

【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25年5月15日
【計算期間】	第11期 （自 平成24年8月16日 至 平成25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】	小濱 公哉
【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		
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(株式 一般))	その他 ()	アフリカ		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		中近東 (中東)		
		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

◇その他資産（投資信託証券（株式 一般））

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

◇年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。

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

上記は、一般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、一般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。	39%
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。	12%

*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、2013年4月1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。

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

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

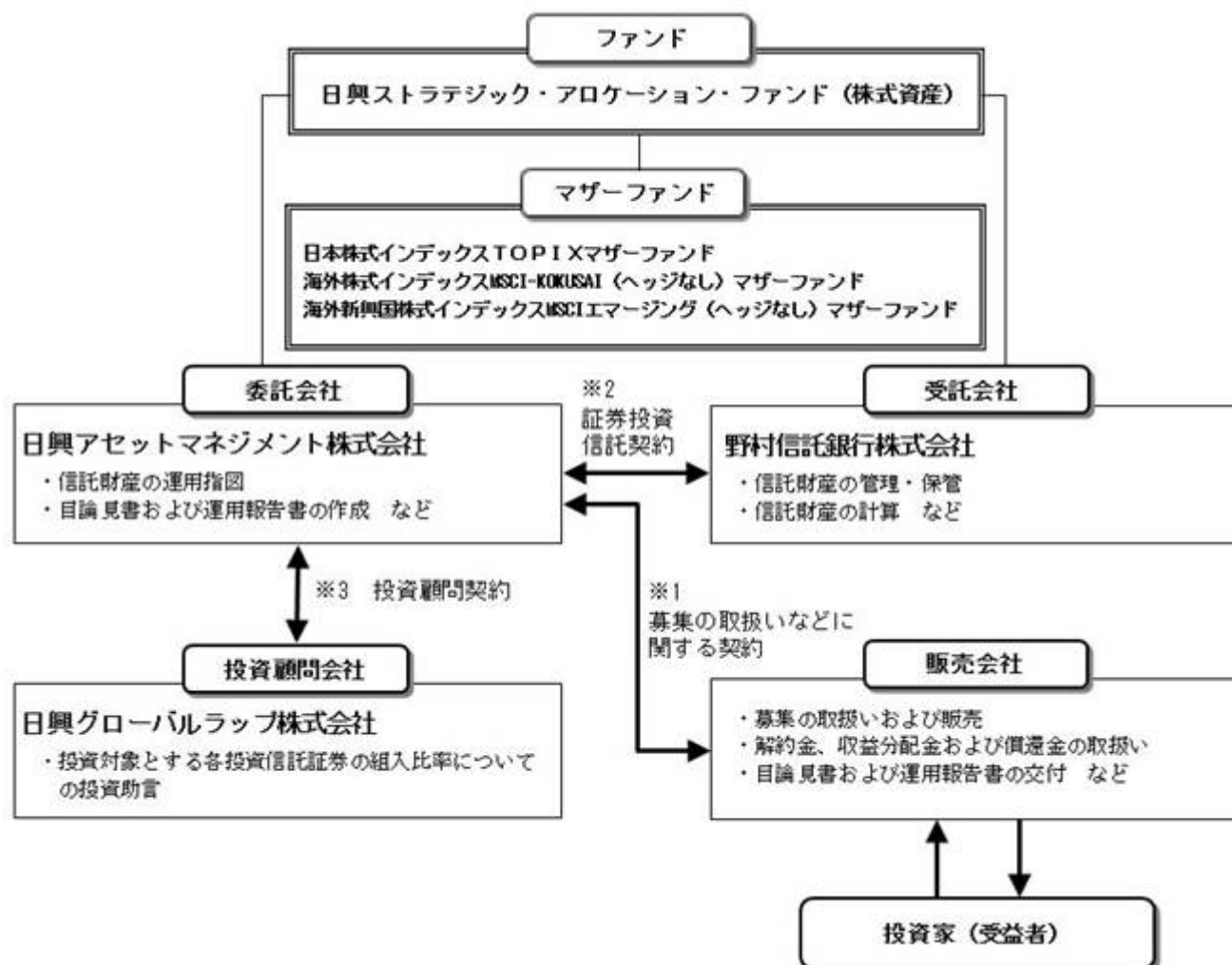
- ・ 投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
- ・ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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25年2月末現在）

1) 資本金

17,363百万円

2) 沿革

昭和34年：日興證券投資信託委託株式会社として設立

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

3) 大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

- ・主として、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。）

- 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ます。）
 - 12) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 13) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 - 14) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 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) 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ます。）
 - 15) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 17) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
 - 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
- ＜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。
 - 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。)
 - 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。)
 - 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。)
 - 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。
 - 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。)
- 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）

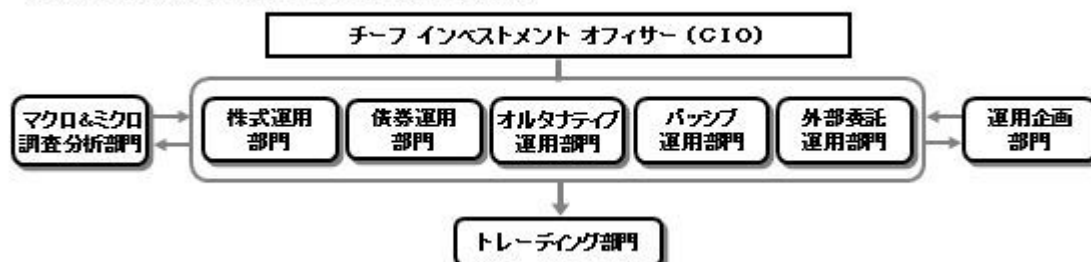
*MSCI エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が発表している、世界の新興国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（円ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。

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。

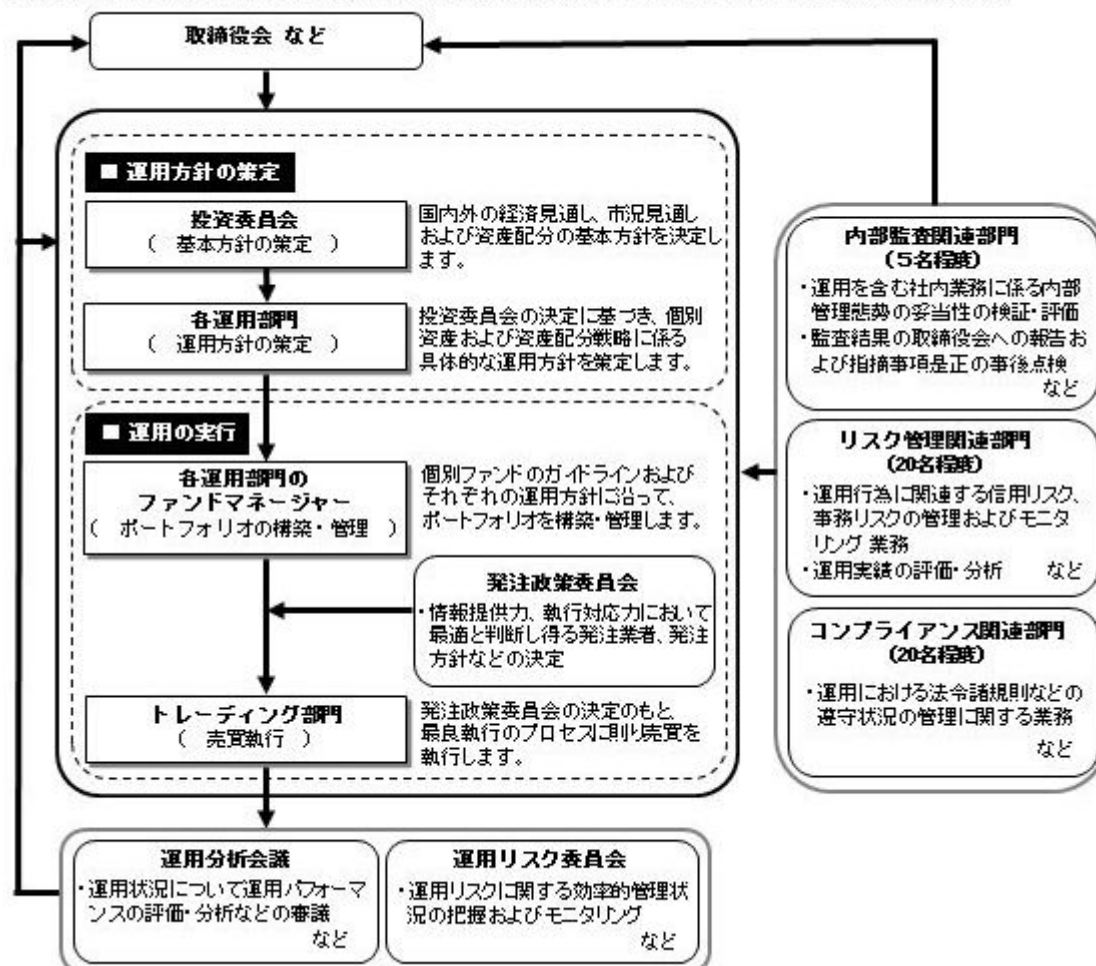
(3) 【運用体制】

＜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かなどのモニタリングを行っております。

※上記体制は平成25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な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（一般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、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡し取引および為替先渡し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）の皆様へ帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。
- ・当ファンドは、主に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

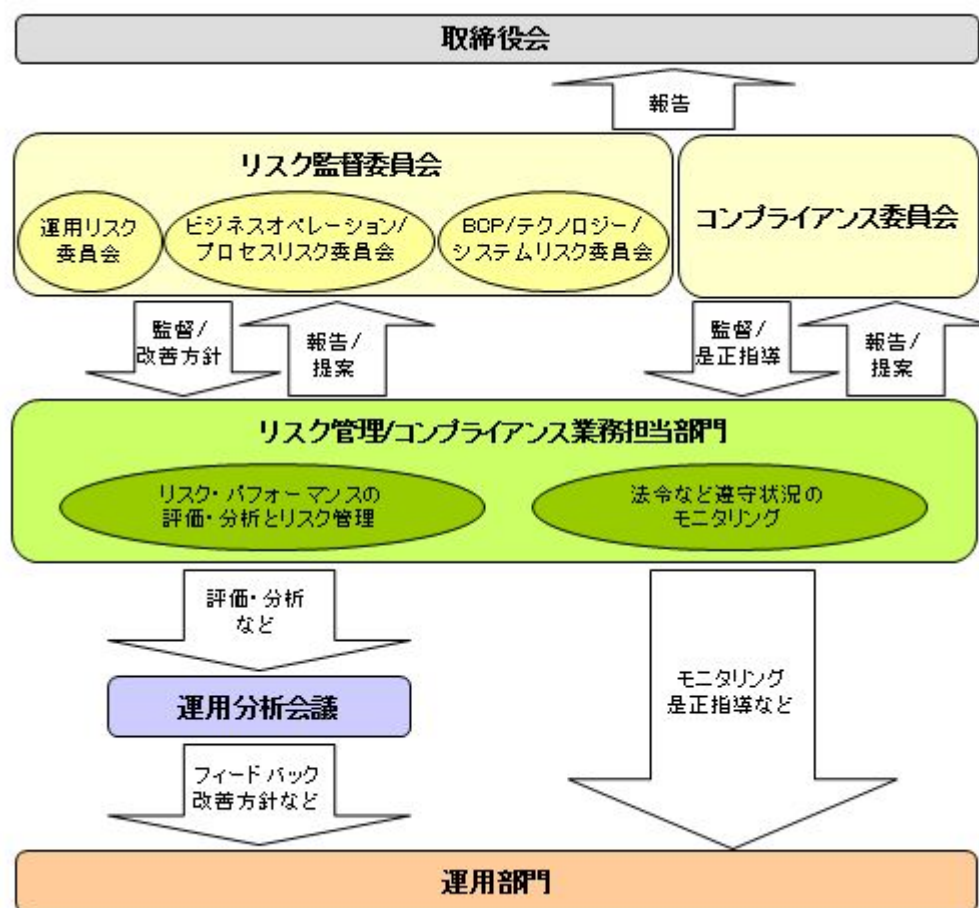
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。

- ・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

当社は運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、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、リスク管理部門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25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% (0.80%)	0.4200% (0.40%)	0.3675% (0.35%)	0.0525% (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乗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、）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、10.147%（所得税7.147%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10.147%の税率は、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、10.147%（所得税7.147%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ます。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、10.147%（所得税7.147%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10.147%の税率は、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、7.147%（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7.147%の税率は、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

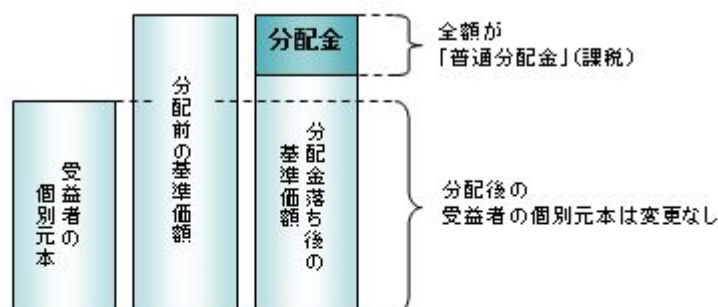
どにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

④ 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

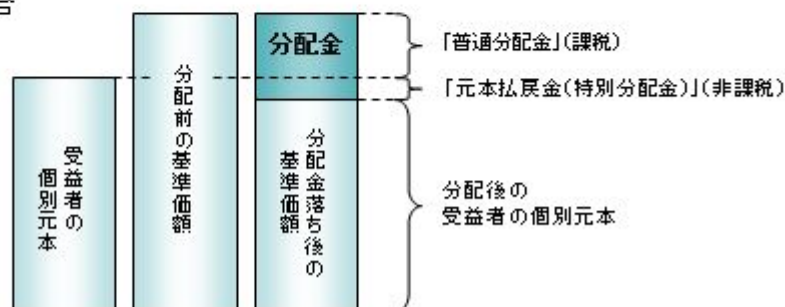
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
 -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



※上記は平成25年5月15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2013年2月28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	241,708,191	99.21
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	1,924,515	0.79
合計（純資産総額）		243,632,706	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	98,787,847	1.2070	119,236,931	1.1918	117,735,356	48.32
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	120,171,431	0.7521	90,380,933	0.7787	93,577,493	38.41
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	23,312,887	1.3340	31,099,391	1.3038	30,395,342	12.48

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	99.21
合 計	99.21

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
第10計算期間末	2012年 8月15日	189	190	0.5057	0.5097
第11計算期間末	2013年 2月15日	242	244	0.6485	0.6535
2012年 2月末日		202	—	0.5438	—
3月末日		207	—	0.5556	—
4月末日		196	—	0.5361	—
5月末日		174	—	0.4772	—
6月末日		185	—	0.4956	—
7月末日		186	—	0.4977	—
8月末日		186	—	0.4979	—
9月末日		191	—	0.5113	—
10月末日		193	—	0.5172	—
11月末日		202	—	0.5403	—
12月末日		219	—	0.5865	—
2013年 1月末日		241	—	0.6445	—
2月末日		243	—	0.6509	—

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
第10期	2012年 2月16日～2012年 8月15日	0.0040
第11期	2012年 8月16日～2013年 2月15日	0.0050

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
第10期	2012年 2月16日～2012年 8月15日	△1.83
第11期	2012年 8月16日～2013年 2月15日	29.23

(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
第10期	2012年 2月16日～2012年 8月15日	8,592,121	7,335,511
第11期	2012年 8月16日～2013年 2月15日	104,328	335,724

(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T O P I Xマザーファンド

以下の運用状況は2013年2月28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	27,297,229,680	99.60
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	109,567,487	0.40
合計（純資産総額）		27,406,797,167	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	106,810,000	0.39

(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	260,500	3,080.00	802,340,000	4,765.00	1,241,282,500	4.53
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,515,500	362.00	548,611,000	513.00	777,451,500	2.84
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	171,100	2,516.00	430,487,600	3,455.00	591,150,500	2.16
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	151,400	2,400.00	363,360,000	3,710.00	561,694,000	2.05
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,579,700	125.04	322,565,688	204.00	526,258,800	1.92
日本	株式	キヤノン	電気機器	126,000	2,560.00	322,560,000	3,365.00	423,990,000	1.55
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	79,500	3,695.00	293,752,500	4,795.00	381,202,500	1.39
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	84,300	3,695.00	311,488,500	4,250.00	358,275,000	1.31
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	95,700	2,575.36	246,461,952	3,435.00	328,729,500	1.20
日本	株式	三菱地所	不動産業	140,000	1,560.00	218,400,000	2,310.00	323,400,000	1.18
日本	株式	ファナック	電気機器	21,100	12,570.00	265,227,000	14,310.00	301,941,000	1.10
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	100,700	2,299.00	231,509,300	2,925.00	294,547,500	1.07
日本	株式	三菱商事	卸売業	156,200	1,395.28	217,942,736	1,839.00	287,251,800	1.05
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	37,400	5,494.25	205,484,950	6,840.00	255,816,000	0.93
日本	株式	日立製作所	電気機器	488,000	412.69	201,395,200	520.00	253,760,000	0.93
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	256,100	685.00	175,428,500	937.00	239,965,700	0.88
日本	株式	三井物産	卸売業	172,800	1,130.00	195,264,000	1,374.00	237,427,200	0.87
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	1,649	123,400.00	203,486,600	143,400.00	236,466,600	0.86
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	47,100	3,975.00	187,222,500	5,010.00	235,971,000	0.86
日本	株式	小松製作所	機械	99,000	1,647.00	163,053,000	2,338.00	231,462,000	0.84
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	83,700	2,505.00	209,668,500	2,706.00	226,492,200	0.83
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	898,000	171.84	154,312,320	251.00	225,398,000	0.82
日本	株式	三井不動産	不動産業	94,000	1,616.06	151,909,640	2,358.00	221,652,000	0.81

日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	409,200	285.00	116,622,000	532.00	217,694,400	0.79
日本	株式	信越化学工業	化学	38,100	4,495.00	171,259,500	5,700.00	217,170,000	0.79
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	77,500	2,149.17	166,560,675	2,618.00	202,895,000	0.74
日本	株式	KDDI	情報・通信業	28,200	6,280.00	177,096,000	6,960.00	196,272,000	0.72
日本	株式	デンソー	輸送用機器	50,100	2,464.00	123,446,400	3,890.00	194,889,000	0.71
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	66,500	1,859.00	123,623,500	2,844.00	189,126,000	0.69
日本	株式	三菱重工業	機械	340,000	352.00	119,680,000	514.00	174,760,000	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	0.08
		鉱業	0.57
		建設業	2.45
		食料品	3.91
		繊維製品	0.80
		パルプ・紙	0.30
		化学	5.67
		医薬品	5.15
		石油・石炭製品	0.79
		ゴム製品	0.94
		ガラス・土石製品	0.93
		鉄鋼	1.77
		非鉄金属	1.07
		金属製品	0.67
		機械	5.10
		電気機器	11.61
		輸送用機器	11.56
		精密機器	1.28
		その他製品	1.32
		電気・ガス業	2.15
		陸運業	4.15
		海運業	0.35
		空運業	0.55
		倉庫・運輸関連業	0.26
		情報・通信業	6.00
		卸売業	5.10
		小売業	4.04
		銀行業	10.66
		証券、商品先物取引業	1.55
		保険業	2.36
		その他金融業	1.06
		不動産業	3.31
		サービス業	2.09
合 計			99.60

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 2013年03月	買建	11	日本円	101,689,152	106,810,000	0.39

(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2013年2月28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	39,928,008,387	54.62
	カナダ	3,684,982,776	5.04
	ドイツ	2,850,253,960	3.90
	イタリア	668,203,944	0.91
	フランス	2,954,874,870	4.04
	オーストラリア	2,821,432,805	3.86
	イギリス	7,052,714,558	9.65
	スイス	3,279,034,096	4.49
	バミューダ	134,643,386	0.18
	香港	955,962,594	1.31
	シンガポール	593,567,509	0.81
	ニュージーランド	46,044,579	0.06
	オランダ	907,829,136	1.24
	スペイン	968,951,835	1.33
	ベルギー	394,439,481	0.54
	スウェーデン	1,088,596,750	1.49
	ノルウェー	259,978,586	0.36
	オーストリア	96,493,317	0.13
	ルクセンブルグ	132,332,565	0.18
	フィンランド	271,019,248	0.37
	デンマーク	393,786,451	0.54
	アイルランド	566,306,323	0.77
	ギリシャ	7,404,500	0.01
	イスラエル	177,902,233	0.24
	ポルトガル	57,443,781	0.08
	ケイマン島	63,754,458	0.09
	モーリシャス	10,455,148	0.01
	ジャージー	273,025,991	0.37
	ガーンジー	18,590,494	0.03
	小計	70,658,033,761	96.67
投資証券	アメリカ	1,140,612,184	1.56
	カナダ	8,281,981	0.01
	フランス	100,687,501	0.14
	オーストラリア	253,994,392	0.35
	イギリス	84,790,218	0.12
	香港	36,617,942	0.05
	シンガポール	31,622,667	0.04
	オランダ	8,452,296	0.01
	小計	1,665,059,181	2.28
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	772,564,459	1.06
合計（純資産総額）		73,095,657,401	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	525,849,967	0.72
	買建	ドイツ	238,586,062	0.33

