | RIO TINTO PLC                | 200,091   | 31.495 | 6,301,866.040  |  |
|  | VODAFONE GROUP PLC           | 7,482,719 | 1.712  | 12,810,414.920 |  |
|  | RECKITT BENCKISER GROUP PLC  | 93,342    | 34.400 | 3,210,964.800  |  |
|  | REED ELSEVIER PLC            | 180,949   | 5.110  | 924,649.390    |  |
|  | OLD MUTUAL PLC               | 731,719   | 1.497  | 1,095,383.340  |  |
|  | ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC     | 293,028   | 8.395  | 2,459,970.060  |  |
|  | ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP | 2,359,215 | 0.230  | 542,619.450    |  |
|  | SSE PLC                      | 140,642   | 13.210 | 1,857,880.820  |  |
|  | SERCO GROUP PLC              | 72,250    | 5.495  | 397,013.750    |  |
|  | BP PLC                       | 2,816,030 | 4.105  | 11,559,803.150 |  |
|  | SAGE GROUP PLC(THE)          | 220,158   | 2.660  | 585,620.280    |  |
|  | INVENSYS PLC                 | 163,653   | 2.000  | 327,306.000    |  |
|  | SMITHS GROUP PLC             | 59,731    | 10.340 | 617,618.540    |  |
|  | STANDARD CHARTERED PLC       | 361,248   | 13.770 | 4,974,384.960  |  |
|  | LLOYDS BANKING GROUP PLC     | 6,151,142 | 0.312  | 1,919,156.300  |  |
|  | TATE & LYLE PLC              | 60,088    | 6.935  | 416,710.280    |  |
|  | BG GROUP PLC                 | 500,844   | 13.335 | 6,678,754.740  |  |
|  | TESCO PLC                    | 1,217,056 | 3.201  | 3,895,796.250  |  |

|        |                                 |            |        |                  |  |
|--------|---------------------------------|------------|--------|------------------|--|
|        | 3I GROUP PLC                    | 119,685    | 1.887  | 225,845.590      |  |
|        | SMITH & NEPHEW PLC              | 123,146    | 6.130  | 754,884.980      |  |
|        | GLAXOSMITHKLINE PLC             | 749,541    | 14.060 | 10,538,546.460   |  |
|        | WEIR GROUP                      | 34,823     | 15.600 | 543,238.800      |  |
|        | LONDON STOCK EXCHANGE PLC       | 29,945     | 10.340 | 309,631.300      |  |
|        | BABCOCK INT'L GROUP             | 60,664     | 8.060  | 488,951.840      |  |
|        | ASTRAZENECA PLC                 | 191,800    | 26.775 | 5,135,445.000    |  |
|        | WHITBREAD PLC                   | 22,710     | 19.240 | 436,940.400      |  |
|        | CARNIVAL PLC                    | 30,375     | 19.620 | 595,957.500      |  |
|        | MARKS & SPENCER GROUP PLC       | 228,941    | 3.479  | 796,485.730      |  |
|        | INTERTEK GROUP PLC              | 28,006     | 24.400 | 683,346.400      |  |
|        | BURBERRY GROUP PLC              | 65,105     | 14.410 | 938,163.050      |  |
|        | INVESTEC PLC                    | 74,705     | 3.448  | 257,582.840      |  |
|        | INTERCONTINENTAL HOTELS         | 34,680     | 14.860 | 515,344.800      |  |
|        | VEDANTA RESOURCES PLC           | 24,021     | 11.180 | 268,554.780      |  |
|        | ICAP PLC                        | 87,128     | 3.471  | 302,421.280      |  |
|        | ITV PLC                         | 446,892    | 0.824  | 368,239.000      |  |
|        | SAINSBURY (J) PLC               | 190,870    | 3.094  | 590,551.780      |  |
|        | G4S PLC                         | 231,452    | 2.664  | 616,588.120      |  |
|        | ADMIRAL GROUP PLC               | 22,361     | 11.480 | 256,704.280      |  |
|        | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS     | 552,843    | 20.505 | 11,336,045.710   |  |
|        | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS     | 385,885    | 21.225 | 8,190,409.120    |  |
|        | INMARSAT PLC                    | 80,402     | 4.582  | 368,401.960      |  |
|        | KAZAKHMYS PLC                   | 34,134     | 7.760  | 264,879.840      |  |
|        | STANDARD LIFE PLC               | 325,057    | 2.111  | 686,195.320      |  |
|        | EXPERIAN PLC                    | 138,137    | 9.100  | 1,257,046.700    |  |
|        | TUI TRAVEL PLC                  | 100,036    | 1.842  | 184,266.310      |  |
|        | EURASIAN NATURAL RESOURCES CORP | 46,617     | 5.370  | 250,333.290      |  |
|        | FRESNILLO PLC NPR               | 23,779     | 14.170 | 336,948.430      |  |
|        | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC C SHRS | 31,060,968 | 0.001  | 31,060.960       |  |
|        | RESOLUTION LTD                  | 183,507    | 2.127  | 390,319.380      |  |
|        | SHIRE PLC                       | 79,603     | 19.900 | 1,584,099.700    |  |
|        | WPP PLC                         | 189,654    | 8.130  | 1,541,887.020    |  |
|        | WOLSELEY PLC                    | 43,144     | 22.460 | 969,014.240      |  |
|        | RANDGOLD RESOURCES LTD NPR      | 14,969     | 48.330 | 723,451.770      |  |
|        | PETROFAC LTD                    | 43,902     | 16.180 | 710,334.360      |  |
|        | GLENCORE INTERNATIONAL PLC      | 181,558    | 3.965  | 719,877.470      |  |
| 英ポンド小計 | 銘柄数 : 99                        | 74,289,345 |        | 207,336,969.950  |  |
|        | 組入時価比率 : 10.15%                 |            |        | (26,750,615,863) |  |
|        | 合計時価比率 : 10.45%                 |            |        |                  |  |
| カナダドル  | AGNICO-EAGLE MINES LTD          | 27,787     | 37.780 | 1,049,792.860    |  |
|        | ALIMENTATION COUCHE TARD INC    | 15,943     | 42.980 | 685,230.140      |  |
|        | BARRICK GOLD CORP               | 153,053    | 37.810 | 5,786,933.930    |  |
|        | TMX GROUP INC                   | 7,585      | 47.250 | 358,391.250      |  |
|        | TALISMAN ENERGY INC             | 149,684    | 11.280 | 1,688,435.520    |  |
|        | BANK OF MONTREAL                | 95,776     | 56.370 | 5,398,893.120    |  |

|  |                                                             |         |         |               |  |
|--|-------------------------------------------------------------|---------|---------|---------------|--|
|  | BANK OF NOVA SCOTIA                                         | 160,297 | 52.800  | 8,463,681.600 |  |
|  | NATIONAL BANK OF CANADA                                     | 21,163  | 73.310  | 1,551,459.530 |  |
|  | BCE INC                                                     | 38,612  | 40.610  | 1,568,033.320 |  |
|  | BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT                                 | 83,934  | 32.400  | 2,719,461.600 |  |
|  | VALEANT PHARMACEUTICALS<br>INTERN                           | 43,944  | 53.270  | 2,340,896.880 |  |
|  | BOMBARDIER INC 'B'                                          | 240,632 | 3.960   | 952,902.720   |  |
|  | SAPUTO INC                                                  | 23,636  | 43.810  | 1,035,493.160 |  |
|  | RESEARCH IN MOTION LTD                                      | 79,152  | 11.800  | 933,993.600   |  |
|  | CGI GROUP INC                                               | 29,163  | 21.360  | 622,921.680   |  |
|  | CAE INC                                                     | 31,436  | 10.130  | 318,446.680   |  |
|  | CAMECO CORP                                                 | 57,534  | 21.500  | 1,236,981.000 |  |
|  | ROGERS COMM-CL B                                            | 58,021  | 35.740  | 2,073,670.540 |  |
|  | CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE                                 | 57,425  | 72.860  | 4,183,985.500 |  |
|  | CANADIAN NATURAL RESOURCES                                  | 163,441 | 31.150  | 5,091,187.150 |  |
|  | NEXEN INC                                                   | 69,707  | 17.250  | 1,202,445.750 |  |
|  | CANADIAN TIRE CORP-CL A                                     | 12,753  | 70.230  | 895,643.190   |  |
|  | CANADIAN UTILITIES LTD                                      | 13,725  | 71.000  | 974,475.000   |  |
|  | CANADIAN NATL RAILWAY CO                                    | 63,973  | 80.810  | 5,169,658.130 |  |
|  | AGRIUM INC                                                  | 22,588  | 82.640  | 1,866,672.320 |  |
|  | YAMANA GOLD INC                                             | 115,290 | 13.820  | 1,593,307.800 |  |
|  | GILDAN ACTIVEWEAR INC                                       | 15,537  | 25.650  | 398,524.050   |  |
|  | OPEN TEXT CORP                                              | 9,281   | 51.130  | 474,537.530   |  |
|  | ELDORADO GOLD CORP                                          | 89,925  | 11.830  | 1,063,812.750 |  |
|  | OSISKO MINING CORP                                          | 52,038  | 8.500   | 442,323.000   |  |
|  | EMPIRE CO LTD                                               | 6,539   | 57.470  | 375,796.330   |  |
|  | KINROSS GOLD CORP                                           | 173,556 | 7.900   | 1,371,092.400 |  |
|  | FINNING INTERNATIONAL INC                                   | 30,080  | 26.060  | 783,884.800   |  |
|  | RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC                                | 17,487  | 20.990  | 367,052.130   |  |
|  | FORTIS INC                                                  | 29,702  | 33.970  | 1,008,976.940 |  |
|  | FIRST QUANTUM MINERALS LTD                                  | 70,329  | 18.270  | 1,284,910.830 |  |
|  | TELUS CORP-NON VOTE                                         | 27,674  | 57.140  | 1,581,292.360 |  |
|  | GREAT WEST LIFE CO INC                                      | 50,480  | 22.130  | 1,117,122.400 |  |
|  | IAMGOLD CORP                                                | 65,070  | 10.970  | 713,817.900   |  |
|  | IMPERIAL OIL LTD                                            | 44,159  | 43.520  | 1,921,799.680 |  |
|  | ENBRIDGE INC                                                | 106,614 | 40.600  | 4,328,528.400 |  |
|  | IGM FINANCIAL INC                                           | 19,774  | 43.660  | 863,332.840   |  |
|  | IVANHOE MINES LTD/CA                                        | 49,079  | 9.990   | 490,299.210   |  |
|  | MANULIFE FINANCIAL CORP                                     | 268,208 | 12.200  | 3,272,137.600 |  |
|  | LOBLAW CO LTD                                               | 17,526  | 32.600  | 571,347.600   |  |
|  | PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP                                | 42,573  | 28.150  | 1,198,429.950 |  |
|  | INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE<br>AND FINANCIAL SERVICES INC | 7,864   | 27.740  | 218,147.360   |  |
|  | MAGNA INTERNATIONAL INC                                     | 30,081  | 43.640  | 1,312,734.840 |  |
|  | SUN LIFE FINANCIAL INC                                      | 83,291  | 22.550  | 1,878,212.050 |  |
|  | FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD                                 | 3,043   | 414.000 | 1,259,802.000 |  |
|  | INMET MINING CORPORATION                                    | 10,004  | 45.890  | 459,083.560   |  |
|  | METRO INC                                                   | 13,859  | 53.600  | 742,842.400   |  |

|  |                                    |         |        |                |  |
|--|------------------------------------|---------|--------|----------------|--|
|  | HUSKY ENERGY INC                   | 48,062  | 24.410 | 1,173,193.420  |  |
|  | CRESCENT POINT ENERGY CORP         | 43,756  | 42.380 | 1,854,379.280  |  |
|  | NIKO RESOURCES LTD                 | 9,961   | 38.710 | 385,590.310    |  |
|  | ONEX CORP                          | 17,569  | 38.780 | 681,325.820    |  |
|  | PAN AMERICAN SILVER CORP           | 21,311  | 17.020 | 362,713.220    |  |
|  | GOLDCORP INC                       | 122,852 | 35.420 | 4,351,417.840  |  |
|  | POTASH CORP OF SASKATCHEWAN        | 129,253 | 41.000 | 5,299,373.000  |  |
|  | POWER CORP OF CANADA               | 48,941  | 24.620 | 1,204,927.420  |  |
|  | POWER FINANCIAL CORP               | 43,517  | 27.070 | 1,178,005.190  |  |
|  | ROYAL BANK OF CANADA               | 212,290 | 53.950 | 11,453,045.500 |  |
|  | SNC-LAVALIN GROUP INC              | 20,986  | 37.040 | 777,321.440    |  |
|  | CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD       | 24,563  | 72.930 | 1,791,379.590  |  |
|  | SHAW COMM INC-B                    | 56,820  | 19.360 | 1,100,035.200  |  |
|  | SINO-FOREST CORP                   | 38,862  | 4.810  | 186,926.220    |  |
|  | SHOPPERS DRUG MART CORP            | 34,176  | 41.400 | 1,414,886.400  |  |
|  | NEW GOLD INC                       | 62,801  | 8.460  | 531,296.460    |  |
|  | SUNCOR ENERGY INC                  | 236,350 | 29.300 | 6,925,055.000  |  |
|  | ENCANA CORP                        | 112,909 | 21.750 | 2,455,770.750  |  |
|  | TECK RESOURCES LTD-CL B            | 80,905  | 33.420 | 2,703,845.100  |  |
|  | THOMSON REUTERS CORP               | 53,002  | 29.570 | 1,567,269.140  |  |
|  | TORONTO DOMINION BANK (THE)<br>C\$ | 136,665 | 80.190 | 10,959,166.350 |  |
|  | TRANSCANADA CORP                   | 107,227 | 42.810 | 4,590,387.870  |  |
|  | TRANSALTA CORP                     | 34,014  | 16.820 | 572,115.480    |  |
|  | WESTON (GEORGE) LTD                | 7,627   | 60.000 | 457,620.000    |  |
|  | CENTERRA GOLD INC                  | 22,699  | 10.270 | 233,118.730    |  |
|  | PROGRESS ENERGY RESOURCES<br>CORP  | 34,783  | 11.420 | 397,221.860    |  |
|  | INTACT FINANCIAL CORP              | 20,440  | 63.950 | 1,307,138.000  |  |
|  | SILVER WHEATON CORP                | 50,604  | 26.550 | 1,343,536.200  |  |
|  | VITERRA INC NPR                    | 46,498  | 15.970 | 742,573.060    |  |
|  | PRECISION DRILLING CORP            | 27,396  | 8.360  | 229,030.560    |  |
|  | BELL ALIANT INC                    | 14,926  | 26.390 | 393,897.140    |  |
|  | FRANCO-NEVADA CORP NPR             | 19,093  | 42.450 | 810,497.850    |  |
|  | CI FINANCIAL CORP                  | 26,281  | 22.550 | 592,636.550    |  |
|  | TOURMALINE OIL CORP                | 15,696  | 24.790 | 389,103.840    |  |
|  | PEMBINA PIPELINE CORP              | 38,549  | 30.640 | 1,181,141.360  |  |
|  | TIM HORTONS INC                    | 22,995  | 55.150 | 1,268,174.250  |  |
|  | BAYTEX ENERGY CORP                 | 18,200  | 46.970 | 854,854.000    |  |
|  | MEG ENERGY CORP                    | 17,794  | 39.980 | 711,404.120    |  |
|  | ATHABASCA OIL SANDS CORP           | 37,765  | 11.540 | 435,808.100    |  |
|  | CENOVUS ENERGY INC W/I             | 107,917 | 33.000 | 3,561,261.000  |  |
|  | ENERPLUS CORP                      | 28,113  | 16.850 | 473,704.050    |  |
|  | VERMILION ENERGY INC               | 10,515  | 45.940 | 483,059.100    |  |
|  | PENN WEST PETROLEUM LTD            | 74,986  | 14.780 | 1,108,293.080  |  |
|  | ARC RESOURCES LTD                  | 42,391  | 19.900 | 843,580.900    |  |
|  | CANADIAN OIL SANDS LTD             | 76,612  | 21.670 | 1,660,182.040  |  |
|  | BONAVISTA ENERGY CORP              | 22,644  | 18.090 | 409,629.960    |  |

|          |                              |           |            |                  |  |
|----------|------------------------------|-----------|------------|------------------|--|
|          | PENGROWTH ENERGY CORP        | 55,901    | 8.420      | 470,686.420      |  |
| カナダドル小計  | 銘柄数 : 99                     | 5,707,244 |            | 173,140,413.050  |  |
|          | 組入時価比率 : 5.24%               |           |            | (13,797,559,516) |  |
|          | 合計時価比率 : 5.39%               |           |            |                  |  |
| スイスフラン   | GAM HOLDING LTD              | 38,728    | 10.950     | 424,071.600      |  |
|          | CREDIT SUISSE GROUP AG       | 170,078   | 19.880     | 3,381,150.640    |  |
|          | SYNGENTA AG                  | 13,605    | 308.000    | 4,190,340.000    |  |
|          | NESTLE SA-REGISTERED         | 489,179   | 54.700     | 26,758,091.300   |  |
|          | CIE FINANC RICHEMONT-A       | 78,383    | 54.200     | 4,248,358.600    |  |
|          | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 104,051   | 156.300    | 16,263,171.300   |  |
|          | SCHINDLER HOLDING-PART CERT  | 8,515     | 112.200    | 955,383.000      |  |
|          | SIKA INHABER                 | 363       | 1,826.000  | 662,838.000      |  |
|          | SGS SOC GEN SURVEILLANCE HLD | 861       | 1,728.000  | 1,487,808.000    |  |
|          | SULZER AG-REG                | 3,187     | 122.700    | 391,044.900      |  |
|          | NOVARTIS AG-REG SHS          | 345,645   | 49.150     | 16,988,451.750   |  |
|          | BALOISE HOLDING AG -R        | 8,984     | 65.500     | 588,452.000      |  |
|          | BARRY CALLEBAUT AG           | 390       | 848.500    | 330,915.000      |  |
|          | SWISSCOM AG-REG              | 3,426     | 361.200    | 1,237,471.200    |  |
|          | ABB LTD                      | 328,240   | 15.980     | 5,245,275.200    |  |
|          | ADECCO SA-REG                | 19,348    | 40.120     | 776,241.760      |  |
|          | GEBERIT AG                   | 4,882     | 190.500    | 930,021.000      |  |
|          | LONZA GROUP AG-REG           | 9,112     | 38.870     | 354,183.440      |  |
|          | LINDT & SPRUENGLI PART       | 91        | 2,880.000  | 262,080.000      |  |
|          | LINDT & SPRUENGLI NAMEN      | 20        | 34,570.000 | 691,400.000      |  |
|          | UBS AG-REGISTERED            | 549,901   | 11.430     | 6,285,368.430    |  |
|          | GIVAUDAN-REG                 | 1,382     | 870.500    | 1,203,031.000    |  |
|          | ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 21,096    | 212.600    | 4,485,009.600    |  |
|          | HOLCIM LTD-REG               | 37,527    | 54.150     | 2,032,087.050    |  |
|          | ACTELION                     | 19,725    | 38.250     | 754,481.250      |  |
|          | SONOVA HOLDING AG            | 8,743     | 95.200     | 832,333.600      |  |
|          | KUEHNE & NAGEL INTL AG       | 6,380     | 103.900    | 662,882.000      |  |
|          | STRAUMANN HOLDING AG         | 157       | 148.600    | 23,330.200       |  |
|          | THE SWATCH GROUP AG-B        | 4,262     | 400.000    | 1,704,800.000    |  |
|          | THE SWATCH GROUP AG-REG      | 7,915     | 69.150     | 547,322.250      |  |
|          | SCHINDLER NAMEN              | 1,824     | 112.200    | 204,652.800      |  |
|          | SWISS LIFE HOLDING AG        | 3,553     | 88.200     | 313,374.600      |  |
|          | PARTNERS GROUP HOLDING AG    | 2,737     | 160.000    | 437,920.000      |  |
|          | ARYZTA AG                    | 13,689    | 45.700     | 625,587.300      |  |
|          | JULIUS BAER GROUP LTD        | 30,873    | 33.560     | 1,036,097.880    |  |
|          | SWISS RE LTD                 | 51,359    | 56.900     | 2,922,327.100    |  |
|          | TRANSOCEAN LTD               | 54,450    | 43.470     | 2,366,941.500    |  |
|          | SYNTHESE INC                 | 9,702     | 156.700    | 1,520,303.400    |  |
| スイスフラン小計 | 銘柄数 : 38                     | 2,452,363 |            | 114,124,598.650  |  |
|          | 組入時価比率 : 3.73%               |           |            | (9,831,834,174)  |  |
|          | 合計時価比率 : 3.84%               |           |            |                  |  |

|                  |                                       |           |         |                 |  |
|------------------|---------------------------------------|-----------|---------|-----------------|--|
| スウェーデン<br>クローネ   | MILLICOM INTERNATIONAL<br>CELLULAR SA | 9,909     | 669.000 | 6,629,121.000   |  |
|                  | ATLAS COPCO AB-A SHS                  | 89,683    | 152.700 | 13,694,594.100  |  |
|                  | ATLAS COPCO AB-B SHS                  | 64,097    | 135.000 | 8,653,095.000   |  |
|                  | ERICSSON LM-B SHS                     | 437,850   | 63.150  | 27,650,227.500  |  |
|                  | GETINGE AB-B SHS                      | 31,964    | 180.600 | 5,772,698.400   |  |
|                  | SKF AB-B SHS                          | 55,959    | 151.200 | 8,461,000.800   |  |
|                  | SANDVIK AB                            | 138,225   | 98.450  | 13,608,251.250  |  |
|                  | SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A          | 214,074   | 43.910  | 9,399,989.340   |  |
|                  | SKANSKA AB-B SHS                      | 58,507    | 103.500 | 6,055,474.500   |  |
|                  | SWEDBANK AB                           | 125,939   | 108.700 | 13,689,569.300  |  |
|                  | SSAB AB-A                             | 32,561    | 65.500  | 2,132,745.500   |  |
|                  | SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS            | 79,580    | 105.000 | 8,355,900.000   |  |
|                  | SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS           | 75,081    | 217.300 | 16,315,101.300  |  |
|                  | VOLVO AB-B SHS                        | 214,370   | 86.800  | 18,607,316.000  |  |
|                  | HOLMEN AB-B SHS                       | 881       | 187.600 | 165,275.600     |  |
|                  | SCANIA AB                             | 49,676    | 125.600 | 6,239,305.600   |  |
|                  | SWEDISH MATCH AB                      | 30,526    | 267.800 | 8,174,862.800   |  |
|                  | TELE2 AB-B SHS                        | 49,717    | 113.900 | 5,662,766.300   |  |
|                  | MODERN TIMES GROUP-B SHS              | 9,101     | 314.300 | 2,860,444.300   |  |
|                  | NORDEA AB                             | 407,758   | 57.400  | 23,405,309.200  |  |
|                  | INDUSTRIVARDEN C                      | 26,391    | 92.900  | 2,451,723.900   |  |
|                  | ELECTROLUX AB-SER B                   | 38,584    | 140.000 | 5,401,760.000   |  |
|                  | SECURITAS AB-B SHS                    | 53,055    | 53.600  | 2,843,748.000   |  |
|                  | INVESTOR AB-B SHS                     | 62,766    | 131.900 | 8,278,835.400   |  |
|                  | HENNES&MAURITZ AB-B SHS               | 154,328   | 225.300 | 34,770,098.400  |  |
|                  | ASSA ABLOY AB-B                       | 43,425    | 191.300 | 8,307,202.500   |  |
|                  | TELIASONERA AB                        | 311,185   | 46.170  | 14,367,411.450  |  |
|                  | LUNDIN PETROLEUM AB                   | 40,808    | 145.100 | 5,921,240.800   |  |
|                  | BOLIDEN AB                            | 44,557    | 100.300 | 4,469,067.100   |  |
|                  | ALFA LAVAL AB                         | 45,040    | 132.000 | 5,945,280.000   |  |
|                  | KINNEVIK INVESTMENT B                 | 33,473    | 127.800 | 4,277,849.400   |  |
|                  | HUSQVARNA AB-B SHS                    | 54,633    | 36.440  | 1,990,826.520   |  |
|                  | RATOS AB                              | 34,246    | 71.400  | 2,445,164.400   |  |
|                  | HEXAGON AB                            | 29,365    | 135.500 | 3,978,957.500   |  |
| スウェーデン<br>クローネ小計 | 銘柄数 : 34                              | 3,147,314 |         | 310,982,213.160 |  |
|                  | 組入時価比率 : 1.36%                        |           |         | (3,579,405,273) |  |
|                  | 合計時価比率 : 1.40%                        |           |         |                 |  |
| ユーロ              | TELEKOM AUSTRIA AG                    | 59,022    | 8.180   | 482,799.960     |  |
|                  | OMV AG                                | 24,898    | 24.070  | 599,294.860     |  |
|                  | VOEST-ALPINE AG                       | 17,613    | 23.110  | 407,036.430     |  |
|                  | ERSTE GROUP BANK AG                   | 33,508    | 16.405  | 549,698.740     |  |
|                  | IMMOFINANZ AG                         | 152,609   | 2.654   | 405,024.280     |  |
|                  | RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL         | 9,099     | 25.500  | 232,024.500     |  |
|                  | UMICORE                               | 18,212    | 39.190  | 713,728.280     |  |
|                  | DELHAIZE GROUP                        | 12,505    | 32.170  | 402,285.850     |  |
|                  | KBC BANKVERZEKERINGSHOLDING           | 27,003    | 14.435  | 389,788.300     |  |

|  |                               |         |        |               |  |
|--|-------------------------------|---------|--------|---------------|--|
|  | ANHEUSER-BUSCH INBEV NV       | 117,252 | 55.450 | 6,501,623.400 |  |
|  | ANHEUSER-BUSCH INBEV NV VVPR  | 39,408  | 0.001  | 39.400        |  |
|  | SOLVAY SA                     | 8,874   | 91.520 | 812,148.480   |  |
|  | MOBISTAR SA                   | 5,958   | 29.985 | 178,650.630   |  |
|  | AGEAS                         | 300,982 | 1.372  | 412,947.300   |  |
|  | UCB SA                        | 13,154  | 38.275 | 503,469.350   |  |
|  | COLRUYT NV                    | 14,070  | 31.835 | 447,918.450   |  |
|  | BEKAERT NV                    | 7,702   | 24.045 | 185,194.590   |  |
|  | GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA   | 12,830  | 51.690 | 663,182.700   |  |
|  | GROUPE BRUX LAMBERT-STR VVPR  | 516     | 0.003  | 1.540         |  |
|  | BELGACOM SA                   | 23,896  | 22.375 | 534,673.000   |  |
|  | ADIDAS AG                     | 31,341  | 61.540 | 1,928,725.140 |  |
|  | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG   | 48,464  | 66.240 | 3,210,255.360 |  |
|  | COMMERZBANK AG                | 486,802 | 1.561  | 759,897.920   |  |
|  | FRESENIUS SE & CO KGAA        | 16,709  | 77.710 | 1,298,456.390 |  |
|  | UNITED INTERNET               | 18,350  | 14.605 | 268,001.750   |  |
|  | MAN SE                        | 10,044  | 85.350 | 857,255.400   |  |
|  | HANNOVER RUECKVERSICHERUNG AG | 5,754   | 45.000 | 258,930.000   |  |

[前へ](#) [次へ](#)

平成24年5月11日現在

| 通貨 | 銘柄                             | 株数      | 評価額     |               | 備考 |
|----|--------------------------------|---------|---------|---------------|----|
|    |                                |         | 単価      | 金額            |    |
|    | GEA GROUP AG                   | 28,135  | 21.670  | 609,685.450   |    |
|    | CONTINENTAL AG                 | 10,318  | 68.350  | 705,235.300   |    |
|    | DEUTSCHE POST AG-REG           | 123,484 | 13.710  | 1,692,965.640 |    |
|    | AXEL SPRINGER AG               | 6,021   | 35.360  | 212,902.560   |    |
|    | PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD     | 25,205  | 43.870  | 1,105,743.350 |    |
|    | MERCK KGAA                     | 9,951   | 79.330  | 789,412.830   |    |
|    | RWE AG                         | 77,047  | 31.675  | 2,440,463.720 |    |
|    | SAP AG                         | 139,089 | 48.005  | 6,676,967.440 |    |
|    | E.ON AG                        | 270,819 | 15.695  | 4,250,504.200 |    |
|    | HENKEL AG & CO KGAA            | 20,540  | 45.345  | 931,386.300   |    |
|    | METRO AG                       | 22,519  | 23.385  | 526,606.810   |    |
|    | SIEMENS AG-REG                 | 120,994 | 67.710  | 8,192,503.740 |    |
|    | BAYER AG                       | 121,096 | 52.490  | 6,356,329.040 |    |
|    | HENKEL AG & CO KGAA VORZUG     | 25,233  | 54.680  | 1,379,740.440 |    |
|    | DAIMLER AG                     | 136,544 | 38.365  | 5,238,510.560 |    |
|    | BASF SE                        | 135,113 | 58.210  | 7,864,927.730 |    |
|    | CELESIO AG                     | 16,256  | 13.205  | 214,660.480   |    |
|    | BEIERSDORF AG                  | 12,865  | 51.530  | 662,933.450   |    |
|    | HOCHTIEF AG                    | 7,587   | 42.735  | 324,230.440   |    |
|    | HEIDELBERGCEMENT AG            | 21,539  | 38.495  | 829,143.800   |    |
|    | FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO | 31,792  | 53.120  | 1,688,791.040 |    |
|    | ALLIANZ SE                     | 68,590  | 79.950  | 5,483,770.500 |    |
|    | PROSIEBEN MEDIA N/V VORZUG REG | 13,630  | 18.825  | 256,584.750   |    |
|    | DEUTSCHE LUFTHANSA-REG         | 39,971  | 9.180   | 366,933.780   |    |
|    | MUENCHENER RUECKVER AG-REG     | 25,226  | 105.600 | 2,663,865.600 |    |
|    | SALZGITTER                     | 7,018   | 37.305  | 261,806.490   |    |
|    | VOLKSWAGEN AG                  | 5,402   | 124.450 | 672,278.900   |    |
|    | VOLKSWAGEN AG PFD              | 21,112  | 134.400 | 2,837,452.800 |    |
|    | THYSSENKRUPP AG                | 55,869  | 16.615  | 928,263.430   |    |
|    | LINDE AG                       | 25,895  | 123.900 | 3,208,390.500 |    |
|    | DEUTSCHE BANK AG-REG           | 139,921 | 31.230  | 4,369,732.830 |    |
|    | BMW VORZUG                     | 11,145  | 43.960  | 489,934.200   |    |
|    | K & S                          | 24,444  | 35.100  | 857,984.400   |    |
|    | SUEDZUCKER AG                  | 11,866  | 22.930  | 272,087.380   |    |
|    | DEUTSCHE TELEKOM AG-REG        | 419,766 | 8.800   | 3,693,940.800 |    |
|    | INFINEON TECHNOLOGIES AG       | 156,734 | 6.784   | 1,063,283.450 |    |
|    | DEUTSCHE BOERSE AG             | 28,550  | 45.425  | 1,296,883.750 |    |
|    | FRAPORT AG                     | 6,165   | 44.960  | 277,178.400   |    |
|    | LANXESS MANUFACTURES POLYMERS  | 10,332  | 62.050  | 641,100.600   |    |
|    | WACKER-CHEMIE GMBH             | 3,025   | 59.740  | 180,713.500   |    |
|    | KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG   | 15,026  | 45.220  | 679,475.720   |    |

|  |                                                   |           |        |               |  |
|--|---------------------------------------------------|-----------|--------|---------------|--|
|  | BRENNTAG AG                                       | 4,077     | 91.230 | 371,944.710   |  |
|  | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA                       | 63,071    | 11.635 | 733,831.080   |  |
|  | IBERDROLA SA                                      | 524,859   | 3.529  | 1,852,227.410 |  |
|  | INDRA SISTEMAS SA                                 | 16,340    | 8.164  | 133,399.760   |  |
|  | REPSOL YPF SA                                     | 118,170   | 14.210 | 1,679,195.700 |  |
|  | TELEFONICA S.A                                    | 616,654   | 11.320 | 6,980,523.280 |  |
|  | ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV                       | 23,133    | 14.030 | 324,555.990   |  |
|  | BANKINTER S.A.                                    | 34,675    | 3.418  | 118,519.150   |  |
|  | ACERINOX SA                                       | 16,481    | 8.887  | 146,466.640   |  |
|  | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA                      | 695,150   | 5.310  | 3,691,246.500 |  |
|  | ACCIONA S.A.                                      | 1,908     | 47.735 | 91,078.380    |  |
|  | GAS NATURAL SDG SA                                | 57,849    | 10.390 | 601,051.110   |  |
|  | BANCO SANTANDER SA                                | 1,250,041 | 4.920  | 6,150,201.720 |  |
|  | RED ELECTRICA DE CORPORACION<br>SA                | 14,371    | 31.765 | 456,494.810   |  |
|  | FOMENTO DE CONSTRUCC Y CONTRA                     | 8,715     | 12.575 | 109,591.120   |  |
|  | BANCO POPULAR ESPANOL                             | 146,617   | 2.161  | 316,839.330   |  |
|  | BANCO SABADELL                                    | 255,883   | 1.636  | 418,624.580   |  |
|  | INDITEX                                           | 33,620    | 67.740 | 2,277,418.800 |  |
|  | MAPFRE SA                                         | 135,413   | 2.039  | 276,107.100   |  |
|  | ENAGAS                                            | 25,191    | 13.355 | 336,425.800   |  |
|  | GRIFOLS SA                                        | 24,523    | 18.250 | 447,544.750   |  |
|  | FERROVIAL SA                                      | 63,117    | 8.589  | 542,111.910   |  |
|  | CAIXABANK                                         | 149,185   | 2.474  | 369,083.690   |  |
|  | AMADEUS IT HOLDING SA                             | 52,881    | 15.400 | 814,367.400   |  |
|  | INTERNATIONAL CONSOLIDATED<br>AIRLINES GROUP SA   | 151,868   | 2.040  | 309,810.720   |  |
|  | DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL<br>DE ALIMENTACION SA | 111,285   | 3.588  | 399,290.580   |  |
|  | BANKIA SAU                                        | 140,798   | 2.105  | 296,379.790   |  |
|  | KESKO OYJ-B                                       | 13,297    | 20.560 | 273,386.320   |  |
|  | WARTSILA OYJ                                      | 26,436    | 29.810 | 788,057.160   |  |
|  | NOKIAN RENKAAT OYJ                                | 15,126    | 36.280 | 548,771.280   |  |
|  | UPM-KYMMENE OYJ                                   | 78,102    | 9.230  | 720,881.460   |  |
|  | STORA ENSO OYJ-R SHS                              | 108,663   | 4.878  | 530,058.110   |  |
|  | SAMPO OYJ-A SHS                                   | 59,871    | 20.190 | 1,208,795.490 |  |
|  | FORTUM OYJ                                        | 65,765    | 16.250 | 1,068,681.250 |  |
|  | NOKIA OYJ                                         | 541,250   | 2.468  | 1,335,805.000 |  |
|  | ELISA CORP                                        | 25,398    | 16.620 | 422,114.760   |  |
|  | METSO OYJ                                         | 21,261    | 29.780 | 633,152.580   |  |
|  | NESTE OIL OYJ                                     | 23,509    | 8.295  | 195,007.150   |  |
|  | KONE OYJ                                          | 22,765    | 46.540 | 1,059,483.100 |  |
|  | ORION OYJ                                         | 17,482    | 15.210 | 265,901.220   |  |
|  | AIR LIQUIDE                                       | 42,849    | 96.810 | 4,148,211.690 |  |
|  | EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE                       | 58,929    | 28.840 | 1,699,512.360 |  |
|  | AXA                                               | 266,452   | 9.914  | 2,641,605.120 |  |
|  | VEOLIA ENVIRONNEMENT                              | 50,645    | 10.475 | 530,506.370   |  |
|  | DANONE                                            | 88,704    | 51.660 | 4,582,448.640 |  |

