

【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5月15日
【計算期間】	第9期 （自 平成23年8月16日 至 平成24年2月15日）
【ファンド名】	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド （株式資産）
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 村上 雅彦
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	雄谷 敦史
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】**第1【ファンドの状況】****1【ファンドの性格】****（1）【ファンドの目的及び基本的性格】**

① ファンドの目的

新興国を含む世界の株式に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざします。

② ファンドの基本的性格

1) 商品分類

単位型投信・ 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国 内	株 式
	海 外	債 券 不動産投信
追加型投信	内 外	その他資産 ()
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

◇追加型投信

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

◇内外

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

◇株式

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

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

◇その他資産（投資信託証券（株式 一般））

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

◇年2回

目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。

◇グローバル（含む日本）

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

◇ファミリーファンド

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

◇為替ヘッジなし

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

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

③ ファンドの特色

1. 新興国を含む世界の株式に投資を行ないます。

日本を含む先進国株式に投資するとともに、経済が相対的に初期・中期の成長過程にあり、今後も高い成長率が期待される新興国株式にも投資を行ないます。外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。

2. 資産配分は、日興グローバルラップ株式会社(日興GW)の助言を受け決定します。

日興GWは、投資対象とする「国内株式」、「海外先進国株式」、「新興国株式」への資産配分比率について、助言を行ないます。日興アセットマネジメント株式会社は、その助言をもとに、運用を行ないます。

・各資産への投資は、各資産を主要投資対象とする投資信託証券(マザーファンド)を通じて行ないます。

※投資対象とする投資信託証券については、収益機会の追求やリスクの分散などを目的として適宜見直しを行ないます。この際、定性評価や定量評価などを勘案のうえ、あらたに投資信託証券を指定したり、既に指定されていた投資信託証券を外したりする場合があります。

投資資産	投資対象とする投資信託証券	資産配分
国内株式	「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」 主として、わが国の株式に投資し、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。	38%
海外先進国株式	「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド」 主として、日本を除く世界各国の株式(DR(預託証券)およびカントリーファンドなどを含みます。)に投資し、MSCI-KOKUSAI インデックス(円ヘッジなし・円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。	49%
新興国株式	「海外新興国株式インデックスMSCI エマージング(ヘッジなし)マザーファンド」 主として、新興国の株式(DR(預託証券)およびカントリーファンドなどを含みます。)に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円ヘッジなし・円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。	13%

※TOPIX(東証株価指数)に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社東京証券取引所に帰属します。

※MSCI-KOKUSAI インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。

※MSCI エマージング・マーケット・インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。

※資産配分は、2012年4月2日現在の目標とする値であり将来変更になる場合があります。

※実際の資産配分比率は、時価の変動の影響などにより、必ずしも上記数値とは一致しません。

日興グローバルラップ株式会社(日興GW)とは

◆日興GWは、運用アドバイザーの評価・選定や資産配分の策定など、資産運用サービスをご提供するコンサルティング・カンパニーです。前身の「株式会社グローバル・ラップ・コンサルティング・グループ」は1998年2月設立。1990年代に米国で急拡大した「投資信託ラップ」を日本で初めて導入しました。

《ファンドの仕組み》

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



主な投資制限

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

分配方針

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

④ 信託金限度額

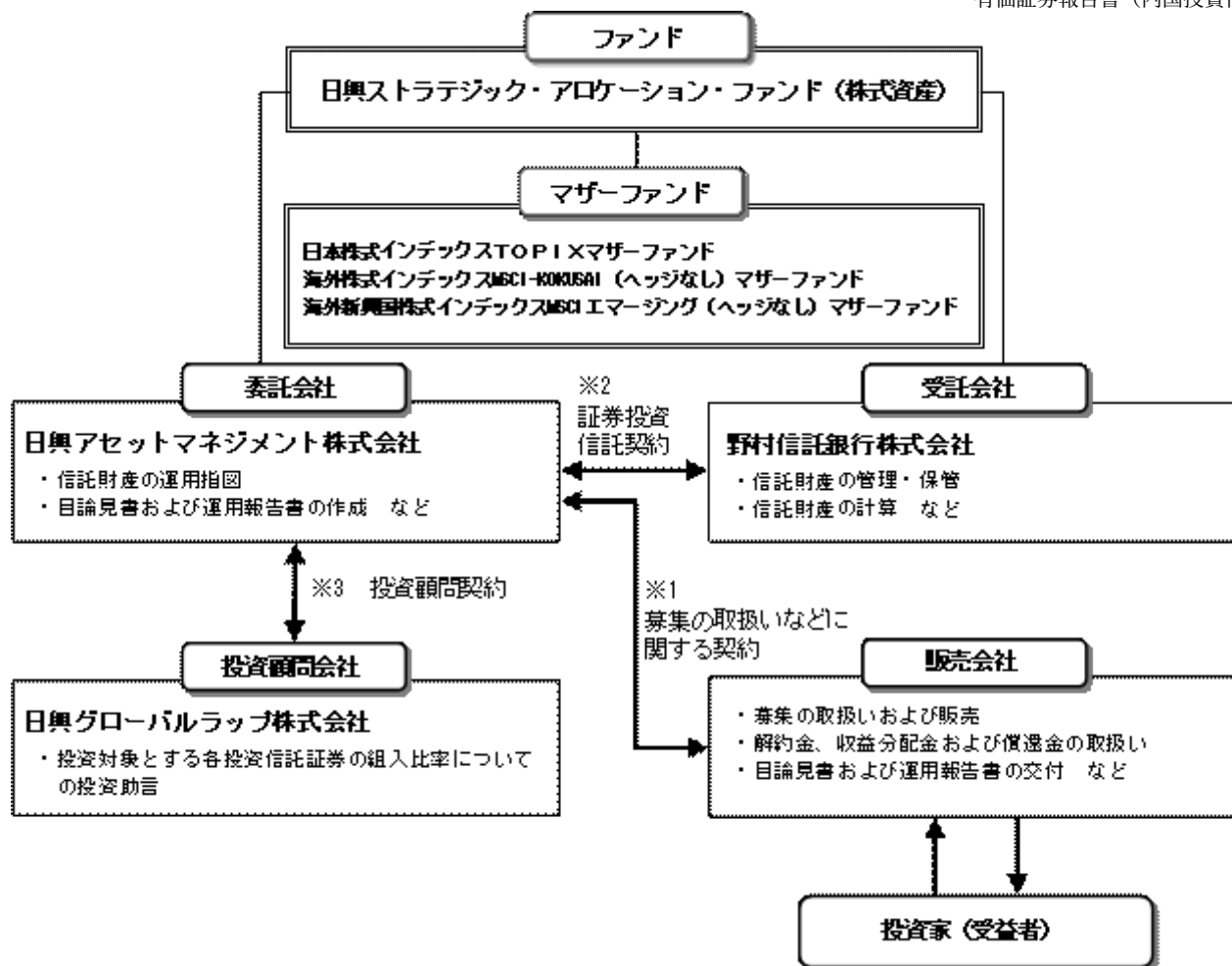
- ・5,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

(2) 【ファンドの沿革】

平成19年10月31日 ファンドの信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

① ファンドの仕組み



- ※1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したもの。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- ※2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したもの。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。
- ※3 投資顧問会社から株式、債券などの有価証券に対する投資判断についての助言（有価証券の種類、銘柄、数量、売買時期の判断など）を受けるルールを委託会社と投資顧問会社との間で規定したもの。投資助言を受ける対象資産、助言の内容、報酬の取決めの内容などが含まれています。

② 委託会社の概況（平成24年2月末現在）

1) 資本金

17,363百万円

2) 沿革

昭和34年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

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

3) 大株主の状況

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

※住友信託銀行株式会社は、2012年4月1日付で以下の通り、名称および住所を変更
 名称：三井住友信託銀行株式会社 住所：東京都千代田区丸の内一丁目4番1号

2【投資方針】

(1)【投資方針】

- 主として、株式を投資対象とする別に定める投資信託証券の一部またはすべてに投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
- 投資信託証券の合計組入比率は、高位を保つことを原則とします。各投資信託証券への投資比率は、原則として、市況環境および投資対象ファンドの収益性やリスクなどを勘案して決定します。なお、資金動向などによっては、各投資信託証券への投資比率を引き下げることもあります。
- 別に定める投資信託証券については、収益機会の追求やリスクの分散などを目的として適宜見直しを行ないます。この際、定性評価や定量評価などを勘案のうえ、あらたに投資信託証券を指定したり、既に指定されていた投資信託証券を外したりする場合があります。

- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【投資対象】

＜日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産）＞

投資信託証券（投資信託または外国投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) 金銭債権
- 3) 約束手形
- 4) 為替手形

② 主として別に定めるマザーファンド受益証券および別に定めるマザーファンドを除く投資信託証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。

- 1) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
- 2) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)の証券の性質を有するもの
- 3) 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。）

③ 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形

④ 次の取引ができます。

- 1) 外国為替予約取引
- 2) 資金の借入

＜日本株式インデックスTOPIXマザーファンド＞

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)～8)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券

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

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

- ① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
 - 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限り。）
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- ② 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
 - 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
 - 2) 国債証券
 - 3) 地方債証券
 - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 7) コマーシャル・ペーパー
 - 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 - 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2）～7）の証券の性質を有するもの
 - 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 - 11) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で12）に定めるもの以外のもの
 - 12) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 - 13) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 - 14) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限り。）
 - 15) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 17) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信

託の受益証券に限ります。)

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

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

新興国の株式（DR（預託証券）およびカントリーファンドなどを含みます。）を主要投資対象とします。

- ① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
 - 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第17条、第18条および第19条に定めるものに限りま。
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- ② 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
 - 1) 株券または新株引受権証券
 - 2) 国債証券
 - 3) 地方債証券
 - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 7) コマーシャル・ペーパー
 - 8) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 - 9) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)～8)の証券または証書の性質を有するもの
 - 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 - 11) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で12)に定めるものの以外のもの
 - 12) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 - 13) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 - 14) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りま。
 - 15) 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証券
 - 17) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

◆投資対象とするマザーファンドの概要
 <日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）＊の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	・主としてわが国の株式に投資し、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成11年10月29日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

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

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	・主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカンントリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成12年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

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

運用の基本方針	
基本方針	主として金融商品取引所に上場されている新興国の株式に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円ヘッジなし・円ベース）*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	新興国の株式（DR（預託証券）およびカントリーファンドなどを含みます。）を主要投資対象とします。
投資方針	・主として、新興国の株式（DR（預託証券）およびカントリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成18年5月17日設定）
決算日	毎年5月16日（休業日の場合は翌営業日）

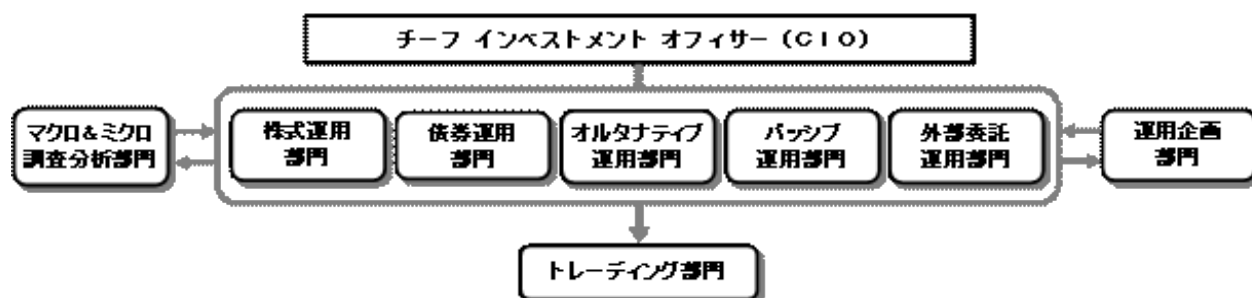
*MSCI エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が発表している、世界の新興国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（円ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。

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

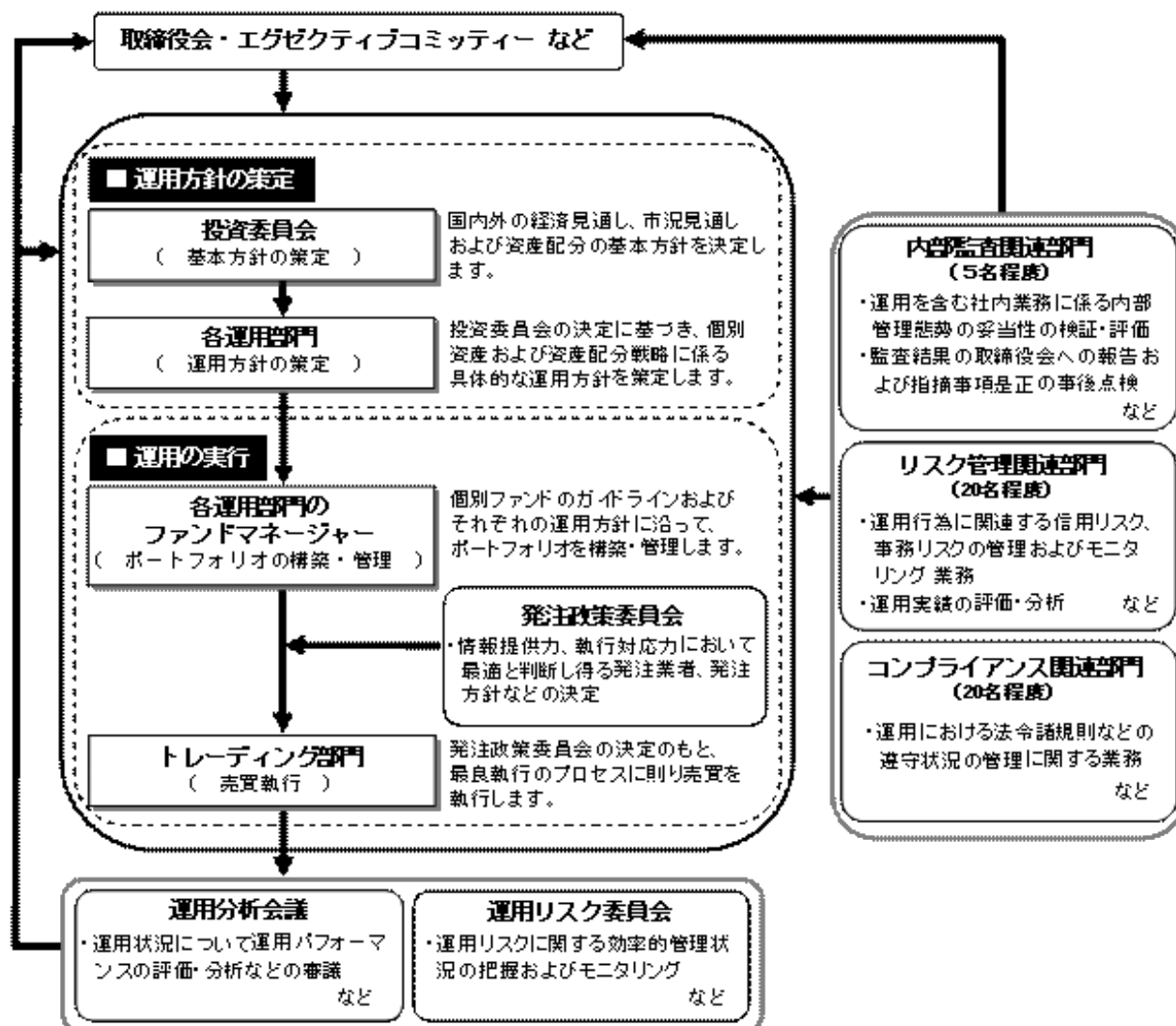
(3) 【運用体制】

＜日興アセットマネジメント株式会社（委託会社）における運用体制＞

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

「投資顧問会社」については、投資顧問会社の管理体制およびリスク管理状況のモニタリングをリスク管理業務担当部門にて行ないます。また、外部委託運用部門では外部委託ファンドの運用管理を行ない、投資方針に沿った運用が行なわれているなどのモニタリングを行なっています。

※上記体制は平成24年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】**① 収益分配方針**

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

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

② 収益分配金の支払い**<分配金再投資コース>**

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

<分配金受取りコース>

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

(5) 【投資制限】**① 約款に定める投資制限****<日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産）>**

1) 投資信託証券、短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）、「コマーシャル・ペーパー」および指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。

2) 有価証券先物取引等の派生商品取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。

3) 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。

4) 同一銘柄の投資信託証券への実質投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の50%以下とします。ただし、不動産投信（社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。）の投資信託証券については、同一銘柄への実質投資割合を、信託財産の純資産総額の30%以下とします。なお、約款または規約においてファンド・オブ・ファンズにのみ取得されること（投資信託委託会社または販売会社による自己設定が行なわれる場合も含みます。）が定められている投資信託証券については、信託財産の純資産総額に対する同一銘柄の時価総額の制限を設けません。

5) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

6) 信託財産に属する外貨建資産の時価総額と投資信託証券またはマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

7) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。

イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内

ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内

ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内

ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。

ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。

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

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

- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）、および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）、ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所に

おける通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

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

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

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

3【投資リスク】**(1) ファンドのリスク**

当ファンドの投資にあたっては、主に以下のリスクを伴います。基準価額変動リスクの大きいファンドですので、お申込みの際は、当ファンドのリスクを十分に認識・検討し、慎重に投資のご判断を行なっていただく必要があります。

- ・投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者（受益者）の皆様に帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。
- ・当ファンドは、主に株式を実質的な投資対象としますので、株式の価格の下落や、株式の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

① 価格変動リスク

- ・一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に新興国の株式は、先進国の株式に比べて価格変動が大きくなる傾向があり、基準価額にも大きな影響を与える場合があります。

② 流動性リスク

- ・市場規模や取引量が少ない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは、価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。
- ・一般に新興国の株式は、先進国の株式に比べて市場規模や取引量が少ないため、流動性リスクが高まる場合があります。

③ 信用リスク

- ・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れや廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

④ 為替変動リスク

- ・外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。
- ・一般に新興国の通貨は、先進国の通貨に比べて為替変動が大きくなる場合があります。

⑤ カントリー・リスク

- ・投資対象国における非常事態など（金融危機、財政上の理由による国自体のデフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）を含む市況動向や資金動向などによっては、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあり、投資方針に従った運用ができない場合があります。
- ・一般に新興国は、情報の開示などが先進国に比べて充分でない、あるいは正確な情報の入手が遅延する場合があります。
- ・ファンドの投資対象資産が上場または取引されている諸国の税制は各国によって異なります。また、それらの諸国における税制が一方的に変更されたり、新たな税制が適用されたりすることもあります。以上のような要因は、ファンドの信託財産の価値に影響を与える可能性があります。

<その他の留意事項>

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥

当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。

- ・運用制限や規制上の制限に関する事項

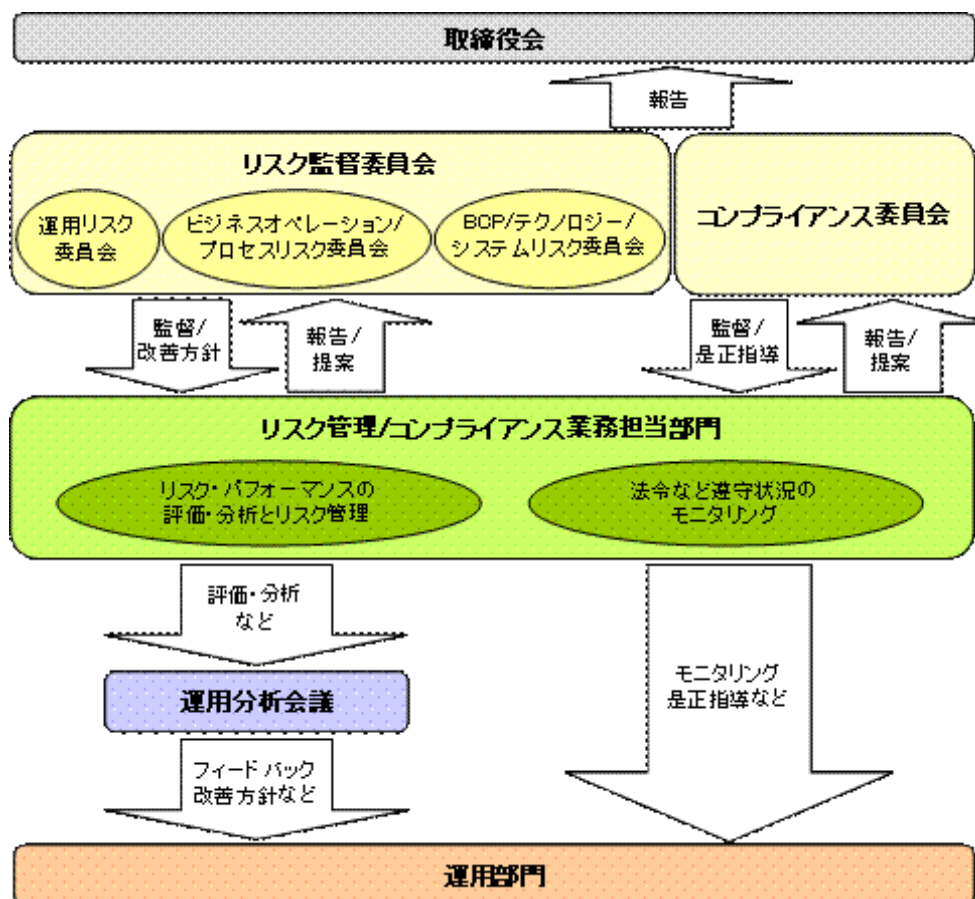
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。

- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

（２）リスク管理体制

＜日興アセットマネジメント株式会社（委託会社）におけるリスク管理体制＞



■全社的リスク管理

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

■リスク・パフォーマンスの評価・分析とリスク管理

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

■法令など遵守状況のモニタリング

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

※上記体制は平成24年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

- ・本書提出日現在、販売会社における申込手数料はありません。
- ・＜分配金再投資コース＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
- ・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(2)【換金（解約）手数料】

① 換金手数料

ありません。

② 信託財産留保額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額（1口当たり）が差し引かれます。

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

(3)【信託報酬等】

① 信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.84%（税抜0.8%）の率を乗じて得た額とします。

② 信託報酬の配分

信託報酬の配分は、以下の通りとします。

信託報酬率（年率）			
合 計	委託会社	販売会社	受託会社
0.8400%	0.4200%	0.3675%	0.0525%
(0.80%)	(0.40%)	(0.35%)	(0.05%)

※括弧内は税抜です。

※投資顧問会社が受ける報酬は、上記委託会社が受ける信託報酬の中から支払います。

③ 支払時期

信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

(4)【その他の手数料等】

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

- ① 振替受益権に係る費用ならびにやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合における発行および管理事務に係る費用。
- ② 有価証券届出書、有価証券報告書および臨時報告書（これらの訂正に係る書類を含みます。）の作成、印刷および提出に係る費用。
- ③ 目論見書および仮目論見書（これらの訂正事項分を含みます。）の作成、印刷および交付に係る費用（これらを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。
- ④ 信託約款の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。
- ⑤ 運用報告書の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。
- ⑥ ファンドの受益者に対して行なう公告に係る費用ならびに信託約款の変更または信託契約の解約に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用。
- ⑦ 格付の取得に要する費用。
- ⑧ ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。

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

- ① 組入る有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料。
- ② 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外貨建資産の保管などに要する費用、解約に伴う支払資金の手当てなどを目的とした借入金の利息および受託会社の立て

替えた立替金の利息。

- ③ 投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合に限り、その対価としての品貸料（マザーファンド（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限ります。）における品貸料については、他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）に0.525（税抜0.5）を乗じて得た貸付有価証券関連報酬。委託会社と受託会社の配分は4：1とし、信託報酬と同時期に支払います。

＜投資対象とするマザーファンドに係る費用＞

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

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

① 個人受益者の場合**1) 収益分配金に対する課税**

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

② 法人受益者の場合**1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税**

- ・収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、7%（所得税のみ）の税率による源泉徴収が行なわれます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。
- ・なお、上記の7%の税率は、平成25年1月1日から平成25年12月31日までは7.147%（所得税のみ）、平成26年1月1日以降は15.315%（所得税のみ）の税率となる予定です。

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

※買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③ 個別元本

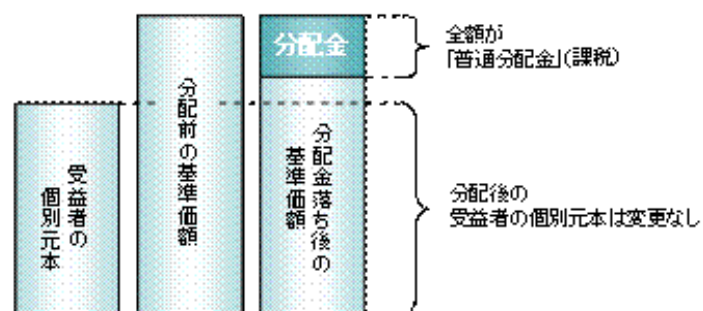
- 1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

④ 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

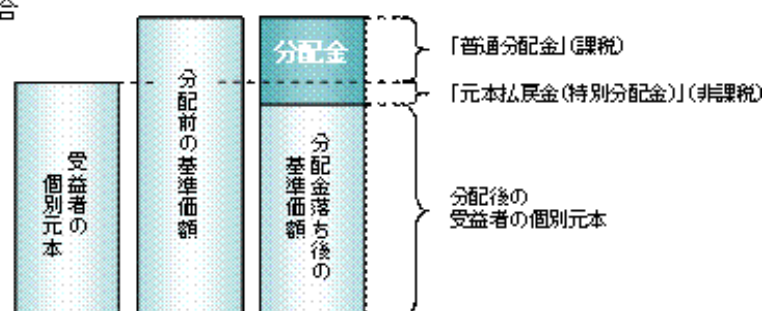
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
 -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

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

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

5【運用状況】

以下の運用状況は2012年2月29日現在です。

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

（１）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	201,783,420	99.42
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	1,185,476	0.58
合計（純資産総額）		202,968,896	100.00

（２）【投資資産】**①【投資有価証券の主要銘柄】****イ.評価額上位銘柄明細**

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	105,921,508	0.8893	94,195,997	0.9358	99,121,347	48.84
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	119,877,440	0.6252	74,947,375	0.6511	78,052,201	38.46
日本	親投資信託受益証券	海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド	21,684,618	1.0790	23,397,702	1.1349	24,609,872	12.12

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.42
合 計	99.42

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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】

① 【純資産の推移】

期別		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末	2008年 2月15日	265	265	0.8195	0.8200
第2計算期間末	2008年 8月15日	452	454	0.7665	0.7715
第3計算期間末	2009年 2月16日	243	245	0.4153	0.4183
第4計算期間末	2009年 8月17日	406	410	0.5464	0.5514
第5計算期間末	2010年 2月15日	393	396	0.5323	0.5363
第6計算期間末	2010年 8月16日	336	339	0.5078	0.5118
第7計算期間末	2011年 2月15日	346	348	0.5911	0.5951
第8計算期間末	2011年 8月15日	180	182	0.4837	0.4877
第9計算期間末	2012年 2月15日	193	195	0.5192	0.5232
2011年 2月末日		340	—	0.5800	—
3月末日		338	—	0.5761	—
4月末日		340	—	0.5801	—
5月末日		213	—	0.5611	—
6月末日		208	—	0.5570	—
7月末日		202	—	0.5418	—
8月末日		181	—	0.4857	—
9月末日		173	—	0.4637	—
10月末日		187	—	0.5019	—
11月末日		174	—	0.4667	—
12月末日		177	—	0.4746	—
2012年 1月末日		184	—	0.4934	—
2月末日		202	—	0.5438	—

② 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2007年10月31日～2008年 2月15日	0.0005
第2期	2008年 2月16日～2008年 8月15日	0.0050
第3期	2008年 8月16日～2009年 2月16日	0.0030
第4期	2009年 2月17日～2009年 8月17日	0.0050
第5期	2009年 8月18日～2010年 2月15日	0.0040
第6期	2010年 2月16日～2010年 8月16日	0.0040
第7期	2010年 8月17日～2011年 2月15日	0.0040
第8期	2011年 2月16日～2011年 8月15日	0.0040
第9期	2011年 8月16日～2012年 2月15日	0.0040

③ 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2007年10月31日～2008年 2月15日	△18.00
第2期	2008年 2月16日～2008年 8月15日	△5.86
第3期	2008年 8月16日～2009年 2月16日	△45.43
第4期	2009年 2月17日～2009年 8月17日	32.77
第5期	2009年 8月18日～2010年 2月15日	△1.85
第6期	2010年 2月16日～2010年 8月16日	△3.85
第7期	2010年 8月17日～2011年 2月15日	17.19
第8期	2011年 2月16日～2011年 8月15日	△17.49

第9期	2011年 8月16日～2012年 2月15日	8.17
-----	-------------------------	------

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落ち）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ち、以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2007年10月31日～2008年 2月15日	338,819,130	14,775,405
第2期	2008年 2月16日～2008年 8月15日	362,590,658	96,862,563
第3期	2008年 8月16日～2009年 2月16日	138,063,695	140,314,510
第4期	2009年 2月17日～2009年 8月17日	169,629,213	13,173,644
第5期	2009年 8月18日～2010年 2月15日	2,080,544	6,742,053
第6期	2010年 2月16日～2010年 8月16日	1,676,667	77,477,574
第7期	2010年 8月17日～2011年 2月15日	1,713,503	79,210,225
第8期	2011年 2月16日～2011年 8月15日	1,482,782	214,052,338
第9期	2011年 8月16日～2012年 2月15日	108,382	408,059

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

（参考）日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド

以下の運用状況は2012年2月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（１）投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	26,549,915,460	99.46
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	143,683,457	0.54
合計（純資産総額）		26,693,598,917	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	91,685,000	0.34

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

（２）投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	301,900	2,528.32	763,299,808	3,355.00	1,012,874,500	3.79
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	1,739,500	331.00	575,774,500	420.00	730,590,000	2.74
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	196,400	2,329.43	457,500,052	3,095.00	607,858,000	2.28
日本	株式	キヤノン	電気機器	144,600	3,508.54	507,334,884	3,680.00	532,128,000	1.99
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	173,800	2,126.33	369,556,154	2,757.00	479,166,600	1.80
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	105,800	3,852.63	407,608,254	3,835.00	405,743,000	1.52

日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,951,800	107.93	318,587,774	136.00	401,444,800	1.50
日本	株式	ファナック	電気機器	24,300	12,506.50	303,907,950	14,730.00	357,939,000	1.34
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	91,300	3,506.43	320,137,059	3,670.00	335,071,000	1.26
日本	株式	三菱商事	卸売業	167,300	1,526.49	255,381,777	1,991.00	333,094,300	1.25
日本	株式	三井物産	卸売業	198,300	1,108.11	219,738,213	1,399.00	277,421,700	1.04
日本	株式	小松製作所	機械	113,700	1,843.62	209,619,594	2,422.00	275,381,400	1.03
日本	株式	エス・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	1,893	135,844.88	257,154,357	138,800.00	262,748,400	0.98
日本	株式	ソニー	電気機器	145,300	1,575.01	228,848,953	1,737.00	252,386,100	0.95
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	104,100	2,427.56	252,708,996	2,421.00	252,026,100	0.94
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	578	378,422.88	218,728,424	432,000.00	249,696,000	0.94
日本	株式	日立製作所	電気機器	523,000	423.84	221,668,320	473.00	247,379,000	0.93
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	294,100	690.04	202,940,764	832.00	244,691,200	0.92
日本	株式	三菱地所	不動産業	161,000	1,327.55	213,735,550	1,470.00	236,670,000	0.89
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	96,100	2,085.47	200,413,667	2,246.00	215,840,600	0.81
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	40,500	4,528.23	183,393,315	5,210.00	211,005,000	0.79
日本	株式	パナソニック	電気機器	266,000	780.56	207,628,960	759.00	201,894,000	0.76
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	87,200	1,809.78	157,812,816	2,245.00	195,764,000	0.73
日本	株式	信越化学工業	化学	43,700	3,954.32	172,803,784	4,355.00	190,313,500	0.71
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	497,500	286.87	142,717,825	375.00	186,562,500	0.70
日本	株式	KDDI	情報・通信業	357	561,242.97	200,363,740	516,000.00	184,212,000	0.69
日本	株式	国際石油開発帝石	鉱業	317	523,813.38	166,048,841	577,000.00	182,909,000	0.69
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	54,100	2,821.90	152,664,790	3,340.00	180,694,000	0.68
日本	株式	東芝	電気機器	490,000	350.35	171,671,500	356.00	174,440,000	0.65
日本	株式	三菱電機	電気機器	233,000	729.71	170,022,430	729.00	169,857,000	0.64

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.78
		建設業	2.35
		食料品	3.46
		繊維製品	0.90
		パルプ・紙	0.38
		化学	5.85
		医薬品	4.70
		石油・石炭製品	0.85
		ゴム製品	0.78
		ガラス・土石製品	1.14
		鉄鋼	1.95
		非鉄金属	1.22
		金属製品	0.69
		機械	5.16
		電気機器	13.58

		輸送用機器	10.49
		精密機器	1.40
		その他製品	1.58
		電気・ガス業	3.01
		陸運業	3.83
		海運業	0.42
		空運業	0.29
		倉庫・運輸関連業	0.23
		情報・通信業	6.07
		卸売業	5.66
		小売業	4.00
		銀行業	9.80
		証券、商品先物取引業	1.23
		保険業	2.44
		その他金融業	0.80
		不動産業	2.48
		サービス業	1.83
合 計			99.46

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの ＜有価証券先物取引等＞

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	評価額（円）	投資 比率 （％）
株価指数先物取引	日本	東京証券取引 所	東証株価指 数先物 20 12年03 月	買建	11	日本円	84,768,471	91,685,000	0.34

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

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

以下の運用状況は2012年2月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（１）投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	36,470,250,492	54.32
	カナダ	3,718,398,863	5.54
	ドイツ	2,637,238,024	3.93
	イタリア	704,512,328	1.05
	フランス	2,715,711,119	4.04
	オーストラリア	2,446,898,077	3.64
	イギリス	6,788,054,409	10.11
	スイス	2,727,387,810	4.06
	バミューダ	148,762,770	0.22
	香港	821,775,112	1.22
	シンガポール	536,411,257	0.80
	ニュージーランド	36,058,869	0.05
	オランダ	789,392,330	1.18
	スペイン	951,171,419	1.42
	ベルギー	297,949,876	0.44
	スウェーデン	984,308,593	1.47
	ノルウェー	252,894,507	0.38
	オーストリア	81,724,404	0.12
	ルクセンブルグ	150,455,603	0.22
	フィンランド	271,953,620	0.41
	デンマーク	352,835,359	0.53
	アイルランド	419,380,156	0.62
	ギリシャ	26,695,332	0.04
	イスラエル	186,313,599	0.28
	ポルトガル	60,173,263	0.09
	中国	4,291,872	0.01
	ケイマン島	69,300,205	0.10
	モーリシャス	10,373,154	0.02
	ジャージー	152,004,178	0.23
	ガーンジー	17,630,886	0.03
	小計	64,830,307,486	96.56
投資証券	アメリカ	869,381,783	1.29
	カナダ	11,514,370	0.02
	フランス	79,172,076	0.12
	オーストラリア	189,255,316	0.28
	イギリス	76,785,631	0.11
	香港	22,159,280	0.03
	シンガポール	16,337,781	0.02
	オランダ	7,672,281	0.01
	小計	1,272,278,518	1.89
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	1,039,751,049	1.55
合計（純資産総額）		67,142,337,053	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	691,528,450	1.03
	買建	ドイツ	336,271,750	0.50

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約先物取引	買建	—	699,739,510	1.04

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(2) 投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE COMPUTER INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	33,661	32,084.82	1,080,007,206	43,196.88	1,454,050,137	2.17
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	176,546	6,409.22	1,131,522,012	7,030.46	1,241,198,743	1.85
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	273,799	2,163.84	592,456,571	2,571.27	704,011,592	1.05
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	43,362	14,551.44	630,979,749	15,973.03	692,622,370	1.03
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	72,731	8,431.06	613,199,424	8,843.33	643,184,583	0.96
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	119,823	4,600.71	551,270,874	5,002.14	599,371,960	0.89
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	384,903	1,308.63	503,695,458	1,545.83	594,994,142	0.89
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	99,779	5,204.67	519,316,448	5,437.03	542,500,937	0.81
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	215,176	2,292.12	493,208,954	2,463.16	530,013,002	0.79
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	99,504	5,138.51	511,302,219	5,258.72	523,263,913	0.78
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	283,300	1,522.43	431,304,872	1,712.03	485,017,985	0.72
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	648,016	674.47	437,065,731	718.53	465,620,691	0.69
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	182,130	2,061.37	375,438,046	2,530.93	460,958,572	0.69
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	9,231	47,058.22	434,394,462	49,891.71	460,550,330	0.69
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	141,575	2,701.97	382,531,855	3,163.46	447,867,245	0.67
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	687,833	587.11	403,832,188	641.45	441,210,965	0.66
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	63,778	5,554.01	354,223,726	6,765.82	431,510,774	0.64
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	190,667	1,987.15	378,883,623	2,197.72	419,033,289	0.62
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	75,036	5,401.53	405,308,904	5,554.82	416,811,323	0.62
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	1,845,695	223.54	412,582,599	221.42	408,670,178	0.61
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	131,368	2,866.17	376,522,455	2,981.15	391,627,233	0.58
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	84,718	4,519.52	382,884,780	4,459.98	377,840,788	0.56

スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	25,503	12,737.65	324,848,338	14,271.22	363,958,974	0.54
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	116,576	3,240.48	377,762,266	3,116.68	363,330,670	0.54
フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	77,052	4,099.36	315,864,233	4,556.24	351,067,231	0.52
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	146,903	2,611.61	383,653,578	2,371.19	348,334,219	0.52
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	111,833	2,655.18	296,936,610	3,096.50	346,290,705	0.52
イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	184,196	1,775.46	327,031,782	1,803.72	332,237,788	0.49
アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC	食品・生活必需品小売り	68,812	4,575.36	314,839,864	4,754.47	327,164,754	0.49
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	199,655	1,419.97	283,503,711	1,629.74	325,384,941	0.48

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	12.41
		素材	7.46
		資本財	7.47
		商業・専門サービス	0.83
		運輸	1.76
		自動車・自動車部品	1.38
		耐久消費財・アパレル	1.25
		消費者サービス	1.69
		メディア	2.52
		小売	2.72
		食品・生活必需品小売り	2.19
		食品・飲料・タバコ	6.69
		家庭用品・パーソナル用品	1.73
		ヘルスケア機器・サービス	2.66
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.50
		銀行	7.30
		各種金融	4.54
		保険	3.92
		不動産	0.68
		ソフトウェア・サービス	5.86
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.85
		電気通信サービス	3.88
		公益事業	3.56
		半導体・半導体製造装置	1.69
投資証券	—	—	1.89
合 計			98.45

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの
＜有価証券先物取引等＞

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	評価額（円）	投資 比率（%）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500 1203	買建	25	米ドル	8,433,600	691,528,450	1.03
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1203	買建	125	ユーロ	3,087,650	336,271,750	0.50