(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	—	448,864,770	0.61

(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	29,896	56,412.60	1,686,511,029	41,127.17	1,229,537,895	1.68
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	147,131	8,365.68	1,230,850,761	8,282.42	1,218,600,781	1.67
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	336,563	1,966.76	661,939,520	2,161.96	727,635,305	1.00
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	62,511	10,264.91	641,669,764	10,791.29	674,574,422	0.92
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	102,963	5,972.82	614,979,311	6,416.17	660,628,317	0.90
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	34,582	17,724.92	612,963,045	18,717.55	647,290,255	0.89
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用 品	87,999	6,482.18	570,424,979	7,100.14	624,805,439	0.85
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	87,831	6,581.16	578,029,986	7,060.36	620,118,760	0.85
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	240,334	2,579.18	619,864,357	2,572.70	618,308,026	0.85
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	8,356	62,699.58	523,917,670	73,987.65	618,240,785	0.85
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	183,776	3,191.59	586,538,562	3,316.48	609,490,071	0.83
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	237,930	2,369.18	563,699,259	2,535.70	603,318,886	0.83
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	582,591	861.87	502,118,753	1,017.68	592,892,665	0.81
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	121,210	3,854.89	467,251,422	4,558.89	552,583,396	0.76
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	159,800	3,150.89	503,512,317	3,249.88	519,330,232	0.71
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	22,448	18,013.10	404,358,158	21,111.60	473,913,129	0.65
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	129,512	3,431.20	444,381,043	3,557.01	460,675,414	0.63
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノ ロジー・ライフサイエンス	73,313	5,658.98	414,877,093	6,221.89	456,145,678	0.62
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	53,748	8,115.90	436,213,516	8,458.19	454,610,758	0.62
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	124,333	2,854.86	354,953,134	3,208.25	398,890,949	0.55
アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC	食品・生活必需品小売り	59,312	6,967.85	413,277,308	6,629.27	393,195,060	0.54
アメリカ	株式	V E R I Z O N COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	90,753	4,093.57	371,503,531	4,287.84	389,134,207	0.53
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	96,953	4,283.21	415,270,349	3,975.15	385,403,173	0.53
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	605,658	604.99	366,419,880	627.38	379,979,965	0.52
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	各種金融	93,327	3,460.80	322,985,997	3,900.22	363,995,981	0.50
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	1,565,185	238.63	373,498,531	231.75	362,732,984	0.50

アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORPORATION	各種金融	343,359	854.79	293,500,663	1,045.36	358,934,794	0.49
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	118,288	2,930.93	346,693,327	3,027.08	358,067,126	0.49
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	102,486	3,260.34	334,139,020	3,480.41	356,693,647	0.49
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	49,761	6,373.01	317,127,544	6,982.65	347,463,885	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	10.89
		素材	6.50
		資本財	7.41
		商業・専門サービス	0.97
		運輸	1.83
		自動車・自動車部品	1.41
		耐久消費財・アパレル	1.42
		消費者サービス	1.65
		メディア	2.77
		小売	2.97
		食品・生活必需品小売り	2.35
		食品・飲料・タバコ	6.89
		家庭用品・パーソナル用品	1.97
		ヘルスケア機器・サービス	2.87
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.15
		銀行	7.88
		各種金融	5.08
		保険	4.36
		不動産	0.72
		ソフトウェア・サービス	6.14
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.01
		電気通信サービス	3.61
		公益事業	3.38
		半導体・半導体製造装置	1.42
投資証券	—	—	2.28
合 計			98.94

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 1303	買建	15	米ドル	5,609,175	525,849,967	0.72
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1303	買建	75	ユーロ	1,977,900	238,586,062	0.33

(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	3,829,000	329,597,243	354,107,210	0.48
	ユーロ	買建	779,000	93,709,649	94,757,560	0.13

(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2013年2月28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	28,968,424	0.34
	香港	448,095,525	5.21
	マレーシア	286,130,917	3.32
	タイ	217,878,819	2.53
	フィリピン	84,456,980	0.98
	ルクセンブルグ	4,035,622	0.05
	インドネシア	243,770,040	2.83
	メキシコ	448,737,649	5.21
	ブラジル	1,064,195,751	12.37
	チリ	157,210,487	1.83
	韓国	1,294,380,846	15.04
	台湾	890,504,754	10.35
	トルコ	156,137,189	1.81
	インド	562,857,918	6.54
	チェコ	21,356,237	0.25
	エジプト	14,446,961	0.17
	コロンビア	106,828,167	1.24
	ハンガリー	19,430,508	0.23
	モロッコ	7,029,776	0.08
	ペルー	47,901,435	0.56
	ポーランド	120,911,331	1.40
	南アフリカ	612,187,783	7.11
	ロシア	510,859,265	5.94
	中国	1,000,461,127	11.62
	ケイマン島	54,878,881	0.64
	小計	8,403,652,392	97.65
投資証券	トルコ	3,842,183	0.04
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	－	198,688,911	2.31
合計（純資産総額）		8,606,183,486	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	165,523,517	1.92

(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	2,600	112,114.73	291,498,290	131,016.60	340,643,160	3.96
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	586,355	266.42	156,214,822	326.04	191,175,184	2.22
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	145,200	1,043.76	151,553,928	1,013.45	147,153,448	1.71
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,719,920	64.67	111,234,132	73.73	126,805,229	1.47
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	130,200	886.75	115,455,490	827.04	107,680,529	1.25
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA - H	銀行	1,559,575	57.13	89,103,373	64.42	100,470,940	1.17
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	電気通信サービス	904,800	123.20	111,473,350	97.21	87,956,874	1.02
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	69,000	1,076.13	74,253,008	1,258.14	86,811,384	1.01
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	52,200	1,332.86	69,575,500	1,622.09	84,672,993	0.98
ブラジル	株式	VALE SA-PREF A	素材	48,650	1,740.96	84,697,704	1,659.06	80,713,269	0.94
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	99,200	865.33	85,840,934	786.71	78,041,433	0.91
中国	株式	BANK OF CHINA LTD - H	銀行	1,821,000	35.49	64,628,212	42.35	77,122,081	0.90
中国	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	24,400	2,743.90	66,951,160	3,151.91	76,906,506	0.89
ブラジル	株式	CIA DE BEBIDAS DAS AME-PREF	食品・飲料・タバコ	18,700	3,626.24	67,810,672	4,042.58	75,596,320	0.88
香港	株式	CNOOC LTD	エネルギー	416,000	174.77	72,706,192	178.71	74,343,942	0.86
ロシア	株式	LUKOIL OAO-SPON ADR	エネルギー	12,285	5,083.42	62,449,869	5,966.89	73,303,305	0.85
南アフリカ	株式	MTN GROUP LTD	電気通信サービス	39,515	1,411.66	55,781,586	1,840.18	72,714,839	0.84
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車部品	3,800	21,492.90	81,673,020	18,447.00	70,098,600	0.81
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	42,173	1,343.54	56,661,191	1,638.00	69,079,374	0.80
中国	株式	PETROCHINA CO LTD-H	エネルギー	511,000	125.50	64,132,339	125.98	64,376,188	0.75
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	249,533	241.72	60,316,609	254.90	63,606,959	0.74
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	9,810	4,773.47	46,827,783	6,073.16	59,577,699	0.69
南アフリカ	株式	SASOL LTD	エネルギー	12,700	3,793.34	48,175,428	3,981.88	50,569,825	0.59
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	9,835	4,178.30	41,093,541	5,035.25	49,521,698	0.58
韓国	株式	POSCO	素材	1,600	32,689.80	52,303,680	30,244.50	48,391,200	0.56
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	69,860	902.30	63,034,957	689.36	48,158,969	0.56
中国	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	169,000	231.68	39,154,021	271.41	45,867,867	0.53
韓国	株式	HYUNDAI MOBIS	自動車・自動車部品	1,720	24,950.72	42,915,238	26,340.60	45,305,832	0.53
ブラジル	株式	VALE SA	素材	25,760	1,785.89	46,004,474	1,731.60	44,606,016	0.52
インド	株式	HDFC BANK LTD	銀行	39,775	863.44	34,343,445	1,111.96	44,228,109	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	11.74
		素材	10.89
		資本財	4.76
		運輸	1.54
		自動車・自動車部品	3.70
		耐久消費財・アパレル	0.77
		消費者サービス	0.45
		メディア	1.05
		小売	1.75
		食品・生活必需品小売り	2.35
		食品・飲料・タバコ	5.34
		家庭用品・パーソナル用品	1.02
		ヘルスケア機器・サービス	0.42
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.77
		銀行	19.42
		各種金融	2.67
		保険	2.63
		不動産	1.84
		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	3.19
		電気通信サービス	7.29
		公益事業	3.37
		半導体・半導体製造装置	7.91
投資証券	—	—	0.04
合 計			97.69

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	MINMSCIE1303	買建	34	米ドル	1,805,290	165,523,517	1.92

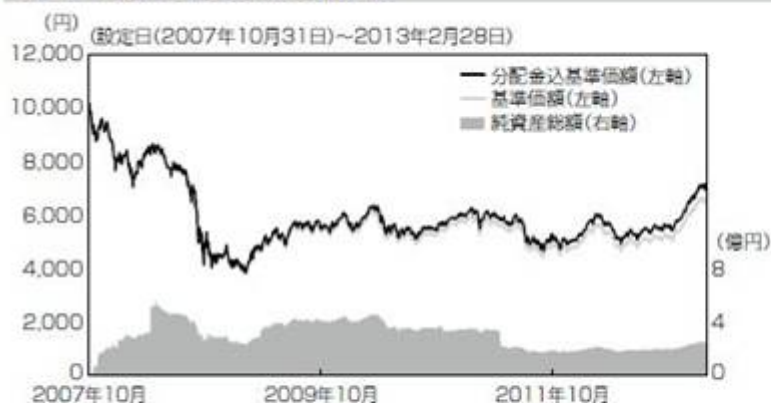
(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

(参考情報)

運用実績

2013年2月28日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額.....6,509円

純資産総額.....2.43億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

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

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2011年2月	2011年8月	2012年2月	2012年8月	2013年2月	設定来累計
40円	40円	40円	40円	50円	425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		38.4%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド		48.3%
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		12.5%
現金その他		0.8%

※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	4.5%
2 三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	銀行業	2.8%
3 本田技研工業	日本	輸送用機器	2.2%
4 三井住友フィナンシャルグループ	日本	銀行業	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

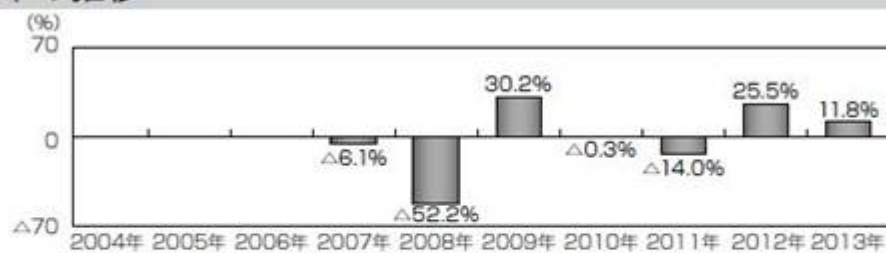
銘柄	国名	業種	比率
1 APPLE COMPUTER INC	アメリカ	テクノロジー・ハードウェア	1.7%
2 EXXON MOBIL CORP	アメリカ	エネルギー	1.7%
3 GENERAL ELECTRIC CO.	アメリカ	資本財	1.0%
4 CHEVRON CORP	アメリカ	エネルギー	0.9%

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	4.0%
2 TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	半導体・半導体製造装置	2.2%
3 CHINA MOBILE LTD	香港	電気通信サービス	1.7%
4 CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	銀行	1.5%

※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して計算しております。

※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。

※2013年は、2013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】

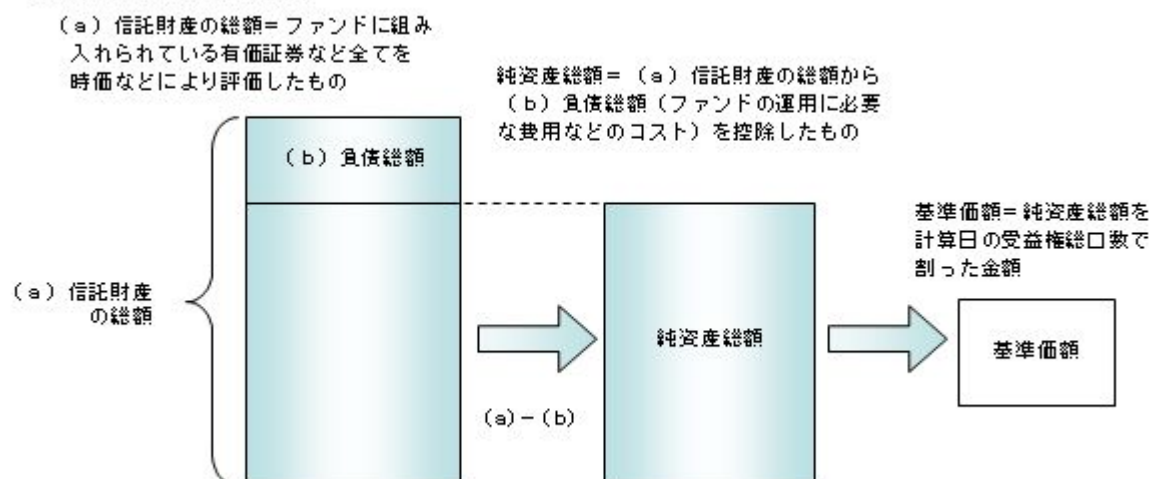
(1) 【資産の評価】

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、法令および一般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

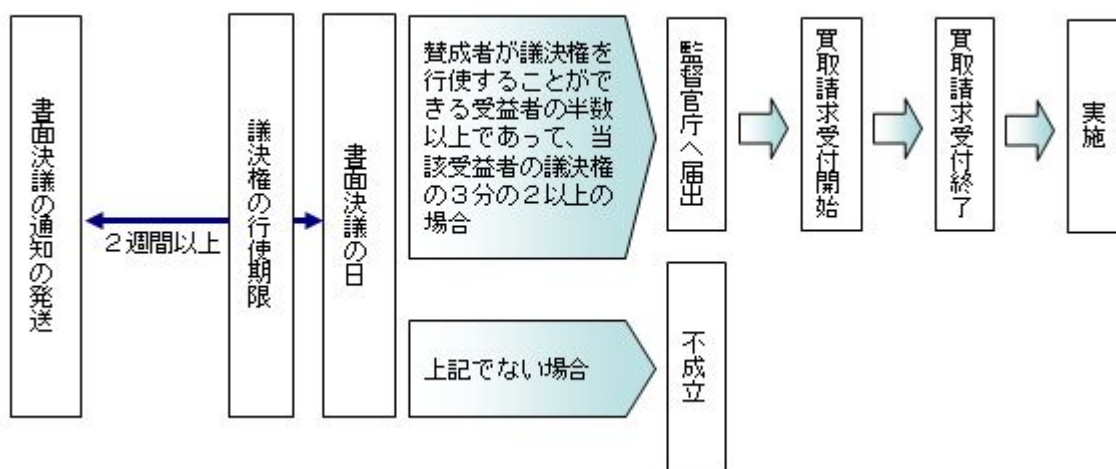
- 2) この場合、委託会社は書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）

- 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。）
- ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 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週間前までに知っ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、知っ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11期計算期間（平成24年8月16日から平成25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10期 平成24年 8 月15日現在	第11期 平成25年 2 月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,042,851	2,085,705
親投資信託受益証券	187,889,526	240,717,255
未収入金	1,900,000	2,700,000
未収利息	3	3
流動資産合計	191,832,380	245,502,963
資産合計	191,832,380	245,502,963
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,497,619	1,870,867
未払受託者報酬	50,009	54,377
未払委託者報酬	751,047	816,639
その他未払費用	180,500	103,572
流動負債合計	2,479,175	2,845,455
負債合計	2,479,175	2,845,455
純資産の部		
元本等		
元本	374,404,813	374,173,417
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△185,051,608	△131,515,909
（分配準備積立金）	1,492,974	1,729,497
元本等合計	189,353,205	242,657,508
純資産合計	189,353,205	242,657,508
負債純資産合計	191,832,380	245,502,963

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期 自 平成24年 2 月16日 至 平成24年 8 月15日	第11期 自 平成24年 8 月16日 至 平成25年 2 月15日
営業収益		
受取利息	519	476
有価証券売買等損益	△2,045,373	56,287,729
営業収益合計	△2,044,854	56,288,205
営業費用		
受託者報酬	50,009	54,377
委託者報酬	751,047	816,639
その他費用	95,248	103,572
営業費用合計	896,304	974,588
営業利益又は営業損失（△）	△2,941,158	55,313,617
経常利益又は経常損失（△）	△2,941,158	55,313,617
当期純利益又は当期純損失（△）	△2,941,158	55,313,617
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（△）	121,428	21,465
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△179,402,649	△185,051,608
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,528,040	165,984
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,528,040	165,984
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	4,616,794	51,570
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	4,616,794	51,570
分配金	1,497,619	1,870,867
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△185,051,608	△131,515,909

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		第10期 平成24年 8月15日現在	第11期 平成25年 2月15日現在
1.	期首元本額	373,148,203円	374,404,813円
	期中追加設定元本額	8,592,121円	104,328円
	期中一部解約元本額	7,335,511円	335,724円
2.	受益権の総数	374,404,813口	374,173,417口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	185,051,608円	131,515,909円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期 自 平成24年 2月16日 至 平成24年 8月15日			第11期 自 平成24年 8月16日 至 平成25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	1,938,184円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	2,108,672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	668,643円	C	信託約款に定める収益調整金	668,656円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	1,052,409円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	1,491,692円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	3,659,236円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	4,269,020円
F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0097円 97円	F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0114円 114円
G	分配金額	1,497,619円	G	分配金額	1,870,867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)	0.0050円 50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10期 自 平成24年 2月16日 至 平成24年 8月15日	第11期 自 平成24年 8月16日 至 平成25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管理部門を設置し、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10期 平成24年 8月15日現在	第11期 平成25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10期（平成24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	△2,164,070
合計	△2,164,070

第11期（平成25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	55,521,948
合計	55,521,948

（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10期 平成24年 8月15日現在		第11期 平成25年 2月15日現在	
1口当たり純資産額	0.5057円	1口当たり純資産額	0.6485円
（1万口当たり純資産額）	（5,057円）	（1万口当たり純資産額）	（6,485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	98,787,847	119,236,931	
	日本株式インデックスTOPIXマザー ファンド	120,171,431	90,380,933	
	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	23,312,887	31,099,391	
親投資信託受益証券 合計		242,272,165	240,717,255	
合計		242,272,165	240,717,255	

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

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

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

科目	対象年月日	平成24年 8月15日現在	平成25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		49,269,505	68,479,514
株式		24,209,021,805	26,877,849,160
派生商品評価勘定		1,795,505	3,555,897
未収入金		—	25,351,689
未収配当金		25,392,150	31,924,450
未収利息		92	125
流動資産合計		24,285,479,057	27,007,160,835
資産合計		24,285,479,057	27,007,160,835
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		185,086	—
前受金		1,835,000	5,675,000
未払解約金		1,503,617	37,850,188
流動負債合計		3,523,703	43,525,188
負債合計		3,523,703	43,525,188
純資産の部			
元本等			
元本		41,211,606,388	35,852,843,556
剰余金			
剰余金又は欠損金 (△)		△16,929,651,034	△8,889,207,909
元本等合計		24,281,955,354	26,963,635,647
純資産合計		24,281,955,354	26,963,635,647
負債純資産合計		24,285,479,057	27,007,160,835

(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) 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	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。

（貸借対照表に関する注記）

		平成24年 8月15日現在	平成25年 2月15日現在
1.	期首	平成24年 2月16日	平成24年 8月16日
	期首元本額	42,341,506,412円	41,211,606,388円
	期首からの追加設定元本額	2,034,735,131円	347,525,026円
	期首からの一部解約元本額	3,164,635,155円	5,706,287,858円
	元本の内訳 ※		
	DCインデックスバランス（株式20）	231,964,983円	197,733,166円
	DCインデックスバランス（株式40）	809,582,805円	726,484,408円
	DCインデックスバランス（株式60）	1,485,080,557円	1,386,752,161円
	DCインデックスバランス（株式80）	1,601,663,517円	1,602,415,136円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	976,705,367円	964,720,424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	15,390,269,087円	13,146,846,373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	17,823,094円	15,780,376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）	119,575,290円	120,171,431円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	196,065,547円	167,697,072円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	168,287,587円	133,680,401円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	274,969,416円	213,498,299円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	342,996,152円	266,297,258円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	14,785,464,642円	12,596,115,690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）	96,398,196円	83,068,082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）	119,499,609円	102,967,605円
	3資産バランスファンド（適格機関投資家向け）	44,013,426円	—円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	79,204,759円	68,365,288円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	427,858,247円	354,774,317円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,147,115,534円	990,350,278円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,469,152,406円	1,343,392,464円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,427,916,167円	1,371,733,327円
	計	41,211,606,388円	35,852,843,556円
2.	受益権の総数	41,211,606,388口	35,852,843,556口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	16,929,651,034円	8,889,207,909円
4.	担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。 株式	220,909,000円	295,239,500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24年 2月16日 至 平成24年 8月15日	自 平成24年 8月16日 至 平成25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管理部門を設置し、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24年 8月15日現在	平成25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24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	50,478,257
合計	50,478,257

(平成25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	5,738,685,272
合計	5,738,685,272

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成24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	73,165,000	—	74,800,000	1,635,000
	合計	73,165,000	—	74,800,000	1,635,000

(平成25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	71,740,000	—	75,320,000	3,580,000
	合計	71,740,000	—	75,320,000	3,580,000

(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24年 8月15日現在		平成25年 2月15日現在	
1口当たり純資産額	0.5892円	1口当たり純資産額	0.7521円
(1万口当たり純資産額)	(5,892円)	(1万口当たり純資産額)	(7,521円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

	銘 柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
1301	極洋	10,000	204.00	2,040,000	
1332	日本水産	25,200	181.00	4,561,200	
1334	マルハニチロホールディングス	45,000	151.00	6,795,000	
1377	サカタのタネ	3,400	1,087.00	3,695,800	
1379	ホクト	2,400	1,677.00	4,024,800	
1514	住石ホールディングス	7,500	83.00	622,500	
1515	日鉄鉱業	6,000	448.00	2,688,000	
1518	三井松島産業	15,000	183.00	2,745,000	
1605	国際石油開発帝石	282	499,000.00	140,718,000	
1606	日本海洋掘削	600	3,385.00	2,031,000	
1661	関東天然瓦斯開発	2,000	495.00	990,000	
1662	石油資源開発	3,300	3,515.00	11,599,500	
1414	ショーボンドホールディングス	2,100	3,130.00	6,573,000	
1417	ミライト・ホールディングス	6,600	851.00	5,616,600	
1712	ダイセキ環境ソリューション	2	124,400.00	248,800	
1719	間組	8,200	226.00	1,853,200	
1720	東急建設	8,430	197.00	1,660,710	
1721	コムシスホールディングス	11,300	1,141.00	12,893,300	
1722	ミサワホーム	2,700	1,160.00	3,132,000	
1762	高松コンストラクショングループ	1,700	1,344.00	2,284,800	
1766	東建コーポレーション	860	4,870.00	4,188,200	
1780	ヤマウラ	1,000	262.00	262,000	
1801	大成建設	117,000	258.00	30,186,000	
1802	大林組	70,000	449.00	31,430,000	
1803	清水建設	71,000	282.00	20,022,000	
1808	長谷工コーポレーション	145,500	76.00	11,058,000	
1810	松井建設	3,000	326.00	978,000	
1812	鹿島建設	102,000	266.00	27,132,000	
1813	不動テトラ	16,700	166.00	2,772,200	
1814	大末建設	10,000	60.00	600,000	
1815	鉄建建設	15,000	111.00	1,665,000	
1816	安藤建設	8,000	119.00	952,000	
1819	太平工業	4,000	348.00	1,392,000	
1820	西松建設	29,000	155.00	4,495,000	
1821	三井住友建設	32,800	72.00	2,361,600	
1822	大豊建設	7,000	118.00	826,000	
1824	前田建設工業	14,000	345.00	4,830,000	