|  |                                              |         |         |                |  |
|--|----------------------------------------------|---------|---------|----------------|--|
|  | SAFRAN SA                                    | 25,102  | 27.065  | 679,385.630    |  |
|  | ACCOR SA                                     | 19,786  | 25.795  | 510,379.870    |  |
|  | BOUYGUES                                     | 30,754  | 21.695  | 667,208.030    |  |
|  | BNP PARIBAS                                  | 144,925 | 29.045  | 4,209,346.620  |  |
|  | THALES SA                                    | 19,494  | 25.425  | 495,634.950    |  |
|  | CAP GEMINI SA                                | 24,414  | 29.000  | 708,006.000    |  |
|  | CASINO GUICHARD PERRACHON                    | 6,567   | 72.310  | 474,859.770    |  |
|  | CHRISTIAN DIOR                               | 7,771   | 111.450 | 866,077.950    |  |
|  | COMPAGNIE GENERALE DE<br>GEOPHYSIQUE-VERITAS | 23,542  | 20.245  | 476,607.790    |  |
|  | ALCATEL-LUCENT                               | 384,592 | 1.222   | 469,971.420    |  |
|  | NATIXIS                                      | 164,630 | 2.101   | 345,887.630    |  |
|  | EIFFAGE                                      | 8,253   | 28.500  | 235,210.500    |  |
|  | PUBLICIS GROUPE                              | 19,919  | 37.635  | 749,651.560    |  |
|  | IMERYS SA                                    | 7,765   | 38.785  | 301,165.520    |  |
|  | LAFARGE SA                                   | 28,285  | 30.030  | 849,398.550    |  |
|  | L'OREAL                                      | 35,517  | 89.620  | 3,183,033.540  |  |
|  | LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA                 | 38,546  | 122.400 | 4,718,030.400  |  |
|  | LAGARDERE S.C.A.                             | 21,125  | 22.295  | 470,981.870    |  |
|  | MICHELIN(CGDE)-B                             | 27,685  | 52.800  | 1,461,768.000  |  |
|  | PERNOD-RICARD                                | 30,026  | 78.410  | 2,354,338.660  |  |
|  | PEUGEOT SA                                   | 30,743  | 8.803   | 270,630.620    |  |
|  | RENAULT SA                                   | 27,030  | 31.605  | 854,283.150    |  |
|  | COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN                    | 61,891  | 31.220  | 1,932,237.020  |  |
|  | SOCIETE GENERALE-A                           | 101,057 | 17.505  | 1,769,002.780  |  |
|  | VINCI S.A.                                   | 67,944  | 35.105  | 2,385,174.120  |  |
|  | SODEXO                                       | 12,740  | 59.820  | 762,106.800    |  |
|  | SCHNEIDER ELECTRIC SA                        | 73,288  | 45.210  | 3,313,350.480  |  |
|  | VIVENDI SA                                   | 181,984 | 13.045  | 2,373,981.280  |  |
|  | TECHNIP-COFLEXIP S.A.                        | 13,014  | 78.420  | 1,020,557.880  |  |
|  | TELEVISION FRANCAISE(T.F.1)                  | 24,183  | 7.425   | 179,558.770    |  |
|  | TOTAL SA                                     | 313,020 | 35.150  | 11,002,653.000 |  |
|  | VALLOUREC                                    | 16,668  | 42.865  | 714,473.820    |  |
|  | FRANCE TELECOM SA                            | 276,290 | 10.555  | 2,916,240.950  |  |
|  | BIC                                          | 6,136   | 83.020  | 509,410.720    |  |
|  | DASSAULT SYSTEMES SA                         | 9,862   | 72.000  | 710,064.000    |  |
|  | PPR                                          | 11,855  | 120.950 | 1,433,862.250  |  |
|  | NEOPOST SA                                   | 6,482   | 42.575  | 275,971.150    |  |
|  | CARREFOUR SA                                 | 85,148  | 14.530  | 1,237,200.440  |  |
|  | ATOS                                         | 9,475   | 45.805  | 434,002.370    |  |
|  | SANOFI                                       | 168,049 | 55.660  | 9,353,607.340  |  |
|  | STMICROELECTRONICS NV                        | 97,120  | 4.116   | 399,745.920    |  |
|  | ESSILOR INTL                                 | 31,399  | 67.580  | 2,121,944.420  |  |
|  | CREDIT AGRICOLE SA                           | 172,905 | 3.496   | 604,475.880    |  |
|  | WENDEL                                       | 2,719   | 58.570  | 159,251.830    |  |
|  | ILIAD SA                                     | 1,861   | 97.300  | 181,075.300    |  |
|  | GDF SUEZ                                     | 185,887 | 17.015  | 3,162,867.300  |  |
|  | ALSTOM                                       | 33,600  | 24.995  | 839,832.000    |  |

|  |                                   |           |        |               |  |
|--|-----------------------------------|-----------|--------|---------------|--|
|  | EUTELSAT COMMUNICATIONS           | 17,450    | 26.390 | 460,505.500   |  |
|  | ELECTRICITE DE FRANCE             | 34,385    | 16.385 | 563,398.220   |  |
|  | ARKEMA SA                         | 9,569     | 61.950 | 592,799.550   |  |
|  | LEGRAND SA                        | 32,977    | 26.160 | 862,678.320   |  |
|  | ADP                               | 6,435     | 61.690 | 396,975.150   |  |
|  | SCOR SE                           | 22,917    | 19.080 | 437,256.360   |  |
|  | BUREAU VERITAS SA                 | 7,690     | 68.000 | 522,920.000   |  |
|  | GROUPE EUROTUNNEL SA              | 89,249    | 6.100  | 544,418.900   |  |
|  | SUEZ ENVIRONNEMENT SA             | 35,172    | 10.110 | 355,588.920   |  |
|  | GDF SUEZ-STRIP VVPR               | 3,318     | 0.001  | 3.310         |  |
|  | EDENRED                           | 27,224    | 23.455 | 638,538.920   |  |
|  | COCA-COLA HELLENIC BOTTLING       | 32,274    | 13.800 | 445,381.200   |  |
|  | NATIONAL BANK OF GREECE           | 170,555   | 1.570  | 267,771.350   |  |
|  | OPAP SA                           | 41,034    | 6.300  | 258,514.200   |  |
|  | CRH PLC                           | 106,593   | 14.445 | 1,539,735.880 |  |
|  | KERRY GROUP PLC-A                 | 24,173    | 32.360 | 782,238.280   |  |
|  | ELAN CORPORATION PLC              | 89,094    | 10.170 | 906,085.980   |  |
|  | IRISH BANK RESOLUTION CORP        | 91,316    | 0.126  | 11,505.810    |  |
|  | ASSICURAZIONI GENERALI            | 177,127   | 9.580  | 1,696,876.660 |  |
|  | INTESA SANPAOLO                   | 1,617,052 | 1.087  | 1,757,735.520 |  |
|  | UNICREDIT SPA                     | 614,261   | 2.842  | 1,745,729.760 |  |
|  | ENI SPA                           | 350,422   | 16.580 | 5,809,996.760 |  |
|  | MEDIOBANCA SPA                    | 81,452    | 3.274  | 266,673.840   |  |
|  | PIRELLI & C                       | 30,073    | 8.525  | 256,372.320   |  |
|  | SAIPEM                            | 41,590    | 33.860 | 1,408,237.400 |  |
|  | LUXOTTICA GROUP SPA               | 16,064    | 27.230 | 437,422.720   |  |
|  | MEDIASET SPA                      | 117,464   | 1.518  | 178,310.350   |  |
|  | AUTOGRILL SPA                     | 20,544    | 7.620  | 156,545.280   |  |
|  | A2A SPA                           | 273,914   | 0.492  | 134,765.680   |  |
|  | FIAT SPA                          | 119,079   | 3.452  | 411,060.700   |  |
|  | ENEL SPA                          | 967,372   | 2.480  | 2,399,082.560 |  |
|  | FINMECCANICA SPA                  | 70,788    | 2.914  | 206,276.230   |  |
|  | BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA      | 804,540   | 0.242  | 194,698.680   |  |
|  | SNAM SPA                          | 225,511   | 3.464  | 781,170.100   |  |
|  | UNIONE DI BANCHE ITALIANE<br>SCPA | 137,041   | 2.514  | 344,521.070   |  |
|  | TELECOM ITALIA SPA                | 1,374,164 | 0.842  | 1,157,046.080 |  |
|  | TELECOM ITALIA-RNC                | 792,074   | 0.707  | 559,996.310   |  |
|  | ATLANTIA SPA                      | 54,105    | 11.360 | 614,632.800   |  |
|  | TERNA SPA                         | 147,965   | 2.776  | 410,750.840   |  |
|  | EXOR SPA                          | 9,585     | 16.790 | 160,932.150   |  |
|  | PRYSMIAN SPA                      | 37,609    | 11.730 | 441,153.570   |  |
|  | BANCO POPOLARE SPA                | 305,979   | 1.011  | 309,344.760   |  |
|  | ENEL GREEN POWER SPA              | 221,755   | 1.315  | 291,607.820   |  |
|  | FIAT INDUSTRIAL SPA               | 119,079   | 7.710  | 918,099.090   |  |
|  | ARCELOR MITTAL (NL)               | 128,605   | 12.700 | 1,633,283.500 |  |
|  | TENARIS SA                        | 71,428    | 13.820 | 987,134.960   |  |
|  | SES FDR                           | 46,853    | 18.635 | 873,105.650   |  |

|             |                              |            |            |                  |  |
|-------------|------------------------------|------------|------------|------------------|--|
|             | BOSKALIS WESTMINSTER CT      | 13,745     | 28.075     | 385,890.870      |  |
|             | REED ELSEVIER NV             | 112,391    | 8.978      | 1,009,046.390    |  |
|             | KONINKLIJKE DSM NV           | 19,732     | 42.350     | 835,650.200      |  |
|             | SBM OFFSHORE NV              | 23,374     | 12.505     | 292,291.870      |  |
|             | ING GROEP NV-CVA             | 555,679    | 5.271      | 2,928,984.000    |  |
|             | RANDSTAD HOLDINGS            | 13,985     | 24.340     | 340,394.900      |  |
|             | KONINKLIJKE AHOLD NV         | 179,713    | 9.690      | 1,741,418.970    |  |
|             | HEINEKEN NV                  | 35,432     | 40.540     | 1,436,413.280    |  |
|             | AKZO NOBEL                   | 35,469     | 38.470     | 1,364,492.430    |  |
|             | ASML HOLDING NV              | 68,040     | 36.850     | 2,507,274.000    |  |
|             | AEGON NV                     | 220,296    | 3.644      | 802,758.620      |  |
|             | UNILEVER NV-CVA              | 246,528    | 25.675     | 6,329,606.400    |  |
|             | PHILIPS ELECTRONICS NV       | 143,771    | 14.670     | 2,109,120.570    |  |
|             | WOLTERS KLUWER-CVA           | 49,896     | 12.690     | 633,180.240      |  |
|             | QIAGEN N.V.                  | 39,540     | 13.165     | 520,544.100      |  |
|             | VOPAK (KON.)                 | 11,504     | 47.065     | 541,435.760      |  |
|             | KONINKLIJKE KPN NV           | 222,305    | 7.800      | 1,733,979.000    |  |
|             | HEINEKEN HOLDING NV-A        | 12,515     | 34.395     | 430,453.420      |  |
|             | FUGRO CERT                   | 10,228     | 50.450     | 516,002.600      |  |
|             | TNT EXPRESS NV W/I           | 61,074     | 9.100      | 555,773.400      |  |
|             | DELTA LLOYD NV               | 19,898     | 12.100     | 240,765.800      |  |
|             | BANCO ESPIRITO SANTO-REG     | 112,619    | 0.630      | 70,949.970       |  |
|             | JERONIMO MARTINS             | 40,183     | 13.970     | 561,356.510      |  |
|             | PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG | 120,094    | 4.205      | 504,995.270      |  |
|             | ENERGIAS DE PORTUGAL SA      | 314,886    | 2.270      | 714,791.220      |  |
|             | GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS  | 43,777     | 10.960     | 479,795.920      |  |
|             | BANCO ESPIRITO SANTO SA RTS  | 112,619    | 0.328      | 36,939.030       |  |
| ユーロ小計       | 銘柄数 : 234                    | 25,976,049 |            | 299,992,758.570  |  |
|             | 組入時価比率 : 11.78%              |            |            | (31,028,251,019) |  |
|             | 合計時価比率 : 12.12%              |            |            |                  |  |
| デンマーククローネ   | CARLSBERG AS-B               | 17,266     | 490.400    | 8,467,246.400    |  |
|             | A P MOLLER A/S               | 168        | 41,640.000 | 6,995,520.000    |  |
|             | AP MOLLER MAERSK A           | 100        | 39,800.000 | 3,980,000.000    |  |
|             | DANSKE BANK A/S              | 89,597     | 89.350     | 8,005,491.950    |  |
|             | NOVOZYMES-B SHS              | 32,498     | 151.000    | 4,907,198.000    |  |
|             | NOVO NORDISK A/S-B           | 62,790     | 825.500    | 51,833,145.000   |  |
|             | VESTAS WIND SYSTEMS A/S      | 35,696     | 43.350     | 1,547,421.600    |  |
|             | TDC A/S                      | 58,423     | 40.440     | 2,362,626.120    |  |
|             | COLOPLAST-B                  | 4,175      | 1,026.000  | 4,283,550.000    |  |
|             | DSV A/S                      | 29,112     | 123.100    | 3,583,687.200    |  |
|             | WILLIAM DEMANT               | 4,646      | 518.000    | 2,406,628.000    |  |
|             | TRYG A/S                     | 4,793      | 325.500    | 1,560,121.500    |  |
| デンマーククローネ小計 | 銘柄数 : 12                     | 339,264    |            | 99,932,635.770   |  |
|             | 組入時価比率 : 0.53%               |            |            | (1,391,062,290)  |  |
|             | 合計時価比率 : 0.54%               |            |            |                  |  |

|                 |                                   |         |         |                 |  |
|-----------------|-----------------------------------|---------|---------|-----------------|--|
| ノルウェーク<br>ローネ   | SEADRILL LTD                      | 46,984  | 211.100 | 9,918,322.400   |  |
|                 | SUBSEA 7 SA                       | 37,286  | 137.500 | 5,126,825.000   |  |
|                 | DNB ASA                           | 136,403 | 60.000  | 8,184,180.000   |  |
|                 | NORSK HYDRO ASA                   | 138,196 | 26.000  | 3,593,096.000   |  |
|                 | TELENOR ASA                       | 110,278 | 104.700 | 11,546,106.600  |  |
|                 | ORKLA ASA                         | 129,845 | 40.420  | 5,248,334.900   |  |
|                 | STATOIL ASA                       | 170,950 | 151.500 | 25,898,925.000  |  |
|                 | YARA INTERNATIONAL ASA            | 28,891  | 264.000 | 7,627,224.000   |  |
|                 | AKER SOLUTIONS ASA                | 18,936  | 90.150  | 1,707,080.400   |  |
|                 | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA         | 43,012  | 69.400  | 2,985,032.800   |  |
| ノルウェーク<br>ローネ小計 | 銘柄数 : 10                          | 860,781 |         | 81,835,127.100  |  |
|                 | 組入時価比率 : 0.42%                    |         |         | (1,116,231,133) |  |
|                 | 合計時価比率 : 0.44%                    |         |         |                 |  |
| 香港ドル            | YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS      | 136,000 | 25.600  | 3,481,600.000   |  |
|                 | ORIENT OVERSEAS<br>INTERNATIONAL  | 43,000  | 44.100  | 1,896,300.000   |  |
|                 | FOXCONN INTERNATIONAL<br>HOLDINGS | 408,000 | 3.450   | 1,407,600.000   |  |
|                 | HANG LUNG PROPERTIES LTD          | 358,000 | 26.250  | 9,397,500.000   |  |
|                 | BANK OF EAST ASIA                 | 193,260 | 28.900  | 5,585,214.000   |  |
|                 | CLP HOLDINGS LTD                  | 276,500 | 65.700  | 18,166,050.000  |  |
|                 | PCCW LTD                          | 734,000 | 2.820   | 2,069,880.000   |  |
|                 | CATHAY PACIFIC AIRWAYS            | 211,000 | 12.520  | 2,641,720.000   |  |
|                 | LI & FUNG LTD                     | 812,400 | 15.720  | 12,770,928.000  |  |
|                 | CHEUNG KONG HOLDINGS LTD          | 199,000 | 99.700  | 19,840,300.000  |  |
|                 | CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE        | 95,000  | 45.600  | 4,332,000.000   |  |
|                 | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR       | 156,400 | 117.200 | 18,330,080.000  |  |
|                 | MTR CORP                          | 245,000 | 26.500  | 6,492,500.000   |  |
|                 | FIRST PACIFIC CO                  | 380,000 | 7.970   | 3,028,600.000   |  |
|                 | HANG LUNG GROUP LTD               | 135,000 | 47.550  | 6,419,250.000   |  |
|                 | HANG SENG BANK LTD                | 106,000 | 105.700 | 11,204,200.000  |  |
|                 | HENDERSON LAND DEVELOPMENT        | 173,000 | 41.250  | 7,136,250.000   |  |
|                 | POWER ASSETS HOLDINGS LTD         | 206,500 | 58.400  | 12,059,600.000  |  |
|                 | (THE) WHARF HOLDINGS LTD          | 211,750 | 43.850  | 9,285,237.500   |  |
|                 | HONG KONG & CHINA GAS             | 698,050 | 19.640  | 13,709,702.000  |  |
|                 | HUTCHISON WHAMPOA LTD             | 318,000 | 71.950  | 22,880,100.000  |  |
|                 | HYSAN DEVELOPMENT CO              | 60,000  | 33.100  | 1,986,000.000   |  |
|                 | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP<br>LTD | 237,000 | 21.650  | 5,131,050.000   |  |
|                 | KERRY PROPERTIES LTD              | 137,000 | 33.550  | 4,596,350.000   |  |
|                 | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD        | 535,000 | 23.700  | 12,679,500.000  |  |
|                 | NWS HOLDINGS LTD                  | 148,000 | 11.580  | 1,713,840.000   |  |
|                 | NEW WORLD DEVELOPMENT             | 419,700 | 9.340   | 3,919,998.000   |  |
|                 | SHANGRI-LA ASIA LTD               | 230,000 | 16.140  | 3,712,200.000   |  |
|                 | SINO LAND CO                      | 389,400 | 12.360  | 4,812,984.000   |  |
|                 | SUN HUNG KAI PROPERTIES           | 224,000 | 89.250  | 19,992,000.000  |  |

|             |                                      |            |         |                 |  |
|-------------|--------------------------------------|------------|---------|-----------------|--|
|             | SWIRE PACIFIC LTD A                  | 98,000     | 87.200  | 8,545,600.000   |  |
|             | WHEELLOCK & CO LTD                   | 162,000    | 25.050  | 4,058,100.000   |  |
|             | LIFESTYLE INTL HLDGS LTD             | 28,500     | 17.100  | 487,350.000     |  |
|             | SJM HOLDINGS LTD                     | 290,000    | 16.360  | 4,744,400.000   |  |
|             | AIA GROUP LTD                        | 1,273,600  | 26.950  | 34,323,520.000  |  |
|             | HKT TRUST / HKT LTD                  | 15,956     | 6.230   | 99,405.880      |  |
|             | ASM PACIFIC TECH                     | 37,600     | 103.200 | 3,880,320.000   |  |
|             | WYNN MACAU LTD                       | 273,200    | 22.150  | 6,051,380.000   |  |
|             | SANDS CHINA LTD                      | 361,200    | 28.450  | 10,276,140.000  |  |
| 香港ドル小計      | 銘柄数 : 39                             | 11,016,016 |         | 323,144,749.380 |  |
|             | 組入時価比率 : 1.26%                       |            |         | (3,328,390,918) |  |
|             | 合計時価比率 : 1.30%                       |            |         |                 |  |
| シンガポール・ドル   | GENTING SINGAPORE PLC                | 887,400    | 1.670   | 1,481,958.000   |  |
|             | GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD            | 821,640    | 0.695   | 571,039.800     |  |
|             | SINGAPORE TECH ENG                   | 261,000    | 3.070   | 801,270.000     |  |
|             | SEMBCORP INDUSTRIES                  | 182,000    | 4.740   | 862,680.000     |  |
|             | SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD         | 261,000    | 3.870   | 1,010,070.000   |  |
|             | DBS GROUP HOLDINGS LTD               | 272,000    | 13.900  | 3,780,800.000   |  |
|             | CITY DEVELOPMENTS LTD                | 88,000     | 10.220  | 899,360.000     |  |
|             | SEMBCORP MARINE                      | 108,000    | 4.650   | 502,200.000     |  |
|             | JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD         | 18,000     | 45.500  | 819,000.000     |  |
|             | SINGAPORE EXCHANGE LTD               | 141,000    | 6.510   | 917,910.000     |  |
|             | CAPITALAND LTD                       | 297,000    | 2.690   | 798,930.000     |  |
|             | FRASER & NEAVE LTD-ORD               | 105,500    | 6.990   | 737,445.000     |  |
|             | KEPPEL CORP LTD                      | 208,500    | 10.420  | 2,172,570.000   |  |
|             | COMFORTDELGRO CORP LTD               | 332,000    | 1.490   | 494,680.000     |  |
|             | NEPTUNE ORIENT                       | 215,750    | 1.135   | 244,876.250     |  |
|             | NOBLE GROUP LTD/SINGAPORE            | 646,763    | 1.170   | 756,712.710     |  |
|             | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP         | 389,200    | 8.930   | 3,475,556.000   |  |
|             | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS         | 1,155,867  | 3.210   | 3,710,333.070   |  |
|             | SINGAPORE AIRLINES LTD               | 91,400     | 10.290  | 940,506.000     |  |
|             | KEPPEL LAND LTD                      | 164,000    | 2.890   | 473,960.000     |  |
|             | UNITED OVERSEAS BANK LTD             | 178,000    | 18.600  | 3,310,800.000   |  |
|             | STARHUB LTD                          | 110,000    | 3.220   | 354,200.000     |  |
|             | OLAM INTERNATIONAL LTD               | 140,800    | 2.120   | 298,496.000     |  |
|             | WILMAR INTERNATIONAL LTD             | 262,000    | 4.270   | 1,118,740.000   |  |
|             | YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD | 390,000    | 1.080   | 421,200.000     |  |
|             | CAPITAMALLS ASIA LTD                 | 288,000    | 1.415   | 407,520.000     |  |
|             | GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD       | 253,000    | 1.960   | 495,880.000     |  |
| シンガポール・ドル小計 | 銘柄数 : 27                             | 8,267,820  |         | 31,858,692.830  |  |
|             | 組入時価比率 : 0.77%                       |            |         | (2,034,496,124) |  |
|             | 合計時価比率 : 0.79%                       |            |         |                 |  |
| イスラエル・シュケル  | BANK HAPOLIM BM                      | 207,413    | 13.810  | 2,864,373.530   |  |

|                  |                                             |           |           |                |  |
|------------------|---------------------------------------------|-----------|-----------|----------------|--|
|                  | BANK LEUMI LE-ISRAEL BM                     | 236,029   | 11.460    | 2,704,892.340  |  |
|                  | BEZEQ ISRAELI<br>TELECOMMUNICATION CORP LTD | 335,378   | 5.330     | 1,787,564.740  |  |
|                  | ISRAEL CHEMICALS LTD                        | 81,827    | 40.860    | 3,343,451.220  |  |
|                  | TEVA PHARMACEUTICAL<br>INDUSTRIES LTD       | 142,447   | 162.000   | 23,076,414.000 |  |
|                  | ISRAEL CORP LTD/THE                         | 489       | 2,290.000 | 1,119,810.000  |  |
| イスラエル・<br>シュケル小計 | 銘柄数 : 6                                     | 1,003,583 |           | 34,896,505.830 |  |
|                  | 組入時価比率 : 0.28%                              |           |           | (731,430,762)  |  |
|                  | 合計時価比率 : 0.29%                              |           |           |                |  |
| オーストラリ<br>アドル    | RAMSAY HEALTH CARE LTD                      | 12,795    | 20.600    | 263,577.000    |  |
|                  | AUST AND NZ BANKING GROUP LT                | 394,554   | 22.150    | 8,739,371.100  |  |
|                  | AMCOR LTD                                   | 172,545   | 7.680     | 1,325,145.600  |  |
|                  | WESTPAC BANKING CORPORATION                 | 457,247   | 22.900    | 10,470,956.300 |  |
|                  | FORTESCUE METALS GROUP LTD                  | 173,901   | 5.490     | 954,716.490    |  |
|                  | TELSTRA CORP LTD                            | 677,536   | 3.640     | 2,466,231.040  |  |
|                  | BENDIGO AND ADELAIDE BANK<br>LTD            | 56,181    | 7.200     | 404,503.200    |  |
|                  | AMP LTD                                     | 449,927   | 4.080     | 1,835,702.160  |  |
|                  | LYNAS CORP LTD                              | 315,096   | 0.970     | 305,643.120    |  |
|                  | ASX LTD                                     | 30,082    | 30.350    | 912,988.700    |  |
|                  | BHP BILLITON LTD                            | 471,393   | 34.620    | 16,319,625.660 |  |
|                  | CALTEX AUSTRALIA LTD                        | 24,948    | 13.390    | 334,053.720    |  |
|                  | CAMPBELL BROTHERS LTD                       | 6,979     | 59.780    | 417,204.620    |  |
|                  | HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD                  | 101,749   | 2.000     | 203,498.000    |  |
|                  | COMPUTERSHARE LT                            | 75,518    | 8.320     | 628,309.760    |  |
|                  | CSL LIMITED                                 | 77,107    | 37.450    | 2,887,657.150  |  |
|                  | TRANSURBAN GROUP                            | 174,256   | 5.880     | 1,024,625.280  |  |
|                  | COCA-COLA AMATIL LTD                        | 93,286    | 12.610    | 1,176,336.460  |  |
|                  | COCHLEAR LTD                                | 10,605    | 65.630    | 696,006.150    |  |
|                  | ORIGIN ENERGY LTD                           | 153,096   | 13.150    | 2,013,212.400  |  |
|                  | COMMONWEALTH BANK OF<br>AUSTRALIA           | 238,795   | 51.900    | 12,393,460.500 |  |
|                  | BORAL LIMITED                               | 107,619   | 3.780     | 406,799.820    |  |
|                  | RIO TINTO LIMITED                           | 59,916    | 61.940    | 3,711,197.040  |  |
|                  | APA GROUP                                   | 40,949    | 5.000     | 204,745.000    |  |
|                  | INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT                | 266,750   | 3.470     | 925,622.500    |  |
|                  | OZ MINERALS LTD                             | 55,513    | 8.850     | 491,290.050    |  |
|                  | ORICA LTD                                   | 50,048    | 26.920    | 1,347,292.160  |  |
|                  | FAIRFAX MEDIA LTD                           | 373,327   | 0.675     | 251,995.720    |  |
|                  | LEIGHTON HLDGS LTD                          | 21,757    | 19.350    | 420,997.950    |  |
|                  | SYDNEY AIRPORT                              | 66,175    | 2.950     | 195,216.250    |  |
|                  | MACQUARIE GROUP LTD                         | 49,466    | 28.050    | 1,387,521.300  |  |
|                  | WORLEYPARSONS LTD                           | 28,202    | 26.570    | 749,327.140    |  |
|                  | SUNCORP GROUP LTD                           | 168,706   | 8.200     | 1,383,389.200  |  |
|                  | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD                 | 331,389   | 24.570    | 8,142,227.730  |  |

|              |                              |           |        |                   |  |
|--------------|------------------------------|-----------|--------|-------------------|--|
|              | NEWCREST MINING LTD          | 103,306   | 25.130 | 2,596,079.780     |  |
|              | INCITEC PIVOT LTD            | 270,689   | 3.240  | 877,032.360       |  |
|              | TOLL HOLDINGS LTD            | 118,338   | 5.640  | 667,426.320       |  |
|              | QANTAS AIRWAYS LIMITED       | 186,960   | 1.505  | 281,374.800       |  |
|              | QBE INSURANCE GROUP LIMITED  | 169,191   | 13.220 | 2,236,705.020     |  |
|              | SANTOS LTD                   | 140,142   | 12.930 | 1,812,036.060     |  |
|              | SIMS METAL MANAGEMENT LTD    | 28,753    | 13.580 | 390,465.740       |  |
|              | SONIC HEALTHCARE             | 64,654    | 12.450 | 804,942.300       |  |
|              | TABCORP HOLDINGS LTD         | 129,182   | 2.960  | 382,378.720       |  |
|              | WESFARMERS LTD               | 144,962   | 30.560 | 4,430,038.720     |  |
|              | ALUMINA LIMITED              | 397,286   | 1.010  | 401,258.860       |  |
|              | ILUKA RESOURCES LIM          | 71,975    | 13.600 | 978,860.000       |  |
|              | WOODSIDE PETROLEUM LTD       | 96,836    | 33.400 | 3,234,322.400     |  |
|              | WOOLWORTHS LTD               | 182,843   | 26.550 | 4,854,481.650     |  |
|              | METCASH LTD                  | 79,084    | 4.060  | 321,081.040       |  |
|              | TATTS GROUP LTD              | 225,953   | 2.640  | 596,515.920       |  |
|              | AGL ENERGY LTD               | 65,010    | 14.540 | 945,245.400       |  |
|              | BRAMBLES LTD                 | 217,633   | 7.220  | 1,571,310.260     |  |
|              | WHITEHAVEN COAL LTD          | 66,260    | 4.680  | 310,096.800       |  |
|              | ASCIANO LTD                  | 161,903   | 4.690  | 759,325.070       |  |
|              | CROWN LTD                    | 36,383    | 9.110  | 331,449.130       |  |
|              | ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD | 116,369   | 4.570  | 531,806.330       |  |
|              | QR NATIONAL LTD              | 278,184   | 3.540  | 984,771.360       |  |
|              | JAMES HARDIE INDUSTRIES SE   | 83,754    | 7.320  | 613,079.280       |  |
| オーストラリアドル小計  | 銘柄数 : 58                     | 9,223,063 |        | 116,302,529.590   |  |
|              | 組入時価比率 : 3.56%               |           |        | (9,369,331,783)   |  |
|              | 合計時価比率 : 3.66%               |           |        |                   |  |
| ニュージーランドドル   | FLETCHER BUILDING LTD        | 152,611   | 6.160  | 940,083.760       |  |
|              | TELECOM CORP OF NEW ZEALAND  | 407,280   | 2.670  | 1,087,437.600     |  |
| ニュージーランドドル小計 | 銘柄数 : 2                      | 559,891   |        | 2,027,521.360     |  |
|              | 組入時価比率 : 0.05%               |           |        | (127,206,690)     |  |
|              | 合計時価比率 : 0.05%               |           |        |                   |  |
| 合計           |                              |           |        | 250,721,656,544   |  |
|              |                              |           |        | (250,721,656,544) |  |

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

#### 株式以外の有価証券

平成24年5月11日現在

| 種 類         | 銘 柄                       | 口数         | 評価額           | 備考 |
|-------------|---------------------------|------------|---------------|----|
| 投資信託受益証券    | CAPITAMALL TRUST          | 294,800.00 | 526,218.000   |    |
|             | ASCENDAS REAL ESTATE INVT | 295,906.00 | 603,648.240   |    |
| シンガポール・ドル小計 | 銘柄数 : 2                   | 590,706.00 | 1,129,866.240 |    |

|             |                                |              |                 |  |
|-------------|--------------------------------|--------------|-----------------|--|
|             | 組入時価比率： 0.03%                  |              | (72,153,258)    |  |
|             | 合計時価比率： 0.03%                  |              |                 |  |
|             | MIRVAC GROUP                   | 612,711.00   | 796,524.300     |  |
|             | CFS RETAIL PROPERTY            | 338,821.00   | 643,759.900     |  |
|             | GPT GROUP                      | 292,236.00   | 940,999.920     |  |
|             | LEND LEASE GROUP               | 97,048.00    | 732,712.400     |  |
|             | STOCKLAND                      | 357,887.00   | 1,138,080.660   |  |
|             | WESTFIELD GROUP                | 314,611.00   | 2,957,343.400   |  |
|             | DEXUS PROPERTY GROUP           | 873,123.00   | 812,004.390     |  |
|             | GOODMAN GROUP                  | 236,716.00   | 864,013.400     |  |
|             | WESTFIELD RETAIL TRUST         | 418,064.00   | 1,141,314.720   |  |
| オーストラリアドル小計 | 銘柄数： 9                         | 3,541,217.00 | 10,026,753.090  |  |
|             | 組入時価比率： 0.31%                  |              | (807,755,229)   |  |
|             | 合計時価比率： 0.32%                  |              |                 |  |
| 投資信託受益証券計   |                                |              | 879,908,487     |  |
|             |                                |              | (879,908,487)   |  |
|             |                                |              |                 |  |
| 投資証券        | BOSTON PROPERTIES INC          | 20,951.00    | 2,266,898.200   |  |
|             | ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT     | 148,978.00   | 2,486,442.820   |  |
|             | PROLOGIS INC                   | 67,853.00    | 2,347,713.800   |  |
|             | AVALONBAY COMMUNITIES INC      | 13,805.00    | 2,028,368.650   |  |
|             | DUKE REALTY TRUST              | 38,117.00    | 562,606.920     |  |
|             | EQUITY RESIDENTIAL             | 44,402.00    | 2,801,322.180   |  |
|             | FEDERAL REALTY INVS TRUST      | 10,146.00    | 1,024,746.000   |  |
|             | GENERAL GROWTH PROPERTIES INC  | 72,923.00    | 1,320,635.530   |  |
|             | HCP INC                        | 66,067.00    | 2,732,531.120   |  |
|             | HEALTH CARE REIT INC           | 30,480.00    | 1,714,195.200   |  |
|             | RAYONIER INC                   | 16,734.00    | 744,663.000     |  |
|             | KIMCO REALTY                   | 65,111.00    | 1,270,966.720   |  |
|             | LIBERTY PROPERTY TRUST         | 16,250.00    | 592,800.000     |  |
|             | THE MACERICH COMPANY           | 19,817.00    | 1,202,495.560   |  |
|             | HOST HOTELS & RESORTS INC      | 107,557.00   | 1,727,365.420   |  |
|             | PLUM CREEK TIMBER CO           | 19,827.00    | 766,710.090     |  |
|             | REGENCY                        | 15,096.00    | 714,191.760     |  |
|             | SIMON PROPERTY GROUP INC       | 44,746.00    | 6,932,497.780   |  |
|             | PUBLIC STORAGE                 | 22,432.00    | 3,120,066.880   |  |
|             | VENTAS INC                     | 42,850.00    | 2,526,864.500   |  |
|             | VORNADO REALTY TRUST           | 24,478.00    | 2,129,586.000   |  |
|             | DIGITAL REALTY TRUST INC       | 16,583.00    | 1,211,553.980   |  |
|             | AMERICAN TOWER CORP            | 60,102.00    | 4,059,289.080   |  |
| 米ドル小計       | 銘柄数： 23                        | 985,305.00   | 46,284,511.190  |  |
|             | 組入時価比率： 1.40%                  |              | (3,699,983,825) |  |
|             | 合計時価比率： 1.44%                  |              |                 |  |
|             | BRITISH LAND CO PLC            | 99,446.00    | 489,174.870     |  |
|             | HAMMERSON PLC                  | 101,418.00   | 422,405.970     |  |
|             | LAND SECURITIES GROUP PLC      | 108,202.00   | 794,743.690     |  |
|             | CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP | 115,270.00   | 361,371.450     |  |
|             | SEGRO PLC                      | 93,543.00    | 202,146.420     |  |

|         |                                 |            |                 |  |
|---------|---------------------------------|------------|-----------------|--|
| 英ポンド小計  | 銘柄数： 5                          | 517,879.00 | 2,269,842.400   |  |
|         | 組入時価比率： 0.11%                   |            | (292,855,066)   |  |
|         | 合計時価比率： 0.11%                   |            |                 |  |
|         | BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES    | 30,249.00  | 549,926.820     |  |
|         | H & R REAL ESTATE INVESTMENT    | 6,464.00   | 156,881.280     |  |
|         | RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 15,764.00  | 431,775.960     |  |
| カナダドル小計 | 銘柄数： 3                          | 52,477.00  | 1,138,584.060   |  |
|         | 組入時価比率： 0.03%                   |            | (90,733,764)    |  |
|         | 合計時価比率： 0.04%                   |            |                 |  |
|         | GECINA SA                       | 1,860.00   | 127,837.800     |  |
|         | UNIBAIL-RODAMCO SE              | 12,822.00  | 1,737,381.000   |  |
|         | KLEPIERRE                       | 11,955.00  | 284,230.120     |  |
|         | FONCIERE DES REGIONS            | 5,785.00   | 306,084.350     |  |
|         | CORIO NV                        | 7,601.00   | 252,163.170     |  |
| ユーロ小計   | 銘柄数： 5                          | 40,023.00  | 2,707,696.440   |  |
|         | 組入時価比率： 0.11%                   |            | (280,057,043)   |  |
|         | 合計時価比率： 0.11%                   |            |                 |  |
|         | LINK REIT/THE                   | 336,500.00 | 10,599,750.000  |  |
| 香港ドル小計  | 銘柄数： 1                          | 336,500.00 | 10,599,750.000  |  |
|         | 組入時価比率： 0.04%                   |            | (109,177,425)   |  |
|         | 合計時価比率： 0.04%                   |            |                 |  |
| 投資証券計   |                                 |            | 4,472,807,123   |  |
|         |                                 |            | (4,472,807,123) |  |
|         |                                 |            |                 |  |
| 合計      |                                 |            | 5,352,715,610   |  |
|         |                                 |            | (5,352,715,610) |  |

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

#### 有価証券明細表注記

#### 外貨建有価証券の内訳

| 通貨         | 銘柄数       | 組入時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|------------|-----------|--------|------------|
| 米ドル        | 株式 564銘柄  | 56.03% | 57.65%     |
| 米ドル        | 投資証券 23銘柄 | 1.40%  | 1.44%      |
| 英ポンド       | 株式 99銘柄   | 10.15% | 10.45%     |
| 英ポンド       | 投資証券 5銘柄  | 0.11%  | 0.11%      |
| カナダドル      | 株式 99銘柄   | 5.24%  | 5.39%      |
| カナダドル      | 投資証券 3銘柄  | 0.03%  | 0.04%      |
| スイスフラン     | 株式 38銘柄   | 3.73%  | 3.84%      |
| スウェーデンクローネ | 株式 34銘柄   | 1.36%  | 1.40%      |
| ユーロ        | 株式 234銘柄  | 11.78% | 12.12%     |
| ユーロ        | 投資証券 5銘柄  | 0.11%  | 0.11%      |
| デンマーククローネ  | 株式 12銘柄   | 0.53%  | 0.54%      |
| ノルウェークローネ  | 株式 10銘柄   | 0.42%  | 0.44%      |
| 香港ドル       | 株式 39銘柄   | 1.26%  | 1.30%      |

|            |          |      |       |       |
|------------|----------|------|-------|-------|
| 香港ドル       | 投資証券     | 1銘柄  | 0.04% | 0.04% |
| シンガポール・ドル  | 株式       | 27銘柄 | 0.77% | 0.79% |
| シンガポール・ドル  | 投資信託受益証券 | 2銘柄  | 0.03% | 0.03% |
| イスラエル・シェケル | 株式       | 6銘柄  | 0.28% | 0.29% |
| オーストラリアドル  | 株式       | 58銘柄 | 3.56% | 3.66% |
| オーストラリアドル  | 投資信託受益証券 | 9銘柄  | 0.31% | 0.32% |
| ニュージーランドドル | 株式       | 2銘柄  | 0.05% | 0.05% |