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

＜為替予約取引＞

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資 比率（%）
為替予約先物取引	米ドル	買建	6,153,000	481,620,308	496,192,400	0.74
	ユーロ	買建	1,874,000	194,787,012	203,547,110	0.30

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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

以下の運用状況は2012年2月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	バミューダ	13,248,248	0.18
	香港	379,986,762	5.20
	マレーシア	233,351,092	3.19
	タイ	143,110,975	1.96
	フィリピン	54,045,359	0.74
	インドネシア	184,346,550	2.52
	メキシコ	317,086,097	4.34
	ブラジル	1,116,134,605	15.27
	チリ	126,410,982	1.73
	韓国	1,038,081,755	14.20
	台湾	748,270,680	10.23
	トルコ	94,999,794	1.30
	インド	477,047,965	6.52
	チェコ	23,484,258	0.32
	エジプト	24,576,845	0.34
	コロンビア	65,588,057	0.90
	ハンガリー	23,000,750	0.31
	モロッコ	7,842,379	0.11
	ペルー	44,806,685	0.61
	ポーランド	96,353,659	1.32
	南アフリカ	549,884,180	7.52
	ロシア	486,260,094	6.65
	中国	829,306,644	11.34
	ケイマン島	58,425,041	0.80
	小計	7,135,649,456	97.60
投資証券	トルコ	2,768,766	0.04
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	173,009,048	2.37
合計（純資産総額）		7,311,427,270	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	156,290,068	2.14

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

(2) 投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	半導体・半導体製造装置	2,560	65,466.67	167,594,667	85,438.50	218,722,560	2.99
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	122,200	1,139.30	139,222,348	1,071.43	130,928,794	1.79
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	584,355	207.28	121,123,614	215.94	126,187,371	1.73
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	139,200	742.26	103,322,386	852.80	118,709,760	1.62
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	99,200	1,100.46	109,165,987	1,157.38	114,811,907	1.57
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,442,920	69.46	100,231,126	67.60	97,541,392	1.33
ブラジル	株式	VALE SA-PREF A	素材	45,150	2,010.78	90,786,893	2,040.75	92,139,997	1.26
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	52,200	1,698.57	88,665,099	1,740.11	90,833,773	1.24
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	電気通信サービス	904,800	94.47	85,473,609	96.89	87,669,691	1.20
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	69,860	1,247.04	87,118,125	1,220.17	85,241,111	1.17
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA - H	銀行	1,390,575	64.64	89,887,694	58.97	81,999,426	1.12
香港	株式	CNOOC LTD	エネルギー	432,000	187.50	80,998,950	184.70	79,792,128	1.09
中国	株式	PETROCHINA CO LTD-H	エネルギー	511,000	110.68	56,556,631	122.51	62,603,632	0.86
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	56,500	1,114.43	62,965,304	1,103.70	62,359,185	0.85
ロシア	株式	LUKOIL OAO-SPON ADR	エネルギー	11,485	4,954.19	56,898,874	5,111.08	58,700,730	0.80
中国	株式	BANK OF CHINA LTD - H	銀行	1,665,000	41.61	69,283,237	34.94	58,181,760	0.80
南アフリカ	株式	MTN GROUP LTD	電気通信サービス	39,515	1,505.38	59,484,929	1,449.37	57,271,895	0.78
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	211,849	269.28	57,046,120	270.27	57,256,429	0.78
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車部品	3,800	16,536.60	62,839,065	15,032.85	57,124,830	0.78
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	37,873	1,462.78	55,399,772	1,460.87	55,327,707	0.76
南アフリカ	株式	SASOL LTD	エネルギー	12,700	3,882.85	49,312,172	4,327.63	54,960,913	0.75
ブラジル	株式	CIA DE BEBIDAS DAS AME-PREF	食品・飲料・タバコ	16,700	2,440.53	40,756,914	3,253.79	54,338,259	0.74
ブラジル	株式	VALE SA	素材	25,760	2,270.53	58,488,936	2,096.89	54,015,773	0.74
中国	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	24,400	2,228.96	54,386,534	2,088.32	50,955,008	0.70
韓国	株式	POSCO	素材	1,600	32,825.78	52,521,245	29,849.40	47,759,040	0.65
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	9,835	4,778.06	46,992,229	4,768.18	46,895,089	0.64
中国	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	169,000	278.72	47,103,680	249.08	42,094,520	0.58
メキシコ	株式	WALMART DE MEXICO -SER V	食品・生活必需品小売り	154,200	216.72	33,418,224	254.96	39,314,986	0.54
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	8,610	4,158.49	35,804,623	4,419.80	38,054,478	0.52
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	28,346	1,573.68	44,607,533	1,322.19	37,478,797	0.51

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	14.23
		素材	13.28
		資本財	5.13
		運輸	1.34
		自動車・自動車部品	3.50
		耐久消費財・アパレル	1.04
		消費者サービス	0.45
		メディア	0.83
		小売	1.72
		食品・生活必需品小売り	2.18
		食品・飲料・タバコ	4.41
		家庭用品・パーソナル用品	0.81
		ヘルスケア機器・サービス	0.30
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.66
		銀行	17.36
		各種金融	2.48
		保険	2.38
		不動産	1.47
		ソフトウェア・サービス	2.78
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.57
		電気通信サービス	7.62
		公益事業	3.54
		半導体・半導体製造装置	6.49
投資証券	—	—	0.04
合 計			97.63

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの
＜有価証券先物取引等＞

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	ニューヨーク証券取引所	MINMSCIE1203	買建	36	米ドル	1,824,740	156,290,068	2.14

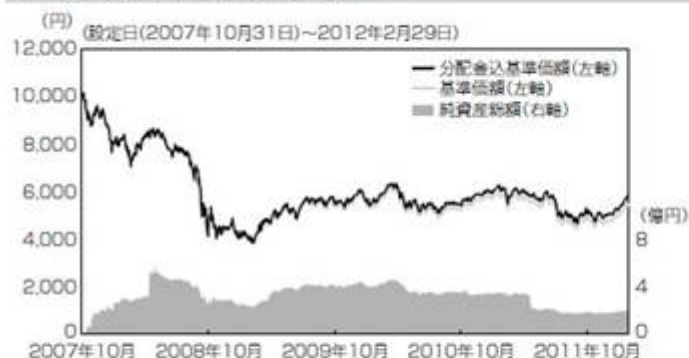
(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

(参考情報)

運用実績

2012年2月29日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額.....5,438円

純資産総額.....2.02億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金込基準価額は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2010年2月	2010年8月	2011年2月	2011年8月	2012年2月	設定来累計
40円	40円	40円	40円	40円	335円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	38.5%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	48.8%
海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし)マザーファンド	12.1%
現金その他	0.6%

※対純資産総額比です。

<組入上位銘柄>

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

銘柄	国名	業種	比率
1 トヨタ自動車	日本	輸送用機器	3.8%
2 三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	銀行業	2.7%
3 本田技研工業	日本	輸送用機器	2.3%
4 キヤノン	日本	電気機器	2.0%

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド

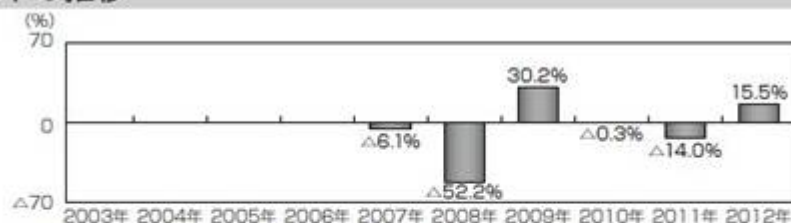
銘柄	国名	業種	比率
1 APPLE COMPUTER INC	アメリカ	テクノロジー・ハードウェア	2.2%
2 EXXON MOBIL CORP	アメリカ	エネルギー	1.8%
3 MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	1.0%
4 INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	1.0%

海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし)マザーファンド

銘柄	国名	業種	比率
1 SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	半導体・半導体製造装置	3.0%
2 GAZPROM OAO-SPON ADR	ロシア	エネルギー	1.8%
3 TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	半導体・半導体製造装置	1.7%
4 CHINA MOBILE LTD	香港	電気通信サービス	1.6%

※各マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

※2007年は、設定時から2007年末までの騰落率です。

※2012年は、2012年2月末までの騰落率です。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- (1) 申込方法
販売会社所定の方法でお申し込みください。
- (2) コースの選択
収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース＞と＜分配金受取りコース＞の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。
＜分配金再投資コース＞
収益分配金を自動的に再投資するコースです。
＜分配金受取りコース＞
収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。
- (3) 申込みの受付
販売会社の営業日に受け付けます。
- (4) 取扱時間
原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
- (5) 取得申込不可日
販売会社の営業日であっても、取得申込日がニューヨーク証券取引所の休業日またはニューヨークの銀行休業日に該当する場合は、取得の申込みの受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (6) 申込金額
取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。
- (7) 申込単位
販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。
＜委託会社の照会先＞

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

- (8) 申込代金の支払い
取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。
- (9) 受付の中止および取消
委託会社は、金融商品取引所[※]における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。
※金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。
- (10) 償還乗換
 - ・受益者は、証券投資信託の償還金額（手取額）の範囲内（単位型証券投資信託については、償還金額（手取額）とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する口数に係る申込手数料を徴収されない措置の適用を受けることができる場合があります。この償還乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
 - ・この措置の適用を受ける受益者は、販売会社から、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求められることがあります。
- (11) 乗換優遇
受益者は、信託期間終了日の1年前以内などの一定の要件を満たした証券投資信託を解約または買取請求により換金した際の代金をもって、換金を行なった販売会社において、取得申込みをする場合の手数料率が割引となる措置の適用を受けることができます。この乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

2【換金（解約）手続等】

＜解約請求による換金＞

- (1) 解約の受付
販売会社の営業日に受け付けます。
- (2) 取扱時間
原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分としま

す。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

(3) 解約請求不可日

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

(4) 解約制限

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

(5) 解約価額

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

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(6) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額から所得税および地方税を差し引いた金額となります。

※税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(7) 解約単位

1口単位

※販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(9) 受付の中止および取消

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

・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けられない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

3【資産管理等の概要】

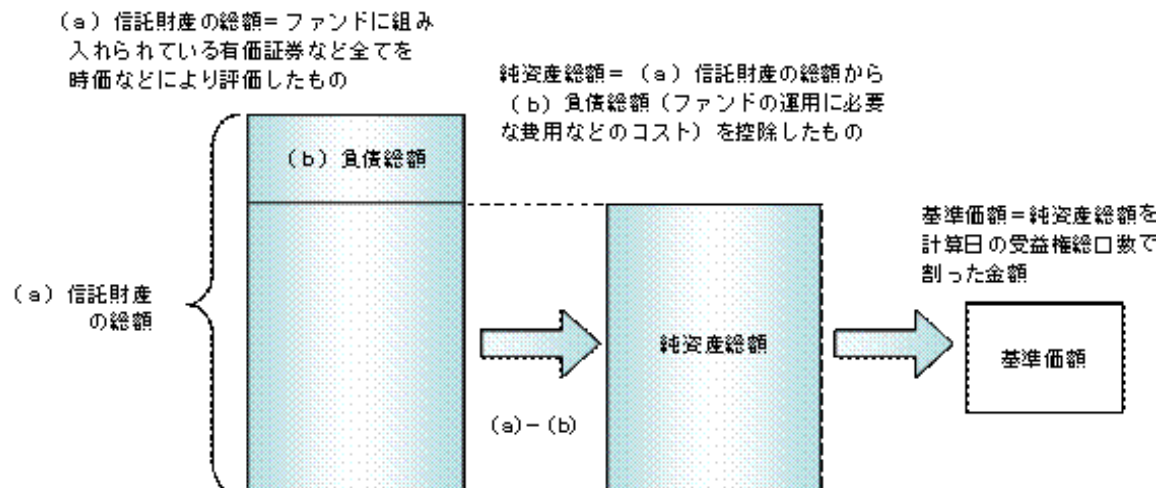
(1) 【資産の評価】

① 基準価額の算出

・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。

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

<基準価額算出の流れ>



② 有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

◇マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

◇国内上場株式

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

◇外国株式

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

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

③ 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

平成29年8月15日までとします（平成19年10月31日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年2月16日から8月15日までおよび8月16日から翌年2月15日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5) 【その他】

① 信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。

イ) 受益者の解約により純資産総額が10億円を下回ることとなった場合

ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ハ) やむを得ない事情が発生したとき

- 2) この場合、委託会社は書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）

- 3) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。

イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、書面決議が困難な場合

ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止し

たとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。）

二）受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき

4）繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

② 償還金について

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

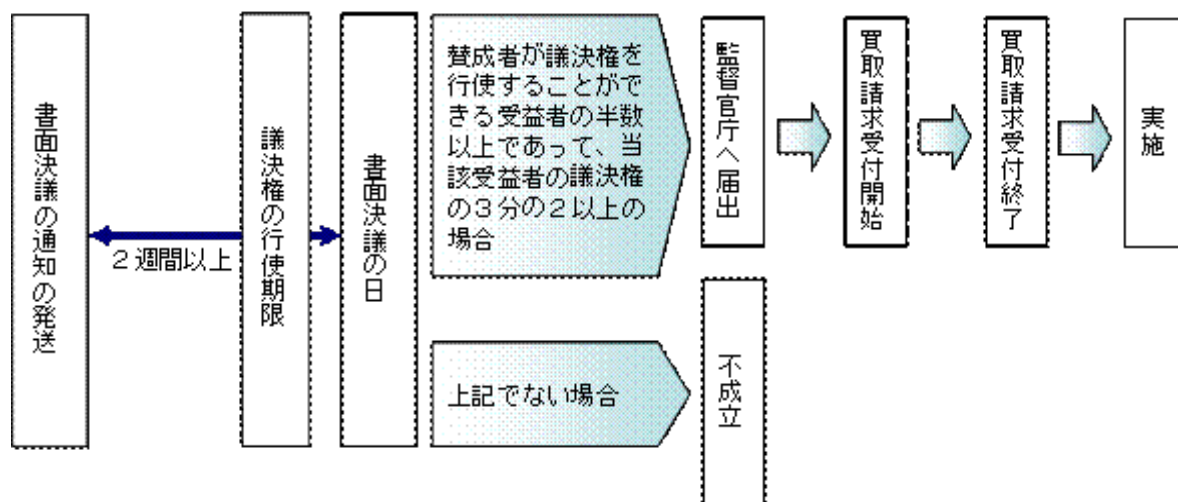
③ 信託約款の変更など

- 1）委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（以下「併合」といいます。）を行なうことができます。信託約款の変更または併合を行なう際には、委託会社は、その旨および内容をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2）この変更事項のうち、その内容が重大なものまたは併合については、書面決議を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）
- 3）委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「書面決議」の規定を適用します。

④ 書面決議

- 1）繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に対して、委託会社は書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにその内容および理由などの事項を定め、決議の日の2週間前までに知れている受益者に対し書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- 2）受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、書面決議について賛成するものとみなします。
- 3）書面決議は、議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
- 4）繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に関する委託会社の提案に対して、すべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときは、書面決議を行ないません。
- 5）当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、併合にかかる他のファンドにおいて併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
- 6）当ファンドの繰上償還、信託約款の重大な変更または併合を行なう場合には、書面決議において反対した受益者は、受託会社に対し、自己の有する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<書面決議の主な流れ>



⑤ 公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

※なお、やむを得ない事由によって公告を電子公告によって行なうことができない場合には、公告は日本経済新聞に掲載します。

⑥ 運用報告書の作成

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

⑦ 関係法人との契約について

- ・販売会社との募集の取扱いなどに関する契約の有効期間は契約日より1年間とします。ただし、期間満了の3ヵ月前までに、販売会社、委託会社いずれからも別段の意思表示がないときは、自動的に1年間延長されるものとし、以後も同様とします。
- ・投資顧問会社との投資顧問契約は、当ファンドの信託期間終了まで存続します。ただし、投資顧問会社、委託会社が重大な契約違反を行なったとき、その他契約を継続し難い重大な事由があるときは、相手方に通知をなすことにより契約を終了することができます。

⑧ 他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

受益者は、委託会社または受託会社に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行なうことはできません。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

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

- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間（平成23年8月16日から平成24年2月15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】

日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産）

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 平成23年 8 月15日現在	第9期 平成24年 2 月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,795,819	1,792,350
親投資信託受益証券	179,718,692	192,541,074
未収入金	1,550,000	1,750,000
未収利息	4	3
流動資産合計	184,064,515	196,083,427
資産合計	184,064,515	196,083,427
負債の部		
流動負債		
未払金	500,000	—
未払収益分配金	1,493,791	1,492,592
未払受託者報酬	70,977	47,161
未払委託者報酬	1,065,691	708,300
その他未払費用	290,383	89,820
流動負債合計	3,420,842	2,337,873
負債合計	3,420,842	2,337,873
純資産の部		
元本等		
元本	373,447,880	373,148,203
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△192,804,207	△179,402,649
（分配準備積立金）	811,598	1,071,927
元本等合計	180,643,673	193,745,554
純資産合計	180,643,673	193,745,554
負債純資産合計	184,064,515	196,083,427

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期 自 平成23年 2 月16日 至 平成23年 8 月15日	第9期 自 平成23年 8 月16日 至 平成24年 2 月15日
営業収益		
受取利息	937	440
有価証券売買等損益	△44,189,122	15,582,382
営業収益合計	△44,188,185	15,582,822
営業費用		
受託者報酬	70,977	47,161
委託者報酬	1,065,691	708,300
その他費用	135,200	89,820
営業費用合計	1,271,868	845,281
営業利益又は営業損失（△）	△45,460,053	14,737,541
経常利益又は経常損失（△）	△45,460,053	14,737,541
当期純利益又は当期純損失（△）	△45,460,053	14,737,541
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（△）	△6,700,219	△1,383
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△239,617,803	△192,804,207
剰余金増加額又は欠損金減少額	87,673,531	211,184
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	87,673,531	211,184
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	—
剰余金減少額又は欠損金増加額	606,310	55,958
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	606,310	55,958
分配金	1,493,791	1,492,592
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△192,804,207	△179,402,649

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(追加情報)

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

(貸借対照表に関する注記)

第8期 平成23年 8月15日現在		第9期 平成24年 2月15日現在	
1. 期首元本額	586,017,436円	1. 期首元本額	373,447,880円
期中追加設定元本額	1,482,782円	期中追加設定元本額	108,382円
期中一部解約元本額	214,052,338円	期中一部解約元本額	408,059円
2. 計算期間末日における受益権の総数	373,447,880口	2. 計算期間末日における受益権の総数	373,148,203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192,804,207円であります。		3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は179,402,649円であります。	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期 自 平成23年 2月16日 至 平成23年 8月15日		第9期 自 平成23年 8月16日 至 平成24年 2月15日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 計算期末における費用控除後の配当等収益	1,718,546円	A 計算期末における費用控除後の配当等収益	1,753,301円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C 信託約款に定める収益調整金	637,481円	C 信託約款に定める収益調整金	637,210円
D 信託約款に定める分配準備積立金	586,843円	D 信託約款に定める分配準備積立金	811,218円
E 分配対象収益(A+B+C+D)	2,942,870円	E 分配対象収益(A+B+C+D)	3,201,729円
F 分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0078円 78円	F 分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0085円 85円
G 分配金額	1,493,791円	G 分配金額	1,492,592円
H 分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0.0040円 40円	H 分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0.0040円 40円

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

	第8期 自 平成23年 2月16日 至 平成23年 8月15日	第9期 自 平成23年 8月16日 至 平成24年 2月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

II 金融商品の時価等に関する事項

	第8期 平成23年 8月15日現在	第9期 平成24年 2月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
第8期（平成23年8月15日現在）
売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	△36,391,413
合計	△36,391,413

第9期（平成24年2月15日現在）
売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	15,466,421
合計	15,466,421

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（１口当たり情報）

第8期 平成23年 8月15日現在		第9期 平成24年 2月15日現在	
1口当たり純資産額	0.4837円	1口当たり純資産額	0.5192円
（１万口当たり純資産額）	（4,837円）	（１万口当たり純資産額）	（5,192円）

（４）【附属明細表】**第1 有価証券明細表****（1）株式**

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI （ヘッジなし）マザーファンド	105,921,508	94,195,997	
	日本株式インデックスTOPIXマ ザーファンド	119,877,440	74,947,375	
	海外新興国株式インデックスMSCIエ マージング（ヘッジなし）マザーファ ンド	21,684,618	23,397,702	
親投資信託受益証券 合計		247,483,566	192,541,074	
合計		247,483,566	192,541,074	

（注）券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

日本株式インデックスTOP I Xマザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

科目	対象年月日	平成23年 8月15日現在	平成24年 2月15日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		378,816,188	66,010,941
株式		26,062,001,365	26,372,786,220
派生商品評価勘定		—	4,281,788
未収入金		95,588	29,214,234
未収配当金		25,664,100	28,426,930
未収利息		583	120
前払金		7,830,000	—
流動資産合計		26,474,407,824	26,500,720,233
資産合計		26,474,407,824	26,500,720,233
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		7,203,414	—
前受金		—	2,910,000
未払金		332,967,850	—
未払解約金		2,358,333	27,985,842
流動負債合計		342,529,597	30,895,842
負債合計		342,529,597	30,895,842
純資産の部			
元本等			
元本		43,697,301,580	42,341,506,412
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		△17,565,423,353	△15,871,682,021
元本等合計		26,131,878,227	26,469,824,391
純資産合計		26,131,878,227	26,469,824,391
負債純資産合計		26,474,407,824	26,500,720,233

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．有価証券の評価基準及び評価方法	株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 （１）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。
-------------------	--

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

（追加情報）

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

（貸借対照表に関する注記）

平成23年 8月15日現在	平成24年 2月15日現在
1. 期首 期首元本額 期首からの追加設定元本額 期首からの一部解約元本額 平成23年 8月15日現在の元本の内訳 ※ D C インデックスバラン ス（株式20） D C インデックスバラン ス（株式40） D C インデックスバラン ス（株式60） D C インデックスバラン ス（株式80） インデックスファンド日 本株式（D C 専用） 世界の財産 3 分法ファン ド（不動産・債券・株 式）毎月分配型 全世界株式債券ファンド （日本・先進国・新興 国）毎月分配型 日興ストラテジック・ア ロケーション・ファンド （株式資産） アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式80） アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式60） アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式40） アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式20）	1. 期首 期首元本額 期首からの追加設定元本額 期首からの一部解約元本額 平成24年 2月15日現在の元本の内訳 ※ D C インデックスバラン ス（株式20） D C インデックスバラン ス（株式40） D C インデックスバラン ス（株式60） D C インデックスバラン ス（株式80） インデックスファンド日 本株式（D C 専用） 世界の財産 3 分法ファン ド（不動産・債券・株 式）毎月分配型 全世界株式債券ファンド （日本・先進国・新興 国）毎月分配型 日興ストラテジック・ア ロケーション・ファンド （株式資産） アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式80） アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式60） アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式40） アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式20）

国際分散型ファンド40 （適格機関投資家向け）	15,132,805,737円	国際分散型ファンド40 （適格機関投資家向け）	15,244,080,617円
世界アセットバランス ファンド40（適格機関投 資家向け）	96,856,927円	世界アセットバランス ファンド40（適格機関投 資家向け）	100,163,083円
世界アセットバランス ファンド25（適格機関投 資家向け）	114,070,642円	世界アセットバランス ファンド25（適格機関投 資家向け）	121,003,275円
3資産バランスファンド （適格機関投資家向け）	87,210,578円	3資産バランスファンド （適格機関投資家向け）	88,849,083円
グローバルバランスファ ンド35（適格機関投資家 向け）	80,468,421円	グローバルバランスファ ンド35（適格機関投資家 向け）	82,002,575円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式20）	405,059,020円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド （株式20）	419,315,073円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式40）	1,043,190,768円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド （株式40）	1,108,344,797円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式60）	1,339,089,604円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド （株式60）	1,427,607,777円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式80）	1,325,323,510円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド （株式80）	1,386,417,164円
計	43,697,301,580円	計	42,341,506,412円
2. 本報告書における開示対 象ファンドの計算期間末 日における当該親投資信 託の受益権の総数	43,697,301,580口	2. 本報告書における開示対 象ファンドの計算期間末 日における当該親投資信 託の受益権の総数	42,341,506,412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17,565,423,353円であります。		3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、 その差額は15,871,682,021円であります。	
4. 担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券 として担保に供している資産は次のとおりであります。		4. 担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券 として担保に供している資産は次のとおりでありま す。	
株式	218,557,000円	株式	230,788,000円

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

	自 平成23年 2月16日 至 平成23年 8月15日	自 平成23年 8月16日 至 平成24年 2月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

II 金融商品の時価等に関する事項

	平成23年 8月15日現在	平成24年 2月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
（平成23年8月15日現在）
売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	△1,391,870,237
合計	△1,391,870,237

（平成24年2月15日現在）
売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,851,651,757
合計	1,851,651,757

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

(デリバティブ取引等に関する注記)
取引の時価等に関する事項
(株式関連)
(平成23年8月15日現在)

(単位：円)

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	84,575,000	—	77,400,000	△7,175,000
合計		84,575,000	—	77,400,000	△7,175,000

(平成24年2月15日現在)

(単位：円)

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	83,965,000	—	88,275,000	4,310,000
合計		83,965,000	—	88,275,000	4,310,000

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成23年 8月15日現在		平成24年 2月15日現在	
1口当たり純資産額	0.5980円	1口当たり純資産額	0.6252円
(1万口当たり純資産額)	(5,980円)	(1万口当たり純資産額)	(6,252円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

	銘 柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
1301	極洋	11,000	194.00	2,134,000	
1332	日本水産	31,400	282.00	8,854,800	
1334	マルハニチロホールディングス	54,000	142.00	7,668,000	
1377	サカタのタネ	4,000	1,109.00	4,436,000	
1379	ホクト	2,700	1,667.00	4,500,900	
1514	住石ホールディングス	8,400	97.00	814,800	
1515	日鉄鉱業	7,000	372.00	2,604,000	
1518	三井松島産業	18,000	169.00	3,042,000	
1605	国際石油開発帝石	328	522,000.00	171,216,000	
1606	日本海洋掘削	700	2,569.00	1,798,300	
1661	関東天然瓦斯開発	3,000	430.00	1,290,000	
1662	石油資源開発	3,800	3,550.00	13,490,000	

1414	ショーボンドホールディングス	2,400	1,885.00	4,524,000	
1417	ミライト・ホールディングス	7,600	611.00	4,643,600	
1712	ダイセキ環境ソリューション	3	171,600.00	514,800	
1719	間組	10,000	253.00	2,530,000	
1720	東急建設	9,610	220.00	2,114,200	
1721	コムシスホールディングス	13,200	875.00	11,550,000	
1722	ミサワホーム	2,700	672.00	1,814,400	
1762	高松コンストラクショングループ	2,100	1,264.00	2,654,400	
1766	東建コーポレーション	1,000	2,869.00	2,869,000	
1780	ヤマウラ	1,500	230.00	345,000	
1801	大成建設	137,000	211.00	28,907,000	
1802	大林組	81,000	350.00	28,350,000	
1803	清水建設	83,000	331.00	27,473,000	
1808	長谷工コーポレーション	169,500	59.00	10,000,500	
1810	松井建設	3,000	317.00	951,000	
1812	鹿島建設	127,000	253.00	32,131,000	
1813	不動テトラ	19,600	166.00	3,253,600	
1814	大末建設	11,000	68.00	748,000	
1815	鉄建建設	16,000	122.00	1,952,000	
1816	安藤建設	9,000	137.00	1,233,000	
1819	太平工業	5,000	421.00	2,105,000	
1820	西松建設	36,000	189.00	6,804,000	
1821	三井住友建設	17,800	77.00	1,370,600	
1822	大豊建設	7,000	120.00	840,000	
1824	前田建設工業	17,000	328.00	5,576,000	
1827	ナカノフドー建設	2,000	193.00	386,000	
1833	奥村組	26,000	328.00	8,528,000	
1834	大和小田急建設	1,500	215.00	322,500	
1835	東鉄工業	4,000	759.00	3,036,000	
1852	浅沼組	9,000	79.00	711,000	
1860	戸田建設	29,000	291.00	8,439,000	
1861	熊谷組	20,000	90.00	1,800,000	
1865	青木あすなろ建設	2,000	443.00	886,000	
1866	北野建設	6,000	190.00	1,140,000	
1867	植木組	4,000	210.00	840,000	
1868	三井ホーム	3,000	418.00	1,254,000	
1870	矢作建設工業	3,400	409.00	1,390,600	
1871	ピーエス三菱	1,800	460.00	828,000	
1878	大東建託	10,200	6,950.00	70,890,000	
1879	新日本建設	3,300	240.00	792,000	
1881	N I P P O	6,000	855.00	5,130,000	
1882	東亜道路工業	5,000	234.00	1,170,000	
1883	前田道路	8,000	930.00	7,440,000	
1884	日本道路	8,000	344.00	2,752,000	
1885	東亜建設工業	24,000	169.00	4,056,000	
1888	若築建設	15,000	116.00	1,740,000	
1890	東洋建設	41,000	87.00	3,567,000	
1893	五洋建設	34,500	267.00	9,211,500	
1896	大林道路	4,000	267.00	1,068,000	

1899	福田組	4,000	278.00	1,112,000	
1911	住友林業	18,600	701.00	13,038,600	
1914	日本基礎技術	3,200	315.00	1,008,000	
1916	日成ビルド工業	8,000	191.00	1,528,000	
1919	エス・バイ・エル	14,000	169.00	2,366,000	
1921	巴コーポレーション	3,500	322.00	1,127,000	
1924	パナホーム	10,000	541.00	5,410,000	
1925	大和ハウス工業	67,000	991.00	66,397,000	
1926	ライト工業	5,800	513.00	2,975,400	
1928	積水ハウス	76,000	732.00	55,632,000	
1929	日特建設	7,000	123.00	861,000	
1930	北陸電気工事	2,000	233.00	466,000	
1934	ユアテック	4,000	432.00	1,728,000	
1937	西部電気工業	3,000	352.00	1,056,000	
1939	四電工	2,000	333.00	666,000	
1941	中電工	4,000	852.00	3,408,000	
1942	関電工	12,000	420.00	5,040,000	
1944	きんでん	18,000	631.00	11,358,000	
1945	東京エネシス	3,000	482.00	1,446,000	
1946	トーエネック	4,000	436.00	1,744,000	
1949	住友電設	2,000	551.00	1,102,000	
1950	日本電設工業	5,000	756.00	3,780,000	
1951	協和エクシオ	9,000	720.00	6,480,000	
1952	新日本空調	2,200	449.00	987,800	
1956	日本電話施設	5,000	253.00	1,265,000	
1959	九電工	5,000	498.00	2,490,000	
1961	三機工業	6,000	413.00	2,478,000	
1963	日揮	25,000	2,120.00	53,000,000	
1964	中外炉工業	9,000	280.00	2,520,000	
1967	ヤマト	3,000	313.00	939,000	
1968	太平電業	3,000	618.00	1,854,000	
1969	高砂熱学工業	7,800	623.00	4,859,400	
1972	三晃金属工業	3,000	249.00	747,000	
1975	朝日工業社	3,000	333.00	999,000	
1979	大気社	4,200	1,630.00	6,846,000	
1980	ダイダン	4,000	535.00	2,140,000	
1982	日比谷総合設備	3,300	835.00	2,755,500	
1983	東芝プラントシステム	4,000	906.00	3,624,000	
6330	東洋エンジニアリング	15,000	322.00	4,830,000	
6366	千代田化工建設	21,000	878.00	18,438,000	
6379	新興プランテック	5,600	666.00	3,729,600	
2001	日本製粉	17,000	356.00	6,052,000	
2002	日清製粉グループ本社	24,500	941.00	23,054,500	
2003	日東富士製粉	2,000	299.00	598,000	
2004	昭和産業	11,000	249.00	2,739,000	
2009	鳥越製粉	2,300	680.00	1,564,000	
2052	協同飼料	10,000	98.00	980,000	
2053	中部飼料	2,400	535.00	1,284,000	
2056	日本配合飼料	9,000	115.00	1,035,000	

2107	東洋精糖	4,000	100.00	400,000	
2108	日本甜菜製糖	15,000	176.00	2,640,000	
2109	三井製糖	10,000	254.00	2,540,000	
2201	森永製菓	26,000	188.00	4,888,000	
2204	中村屋	6,000	414.00	2,484,000	
2206	江崎グリコ	10,000	895.00	8,950,000	
2207	名糖産業	1,200	1,000.00	1,200,000	
2211	不二家	16,000	168.00	2,688,000	
2212	山崎製パン	20,000	1,058.00	21,160,000	
2215	第一屋製パン	5,000	94.00	470,000	
2217	モロゾフ	4,000	272.00	1,088,000	
2229	カルビー	1,400	3,615.00	5,061,000	
2264	森永乳業	23,000	296.00	6,808,000	
2267	ヤクルト本社	14,500	2,375.00	34,437,500	
2269	明治ホールディングス	8,000	3,350.00	26,800,000	
2270	雪印メグミルク	5,800	1,531.00	8,879,800	
2281	プリマハム	16,000	132.00	2,112,000	
2282	日本ハム	20,000	988.00	19,760,000	
2284	伊藤ハム	15,000	311.00	4,665,000	
2286	林兼産業	9,000	78.00	702,000	
2288	丸大食品	13,000	302.00	3,926,000	
2290	米久	2,400	736.00	1,766,400	
2292	S F o o d s	1,500	701.00	1,051,500	
2501	サッポロホールディングス	44,000	302.00	13,288,000	
2502	アサヒグループホールディングス	50,600	1,776.00	89,865,600	
2503	キリンホールディングス	108,000	953.00	102,924,000	
2531	宝ホールディングス	23,000	499.00	11,477,000	
2533	オエノンホールディングス	7,000	187.00	1,309,000	
2540	養命酒製造	2,000	770.00	1,540,000	
2572	三国コカ・コーラボトリング	2,800	687.00	1,923,600	
2579	コカ・コーラウエスト	9,100	1,345.00	12,239,500	
2580	コカ・コーラ セントラル ジャパン	3,000	1,014.00	3,042,000	
2590	ダイドードリンコ	1,200	3,140.00	3,768,000	
2593	伊藤園	7,500	1,322.00	9,915,000	
2594	キーコーヒー	2,400	1,479.00	3,549,600	
2597	ユニカフェ	800	362.00	289,600	
2599	ジャパンフーズ	400	823.00	329,200	
2602	日清オイリオグループ	10,000	329.00	3,290,000	
2607	不二製油	6,500	1,089.00	7,078,500	
2613	Jーオイルミルズ	10,000	230.00	2,300,000	
2801	キッコーマン	22,000	868.00	19,096,000	
2802	味の素	71,000	928.00	65,888,000	
2809	キューピー	13,700	1,137.00	15,576,900	
2810	ハウス食品	9,600	1,405.00	13,488,000	
2811	カゴメ	10,400	1,590.00	16,536,000	
2812	焼津水産化学工業	1,300	724.00	941,200	
2815	アリアケジャパン	2,500	1,605.00	4,012,500	
2871	ニチレイ	30,000	381.00	11,430,000	
2875	東洋水産	12,000	1,984.00	23,808,000	

2897	日清食品ホールディングス	10,500	2,953.00	31,006,500	
2899	永谷園	2,000	890.00	1,780,000	
2908	フジッコ	3,000	1,006.00	3,018,000	
2910	ロック・フィールド	1,300	1,362.00	1,770,600	
2914	日本たばこ産業	598	418,500.00	250,263,000	
2918	わらべや日洋	1,500	1,054.00	1,581,000	
2922	なとり	1,300	886.00	1,151,800	
4404	ミヨシ油脂	9,000	110.00	990,000	
3001	片倉工業	3,100	730.00	2,263,000	
3002	グンゼ	19,000	243.00	4,617,000	
3101	東洋紡績	106,000	113.00	11,978,000	
3103	ユニチカ	57,000	49.00	2,793,000	
3104	富士紡ホールディングス	11,000	171.00	1,881,000	
3105	日清紡ホールディングス	16,000	702.00	11,232,000	
3106	倉敷紡績	26,000	157.00	4,082,000	
3109	シキボウ	17,000	114.00	1,938,000	
3201	日本毛織	9,000	581.00	5,229,000	
3202	大東紡織	4,000	71.00	284,000	
3204	トーア紡コーポレーション	12,000	59.00	708,000	
3205	ダイドーリミテッド	3,200	675.00	2,160,000	
3302	帝国繊維	2,000	540.00	1,080,000	
3401	帝人	103,000	253.00	26,059,000	
3402	東レ	183,000	573.00	104,859,000	
3408	サカイオーベックス	8,000	135.00	1,080,000	
3501	住江織物	6,000	154.00	924,000	
3512	日本フェルト	1,400	406.00	568,400	
3513	イチカワ	2,000	165.00	330,000	
3514	日本バイリーン	3,000	345.00	1,035,000	
3524	日東製網	3,000	168.00	504,000	
3526	芦森工業	6,000	118.00	708,000	
3529	アツギ	20,000	99.00	1,980,000	
3551	ダイニック	5,000	154.00	770,000	
3569	セーレン	6,300	473.00	2,979,900	
3577	東海染工	4,000	92.00	368,000	
3580	小松精練	4,000	388.00	1,552,000	
3591	ワコールホールディングス	15,000	1,016.00	15,240,000	
3593	ホギメディカル	1,600	3,305.00	5,288,000	
3606	レナウン	5,800	154.00	893,200	
3607	クラウディア	300	1,075.00	322,500	
3608	T S I ホールディングス	11,200	462.00	5,174,400	
8011	三陽商会	12,000	209.00	2,508,000	
8013	ナイガイ	8,000	57.00	456,000	
8016	オンワードホールディングス	16,000	668.00	10,688,000	
8029	ルック	5,000	231.00	1,155,000	
8111	ゴールドウイン	6,000	442.00	2,652,000	
8114	デサント	6,000	417.00	2,502,000	
8127	ヤマトインターナショナル	1,500	375.00	562,500	
3708	特種東海製紙	16,000	179.00	2,864,000	
3861	王子製紙	111,000	395.00	43,845,000	

3864	三菱製紙	36,000	83.00	2,988,000	
3865	北越紀州製紙	15,500	514.00	7,967,000	
3877	中越パルプ工業	9,000	162.00	1,458,000	
3878	巴川製紙所	4,000	188.00	752,000	
3880	大王製紙	11,000	516.00	5,676,000	
3893	日本製紙グループ本社	12,200	1,803.00	21,996,600	
3941	レンゴー	20,000	543.00	10,860,000	
3946	トーモク	8,000	224.00	1,792,000	
3950	ザ・バック	1,400	1,165.00	1,631,000	
3405	クラレ	40,000	1,101.00	44,040,000	
3407	旭化成	147,000	488.00	71,736,000	
3553	共和レザー	1,600	308.00	492,800	
4003	コープケミカル	4,000	121.00	484,000	
4004	昭和電工	157,000	164.00	25,748,000	
4005	住友化学	173,000	321.00	55,533,000	
4007	日本化成	5,000	141.00	705,000	
4008	住友精化	5,000	353.00	1,765,000	
4021	日産化学工業	19,200	782.00	15,014,400	
4022	ラサ工業	11,000	127.00	1,397,000	
4023	クレハ	16,000	420.00	6,720,000	
4027	テイカ	4,000	298.00	1,192,000	
4028	石原産業	43,000	89.00	3,827,000	
4031	片倉チッカリン	2,000	227.00	454,000	
4041	日本曹達	15,000	366.00	5,490,000	
4042	東ソー	68,000	232.00	15,776,000	
4043	トクヤマ	39,000	288.00	11,232,000	
4044	セントラル硝子	24,000	367.00	8,808,000	
4045	東亜合成	32,000	347.00	11,104,000	
4046	ダイソー	10,000	257.00	2,570,000	
4047	関東電化工業	6,000	298.00	1,788,000	
4061	電気化学工業	53,000	320.00	16,960,000	
4063	信越化学工業	45,200	4,155.00	187,806,000	
4064	日本カーバイド工業	8,000	121.00	968,000	
4078	堺化学工業	8,000	303.00	2,424,000	
4088	エア・ウォーター	20,000	1,033.00	20,660,000	
4091	大陽日酸	33,000	518.00	17,094,000	