1827	ナカノフドー建設	2,000	232.00	464,000	
1833	奥村組	20,000	372.00	7,440,000	
1834	大和小田急建設	1,500	192.00	288,000	
1835	東鉄工業	3,000	1,258.00	3,774,000	
1847	イチケン	3,000	166.00	498,000	
1852	浅沼組	8,000	66.00	528,000	
1860	戸田建設	27,000	200.00	5,400,000	
1861	熊谷組	17,000	92.00	1,564,000	
1865	青木あすなろ建設	1,500	492.00	738,000	
1866	北野建設	5,000	214.00	1,070,000	
1867	植木組	3,000	185.00	555,000	
1868	三井ホーム	3,000	471.00	1,413,000	
1870	矢作建設工業	2,900	370.00	1,073,000	
1871	ピーエス三菱	1,500	492.00	738,000	
1878	大東建託	8,800	8,210.00	72,248,000	
1879	新日本建設	2,900	229.00	664,100	
1881	N I P P O	5,000	1,201.00	6,005,000	
1882	東亜道路工業	4,000	304.00	1,216,000	
1883	前田道路	7,000	1,294.00	9,058,000	
1884	日本道路	7,000	388.00	2,716,000	
1885	東亜建設工業	20,000	126.00	2,520,000	
1888	若築建設	13,000	100.00	1,300,000	
1890	東洋建設	7,400	281.00	2,079,400	
1893	五洋建設	28,000	217.00	6,076,000	
1896	大林道路	3,000	354.00	1,062,000	
1899	福田組	4,000	368.00	1,472,000	
1911	住友林業	15,900	850.00	13,515,000	
1914	日本基礎技術	2,800	300.00	840,000	
1916	日成ビルド工業	7,000	176.00	1,232,000	
1919	エス・バイ・エル	12,000	140.00	1,680,000	
1921	巴コーポレーション	3,200	305.00	976,000	
1924	パナホーム	9,000	545.00	4,905,000	
1925	大和ハウス工業	58,000	1,597.00	92,626,000	
1926	ライト工業	5,300	421.00	2,231,300	
1928	積水ハウス	69,000	992.00	68,448,000	
1929	日特建設	2,100	349.00	732,900	
1930	北陸電気工事	1,000	267.00	267,000	
1934	ユアテック	4,000	280.00	1,120,000	
1937	西部電気工業	2,000	393.00	786,000	
1939	四電工	2,000	309.00	618,000	
1941	中電工	3,400	837.00	2,845,800	
1942	関電工	11,000	425.00	4,675,000	
1944	きんでん	16,000	592.00	9,472,000	
1945	東京エネシス	2,000	439.00	878,000	
1946	トーエネック	3,000	458.00	1,374,000	
1949	住友電設	1,600	1,121.00	1,793,600	
1950	日本電設工業	4,000	901.00	3,604,000	
1951	協和エクシオ	8,400	971.00	8,156,400	
1952	新日本空調	1,700	488.00	829,600	

1956	N D S	4,000	270.00	1,080,000	
1959	九電工	4,000	440.00	1,760,000	
1961	三機工業	5,000	469.00	2,345,000	
1963	日揮	23,000	2,327.00	53,521,000	
1964	中外炉工業	7,000	226.00	1,582,000	
1967	ヤマト	2,000	296.00	592,000	
1968	太平電業	3,000	512.00	1,536,000	
1969	高砂熱学工業	6,600	655.00	4,323,000	
1972	三晃金属工業	3,000	217.00	651,000	
1975	朝日工業社	3,000	293.00	879,000	
1979	大気社	3,300	1,776.00	5,860,800	
1980	ダイダン	3,000	495.00	1,485,000	
1982	日比谷総合設備	2,800	953.00	2,668,400	
1983	東芝プラントシステム	4,000	1,145.00	4,580,000	
6330	東洋エンジニアリング	12,000	404.00	4,848,000	
6366	千代田化工建設	17,000	1,078.00	18,326,000	
6379	新興ブランテック	4,800	690.00	3,312,000	
2001	日本製粉	14,000	385.00	5,390,000	
2002	日清製粉グループ本社	21,000	1,071.00	22,491,000	
2003	日東富士製粉	2,000	302.00	604,000	
2004	昭和産業	9,000	287.00	2,583,000	
2009	鳥越製粉	1,900	616.00	1,170,400	
2052	協同飼料	9,000	100.00	900,000	
2053	中部飼料	2,100	531.00	1,115,100	
2056	日本配合飼料	7,000	106.00	742,000	
2107	東洋精糖	4,000	97.00	388,000	
2108	日本甜菜製糖	12,000	167.00	2,004,000	
2109	三井製糖	9,000	309.00	2,781,000	
2201	森永製菓	22,000	191.00	4,202,000	
2204	中村屋	5,000	406.00	2,030,000	
2206	江崎グリコ	8,000	877.00	7,016,000	
2207	名糖産業	1,100	968.00	1,064,800	
2211	不二家	14,000	192.00	2,688,000	
2212	山崎製パン	17,000	1,043.00	17,731,000	
2215	第一屋製パン	4,000	82.00	328,000	
2217	モロゾフ	4,000	296.00	1,184,000	
2220	亀田製菓	1,300	2,085.00	2,710,500	
2229	カルビー	2,100	7,840.00	16,464,000	
2264	森永乳業	20,000	276.00	5,520,000	
2267	ヤクルト本社	13,600	3,440.00	46,784,000	
2269	明治ホールディングス	6,800	3,785.00	25,738,000	
2270	雪印メグミルク	4,500	1,375.00	6,187,500	
2281	プリマハム	13,000	164.00	2,132,000	
2282	日本ハム	18,000	1,322.00	23,796,000	
2284	伊藤ハム	13,000	419.00	5,447,000	
2286	林兼産業	8,000	72.00	576,000	
2288	丸大食品	11,000	292.00	3,212,000	
2290	米久	2,100	949.00	1,992,900	
2292	S F o o d s	1,500	868.00	1,302,000	

2501	サッポロホールディングス	38,000	300.00	11,400,000	
2502	アサヒグループホールディングス	46,600	2,131.00	99,304,600	
2503	キリンホールディングス	99,000	1,171.00	115,929,000	
2531	宝ホールディングス	18,000	766.00	13,788,000	
2533	オエノンホールディングス	6,000	229.00	1,374,000	
2540	養命酒製造	2,000	762.00	1,524,000	
2572	三国コカ・コーラボトリング	2,400	939.00	2,253,600	
2579	コカ・コーラウエスト	7,800	1,490.00	11,622,000	
2580	コカ・コーラ セントラル ジャパン	2,900	1,215.00	3,523,500	
2590	ダイドードリンコ	1,200	3,710.00	4,452,000	
2593	伊藤園	6,300	1,779.00	11,207,700	
2594	キーコーヒー	2,000	1,587.00	3,174,000	
2597	ユニカフェ	700	513.00	359,100	
2599	ジャパンフーズ	300	963.00	288,900	
2602	日清オイリオグループ	10,000	319.00	3,190,000	
2607	不二製油	5,600	1,301.00	7,285,600	
2613	J-オイルミルズ	10,000	276.00	2,760,000	
2801	キッコーマン	19,000	1,323.00	25,137,000	
2802	味の素	61,000	1,165.00	71,065,000	
2809	キューピー	11,800	1,211.00	14,289,800	
2810	ハウス食品	8,200	1,405.00	11,521,000	
2811	カゴメ	8,300	1,694.00	14,060,200	
2812	焼津水産化学工業	1,100	795.00	874,500	
2815	アリアケジャパン	2,100	1,692.00	3,553,200	
2871	ニチレイ	26,000	462.00	12,012,000	
2875	東洋水産	11,000	2,616.00	28,776,000	
2897	日清食品ホールディングス	9,000	3,490.00	31,410,000	
2899	永谷園	2,000	850.00	1,700,000	
2908	フジッコ	2,000	1,041.00	2,082,000	
2910	ロック・フィールド	1,200	1,523.00	1,827,600	
2914	日本たばこ産業	102,800	2,900.00	298,120,000	
2915	ケンコーマヨネーズ	700	846.00	592,200	
2918	わらべや日洋	1,400	1,433.00	2,006,200	
2922	なとり	1,100	900.00	990,000	
4404	ミヨシ油脂	7,000	169.00	1,183,000	
3001	片倉工業	2,700	818.00	2,208,600	
3002	グンゼ	16,000	232.00	3,712,000	
3101	東洋紡	91,000	156.00	14,196,000	
3103	ユニチカ	61,000	50.00	3,050,000	
3104	富士紡ホールディングス	10,000	265.00	2,650,000	
3105	日清紡ホールディングス	14,000	658.00	9,212,000	
3106	倉敷紡績	22,000	148.00	3,256,000	
3109	シキボウ	14,000	104.00	1,456,000	
3201	日本毛織	7,000	586.00	4,102,000	
3202	大東紡織	4,000	64.00	256,000	
3204	トーア紡コーポレーション	11,000	62.00	682,000	
3205	ダイドーリミテッド	2,400	629.00	1,509,600	
3302	帝国繊維	2,000	674.00	1,348,000	
3401	帝人	82,000	203.00	16,646,000	

3402	東レ	168,000	543.00	91,224,000	
3408	サカイオーベックス	6,000	126.00	756,000	
3501	住江織物	6,000	190.00	1,140,000	
3512	日本フェルト	1,200	415.00	498,000	
3513	イチカワ	1,000	156.00	156,000	
3514	日本バイリーン	3,000	404.00	1,212,000	
3524	日東製網	3,000	128.00	384,000	
3526	芦森工業	5,000	122.00	610,000	
3529	アツギ	19,000	105.00	1,995,000	
3551	ダイニック	4,000	170.00	680,000	
3569	セーレン	5,800	542.00	3,143,600	
3577	東海染工	4,000	99.00	396,000	
3580	小松精練	4,000	378.00	1,512,000	
3591	ワコールホールディングス	13,000	930.00	12,090,000	
3593	ホギメディカル	1,400	4,495.00	6,293,000	
3606	レナウン	5,000	133.00	665,000	
3607	クラウドシア	200	1,130.00	226,000	
3608	T S I ホールディングス	11,100	462.00	5,128,200	
8011	三陽商会	11,000	242.00	2,662,000	
8013	ナイガイ	9,000	59.00	531,000	
8016	オンワードホールディングス	14,000	714.00	9,996,000	
8029	ルック	4,000	344.00	1,376,000	
8111	ゴールドウイン	5,000	549.00	2,745,000	
8114	デサント	5,000	541.00	2,705,000	
8127	ヤマトインターナショナル	1,200	399.00	478,800	
3708	特種東海製紙	12,000	208.00	2,496,000	
3861	王子ホールディングス	96,000	297.00	28,512,000	
3864	三菱製紙	31,000	87.00	2,697,000	
3865	北越紀州製紙	13,500	429.00	5,791,500	
3877	中越パルプ工業	8,000	138.00	1,104,000	
3878	巴川製紙所	4,000	151.00	604,000	
3880	大王製紙	9,000	601.00	5,409,000	
3893	日本製紙グループ本社	10,500	1,324.00	13,902,000	
3941	レンゴー	17,000	438.00	7,446,000	
3946	トーモク	7,000	245.00	1,715,000	
3950	ザ・バック	1,500	1,480.00	2,220,000	
3405	クラレ	36,900	1,161.00	42,840,900	
3407	旭化成	135,000	538.00	72,630,000	
3553	共和レザー	1,300	285.00	370,500	
4003	コープケミカル	3,000	102.00	306,000	
4004	昭和電工	135,000	128.00	17,280,000	
4005	住友化学	149,000	272.00	40,528,000	
4007	日本化成	4,000	129.00	516,000	
4008	住友精化	4,000	311.00	1,244,000	
4021	日産化学工業	15,400	1,117.00	17,201,800	
4022	ラサ工業	8,000	111.00	888,000	
4023	クレハ	15,000	340.00	5,100,000	
4027	テイカ	4,000	251.00	1,004,000	
4028	石原産業	39,000	80.00	3,120,000	

4031	片倉チッカリン	2,000	213.00	426,000	
4041	日本曹達	13,000	413.00	5,369,000	
4042	東ソー	58,000	232.00	13,456,000	
4043	トクヤマ	32,000	200.00	6,400,000	
4044	セントラル硝子	19,000	274.00	5,206,000	
4045	東亜合成	25,000	367.00	9,175,000	
4046	ダイソー	8,000	253.00	2,024,000	
4047	関東電化工業	6,000	169.00	1,014,000	
4061	電気化学工業	43,000	329.00	14,147,000	

[次へ](#)

２【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2013年2月28日現在です。

【純資産額計算書】

I 資産総額	243,812,624 円
II 負債総額	179,918 円
III 純資産総額（I－II）	243,632,706 円
IV 発行済口数	374,274,946 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	0.6509 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	27,667,511,285 円
II 負債総額	260,714,118 円
III 純資産総額（I－II）	27,406,797,167 円
IV 発行済口数	35,195,614,476 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	0.7787 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	73,219,387,264 円
II 負債総額	123,729,863 円
III 純資産総額（I－II）	73,095,657,401 円
IV 発行済口数	61,332,377,299 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.1918 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	8,616,296,720 円
II 負債総額	10,113,234 円
III 純資産総額（I－II）	8,606,183,486 円
IV 発行済口数	6,601,026,102 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.3038 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なわないものとします。

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

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

平成25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

株主総会は、取締役・監査役の選任および定款変更に係る決議などの株式会社の基本的な方針や重要な事項の決定を行ないます。

当社は、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

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。

当社の取締役会は10名以内の取締役で構成され、取締役の任期は選任後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。

・監査役会

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

（平成25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25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25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	437	84,545
株式投資信託	372	67,102
単位型	43	938
追加型	329	66,164
公社債投資信託	65	17,442
単位型	48	529
追加型	17	16,912
投資法人合計	1	35

3【委託会社等の経理状況】

- 1．当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第53期事業年度（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：百万円）

	第52期 (平成23年 3月31日)		第53期 (平成24年 3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	※3	21,290	※3	17,352
前払費用		330		332
未収入金		4		1
未収委託者報酬		6,173		5,872
未収収益	※3	422	※3	543
関係会社短期貸付金		—		33
立替金		504		1,094
繰延税金資産		1,142		1,084
その他	※2	30	※2	30
流動資産合計		29,897		26,345
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	67	※1	66
器具備品	※1	147	※1	137
有形固定資産合計		215		203
無形固定資産				
ソフトウェア		101		72
無形固定資産合計		101		72
投資その他の資産				
投資有価証券		7,030		3,002
関係会社株式		16,225		24,320
関係会社長期貸付金		60		60
長期差入保証金		962		774
繰延税金資産		868		723
投資その他の資産合計		25,147		28,880
固定資産合計		25,463		29,156
資産合計		55,361		55,502

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

（２）【損益計算書】

(単位：百万円)

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

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

	(単位：百万円)	
	第52期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	17,363	17,363
当期末残高	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	5,220	5,220
当期末残高	5,220	5,220
その他資本剰余金		
当期首残高	4	4
当期変動額		
自己株式の処分	—	△4
当期変動額合計	—	△4
当期末残高	4	—
資本剰余金合計		
当期首残高	5,225	5,225
当期変動額		
自己株式の処分	—	△4
当期変動額合計	—	△4
当期末残高	5,225	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		
当期首残高	18,814	21,703
当期変動額		
剰余金の配当	△305	△1,502
当期純利益	3,195	2,570
自己株式の処分	—	△599
当期変動額合計	2,889	468
当期末残高	21,703	22,172
利益剰余金合計		
当期首残高	18,814	21,703
当期変動額		
剰余金の配当	△305	△1,502
当期純利益	3,195	2,570
自己株式の処分	—	△599
当期変動額合計	2,889	468
当期末残高	21,703	22,172

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

重要な会計方針

	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 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
2 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 4年～5年 器具備品 4年～20年 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。
3 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当事業年度の負担額を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当事業年度の負担額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理することとしております。
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。

追加情報

第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」等の適用 当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

第52期 (平成23年3月31日)	第53期 (平成24年3月31日)
※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N C T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 Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務112百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワーアソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務177百万円に対して保証を行っております。	※1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,012百万円 器具備品 590百万円 ※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。 ※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 5,802百万円 未収収益 217百万円 (流動負債) 未払手数料 42百万円 未払費用 259百万円 ※4 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務110百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワーアソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務138百万円に対して保証を行っております。

（損益計算書関係）

第52期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
※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	※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 743百万円

(株主資本等変動計算書関係)

第52期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	85,000	24,600	—	109,600

(注) 自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

3 新株予約権等に関する事項

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

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

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

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

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第53期（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

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

3 新株予約権等に関する事項

区分	新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年 度末残高 (百万円)
			当事業年 度期首	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
提出会社	平成21年度 ストックオプション（1）	普通株式	19,328,100	—	112,200	19,215,900	—
	平成21年度 ストックオプション（2）	普通株式	1,702,800	—	26,400	1,676,400	—
	平成22年度 ストックオプション（1）	普通株式	2,310,000	—	—	2,310,000	—
	第1回新株予約権	普通株式	—	2,955,200	—	2,955,200	—
	平成23年度 ストックオプション（1）	普通株式	—	6,101,700	9,900	6,091,800	—
合計			23,340,900	9,056,900	148,500	32,249,300	—

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

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

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

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

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(リース取引関係)

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

(金融商品関係)

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れておりますが、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23年3月31日（当期の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

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

(※)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、株式は市場価格、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

（単位：百万円）

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

(※)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、株式は市場価格、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

2 非上場株式等（貸借対照表計上額147百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)投資有価証券 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20,023百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)関係会社株式」には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

(有価証券関係)

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

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

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

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

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

(持分法損益等)

第52期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円) (1) 関連会社に対する投資の金額 2,892 (2) 持分法を適用した場合の投資の金額 4,703 (3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,054	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円) (1) 関連会社に対する投資の金額 4,407 (2) 持分法を適用した場合の投資の金額 6,834 (3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 927

(退職給付関係)

第52期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)																																																
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>△890</td></tr> <tr> <td>ロ 未積立退職給付債務</td><td>△890</td></tr> <tr> <td>ハ 未認識数理計算上の差異</td><td>72</td></tr> <tr> <td>ニ 退職給付引当金残高</td><td>△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>95</td></tr> <tr> <td>ロ 利息費用</td><td>14</td></tr> <tr> <td>ハ 数理計算上の差異の費用処理額</td><td>30</td></tr> <tr> <td>ニ 確定拠出型企業年金への掛金</td><td>165</td></tr> <tr> <td>ホ 退職給付費用合計</td><td>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>勤続期間比例</td></tr> <tr> <td>ロ 割引率</td><td>1.6%</td></tr> <tr> <td>ハ 数理計算上の差異の処理年数</td><td>10年</td></tr> </table>	イ 退職給付債務	△890	ロ 未積立退職給付債務	△890	ハ 未認識数理計算上の差異	72	ニ 退職給付引当金残高	△818	イ 勤務費用	95	ロ 利息費用	14	ハ 数理計算上の差異の費用処理額	30	ニ 確定拠出型企業年金への掛金	165	ホ 退職給付費用合計	305	イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例	ロ 割引率	1.6%	ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年	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>△985</td></tr> <tr> <td>ロ 未積立退職給付債務</td><td>△985</td></tr> <tr> <td>ハ 未認識数理計算上の差異</td><td>77</td></tr> <tr> <td>ニ 退職給付引当金残高</td><td>△907</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>97</td></tr> <tr> <td>ロ 利息費用</td><td>14</td></tr> <tr> <td>ハ 数理計算上の差異の費用処理額</td><td>27</td></tr> <tr> <td>ニ 確定拠出型企業年金への掛金</td><td>168</td></tr> <tr> <td>ホ 退職給付費用合計</td><td>307</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>勤続期間比例</td></tr> <tr> <td>ロ 割引率</td><td>1.4%</td></tr> <tr> <td>ハ 数理計算上の差異の処理年数</td><td>10年</td></tr> </table>	イ 退職給付債務	△985	ロ 未積立退職給付債務	△985	ハ 未認識数理計算上の差異	77	ニ 退職給付引当金残高	△907	イ 勤務費用	97	ロ 利息費用	14	ハ 数理計算上の差異の費用処理額	27	ニ 確定拠出型企業年金への掛金	168	ホ 退職給付費用合計	307	イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例	ロ 割引率	1.4%	ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年
イ 退職給付債務	△890																																																
ロ 未積立退職給付債務	△890																																																
ハ 未認識数理計算上の差異	72																																																
ニ 退職給付引当金残高	△818																																																
イ 勤務費用	95																																																
ロ 利息費用	14																																																
ハ 数理計算上の差異の費用処理額	30																																																
ニ 確定拠出型企業年金への掛金	165																																																
ホ 退職給付費用合計	305																																																
イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例																																																
ロ 割引率	1.6%																																																
ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年																																																
イ 退職給付債務	△985																																																
ロ 未積立退職給付債務	△985																																																
ハ 未認識数理計算上の差異	77																																																
ニ 退職給付引当金残高	△907																																																
イ 勤務費用	97																																																
ロ 利息費用	14																																																
ハ 数理計算上の差異の費用処理額	27																																																
ニ 確定拠出型企業年金への掛金	168																																																
ホ 退職給付費用合計	307																																																
イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例																																																
ロ 割引率	1.4%																																																
ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年																																																