(注) 「組入時価比率」は小計金額の純資産に対する比率、「合計金額に対する比率」は小計金額の合計金額に対する比率であります。

## 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

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

## 「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

| 科目          | 注記<br>番号 | 平成23年11月11日現在   | 平成24年5月11日現在    |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
|             |          | 金額<br>(円)       | 金額<br>(円)       |
| 資産の部        |          |                 |                 |
| 流動資産        |          |                 |                 |
| コール・ローン     |          | 1,430,737,889   | 2,233,761,810   |
| 国債証券        |          | 317,851,977,200 | 326,850,883,100 |
| 地方債証券       |          | 28,110,352,112  | 28,359,909,212  |
| 特殊債券        |          | 36,949,635,934  | 33,624,647,918  |
| 社債券         |          | 29,551,388,540  | 28,649,655,180  |
| 未収利息        |          | 1,381,931,890   | 1,363,329,590   |
| 前払費用        |          | 56,713,474      | 55,232,902      |
| 流動資産合計      |          | 415,332,737,039 | 421,137,419,712 |
| 資産合計        |          | 415,332,737,039 | 421,137,419,712 |
| 負債の部        |          |                 |                 |
| 流動負債        |          |                 |                 |
| 未払解約金       |          | 201,558,000     | 319,365,000     |
| 流動負債合計      |          | 201,558,000     | 319,365,000     |
| 負債合計        |          | 201,558,000     | 319,365,000     |
| 純資産の部       |          |                 |                 |
| 元本等         |          |                 |                 |
| 元本          |          | 364,643,942,666 | 365,145,726,104 |
| 剰余金         |          |                 |                 |
| 剰余金又は欠損金（ ） |          | 50,487,236,373  | 55,672,328,608  |
| 元本等合計       |          | 415,131,179,039 | 420,818,054,712 |
| 純資産合計       |          | 415,131,179,039 | 420,818,054,712 |
| 負債純資産合計     |          | 415,332,737,039 | 421,137,419,712 |

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                            |                                                                                                                                                  |
|----------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 計算期間の取扱い<br>当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年2月15日から平成24年2月14日まで及び平成24年2月15日から平成25年2月14日までとなっております。                                    |

## （貸借対照表に関する注記）

| 区分                                | 平成23年11月11日現在    | 平成24年5月11日現在     |
|-----------------------------------|------------------|------------------|
| *1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における    |                  |                  |
| 当該親投資信託の元本額                       | 390,026,049,070円 | 364,643,942,666円 |
| 同期中追加設定元本額                        | 18,897,285,868円  | 31,317,867,868円  |
| 同期中解約元本額                          | 44,279,392,272円  | 30,816,084,430円  |
| 同期末における元本の内訳                      |                  |                  |
| D I A M国内債券パッシブ・ファンド              | 5,373,886,627円   | 4,095,266,332円   |
| D I A M国内債券インデックスファンド< D C年金>     | 8,226,701,665円   | 9,209,496,768円   |
| D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型    | 2,661,718,935円   | 2,879,071,788円   |
| D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型 | 4,110,156,626円   | 4,517,857,769円   |
| D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型    | 1,626,765,581円   | 1,799,575,545円   |
| D I A M D C バランス30インデックスファンド      | 1,191,394,109円   | 1,194,846,312円   |
| D I A M D C バランス50インデックスファンド      | 1,190,606,149円   | 1,213,499,754円   |
| D I A M D C バランス70インデックスファンド      | 152,558,937円     | 155,448,671円     |
| マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>             | 195,601,240円     | 189,055,349円     |

|                                      |                 |                 |
|--------------------------------------|-----------------|-----------------|
| マネックス資産設計ファンド＜育成型＞                   | 2,041,174,757円  | 2,158,157,748円  |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション               | 7,211,845円      | 5,330,755円      |
| みずほエマージングボンドオープン                     | 10,801,911円     | 10,801,911円     |
| D I A M高金利通貨ファンド                     | 9,608,918円      | 9,608,918円      |
| D I A Mエマージング債券ファンド                  | 9,450,010円      | 9,450,010円      |
| D I A Mロシア株式ファンド                     | 10,126,042円     | 10,126,042円     |
| D I A M国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）       | 19,626,913,453円 | 17,689,756,236円 |
| D I A M国内債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家限定）     | 110,129,562円    | - 円             |
| D I A Mワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）       | 807,217,549円    | 782,968,994円    |
| D I A Mグローバル・バランスファンド25VA（適格機関投資家限定） | 12,010,753,758円 | 11,869,229,156円 |
| D I A Mグローバル・バランスファンド50VA（適格機関投資家限定） | 656,533,368円    | 667,629,677円    |
| D I A M国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）   | 456,224,693円    | 463,089,269円    |
| D I A M国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）   | 1,126,422,012円  | 1,144,387,616円  |
| D I A M国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）   | 507,270,884円    | 512,470,010円    |
| D I A M国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）   | 360,517,758円    | 370,957,796円    |
| D I A M世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）     | 28,077,662,335円 | 28,465,592,016円 |
| D I A M世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）     | 9,302,326,174円  | 9,457,199,858円  |
| D I A Mバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）       | 12,961,527,805円 | 12,923,512,076円 |
| D I A Mバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）     | 4,818,550,119円  | 4,749,712,296円  |
| D I A Mバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）       | 7,428,515,475円  | 7,371,362,471円  |

|                                              |                  |                  |
|----------------------------------------------|------------------|------------------|
| D I A Mグローバル・アセット・バランスV A（適格機関投資家限定）         | 1,700,853,205円   | 1,691,336,852円   |
| D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2（適格機関投資家限定）       | 6,185,022,419円   | 6,138,772,211円   |
| D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A（適格機関投資家限定） | 7,594,920,927円   | 7,439,812,540円   |
| D I A M世界アセットバランスファンドV A（適格機関投資家向け）          | 13,828,161,253円  | 13,954,466,607円  |
| D I A Mグローバルβ 私募ファンド（適格機関投資家向け）              | 708,137,610円     | 600,022,667円     |
| D I A M世界バランスファンド5 5 V A（適格機関投資家限定）          | 13,721,554,392円  | 13,692,062,956円  |
| D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド3 5 V A（適格機関投資家限定）    | 6,823,139,570円   | 7,032,441,249円   |
| D I A Mグローバル分散ファンドV A（適格機関投資家限定）             | 1,440,894,846円   | 1,461,352,959円   |
| D I A M世界アセットバランスファンド2 V A（適格機関投資家限定）        | 103,831,099,275円 | 104,780,053,484円 |
| D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A（適格機関投資家限定）      | 2,548,894,856円   | 2,510,256,698円   |
| D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A（適格機関投資家限定）      | 9,572,960,140円   | 9,639,453,927円   |
| D I A M世界アセットバランスファンド3 V A（適格機関投資家限定）        | 31,681,864,688円  | 31,964,888,442円  |
| D I A Mバランス3 0 V A（適格機関投資家限定）                | 2,208,694,874円   | 2,164,348,708円   |
| D I A Mバランス5 0 V A（適格機関投資家限定）                | 236,701円         | 245,409円         |
| D I A Mバランス7 0 V A（適格機関投資家限定）                | 145,905円         | 152,868円         |
| D I A M世界アセットバランスファンド4 V A（適格機関投資家限定）        | 34,668,637,603円  | 34,945,496,290円  |
| D I A M世界バランス2 5 V A（適格機関投資家限定）              | 762,537,936円     | 921,895,780円     |
| D I A M国内バランス3 0 V A（適格機関投資家限定）              | 193,952,296円     | 205,120,531円     |
| D I A Mバランス2 0 V A（適格機関投資家限定）                | 2,103,369,036円   | 2,077,529,655円   |
| D I A Mバランス4 0 V A（適格機関投資家限定）                | 312,378円         | 321,961円         |

|                                          |                              |                              |
|------------------------------------------|------------------------------|------------------------------|
| D I A Mバランス60V A（適格機関投資家限定）<br>（合 計）     | 224,459円<br>364,643,942,666円 | 233,167円<br>365,145,726,104円 |
| *2 本有価証券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受益権の総数 | 364,643,942,666口             | 365,145,726,104口             |

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

| 区分                       | 自平成23年5月12日<br>至平成23年11月11日                                                                                                                    | 自平成23年11月12日<br>至平成24年5月11日 |
|--------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。                                                                    | 同左                          |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 | 同左                          |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | 運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。                                 | 同左                          |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                         | 平成23年11月11日現在                                                                                                                                        | 平成24年5月11日現在                                                  |
|----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。                                                                                               | 同左                                                            |
| 2. 時価の算定方法                 | (1)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券<br>「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。<br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 | (1)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券<br>同左<br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>同左 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。                                | 同左                                                            |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

|       | 平成23年11月11日現在         | 平成24年5月11日現在          |
|-------|-----------------------|-----------------------|
| 種 類   | 当期の損益に含まれた<br>評価差額(円) | 当期の損益に含まれた<br>評価差額(円) |
| 国債証券  | 7,254,915,700         | 2,453,874,400         |
| 地方債証券 | 302,987,487           | 61,407,990            |
| 特殊債券  | 369,359,683           | 55,945,419            |
| 社債券   | 627,146,900           | 45,186,940            |
| 合計    | 7,300,115,970         | 2,616,414,749         |

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの特定期間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）

該当事項はありません。

## （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口当たり情報に関する注記 )

|                | 平成23年11月11日現在 | 平成24年5月11日現在 |
|----------------|---------------|--------------|
| 1口当たり純資産額      | 1.1385円       | 1.1525円      |
| ( 1万口当たり純資産額 ) | (11,385円)     | (11,525円)    |

[前へ](#) [次へ](#)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成24年5月11日現在

| 種 類  | 銘 柄                 | 券面総額（円）       | 評価額（円）        | 備考 |
|------|---------------------|---------------|---------------|----|
| 国債証券 | 3 0 5 回 利付国庫債券（2年）  | 3,000,000,000 | 3,003,060,000 |    |
|      | 3 0 6 回 利付国庫債券（2年）  | 2,000,000,000 | 2,002,320,000 |    |
|      | 3 0 7 回 利付国庫債券（2年）  | 2,200,000,000 | 2,202,596,000 |    |
|      | 3 0 8 回 利付国庫債券（2年）  | 1,500,000,000 | 1,499,895,000 |    |
|      | 3 0 9 回 利付国庫債券（2年）  | 1,500,000,000 | 1,499,880,000 |    |
|      | 3 1 0 回 利付国庫債券（2年）  | 2,000,000,000 | 2,002,840,000 |    |
|      | 3 1 2 回 利付国庫債券（2年）  | 2,500,000,000 | 2,499,775,000 |    |
|      | 3 1 3 回 利付国庫債券（2年）  | 1,500,000,000 | 1,499,865,000 |    |
|      | 3 1 4 回 利付国庫債券（2年）  | 1,500,000,000 | 1,499,850,000 |    |
|      | 7 2 回 利付国庫債券（5年）    | 4,200,000,000 | 4,264,260,000 |    |
|      | 7 5 回 利付国庫債券（5年）    | 4,600,000,000 | 4,661,732,000 |    |
|      | 7 8 回 利付国庫債券（5年）    | 3,500,000,000 | 3,544,415,000 |    |
|      | 8 1 回 利付国庫債券（5年）    | 5,700,000,000 | 5,772,960,000 |    |
|      | 8 3 回 利付国庫債券（5年）    | 4,100,000,000 | 4,168,224,000 |    |
|      | 8 5 回 利付国庫債券（5年）    | 3,500,000,000 | 3,548,825,000 |    |
|      | 8 7 回 利付国庫債券（5年）    | 3,800,000,000 | 3,838,418,000 |    |
|      | 8 8 回 利付国庫債券（5年）    | 4,000,000,000 | 4,043,680,000 |    |
|      | 8 9 回 利付国庫債券（5年）    | 4,500,000,000 | 4,538,880,000 |    |
|      | 9 1 回 利付国庫債券（5年）    | 1,700,000,000 | 1,715,300,000 |    |
|      | 9 2 回 利付国庫債券（5年）    | 4,000,000,000 | 4,022,680,000 |    |
|      | 9 3 回 利付国庫債券（5年）    | 4,000,000,000 | 4,050,840,000 |    |
|      | 9 5 回 利付国庫債券（5年）    | 2,000,000,000 | 2,033,640,000 |    |
|      | 9 6 回 利付国庫債券（5年）    | 2,000,000,000 | 2,025,980,000 |    |
|      | 9 7 回 利付国庫債券（5年）    | 4,500,000,000 | 4,540,275,000 |    |
|      | 9 9 回 利付国庫債券（5年）    | 5,000,000,000 | 5,043,100,000 |    |
|      | 1 0 1 回 利付国庫債券（5年）  | 2,000,000,000 | 2,016,380,000 |    |
|      | 1 0 2 回 利付国庫債券（5年）  | 4,000,000,000 | 4,014,560,000 |    |
|      | 1 0 3 回 利付国庫債券（5年）  | 1,500,000,000 | 1,504,305,000 |    |
|      | 2 回 利付国庫債券（40年）     | 600,000,000   | 634,884,000   |    |
|      | 3 回 利付国庫債券（40年）     | 1,000,000,000 | 1,054,430,000 |    |
|      | 4 回 利付国庫債券（40年）     | 1,300,000,000 | 1,361,295,000 |    |
|      | 2 5 0 回 利付国庫債券（10年） | 1,100,000,000 | 1,104,818,000 |    |
|      | 2 5 4 回 利付国庫債券（10年） | 2,700,000,000 | 2,747,142,000 |    |
|      | 2 5 6 回 利付国庫債券（10年） | 2,500,000,000 | 2,551,900,000 |    |
|      | 2 5 8 回 利付国庫債券（10年） | 1,000,000,000 | 1,022,020,000 |    |
|      | 2 6 0 回 利付国庫債券（10年） | 2,100,000,000 | 2,165,730,000 |    |
|      | 2 6 3 回 利付国庫債券（10年） | 2,700,000,000 | 2,794,635,000 |    |

|  |                         |               |               |  |
|--|-------------------------|---------------|---------------|--|
|  | 2 6 6 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 3,700,000,000 | 3,823,728,000 |  |
|  | 2 6 9 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 1,500,000,000 | 1,550,430,000 |  |
|  | 2 7 0 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 1,400,000,000 | 1,450,988,000 |  |
|  | 2 7 2 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 2,100,000,000 | 2,188,956,000 |  |
|  | 2 7 4 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 2,400,000,000 | 2,516,448,000 |  |
|  | 2 7 7 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 2,500,000,000 | 2,637,625,000 |  |
|  | 2 8 0 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 2,800,000,000 | 2,996,532,000 |  |
|  | 2 8 2 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 3,400,000,000 | 3,620,728,000 |  |
|  | 2 8 4 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 2,300,000,000 | 2,455,572,000 |  |
|  | 2 8 5 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 5,000,000,000 | 5,352,250,000 |  |
|  | 2 8 6 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 4,100,000,000 | 4,419,923,000 |  |
|  | 2 8 8 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 3,600,000,000 | 3,870,504,000 |  |
|  | 2 8 9 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 4,600,000,000 | 4,902,634,000 |  |
|  | 2 9 0 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 3,200,000,000 | 3,396,384,000 |  |
|  | 2 9 3 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 4,200,000,000 | 4,562,250,000 |  |
|  | 2 9 6 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 4,000,000,000 | 4,275,120,000 |  |
|  | 2 9 7 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 3,200,000,000 | 3,401,376,000 |  |
|  | 2 9 9 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 3,400,000,000 | 3,591,930,000 |  |
|  | 3 0 1 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 3,800,000,000 | 4,067,444,000 |  |
|  | 3 0 3 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 2,800,000,000 | 2,977,604,000 |  |
|  | 3 0 5 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 4,300,000,000 | 4,538,564,000 |  |
|  | 3 0 6 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 4,000,000,000 | 4,247,720,000 |  |
|  | 3 0 8 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 1,800,000,000 | 1,895,112,000 |  |
|  | 3 0 9 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 2,000,000,000 | 2,074,020,000 |  |
|  | 3 1 0 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 4,500,000,000 | 4,622,895,000 |  |
|  | 3 1 2 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 4,200,000,000 | 4,375,644,000 |  |
|  | 3 1 3 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 5,500,000,000 | 5,767,685,000 |  |
|  | 3 1 5 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 4,000,000,000 | 4,155,080,000 |  |
|  | 3 1 7 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 4,500,000,000 | 4,625,460,000 |  |
|  | 3 1 8 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 2,200,000,000 | 2,241,184,000 |  |
|  | 3 1 9 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 3,000,000,000 | 3,077,490,000 |  |
|  | 3 2 0 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 3,500,000,000 | 3,557,645,000 |  |
|  | 3 2 1 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ） | 1,500,000,000 | 1,521,120,000 |  |
|  | 1 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）     | 100,000,000   | 119,127,000   |  |
|  | 2 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）     | 100,000,000   | 112,706,000   |  |
|  | 3 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）     | 200,000,000   | 222,218,000   |  |
|  | 4 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）     | 200,000,000   | 241,452,000   |  |
|  | 5 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）     | 200,000,000   | 218,608,000   |  |
|  | 6 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）     | 200,000,000   | 224,968,000   |  |
|  | 7 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）     | 300,000,000   | 332,337,000   |  |
|  | 8 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）     | 500,000,000   | 510,325,000   |  |
|  | 1 1 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）   | 400,000,000   | 400,000,000   |  |
|  | 1 2 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）   | 300,000,000   | 321,060,000   |  |
|  | 1 3 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）   | 300,000,000   | 315,714,000   |  |
|  | 1 4 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）   | 500,000,000   | 562,475,000   |  |
|  | 1 5 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）   | 200,000,000   | 228,826,000   |  |
|  | 1 6 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）   | 400,000,000   | 457,008,000   |  |
|  | 1 7 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）   | 200,000,000   | 224,876,000   |  |

|  |                     |               |               |  |
|--|---------------------|---------------|---------------|--|
|  | 1 8 回 利付国庫債券（3 0 年） | 820,000,000   | 906,173,800   |  |
|  | 1 9 回 利付国庫債券（3 0 年） | 200,000,000   | 221,002,000   |  |
|  | 2 0 回 利付国庫債券（3 0 年） | 300,000,000   | 342,981,000   |  |
|  | 2 1 回 利付国庫債券（3 0 年） | 500,000,000   | 551,920,000   |  |
|  | 2 2 回 利付国庫債券（3 0 年） | 470,000,000   | 537,445,000   |  |
|  | 2 3 回 利付国庫債券（3 0 年） | 400,000,000   | 457,440,000   |  |
|  | 2 4 回 利付国庫債券（3 0 年） | 600,000,000   | 686,208,000   |  |
|  | 2 5 回 利付国庫債券（3 0 年） | 600,000,000   | 662,442,000   |  |
|  | 2 6 回 利付国庫債券（3 0 年） | 1,000,000,000 | 1,124,240,000 |  |
|  | 2 7 回 利付国庫債券（3 0 年） | 900,000,000   | 1,031,202,000 |  |
|  | 2 8 回 利付国庫債券（3 0 年） | 800,000,000   | 916,568,000   |  |
|  | 2 9 回 利付国庫債券（3 0 年） | 1,300,000,000 | 1,464,268,000 |  |
|  | 3 0 回 利付国庫債券（3 0 年） | 1,500,000,000 | 1,656,735,000 |  |
|  | 3 1 回 利付国庫債券（3 0 年） | 1,600,000,000 | 1,731,568,000 |  |
|  | 3 2 回 利付国庫債券（3 0 年） | 1,600,000,000 | 1,766,400,000 |  |
|  | 3 3 回 利付国庫債券（3 0 年） | 1,800,000,000 | 1,867,572,000 |  |
|  | 3 4 回 利付国庫債券（3 0 年） | 2,200,000,000 | 2,378,376,000 |  |
|  | 3 5 回 利付国庫債券（3 0 年） | 2,400,000,000 | 2,485,008,000 |  |
|  | 3 6 回 利付国庫債券（3 0 年） | 300,000,000   | 310,143,000   |  |
|  | 3 7 回 利付国庫債券（2 0 年） | 600,000,000   | 689,556,000   |  |
|  | 3 9 回 利付国庫債券（2 0 年） | 400,000,000   | 452,340,000   |  |
|  | 4 0 回 利付国庫債券（2 0 年） | 720,000,000   | 805,716,000   |  |
|  | 4 2 回 利付国庫債券（2 0 年） | 800,000,000   | 915,152,000   |  |
|  | 4 3 回 利付国庫債券（2 0 年） | 860,000,000   | 1,007,404,000 |  |
|  | 4 5 回 利付国庫債券（2 0 年） | 900,000,000   | 1,025,235,000 |  |
|  | 4 6 回 利付国庫債券（2 0 年） | 500,000,000   | 561,825,000   |  |
|  | 4 7 回 利付国庫債券（2 0 年） | 950,000,000   | 1,068,778,500 |  |
|  | 4 8 回 利付国庫債券（2 0 年） | 500,000,000   | 575,595,000   |  |
|  | 5 0 回 利付国庫債券（2 0 年） | 780,000,000   | 858,374,400   |  |
|  | 5 1 回 利付国庫債券（2 0 年） | 600,000,000   | 665,310,000   |  |
|  | 5 2 回 利付国庫債券（2 0 年） | 550,000,000   | 614,894,500   |  |
|  | 5 4 回 利付国庫債券（2 0 年） | 700,000,000   | 789,481,000   |  |
|  | 5 5 回 利付国庫債券（2 0 年） | 810,000,000   | 898,330,500   |  |
|  | 5 7 回 利付国庫債券（2 0 年） | 1,130,000,000 | 1,240,920,800 |  |
|  | 5 8 回 利付国庫債券（2 0 年） | 600,000,000   | 659,304,000   |  |
|  | 6 0 回 利付国庫債券（2 0 年） | 990,000,000   | 1,036,896,300 |  |
|  | 6 1 回 利付国庫債券（2 0 年） | 800,000,000   | 803,536,000   |  |
|  | 6 2 回 利付国庫債券（2 0 年） | 1,300,000,000 | 1,274,650,000 |  |
|  | 6 4 回 利付国庫債券（2 0 年） | 800,000,000   | 876,520,000   |  |
|  | 6 5 回 利付国庫債券（2 0 年） | 1,100,000,000 | 1,204,148,000 |  |
|  | 6 7 回 利付国庫債券（2 0 年） | 1,600,000,000 | 1,749,728,000 |  |
|  | 7 0 回 利付国庫債券（2 0 年） | 1,250,000,000 | 1,436,537,500 |  |
|  | 7 2 回 利付国庫債券（2 0 年） | 1,250,000,000 | 1,392,725,000 |  |
|  | 7 3 回 利付国庫債券（2 0 年） | 1,190,000,000 | 1,310,689,800 |  |
|  | 7 5 回 利付国庫債券（2 0 年） | 1,400,000,000 | 1,556,702,000 |  |
|  | 7 8 回 利付国庫債券（2 0 年） | 1,550,000,000 | 1,682,323,500 |  |
|  | 8 1 回 利付国庫債券（2 0 年） | 1,400,000,000 | 1,534,176,000 |  |
|  | 8 3 回 利付国庫債券（2 0 年） | 1,600,000,000 | 1,770,432,000 |  |

|       |                         |               |                 |  |
|-------|-------------------------|---------------|-----------------|--|
|       | 8 5 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）   | 2,050,000,000 | 2,265,024,500   |  |
|       | 8 8 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）   | 1,700,000,000 | 1,918,552,000   |  |
|       | 9 0 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）   | 1,600,000,000 | 1,783,856,000   |  |
|       | 9 2 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）   | 1,700,000,000 | 1,870,323,000   |  |
|       | 9 3 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）   | 1,000,000,000 | 1,085,080,000   |  |
|       | 9 4 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）   | 800,000,000   | 879,096,000     |  |
|       | 9 5 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）   | 1,700,000,000 | 1,912,143,000   |  |
|       | 9 7 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）   | 1,500,000,000 | 1,664,235,000   |  |
|       | 9 9 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）   | 1,600,000,000 | 1,751,248,000   |  |
|       | 1 0 0 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ） | 1,800,000,000 | 1,991,916,000   |  |
|       | 1 0 2 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ） | 1,900,000,000 | 2,153,859,000   |  |
|       | 1 0 5 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ） | 1,800,000,000 | 1,961,118,000   |  |
|       | 1 0 7 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ） | 2,000,000,000 | 2,175,380,000   |  |
|       | 1 0 9 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ） | 2,000,000,000 | 2,113,260,000   |  |
|       | 1 1 1 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ） | 2,200,000,000 | 2,419,428,000   |  |
|       | 1 1 3 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ） | 2,200,000,000 | 2,383,370,000   |  |
|       | 1 1 4 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ） | 2,200,000,000 | 2,380,466,000   |  |
|       | 1 1 6 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ） | 2,600,000,000 | 2,850,198,000   |  |
|       | 1 1 8 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ） | 1,200,000,000 | 1,276,320,000   |  |
|       | 1 1 9 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ） | 1,500,000,000 | 1,547,520,000   |  |
|       | 1 2 1 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ） | 2,200,000,000 | 2,301,772,000   |  |
|       | 1 2 3 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ） | 2,200,000,000 | 2,369,554,000   |  |
|       | 1 2 5 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ） | 2,400,000,000 | 2,621,784,000   |  |
|       | 1 2 8 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ） | 1,200,000,000 | 1,251,744,000   |  |
|       | 1 2 9 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ） | 1,000,000,000 | 1,027,000,000   |  |
|       | 1 3 0 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ） | 2,500,000,000 | 2,564,400,000   |  |
|       | 1 3 2 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ） | 2,400,000,000 | 2,417,760,000   |  |
|       | 1 3 4 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ） | 600,000,000   | 614,370,000     |  |
| 国債証券計 |                         |               | 326,850,883,100 |  |
|       |                         |               |                 |  |
| 地方債証券 | 6 0 2 回 東京都公募公債         | 148,000,000   | 150,666,960     |  |
|       | 6 1 1 回 東京都公募公債         | 200,000,000   | 207,044,000     |  |
|       | 6 1 2 回 東京都公募公債         | 161,500,000   | 166,779,435     |  |
|       | 6 1 4 回 東京都公募公債         | 200,000,000   | 206,228,000     |  |
|       | 6 1 6 回 東京都公募公債         | 100,000,000   | 103,233,000     |  |
|       | 6 1 7 回 東京都公募公債         | 200,000,000   | 206,414,000     |  |
|       | 6 1 9 回 東京都公募公債         | 200,000,000   | 207,760,000     |  |
|       | 6 2 0 回 東京都公募公債         | 200,000,000   | 206,736,000     |  |
|       | 6 2 2 回 東京都公募公債         | 106,800,000   | 110,461,104     |  |
|       | 6 2 3 回 東京都公募公債         | 200,000,000   | 207,042,000     |  |
|       | 6 2 7 回 東京都公募公債         | 100,000,000   | 104,469,000     |  |
|       | 6 2 8 回 東京都公募公債         | 100,000,000   | 105,013,000     |  |
|       | 6 2 9 回 東京都公募公債         | 494,000,000   | 516,284,340     |  |
|       | 6 3 2 回 東京都公募公債         | 115,300,000   | 123,210,733     |  |
|       | 6 3 3 回 東京都公募公債         | 100,000,000   | 106,746,000     |  |
|       | 6 3 4 回 東京都公募公債         | 200,000,000   | 213,312,000     |  |
|       | 6 3 8 回 東京都公募公債         | 200,000,000   | 214,286,000     |  |
|       | 6 4 0 回 東京都公募公債         | 150,000,000   | 160,417,500     |  |

|                      |             |             |  |
|----------------------|-------------|-------------|--|
| 6 4 1 回 東京都公募公債      | 100,000,000 | 107,082,000 |  |
| 6 5 9 回 東京都公募公債      | 203,500,000 | 218,154,035 |  |
| 6 6 4 回 東京都公募公債      | 300,000,000 | 317,895,000 |  |
| 6 6 7 回 東京都公募公債      | 300,000,000 | 321,393,000 |  |
| 6 8 0 回 東京都公募公債      | 200,000,000 | 211,454,000 |  |
| 6 8 5 回 東京都公募公債      | 500,000,000 | 517,885,000 |  |
| 6 8 8 回 東京都公募公債      | 200,000,000 | 203,632,000 |  |
| 6 9 7 回 東京都公募公債      | 200,000,000 | 205,266,000 |  |
| 1 5 年度 2 回 北海道公募公債   | 203,000,000 | 205,090,900 |  |
| 1 6 年度 1 1 回 北海道公募公債 | 250,000,000 | 257,245,000 |  |
| 1 8 年度 4 回 北海道公募公債   | 190,500,000 | 203,606,400 |  |
| 1 8 年度 6 回 北海道公募公債   | 100,000,000 | 107,517,000 |  |
| 1 9 年度 4 回 北海道公募公債   | 300,000,000 | 324,012,000 |  |
| 2 1 年度 6 回 北海道公募公債   | 200,000,000 | 213,406,000 |  |
| 1 2 5 回 神奈川県公募公債     | 100,000,000 | 102,323,000 |  |
| 1 2 6 回 神奈川県公募公債     | 178,870,000 | 183,558,182 |  |
| 1 2 7 回 神奈川県公募公債     | 100,000,000 | 103,615,000 |  |
| 1 2 8 回 神奈川県公募公債     | 100,000,000 | 103,176,000 |  |
| 1 3 0 回 神奈川県公募公債     | 156,200,000 | 161,373,344 |  |
| 1 3 5 回 神奈川県公募公債     | 200,000,000 | 209,672,000 |  |
| 1 3 6 回 神奈川県公募公債     | 100,000,000 | 104,671,000 |  |
| 1 6 6 回 神奈川県公募公債     | 300,000,000 | 316,740,000 |  |
| 2 7 8 回 大阪府公募公債      | 200,000,000 | 206,374,000 |  |
| 2 8 5 回 大阪府公募公債      | 100,000,000 | 104,416,000 |  |
| 2 8 6 回 大阪府公募公債      | 200,000,000 | 209,002,000 |  |
| 2 8 9 回 大阪府公募公債      | 200,000,000 | 211,788,000 |  |
| 2 9 3 回 大阪府公募公債      | 200,000,000 | 215,114,000 |  |
| 3 0 1 回 大阪府公募公債      | 100,000,000 | 107,134,000 |  |
| 3 1 0 回 大阪府公募公債      | 240,000,000 | 255,744,000 |  |
| 3 3 6 回 大阪府公募公債      | 200,000,000 | 211,200,000 |  |
| 1 回 大阪府公募公債 7 年      | 200,000,000 | 204,050,000 |  |
| 1 5 年度 3 回 京都府公募公債   | 219,300,000 | 224,030,301 |  |
| 1 6 年度 2 回 京都府公募公債   | 100,000,000 | 103,155,000 |  |
| 1 8 年度 1 回 京都府公募公債   | 100,000,000 | 106,495,000 |  |
| 1 6 年度 4 回 兵庫県公募公債   | 251,970,000 | 259,017,600 |  |
| 1 6 年度 8 回 兵庫県公募公債   | 111,500,000 | 115,754,840 |  |
| 1 7 年度 2 回 兵庫県公募公債   | 200,000,000 | 206,832,000 |  |
| 1 7 年度 9 回 兵庫県公募公債   | 306,000,000 | 320,446,260 |  |
| 1 7 年度 1 3 回 兵庫県公募公債 | 105,000,000 | 110,724,600 |  |
| 1 8 年度 1 回 兵庫県公募公債   | 120,000,000 | 127,122,000 |  |
| 1 5 年度 3 回 静岡県公募公債   | 116,130,000 | 118,224,985 |  |
| 1 8 年度 5 回 静岡県公募公債   | 129,800,000 | 138,869,126 |  |
| 2 1 年度 5 回 静岡県公募公債   | 197,000,000 | 207,815,300 |  |
| 1 5 年度 1 回 愛知県公募公債   | 303,600,000 | 309,076,944 |  |
| 1 6 年度 2 回 愛知県公募公債   | 200,000,000 | 207,014,000 |  |
| 1 8 年度 2 回 愛知県公募公債   | 160,300,000 | 171,867,248 |  |
| 2 0 年度 4 回 愛知県公募公債   | 100,000,000 | 107,131,000 |  |
| 2 2 年度 6 回 愛知県公募公債   | 200,000,000 | 207,592,000 |  |

|  |                    |             |             |  |
|--|--------------------|-------------|-------------|--|
|  | 1 6 年度 2 回 広島県公募公債 | 200,000,000 | 207,510,000 |  |
|  | 2 2 年度 1 回 広島県公募公債 | 200,000,000 | 210,684,000 |  |
|  | 1 5 年度 3 回 埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 101,972,000 |  |
|  | 1 7 年度 2 回 埼玉県公募公債 | 200,000,000 | 206,768,000 |  |
|  | 1 8 年度 1 回 埼玉県公募公債 | 200,000,000 | 212,370,000 |  |
|  | 2 1 年度 4 回 埼玉県公募公債 | 440,000,000 | 467,724,400 |  |
|  | 2 3 年度 2 回 埼玉県公募公債 | 200,000,000 | 206,578,000 |  |
|  | 1 6 年度 3 回 福岡県公募公債 | 131,040,000 | 135,133,689 |  |
|  | 1 7 年度 1 回 福岡県公募公債 | 100,000,000 | 103,959,000 |  |
|  | 1 7 年度 5 回 福岡県公募公債 | 100,000,000 | 104,764,000 |  |
|  | 1 8 年度 1 回 福岡県公募公債 | 104,000,000 | 112,193,120 |  |
|  | 2 1 年度 3 回 福岡県公募公債 | 200,000,000 | 213,896,000 |  |
|  | 1 5 年度 4 回 千葉県公募公債 | 100,000,000 | 102,092,000 |  |
|  | 1 6 年度 3 回 千葉県公募公債 | 100,000,000 | 103,958,000 |  |
|  | 1 6 年度 8 回 千葉県公募公債 | 200,000,000 | 206,254,000 |  |
|  | 1 7 年度 2 回 千葉県公募公債 | 200,000,000 | 206,952,000 |  |
|  | 1 9 年度 5 回 千葉県公募公債 | 300,000,000 | 324,183,000 |  |
|  | 2 1 年度 6 回 千葉県公募公債 | 200,000,000 | 211,814,000 |  |
|  | 1 8 年度 2 回 新潟県公募公債 | 169,000,000 | 181,080,120 |  |
|  | 8 回 共同発行市場公募地方債    | 400,000,000 | 408,792,000 |  |
|  | 9 回 共同発行市場公募地方債    | 210,000,000 | 214,521,300 |  |
|  | 1 1 回 共同発行市場公募地方債  | 300,000,000 | 306,090,000 |  |
|  | 1 2 回 共同発行市場公募地方債  | 130,000,000 | 132,993,900 |  |
|  | 1 3 回 共同発行市場公募地方債  | 221,000,000 | 226,752,630 |  |
|  | 1 8 回 共同発行市場公募地方債  | 100,000,000 | 103,395,000 |  |
|  | 1 9 回 共同発行市場公募地方債  | 130,000,000 | 134,543,500 |  |
|  | 2 0 回 共同発行市場公募地方債  | 100,000,000 | 103,366,000 |  |
|  | 2 1 回 共同発行市場公募地方債  | 300,000,000 | 309,600,000 |  |
|  | 2 3 回 共同発行市場公募地方債  | 100,000,000 | 103,127,000 |  |
|  | 2 5 回 共同発行市場公募地方債  | 304,000,000 | 314,907,520 |  |
|  | 2 8 回 共同発行市場公募地方債  | 200,000,000 | 207,096,000 |  |
|  | 2 9 回 共同発行市場公募地方債  | 200,000,000 | 207,912,000 |  |
|  | 3 1 回 共同発行市場公募地方債  | 200,000,000 | 208,948,000 |  |
|  | 3 2 回 共同発行市場公募地方債  | 200,000,000 | 209,848,000 |  |
|  | 3 3 回 共同発行市場公募地方債  | 300,000,000 | 315,057,000 |  |
|  | 3 5 回 共同発行市場公募地方債  | 200,000,000 | 210,458,000 |  |
|  | 3 6 回 共同発行市場公募地方債  | 100,000,000 | 105,299,000 |  |
|  | 3 7 回 共同発行市場公募地方債  | 150,000,000 | 159,264,000 |  |
|  | 3 8 回 共同発行市場公募地方債  | 170,000,000 | 182,037,700 |  |
|  | 3 9 回 共同発行市場公募地方債  | 146,000,000 | 155,917,780 |  |
|  | 4 0 回 共同発行市場公募地方債  | 150,000,000 | 161,614,500 |  |
|  | 4 7 回 共同発行市場公募地方債  | 161,600,000 | 173,130,160 |  |
|  | 5 5 回 共同発行市場公募地方債  | 200,000,000 | 216,122,000 |  |
|  | 5 7 回 共同発行市場公募地方債  | 200,000,000 | 214,172,000 |  |
|  | 6 1 回 共同発行市場公募地方債  | 300,000,000 | 320,058,000 |  |
|  | 6 5 回 共同発行市場公募地方債  | 100,000,000 | 107,220,000 |  |
|  | 7 5 回 共同発行市場公募地方債  | 500,000,000 | 537,905,000 |  |
|  | 8 0 回 共同発行市場公募地方債  | 700,000,000 | 748,013,000 |  |