[次へ](#)

２【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2012年2月29日現在です。

【純資産額計算書】

I 資産総額	203,125,535 円
II 負債総額	156,639 円
III 純資産総額（I－II）	202,968,896 円
IV 発行済口数	373,249,040 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	0.5438 円

（参考）日本株式インデックスTOPIXマザーファンド**純資産額計算書**

I 資産総額	26,783,780,686 円
II 負債総額	90,181,769 円
III 純資産総額（I－II）	26,693,598,917 円
IV 発行済口数	40,995,502,507 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	0.6511 円

（参考）海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド**純資産額計算書**

I 資産総額	67,244,022,958 円
II 負債総額	101,685,905 円
III 純資産総額（I－II）	67,142,337,053 円
IV 発行済口数	71,752,406,171 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	0.9358 円

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

I 資産総額	7,315,074,990 円
II 負債総額	3,647,720 円
III 純資産総額（I－II）	7,311,427,270 円
IV 発行済口数	6,442,202,154 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.1349 円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】**（１）名義書換**

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

（２）受益者に対する特典

該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容

- ① 譲渡制限はありません。
- ② 受益権の譲渡

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

③ 受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】**第1【委託会社等の概況】****1【委託会社等の概況】****(1) 資本金の額**

平成24年2月末現在

資本金	17,363,045,900円
発行可能株式総数	230,000,000株
発行済株式総数	197,012,500株

●過去5年間ににおける主な資本金の増減

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

(2) 会社の意思決定機関

・株主総会

取締役・監査役の選任および定款変更に係る決議などを行ないます。

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

・取締役会

当社の業務執行を決定し、取締役の職務の執行について監督します。

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

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

・監査役会

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

(平成24年2月末現在)

(3) 運用の意思決定プロセス

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

(平成24年2月末現在)

2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、平成24年2月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	420	72,172
株式投資信託	354	58,560
単位型	42	1,376
追加型	312	57,184
公社債投資信託	66	13,611
単位型	49	604
追加型	17	13,007
投資法人合計	1	30

3【委託会社等の経理状況】

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

（１）【貸借対照表】

（単位：百万円）

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

(単位：百万円)

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

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

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

(単位：百万円)		
	第51期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第52期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
営業外収益		
受取利息	2	2
受取配当金	※ 1 714	※ 1 1,071
有価証券償還益	13	29
時効成立分配金・償還金	23	8
その他	123	10
営業外収益計	876	1,121
営業外費用		
支払利息	9	10
時効成立後支払分配金・償還金	56	34
支払源泉所得税	71	106
為替差損	53	1
弁護士報酬等	37	—
その他	111	0
営業外費用計	340	153
経常利益	3,397	4,448
特別利益		
投資有価証券売却益	84	49
子会社投資損失引当金戻入額	—	576
その他	—	23
特別利益計	84	649
特別損失		
投資有価証券売却損	12	0
固定資産処分損	7	4
特別賞与引当金繰入額	3,742	—
役員特別賞与引当金繰入額	355	—
割増退職金	29	—
過年度敷金償却費用	—	58
その他	246	—
特別損失計	4,393	62
税引前当期純利益又は税引前当期純損失 (△)	△911	5,034
法人税、住民税及び事業税	482	1,134
法人税等調整額	△697	705
法人税等合計	△214	1,839
当期純利益又は当期純損失(△)	△696	3,195

(3) 【株主資本等変動計算書】

	(単位：百万円)	
	第51期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第52期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	16,403	17,363
当期変動額		
新株の発行	960	—
当期変動額合計	960	—
当期末残高	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	4,272	5,220
当期変動額		
新株の発行	948	—
当期変動額合計	948	—
当期末残高	5,220	5,220
その他資本剰余金		
前期末残高	4	4
当期変動額		
当期変動額合計	—	—
当期末残高	4	4
資本剰余金合計		
前期末残高	4,277	5,225
当期変動額		
新株の発行	948	—
当期変動額合計	948	—
当期末残高	5,225	5,225
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		
前期末残高	20,593	18,814
当期変動額		
剰余金の配当	△1,082	△305
当期純利益又は当期純損失(△)	△696	3,195
当期変動額合計	△1,779	2,889
当期末残高	18,814	21,703
利益剰余金合計		
前期末残高	20,593	18,814
当期変動額		
剰余金の配当	△1,082	△305
当期純利益又は当期純損失(△)	△696	3,195
当期変動額合計	△1,779	2,889
当期末残高	18,814	21,703

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

重要な会計方針

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

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

会計方針の変更

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

追加情報

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

注記事項 (貸借対照表関係)

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

(損益計算書関係)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第51期（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

(注) 自己株式の増加及び減少は、自己株式の取得及び処分であります。

3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

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

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

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

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

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

第52期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

(注) 自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

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

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

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

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

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(リース取引関係)

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

（金融商品関係）

第51期(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項**(1) 金融商品に対する取組方針**

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制**①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理**

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

②市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

③流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

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

(※)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

②市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

③流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

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

(※)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

(有価証券関係)

第51期(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時 価	差 額
子会社株式	1,404	1,734	329
合 計	1,404	1,734	329

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種 類	貸借対照表計上額	取 得 原 価	差 額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株 式	21	7	14
	そ の 他	9,873	9,637	235
	小 計	9,894	9,644	250
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	そ の 他	979	1,024	△ 45
	小 計	979	1,024	△ 45
合 計		10,873	10,669	204

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種 類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
株 式	11	—	12
そ の 他	230	84	0
合 計	242	84	12

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時 価	差 額
子会社株式	1,404	1,672	268
合 計	1,404	1,672	268

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種 類	貸借対照表計上額	取 得 原 価	差 額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるものの	株 式	31	7	24
	そ の 他	5,560	5,363	196
	小 計	5,591	5,370	220
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	そ の 他	1,291	1,404	△ 113
	小 計	1,291	1,404	△ 113
合 計		6,882	6,775	107

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種 類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	144	49	0
合 計	144	49	0

(持分法損益等)

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

(退職給付関係)

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

(ストックオプション等関係)

第51期(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

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

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

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

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

(2) スtockオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

① スtockオプション（新株予約権）の数

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

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

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

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

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

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

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

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

② 単価情報

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 1 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

① ストックオプション（新株予約権）の数

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

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

(注) 1 株式数に換算して記載しております。

② 単価情報

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

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

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

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

(税効果会計関係)

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

(関連当事者情報)

第51期(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

資産合計	10,090百万円
負債合計	1,626百万円
純資産合計	8,464百万円

営業収益	10,606百万円
税引前当期純利益	4,405百万円
当期純利益	3,482百万円

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

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

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

(注) 1 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

(注) 1 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

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

(セグメント情報等)

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1 セグメント情報

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

2 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

①営業収益

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

②有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

3 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

(注) 算定上の基礎

1 1株当たり純資産額

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

2 1株当たり当期純利益又は1株当たり当期純損失

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

(重要な後発事象)

第51期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第52期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
—	—

- 1 当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 2 金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第53期中間会計期間（平成23年4月1日から平成23年9月30日まで）の中間財務諸表について、あらた監査法人により中間監査を受けております。

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第53期中間会計期間
(平成23年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金		17,081
未収委託者報酬		5,482
未収収益		589
関係会社短期貸付金		434
繰延税金資産		678
その他	※ 2	1,292
流動資産合計		25,558

固定資産

有形固定資産	※ 1	217
無形固定資産		84
投資その他の資産		
投資有価証券		2,765
関係会社株式		24,320
長期差入保証金		784
繰延税金資産		982
その他		60
投資その他の資産合計		28,913
固定資産合計		29,214
資産合計		54,773

(単位：百万円)

第53期中間会計期間
(平成23年9月30日)

負債の部

流動負債

未払金	2,944
未払費用	3,149
未払法人税等	687
未払消費税等	231
賞与引当金	1,130
役員賞与引当金	100
その他	1,588

流動負債合計	9,831
--------	-------

固定負債

退職給付引当金	859
その他	55

固定負債合計	915
--------	-----

負債合計	10,746
------	--------

純資産の部

株主資本

資本金	17,363
資本剰余金	
資本準備金	5,220
資本剰余金合計	5,220

利益剰余金

その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	21,604
利益剰余金合計	21,604

自己株式	△ 68
------	------

株主資本合計	44,119
--------	--------

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	△ 92
--------------	------

評価・換算差額等合計	△ 92
------------	------

純資産合計	44,027
-------	--------

負債純資産合計	54,773
---------	--------

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第53期中間会計期間
(自 平成23年4月1日
至 平成23年9月30日)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：百万円)

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

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

重要な会計方針

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

追加情報

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

注記事項

(中間貸借対照表関係)

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

(中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第53期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

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

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

2 第1回新株予約権の増加は、新株予約権の発行によるものであります。

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

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

該当事項はありません。

(リース取引関係)

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

(金融商品関係)

第53期中間会計期間（平成23年9月30日）

1 金融商品の時価等に関する事項

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

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

(※)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、株式は市場価格、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

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

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

(有価証券関係)

第53期中間会計期間(平成23年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

	中間貸借対照表計上額 (百万円)	時 価 (百万円)	差 額 (百万円)
子会社株式	1,404	1,408	3
合 計	1,404	1,408	3

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

2 その他有価証券

	種 類	中間貸借対照表計上額 (百万円)	取 得 原 価 (百万円)	差 額 (百万円)
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの	株 式	26	7	19
	そ の 他	971	901	69
	小 計	997	908	89
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの	そ の 他	1,620	1,864	△ 244
	小 計	1,620	1,864	△ 244
合 計		2,617	2,773	△ 155

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

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

(持分法損益等)

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

(ストックオプション等関係)

第53期中間会計期間(自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

第53期中間会計期間(自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)

1 セグメント情報

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

2 関連情報**(1) 製品及びサービスごとの情報**

当社の製品及びサービスは単一であるため、記載しておりません。

(2) 地域ごとの情報**① 営業収益**

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

② 有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

(1株当たり情報)

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

(注) 算定上の基礎

1 1株当たり純資産額

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

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

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

(重要な後発事象)

第53期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

新株予約権（ストックオプション）の付与

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

- | | |
|-----------------------|--------------------------|
| ① 新株予約権の数 | 1,849個 |
| ② 新株予約権の目的となる株式の種類及び数 | 当社普通株式 6,101,700株 |
| ③ 新株予約権の発行価額 | 無償 |
| ④ 新株予約権の行使時の払込金額 | 1株当たり金737円（注） |
| ⑤ 新株予約権の行使期間 | 平成25年10月7日から平成33年10月6日まで |

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

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常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なうこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記（３）、（４）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】**(1) 定款の変更**

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】**1【名称、資本金の額及び事業の内容】****(1) 受託会社**

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

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (平成23年9月末現在)	事業の内容
SMB C日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(3) 投資顧問会社

名 称	資本金の額 (平成23年12月末現在)	事業の内容
日興グローバルラップ株式会社	1,499百万円	資産運用に関する業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】**(1) 受託会社**

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

(2) 販売会社

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

(3) 投資顧問会社

投資対象とする各投資信託証券の組入比率について投資助言を行ないます。

3【資本関係】**（1）受託会社**

該当事項はありません。

（2）販売会社

該当事項はありません。

（3）投資顧問会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
平成23年11月15日	有価証券報告書
平成23年11月15日	有価証券届出書の訂正届出書

4092	日本化学工業	10,000	142.00	1,420,000	
4095	日本パーカライジング	6,000	1,199.00	7,194,000	
4097	高圧ガス工業	4,000	483.00	1,932,000	
4099	四国化成工業	3,000	433.00	1,299,000	
4100	戸田工業	3,000	667.00	2,001,000	
4109	ステラ ケミファ	1,200	2,254.00	2,704,800	
4112	保土谷化学工業	5,000	269.00	1,345,000	
4114	日本触媒	18,000	974.00	17,532,000	
4116	大日精化工業	9,000	365.00	3,285,000	
4118	カネカ	31,000	445.00	13,795,000	
4182	三菱瓦斯化学	43,000	486.00	20,898,000	
4183	三井化学	107,000	263.00	28,141,000	
4185	J S R	23,000	1,627.00	37,421,000	
4186	東京応化工業	4,500	1,824.00	8,208,000	
4187	大阪有機化学工業	1,600	429.00	686,400	
4188	三菱ケミカルホールディングス	157,500	461.00	72,607,500	
4201	日本合成化学工業	5,000	493.00	2,465,000	
4202	ダイセル	33,000	514.00	16,962,000	
4203	住友ベークライト	22,000	474.00	10,428,000	
4204	積水化学工業	53,000	664.00	35,192,000	
4205	日本ゼオン	24,000	696.00	16,704,000	
4206	アイカ工業	6,600	1,129.00	7,451,400	
4208	宇部興産	106,000	239.00	25,334,000	
4212	積水樹脂	4,000	794.00	3,176,000	
4215	タキロン	6,000	272.00	1,632,000	
4216	旭有機材工業	9,000	226.00	2,034,000	
4217	日立化成工業	10,900	1,481.00	16,142,900	
4218	ニチバン	3,000	262.00	786,000	
4220	リケンテクノス	4,000	248.00	992,000	
4221	大倉工業	6,000	248.00	1,488,000	
4228	積水化成成品工業	7,000	280.00	1,960,000	
4229	群栄化学工業	7,000	207.00	1,449,000	
4231	タイガースポリマー	1,300	306.00	397,800	
4271	日本カーリット	2,000	408.00	816,000	
4272	日本化薬	18,000	743.00	13,374,000	
4362	日本精化	2,100	550.00	1,155,000	
4401	A D E K A	10,800	777.00	8,391,600	
4403	日油	20,000	401.00	8,020,000	
4410	ハリマ化成	2,100	571.00	1,199,100	
4452	花王	66,900	2,041.00	136,542,900	
4461	第一工業製薬	5,000	230.00	1,150,000	
4471	三洋化成工業	8,000	541.00	4,328,000	
4611	大日本塗料	15,000	96.00	1,440,000	
4612	日本ペイント	24,000	629.00	15,096,000	
4613	関西ペイント	28,000	776.00	21,728,000	
4614	トウペ	3,000	100.00	300,000	
4617	中国塗料	8,000	536.00	4,288,000	
4619	日本特殊塗料	2,000	336.00	672,000	
4620	藤倉化成	3,200	399.00	1,276,800	

4626	太陽ホールディングス	2,000	2,126.00	4,252,000	
4631	D I C	97,000	155.00	15,035,000	
4633	サカタインクス	5,000	372.00	1,860,000	
4634	東洋インキ S Cホールディングス	23,000	311.00	7,153,000	
4901	富士フイルムホールディングス	53,900	1,898.00	102,302,200	
4911	資生堂	41,800	1,393.00	58,227,400	
4912	ライオン	29,000	469.00	13,601,000	
4914	高砂香料工業	8,000	374.00	2,992,000	
4917	マンダム	2,500	1,948.00	4,870,000	
4919	ミルボン	1,300	2,407.00	3,129,100	
4921	ファンケル	6,300	1,046.00	6,589,800	
4922	コーセー	4,100	1,847.00	7,572,700	
4924	ドクターシーラボ	15	389,000.00	5,835,000	
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	2,600	1,995.00	5,187,000	
4951	エスター	1,600	1,009.00	1,614,400	
4956	コニシ	1,800	1,058.00	1,904,400	
4958	長谷川香料	3,200	1,214.00	3,884,800	
4967	小林製薬	3,500	3,930.00	13,755,000	
4968	荒川化学工業	2,000	735.00	1,470,000	
4971	メック	1,900	317.00	602,300	
4973	日本高純度化学	7	209,000.00	1,463,000	
4975	荏原ユーザライト	400	2,285.00	914,000	
4985	アース製薬	1,800	2,855.00	5,139,000	
4989	イハラケミカル工業	4,000	316.00	1,264,000	
4992	北興化学工業	3,000	232.00	696,000	
4994	大成ラミック	700	2,527.00	1,768,900	
4996	クミアイ化学工業	6,000	332.00	1,992,000	
4997	日本農薬	6,000	347.00	2,082,000	
5142	アキレス	21,000	117.00	2,457,000	
5208	有沢製作所	4,200	332.00	1,394,400	
6988	日東電工	20,800	3,240.00	67,392,000	
7874	レック	800	1,272.00	1,017,600	
7908	きもと	2,100	527.00	1,106,700	
7917	藤森工業	1,800	1,291.00	2,323,800	
7925	前澤化成工業	1,800	854.00	1,537,200	
7942	J S P	1,700	1,192.00	2,026,400	
7947	エフピコ	1,100	5,410.00	5,951,000	
7958	天馬	2,000	776.00	1,552,000	
7970	信越ポリマー	4,900	359.00	1,759,100	
7971	東リ	7,000	170.00	1,190,000	
7988	ニフコ	5,600	2,027.00	11,351,200	
7995	日本バルカー工業	10,000	224.00	2,240,000	
8113	ユニ・チャーム	13,900	4,190.00	58,241,000	
4151	協和発酵キリン	34,000	914.00	31,076,000	
4502	武田薬品工業	94,400	3,435.00	324,264,000	代用有価証券 10,000株
4503	アステラス製薬	56,000	3,235.00	181,160,000	
4506	大日本住友製薬	17,900	847.00	15,161,300	
4507	塩野義製薬	39,400	1,054.00	41,527,600	

4508	田辺三菱製薬	25,100	1,067.00	26,781,700	
4512	わかもと製薬	3,000	240.00	720,000	
4514	あすか製薬	3,000	499.00	1,497,000	
4516	日本新薬	5,000	955.00	4,775,000	
4519	中外製薬	29,300	1,252.00	36,683,600	
4521	科研製薬	10,000	1,015.00	10,150,000	
4523	エーザイ	31,000	3,160.00	97,960,000	
4527	ロート製薬	10,000	942.00	9,420,000	
4528	小野薬品工業	12,300	4,400.00	54,120,000	
4530	久光製薬	7,800	3,545.00	27,651,000	
4531	有機合成薬品工業	2,000	204.00	408,000	
4534	持田製薬	9,000	924.00	8,316,000	
4536	参天製薬	8,500	3,180.00	27,030,000	
4538	扶桑薬品工業	9,000	210.00	1,890,000	
4539	日本ケミファ	4,000	350.00	1,400,000	
4540	ツムラ	6,900	2,316.00	15,980,400	
4541	日医工	4,300	1,774.00	7,628,200	
4547	キッセイ薬品工業	4,700	1,552.00	7,294,400	
4548	生化学工業	4,800	895.00	4,296,000	
4549	栄研化学	2,000	1,096.00	2,192,000	
4550	日水製薬	1,100	723.00	795,300	
4551	鳥居薬品	1,700	1,519.00	2,582,300	
4553	東和薬品	1,300	3,370.00	4,381,000	
4555	沢井製薬	1,700	7,990.00	13,583,000	
4559	ゼリア新薬工業	4,000	1,356.00	5,424,000	
4568	第一三共	84,800	1,461.00	123,892,800	
4569	キョーリン製薬ホールディングス	6,000	1,416.00	8,496,000	
4574	大幸薬品	1,200	842.00	1,010,400	
4577	ダイト	700	1,150.00	805,000	
4578	大塚ホールディングス	50,000	2,183.00	109,150,000	
4581	大正製薬ホールディングス	6,100	6,960.00	42,456,000	
3315	日本コークス工業	20,500	115.00	2,357,500	
5002	昭和シェル石油	22,600	527.00	11,910,200	
5007	コスモ石油	70,000	219.00	15,330,000	
5011	ニチレキ	3,000	445.00	1,335,000	
5012	東燃ゼネラル石油	38,000	730.00	27,740,000	
5013	ユシロ化学工業	1,400	850.00	1,190,000	
5015	ビービー・カストロール	1,000	337.00	337,000	
5017	AOCホールディングス	5,900	506.00	2,985,400	
5018	MORESCO	500	907.00	453,500	
5019	出光興産	3,000	8,060.00	24,180,000	
5020	JXホールディングス	279,600	491.00	137,283,600	
5101	横浜ゴム	31,000	504.00	15,624,000	
5105	東洋ゴム工業	19,000	206.00	3,914,000	
5108	ブリヂストン	79,000	1,776.00	140,304,000	
5110	住友ゴム工業	19,700	962.00	18,951,400	
5121	藤倉ゴム工業	1,600	307.00	491,200	
5122	オカモト	9,000	300.00	2,700,000	
5185	フコク	1,000	747.00	747,000	

5186	ニッタ	2,500	1,391.00	3,477,500	
5191	東海ゴム工業	4,700	914.00	4,295,800	
5192	三ツ星ベルト	7,000	433.00	3,031,000	
5195	バンドー化学	9,000	313.00	2,817,000	
3110	日東紡績	19,000	268.00	5,092,000	
5201	旭硝子	124,000	660.00	81,840,000	
5202	日本板硝子	108,000	136.00	14,688,000	
5204	石塚硝子	3,000	151.00	453,000	
5210	日本山村硝子	10,000	202.00	2,020,000	
5214	日本電気硝子	48,000	690.00	33,120,000	
5218	オハラ	1,000	848.00	848,000	
5232	住友大阪セメント	51,000	250.00	12,750,000	
5233	太平洋セメント	148,000	175.00	25,900,000	
5234	デイ・シイ	2,500	284.00	710,000	
5262	日本ヒューム	3,000	389.00	1,167,000	
5269	日本コンクリート工業	4,000	291.00	1,164,000	
5301	東海カーボン	22,000	418.00	9,196,000	
5302	日本カーボン	12,000	212.00	2,544,000	
5310	東洋炭素	1,200	3,210.00	3,852,000	
5331	ノリタケカンパニーリミテド	13,000	252.00	3,276,000	
5332	TOTO	39,000	600.00	23,400,000	
5333	日本碍子	33,000	1,019.00	33,627,000	
5334	日本特殊陶業	22,000	1,034.00	22,748,000	
5337	ダントーホールディングス	4,000	90.00	360,000	
5344	MARUWA	700	3,180.00	2,226,000	
5351	品川リフラクトリーズ	6,000	235.00	1,410,000	
5352	黒崎播磨	5,000	267.00	1,335,000	
5363	東京窯業	3,000	191.00	573,000	
5367	ニッカトー	900	491.00	441,900	
5384	フジミインコーポレーテッド	2,300	1,011.00	2,325,300	
5391	エーアンドエーマテリアル	6,000	91.00	546,000	
5393	ニチアス	11,000	437.00	4,807,000	
7943	ニチハ	2,800	891.00	2,494,800	
5401	新日本製鐵	661,000	211.00	139,471,000	
5405	住友金属工業	467,000	151.00	70,517,000	
5406	神戸製鋼所	349,000	132.00	46,068,000	
5407	日新製鋼	89,000	129.00	11,481,000	
5408	中山製鋼所	13,000	95.00	1,235,000	
5410	合同製鐵	14,000	210.00	2,940,000	
5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	59,700	1,524.00	90,982,800	
5423	東京製鐵	12,800	614.00	7,859,200	
5440	共英製鋼	2,700	1,468.00	3,963,600	
5444	大和工業	5,700	2,496.00	14,227,200	
5445	東京鐵鋼	5,000	287.00	1,435,000	
5449	大阪製鐵	1,600	1,447.00	2,315,200	
5451	淀川製鋼所	18,000	361.00	6,498,000	
5453	東洋鋼板	6,000	300.00	1,800,000	
5457	住友鋼管	1,500	669.00	1,003,500	
5463	丸一鋼管	7,700	1,786.00	13,752,200	

5464	モリ工業	4,000	285.00	1,140,000	
5471	大同特殊鋼	42,000	515.00	21,630,000	
5476	日本高周波鋼業	10,000	108.00	1,080,000	
5479	日本金属工業	20,000	75.00	1,500,000	
5480	日本冶金工業	19,000	139.00	2,641,000	
5481	山陽特殊製鋼	12,000	458.00	5,496,000	
5482	愛知製鋼	13,000	416.00	5,408,000	
5486	日立金属	16,000	923.00	14,768,000	
5491	日本金属	6,000	157.00	942,000	
5541	大太平洋金属	17,000	424.00	7,208,000	
5563	日本電工	9,000	335.00	3,015,000	
5602	栗本鐵工所	12,000	216.00	2,592,000	
5606	旭テック	22,000	33.00	726,000	
5612	日本鑄鉄管	3,000	188.00	564,000	
5632	三菱製鋼	15,000	249.00	3,735,000	
5658	日亜鋼業	4,000	205.00	820,000	
5659	日本精線	2,000	391.00	782,000	
6319	シンニッタン	2,200	402.00	884,400	
7305	新家工業	6,000	133.00	798,000	
5701	日本軽金属	57,000	113.00	6,441,000	
5702	大紀アルミニウム工業所	4,000	280.00	1,120,000	
5706	三井金属鉱業	69,000	230.00	15,870,000	
5707	東邦亜鉛	14,000	334.00	4,676,000	
5711	三菱マテリアル	157,000	249.00	39,093,000	
5713	住友金属鉱山	65,000	1,130.00	73,450,000	
5714	DOWAホールディングス	30,000	492.00	14,760,000	
5715	古河機械金属	43,000	74.00	3,182,000	
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	2,500	3,460.00	8,650,000	
5727	東邦チタニウム	4,100	1,363.00	5,588,300	
5738	住友軽金属工業	61,000	79.00	4,819,000	
5741	古河スカイ	10,000	231.00	2,310,000	
5801	古河電気工業	79,000	215.00	16,985,000	
5802	住友電気工業	89,000	971.00	86,419,000	
5803	フジクラ	38,000	265.00	10,070,000	
5805	昭和電線ホールディングス	33,000	82.00	2,706,000	
5809	タツタ電線	5,000	414.00	2,070,000	
5812	日立電線	20,000	186.00	3,720,000	
5815	沖電線	3,000	164.00	492,000	
5819	カナレ電気	300	1,224.00	367,200	
5821	平河ヒューテック	500	757.00	378,500	
5851	リョービ	14,000	309.00	4,326,000	
5857	アサヒホールディングス	3,500	1,607.00	5,624,500	
3421	稲葉製作所	1,300	942.00	1,224,600	
3431	宮地エンジニアリンググループ	8,000	174.00	1,392,000	
3432	三協・立山ホールディングス	34,000	141.00	4,794,000	
3433	トーカロ	1,400	1,684.00	2,357,600	
3434	アルファC o	900	1,029.00	926,100	
3436	SUMCO	15,500	730.00	11,315,000	
3443	川田テクノロジーズ	600	1,300.00	780,000	

5901	東洋製罐	17,800	1,097.00	19,526,600	
5902	ホッカンホールディングス	6,000	235.00	1,410,000	
5909	コロナ	1,200	1,222.00	1,466,400	
5911	横河ブリッジホールディングス	5,000	565.00	2,825,000	
5915	駒井ハルテック	5,000	271.00	1,355,000	

[次へ](#)

5929	三和ホールディングス	25,000	286.00	7,150,000	
5930	文化シャッター	7,000	296.00	2,072,000	
5936	東洋シャッター	800	392.00	313,600	
5938	住生活グループ	32,800	1,705.00	55,924,000	
5942	日本フィルコン	1,900	408.00	775,200	
5943	ノーリツ	4,900	1,490.00	7,301,000	
5946	長府製作所	2,400	1,983.00	4,759,200	
5947	リンナイ	4,000	5,610.00	22,440,000	
5951	ダイニチ工業	1,300	805.00	1,046,500	
5957	日東精工	3,000	216.00	648,000	
5958	三洋工業	4,000	177.00	708,000	
5959	岡部	5,000	419.00	2,095,000	
5974	中国工業	5,000	106.00	530,000	
5975	東プレ	4,800	798.00	3,830,400	
5976	高周波熱錬	3,400	746.00	2,536,400	
5981	東京製綱	16,000	183.00	2,928,000	
5988	バイオラックス	1,100	1,944.00	2,138,400	
5991	日本発條	18,200	802.00	14,596,400	
5992	中央発條	3,000	294.00	882,000	
5998	アドバネクス	6,000	71.00	426,000	
8155	三益半導体工業	2,100	742.00	1,558,200	
1978	アタカ大機	2,000	273.00	546,000	
5631	日本製鋼所	39,000	628.00	24,492,000	
5963	日立ツール	1,400	880.00	1,232,000	
6005	三浦工業	3,700	2,224.00	8,228,800	
6013	タクマ	9,000	388.00	3,492,000	
6101	ツガミ	6,000	560.00	3,360,000	
6103	オークマ	15,000	614.00	9,210,000	
6104	東芝機械	14,000	407.00	5,698,000	
6113	アマダ	36,000	539.00	19,404,000	
6118	アイダエンジニアリング	6,600	420.00	2,772,000	
6135	牧野フライス製作所	13,000	549.00	7,137,000	
6136	オーエスジー	11,100	1,202.00	13,342,200	
6138	ダイジェット工業	3,000	162.00	486,000	
6140	旭ダイヤモンド工業	6,200	980.00	6,076,000	
6141	森精機製作所	13,300	776.00	10,320,800	
6146	ディスコ	2,600	4,130.00	10,738,000	
6151	日東工器	1,400	1,888.00	2,643,200	
6203	豊和工業	14,000	75.00	1,050,000	
6205	大阪機工	10,000	117.00	1,170,000	
6210	東洋機械金属	2,000	216.00	432,000	
6217	津田駒工業	6,000	195.00	1,170,000	
6222	島精機製作所	3,300	1,447.00	4,775,100	
6247	日阪製作所	3,000	834.00	2,502,000	
6250	やまびこ	1,000	1,022.00	1,022,000	
6262	ペガサスミシン製造	2,400	224.00	537,600	
6268	ナブテスコ	10,500	1,748.00	18,354,000	
6269	三井海洋開発	2,100	1,443.00	3,030,300	
6272	レオン自動機	3,000	201.00	603,000	

6273	SMC	7,500	13,570.00	101,775,000	
6274	新川	2,000	424.00	848,000	
6277	ホソカワミクロン	4,000	418.00	1,672,000	
6278	ユニオンツール	1,400	1,368.00	1,915,200	
6282	オイレス工業	2,800	1,505.00	4,214,000	
6287	サトーホールディングス	2,600	1,070.00	2,782,000	
6291	日本エアーテック	800	378.00	302,400	
6293	日精樹脂工業	2,100	392.00	823,200	
6298	ワイエイシイ	1,000	640.00	640,000	
6301	小松製作所	119,500	2,238.00	267,441,000	
6302	住友重機械工業	64,000	429.00	27,456,000	
6305	日立建機	12,900	1,550.00	19,995,000	
6306	日工	3,000	310.00	930,000	
6309	巴工業	900	1,489.00	1,340,100	
6310	井関農機	26,000	199.00	5,174,000	
6315	TOWA	2,300	491.00	1,129,300	
6316	丸山製作所	6,000	185.00	1,110,000	
6317	北川鉄工所	12,000	153.00	1,836,000	
6326	クボタ	115,000	770.00	88,550,000	
6328	荏原実業	600	1,208.00	724,800	
6331	三菱化工機	8,000	158.00	1,264,000	
6332	月島機械	4,000	672.00	2,688,000	
6333	帝国電機製作所	800	1,435.00	1,148,000	
6339	新東工業	5,500	771.00	4,240,500	
6340	澁谷工業	1,500	871.00	1,306,500	
6345	アイチ コーポレーション	4,100	336.00	1,377,600	
6349	小森コーポレーション	7,200	555.00	3,996,000	
6351	鶴見製作所	2,000	625.00	1,250,000	
6355	住友精密工業	4,000	498.00	1,992,000	
6358	酒井重工業	5,000	186.00	930,000	
6361	荏原製作所	41,000	280.00	11,480,000	
6362	石井鐵工所	4,000	166.00	664,000	
6363	西島製作所	2,900	1,102.00	3,195,800	
6367	ダイキン工業	30,700	2,258.00	69,320,600	
6368	オルガノ	5,000	609.00	3,045,000	
6369	トーヨーカネツ	13,000	177.00	2,301,000	
6370	栗田工業	13,900	2,050.00	28,495,000	
6371	椿本チエイン	13,000	466.00	6,058,000	
6373	大同工業	5,000	146.00	730,000	
6375	日本コンベヤ	8,000	85.00	680,000	
6378	木村化工機	2,300	367.00	844,100	
6381	アネスト岩田	4,000	345.00	1,380,000	
6383	ダイフク	11,000	454.00	4,994,000	
6390	加藤製作所	6,000	294.00	1,764,000	
6393	油研工業	4,000	173.00	692,000	
6395	タダノ	12,000	523.00	6,276,000	
6406	フジテック	7,000	505.00	3,535,000	
6407	シーケーディ	6,800	586.00	3,984,800	
6409	キトー	10	62,100.00	621,000	

6412	平和	5,200	1,497.00	7,784,400	
6413	理想科学工業	1,700	1,157.00	1,966,900	
6417	SANKYO	7,300	3,785.00	27,630,500	
6418	日本金銭機械	2,200	591.00	1,300,200	
6419	マースエンジニアリング	1,300	1,422.00	1,848,600	
6420	福島工業	600	1,025.00	615,000	
6428	オーイズミ	900	256.00	230,400	
6430	ダイコク電機	1,100	910.00	1,001,000	
6436	アマノ	7,200	707.00	5,090,400	
6440	JUKI	15,000	167.00	2,505,000	
6444	サンデン	13,000	261.00	3,393,000	
6445	蛇の目ミシン工業	24,000	68.00	1,632,000	
6454	マックス	4,000	966.00	3,864,000	
6457	グローリー	7,200	1,762.00	12,686,400	
6459	大和冷機工業	3,000	430.00	1,290,000	
6460	セガサミーホールディングス	25,900	1,551.00	40,170,900	
6461	日本ピストンリング	9,000	178.00	1,602,000	
6462	リケン	9,000	331.00	2,979,000	
6463	TPR	2,700	1,099.00	2,967,300	
6465	ホシザキ電機	4,800	1,844.00	8,851,200	
6470	大豊工業	1,700	844.00	1,434,800	
6471	日本精工	54,000	604.00	32,616,000	
6472	NTN	56,000	337.00	18,872,000	
6473	ジェイテクト	23,100	869.00	20,073,900	
6474	不二越	24,000	433.00	10,392,000	
6480	日本トムソン	8,000	473.00	3,784,000	
6481	THK	16,000	1,663.00	26,608,000	
6482	ユーシン精機	1,200	1,564.00	1,876,800	
6485	前澤給装工業	900	1,080.00	972,000	
6486	イーグル工業	3,000	688.00	2,064,000	
6489	前澤工業	1,900	234.00	444,600	
6490	日本ビラー工業	2,000	606.00	1,212,000	
6498	キッツ	9,900	348.00	3,445,200	
6581	日立工機	6,400	656.00	4,198,400	
6586	マキタ	15,700	3,080.00	48,356,000	
7004	日立造船	95,000	112.00	10,640,000	
7011	三菱重工業	403,000	365.00	147,095,000	
7013	IHI	165,000	198.00	32,670,000	
4062	イビデン	15,800	1,838.00	29,040,400	
4902	コニカミノルタホールディングス	63,500	638.00	40,513,000	
6448	ブラザー工業	31,100	990.00	30,789,000	
6479	ミネベア	36,000	379.00	13,644,000	
6501	日立製作所	541,000	438.00	236,958,000	
6502	東芝	507,000	339.00	171,873,000	
6503	三菱電機	241,000	699.00	168,459,000	
6504	富士電機	73,000	211.00	15,403,000	
6505	東洋電機製造	5,000	308.00	1,540,000	
6506	安川電機	28,000	721.00	20,188,000	
6507	シンフォニアテクノロジー	15,000	186.00	2,790,000	

6508	明電舎	24,000	287.00	6,888,000	
6513	オリジン電気	4,000	275.00	1,100,000	
6517	デンヨー	2,300	1,072.00	2,465,600	
6588	東芝テック	15,000	282.00	4,230,000	
6590	芝浦メカトロニクス	4,000	226.00	904,000	
6592	マブチモーター	3,300	3,525.00	11,632,500	
6594	日本電産	13,000	7,680.00	99,840,000	
6621	高岳製作所	10,000	248.00	2,480,000	
6622	ダイヘン	14,000	296.00	4,144,000	
6632	JVCケンウッド	14,700	355.00	5,218,500	
6640	第一精工	600	2,560.00	1,536,000	
6641	日新電機	5,000	556.00	2,780,000	
6644	大崎電気工業	3,000	787.00	2,361,000	
6645	オムロン	26,800	1,591.00	42,638,800	
6651	日東工業	3,600	931.00	3,351,600	
6652	I D E C	3,200	796.00	2,547,200	
6665	エルピーダメモリ	32,600	320.00	10,432,000	
6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	46,000	423.00	19,458,000	
6675	サクサホールディングス	6,000	238.00	1,428,000	
6676	メルコホールディングス	1,300	2,031.00	2,640,300	
6678	テクノメディカ	2	305,000.00	610,000	
6701	日本電気	331,000	159.00	52,629,000	
6702	富士通	232,000	402.00	93,264,000	
6703	沖電気工業	93,000	82.00	7,626,000	
6704	岩崎通信機	11,000	79.00	869,000	
6706	電気興業	7,000	380.00	2,660,000	
6707	サンケン電気	12,000	341.00	4,092,000	
6715	ナカヨ通信機	2,000	364.00	728,000	
6718	アイホン	1,400	1,550.00	2,170,000	
6723	ルネサスエレクトロニクス	6,200	581.00	3,602,200	
6724	セイコーエプソン	16,500	1,032.00	17,028,000	
6727	ワコム	48	143,400.00	6,883,200	
6728	アルバック	4,800	951.00	4,564,800	
6730	アクセル	1,100	1,725.00	1,897,500	
6737	ナナオ	2,000	1,778.00	3,556,000	
6741	日本信号	5,700	509.00	2,901,300	
6742	京三製作所	5,000	348.00	1,740,000	
6744	能美防災	3,000	525.00	1,575,000	
6745	ホーチキ	2,000	405.00	810,000	
6751	日本無線	5,000	206.00	1,030,000	
6752	パナソニック	275,000	664.00	182,600,000	
6753	シャープ	116,000	539.00	62,524,000	
6754	アンリツ	11,000	914.00	10,054,000	
6755	富士通ゼネラル	6,000	489.00	2,934,000	
6756	日立国際電気	5,000	692.00	3,460,000	
6758	ソニー	150,200	1,575.00	236,565,000	
6762	T D K	12,600	3,990.00	50,274,000	
6763	帝国通信工業	6,000	139.00	834,000	
6767	ミツミ電機	8,600	736.00	6,329,600	