(ストックオプション等関係)

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

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) 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 — 百万円

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

（注） 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

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	19,328,100	1,702,800
付与	0	0
失効	112,200	26,400
権利確定	0	0
権利未確定残	19,215,900	1,676,400
権利確定後(株)		
期首	—	—
権利確定	—	—
権利行使	—	—
失効	—	—
権利未行使残	—	—

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

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

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

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

当事業年度末における本源的価値の合計額 — 百万円

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

(税効果会計関係)

第52期 (平成23年3月31日)		第53期 (平成24年3月31日)	
1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		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)		(単位：百万円)	
繰延税金資産(流動)		繰延税金資産(流動)	
賞与引当金繰入超過額	886	賞与引当金繰入超過額	775
その他	255	その他	309
	1,142		1,084
繰延税金資産(固定)		繰延税金資産(固定)	
投資有価証券等評価損	60	投資有価証券等評価損	52
関係会社株式評価損	185	関係会社株式評価損	205
退職給付引当金超過額	333	退職給付引当金超過額	329
固定資産減価償却超過額	234	固定資産減価償却超過額	190
その他	99	その他	28
	912		806
繰延税金資産合計	2,054	繰延税金資産小計	1,890
		評価性引当金	△61
繰延税金負債(固定)		繰延税金資産合計	1,829
その他有価証券評価差額金	43		
繰延税金負債合計	43	繰延税金負債(固定)	
繰延税金資産の純額	2,010	その他有価証券評価差額金	22
		繰延税金負債合計	22
		繰延税金資産の純額	1,807
2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳		2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率	40.6%	法定実効税率	40.6%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	2.7%	交際費等永久に損金に算入されない項目	2.5%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△7.3%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△5.6%
海外子会社の留保利益の影響額等	0.5%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	3.8%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	36.5%	海外子会社の留保利益の影響額等	2.7%
		税効果会計適用後の法人税等の負担率	44.0%

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

（関連当事者情報）

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

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

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

(注) 1 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

(注) 1 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

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

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

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

上記の金額のうち、取引金額には消費税が含まれておりません。

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の 名称又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等の 所有(被所 有) 割合(%)	関連当事 者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残 高(百万 円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール 国	252,000	アセットマ ネジメント 業	直接 100.00	—	増資の引受 (注1)	8,095	—	—
							株式売買代金 相当額の引受 (注2)	8,095	—	—

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

住友信託銀行株式会社（非上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

（セグメント情報等）

セグメント情報

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

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

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

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

関連情報

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無い場合、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場合、記載しておりません。

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無い場合、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場合、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

該当事項はありません。

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

該当事項はありません。

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

該当事項はありません。

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

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

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

２ １株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第52期 (自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日)	第53期 (自 平成23年４月１日 至 平成24年３月31日)
１株当たり当期純利益金額		
当期純利益（百万円）	3,195	2,570
普通株主に帰属しない金額（百万円）	—	—
普通株式に係る当期純利益（百万円）	3,195	2,570
普通株式の期中平均株式数（千株）	196,926	196,278
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1) 19,328,100株、平成21年度ストックオプション(2) 1,702,800株、平成22年度ストックオプション(1)2,310,000株	平成21年度ストックオプション(1) 19,215,900株、平成21年度ストックオプション(2) 1,676,400株、平成22年度ストックオプション(1)2,310,000株、第1回新株予約権2,955,200株、平成23年度ストックオプション(1)6,091,800株

３ １株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

- 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54期中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。
なお、当社の監査法人は次のとおり、交代しております。
第53期事業年度 あらた監査法人
第54期中間会計期間 有限責任 あずさ監査法人

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第54期中間会計期間
(平成24年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金		14,955
未収委託者報酬		4,974
未収収益		529
関係会社短期貸付金		63
繰延税金資産		473
その他	※ 2	1,096

流動資産合計		22,092
--------	--	--------

固定資産

有形固定資産	※ 1	208
無形固定資産		73

投資その他の資産

投資有価証券		3,794
関係会社株式		24,340
関係会社長期貸付金		313
長期差入保証金		770
繰延税金資産		779

投資その他の資産合計		29,996
------------	--	--------

固定資産合計		30,279
--------	--	--------

資産合計		52,371
------	--	--------

(単位：百万円)

		第54期中間会計期間 (平成24年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		2,741
未払費用		2,622
未払法人税等		124
未払消費税等	※ 3	112
賞与引当金		810
役員賞与引当金		105
その他		291
流動負債合計		6,807
固定負債		
退職給付引当金		952
その他		55
固定負債合計		1,007
負債合計		7,814
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		22,055
利益剰余金合計		22,055
自己株式		△68
株主資本合計		44,571
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		△14
評価・換算差額等合計		△14
純資産合計		44,556
負債純資産合計		52,371

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第54期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)		
営業収益		
委託者報酬		24,943
その他営業収益		928
営業収益合計		25,872
営業費用及び一般管理費	※ 1	24,332
営業利益		1,540
営業外収益	※ 2	577
営業外費用	※ 3	70
経常利益		2,047
特別損失	※ 4	1
税引前中間純利益		2,046
法人税、住民税及び事業税		106
法人税等調整額		586
中間純利益		1,352

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：百万円)

	第54期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24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	17,363
資本剰余金	
資本準備金	
当期首残高	5,220
当中間期末残高	5,220
資本剰余金合計	
当期首残高	5,220
当中間期末残高	5,220
利益剰余金	
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	
当期首残高	22,172
当中間期変動額	
剰余金の配当	△1,468
中間純利益	1,352
当中間期変動額合計	△116
当中間期末残高	22,055
利益剰余金合計	
当期首残高	22,172
当中間期変動額	
剰余金の配当	△1,468
中間純利益	1,352
当中間期変動額合計	△116
当中間期末残高	22,055

(単位：百万円)

	第54期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)
自己株式	
当期首残高	△68
当中間期末残高	△68
株主資本合計	
当期首残高	44,687
当中間期変動額	
剰余金の配当	△1,468
中間純利益	1,352
当中間期変動額合計	△116
当中間期末残高	44,571
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	42
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)	△56
当中間期変動額合計	△56
当中間期末残高	△14
評価・換算差額等合計	
当期首残高	42
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)	△56
当中間期変動額合計	△56
当中間期末残高	△14
純資産合計	
当期首残高	44,729
当中間期変動額	
剰余金の配当	△1,468
中間純利益	1,352
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	△56
当中間期変動額合計	△172
当中間期末残高	44,556

会計方針の変更等

第54期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)
(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更) 当社は、法人税法の改正に伴い、当中間会計期間より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却の方法に変更しております。 この変更による当中間会計期間の損益に与える影響は軽微であります。

重要な会計方針

項目	第54期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	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
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。 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。
3 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当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)按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理することとしております。
4 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第54期中間会計期間 (平成24年9月30日)	
※1 有形固定資産の減価償却累計額	1,625百万円
※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 消費税等の取扱い	
仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。	
※4 保証債務	
当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務91百万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37百万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54期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)	
※1 減価償却実施額	
有形固定資産	44百万円
無形固定資産	12百万円
※2 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	4百万円
受取配当金	570百万円
※3 営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	9百万円
時効成立後支払分配金・償還金	1百万円
支払源泉所得税	55百万円
※4 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54期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24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	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
普通株式（株）	197,012,500	—	—	197,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	109,600	—	—	109,600

3 新株予約権等に関する事項

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	19,215,900	—	2,237,400	16,978,500	—
平成21年度 ストックオプション（2）	普通株式	1,676,400	—	49,500	1,626,900	—
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	—
平成23年度 ストックオプション（1）	普通株式	6,091,800	—	158,400	5,933,400	—
合計		32,249,300	—	2,445,300	29,804,000	—

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

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24年5月28日 取締役会	普通株式	1,468	7.46	平成24年3月31日	平成24年6月19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54期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)	
オペレーティング・リース取引	
解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	740百万円
1年超	1,178百万円
合計	1,918百万円

(金融商品関係)

第54期中間会計期間(平成24年9月30日)

1 金融商品の時価等に関する事項

平成24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、次表には含めておりません（（注）2をご参照ください。）。

(単位：百万円)

	中間貸借対照表 計上額(※)	時価(※)	差額
(1) 現金及び預金	14,955	14,955	—
(2) 未収委託者報酬	4,974	4,974	—
(3) 未収収益	529	529	—
(4) 投資有価証券 その他有価証券	3,646	3,646	—
(5) 関係会社株式 関連会社株式	1,404	1,523	119
(6) 未払金	(2,741)	(2,741)	—
(7) 未払費用	(2,622)	(2,622)	—

(※)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、株式は市場価格、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

3 子会社株式（中間貸借対照表計上額20,042百万円）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54期中間会計期間(平成24年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額	時 価	差 額
関連会社株式	1,404	1,523	119
合 計	1,404	1,523	119

(注) 子会社株式（中間貸借対照表計上額20,042百万円）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

(単位：百万円)

	種 類	中間貸借対照表計上額	取 得 原 価	差 額
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの	株 式	29	7	22
	そ の 他	1,670	1,505	165
	小 計	1,700	1,512	187
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	1,946	2,157	△211
	小 計	1,946	2,157	△211
合 計		3,646	3,670	△23

(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54期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24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	
(1) 関連会社に対する投資の金額	4,297百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	6,089百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	323百万円

（ストックオプション等関係）

第54期中間会計期間(自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

セグメント情報

第54期中間会計期間(自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)

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

関連情報

第54期中間会計期間(自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無い場合、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場合、記載しておりません。

（１株当たり情報）

項目	第54期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)
1株当たり純資産額	226円28銭
1株当たり中間純利益金額	6円86銭

(注) 1 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、新株予約権等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。

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第54期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)
1株当たり中間純利益金額	
中間純利益（百万円）	1,352
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）	1,352
普通株式の期中平均株式数（千株）	196,903
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金額の算定に含ま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）16,978,500株、平成21年度ストックオプション（2）1,626,900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、平成23年度ストックオプション（1）5,933,400株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第54期中間会計期間 (平成24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）	44,556
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	—
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額（百万円）	44,556
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数（千株）	196,903

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常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24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24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24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24年11月15日	有価証券報告書
平成24年11月15日	有価証券届出書の訂正届出書

4063	信越化学工業	38,900	5,550.00	215,895,000	
4064	日本カーバイド工業	6,000	398.00	2,388,000	
4078	堺化学工業	8,000	253.00	2,024,000	
4088	エア・ウォーター	18,000	1,202.00	21,636,000	
4091	大陽日酸	28,000	626.00	17,528,000	
4092	日本化学工業	8,000	111.00	888,000	
4095	日本パーカライジング	5,000	1,450.00	7,250,000	
4097	高压ガス工業	3,000	498.00	1,494,000	
4099	四国化成工業	3,000	615.00	1,845,000	
4100	戸田工業	3,000	311.00	933,000	
4109	ステラ ケミファ	1,000	1,725.00	1,725,000	
4112	保土谷化学工業	5,000	161.00	805,000	
4114	日本触媒	16,000	864.00	13,824,000	
4116	大日精化工業	8,000	403.00	3,224,000	
4118	カネカ	27,000	490.00	13,230,000	
4182	三菱瓦斯化学	34,000	638.00	21,692,000	
4183	三井化学	92,000	201.00	18,492,000	
4185	J S R	21,400	1,805.00	38,627,000	
4186	東京応化工業	4,200	1,906.00	8,005,200	
4187	大阪有機化学工業	1,500	370.00	555,000	
4188	三菱ケミカルホールディングス	135,500	405.00	54,877,500	
4201	日本合成化学工業	4,000	678.00	2,712,000	
4202	ダイセル	26,000	668.00	17,368,000	
4203	住友ベークライト	17,000	380.00	6,460,000	
4204	積水化学工業	45,000	842.00	37,890,000	
4205	日本ゼオン	19,000	822.00	15,618,000	
4206	アイカ工業	6,100	1,506.00	9,186,600	
4208	宇部興産	104,000	186.00	19,344,000	
4212	積水樹脂	3,000	1,085.00	3,255,000	
4215	タキロン	5,000	309.00	1,545,000	
4216	旭有機材工業	8,000	207.00	1,656,000	
4217	日立化成	9,400	1,298.00	12,201,200	
4218	ニチバン	2,000	290.00	580,000	
4220	リケンテクノス	4,000	254.00	1,016,000	
4221	大倉工業	5,000	358.00	1,790,000	
4228	積水化成成品工業	6,000	211.00	1,266,000	
4229	群栄化学工業	6,000	208.00	1,248,000	
4231	タイガースポリマー	1,100	324.00	356,400	
4238	ミライアル	500	1,674.00	837,000	
4271	日本カーリット	1,800	451.00	811,800	
4272	日本化薬	15,000	1,034.00	15,510,000	
4362	日本精化	1,800	574.00	1,033,200	
4401	A D E K A	9,300	818.00	7,607,400	
4403	日油	17,000	402.00	6,834,000	
4410	ハリマ化成グループ	1,900	425.00	807,500	
4452	花王	57,400	2,850.00	163,590,000	
4461	第一工業製薬	4,000	228.00	912,000	
4471	三洋化成工業	7,000	478.00	3,346,000	
4611	大日本塗料	12,000	155.00	1,860,000	

4612	日本ペイント	19,000	835.00	15,865,000	
4613	関西ペイント	24,000	963.00	23,112,000	
4614	トウペ	2,000	124.00	248,000	
4617	中国塗料	7,000	472.00	3,304,000	
4619	日本特殊塗料	1,700	370.00	629,000	
4620	藤倉化成	2,600	367.00	954,200	
4626	太陽ホールディングス	1,700	2,654.00	4,511,800	
4631	D I C	77,000	177.00	13,629,000	
4633	サカタインクス	4,000	484.00	1,936,000	
4634	東洋インキ S Cホールディングス	19,000	390.00	7,410,000	
4901	富士フイルムホールディングス	46,300	1,773.00	82,089,900	
4911	資生堂	38,600	1,206.00	46,551,600	
4912	ライオン	25,000	465.00	11,625,000	
4914	高砂香料工業	7,000	466.00	3,262,000	
4917	マンダム	2,300	2,744.00	6,311,200	
4919	ミルボン	1,100	2,915.00	3,206,500	
4921	ファンケル	5,500	1,005.00	5,527,500	
4922	コーセー	3,900	1,954.00	7,620,600	
4924	ドクターシーラボ	15	261,100.00	3,916,500	
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	2,600	2,735.00	7,111,000	
4928	ノエビアホールディングス	1,300	1,375.00	1,787,500	
4951	エスター	1,300	971.00	1,262,300	
4956	コニシ	1,600	1,607.00	2,571,200	
4958	長谷川香料	2,700	1,131.00	3,053,700	
4963	星光PMC	900	344.00	309,600	
4967	小林製薬	3,300	4,395.00	14,503,500	
4968	荒川化学工業	1,700	679.00	1,154,300	
4971	メック	1,600	452.00	723,200	
4973	日本高純度化学	6	225,000.00	1,350,000	
4975	J C U	300	3,450.00	1,035,000	
4977	新田ゼラチン	900	833.00	749,700	
4985	アース製薬	1,500	2,973.00	4,459,500	
4989	イハラケミカル工業	4,000	441.00	1,764,000	
4992	北興化学工業	2,000	253.00	506,000	
4994	大成ラミック	600	2,423.00	1,453,800	
4996	クミアイ化学工業	4,000	468.00	1,872,000	
4997	日本農薬	5,000	568.00	2,840,000	
5142	アキレス	18,000	125.00	2,250,000	
5208	有沢製作所	3,500	311.00	1,088,500	
6988	日東電工	17,900	5,270.00	94,333,000	
7874	レック	700	1,215.00	850,500	
7908	きもと	2,000	825.00	1,650,000	
7917	藤森工業	1,700	2,043.00	3,473,100	
7925	前澤化成工業	1,500	874.00	1,311,000	
7942	J S P	1,400	1,264.00	1,769,600	
7947	エフピコ	1,100	5,750.00	6,325,000	
7958	天馬	1,700	937.00	1,592,900	
7970	信越ポリマー	4,300	352.00	1,513,600	
7971	東リ	6,000	205.00	1,230,000	

7988	ニフコ	4,800	1,910.00	9,168,000	
7995	日本バルカー工業	9,000	224.00	2,016,000	
8113	ユニ・チャーム	12,000	5,300.00	63,600,000	
4151	協和発酵キリン	26,000	872.00	22,672,000	
4502	武田薬品工業	81,200	4,660.00	378,392,000	代用有価証券 10,000株
4503	アステラス製薬	48,100	4,910.00	236,171,000	
4506	大日本住友製薬	15,300	1,226.00	18,757,800	
4507	塩野義製薬	31,600	1,702.00	53,783,200	
4508	田辺三菱製薬	18,000	1,261.00	22,698,000	
4512	わかもと製薬	3,000	232.00	696,000	
4514	あすか製薬	3,000	569.00	1,707,000	
4516	日本新薬	5,000	1,174.00	5,870,000	
4519	中外製薬	25,100	1,942.00	48,744,200	
4521	科研製薬	8,000	1,477.00	11,816,000	
4523	エーザイ	26,700	3,845.00	102,661,500	
4527	ロート製薬	9,000	1,185.00	10,665,000	
4528	小野薬品工業	10,600	4,800.00	50,880,000	
4530	久光製薬	6,700	5,090.00	34,103,000	
4531	有機合成薬品工業	2,000	234.00	468,000	
4534	持田製薬	8,000	1,085.00	8,680,000	
4536	参天製薬	7,400	3,965.00	29,341,000	
4538	扶桑薬品工業	7,000	341.00	2,387,000	
4539	日本ケミファ	3,000	575.00	1,725,000	
4540	ツムラ	5,900	3,150.00	18,585,000	
4541	日医工	3,200	1,851.00	5,923,200	
4547	キッセイ薬品工業	4,000	1,741.00	6,964,000	
4548	生化学工業	4,100	953.00	3,907,300	
4549	栄研化学	1,500	1,220.00	1,830,000	
4550	日水製薬	900	938.00	844,200	
4551	鳥居薬品	1,300	2,078.00	2,701,400	
4553	東和薬品	1,100	4,855.00	5,340,500	
4554	富士製薬工業	600	1,619.00	971,400	
4555	沢井製薬	1,400	9,740.00	13,636,000	
4559	ゼリア新薬工業	3,000	1,378.00	4,134,000	
4568	第一三共	68,300	1,593.00	108,801,900	
4569	キョーリン製薬ホールディングス	5,800	1,919.00	11,130,200	
4574	大幸薬品	1,000	836.00	836,000	
4577	ダイト	600	1,348.00	808,800	
4578	大塚ホールディングス	43,000	2,913.00	125,259,000	
4581	大正製薬ホールディングス	5,200	6,240.00	32,448,000	
3315	日本コークス工業	18,000	116.00	2,088,000	
5002	昭和シェル石油	19,400	589.00	11,426,600	
5007	コスモ石油	60,000	192.00	11,520,000	
5011	ニチレキ	3,000	545.00	1,635,000	
5012	東燃ゼネラル石油	33,000	790.00	26,070,000	
5013	ユシロ化学工業	1,200	850.00	1,020,000	
5015	ビービー・カストロール	800	385.00	308,000	
5017	AOCホールディングス	5,100	351.00	1,790,100	

5018	MORESCO	400	814.00	325,600	
5019	出光興産	2,600	7,780.00	20,228,000	
5020	JXホールディングス	240,400	520.00	125,008,000	
5101	横浜ゴム	24,000	787.00	18,888,000	
5105	東洋ゴム工業	18,000	353.00	6,354,000	
5108	ブリヂストン	67,900	2,485.00	168,731,500	
5110	住友ゴム工業	16,900	1,324.00	22,375,600	
5121	藤倉ゴム工業	1,300	256.00	332,800	
5122	オカモト	8,000	302.00	2,416,000	
5185	フコク	900	750.00	675,000	
5186	ニッタ	2,100	1,584.00	3,326,400	
5191	東海ゴム工業	4,000	990.00	3,960,000	
5192	三ツ星ベルト	5,000	469.00	2,345,000	
5195	バンドー化学	7,000	285.00	1,995,000	
3110	日東紡績	16,000	340.00	5,440,000	
5201	旭硝子	107,000	637.00	68,159,000	
5202	日本板硝子	99,000	114.00	11,286,000	
5204	石塚硝子	3,000	144.00	432,000	
5210	日本山村硝子	9,000	171.00	1,539,000	
5214	日本電気硝子	38,000	446.00	16,948,000	
5218	オハラ	800	656.00	524,800	
5232	住友大阪セメント	38,000	268.00	10,184,000	
5233	太平洋セメント	119,000	216.00	25,704,000	
5234	デイ・シイ	2,300	286.00	657,800	
5262	日本ヒューム	2,000	504.00	1,008,000	
5269	日本コンクリート工業	4,000	292.00	1,168,000	
5288	ジャパンパイル	1,600	536.00	857,600	
5301	東海カーボン	19,000	337.00	6,403,000	
5302	日本カーボン	11,000	186.00	2,046,000	
5310	東洋炭素	1,200	2,118.00	2,541,600	
5331	ノリタケカンパニーリミテド	11,000	213.00	2,343,000	
5332	TOTO	33,000	796.00	26,268,000	
5333	日本碍子	28,000	952.00	26,656,000	
5334	日本特殊陶業	19,000	1,211.00	23,009,000	
5337	ダントーホールディングス	3,000	97.00	291,000	
5344	MARUWA	500	2,251.00	1,125,500	
5351	品川リフラクトリーズ	5,000	196.00	980,000	
5352	黒崎播磨	5,000	218.00	1,090,000	
5363	東京窯業	3,000	167.00	501,000	
5367	ニッカトー	700	398.00	278,600	
5384	フジミインコーポレーテッド	2,000	1,360.00	2,720,000	
5391	エーアンドエーマテリアル	5,000	78.00	390,000	
5393	ニチアス	10,000	484.00	4,840,000	
7943	ニチハ	2,400	1,186.00	2,846,400	
5401	新日鐵住金	916,000	252.00	230,832,000	
5406	神戸製鋼所	300,000	128.00	38,400,000	
5410	合同製鐵	12,000	175.00	2,100,000	
5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	55,300	2,083.00	115,189,900	
5413	日新製鋼ホールディングス	9,200	761.00	7,001,200	