|        |                      |             |                |  |
|--------|----------------------|-------------|----------------|--|
|        | 9 4 回 共同発行市場公募地方債    | 100,000,000 | 103,959,000    |  |
|        | 9 9 回 共同発行市場公募地方債    | 700,000,000 | 721,420,000    |  |
|        | 1 7 年度 3 回 大阪市公募公債   | 100,000,000 | 103,297,000    |  |
|        | 1 7 年度 7 回 大阪市公募公債   | 200,000,000 | 207,582,000    |  |
|        | 1 7 年度 8 回 大阪市公募公債   | 200,000,000 | 209,088,000    |  |
|        | 1 7 年度 1 1 回 大阪市公募公債 | 100,000,000 | 104,905,000    |  |
|        | 1 8 年度 2 回 大阪市公募公債   | 100,000,000 | 106,844,000    |  |
|        | 1 8 年度 3 回 大阪市公募公債   | 150,000,000 | 161,092,500    |  |
|        | 1 9 年度 5 回 大阪市公募公債   | 135,000,000 | 145,957,950    |  |
|        | 1 2 回ひ号 名古屋市公募公債     | 200,000,000 | 207,078,000    |  |
|        | 1 2 回せ号 名古屋市公募公債     | 359,500,000 | 374,120,865    |  |
|        | 1 7 年度 1 回 京都市公募公債   | 100,000,000 | 103,854,000    |  |
|        | 1 8 年度 3 回 京都市公募公債   | 101,700,000 | 109,320,381    |  |
|        | 1 6 年度 5 回 神戸市公募公債   | 200,000,000 | 206,258,000    |  |
|        | 1 7 年度 1 3 回 神戸市公募公債 | 103,000,000 | 108,255,060    |  |
|        | 1 5 年度 5 回 横浜市公募公債   | 200,000,000 | 204,060,000    |  |
|        | 1 6 年度 1 回 横浜市公募公債   | 200,000,000 | 205,314,000    |  |
|        | 1 7 年度 1 回 横浜市公募公債   | 300,000,000 | 309,591,000    |  |
|        | 2 2 年度 3 回 横浜市公募公債   | 200,000,000 | 207,146,000    |  |
|        | 2 2 年度 5 回 横浜市公募公債   | 200,000,000 | 208,464,000    |  |
|        | 1 6 年度 7 回 札幌市公募公債   | 100,000,000 | 103,755,000    |  |
|        | 1 9 年度 7 回 札幌市公募公債   | 300,000,000 | 318,543,000    |  |
|        | 2 回 川崎市公募公債 1 5 年    | 100,000,000 | 107,346,000    |  |
|        | 2 1 年度 2 回 北九州市公募公債  | 200,000,000 | 210,694,000    |  |
|        | 1 8 年度 4 回 福岡市公募公債   | 100,000,000 | 106,676,000    |  |
|        | 1 6 年度 1 回 広島市公募公債   | 100,000,000 | 103,129,000    |  |
|        | 1 6 年度 2 回 千葉市公募公債   | 100,000,000 | 103,253,000    |  |
| 地方債証券計 |                      |             | 28,359,909,212 |  |
|        |                      |             |                |  |
| 特殊債券   | 8 回 政保日本政策投資銀行債券     | 102,000,000 | 105,850,500    |  |
|        | 1 3 回 政保日本政策投資銀行債券   | 121,000,000 | 130,071,370    |  |
|        | 1 6 回 日本政策投資銀行債券     | 100,000,000 | 102,978,000    |  |
|        | 9 回 日本政策投資銀行債券       | 100,000,000 | 101,811,000    |  |
|        | 1 3 回 日本政策投資銀行債券     | 100,000,000 | 102,487,000    |  |
|        | 2 7 回 日本政策投資銀行債券     | 200,000,000 | 214,144,000    |  |
|        | 4 6 回 日本政策投資銀行債券     | 200,000,000 | 213,970,000    |  |
|        | 3 4 回 日本道路・機構承継債     | 200,000,000 | 206,494,000    |  |
|        | 3 1 9 回 政保道路債        | 132,000,000 | 133,273,800    |  |
|        | 3 2 2 回 政保道路債        | 106,000,000 | 108,212,220    |  |
|        | 3 2 4 回 政保道路債        | 200,000,000 | 204,254,000    |  |
|        | 3 2 8 回 政保道路債        | 200,000,000 | 205,528,000    |  |
|        | 3 2 9 回 政保道路債        | 100,000,000 | 103,076,000    |  |
|        | 3 3 3 回 政保道路債        | 300,000,000 | 310,686,000    |  |
|        | 3 3 5 回 政保道路債        | 237,000,000 | 244,735,680    |  |
|        | 3 3 8 回 政保道路債        | 264,000,000 | 274,166,640    |  |
|        | 3 3 9 回 政保道路債        | 301,000,000 | 312,025,630    |  |
|        | 1 5 回 高速道路機構債        | 400,000,000 | 429,492,000    |  |
|        | 2 5 回 高速道路機構債        | 300,000,000 | 322,101,000    |  |

|  |                        |             |             |  |
|--|------------------------|-------------|-------------|--|
|  | 3 5 回 高速道路機構債          | 400,000,000 | 427,028,000 |  |
|  | 4 8 回 高速道路機構債          | 700,000,000 | 751,926,000 |  |
|  | 3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構  | 300,000,000 | 314,547,000 |  |
|  | 5 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構  | 209,000,000 | 220,102,080 |  |
|  | 8 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構  | 108,000,000 | 113,806,080 |  |
|  | 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構  | 100,000,000 | 109,657,000 |  |
|  | 1 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 301,000,000 | 323,298,080 |  |
|  | 1 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 122,000,000 | 131,208,560 |  |
|  | 1 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 106,772,000 |  |
|  | 2 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 375,000,000 | 401,178,750 |  |
|  | 2 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 300,000,000 | 319,770,000 |  |
|  | 2 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 200,000,000 | 204,870,000 |  |
|  | 3 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 300,000,000 | 320,580,000 |  |
|  | 3 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 297,000,000 | 317,611,800 |  |
|  | 3 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 344,000,000 | 371,877,760 |  |
|  | 4 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 331,000,000 | 358,449,830 |  |
|  | 4 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 200,000,000 | 212,706,000 |  |
|  | 5 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 200,000,000 | 211,848,000 |  |
|  | 6 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 162,000,000 | 172,722,780 |  |
|  | 6 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 401,000,000 | 430,156,710 |  |
|  | 7 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 600,000,000 | 636,072,000 |  |
|  | 7 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 200,000,000 | 212,126,000 |  |
|  | 8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 106,737,000 |  |
|  | 8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 300,000,000 | 315,861,000 |  |
|  | 2 6 回 日本道路・機構承継債       | 200,000,000 | 204,602,000 |  |
|  | 4 1 回 日本道路・機構承継債       | 300,000,000 | 310,761,000 |  |
|  | 8 3 7 回 政保公営企業債券       | 432,000,000 | 442,100,160 |  |

|  |                      |             |             |  |
|--|----------------------|-------------|-------------|--|
|  | 8 3 8 回 政保公営企業債券     | 600,000,000 | 615,798,000 |  |
|  | 8 3 9 回 政保公営企業債券     | 260,000,000 | 267,142,200 |  |
|  | 8 4 3 回 政保公営企業債券     | 100,000,000 | 103,210,000 |  |
|  | 8 4 7 回 政保公営企業債券     | 200,000,000 | 206,730,000 |  |
|  | 8 4 8 回 政保公営企業債券     | 200,000,000 | 206,362,000 |  |
|  | 8 4 9 回 政保公営企業債券     | 261,000,000 | 270,983,250 |  |
|  | 8 5 2 回 政保公営企業債券     | 300,000,000 | 310,611,000 |  |
|  | 8 5 3 回 政保公営企業債券     | 204,000,000 | 210,723,840 |  |
|  | 8 5 4 回 政保公営企業債券     | 304,000,000 | 316,160,000 |  |
|  | 8 5 6 回 政保公営企業債券     | 200,000,000 | 209,070,000 |  |
|  | 8 5 9 回 政保公営企業債券     | 207,000,000 | 217,004,310 |  |
|  | 8 6 2 回 政保公営企業債券     | 239,000,000 | 253,908,820 |  |
|  | 8 6 3 回 政保公営企業債券     | 200,000,000 | 214,354,000 |  |
|  | 8 6 7 回 政保公営企業債券     | 200,000,000 | 213,478,000 |  |
|  | 8 6 8 回 政保公営企業債券     | 101,000,000 | 107,908,400 |  |
|  | 8 6 9 回 政保公営企業債券     | 102,000,000 | 109,082,880 |  |
|  | 8 7 5 回 政保公営企業債券     | 482,000,000 | 515,812,300 |  |
|  | 8 回 政保地方公営企業金融機構債券   | 651,000,000 | 694,779,750 |  |
|  | 3 回 政保地方公共団体金融機構債券   | 101,000,000 | 107,793,260 |  |
|  | 5 回 地方公共団体金融機構債券     | 500,000,000 | 527,460,000 |  |
|  | 8 回 政保地方公共団体金融機構債券   | 300,000,000 | 315,561,000 |  |
|  | 1 0 回 政保地方公共団体金融機構債券 | 500,000,000 | 525,610,000 |  |
|  | 1 5 回 政保地方公共団体金融機構債券 | 200,000,000 | 204,928,000 |  |
|  | 2 0 回 政保地方公共団体金融機構債券 | 300,000,000 | 311,514,000 |  |
|  | 2 4 回 地方公共団体金融機構債券   | 300,000,000 | 309,549,000 |  |
|  | 1 2 回 公営企業金融公庫債券     | 300,000,000 | 309,384,000 |  |
|  | 1 4 回 公営企業金融公庫債券     | 100,000,000 | 103,520,000 |  |
|  | 1 5 回 公営企業金融公庫債券     | 300,000,000 | 310,269,000 |  |

[前へ](#) [次へ](#)

平成24年5月11日現在

| 種 類 | 銘 柄                       | 券面総額（円）     | 評価額（円）      | 備考 |
|-----|---------------------------|-------------|-------------|----|
|     | 1 7 回 公営企業金融公庫債券          | 100,000,000 | 104,484,000 |    |
|     | 2 0 回 公営企業金融公庫債券          | 200,000,000 | 214,424,000 |    |
|     | 2 4 回 公営企業金融公庫債券          | 300,000,000 | 322,152,000 |    |
|     | 1 9 1 回 政保首都高速道路債券        | 113,000,000 | 117,117,720 |    |
|     | 1 4 2 回 政保阪神高速道路債         | 100,000,000 | 103,227,000 |    |
|     | 1 4 8 回 政保阪神高速道路債         | 107,000,000 | 111,036,040 |    |
|     | 5 回 阪神高速道路・機構承継債          | 100,000,000 | 102,856,000 |    |
|     | 1 7 6 回 政保中小企業債券          | 100,000,000 | 101,951,000 |    |
|     | 1 8 0 回 政保中小企業債券          | 142,000,000 | 147,114,840 |    |
|     | 1 8 6 回 政保中小企業債券          | 104,000,000 | 107,893,760 |    |
|     | 1 5 回 国際協力銀行債券            | 200,000,000 | 206,318,000 |    |
|     | 1 2 回 国際協力銀行債券            | 200,000,000 | 205,048,000 |    |
|     | 2 回 都市再生債券                | 100,000,000 | 103,889,000 |    |
|     | 1 9 回 都市再生機構債券            | 200,000,000 | 217,404,000 |    |
|     | 2 3 回 都市再生機構債券            | 200,000,000 | 203,052,000 |    |
|     | 2 回 本州四国連絡・機構承継債券         | 100,000,000 | 102,557,000 |    |
|     | 6 回 政保中部国際空港債券            | 100,000,000 | 102,335,000 |    |
|     | 1 1 回 住宅金融支援機構債券          | 200,000,000 | 213,310,000 |    |
|     | 3 2 回 住宅金融支援機構債券          | 300,000,000 | 303,726,000 |    |
|     | 3 7 回 住宅金融支援機構債券          | 300,000,000 | 315,804,000 |    |
|     | 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券     | 114,051,000 | 121,708,384 |    |
|     | 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券     | 78,964,000  | 83,802,913  |    |
|     | 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券     | 118,116,000 | 125,582,112 |    |
|     | 2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券   | 135,702,000 | 144,381,499 |    |
|     | 1 3 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券 | 62,101,000  | 65,746,949  |    |
|     | 1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券 | 319,415,000 | 334,427,505 |    |
|     | 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券         | 74,841,000  | 78,107,061  |    |
|     | 4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券       | 56,921,000  | 60,749,506  |    |
|     | 4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券       | 220,632,000 | 235,610,706 |    |
|     | 5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券       | 175,152,000 | 186,032,442 |    |
|     | 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 299,695,000 | 317,344,038 |    |
|     | 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券     | 397,435,000 | 416,182,008 |    |
|     | 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券     | 708,760,000 | 737,833,335 |    |
|     | 1 4 回 政保国民生活債券            | 132,000,000 | 136,177,800 |    |
|     | 7 0 4 号 利附商工債             | 200,000,000 | 203,842,000 |    |
|     | 7 0 6 号 利付商工債             | 300,000,000 | 306,306,000 |    |

|       |                                       |             |                |  |
|-------|---------------------------------------|-------------|----------------|--|
|       | 7 1 4 号 利付商工債                         | 300,000,000 | 305,091,000    |  |
|       | 7 2 3 号 利付商工債                         | 300,000,000 | 302,448,000    |  |
|       | 7 3 2 号 利付商工債                         | 200,000,000 | 202,438,000    |  |
|       | 6 9 8 号 利附農林債                         | 300,000,000 | 304,515,000    |  |
|       | 7 0 1 号 利附農林債                         | 200,000,000 | 203,454,000    |  |
|       | 7 0 9 号 利附農林債                         | 400,000,000 | 407,576,000    |  |
|       | 7 1 3 号 利附農林債                         | 300,000,000 | 303,963,000    |  |
|       | 7 1 7 号 利附農林債                         | 300,000,000 | 304,038,000    |  |
|       | 7 2 1 号 利附農林債                         | 120,000,000 | 121,206,000    |  |
|       | 2 2 6 回 利附信金中金債                       | 300,000,000 | 304,602,000    |  |
|       | 2 2 9 回 利附信金中金債                       | 400,000,000 | 407,560,000    |  |
|       | 2 3 3 回 利附信金中金債                       | 300,000,000 | 306,513,000    |  |
|       | 2 3 6 回 利附信金中金債                       | 300,000,000 | 304,377,000    |  |
|       | 2 4 1 回 利附信金中金債                       | 300,000,000 | 303,561,000    |  |
|       | 2 5 3 回 利附信金中金債                       | 300,000,000 | 303,501,000    |  |
|       | 1 3 9 号 利附商工債（3年）                     | 300,000,000 | 300,477,000    |  |
|       | 1 回 政保東日本高速道路債券                       | 101,000,000 | 106,028,790    |  |
|       | 2 回 政保東日本高速道路債券                       | 101,000,000 | 105,748,010    |  |
|       | 4 回 政保中日本高速道路債券                       | 170,000,000 | 179,103,500    |  |
|       | 8 回 政保中日本高速道路債券                       | 170,000,000 | 182,678,600    |  |
|       | 2 1 回 政保中日本高速道路債券                     | 300,000,000 | 323,121,000    |  |
|       | 5 回 中日本高速道路債券                         | 200,000,000 | 216,180,000    |  |
|       | 1 回 政保西日本高速道路債券                       | 201,000,000 | 211,007,790    |  |
|       | 5 回 政保西日本高速道路債券                       | 259,000,000 | 277,425,260    |  |
|       | 6 回 政保西日本高速道路債券                       | 117,000,000 | 125,450,910    |  |
|       | 2 回 鉄道建設運輸施設債                         | 300,000,000 | 310,611,000    |  |
| 特殊債券計 |                                       |             | 33,624,647,918 |  |
|       |                                       |             |                |  |
| 社債券   | 9 回 G E キャピタル円貨債                      | 100,000,000 | 101,975,000    |  |
|       | 1 2 回 G E キャピタル円貨債                    | 100,000,000 | 102,216,000    |  |
|       | 1 4 回 G E キャピタル円貨債                    | 100,000,000 | 103,553,000    |  |
|       | 2 回 J P モルガン・チェース劣後債                  | 100,000,000 | 101,710,000    |  |
|       | 4 回 ゴールドマン・サックス円貨債                    | 100,000,000 | 101,253,000    |  |
|       | 1 6 回 シティグループ円貨社債                     | 100,000,000 | 100,347,000    |  |
|       | 2 2 回 シティグループ円貨社債                     | 200,000,000 | 204,906,000    |  |
|       | 7 回 ウェストパック銀行円貨社債                     | 100,000,000 | 100,977,000    |  |
|       | 1 回 オーストラリア連邦保証オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債 | 100,000,000 | 102,094,000    |  |
|       | 2 2 回 中日本高速道路債券                       | 300,000,000 | 305,073,000    |  |
|       | 3 2 回 アサヒビール社債                        | 100,000,000 | 101,042,000    |  |
|       | 7 回 キリンホールディングス社債                     | 100,000,000 | 106,562,000    |  |
|       | 5 回 日本たばこ産業社債                         | 100,000,000 | 101,791,000    |  |
|       | 2 5 回 住友化学工業社債                        | 100,000,000 | 101,943,000    |  |
|       | 4 1 回 住友化学社債                          | 100,000,000 | 105,893,000    |  |
|       | 3 4 回 三井化学社債                          | 100,000,000 | 105,208,000    |  |
|       | 2 4 回 新日本石油社債                         | 100,000,000 | 103,579,000    |  |
|       | 2 9 回 新日本製鐵社債                         | 100,000,000 | 113,848,000    |  |

|  |                            |             |             |  |
|--|----------------------------|-------------|-------------|--|
|  | 5 2 回 新日本製鐵社債              | 100,000,000 | 102,617,000 |  |
|  | 6 4 回 新日本製鐵社債              | 100,000,000 | 105,626,000 |  |
|  | 1 3 回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債 | 100,000,000 | 101,452,000 |  |
|  | 1 5 回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債 | 100,000,000 | 100,872,000 |  |
|  | 2 5 回 富士通社債                | 100,000,000 | 103,360,000 |  |
|  | 7 回 パナソニック社債               | 200,000,000 | 204,100,000 |  |
|  | 1 0 回 パナソニック社債             | 200,000,000 | 202,008,000 |  |
|  | 1 1 回 パナソニック社債             | 100,000,000 | 102,011,000 |  |
|  | 2 4 回 シャープ社債               | 200,000,000 | 198,318,000 |  |
|  | 1 7 回 ソニー社債                | 100,000,000 | 103,224,000 |  |
|  | 3 回 パナソニック電工社債             | 100,000,000 | 103,810,000 |  |
|  | 1 9 回 三菱重工業社債              | 100,000,000 | 107,066,000 |  |
|  | 4 9 回 日産自動車社債              | 100,000,000 | 103,641,000 |  |
|  | 5 1 回 日産自動車社債              | 100,000,000 | 101,215,000 |  |
|  | 7 回 トヨタ自動車社債               | 300,000,000 | 305,265,000 |  |
|  | 9 回 トヨタ自動車社債               | 200,000,000 | 203,474,000 |  |
|  | 4 9 回 伊藤忠商事社債              | 100,000,000 | 109,754,000 |  |
|  | 5 8 回 伊藤忠商事社債              | 100,000,000 | 100,910,000 |  |
|  | 7 7 回 丸紅社債                 | 100,000,000 | 101,143,000 |  |
|  | 3 0 回 住友商事社債               | 100,000,000 | 105,123,000 |  |
|  | 1 6 回 三菱商事社債               | 100,000,000 | 104,671,000 |  |
|  | 6 9 回 三菱商事社債               | 300,000,000 | 325,254,000 |  |
|  | 1 回 みずほコーポレート銀行劣後社債        | 200,000,000 | 205,206,000 |  |
|  | 7 回 みずほコーポレート銀行社債          | 100,000,000 | 107,972,000 |  |
|  | 1 3 回 みずほコーポレート銀行社債        | 200,000,000 | 202,608,000 |  |
|  | 1 4 回 みずほコーポレート銀行社債        | 100,000,000 | 101,932,000 |  |
|  | 1 5 回 みずほコーポレート銀行社債        | 200,000,000 | 203,692,000 |  |
|  | 1 8 回 みずほコーポレート銀行社債        | 200,000,000 | 202,566,000 |  |
|  | 2 0 回 みずほコーポレート銀行社債        | 200,000,000 | 202,344,000 |  |
|  | 2 4 回 みずほコーポレート銀行社債        | 200,000,000 | 201,850,000 |  |
|  | 1 0 0 回 三菱東京ＵＦＪ銀行社債        | 200,000,000 | 202,696,000 |  |
|  | 1 0 6 回 三菱東京ＵＦＪ銀行社債        | 300,000,000 | 304,398,000 |  |
|  | 1 1 2 回 三菱東京ＵＦＪ銀行社債        | 200,000,000 | 202,288,000 |  |
|  | 1 1 4 回 三菱東京ＵＦＪ銀行社債        | 200,000,000 | 202,510,000 |  |
|  | 6 回 東京三菱銀行劣後社債             | 100,000,000 | 103,336,000 |  |
|  | 8 回 東京三菱銀行劣後社債             | 200,000,000 | 207,302,000 |  |
|  | 1 2 回 三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債        | 200,000,000 | 215,248,000 |  |
|  | 2 8 回 三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債        | 200,000,000 | 206,804,000 |  |
|  | 1 1 回 三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債        | 200,000,000 | 214,780,000 |  |
|  | 4 回 りそな銀行劣後社債              | 100,000,000 | 110,253,000 |  |
|  | 6 回 りそな銀行劣後社債              | 100,000,000 | 105,409,000 |  |
|  | 4 回 住友信託銀行劣後社債             | 100,000,000 | 103,077,000 |  |
|  | 7 回 住友信託銀行劣後社債             | 100,000,000 | 105,577,000 |  |
|  | 5 回 住友信託銀行劣後債              | 100,000,000 | 106,011,000 |  |
|  | 4 5 回 三井住友銀行社債             | 200,000,000 | 203,364,000 |  |
|  | 4 7 回 三井住友銀行社債             | 200,000,000 | 202,940,000 |  |

|  |                     |             |             |  |
|--|---------------------|-------------|-------------|--|
|  | 5 0 回 三井住友銀行社債      | 200,000,000 | 201,530,000 |  |
|  | 5 1 回 三井住友銀行社債      | 200,000,000 | 200,530,000 |  |
|  | 6 回 三井住友銀行劣後社債      | 100,000,000 | 101,591,000 |  |
|  | 7 回 三井住友銀行劣後社債      | 100,000,000 | 102,739,000 |  |
|  | 8 回 三井住友銀行劣後社債      | 100,000,000 | 103,625,000 |  |
|  | 9 回 三井住友銀行劣後社債      | 100,000,000 | 103,995,000 |  |
|  | 1 1 回 三井住友銀行劣後社債    | 200,000,000 | 215,654,000 |  |
|  | 2 0 回 三井住友銀行劣後社債    | 200,000,000 | 217,564,000 |  |
|  | 1 回 みずほ銀行劣後特約付社債    | 100,000,000 | 102,880,000 |  |
|  | 6 回 みずほ銀行劣後特約付社債    | 100,000,000 | 106,460,000 |  |
|  | 1 0 回 みずほ銀行劣後特約付社債  | 100,000,000 | 106,282,000 |  |
|  | 1 4 回 みずほ銀行劣後特約付社債  | 100,000,000 | 106,950,000 |  |
|  | 3 8 回 N T Tファイナンス社債 | 200,000,000 | 201,490,000 |  |
|  | 1 7 回 ホンダファイナンス社債   | 100,000,000 | 100,338,000 |  |
|  | 1 9 回 トヨタファイナンス社債   | 100,000,000 | 106,586,000 |  |
|  | 2 3 回 トヨタファイナンス社債   | 300,000,000 | 320,811,000 |  |
|  | 4 0 回 トヨタファイナンス社債   | 100,000,000 | 102,566,000 |  |
|  | 1 1 8 回 オリックス社債     | 100,000,000 | 103,135,000 |  |
|  | 1 4 4 回 オリックス社債     | 100,000,000 | 101,293,000 |  |
|  | 1 4 8 回 オリックス社債     | 200,000,000 | 201,778,000 |  |
|  | 1 2 回 三菱ＵＦＪリース社債    | 100,000,000 | 100,773,000 |  |
|  | 8 回 野村ホールディングス社債    | 100,000,000 | 105,285,000 |  |
|  | 1 5 回 野村ホールディングス社債  | 100,000,000 | 102,637,000 |  |
|  | 1 7 回 野村ホールディングス社債  | 200,000,000 | 202,506,000 |  |
|  | 2 0 回 野村ホールディングス社債  | 100,000,000 | 100,464,000 |  |
|  | 2 2 回 野村ホールディングス社債  | 200,000,000 | 200,542,000 |  |
|  | 2 4 回 三井不動産社債       | 100,000,000 | 104,734,000 |  |
|  | 3 1 回 三井不動産社債       | 100,000,000 | 103,202,000 |  |
|  | 7 9 回 三菱地所社債        | 200,000,000 | 213,426,000 |  |
|  | 9 0 回 三菱地所社債        | 100,000,000 | 106,599,000 |  |
|  | 7 3 回 住友不動産社債       | 100,000,000 | 100,879,000 |  |
|  | 4 1 回 小田急電鉄社債       | 100,000,000 | 107,787,000 |  |
|  | 2 回 東日本旅客鉄道社債       | 200,000,000 | 225,774,000 |  |
|  | 3 回 東日本旅客鉄道社債       | 200,000,000 | 227,462,000 |  |
|  | 7 回 東日本旅客鉄道社債       | 100,000,000 | 114,982,000 |  |
|  | 1 9 回 東日本旅客鉄道社債     | 100,000,000 | 112,627,000 |  |
|  | 3 1 回 東日本旅客鉄道社債     | 200,000,000 | 204,872,000 |  |
|  | 4 1 回 東日本旅客鉄道社債     | 100,000,000 | 104,255,000 |  |
|  | 5 6 回 東日本旅客鉄道社債     | 300,000,000 | 321,705,000 |  |
|  | 3 回 西日本旅客鉄道社債       | 100,000,000 | 114,038,000 |  |
|  | 1 0 回 西日本旅客鉄道社債     | 100,000,000 | 109,164,000 |  |
|  | 1 回 東海旅客鉄道社債        | 100,000,000 | 107,812,000 |  |
|  | 2 回 東海旅客鉄道社債        | 200,000,000 | 228,494,000 |  |
|  | 6 回 東海旅客鉄道社債        | 100,000,000 | 112,914,000 |  |
|  | 1 0 回 東海旅客鉄道社債      | 190,000,000 | 199,908,500 |  |
|  | 2 3 回 東海旅客鉄道社債      | 100,000,000 | 109,607,000 |  |
|  | 3 回 東京地下鉄社債         | 100,000,000 | 106,728,000 |  |
|  | 4 8 回 日本電信電話社債      | 400,000,000 | 412,756,000 |  |

|  |                   |             |             |  |
|--|-------------------|-------------|-------------|--|
|  | 5 0 回 日本電信電話社債    | 100,000,000 | 104,356,000 |  |
|  | 5 1 回 日本電信電話社債    | 200,000,000 | 214,156,000 |  |
|  | 5 8 回 日本電信電話社債    | 100,000,000 | 101,584,000 |  |
|  | 6 0 回 日本電信電話社債    | 300,000,000 | 312,045,000 |  |
|  | 5 回 K D D I 社債    | 100,000,000 | 113,463,000 |  |
|  | 1 5 回 N T T ドコモ社債 | 200,000,000 | 217,146,000 |  |
|  | 1 6 回 N T T ドコモ社債 | 200,000,000 | 203,324,000 |  |
|  | 4 5 5 回 東京電力社債    | 200,000,000 | 155,628,000 |  |
|  | 5 1 1 回 東京電力社債    | 100,000,000 | 91,479,000  |  |
|  | 5 1 6 回 東京電力社債    | 100,000,000 | 87,188,000  |  |
|  | 5 1 9 回 東京電力社債    | 372,000,000 | 316,456,680 |  |
|  | 5 4 2 回 東京電力社債    | 500,000,000 | 385,855,000 |  |
|  | 4 0 7 回 中部電力社債    | 100,000,000 | 108,848,000 |  |
|  | 4 0 9 回 中部電力社債    | 300,000,000 | 339,258,000 |  |
|  | 4 6 7 回 中部電力社債    | 100,000,000 | 102,667,000 |  |
|  | 4 6 8 回 中部電力社債    | 100,000,000 | 102,519,000 |  |
|  | 4 7 1 回 中部電力社債    | 300,000,000 | 306,807,000 |  |
|  | 4 7 6 回 中部電力社債    | 100,000,000 | 107,415,000 |  |
|  | 4 7 8 回 中部電力社債    | 100,000,000 | 105,136,000 |  |
|  | 4 8 0 回 中部電力社債    | 200,000,000 | 209,890,000 |  |
|  | 4 8 4 回 中部電力社債    | 200,000,000 | 204,248,000 |  |
|  | 4 8 7 回 中部電力社債    | 140,000,000 | 141,463,000 |  |
|  | 4 9 6 回 中部電力社債    | 500,000,000 | 503,660,000 |  |
|  | 4 1 0 回 関西電力社債    | 300,000,000 | 318,609,000 |  |
|  | 4 3 3 回 関西電力社債    | 200,000,000 | 203,556,000 |  |
|  | 4 4 1 回 関西電力社債    | 200,000,000 | 204,910,000 |  |
|  | 4 4 6 回 関西電力社債    | 200,000,000 | 208,340,000 |  |
|  | 2 9 8 回 中国電力社債    | 200,000,000 | 221,270,000 |  |
|  | 3 1 0 回 中国電力社債    | 200,000,000 | 225,210,000 |  |
|  | 3 4 1 回 中国電力社債    | 100,000,000 | 102,152,000 |  |
|  | 3 5 0 回 中国電力社債    | 200,000,000 | 205,064,000 |  |
|  | 2 4 5 回 北陸電力社債    | 200,000,000 | 219,988,000 |  |
|  | 2 6 0 回 北陸電力社債    | 100,000,000 | 109,285,000 |  |
|  | 2 8 1 回 北陸電力社債    | 200,000,000 | 212,934,000 |  |
|  | 2 8 9 回 北陸電力社債    | 300,000,000 | 306,831,000 |  |
|  | 3 6 8 回 東北電力社債    | 300,000,000 | 324,297,000 |  |
|  | 3 7 5 回 東北電力社債    | 100,000,000 | 109,435,000 |  |
|  | 3 8 0 回 東北電力社債    | 300,000,000 | 336,747,000 |  |
|  | 4 2 0 回 東北電力社債    | 100,000,000 | 101,303,000 |  |
|  | 4 2 7 回 東北電力社債    | 200,000,000 | 204,948,000 |  |
|  | 4 3 2 回 東北電力社債    | 500,000,000 | 526,470,000 |  |
|  | 2 3 7 回 四国電力社債    | 100,000,000 | 107,101,000 |  |
|  | 2 5 7 回 四国電力社債    | 200,000,000 | 204,706,000 |  |
|  | 3 7 4 回 九州電力社債    | 300,000,000 | 304,032,000 |  |
|  | 3 8 2 回 九州電力社債    | 100,000,000 | 102,490,000 |  |
|  | 3 8 3 回 九州電力社債    | 100,000,000 | 102,633,000 |  |
|  | 3 8 7 回 九州電力社債    | 200,000,000 | 208,094,000 |  |
|  | 2 5 7 回 北海道電力社債   | 200,000,000 | 224,858,000 |  |

|      |                 |             |                 |  |
|------|-----------------|-------------|-----------------|--|
|      | 2 8 2 回 北海道電力社債 | 200,000,000 | 202,944,000     |  |
|      | 2 8 4 回 北海道電力社債 | 500,000,000 | 515,735,000     |  |
|      | 2 8 6 回 北海道電力社債 | 100,000,000 | 102,410,000     |  |
|      | 4 回 電源開発社債      | 200,000,000 | 202,446,000     |  |
|      | 6 回 電源開発社債      | 100,000,000 | 102,248,000     |  |
|      | 1 4 回 電源開発社債    | 100,000,000 | 103,083,000     |  |
|      | 1 7 回 電源開発社債    | 100,000,000 | 105,427,000     |  |
|      | 1 4 回 東京ガス社債    | 100,000,000 | 110,638,000     |  |
|      | 2 4 回 東京瓦斯社債    | 200,000,000 | 203,622,000     |  |
|      | 9 回 大阪ガス社債      | 100,000,000 | 113,733,000     |  |
|      | 2 4 回 大阪瓦斯社債    | 100,000,000 | 103,269,000     |  |
|      | 2 7 回 大阪瓦斯社債    | 100,000,000 | 101,469,000     |  |
| 社債券計 |                 |             | 28,649,655,180  |  |
|      |                 |             |                 |  |
| 合計   |                 |             | 417,485,095,410 |  |

## 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。

[前へ](#) [次へ](#)

## 「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

| 科目          | 注記<br>番号 | 平成23年11月11日現在   | 平成24年5月11日現在    |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
|             |          | 金額<br>(円)       | 金額<br>(円)       |
| 資産の部        |          |                 |                 |
| 流動資産        |          |                 |                 |
| 預金          |          | 2,871,664,871   | 5,478,729,845   |
| コール・ローン     |          | 170,775,621     | 328,058,930     |
| 国債証券        |          | 357,920,231,801 | 363,175,919,345 |
| 派生商品評価勘定    |          | 1,444,094       | 8,954           |
| 未収利息        |          | 4,571,127,430   | 4,354,518,544   |
| 前払費用        |          | 210,204,457     | 133,713,726     |
| 流動資産合計      |          | 365,745,448,274 | 373,470,949,344 |
| 資産合計        |          | 365,745,448,274 | 373,470,949,344 |
| 負債の部        |          |                 |                 |
| 流動負債        |          |                 |                 |
| 派生商品評価勘定    |          | 75,348          | 257,292         |
| 未払金         |          | -               | 2,237,600,705   |
| 未払解約金       |          | 167,217,000     | 261,242,000     |
| 流動負債合計      |          | 167,292,348     | 2,499,099,997   |
| 負債合計        |          | 167,292,348     | 2,499,099,997   |
| 純資産の部       |          |                 |                 |
| 元本等         |          |                 |                 |
| 元本          |          | 321,714,165,896 | 311,387,405,319 |
| 剰余金         |          |                 |                 |
| 剰余金又は欠損金（ ） |          | 43,863,990,030  | 59,584,444,028  |
| 元本等合計       |          | 365,578,155,926 | 370,971,849,347 |
| 純資産合計       |          | 365,578,155,926 | 370,971,849,347 |
| 負債純資産合計     |          | 365,745,448,274 | 373,470,949,344 |

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                           |                                                                                                                                                                                                                                                              |
|---------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1．有価証券の評価基準及び評価方法         | <p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>                                                                                                                  |
| 2．デリバティブ等の評価基準及び評価方法      | <p>為替予約取引</p> <p>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によって計算しております。</p>                                                                                                                                                                                           |
| 3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>(1)外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「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条及び同第61条にしたがって換算しております。</p> <p>(2)計算期間の取扱い</p> <p>当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年2月22日から平成24年2月21日まで及び平成24年2月22日から平成25年2月21日までとなっております。</p> |