6768	タムラ製作所	8,000	236.00	1,888,000	
6770	アルプス電気	19,100	657.00	12,548,700	
6771	池上通信機	9,000	61.00	549,000	
6773	パイオニア	34,300	383.00	13,136,900	
6779	日本電波工業	1,900	1,082.00	2,055,800	
6788	日本トリム	300	1,905.00	571,500	
6789	ローランド ディー. ジー.	1,100	930.00	1,023,000	
6794	フォスター電機	2,300	1,120.00	2,576,000	
6796	クラリオン	15,000	164.00	2,460,000	
6798	SMK	8,000	266.00	2,128,000	
6800	ヨコオ	1,900	439.00	834,100	
6801	東光	11,000	175.00	1,925,000	
6803	ティアック	14,000	39.00	546,000	
6804	ホシデン	6,500	608.00	3,952,000	
6806	ヒロセ電機	4,200	7,990.00	33,558,000	
6807	日本航空電子工業	5,000	630.00	3,150,000	
6809	TOA	3,000	564.00	1,692,000	
6815	ユニデン	7,000	295.00	2,065,000	
6816	アルパイン	4,700	1,028.00	4,831,600	
6817	スミダコーポレーション	1,500	551.00	826,500	
6820	アイコム	1,300	2,012.00	2,615,600	
6823	リオン	500	750.00	375,000	
6839	船井電機	2,200	1,812.00	3,986,400	
6841	横河電機	26,200	756.00	19,807,200	
6844	新電元工業	9,000	383.00	3,447,000	
6845	山武	6,100	1,768.00	10,784,800	
6849	日本光電工業	4,800	1,968.00	9,446,400	
6850	チノー	4,000	215.00	860,000	
6853	共和電業	2,000	236.00	472,000	
6855	日本電子材料	1,000	394.00	394,000	
6856	堀場製作所	4,400	2,513.00	11,057,200	
6857	アドバンテスト	18,000	1,015.00	18,270,000	
6858	小野測器	3,000	290.00	870,000	
6859	エスベック	2,500	557.00	1,392,500	
6860	パナソニック電工SUNX	2,100	411.00	863,100	
6861	キーエンス	5,400	19,370.00	104,598,000	
6866	日置電機	1,100	1,297.00	1,426,700	
6869	シスメックス	8,400	2,736.00	22,982,400	
6875	メガチップス	2,000	1,442.00	2,884,000	
6877	OBARA GROUP	1,700	995.00	1,691,500	
6883	日本電産コパル電子	2,400	454.00	1,089,600	
6885	ミヤチテクノス	1,100	655.00	720,500	
6900	東京電波	700	384.00	268,800	
6901	澤藤電機	2,000	227.00	454,000	
6905	コーセル	3,500	1,124.00	3,934,000	
6910	日立メディコ	2,000	922.00	1,844,000	
6911	新日本無線	2,000	216.00	432,000	
6914	オプテックス	1,600	1,030.00	1,648,000	
6915	千代田インテグレ	1,200	962.00	1,154,400	

6921	東光電気	1,000	348.00	348,000	
6923	スタンレー電気	16,100	1,289.00	20,752,900	
6924	岩崎電気	9,000	175.00	1,575,000	
6925	ウシオ電機	14,600	1,126.00	16,439,600	
6926	岡谷電機産業	1,300	347.00	451,100	
6927	ヘリオス テクノ ホールディング	2,100	148.00	310,800	
6929	日本セラミック	1,500	1,397.00	2,095,500	
6934	新神戸電機	2,000	1,740.00	3,480,000	
6935	日本デジタル研究所	2,000	915.00	1,830,000	
6937	古河電池	2,000	381.00	762,000	
6938	双信電機	1,200	358.00	429,600	
6941	山一電機	2,600	177.00	460,200	
6947	図研	1,600	591.00	945,600	
6951	日本電子	9,000	220.00	1,980,000	
6952	カシオ計算機	23,000	508.00	11,684,000	
6954	ファナック	25,100	14,020.00	351,902,000	
6958	日本シイエムケイ	5,200	362.00	1,882,400	
6961	エンブラス	1,200	1,639.00	1,966,800	
6963	ローム	11,900	3,860.00	45,934,000	
6965	浜松ホトニクス	9,400	2,698.00	25,361,200	
6966	三井ハイテック	3,200	348.00	1,113,600	
6967	新光電気工業	8,100	649.00	5,256,900	
6971	京セラ	20,000	6,890.00	137,800,000	
6976	太陽誘電	10,900	767.00	8,360,300	
6981	村田製作所	25,300	4,585.00	116,000,500	
6985	ユーシン	3,400	598.00	2,033,200	
6986	双葉電子工業	4,100	1,330.00	5,453,000	
6989	北陸電気工業	10,000	117.00	1,170,000	
6996	ニチコン	7,600	931.00	7,075,600	
6997	日本ケミコン	14,000	311.00	4,354,000	
6999	KOA	3,000	762.00	2,286,000	
7244	市光工業	6,000	155.00	930,000	
7276	小糸製作所	12,000	1,338.00	16,056,000	
7280	ミツバ	4,000	766.00	3,064,000	
7718	スター精密	3,900	763.00	2,975,700	
7735	大日本スクリーン製造	23,000	605.00	13,915,000	
7739	キャノン電子	2,200	1,991.00	4,380,200	
7751	キャノン	149,500	3,530.00	527,735,000	代用有価証券 10,000株
7752	リコー	72,000	644.00	46,368,000	
7757	日本電産サンキョー	6,000	535.00	3,210,000	
7999	MUTOHホールディングス	2,000	423.00	846,000	
8035	東京エレクトロン	20,200	4,195.00	84,739,000	
3116	トヨタ紡織	8,400	922.00	7,744,800	
5196	鬼怒川ゴム工業	6,000	666.00	3,996,000	
5949	ユニプレス	3,900	2,395.00	9,340,500	
6201	豊田自動織機	21,900	2,461.00	53,895,900	
6455	モリタホールディングス	4,000	519.00	2,076,000	
6584	三桜工業	3,100	623.00	1,931,300	

6902	デンソー	59,400	2,540.00	150,876,000	
6995	東海理化電機製作所	5,600	1,406.00	7,873,600	
7003	三井造船	93,000	148.00	13,764,000	
7007	佐世保重工業	16,000	143.00	2,288,000	
7012	川崎重工業	175,000	227.00	39,725,000	
7102	日本車輛製造	9,000	343.00	3,087,000	
7105	日本輸送機	3,000	245.00	735,000	
7122	近畿車輛	4,000	292.00	1,168,000	
7201	日産自動車	304,100	787.00	239,326,700	
7202	いすゞ自動車	152,000	433.00	65,816,000	
7203	トヨタ自動車	312,100	3,265.00	1,019,006,500	代用有価証券 35,000株
7205	日野自動車	34,000	541.00	18,394,000	
7211	三菱自動車工業	538,000	98.00	52,724,000	
7212	エフテック	900	1,238.00	1,114,200	
7220	武蔵精密工業	2,300	1,892.00	4,351,600	
7222	日産車体	7,000	838.00	5,866,000	
7224	新明和工業	11,000	363.00	3,993,000	
7226	極東開発工業	4,200	727.00	3,053,400	
7230	日信工業	4,400	1,330.00	5,852,000	
7231	トピー工業	18,000	225.00	4,050,000	
7236	ティラド	9,000	306.00	2,754,000	
7238	曙ブレーキ工業	12,200	417.00	5,087,400	
7239	タチエス	3,100	1,594.00	4,941,400	
7240	NOK	11,600	1,515.00	17,574,000	
7241	フタバ産業	6,800	468.00	3,182,400	
7242	カヤバ工業	17,000	438.00	7,446,000	
7243	シロキ工業	5,000	238.00	1,190,000	
7245	大同メタル工業	4,000	950.00	3,800,000	
7246	プレス工業	11,000	443.00	4,873,000	
7248	カルソニックカンセイ	14,000	466.00	6,524,000	
7250	太平洋工業	5,000	424.00	2,120,000	
7251	ケーヒン	5,000	1,580.00	7,900,000	
7256	河西工業	3,000	398.00	1,194,000	
7259	アイシン精機	19,800	2,705.00	53,559,000	
7260	富士機工	3,000	276.00	828,000	
7261	マツダ	200,000	157.00	31,400,000	
7262	ダイハツ工業	22,000	1,515.00	33,330,000	
7263	愛知機械工業	5,000	316.00	1,580,000	
7266	今仙電機製作所	1,800	1,065.00	1,917,000	
7267	本田技研工業	203,100	2,888.00	586,552,800	
7269	スズキ	50,300	1,872.00	94,161,600	
7270	富士重工業	76,000	568.00	43,168,000	
7272	ヤマハ発動機	39,200	1,100.00	43,120,000	
7274	ショーワ	5,200	587.00	3,052,400	
7277	T B K	2,000	487.00	974,000	
7278	エクセディ	3,300	2,342.00	7,728,600	
7282	豊田合成	6,800	1,359.00	9,241,200	
7283	愛三工業	2,500	685.00	1,712,500	

7294	ヨロズ	1,500	1,766.00	2,649,000	
7296	エフ・シー・シー	3,900	1,822.00	7,105,800	
7309	シマノ	9,100	4,500.00	40,950,000	
7312	タカタ	4,400	1,931.00	8,496,400	
7313	テイ・エス テック	5,100	1,545.00	7,879,500	
7728	日本電産トーソク	1,100	983.00	1,081,300	
4543	テルモ	17,000	3,695.00	62,815,000	
5187	クリエートメディック	700	799.00	559,300	
6376	日機装	8,000	700.00	5,600,000	
7701	島津製作所	29,000	656.00	19,024,000	
7702	JMS	4,000	245.00	980,000	
7714	モリテックス	600	321.00	192,600	
7715	長野計器	1,700	779.00	1,324,300	
7717	ブイ・テクノロジー	3	278,400.00	835,200	
7721	東京計器	8,000	162.00	1,296,000	
7723	愛知時計電機	3,000	278.00	834,000	
7729	東京精密	4,300	1,659.00	7,133,700	
7731	ニコン	42,000	2,089.00	87,738,000	
7732	トプコン	5,600	490.00	2,744,000	
7733	オリンパス	28,400	1,304.00	37,033,600	
7734	理研計器	2,000	589.00	1,178,000	
7740	タムロン	2,100	2,281.00	4,790,100	
7741	HOYA	58,500	1,846.00	107,991,000	
7744	ノーリツ銅機	2,300	369.00	848,700	
7745	エー・アンド・デイ	2,400	253.00	607,200	
7756	日本電産コパル	1,900	855.00	1,624,500	
7762	シチズンホールディングス	28,900	463.00	13,380,700	
7769	リズム時計工業	11,000	143.00	1,573,000	
7775	大研医器	300	804.00	241,200	
8050	セイコーホールディングス	14,000	167.00	2,338,000	
8086	ニプロ	9,500	644.00	6,118,000	
7817	パラマウントベッドホールディングス	2,100	2,216.00	4,653,600	
7819	SHO-BI	400	487.00	194,800	
7822	永大産業	3,000	387.00	1,161,000	
7825	SRIスポーツ	1,500	899.00	1,348,500	
7832	バンダイナムコホールディングス	25,900	1,140.00	29,526,000	
7838	共立印刷	3,000	281.00	843,000	
7840	フランスベッドホールディングス	17,000	175.00	2,975,000	
7846	パイロットコーポレーション	21	158,000.00	3,318,000	
7862	トッパン・フォームズ	5,100	679.00	3,462,900	
7864	フジシールインターナショナル	2,700	1,423.00	3,842,100	
7867	タカラトミー	7,900	579.00	4,574,100	
7868	廣済堂	2,300	299.00	687,700	
7885	タカノ	1,000	445.00	445,000	
7893	プロネクス	2,700	406.00	1,096,200	
7897	ホクシン	2,000	171.00	342,000	
7898	ウッドワン	4,000	316.00	1,264,000	
7905	大建工業	10,000	266.00	2,660,000	
7911	凸版印刷	73,000	626.00	45,698,000	

7912	大日本印刷	73,000	807.00	58,911,000	
7913	図書印刷	4,000	157.00	628,000	
7914	共同印刷	8,000	209.00	1,672,000	
7915	日本写真印刷	4,100	1,043.00	4,276,300	
7916	光村印刷	3,000	279.00	837,000	
7921	宝印刷	1,400	603.00	844,200	
7936	アシックス	22,500	957.00	21,532,500	
7937	ツツミ	1,200	2,127.00	2,552,400	
7944	ローランド	2,500	742.00	1,855,000	
7949	小松ウオール工業	1,000	817.00	817,000	
7951	ヤマハ	17,800	718.00	12,780,400	
7952	河合楽器製作所	9,000	161.00	1,449,000	
7955	クリナップ	2,900	527.00	1,528,300	
7956	ビジョン	2,100	2,895.00	6,079,500	
7961	兼松日産農林	4,000	187.00	748,000	
7962	キングジム	2,000	617.00	1,234,000	
7966	リンテック	4,600	1,583.00	7,281,800	
7968	T A S A K I	6,000	52.00	312,000	
7972	イトーキ	5,400	206.00	1,112,400	
7974	任天堂	13,800	11,230.00	154,974,000	
7976	三菱鉛筆	2,000	1,416.00	2,832,000	
7981	タカラスタANDARD	11,000	618.00	6,798,000	
7984	コクヨ	12,600	564.00	7,106,400	
7987	ナカバヤシ	6,000	191.00	1,146,000	
7994	岡村製作所	8,000	572.00	4,576,000	
8022	美津濃	12,000	414.00	4,968,000	
8170	アデランス	3,000	973.00	2,919,000	
9501	東京電力	192,400	209.00	40,211,600	
9502	中部電力	79,300	1,523.00	120,773,900	
9503	関西電力	98,200	1,396.00	137,087,200	
9504	中国電力	33,300	1,517.00	50,516,100	
9505	北陸電力	23,600	1,605.00	37,878,000	
9506	東北電力	60,200	927.00	55,805,400	
9507	四国電力	22,200	2,305.00	51,171,000	
9508	九州電力	53,200	1,212.00	64,478,400	
9509	北海道電力	22,500	1,216.00	27,360,000	
9511	沖縄電力	1,400	3,420.00	4,788,000	
9513	電源開発	15,000	2,136.00	32,040,000	
9531	東京瓦斯	290,000	368.00	106,720,000	
9532	大阪瓦斯	234,000	314.00	73,476,000	
9533	東邦瓦斯	61,000	495.00	30,195,000	
9534	北海道瓦斯	4,000	277.00	1,108,000	
9536	西部瓦斯	27,000	220.00	5,940,000	
9543	静岡瓦斯	6,000	529.00	3,174,000	
9001	東武鉄道	137,000	397.00	54,389,000	
9003	相鉄ホールディングス	38,000	254.00	9,652,000	
9005	東京急行電鉄	142,000	386.00	54,812,000	
9006	京浜急行電鉄	62,000	705.00	43,710,000	
9007	小田急電鉄	77,000	760.00	58,520,000	

9008	京王電鉄	67,000	573.00	38,391,000	
9009	京成電鉄	39,000	584.00	22,776,000	
9010	富士急行	7,000	488.00	3,416,000	
9020	東日本旅客鉄道	41,900	5,060.00	212,014,000	
9021	西日本旅客鉄道	21,000	3,255.00	68,355,000	
9022	東海旅客鉄道	209	658,000.00	137,522,000	
9031	西日本鉄道	31,000	385.00	11,935,000	
9037	ハマキョウレックス	700	2,371.00	1,659,700	
9039	サカイ引越センター	400	1,711.00	684,400	

[次へ](#)

9041	近畿日本鉄道	218,000	301.00	65,618,000	
9042	阪急阪神ホールディングス	162,000	357.00	57,834,000	
9044	南海電気鉄道	50,000	360.00	18,000,000	
9045	京阪電気鉄道	54,000	402.00	21,708,000	
9047	名糖運輸	1,000	630.00	630,000	
9048	名古屋鉄道	84,000	222.00	18,648,000	
9062	日本通運	95,000	318.00	30,210,000	
9064	ヤマトホールディングス	49,000	1,269.00	62,181,000	
9065	山九	29,000	307.00	8,903,000	
9067	丸運	1,300	205.00	266,500	
9068	丸全昭和運輸	8,000	264.00	2,112,000	
9069	センコー	10,000	317.00	3,170,000	
9070	トナミホールディングス	5,000	190.00	950,000	
9072	日本梱包運輸倉庫	7,200	883.00	6,357,600	
9074	日本石油輸送	3,000	200.00	600,000	
9075	福山通運	14,000	440.00	6,160,000	
9076	セイノーホールディングス	19,000	588.00	11,172,000	
9081	神奈川中央交通	3,000	428.00	1,284,000	
9086	日立物流	5,000	1,310.00	6,550,000	
9101	日本郵船	191,000	245.00	46,795,000	
9104	商船三井	126,000	363.00	45,738,000	
9107	川崎汽船	75,000	184.00	13,800,000	
9110	N S ユナイテッド海運	10,000	146.00	1,460,000	
9113	乾汽船	2,700	361.00	974,700	
9115	明治海運	2,200	434.00	954,800	
9119	飯野海運	11,700	401.00	4,691,700	
9130	共栄タンカー	2,000	237.00	474,000	
9132	第一中央汽船	16,000	137.00	2,192,000	
9202	全日本空輸	321,000	245.00	78,645,000	
9232	バスコ	2,000	296.00	592,000	
9234	国際航業ホールディングス	2,000	187.00	374,000	
9066	日新	9,000	213.00	1,917,000	
9301	三菱倉庫	17,000	895.00	15,215,000	
9302	三井倉庫	11,000	311.00	3,421,000	
9303	住友倉庫	17,000	381.00	6,477,000	
9304	澁澤倉庫	6,000	242.00	1,452,000	
9306	東陽倉庫	4,000	183.00	732,000	
9310	日本トランスシティ	5,000	278.00	1,390,000	
9312	ケイヒン	5,000	123.00	615,000	
9324	安田倉庫	1,900	511.00	970,900	
9351	東洋埠頭	7,000	147.00	1,029,000	
9358	宇徳	1,700	290.00	493,000	
9364	上組	27,000	689.00	18,603,000	
9366	サンリツ	700	544.00	380,800	
9368	キムラユニティー	500	715.00	357,500	
9369	キューソー流通システム	800	866.00	692,800	
9370	郵船ロジスティクス	1,900	1,121.00	2,129,900	
9375	近鉄エクスプレス	2,100	2,412.00	5,065,200	
9380	東海運	1,700	261.00	443,700	

9381	エーアイティー	200	1,234.00	246,800	
1973	NECネットエスアイ	2,300	1,120.00	2,576,000	
2317	システナ	28	56,400.00	1,579,200	
2327	新日鉄ソリューションズ	1,600	1,590.00	2,544,000	
2359	コア	900	700.00	630,000	
3371	ソフトクリエイト	300	1,125.00	337,500	
3620	デジタルハーツ	2	137,300.00	274,600	
3626	I Tホールディングス	7,200	934.00	6,724,800	
3632	グリー	12,200	2,581.00	31,488,200	
3635	コーエーテクモホールディングス	4,700	652.00	3,064,400	
3636	三菱総合研究所	900	1,534.00	1,380,600	
3639	ボルテージ	300	1,138.00	341,400	
3659	ネクソン	11,900	1,203.00	14,315,700	
3715	ドワンゴ	12	134,200.00	1,610,400	
3724	ベリサーブ	2	138,100.00	276,200	
3730	マクロミル	2,300	798.00	1,835,400	
3738	ティーガイア	15	142,800.00	2,142,000	
3769	GMOペイメントゲートウェイ	5	338,000.00	1,690,000	
3770	ザッパラス	13	88,400.00	1,149,200	
3774	インターネットイニシアティブ	14	244,600.00	3,424,400	
3789	ソネットエンタテインメント	13	317,500.00	4,127,500	
3817	S R Aホールディングス	1,200	851.00	1,021,200	
3820	J B I Sホールディングス	2,500	309.00	772,500	
3834	朝日ネット	2,000	366.00	732,000	
4283	パナソニック電工インフォメーション システ	500	2,080.00	1,040,000	
4295	フェイス	82	9,370.00	768,340	
4307	野村総合研究所	13,400	1,836.00	24,602,400	
4312	サイバネットシステム	20	22,310.00	446,200	
4326	インテージ	700	1,501.00	1,050,700	
4340	シンプレクス・ホールディングス	40	24,950.00	998,000	
4344	ソースネクスト	8	15,000.00	120,000	
4674	クレスコ	600	609.00	365,400	
4676	フジ・メディア・ホールディングス	248	118,300.00	29,338,400	
4684	オービック	740	15,200.00	11,248,000	
4687	ティーディーシーソフトウェアエンジ ニアリ	500	785.00	392,500	
4689	ヤフー	1,737	25,070.00	43,546,590	
4704	トレンドマイクロ	10,500	2,548.00	26,754,000	
4716	日本オラクル	4,700	2,791.00	13,117,700	
4719	アルファシステムズ	700	1,214.00	849,800	
4722	フューチャーアーキテクト	28	32,900.00	921,200	
4725	シーエーシー	1,600	668.00	1,068,800	
4726	ソフトバンク・テクノロジー	600	716.00	429,600	
4728	トーセ	600	550.00	330,000	
4733	オービックビジネスコンサルタント	600	3,600.00	2,160,000	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	2,800	3,540.00	9,912,000	
4743	アイティフォー	2,700	290.00	783,000	
4746	東計電算	400	1,033.00	413,200	

4762	エクスネット	2	118,600.00	237,200	
4768	大塚商会	1,900	5,760.00	10,944,000	
4776	サイボウズ	45	26,300.00	1,183,500	
4779	ソフトブレーン	39	8,670.00	338,130	
4799	アグレックス	600	769.00	461,400	
4812	電通国際情報サービス	1,500	622.00	933,000	
4825	ウェザーニューズ	500	2,046.00	1,023,000	
4826	C I J	2,400	311.00	746,400	
4839	WOWOW	7	198,500.00	1,389,500	
6791	日本コロムビア	25,000	35.00	875,000	
7518	ネットワンシステムズ	54	196,300.00	10,600,200	
7595	アルゴグラフィックス	800	1,075.00	860,000	
7860	エイベックス・グループ・ホールディングス	4,500	963.00	4,333,500	
8056	日本ユニシス	5,800	541.00	3,137,800	
8096	兼松エレクトロニクス	1,400	818.00	1,145,200	
9401	東京放送ホールディングス	14,200	1,100.00	15,620,000	
9404	日本テレビ放送網	2,090	12,040.00	25,163,600	
9409	テレビ朝日	60	134,700.00	8,082,000	
9412	スカパーJ S A Tホールディングス	180	38,200.00	6,876,000	
9413	テレビ東京ホールディングス	1,500	1,082.00	1,623,000	
9422	アイ・ティー・シーネットワーク	2,200	520.00	1,144,000	
9427	イー・アクセス	182	19,340.00	3,519,880	
9430	N E Cモバイリング	900	2,696.00	2,426,400	
9432	日本電信電話	109,400	3,810.00	416,814,000	代用有価証券 12,300株
9433	K D D I	369	496,000.00	183,024,000	
9435	光通信	2,200	2,045.00	4,499,000	
9437	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	1,957	136,900.00	267,913,300	
9449	GMOインターネット	7,100	364.00	2,584,400	
9470	学研ホールディングス	7,000	174.00	1,218,000	
9474	ゼンリン	3,400	803.00	2,730,200	
9475	昭文社	1,300	618.00	803,400	
9477	角川グループホールディングス	2,200	2,447.00	5,383,400	
9479	インプレスホールディングス	2,200	119.00	261,800	
9600	アイネット	1,100	461.00	507,100	
9601	松竹	16,000	804.00	12,864,000	
9602	東宝	16,900	1,387.00	23,440,300	
9605	東映	10,000	390.00	3,900,000	
9607	葵プロモーション	1,000	460.00	460,000	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	147	262,600.00	38,602,200	
9682	D T S	2,500	997.00	2,492,500	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,800	1,578.00	12,308,400	
9692	シーイーシー	1,500	368.00	552,000	
9697	カプコン	4,600	1,714.00	7,884,400	
9717	ジャステック	1,600	483.00	772,800	
9719	S C S K	4,800	1,224.00	5,875,200	
9739	日本システムウエア	800	318.00	254,400	
9742	アイネス	2,900	594.00	1,722,600	

9746	T K C	2,000	1,639.00	3,278,000	
9749	富士ソフト	3,100	1,520.00	4,712,000	
9759	N S D	4,600	671.00	3,086,600	
9766	コナミ	10,700	2,171.00	23,229,700	
9790	福井コンピュータ	400	411.00	164,400	
9889	J B C Cホールディングス	1,900	546.00	1,037,400	
9984	ソフトバンク	107,700	2,388.00	257,187,600	
1352	ハウスイ	2,000	123.00	246,000	
2657	インターニックス	1,000	364.00	364,000	
2676	高千穂交易	1,000	895.00	895,000	
2692	伊藤忠食品	600	2,889.00	1,733,400	
2715	エレマテック	1,900	1,388.00	2,637,200	
2729	J A L U X	700	782.00	547,400	
2737	トーメンデバイス	300	1,935.00	580,500	
2760	東京エレクトロン デバイス	5	143,300.00	716,500	
2768	双日	159,200	141.00	22,447,200	
2784	アルフレッサ ホールディングス	6,200	3,460.00	21,452,000	
2874	横浜冷凍	5,500	617.00	3,393,500	
3004	神栄	3,000	150.00	450,000	
3022	山下医科器械	200	943.00	188,600	
3023	ラサ商事	1,100	394.00	433,400	
3036	アルコニックス	600	1,793.00	1,075,800	
3076	あい ホールディングス	3,700	340.00	1,258,000	
3107	ダイワボウホールディングス	23,000	188.00	4,324,000	
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	4,400	688.00	3,027,200	
3153	八洲電機	1,600	358.00	572,800	
3156	U K Cホールディングス	1,300	990.00	1,287,000	
3167	T O K A Iホールディングス	11,600	391.00	4,535,600	
3321	ミタチ産業	500	384.00	192,000	
3332	J F E商事ホールディングス	16,000	363.00	5,808,000	
3360	シップヘルスケアホールディングス	3,100	1,643.00	5,093,300	
5009	富士興産	9,000	80.00	720,000	
6973	協栄産業	3,000	148.00	444,000	
7414	小野建	2,000	671.00	1,342,000	
7420	佐島電機	1,700	503.00	855,100	
7427	エコートレーディング	600	758.00	454,800	
7433	伯東	1,400	786.00	1,100,400	
7438	コンドーテック	1,700	522.00	887,400	
7442	中山福	1,300	629.00	817,700	
7447	ナガイレーベン	3,100	1,168.00	3,620,800	
7451	三菱食品	2,200	2,173.00	4,780,600	
7456	松田産業	1,700	1,287.00	2,187,900	
7459	メディパルホールディングス	25,600	966.00	24,729,600	
7463	アドヴァン	1,400	764.00	1,069,600	
7466	S P K	600	1,389.00	833,400	
7476	アズワン	1,500	1,717.00	2,575,500	
7480	スズデン	800	531.00	424,800	
7482	シモジマ	1,400	1,075.00	1,505,000	

7483	ドウシシャ	1,100	2,317.00	2,548,700	
7504	高速	1,400	670.00	938,000	
7517	黒田電気	2,900	819.00	2,375,100	
7537	丸文	1,900	375.00	712,500	
7552	ハピネット	1,300	740.00	962,000	
7558	トーメンエレクトロニクス	1,000	1,046.00	1,046,000	
7591	エクセル	1,100	783.00	861,300	
7594	マルカキカイ	800	787.00	629,600	
7599	ガリバーインターナショナル	720	3,140.00	2,260,800	
7600	日本エム・ディ・エム	2,200	259.00	569,800	
7607	進和	1,400	937.00	1,311,800	
7608	エスケイジャパン	700	265.00	185,500	
7609	ダイトエレクトロン	1,100	413.00	454,300	
7613	シークス	1,500	1,039.00	1,558,500	
7619	田中商事	800	439.00	351,200	
7628	オーハシテクニカ	1,300	600.00	780,000	
7631	マクニカ	1,200	1,933.00	2,319,600	
7637	白銅	700	769.00	538,300	
8001	伊藤忠商事	189,500	896.00	169,792,000	
8002	丸紅	208,000	541.00	112,528,000	
8007	高島	4,000	204.00	816,000	
8008	F & A アクアホールディングス	1,800	808.00	1,454,400	
8012	長瀬産業	13,400	921.00	12,341,400	
8014	蝶理	14,000	103.00	1,442,000	
8015	豊田通商	26,500	1,561.00	41,366,500	
8018	三共生興	4,000	295.00	1,180,000	
8020	兼松	51,000	87.00	4,437,000	
8025	ツカモトコーポレーション	5,000	176.00	880,000	
8031	三井物産	205,100	1,341.00	275,039,100	
8032	日本紙パルプ商事	12,000	287.00	3,444,000	
8036	日立ハイテクノロジーズ	7,200	1,772.00	12,758,400	
8037	カメイ	3,000	962.00	2,886,000	
8038	東都水産	5,000	161.00	805,000	
8043	スターゼン	8,000	253.00	2,024,000	
8051	山善	9,200	616.00	5,667,200	
8052	椿本興業	3,000	233.00	699,000	
8053	住友商事	140,100	1,170.00	163,917,000	
8057	内田洋行	5,000	251.00	1,255,000	
8058	三菱商事	173,000	1,833.00	317,109,000	
8059	第一実業	5,000	387.00	1,935,000	
8060	キャノンマーケティングジャパン	7,900	963.00	7,607,700	
8061	西華産業	9,000	227.00	2,043,000	
8065	佐藤商事	2,100	518.00	1,087,800	
8068	菱洋エレクトロ	2,700	901.00	2,432,700	
8070	東京産業	2,500	288.00	720,000	
8074	ユアサ商事	25,000	132.00	3,300,000	
8075	神鋼商事	6,000	193.00	1,158,000	
8078	阪和興業	24,000	366.00	8,784,000	
8081	カナデン	2,000	518.00	1,036,000	

8084	菱電商事	3,000	466.00	1,398,000	
8087	フルサト工業	1,400	735.00	1,029,000	
8088	岩谷産業	26,000	273.00	7,098,000	
8089	すてきなイスグループ	11,000	225.00	2,475,000	
8090	昭光通商	9,000	134.00	1,206,000	
8091	ニチモウ	4,000	198.00	792,000	
8093	極東貿易	3,000	182.00	546,000	
8095	イワキ	4,000	206.00	824,000	
8097	三愛石油	6,000	357.00	2,142,000	
8098	稲畑産業	6,300	502.00	3,162,600	
8101	G S I クレオス	6,000	117.00	702,000	
8103	明和産業	1,900	297.00	564,300	
8129	東邦ホールディングス	7,600	1,310.00	9,956,000	
8130	サンゲツ	4,200	2,106.00	8,845,200	
8131	ミツウロコグループホールディングス	3,800	508.00	1,930,400	
8132	シナネン	5,000	357.00	1,785,000	
8133	伊藤忠エネクス	5,200	464.00	2,412,800	
8136	サンリオ	6,000	3,645.00	21,870,000	
8137	サンワテクノス	1,200	816.00	979,200	
8140	リョーサン	3,800	1,773.00	6,737,400	
8141	新光商事	2,600	682.00	1,773,200	
8142	トーヨー	5,000	314.00	1,570,000	
8150	三信電気	3,400	682.00	2,318,800	
8151	東陽テクニカ	3,400	861.00	2,927,400	
8153	モスフードサービス	3,100	1,562.00	4,842,200	
8154	加賀電子	2,500	853.00	2,132,500	
8158	ソーダニッカ	3,000	355.00	1,065,000	
8159	立花エレテック	1,500	710.00	1,065,000	
8283	P a l t a c	2,500	1,058.00	2,645,000	
8835	太平洋興発	9,000	84.00	756,000	
9305	ヤマタネ	12,000	125.00	1,500,000	
9763	丸紅建材リース	3,000	187.00	561,000	
9810	日鐵商事	5,000	224.00	1,120,000	
9830	トラスコ中山	2,900	1,654.00	4,796,600	
9832	オートバックスセブン	2,800	3,765.00	10,542,000	
9869	加藤産業	3,400	1,543.00	5,246,200	
9880	イノテック	1,500	530.00	795,000	
9882	イエローハット	2,300	1,150.00	2,645,000	
9883	富士エレクトロニクス	1,200	1,217.00	1,460,400	
9896	J Kホールディングス	2,000	402.00	804,000	
9902	日伝	1,000	2,226.00	2,226,000	
9930	北沢産業	2,500	178.00	445,000	
9932	杉本商事	1,300	741.00	963,300	
9934	因幡電機産業	2,800	2,335.00	6,538,000	
9938	住金物産	11,000	220.00	2,420,000	
9962	ミスミグループ本社	8,800	1,944.00	17,107,200	
9963	江守商事	400	955.00	382,000	
9972	アルテック	1,300	223.00	289,900	
9982	タキヒヨー	4,000	467.00	1,868,000	

9987	スズケン	9,100	2,389.00	21,739,900	
9991	ジェコス	1,700	360.00	612,000	
2651	ローソン	7,500	4,780.00	35,850,000	
2659	サンエー	800	3,135.00	2,508,000	
2660	キリン堂	1,100	519.00	570,900	
2662	ダイユーエイト	400	859.00	343,600	
2664	カワチ薬品	1,700	1,643.00	2,793,100	
2670	エービーシー・マート	3,400	2,843.00	9,666,200	
2674	ハードオフコーポレーション	1,200	619.00	742,800	
2678	アスクル	1,600	1,217.00	1,947,200	
2681	ゲオホールディングス	39	89,500.00	3,490,500	
2685	ポイント	2,000	3,140.00	6,280,000	
2687	シー・ヴィ・エス・バイエリア	2,000	155.00	310,000	
2695	くらコーポレーション	1,200	1,140.00	1,368,000	
2698	キャンドゥ	14	85,900.00	1,202,600	
2726	バル	700	3,180.00	2,226,000	
2730	エディオン	9,500	571.00	5,424,500	
2734	サーラコーポレーション	2,000	500.00	1,000,000	
2753	あみやき亭	4	198,700.00	794,800	
2764	ひらまつ	10	71,700.00	717,000	
2772	ゲンキー	200	1,783.00	356,600	
2792	ハニーズ	2,110	1,339.00	2,825,290	
3028	アルペン	1,800	1,461.00	2,629,800	
3048	ビックカメラ	90	45,250.00	4,072,500	
3050	DCMホールディングス	12,300	598.00	7,355,400	
3064	MonotaRO	1,400	974.00	1,363,600	
3086	J. フロント リテイリング	56,000	378.00	21,168,000	
3087	ドトール・日レスホールディングス	3,700	1,082.00	4,003,400	
3088	マツモトキヨシホールディングス	4,400	1,650.00	7,260,000	
3097	物語コーポレーション	300	1,283.00	384,900	
3098	ココカラファイン	2,400	2,153.00	5,167,200	
3099	三越伊勢丹ホールディングス	47,200	874.00	41,252,800	
3148	クリエイトSDホールディングス	1,000	1,792.00	1,792,000	
3159	丸善CHIホールディングス	800	207.00	165,600	
3313	ブックオフコーポレーション	1,300	726.00	943,800	
3333	あさひ	1,400	1,568.00	2,195,200	
3337	サークルKサンクス	5,100	1,329.00	6,777,900	
3341	日本調剤	300	2,553.00	765,900	
3349	コスモス薬品	1,000	3,575.00	3,575,000	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	99,400	2,196.00	218,282,400	
3391	ツルハホールディングス	1,900	4,065.00	7,723,500	
3395	サンマルクホールディングス	700	3,000.00	2,100,000	
3396	フェリシモ	700	1,113.00	779,100	
3397	トリドール	2,000	853.00	1,706,000	
3398	クスリのアオキ	400	1,695.00	678,000	
4350	メディカルシステムネットワーク	400	964.00	385,600	
4775	総合メディカル	600	2,472.00	1,483,200	
7416	はるやま商事	1,100	388.00	426,800	
7421	カップ・クリエイト	1,750	1,868.00	3,269,000	

7445	ライトオン	1,800	568.00	1,022,400	
7448	ジーンズメイト	900	193.00	173,700	
7453	良品計画	2,500	3,875.00	9,687,500	
7455	三城ホールディングス	3,000	621.00	1,863,000	
7494	コナカ	2,800	736.00	2,060,800	
7506	ハウス オブ ローゼ	300	1,295.00	388,500	
7508	G-7ホールディングス	700	407.00	284,900	
7512	イオン北海道	1,600	366.00	585,600	
7513	コジマ	3,200	495.00	1,584,000	
7516	コーナン商事	2,600	1,215.00	3,159,000	
7520	エコス	1,000	503.00	503,000	
7522	ワタミ	2,800	1,761.00	4,930,800	
7524	マルシェ	700	719.00	503,300	
7532	ドン・キホーテ	6,300	2,759.00	17,381,700	
7541	メガネトップ	3,400	832.00	2,828,800	
7545	西松屋チェーン	5,200	648.00	3,369,600	
7550	ゼンショーホールディングス	9,000	1,003.00	9,027,000	
7554	幸楽苑	1,500	1,244.00	1,866,000	
7561	ハークスレイ	500	507.00	253,500	
7581	サイゼリヤ	3,500	1,259.00	4,406,500	
7601	ポプラ	700	493.00	345,100	
7606	ユナイテッドアローズ	2,600	1,649.00	4,287,400	
7611	ハイデイ日高	1,000	1,595.00	1,595,000	
7615	京都きもの友禅	1,600	950.00	1,520,000	
7616	コロワイド	8,000	609.00	4,872,000	
7630	壺番屋	1,000	2,285.00	2,285,000	
7640	トップカルチャー	900	386.00	347,400	
7649	スギホールディングス	4,300	2,116.00	9,098,800	
8005	スクロール	3,100	310.00	961,000	
8028	ファミリーマート	7,300	3,065.00	22,374,500	
8160	木曽路	2,700	1,528.00	4,125,600	
8165	千趣会	4,300	522.00	2,244,600	
8166	タカキュー	2,000	168.00	336,000	
8168	ケーヨー	4,500	530.00	2,385,000	
8173	上新電機	5,000	853.00	4,265,000	
8174	日本瓦斯	2,300	1,281.00	2,946,300	
8175	ベスト電器	7,500	195.00	1,462,500	
8178	マルエツ	5,000	307.00	1,535,000	
8179	ロイヤルホールディングス	4,000	942.00	3,768,000	
8181	東天紅	2,000	168.00	336,000	
8182	いなげや	2,700	940.00	2,538,000	
8184	島忠	5,400	1,830.00	9,882,000	
8185	チヨダ	3,100	1,468.00	4,550,800	
8194	ライフコーポレーション	1,500	1,401.00	2,101,500	
8196	カスミ	4,900	532.00	2,606,800	
8200	リンガーハット	2,200	1,099.00	2,417,800	
8201	さが美	2,000	93.00	186,000	
8203	MrMax	2,400	344.00	825,600	
8207	テンアライド	2,000	287.00	574,000	