5423	東京製鐵	12,000	473.00	5,676,000	
5440	共英製鋼	2,000	1,623.00	3,246,000	
5444	大和工業	4,500	2,651.00	11,929,500	
5445	東京鐵鋼	4,000	380.00	1,520,000	
5449	大阪製鐵	1,100	1,555.00	1,710,500	
5451	淀川製鋼所	15,000	353.00	5,295,000	
5453	東洋鋼鈑	5,000	296.00	1,480,000	
5457	住友鋼管	1,500	730.00	1,095,000	
5463	丸一鋼管	7,200	2,256.00	16,243,200	
5464	モリ工業	3,000	264.00	792,000	
5471	大同特殊鋼	33,000	450.00	14,850,000	
5476	日本高周波鋼業	9,000	88.00	792,000	
5480	日本冶金工業	16,000	110.00	1,760,000	
5481	山陽特殊製鋼	11,000	340.00	3,740,000	
5482	愛知製鋼	11,000	387.00	4,257,000	
5486	日立金属	15,000	876.00	13,140,000	
5491	日本金属	6,000	120.00	720,000	
5541	大平洋金属	14,000	490.00	6,860,000	
5563	日本電工	9,000	292.00	2,628,000	
5602	栗本鐵工所	10,000	311.00	3,110,000	
5612	日本鑄鉄管	3,000	238.00	714,000	
5632	三菱製鋼	13,000	181.00	2,353,000	
5658	日亜鋼業	3,000	233.00	699,000	
5659	日本精線	1,000	322.00	322,000	
6319	シンニッタン	1,700	369.00	627,300	
7305	新家工業	5,000	116.00	580,000	
5702	大紀アルミニウム工業所	4,000	202.00	808,000	
5703	日本軽金属ホールディングス	45,800	104.00	4,763,200	
5706	三井金属鉱業	55,000	228.00	12,540,000	
5707	東邦亜鉛	12,000	379.00	4,548,000	
5711	三菱マテリアル	127,000	276.00	35,052,000	
5713	住友金属鉱山	56,000	1,522.00	85,232,000	
5714	DOWAホールディングス	24,000	641.00	15,384,000	
5715	古河機械金属	37,000	95.00	3,515,000	
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	2,200	1,840.00	4,048,000	
5727	東邦チタニウム	3,700	793.00	2,934,100	
5738	住友軽金属工業	53,000	86.00	4,558,000	
5741	古河スカイ	7,000	247.00	1,729,000	
5801	古河電気工業	68,000	195.00	13,260,000	
5802	住友電気工業	76,500	1,040.00	79,560,000	
5803	フジクラ	35,000	261.00	9,135,000	
5805	昭和電線ホールディングス	28,000	76.00	2,128,000	
5809	タツタ電線	4,000	627.00	2,508,000	
5812	日立電線	17,000	147.00	2,499,000	
5815	沖電線	2,000	130.00	260,000	
5819	カナレ電気	300	1,299.00	389,700	
5821	平河ヒューテック	500	812.00	406,000	
5851	リョービ	12,000	227.00	2,724,000	
5857	アサヒホールディングス	3,300	1,679.00	5,540,700	

3421	稲葉製作所	1,000	1,045.00	1,045,000	
3431	宮地エンジニアリンググループ	7,000	147.00	1,029,000	
3433	トーカロ	1,200	1,297.00	1,556,400	
3434	アルファC o	700	1,044.00	730,800	
3436	SUMCO	13,300	895.00	11,903,500	
3443	川田テクノロジーズ	500	1,744.00	872,000	
5901	東洋製罐	15,400	1,275.00	19,635,000	
5902	ホッカンホールディングス	5,000	271.00	1,355,000	
5909	コロナ	1,000	1,106.00	1,106,000	
5911	横河ブリッジホールディングス	4,000	778.00	3,112,000	

[次へ](#)

5915	駒井ハルテック	5,000	235.00	1,175,000	
5923	高田機工	2,000	187.00	374,000	
5929	三和ホールディングス	20,000	416.00	8,320,000	
5930	文化シャッター	6,000	408.00	2,448,000	
5932	三協立山	2,800	1,686.00	4,720,800	
5936	東洋シャッター	700	459.00	321,300	
5938	L I X I Lグループ	30,200	1,995.00	60,249,000	
5942	日本フィルコン	1,600	363.00	580,800	
5943	ノーリツ	4,200	1,706.00	7,165,200	
5946	長府製作所	2,100	1,843.00	3,870,300	
5947	リンナイ	3,500	6,500.00	22,750,000	
5951	ダイニチ工業	1,100	811.00	892,100	
5957	日東精工	3,000	266.00	798,000	
5958	三洋工業	3,000	173.00	519,000	
5959	岡部	4,300	663.00	2,850,900	
5974	中国工業	4,000	82.00	328,000	
5975	東プレ	4,200	814.00	3,418,800	
5976	高周波熱錬	2,900	663.00	1,922,700	
5981	東京製綱	15,000	107.00	1,605,000	
5988	パイオラックス	900	2,347.00	2,112,300	
5991	日本発條	15,700	780.00	12,246,000	
5992	中央発條	3,000	300.00	900,000	
5998	アドバネクス	5,000	87.00	435,000	
8155	三益半導体工業	1,800	718.00	1,292,400	
1978	アタカ大機	2,000	318.00	636,000	
5631	日本製鋼所	33,000	475.00	15,675,000	
6005	三浦工業	3,200	2,200.00	7,040,000	
6013	タクマ	7,000	583.00	4,081,000	
6101	ツガミ	6,000	523.00	3,138,000	
6103	オークマ	14,000	688.00	9,632,000	
6104	東芝機械	11,000	456.00	5,016,000	
6113	アマダ	33,000	559.00	18,447,000	
6118	アイダエンジニアリング	5,100	678.00	3,457,800	
6135	牧野フライス製作所	10,000	620.00	6,200,000	
6136	オーエスジー	8,900	1,223.00	10,884,700	
6138	ダイジェット工業	3,000	146.00	438,000	
6140	旭ダイヤモンド工業	5,400	840.00	4,536,000	
6141	森精機製作所	11,500	959.00	11,028,500	
6146	ディスコ	2,400	5,330.00	12,792,000	
6151	日東工器	1,200	1,778.00	2,133,600	
6203	豊和工業	13,000	98.00	1,274,000	
6205	大阪機工	9,000	131.00	1,179,000	
6210	東洋機械金属	1,800	215.00	387,000	
6217	津田駒工業	6,000	153.00	918,000	
6222	島精機製作所	2,800	1,789.00	5,009,200	
6247	日阪製作所	3,000	817.00	2,451,000	
6250	やまびこ	800	1,640.00	1,312,000	
6262	ペガサスミシン製造	2,100	183.00	384,300	
6268	ナブテスコ	10,700	1,814.00	19,409,800	

6269	三井海洋開発	1,800	1,996.00	3,592,800	
6272	レオン自動機	2,000	193.00	386,000	
6273	SMC	6,500	15,900.00	103,350,000	
6274	新川	1,800	442.00	795,600	
6277	ホソカワミクロン	4,000	665.00	2,660,000	
6278	ユニオンツール	1,200	1,771.00	2,125,200	
6282	オイレス工業	2,300	1,751.00	4,027,300	
6287	サトーホールディングス	2,200	1,441.00	3,170,200	
6291	日本エアーテック	700	416.00	291,200	
6293	日精樹脂工業	1,600	504.00	806,400	
6298	ワイエイシイ	800	478.00	382,400	
6301	小松製作所	101,100	2,398.00	242,437,800	
6302	住友重機械工業	59,000	378.00	22,302,000	
6305	日立建機	11,100	2,129.00	23,631,900	
6306	日工	3,000	347.00	1,041,000	
6309	巴工業	800	1,753.00	1,402,400	
6310	井関農機	21,000	244.00	5,124,000	
6315	TOWA	1,900	489.00	929,100	
6316	丸山製作所	5,000	169.00	845,000	
6317	北川鉄工所	10,000	146.00	1,460,000	
6326	クボタ	116,000	1,040.00	120,640,000	
6328	荏原実業	500	1,276.00	638,000	
6331	三菱化工機	7,000	143.00	1,001,000	
6332	月島機械	3,000	792.00	2,376,000	
6333	帝国電機製作所	700	1,646.00	1,152,200	
6339	新東工業	4,400	782.00	3,440,800	
6340	澁谷工業	1,300	836.00	1,086,800	
6345	アイチ コーポレーション	3,600	440.00	1,584,000	
6349	小森コーポレーション	5,300	872.00	4,621,600	
6351	鶴見製作所	1,000	746.00	746,000	
6355	住友精密工業	3,000	407.00	1,221,000	
6358	酒井重工業	4,000	274.00	1,096,000	
6361	荏原製作所	41,000	402.00	16,482,000	
6362	石井鐵工所	3,000	184.00	552,000	
6363	西島製作所	2,500	716.00	1,790,000	
6367	ダイキン工業	28,200	3,425.00	96,585,000	
6368	オルガノ	4,000	492.00	1,968,000	
6369	トーヨーカネツ	12,000	226.00	2,712,000	
6370	栗田工業	11,900	1,810.00	21,539,000	
6371	椿本チエイン	11,000	487.00	5,357,000	
6373	大同工業	4,000	139.00	556,000	
6375	日本コンベヤ	7,000	84.00	588,000	
6378	木村化工機	2,100	349.00	732,900	
6381	アネスト岩田	3,000	369.00	1,107,000	
6383	ダイフク	9,500	620.00	5,890,000	
6390	加藤製作所	5,000	280.00	1,400,000	
6393	油研工業	4,000	150.00	600,000	
6395	タダノ	10,000	865.00	8,650,000	
6406	フジテック	6,000	660.00	3,960,000	

6407	CKD	5,800	604.00	3,503,200	
6409	キトー	13	78,300.00	1,017,900	
6412	平和	4,500	1,672.00	7,524,000	
6413	理想科学工業	1,500	1,895.00	2,842,500	
6417	SANKYO	6,300	3,830.00	24,129,000	
6418	日本金銭機械	1,900	774.00	1,470,600	
6419	マースエンジニアリング	1,200	1,827.00	2,192,400	
6420	福島工業	600	2,068.00	1,240,800	
6428	オーイズミ	800	413.00	330,400	
6430	ダイコク電機	800	2,250.00	1,800,000	
6436	アマノ	6,200	858.00	5,319,600	
6440	JUKI	14,000	134.00	1,876,000	
6444	サンデン	12,000	388.00	4,656,000	
6445	蛇の目ミシン工業	20,000	74.00	1,480,000	
6454	マックス	3,000	1,088.00	3,264,000	
6457	グローリー	6,200	2,022.00	12,536,400	
6459	大和冷機工業	3,000	520.00	1,560,000	
6460	セガサミーホールディングス	22,200	1,520.00	33,744,000	
6461	日本ビストンリング	8,000	176.00	1,408,000	
6462	リケン	8,000	353.00	2,824,000	
6463	T P R	2,300	1,242.00	2,856,600	
6465	ホシザキ電機	4,500	2,714.00	12,213,000	
6470	大豊工業	1,500	1,131.00	1,696,500	
6471	日本精工	46,000	670.00	30,820,000	
6472	NTN	45,000	252.00	11,340,000	
6473	ジェイテクト	22,000	904.00	19,888,000	
6474	不二越	19,000	370.00	7,030,000	
6480	日本トムソン	7,000	381.00	2,667,000	
6481	THK	13,800	1,706.00	23,542,800	
6482	ユーシン精機	1,000	1,549.00	1,549,000	
6485	前澤給装工業	800	1,223.00	978,400	
6486	イーグル工業	3,000	802.00	2,406,000	
6489	前澤工業	1,600	217.00	347,200	
6490	日本ビラー工業	2,000	694.00	1,388,000	
6498	キッツ	8,500	438.00	3,723,000	
6581	日立工機	5,500	777.00	4,273,500	
6586	マキタ	12,600	4,075.00	51,345,000	
7004	日立造船	82,000	133.00	10,906,000	
7011	三菱重工業	347,000	504.00	174,888,000	
7013	I H I	141,000	243.00	34,263,000	
4062	イビデン	12,600	1,395.00	17,577,000	
4902	コニカミノルタホールディングス	54,500	660.00	35,970,000	
6448	ブラザー工業	26,800	938.00	25,138,400	
6479	ミネベア	28,000	300.00	8,400,000	
6501	日立製作所	488,000	517.00	252,296,000	
6502	東芝	409,000	401.00	164,009,000	
6503	三菱電機	207,000	770.00	159,390,000	
6504	富士電機	62,000	248.00	15,376,000	
6505	東洋電機製造	4,000	235.00	940,000	

6506	安川電機	23,000	846.00	19,458,000	
6507	シンフォニアテクノロジー	12,000	153.00	1,836,000	
6508	明電舎	21,000	277.00	5,817,000	
6513	オリジン電気	3,000	380.00	1,140,000	
6517	デンヨー	2,000	1,074.00	2,148,000	
6588	東芝テック	13,000	488.00	6,344,000	
6590	芝浦メカトロニクス	4,000	195.00	780,000	
6592	マブチモーター	3,100	4,270.00	13,237,000	
6594	日本電産	11,200	5,280.00	59,136,000	
6617	東光高岳ホールディングス	1,100	1,477.00	1,624,700	
6620	宮越ホールディングス	800	320.00	256,000	
6622	ダイヘン	11,000	264.00	2,904,000	
6630	ヤーマン	200	1,216.00	243,200	
6632	JVCケンウッド	12,700	254.00	3,225,800	
6640	第一精工	700	1,320.00	924,000	
6641	日新電機	4,000	456.00	1,824,000	
6644	大崎電気工業	3,000	436.00	1,308,000	
6645	オムロン	23,000	2,120.00	48,760,000	
6651	日東工業	3,000	1,398.00	4,194,000	
6652	I D E C	2,700	800.00	2,160,000	
6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	40,000	324.00	12,960,000	
6675	サクサホールディングス	5,000	167.00	835,000	
6676	メルコホールディングス	1,300	1,562.00	2,030,600	
6678	テクノメディカ	1	480,000.00	480,000	
6701	日本電気	268,000	228.00	61,104,000	
6702	富士通	199,000	407.00	80,993,000	
6703	沖電気工業	76,000	100.00	7,600,000	
6704	岩崎通信機	9,000	71.00	639,000	
6706	電気興業	5,000	372.00	1,860,000	
6707	サンケン電気	11,000	339.00	3,729,000	
6715	ナカヨ通信機	2,000	255.00	510,000	
6718	アイホン	1,200	1,469.00	1,762,800	
6723	ルネサスエレクトロニクス	5,400	245.00	1,323,000	
6724	セイコーエプソン	14,200	886.00	12,581,200	
6727	ワコム	38	295,300.00	11,221,400	
6728	アルバック	3,500	887.00	3,104,500	
6730	アクセル	1,000	2,003.00	2,003,000	
6737	ナナオ	1,700	1,488.00	2,529,600	
6741	日本信号	5,200	673.00	3,499,600	
6742	京三製作所	5,000	290.00	1,450,000	
6744	能美防災	3,000	643.00	1,929,000	
6745	ホーチキ	2,000	427.00	854,000	
6751	日本無線	4,000	271.00	1,084,000	
6752	パナソニック	236,400	665.00	157,206,000	
6753	シャープ	107,000	315.00	33,705,000	
6754	アンリツ	11,000	1,272.00	13,992,000	
6755	富士通ゼネラル	5,000	769.00	3,845,000	
6756	日立国際電気	5,000	771.00	3,855,000	
6758	ソニー	130,100	1,313.00	170,821,300	

6762	T D K	11,700	3,275.00	38,317,500	
6763	帝国通信工業	5,000	164.00	820,000	
6767	ミツミ電機	7,900	549.00	4,337,100	
6768	タムラ製作所	8,000	182.00	1,456,000	
6770	アルプス電気	15,300	637.00	9,746,100	
6771	池上通信機	7,000	63.00	441,000	
6773	パイオニア	25,300	203.00	5,135,900	
6779	日本電波工業	1,800	961.00	1,729,800	

[次へ](#)

6788	日本トリム	300	2,687.00	806,100	
6789	ローランド ディー. ジー.	900	1,090.00	981,000	
6794	フォスター電機	2,100	1,342.00	2,818,200	
6796	クラリオン	11,000	120.00	1,320,000	
6798	SMK	6,000	264.00	1,584,000	
6800	ヨコオ	1,600	427.00	683,200	
6801	東光	11,000	268.00	2,948,000	
6803	ティアック	12,000	54.00	648,000	
6804	ホシデン	5,600	565.00	3,164,000	
6806	ヒロセ電機	3,600	10,740.00	38,664,000	
6807	日本航空電子工業	5,000	715.00	3,575,000	
6809	T O A	2,000	639.00	1,278,000	
6815	ユニデン	6,000	212.00	1,272,000	
6816	アルパイン	4,000	817.00	3,268,000	
6817	スミダコーポレーション	1,300	553.00	718,900	
6820	アイコム	1,100	1,939.00	2,132,900	
6823	リオン	500	734.00	367,000	
6839	船井電機	2,100	1,255.00	2,635,500	
6841	横河電機	20,700	918.00	19,002,600	
6844	新電元工業	7,000	318.00	2,226,000	
6845	アズビル	5,800	1,873.00	10,863,400	
6849	日本光電工業	4,100	3,140.00	12,874,000	
6850	チノー	4,000	205.00	820,000	
6853	共和電業	2,000	268.00	536,000	
6855	日本電子材料	800	376.00	300,800	
6856	堀場製作所	4,100	2,766.00	11,340,600	
6857	アドバンテスト	14,100	1,219.00	17,187,900	
6858	小野測器	2,000	411.00	822,000	
6859	エスベック	2,200	670.00	1,474,000	
6860	パナソニック デバイス S U N X	1,700	375.00	637,500	
6861	キーエンス	5,100	26,200.00	133,620,000	
6866	日置電機	1,100	1,353.00	1,488,300	
6869	シスメックス	7,300	4,750.00	34,675,000	
6875	メガチップス	1,700	1,377.00	2,340,900	
6877	O B A R A G R O U P	1,500	1,229.00	1,843,500	
6883	日本電産コパル電子	2,100	416.00	873,600	
6885	ミヤチテクノス	1,000	866.00	866,000	
6901	澤藤電機	1,000	247.00	247,000	
6905	コーセル	3,000	1,020.00	3,060,000	
6910	日立メディコ	1,000	1,275.00	1,275,000	
6911	新日本無線	1,000	197.00	197,000	
6914	オプテックス	1,300	1,085.00	1,410,500	
6915	千代田インテグレ	1,000	998.00	998,000	
6923	スタンレー電気	16,100	1,513.00	24,359,300	
6924	岩崎電気	8,000	179.00	1,432,000	
6925	ウシオ電機	12,600	997.00	12,562,200	
6926	岡谷電機産業	1,100	337.00	370,700	
6927	ヘリオス テクノ ホールディング	1,900	189.00	359,100	
6929	日本セラミック	1,400	1,385.00	1,939,000	

6935	日本デジタル研究所	1,800	1,028.00	1,850,400	
6937	古河電池	1,000	504.00	504,000	
6938	双信電機	1,000	320.00	320,000	
6941	山一電機	2,400	145.00	348,000	
6947	図研	1,200	551.00	661,200	
6951	日本電子	8,000	313.00	2,504,000	
6952	カシオ計算機	19,700	705.00	13,888,500	
6954	ファナック	21,500	14,840.00	319,060,000	
6958	日本シイエムケイ	4,500	330.00	1,485,000	
6961	エンプラス	900	3,570.00	3,213,000	
6963	ローム	10,900	3,235.00	35,261,500	
6965	浜松ホトニクス	8,100	3,570.00	28,917,000	
6966	三井ハイテック	3,000	617.00	1,851,000	
6967	新光電気工業	7,000	724.00	5,068,000	
6971	京セラ	17,200	8,260.00	142,072,000	
6976	太陽誘電	10,200	1,047.00	10,679,400	
6981	村田製作所	21,700	5,860.00	127,162,000	
6985	ユーシン	2,900	666.00	1,931,400	
6986	双葉電子工業	3,900	953.00	3,716,700	
6989	北陸電気工業	9,000	107.00	963,000	
6996	ニチコン	6,500	856.00	5,564,000	
6997	日本ケミコン	12,000	234.00	2,808,000	
6999	K O A	2,600	870.00	2,262,000	
7244	市光工業	5,000	138.00	690,000	
7276	小糸製作所	10,000	1,467.00	14,670,000	
7280	ミツバ	4,000	734.00	2,936,000	
7718	スター精密	3,700	923.00	3,415,100	
7735	大日本スクリーン製造	21,000	435.00	9,135,000	
7739	キャノン電子	1,900	1,791.00	3,402,900	
7751	キャノン	128,500	3,265.00	419,552,500	代用有価証券 10,000株
7752	リコー	62,000	958.00	59,396,000	
7999	MUTOHホールディングス	3,000	207.00	621,000	
8035	東京エレクトロン	17,400	4,070.00	70,818,000	
3116	トヨタ紡織	7,200	1,245.00	8,964,000	
5196	鬼怒川ゴム工業	4,000	451.00	1,804,000	
5949	ユニプレス	3,600	1,831.00	6,591,600	
6201	豊田自動織機	18,800	3,155.00	59,314,000	
6455	モリタホールディングス	4,000	760.00	3,040,000	
6584	三櫻工業	2,600	616.00	1,601,600	
6902	デンソー	51,100	3,580.00	182,938,000	
6995	東海理化電機製作所	4,900	1,514.00	7,418,600	
7003	三井造船	80,000	162.00	12,960,000	
7007	佐世保重工業	14,000	104.00	1,456,000	
7012	川崎重工業	161,000	274.00	44,114,000	
7102	日本車輛製造	7,000	321.00	2,247,000	
7105	日本輸送機	3,000	374.00	1,122,000	
7122	近畿車輛	4,000	275.00	1,100,000	
7201	日産自動車	261,400	932.00	243,624,800	