## （貸借対照表に関する注記）

| 区分                             | 平成23年11月11日現在    | 平成24年5月11日現在     |
|--------------------------------|------------------|------------------|
| *1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における |                  |                  |
| 当該親投資信託の元本額                    | 334,116,315,089円 | 321,714,165,896円 |
| 同期中追加設定元本額                     | 18,571,516,995円  | 12,500,469,133円  |
| 同期中解約元本額                       | 30,973,666,188円  | 22,827,229,710円  |
| 同期末における元本の内訳                   |                  |                  |
| D I A M外国債券パッシブ・ファンド           | 2,096,124,741円   | 1,978,249,579円   |
| D I A M外国債券インデックスファンド< D C年金>  | 3,874,193,425円   | 4,041,557,800円   |
| D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型 | 324,215,560円     | 336,794,400円     |

|                                                  |                 |                 |
|--------------------------------------------------|-----------------|-----------------|
| D I A Mバランス・ファンド＜<br>D C 年金＞ 2 安定・成長型            | 1,142,218,404円  | 1,178,691,773円  |
| D I A Mバランス・ファンド＜<br>D C 年金＞ 3 成長型               | 1,189,846,561円  | 1,214,376,516円  |
| D I A M D C バランス 3 0 イ<br>ンデックスファンド              | 339,634,869円    | 328,530,599円    |
| D I A M D C バランス 5 0 イ<br>ンデックスファンド              | 670,636,125円    | 657,766,156円    |
| D I A M D C バランス 7 0 イ<br>ンデックスファンド              | 415,561,026円    | 420,014,419円    |
| マネックス資産設計ファンド＜<br>隔月分配型＞                         | 167,928,414円    | 133,733,796円    |
| マネックス資産設計ファンド＜<br>育成型＞                           | 1,752,895,046円  | 1,525,083,478円  |
| マネックス資産設計ファンド エ<br>ボリューション                       | 16,351,670円     | 9,444,741円      |
| D I A Mパッシブ資産分散ファ<br>ンド                          | 6,460,377,165円  | 5,369,825,138円  |
| D I A M為替フルヘッジ型外国<br>債券パッシブ私募ファンド（適<br>格機関投資家向け） | 7,897,336,008円  | 7,830,625,631円  |
| D I A M外国債券パッシブファ<br>ンド（適格機関投資家向け）               | 7,446,838,701円  | 6,635,291,735円  |
| 外国債券パッシブファンド（適<br>格機関投資家限定）                      | 946,676,260円    | 945,973,519円    |
| D I A Mワールドバランス 2 5<br>V A（適格機関投資家限定）            | 240,498,150円    | 225,348,212円    |
| D I A Mグローバル・バランス<br>ファンド 2 5 V A（適格機関投<br>資家限定） | 47,028,947,296円 | 44,938,406,388円 |
| D I A Mグローバル・バランス<br>ファンド 5 0 V A（適格機関投<br>資家限定） | 2,571,344,283円  | 2,528,400,416円  |
| D I A M国際分散バランスファ<br>ンド 3 0 V A（適格機関投資家<br>限定）   | 446,376,685円    | 438,118,101円    |
| D I A M国際分散バランスファ<br>ンド 5 0 V A（適格機関投資家<br>限定）   | 734,628,891円    | 721,668,872円    |
| D I A M国内重視バランスファ<br>ンド 3 0 V A（適格機関投資家<br>限定）   | 198,574,188円    | 193,891,256円    |
| D I A M国内重視バランスファ<br>ンド 5 0 V A（適格機関投資家<br>限定）   | 88,107,174円     | 87,689,999円     |
| D I A M世界バランスファンド<br>4 0 V A（適格機関投資家限<br>定）      | 27,471,479,284円 | 26,930,642,275円 |
| D I A M世界バランスファンド<br>5 0 V A（適格機関投資家限<br>定）      | 6,072,780,655円  | 5,963,816,143円  |

|                                                       |                 |                 |
|-------------------------------------------------------|-----------------|-----------------|
| D I A Mバランスファンド 2 5<br>V A（適格機関投資家限定）                 | 11,096,046,838円 | 10,697,828,273円 |
| D I A Mバランスファンド 3<br>7 . 5 V A（適格機関投資家限<br>定）         | 5,125,191,027円  | 4,868,127,219円  |
| D I A Mバランスファンド 5 0<br>V A（適格機関投資家限定）                 | 7,268,138,307円  | 6,973,825,581円  |
| D I A Mグローバル・アセット<br>・バランス V A（適格機関投資<br>家限定）         | 2,777,830,025円  | 2,665,760,715円  |
| D I A Mグローバル・アセット<br>・バランス V A 2（適格機関投<br>資家限定）       | 8,474,121,378円  | 8,124,341,725円  |
| D I A M アクサ グローバル バ<br>ランスファンド 3 0 V A（適格<br>機関投資家限定） | 9,930,618,651円  | 9,439,303,036円  |
| D I A M世界アセットバランス<br>ファンド V A（適格機関投資家<br>向け）          | 49,888,733,703円 | 49,010,145,912円 |
| D I A Mグローバルβ 私募ファ<br>ンド（適格機関投資家向け）                   | 267,315,107円    | 217,953,314円    |
| D I A M世界バランスファンド<br>5 5 V A（適格機関投資家限<br>定）           | 6,711,196,194円  | 6,467,454,654円  |
| D I A Mアイエヌジー世界バラ<br>ンスファンド 3 5 V A（適格機<br>関投資家限定）    | 15,061,844,607円 | 14,927,905,103円 |
| D I A Mグローバル分散ファン<br>ド V A（適格機関投資家限定）                 | 290,931,174円    | 277,669,789円    |
| D I A M世界アセットバランス<br>ファンド 2 V A（適格機関投資<br>家限定）        | 25,405,826,761円 | 24,773,062,311円 |
| D I A M世界アセットバランス<br>ファンド 3 V A（適格機関投資<br>家限定）        | 31,031,207,133円 | 30,241,028,832円 |
| D I A Mバランス 3 0 V A（適<br>格機関投資家限定）                    | 813,519,355円    | 767,562,499円    |
| D I A Mバランス 5 0 V A（適<br>格機関投資家限定）                    | 230,952円        | 232,859円        |
| D I A Mバランス 7 0 V A（適<br>格機関投資家限定）                    | 142,391円        | 144,195円        |
| D I A M世界アセットバランス<br>ファンド 4 V A（適格機関投資<br>家限定）        | 27,133,367,705円 | 26,446,024,205円 |
| D I A M世界バランス 2 5 V A<br>（適格機関投資家限定）                  | 226,991,467円    | 265,352,472円    |
| D I A Mバランス 2 0 V A（適<br>格機関投資家限定）                    | 616,993,225円    | 589,391,864円    |
| D I A Mバランス 4 0 V A（適<br>格機関投資家限定）                    | 217,901円        | 217,413円        |

|                                          |                              |                              |
|------------------------------------------|------------------------------|------------------------------|
| D I A Mバランス 6 0 V A（適格機関投資家限定）<br>（合 計）  | 131,414円<br>321,714,165,896円 | 132,406円<br>311,387,405,319円 |
| *2 本有価証券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受益権の総数 | 321,714,165,896口             | 311,387,405,319口             |

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

| 区分                       | 自平成23年5月12日<br>至平成23年11月11日                                                                                                                                                                                                                                                 | 自平成23年11月12日<br>至平成24年5月11日 |
|--------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。                                                                                                                                                                                                 | 同左                          |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。<br>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。 | 同左                          |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | 運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。                                                                                                                                                              | 同左                          |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                         | 平成23年11月11日現在                                                                                                                                                                                              | 平成24年5月11日現在                                                       |
|----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。                                                                                                                                                     | 同左                                                                 |
| 2. 時価の算定方法                 | (1)国債証券<br>「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。<br>(2)派生商品評価勘定<br>「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。<br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。                   | (1)国債証券<br>同左<br>(2)派生商品評価勘定<br>同左<br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>同左 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左                                                                 |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

|      | 平成23年11月11日現在     | 平成24年5月11日現在      |
|------|-------------------|-------------------|
| 種 類  | 当期の損益に含まれた評価差額(円) | 当期の損益に含まれた評価差額(円) |
| 国債証券 | 13,180,194,944    | 2,055,492,618     |
| 合計   | 13,180,194,944    | 2,055,492,618     |

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの特定期間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）

## （通貨関連）

| 平成23年11月11日現在 |              |             |       |             |           |
|---------------|--------------|-------------|-------|-------------|-----------|
| 区分            | 種 類          | 契約額等（円）     |       | 時価（円）       | 評価損益（円）   |
|               |              |             | うち1年超 |             |           |
| 市場取引以外の取引     | 為替予約取引<br>売建 |             |       |             |           |
|               | マレーシアリングット   | 99,877,600  | -     | 98,440,000  | 1,437,600 |
|               | ユーロ          | 67,808,692  | -     | 67,884,040  | 75,348    |
|               | 米ドル          | 57,260,534  | -     | 57,254,040  | 6,494     |
| 合 計           |              | 224,946,826 | -     | 223,578,080 | 1,368,746 |

| 平成24年5月11日現在 |              |             |       |             |         |
|--------------|--------------|-------------|-------|-------------|---------|
| 区分           | 種 類          | 契約額等（円）     |       | 時価（円）       | 評価損益（円） |
|              |              |             | うち1年超 |             |         |
| 市場取引以外の取引    | 為替予約取引<br>売建 |             |       |             |         |
|              | ユーロ          | 105,334,528 | -     | 105,591,820 | 257,292 |
|              | 米ドル          | 85,214,334  | -     | 85,205,380  | 8,954   |
| 合 計          |              | 190,548,862 | -     | 190,797,200 | 248,338 |

## （注）時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

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

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

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

2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## （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口当たり情報に関する注記）

|              | 平成23年11月11日現在 | 平成24年5月11日現在 |
|--------------|---------------|--------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.1363円       | 1.1914円      |
| （1万口当たり純資産額） | （11,363円）     | （11,914円）    |

[前へ](#) [次へ](#)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成24年5月11日現在

| 種 類  | 銘 柄                     | 券面総額          | 評価額            | 備考 |
|------|-------------------------|---------------|----------------|----|
| 国債証券 | US T N/B 3.625 05/15/13 | 29,000,000.00 | 29,997,890.000 |    |
|      | US T N/B 3.5 05/31/13   | 32,000,000.00 | 33,107,200.000 |    |
|      | US T N/B 1.0 07/15/13   | 40,000,000.00 | 40,360,800.000 |    |
|      | US T N/B 4.25 08/15/13  | 35,000,000.00 | 36,768,900.000 |    |
|      | US T N/B 0.125 08/31/13 | 35,000,000.00 | 34,949,250.000 |    |
|      | US T N/B 0.5 10/15/13   | 30,000,000.00 | 30,108,900.000 |    |
|      | US T N/B 4.25 11/15/13  | 40,000,000.00 | 42,407,600.000 |    |
|      | US T N/B 0.75 12/15/13  | 25,000,000.00 | 25,196,250.000 |    |
|      | US T N/B 4.0 02/15/14   | 40,000,000.00 | 42,623,200.000 |    |
|      | US T N/B 1.75 03/31/14  | 25,000,000.00 | 25,702,000.000 |    |
|      | US T N/B 4.75 05/15/14  | 35,000,000.00 | 38,133,550.000 |    |
|      | US T N/B 2.625 06/30/14 | 30,000,000.00 | 31,498,800.000 |    |
|      | US T N/B 0.75 06/15/14  | 20,000,000.00 | 20,193,600.000 |    |
|      | US T N/B 4.25 08/15/14  | 28,000,000.00 | 30,483,880.000 |    |
|      | US T N/B 2.375 09/30/14 | 28,000,000.00 | 29,375,920.000 |    |
|      | US T N/B 0.25 09/15/14  | 20,000,000.00 | 19,971,800.000 |    |
|      | US T N/B 4.25 11/15/14  | 30,000,000.00 | 32,928,300.000 |    |
|      | US T N/B 2.125 11/30/14 | 25,000,000.00 | 26,131,750.000 |    |
|      | US T N/B 2.625 12/31/14 | 16,000,000.00 | 16,956,160.000 |    |
|      | US T N/B 2.25 01/31/15  | 25,000,000.00 | 26,282,000.000 |    |
|      | US T N/B 4.0 02/15/15   | 20,000,000.00 | 21,991,400.000 |    |
|      | US T N/B 2.375 02/28/15 | 23,000,000.00 | 24,279,260.000 |    |
|      | US T N/B 2.5 03/31/15   | 20,000,000.00 | 21,214,000.000 |    |
|      | US T N/B 2.5 04/30/15   | 20,000,000.00 | 21,246,000.000 |    |
|      | US T N/B 4.125 05/15/15 | 18,000,000.00 | 20,003,760.000 |    |
|      | US T N/B 1.875 06/30/15 | 15,000,000.00 | 15,681,300.000 |    |
|      | US T N/B 1.75 07/31/15  | 8,000,000.00  | 8,338,400.000  |    |
|      | US T N/B 4.25 08/15/15  | 15,000,000.00 | 16,853,850.000 |    |
|      | US T N/B 1.25 08/31/15  | 15,000,000.00 | 15,405,450.000 |    |
|      | US T N/B 1.25 09/30/15  | 13,000,000.00 | 13,347,750.000 |    |
|      | US T N/B 4.5 11/15/15   | 18,000,000.00 | 20,504,520.000 |    |
|      | US T N/B 1.375 11/30/15 | 15,000,000.00 | 15,465,150.000 |    |
|      | US T N/B 4.5 02/15/16   | 16,000,000.00 | 18,356,160.000 |    |
|      | US T N/B 2.375 03/31/16 | 20,000,000.00 | 21,390,600.000 |    |
|      | US T N/B 2.0 04/30/16   | 15,000,000.00 | 15,840,750.000 |    |
|      | US T N/B 7.25 05/15/16  | 10,000,000.00 | 12,639,000.000 |    |
|      | US T N/B 1.75 05/31/16  | 20,000,000.00 | 20,932,800.000 |    |

|  |                         |               |                |  |
|--|-------------------------|---------------|----------------|--|
|  | US T N/B 3.25 06/30/16  | 25,000,000.00 | 27,683,500.000 |  |
|  | US T N/B 4.875 08/15/16 | 17,000,000.00 | 20,037,390.000 |  |
|  | US T N/B 1.0 08/31/16   | 20,000,000.00 | 20,309,200.000 |  |
|  | US T N/B 3.0 09/30/16   | 20,000,000.00 | 22,012,400.000 |  |
|  | US T N/B 1.0 10/31/16   | 15,000,000.00 | 15,216,750.000 |  |
|  | US T N/B 7.5 11/15/16   | 14,000,000.00 | 18,230,520.000 |  |
|  | US T N/B 2.75 11/30/16  | 20,000,000.00 | 21,831,200.000 |  |
|  | US T N/B 3.25 12/31/16  | 20,000,000.00 | 22,306,200.000 |  |
|  | US T N/B 4.625 02/15/17 | 22,000,000.00 | 25,996,080.000 |  |
|  | US T N/B 3.0 02/28/17   | 20,000,000.00 | 22,113,200.000 |  |
|  | US T N/B 3.25 03/31/17  | 7,000,000.00  | 7,830,410.000  |  |
|  | US T N/B 3.125 04/30/17 | 10,000,000.00 | 11,134,700.000 |  |
|  | US T N/B 8.75 05/15/17  | 7,000,000.00  | 9,749,670.000  |  |
|  | US T N/B 2.5 06/30/17   | 18,000,000.00 | 19,508,760.000 |  |
|  | US T N/B 4.75 08/15/17  | 15,000,000.00 | 18,019,200.000 |  |
|  | US T N/B 1.875 08/31/17 | 8,000,000.00  | 8,414,960.000  |  |
|  | US T N/B 1.875 09/30/17 | 8,000,000.00  | 8,411,520.000  |  |
|  | US T N/B 4.25 11/15/17  | 14,000,000.00 | 16,512,300.000 |  |
|  | US T N/B 2.25 11/30/17  | 19,000,000.00 | 20,373,700.000 |  |
|  | US T N/B 3.5 02/15/18   | 14,000,000.00 | 15,982,960.000 |  |
|  | US T N/B 2.875 03/31/18 | 10,000,000.00 | 11,085,100.000 |  |
|  | US T N/B 3.875 05/15/18 | 8,000,000.00  | 9,339,360.000  |  |
|  | US T N/B 2.375 06/30/18 | 16,000,000.00 | 17,258,080.000 |  |
|  | US T N/B 4.0 08/15/18   | 12,000,000.00 | 14,151,480.000 |  |
|  | US T N/B 1.375 09/30/18 | 12,000,000.00 | 12,192,120.000 |  |
|  | US T N/B 3.75 11/15/18  | 20,000,000.00 | 23,328,800.000 |  |
|  | US T N/B 1.375 11/30/18 | 15,000,000.00 | 15,209,700.000 |  |
|  | US T N/B 8.875 02/15/19 | 4,000,000.00  | 6,020,920.000  |  |
|  | US T N/B 2.75 02/15/19  | 11,000,000.00 | 12,119,690.000 |  |
|  | US T N/B 1.375 02/28/19 | 10,000,000.00 | 10,104,600.000 |  |
|  | US T N/B 3.125 05/15/19 | 13,000,000.00 | 14,652,300.000 |  |
|  | US T N/B 8.125 08/15/19 | 4,000,000.00  | 5,910,920.000  |  |
|  | US T N/B 3.625 08/15/19 | 9,000,000.00  | 10,455,390.000 |  |
|  | US T N/B 3.375 11/15/19 | 14,000,000.00 | 16,014,600.000 |  |
|  | US T N/B 3.625 02/15/20 | 20,000,000.00 | 23,248,400.000 |  |
|  | US T N/B 3.5 05/15/20   | 16,000,000.00 | 18,457,440.000 |  |
|  | US T N/B 8.75 08/15/20  | 4,000,000.00  | 6,268,880.000  |  |
|  | US T N/B 2.625 08/15/20 | 17,000,000.00 | 18,426,300.000 |  |
|  | US T N/B 2.625 11/15/20 | 21,000,000.00 | 22,721,790.000 |  |
|  | US T N/B 3.625 02/15/21 | 19,000,000.00 | 22,103,650.000 |  |
|  | US T N/B 3.125 05/15/21 | 18,000,000.00 | 20,161,980.000 |  |
|  | US T N/B 2.125 08/15/21 | 20,000,000.00 | 20,620,200.000 |  |
|  | US T N/B 8.0 11/15/21   | 6,000,000.00  | 9,325,740.000  |  |
|  | US T N/B 2.0 11/15/21   | 19,000,000.00 | 19,310,840.000 |  |
|  | US T N/B 2.0 02/15/22   | 15,000,000.00 | 15,199,200.000 |  |
|  | US T N/B 7.25 08/15/22  | 3,000,000.00  | 4,522,500.000  |  |
|  | US T N/B 7.125 02/15/23 | 3,000,000.00  | 4,520,610.000  |  |
|  | US T N/B 6.25 08/15/23  | 7,000,000.00  | 9,993,550.000  |  |

|       |                           |                  |                   |  |
|-------|---------------------------|------------------|-------------------|--|
|       | US T N/B 7.5 11/15/24     | 2,000,000.00     | 3,176,940.000     |  |
|       | US T N/B 6.875 08/15/25   | 2,500,000.00     | 3,829,875.000     |  |
|       | US T N/B 6.0 02/15/26     | 4,000,000.00     | 5,737,480.000     |  |
|       | US T N/B 6.5 11/15/26     | 3,000,000.00     | 4,524,120.000     |  |
|       | US T N/B 6.625 02/15/27   | 1,000,000.00     | 1,528,430.000     |  |
|       | US T N/B 6.375 08/15/27   | 2,000,000.00     | 3,008,280.000     |  |
|       | US T N/B 6.125 11/15/27   | 6,000,000.00     | 8,854,680.000     |  |
|       | US T N/B 5.5 08/15/28     | 3,000,000.00     | 4,203,750.000     |  |
|       | US T N/B 5.25 11/15/28    | 3,000,000.00     | 4,106,700.000     |  |
|       | US T N/B 5.25 02/15/29    | 3,000,000.00     | 4,115,130.000     |  |
|       | US T N/B 6.125 08/15/29   | 1,000,000.00     | 1,503,120.000     |  |
|       | US T N/B 6.25 05/15/30    | 4,000,000.00     | 6,133,720.000     |  |
|       | US T N/B 5.375 02/15/31   | 5,000,000.00     | 7,058,950.000     |  |
|       | US T N/B 4.5 02/15/36     | 6,000,000.00     | 7,704,840.000     |  |
|       | US T N/B 4.75 02/15/37    | 2,500,000.00     | 3,330,175.000     |  |
|       | US T N/B 5.0 05/15/37     | 4,000,000.00     | 5,517,800.000     |  |
|       | US T N/B 4.375 02/15/38   | 5,000,000.00     | 6,324,600.000     |  |
|       | US T N/B 4.5 05/15/38     | 6,000,000.00     | 7,737,180.000     |  |
|       | US T N/B 3.5 02/15/39     | 8,000,000.00     | 8,792,160.000     |  |
|       | US T N/B 4.25 05/15/39    | 8,000,000.00     | 9,944,320.000     |  |
|       | US T N/B 4.5 08/15/39     | 7,000,000.00     | 9,044,700.000     |  |
|       | US T N/B 4.375 11/15/39   | 12,000,000.00    | 15,207,120.000    |  |
|       | US T N/B 4.625 02/15/40   | 11,000,000.00    | 14,488,100.000    |  |
|       | US T N/B 4.375 05/15/40   | 12,000,000.00    | 15,208,080.000    |  |
|       | US T N/B 3.875 08/15/40   | 11,000,000.00    | 12,849,320.000    |  |
|       | US T N/B 4.25 11/15/40    | 12,000,000.00    | 14,910,840.000    |  |
|       | US T N/B 4.75 02/15/41    | 9,000,000.00     | 12,090,150.000    |  |
|       | US T N/B 4.375 05/15/41   | 14,000,000.00    | 17,753,680.000    |  |
|       | US T N/B 3.75 08/15/41    | 13,000,000.00    | 14,842,230.000    |  |
|       | US T N/B 3.125 11/15/41   | 13,000,000.00    | 13,191,880.000    |  |
|       | US T N/B 3.125 02/15/42   | 12,000,000.00    | 12,169,680.000    |  |
| 米ドル小計 | 銘柄数 : 116                 | 1,733,000,000.00 | 1,919,954,690.000 |  |
|       | 組入時価比率 : 41.37%           |                  | (153,481,177,919) |  |
|       | 合計時価比率 : 42.26%           |                  |                   |  |
|       | UK TREASURY 2.25 03/07/14 | 9,000,000.00     | 9,299,700.000     |  |
|       | UK TREASURY 5.0 09/07/14  | 8,000,000.00     | 8,844,000.000     |  |
|       | UK TREASURY 2.75 01/22/15 | 9,000,000.00     | 9,532,800.000     |  |
|       | UK TREASURY 4.75 09/07/15 | 7,000,000.00     | 7,954,100.000     |  |
|       | UK TREASURY 8.0 12/07/15  | 2,000,000.00     | 2,522,400.000     |  |
|       | UK TREASURY 2.0 01/22/16  | 9,500,000.00     | 9,923,700.000     |  |
|       | UK TREASURY 4.0 09/07/16  | 9,000,000.00     | 10,192,500.000    |  |
|       | UK TREASURY 1.75 01/22/17 | 6,000,000.00     | 6,204,600.000     |  |
|       | UK TREASURY 8.75 08/25/17 | 3,000,000.00     | 4,193,700.000     |  |
|       | UK TREASURY 1.0 09/07/17  | 500,000.00       | 496,000.000       |  |
|       | UK TREASURY 5.0 03/07/18  | 5,500,000.00     | 6,678,100.000     |  |
|       | UK TREASURY 4.5 03/07/19  | 6,000,000.00     | 7,213,200.000     |  |
|       | UK TREASURY 3.75 09/07/19 | 7,000,000.00     | 8,081,500.000     |  |
|       | UK TREASURY 4.75 03/07/20 | 6,500,000.00     | 7,997,600.000     |  |

|         |                           |                |                  |  |
|---------|---------------------------|----------------|------------------|--|
|         | UK TREASURY 3.75 09/07/20 | 8,000,000.00   | 9,246,400.000    |  |
|         | UK TREASURY 8.0 06/07/21  | 4,000,000.00   | 6,082,800.000    |  |
|         | UK TREASURY 3.75 09/07/21 | 8,500,000.00   | 9,832,460.000    |  |
|         | UK TREASURY 4.0 03/07/22  | 5,500,000.00   | 6,486,150.000    |  |
|         | UK TREASURY 5.0 03/07/25  | 6,000,000.00   | 7,767,000.000    |  |
|         | UK TREASURY 4.25 12/07/27 | 5,000,000.00   | 6,027,500.000    |  |
|         | UK TREASURY 6.0 12/07/28  | 3,500,000.00   | 5,075,000.000    |  |
|         | UK TREASURY 4.75 12/07/30 | 5,500,000.00   | 6,976,750.000    |  |
|         | UK TREASURY 4.25 06/07/32 | 6,500,000.00   | 7,736,950.000    |  |
|         | UK TREASURY 4.5 09/07/34  | 5,000,000.00   | 6,142,000.000    |  |
|         | UK TREASURY 4.25 03/07/36 | 6,000,000.00   | 7,117,200.000    |  |
|         | UK TREASURY 4.75 12/07/38 | 5,500,000.00   | 7,041,100.000    |  |
|         | UK TREASURY 4.25 09/07/39 | 4,500,000.00   | 5,334,300.000    |  |
|         | UK TREASURY 4.25 12/07/40 | 6,000,000.00   | 7,112,400.000    |  |
|         | UK TREASURY 4.5 12/07/42  | 5,500,000.00   | 6,823,850.000    |  |
|         | UK TREASURY 4.25 12/07/46 | 6,000,000.00   | 7,182,000.000    |  |
|         | UK TREASURY 4.25 12/07/49 | 5,000,000.00   | 6,001,000.000    |  |
|         | UK TREASURY 3.75 07/22/52 | 2,000,000.00   | 2,180,000.000    |  |
|         | UK TREASURY 4.25 12/07/55 | 5,300,000.00   | 6,429,430.000    |  |
|         | UK TREASURY 4.0 01/22/60  | 3,500,000.00   | 4,083,800.000    |  |
| 英ポンド小計  | 銘柄数 : 34                  | 194,800,000.00 | 229,811,990.000  |  |
|         | 組入時価比率 : 7.99%            |                | (29,650,342,950) |  |
|         | 合計時価比率 : 8.16%            |                |                  |  |
|         | CANADA 5.25 06/01/13      | 2,000,000.00   | 2,084,240.000    |  |
|         | CANADA 2.5 09/01/13       | 13,000,000.00  | 13,212,680.000   |  |
|         | CANADA 1.5 11/01/13       | 7,000,000.00   | 7,026,880.000    |  |
|         | CANADA 2.0 03/01/14       | 3,000,000.00   | 3,040,080.000    |  |
|         | CANADA 5.0 06/01/14       | 10,000,000.00  | 10,755,600.000   |  |
|         | CANADA 2.0 12/01/14       | 9,000,000.00   | 9,152,370.000    |  |
|         | CANADA 4.5 06/01/15       | 8,000,000.00   | 8,747,440.000    |  |
|         | CANADA 3.0 12/01/15       | 4,000,000.00   | 4,218,440.000    |  |
|         | CANADA 4.0 06/01/16       | 7,500,000.00   | 8,249,025.000    |  |
|         | CANADA 2.75 09/01/16      | 4,000,000.00   | 4,214,480.000    |  |
|         | CANADA 1.5 03/01/17       | 2,500,000.00   | 2,501,000.000    |  |
|         | CANADA 4.0 06/01/17       | 3,500,000.00   | 3,920,140.000    |  |
|         | CANADA 4.25 06/01/18      | 3,500,000.00   | 4,029,970.000    |  |
|         | CANADA 3.75 06/01/19      | 6,500,000.00   | 7,384,455.000    |  |
|         | CANADA 3.5 06/01/20       | 4,500,000.00   | 5,071,860.000    |  |
|         | CANADA 3.25 06/01/21      | 4,000,000.00   | 4,450,160.000    |  |
|         | CANADA 2.75 06/01/22      | 2,500,000.00   | 2,670,625.000    |  |
|         | CANADA 9.0 06/01/25       | 1,200,000.00   | 2,127,024.000    |  |
|         | CANADA 8.0 06/01/27       | 1,700,000.00   | 2,932,942.000    |  |
|         | CANADA 5.75 06/01/29      | 4,000,000.00   | 5,893,560.000    |  |
|         | CANADA 5.75 06/01/33      | 4,500,000.00   | 6,891,075.000    |  |
|         | CANADA 5.0 06/01/37       | 4,700,000.00   | 6,833,001.000    |  |
|         | CANADA 4.0 06/01/41       | 5,500,000.00   | 7,180,250.000    |  |
|         | CANADA 3.5 12/01/45       | 1,500,000.00   | 1,832,265.000    |  |
| カナダドル小計 | 銘柄数 : 24                  | 117,600,000.00 | 134,419,562.000  |  |

|                  |                       |                |                  |  |
|------------------|-----------------------|----------------|------------------|--|
|                  | 組入時価比率： 2.89%         |                | (10,711,894,896) |  |
|                  | 合計時価比率： 2.95%         |                |                  |  |
|                  | SWEDEN 6.75 05/05/14  | 26,000,000.00  | 28,909,660.000   |  |
|                  | SWEDEN 4.5 08/12/15   | 23,000,000.00  | 25,498,720.000   |  |
|                  | SWEDEN 3.0 07/12/16   | 18,000,000.00  | 19,373,760.000   |  |
|                  | SWEDEN 3.75 08/12/17  | 19,000,000.00  | 21,463,350.000   |  |
|                  | SWEDEN 4.25 03/12/19  | 25,000,000.00  | 29,705,000.000   |  |
|                  | SWEDEN 5.0 12/01/20   | 27,000,000.00  | 34,593,480.000   |  |
|                  | SWEDEN 3.5 06/01/22   | 11,000,000.00  | 12,974,610.000   |  |
|                  | SWEDEN 3.5 03/30/39   | 16,000,000.00  | 21,117,120.000   |  |
| スウェーデンク<br>ローネ小計 | 銘柄数： 8                | 165,000,000.00 | 193,635,700.000  |  |
|                  | 組入時価比率： 0.60%         |                | (2,228,746,907)  |  |
|                  | 合計時価比率： 0.61%         |                |                  |  |
|                  | AUSTRIA 3.8 10/20/13  | 2,500,000.00   | 2,620,000.000    |  |
|                  | AUSTRIA 4.3 07/15/14  | 5,500,000.00   | 5,927,405.000    |  |
|                  | AUSTRIA 3.4 10/20/14  | 3,000,000.00   | 3,198,000.000    |  |
|                  | AUSTRIA 3.5 07/15/15  | 5,000,000.00   | 5,402,500.000    |  |
|                  | AUSTRIA 4.0 09/15/16  | 4,500,000.00   | 5,001,750.000    |  |
|                  | AUSTRIA 3.2 02/20/17  | 1,700,000.00   | 1,834,810.000    |  |
|                  | AUSTRIA 4.3 09/15/17  | 3,000,000.00   | 3,394,500.000    |  |
|                  | AUSTRIA 4.65 01/15/18 | 4,000,000.00   | 4,602,000.000    |  |
|                  | AUSTRIA 4.35 03/15/19 | 4,000,000.00   | 4,573,400.000    |  |
|                  | AUSTRIA 3.9 07/15/20  | 4,500,000.00   | 5,004,000.000    |  |
|                  | AUSTRIA 3.5 09/15/21  | 4,500,000.00   | 4,869,000.000    |  |
|                  | AUSTRIA 3.65 04/20/22 | 2,500,000.00   | 2,726,250.000    |  |
|                  | AUSTRIA 3.4 11/22/22  | 1,300,000.00   | 1,392,950.000    |  |
|                  | AUSTRIA 4.85 03/15/26 | 2,800,000.00   | 3,401,160.000    |  |
|                  | AUSTRIA 6.25 07/15/27 | 2,500,000.00   | 3,469,250.000    |  |
|                  | AUSTRIA 4.15 03/15/37 | 4,300,000.00   | 4,942,850.000    |  |
|                  | BELGIUM 4.25 09/28/13 | 5,000,000.00   | 5,242,700.000    |  |
|                  | BELGIUM 4.0 03/28/14  | 4,500,000.00   | 4,756,680.000    |  |
|                  | BELGIUM 4.25 09/28/14 | 4,000,000.00   | 4,289,680.000    |  |
|                  | BELGIUM 3.5 03/28/15  | 5,000,000.00   | 5,302,000.000    |  |
|                  | BELGIUM 3.75 09/28/15 | 5,000,000.00   | 5,378,500.000    |  |
|                  | BELGIUM 2.75 03/28/16 | 3,000,000.00   | 3,124,110.000    |  |
|                  | BELGIUM 3.25 09/28/16 | 5,000,000.00   | 5,275,000.000    |  |
|                  | BELGIUM 4.0 03/28/17  | 5,500,000.00   | 5,992,525.000    |  |
|                  | BELGIUM 5.5 09/28/17  | 3,500,000.00   | 4,053,000.000    |  |
|                  | BELGIUM 4.0 03/28/18  | 3,000,000.00   | 3,256,380.000    |  |
|                  | BELGIUM 4.0 03/28/19  | 3,500,000.00   | 3,795,225.000    |  |
|                  | BELGIUM 3.0 09/28/19  | 1,500,000.00   | 1,524,135.000    |  |
|                  | BELGIUM 3.75 09/28/20 | 6,000,000.00   | 6,372,060.000    |  |
|                  | BELGIUM 4.25 09/28/21 | 4,500,000.00   | 4,891,185.000    |  |
|                  | BELGIUM 4.0 03/28/22  | 5,000,000.00   | 5,342,850.000    |  |
|                  | BELGIUM 4.25 09/28/22 | 2,000,000.00   | 2,164,900.000    |  |
|                  | BELGIUM 4.5 03/28/26  | 1,500,000.00   | 1,658,175.000    |  |
|                  | BELGIUM 5.5 03/28/28  | 5,500,000.00   | 6,725,785.000    |  |

|  |                            |               |                |  |
|--|----------------------------|---------------|----------------|--|
|  | BELGIUM 4.0 03/28/32       | 1,500,000.00  | 1,552,890.000  |  |
|  | BELGIUM 5.0 03/28/35       | 5,500,000.00  | 6,528,775.000  |  |
|  | BELGIUM 4.25 03/28/41      | 3,500,000.00  | 3,781,400.000  |  |
|  | DEUTSCHLAND 3.75 07/04/13  | 8,500,000.00  | 8,856,660.000  |  |
|  | BUNDESSCHAT 0.75 09/13/13  | 8,000,000.00  | 8,074,400.000  |  |
|  | DEUTSCHLAND 4.25 01/04/14  | 20,000,000.00 | 21,376,000.000 |  |
|  | DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14  | 17,000,000.00 | 18,513,000.000 |  |
|  | DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15  | 17,000,000.00 | 18,625,200.000 |  |
|  | DEUTSCHLAND 3.25 07/04/15  | 18,000,000.00 | 19,720,800.000 |  |
|  | DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16   | 14,000,000.00 | 15,636,600.000 |  |
|  | BUNDESOBL 2.75 04/08/16    | 11,000,000.00 | 12,046,100.000 |  |
|  | DEUTSCHLAND 4.0 07/04/16   | 13,000,000.00 | 14,953,900.000 |  |
|  | DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17  | 12,000,000.00 | 13,821,000.000 |  |
|  | DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17  | 7,000,000.00  | 8,303,400.000  |  |
|  | DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18   | 7,000,000.00  | 8,284,500.000  |  |
|  | DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18  | 7,500,000.00  | 9,056,250.000  |  |
|  | DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19  | 8,000,000.00  | 9,480,800.000  |  |
|  | DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19   | 8,000,000.00  | 9,364,800.000  |  |
|  | DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20  | 7,000,000.00  | 8,101,800.000  |  |
|  | DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20   | 7,000,000.00  | 8,001,700.000  |  |
|  | DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20  | 6,000,000.00  | 6,500,400.000  |  |
|  | DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21   | 7,000,000.00  | 7,721,000.000  |  |
|  | DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21  | 6,500,000.00  | 7,578,350.000  |  |
|  | DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21  | 6,000,000.00  | 6,458,400.000  |  |
|  | DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22   | 6,000,000.00  | 6,313,200.000  |  |
|  | DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22  | 2,000,000.00  | 2,037,920.000  |  |
|  | DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24  | 3,500,000.00  | 5,164,250.000  |  |
|  | DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27   | 4,000,000.00  | 6,290,000.000  |  |
|  | DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28 | 4,700,000.00  | 6,864,350.000  |  |
|  | DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28  | 4,000,000.00  | 5,394,800.000  |  |
|  | DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30  | 3,000,000.00  | 4,755,600.000  |  |
|  | DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31   | 5,800,000.00  | 8,654,760.000  |  |
|  | DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34  | 7,000,000.00  | 10,014,900.000 |  |
|  | DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37   | 8,000,000.00  | 10,609,120.000 |  |
|  | DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39  | 4,700,000.00  | 6,627,000.000  |  |
|  | DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40  | 5,500,000.00  | 8,386,400.000  |  |
|  | DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42  | 5,100,000.00  | 6,213,330.000  |  |
|  | SPAIN 4.2 07/30/13         | 10,000,000.00 | 10,141,800.000 |  |
|  | SPAIN 4.25 01/31/14        | 12,000,000.00 | 12,143,400.000 |  |
|  | SPAIN 4.75 07/30/14        | 8,000,000.00  | 8,148,000.000  |  |
|  | SPAIN 3.3 10/31/14         | 5,500,000.00  | 5,432,075.000  |  |
|  | SPAIN 4.4 01/31/15         | 7,000,000.00  | 7,077,700.000  |  |
|  | SPAIN 3.0 04/30/15         | 6,000,000.00  | 5,816,700.000  |  |
|  | SPAIN 4.0 07/30/15         | 4,000,000.00  | 3,983,600.000  |  |
|  | SPAIN 3.15 01/31/16        | 7,000,000.00  | 6,605,900.000  |  |
|  | SPAIN 3.25 04/30/16        | 6,000,000.00  | 5,713,800.000  |  |
|  | SPAIN 4.25 10/31/16        | 4,000,000.00  | 3,912,680.000  |  |
|  | SPAIN 3.8 01/31/17         | 6,000,000.00  | 5,685,000.000  |  |