8214	A O K I ホールディングス	2,100	1,259.00	2,643,900	
8217	オークワ	3,000	1,107.00	3,321,000	
8218	コメリ	3,300	2,391.00	7,890,300	
8219	青山商事	6,600	1,409.00	9,299,400	
8227	しまむら	2,700	8,290.00	22,383,000	
8229	C F S コーポレーション	1,500	389.00	583,500	
8233	高島屋	32,000	596.00	19,072,000	

[次へ](#)

8237	松屋	4,900	513.00	2,513,700	
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	12,000	579.00	6,948,000	
8245	丸栄	4,000	103.00	412,000	
8248	ニッセンホールディングス	4,800	360.00	1,728,000	
8251	バルコ	4,400	633.00	2,785,200	
8252	丸井グループ	31,100	615.00	19,126,500	
8255	原信ナルスホールディングス	1,300	1,340.00	1,742,000	
8263	ダイエー	15,000	280.00	4,200,000	
8266	イズミヤ	8,000	413.00	3,304,000	
8267	イオン	83,700	1,034.00	86,545,800	
8270	ユニー	17,900	715.00	12,798,500	
8273	イズミ	7,100	1,390.00	9,869,000	
8274	東武ストア	3,000	286.00	858,000	
8276	平和堂	4,400	1,030.00	4,532,000	
8278	フジ	2,600	1,890.00	4,914,000	
8279	ヤオコー	1,000	2,574.00	2,574,000	
8281	ゼビオ	2,900	1,939.00	5,623,100	
8282	ケーズホールディングス	5,900	2,809.00	16,573,100	
8289	O l y m p i c	1,600	865.00	1,384,000	
8291	日産東京販売ホールディングス	4,000	193.00	772,000	
9627	アインファーマシーズ	1,300	3,705.00	4,816,500	
9828	元気寿司	800	1,000.00	800,000	
9831	ヤマダ電機	11,560	5,370.00	62,077,200	
9842	アークランドサカモト	1,600	1,351.00	2,161,600	
9843	ニトリホールディングス	4,700	7,010.00	32,947,000	
9854	愛眼	2,000	374.00	748,000	
9861	吉野家ホールディングス	64	110,900.00	7,097,600	
9887	松屋フーズ	1,100	1,642.00	1,806,200	
9900	サガミチェーン	3,000	540.00	1,620,000	
9945	ブレナス	2,600	1,338.00	3,478,800	
9946	ミニストップ	1,800	1,433.00	2,579,400	
9948	アークス	3,300	1,474.00	4,864,200	
9956	バロー	4,700	1,229.00	5,776,300	
9974	ベルク	1,200	1,211.00	1,453,200	
9979	大庄	1,100	1,062.00	1,168,200	
9983	ファーストリテイリング	5,600	16,120.00	90,272,000	
9989	サンドラッグ	4,500	2,243.00	10,093,500	
9993	ヤマザワ	600	1,438.00	862,800	
9994	やまや	400	1,113.00	445,200	
9997	ベルーナ	3,050	609.00	1,857,450	
8303	新生銀行	186,000	100.00	18,600,000	
8304	あおぞら銀行	74,000	231.00	17,094,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,798,400	408.00	733,747,200	
8308	りそなホールディングス	206,700	370.00	76,479,000	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	466,000	270.00	125,820,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	179,700	2,703.00	485,729,100	
8324	第四銀行	31,000	276.00	8,556,000	
8325	北越銀行	24,000	167.00	4,008,000	
8327	西日本シティ銀行	83,000	226.00	18,758,000	

8328	札幌北洋ホールディングス	36,000	279.00	10,044,000	
8331	千葉銀行	94,000	504.00	47,376,000	
8332	横浜銀行	152,000	381.00	57,912,000	
8333	常陽銀行	92,000	356.00	32,752,000	
8334	群馬銀行	54,000	434.00	23,436,000	
8336	武蔵野銀行	3,800	2,667.00	10,134,600	
8337	千葉興業銀行	4,600	422.00	1,941,200	
8338	筑波銀行	10,000	281.00	2,810,000	
8339	東京都民銀行	4,500	982.00	4,419,000	
8341	七十七銀行	37,000	379.00	14,023,000	
8342	青森銀行	18,000	253.00	4,554,000	
8343	秋田銀行	16,000	250.00	4,000,000	
8344	山形銀行	14,000	391.00	5,474,000	
8345	岩手銀行	1,600	3,730.00	5,968,000	
8346	東邦銀行	20,000	280.00	5,600,000	
8349	東北銀行	13,000	150.00	1,950,000	
8350	みちのく銀行	12,000	163.00	1,956,000	
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	96,000	339.00	32,544,000	
8355	静岡銀行	72,000	802.00	57,744,000	
8356	十六銀行	30,000	272.00	8,160,000	
8358	スルガ銀行	23,000	732.00	16,836,000	
8359	八十二銀行	44,000	452.00	19,888,000	
8360	山梨中央銀行	15,000	370.00	5,550,000	
8361	大垣共立銀行	32,000	278.00	8,896,000	
8362	福井銀行	20,000	251.00	5,020,000	
8363	北國銀行	28,000	309.00	8,652,000	
8364	清水銀行	800	3,385.00	2,708,000	
8366	滋賀銀行	22,000	520.00	11,440,000	
8367	南都銀行	22,000	400.00	8,800,000	
8368	百五銀行	21,000	351.00	7,371,000	
8369	京都銀行	43,000	675.00	29,025,000	
8374	三重銀行	10,000	186.00	1,860,000	
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	166,000	155.00	25,730,000	
8379	広島銀行	70,000	368.00	25,760,000	
8381	山陰合同銀行	14,000	602.00	8,428,000	
8382	中国銀行	20,000	1,063.00	21,260,000	
8383	鳥取銀行	8,000	157.00	1,256,000	
8385	伊予銀行	25,000	745.00	18,625,000	
8386	百十四銀行	26,000	379.00	9,854,000	
8387	四国銀行	17,000	304.00	5,168,000	
8388	阿波銀行	21,000	528.00	11,088,000	
8390	鹿児島銀行	15,000	539.00	8,085,000	
8392	大分銀行	15,000	234.00	3,510,000	
8393	宮崎銀行	16,000	200.00	3,200,000	
8394	肥後銀行	18,000	464.00	8,352,000	
8395	佐賀銀行	14,000	199.00	2,786,000	
8396	十八銀行	15,000	238.00	3,570,000	
8397	沖縄銀行	1,800	3,365.00	6,057,000	
8399	琉球銀行	5,000	993.00	4,965,000	

8409	八千代銀行	1,300	2,054.00	2,670,200	
8410	セブン銀行	66,900	177.00	11,841,300	
8411	みずほフィナンシャルグループ	3,051,800	129.00	393,682,200	
8415	紀陽ホールディングス	94,000	124.00	11,656,000	
8418	山口フィナンシャルグループ	24,000	749.00	17,976,000	
8521	長野銀行	8,000	170.00	1,360,000	
8522	名古屋銀行	22,000	280.00	6,160,000	
8527	愛知銀行	900	4,655.00	4,189,500	
8529	第三銀行	13,000	177.00	2,301,000	
8530	中京銀行	10,000	216.00	2,160,000	
8536	東日本銀行	11,000	177.00	1,947,000	
8537	大光銀行	8,000	261.00	2,088,000	
8541	愛媛銀行	15,000	231.00	3,465,000	
8542	トマト銀行	9,000	146.00	1,314,000	
8543	みなと銀行	21,000	159.00	3,339,000	
8544	京葉銀行	19,000	381.00	7,239,000	
8545	関西アーバン銀行	33,000	131.00	4,323,000	
8550	栃木銀行	12,000	283.00	3,396,000	
8551	北日本銀行	700	2,067.00	1,446,900	
8558	東和銀行	24,000	93.00	2,232,000	
8562	福島銀行	28,000	84.00	2,352,000	
8563	大東銀行	16,000	82.00	1,312,000	
8600	トモニホールディングス	18,200	371.00	6,752,200	
8713	フィデアホールディングス	13,500	217.00	2,929,500	
8714	池田泉州ホールディングス	97,500	119.00	11,602,500	
8473	S B Iホールディングス	2,535	6,900.00	17,491,500	
8595	ジャフコ	3,000	1,693.00	5,079,000	
8601	大和証券グループ本社	236,000	302.00	71,272,000	
8604	野村ホールディングス	514,400	334.00	171,809,600	
8609	岡三証券グループ	20,000	284.00	5,680,000	
8613	丸三証券	8,100	294.00	2,381,400	
8614	東洋証券	9,000	143.00	1,287,000	
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	27,000	281.00	7,587,000	
8617	光世証券	7,000	74.00	518,000	
8622	水戸証券	8,000	132.00	1,056,000	
8624	いちよし証券	5,400	442.00	2,386,800	
8628	松井証券	14,200	453.00	6,432,600	
8692	だいこう証券ビジネス	1,400	287.00	401,800	
8698	マネックスグループ	192	15,450.00	2,966,400	
8703	カブドットコム証券	9,600	277.00	2,659,200	
8706	極東証券	3,200	645.00	2,064,000	
8707	岩井コスモホールディングス	2,400	294.00	705,600	
8742	小林洋行	900	196.00	176,400	
8630	NK S Jホールディングス	49,700	1,793.00	89,112,100	
8725	M S & A Dインシュアランスグループホール	71,000	1,748.00	124,108,000	
8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	22,800	1,423.00	32,444,400	
8750	第一生命保険	1,271	96,000.00	122,016,000	

8766	東京海上ホールディングス	90,200	2,157.00	194,561,400	
8795	T & Dホールディングス	86,700	872.00	75,602,400	
8253	クレディセゾン	19,500	1,513.00	29,503,500	
8424	芙蓉総合リース	2,300	2,888.00	6,642,400	
8425	興銀リース	3,400	1,911.00	6,497,400	
8439	東京センチュリーリース	6,500	1,622.00	10,543,000	
8511	日本証券金融	10,100	442.00	4,464,200	
8512	大阪証券金融	4,000	180.00	720,000	
8519	ポケットカード	3,000	296.00	888,000	
8566	リコーリース	1,800	1,951.00	3,511,800	
8570	イオンクレジットサービス	10,700	1,169.00	12,508,300	
8572	アコム	4,880	1,573.00	7,676,240	
8574	プロミス	2,050	957.00	1,961,850	
8584	ジャックス	15,000	261.00	3,915,000	
8585	オリエントコーポレーション	36,000	85.00	3,060,000	
8586	日立キャピタル	4,900	1,185.00	5,806,500	
8591	オリックス	12,370	7,790.00	96,362,300	
8593	三菱UFJリース	6,080	3,575.00	21,736,000	
8772	アサックス	4	93,200.00	372,800	
8793	NECキャピタルソリューション	1,000	1,249.00	1,249,000	
2353	日本駐車場開発	257	3,530.00	907,210	
3003	昭栄	4,400	378.00	1,663,200	
3225	東京建物不動産販売	1,000	254.00	254,000	
3231	野村不動産ホールディングス	11,400	1,311.00	14,945,400	
3258	常和ホールディングス	400	1,394.00	557,600	
3265	ヒューリック	7,700	1,104.00	8,500,800	
4666	パーク24	12,300	1,017.00	12,509,100	
8801	三井不動産	105,000	1,436.00	150,780,000	
8802	三菱地所	166,000	1,371.00	227,586,000	
8803	平和不動産	22,500	199.00	4,477,500	
8804	東京建物	45,000	306.00	13,770,000	
8806	ダイビル	7,000	575.00	4,025,000	
8809	サンケイビル	4,100	737.00	3,021,700	
8815	東急不動産	48,000	362.00	17,376,000	
8818	京阪神ビルディング	2,800	384.00	1,075,200	
8830	住友不動産	57,000	1,748.00	99,636,000	
8833	東宝不動産	2,600	494.00	1,284,400	
8840	大京	37,000	186.00	6,882,000	
8841	テーオーシー	9,200	422.00	3,882,400	
8842	東京楽天地	4,000	284.00	1,136,000	
8848	レオパレス21	18,600	210.00	3,906,000	
8860	フジ住宅	3,000	410.00	1,230,000	
8864	空港施設	2,500	403.00	1,007,500	
8869	明和地所	1,200	376.00	451,200	
8870	住友不動産販売	860	3,430.00	2,949,800	
8871	ゴールドクレスト	2,160	1,507.00	3,255,120	
8875	東栄住宅	1,600	829.00	1,326,400	
8876	リロ・ホールディング	800	2,119.00	1,695,200	
8877	日本エスリード	900	708.00	637,200	

8879	東急リバブル	2,200	692.00	1,522,400	
8880	飯田産業	2,200	648.00	1,425,600	
8881	日神不動産	1,400	500.00	700,000	
8895	アーネストワン	3,900	902.00	3,517,800	
8897	タカラレーベン	2,800	479.00	1,341,200	
8904	サンヨーハウジング名古屋	10	78,200.00	782,000	
8905	イオンモール	10,800	1,821.00	19,666,800	
8907	フージャースコーポレーション	38	43,700.00	1,660,600	
8915	タクトホーム	12	67,800.00	813,600	
8918	ランド	5,500	13.00	71,500	
8923	トーセイ	24	22,730.00	545,520	
8933	エヌ・ティ・ティ都市開発	148	62,500.00	9,250,000	
8934	サンフロンティア不動産	22	12,800.00	281,600	
8944	ランドビジネス	18	15,580.00	280,440	
8999	グランディハウス	5	57,800.00	289,000	
9706	日本空港ビルデング	7,600	1,103.00	8,382,800	
1954	日本工営	9,000	293.00	2,637,000	
2120	ネクスト	1,000	342.00	342,000	
2127	日本M&Aセンター	5	396,500.00	1,982,500	
2128	ノバレーゼ	5	50,800.00	254,000	
2131	アコーディア・ゴルフ	102	61,800.00	6,303,600	
2168	パソナグループ	25	72,700.00	1,817,500	
2170	リンクアンドモチベーション	6	47,000.00	282,000	
2175	エス・エム・エス	4	71,200.00	284,800	
2181	テンプホールディングス	3,400	780.00	2,652,000	
2193	クックパッド	400	1,595.00	638,000	
2301	学情	1,000	260.00	260,000	
2305	スタジオアリス	1,200	1,199.00	1,438,800	
2309	シミックホールディングス	800	1,145.00	916,000	
2322	NECフィールディング	2,000	999.00	1,998,000	
2331	総合警備保障	9,100	926.00	8,426,600	
2371	カカクコム	3,900	2,209.00	8,615,100	
2378	ルネサンス	1,100	426.00	468,600	
2395	新日本科学	1,700	257.00	436,900	
2413	エムスリー	20	325,500.00	6,510,000	
2418	ベストブライダル	5	77,300.00	386,500	
2432	ディー・エヌ・エー	11,300	2,651.00	29,956,300	
2433	博報堂DYホールディングス	3,200	4,705.00	15,056,000	
2440	ぐるなび	1,700	1,022.00	1,737,400	
2450	一休	18	36,200.00	651,600	
2453	ジャパンベストレスキューシステム	4	72,800.00	291,200	
2462	ジェイコムホールディングス	500	696.00	348,000	
2466	PGMホールディングス	36	51,900.00	1,868,400	
4282	イーピーエス	14	164,300.00	2,300,200	
4301	アミューズ	700	1,170.00	819,000	
4310	ドリームインキュベータ	9	69,000.00	621,000	
4319	TAC	1,400	194.00	271,600	
4321	ケネディクス	278	13,070.00	3,633,460	
4324	電通	22,900	2,430.00	55,647,000	

4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	110	6,940.00	763,400	
4337	びあ	800	854.00	683,200	
4343	イオンファンタジー	800	1,412.00	1,129,600	
4544	みらかホールディングス	6,600	2,860.00	18,876,000	
4641	アルプス技研	1,200	622.00	746,400	
4651	サニックス	3,900	230.00	897,000	
4653	ダイオーズ	500	496.00	248,000	
4658	日本空調サービス	600	739.00	443,400	
4661	オリエンタルランド	6,800	8,460.00	57,528,000	
4665	ダスキン	7,500	1,607.00	12,052,500	
4668	明光ネットワークジャパン	2,200	752.00	1,654,400	
4671	ファルコSDホールディングス	1,400	920.00	1,288,000	
4678	秀英予備校	500	317.00	158,500	
4679	田谷	400	689.00	275,600	
4680	ラウンドワン	7,900	522.00	4,123,800	
4681	リゾートトラスト	3,900	1,232.00	4,804,800	
4694	ビー・エム・エル	1,600	2,000.00	3,200,000	
4696	ワタベウェディング	800	711.00	568,800	
4708	もしもしホットライン	4,100	791.00	3,243,100	
4711	東急コミュニティー	600	2,484.00	1,490,400	
4714	リソー教育	253	5,500.00	1,391,500	
4724	ウェアハウス	500	237.00	118,500	
4732	ユー・エス・エス	3,270	7,750.00	25,342,500	
4745	東京個別指導学院	1,300	175.00	227,500	
4767	テー・オー・ダブリュー	800	481.00	384,800	
4801	セントラルスポーツ	800	1,057.00	845,600	
5261	リゾートソリューション	2,000	163.00	326,000	
9603	エイチ・アイ・エス	2,600	2,220.00	5,772,000	
9616	共立メンテナンス	1,300	1,612.00	2,095,600	
9619	イチネンホールディングス	2,700	427.00	1,152,900	
9621	建設技術研究所	1,500	531.00	796,500	
9628	燦ホールディングス	500	1,566.00	783,000	
9632	スバル興業	2,000	272.00	544,000	
9633	東京テアトル	10,000	114.00	1,140,000	
9667	ホリプロ	900	1,040.00	936,000	
9671	よみうりランド	5,000	261.00	1,305,000	
9672	東京都競馬	19,000	119.00	2,261,000	
9675	常磐興産	8,000	103.00	824,000	
9678	カナモト	3,000	846.00	2,538,000	
9681	東京ドーム	20,000	215.00	4,300,000	
9715	トランス・コスモス	3,300	1,038.00	3,425,400	
9716	乃村工藝社	5,000	285.00	1,425,000	
9722	藤田観光	6,000	258.00	1,548,000	
9726	近畿日本ツーリスト	9,000	108.00	972,000	
9728	日本管財	900	1,495.00	1,345,500	
9729	トーカイ	1,000	1,683.00	1,683,000	
9731	白洋舎	3,000	216.00	648,000	
9735	セコム	24,400	3,650.00	89,060,000	
9740	セントラル警備保障	1,100	809.00	889,900	

9743	丹青社	3,000	224.00	672,000	
9744	メイテック	4,000	1,724.00	6,896,000	
9747	アサツー ディ・ケイ	4,400	2,184.00	9,609,600	
9755	応用地質	2,700	1,017.00	2,745,900	
9757	船井総合研究所	2,600	539.00	1,401,400	
9760	進学会	1,200	319.00	382,800	
9783	ベネッセホールディングス	7,700	3,635.00	27,989,500	
9787	イオンディライト	2,800	1,598.00	4,474,400	
9788	ナック	600	1,504.00	902,400	
9792	ニチイ学館	4,900	967.00	4,738,300	
9793	ダイセキ	4,000	1,418.00	5,672,000	
合 計		36,830,409	—	26,372,786,220	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

[次へ](#)

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

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

（1）貸借対照表

（単位：円）

科目	対象年月日	平成23年 8月15日現在	平成24年 2月15日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		67,473,506	35,324,058
コール・ローン		1,294,641,675	473,865,931
株式		58,323,697,347	61,694,502,392
投資証券		1,057,511,521	1,238,368,627
派生商品評価勘定		28,900	72,949,703
未収入金		839,649	1,312,573,312
未収配当金		104,917,195	65,972,186
未収利息		1,993	867
差入委託証拠金		376,384,112	269,323,924
流動資産合計		61,225,495,898	65,162,881,000
資産合計		61,225,495,898	65,162,881,000
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		175,510,734	259,895
未払金		34,776,630	139,200
未払解約金		13,771,787	121,061,587
流動負債合計		224,059,151	121,460,682
負債合計		224,059,151	121,460,682
純資産の部			
元本等			
元本		76,853,962,835	73,136,154,104
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		△15,852,526,088	△8,094,733,786
元本等合計		61,001,436,747	65,041,420,318
純資産合計		61,001,436,747	65,041,420,318
負債純資産合計		61,225,495,898	65,162,881,000

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(追加情報)

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

(貸借対照表に関する注記)

平成23年 8月15日現在		平成24年 2月15日現在	
1. 期首	平成23年 2月16日	1. 期首	平成23年 8月16日
期首元本額	78,161,068,413円	期首元本額	76,853,962,835円
期首からの追加設定元本額	5,334,436,819円	期首からの追加設定元本額	3,593,203,627円
期首からの一部解約元本額	6,641,542,397円	期首からの一部解約元本額	7,311,012,358円
平成23年 8月15日現在の元本の内訳 ※		平成24年 2月15日現在の元本の内訳 ※	
インデックスファンド海外株式ヘッジなし（DC専用）	12,708,555,883円	インデックスファンド海外株式ヘッジなし（DC専用）	13,451,759,974円
DCインデックスバランス（株式20）	51,968,309円	DCインデックスバランス（株式20）	50,634,393円
DCインデックスバランス（株式40）	175,230,475円	DCインデックスバランス（株式40）	175,461,897円
DCインデックスバランス（株式60）	323,783,429円	DCインデックスバランス（株式60）	327,185,398円
DCインデックスバランス（株式80）	355,516,739円	DCインデックスバランス（株式80）	355,389,209円

世界の財産 3 分法ファン ド（不動産・債券・株 式）毎月分配型	13,301,847,718円	世界の財産 3 分法ファン ド（不動産・債券・株 式）毎月分配型	11,409,656,625円
日興五大陸株式ファンド	21,947,726,342円	日興五大陸株式ファンド	20,262,666,276円
全世界株式債券ファンド （日本・先進国・新興 国）毎月分配型	88,106,924円	全世界株式債券ファンド （日本・先進国・新興 国）毎月分配型	86,268,948円
日興ストラテジック・ア ロケーション・ファンド （株式資産）	110,248,074円	日興ストラテジック・ア ロケーション・ファンド （株式資産）	105,921,508円
アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式80）	22,843,242円	アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式80）	22,446,329円
アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式60）	22,310,824円	アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式60）	19,591,740円
アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式40）	35,561,385円	アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式40）	32,327,430円
アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式20）	42,341,968円	アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式20）	41,109,781円
国際分散型ファンド40 （適格機関投資家向け）	19,331,969,523円	国際分散型ファンド40 （適格機関投資家向け）	17,902,309,109円
3 資産 バランスファンド （適格機関投資家向け）	65,065,502円	3 資産 バランスファンド （適格機関投資家向け）	61,356,620円
グローバルバランスファ ンド35（適格機関投資家 向け）	23,952,466円	グローバルバランスファ ンド35（適格機関投資家 向け）	22,941,796円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式20）	52,897,889円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド （株式20）	48,817,527円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式40）	129,361,371円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド （株式40）	129,380,259円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式60）	166,084,876円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド （株式60）	168,417,446円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式80）	172,771,496円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド （株式80）	163,113,945円
年金積立 インデックス ファンド海外株式（ヘッ ジなし）	7,725,818,400円	年金積立 インデックス ファンド海外株式（ヘッ ジなし）	8,299,397,894円
計	76,853,962,835円	計	73,136,154,104円
2. 本報告書における開示対 象ファンドの計算期間末 日における当該親投資信 託の受益権の総数	76,853,962,835口	2. 本報告書における開示対 象ファンドの計算期間末 日における当該親投資信 託の受益権の総数	73,136,154,104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15,852,526,088円であります。		3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、 その差額は8,094,733,786円であります。	

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

I 金融商品の状況に関する事項

	自 平成23年 2月16日 至 平成23年 8月15日	自 平成23年 8月16日 至 平成24年 2月15日
--	--------------------------------	--------------------------------

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

II 金融商品の時価等に関する事項

	平成23年 8月15日現在	平成24年 2月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
 （平成23年8月15日現在）
 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	△3,683,860,904
投資証券	△26,495,633
合計	△3,710,356,537

（平成24年2月15日現在）
 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
----	-------------------

株式	4,669,719,599
投資証券	93,389,340
合計	4,763,108,939

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成23年8月15日現在)

(単位：円)

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,576,758,000	—	1,435,277,752	△141,480,248
	合計	1,576,758,000	—	1,435,277,752	△141,480,248

(平成24年2月15日現在)

(単位：円)

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,814,173,192	—	1,880,533,132	66,359,940
	合計	1,814,173,192	—	1,880,533,132	66,359,940

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(平成23年8月15日現在)

(単位：円)

区分	種 類	契約額等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	買建	1,198,695,186	—	1,164,693,600	△34,001,586
	米ドル	786,890,609	—	765,230,860	△21,659,749
	ユーロ	411,804,577	—	399,462,740	△12,341,837
合計		1,198,695,186	—	1,164,693,600	△34,001,586

(平成24年2月15日現在)

(単位：円)

区分	種 類	契約額等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	買建	830,127,327	—	836,665,210	6,537,883
	米ドル	530,330,418	—	534,625,810	4,295,392
	ユーロ	299,796,909	—	302,039,400	2,242,491
	売建	536,671,635	—	536,879,650	△208,015
	米ドル	235,462,500	—	235,560,000	△97,500
	加ドル	83,233,320	—	83,241,800	△8,480
	豪ドル	49,440,820	—	49,453,800	△12,980
	英ポンド	116,941,200	—	117,011,500	△70,300
	スイスフラン	51,593,795	—	51,612,550	△18,755
合計		1,366,798,962	—	1,373,544,860	6,329,868

(注)1.時価の算定方法

(1) 本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

① 同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

② 同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成23年 8月15日現在		平成24年 2月15日現在	
1口当たり純資産額	0.7937円	1口当たり純資産額	0.8893円
(1万口当たり純資産額)	(7,937円)	(1万口当たり純資産額)	(8,893円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
米ドル				
ALPHA NATURAL RESOURCES INC	8,280	19.95	165,186.00	
ANADARKO PETROLEUM CORP	17,968	87.05	1,564,114.40	
APACHE CORP	13,814	107.31	1,482,380.34	
ARCH COAL INC	7,385	13.56	100,140.60	
BAKER HUGHES INC	15,965	48.00	766,320.00	
CABOT OIL & GAS CORP	7,900	35.01	276,579.00	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	8,451	57.31	484,326.81	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	24,685	22.71	560,596.35	
CHEVRON CORP	72,731	106.49	7,745,124.19	
CIMAREX ENERGY CO	3,355	68.78	230,756.90	
CONCHO RESOURCES INC	3,645	112.68	410,718.60	
CONOCOPHILLIPS	47,350	73.60	3,484,960.00	
CONSOL ENERGY INC	8,638	35.84	309,585.92	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,630	81.99	133,643.70	
DENBURY RESOURCES INC	15,145	19.46	294,721.70	
DEVON ENERGY CORPORATION	14,531	66.90	972,123.90	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	2,585	62.95	162,725.75	
EL PASO CORP	29,105	27.19	791,364.95	
ENERGEN CORP	2,310	49.59	114,552.90	
EOG RESOURCES INC	9,916	113.75	1,127,945.00	
EQT CORP	5,345	49.53	264,737.85	
EXXON MOBIL CORP	176,546	84.67	14,948,149.82	
FMC TECHNOLOGIES INC	8,285	53.77	445,484.45	
HALLIBURTON CO	33,157	35.70	1,183,704.90	
HELMERICH & PAYNE	4,100	59.09	242,269.00	
HESS CORP	10,830	61.90	670,377.00	
HOLLYFRONTIER CORP	7,800	34.10	265,980.00	
KINDER MORGAN INC	4,010	32.31	129,563.10	
MARATHON OIL CORP	25,317	32.97	834,701.49	
MARATHON PETROLEUM CORP	13,426	44.02	591,012.52	
MURPHY OIL CORP	6,965	61.75	430,088.75	
NABORS INDUSTRIES LTD	10,741	18.86	202,575.26	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	15,281	83.93	1,282,534.33	
NEWFIELD EXPLORATION CO	4,950	39.43	195,178.50	
NOBLE CORP	9,482	38.59	365,910.38	
NOBLE ENERGY INC	6,471	103.99	672,919.29	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	29,501	104.00	3,068,104.00	
PEABODY ENERGY CORP	9,290	34.67	322,084.30	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,600	110.79	398,844.00	
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	4,725	43.10	203,647.50	
QEP RESOURCES INC	6,820	31.00	211,420.00	
RANGE RESOURCES CORP	6,030	63.25	381,397.50	
ROWAN COMPANIES INC	4,980	37.72	187,845.60	
SCHLUMBERGER LTD	48,984	77.80	3,810,955.20	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	12,765	33.70	430,180.50	
SPECTRA ENERGY CORP	24,064	30.99	745,743.36	
SUNOCO INC	4,938	39.45	194,804.10	
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	5,500	28.54	156,970.00	
ULTRA PETROLEUM CORP	5,524	24.34	134,454.16	
VALERO ENERGY CORP	21,157	24.62	520,885.34	
WEATHERFORD INTL LTD	28,429	17.47	496,654.63	
WHITING PETROLEUM CORP	4,285	52.90	226,676.50	

WILLIAMS COS INC	21,944	29.18	640,325.92	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	7,905	90.78	717,615.90	
AIRGAS INC	2,650	79.03	209,429.50	
ALCOA INC	39,339	10.21	401,651.19	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	4,010	45.03	180,570.30	
BALL CORP	5,073	39.87	202,260.51	
CELANESE CORP-SERIES A	6,010	50.44	303,144.40	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,695	177.90	479,440.50	
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	5,350	69.91	374,018.50	
CROWN HOLDINGS INC	6,195	36.99	229,153.05	
DOW CHEMICAL	42,638	33.60	1,432,636.80	
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	33,688	49.66	1,672,946.08	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,675	54.14	253,104.50	
ECOLAB INC	10,900	61.31	668,279.00	
FMC CORP	2,780	92.50	257,150.00	
FREEPORT-MCMORAN COPPER	34,228	42.96	1,470,434.88	
INTERNATIONAL PAPER CO	15,520	33.05	512,936.00	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,224	56.40	181,833.60	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,450	44.61	466,174.50	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,070	88.36	182,905.20	
MEADWESTVACO CORP	6,889	30.03	206,876.67	
MONSANTO CO	19,336	76.94	1,487,711.84	
MOSAIC CO/THE	11,390	54.92	625,538.80	
NEWMONT MINING CORP	18,190	58.77	1,069,026.30	
NUCOR CORP	11,649	43.37	505,217.13	
OWENS-ILLINOIS INC	6,475	24.01	155,464.75	
PPG INDUSTRIES INC	5,397	90.52	488,536.44	
PRAXAIR INC	11,085	107.27	1,189,087.95	
ROCK-TENN COMPANY-CL A	2,500	68.93	172,325.00	
SEALED AIR CORP	4,356	19.31	84,114.36	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,327	99.80	332,034.60	
SIGMA-ALDRICH	4,395	70.32	309,056.40	
UNITED STATES STEEL CORP	5,237	28.00	146,636.00	
VULCAN MATERIALS CO	4,443	47.14	209,443.02	
WALTER ENERGY INC	2,240	67.20	150,528.00	
3M CO	24,421	87.99	2,148,803.79	
AGCO CORP	3,790	52.41	198,633.90	
AMETEK INC	5,442	48.60	264,481.20	
BOEING CO	25,497	75.56	1,926,553.32	
CATERPILLAR INC	23,281	114.45	2,664,510.45	
COOPER INDUSTRIES PLC	6,093	60.83	370,637.19	
CUMMINS INC	6,525	121.50	792,787.50	
DANAHER CORP	21,329	51.73	1,103,349.17	
DEERE & CO	14,930	89.05	1,329,516.50	
DOVER CORP	6,340	66.00	418,440.00	
EATON CORP	11,196	51.74	579,281.04	
EMERSON ELECTRIC CO	26,810	51.62	1,383,932.20	
FASTENAL CO	10,363	51.24	531,000.12	
FLOWSERVE CORP	1,825	117.16	213,817.00	
FLUOR CORP	5,893	60.81	358,353.33	
GENERAL DYNAMICS CORP	11,152	70.16	782,424.32	
GENERAL ELECTRIC CO.	384,903	18.94	7,290,062.82	
GOODRICH CORP	4,615	125.83	580,705.45	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	26,796	59.84	1,603,472.64	

ILLINOIS TOOL WORKS	16,100	55.97	901,117.00	
INGERSOLL-RAND PLC	12,056	38.90	468,978.40	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,810	45.99	221,211.90	
JOY GLOBAL INC	3,935	85.45	336,245.75	
KBR INC	5,860	33.10	193,966.00	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	3,816	70.80	270,172.80	
LOCKHEED MARTIN CORP	10,281	88.45	909,354.45	
MASCO CORP	14,899	11.63	173,275.37	
NORTHROP GRUMMAN CORP	9,524	60.21	573,440.04	
PACCAR INC	11,999	43.42	520,996.58	
PALL CORP	4,486	64.12	287,642.32	
PARKER HANNIFIN CORP	5,290	88.98	470,704.20	
PENTAIR INC	3,864	38.83	150,039.12	
PRECISION CASTPARTS CORP	5,365	170.26	913,444.90	
QUANTA SERVICES INC	8,315	22.20	184,593.00	
RAYTHEON COMPANY	12,662	50.36	637,658.32	
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,933	79.79	393,604.07	
ROCKWELL COLLINS INC.	5,725	59.61	341,267.25	
ROPER INDUSTRIES INC	3,180	94.21	299,587.80	
SPX CORP	2,087	75.01	156,545.87	
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,436	75.70	411,505.20	
TEXTRON INC	10,336	27.98	289,201.28	
TYCO INTERNATIONAL LTD	16,935	49.04	830,492.40	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	31,285	84.64	2,647,962.40	
URS CORP	3,410	43.33	147,755.30	
WW GRAINGER INC	2,157	209.10	451,028.70	
XYLEM INC	6,518	26.92	175,464.56	
AVERY DENNISON CORP	3,790	29.35	111,236.50	
CINTAS CORP	4,727	38.20	180,595.03	
DUN & BRADSTREET CORP	2,082	78.31	163,041.42	
EQUIFAX INC	4,084	42.85	174,999.40	
IHS INC-CLASS A	1,710	90.56	154,857.60	
IRON MOUNTAIN INC	6,817	30.56	208,327.52	
MANPOWERGROUP	2,657	44.75	118,900.75	
NIELSEN HOLDINGS NV	3,245	27.31	88,620.95	
PITNEY BOWES INC	8,543	18.51	158,130.93	
REPUBLIC SERVICES INC	11,045	30.16	333,117.20	
ROBERT HALF INTL INC	5,715	29.39	167,963.85	
RR DONNELLEY & SONS CO	8,005	12.82	102,624.10	
STERICYCLE INC	3,025	87.94	266,018.50	
VERISK ANALYTICS INC	4,000	40.65	162,600.00	
WASTE MANAGEMENT INC	16,164	35.44	572,852.16	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,095	65.48	399,100.60	
CSX CORP	38,543	21.82	841,008.26	
DELTA AIR LINES INC	6,905	10.94	75,540.70	
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,907	43.72	345,694.04	
FEDEX CORP	10,708	95.55	1,023,149.40	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	9,780	14.72	143,961.60	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,080	51.72	159,297.60	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	200,000	0.79	158,000.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	4,130	69.60	287,448.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,830	70.40	903,232.00	
SOUTHWEST AIRLINES CO	7,030	9.59	67,417.70	
UNION PACIFIC CORP	17,643	113.17	1,996,658.31	

UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	2,495	23.57	58,807.15	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	26,722	77.11	2,060,533.42	
AUTOLIV INC	3,510	65.23	228,957.30	
BORGWARNER INC	4,135	79.41	328,360.35	
FORD MOTOR COMPANY	127,980	12.48	1,597,190.40	
GENERAL MOTORS CORP	28,115	25.40	714,121.00	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	9,385	13.25	124,351.25	
HARLEY-DAVIDSON INC	8,894	46.50	413,571.00	
JOHNSON CONTROLS INC	24,848	33.27	826,692.96	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	3,805	41.60	158,288.00	
COACH INC	10,686	75.82	810,212.52	
DR HORTON INC	12,086	14.56	175,972.16	
FOSSIL INC	2,035	119.82	243,833.70	
GARMIN LTD	4,625	43.91	203,083.75	
HASBRO INC	4,458	36.58	163,073.64	
LEGGETT & PLATT INC	4,468	21.47	95,927.96	
LULULEMON ATHLETICA INC	3,600	65.34	235,224.00	
MATTEL INC	11,459	32.49	372,360.20	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,318	66.74	154,703.32	
NEWELL RUBBERMAID INC	11,190	18.91	211,602.90	
NIKE INC -CL B	12,922	106.63	1,377,872.86	
RALPH LAUREN CORP	2,095	174.78	366,164.10	
TOLL BROTHERS INC	4,501	23.71	106,718.71	
VF CORP	3,315	143.63	476,133.45	
WHIRLPOOL CORP	2,934	72.07	211,453.38	
APOLLO GROUP INC-CL A	4,612	53.59	247,157.08	
CARNIVAL CORP	17,087	30.44	520,128.28	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,155	378.94	437,675.70	
DARDEN RESTAURANTS INC	4,383	48.93	214,460.19	
DEVRY INC	2,085	38.08	79,396.80	
H&R BLOCK INC	12,000	16.21	194,520.00	
INTL GAME TECHNOLOGY	11,686	15.13	176,809.18	
LAS VEGAS SANDS CORP	13,660	51.75	706,905.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	9,466	35.13	332,540.58	
MCDONALD'S CORP	37,451	99.55	3,728,247.05	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	14,000	14.50	203,000.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,908	29.99	147,190.92	
STARBUCKS CORP	26,917	49.12	1,322,163.04	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	6,567	55.29	363,089.43	
WYNN RESORTS LTD	3,060	111.16	340,149.60	
YUM! BRANDS INC	17,094	63.98	1,093,674.12	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	8,425	14.55	122,583.75	
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	23,163	29.79	690,025.77	
COMCAST CORP-CLASS A	75,451	27.25	2,056,039.75	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	24,091	26.15	629,979.65	
DIRECTV-CLASS A	26,454	45.85	1,212,915.90	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	4,960	45.20	224,192.00	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	4,635	41.46	192,167.10	
DISH NETWORK CORP-A	7,659	28.36	217,209.24	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,846	10.70	169,552.20	
LIBERTY GLOBAL INC-A	4,473	49.05	219,400.65	
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	4,683	46.82	219,258.06	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-A	4,085	85.59	349,635.15	
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	11,137	45.50	506,733.50	