7202	いすゞ自動車	120,000	579.00	69,480,000	
7203	トヨタ自動車	265,800	4,725.00	1,255,905,000	代用有価証券 35,000株
7205	日野自動車	26,000	926.00	24,076,000	
7211	三菱自動車工業	502,000	105.00	52,710,000	
7212	エフテック	700	1,142.00	799,400	
7220	武蔵精密工業	2,200	1,873.00	4,120,600	
7222	日産車体	7,000	1,134.00	7,938,000	
7224	新明和工業	8,000	583.00	4,664,000	
7226	極東開発工業	3,900	933.00	3,638,700	
7230	日信工業	4,200	1,435.00	6,027,000	
7231	トピー工業	16,000	215.00	3,440,000	
7236	ティラド	7,000	228.00	1,596,000	
7238	曙ブレーキ工業	9,600	395.00	3,792,000	
7239	タチエス	2,800	1,530.00	4,284,000	
7240	NOK	10,000	1,278.00	12,780,000	
7241	フタバ産業	6,400	357.00	2,284,800	
7242	カヤバ工業	16,000	370.00	5,920,000	
7243	シロキ工業	5,000	214.00	1,070,000	
7245	大同メタル工業	3,000	742.00	2,226,000	
7246	プレス工業	9,000	446.00	4,014,000	
7248	カルソニックカンセイ	14,000	394.00	5,516,000	
7250	太平洋工業	4,200	500.00	2,100,000	
7251	ケーヒン	4,300	1,359.00	5,843,700	
7256	河西工業	3,000	409.00	1,227,000	
7259	アイシン精機	18,900	3,280.00	61,992,000	
7260	富士機工	2,000	301.00	602,000	
7261	マツダ	328,000	276.00	90,528,000	
7262	ダイハツ工業	22,000	1,830.00	40,260,000	
7266	今仙電機製作所	1,500	1,092.00	1,638,000	
7267	本田技研工業	174,600	3,455.00	603,243,000	
7269	スズキ	43,200	2,320.00	100,224,000	
7270	富士重工業	65,000	1,258.00	81,770,000	
7272	ヤマハ発動機	31,500	1,064.00	33,516,000	
7274	ショーワ	4,900	996.00	4,880,400	
7277	T B K	2,000	490.00	980,000	
7278	エクセディ	2,800	1,914.00	5,359,200	
7282	豊田合成	5,900	2,138.00	12,614,200	
7283	愛三工業	2,200	813.00	1,788,600	
7294	ヨロズ	1,500	1,428.00	2,142,000	
7296	エフ・シー・シー	3,400	2,036.00	6,922,400	
7309	シマノ	8,300	6,270.00	52,041,000	
7312	タカタ	3,700	1,657.00	6,130,900	
7313	テイ・エス テック	4,400	2,034.00	8,949,600	
7728	日本電産トーソク	1,000	614.00	614,000	
4543	テルモ	15,800	4,015.00	63,437,000	
5187	クリエートメディック	600	813.00	487,800	
6376	日機装	7,000	1,007.00	7,049,000	
7701	島津製作所	25,000	572.00	14,300,000	

7702	JMS	3,000	345.00	1,035,000	
7714	モリテックス	500	266.00	133,000	
7715	長野計器	1,500	617.00	925,500	
7717	ブイ・テクノロジー	5	221,900.00	1,109,500	
7721	東京計器	7,000	173.00	1,211,000	
7723	愛知時計電機	2,000	279.00	558,000	
7729	東京精密	3,700	1,684.00	6,230,800	
7730	マニー	600	3,100.00	1,860,000	
7731	ニコン	38,600	2,118.00	81,754,800	
7732	トプコン	4,200	855.00	3,591,000	
7733	オリンパス	24,400	1,966.00	47,970,400	
7734	理研計器	1,700	539.00	916,300	
7740	タムロン	1,600	2,086.00	3,337,600	
7741	HOYA	50,300	1,782.00	89,634,600	
7744	ノーリツ銅機	1,900	460.00	874,000	
7745	エー・アンド・デイ	1,900	365.00	693,500	
7756	日本電産コパル	1,600	617.00	987,200	
7762	シチズンホールディングス	23,400	458.00	10,717,200	
7769	リズム時計工業	9,000	163.00	1,467,000	
7775	大研医器	300	1,980.00	594,000	
7979	松風	1,000	820.00	820,000	
8050	セイコーホールディングス	13,000	251.00	3,263,000	
8086	ニプロ	11,100	653.00	7,248,300	
7817	パラマウントベッドホールディングス	1,800	2,845.00	5,121,000	
7819	SHO-BI	500	390.00	195,000	
7821	前田工繊	200	2,334.00	466,800	
7822	永大産業	3,000	356.00	1,068,000	
7825	ダンロップスポーツ	1,100	1,010.00	1,111,000	
7832	バンダイナムコホールディングス	21,400	1,427.00	30,537,800	
7838	共立印刷	2,900	230.00	667,000	
7840	フランスベッドホールディングス	13,000	190.00	2,470,000	
7846	パイロットコーポレーション	18	250,000.00	4,500,000	
7862	トッパン・フォームズ	3,700	810.00	2,997,000	
7864	フジシールインターナショナル	2,500	2,048.00	5,120,000	
7867	タカラトミー	6,900	513.00	3,539,700	
7868	廣済堂	1,900	298.00	566,200	
7873	アーク	7,300	157.00	1,146,100	
7885	タカノ	1,000	428.00	428,000	
7893	プロネクサス	2,400	519.00	1,245,600	
7897	ホクシン	1,700	173.00	294,100	
7898	ウッドワン	4,000	272.00	1,088,000	
7905	大建工業	8,000	237.00	1,896,000	
7911	凸版印刷	58,000	591.00	34,278,000	
7912	大日本印刷	63,000	775.00	48,825,000	
7913	図書印刷	4,000	130.00	520,000	
7914	共同印刷	7,000	232.00	1,624,000	
7915	日本写真印刷	3,200	1,798.00	5,753,600	
7916	光村印刷	2,000	261.00	522,000	
7921	宝印刷	1,200	629.00	754,800	

7936	アシックス	19,300	1,366.00	26,363,800	
7937	ツツミ	1,000	2,292.00	2,292,000	
7944	ローランド	2,000	748.00	1,496,000	
7949	小松ウオール工業	800	1,634.00	1,307,200	
7951	ヤマハ	15,200	868.00	13,193,600	
7952	河合楽器製作所	7,000	162.00	1,134,000	
7955	クリナップ	2,100	596.00	1,251,600	
7956	ピジョン	1,600	4,930.00	7,888,000	
7961	兼松日産農林	4,000	145.00	580,000	
7962	キングジム	1,600	644.00	1,030,400	
7966	リンテック	4,400	1,647.00	7,246,800	
7968	T A S A K I	500	412.00	206,000	
7972	イトーキ	4,500	459.00	2,065,500	
7974	任天堂	11,800	8,470.00	99,946,000	
7976	三菱鉛筆	1,700	1,656.00	2,815,200	
7981	タカラスタANDARD	9,000	621.00	5,589,000	
7984	コクヨ	10,800	609.00	6,577,200	
7987	ナカバヤシ	5,000	183.00	915,000	
7994	岡村製作所	8,000	571.00	4,568,000	
8022	美津濃	10,000	385.00	3,850,000	
8170	アデランス	2,600	1,300.00	3,380,000	
9501	東京電力	175,700	192.00	33,734,400	
9502	中部電力	63,300	1,132.00	71,655,600	
9503	関西電力	84,500	802.00	67,769,000	
9504	中国電力	28,600	1,169.00	33,433,400	
9505	北陸電力	20,300	1,000.00	20,300,000	
9506	東北電力	51,700	724.00	37,430,800	
9507	四国電力	18,600	1,050.00	19,530,000	
9508	九州電力	45,700	889.00	40,627,300	
9509	北海道電力	19,400	798.00	15,481,200	
9511	沖縄電力	1,200	2,732.00	3,278,400	
9513	電源開発	12,800	2,258.00	28,902,400	
9531	東京瓦斯	248,000	434.00	107,632,000	
9532	大阪瓦斯	201,000	336.00	67,536,000	
9533	東邦瓦斯	52,000	473.00	24,596,000	
9534	北海道瓦斯	4,000	241.00	964,000	
9536	西部瓦斯	23,000	207.00	4,761,000	
9543	静岡瓦斯	5,500	628.00	3,454,000	
9001	東武鉄道	118,000	482.00	56,876,000	
9003	相鉄ホールディングス	33,000	304.00	10,032,000	
9005	東京急行電鉄	122,000	503.00	61,366,000	
9006	京浜急行電鉄	53,000	766.00	40,598,000	
9007	小田急電鉄	66,000	915.00	60,390,000	
9008	京王電鉄	58,000	686.00	39,788,000	
9009	京成電鉄	31,000	815.00	25,265,000	
9010	富士急行	6,000	537.00	3,222,000	
9020	東日本旅客鉄道	38,200	6,520.00	249,064,000	
9021	西日本旅客鉄道	17,900	3,775.00	67,572,500	
9022	東海旅客鉄道	17,200	8,320.00	143,104,000	

9031	西日本鉄道	27,000	364.00	9,828,000	
9037	ハマキョウレックス	600	2,953.00	1,771,800	
9039	サカイ引越センター	400	2,020.00	808,000	
9041	近畿日本鉄道	187,000	377.00	70,499,000	
9042	阪急阪神ホールディングス	131,000	487.00	63,797,000	
9044	南海電気鉄道	43,000	393.00	16,899,000	
9045	京阪電気鉄道	46,000	398.00	18,308,000	
9047	名糖運輸	900	618.00	556,200	
9048	名古屋鉄道	72,000	255.00	18,360,000	
9062	日本通運	82,000	384.00	31,488,000	
9064	ヤマトホールディングス	39,100	1,469.00	57,437,900	
9065	山九	25,000	374.00	9,350,000	
9067	丸運	1,300	211.00	274,300	
9068	丸全昭和運輸	7,000	282.00	1,974,000	
9069	センコー	8,000	444.00	3,552,000	
9070	トナミホールディングス	4,000	181.00	724,000	
9072	日本梱包運輸倉庫	6,700	1,273.00	8,529,100	
9074	日本石油輸送	3,000	198.00	594,000	
9075	福山通運	12,000	468.00	5,616,000	
9076	セイノーホールディングス	16,000	701.00	11,216,000	
9081	神奈川中央交通	3,000	480.00	1,440,000	
9086	日立物流	3,600	1,276.00	4,593,600	
9101	日本郵船	164,000	216.00	35,424,000	
9104	商船三井	101,000	300.00	30,300,000	
9107	川崎汽船	91,000	179.00	16,289,000	
9110	NSユニテッド海運	9,000	119.00	1,071,000	
9113	乾汽船	2,700	285.00	769,500	
9115	明治海運	2,000	302.00	604,000	
9119	飯野海運	8,600	397.00	3,414,200	
9130	共栄タンカー	2,000	184.00	368,000	
9201	日本航空	17,600	4,365.00	76,824,000	
9202	全日本空輸	407,000	186.00	75,702,000	
9232	パスコ	2,000	278.00	556,000	
9058	トランコム	600	2,237.00	1,342,200	
9066	日新	8,000	231.00	1,848,000	
9301	三菱倉庫	15,000	1,331.00	19,965,000	
9302	三井倉庫	10,000	371.00	3,710,000	
9303	住友倉庫	14,000	449.00	6,286,000	
9304	澁澤倉庫	5,000	304.00	1,520,000	
9306	東陽倉庫	3,000	229.00	687,000	
9310	日本トランスシティ	5,000	320.00	1,600,000	
9312	ケイヒン	4,000	118.00	472,000	
9324	安田倉庫	1,600	639.00	1,022,400	
9351	東洋埠頭	6,000	150.00	900,000	
9358	宇徳	1,800	285.00	513,000	
9364	上組	23,000	746.00	17,158,000	
9366	サンリツ	600	571.00	342,600	
9368	キムラユニティー	500	800.00	400,000	
9369	キューソー流通システム	600	934.00	560,400	

9370	郵船ロジスティクス	1,700	885.00	1,504,500	
9375	近鉄エクスプレス	1,900	2,974.00	5,650,600	
9380	東海運	1,300	246.00	319,800	
9381	エーアイティー	200	1,717.00	343,400	
1973	NECネットエスアイ	1,900	1,658.00	3,150,200	
2317	システナ	22	79,400.00	1,746,800	
2327	新日鉄住金ソリューションズ	1,400	1,739.00	2,434,600	
2359	コア	800	707.00	565,600	
3371	ソフトクリエイトホールディングス	200	1,434.00	286,800	
3620	デジタルハーツ	400	655.00	262,000	
3626	I Tホールディングス	6,800	1,065.00	7,242,000	
3627	ネオス	4	55,800.00	223,200	
3630	電算システム	200	1,234.00	246,800	
3632	グリー	10,600	1,086.00	11,511,600	
3635	コーエーテクモホールディングス	4,000	772.00	3,088,000	
3636	三菱総合研究所	800	1,777.00	1,421,600	
3639	ボルテージ	300	881.00	264,300	
3656	K L a b	700	430.00	301,000	
3657	ポルトゥウィン・ピットクルーホール ディ	400	1,395.00	558,000	
3659	ネクソン	16,800	837.00	14,061,600	
3660	アイスタイル	400	606.00	242,400	
3662	エイチーム	100	2,439.00	243,900	
3715	ドワンゴ	11	228,000.00	2,508,000	
3724	ベリサーブ	1	144,900.00	144,900	
3730	マクロミル	1,600	1,004.00	1,606,400	
3738	ティーガイア	2,500	892.00	2,230,000	
3769	GMOペイメントゲートウェイ	700	1,443.00	1,010,100	
3770	ザッパラス	12	93,000.00	1,116,000	
3774	インターネットイニシアティブ	2,400	2,463.00	5,911,200	
3817	S R Aホールディングス	1,000	961.00	961,000	
3834	朝日ネット	2,000	432.00	864,000	
4283	パナソニック インフォメーションシス テム	500	1,962.00	981,000	
4295	フェイス	70	10,770.00	753,900	
4307	野村総合研究所	11,600	2,035.00	23,606,000	
4312	サイバネットシステム	17	24,550.00	417,350	
4326	インテージ	600	1,973.00	1,183,800	
4340	シンプレクス・ホールディングス	38	27,380.00	1,040,440	
4344	ソースネクスト	600	378.00	226,800	
4674	クレスコ	500	634.00	317,000	
4676	フジ・メディア・ホールディングス	198	149,100.00	29,521,800	
4684	オービック	700	19,500.00	13,650,000	
4687	TDCソフトウェアエンジニアリング	400	777.00	310,800	
4689	ヤフー	1,494	38,050.00	56,846,700	
4704	トレンドマイクロ	8,100	2,581.00	20,906,100	
4716	日本オラクル	4,100	3,725.00	15,272,500	
4719	アルファシステムズ	700	1,060.00	742,000	
4722	フューチャーアーキテクト	24	35,450.00	850,800	

4725	シーエーシー	1,200	735.00	882,000	
4726	ソフトバンク・テクノロジー	500	885.00	442,500	
4728	トーセ	500	556.00	278,000	
4733	オービックビジネスコンサルタント	650	4,925.00	3,201,250	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	2,400	3,745.00	8,988,000	
4743	アイティフォー	2,300	334.00	768,200	
4746	東計電算	300	1,244.00	373,200	
4762	エックスネット	2	126,500.00	253,000	
4768	大塚商会	1,800	8,190.00	14,742,000	
4776	サイボウズ	35	24,370.00	852,950	
4779	ソフトブレーン	33	12,420.00	409,860	
4799	アグレックス	600	834.00	500,400	
4812	電通国際情報サービス	1,300	917.00	1,192,100	
4820	EMシステムズ	300	1,630.00	489,000	
4825	ウェザーニューズ	600	2,187.00	1,312,200	
4826	C I J	2,000	333.00	666,000	
4839	WOWOW	6	198,400.00	1,190,400	
6791	日本コロムビア	21,000	41.00	861,000	
7518	ネットワンシステムズ	7,500	809.00	6,067,500	
7595	アルゴグラフィックス	700	1,237.00	865,900	
7844	マーベラスAQ L	24	36,850.00	884,400	
7860	エイベックス・グループ・ホールディングス	3,900	2,352.00	9,172,800	
8056	日本ユニシス	5,700	672.00	3,830,400	
8096	兼松エレクトロニクス	1,300	1,043.00	1,355,900	
9401	東京放送ホールディングス	11,000	1,076.00	11,836,000	
9404	日本テレビホールディングス	18,600	1,351.00	25,128,600	
9409	テレビ朝日	5,200	1,556.00	8,091,200	
9412	スカパーJ S A Tホールディングス	177	45,400.00	8,035,800	
9413	テレビ東京ホールディングス	1,500	962.00	1,443,000	
9422	アイ・ティー・シーネットワーク	1,900	685.00	1,301,500	
9430	NECモバイルリング	700	3,960.00	2,772,000	
9432	日本電信電話	86,000	4,115.00	353,890,000	代用有価証券 12,300株
9433	K D D I	28,800	6,790.00	195,552,000	
9435	光通信	2,100	4,140.00	8,694,000	
9437	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	1,682	137,000.00	230,434,000	
9449	GMOインターネット	6,800	713.00	4,848,400	
9470	学研ホールディングス	6,000	241.00	1,446,000	
9474	ゼンリン	2,700	1,025.00	2,767,500	
9475	昭文社	1,200	582.00	698,400	
9477	角川グループホールディングス	1,700	2,385.00	4,054,500	
9479	インプレスホールディングス	1,900	125.00	237,500	
9600	アイネット	900	643.00	578,700	
9601	松竹	13,000	954.00	12,402,000	
9602	東宝	14,500	1,703.00	24,693,500	
9605	東映	8,000	504.00	4,032,000	
9607	A O I P r o .	900	583.00	524,700	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	126	267,700.00	33,730,200	
9682	D T S	1,900	1,279.00	2,430,100	

9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,400	1,051.00	7,777,400	
9692	シーイーシー	1,400	520.00	728,000	
9697	カプコン	4,000	1,421.00	5,684,000	
9717	ジャステック	1,300	544.00	707,200	
9719	S C S K	4,900	1,578.00	7,732,200	
9739	日本システムウエア	800	358.00	286,400	
9742	アイネス	2,800	627.00	1,755,600	
9746	T K C	1,900	1,609.00	3,057,100	
9749	富士ソフト	2,900	1,937.00	5,617,300	
9759	N S D	4,000	930.00	3,720,000	
9766	コナミ	9,200	1,788.00	16,449,600	
9790	福井コンピュータホールディングス	300	543.00	162,900	
9889	J B C Cホールディングス	1,700	680.00	1,156,000	
9928	ミロク情報サービス	1,500	328.00	492,000	
9984	ソフトバンク	97,700	3,425.00	334,622,500	
1352	ハウスイ	2,000	112.00	224,000	
2676	高千穂交易	800	896.00	716,800	
2692	伊藤忠食品	500	3,165.00	1,582,500	

[次へ](#)

2715	エレマテック	900	1,228.00	1,105,200	
2729	JALUX	600	875.00	525,000	
2733	あらた	5,000	315.00	1,575,000	
2737	トーメンデバイス	300	1,771.00	531,300	
2760	東京エレクトロン デバイス	4	146,800.00	587,200	
2768	双日	129,000	138.00	17,802,000	
2784	アルフレッサ ホールディングス	5,300	4,375.00	23,187,500	
2874	横浜冷凍	5,100	633.00	3,228,300	
3004	神栄	3,000	101.00	303,000	
3022	山下医科器械	200	1,371.00	274,200	
3023	ラサ商事	900	459.00	413,100	
3036	アルコニックス	600	1,475.00	885,000	
3076	あい ホールディングス	3,600	657.00	2,365,200	
3107	ダイワボウホールディングス	19,000	171.00	3,249,000	
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,800	808.00	3,070,400	
3153	八洲電機	1,600	377.00	603,200	
3156	UKCホールディングス	1,200	1,787.00	2,144,400	
3167	TOKAIホールディングス	8,100	288.00	2,332,800	
3321	ミタチ産業	500	426.00	213,000	
3360	シップヘルスケアホールディングス	2,900	2,444.00	7,087,600	
5009	富士興産	800	525.00	420,000	
6973	協栄産業	3,000	152.00	456,000	
7414	小野建	1,800	840.00	1,512,000	
7420	佐島電機	1,500	450.00	675,000	
7427	エコートレーディング	500	831.00	415,500	
7433	伯東	1,200	850.00	1,020,000	
7438	コンドーテック	1,700	508.00	863,600	
7442	中山福	1,200	690.00	828,000	
7447	ナガイレーベン	2,600	1,137.00	2,956,200	
7451	三菱食品	2,200	2,485.00	5,467,000	
7456	松田産業	1,500	1,224.00	1,836,000	
7459	メディパルホールディングス	20,400	1,136.00	23,174,400	
7463	アドヴァン	1,100	866.00	952,600	
7466	S PK	500	1,527.00	763,500	
7476	アズワン	1,300	1,842.00	2,394,600	
7480	スズデン	700	466.00	326,200	
7482	シモジマ	1,300	972.00	1,263,600	
7483	ドウシシャ	1,100	2,365.00	2,601,500	
7504	高速	1,200	803.00	963,600	
7517	黒田電気	2,700	1,085.00	2,929,500	
7537	丸文	1,800	408.00	734,400	
7552	ハピネット	1,300	736.00	956,800	
7558	トーメンエレクトロニクス	1,000	1,119.00	1,119,000	
7591	エクセル	900	848.00	763,200	
7594	マルカキカイ	700	1,197.00	837,900	
7599	ガリバーインターナショナル	690	3,445.00	2,377,050	
7600	日本エム・ディ・エム	2,000	244.00	488,000	
7607	進和	1,200	1,022.00	1,226,400	