|  |                          |               |                |  |
|--|--------------------------|---------------|----------------|--|
|  | SPAIN 5.5 07/30/17       | 5,500,000.00  | 5,597,405.000  |  |
|  | SPAIN 4.1 07/30/18       | 6,000,000.00  | 5,623,500.000  |  |
|  | SPAIN 4.6 07/30/19       | 6,000,000.00  | 5,677,800.000  |  |
|  | SPAIN 4.3 10/31/19       | 5,500,000.00  | 5,088,600.000  |  |
|  | SPAIN 4.0 04/30/20       | 7,000,000.00  | 6,293,700.000  |  |
|  | SPAIN 4.85 10/31/20      | 6,000,000.00  | 5,625,600.000  |  |
|  | SPAIN 5.5 04/30/21       | 7,500,000.00  | 7,240,500.000  |  |
|  | SPAIN 5.85 01/31/22      | 2,000,000.00  | 1,988,700.000  |  |
|  | SPAIN 4.8 01/31/24       | 5,500,000.00  | 4,876,850.000  |  |
|  | SPAIN 4.65 07/30/25      | 5,000,000.00  | 4,277,500.000  |  |
|  | SPAIN 5.9 07/30/26       | 2,500,000.00  | 2,384,250.000  |  |
|  | SPAIN 6.0 01/31/29       | 6,000,000.00  | 5,778,540.000  |  |
|  | SPAIN 5.75 07/30/32      | 5,000,000.00  | 4,679,700.000  |  |
|  | SPAIN 4.2 01/31/37       | 5,500,000.00  | 4,054,270.000  |  |
|  | SPAIN 4.9 07/30/40       | 4,500,000.00  | 3,591,000.000  |  |
|  | SPAIN 4.7 07/30/41       | 3,500,000.00  | 2,726,150.000  |  |
|  | FINLAND 5.375 07/04/13   | 2,500,000.00  | 2,650,625.000  |  |
|  | FINLAND 3.125 09/15/14   | 1,500,000.00  | 1,602,000.000  |  |
|  | FINLAND 4.25 07/04/15    | 2,500,000.00  | 2,792,500.000  |  |
|  | FINLAND 1.75 04/15/16    | 3,000,000.00  | 3,127,350.000  |  |
|  | FINLAND 3.875 09/15/17   | 2,000,000.00  | 2,277,000.000  |  |
|  | FINLAND 4.375 07/04/19   | 2,000,000.00  | 2,377,500.000  |  |
|  | FINLAND 3.375 04/15/20   | 2,000,000.00  | 2,241,300.000  |  |
|  | FINLAND 3.5 04/15/21     | 1,500,000.00  | 1,695,000.000  |  |
|  | FINLAND 4.0 07/04/25     | 2,800,000.00  | 3,303,160.000  |  |
|  | FINLAND 2.75 07/04/28    | 1,000,000.00  | 1,025,300.000  |  |
|  | FRANCE OAT 4.0 10/25/13  | 19,000,000.00 | 19,988,000.000 |  |
|  | FR TREASURY 2.5 01/12/14 | 10,000,000.00 | 10,330,500.000 |  |
|  | FRANCE OAT 4.0 04/25/14  | 14,000,000.00 | 14,933,800.000 |  |
|  | FRANCE OAT 4.0 10/25/14  | 18,000,000.00 | 19,416,600.000 |  |
|  | FRANCE OAT 3.5 04/25/15  | 16,000,000.00 | 17,212,800.000 |  |
|  | FRANCE OAT 3.0 10/25/15  | 17,000,000.00 | 18,100,070.000 |  |
|  | FRANCE OAT 3.25 04/25/16 | 17,000,000.00 | 18,298,460.000 |  |
|  | FR TREASURY 2.5 07/25/16 | 8,000,000.00  | 8,366,560.000  |  |
|  | FRANCE OAT 5.0 10/25/16  | 10,000,000.00 | 11,522,200.000 |  |
|  | FRANCE OAT 3.75 04/25/17 | 12,000,000.00 | 13,192,200.000 |  |
|  | FRANCE OAT 4.25 10/25/17 | 8,000,000.00  | 9,013,200.000  |  |
|  | FRANCE OAT 4.0 04/25/18  | 9,000,000.00  | 10,054,620.000 |  |
|  | FRANCE OAT 4.25 10/25/18 | 8,000,000.00  | 9,040,400.000  |  |
|  | FRANCE OAT 4.25 04/25/19 | 9,500,000.00  | 10,744,500.000 |  |
|  | FRANCE OAT 8.5 10/25/19  | 3,000,000.00  | 4,255,500.000  |  |
|  | FRANCE OAT 3.75 10/25/19 | 9,000,000.00  | 9,874,620.000  |  |
|  | FRANCE OAT 3.5 04/25/20  | 10,000,000.00 | 10,746,800.000 |  |
|  | FRANCE OAT 2.5 10/25/20  | 10,000,000.00 | 9,951,000.000  |  |
|  | FRANCE OAT 3.75 04/25/21 | 11,000,000.00 | 11,949,740.000 |  |
|  | FRANCE OAT 3.25 10/25/21 | 10,000,000.00 | 10,449,300.000 |  |
|  | FRANCE OAT 3.0 04/25/22  | 5,000,000.00  | 5,085,050.000  |  |
|  | FRANCE BTAN 8.5 04/25/23 | 4,000,000.00  | 6,096,600.000  |  |

|  |                          |               |                |  |
|--|--------------------------|---------------|----------------|--|
|  | FRANCE OAT 4.25 10/25/23 | 11,000,000.00 | 12,378,960.000 |  |
|  | FRANCE OAT 6.0 10/25/25  | 6,000,000.00  | 7,835,160.000  |  |
|  | FRANCE OAT 3.5 04/25/26  | 9,000,000.00  | 9,212,400.000  |  |
|  | FRANCE OAT 5.5 04/25/29  | 8,000,000.00  | 10,119,600.000 |  |
|  | FRANCE OAT 5.75 10/25/32 | 8,000,000.00  | 10,695,360.000 |  |
|  | FRANCE OAT 4.75 04/25/35 | 6,500,000.00  | 7,788,105.000  |  |
|  | FRANCE OAT 4.0 10/25/38  | 8,300,000.00  | 8,957,111.000  |  |
|  | FRANCE OAT 4.5 04/25/41  | 7,000,000.00  | 8,187,550.000  |  |
|  | FRANCE OAT 4.0 04/25/55  | 5,500,000.00  | 5,937,250.000  |  |
|  | FRANCE OAT 4.0 04/25/60  | 2,800,000.00  | 3,076,080.000  |  |
|  | IRISH 4.0 01/15/14       | 3,000,000.00  | 2,930,400.000  |  |
|  | IRISH 4.6 04/18/16       | 3,000,000.00  | 2,871,810.000  |  |
|  | IRISH 4.5 10/18/18       | 3,000,000.00  | 2,665,170.000  |  |
|  | IRISH 4.4 06/18/19       | 3,000,000.00  | 2,587,500.000  |  |
|  | IRISH 5.9 10/18/19       | 2,000,000.00  | 1,882,700.000  |  |
|  | IRISH 4.5 04/18/20       | 3,000,000.00  | 2,595,210.000  |  |
|  | IRISH 5.0 10/18/20       | 2,000,000.00  | 1,759,800.000  |  |
|  | IRISH 5.4 03/13/25       | 3,000,000.00  | 2,665,920.000  |  |
|  | ITALY BTPS 4.25 08/01/13 | 13,000,000.00 | 13,261,690.000 |  |
|  | ITALY BTPS 3.75 12/15/13 | 18,000,000.00 | 18,261,000.000 |  |
|  | ITALY BTPS 3.5 06/01/14  | 7,000,000.00  | 7,049,000.000  |  |
|  | ITALY BTPS 4.25 08/01/14 | 16,000,000.00 | 16,316,800.000 |  |
|  | ITALY BTPS 4.25 02/01/15 | 13,000,000.00 | 13,278,200.000 |  |
|  | ITALY BTPS 3.0 04/15/15  | 10,000,000.00 | 9,844,000.000  |  |
|  | ITALY BTPS 3.75 08/01/15 | 15,000,000.00 | 15,060,000.000 |  |
|  | ITALY BTPS 3.75 04/15/16 | 10,000,000.00 | 9,940,000.000  |  |
|  | ITALY BTPS 3.75 08/01/16 | 14,000,000.00 | 13,865,600.000 |  |
|  | ITALY BTPS 4.0 02/01/17  | 11,000,000.00 | 10,907,600.000 |  |
|  | ITALY BTPS 5.25 08/01/17 | 8,000,000.00  | 8,266,400.000  |  |
|  | ITALY BTPS 4.5 02/01/18  | 9,000,000.00  | 8,950,500.000  |  |
|  | ITALY BTPS 4.5 08/01/18  | 9,000,000.00  | 8,896,500.000  |  |
|  | ITALY BTPS 4.25 02/01/19 | 8,000,000.00  | 7,740,000.000  |  |
|  | ITALY BTPS 4.5 03/01/19  | 8,500,000.00  | 8,300,250.000  |  |
|  | ITALY BTPS 4.25 09/01/19 | 8,000,000.00  | 7,663,200.000  |  |
|  | ITALY BTPS 4.5 02/01/20  | 7,500,000.00  | 7,237,500.000  |  |
|  | ITALY BTPS 4.25 03/01/20 | 8,000,000.00  | 7,591,200.000  |  |
|  | ITALY BTPS 4.0 09/01/20  | 8,000,000.00  | 7,408,800.000  |  |
|  | ITALY BTPS 3.75 03/01/21 | 8,000,000.00  | 7,195,200.000  |  |
|  | ITALY BTPS 3.75 08/01/21 | 10,000,000.00 | 8,910,000.000  |  |
|  | ITALY BTPS 4.75 09/01/21 | 9,000,000.00  | 8,641,800.000  |  |
|  | ITALY BTPS 5.0 03/01/22  | 5,500,000.00  | 5,324,550.000  |  |
|  | ITALY BTPS 5.5 09/01/22  | 3,000,000.00  | 2,988,330.000  |  |
|  | ITALY BTPS 4.75 08/01/23 | 7,000,000.00  | 6,543,600.000  |  |
|  | ITALY BTPS 9.0 11/01/23  | 4,000,000.00  | 5,028,400.000  |  |
|  | ITALY BTPS 5.0 03/01/25  | 7,500,000.00  | 7,094,250.000  |  |
|  | ITALY BTPS 4.5 03/01/26  | 5,500,000.00  | 4,886,200.000  |  |
|  | ITALY BTPS 7.25 11/01/26 | 3,500,000.00  | 3,952,200.000  |  |
|  | ITALY BTPS 6.5 11/01/27  | 9,000,000.00  | 9,418,500.000  |  |

|             |                           |                  |                   |  |
|-------------|---------------------------|------------------|-------------------|--|
|             | ITALY BTPS 5.25 11/01/29  | 9,000,000.00     | 8,455,500.000     |  |
|             | ITALY BTPS 6.0 05/01/31   | 10,500,000.00    | 10,486,350.000    |  |
|             | ITALY BTPS 5.75 02/01/33  | 5,000,000.00     | 4,872,500.000     |  |
|             | ITALY BTPS 5.0 08/01/34   | 7,000,000.00     | 6,237,000.000     |  |
|             | ITALY BTPS 4.0 02/01/37   | 9,000,000.00     | 7,030,800.000     |  |
|             | ITALY BTPS 5.0 08/01/39   | 6,500,000.00     | 5,717,400.000     |  |
|             | ITALY BTPS 5.0 09/01/40   | 7,000,000.00     | 6,149,500.000     |  |
|             | NETHERLANDS 4.25 07/15/13 | 4,000,000.00     | 4,189,600.000     |  |
|             | NETHERLANDS 1.0 01/15/14  | 4,000,000.00     | 4,054,640.000     |  |
|             | NETHERLANDS 3.75 07/15/14 | 7,000,000.00     | 7,522,200.000     |  |
|             | NETHERLANDS 2.75 01/15/15 | 5,000,000.00     | 5,309,500.000     |  |
|             | NETHERLANDS 0.75 04/15/15 | 1,000,000.00     | 1,008,050.000     |  |
|             | NETHERLANDS 3.25 07/15/15 | 6,000,000.00     | 6,508,200.000     |  |
|             | NETHERLANDS 4.0 07/15/16  | 5,000,000.00     | 5,648,000.000     |  |
|             | NETHERLANDS 2.5 01/15/17  | 3,000,000.00     | 3,202,470.000     |  |
|             | NETHERLANDS 4.5 07/15/17  | 5,000,000.00     | 5,836,000.000     |  |
|             | NETHERLANDS 4.0 07/15/18  | 6,000,000.00     | 6,916,800.000     |  |
|             | NETHERLANDS 4.0 07/15/19  | 4,500,000.00     | 5,220,900.000     |  |
|             | NETHERLANDS 3.5 07/15/20  | 6,000,000.00     | 6,751,200.000     |  |
|             | NETHERLANDS 3.25 07/15/21 | 5,000,000.00     | 5,533,000.000     |  |
|             | NETHERLANDS 2.25 07/15/22 | 2,000,000.00     | 2,031,660.000     |  |
|             | NETHERLANDS 7.5 01/15/23  | 4,500,000.00     | 6,792,300.000     |  |
|             | NETHERLANDS 5.5 01/15/28  | 4,500,000.00     | 6,225,750.000     |  |
|             | NETHERLANDS 2.5 01/15/33  | 1,500,000.00     | 1,475,340.000     |  |
|             | NETHERLANDS 4.0 01/15/37  | 4,000,000.00     | 5,028,000.000     |  |
|             | NETHERLANDS 3.75 01/15/42 | 4,000,000.00     | 4,991,600.000     |  |
| ユーロ小計       | 銘柄数 : 204                 | 1,337,800,000.00 | 1,430,209,061.000 |  |
|             | 組入時価比率 : 39.88%           |                  | (147,926,523,179) |  |
|             | 合計時価比率 : 40.73%           |                  |                   |  |
|             | DENMARK 5.0 11/15/13      | 28,000,000.00    | 30,044,000.000    |  |
|             | DENMARK 2.0 11/15/14      | 6,000,000.00     | 6,264,900.000     |  |
|             | DENMARK 4.0 11/15/15      | 35,000,000.00    | 39,434,500.000    |  |
|             | DENMARK 4.0 11/15/17      | 21,000,000.00    | 24,601,500.000    |  |
|             | DENMARK 4.0 11/15/19      | 33,000,000.00    | 39,831,000.000    |  |
|             | DENMARK 3.0 11/15/21      | 19,000,000.00    | 21,593,500.000    |  |
|             | DENMARK 7.0 11/10/24      | 9,000,000.00     | 14,253,300.000    |  |
|             | DENMARK 4.5 11/15/39      | 37,500,000.00    | 55,976,625.000    |  |
| デンマーククローネ小計 | 銘柄数 : 8                   | 188,500,000.00   | 231,999,325.000   |  |
|             | 組入時価比率 : 0.87%            |                  | (3,229,430,604)   |  |
|             | 合計時価比率 : 0.89%            |                  |                   |  |
|             | NORWAY 6.5 05/15/13       | 22,000,000.00    | 23,093,400.000    |  |
|             | NORWAY 5.0 05/15/15       | 20,000,000.00    | 22,060,000.000    |  |
|             | NORWAY 4.25 05/19/17      | 15,000,000.00    | 16,935,000.000    |  |
|             | NORWAY 4.5 05/22/19       | 10,000,000.00    | 11,750,000.000    |  |
|             | NORWAY 3.75 05/25/21      | 10,500,000.00    | 11,994,150.000    |  |
| ノルウェークローネ小計 | 銘柄数 : 5                   | 77,500,000.00    | 85,832,550.000    |  |

|              |                          |                |                 |  |
|--------------|--------------------------|----------------|-----------------|--|
|              | 組入時価比率： 0.32%            |                | (1,170,755,982) |  |
|              | 合計時価比率： 0.32%            |                |                 |  |
|              | POLAND 5.0 10/24/13      | 15,000,000.00  | 15,052,500.000  |  |
|              | POLAND 5.75 04/25/14     | 13,000,000.00  | 13,242,580.000  |  |
|              | POLAND 5.5 04/25/15      | 4,500,000.00   | 4,581,900.000   |  |
|              | POLAND 6.25 10/24/15     | 17,000,000.00  | 17,765,000.000  |  |
|              | POLAND 5.0 04/25/16      | 4,000,000.00   | 4,009,600.000   |  |
|              | POLAND 4.75 10/25/16     | 4,000,000.00   | 3,965,200.000   |  |
|              | POLAND 5.25 10/25/17     | 12,000,000.00  | 12,180,000.000  |  |
|              | POLAND 5.5 10/25/19      | 9,000,000.00   | 9,159,030.000   |  |
|              | POLAND 5.25 10/25/20     | 11,000,000.00  | 10,966,450.000  |  |
|              | POLAND 5.75 10/25/21     | 2,500,000.00   | 2,566,875.000   |  |
|              | POLAND 5.75 09/23/22     | 9,000,000.00   | 9,247,500.000   |  |
|              | POLAND 5.75 04/25/29     | 3,000,000.00   | 3,052,350.000   |  |
| ポーランドズロチ小計   | 銘柄数： 12                  | 104,000,000.00 | 105,788,985.000 |  |
|              | 組入時価比率： 0.70%            |                | (2,587,598,573) |  |
|              | 合計時価比率： 0.71%            |                |                 |  |
|              | SINGAPORE 2.25 07/01/13  | 1,000,000.00   | 1,023,520.000   |  |
|              | SINGAPORE 3.625 07/01/14 | 4,000,000.00   | 4,292,760.000   |  |
|              | SINGAPORE 2.875 07/01/15 | 3,000,000.00   | 3,243,960.000   |  |
|              | SINGAPORE 3.75 09/01/16  | 3,000,000.00   | 3,431,280.000   |  |
|              | SINGAPORE 4.0 09/01/18   | 2,500,000.00   | 2,984,475.000   |  |
|              | SINGAPORE 3.25 09/01/20  | 2,800,000.00   | 3,201,464.000   |  |
|              | SINGAPORE 3.125 09/01/22 | 2,200,000.00   | 2,497,374.000   |  |
|              | SINGAPORE 3.5 03/01/27   | 2,000,000.00   | 2,337,040.000   |  |
|              | SINGAPORE 2.875 09/01/30 | 800,000.00     | 877,904.000     |  |
|              | SINGAPORE 2.75 04/01/42  | 800,000.00     | 815,240.000     |  |
| シンガポール・ドル小計  | 銘柄数： 10                  | 22,100,000.00  | 24,705,017.000  |  |
|              | 組入時価比率： 0.43%            |                | (1,577,662,386) |  |
|              | 合計時価比率： 0.43%            |                |                 |  |
|              | MALAYSIA 5.094 04/30/14  | 13,000,000.00  | 13,498,030.000  |  |
|              | MALAYSIA 3.835 08/12/15  | 12,000,000.00  | 12,234,600.000  |  |
|              | MALAYSIA 4.262 09/15/16  | 7,000,000.00   | 7,284,830.000   |  |
|              | MALAYSIA 3.814 02/15/17  | 7,000,000.00   | 7,162,330.000   |  |
|              | MALAYSIA 4.24 02/07/18   | 10,000,000.00  | 10,453,000.000  |  |
|              | MALAYSIA 4.378 11/29/19  | 8,000,000.00   | 8,472,560.000   |  |
|              | MALAYSIA 4.16 07/15/21   | 4,000,000.00   | 4,191,480.000   |  |
|              | MALAYSIA 3.502 05/31/27  | 5,000,000.00   | 4,773,550.000   |  |
|              | MALAYSIA 5.248 09/15/28  | 2,000,000.00   | 2,308,940.000   |  |
| マレーシアリンギット小計 | 銘柄数： 9                   | 68,000,000.00  | 70,379,320.000  |  |
|              | 組入時価比率： 0.49%            |                | (1,831,269,906) |  |
|              | 合計時価比率： 0.50%            |                |                 |  |
|              | AUSTRALIAN 6.5 05/15/13  | 6,500,000.00   | 6,724,445.000   |  |
|              | AUSTRALIAN 6.25 06/15/14 | 8,500,000.00   | 9,105,455.000   |  |
|              | AUSTRALIAN 6.25 04/15/15 | 8,000,000.00   | 8,795,120.000   |  |

|                 |                             |                |                   |  |
|-----------------|-----------------------------|----------------|-------------------|--|
|                 | AUSTRALIAN 4.75 06/15/16    | 4,500,000.00   | 4,841,460.000     |  |
|                 | AUSTRALIAN 6.0 02/15/17     | 6,500,000.00   | 7,416,240.000     |  |
|                 | AUSTRALIAN 5.5 01/21/18     | 3,500,000.00   | 3,963,260.000     |  |
|                 | AUSTRALIAN 5.25 03/15/19    | 6,000,000.00   | 6,815,880.000     |  |
|                 | AUSTRALIAN 4.5 04/15/20     | 5,500,000.00   | 6,015,405.000     |  |
|                 | AUSTRALIAN 5.75 05/15/21    | 6,000,000.00   | 7,166,460.000     |  |
|                 | AUSTRALIAN 5.75 07/15/22    | 3,700,000.00   | 4,462,274.000     |  |
|                 | AUSTRALIAN 5.5 04/21/23     | 2,000,000.00   | 2,374,660.000     |  |
|                 | AUSTRALIAN 4.75 04/21/27    | 1,500,000.00   | 1,685,070.000     |  |
| オーストラリア<br>ドル小計 | 銘柄数 : 12                    | 62,200,000.00  | 69,365,729.000    |  |
|                 | 組入時価比率 : 1.51%              |                | (5,588,103,128)   |  |
|                 | 合計時価比率 : 1.54%              |                |                   |  |
|                 | MEXICAN BONDS 9.5 12/18/14  | 145,000,000.00 | 161,463,300.000   |  |
|                 | MEXICAN BONDS 6.25 06/16/16 | 10,000,000.00  | 10,414,400.000    |  |
|                 | MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17 | 70,000,000.00  | 78,212,400.000    |  |
|                 | MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20  | 70,000,000.00  | 79,643,900.000    |  |
|                 | MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21  | 25,000,000.00  | 25,776,250.000    |  |
|                 | MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24 | 55,000,000.00  | 72,683,600.000    |  |
|                 | MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29  | 50,000,000.00  | 57,954,500.000    |  |
|                 | MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38  | 48,000,000.00  | 54,023,040.000    |  |
| メキシコ ペソ<br>小計   | 銘柄数 : 8                     | 473,000,000.00 | 540,171,390.000   |  |
|                 | 組入時価比率 : 0.86%              |                | (3,192,412,915)   |  |
|                 | 合計時価比率 : 0.88%              |                |                   |  |
| 合計              |                             |                | 363,175,919,345   |  |
|                 |                             |                | (363,175,919,345) |  |

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

#### 有価証券明細表注記

#### 外貨建有価証券の内訳

| 通貨         | 銘柄数        | 組入時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|------------|------------|--------|------------|
| 米ドル        | 国債証券 116銘柄 | 41.37% | 42.26%     |
| 英ポンド       | 国債証券 34銘柄  | 7.99%  | 8.16%      |
| カナダドル      | 国債証券 24銘柄  | 2.89%  | 2.95%      |
| スウェーデンクローネ | 国債証券 8銘柄   | 0.60%  | 0.61%      |
| ユーロ        | 国債証券 204銘柄 | 39.88% | 40.73%     |
| デンマーククローネ  | 国債証券 8銘柄   | 0.87%  | 0.89%      |
| ノルウェークローネ  | 国債証券 5銘柄   | 0.32%  | 0.32%      |
| ポーランドズロチ   | 国債証券 12銘柄  | 0.70%  | 0.71%      |
| シンガポール・ドル  | 国債証券 10銘柄  | 0.43%  | 0.43%      |
| マレーシアリンギット | 国債証券 9銘柄   | 0.49%  | 0.50%      |
| オーストラリアドル  | 国債証券 12銘柄  | 1.51%  | 1.54%      |
| メキシコ ペソ    | 国債証券 8銘柄   | 0.86%  | 0.88%      |

（注）「組入時価比率」は小計金額の純資産に対する比率、「合計金額に対する比率」は小計金額の合計金額に対する比率であります。

## 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

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

## 「J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

| 科目          | 注記<br>番号 | 平成23年11月11日現在 | 平成24年5月11日現在  |
|-------------|----------|---------------|---------------|
|             |          | 金額<br>(円)     | 金額<br>(円)     |
| 資産の部        |          |               |               |
| 流動資産        |          |               |               |
| コール・ローン     |          | 3,221,864     | 1,003,398,226 |
| 投資証券        |          | 4,126,423,510 | 4,695,542,050 |
| 未収入金        |          | 288,813,310   | 518,535       |
| 未収配当金       |          | 50,026,956    | 51,754,435    |
| 流動資産合計      |          | 4,468,485,640 | 5,751,213,246 |
| 資産合計        |          | 4,468,485,640 | 5,751,213,246 |
| 負債の部        |          |               |               |
| 流動負債        |          |               |               |
| 未払金         |          | -             | 999,253,219   |
| 未払解約金       |          | 189,736,000   | 153,000       |
| 流動負債合計      |          | 189,736,000   | 999,406,219   |
| 負債合計        |          | 189,736,000   | 999,406,219   |
| 純資産の部       |          |               |               |
| 元本等         |          |               |               |
| 元本          |          | 6,155,381,436 | 6,083,531,348 |
| 剰余金         |          |               |               |
| 剰余金又は欠損金（ ） | *3       | 1,876,631,796 | 1,331,724,321 |
| 元本等合計       |          | 4,278,749,640 | 4,751,807,027 |
| 純資産合計       |          | 4,278,749,640 | 4,751,807,027 |
| 負債純資産合計     |          | 4,468,485,640 | 5,751,213,246 |

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                            |                                                                                                                              |
|----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 投資証券<br>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 計算期間の取扱い<br>当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年6月7日から平成24年6月6日までとなっております。                                            |

## （貸借対照表に関する注記）

| 区分                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 平成23年11月11日現在                                                                                                                                                               | 平成24年5月11日現在                                                                                                                                                                |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| *1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における<br>当該親投資信託の元本額<br>同期中追加設定元本額<br>同期中解約元本額<br><br>同期末における元本の内訳<br>マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞<br>マネックス資産設計ファンド＜育成型＞<br>マネックス資産設計ファンド エボリューション<br>D I A M J - R E I Tインデックスファンド（適格機関投資家向け）<br>D I A Mグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）<br>D I A Mグローバル分散ファンドV A（適格機関投資家限定）<br>（合 計） | <br>4,818,520,039円<br>3,173,816,879円<br>1,836,955,482円<br><br>45,687,156円<br>476,725,760円<br>2,498,685円<br>4,838,618,566円<br>363,475,224円<br>428,376,045円<br>6,155,381,436円 | <br>6,155,381,436円<br>1,617,688,729円<br>1,689,538,817円<br><br>53,285,219円<br>608,054,003円<br>2,352,298円<br>4,688,131,871円<br>308,433,701円<br>423,274,256円<br>6,083,531,348円 |
| *2 本有価証券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受益権の総数                                                                                                                                                                                                                                                       | 6,155,381,436口                                                                                                                                                              | 6,083,531,348口                                                                                                                                                              |
| *3 元本の欠損                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,876,631,796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1,331,724,321円であります。                                                                                                                           |

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

| 区分                       | 自平成23年5月12日<br>至平成23年11月11日                                                                                                                    | 自平成23年11月12日<br>至平成24年5月11日 |
|--------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。                                                                    | 同左                          |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 | 同左                          |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | 運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。                                 | 同左                          |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                   | 平成23年11月11日現在                                                                                                                        | 平成24年5月11日現在                                  |
|----------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。                                                                               | 同左                                            |
| 2. 時価の算定方法           | (1)投資証券<br>「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。<br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 | (1)投資証券<br>同左<br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>同左 |

|                            |                                                                                                                       |    |
|----------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左 |
|----------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

|      | 平成23年11月11日現在         | 平成24年5月11日現在          |
|------|-----------------------|-----------------------|
| 種 類  | 当期の損益に含まれた<br>評価差額(円) | 当期の損益に含まれた<br>評価差額(円) |
| 投資証券 | 730,307,245           | 252,913,254           |
| 合計   | 730,307,245           | 252,913,254           |

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの特定期間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）

該当事項はありません。

## （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口当たり情報に関する注記）

|              | 平成23年11月11日現在 | 平成24年5月11日現在 |
|--------------|---------------|--------------|
| 1口当たり純資産額    | 0.6951円       | 0.7811円      |
| （1万口当たり純資産額） | (6,951円)      | (7,811円)     |

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## 株 式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

平成24年5月11日現在

| 種 類  | 銘 柄                | 口数  | 評価額（円）      | 備考 |
|------|--------------------|-----|-------------|----|
| 投資証券 | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 269 | 136,383,000 |    |
|      | M I Dリート投資法人       | 253 | 52,952,900  |    |
|      | 森ヒルズリート投資法人        | 319 | 97,933,000  |    |

|    |                   |        |               |  |
|----|-------------------|--------|---------------|--|
|    | 野村不動産レジデンシャル投資法人  | 208    | 85,280,000    |  |
|    | 産業ファンド投資法人        | 194    | 89,725,000    |  |
|    | アドバンス・レジデンス投資法人   | 1,517  | 229,825,500   |  |
|    | 日本ビルファンド投資法人      | 846    | 618,426,000   |  |
|    | ジャパンリアルエステイト投資法人  | 757    | 526,872,000   |  |
|    | 日本リテールファンド投資法人    | 2,593  | 322,569,200   |  |
|    | オリックス不動産投資法人      | 392    | 136,220,000   |  |
|    | 日本プライムリアルティ投資法人   | 986    | 224,906,600   |  |
|    | プレミアム投資法人         | 271    | 76,991,100    |  |
|    | 東急リアル・エステート投資法人   | 234    | 91,494,000    |  |
|    | グローバル・ワン不動産投資法人   | 134    | 70,618,000    |  |
|    | 野村不動産オフィスファンド投資法人 | 421    | 186,503,000   |  |
|    | ユナイテッド・アーバン投資法人   | 2,901  | 266,892,000   |  |
|    | 森トラスト総合リート投資法人    | 334    | 222,778,000   |  |
|    | インヴィンシブル投資法人      | 1,860  | 12,090,000    |  |
|    | フロンティア不動産投資法人     | 268    | 174,736,000   |  |
|    | 平和不動産リート投資法人      | 960    | 44,112,000    |  |
|    | 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 204    | 141,984,000   |  |
|    | 福岡リート投資法人         | 170    | 94,690,000    |  |
|    | ケネディクス不動産投資法人     | 395    | 104,003,500   |  |
|    | 積水ハウス・S I 投資法人    | 159    | 49,846,500    |  |
|    | いちご不動産投資法人        | 1,163  | 39,658,300    |  |
|    | 大和証券オフィス投資法人      | 546    | 110,838,000   |  |
|    | 阪急リート投資法人         | 118    | 44,899,000    |  |
|    | スターツプロシード投資法人     | 149    | 15,972,800    |  |
|    | トップリート投資法人        | 214    | 91,164,000    |  |
|    | 大和ハウス・レジデンシャル投資法人 | 221    | 116,909,000   |  |
|    | ジャパン・ホテル・リート投資法人  | 2,565  | 49,581,450    |  |
|    | 日本賃貸住宅投資法人        | 1,836  | 64,168,200    |  |
|    | ジャパンエクセレント投資法人    | 260    | 104,520,000   |  |
| 合計 |                   | 23,717 | 4,695,542,050 |  |

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

| 科目       | 注記<br>番号 | 平成23年11月11日現在 | 平成24年5月11日現在 |
|----------|----------|---------------|--------------|
|          |          | 金額<br>(円)     | 金額<br>(円)    |
| 資産の部     |          |               |              |
| 流動資産     |          |               |              |
| 預金       |          | 41,409,768    | 31,141,331   |
| コール・ローン  |          | 6,210,204     | 30,273,968   |
| 投資信託受益証券 |          | 382,344,508   | 391,434,671  |

|             |    |               |               |
|-------------|----|---------------|---------------|
| 投資証券        |    | 2,211,430,857 | 2,321,666,681 |
| 未収入金        |    | 38,232        | 66,762        |
| 未収配当金       |    | 6,538,626     | 13,407,050    |
| 流動資産合計      |    | 2,647,972,195 | 2,787,990,463 |
| 資産合計        |    | 2,647,972,195 | 2,787,990,463 |
| 負債の部        |    |               |               |
| 流動負債        |    |               |               |
| 未払解約金       |    | 139,000       | -             |
| 流動負債合計      |    | 139,000       | -             |
| 負債合計        |    | 139,000       | -             |
| 純資産の部       |    |               |               |
| 元本等         |    |               |               |
| 元本          |    | 3,746,139,784 | 3,308,970,583 |
| 剰余金         |    |               |               |
| 剰余金又は欠損金（ ） | *3 | 1,098,306,589 | 520,980,120   |
| 元本等合計       |    | 2,647,833,195 | 2,787,990,463 |
| 純資産合計       |    | 2,647,833,195 | 2,787,990,463 |
| 負債純資産合計     |    | 2,647,972,195 | 2,787,990,463 |

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                            |                                                                                                                                                                                                                 |
|----------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 株式、投資信託受益証券及び投資証券<br>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。                                                                       |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法      | 為替予約取引<br>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によって計算しております。                                                                                                                                                         |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | (1)外貨建取引等の処理基準<br>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「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条及び同第61条にしたがって換算しております。<br>(2)計算期間の取扱い<br>当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年11月8日から平成24年11月6日までとなっております。 |

## （貸借対照表に関する注記）

| 区分                                                                                                                                                                                                                                   | 平成23年11月11日現在                                                                                                                                       | 平成24年5月11日現在                                                                                                                                         |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| *1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における<br>当該親投資信託の元本額<br>同期中追加設定元本額<br>同期中解約元本額<br><br>同期末における元本の内訳<br>マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞<br>マネックス資産設計ファンド＜育成型＞<br>マネックス資産設計ファンド エポリーション<br>D I A Mパッシブ資産分散ファンド<br>D I A Mグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）<br>（合 計） | 4,294,154,362円<br>31,131,206円<br>579,145,784円<br><br>47,923,474円<br>499,647,966円<br>33,066,174円<br>2,990,376,523円<br>175,125,647円<br>3,746,139,784円 | 3,746,139,784円<br>177,117,730円<br>614,286,931円<br><br>42,051,106円<br>479,531,210円<br>39,173,318円<br>2,605,177,945円<br>143,037,004円<br>3,308,970,583円 |
| *2 本有価証券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受益権の総数                                                                                                                                                                                             | 3,746,139,784口                                                                                                                                      | 3,308,970,583口                                                                                                                                       |
| *3 元本の欠損                                                                                                                                                                                                                             | 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,098,306,589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520,980,120円であります。                                                                                                      |

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

| 区分              | 自平成23年5月12日<br>至平成23年11月11日                                                 | 自平成23年11月12日<br>至平成24年5月11日 |
|-----------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 | 同左                          |

|                          |                                                                                                                                                                                                                                                                             |    |
|--------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。<br>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。 | 同左 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | 運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。                                                                                                                                                              | 同左 |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                   | 平成23年11月11日現在                                                                                                                                  | 平成24年5月11日現在                                            |
|----------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。                                                                                         | 同左                                                      |
| 2. 時価の算定方法           | (1)投資信託受益証券及び投資証券<br>「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。<br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 | (1)投資信託受益証券及び投資証券<br>同左<br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>同左 |

|                            |                                                                                                                       |    |
|----------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左 |
|----------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

|          | 平成23年11月11日現在         | 平成24年5月11日現在          |
|----------|-----------------------|-----------------------|
| 種 類      | 当期の損益に含まれた<br>評価差額(円) | 当期の損益に含まれた<br>評価差額(円) |
| 投資信託受益証券 | 1,159,580             | 34,852,094            |
| 投資証券     | 67,888,767            | 221,753,129           |
| 合計       | 69,048,347            | 256,605,223           |

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの特定期間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）

該当事項はありません。

## （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口当たり情報に関する注記）

|                           | 平成23年11月11日現在       | 平成24年5月11日現在        |
|---------------------------|---------------------|---------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 0.7068円<br>(7,068円) | 0.8426円<br>(8,426円) |

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## 株 式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