NEWS CORP-CL A	65,942	19.15	1,262,789.30	
NEWS CORP-CLASS B	15,779	19.91	314,159.89	
OMNICOM GROUP	9,457	48.00	453,936.00	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	3,320	43.24	143,556.80	
SIRIUS XM RADIO INC	135,530	2.14	290,711.85	
THE WALT DISNEY CO.	64,003	41.60	2,662,524.80	
TIME WARNER CABLE	11,907	75.92	903,979.44	
TIME WARNER INC	37,643	37.84	1,424,411.12	
VIACOM INC-CLASS B	19,183	49.04	940,734.32	
VIRGIN MEDIA INC	11,460	25.93	297,157.80	
WASHINGTON POST-CLASS B	212	383.75	81,355.00	
ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	3,321	44.59	148,083.39	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,708	79.77	216,017.16	
AMAZON.COM INC	13,140	191.30	2,513,682.00	
AUTOZONE INC	932	360.11	335,622.52	
BED BATH & BEYOND INC	9,172	59.76	548,118.72	
BEST BUY CO INC	11,434	25.49	291,452.66	
CARMAX INC	8,679	29.72	257,939.88	
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	4,840	42.49	205,651.60	
DOLLAR TREE INC	4,557	88.50	403,294.50	
EXPEDIA INC	3,642	33.92	123,536.64	
FAMILY DOLLAR STORES	4,623	57.09	263,927.07	
GAMESTOP CORP-CLASS A	5,150	22.98	118,347.00	
GAP INC/THE	13,956	22.34	311,777.04	
GENUINE PARTS CO	5,771	64.70	373,383.70	
HOME DEPOT INC	56,700	46.06	2,611,602.00	
J.C. PENNEY CO INC	6,061	42.37	256,804.57	
KOHL'S CORP	9,687	50.90	493,068.30	
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	22,020	18.26	402,085.20	
LIMITED INC/THE	9,518	45.60	434,020.80	
LOWE'S COS INC	45,422	27.19	1,235,024.18	
MACY'S INC	14,969	35.56	532,297.64	
NETFLIX INC	1,830	123.07	225,218.10	
NORDSTROM INC	5,840	50.67	295,912.80	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,665	84.00	391,860.00	
PETSMART INC	4,460	55.23	246,325.80	
PRICELINE.COM INC	1,825	576.94	1,052,915.50	
ROSS STORES INC	8,656	51.90	449,246.40	
STAPLES INC	25,644	14.90	382,095.60	
TARGET CORP	23,140	52.27	1,209,527.80	
TIFFANY & CO	4,560	65.57	298,999.20	
TJX COMPANIES INC	27,978	34.49	964,961.22	
URBAN OUTFITTERS INC	4,770	27.17	129,624.75	
COSTCO WHOLESALE CORP	15,809	84.10	1,329,536.90	
CVS CAREMARK CORP	48,702	43.38	2,112,692.76	
KROGER CO	19,915	23.87	475,371.05	
SAFEWAY INC	13,113	22.15	290,452.95	
SYSCO CORP	22,006	29.30	644,775.80	
WALGREEN CO	33,152	34.63	1,148,053.76	
WAL-MART STORES INC	68,812	62.22	4,281,482.64	
WHOLE FOODS MARKET INC	5,545	80.99	449,089.55	
ALTRIA GROUP INC	75,448	29.27	2,208,362.96	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	24,373	31.15	759,218.95	
BEAM INC	5,276	54.18	285,853.68	

BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,145	82.00	257,890.00	
BUNGE LTD	5,487	65.67	360,331.29	
CAMPBELL SOUP CO	7,215	31.81	229,509.15	
COCA-COLA CO/THE	75,036	68.90	5,169,980.40	
COCA-COLA ENTERPRISES	10,930	28.10	307,133.00	
CONAGRA FOODS INC	14,060	26.76	376,245.60	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,965	21.46	170,928.90	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	8,259	39.11	323,009.49	
GENERAL MILLS INC	23,974	39.80	954,165.20	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	4,875	67.32	328,185.00	
HERSHEY CO/THE	6,065	60.62	367,660.30	
HJ HEINZ CO	11,835	51.69	611,751.15	
HORMEL FOODS CORP	5,800	28.93	167,794.00	
JM SMUCKER CO/THE	4,230	79.42	335,946.60	
KELLOGG CO	9,318	50.30	468,695.40	
KRAFT FOODS INC-CLASS A	61,105	38.50	2,352,542.50	
LORILLARD INC	5,120	122.74	628,428.80	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,005	50.32	201,531.60	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	7,191	75.94	546,084.54	
MOLSON COORS BREWING CO -B	5,920	44.02	260,598.40	
MONSTER BEVERAGE CORP	2,825	110.27	311,512.75	
PEPSICO INC	57,446	63.52	3,648,969.92	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	63,778	81.65	5,207,473.70	
RALCORP HOLDINGS INC	1,820	74.55	135,681.00	
REYNOLDS AMERICAN INC	13,220	40.38	533,823.60	
SARA LEE CORP	20,968	20.25	424,602.00	
TYSON FOODS INC-CL A	11,206	18.92	212,017.52	
AVON PRODUCTS	15,953	17.80	283,963.40	
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,515	47.45	261,686.75	
CLOROX COMPANY	4,926	68.09	335,411.34	
COLGATE-PALMOLIVE CO	17,650	91.90	1,622,035.00	
ENERGIZER HOLDINGS INC	2,751	76.76	211,166.76	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	8,340	55.16	460,034.40	
HERBALIFE LTD	4,450	59.42	264,419.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	14,373	71.63	1,029,537.99	
PROCTER & GAMBLE CO	99,779	64.48	6,433,749.92	
AETNA INC	13,803	47.27	652,467.81	
AMERISOURCEBERGEN CORP	9,014	37.55	338,475.70	
BAXTER INTERNATIONAL INC	20,934	56.99	1,193,028.66	
BECTON DICKINSON AND CO	7,966	76.70	610,992.20	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	52,468	5.92	310,610.56	
CARDINAL HEALTH INC	11,805	42.06	496,518.30	
CAREFUSION CORP	8,275	25.76	213,164.00	
CERNER CORP	5,335	70.64	376,864.40	
CIGNA CORP	10,330	43.99	454,416.70	
COVENTRY HEALTH CARE INC	5,075	32.73	166,104.75	
COVIDIEN PLC	18,155	52.31	949,688.05	
CR BARD INC	3,174	95.62	303,497.88	
DAVITA INC	3,499	84.75	296,540.25	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	4,562	38.61	176,138.82	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,300	73.93	317,899.00	
EXPRESS SCRIPTS INC	17,032	52.12	887,707.84	
HCA HOLDINGS INC	6,715	25.09	168,479.35	
HENRY SCHEIN INC	3,010	73.15	220,181.50	

HOLOGIC INC	8,758	20.85	182,648.09	
HUMANA INC	5,785	88.60	512,551.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	1,450	510.40	740,080.00	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,685	89.20	328,702.00	
MCKESSON CORP	9,064	81.86	741,979.04	
MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	14,182	62.90	892,047.80	
MEDTRONIC INC	38,247	39.53	1,511,903.91	
OMNICARE INC	3,640	33.26	121,066.40	
PATTERSON COS INC	3,142	32.44	101,926.48	
QUEST DIAGNOSTICS	5,866	57.49	337,236.34	
ST JUDE MEDICAL INC	12,080	43.64	527,171.20	
STRYKER CORP	10,688	53.52	572,021.76	
UNITEDHEALTH GROUP INC	38,910	54.46	2,119,038.60	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,304	65.77	283,074.08	
WELLPOINT INC	13,311	65.69	874,399.59	
ZIMMER HOLDINGS INC	6,962	61.79	430,181.98	
ABBOTT LABORATORIES	56,502	55.08	3,112,130.16	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	12,200	43.78	534,116.00	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	6,820	83.39	568,719.80	
ALLERGAN INC	11,055	88.88	982,568.40	
AMGEN INC	28,681	67.84	1,945,719.04	
BIOGEN IDEC INC	8,267	119.70	989,559.90	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	62,156	31.85	1,979,668.60	
CELGENE CORP	16,417	74.14	1,217,238.46	
COVANCE INC	2,000	47.68	95,360.00	
ELI LILLY & CO	38,018	38.49	1,463,312.82	
FOREST LABORATORIES INC	9,545	31.63	301,908.35	
GILEAD SCIENCES INC	27,852	54.55	1,519,465.86	
HOSPIRA INC	6,181	36.30	224,370.30	
ILLUMINA INC	4,745	54.34	257,843.30	
JOHNSON & JOHNSON	99,504	64.61	6,428,953.44	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	6,776	49.85	337,783.60	
MERCK & CO. INC.	111,833	38.21	4,273,138.93	
MYLAN INC	14,505	23.24	337,096.20	
PERRIGO CO	3,180	94.73	301,241.40	
PFIZER INC	283,300	21.33	6,042,789.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	14,129	55.85	789,104.65	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	7,990	36.13	288,678.70	
WARNER CHILCOTT PLC	4,500	16.43	73,935.00	
WATERS CORP	3,106	88.51	274,912.06	
WATSON PHARMACEUTICALS INC	4,705	60.07	282,629.35	
BB&T CORP	25,818	29.60	764,212.80	
CIT GROUP INC	7,175	41.22	295,753.50	
COMERICA INC	7,190	30.00	215,700.00	
FIFTH THIRD BANCORP	31,889	13.30	424,123.70	
HUDSON CITY BANCORP INC	19,870	6.88	136,705.60	
KEYCORP	34,838	7.96	277,310.48	
M & T BANK CORP	4,273	81.03	346,241.19	
NATIONAL BANK OF GREECE-ADR	20,000	3.73	74,600.00	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	16,064	12.32	197,908.48	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	14,980	12.57	188,373.50	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	19,370	59.56	1,153,677.20	
REGIONS FINANCIAL CORP	45,874	5.65	259,188.10	
SUNTRUST BANKS INC	18,667	21.67	404,513.89	

US BANCORP	69,836	29.00	2,025,244.00	
WELLS FARGO & CO	182,130	30.42	5,540,394.60	
AMERICAN EXPRESS CO	39,149	51.96	2,034,182.04	

[次へ](#)

AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,140	55.32	450,304.80	
BANK OF AMERICA CORPORATION	367,879	7.98	2,935,674.42	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	45,167	21.01	948,958.67	
BLACKROCK INC	3,465	191.52	663,616.80	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	17,185	47.98	824,536.30	
CITIGROUP INC	105,922	32.08	3,397,977.76	
CME GROUP INC	2,306	290.00	668,740.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	19,360	28.48	551,372.80	
EATON VANCE CORP	3,790	27.68	104,907.20	
FRANKLIN RESOURCES INC	5,525	115.99	640,844.75	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	17,403	112.87	1,964,276.61	
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	2,760	133.68	368,956.80	
INVESCO LTD	17,037	23.95	408,036.15	
JPMORGAN CHASE & CO	141,575	37.92	5,368,524.00	
LEGG MASON INC	5,775	27.06	156,271.50	
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	28.63	209,142.15	
MOODY'S CORP	7,797	38.66	301,432.02	
MORGAN STANLEY	52,185	19.05	994,124.25	
NASDAQ OMX GROUP/THE	5,095	26.36	134,304.20	
NORTHERN TRUST CORP	7,340	43.41	318,629.40	
NYSE EURONEXT	9,700	29.46	285,762.00	
SCHWAB (CHARLES) CORP	40,144	12.34	495,376.96	
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,325	19.43	84,034.75	
SLM CORP	19,832	16.07	318,700.24	
STATE STREET CORP	17,917	39.46	707,004.82	
T ROWE PRICE GROUP INC	8,825	59.95	529,058.75	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	8,530	17.30	147,569.00	
ACE LTD	12,563	73.60	924,636.80	
AFLAC INC	16,432	48.56	797,937.92	
ALLSTATE CORP	18,543	31.15	577,614.45	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	17,935	26.60	477,071.00	
AON CORP	10,247	48.29	494,827.63	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	5,295	37.64	199,303.80	
ASSURANT INC	3,640	43.64	158,849.60	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	4,795	32.58	156,221.10	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	32,815	78.92	2,589,759.80	
CHUBB CORP	10,453	69.32	724,601.96	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,340	34.82	220,790.50	
EVEREST RE GROUP LTD	2,074	88.68	183,922.32	
FIDELITY NATIONAL FINL-A	5,881	17.52	103,035.12	
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	18,645	8.88	165,567.60	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	14,002	19.81	277,379.62	
LINCOLN NATIONAL CORP	11,528	24.00	276,672.00	
LOEWS CORP	12,325	38.15	470,198.75	
MARSH & MCLENNAN COS	19,203	31.89	612,383.67	
METLIFE INC	38,070	37.32	1,420,772.40	
PARTNERRE LTD	2,372	66.48	157,690.56	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,290	26.42	271,861.80	
PROGRESSIVE CORP	22,020	21.77	479,375.40	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	17,782	59.41	1,056,428.62	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,497	72.31	108,248.07	
TORCHMARK CORP	4,271	48.10	205,435.10	
TRAVELERS COS INC/THE	15,224	59.16	900,651.84	
UNUM GROUP	10,918	22.53	245,982.54	

WILLIS GROUP HOLDING	6,260	38.67	242,074.20	
WR BERKLEY CORP	5,288	36.16	191,214.08	
XL GROUP PLC	9,680	19.31	186,920.80	
CBRE GROUP INC	11,490	18.30	210,267.00	
ACCENTURE PLC-CL A	23,248	57.46	1,335,830.08	
ACTIVISION BLIZZARD INC	19,170	12.48	239,241.60	
ADOBE SYSTEMS INC	18,109	32.44	587,455.96	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	7,210	38.48	277,440.80	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,025	120.23	243,465.75	
AUTODESK INC	7,690	38.79	298,295.10	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	18,036	54.25	978,453.00	
BMC SOFTWARE INC	6,394	39.10	250,005.40	
CA INC	14,815	27.03	400,449.45	
CITRIX SYSTEMS INC	6,488	73.87	479,268.56	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	11,154	70.74	789,089.73	
COMPUTER SCIENCES CORP	5,583	32.60	182,005.80	
EBAY INC	41,797	32.96	1,377,629.12	
ELECTRONIC ARTS INC	12,614	17.66	222,763.24	
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	9,055	31.04	281,067.20	
FISERV INC	5,139	65.37	335,936.43	
GOOGLE INC-CL A	9,231	609.76	5,628,694.56	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	43,362	192.22	8,335,043.64	
INTUIT INC	9,976	56.77	566,337.52	
MASTERCARD INC-CLASS A	3,920	395.55	1,550,556.00	
MICROSOFT CORP	273,799	30.25	8,282,419.75	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	9,350	28.00	261,800.00	
ORACLE CORP	146,903	28.24	4,148,540.72	
PAYCHEX INC	11,862	31.22	370,331.64	
RED HAT INC	7,270	48.81	354,848.70	
SAIC INC	10,745	12.61	135,494.45	
SALESFORCE.COM INC	4,690	131.60	617,204.00	
SYMANTEC CORP	27,165	17.92	486,796.80	
SYNOPSYS INC	4,627	30.37	140,521.99	
TERADATA CORP	6,370	62.16	395,959.20	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,506	21.55	97,104.30	
VERISIGN INC	5,190	37.20	193,068.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	18,775	115.24	2,163,631.00	
VMWARE INC	3,115	97.51	303,743.65	
WESTERN UNION CO	23,401	17.68	413,729.68	
YAHOO! INC	44,155	15.36	678,441.57	
AMPHENOL CORP-CL A	6,280	55.06	345,776.80	
APPLE COMPUTER INC	33,661	509.46	17,148,933.06	
ARROW ELECTRONICS INC	4,490	40.15	180,273.50	
AVNET INC	6,080	35.94	218,515.20	
CISCO SYSTEMS INC	199,655	20.07	4,007,075.85	
CORNING INC	57,428	13.48	774,129.44	
DELL INC	60,546	18.04	1,092,249.84	
DOLBY LABORATORIES INC CLASS A	2,100	37.36	78,456.00	
EMC CORP/MASS	74,354	26.40	1,962,945.60	
F5 NETWORKS INC	3,005	125.78	377,968.90	
FLEXTRONICS INTL LTD	27,456	6.98	191,642.88	
FLIR SYSTEMS INC	5,565	24.74	137,678.10	
HARRIS CORP	4,560	42.46	193,617.60	
HEWLETT-PACKARD CO	74,880	29.08	2,177,510.40	

JUNIPER NETWORKS INC	19,573	22.57	441,762.61	
MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS I	10,493	39.68	416,362.24	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	10,830	47.70	516,591.00	
NETAPP INC	13,486	39.12	527,572.32	
QUALCOMM INC	60,877	61.71	3,756,719.67	
SANDISK CORP	8,963	46.99	421,216.18	
SEAGATE TECHNOLOGY	15,444	26.60	410,810.40	
TE CONNECTIVITY LTD	15,970	34.83	556,235.10	
WESTERN DIGITAL CORP	8,555	39.14	334,842.70	
XEROX CORP	52,349	8.37	438,161.13	
AT&T INC	215,176	30.07	6,470,342.32	
CENTURYLINK INC	22,876	37.82	865,170.32	
CROWN CASTLE INTL CORP	10,700	49.42	528,794.00	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	39,734	4.06	161,320.04	
METROPCS COMMUNICATIONS INC	8,725	9.99	87,162.75	
NII HOLDINGS INC	6,497	23.21	150,795.37	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	4,610	45.39	209,247.90	
SPRINT NEXTEL CORP	111,942	2.31	258,586.02	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	102,763	38.04	3,909,104.52	
WINDSTREAM CORP	20,465	12.46	254,993.90	
AES CORP	24,528	13.48	330,637.44	
ALLIANT ENERGY CORP	3,610	42.73	154,255.30	
AMEREN CORPORATION	8,922	31.19	278,277.18	
AMERICAN ELECTRIC POWER	17,008	39.84	677,598.72	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5,875	33.98	199,632.50	
CALPINE CORP	12,490	15.44	192,845.60	
CENTERPOINT ENERGY INC	14,762	18.63	275,016.06	
CONSOLIDATED EDISON INC	10,856	57.97	629,322.32	
CONSTELLATION ENERGY GROUP	7,245	36.18	262,124.10	
DOMINION RESOURCES INC/VA	21,167	50.23	1,063,218.41	
DTE ENERGY COMPANY	5,638	53.39	301,012.82	
DUKE ENERGY CORP	49,023	21.50	1,053,994.50	
EDISON INTERNATIONAL	10,619	40.80	433,255.20	
ENTERGY CORP	6,547	67.74	443,493.78	
EXELON CORP	24,439	39.03	953,854.17	
FIRSTENERGY CORP	14,755	43.16	636,825.80	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	2,420	53.68	129,905.60	
MDU RESOURCES GROUP INC	8,455	21.41	181,021.55	
NEXTERA ENERGY INC	14,755	60.38	890,906.90	
NISOURCE INC	10,915	22.87	249,626.05	
NORTHEAST UTILITIES	6,920	34.90	241,508.00	
NRG ENERGY INC	9,360	17.05	159,588.00	
NSTAR	3,415	45.64	155,860.60	
ONEOK INC	3,245	81.27	263,721.15	
P G & E CORP	14,601	41.54	606,525.54	
PEPCO HOLDINGS INC	7,192	19.81	142,473.52	
PINNACLE WEST CAPITAL	3,569	47.32	168,885.08	
PPL CORPORATION	21,108	27.85	587,857.80	
PROGRESS ENERGY INC	11,073	54.76	606,357.48	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	18,763	30.78	577,525.14	
SCANA CORP	4,853	45.00	218,385.00	
SEMPRA ENERGY	7,777	57.49	447,099.73	
SOUTHERN CO	31,310	44.54	1,394,547.40	
WISCONSIN ENERGY CORP	7,644	34.32	262,342.08	

XCEL ENERGY INC	18,014	26.40	475,569.60	
ADVANCED MICRO DEVICES	23,671	7.32	173,271.72	
ALTERA CORPORATION	11,116	39.72	441,527.52	
ANALOG DEVICES INC	10,261	39.43	404,591.23	
APPLIED MATERIALS INC	48,423	12.87	623,204.01	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	8,140	34.51	280,911.40	
BROADCOM CORP-CL A	17,556	36.85	646,938.60	
CREE INC	3,840	27.28	104,755.20	
FIRST SOLAR INC	2,040	39.21	79,988.40	
INTEL CORP	190,667	26.78	5,106,062.26	
KLA-TENCOR CORPORATION	6,269	49.60	310,942.40	
LAM RESEARCH CORP	4,827	41.91	202,299.57	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	7,544	33.54	253,025.76	
LSI CORP	20,595	8.48	174,645.60	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	18,834	16.00	301,344.00	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	9,910	27.49	272,425.90	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6,334	36.94	233,977.96	
MICRON TECHNOLOGY INC	32,857	8.34	274,027.38	
NVIDIA CORP	22,805	16.24	370,353.20	
TEXAS INSTRUMENTS INC	41,652	33.22	1,383,679.44	
XILINX INC	9,885	36.53	361,099.05	
米ドル小計	11,204,135		452,617,253.93 (35,544,032,951)	
加ドル				
ARC RESOURCES LTD	10,615	24.12	256,033.80	
ATHABASCA OIL SANDS CORP	11,180	12.05	134,719.00	
BAYTEX ENERGY CORP	4,425	55.60	246,030.00	
BONAVISTA ENERGY CORP	4,985	22.20	110,667.00	
CAMECO CORP	13,702	22.30	305,554.60	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	39,574	36.36	1,438,910.64	
CANADIAN OIL SANDS LTD	17,840	22.35	398,724.00	
CENOVUS ENERGY INC	27,213	38.60	1,050,421.80	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	9,325	46.41	432,773.25	
ENBRIDGE INC	27,035	39.10	1,057,068.50	
ENCANA CORP	27,648	19.30	533,606.40	
ENERPLUS CORP	6,630	23.55	156,136.50	
HUSKY ENERGY INC	10,659	25.49	271,697.91	
IMPERIAL OIL LTD	10,992	47.66	523,878.72	
MEG ENERGY CORP	4,510	42.70	192,577.00	
NEXEN INC	18,090	18.66	337,559.40	
NIKO RESOURCES LTD	1,695	43.03	72,935.85	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	9,390	26.12	245,266.80	
PEMBINA PIPELINE CORP	6,305	28.47	179,503.35	
PENGROWTH ENERGY CORP	12,780	9.95	127,161.00	
PENN WEST PETROLEUM LTD	17,873	21.44	383,197.12	
PRECISION DRILLING CORP	8,865	11.15	98,844.75	
PROGRESS ENERGY RESOURCES CORP	6,275	10.32	64,758.00	
SUNCOR ENERGY INC	56,845	33.73	1,917,381.85	
TALISMAN ENERGY INC	37,632	12.52	471,152.64	
TOURMALINE OIL CORP	4,005	24.60	98,523.00	
TRANSCANADA CORP	26,368	42.15	1,111,411.20	
VERMILION ENERGY INC	3,000	46.01	138,030.00	
AGNICO-EAGLE MINES LTD	6,375	33.85	215,793.75	
AGRIUM INC	5,415	81.33	440,401.95	
BARRICK GOLD CORP	36,094	47.64	1,719,518.16	

CENTERRA GOLD INC	6,530	19.87	129,751.10	
ELDORADO GOLD CORP	20,510	13.02	267,040.20	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	17,720	22.18	393,029.60	
FRANCO-NEVADA CORP	4,495	43.55	195,757.25	
GOLDCORP INC	29,052	45.43	1,319,832.36	
IAMGOLD CORP	14,165	16.23	229,897.95	
INMET MINING CORPORATION	2,100	63.75	133,875.00	
IVANHOE MINES LTD	9,940	16.35	162,519.00	
KINROSS GOLD CORP	42,395	10.35	438,788.25	
NEW GOLD INC	16,160	11.23	181,476.80	
OSISKO MINING CORP	13,590	11.87	161,313.30	
PAN AMERICAN SILVER CORP	4,115	23.64	97,278.60	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	30,822	44.45	1,370,037.90	
SILVER WHEATON CORP	12,035	35.16	423,150.60	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	20,625	38.97	803,756.25	
YAMANA GOLD INC	24,996	16.09	402,185.64	
BOMBARDIER INC 'B'	52,816	4.71	248,763.36	
CAE INC	10,675	10.63	113,475.25	
FINNING INTERNATIONAL INC	6,675	27.04	180,492.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	5,715	50.15	286,607.25	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3,295	24.26	79,936.70	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	16,249	78.25	1,271,484.25	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,245	74.68	466,376.60	
MAGNA INTERNATIONAL INC	8,149	42.72	348,125.28	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,920	24.24	95,020.80	
TIM HORTONS INC	6,045	49.00	296,205.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	13,305	19.67	261,709.35	
THOMSON REUTERS CORP	13,504	26.95	363,932.80	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,970	65.85	195,574.50	
ALIMENTATION COUCHE SUB VTG	4,700	30.15	141,705.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	1,000	56.07	56,070.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	3,849	36.10	138,948.90	
METRO INC	3,090	51.49	159,104.10	
SHOPPERS DRUG MART INC	7,155	40.50	289,777.50	
WESTON (GEORGE) LTD	1,872	63.99	119,789.28	
SAPUTO INC	5,200	41.54	216,008.00	
VITERRA INC	14,445	10.25	148,061.25	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	10,754	48.48	521,353.92	
BANK OF MONTREAL	22,811	58.27	1,329,196.97	
BANK OF NOVA SCOTIA	39,099	52.71	2,060,908.29	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	14,655	76.91	1,127,116.05	
NATIONAL BANK OF CANADA	5,470	76.52	418,564.40	
ROYAL BANK OF CANADA	52,154	53.65	2,798,062.10	
TORONTO-DOMINION BANK	32,055	78.34	2,511,188.70	
CI FINANCIAL CORP	5,690	21.85	124,326.50	
IGM FINANCIAL INC	4,295	45.39	194,950.05	
ONEX CORPORATION	3,845	36.34	139,727.30	
TMX GROUP INC	2,295	41.50	95,242.50	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	752	418.31	314,569.12	
GREAT-WEST LIFECO INC	11,084	22.55	249,944.20	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	2,905	25.69	74,629.45	
INTACT FINANCIAL CORP	4,025	59.96	241,339.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	66,461	11.87	788,892.07	
POWER CORP OF CANADA	12,990	24.70	320,853.00	

POWER FINANCIAL CORP	9,735	26.99	262,747.65	
SUN LIFE FINANCIAL INC	21,564	20.86	449,825.04	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	21,397	31.10	665,446.70	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES CORP	8,664	17.88	154,912.32	
CGI GROUP INC - CL A	8,920	20.68	184,465.60	
OPEN TEXT CORPORATION	2,255	61.98	139,764.90	
RESEARCH IN MOTION	16,878	14.55	245,574.90	
BCE INC	10,310	39.40	406,214.00	
BELL ALIANT INC	2,800	26.96	75,488.00	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	15,720	37.76	593,587.20	
TELUS CORP	1,615	56.35	91,005.25	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	5,628	54.00	303,912.00	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	3,115	61.87	192,725.05	
FORTIS INC	7,035	32.99	232,084.65	
TRANSALTA CORP	7,950	20.40	162,180.00	
加ドル小計	1,378,390		44,387,891.79 (3,486,668,900)	
豪ドル				
CALTEX AUSTRALIA LTD	4,575	12.66	57,919.50	
ORIGIN ENERGY LTD	40,210	13.39	538,411.90	
SANTOS LTD	33,605	13.79	463,412.95	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	23,318	35.17	820,094.06	
WORLEYPARSONS LTD	7,260	28.00	203,280.00	
ALUMINA LTD	94,332	1.17	110,840.10	
AMCOR LIMITED	44,030	6.90	303,807.00	
BHP BILLITON LTD	116,576	36.17	4,216,553.92	
BORAL LTD	28,545	4.27	121,887.15	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	46,275	5.61	259,602.75	
ILUKA RESOURCES LTD	15,185	17.12	259,967.20	
INCITEC PIVOT LTD	53,090	3.39	179,975.10	
JAMES HARDIE INDUSTRIES SE	13,935	7.12	99,217.20	
LYNAS CORP LTD	61,300	1.27	78,157.50	
NEWCREST MINING LTD	27,889	34.40	959,381.60	
ONESTEEL LTD	33,285	0.75	24,963.75	
ORICA LIMITED	13,435	25.72	345,548.20	
OZ MINERALS LTD	10,381	11.49	119,277.69	
RIO TINTO LTD	15,983	69.28	1,107,302.24	
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	6,495	14.18	92,099.10	
LEIGHTON HOLDINGS LTD	5,867	22.87	134,178.29	
BRAMBLES LTD	53,968	7.11	383,712.48	
CAMPBELL BROTHERS LTD	2,540	55.82	141,782.80	
ASCIANO LTD	36,333	4.59	166,768.47	
QANTAS AIRWAYS LTD	34,245	1.54	52,737.30	
QR NATIONAL LTD	59,950	3.73	223,613.50	
SYDNEY AIRPORT	16,920	2.65	44,838.00	
TOLL HOLDINGS LTD	24,745	5.10	126,199.50	
TRANSURBAN GROUP	47,535	5.61	266,671.35	
CROWN LTD	17,690	8.37	148,065.30	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	23,977	3.58	85,837.66	
TABCORP HOLDINGS LTD	23,977	2.75	65,936.75	
TATTS GROUP LTD	42,460	2.50	106,150.00	
FAIRFAX MEDIA LTD	100,125	0.78	78,097.50	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	25,515	1.98	50,519.70	
METCASH LTD	31,790	4.06	129,067.40	
WESFARMERS LTD	37,030	29.55	1,094,236.50	

WOOLWORTHS LTD	44,647	24.99	1,115,728.53	
COCA-COLA AMATIL LTD	20,630	11.73	241,989.90	
COCHLEAR LTD	2,157	60.55	130,606.35	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	4,895	18.58	90,949.10	
SONIC HEALTHCARE LTD	14,760	11.19	165,164.40	
CSL LTD	19,732	30.78	607,350.96	
AUST AND NZ BANKING GROUP	94,864	21.69	2,057,600.16	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	15,708	8.07	126,763.56	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	56,582	49.96	2,826,836.72	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	79,463	23.02	1,829,238.26	
WESTPAC BANKING CORP	109,286	20.90	2,284,077.40	
ASX LTD	6,590	30.24	199,281.60	
MACQUARIE GROUP LTD	11,946	26.78	319,913.88	
AMP LTD	96,747	4.32	417,947.04	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	73,478	2.84	208,677.52	
QBE INSURANCE GROUP LTD	40,780	11.80	481,204.00	
SUNCORP GROUP LTD	46,700	8.30	387,610.00	
COMPUTERSHARE LTD	17,960	8.00	143,680.00	
TELSTRA CORPORATION LTD	165,734	3.41	565,152.94	
AGL ENERGY LTD	14,290	14.29	204,204.10	
豪ドル小計	2,211,320		28,064,087.83 (2,354,296,328)	
英ポンド				
AMEC PLC	13,270	11.00	145,970.00	
BG GROUP PLC	123,054	14.67	1,805,202.18	
BP PLC	687,833	4.94	3,403,397.68	
ESSAR ENERGY PLC	10,660	1.27	13,538.20	
PETROFAC LTD	9,765	15.40	150,381.00	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	131,368	23.31	3,062,844.92	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	97,444	23.61	2,301,140.06	
TULLOW OIL PLC	33,380	15.26	509,378.80	
ANGLO AMERICAN PLC	47,774	27.72	1,324,295.28	
ANTOFAGASTA PLC	14,880	13.37	198,945.60	
BHP BILLITON PLC	76,326	20.72	1,581,474.72	
EURASIAN NATURAL RESOURCES	10,270	7.09	72,865.65	
FRESNILLO PLC	6,750	17.84	120,420.00	
GLENCORE INTERNATIONAL-WI	32,380	4.23	137,145.49	
JOHNSON MATTHEY PLC	7,174	23.06	165,432.44	
KAZAKHMYS PLC-	7,325	11.21	82,113.25	
LONMIN PLC	7,445	10.17	75,715.65	
RANDGOLD RESOURCES LTD	3,050	71.55	218,227.50	
REXAM PLC	32,225	3.76	121,423.80	
RIO TINTO PLC	50,780	37.27	1,892,824.50	
VEDANTA RESOURCES PLC	3,810	12.51	47,663.10	
XSTRATA PLC	74,845	11.84	886,164.80	
BAE SYSTEMS PLC ORD	120,170	3.29	395,839.98	
BALFOUR BEATTY PLC	18,710	2.82	52,818.33	
BUNZL PLC	10,376	9.10	94,473.48	
COBHAM PLC	34,695	1.92	66,718.48	
INVENSYS PLC	27,080	2.11	57,274.20	
MEGGITT PLC	29,235	3.72	108,841.90	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	69,575	7.79	542,337.12	
SMITHS GROUP PLC	14,563	10.53	153,348.39	
WEIR GROUP PLC/THE	8,360	19.60	163,856.00	
WOLSELEY PLC	10,805	23.20	250,676.00	

AGGREKO PLC	10,021	21.87	219,159.27	
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	9,775	7.46	72,921.50	
CAPITA PLC	23,289	6.48	150,912.72	
EXPERIAN PLC	34,088	9.39	320,256.76	
G4S PLC	55,329	2.83	156,857.71	
INTERTEK GROUP PLC	6,595	22.30	147,068.50	
SERCO GROUP PLC	19,895	5.34	106,338.77	
GKN PLC	58,715	2.18	128,468.42	
BURBERRY GROUP PLC	16,414	14.23	233,571.22	
CARNIVAL PLC	6,710	19.14	128,429.40	
COMPASS GROUP PLC	69,263	6.34	439,473.73	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	11,647	13.72	159,796.84	
TUI TRAVEL PLC	21,725	2.05	44,601.42	
WHITBREAD PLC	6,950	17.25	119,887.50	
BRITISH SKY BROADCASTING GRO	41,474	6.98	289,695.89	
ITV PLC	147,795	0.78	116,019.07	
PEARSON PLC	27,619	12.06	333,085.14	
REED ELSEVIER PLC	39,836	5.36	213,720.14	
WPP PLC	46,044	7.99	367,891.56	
KINGFISHER PLC	88,782	2.71	240,599.22	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	58,200	3.44	200,440.80	
NEXT PLC	6,637	27.57	182,982.09	
SAINSBURY (J) PLC	44,131	2.89	127,935.76	
TESCO PLC	289,074	3.14	908,125.97	
WM MORRISON SUPERMARKETS	79,475	2.91	231,510.67	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,365	12.10	161,716.50	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	71,762	31.47	2,258,350.14	
DIAGEO PLC	90,492	15.09	1,365,976.74	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	36,557	24.73	904,054.61	
SABMILLER PLC	34,396	25.58	879,849.68	
TATE & LYLE PLC	17,580	6.95	122,268.90	
UNILEVER PLC	46,187	20.80	960,689.60	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	22,175	35.36	784,108.00	
SMITH & NEPHEW PLC	33,686	6.35	213,906.10	
ASTRAZENECA PLC	48,698	30.17	1,469,462.15	
GLAXOSMITHKLINE PLC	184,196	14.40	2,652,422.40	
SHIRE PLC	19,855	22.67	450,112.85	
BARCLAYS PLC	417,651	2.34	981,062.19	
HSBC HOLDINGS PLC	648,016	5.61	3,638,609.84	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,500,886	0.34	514,578.76	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	681,204	0.26	181,540.86	
STANDARD CHARTERED PLC	86,254	15.85	1,367,557.17	
3I GROUP PLC	39,379	1.92	75,883.33	
ICAP PLC	23,340	3.66	85,447.74	
INVESTEC PLC	13,185	3.89	51,289.65	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	4,068	9.42	38,320.56	
MAN GROUP PLC	68,256	1.32	90,302.68	
SCHRODERS PLC	4,981	15.68	78,102.08	
ADMIRAL GROUP PLC	6,965	9.68	67,421.20	
AVIVA PLC	98,450	3.61	355,995.20	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	198,871	1.19	237,253.10	
OLD MUTUAL PLC	190,765	1.57	300,645.64	
PRUDENTIAL PLC	93,757	7.18	673,175.26	
RESOLUTION LTD	51,593	2.69	138,785.17	

RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	123,607	1.11	137,698.19	
STANDARD LIFE PLC	87,275	2.28	199,685.20	
SAGE GROUP PLC/THE	43,845	2.99	131,403.46	
BT GROUP PLC	278,462	2.14	597,857.91	
INMARSAT PLC	16,910	4.61	78,107.29	
VODAFONE GROUP PLC	1,845,695	1.73	3,209,663.60	
CENTRICA PLC	188,610	2.92	550,741.20	
INTERNATIONAL POWER PLC	58,505	3.34	195,933.24	
NATIONAL GRID PLC	128,380	6.41	823,557.70	
SEVERN TRENT PLC	9,623	15.41	148,290.43	
SSE PLC	34,057	12.81	436,270.17	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,735	6.05	161,746.75	
ARM HOLDINGS PLC	50,630	5.82	294,919.75	
英ポンド小計	10,683,764		53,907,261.56 (6,640,835,551)	
スイスフラン				
TRANSOCEAN LTD	11,995	44.03	528,139.85	
GIVAUDAN-REG	328	883.50	289,788.00	
HOLCIM LIMITED-REG SHRS	8,463	55.75	471,812.25	
SIKA AG-BR	85	1,948.00	165,580.00	
SYNGENTA AG-REG	3,471	289.80	1,005,895.80	
ABB LTD-REG	79,020	19.70	1,556,694.00	
GEBERIT AG-REG	1,525	194.70	296,917.50	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	780	107.40	83,772.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,900	107.00	203,300.00	
SULZER AG-REG	870	119.00	103,530.00	
ADECCO SA-REG	4,757	45.87	218,203.59	
SGS SA-REG	201	1,712.00	344,112.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,020	122.50	247,450.00	
CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	18,579	53.35	991,189.65	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,065	401.20	427,278.00	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,520	69.80	106,096.00	
ARYZTA AG	2,630	43.65	114,799.50	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	25	2,738.00	68,450.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	5	31,800.00	159,000.00	
NESTLE SA-REG	119,823	54.25	6,500,397.75	
SONOVA HOLDING AG-REG	1,940	102.10	198,074.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	211	161.10	33,992.10	
SYNTHES INC	2,494	157.60	393,054.40	
ACTELION LTD-REG	4,640	33.37	154,836.80	
LONZA GROUP AG-REG	1,650	49.63	81,889.50	
NOVARTIS AG-REG	84,718	51.80	4,388,392.40	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	25,503	162.20	4,136,586.60	
CREDIT SUISSE GROUP-REG	42,085	23.52	989,839.20	
GAM HOLDING LTD	5,635	12.45	70,155.75	
JULIUS BAER GROUP LTD	8,140	37.50	305,250.00	
PARGESA HOLDING SA-BR	975	65.35	63,716.25	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	500	170.00	85,000.00	
UBS AG-REG	131,882	12.90	1,701,277.80	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,390	73.50	102,165.00	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	850	100.00	85,000.00	
SWISS RE LTD	12,679	53.10	673,254.90	
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	5,241	234.00	1,226,394.00	
SWISSCOM AG-REG	894	367.60	328,634.40	