7608	エスケイジャパン	600	287.00	172,200	
7609	ダイトエレクトロン	1,000	357.00	357,000	
7613	シークス	1,300	1,015.00	1,319,500	
7619	田中商事	700	473.00	331,100	
7628	オーハシテクニカ	1,100	627.00	689,700	
7631	マクニカ	1,000	1,693.00	1,693,000	
7637	白銅	700	808.00	565,600	
8001	伊藤忠商事	162,900	1,064.00	173,325,600	
8002	丸紅	167,000	678.00	113,226,000	
8007	高島	4,000	269.00	1,076,000	
8008	F & A アクアホールディングス	1,500	1,013.00	1,519,500	
8012	長瀬産業	11,500	979.00	11,258,500	
8014	蝶理	1,300	963.00	1,251,900	
8015	豊田通商	22,700	2,311.00	52,459,700	
8018	三共生興	3,400	317.00	1,077,800	
8020	兼松	44,000	126.00	5,544,000	
8025	ツカモトコーポレーション	4,000	153.00	612,000	
8031	三井物産	176,300	1,371.00	241,707,300	
8032	日本紙パルプ商事	10,000	289.00	2,890,000	
8036	日立ハイテクノロジーズ	6,200	1,877.00	11,637,400	
8037	カメイ	2,000	834.00	1,668,000	
8038	東都水産	4,000	130.00	520,000	
8043	スターゼン	7,000	251.00	1,757,000	
8051	山善	7,800	591.00	4,609,800	
8052	椿本興業	2,000	249.00	498,000	
8053	住友商事	120,500	1,147.00	138,213,500	
8057	内田洋行	4,000	244.00	976,000	
8058	三菱商事	159,300	1,900.00	302,670,000	
8059	第一実業	5,000	414.00	2,070,000	
8060	キヤノンマーケティングジャパン	6,800	1,235.00	8,398,000	
8061	西華産業	7,000	244.00	1,708,000	
8065	佐藤商事	1,800	569.00	1,024,200	
8068	菱洋エレクトロ	2,400	793.00	1,903,200	
8070	東京産業	2,000	276.00	552,000	
8074	ユアサ商事	21,000	164.00	3,444,000	
8075	神鋼商事	5,000	174.00	870,000	
8078	阪和興業	20,000	356.00	7,120,000	
8081	カナデン	2,000	555.00	1,110,000	
8084	菱電商事	3,000	560.00	1,680,000	
8087	フルサト工業	1,100	869.00	955,900	
8088	岩谷産業	23,000	350.00	8,050,000	
8089	すてきなイスグループ	8,000	213.00	1,704,000	
8090	昭光通商	8,000	130.00	1,040,000	
8091	ニチモウ	3,000	188.00	564,000	
8093	極東貿易	3,000	152.00	456,000	
8095	イワキ	3,000	183.00	549,000	
8097	三愛石油	5,000	388.00	1,940,000	
8098	稲畑産業	5,000	604.00	3,020,000	
8101	G S I クレオス	6,000	126.00	756,000	

8103	明和産業	1,700	378.00	642,600	
8129	東邦ホールディングス	6,600	1,837.00	12,124,200	
8130	サンゲツ	3,600	2,215.00	7,974,000	
8131	ミツウロコグループホールディングス	3,300	503.00	1,659,900	
8132	シナネン	4,000	384.00	1,536,000	
8133	伊藤忠エネクス	4,500	478.00	2,151,000	
8136	サンリオ	5,200	3,640.00	18,928,000	
8137	サンワテクノス	1,000	636.00	636,000	
8140	リョーサン	3,300	1,967.00	6,491,100	
8141	新光商事	2,200	886.00	1,949,200	
8142	トーホー	4,000	321.00	1,284,000	
8150	三信電気	2,900	644.00	1,867,600	
8151	東陽テクニカ	2,900	1,072.00	3,108,800	
8153	モスフードサービス	2,600	1,702.00	4,425,200	
8154	加賀電子	2,000	753.00	1,506,000	
8158	ソーダニッカ	2,000	387.00	774,000	
8159	立花エレテック	1,200	849.00	1,018,800	
8283	P a l t a c	2,500	1,108.00	2,770,000	
8835	太平洋興発	8,000	89.00	712,000	
9305	ヤマタネ	10,000	130.00	1,300,000	
9763	丸紅建材リース	2,000	170.00	340,000	
9810	日鐵商事	5,000	257.00	1,285,000	
9830	トラスコ中山	2,300	1,736.00	3,992,800	
9832	オートバックスセブン	2,500	3,855.00	9,637,500	
9869	加藤産業	2,900	1,661.00	4,816,900	
9880	イノテック	1,800	381.00	685,800	
9882	イエローハット	1,900	1,360.00	2,584,000	
9883	富士エレクトロニクス	1,000	1,236.00	1,236,000	
9896	J Kホールディングス	1,700	436.00	741,200	
9902	日伝	900	2,098.00	1,888,200	
9930	北沢産業	1,500	164.00	246,000	
9932	杉本商事	1,100	782.00	860,200	
9934	因幡電機産業	2,400	2,692.00	6,460,800	
9938	住金物産	11,000	282.00	3,102,000	
9957	バイテック	500	656.00	328,000	
9962	ミスミグループ本社	7,600	2,329.00	17,700,400	
9963	江守商事	500	974.00	487,000	
9972	アルテック	1,200	194.00	232,800	
9982	タキヒヨー	3,000	460.00	1,380,000	
9987	スズケン	7,900	3,070.00	24,253,000	
9991	ジェコス	1,400	599.00	838,600	
2651	ローソン	7,700	6,870.00	52,899,000	
2659	サンエー	800	3,710.00	2,968,000	
2660	キリン堂	800	620.00	496,000	
2662	ダイユーエイト	500	680.00	340,000	
2664	カワチ薬品	1,400	1,820.00	2,548,000	
2670	エービーシー・マート	2,400	3,290.00	7,896,000	
2674	ハードオフコーポレーション	1,000	628.00	628,000	
2678	アスクル	1,700	1,255.00	2,133,500	

2681	ゲオホールディングス	35	89,500.00	3,132,500	
2685	ポイント	1,880	3,185.00	5,987,800	
2687	シー・ヴィ・エス・ペイエリア	3,000	79.00	237,000	
2695	くらコーポレーション	1,200	1,259.00	1,510,800	
2698	キャンドゥ	11	117,900.00	1,296,900	
2726	パル	600	4,160.00	2,496,000	
2730	エディオン	8,900	388.00	3,453,200	
2734	サーラコーポレーション	1,800	458.00	824,400	
2753	あみやき亭	4	201,900.00	807,600	
2764	ひらまつ	7	176,900.00	1,238,300	
2772	デンキー	200	1,968.00	393,600	
2791	大黒天物産	400	2,277.00	910,800	
2792	ハニーズ	1,640	1,109.00	1,818,760	
3028	アルペン	1,600	1,582.00	2,531,200	
3034	クオール	600	800.00	480,000	
3048	ビックカメラ	78	45,500.00	3,549,000	
3050	DCMホールディングス	10,600	608.00	6,444,800	
3064	Monotaro	1,400	3,310.00	4,634,000	
3086	J. フロント リテイリング	48,000	520.00	24,960,000	
3087	ドトール・日レスホールディングス	3,600	1,262.00	4,543,200	
3088	マツモトキヨシホールディングス	3,500	2,359.00	8,256,500	
3091	ブロンコビリー	200	2,313.00	462,600	
3092	スタートトゥデイ	4,300	940.00	4,042,000	
3097	物語コーポレーション	300	1,980.00	594,000	
3098	ココカラファイン	2,100	2,897.00	6,083,700	
3099	三越伊勢丹ホールディングス	40,600	925.00	37,555,000	
3141	ウエルシアホールディングス	700	3,650.00	2,555,000	
3148	クリエイトSDホールディングス	900	2,774.00	2,496,600	
3159	丸善CH Iホールディングス	1,200	244.00	292,800	
3313	ブックオフコーポレーション	1,200	657.00	788,400	
3333	あさひ	1,200	1,219.00	1,462,800	
3341	日本調剤	260	2,196.00	570,960	
3349	コスモス薬品	1,000	10,560.00	10,560,000	
3366	一六堂	300	498.00	149,400	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	85,400	2,756.00	235,362,400	
3391	ツルハホールディングス	2,000	7,810.00	15,620,000	
3395	サンマルクホールディングス	700	3,515.00	2,460,500	
3396	フェリシモ	600	1,082.00	649,200	
3397	トリドール	1,800	887.00	1,596,600	
3398	クスリのアオキ	300	5,910.00	1,773,000	
4350	メディカルシステムネットワーク	1,200	373.00	447,600	
4775	総合メディカル	500	2,998.00	1,499,000	
7416	はるやま商事	900	507.00	456,300	
7421	カッパ・クリエイトホールディングス	1,500	2,006.00	3,009,000	
7445	ライトオン	1,600	667.00	1,067,200	
7448	ジーンズメイト	700	307.00	214,900	
7453	良品計画	2,200	5,220.00	11,484,000	
7455	三城ホールディングス	2,500	465.00	1,162,500	
7494	コナカ	2,500	727.00	1,817,500	

7506	ハウス オブ ローゼ	200	1,347.00	269,400	
7508	G-7ホールディングス	700	515.00	360,500	
7512	イオン北海道	1,400	479.00	670,600	
7513	コジマ	3,100	285.00	883,500	
7514	ヒマラヤ	600	713.00	427,800	
7516	コーナン商事	2,700	1,069.00	2,886,300	
7520	エコス	800	580.00	464,000	
7522	ワタミ	2,400	1,668.00	4,003,200	
7524	マルシェ	600	800.00	480,000	
7532	ドン・キホーテ	5,900	3,630.00	21,417,000	
7541	メガネトップ	3,500	1,047.00	3,664,500	
7545	西松屋チェーン	4,000	747.00	2,988,000	
7550	ゼンショーホールディングス	7,800	1,097.00	8,556,600	
7554	幸楽苑	1,200	1,262.00	1,514,400	
7561	ハークスレイ	600	698.00	418,800	
7581	サイゼリヤ	3,000	1,181.00	3,543,000	
7601	ポプラ	600	563.00	337,800	
7606	ユナイテッドアローズ	2,200	2,266.00	4,985,200	
7611	ハイデイ日高	1,100	1,948.00	2,142,800	
7615	京都きもの友禅	1,300	1,099.00	1,428,700	
7616	コロワイド	7,000	923.00	6,461,000	
7630	壺番屋	800	2,948.00	2,358,400	
7640	トップカルチャー	800	386.00	308,800	
7649	スギホールディングス	3,300	3,265.00	10,774,500	
8005	スクロール	2,800	261.00	730,800	
8028	ファミリーマート	6,300	3,840.00	24,192,000	
8160	木曽路	2,500	1,727.00	4,317,500	
8165	千趣会	3,700	645.00	2,386,500	
8166	タカキュー	2,000	317.00	634,000	
8168	ケーヨー	3,500	483.00	1,690,500	
8173	上新電機	4,000	915.00	3,660,000	
8174	日本瓦斯	2,800	1,057.00	2,959,600	
8175	ベスト電器	7,000	137.00	959,000	
8178	マルエツ	4,000	298.00	1,192,000	
8179	ロイヤルホールディングス	3,400	1,040.00	3,536,000	
8181	東天紅	1,000	193.00	193,000	
8182	いなげや	2,300	1,001.00	2,302,300	
8184	島忠	4,600	1,897.00	8,726,200	
8185	チヨダ	2,400	1,990.00	4,776,000	
8194	ライフコーポレーション	1,300	1,220.00	1,586,000	
8196	カスミ	4,200	569.00	2,389,800	
8200	リンガーハット	1,800	1,217.00	2,190,600	
8201	さが美	2,000	115.00	230,000	
8203	MrMax	2,100	311.00	653,100	
8207	テンアライド	1,700	298.00	506,600	
8214	AOKIホールディングス	1,800	2,210.00	3,978,000	
8217	オークワ	3,000	1,046.00	3,138,000	
8218	コメリ	3,200	2,486.00	7,955,200	
8219	青山商事	5,600	1,997.00	11,183,200	

8227	しまむら	2,400	9,090.00	21,816,000	
8229	C F S コーポレーション	1,400	414.00	579,600	
8233	高島屋	28,000	694.00	19,432,000	
8237	松屋	4,100	781.00	3,202,100	
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	13,000	790.00	10,270,000	
8245	丸栄	4,000	94.00	376,000	
8248	ニッセンホールディングス	3,700	320.00	1,184,000	
8251	パルコ	3,900	903.00	3,521,700	
8252	丸井グループ	26,700	707.00	18,876,900	
8255	原信ナルスホールディングス	1,100	1,577.00	1,734,700	
8263	ダイエー	12,050	195.00	2,349,750	
8266	イズミヤ	8,000	474.00	3,792,000	
8267	イオン	72,000	1,046.00	75,312,000	
8270	ユニー	19,600	658.00	12,896,800	
8273	イズミ	5,100	1,890.00	9,639,000	
8274	東武ストア	3,000	281.00	843,000	
8276	平和堂	4,200	1,285.00	5,397,000	
8278	フジ	2,300	1,771.00	4,073,300	
8279	ヤオコー	1,000	3,535.00	3,535,000	
8281	ゼビオ	2,800	1,729.00	4,841,200	
8282	ケーズホールディングス	5,100	2,228.00	11,362,800	
8289	O l y m p i c	1,200	655.00	786,000	
8291	日産東京販売ホールディングス	3,000	297.00	891,000	
9627	アインファーマシーズ	1,200	4,875.00	5,850,000	
9828	元気寿司	700	1,122.00	785,400	
9831	ヤマダ電機	9,330	3,515.00	32,794,950	
9842	アークランドサカモト	1,400	1,352.00	1,892,800	
9843	ニトリホールディングス	4,050	6,750.00	27,337,500	
9854	愛眼	1,700	304.00	516,800	
9861	吉野家ホールディングス	55	106,600.00	5,863,000	
9887	松屋フーズ	1,000	1,562.00	1,562,000	
9900	サガミチェーン	2,000	711.00	1,422,000	
9945	ブレナス	2,300	1,489.00	3,424,700	
9946	ミニストップ	1,500	1,495.00	2,242,500	
9948	アークス	3,500	1,730.00	6,055,000	
9956	バロー	4,400	1,514.00	6,661,600	
9974	ベルク	1,000	1,328.00	1,328,000	
9979	大庄	1,000	1,189.00	1,189,000	
9983	ファーストリテイリング	4,100	24,860.00	101,926,000	
9989	サンドラッグ	3,900	3,690.00	14,391,000	
9990	東京デリカ	700	925.00	647,500	
9993	ヤマザワ	500	1,493.00	746,500	
9994	やまや	400	1,388.00	555,200	
9997	ペルーナ	2,550	663.00	1,690,650	
7150	島根銀行	500	1,263.00	631,500	
7161	じもとホールディングス	14,800	195.00	2,886,000	
8303	新生銀行	177,000	188.00	33,276,000	
8304	あおぞら銀行	74,000	261.00	19,314,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,546,400	508.00	785,571,200	

8308	りそなホールディングス	210,100	417.00	87,611,700	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	435,000	336.00	146,160,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	154,400	3,640.00	562,016,000	
8324	第四銀行	26,000	310.00	8,060,000	
8325	北越銀行	21,000	196.00	4,116,000	
8327	西日本シティ銀行	72,000	232.00	16,704,000	
8331	千葉銀行	79,000	576.00	45,504,000	
8332	横浜銀行	130,000	442.00	57,460,000	
8333	常陽銀行	77,000	429.00	33,033,000	
8334	群馬銀行	46,000	454.00	20,884,000	
8336	武蔵野銀行	3,300	3,000.00	9,900,000	
8337	千葉興業銀行	4,000	646.00	2,584,000	
8338	筑波銀行	8,500	337.00	2,864,500	
8339	東京都民銀行	3,900	840.00	3,276,000	
8341	七十七銀行	32,000	414.00	13,248,000	
8342	青森銀行	15,000	269.00	4,035,000	
8343	秋田銀行	14,000	236.00	3,304,000	
8344	山形銀行	12,000	383.00	4,596,000	
8345	岩手銀行	1,500	3,635.00	5,452,500	
8346	東邦銀行	17,000	282.00	4,794,000	
8349	東北銀行	11,000	144.00	1,584,000	
8350	みちのく銀行	10,000	195.00	1,950,000	
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	83,000	395.00	32,785,000	
8355	静岡銀行	60,000	889.00	53,340,000	
8356	十六銀行	25,000	314.00	7,850,000	
8358	スルガ銀行	20,000	1,281.00	25,620,000	
8359	八十二銀行	38,000	445.00	16,910,000	
8360	山梨中央銀行	12,000	366.00	4,392,000	
8361	大垣共立銀行	27,000	292.00	7,884,000	
8362	福井銀行	18,000	173.00	3,114,000	
8363	北國銀行	24,000	354.00	8,496,000	
8364	清水銀行	700	2,498.00	1,748,600	
8366	滋賀銀行	19,000	510.00	9,690,000	
8367	南都銀行	20,000	386.00	7,720,000	
8368	百五銀行	19,000	385.00	7,315,000	
8369	京都銀行	36,000	760.00	27,360,000	
8374	三重銀行	9,000	202.00	1,818,000	
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	143,000	150.00	21,450,000	
8379	広島銀行	60,000	376.00	22,560,000	
8381	山陰合同銀行	12,000	700.00	8,400,000	
8382	中国銀行	16,000	1,293.00	20,688,000	
8383	鳥取銀行	7,000	179.00	1,253,000	
8385	伊予銀行	22,000	720.00	15,840,000	
8386	百十四銀行	22,000	343.00	7,546,000	
8387	四国銀行	15,000	228.00	3,420,000	
8388	阿波銀行	17,000	530.00	9,010,000	
8390	鹿児島銀行	14,000	572.00	8,008,000	
8392	大分銀行	12,000	318.00	3,816,000	
8393	宮崎銀行	14,000	233.00	3,262,000	

8394	肥後銀行	17,000	522.00	8,874,000	
8395	佐賀銀行	13,000	207.00	2,691,000	
8396	十八銀行	13,000	231.00	3,003,000	
8397	沖縄銀行	1,500	3,540.00	5,310,000	
8399	琉球銀行	4,200	1,137.00	4,775,400	
8409	八千代銀行	1,300	2,187.00	2,843,100	
8410	セブン銀行	68,900	234.00	16,122,600	
8411	みずほフィナンシャルグループ	2,632,200	196.00	515,911,200	
8415	紀陽ホールディングス	81,000	130.00	10,530,000	
8418	山口フィナンシャルグループ	20,000	841.00	16,820,000	
8521	長野銀行	7,000	169.00	1,183,000	
8522	名古屋銀行	18,000	313.00	5,634,000	
8524	北洋銀行	30,900	308.00	9,517,200	
8527	愛知銀行	700	4,635.00	3,244,500	
8529	第三銀行	12,000	167.00	2,004,000	

[次へ](#)

8530	中京銀行	8,000	190.00	1,520,000	
8536	東日本銀行	9,000	226.00	2,034,000	
8537	大光銀行	7,000	225.00	1,575,000	
8541	愛媛銀行	12,000	223.00	2,676,000	
8542	トマト銀行	8,000	169.00	1,352,000	
8543	みなと銀行	18,000	158.00	2,844,000	
8544	京葉銀行	17,000	441.00	7,497,000	
8545	関西アーバン銀行	28,000	111.00	3,108,000	
8550	栃木銀行	10,000	352.00	3,520,000	
8551	北日本銀行	600	2,436.00	1,461,600	
8558	東和銀行	22,000	100.00	2,200,000	
8562	福島銀行	26,000	80.00	2,080,000	
8563	大東銀行	14,000	91.00	1,274,000	
8600	トモニホールディングス	15,600	374.00	5,834,400	
8713	フィデアホールディングス	11,700	203.00	2,375,100	
8714	池田泉州ホールディングス	16,800	487.00	8,181,600	
7148	F P G	300	1,746.00	523,800	
8473	S B I ホールディングス	26,100	727.00	18,974,700	
8595	ジャフコ	2,800	2,815.00	7,882,000	
8601	大和証券グループ本社	202,000	537.00	108,474,000	
8604	野村ホールディングス	417,600	528.00	220,492,800	
8609	岡三証券グループ	17,000	681.00	11,577,000	
8613	丸三証券	6,300	661.00	4,164,300	
8614	東洋証券	8,000	280.00	2,240,000	
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	23,000	487.00	11,201,000	
8617	光世証券	5,000	215.00	1,075,000	
8622	水戸証券	6,000	359.00	2,154,000	
8624	いちよし証券	4,600	771.00	3,546,600	
8628	松井証券	12,100	845.00	10,224,500	
8692	だいこう証券ビジネス	1,200	600.00	720,000	
8698	マネックスグループ	232	30,600.00	7,099,200	
8703	カブドットコム証券	8,400	442.00	3,712,800	
8706	極東証券	2,700	1,152.00	3,110,400	
8707	岩井コスモホールディングス	2,000	631.00	1,262,000	
8630	N K S J ホールディングス	45,300	1,933.00	87,564,900	
8725	M S & A D インシュアランスグループホール	61,000	1,890.00	115,290,000	
8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	19,600	1,464.00	28,694,400	
8750	第一生命保険	1,093	130,300.00	142,417,900	
8766	東京海上ホールディングス	79,100	2,677.00	211,750,700	
8795	T & D ホールディングス	70,100	1,133.00	79,423,300	
7164	全国保証	1,600	2,661.00	4,257,600	
8253	クレディセゾン	17,900	1,870.00	33,473,000	
8424	芙蓉総合リース	2,000	3,135.00	6,270,000	
8425	興銀リース	3,100	2,288.00	7,092,800	
8439	東京センチュリーリース	4,800	2,061.00	9,892,800	
8511	日本証券金融	7,900	604.00	4,771,600	
8512	大阪証券金融	2,900	234.00	678,600	