平成24年5月11日現在

| 種 類      | 銘 柄                       | 口数         | 評価額         | 備考 |
|----------|---------------------------|------------|-------------|----|
| 投資信託受益証券 | CAPITAMALL TRUST          | 106,000.00 | 189,210.000 |    |
|          | ASCENDAS REAL ESTATE INVT | 132,000.00 | 269,280.000 |    |
|          | CAPITACOMMERCIAL TRUST    | 150,000.00 | 195,750.000 |    |

|             |                                    |              |               |  |
|-------------|------------------------------------|--------------|---------------|--|
|             | SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR       | 170,000.00   | 228,650.000   |  |
|             | STARHILL GLOBAL REIT               | 120,000.00   | 77,400.000    |  |
|             | FRASERS COMMERCIAL TRUST           | 50,000.00    | 47,000.000    |  |
|             | CDL HOSPITALITY TRUSTS             | 58,000.00    | 113,100.000   |  |
|             | CAPITARETAIL CHINA TRUST           | 71,000.00    | 94,430.000    |  |
|             | FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 110,000.00   | 99,000.000    |  |
| シンガポール・ドル小計 | 銘柄数 : 9                            | 967,000.00   | 1,313,820.000 |  |
|             | 組入時価比率 : 3.01%                     |              | (83,900,545)  |  |
|             | 合計時価比率 : 3.09%                     |              |               |  |
|             | BWP TRUST                          | 20,500.00    | 37,720.000    |  |
|             | COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE       | 152,300.00   | 156,869.000   |  |
|             | MIRVAC GROUP                       | 191,854.00   | 249,410.200   |  |
|             | INVESTA OFFICE FUND                | 40,270.00    | 110,339.800   |  |
|             | CHARTER HALL RETAIL REIT           | 8,480.00     | 27,899.200    |  |
|             | CFS RETAIL PROPERTY                | 153,300.00   | 291,270.000   |  |
|             | GPT GROUP                          | 86,000.00    | 276,920.000   |  |
|             | ABACUS PROPERTY GROUP              | 16,920.00    | 33,501.600    |  |
|             | STOCKLAND                          | 130,140.00   | 413,845.200   |  |
|             | WESTFIELD GROUP                    | 116,200.00   | 1,092,280.000 |  |
|             | DEXUS PROPERTY GROUP               | 247,400.00   | 230,082.000   |  |
|             | GOODMAN GROUP                      | 89,152.00    | 325,404.800   |  |
|             | ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP         | 23,590.00    | 64,636.600    |  |
|             | CENTRO RETAIL AUSTRALIA            | 50,000.00    | 94,500.000    |  |
|             | WESTFIELD RETAIL TRUST             | 151,200.00   | 412,776.000   |  |
| オーストラリアドル小計 | 銘柄数 : 15                           | 1,477,306.00 | 3,817,454.400 |  |
|             | 組入時価比率 : 11.03%                    |              | (307,534,126) |  |
|             | 合計時価比率 : 11.34%                    |              |               |  |
| 投資信託受益証券計   |                                    |              | 391,434,671   |  |
|             |                                    |              | (391,434,671) |  |
|             |                                    |              |               |  |
| 投資証券        | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT       | 3,900.00     | 290,550.000   |  |
|             | BOSTON PROPERTIES INC              | 7,780.00     | 841,796.000   |  |
|             | CEDAR REALTY TRUST INC             | 5,300.00     | 26,023.000    |  |
|             | FIRST POTOMAC REALTY TRUST         | 2,400.00     | 30,192.000    |  |
|             | OMEGA HEALTHCARE INVS INC          | 3,500.00     | 74,900.000    |  |
|             | APARTMENT INVT & MGMT CO-A         | 7,715.00     | 214,245.550   |  |
|             | AGREE REALTY CORP                  | 1,100.00     | 24,662.000    |  |
|             | BRE PROPERTIES -CL A               | 2,500.00     | 131,525.000   |  |
|             | SL GREEN                           | 3,825.00     | 310,513.500   |  |
|             | ENTERTAINMENT PROPERTIES TR        | 2,200.00     | 97,966.000    |  |
|             | PROLOGIS INC                       | 25,729.00    | 890,223.400   |  |
|             | AVALONBAY COMMUNITIES INC          | 4,798.00     | 704,970.140   |  |
|             | LEXINGTON REALTY TRUST             | 3,521.00     | 32,217.150    |  |
|             | CAMDEN PROPERTY TRUST              | 3,800.00     | 259,768.000   |  |
|             | CBL & ASSOCIATES                   | 9,882.00     | 187,263.900   |  |
|             | MACK CALI                          | 5,300.00     | 152,852.000   |  |

|  |                                |           |             |  |
|--|--------------------------------|-----------|-------------|--|
|  | COLONIAL PROPERTIES TRUST      | 3,500.00  | 78,050.000  |  |
|  | NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 8,000.00  | 222,080.000 |  |
|  | COUSINS PROPERTIES INC         | 909.00    | 6,972.030   |  |
|  | LASALLE HOTEL PROPERTIES       | 5,000.00  | 144,300.000 |  |
|  | URSTADT BIDDLE PROPERTIES      | 2,600.00  | 49,894.000  |  |
|  | DDR CORP                       | 12,882.00 | 189,494.220 |  |
|  | DUKE REALTY TRUST              | 10,100.00 | 149,076.000 |  |
|  | ASHFORD HOSPITALITY TRUST      | 7,700.00  | 63,448.000  |  |
|  | ESSEX PROPERTY TRUST INC       | 2,060.00  | 324,532.400 |  |
|  | EQUITY RESIDENTIAL             | 15,700.00 | 990,513.000 |  |
|  | FEDERAL REALTY INVS TRUST      | 4,030.00  | 407,030.000 |  |
|  | FIRST INDUSTRIAL RT            | 4,600.00  | 56,028.000  |  |
|  | GENERAL GROWTH PROPERTIES INC  | 34,963.00 | 633,179.930 |  |
|  | GLIMCHER REALTY TRUST          | 9,200.00  | 91,356.000  |  |
|  | FELCOR LODGING TR INC          | 4,700.00  | 21,667.000  |  |
|  | HOME PROPERTIES INC            | 2,400.00  | 152,352.000 |  |
|  | HCP INC                        | 20,900.00 | 864,424.000 |  |
|  | COMMONWEALTH REIT              | 4,325.00  | 81,310.000  |  |
|  | HEALTHCARE REALTY TRUST INC    | 5,800.00  | 126,266.000 |  |
|  | HIGHWOODS PROPERTIES INC       | 3,300.00  | 115,500.000 |  |
|  | STRATEGIC HOTELS & RESORTS     | 8,000.00  | 51,360.000  |  |
|  | HOSPITALITY PROPERTIES TRUST   | 8,400.00  | 213,192.000 |  |
|  | HEALTH CARE REIT INC           | 11,201.00 | 629,944.240 |  |
|  | EAST GROUP                     | 2,300.00  | 116,518.000 |  |
|  | KIMCO REALTY                   | 21,199.00 | 413,804.480 |  |
|  | KILROY REALTY CORP             | 4,400.00  | 210,980.000 |  |
|  | LTC PROPERTIES INC             | 3,500.00  | 115,325.000 |  |
|  | SENIOR HOUSING PPTYS TRUST     | 6,800.00  | 146,608.000 |  |
|  | LIBERTY PROPERTY TRUST         | 7,400.00  | 269,952.000 |  |
|  | BRANDYWINE REALTY TRUST        | 5,700.00  | 67,887.000  |  |
|  | THE MACERICH COMPANY           | 6,020.00  | 365,293.600 |  |
|  | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES    | 2,800.00  | 193,480.000 |  |
|  | ACADIA REALTY TRUST            | 4,585.00  | 106,326.150 |  |
|  | HOST HOTELS & RESORTS INC      | 41,168.00 | 661,158.080 |  |
|  | MID AMERICA                    | 2,200.00  | 153,296.000 |  |
|  | HERSHA HOSPITALITY TRUST       | 10,400.00 | 57,304.000  |  |
|  | NATIONAL HEALTH INVS INC       | 2,000.00  | 98,980.000  |  |
|  | INVESTORS REAL ESTATE TRUST    | 11,500.00 | 83,490.000  |  |
|  | PARKWAY PROPERTIES INC         | 4,900.00  | 52,577.000  |  |
|  | PENN REAL ESTATE INVEST TST    | 5,600.00  | 81,368.000  |  |
|  | GETTY REALTY CORP              | 3,500.00  | 56,980.000  |  |
|  | POST PROPERTIES, INC           | 2,200.00  | 110,154.000 |  |
|  | PS BUSINESS PARKS              | 400.00    | 27,612.000  |  |
|  | RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES    | 5,600.00  | 69,384.000  |  |
|  | REALTY INCOME CORP             | 8,100.00  | 318,411.000 |  |
|  | REGENCY                        | 5,700.00  | 269,667.000 |  |
|  | UDR INC                        | 13,779.00 | 372,033.000 |  |
|  | CORPORATE OFFICE PROPERTIES    | 3,800.00  | 89,338.000  |  |

|        |                                  |            |                 |  |
|--------|----------------------------------|------------|-----------------|--|
|        | SAUL CENTERS INC                 | 800.00     | 32,216.000      |  |
|        | SIMON PROPERTY GROUP INC         | 16,814.00  | 2,604,993.020   |  |
|        | SOVRAN SELF STORAGE INC          | 2,700.00   | 141,291.000     |  |
|        | PUBLIC STORAGE                   | 8,158.00   | 1,134,696.220   |  |
|        | SUN COMMUNITIES INC              | 1,200.00   | 52,536.000      |  |
|        | TAUBMAN CENTERS INC              | 3,100.00   | 240,095.000     |  |
|        | TANGER FACTORY OUTLET            | 4,700.00   | 151,857.000     |  |
|        | UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME     | 900.00     | 35,784.000      |  |
|        | VENTAS INC                       | 15,302.00  | 902,358.940     |  |
|        | VORNADO REALTY TRUST             | 10,429.00  | 907,323.000     |  |
|        | WASHINGTON REIT                  | 4,000.00   | 120,200.000     |  |
|        | WEINGARTEN REALTY INVST          | 7,100.00   | 193,759.000     |  |
|        | CAPLEASE INC                     | 7,000.00   | 29,400.000      |  |
|        | BIOMED REALTY TRUST INC          | 8,300.00   | 161,103.000     |  |
|        | AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES      | 3,209.00   | 145,752.780     |  |
|        | EXTRA SPACE STORAGE INC          | 5,900.00   | 176,351.000     |  |
|        | FRANKLIN STREET PROPERTIES C     | 5,700.00   | 58,083.000      |  |
|        | CUBESMART                        | 8,900.00   | 109,025.000     |  |
|        | DIGITAL REALTY TRUST INC         | 5,510.00   | 402,560.600     |  |
|        | INLAND REAL ESTATE CORP          | 4,900.00   | 40,621.000      |  |
|        | EDUCATION REALTY TRUST INC       | 7,800.00   | 88,998.000      |  |
|        | DIAMONDROCK HOSPITALITY CO       | 8,372.00   | 89,161.800      |  |
|        | MEDICAL PROPERTIES TRUST         | 3,900.00   | 36,075.000      |  |
|        | DOUGLAS EMMETT INC               | 8,600.00   | 199,434.000     |  |
|        | DCT INDUSTRIAL TRUST INC         | 16,000.00  | 95,680.000      |  |
|        | DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC     | 3,500.00   | 91,735.000      |  |
|        | PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | 7,400.00   | 125,800.000     |  |
|        | PEBBLEBROOK HOTEL TRUST          | 700.00     | 16,114.000      |  |
|        | ROUSE PROPERTIES INC             | 1,311.00   | 17,973.810      |  |
| 米ドル小計  | 銘柄数 : 93                         | 651,276.00 | 22,840,539.940  |  |
|        | 組入時価比率 : 65.49%                  |            | (1,825,872,763) |  |
|        | 合計時価比率 : 67.30%                  |            |                 |  |
|        | BRITISH LAND CO PLC              | 45,200.00  | 222,338.800     |  |
|        | DERWENT LONDON PLC               | 5,800.00   | 101,036.000     |  |
|        | BIG YELLOW GROUP PLC             | 10,000.00  | 29,800.000      |  |
|        | HAMMERSON PLC                    | 27,200.00  | 113,288.000     |  |
|        | LAND SECURITIES GROUP PLC        | 43,200.00  | 317,304.000     |  |
|        | WORKSPACE GROUP PLC              | 7,067.00   | 15,618.070      |  |
|        | CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP   | 37,804.00  | 118,515.540     |  |
|        | SHAFTESBURY PLC                  | 16,000.00  | 82,320.000      |  |
|        | SEGRO PLC                        | 50,090.00  | 108,244.490     |  |
|        | GREAT PORTLAND ESTATES PLC       | 21,400.00  | 78,538.000      |  |
|        | LONDON & STAMFORD PROPERTY PLC   | 36,000.00  | 39,420.000      |  |
| 英ポンド小計 | 銘柄数 : 11                         | 299,761.00 | 1,226,422.900   |  |
|        | 組入時価比率 : 5.68%                   |            | (158,233,083)   |  |
|        | 合計時価比率 : 5.83%                   |            |                 |  |
|        | CALLOWAY REAL ESTATE INVT TR     | 3,400.00   | 94,758.000      |  |
|        | CANADIAN APT PPTYS REIT          | 5,400.00   | 125,226.000     |  |

|              |                                     |            |                 |  |
|--------------|-------------------------------------|------------|-----------------|--|
|              | MORGUARD REAL ESTATE INVT TR        | 5,900.00   | 96,996.000      |  |
|              | H & R REAL ESTATE INVESTMENT        | 5,400.00   | 131,058.000     |  |
|              | CHARTWELL SENIOR HSG REIT           | 1,300.00   | 12,688.000      |  |
|              | CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST      | 2,700.00   | 108,108.000     |  |
|              | RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST     | 10,000.00  | 273,900.000     |  |
|              | COMINAR REAL ESTATE INVT TR         | 1,200.00   | 29,040.000      |  |
|              | PRIMARIS RETAIL REIT                | 4,900.00   | 111,671.000     |  |
|              | INNVEST REAL ESTATE INVT TR         | 4,500.00   | 22,905.000      |  |
|              | BOARDWALK REAL ESTATE INVEST        | 900.00     | 54,090.000      |  |
| カナダドル小計      | 銘柄数 : 11                            | 45,600.00  | 1,060,440.000   |  |
|              | 組入時価比率 : 3.03%                      |            | (84,506,464)    |  |
|              | 合計時価比率 : 3.11%                      |            |                 |  |
|              | BEFIMMO                             | 1,104.00   | 48,244.800      |  |
|              | COFINIMMO SA                        | 1,090.00   | 92,257.600      |  |
|              | WAREHOUSES DE PAUW                  | 1,534.00   | 59,826.000      |  |
|              | GECINA SA                           | 1,790.00   | 123,026.700     |  |
|              | ICADE EMGP                          | 1,520.00   | 93,115.200      |  |
|              | UNIBAIL-RODAMCO SE                  | 5,230.00   | 708,665.000     |  |
|              | KLEPIERRE                           | 6,400.00   | 152,160.000     |  |
|              | FONCIERE DES REGIONS                | 2,000.00   | 105,820.000     |  |
|              | MERCIALYS                           | 3,065.00   | 45,852.400      |  |
|              | EUROCOMMERCIAL                      | 3,000.00   | 78,135.000      |  |
|              | VASTNED RETAIL                      | 700.00     | 22,967.000      |  |
|              | CORIO NV                            | 5,800.00   | 192,415.000     |  |
|              | WERELDHAVE NV                       | 1,500.00   | 77,700.000      |  |
|              | NIEUWE STEEN INVS                   | 2,691.00   | 20,941.360      |  |
| ユーロ小計        | 銘柄数 : 14                            | 37,424.00  | 1,821,126.060   |  |
|              | 組入時価比率 : 6.76%                      |            | (188,359,068)   |  |
|              | 合計時価比率 : 6.94%                      |            |                 |  |
|              | LINK REIT/THE                       | 135,000.00 | 4,252,500.000   |  |
|              | PROSPERITY REIT                     | 106,000.00 | 182,320.000     |  |
|              | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 133,000.00 | 526,680.000     |  |
|              | REGAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST  | 100,000.00 | 199,000.000     |  |
|              | FORTUNE REAL ESTATE (HK)            | 78,000.00  | 328,380.000     |  |
| 香港ドル小計       | 銘柄数 : 5                             | 552,000.00 | 5,488,880.000   |  |
|              | 組入時価比率 : 2.03%                      |            | (56,535,464)    |  |
|              | 合計時価比率 : 2.08%                      |            |                 |  |
|              | GOODMAN PROPERTY TRUST              | 73,600.00  | 75,808.000      |  |
|              | KIWI INCOME PROPERTY TRUST          | 50,000.00  | 54,250.000      |  |
| ニュージーランドドル小計 | 銘柄数 : 2                             | 123,600.00 | 130,058.000     |  |
|              | 組入時価比率 : 0.29%                      |            | (8,159,839)     |  |
|              | 合計時価比率 : 0.30%                      |            |                 |  |
| 投資証券計        |                                     |            | 2,321,666,681   |  |
|              |                                     |            | (2,321,666,681) |  |
|              |                                     |            |                 |  |
| 合計           |                                     |            | 2,713,101,352   |  |
|              |                                     |            | (2,713,101,352) |  |

- (注)1. 通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。  
 2. 合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。  
 3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

#### 有価証券明細表注記

#### 外貨建有価証券の内訳

| 通貨         | 銘柄数           | 組入時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|------------|---------------|--------|------------|
| 米ドル        | 投資証券 93銘柄     | 65.49% | 67.30%     |
| 英ポンド       | 投資証券 11銘柄     | 5.68%  | 5.83%      |
| カナダドル      | 投資証券 11銘柄     | 3.03%  | 3.11%      |
| ユーロ        | 投資証券 14銘柄     | 6.76%  | 6.94%      |
| 香港ドル       | 投資証券 5銘柄      | 2.03%  | 2.08%      |
| シンガポール・ドル  | 投資信託受益証券 9銘柄  | 3.01%  | 3.09%      |
| オーストラリアドル  | 投資信託受益証券 15銘柄 | 11.03% | 11.34%     |
| ニュージーランドドル | 投資証券 2銘柄      | 0.29%  | 0.30%      |

(注) 「組入時価比率」は小計金額の純資産に対する比率、「合計金額に対する比率」は小計金額の合計金額に対する比率であります。

#### 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。

[前へ](#)

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成24年5月31日現在

| 項 目            | 金額又は口数         |
|----------------|----------------|
| 資産総額           | 671,963,171円   |
| 負債総額           | 458,667円       |
| 純資産総額（ - ）     | 671,504,504円   |
| 発行済数量          | 1,114,140,000口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 0.6027円        |

（参考）マザーファンドの現況

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成24年5月31日現在

| 項 目            | 金額又は口数           |
|----------------|------------------|
| 資産総額           | 257,969,042,265円 |
| 負債総額           | 10,956,219,378円  |
| 純資産総額（ - ）     | 247,012,822,887円 |
| 発行済数量          | 254,415,901,273口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 0.9709円          |

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成24年5月31日現在

| 項 目            | 金額又は口数           |
|----------------|------------------|
| 資産総額           | 264,828,086,208円 |
| 負債総額           | 9,824,578,036円   |
| 純資産総額（ - ）     | 255,003,508,172円 |
| 発行済数量          | 212,111,407,348口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.2022円          |

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成24年5月31日現在

| 項 目            | 金額又は口数           |
|----------------|------------------|
| 資産総額           | 415,222,375,838円 |
| 負債総額           | 8,677,497,000円   |
| 純資産総額（ - ）     | 406,544,878,838円 |
| 発行済数量          | 351,782,605,724口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.1557円          |

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成24年5月31日現在

| 項 目        | 金額又は口数           |
|------------|------------------|
| 資産総額       | 356,647,086,487円 |
| 負債総額       | 10,102,040円      |
| 純資産総額（ - ） | 356,636,984,447円 |
| 発行済数量      | 308,195,322,985口 |

|                |         |
|----------------|---------|
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.1572円 |
|----------------|---------|

## J - R E I T インデックスファンド・マザーファンド

平成24年5月31日現在

| 項 目            | 金額又は口数         |
|----------------|----------------|
| 資産総額           | 4,747,797,308円 |
| 負債総額           | 18,704,177円    |
| 純資産総額（ - ）     | 4,729,093,131円 |
| 発行済数量          | 6,086,043,334口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 0.7770円        |

## グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成24年5月31日現在

| 項 目            | 金額又は口数         |
|----------------|----------------|
| 資産総額           | 2,618,146,482円 |
| 負債総額           | - 円            |
| 純資産総額（ - ）     | 2,618,146,482円 |
| 発行済数量          | 3,311,272,205口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 0.7907円        |

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

ファンドの受益権は振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

## (2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

## (3) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けるこ

とができます。

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益権の再分割

委託会社は、社振法に定めるところにしたがい、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### （１）資本金の額

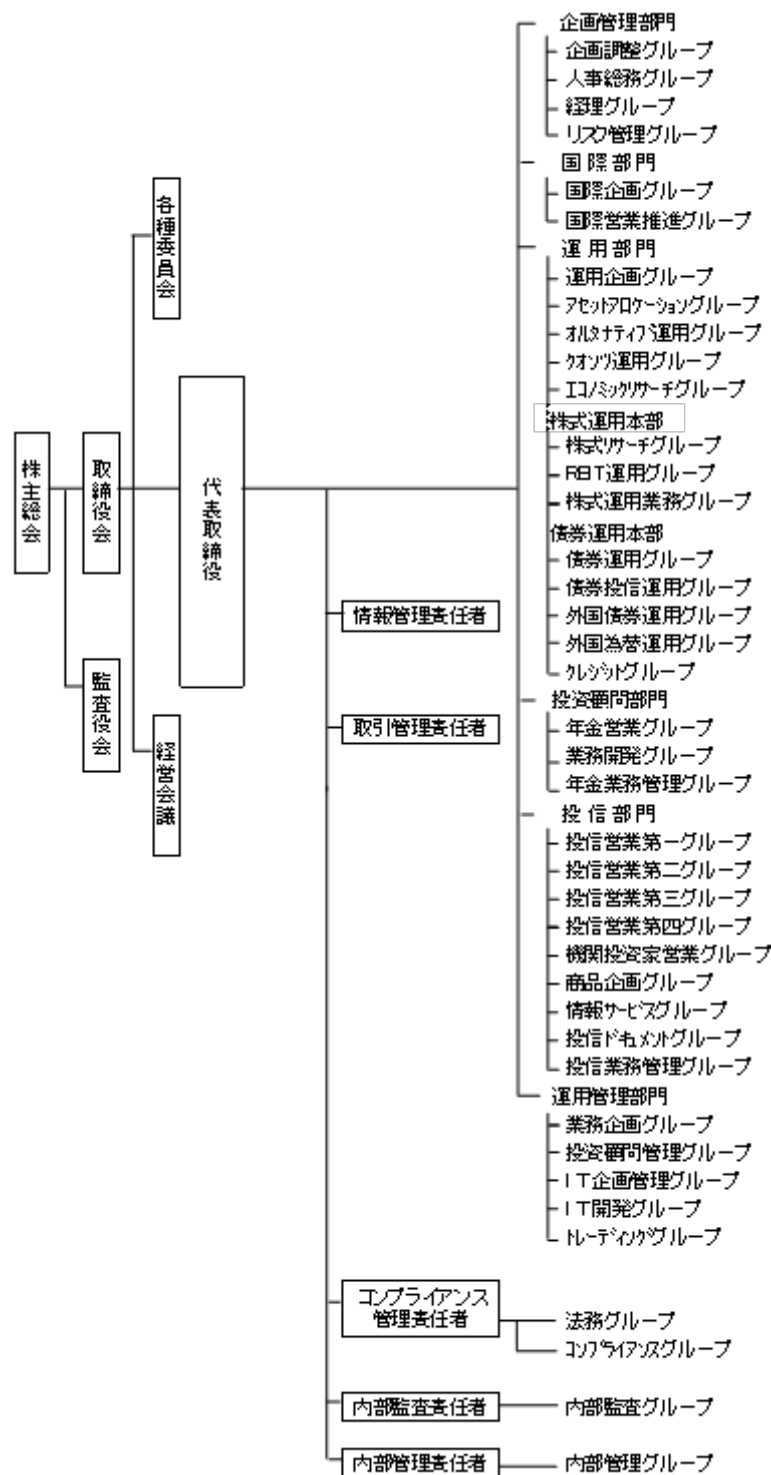
|               |         |
|---------------|---------|
| 本書提出日現在の資本金の額 | 20億円    |
| 発行する株式総数      | 80,000株 |
| 発行済株式総数       | 24,000株 |

##### 直近5ヵ年の資本金の変動

該当事項はありません。

##### （２）会社の機構

会社の組織図



上記組織は、平成24年5月31日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

## 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は就任後2年内の最終の決算期に関する定時株主総会の終結の時までです。ただし、補欠または増員で選任された取締役の任期は、現任取締役の任期の満了の時までとします。

取締役会は、代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議に従い業務を執行します。また、取締役会は、その決議をもって、取締役会長1名、取締役社長1名、取締役副社長1名、専務取締役および常務取締役若干名を置くことができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、原則として取締役社長が招集します。取締役会の議長は、原則として取締役社長がこれにあたります。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、議決に加わることができる取締役の過半数が出席し、出席取締役の過半数をもって行います。

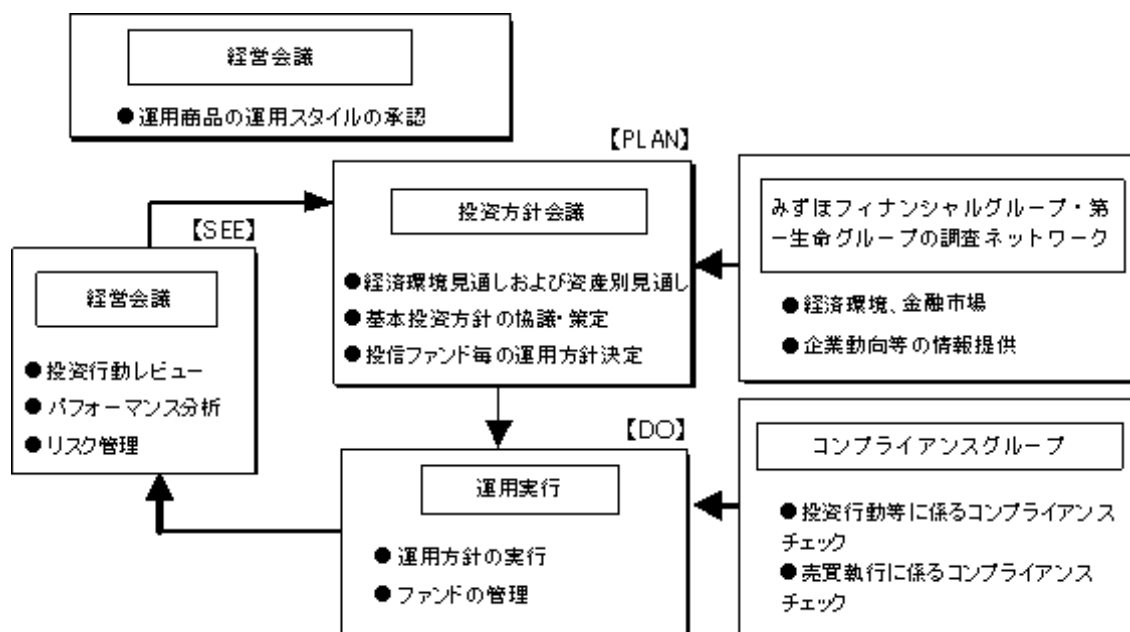
## 投資運用の意思決定機構

委託会社が運用指図権を有するファンドに係る運用スタイルの承認は、原則として月3回開催される経営会議のうち、月2回の経営会議において決定します。なお、議長は社長とします。

ファンド全般に係る経済環境見通しおよび資産別市場見通しならびにファンド毎の運用方針は、投資方針会議において協議し、策定します。投資方針会議は原則として月1回開催され、議長は運用部門担当取締役とします。

各ファンドにおける有価証券の売買等の意思決定は、原則として運用担当者が行います。すなわち、運用担当者は、投資方針会議において決定された運用方針を受けて、各ファンドの投資方針に基づき運用計画を策定し、有価証券への運用指図を行います。

運用担当者による運用計画の策定および有価証券等の運用指図に関する意思決定は、運用担当者自身の調査活動、アナリスト等の調査活動、その他の活動によって得られた当該有価証券等に関する情報に基づいて行われ、それらの活動の成果である各ファンドの投資運用の実績は、原則として月3回開催される経営会議のうち、月1回検討・評価されます。



上記体制は平成24年5月31日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「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り、投資信託の設定を行うとともに「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っています。

平成24年5月31日現在、委託会社の運用する投資信託は275本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

| 基本的性格         | 本数  | 純資産総額<br>(単位：円)   |
|---------------|-----|-------------------|
| 単位型株式投資信託     | 13  | 20,659,429,270    |
| 追加型株式投資信託     | 251 | 3,833,814,488,802 |
| 単位型公社債投資信託    | 10  | 77,770,455,346    |
| 追加型公社債投資信託    | 0   | 0                 |
| 証券投資信託以外の投資信託 | 1   | 173,491,762       |
| 合計            | 275 | 3,932,417,865,180 |

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第27期事業年度（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

|           | 第26期<br>(平成23年3月31日現在) | 第27期<br>(平成24年3月31日現在) |
|-----------|------------------------|------------------------|
| (資産の部)    |                        |                        |
| 流動資産      |                        |                        |
| 現金・預金     | 12,220,759             | 12,520,748             |
| 金銭の信託     | 5,967,344              | 6,548,577              |
| 前払費用      | 27,593                 | 25,744                 |
| 未収委託者報酬   | 2,942,180              | 2,780,527              |
| 未収運用受託報酬  | 1,061,935              | 1,167,998              |
| 未収投資助言報酬  | 2 267,240              | 2 241,851              |
| 未収収益      | 186,483                | 212,226                |
| 繰延税金資産    | 403,201                | 344,793                |
| その他       | 102,404                | 22,264                 |
| 流動資産計     | 23,179,143             | 23,864,733             |
| 固定資産      |                        |                        |
| 有形固定資産    | 400,967                | 470,082                |
| 建物        | 1 183,704              | 1 167,433              |
| 車両運搬具     | -                      | 1 4,752                |
| 器具備品      | 1 206,306              | 1 188,367              |
| 建設仮勘定     | 10,956                 | 109,529                |
| 無形固定資産    | 1,267,273              | 1,262,102              |
| 商標権       | 1 510                  | 1 383                  |
| ソフトウェア    | 1 780,190              | 1 1,101,685            |
| ソフトウェア仮勘定 | 478,971                | 152,513                |
| 電話加入権     | 7,148                  | 7,148                  |
| 電話施設利用権   | 1 451                  | 1 371                  |
| 投資その他の資産  | 4,252,397              | 3,982,258              |
| 投資有価証券    | 604,498                | 450,882                |
| 関係会社株式    | 2,457,319              | 2,119,074              |
| 繰延税金資産    | 402,191                | 590,822                |
| 長期差入保証金   | 702,696                | 731,197                |
| その他       | 85,690                 | 90,282                 |
| 固定資産計     | 5,920,638              | 5,714,444              |
| 資産合計      | 29,099,782             | 29,579,177             |

（単位：千円）

|              | 第26期<br>（平成23年3月31日現在） | 第27期<br>（平成24年3月31日現在） |
|--------------|------------------------|------------------------|
| （負債の部）       |                        |                        |
| 流動負債         |                        |                        |
| 預り金          | 120,910                | 132,805                |
| 未払金          | 1,479,756              | 1,460,128              |
| 未払収益分配金      | 3,223                  | 670                    |
| 未払償還金        | 98,362                 | 86,391                 |
| 未払手数料        | 1,134,992              | 1,088,348              |
| その他未払金       | 243,178                | 284,718                |
| 未払費用         | 2 1,226,658            | 2 1,105,512            |
| 未払法人税等       | 1,706,391              | 1,195,056              |
| 未払消費税等       | 143,728                | 92,354                 |
| 賞与引当金        | 575,326                | 574,646                |
| その他          | 10,000                 | -                      |
| 流動負債計        | 5,262,771              | 4,560,503              |
| 固定負債         |                        |                        |
| 退職給付引当金      | 579,063                | 680,768                |
| 役員退職慰労引当金    | 100,260                | 56,690                 |
| 固定負債計        | 679,324                | 737,458                |
| 負債合計         | 5,942,095              | 5,297,962              |
| （純資産の部）      |                        |                        |
| 株主資本         |                        |                        |
| 資本金          | 2,000,000              | 2,000,000              |
| 資本剰余金        | 2,428,478              | 2,428,478              |
| 資本準備金        | 2,428,478              | 2,428,478              |
| 利益剰余金        | 18,512,674             | 19,716,594             |
| 利益準備金        | 123,293                | 123,293                |
| その他利益剰余金     |                        |                        |
| 別途積立金        | 13,430,000             | 15,630,000             |
| 研究開発積立金      | 300,000                | 300,000                |
| 運用責任準備積立金    | 200,000                | 200,000                |
| 繰越利益剰余金      | 4,459,380              | 3,463,300              |
| 株主資本計        | 22,941,152             | 24,145,072             |
| 評価・換算差額等     |                        |                        |
| その他有価証券評価差額金 | 216,534                | 136,143                |
| 評価・換算差額等計    | 216,534                | 136,143                |
| 純資産合計        | 23,157,686             | 24,281,215             |
| 負債・純資産合計     | 29,099,782             | 29,579,177             |

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

|             | 第26期<br>(自 平成22年4月 1日<br>至 平成23年3月31日) |            | 第27期<br>(自 平成23年4月 1日<br>至 平成24年3月31日) |            |
|-------------|----------------------------------------|------------|----------------------------------------|------------|
| 営業収益        |                                        |            |                                        |            |
| 委託者報酬       | 24,367,005                             |            | 23,208,602                             |            |
| 運用受託報酬      | 4,458,894                              |            | 4,966,992                              |            |
| 投資助言報酬      | 1,019,727                              |            | 943,057                                |            |
| その他営業収益     | 789,867                                |            | 697,063                                |            |
| 営業収益計       |                                        | 30,635,495 |                                        | 29,815,715 |
| 営業費用        |                                        |            |                                        |            |
| 支払手数料       | 10,405,593                             |            | 10,154,958                             |            |
| 広告宣伝費       | 272,928                                |            | 164,286                                |            |
| 公告費         | 2,297                                  |            | -                                      |            |
| 調査費         | 4,755,890                              |            | 4,590,302                              |            |
| 調査費         | 2,611,173                              |            | 2,888,013                              |            |
| 委託調査費       | 2,144,716                              |            | 1,702,289                              |            |
| 委託計算費       | 338,206                                |            | 335,754                                |            |
| 営業雑経費       | 671,721                                |            | 496,565                                |            |
| 通信費         | 30,286                                 |            | 26,941                                 |            |
| 印刷費         | 585,041                                |            | 399,066                                |            |
| 協会費         | 23,561                                 |            | 25,014                                 |            |
| 諸会費         | 38                                     |            | 41                                     |            |
| 支払販売手数料     | 32,794                                 |            | 45,500                                 |            |
| 営業費用計       |                                        | 16,446,637 |                                        | 15,741,867 |
| 一般管理費       |                                        |            |                                        |            |
| 給料          | 4,576,265                              |            | 4,630,102                              |            |
| 役員報酬        | 1 235,289                              |            | 1 245,224                              |            |
| 給料・手当       | 3,768,114                              |            | 3,824,122                              |            |
| 賞与          | 572,860                                |            | 560,755                                |            |
| 交際費         | 38,997                                 |            | 35,987                                 |            |
| 寄付金         | 13,335                                 |            | 3,156                                  |            |
| 旅費交通費       | 255,190                                |            | 213,642                                |            |
| 租税公課        | 89,571                                 |            | 84,346                                 |            |
| 不動産賃借料      | 718,929                                |            | 656,463                                |            |
| 退職給付費用      | 139,773                                |            | 164,627                                |            |
| 固定資産減価償却費   | 486,987                                |            | 475,556                                |            |
| 福利厚生費       | 20,476                                 |            | 24,887                                 |            |
| 修繕費         | 20,842                                 |            | 6,721                                  |            |
| 賞与引当金繰入     | 575,326                                |            | 574,646                                |            |
| 役員退職慰労引当金繰入 | 42,036                                 |            | 30,048                                 |            |
| 役員退職金       | 13,140                                 |            | 27,503                                 |            |
| 機器リース料      | 1,951                                  |            | 1,510                                  |            |
| 事務委託費       | 331,935                                |            | 323,740                                |            |
| 消耗品費        | 70,952                                 |            | 58,739                                 |            |
| 器具備品費       | 575                                    |            | 2,889                                  |            |
| 諸経費         | 124,218                                |            | 114,695                                |            |
| 一般管理費計      |                                        | 7,520,506  |                                        | 7,429,267  |
| 営業利益        |                                        | 6,668,351  |                                        | 6,644,580  |

（単位：千円）

|              | 第26期<br>（自 平成22年4月 1日<br>至 平成23年3月31日） |           | 第27期<br>（自 平成23年4月 1日<br>至 平成24年3月31日） |           |
|--------------|----------------------------------------|-----------|----------------------------------------|-----------|
| 営業外収益        |                                        |           |                                        |           |
| 受取配当金        | 4                                      | 341,775   | 61,720                                 |           |
| 受取利息         |                                        | 9,168     | 3,921                                  |           |
| 時効成立分配金      |                                        | 2,574     | 11,383                                 |           |
| 為替差益         |                                        | -         | 1,660                                  |           |
| 投資信託解約益      |                                        | 157,213   | -                                      |           |
| 先物利益         |                                        | 9,816     | -                                      |           |
| 金銭の信託運用益     |                                        | 69,014    | -                                      |           |
| 雑収入          |                                        | 8,602     | 5,992                                  |           |
| 営業外収益計       |                                        | 598,165   |                                        | 84,678    |
| 営業外費用        |                                        |           |                                        |           |
| 為替差損         |                                        | 755       | -                                      |           |
| 時効成立後支払分配金   |                                        | -         | 36                                     |           |
| 金銭の信託運用損     |                                        | -         | 417,812                                |           |
| 雑損失          |                                        | 6,089     | 1,152                                  |           |
| 営業外費用計       |                                        | 6,844     |                                        | 419,001   |
| 経常利益         |                                        | 7,259,672 |                                        | 6,310,257 |
| 特別利益         |                                        |           |                                        |           |
| ゴルフ会員権売却益    |                                        | -         | 1,959                                  |           |
| 貸倒引当金戻入益     |                                        | 4,288     | -                                      |           |
| 過年度損益修正益     | 3, 4                                   | 105,241   | -                                      |           |
| 特別利益計        |                                        | 109,530   |                                        | 1,959     |
| 特別損失         |                                        |           |                                        |           |
| 固定資産除却損      | 2                                      | 31,419    | 2                                      | 36,415    |
| 固定資産売却損      |                                        | 1,440     |                                        | 381       |
| 関係会社株式評価損    |                                        | 3,825     |                                        | 338,244   |
| 特別損失計        |                                        | 36,684    |                                        | 375,042   |
| 税引前当期純利益     |                                        | 7,332,518 |                                        | 5,937,173 |
| 法人税、住民税及び事業税 |                                        | 2,885,426 |                                        | 2,582,251 |
| 法人税等調整額      |                                        | 7,586     |                                        | 56,997    |
| 法人税等合計       |                                        | 2,877,839 |                                        | 2,525,253 |
| 当期純利益        |                                        | 4,454,678 |                                        | 3,411,920 |