スイスフラン小計	590,489		28,899,918.99 (2,465,452,089)	
香港ドル				
HUTCHISON WHAMPOA LTD	78,823	76.20	6,006,312.60	
NWS HOLDINGS LTD	48,500	12.64	613,040.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	37,000	15.72	581,640.00	
MTR CORP	54,500	26.50	1,444,250.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	6,000	50.25	301,500.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	24,500	25.10	614,950.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	45,000	17.96	808,200.00	
SANDS CHINA LTD	92,600	28.10	2,602,060.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	48,000	17.10	820,800.00	
SJM HOLDINGS LTD	57,000	14.44	823,080.00	
WYNN MACAU LTD	58,200	19.38	1,127,916.00	
LI & FUNG LTD	210,000	18.08	3,796,800.00	
LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	26,500	20.30	537,950.00	
BANK OF EAST ASIA	50,640	29.75	1,506,540.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	137,500	21.35	2,935,625.00	
HANG SENG BANK LTD	28,600	100.10	2,862,860.00	
WING HANG BANK LTD	7,500	71.65	537,375.00	
FIRST PACIFIC CO	80,000	8.45	676,000.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	38,200	141.50	5,405,300.00	
AIA GROUP LTD	311,800	26.70	8,325,060.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	51,682	109.10	5,638,506.20	
HANG LUNG GROUP LTD	33,000	50.40	1,663,200.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	90,000	28.10	2,529,000.00	
HENDERSON LAND DVLP CO LTD	37,426	45.40	1,699,140.40	
HOPEWELL HOLDINGS	29,000	20.85	604,650.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	22,000	31.85	700,700.00	
KERRY PROPERTIES LTD	27,950	33.90	947,505.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	131,000	9.65	1,264,150.00	
SINO LAND CO	105,050	13.10	1,376,155.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	51,480	113.80	5,858,424.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	24,017	86.00	2,065,462.00	
WHARF HOLDINGS LTD	57,800	46.85	2,707,930.00	
WHEELLOCK & CO LTD	34,000	25.85	878,900.00	
FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	76,000	5.67	430,920.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	15,000	43.80	657,000.00	
CLP HOLDINGS LTD	72,000	64.65	4,654,800.00	
HONG KONG & CHINA GAS	165,156	18.32	3,025,657.92	
POWER ASSETS HOLDINGS	52,500	55.35	2,905,875.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	105.30	684,450.00	
香港ドル小計	2,522,424		82,619,684.12 (836,937,400)	
シンガポールドル				
COSCO CORP SINGAPORE LTD	47,000	1.27	59,690.00	
FRASER AND NEAVE LTD	37,000	6.45	238,650.00	
KEPPEL CORP LTD	49,660	10.92	542,287.20	
NOBLE GROUP LTD	141,854	1.48	210,653.19	
SEMBICORP INDUSTRIES LTD	32,000	5.04	161,280.00	
SEMBICORP MARINE LTD	27,000	5.23	141,210.00	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	64,000	3.00	192,000.00	
YANGZIJIAN SHIPBUILDING	71,000	1.30	92,655.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	77,000	1.49	114,730.00	
NEPTUNE ORIENT LINES LTD	30,000	1.42	42,600.00	

SINGAPORE AIRLINES LTD	20,800	10.94	227,552.00	
GENTING SINGAPORE PLC	222,000	1.69	376,290.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	55,050	3.70	203,685.00	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,000	50.30	201,200.00	
OLAM INTERNATIONAL LTD	47,000	2.61	122,670.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	220,000	0.77	169,400.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	74,000	5.79	428,460.00	

[次へ](#)

DBS GROUP HOLDINGS LTD	65,625	13.68	897,750.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	96,240	8.78	844,987.20	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	45,300	17.61	797,733.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	28,000	7.23	202,440.00	
CAPITALAND LTD	101,000	2.90	292,900.00	
CAPITAMALLS ASIA LTD	50,000	1.49	74,750.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	20,000	10.77	215,400.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	60,000	1.98	118,800.00	
KEPPEL LAND LTD	30,000	3.02	90,600.00	
UOL GROUP LTD	12,250	4.74	58,065.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	276,810	3.10	858,111.00	
シンガポールドル小計	2,004,589		7,976,548.59 (495,503,198)	
ニュージーランドドル				
FLETCHER BUILDING LTD	23,390	6.71	156,946.90	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	43,390	2.49	108,258.05	
SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	19,990	3.64	72,763.60	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	72,897	2.17	158,550.97	
CONTACT ENERGY LIMITED	9,430	4.80	45,264.00	
ニュージーランドドル小計	169,097		541,783.52 (35,481,402)	
スウェーデンクローナ				
LUNDIN PETROLEUM AB	8,370	156.90	1,313,253.00	
BOLIDEN AB	7,620	116.80	890,016.00	
HOLMEN AB-B SHS	1,885	188.00	354,380.00	
SSAB AB-A SHARES	6,295	66.35	417,673.25	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	21,345	114.30	2,439,733.50	
ALFA LAVAL AB	12,110	131.10	1,587,621.00	
ASSA ABLOY AB-B	11,670	195.40	2,280,318.00	
ATLAS COPCO AB-A SHS	22,945	164.90	3,783,630.50	
ATLAS COPCO AB-B SHS	14,760	146.30	2,159,388.00	
SANDVIK AB	34,950	101.30	3,540,435.00	
SCANIA AB-B SHS	12,030	117.70	1,415,931.00	
SKANSKA AB-B SHS	14,750	119.00	1,755,250.00	
SKF AB-B SHS	12,949	164.30	2,127,520.70	
VOLVO AB-B SHARES	50,800	93.20	4,734,560.00	
SECURITAS AB-B SHS	12,199	58.80	717,301.20	
ELECTROLUX AB - B	8,875	139.20	1,235,400.00	
HUSQVARNA AB-B SHS	14,220	37.22	529,268.40	
MODERN TIMES GROUP-B SHS	1,325	322.90	427,842.50	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	36,598	232.80	8,520,014.40	
SWEDISH MATCH AB	8,145	243.50	1,983,307.50	
GETINGE AB-B SHS	7,610	191.00	1,453,510.00	
NORDEA BANK AB	96,108	60.95	5,857,782.60	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	53,625	48.03	2,575,608.75	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	18,130	212.70	3,856,251.00	
SWEDBANK AB - A SHARES	30,470	106.50	3,245,055.00	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,390	99.75	437,902.50	
INVESTOR AB-B SHS	17,415	142.10	2,474,671.50	
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	6,715	139.80	938,757.00	
RATOS AB-B SHS	7,000	88.00	616,000.00	
ERICSSON LM-B SHS	110,650	64.10	7,092,665.00	
HEXAGON AB-B SHS	8,970	130.40	1,169,688.00	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2,970	718.50	2,133,945.00	

TELE2 AB-B SHS	12,235	126.70	1,550,174.50	
TELIASONERA AB	80,590	46.46	3,744,211.40	
スウェーデンクローナ小計	770,719		79,359,066.20 (932,469,027)	
ノルウェークローネ				
AKER SOLUTIONS ASA	6,800	80.90	550,120.00	
SEADRILL LTD	11,325	224.30	2,540,197.50	
STATOIL ASA	41,084	155.80	6,400,887.20	
SUBSEA 7 SA	10,615	125.00	1,326,875.00	
NORSK HYDRO A S	34,250	30.53	1,045,652.50	
YARA INTERNATIONAL ASA	6,300	255.70	1,610,910.00	
ORKLA ASA	28,690	45.15	1,295,353.50	
DNB ASA	36,510	67.90	2,479,029.00	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,250	64.90	470,525.00	
TELENOR ASA	27,340	97.65	2,669,751.00	
ノルウェークローネ小計	210,164		20,389,300.70 (278,925,633)	
デンマーククローネ				
NOVOZYMES A/S-B SHARES	8,275	162.70	1,346,342.50	
VESTAS WIND SYSTEMS AS	7,500	51.95	389,625.00	
A P MOLLER - MAERSK A/S - A	23	43,800.00	1,007,400.00	
A P MOLLER - MAERSK A/S - B	43	45,600.00	1,960,800.00	
DSV A/S	7,370	123.30	908,721.00	
CARLSBERG AS-B	3,930	432.00	1,697,760.00	
COLOPLAST-B	881	884.50	779,244.50	
WILLIAM DEMANT HOLDING	1,000	500.00	500,000.00	
NOVO NORDISK A/S-B	15,345	766.00	11,754,270.00	
DANSKE BANK A/S	23,595	90.75	2,141,246.25	
TRYG A/S	1,045	298.30	311,723.50	
TDC A/S	14,545	43.28	629,507.60	
デンマーククローネ小計	83,552		23,426,640.35 (324,693,235)	
イスラエルシュケル				
ISRAEL CHEMICALS LTD	18,570	39.50	733,515.00	
ISRAEL CORP LIMITED/THE	108	2,331.00	251,748.00	
TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	34,310	163.80	5,619,978.00	
BANK HAPOLIM BM	45,645	13.10	597,949.50	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	56,605	12.11	685,486.55	
NICE SYSTEMS LTD	2,860	136.30	389,818.00	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	81,755	6.32	517,100.37	
イスラエルシュケル小計	239,853		8,795,595.42 (184,707,503)	
ユーロ				
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	4,720	21.54	101,692.40	
ENI SPA	86,786	17.38	1,508,340.68	
FUGRO NV-CVA	2,640	52.43	138,415.20	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	9,315	13.06	121,653.90	
NESTE OIL OYJ	3,590	9.65	34,643.50	
OMV AG	6,300	26.74	168,493.50	
REPSOL YPF SA	29,891	20.94	625,917.54	
SAIPEM SPA	8,980	37.55	337,199.00	
SBM OFFSHORE NV	6,700	13.56	90,852.00	
TECHNIP SA	3,748	75.80	284,098.40	
TENARIS SA	17,925	15.14	271,384.50	
TOTAL SA	77,052	41.10	3,166,837.20	

ACERINOX SA	4,717	10.76	50,754.92	
AIR LIQUIDE	10,197	98.12	1,000,529.64	
AKZO NOBEL NV	8,668	40.29	349,233.72	
ARCELORMITTAL	30,061	16.72	502,619.92	
ARKEMA	2,005	65.82	131,969.10	
BASF SE	33,340	61.23	2,041,408.20	
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	5,550	5.10	28,305.00	
CRH PLC	27,255	15.15	412,913.25	
HEIDELBERGCEMENT AG	5,055	37.37	188,905.35	
IMERYS SA	1,520	42.40	64,448.00	
K+S AG	6,500	39.47	256,587.50	
KONINKLIJKE DSM NV	5,682	41.04	233,217.69	
LAFARGE SA	7,458	31.58	235,560.93	
LANXESS AG	2,765	55.78	154,231.70	
LINDE AG	6,345	123.20	781,704.00	
SALZGITTER AG	1,685	44.29	74,637.07	
SOLVAY ET CIE SA -A	2,181	78.81	171,884.61	
STORA ENSO OYJ-R SHS	20,375	5.44	110,840.00	
THYSSENKRUPP AG	13,275	21.07	279,704.25	
UMICORE	3,460	36.88	127,604.80	
UPM-KYMMENE OYJ	18,648	9.91	184,894.92	
VOESTALPINE AG	4,239	25.63	108,666.76	
WACKER CHEMIE AG	580	78.89	45,756.20	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	5,146	23.40	120,416.40	
ALSTOM	7,390	29.51	218,078.90	
BEKAERT NV	1,540	27.98	43,089.20	
BOSKALIS WESTMINSTER	2,855	28.15	80,382.52	
BOUYGUES SA	6,820	24.52	167,226.40	
BRENTAG AG	1,125	85.37	96,041.25	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	14,831	35.19	521,902.89	
EADS NV	14,968	26.99	403,986.32	
EIFFAGE	1,355	25.18	34,118.90	
FERROVIAL SA	13,715	9.44	129,551.89	
FIAT INDUSTRIAL	28,270	7.67	216,830.90	
FINMECCANICA SPA	14,290	3.41	48,728.90	
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	2,535	18.47	46,821.45	
GEA GROUP AG	6,740	25.06	168,904.40	
HOCHTIEF AG	1,655	51.70	85,563.50	
KONE OYJ-B	5,907	43.62	257,663.34	
KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRON	35,731	15.44	551,865.29	
LEGRAND SA	7,405	25.58	189,419.90	
MAN SE	2,414	82.92	200,168.88	
METSO OYJ	4,900	33.62	164,738.00	
PRYSMIAN SPA	5,635	12.33	69,479.55	
SAFRAN SA	6,190	24.21	149,859.90	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	18,033	47.49	856,477.33	
SIEMENS AG-REG	29,866	74.00	2,210,084.00	
THALES SA	3,505	26.95	94,459.75	
VALLOUREC	4,265	54.40	232,016.00	
VINCI SA	16,635	38.04	632,795.40	
WARTSILA OYJ	6,100	26.00	158,600.00	
WENDEL	1,190	60.30	71,757.00	
ZARDOYA OTIS SA	5,219	10.52	54,903.88	
BUREAU VERITAS SA	1,770	58.77	104,022.90	

EDENRED	6,096	18.87	115,031.52	
RANDSTAD HOLDING NV	4,405	27.50	121,159.52	
SOCIETE BIC SA	1,265	71.63	90,611.95	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	14,551	13.04	189,745.04	
ADP	1,210	56.59	68,473.90	
ATLANTIA SPA	11,496	12.46	143,240.16	
DEUTCHE LUFTHANSA	7,870	10.52	82,831.75	
DEUTSCHE POST AG	31,433	13.02	409,257.66	
FRAPORT AG	1,740	44.81	77,969.40	
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	17,530	6.40	112,192.00	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	31,722	2.06	65,537.65	
RYANAIR HOLDINGS PLC	8,345	4.20	35,099.07	
TNT EXPRESS NV	13,270	6.11	81,106.24	
VOPAK	2,440	41.35	100,906.20	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	11,825	70.02	827,986.50	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,090	45.51	95,126.35	
CONTINENTAL AG	2,915	65.78	191,748.70	
DAIMLER AG	32,647	46.96	1,533,103.12	
FIAT SPA	26,775	4.61	123,646.95	
MICHELIN (CGDE)-B	6,179	53.44	330,205.76	
NOKIAN RENKAAT OYJ	4,245	33.80	143,481.00	
PEUGEOT SA	5,872	15.11	88,755.28	
PIRELLI & C.	9,236	7.62	70,424.50	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,740	46.86	269,005.10	
RENAULT SA	6,797	35.50	241,293.50	
VOLKSWAGEN AG	1,151	127.65	146,925.15	
VOLKSWAGEN AG-PFD	5,133	141.05	724,009.65	
ADIDAS AG	7,721	57.77	446,042.17	
CHRISTIAN DIOR	2,000	112.95	225,900.00	
LUXOTTICA GROUP SPA	3,976	25.58	101,706.08	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	9,174	125.05	1,147,208.70	
ACCOR SA	5,606	25.31	141,915.89	
AUTOGRILL SPA	3,115	8.08	25,169.20	
OPAP SA	8,450	7.06	59,657.00	
SODEXO	3,470	57.50	199,525.00	
AXEL SPRINGER AG	1,665	36.20	60,273.00	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	28.73	109,030.35	
JC DECAUX SA .	2,520	19.87	50,085.00	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	3,080	39.57	121,875.60	
LAGARDERE S.C.A.	5,040	21.24	107,049.60	
MEDIASET SPA	25,926	2.42	62,740.92	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	2,855	18.64	53,217.20	
PUBLICIS GROUPE	4,725	40.75	192,567.37	
REED ELSEVIER NV	25,748	9.05	233,019.40	
SANOMA OYJ	3,275	10.15	33,241.25	
SES	11,190	18.22	203,937.75	
TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	3,840	8.77	33,676.80	
WOLTERS KLUWER	11,107	13.67	151,888.22	
INDITEX	8,045	68.12	548,025.40	
PPR	2,667	123.30	328,841.10	
CARREFOUR SA	21,653	17.36	375,896.08	
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,004	72.07	144,428.28	
COLRUYT SA	2,725	29.23	79,665.37	
DELHAIZE GROUP	3,666	42.26	154,925.16	

DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	22,688	3.68	83,491.84	
JERONIMO MARTINS	7,685	13.10	100,673.50	
KESKO OYJ-B SHS	2,230	24.53	54,701.90	
KONINKLIJKE AHOLD NV	40,664	10.67	433,884.88	
METRO AG	4,940	28.42	140,394.80	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	28,916	49.25	1,424,113.00	
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	6,798	14.50	98,571.00	
DANONE	21,069	48.99	1,032,275.65	
HEINEKEN HOLDING NV	4,275	30.79	131,648.62	
HEINEKEN NV	9,673	36.55	353,596.51	
KERRY GROUP PLC-A	5,390	29.36	158,250.40	
PERNOD-RICARD SA	7,036	76.65	539,309.40	
SUEDZUCKER AG	2,400	22.58	54,192.00	
UNILEVER NV-CVA	58,720	25.64	1,505,580.80	
BEIERSDORF AG	3,745	47.46	177,737.70	
HENKEL AG & CO KGAA	5,110	40.20	205,422.00	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	5,873	47.55	279,290.51	
L'OREAL	8,836	84.73	748,674.28	
CELESIO AG	3,620	14.22	51,476.40	
ESSILOR INTERNATIONAL	7,395	57.90	428,170.50	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	7,383	55.31	408,353.73	
FRESENIUS SE & CO KGAA	3,985	78.51	312,862.35	
BAYER AG	29,900	55.00	1,644,500.00	
ELAN CORP PLC	18,000	9.95	179,100.00	
GRIFOLS SA	5,290	15.10	79,879.00	
MERCK KGAA	2,405	81.55	196,127.75	
ORION OYJ-CLASS B	2,590	16.02	41,491.80	
QIAGEN N.V.	7,635	11.55	88,184.25	
SANOFI	41,601	56.55	2,352,536.55	
UCB SA	3,708	31.24	115,837.92	
BANCA CARIGE SPA	28,825	1.43	41,248.57	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	153,605	0.30	46,742.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	165,663	7.12	1,180,183.21	
BANCO DE SABADELL SA	41,782	2.78	116,153.96	
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	21,145	1.54	32,563.30	
BANCO POPOLARE SCARL	62,764	1.39	87,430.25	
BANCO POPULAR ESPANOL	36,697	3.50	128,622.98	
BANCO SANTANDER SA	306,327	6.42	1,967,231.99	
BANKIA SAU	27,425	3.45	94,616.25	
BANKINTER SA	9,305	5.14	47,902.14	
BNP PARIBAS	34,872	33.51	1,168,735.08	
CAIXABANK	26,440	4.00	105,892.20	
COMMERZBANK AG	134,443	2.07	278,565.89	
CREDIT AGRICOLE SA	37,252	4.87	181,715.25	
ERSTE GROUP BANK AG	7,118	18.33	130,508.53	
INTESA SANPAOLO	377,913	1.48	560,444.97	
INTESA SANPAOLO-RSP	31,990	1.27	40,755.26	
KBC GROEP NV	6,119	17.04	104,298.35	
NATIONAL BANK OF GREECE	22,263	2.84	63,226.92	
NATIXIS	32,490	2.28	74,272.14	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	1,470	26.49	38,947.65	
SOCIETE GENERALE	23,749	21.90	520,103.10	
UBI BANCA SCPA	28,684	3.70	106,302.90	
UNICREDIT SPA	150,673	4.07	613,540.45	

DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	33,440	32.99	1,103,352.80	
DEUTSCHE BOERSE AG	7,280	49.94	363,563.20	
EURAZEO	1,442	33.74	48,660.29	
EXOR SPA	1,714	18.55	31,794.70	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,912	54.80	159,577.60	
ING GROEP NV-CVA	136,975	6.56	899,240.87	
MEDIOBANCA SPA	19,150	4.71	90,196.50	
POHJOLA BANK PLC	3,875	8.50	32,956.87	
AEGON NV	56,759	3.75	213,016.52	
AGEAS	84,144	1.67	140,520.48	
ALLIANZ SE-REG	16,418	87.49	1,436,410.82	
ASSICURAZIONI GENERALI	43,088	12.14	523,088.32	
AXA	64,167	12.17	780,912.39	
CNP ASSURANCES	6,070	10.71	65,040.05	
DELTA LLOYD NV	3,600	14.32	51,552.00	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNGS	2,455	42.03	103,195.92	
MAPFRE SA	26,034	2.58	67,167.72	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,536	107.00	699,352.00	
SAMPO OYJ-A SHS	15,819	20.57	325,396.83	
SCOR SE	6,822	19.42	132,483.24	
VIENNA INSURANCE GROUP	1,410	34.86	49,152.60	
IMMOEAST AG-TEMPORARY	16,150	—	—	
IMMOFINANZ AG	25,580	2.66	68,068.38	
IMMOFINANZ AG-TEMPORARY	13,000	—	—	
AMADEUS IT HOLDING SA	10,060	14.37	144,562.20	
ATOS	1,650	41.45	68,400.75	
CAP GEMINI SA	5,469	28.74	157,179.06	
DASSAULT SYSTEMES SA	2,315	62.00	143,530.00	
INDRA SISTEMAS SA	4,269	10.50	44,824.50	
SAP AG-COMMON	33,242	48.42	1,609,743.85	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,720	14.81	69,926.80	
ALCATEL-LUCENT	91,534	1.74	159,909.89	
NEOPOST SA	867	52.88	45,846.96	
NOKIA OYJ	137,696	3.84	529,303.42	
BELGACOM SA	5,820	23.49	136,740.90	
DEUTSCHE TELEKOM AG	101,686	8.94	909,276.21	
ELISA OYJ	4,205	16.85	70,854.25	
FRANCE TELECOM SA	66,774	11.33	756,883.29	
ILIAD SA	815	96.31	78,492.65	
KONINKLIJKE KPN NV	54,906	7.89	433,702.49	
MOBISTAR SA	1,279	36.43	46,600.36	
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	27,363	4.30	117,825.07	
TELECOM ITALIA SPA	354,593	0.80	284,028.99	
TELECOM ITALIA-RSP	234,007	0.67	157,369.70	
TELEFONICA SA	148,843	13.09	1,948,354.87	
TELEKOM AUSTRIA AG	14,020	8.73	122,394.60	
VIVENDI	44,362	16.31	723,544.22	
A2A SPA	29,880	0.79	23,694.84	
ACCIONA SA	976	62.58	61,078.08	
E.ON AG	64,994	16.36	1,063,626.81	
EDP RENOVAVEIS SA	8,115	4.40	35,730.34	
ELECTRICITE DE FRANCE	8,795	18.61	163,674.95	
ENAGAS	7,050	15.21	107,230.50	
ENEL GREEN POWER SPA	64,340	1.51	97,603.78	

ENEL SPA	241,704	3.30	799,556.83	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	71,841	2.27	163,150.91	
FORTUM OYJ	16,355	17.91	292,918.05	
GAS NATURAL SDG SA	11,902	13.10	155,916.20	
GDF SUEZ	45,409	19.40	880,934.60	
IBERDROLA SA	140,427	4.68	658,181.34	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,050	36.89	149,404.50	
RWE AG	17,965	32.85	590,150.25	
RWE AG-NON VTG PFD	1,060	30.70	32,547.30	
SNAM SPA	58,840	3.58	210,882.56	
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	10,319	10.09	104,170.30	
TERNA SPA	43,127	2.81	121,531.88	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	13,334	9.31	124,246.21	
VERBUND AG	2,370	22.00	52,140.00	
ASML HOLDING NV	15,977	34.54	551,845.58	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	37,545	7.10	266,682.13	
STMICROELECTRONICS NV	23,623	5.12	121,138.74	
ユーロ小計	6,254,131		78,758,605.99 (8,114,499,175)	
合 計	38,322,627		61,694,502,392 (61,694,502,392)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	AMERICAN TOWER CORP	14,624	941,493.12	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	34,640	571,213.60	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,475	461,306.25	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,397	556,592.61	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,735	260,068.05	
		DUKE REALTY CORPORATION	6,875	94,531.25	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	10,300	595,031.00	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	2,475	239,926.50	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	17,145	283,235.40	
		HCP INC	14,985	614,235.15	
		HEALTH CARE REIT INC	6,530	369,859.20	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	26,659	435,341.47	
		KIMCO REALTY CORPORATION	15,255	282,827.70	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	103,756.29	
		PLUM CREEK TIMBER CO	6,458	254,897.26	
		PROLOGIS INC	17,042	569,032.38	
		PUBLIC STORAGE	5,389	746,484.28	
		RAYONIER INC	5,057	228,121.27	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	2,805	119,240.55	
		SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	10,609	1,440,490.02	
		THE MACERICH COMPANY	4,370	239,738.20	
		VENTAS INC	10,295	597,727.70	
		VORNADO REALTY TRUST	5,821	487,450.54	
		WEYERHAEUSER CO	20,336	406,313.28	
		投資証券小計		253,390	10,898,913.07 (855,891,643)
米ドル合計				10,898,913.07 (855,891,643)	
加ドル	投資証券	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,250	139,020.00	
	投資証券小計		5,250	139,020.00 (10,920,021)	
加ドル合計				139,020.00 (10,920,021)	
豪ドル	投資証券	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	67,010	113,581.95	
		DEXUS PROPERTY GROUP	163,705	143,241.87	
		GOODMAN GROUP	273,860	175,270.40	
		GPT GROUP	63,695	192,358.90	
		LEND LEASE GROUP	21,287	152,840.66	
		MIRVAC GROUP	108,455	129,603.72	
		STOCKLAND	86,100	273,798.00	
		WESTFIELD GROUP	80,385	672,822.45	
		WESTFIELD RETAIL TRUST	107,475	252,566.25	
		投資証券小計		971,972	2,106,084.20 (176,679,403)
豪ドル合計				2,106,084.20 (176,679,403)	
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	32,561	159,516.33	
		CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	24,090	81,183.30	
		HAMMERSON PLC	30,035	118,187.72	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	28,889	198,178.54	
		SEGRO PLC	20,223	46,897.13	
		投資証券小計		135,798	603,963.02 (74,402,204)

英ポンド合計				603,963.02 (74,402,204)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	74,500	2,197,750.00	
	投資証券小計		74,500	2,197,750.00 (22,263,207)	
香港ドル合計				2,197,750.00 (22,263,207)	
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	62,000	121,830.00	
		CAPITAMALL TRUST	71,800	125,650.00	
	投資証券小計		133,800	247,480.00 (15,373,457)	
シンガポールドル合計				247,480.00 (15,373,457)	
ユーロ	投資証券	CORIO NV	1,970	72,752.10	
		FONCIERE DES REGIONS	1,005	56,089.05	
		GECINA SA	740	55,056.00	
		ICADE	685	42,154.90	
		KLEPIERRE	3,895	91,590.92	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	3,380	486,382.00	
	投資証券小計		11,675	804,024.97 (82,838,692)	
ユーロ合計				804,024.97 (82,838,692)	
合計				1,238,368,627 (1,238,368,627)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 562銘柄	97.6%	—	56.6%
	投資証券 24銘柄	—	2.4%	1.4%
加ドル	株式 100銘柄	99.7%	—	5.5%
	投資証券 1銘柄	—	0.3%	0.0%
豪ドル	株式 57銘柄	93.0%	—	3.7%
	投資証券 9銘柄	—	7.0%	0.3%
英ポンド	株式 99銘柄	98.9%	—	10.6%
	投資証券 5銘柄	—	1.1%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%	—	3.9%
香港ドル	株式 39銘柄	97.4%	—	1.3%
	投資証券 1銘柄	—	2.6%	0.0%
シンガポールドル	株式 28銘柄	97.0%	—	0.8%
	投資証券 2銘柄	—	3.0%	0.0%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.0%	—	0.1%
スウェーデンクローナ	株式 34銘柄	100.0%	—	1.5%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%	—	0.4%
デンマーククローネ	株式 12銘柄	100.0%	—	0.5%
イスラエルシェケル	株式 7銘柄	100.0%	—	0.3%
ユーロ	株式 245銘柄	99.0%	—	12.9%
	投資証券 6銘柄	—	1.0%	0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

3. 「海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド」の状況
 なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

科目	対象年月日	平成23年 8月15日現在	平成24年 2月15日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		31,687,700	55,538,757
コール・ローン		94,251,176	68,277,570
株式		5,784,967,534	6,816,411,916
投資証券		2,344,368	2,565,076
派生商品評価勘定		—	6,459,485
未収入金		99,529	2,992
未収配当金		23,722,215	10,508,631
未収利息		145	125
差入委託証拠金		41,337,456	23,841,080
流動資産合計		5,978,410,123	6,983,605,632
資産合計		5,978,410,123	6,983,605,632
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		13,842,291	561,903
未払解約金		7,455,395	6,907,000
流動負債合計		21,297,686	7,468,903
負債合計		21,297,686	7,468,903
純資産の部			
元本等			
元本		5,972,989,196	6,465,102,913
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		△15,876,759	511,033,816
元本等合計		5,957,112,437	6,976,136,729
純資産合計		5,957,112,437	6,976,136,729
負債純資産合計		5,978,410,123	6,983,605,632

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。
--------------------	---

2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (1) デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 (2) 為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。 外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。
--	---

（追加情報）

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

（貸借対照表に関する注記）

平成23年 8月15日現在		平成24年 2月15日現在	
1. 期首	平成23年 2月16日	1. 期首	平成23年 8月16日
期首元本額	6,034,748,244円	期首元本額	5,972,989,196円
期首からの追加設定元本額	513,979,844円	期首からの追加設定元本額	866,276,146円
期首からの一部解約元本額	575,738,892円	期首からの一部解約元本額	374,162,429円
平成23年 8月15日現在の元本の内訳 ※		平成24年 2月15日現在の元本の内訳 ※	
日興五大陸株式ファンド	4,269,844,910円	日興五大陸株式ファンド	4,256,270,690円
全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	42,467,161円	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	46,429,926円
年金積立 インデックスファンド海外新興国（エマージング）株式	1,639,891,189円	年金積立 インデックスファンド海外新興国（エマージング）株式	2,140,717,679円
日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産）	20,785,936円	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産）	21,684,618円
計	5,972,989,196円	計	6,465,102,913円
2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	5,972,989,196口	2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	6,465,102,913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15,876,759円であります。			

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

	自 平成23年 2月16日 至 平成23年 8月15日	自 平成23年 8月16日 至 平成24年 2月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左
----------------	--	----

II 金融商品の時価等に関する事項

	平成23年 8月15日現在	平成24年 2月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
 （平成23年8月15日現在）
 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	△860,453,017
投資証券	△895,256
合計	△861,348,273

（平成24年2月15日現在）
 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	△240,326,778
投資証券	△756,004
合計	△241,082,782

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

（デリバティブ取引等に関する注記）
 取引の時価等に関する事項
 （株式関連）
 （平成23年8月15日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等		時 価	評価損益
			うち1年超		

市場取引	株価指数先物取引				
	買建	137,879,074	—	124,036,783	△13,842,291
合計		137,879,074	—	124,036,783	△13,842,291

（平成24年2月15日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	67,898,608	—	74,331,000	6,432,392
合計		67,898,608	—	74,331,000	6,432,392

（注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

[次へ](#)

(通貨関連)

(平成23年8月15日現在)

該当事項はありません。

(平成24年2月15日現在)

(単位：円)

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	売建	43,288,090	—	43,822,900	△534,810
	米ドル	31,008,000	—	31,408,000	△400,000
	香港ドル	3,298,680	—	3,342,900	△44,220
	メキシコペソ	4,259,290	—	4,284,000	△24,710
	台湾ドル	4,722,120	—	4,788,000	△65,880
合計		43,288,090	—	43,822,900	△534,810

(注)1.時価の算定方法

(1) 本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

① 同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

② 同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

- ・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成23年 8月15日現在		平成24年 2月15日現在	
1口当たり純資産額	0.9973円	1口当たり純資産額	1.0790円
(1万口当たり純資産額)	(9,973円)	(1万口当たり純資産額)	(10,790円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
米ドル				
ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	3,550	53.53	190,031.50	
GAZPROM OAO	3,000	6.40	19,200.00	
GAZPROM OAO-SPON ADR	122,200	12.72	1,554,384.00	
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	13,200	5.28	69,814.80	
LUKOIL OAO-SPON ADR	11,485	61.90	710,921.50	
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	1,976	137.70	272,095.20	
PETROLEO BRASILEIRO-SPON ADR	450	27.03	12,163.50	
ROSNEFT OJSC-REG S GDR	41,540	7.15	297,218.70	
SURGUTNEFTGAS-SP ADR	26,000	9.51	247,260.00	
TATNEFT-GDR	5,449	35.34	192,567.66	
TMK-GDR REG S	1,860	12.34	22,952.40	
BRASKEM SA-SPON ADR	1,780	17.49	31,132.20	
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	4,650	39.89	185,488.50	
CIA SIDERURGICA NACL-SP ADR	10,170	10.43	106,073.10	
FIBRIA CELULO SA-ADR	3,094	9.28	28,712.32	
GERDAU SA -SPON ADR	3,600	10.19	36,684.00	
MECHEL-SPONSORED ADR	1,380	10.90	15,042.00	
MMC NORILSK NICKEL JSC-ADR	12,494	19.25	240,509.50	
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	2,110	24.75	52,222.50	
QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	1,600	58.22	93,152.00	
SEVERSTAL - GDR REG S	6,470	14.83	95,950.10	
SOUTHERN COPPER CORP(US)	4,235	32.19	136,324.65	
SOUTHERN COPPER CORP(US)(N)	45	32.19	1,448.55	
URALKALI-SPON GDR-REG S	6,220	38.20	237,604.00	
VALE SA-SP ADR	4,800	25.76	123,648.00	
ORASCOM CONSTRUCTION-GDR	2,200	42.75	94,050.00	
LAN AIRLINES SA-SPON ADR	3,880	26.70	103,596.00	
GRUPO TELEvisa SA-SPONS ADR	1,800	20.22	36,396.00	
CIA BRASILEIRA-SP ADR PREF	2,380	43.56	103,672.80	
MAGNIT OJSC-SPON GDR REGS	7,000	27.78	194,460.00	
BRF - BRASIL FOODS SA-ADR	6,180	19.55	120,819.00	
FOMENTO ECONOMICO MEX-SP ADR	1,200	73.47	88,164.00	
BANCO BRADESCO-ADR	5,360	18.23	97,712.80	
BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	860	78.27	67,312.20	
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	3,350	63.32	212,122.00	
CREDICORP LTD	1,760	119.10	209,616.00	
ITAU UNIBANCO HLDNG-PREF ADR	2,775	21.49	59,634.75	
SBERBANK-SPONSORED ADR	56,500	12.92	729,980.00	
STATE BANK OF INDIA-SPON GDR	930	86.70	80,631.00	
VTB BANK OJSC-GDR-REG S	30,030	4.73	142,131.99	
EGYPTIAN KUWAITI HOLDING CO	19,965	1.17	23,359.05	
LSR GROUP OJSC-GDR REGS	7,000	5.40	37,800.00	
AMERICA MOVIL-ADR SERIES L	2,000	23.44	46,880.00	
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	15,712	17.26	271,189.12	
ROSTELECOM-SPONSORED-ADR	5,330	30.00	159,900.00	
SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR	2,515	19.30	48,539.50	
TELE NORTE LESTE PART-ADR	850	9.71	8,253.50	
TELEF BRASIL-ADR	3,924	28.08	110,185.92	
TIM PARTICIPACOES SA-ADR	1,840	27.92	51,372.80	

CEMIG SA -SPONS ADR	2,384	22.05	52,567.20	
CIA PARANAENSE ENER-SP ADR P	3,675	23.66	86,950.50	
FEDERAL GRID CO UNIFIED-CLS	4,000,000	0.01	44,000.00	
FEDERAL HYDROGENERATING CO-ADR	35,000	3.75	131,495.00	
SABESP-ADR	1,030	73.40	75,602.00	
米ドル小計	4,520,788		8,460,993.81 (664,441,843)	
香港ドル				
CHINA COAL ENERGY CO - H	115,000	9.95	1,144,250.00	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	44,000	13.60	598,400.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	407,000	9.14	3,719,980.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	81,000	35.15	2,847,150.00	
CNOOC LTD	432,000	17.38	7,508,160.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	80,000	12.44	995,200.00	
PETROCHINA CO LTD-H	511,000	11.58	5,917,380.00	
YANZHOU COAL MINING CO-H	50,000	19.10	955,000.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	63,000	4.09	257,670.00	
ANGANG STEEL CO LTD-H	24,000	6.02	144,480.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	33,000	26.15	862,950.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	74,000	9.84	728,160.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	64,000	6.32	404,480.00	
CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP	70,000	6.60	462,000.00	
HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	45,000	5.74	258,300.00	
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	31,000	20.90	647,900.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	42,000	6.18	259,560.00	
SINOERT HOLDINGS LTD	40,000	2.32	92,800.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	43,000	3.05	131,150.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	40,000	15.40	616,000.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	147,750	3.52	520,080.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	12,000	47.60	571,200.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	114,000	7.14	813,960.00	
CHINA INTL MARINE CONTAINER-B	26,876	9.89	265,803.64	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	46,000	5.60	257,600.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	100,000	3.04	304,000.00	
CHINA RONGSHENG HEAVY INDUST	63,000	2.75	173,250.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	52,000	6.46	335,920.00	
CITIC PACIFIC LTD	29,000	15.54	450,660.00	
CSR CORP LTD	41,000	5.38	220,580.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-H	12,000	21.65	259,800.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	110,000	2.10	231,000.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	70,000	3.78	264,600.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	13,000	26.35	342,550.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	8,000	41.25	330,000.00	
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	9,000	18.22	163,980.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TE-H	32,500	11.02	358,150.00	
AIR CHINA LTD-H	58,000	6.45	374,100.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	60,000	3.79	227,400.00	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	65,825	5.27	346,897.75	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	35,000	28.60	1,001,000.00	
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	100,750	2.44	245,830.00	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	36,000	5.86	210,960.00	
COSCO PACIFIC LTD	30,000	12.10	363,000.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	62,000	7.83	485,460.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	43,000	5.52	237,360.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	64,000	9.24	591,360.00	

BYD CO LTD-H	10,000	25.00	250,000.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	50,000	15.50	775,000.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	100,000	2.90	290,000.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	35,000	13.94	487,900.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	76,318	8.16	622,754.88	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	50,000	8.14	407,000.00	
CHINA DONGXIANG GROUP CO	90,000	1.40	126,000.00	
DAPHNE INTERNATIONAL HOLDING	44,000	9.33	410,520.00	
SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	50,000	3.81	190,500.00	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	108,000	13.08	1,412,640.00	
DAH CHONG HONG	40,000	10.18	407,200.00	
GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP	23,000	17.94	412,620.00	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	191,160	2.06	393,789.60	
INTIME DEPARTMENT STORE	32,000	9.04	289,280.00	
PARKSON RETAIL GROUP LTD	44,000	9.79	430,760.00	
CHINA RESOURCES ENTERPRISES	37,000	27.85	1,030,450.00	
SUN ART RETAIL GROUP	43,000	9.72	417,960.00	
WUMART STORES INC-H	24,000	16.18	388,320.00	
CHAODA MODERN AGRICULTURE	54,756	1.10	60,231.60	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	48,000	6.36	305,280.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	35,000	21.85	764,750.00	
CHINA YURUN FOOD GROUP LTD	31,000	10.94	339,140.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	36,000	22.55	811,800.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	6,000	40.40	242,400.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	130,000	7.06	917,800.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	20,000	70.65	1,413,000.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	32,000	7.21	230,720.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	16,400	21.05	345,220.00	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	75,000	3.04	228,000.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	485,000	3.72	1,804,200.00	
BANK OF CHINA LTD - H	1,665,000	3.28	5,461,200.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	168,245	6.07	1,021,247.15	
CHINA CITIC BANK - H	150,000	4.82	723,000.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,442,920	6.31	9,104,825.20	
CHINA MERCHANTS BANK - H	98,150	17.22	1,690,143.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	84,000	7.34	616,560.00	
IND & COMM BK OF CHINA - H	1,390,575	5.37	7,467,387.75	
CHINA EVERBRIGHT LTD	18,000	13.70	246,600.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	169,000	22.30	3,768,700.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	32,600	26.15	852,490.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	14,000	15.64	218,960.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	54,000	11.14	601,560.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	40,000	65.40	2,616,000.00	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	42,000	9.21	386,820.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	86,320	15.10	1,303,432.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	44,000	14.56	640,640.00	
CHINA VANKE CO LTD -B	23,360	8.90	207,904.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	90,000	3.43	308,700.00	
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	146,000	4.32	630,720.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	26,400	8.65	228,360.00	
LONGFOR PROPERTIES	15,000	11.16	167,400.00	
POLY HONG KONG INVESTMENTS	34,000	4.20	142,800.00	
RENHE COMMERCIAL HOLDINGS	250,000	0.91	227,500.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	37,500	9.08	340,500.00	