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

|           | 第26期<br>(自 平成22年4月 1日<br>至 平成23年3月31日) | 第27期<br>(自 平成23年4月 1日<br>至 平成24年3月31日) |
|-----------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 株主資本      |                                        |                                        |
| 資本金       |                                        |                                        |
| 当期首残高     | 2,000,000                              | 2,000,000                              |
| 当期変動額     | -                                      | -                                      |
| 当期末残高     | 2,000,000                              | 2,000,000                              |
| 資本剰余金     |                                        |                                        |
| 資本準備金     |                                        |                                        |
| 当期首残高     | 2,428,478                              | 2,428,478                              |
| 当期変動額     | -                                      | -                                      |
| 当期末残高     | 2,428,478                              | 2,428,478                              |
| 利益剰余金     |                                        |                                        |
| 利益準備金     |                                        |                                        |
| 当期首残高     | 123,293                                | 123,293                                |
| 当期変動額     | -                                      | -                                      |
| 当期末残高     | 123,293                                | 123,293                                |
| その他利益剰余金  |                                        |                                        |
| 別途積立金     |                                        |                                        |
| 当期首残高     | 11,650,000                             | 13,430,000                             |
| 当期変動額     | 1,780,000                              | 2,200,000                              |
| 当期末残高     | 13,430,000                             | 15,630,000                             |
| 研究開発積立金   |                                        |                                        |
| 当期首残高     | 300,000                                | 300,000                                |
| 当期変動額     | -                                      | -                                      |
| 当期末残高     | 300,000                                | 300,000                                |
| 運用責任準備積立金 |                                        |                                        |
| 当期首残高     | 200,000                                | 200,000                                |
| 当期変動額     | -                                      | -                                      |
| 当期末残高     | 200,000                                | 200,000                                |
| 繰越利益剰余金   |                                        |                                        |
| 当期首残高     | 3,464,702                              | 4,459,380                              |
| 当期変動額     |                                        |                                        |
| 剰余金の配当    | 1,680,000                              | 2,208,000                              |
| 別途積立金の積立  | 1,780,000                              | 2,200,000                              |
| 当期純利益     | 4,454,678                              | 3,411,920                              |
| 当期末残高     | 4,459,380                              | 3,463,300                              |
| 利益剰余金合計   |                                        |                                        |
| 当期首残高     | 15,737,995                             | 18,512,674                             |
| 当期変動額     | 2,774,678                              | 1,203,920                              |
| 当期末残高     | 18,512,674                             | 19,716,594                             |
| 株主資本合計    |                                        |                                        |
| 当期首残高     | 20,166,473                             | 22,941,152                             |

|          |              |            |            |
|----------|--------------|------------|------------|
|          | 当期変動額        | 2,774,678  | 1,203,920  |
|          | 当期末残高        | 22,941,152 | 24,145,072 |
| 評価・換算差額等 |              |            |            |
|          | その他有価証券評価差額金 |            |            |
|          | 当期首残高        | 231,525    | 216,534    |
|          | 当期変動額（純額）    | 14,991     | 80,390     |
|          | 当期末残高        | 216,534    | 136,143    |
| 純資産合計    |              |            |            |
|          | 当期首残高        | 20,397,999 | 23,157,686 |
|          | 当期変動額        | 2,759,687  | 1,123,529  |
|          | 当期末残高        | 23,157,686 | 24,281,215 |

[次へ](#)

## 重要な会計方針

| 項目                       | 第27期<br>(自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)                                                                                                                                                                                                                                           |
|--------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法       | (1) 子会社株式及び関連会社株式<br>：移動平均法による原価法<br><br>(2) その他有価証券<br>時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法<br>（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）<br>時価のないもの：移動平均法による原価法                                                                                                                           |
| 2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法      | 時価法                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 3. デリバティブの評価基準及び評価方法     | 時価法                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 4. 固定資産の減価償却の方法          | (1) 有形固定資産（リース資産を除く）<br>定率法によっております。<br>(2) 無形固定資産（リース資産を除く）<br>自社利用のソフトウェアについては、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。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。<br>(3) リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産）<br>リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法                                                       |
| 5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 | 外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。                                                                                                                                                                                                                        |
| 6. 引当金の計上基準              | (1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。<br>(2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。<br>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。<br>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。 |
| 7. リース取引の処理方法            | 所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。                                                                                                                                                                                    |
| 8. 消費税等の処理方法             | 税抜方式によっております。                                                                                                                                                                                                                                                              |

## 追加情報

| 第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）                                                                                                                        |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。 |

## 注記事項

（貸借対照表関係）

## 1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

|         | 第26期<br>（平成23年3月31日現在） | 第27期<br>（平成24年3月31日現在） |
|---------|------------------------|------------------------|
| 建物      | 484,832                | 513,080                |
| 車両運搬具   | -                      | 171                    |
| 器具備品    | 499,620                | 462,449                |
| 商標権     | 2,428                  | 2,555                  |
| ソフトウェア  | 809,403                | 961,584                |
| 電話施設利用権 | 1,145                  | 1,225                  |

## 2. 関係会社項目

関係会社に関する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。

（千円）

|      |          | 第26期<br>（平成23年3月31日現在） | 第27期<br>（平成24年3月31日現在） |
|------|----------|------------------------|------------------------|
| 流動資産 | 未収投資助言報酬 | 266,194                | 238,121                |
| 流動負債 | 未払費用     | 291,628                | 292,536                |

（損益計算書関係）

## 1. 役員報酬の限度額

（千円）

|         | 第26期<br>（自 平成22年4月 1日<br>至 平成23年3月31日） | 第27期<br>（自 平成23年4月 1日<br>至 平成24年3月31日） |
|---------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 取締役（年額） | 250,000                                | 250,000                                |
| 監査役（年額） | 50,000                                 | 50,000                                 |

## ２．固定資産除却損の内訳

（千円）

|        | 第26期<br>（自 平成22年4月 1日<br>至 平成23年3月31日） | 第27期<br>（自 平成23年4月 1日<br>至 平成24年3月31日） |
|--------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 建物     | 15,317                                 | 1,892                                  |
| 器具備品   | 3,597                                  | 18,917                                 |
| ソフトウェア | 12,503                                 | 15,606                                 |

## ３．過年度損益修正益の内訳

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

特別利益の過年度損益修正益は、過年度の調査費の過大計上分の戻し入れであります。

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

該当事項はありません。

## ４．関係会社項目

各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。

（千円）

|          | 第26期<br>（自 平成22年4月 1日<br>至 平成23年3月31日） | 第27期<br>（自 平成23年4月 1日<br>至 平成24年3月31日） |
|----------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 受取配当金    | 331,240                                | -                                      |
| 過年度損益修正益 | 105,241                                | -                                      |

（株主資本等変動計算書関係）

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

## １．発行済株式の種類及び総数に関する事項

| 発行済株式の種類 | 当事業年度期首<br>株式数（株） | 当事業年度<br>増加株式数（株） | 当事業年度<br>減少株式数（株） | 当事業年度末<br>株式数（株） |
|----------|-------------------|-------------------|-------------------|------------------|
| 普通株式     | 24,000            | -                 | -                 | 24,000           |
| 合計       | 24,000            | -                 | -                 | 24,000           |

## ２．配当に関する事項

## （１）配当金支払額

| 決議 | 株式の<br>種類 | 配当金の<br>総額<br>（千円） | 1株当たり<br>配当額<br>（円） | 基準日 | 効力発生日 |
|----|-----------|--------------------|---------------------|-----|-------|
|----|-----------|--------------------|---------------------|-----|-------|

|                      |          |           |        |            |           |
|----------------------|----------|-----------|--------|------------|-----------|
| 平成22年6月30日<br>定時株主総会 | 普通<br>株式 | 1,680,000 | 70,000 | 平成22年3月31日 | 平成22年7月1日 |
|----------------------|----------|-----------|--------|------------|-----------|

## (2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

| 決議                   | 株式の<br>種類 | 配当の<br>原資 | 配当金の<br>総額<br>(千円) | 1株当たり<br>配当額<br>(円) | 基準日        | 効力発生日      |
|----------------------|-----------|-----------|--------------------|---------------------|------------|------------|
| 平成23年6月28日<br>定時株主総会 | 普通<br>株式  | 利益剰<br>余金 | 2,208,000          | 92,000              | 平成23年3月31日 | 平成23年6月29日 |

## 第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

| 発行済株式の種類 | 当事業年度期首<br>株式数（株） | 当事業年度<br>増加株式数（株） | 当事業年度<br>減少株式数（株） | 当事業年度末<br>株式数（株） |
|----------|-------------------|-------------------|-------------------|------------------|
| 普通株式     | 24,000            | -                 | -                 | 24,000           |
| 合計       | 24,000            | -                 | -                 | 24,000           |

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

| 決議                   | 株式の<br>種類 | 配当金の<br>総額<br>(千円) | 1株当たり<br>配当額<br>(円) | 基準日        | 効力発生日      |
|----------------------|-----------|--------------------|---------------------|------------|------------|
| 平成23年6月28日<br>定時株主総会 | 普通<br>株式  | 2,208,000          | 92,000              | 平成23年3月31日 | 平成23年6月29日 |

## (2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

平成24年6月29日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

| 決議                   | 株式の<br>種類 | 配当の<br>原資 | 配当金の<br>総額<br>(千円) | 1株当たり<br>配当額<br>(円) | 基準日        | 効力発生日     |
|----------------------|-----------|-----------|--------------------|---------------------|------------|-----------|
| 平成24年6月29日<br>定時株主総会 | 普通<br>株式  | 利益剰<br>余金 | 2,712,000          | 113,000             | 平成24年3月31日 | 平成24年7月2日 |

## （リース取引関係）

## 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

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額

（千円）

|      | 第26期<br>（平成23年3月31日現在） |                |             | 第27期<br>（平成24年3月31日現在） |                |             |
|------|------------------------|----------------|-------------|------------------------|----------------|-------------|
|      | 取得価額<br>相当額            | 減価償却累<br>計額相当額 | 期末残高<br>相当額 | 取得価額<br>相当額            | 減価償却累<br>計額相当額 | 期末残高<br>相当額 |
| 器具備品 | 46,681                 | 46,138         | 543         | -                      | -              | -           |
| その他  | -                      | -              | -           | -                      | -              | -           |
| 合計   | 46,681                 | 46,138         | 543         | -                      | -              | -           |

未経過リース料期末残高相当額

（千円）

|      | 第26期<br>（平成23年3月31日現在） | 第27期<br>（平成24年3月31日現在） |
|------|------------------------|------------------------|
| 一年以内 | 586                    | -                      |
| 一年超  | -                      | -                      |
| 合計   | 586                    | -                      |

支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

（千円）

|          | 第26期<br>（自 平成22年4月 1日<br>至 平成23年3月31日） | 第27期<br>（自 平成23年4月 1日<br>至 平成24年3月31日） |
|----------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 支払リース料   | 15,998                                 | 588                                    |
| 減価償却費相当額 | 14,995                                 | 543                                    |
| 支払利息相当額  | 234                                    | 1                                      |

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

リース料総額とリース資産の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。

## 2. オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料期末残高相当額

（千円）

|      | 第26期<br>（平成23年3月31日現在） | 第27期<br>（平成24年3月31日現在） |
|------|------------------------|------------------------|
| 一年以内 | 1,475                  | -                      |
| 一年超  | -                      | -                      |

|    |       |   |
|----|-------|---|
| 合計 | 1,475 | - |
|----|-------|---|

## （金融商品関係）

### 1. 金融商品の状況に関する事項

#### (1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

デリバティブ取引は、後述するリスクを低減する目的で行っております。取引は実需の範囲内でのみ利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。

取引の方針については社内会議で審議のうえ個別決裁により決定し、取引の実行とその内容の確認についてはそれぞれ担当所管を分離して実行しております。

#### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

金銭の信託の主な内容は、当社運用ファンドの安定運用を主な目的として資金投入した投資信託及びデリバティブ取引であります。金銭の信託に含まれる投資信託は為替及び市場価格の変動リスクに晒されておりますが、デリバティブ取引を利用して一部リスクを低減しております。

長期差入保証金の主な内容は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金であります。

金銭の信託に含まれるデリバティブ取引は為替予約取引、株価指数先物取引および債券先物取引であり、金銭の信託に含まれる投資信託に係る為替および市場価格の変動リスクを低減する目的で行っております。

#### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

為替相場及び株式相場の変動によるリスクを有しておりますが、取引先は信用度の高い金融機関に限定しているため、相手方の契約不履行によるリスクはほとんどないと認識しております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

組織規程における分掌業務の定めに基づき、リスク管理担当所管にて、取引残高、損益及びリスク量等の実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

取引実行担当所管からの報告に基づき、資金管理担当所管が資金繰計画を確認するとともに、十分な手許流動性を維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。

#### (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注2）参照）。

### 第26期（平成23年3月31日現在）

|                      | 貸借対照表計上額<br>（千円） | 時価<br>（千円） | 差額<br>（千円） |
|----------------------|------------------|------------|------------|
| (1) 現金・預金            | 12,220,759       | 12,220,759 | -          |
| (2) 金銭の信託            | 5,967,344        | 5,967,344  | -          |
| (3) 投資有価証券<br>其他有価証券 | 524,252          | 524,252    | -          |
| 資産計                  | 18,712,356       | 18,712,356 | -          |
| (1) 未払法人税等           | 1,706,391        | 1,706,391  | -          |
| 負債計                  | 1,706,391        | 1,706,391  | -          |

### 第27期（平成24年3月31日現在）

|                      | 貸借対照表計上額<br>（千円） | 時価<br>（千円） | 差額<br>（千円） |
|----------------------|------------------|------------|------------|
| (1) 現金・預金            | 12,520,748       | 12,520,748 | -          |
| (2) 金銭の信託            | 6,548,577        | 6,548,577  | -          |
| (3) 投資有価証券<br>其他有価証券 | 370,636          | 370,636    | -          |
| 資産計                  | 19,439,962       | 19,439,962 | -          |
| (1) 未払法人税等           | 1,195,056        | 1,195,056  | -          |
| 負債計                  | 1,195,056        | 1,195,056  | -          |

#### （注1）金融商品の時価の算定方法

##### 資 産

##### （1）現金・預金

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

##### （2）金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

##### （3）投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

##### 負 債

##### （1）未払法人税等

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（千円）

| 区分      | 第26期<br>（平成23年3月31日現在） | 第27期<br>（平成24年3月31日現在） |
|---------|------------------------|------------------------|
| 非上場株式   | 80,246                 | 80,246                 |
| 関係会社株式  | 2,457,319              | 2,119,074              |
| 長期差入保証金 | 702,696                | 731,197                |

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載していません。

長期差入保証金は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等であり、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載していません。

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第26期（平成23年3月31日現在）

|       | 1年以内<br>（千円） | 1年超5年以内<br>（千円） | 5年超10年以内<br>（千円） | 10年超<br>（千円） |
|-------|--------------|-----------------|------------------|--------------|
| （1）預金 | 12,220,413   | -               | -                | -            |
| 合計    | 12,220,413   | -               | -                | -            |

第27期（平成24年3月31日現在）

|       | 1年以内<br>（千円） | 1年超5年以内<br>（千円） | 5年超10年以内<br>（千円） | 10年超<br>（千円） |
|-------|--------------|-----------------|------------------|--------------|
| （1）預金 | 12,520,524   | -               | -                | -            |
| 合計    | 12,520,524   | -               | -                | -            |

（注4）社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

（有価証券関係）

1．売買目的有価証券

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（第26期の貸借対照表計上額2,457,319千円、第27期の貸借対照表計上額2,119,074千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

## 4. その他有価証券

第26期（平成23年3月31日現在）

（千円）

| 区 分                      | 貸借対照表日における<br>貸借対照表計上額 | 取得原価    | 差額      |
|--------------------------|------------------------|---------|---------|
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えるもの  |                        |         |         |
| 株式                       | 513,129                | 146,101 | 367,027 |
| 債券                       | -                      | -       | -       |
| その他（投資信託）                | 3,400                  | 3,000   | 400     |
| 小計                       | 516,529                | 149,101 | 367,427 |
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えないもの |                        |         |         |
| 株式                       | -                      | -       | -       |
| 債券                       | -                      | -       | -       |
| その他（投資信託）                | 7,723                  | 10,000  | 2,277   |
| 小計                       | 7,723                  | 10,000  | 2,277   |
| 合計                       | 524,252                | 159,101 | 365,150 |

（注）非上場株式（貸借対照表計上額80,246千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第27期（平成24年3月31日現在）

（千円）

| 区 分                      | 貸借対照表日における<br>貸借対照表計上額 | 取得原価    | 差額      |
|--------------------------|------------------------|---------|---------|
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えるもの  |                        |         |         |
| 株式                       | 359,540                | 146,101 | 213,438 |
| 債券                       | -                      | -       | -       |
| その他（投資信託）                | 3,482                  | 3,000   | 482     |
| 小計                       | 363,022                | 149,101 | 213,920 |
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えないもの |                        |         |         |
| 株式                       | -                      | -       | -       |
| 債券                       | -                      | -       | -       |
| その他（投資信託）                | 7,614                  | 10,000  | 2,386   |
| 小計                       | 7,614                  | 10,000  | 2,386   |
| 合計                       | 370,636                | 159,101 | 211,534 |

（注）非上場株式（貸借対照表計上額80,246千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## 5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

（千円）

| 区分        | 売却額     | 売却益の合計  | 売却損の合計 |
|-----------|---------|---------|--------|
| その他（投資信託） | 719,016 | 162,043 | 4,830  |

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

該当事項はありません。

## 7. 減損処理を行った有価証券

当事業年度において、関係会社株式について338,244千円減損処理を行っております。

（金銭の信託関係）

## 1. 運用目的の金銭の信託

第26期（平成23年3月31日現在）

|            | 貸借対照表日における<br>貸借対照表計上額（千円） | 当事業年度の損益に含まれた<br>評価差額（千円） |
|------------|----------------------------|---------------------------|
| 運用目的の金銭の信託 | 5,967,344                  | 119,701                   |

第27期（平成24年3月31日現在）

|            | 貸借対照表日における<br>貸借対照表計上額（千円） | 当事業年度の損益に含まれた<br>評価差額（千円） |
|------------|----------------------------|---------------------------|
| 運用目的の金銭の信託 | 6,548,577                  | 495,939                   |

## 2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

## 3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

## （退職給付関係）

## 1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

## 2．退職給付債務に関する事項

（千円）

|                | 第26期<br>（平成23年3月31日現在） | 第27期<br>（平成24年3月31日現在） |
|----------------|------------------------|------------------------|
| （１）退職給付債務      | 636,624                | 740,560                |
| （２）未認識数理計算上の差異 | 57,560                 | 59,792                 |
| 退職給付引当金        | 579,063                | 680,768                |

## 3．退職給付費用に関する事項

（千円）

|                   | 第26期<br>（自平成22年4月1日<br>至平成23年3月31日） | 第27期<br>（自平成23年4月1日<br>至平成24年3月31日） |
|-------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| （１）勤務費用           | 85,216                              | 102,728                             |
| （２）利息費用           | 7,954                               | 9,549                               |
| （３）数理計算上の差異の費用処理額 | 9,383                               | 13,388                              |
| （４）確定拠出年金 拠出額     | 37,218                              | 38,960                              |
| 退職給付費用            | 139,773                             | 164,627                             |

## 4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

## （１）割引率

| 第26期<br>（自平成22年4月1日<br>至平成23年3月31日） | 第27期<br>（自平成23年4月1日<br>至平成24年3月31日） |
|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 1.5%                                | 1.5%                                |

## （２）退職給付見込額の期間配分方法

期間定額基準

## （３）数理計算上の差異の処理年数

5年（各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理する方法）

（税効果会計関係）

## 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

|                 | 第26期<br>(平成23年3月31日現在) | 第27期<br>(平成24年3月31日現在) |
|-----------------|------------------------|------------------------|
|                 | (千円)                   | (千円)                   |
| 繰延税金資産          |                        |                        |
| 未払事業税           | 128,299                | 87,682                 |
| 未払事業所税          | 6,141                  | 5,792                  |
| 賞与引当金           | 234,157                | 218,423                |
| 未払法定福利費         | 28,823                 | 24,791                 |
| 未払確定拠出年金掛金      | 2,739                  | 2,607                  |
| 減価償却超過額（一括償却資産） | 3,039                  | 5,496                  |
| 減価償却超過額         | 36,256                 | 150,369                |
| 繰延資産償却超過額（税法上）  | 139,027                | 47,261                 |
| 退職給付引当金         | 235,678                | 243,845                |
| 役員退職慰労引当金       | 40,806                 | 20,204                 |
| ゴルフ会員権評価損       | 5,577                  | 2,138                  |
| 投資有価証券評価損       | 763                    | 4,410                  |
| 関係会社株式評価損       | 1,556                  | 121,913                |
| その他有価証券評価差額金    | -                      | 678                    |
| 貸倒引当金繰入額        | -                      | -                      |
| 繰延税金資産合計        | 862,867                | 935,615                |
| 繰延税金負債          |                        |                        |
| その他有価証券評価差額金    | 57,474                 | -                      |
| 繰延税金負債合計        | 57,474                 | -                      |
| 差引繰延税金資産の純額     | 805,393                | 935,615                |

## 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差異の原因となった主要な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

## 3. 法人税率の変更等による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げ及び復興特別法人税の課税が行われることになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の40.7%から、平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については38.01%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については35.64%となります。

この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は98,284千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は108,988千円増加し、その他有価証券評価差額金は10,703千円増加しております。

## （セグメント情報等）

## １．セグメント情報

当社は、投資信託及び投資顧問を主とした資産運用業の単一事業であるため、記載を省略しております。

## ２．関連情報

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

## （１）サービスごとの情報

|      | 投資信託<br>（千円） | 投資顧問<br>（千円） | その他<br>（千円） | 合計<br>（千円） |
|------|--------------|--------------|-------------|------------|
| 営業収益 | 24,367,005   | 5,478,622    | 789,867     | 30,635,495 |

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## （２）地域ごとの情報

## 営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 有形固定資産

当社は、本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

## （３）主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

## （１）サービスごとの情報

|      | 投資信託<br>（千円） | 投資顧問<br>（千円） | その他<br>（千円） | 合計<br>（千円） |
|------|--------------|--------------|-------------|------------|
| 営業収益 | 23,208,602   | 5,910,049    | 697,063     | 29,815,715 |

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## （２）地域ごとの情報

## 営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 有形固定資産

当社は、本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

## （３）主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

## （関連当事者との取引）

## (1)親会社及び法人主要株主等

## 第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

| 属性       | 会社等の名称     | 住所      | 資本金<br>又は出<br>資金 | 事業の<br>内容又<br>は職業 | 議決権等<br>の所有<br>(被所有)<br>割合 | 関係内容             |            | 取引の内容          | 取引金額<br>(千円) | 科目       | 期末<br>残高<br>(千円) |
|----------|------------|---------|------------------|-------------------|----------------------------|------------------|------------|----------------|--------------|----------|------------------|
|          |            |         |                  |                   |                            | 役員の<br>兼任等       | 事業上の<br>関係 |                |              |          |                  |
| その他の関係会社 | 第一生命保険株式会社 | 東京都千代田区 | 2,102億円          | 生命保険業             | (被所有)直接50%                 | 兼務1名, 出向3名, 転籍2名 | 資産運用の助言    | 資産運用の助言の顧問料の受入 | 710,392      | 未収投資助言報酬 | 190,149          |

## 第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

| 属性       | 会社等の名称     | 住所      | 資本金<br>又は出<br>資金 | 事業の<br>内容又<br>は職業 | 議決権等<br>の所有<br>(被所有)<br>割合 | 関係内容             |            | 取引の内容          | 取引金額<br>(千円) | 科目       | 期末<br>残高<br>(千円) |
|----------|------------|---------|------------------|-------------------|----------------------------|------------------|------------|----------------|--------------|----------|------------------|
|          |            |         |                  |                   |                            | 役員の<br>兼任等       | 事業上の<br>関係 |                |              |          |                  |
| その他の関係会社 | 第一生命保険株式会社 | 東京都千代田区 | 2,102億円          | 生命保険業             | (被所有)直接50%                 | 兼務1名, 出向2名, 転籍3名 | 資産運用の助言    | 資産運用の助言の顧問料の受入 | 687,972      | 未収投資助言報酬 | 177,282          |

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。

（注2）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

## (2)子会社等

## 第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

| 属性          | 会社等の名称                         | 住所                          | 資本金<br>又は出<br>資金 | 事業の<br>内容又<br>は職業 | 議決権<br>等の所有(被所有)割合 | 関係内容           |                   | 取引の<br>内容                    | 取引<br>金額<br>(千円) | 科目       | 期末<br>残高<br>(千円) |
|-------------|--------------------------------|-----------------------------|------------------|-------------------|--------------------|----------------|-------------------|------------------------------|------------------|----------|------------------|
|             |                                |                             |                  |                   |                    | 役員<br>の兼<br>任等 | 事業上<br>の関係        |                              |                  |          |                  |
| 子<br>会<br>社 | DIAM<br>International<br>Ltd   | London<br>United<br>kingdom | 4,000<br>千GBP    | 資産の<br>運用         | (所有)<br>直接<br>100% | 兼務<br>2名       | 当社預<br>り資産<br>の運用 | 当社預り<br>資産の運<br>用の顧問<br>料の支払 | 646,432          | 未払<br>費用 | 172,736          |
|             | DIAM U.S.A.,<br>Inc.           | New York<br>U.S.A.          | 4,000<br>千USD    | 資産の<br>運用         | (所有)<br>直接<br>100% | 兼務<br>2名       | 当社預<br>り資産<br>の運用 | 当社預り<br>資産の運<br>用の顧問<br>料の支払 | 224,694          | 未払<br>費用 | 88,837           |
|             | DIAM<br>SINGAPORE<br>PTE. LTD. | Central<br>Singapore        | 700,000<br>千円    | 資産の<br>運用         | (所有)<br>直接<br>100% | -              | なし                | 増資の引<br>受                    | 300,000          | -        | -                |

## 第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

| 属性          | 会社等の名称                       | 住所                          | 資本金<br>又は出<br>資金 | 事業の<br>内容又<br>は職業 | 議決権<br>等の所有(被所有)割合 | 関係内容           |                   | 取引の<br>内容                    | 取引<br>金額<br>(千円) | 科目       | 期末<br>残高<br>(千円) |
|-------------|------------------------------|-----------------------------|------------------|-------------------|--------------------|----------------|-------------------|------------------------------|------------------|----------|------------------|
|             |                              |                             |                  |                   |                    | 役員<br>の兼<br>任等 | 事業上<br>の関係        |                              |                  |          |                  |
| 子<br>会<br>社 | DIAM<br>International<br>Ltd | London<br>United<br>kingdom | 4,000<br>千GBP    | 資産の<br>運用         | (所有)<br>直接<br>100% | 兼務<br>2名       | 当社預<br>り資産<br>の運用 | 当社預り<br>資産の運<br>用の顧問<br>料の支払 | 523,845          | 未払<br>費用 | 158,645          |
|             | DIAM U.S.A.,<br>Inc.         | New York<br>U.S.A.          | 4,000<br>千USD    | 資産の<br>運用         | (所有)<br>直接<br>100% | 兼務<br>2名       | 当社預<br>り資産<br>の運用 | 当社預り<br>資産の運<br>用の顧問<br>料の支払 | 203,092          | 未払<br>費用 | 75,484           |

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

（注2）上記の取引金額及び期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

（注3）増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

## (3)兄弟会社等

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

| 属性                   | 会社等の<br>名称                                 | 住所              | 資本金<br>又は出<br>資金 | 事業の<br>内容又<br>は職業 | 議決権<br>等の所<br>有(被<br>所有)<br>割合 | 関係内容           |                                      | 取引の<br>内容                    | 取引<br>金額<br>(千円) | 科目        | 期末<br>残高<br>(千円) |
|----------------------|--------------------------------------------|-----------------|------------------|-------------------|--------------------------------|----------------|--------------------------------------|------------------------------|------------------|-----------|------------------|
|                      |                                            |                 |                  |                   |                                | 役員<br>の兼<br>任等 | 事業上<br>の関係                           |                              |                  |           |                  |
| その他の<br>関係会社<br>の子会社 | 株式会社<br>みずほ銀行                              | 東京都<br>千代田<br>区 | 7,000<br>億円      | 銀行業               | -                              | -              | 当社設<br>定投資<br>信託の<br>販売、<br>預金取<br>引 | 投資信託の<br>販売代行手<br>数料         | 1,538,792        | 未払<br>手数料 | 108,444          |
|                      |                                            |                 |                  |                   |                                |                |                                      | 預金の預入<br>(純額)                | 112,401          | 現金・<br>預金 | 524,914          |
|                      |                                            |                 |                  |                   |                                |                |                                      | 受取利息                         | 156              | 未収<br>収益  | -                |
|                      | 株式会社<br>みずほコ<br>ーポレー<br>ト銀行                | 東京都<br>千代田<br>区 | 14,040<br>億円     | 銀行業               | -                              | -              | 当社設<br>定投資<br>信託の<br>販売、<br>預金取<br>引 | 投資信託の<br>販売代行手<br>数料         | 536,163          | 未払<br>手数料 | 89,649           |
|                      |                                            |                 |                  |                   |                                |                |                                      | 預金の引出<br>(純額)                | 1,524,876        | 現金・<br>預金 | 11,047,758       |
|                      |                                            |                 |                  |                   |                                |                |                                      | 受取利息                         | 7,802            | 未収<br>収益  | -                |
|                      | みずほ第<br>一フィナ<br>ンシャル<br>テクノロ<br>ジー株式<br>会社 | 東京都<br>千代田<br>区 | 2億円              | 金融<br>技術<br>研究等   | -                              | -              | 当社預<br>り資産<br>の助言                    | 当社預り資<br>産の助言の<br>顧問料の支<br>払 | 198,967          | 未払<br>費用  | 94,085           |
|                      |                                            |                 |                  |                   |                                |                |                                      | 業務委託料<br>の支払                 | 17,740           | 未払<br>費用  | 21,598           |
|                      | 資産管理<br>サービス<br>信託銀行<br>株式会社               | 東京都<br>中央区      | 500<br>億円        | 資産管<br>理等         | -                              | -              | 当社信<br>託財産<br>の運用                    | 信託元本の<br>追加<br>(純額)          | 5,500,000        | 金銭の<br>信託 | 5,967,344        |
|                      |                                            |                 |                  |                   |                                |                |                                      | 信託報酬の<br>支払                  | 3,163            |           |                  |

## 第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

| 属性                       | 会社等の<br>名称                                 | 住所              | 資本金<br>又は出<br>資金 | 事業の<br>内容又<br>は職業 | 議決権<br>等の所<br>有(被<br>所有)<br>割合 | 関係内容           |                                      | 取引の<br>内容                    | 取引金額<br>(千円) | 科目        | 期末<br>残高<br>(千円) |
|--------------------------|--------------------------------------------|-----------------|------------------|-------------------|--------------------------------|----------------|--------------------------------------|------------------------------|--------------|-----------|------------------|
|                          |                                            |                 |                  |                   |                                | 役員<br>の兼<br>任等 | 事業上<br>の関係                           |                              |              |           |                  |
| その他の<br>関係会<br>社の子<br>会社 | 株式会社<br>みずほ銀<br>行                          | 東京都<br>千代田<br>区 | 7,000<br>億円      | 銀行業               | -                              | -              | 当社設<br>定投資<br>信託の<br>販売、<br>預金取<br>引 | 投資信託の<br>販売代行手<br>数料         | 1,548,354    | 未払<br>手数料 | 122,786          |
|                          |                                            |                 |                  |                   |                                |                |                                      | 預金の引出<br>(純額)                | 91,135       | 現金・<br>預金 | 433,779          |
|                          |                                            |                 |                  |                   |                                |                |                                      | 受取利息                         | 104          | 未収<br>収益  | -                |
|                          | 株式会社<br>みずほコ<br>ーポレー<br>ト銀行                | 東京都<br>千代田<br>区 | 14,040<br>億円     | 銀行業               | -                              | -              | 当社設<br>定投資<br>信託の<br>販売、<br>預金取<br>引 | 投資信託の<br>販売代行手<br>数料         | 450,766      | 未払<br>手数料 | 83,446           |
|                          |                                            |                 |                  |                   |                                |                |                                      | 預金の預入<br>(純額)                | 392,267      | 現金・<br>預金 | 11,440,025       |
|                          |                                            |                 |                  |                   |                                |                |                                      | 受取利息                         | 3,654        | 未収<br>収益  | -                |
|                          | みずほ第<br>一フィナ<br>ンシャル<br>テクノロ<br>ジー株式<br>会社 | 東京都<br>千代田<br>区 | 2億円              | 金融<br>技術<br>研究等   | -                              | -              | 当社預<br>り資産<br>の助言                    | 当社預り資<br>産の助言の<br>顧問料の支<br>払 | 237,031      | 未払<br>費用  | 127,757          |
|                          |                                            |                 |                  |                   |                                |                |                                      | 業務委託料<br>の支払                 | 15,140       | 未払<br>費用  | 6,373            |
|                          | 資産管理<br>サービス<br>信託銀行<br>株式会社               | 東京都<br>中央区      | 500<br>億円        | 資産管<br>理等         | -                              | -              | 当社信<br>託財産<br>の運用                    | 信託元本の<br>追加<br>(純額)          | 1,000,000    | 金銭の<br>信託 | 6,548,577        |
|                          |                                            |                 |                  |                   |                                |                |                                      | 信託報酬の<br>支払                  | 5,087        |           |                  |

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

（注2）資産の助言の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

（注3）業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。

（注4）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税が含まれております。

（注5）預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

（注6）信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

## （1株当たり情報）

|              | 第26期<br>（自 平成22年4月 1日<br>至 平成23年3月31日） | 第27期<br>（自 平成23年4月 1日<br>至 平成24年3月31日） |
|--------------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 1株当たり純資産額    | 964,903円60銭                            | 1,011,717円32銭                          |
| 1株当たり当期純利益金額 | 185,611円60銭                            | 142,163円33銭                            |

（注1）潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債及び転換社債を発行していないため記載しておりません。

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

|              | 第26期<br>（自 平成22年4月 1日<br>至 平成23年3月31日） | 第27期<br>（自 平成23年4月 1日<br>至 平成24年3月31日） |
|--------------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 当期純利益        | 4,454,678千円                            | 3,411,920千円                            |
| 普通株主に帰属しない金額 | -                                      | -                                      |
| 普通株式に係る当期純利益 | 4,454,678千円                            | 3,411,920千円                            |
| 期中平均株式数      | 24,000株                                | 24,000株                                |

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（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うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の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うことを内容とした運用を行うこと。
- (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) 定款の変更等

平成21年6月29日付で、定款について次の変更をいたしました。

・株券不発行に伴う対応および役付取締役（取締役会長職）追加に伴う変更

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社及びファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

### 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

- a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

- b. 資本金の額

平成24年3月末日現在 247,369百万円

- c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

- (2) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の「販売会社一覧表」の通りです。

（平成24年3月末日現在）

| 名 称 | 資本金の額<br>(単位:百万円) | 事 業 の 内 容 |
|-----|-------------------|-----------|
|-----|-------------------|-----------|

|             |       |                                  |
|-------------|-------|----------------------------------|
| マネックス証券株式会社 | 7,425 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。 |
|-------------|-------|----------------------------------|

## (3)投資顧問会社

## a. 名称

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社

## b. 資本金の額

平成24年3月末日現在 9,557.5万円

## c. 事業の内容

日本において投資顧問業務を営んでいます。

## (4)投資顧問会社

## a. 名称

DIAM International Ltd

## b. 資本金の額

平成23年12月末日現在 400万ポンド

## c. 事業の内容

イギリスにおいて投資顧問業務を営んでいます。

**2【関係業務の概要】**

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2) 信託財産の計算
- (3) 信託財産に関する報告書の作成
- (4) その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集の取扱い
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 信託契約の一部解約事務
- (4) 受益者に対する収益分配金、一部解約金および償還金の支払い
- (5) 受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付
- (6) その他上記に付帯する業務

**3【資本関係】**

委託会社は、DIAM International Ltdの株式について100%保有しています。

その他委託会社と上記関係法人間に資本関係はありません。

**第3【参考情報】**

当ファンドについては、当特定期間の間に、次の書類を提出いたしました。

| 書 類 名   | 提 出 年 月 日                         |
|---------|-----------------------------------|
| 有価証券報告書 | 平成24年2月10日                        |
| 有価証券届出書 | 平成24年2月10日                        |
| 臨時報告書   | 平成23年11月21日、平成24年1月20日、平成24年3月21日 |

## 独立監査人の監査報告書

平成24年6月26日

D I A M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 印  
業務執行社員指 定 社 員 公認会計士 和 田 渉 印  
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」に掲げられているマネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞の平成23年11月12日から平成24年5月11日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞の平成24年5月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

D I A M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

---

上記は、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。  
財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれていません。

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成24年6月8日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

### 新日本有限責任監査法人

|                    |       |         |
|--------------------|-------|---------|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 山内 正彦 印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 浅野 功 印  |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 近藤 敏弘 印 |

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D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第27期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

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

#### 利害関係

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

以上

（注）上記は、独立監査人の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。