SHUI ON LAND LTD	42,900	2.79	119,691.00	
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	65,000	4.26	276,900.00	
SOHO CHINA LTD	65,000	5.20	338,000.00	
ALIBABA.COM LTD	24,500	9.25	226,625.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	24,400	186.20	4,543,280.00	
KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	14,000	28.70	401,800.00	
LENOVO GROUP LTD	204,000	6.60	1,346,400.00	
ZTE CORP-H	9,621	21.70	208,775.70	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	60,000	3.92	235,200.00	
CHINA MOBILE LTD	139,200	79.80	11,108,160.00	
CHINA TELECOM CORP LTD	304,000	4.33	1,316,320.00	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	123,882	14.28	1,769,034.96	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	48,000	6.36	305,280.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	47,000	14.94	702,180.00	
DATANG INTL POWER GEN CO-H	23,000	2.70	62,100.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	24,000	25.55	613,200.00	
GUANGDONG INVEST	62,000	4.71	292,020.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	106,000	5.04	534,240.00	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	198,000	2.85	564,300.00	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	580,000	0.43	249,400.00	
香港ドル小計	14,031,908		118,889,063.23 (1,204,346,210)	
マレーシアリングット				
PETRONAS DAGANGAN BHD	10,000	18.78	187,800.00	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	42,000	6.98	293,160.00	
GAMUDA BHD	56,000	3.79	212,240.00	
IJM CORP BHD	35,000	5.95	208,250.00	
SIME DARBY BERHAD	64,720	9.64	623,900.80	
AIRASIA BHD	47,000	3.68	172,960.00	
MISC BHD	31,000	5.91	183,210.00	
BERJAYA SPORTS TOTO BERHAD	26,250	4.45	116,812.50	
GENTING BHD	45,300	10.54	477,462.00	
GENTING MALAYSIA BHD	90,500	3.94	356,570.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	2,500	51.78	129,450.00	
IOI CORPORATION BERHAD	91,675	5.49	503,295.75	
KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	16,000	25.46	407,360.00	
PPB GROUP BERHAD	11,700	17.70	207,090.00	
BUMIPUTRA-COMMERCE HLDGS BHD	100,800	7.31	736,848.00	
HONG LEONG BANK BERHAD	31,800	11.70	372,060.00	
MALAYAN BANKING BHD	72,150	8.52	614,718.00	
PUBLIC BANK BHD-FOREIGN MKT	32,700	13.94	455,838.00	
RHB CAPITAL BHD	25,000	7.28	182,000.00	
AMMB HOLDINGS BHD	52,600	6.12	321,912.00	
SP SETIA BHD	15,975	3.92	62,622.00	
AXIATA GROUP BERHAD	61,900	5.00	309,500.00	
DIGI.COM BHD	107,000	4.10	438,700.00	
MAXIS BHD	40,000	5.80	232,000.00	
PETRONAS GAS BERHAD	20,000	16.74	334,800.00	
TENAGA NASIONAL BERHAD	47,125	6.13	288,876.25	
YTL CORPORATION BERHAD	135,660	1.48	200,776.80	
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	70,000	1.90	133,000.00	
マレーシアリングット小計	1,382,355		8,763,212.10 (225,740,343)	
タイパーツ				
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	3,500	626.00	2,191,000.00	

IRPC PCL - NVDR	191,800	4.64	889,952.00	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	30,700	173.50	5,326,450.00	
PTT PCL-NVDR	15,100	338.00	5,103,800.00	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	39,000	38.25	1,491,750.00	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	20,045	70.75	1,418,183.75	
SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	12,600	408.00	5,140,800.00	
CP ALL PCL-NVDR	38,400	57.25	2,198,400.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	70,000	36.25	2,537,500.00	
BANGKOK BANK-FOREIGN REG	32,040	181.00	5,799,240.00	
BANK OF AYUDHYA PUBLIC-NVDR	94,000	24.40	2,293,600.00	
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	24,200	142.00	3,436,400.00	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	20,000	139.00	2,780,000.00	
KRUNG THAI BANK - NVDR	129,700	16.60	2,153,020.00	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	36,300	130.00	4,719,000.00	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	28,600	148.00	4,232,800.00	
タイパーツ小計	785,985		51,711,895.75 (131,348,215)	
フィリピンペソ				
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	52,000	42.45	2,207,400.00	
SM INVESTMENTS CORP	4,410	647.50	2,855,475.00	
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	30,741	69.00	2,121,129.00	
METROPOLITAN BANK & TRUST	25,000	81.00	2,025,000.00	
AYALA CORPORATION	9,442	390.00	3,682,380.00	
AYALA LAND INC	177,960	19.02	3,384,799.20	
AYALA LAND INC-PREFERENCE	177,960	0.10	17,796.00	
SM PRIME HOLDINGS INC	174,168	15.54	2,706,570.72	
PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	810	2,744.00	2,222,640.00	
ABOITIZ POWER CORP	86,000	28.75	2,472,500.00	
ENERGY DEVELOPMENT CORP	350,000	5.70	1,995,000.00	
MANILA ELECTRIC COMPANY	10,000	270.00	2,700,000.00	
フィリピンペソ小計	1,098,491		28,390,689.92 (52,238,869)	
インドネシアルピア				
ADARO ENERGY TBK PT	270,000	1,920.00	518,400,000.00	
BUMI RESOURCES TBK PT	450,000	2,475.00	1,113,750,000.00	
TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	25,000	20,950.00	523,750,000.00	
ANEKA TAMBANG TBK PT	92,500	1,940.00	179,450,000.00	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	32,000	17,800.00	569,600,000.00	
SEMEN GRESIK (PERSERO) PT	66,000	11,550.00	762,300,000.00	
VALE INDONESIA TBK PT	45,000	3,575.00	160,875,000.00	
PT UNITED TRACTORS	53,500	28,900.00	1,546,150,000.00	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	49,500	73,700.00	3,648,150,000.00	
GUDANG GARAM TBK PT	15,000	54,800.00	822,000,000.00	
PT INDOFOOD SUKSES MAK TBK	136,000	5,000.00	680,000,000.00	
KALBE FARMA TBK PT	150,000	3,525.00	528,750,000.00	
BANK DANAMON INDONESIA TBK	48,000	4,475.00	214,800,000.00	
BANK MANDIRI TBK	197,000	6,250.00	1,231,250,000.00	
BANK RAKYAT INDONESIA	284,000	6,700.00	1,902,800,000.00	
PT BANK CENTRAL ASIA	294,000	7,400.00	2,175,600,000.00	
PT BANK NEGARA INDONESIA	180,000	3,500.00	630,000,000.00	
INDOSAT TBK PT	75,000	5,450.00	408,750,000.00	
PT TELEKOMUNIKASI	263,000	6,900.00	1,814,700,000.00	
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	413,500	3,650.00	1,509,275,000.00	
インドネシアルピア小計	3,139,000		20,940,350,000.00 (184,275,080)	

メキシコペソ				
CEMEX SAB-CPO	187,627	10.52	1,973,836.04	
GRUPO MEXICO SA-SER B	91,578	41.93	3,839,865.54	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	2,500	627.04	1,567,600.00	
MEXICHEM SAB DE CV-*	12,000	46.41	556,920.00	
MINERA FRISCO SAB DE CV-A1	11,000	58.93	648,230.00	
ALFA S.A.B.-A	10,800	170.89	1,845,612.00	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	11,000	39.88	438,680.00	
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	10,000	47.88	478,800.00	
URBI DESARROLLOS URBANOS SA	21,000	16.88	354,480.00	
GRUPO TELEvisa SAB	43,100	51.72	2,229,132.00	
GRUPO ELEKTRA SA-CPO	1,500	1,135.98	1,703,970.00	
WALMART DE MEXICO -SER V	154,200	39.74	6,127,908.00	
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	8,100	128.11	1,037,691.00	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	41,700	93.71	3,907,707.00	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	43,500	29.36	1,277,160.00	
GRUPO MODELO S.A.B.-SER C	17,600	83.39	1,467,664.00	
KIMBERLY CLARK MEXICO-CL A	13,890	74.70	1,037,583.00	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	26,900	53.42	1,436,998.00	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	66,000	27.45	1,811,700.00	
COMPARTAMOS SAB DE CV	30,000	15.88	476,400.00	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	904,800	15.01	13,581,048.00	
メキシコペソ小計	1,708,795		47,798,984.58 (293,007,775)	
ブラジルリアル				
HRT PARTICIPACOES EM PETROLE	100	550.00	55,000.00	
OGX PETROLEO E GAS PARTICIPA	26,300	17.26	453,938.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	69,860	24.89	1,738,815.40	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	99,200	23.21	2,302,432.00	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	6,800	35.65	242,420.00	
BRADSPAR SA -PREF	5,600	36.30	203,280.00	
BRASKEM SA-PREF A	1,000	14.80	14,800.00	
CIA SIDERURGICA NACIONAL	7,800	17.88	139,464.00	
DURATEX SA	6,000	9.78	58,680.00	
FIBRIA CELULOSE SA	829	15.80	13,098.20	
GERDAU SA-PREF	22,500	17.35	390,375.00	
INDS KLABIN PAPEL E CELU-PRF	15,300	8.22	125,766.00	
METALURGICA GERDAU SA-PREF	7,100	21.85	155,135.00	
MMX MINERACAO E METALICOS SA	14,000	8.48	118,720.00	
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	4,500	7.85	35,325.00	
USINAS SIDER MINAS GER	4,000	15.85	63,400.00	
USINAS SIDER MINAS GER-PF A	8,600	11.99	103,114.00	
VALE SA	25,760	44.25	1,139,880.00	
VALE SA-PREF A	45,150	42.88	1,936,032.00	
EMBRAER SA	15,900	12.61	200,499.00	
ALL AMERICA LATINA LOGISTICA	12,500	10.45	130,625.00	
CCR SA	18,000	13.30	239,400.00	
ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	7,000	13.73	96,110.00	
GOL LINHAS AEREAS - PREF	4,000	14.34	57,360.00	
LOCALIZA RENT A CAR	2,800	30.40	85,120.00	
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP	6,700	17.22	115,374.00	
MRV ENGENHARIA	5,700	14.40	82,080.00	
PDG REALTY SA	23,600	7.90	186,440.00	
ROSSI RESIDENCIAL S.A.	10,000	10.29	102,900.00	
ANHANGUERA EDUCACIONAL PART	2,650	23.55	62,407.50	

CIA HERING	3,750	42.50	159,375.00	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	6,828	17.65	120,514.20	
LOJAS RENNER S.A.	2,800	60.28	168,784.00	
BRF - BRASIL FOODS SA	7,800	33.30	259,740.00	
CIA DE BEBIDAS DAS AME-PREF	16,700	64.80	1,082,160.00	
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	1,400	29.52	41,328.00	
JBS SA	24,900	7.45	185,505.00	
SOUZA CRUZ SA	11,500	22.85	262,775.00	
HYPERMARCAS SA	5,000	12.25	61,250.00	
NATURA COSMETICOS SA	5,300	40.44	214,332.00	
AMIL PARTICIPACOES SA	5,000	17.92	89,600.00	
DIAGNOSTICOS DA AMERICA SA	6,150	15.50	95,325.00	
ODONTOPREV S.A.	3,100	29.11	90,241.00	
BANCO BRADESCO SA-PREF	37,873	31.05	1,175,956.65	
BANCO DO BRASIL S.A.	13,500	27.47	370,845.00	
BANCO ESTADO RIO GRANDE SUL	6,500	20.07	130,455.00	
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	12,000	17.95	215,400.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	52,200	36.98	1,930,356.00	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	51,799	12.07	625,213.93	
BM&FBOVESPA SA	45,573	12.31	561,003.63	
CETIP SA-BALCAO ORGANIZADO	4,700	29.25	137,475.00	
PORTO SEGURO SA	4,200	22.74	95,508.00	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	13,000	21.10	274,300.00	
CIELO SA	6,600	55.75	367,950.00	
REDECARD SA	6,400	36.08	230,912.00	
TOTVS SA	3,250	32.30	104,975.00	
BRASIL TELECOM SA-PREFERENCE	7,000	10.94	76,580.00	
TELE NORTE LESTE PART	1,400	20.20	28,280.00	
TELE NORTE LESTE PART-PREF	2,700	16.85	45,495.00	
TELEFONICA BRASIL S.A. -PREF	2,830	48.39	136,943.70	
TELEMAR NORTE LESTE SA-PR A	1,200	41.25	49,500.00	
TIM PARTICIPACOES SA	14,605	9.54	139,331.70	
AES TIETE SA-PREF	3,500	24.61	86,135.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS	5,880	18.27	107,427.60	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	2,300	25.92	59,616.00	
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	5,700	35.80	204,060.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	4,207	37.75	158,814.25	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	720	63.20	45,504.00	
CPFL ENERGIA SA	6,800	26.75	181,900.00	
ELETROPAULO METROPOLI-PREF	2,640	36.91	97,442.40	
TRACTEBEL ENERGIA SA ORD	3,700	30.13	111,481.00	
ブラジルリアル小計	902,254		21,227,780.16 (966,076,275)	
チリペソ				
CAP SA	2,045	21,208.00	43,370,360.00	
EMPRESAS CMPC SA	37,000	2,193.60	81,163,200.00	
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B-PRF	1,400	28,174.00	39,443,600.00	
EMPRESAS COPEC SA	11,490	8,159.80	93,756,102.00	
S.A.C.I. FALABELLA	9,000	4,533.20	40,798,800.00	
CENCOSUD SA	19,150	3,090.30	59,179,245.00	
BANCO DE CHILE	390,000	73.33	28,598,700.00	
BANCO DE CREDITO E INVERSION	810	30,524.00	24,724,440.00	
BANCO SANTANDER CHILE SA	747,000	36.50	27,265,500.00	
CORPBANCA	2,600,000	7.38	19,208,800.00	
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	2,700	9,509.20	25,674,840.00	

COLBUN SA	268,000	130.02	34,845,360.00	
EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	57,700	811.35	46,814,895.00	
ENERSIS SA	269,500	179.56	48,391,420.00	

[次へ](#)

チリペソ小計	4,415,795		613,235,262.00 (99,282,788)	
韓国ウォン				
GS HOLDINGS	1,270	69,900.00	88,773,000.00	
SK INNOVATION CO LTD	1,482	187,000.00	277,134,000.00	
S-OIL CORPORATION	865	134,500.00	116,342,500.00	
CHEIL INDUSTRIES INC	1,240	99,100.00	122,884,000.00	
DONGKUK STEEL MILL CO LTD	1,090	24,650.00	26,868,500.00	
HANWHA CHEMICAL CORP	2,000	29,950.00	59,900,000.00	
HANWHA CORPORATION	1,160	38,750.00	44,950,000.00	
HONAM PETROCHEMICAL CORP	370	376,500.00	139,305,000.00	
HYOSUNG CORPORATION	550	69,200.00	38,060,000.00	
HYUNDAI STEEL CO	1,130	113,000.00	127,690,000.00	
KOREA KUMHO PETROCHEMICAL CO	460	173,500.00	79,810,000.00	
KOREA ZINC CO LTD	295	401,500.00	118,442,500.00	
LG CHEM LTD	1,222	416,500.00	508,963,000.00	
OCI CO LTD	320	301,500.00	96,480,000.00	
POSCO	1,600	415,000.00	664,000,000.00	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	610	124,500.00	75,945,000.00	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	3,686	11,400.00	42,020,400.00	
DAEWOO INTERNATIONAL CORP	1,431	32,200.00	46,078,200.00	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,340	31,950.00	74,763,000.00	
DOOSAN CORP	230	165,000.00	37,950,000.00	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	800	76,300.00	61,040,000.00	
DOOSAN INFRACORE CO LTD	2,030	20,550.00	41,716,500.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	910	107,000.00	97,370,000.00	
HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	1,595	24,900.00	39,715,500.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	1,110	80,700.00	89,577,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	915	329,500.00	301,492,500.00	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	245	142,500.00	34,912,500.00	
KCC CORP	120	347,000.00	41,640,000.00	
LG CORP	2,000	74,500.00	149,000,000.00	
LS CORP	650	90,000.00	58,500,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	3,250	76,200.00	247,650,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	835	225,500.00	188,292,500.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	3,690	38,300.00	141,327,000.00	
SAMSUNG TECHWIN CO LTD	841	59,200.00	49,787,200.00	
SK HOLDINGS CO LTD	450	154,000.00	69,300,000.00	
SK NETWORKS CO LTD	1,950	11,200.00	21,840,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	1,073	56,300.00	60,409,900.00	
STX PAN OCEAN CO LTD	2,670	7,800.00	20,826,000.00	
HANKOOK TIRE CO LTD	2,620	44,900.00	117,638,000.00	
HYUNDAI MOBIS	1,520	287,000.00	436,240,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	3,800	219,000.00	832,200,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	850	65,100.00	55,335,000.00	
KIA MOTORS CORPORATION	5,490	68,500.00	376,065,000.00	
MANDO CORP	450	171,000.00	76,950,000.00	
LG ELECTRONICS INC	2,785	91,000.00	253,435,000.00	
WOONGJIN COWAY CO LTD	1,090	38,200.00	41,638,000.00	
KANGWON LAND INC	2,770	27,600.00	76,452,000.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	380	173,000.00	65,740,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	215	357,500.00	76,862,500.00	
SHINSEGAE CO LTD	167	286,500.00	47,845,500.00	
E-MART CO LTD	472	260,000.00	122,720,000.00	

CJ CHEILJEDANG CORP	194	313,500.00	60,819,000.00	
KT&G CORP	3,295	72,700.00	239,546,500.00	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	25	1,695,000.00	42,375,000.00	
ORION CORP	80	648,000.00	51,840,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	90	964,000.00	86,760,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	250	462,000.00	115,500,000.00	
CELLTRION INC	2,000	35,600.00	71,200,000.00	
YUHAN CORPORATION	367	127,000.00	46,609,000.00	
BS FINANCIAL ROUP INC	4,549	12,850.00	58,454,650.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	4,140	15,100.00	62,514,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	5,700	40,500.00	230,850,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	4,640	13,850.00	64,264,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	8,805	44,000.00	387,420,000.00	
KOREA EXCHANGE BANK	6,540	8,100.00	52,974,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	9,040	44,550.00	402,732,000.00	
WOORI FINANCE HOLDINGS CO	5,950	12,250.00	72,887,500.00	
DAEWOO SECURITIES CO.	4,575	13,700.00	62,677,500.00	
HYUNDAI SECURITIES CO	3,610	11,350.00	40,973,500.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	955	43,000.00	41,065,000.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	570	38,650.00	22,030,500.00	
SAMSUNG CARD CO	690	41,850.00	28,876,500.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,517	63,000.00	95,571,000.00	
WOORI INVESTMENT & SECURITIE	3,171	13,650.00	43,284,150.00	
DONGBU INSURANCE CO LTD	800	49,650.00	39,720,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	725	209,000.00	151,525,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	1,100	87,000.00	95,700,000.00	
NCISOFT CORPORATION	200	290,000.00	58,000,000.00	
NHN CORP	1,005	219,000.00	220,095,000.00	
SK C&C CO LTD	500	122,500.00	61,250,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	4,560	29,750.00	135,660,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,330	98,500.00	131,005,000.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	620	153,000.00	94,860,000.00	
KT CORP	2,127	32,550.00	69,233,850.00	
LG UPLUS CORP.	8,000	5,930.00	47,440,000.00	
SK TELECOM	990	137,500.00	136,125,000.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	7,390	25,600.00	189,184,000.00	
KOREA GAS CORPORATION	710	39,850.00	28,293,500.00	
HYNIX SEMICONDUCTOR INC	11,230	27,550.00	309,386,500.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	2,560	1,080,000.00	2,764,800,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	525	663,000.00	348,075,000.00	
韓国ウォン小計	186,219		14,341,453,350.00 (1,002,467,589)	
台湾ドル				
CHINATRUST FINANCIAL HOLDING-RTS(N)	11,030	3.55	39,156.50	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	32,080	90.40	2,900,032.00	
ASIA CEMENT CORP	54,105	36.20	1,958,601.00	
CHINA PETROCHEMICAL DEV CORP	66,000	35.25	2,326,500.00	
CHINA STEEL CORP	274,605	29.40	8,073,387.00	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	76,745	87.00	6,676,815.00	
FORMOSA PLASTICS CORP	87,408	88.00	7,691,904.00	
NAN YA PLASTICS CORP	105,857	66.50	7,039,490.50	
TAIWAN CEMENT	105,170	36.70	3,859,739.00	
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	20,000	79.50	1,590,000.00	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	95,622	37.40	3,576,262.80	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	6,000	322.00	1,932,000.00	

WALSIN LIHWA CORP	185,000	10.95	2,025,750.00	
EVA AIRWAYS CORP	62,000	20.90	1,295,800.00	
EVERGREEN MARINE	44,769	19.00	850,611.00	
YANG MING MARINE TRANSPORT	52,443	16.85	883,664.55	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	56,100	67.40	3,781,140.00	
YULON MOTOR COMPANY	35,020	61.50	2,153,730.00	
POU CHEN	77,145	25.45	1,963,340.25	
TATUNG CO LTD	46,344	9.56	443,048.64	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	20,448	155.00	3,169,440.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	87,741	44.10	3,869,378.10	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	118,810	18.15	2,156,401.50	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	250,715	9.91	2,484,585.65	
CHINATRUST FINANCIAL HOLDING	220,757	19.85	4,382,026.45	
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	120,186	15.05	1,808,799.30	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	135,877	19.05	2,588,456.85	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	142,074	17.20	2,443,672.80	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	187,680	22.50	4,222,800.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	90,741	10.30	934,632.30	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	124,018	12.15	1,506,818.70	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	114,268	19.25	2,199,659.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	103,623	34.75	3,600,899.25	
KGI SECURITIES CO LTD	91,782	13.15	1,206,933.30	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	278,127	16.95	4,714,252.65	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	153,546	34.95	5,366,432.70	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	53,000	30.50	1,616,500.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	107,754	10.10	1,088,315.40	
ACER INC	59,680	43.05	2,569,224.00	
ADVANTECH CO LTD	10,968	91.60	1,004,668.80	
ASUSTEK COMPUTER INC	15,797	248.50	3,925,554.50	
AU OPTRONICS CORP	173,994	16.25	2,827,402.50	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	15,405	205.00	3,158,025.00	
CHENG UEI PRECISION INDUSTRY	6,881	70.20	483,046.20	
CHIMEI INNOLUX CORP	125,061	16.20	2,025,988.20	
COMPAL ELECTRONICS	111,955	34.25	3,834,458.75	
DELTA ELECTRONICS INC	40,419	78.60	3,176,933.40	
E INK HOLDINGS INC	35,000	40.30	1,410,500.00	
EVERLIGHT ELECTRONICS CO LTD	11,749	59.40	697,890.60	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	20,145	134.00	2,699,430.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	211,849	101.00	21,396,749.00	
HTC CORP	17,011	580.00	9,866,380.00	
INVENTEC CO LTD	60,060	12.80	768,768.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	3,236	620.00	2,006,320.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	33,455	36.25	1,212,743.75	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	5,391	74.60	402,168.60	
PEGATRON CORP	34,854	37.00	1,289,598.00	
QUANTA COMPUTER INC	63,416	70.00	4,439,120.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	30,591	73.20	2,239,261.20	
TPK HOLDING CO LTD	2,100	455.00	955,500.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	21,000	39.55	830,550.00	
WINTEK CORP	51,696	25.35	1,310,493.60	
WISTRON CORP	41,747	46.65	1,947,497.55	
WPG HOLDINGS LTD	40,000	39.15	1,566,000.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	92,371	93.90	8,673,636.90	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	27,000	55.80	1,506,600.00	

TAIWAN MOBILE CO LTD	46,188	87.50	4,041,450.00	
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	128,772	28.60	3,682,879.20	
EPISTAR CORP	10,292	73.30	754,403.60	
INOTERA MEMORIES INC	78,440	6.64	520,841.60	
MACRONIX INTERNATIONAL	94,028	12.50	1,175,350.00	
MEDIATEK INC	22,530	316.00	7,119,480.00	
MOTECH INDUSTRIES INC	9,194	62.50	574,625.00	
MSTAR SEMICONDUCTOR INC	9,908	195.00	1,932,060.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	12,522	85.20	1,066,874.40	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	19,635	73.10	1,435,318.50	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	11,584	60.10	696,198.40	
RICHTEK TECHNOLOGY CORP	5,512	176.00	970,112.00	
SILICONWARE PRECISION INDS	92,082	34.20	3,149,204.40	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	584,355	77.30	45,170,641.50	
TRANSCEND INFORMATION INC	7,346	82.50	606,045.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	288,592	14.75	4,256,732.00	
台湾ドル小計	6,678,401		275,797,700.34 (733,621,882)	
インドルピー				
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	3,200	598.30	1,914,560.00	
COAL INDIA LTD	9,000	334.35	3,009,150.00	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	25,460	276.10	7,029,506.00	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	28,346	848.90	24,062,919.40	
ACC LIMITED	1,330	1,339.20	1,781,136.00	
AMBUJA CEMENTS LIMITED	10,970	170.75	1,873,127.50	
ASIAN PAINTS LTD	1,000	3,027.20	3,027,200.00	
HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	29,280	161.10	4,717,008.00	
JINDAL STEEL & POWER LTD	13,500	598.80	8,083,800.00	
JSW STEEL LIMITED	2,000	828.05	1,656,100.00	
SESA GOA LTD	8,500	244.70	2,079,950.00	
STERLITE INDUSTRIES INDIA LT	24,600	129.05	3,174,630.00	
TATA STEEL LIMITED	5,416	487.95	2,642,737.20	
ADANI ENTERPRISES LTD	5,500	356.10	1,958,550.00	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	13,150	265.00	3,484,750.00	
JAIPRAKASH ASSOCIATES LTD	18,060	79.50	1,435,770.00	
LARSEN & TOUBRO LIMITED	4,220	1,379.50	5,821,490.00	
SIEMENS INDIA LIMITED	1,890	790.60	1,494,234.00	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	15,000	144.15	2,162,250.00	
BAJAJ AUTO LTD	2,400	1,732.35	4,157,640.00	
HERO MOTOCORP LTD	2,200	2,081.80	4,579,960.00	
MAHINDRA & MAHINDRA LIMITED	10,600	717.30	7,603,380.00	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,105	1,267.70	2,668,508.50	
TATA MOTORS LTD	31,500	267.95	8,440,425.00	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	12,780	134.30	1,716,354.00	
ITC LTD	50,510	202.55	10,230,800.50	
UNITED SPIRITS LIMITED	1,330	675.85	898,880.50	
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	15,520	391.85	6,081,512.00	
CIPLA LTD	7,650	321.20	2,457,180.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	1,740	1,610.65	2,802,531.00	
LUPIN LTD	5,200	474.90	2,469,480.00	
RANBAXY LABORATORIES LTD	4,755	433.65	2,062,005.75	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	5,500	554.60	3,050,300.00	
AXIS BANK LIMITED	6,160	1,129.65	6,958,644.00	
HDFC BANK LTD	39,775	517.90	20,599,472.50	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	26,575	697.75	18,542,706.25	

ICICI BANK LTD	15,265	943.70	14,405,580.50	
INDUSIND BANK LTD	9,000	321.95	2,897,550.00	
INFRASTRUCTURE DEV FINANCE	17,300	138.10	2,389,130.00	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	5,810	559.85	3,252,728.50	
RELIANCE CAPITAL LIMITED	3,510	423.80	1,487,538.00	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	4,000	550.30	2,201,200.00	
DLF LTD	4,900	234.60	1,149,540.00	
UNITECH LTD	40,000	29.75	1,190,000.00	
HCL TECHNOLOGIES LTD	7,300	468.25	3,418,225.00	
INFOSYS LTD	9,835	2,801.05	27,548,326.75	
TATA CONSULTANCY SVS LTD	12,050	1,220.00	14,701,000.00	
WIPRO LTD	12,166	435.10	5,293,426.60	
BHARTI AIRTEL LTD	10,000	342.35	3,423,500.00	
RELIANCE COMMUNICATION LTD	9,055	99.20	898,256.00	
GAIL INDIA LTD	10,875	385.55	4,192,856.25	
GMR INFRASTRUCTURE LTD	22,980	32.00	735,360.00	
NTPC LIMITED	13,850	181.65	2,515,852.50	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	28,300	109.40	3,096,020.00	
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	2,940	615.85	1,810,599.00	
RELIANCE POWER LTD	15,875	108.60	1,724,025.00	
TATA POWER CO LTD	26,000	104.20	2,709,200.00	
インドルピー小計	727,733		287,768,562.20 (463,307,385)	
チェココルナ				
KOMERCNI BANKA AS	360	3,680.00	1,324,800.00	
TELEFONICA CZECH REPUBLIC AS	1,925	376.00	723,800.00	
CEZ AS	4,130	820.00	3,386,600.00	
チェココルナ小計	6,415		5,435,200.00 (22,338,672)	
エジプトポンド				
COMMERCIAL INTL BANK	16,500	23.98	395,670.00	
EGYPTIAN FINANCIAL GROUP	6,625	12.89	85,396.25	
MOBINIL-EGYPTIAN MOBILE SERV	1,570	151.67	238,121.90	
ORASCOM TELECOM HOLDING	60,000	4.20	252,000.00	
ORASCOM TELECOM MEDIA AND TE	60,000	1.58	94,800.00	
エジプトポンド小計	144,695		1,065,988.15 (13,868,505)	
コロンビアペソ				
ECOPETROL SA	25,000	4,785.00	119,625,000.00	
CEMENTOS ARGOS SA	8,890	11,000.00	97,790,000.00	
INVERSIONES ARGOS SA	8,660	16,900.00	146,354,000.00	
ALMACENES EXITO SA	4,500	25,060.00	112,770,000.00	
CORP FINANCIERA COLOMBIANA	2,500	34,300.00	85,750,000.00	
GRUPO DE INV SURAMERICANA	4,500	31,400.00	141,300,000.00	
コロンビアペソ小計	54,050		703,589,000.00 (30,887,557)	
ハンガリーフォリント				
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	1,210	19,180.00	23,207,800.00	
RICHTER GEDEON NYRT.	320	38,170.00	12,214,400.00	
OTP BANK PLC	4,585	3,930.00	18,019,050.00	
MAGYAR TELEKOM TELECOMMUNICA	13,420	543.00	7,287,060.00	
ハンガリーフォリント小計	19,535		60,728,310.00 (21,449,239)	
モロッコディルハム				
DOUJA PROM ADDOHA	3,700	71.50	264,550.00	

モロッコディルハム小計	3,700		264,550.00 (2,444,442)	
ポーランドズロチ				
GRUPA LOTOS SA	6,000	26.50	159,000.00	
POLISH OIL & GAS	37,985	3.74	142,063.90	
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	9,130	36.00	328,680.00	
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	1,200	107.20	128,640.00	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	3,910	135.10	528,241.00	
TVN SA	8,000	11.80	94,400.00	
BANK PEKAO SA	3,152	158.90	500,852.80	
BRE BANK SA	230	297.00	68,310.00	
PKO BANK POLSKI SA	13,445	35.10	471,919.50	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	1,400	340.00	476,000.00	
GLOBE TRADE CENTRE SA	3,640	10.05	36,582.00	
ASSECO POLAND SA	2,400	50.50	121,200.00	
TELEKOMUNIKACJA POLSKA SA	14,105	16.75	236,258.75	
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	18,400	20.29	373,336.00	
TAURON POLSKA ENERGIA SA	37,000	5.47	202,390.00	
ポーランドズロチ小計	159,997		3,867,873.95 (95,420,450)	
南アフリカランド				
SASOL LTD	12,700	401.02	5,092,954.00	
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	1,800	190.49	342,882.00	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	1,660	560.00	929,600.00	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	8,570	350.05	2,999,928.50	
ARCELORMITTAL SOUTH AFRICA	4,451	64.16	285,576.16	
EXXARO RESOURCES LTD	3,510	203.00	712,530.00	
GOLD FIELDS LTD	15,090	127.96	1,930,916.40	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	11,200	98.21	1,099,952.00	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	13,730	168.00	2,306,640.00	
KUMBA IRON ORE LTD	1,680	553.00	929,040.00	
PRETORIA PORTLAND CEMENT CO	14,010	30.41	426,044.10	
SAPPI LIMITED	8,415	24.65	207,429.75	
AVENG LTD	15,626	34.62	540,972.12	
BARLOWORLD LTD	6,500	90.50	588,250.00	
BIDVEST GROUP LTD	6,122	173.06	1,059,473.32	
REUNERT LTD	6,010	67.41	405,134.10	
STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	25,460	25.55	650,503.00	
NASPERS LTD-N SHS	8,610	389.33	3,352,131.30	
FOSCHINI GROUP LTD/THE	6,775	111.00	752,025.00	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	3,655	139.00	508,045.00	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	13,420	77.96	1,046,223.20	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	21,905	41.93	918,476.65	
MASSMART HOLDINGS LTD	2,739	174.55	478,092.45	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	12,210	132.25	1,614,772.50	
SPAR GROUP LIMITED/THE	4,760	111.00	528,360.00	
TIGER BRANDS LTD	3,490	250.00	872,500.00	
NETCARE LTD	16,150	13.78	222,547.00	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	9,041	102.78	929,233.98	
ABSA GROUP LTD	6,900	152.40	1,051,560.00	
NEDBANK GROUP LTD	3,050	158.91	484,675.50	
STANDARD BANK GROUP LTD	29,616	110.25	3,265,164.00	
AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	18,069	37.60	679,394.40	
FIRSTRAND LTD	55,870	22.65	1,265,455.50	
INVESTEC LTD	6,500	48.48	315,120.00	

REMGRO LTD	8,040	128.50	1,033,140.00	
RMB HOLDINGS LTD	19,830	29.85	591,925.50	
DISCOVERY HOLDINGS LTD	9,400	46.93	441,142.00	
MMI HOLDINGS LTD	24,429	19.40	473,922.60	
RMI HOLDINGS LTD	19,830	15.78	312,917.40	
SANLAM LTD	41,835	30.35	1,269,692.25	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	41,000	20.10	824,100.00	
REDEFINE PROPERTIES LTD	55,000	7.84	431,200.00	
MTN GROUP LTD	39,515	135.00	5,334,525.00	
TELKOM SA LTD	3,035	27.45	83,310.75	
VODACOM GROUP LTD	9,035	103.50	935,122.50	
南アフリカランド小計	650,243		50,522,599.93 (513,309,615)	
トルコリラ				
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	3,470	44.40	154,068.00	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	28,268	3.94	111,375.92	
ENKA INSAAT VE SANAYI AS	13,748	4.96	68,190.08	
KOC HOLDING AS	11,547	7.16	82,676.52	
ARCELIK A.S.	14,500	7.70	111,650.00	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	2,200	59.00	129,800.00	
ANADOLU EFES BIRACILIK	5,581	26.10	145,664.10	
AKBANK T.A.S.	29,759	6.88	204,741.92	
TURKIYE GARANTI BANKASI	49,740	6.68	332,263.20	
TURKIYE HALK BANKASI	14,660	12.05	176,653.00	
TURKIYE IS BANKASI-C	39,904	3.98	158,817.92	
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	19,682	3.09	60,817.38	
YAPI VE KREDI BANKASI	18,033	3.44	62,033.52	
HACI OMER SABANCI HOLDING	13,753	7.04	96,821.12	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	17,056	9.38	159,985.28	
トルコリラ小計	281,901		2,055,557.96 (91,348,995)	
ユーロ				
MAROC TELECOM	3,890	12.95	50,375.50	
ユーロ小計	3,890		50,375.50 (5,190,187)	
合 計	40,902,150		6,816,411,916 (6,816,411,916)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
トルコリラ	投資証券	EMLAK KONUT GAYRIMEN	26,000	57,720.00	
	投資証券小計		26,000	57,720.00 (2,565,076)	
トルコリラ合計				57,720.00 (2,565,076)	
合計				2,565,076 (2,565,076)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 54銘柄	100.0%	—	9.7%
香港ドル	株式 121銘柄	100.0%	—	17.7%
マレーシアリングット	株式 28銘柄	100.0%	—	3.3%
タイバーツ	株式 16銘柄	100.0%	—	1.9%
フィリピンペソ	株式 12銘柄	100.0%	—	0.8%
インドネシアルピア	株式 20銘柄	100.0%	—	2.7%
メキシコペソ	株式 21銘柄	100.0%	—	4.3%
ブラジルレアル	株式 71銘柄	100.0%	—	14.2%
チリペソ	株式 14銘柄	100.0%	—	1.5%
韓国ウォン	株式 91銘柄	100.0%	—	14.7%
台湾ドル	株式 82銘柄	100.0%	—	10.8%
インドルピー	株式 57銘柄	100.0%	—	6.8%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%	—	0.3%
エジプトポンド	株式 5銘柄	100.0%	—	0.2%
コロンビアペソ	株式 6銘柄	100.0%	—	0.5%
ハンガリーフォリント	株式 4銘柄	100.0%	—	0.3%
モロッコディルハム	株式 1銘柄	100.0%	—	0.0%
ポーランドズロチ	株式 15銘柄	100.0%	—	1.4%
南アフリカランド	株式 45銘柄	100.0%	—	7.5%
トルコリラ	株式 15銘柄	97.3%	—	1.3%
	投資証券 1銘柄	—	2.7%	0.0%
ユーロ	株式 1銘柄	100.0%	—	0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

独立監査人の監査報告書

平成24年3月27日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴 司
業務執行社員

指定社員 公認会計士 和 田 渉
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産）の平成23年8月16日から平成24年2月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産）の平成24年2月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年6月18日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指 定 社 員 公認会計士 佐々木 貴 司
業務執行社員

指 定 社 員 公認会計士 辻 村 和 之
業務執行社員

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

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

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

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成23年6月17日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴 司
業務執行社員

指定社員 公認会計士 辻 村 和 之
業務執行社員

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

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

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

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

以 上

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

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成23年12月9日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

あらた監査法人

指定社員

公認会計士 佐々木 貴 司

業務執行社員

指定社員

公認会計士 辻 村 和 之

業務執行社員

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以 上

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