8515	アイフル	17,100	563.00	9,627,300	
8519	ポケットカード	2,100	426.00	894,600	
8566	リコーリース	1,400	2,274.00	3,183,600	
8570	イオンクレジットサービス	7,500	2,033.00	15,247,500	
8572	アコム	4,120	2,179.00	8,977,480	
8584	ジャックス	11,000	403.00	4,433,000	
8585	オリエントコーポレーション	39,500	273.00	10,783,500	
8586	日立キャピタル	4,000	1,695.00	6,780,000	
8591	オリックス	10,630	10,180.00	108,213,400	
8593	三菱UFJリース	5,190	3,995.00	20,734,050	
8771	イー・ギャランティ	200	1,808.00	361,600	
8772	アサックス	4	142,700.00	570,800	
8793	NECキャピタルソリューション	900	1,474.00	1,326,600	
2353	日本駐車場開発	219	5,410.00	1,184,790	
3003	ヒューリック	26,300	614.00	16,148,200	
3225	東京建物不動産販売	1,100	298.00	327,800	
3228	三栄建築設計	500	869.00	434,500	
3231	野村不動産ホールディングス	9,800	1,532.00	15,013,600	
3258	常和ホールディングス	400	1,649.00	659,600	
4666	パーク24	10,600	1,638.00	17,362,800	
8801	三井不動産	96,000	2,042.00	196,032,000	
8802	三菱地所	143,000	2,046.00	292,578,000	
8803	平和不動産	3,900	1,231.00	4,800,900	
8804	東京建物	39,000	426.00	16,614,000	
8806	ダイビル	5,300	845.00	4,478,500	
8815	東急不動産	44,000	592.00	26,048,000	
8818	京阪神ビルディング	2,700	484.00	1,306,800	
8830	住友不動産	49,000	2,638.00	129,262,000	
8833	東宝不動産	1,800	740.00	1,332,000	
8840	大京	32,000	213.00	6,816,000	
8841	テーオーシー	7,000	565.00	3,955,000	
8842	東京楽天地	3,000	338.00	1,014,000	
8848	レオパレス21	17,200	318.00	5,469,600	
8860	フジ住宅	2,600	482.00	1,253,200	
8864	空港施設	2,500	447.00	1,117,500	
8869	明和地所	1,000	481.00	481,000	
8870	住友不動産販売	730	4,095.00	2,989,350	
8871	ゴールドクレスト	1,600	1,554.00	2,486,400	
8875	東栄住宅	1,400	1,189.00	1,664,600	
8877	日本エスリード	900	947.00	852,300	
8879	東急リパブル	2,200	1,315.00	2,893,000	
8880	飯田産業	2,300	1,142.00	2,626,600	
8881	日神不動産	1,200	544.00	652,800	
8895	アーネストワン	3,400	1,484.00	5,045,600	
8897	タカラレーベン	2,200	984.00	2,164,800	
8904	サンヨーハウジング名古屋	10	103,300.00	1,033,000	
8905	イオンモール	9,300	2,096.00	19,492,800	
8907	フージャースコーポレーション	28	73,600.00	2,060,800	
8915	タクトホーム	11	128,600.00	1,414,600	

8923	トーセイ	27	59,300.00	1,601,100	
8933	エヌ・ティ・ティ都市開発	127	84,500.00	10,731,500	
8934	サンフロンティア不動産	17	56,400.00	958,800	
8944	ランドビジネス	14	40,250.00	563,500	
8999	グランディハウス	400	793.00	317,200	
9706	日本空港ビルデング	7,100	978.00	6,943,800	
1954	日本工営	7,000	315.00	2,205,000	
2120	ネクスト	1,000	1,000.00	1,000,000	
2127	日本M&Aセンター	1,100	2,999.00	3,298,900	
2128	ノバレーゼ	6	55,600.00	333,600	
2131	アコーディア・ゴルフ	96	82,500.00	7,920,000	
2151	タケエイ	200	2,448.00	489,600	
2168	パソナグループ	22	45,000.00	990,000	
2170	リンクアンドモチベーション	9	41,850.00	376,650	
2174	G C Aサヴィアングループ	1,000	912.00	912,000	
2175	エス・エム・エス	6	212,400.00	1,274,400	
2181	テンプホールディングス	2,900	1,305.00	3,784,500	
2193	クックパッド	600	2,872.00	1,723,200	
2196	エスクリ	500	675.00	337,500	
2301	学情	800	317.00	253,600	
2305	スタジオアリス	1,000	1,248.00	1,248,000	
2309	シミックホールディングス	800	1,398.00	1,118,400	
2322	N E Cフィールドینگ	1,700	1,027.00	1,745,900	
2331	総合警備保障	7,900	1,177.00	9,298,300	
2371	カカクコム	2,900	3,510.00	10,179,000	
2378	ルネサンス	1,000	664.00	664,000	
2398	ツクイ	1,000	1,632.00	1,632,000	
2413	エムスリー	51	164,900.00	8,409,900	
2418	ベストブライダル	6	88,500.00	531,000	
2432	ディー・エヌ・エー	10,700	2,606.00	27,884,200	
2433	博報堂D Yホールディングス	2,990	6,490.00	19,405,100	
2440	ぐるなび	1,500	943.00	1,414,500	
2450	一休	14	74,700.00	1,045,800	
2453	ジャパンベストレスキューシステム	3	81,400.00	244,200	
2462	ジェイコムホールディングス	400	706.00	282,400	
2466	P G Mホールディングス	30	68,300.00	2,049,000	
2491	バリューコマース	7	57,200.00	400,400	
2749	J Pホールディングス	600	1,221.00	732,600	
4282	イーピーエス	13	221,600.00	2,880,800	
4301	アミューズ	700	1,810.00	1,267,000	
4310	ドリームインキュベータ	7	81,400.00	569,800	
4319	T A C	1,600	190.00	304,000	
4321	ケネディクス	207	18,640.00	3,858,480	
4324	電通	19,700	2,751.00	54,194,700	
4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	86	9,210.00	792,060	
4337	びあ	600	1,270.00	762,000	
4343	イオンファンタジー	700	1,307.00	914,900	
4544	みらかホールディングス	5,700	4,220.00	24,054,000	
4641	アルプス技研	900	743.00	668,700	

4651	サニックス	3,300	359.00	1,184,700	
4653	ダイオーズ	400	568.00	227,200	
4658	日本空調サービス	600	783.00	469,800	
4661	オリエンタルランド	6,400	12,430.00	79,552,000	
4665	ダスキン	5,900	1,770.00	10,443,000	
4668	明光ネットワークジャパン	1,900	1,015.00	1,928,500	
4671	ファルコSDホールディングス	1,200	1,009.00	1,210,800	
4678	秀英予備校	400	351.00	140,400	
4679	田谷	300	726.00	217,800	
4680	ラウンドワン	6,800	574.00	3,903,200	
4681	リゾートトラスト	3,700	1,928.00	7,133,600	
4694	ビー・エム・エル	1,300	2,278.00	2,961,400	
4696	ワタベウェディング	700	742.00	519,400	
4708	もしもしホットライン	3,600	1,242.00	4,471,200	
4711	東急コミュニティー	500	3,350.00	1,675,000	
4714	リソー教育	216	7,770.00	1,678,320	
4718	早稲田アカデミー	200	744.00	148,800	
4724	ウェアハウス	500	299.00	149,500	
4732	ユー・エス・エス	2,410	9,670.00	23,304,700	
4745	東京個別指導学院	1,100	220.00	242,000	
4767	テー・オー・ダブリュー	800	531.00	424,800	
4801	セントラルスポーツ	700	1,378.00	964,600	
5261	リゾートソリューション	2,000	184.00	368,000	
6054	リブセンス	200	3,535.00	707,000	
8876	リロ・ホールディング	700	3,330.00	2,331,000	
9603	エイチ・アイ・エス	1,800	3,065.00	5,517,000	
9616	共立メンテナンス	1,100	2,298.00	2,527,800	
9619	イチネンホールディングス	2,300	568.00	1,306,400	
9621	建設技術研究所	1,200	569.00	682,800	
9622	スペース	1,200	674.00	808,800	
9628	燦ホールディングス	500	1,293.00	646,500	
9632	スバル興業	2,000	318.00	636,000	
9633	東京テアトル	9,000	121.00	1,089,000	
9671	よみうりランド	4,000	422.00	1,688,000	
9672	東京都競馬	17,000	195.00	3,315,000	
9675	常磐興産	7,000	145.00	1,015,000	
9678	カナモト	2,000	1,308.00	2,616,000	
9681	東京ドーム	16,000	312.00	4,992,000	
9715	トランス・コスモス	2,800	1,116.00	3,124,800	
9716	乃村工藝社	5,000	403.00	2,015,000	
9722	藤田観光	5,000	286.00	1,430,000	
9726	KNT-CTホールディングス	7,000	136.00	952,000	
9728	日本管財	800	1,567.00	1,253,600	
9729	トーカイ	900	2,431.00	2,187,900	
9731	白洋舎	2,000	207.00	414,000	
9735	セコム	22,500	4,490.00	101,025,000	
9740	セントラル警備保障	1,000	863.00	863,000	
9743	丹青社	2,000	338.00	676,000	
9744	メイテック	3,400	2,258.00	7,677,200	

9747	アサツー ディ・ケイ	3,600	2,351.00	8,463,600	
9755	応用地質	2,300	1,038.00	2,387,400	
9757	船井総合研究所	2,300	590.00	1,357,000	
9760	進学会	1,000	314.00	314,000	
9783	ベネッセホールディングス	6,500	3,615.00	23,497,500	
9787	イオンディライト	2,100	1,696.00	3,561,600	
9788	ナック	500	2,493.00	1,246,500	
9792	ニチイ学館	4,200	847.00	3,557,400	
9793	ダイセキ	3,200	1,309.00	4,188,800	
9795	ステップ	700	724.00	506,800	
合 計		32,002,071	—	26,877,849,160	

(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。

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24年 8月15日現在	平成25年 2月15日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		100,307,199	161,266,473
コール・ローン		590,504,373	761,441,805
株式		60,026,277,128	71,654,872,120
投資証券		1,385,437,909	1,675,813,930
派生商品評価勘定		52,978,916	50,386,202
未収入金		1,065,998,119	13,787,006
未収配当金		115,833,916	104,856,394
未収利息		1,107	1,390
差入委託証拠金		232,959,817	328,977,902
流動資産合計		63,570,298,484	74,751,403,222
資産合計		63,570,298,484	74,751,403,222
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,708,133	3,394,956
未払金		1,695,182	—
未払解約金		269,924,648	85,949,879
流動負債合計		274,327,963	89,344,835
負債合計		274,327,963	89,344,835
純資産の部			
元本等			
元本		69,146,010,791	61,859,204,053
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		△5,850,040,270	12,802,854,334
元本等合計		63,295,970,521	74,662,058,387
純資産合計		63,295,970,521	74,662,058,387
負債純資産合計		63,570,298,484	74,751,403,222

(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。

（貸借対照表に関する注記）

		平成24年 8月15日現在	平成25年 2月15日現在
1.	期首	平成24年 2月16日	平成24年 8月16日
	期首元本額	73,136,154,104円	69,146,010,791円
	期首からの追加設定元本額	2,418,484,403円	1,334,214,394円
	期首からの一部解約元本額	6,408,627,716円	8,621,021,132円
	元本の内訳 ※		
	インデックスファンド海外株式ヘッジなし（DC専用）	14,137,433,281円	14,506,433,257円
	DCインデックスバランス（株式20）	50,363,000円	41,603,656円
	DCインデックスバランス（株式40）	177,091,026円	152,823,559円
	DCインデックスバランス（株式60）	327,661,543円	291,543,468円
	DCインデックスバランス（株式80）	356,198,409円	338,733,712円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	10,129,006,606円	8,308,962,994円
	日興五大陸株式ファンド	18,616,031,417円	16,588,006,855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	78,109,605円	67,849,151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）	101,436,432円	98,787,847円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	21,915,500円	17,740,932円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	19,215,294円	14,100,049円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	30,298,500円	22,550,057円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	37,379,612円	28,073,594円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	16,499,123,068円	13,265,922,766円
	3資産バランスファンド（適格機関投資家向け）	29,770,220円	—円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	20,767,496円	17,312,852円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	46,088,735円	37,519,465円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	126,246,552円	104,633,239円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	164,102,767円	141,948,528円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	158,162,323円	144,302,753円
	年金積立 インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	8,019,609,405円	7,670,355,319円
	計	69,146,010,791円	61,859,204,053円
2.	受益権の総数	69,146,010,791口	61,859,204,053口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	5,850,040,270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24年 2月16日 至 平成24年 8月15日	自 平成24年 8月16日 至 平成25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管理部門を設置し、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24年 8月15日現在	平成25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24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	5,626,340,823
投資証券	199,510,308
合計	5,825,851,131

(平成25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	5,360,953,204
投資証券	84,521,569
合計	5,445,474,773

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成24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	1,592,102,019	—	1,643,186,659	51,084,640
	合計	1,592,102,019	—	1,643,186,659	51,084,640

(平成25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	1,124,399,330	—	1,133,355,105	8,955,775
	合計	1,124,399,330	—	1,133,355,105	8,955,775

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(平成24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
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	買建	753,371,427	—	752,571,540	△799,887
	米ドル	499,839,039	—	500,189,510	350,471
	ユーロ	253,532,388	—	252,382,030	△1,150,358
	売建	486,827,530	—	486,841,500	△13,970
	米ドル	236,575,200	—	236,550,000	25,200
	加ドル	63,531,600	—	63,544,000	△12,400
	豪ドル	41,260,100	—	41,265,000	△4,900
	英ポンド	105,004,580	—	105,017,500	△12,920
	スイスフラン	40,456,050	—	40,465,000	△8,950
合計		1,240,198,957	—	1,239,413,040	△813,857

(平成25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				
	買建	636,244,789	—	674,280,260	38,035,471
	米ドル	477,702,497	—	512,055,420	34,352,923
	ユーロ	158,542,292	—	162,224,840	3,682,548
合計		636,244,789	—	674,280,260	38,035,471

(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24年 8月15日現在		平成25年 2月15日現在	
1口当たり純資産額	0.9154円	1口当たり純資産額	1.2070円
(1万口当たり純資産額)	(9,154円)	(1万口当たり純資産額)	(12,070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				
ANADARKO PETROLEUM CORP	15,823	84.00	1,329,132.00	
APACHE CORP	12,244	80.33	983,560.52	
BAKER HUGHES INC	13,585	47.26	642,027.10	
CABOT OIL & GAS CORP	7,070	54.96	388,567.20	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	8,451	65.49	553,455.99	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	22,240	20.40	453,696.00	
CHEVRON CORP	62,511	115.71	7,233,147.81	
CIMAREX ENERGY CO	3,355	67.25	225,623.75	
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	5,000	25.30	126,500.00	
CONCHO RESOURCES INC	2,935	96.45	283,080.75	
CONOCOPHILLIPS	36,820	57.92	2,132,614.40	
CONSOL ENERGY INC	6,858	34.12	233,994.96	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,630	85.40	139,202.00	
CORE LABORATORIES N.V.	1,470	134.00	196,980.00	
DENBURY RESOURCES INC	10,745	18.92	203,295.40	
DEVON ENERGY CORPORATION	11,771	60.66	714,028.86	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	2,585	75.77	195,865.45	
ENERGEN CORP	2,310	48.95	113,074.50	
ENSCO PLC-CL A	7,000	65.32	457,240.00	
EOG RESOURCES INC	8,836	133.33	1,178,103.88	
EQT CORP	5,345	60.50	323,372.50	
EXXON MOBIL CORP	147,131	88.52	13,024,036.12	
FMC TECHNOLOGIES INC	8,285	51.52	426,843.20	
HALLIBURTON CO	29,567	43.32	1,280,842.44	
HELMERICH & PAYNE	2,800	67.86	190,008.00	
HESS CORP	9,410	68.35	643,173.50	
HOLLYFRONTIER CORP	6,410	56.56	362,549.60	
KINDER MORGAN INC	20,510	37.57	770,560.70	
MARATHON OIL CORP	22,967	35.34	811,653.78	
MARATHON PETROLEUM CORP	11,066	83.16	920,248.56	
MURPHY OIL CORP	6,255	60.32	377,301.60	
NABORS INDUSTRIES LTD	10,741	17.92	192,478.72	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	13,301	70.29	934,927.29	
NEWFIELD EXPLORATION CO	4,950	28.11	139,144.50	
NOBLE CORP	7,632	40.09	305,966.88	
NOBLE ENERGY INC	5,651	112.15	633,759.65	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	25,721	86.91	2,235,412.11	
OCEANEERING INTL INC	3,620	64.47	233,381.40	
PEABODY ENERGY CORP	9,290	25.01	232,342.90	
PHILLIPS 66	19,495	64.83	1,263,860.85	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,600	130.05	468,180.00	

PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	4,725	48.06	227,083.50	
QEP RESOURCES INC	6,820	29.82	203,372.40	
RANGE RESOURCES CORP	4,920	71.73	352,911.60	
ROWAN COMPANIES PLC	3,300	36.30	119,790.00	
SCHLUMBERGER LTD	42,209	81.56	3,442,566.04	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	10,635	33.31	354,251.85	
SPECTRA ENERGY CORP	20,594	29.56	608,758.64	
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	5,500	27.01	148,555.00	
ULTRA PETROLEUM CORP	5,524	16.80	92,803.20	
VALERO ENERGY CORP	17,002	47.23	803,004.46	
WEATHERFORD INTL LTD	24,599	13.24	325,690.76	
WHITING PETROLEUM CORP	4,285	50.67	217,120.95	
WILLIAMS COS INC	21,124	35.46	749,057.04	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	6,485	88.69	575,154.65	
AIRGAS INC	2,080	97.90	203,632.00	
ALBEMARLE CORP	2,650	65.41	173,336.50	
ALCOA INC	30,889	9.29	286,958.81	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	4,010	34.03	136,460.30	
BALL CORP	5,073	45.21	229,350.33	
CELANESE CORP-SERIES A	4,510	50.20	226,402.00	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1,940	217.86	422,648.40	
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	5,350	29.48	157,718.00	
CROWN HOLDINGS INC	4,035	39.78	160,512.30	
DOW CHEMICAL	37,963	32.49	1,233,417.87	
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	29,498	47.23	1,393,190.54	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,675	74.08	346,324.00	
ECOLAB INC	9,230	74.82	690,588.60	
FMC CORP	4,430	59.01	261,414.30	
FREEPORT-MCMORAN COPPER	30,023	35.53	1,066,717.19	
INTERNATIONAL PAPER CO	14,050	41.80	587,290.00	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,494	73.80	184,057.20	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,450	61.17	639,226.50	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,445	100.35	145,005.75	
MEADWESTVACO CORP	4,879	31.68	154,566.72	
MONSANTO CO	17,001	102.00	1,734,102.00	
MOSAIC CO/THE	10,390	61.98	643,972.20	
NEWMONT MINING CORP	15,980	44.55	711,909.00	
NUCOR CORP	9,649	48.23	465,371.27	
OWENS-ILLINOIS INC	4,955	26.10	129,325.50	
PPG INDUSTRIES INC	4,457	139.00	619,523.00	
PRAXAIR INC	9,670	111.21	1,075,400.70	
ROCK-TENN COMPANY-CL A	2,500	82.94	207,350.00	
SEALED AIR CORP	4,356	18.97	82,633.32	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,877	163.67	470,878.59	
SIGMA-ALDRICH	3,575	77.11	275,668.25	
UNITED STATES STEEL CORP	5,237	23.57	123,436.09	
VULCAN MATERIALS CO	4,443	54.87	243,787.41	
3M CO	20,936	102.78	2,151,802.08	
AGCO CORP	2,710	53.80	145,798.00	
AMETEK INC	8,163	41.91	342,111.33	
BOEING CO	22,712	74.93	1,701,810.16	
CATERPILLAR INC	20,746	96.07	1,993,068.22	
CUMMINS INC	5,725	118.73	679,729.25	
DANAHER CORP	19,449	61.16	1,189,500.84	

DEERE & CO	11,760	90.57	1,065,103.20	
DOVER CORP	5,410	71.86	388,762.60	
EATON CORP PLC	15,076	61.24	923,254.24	
EMERSON ELECTRIC CO	23,050	58.41	1,346,350.50	
FASTENAL CO	8,533	52.49	447,897.17	
FLOWSERVE CORP	1,825	159.97	291,945.25	
FLUOR CORP	4,903	64.57	316,586.71	
GENERAL DYNAMICS CORP	9,282	66.22	614,654.04	
GENERAL ELECTRIC CO.	336,563	23.41	7,878,939.83	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	23,456	70.09	1,644,031.04	
ILLINOIS TOOL WORKS	13,800	63.70	879,060.00	
INGERSOLL-RAND PLC	10,266	53.03	544,405.98	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,810	48.90	235,209.00	
JOY GLOBAL INC	3,005	62.73	188,503.65	
KBR INC	4,120	31.56	130,027.20	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	3,081	77.74	239,516.94	
LOCKHEED MARTIN CORP	9,081	87.08	790,773.48	
MASCO CORP	12,359	20.11	248,539.49	
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,494	65.80	493,105.20	
PACCAR INC	10,674	48.17	514,166.58	
PALL CORP	3,666	68.22	250,094.52	
PARKER HANNIFIN CORP	4,410	96.31	424,727.10	
PENTAIR LTD-REGISTERED	6,498	52.83	343,289.34	
PRECISION CASTPARTS CORP	4,660	184.64	860,422.40	
QUANTA SERVICES INC	6,025	29.11	175,387.75	
RAYTHEON COMPANY	10,732	53.76	576,952.32	
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,273	90.85	388,202.05	
ROCKWELL COLLINS INC.	4,795	59.13	283,528.35	
ROPER INDUSTRIES INC	3,180	119.86	381,154.80	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,100	33.35	103,385.00	
SPX CORP	1,477	79.35	117,199.95	
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,436	77.81	422,975.16	
TEXTRON INC	8,346	29.48	246,040.08	
TRANSDIGM GROUP INC	1,460	143.44	209,422.40	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	27,475	89.69	2,464,232.75	
WW GRAINGER INC	1,767	226.29	399,854.43	
XYLEM INC	6,518	28.47	185,567.46	
ADT CORP/THE	8,177	46.73	382,111.21	
AVERY DENNISON CORP	3,790	39.69	150,425.10	
CINTAS CORP	3,387	43.67	147,910.29	
DUN & BRADSTREET CORP	1,662	81.25	135,037.50	
EQUIFAX INC	4,084	54.25	221,557.00	
IHS INC-CLASS A	1,710	101.82	174,112.20	
IRON MOUNTAIN INC	4,684	34.56	161,879.04	
MANPOWERGROUP	2,657	52.66	139,917.62	
NIELSEN HOLDINGS NV	3,245	32.55	105,624.75	
PITNEY BOWES INC	5,613	13.49	75,719.37	
REPUBLIC SERVICES INC	9,240	31.30	289,212.00	
ROBERT HALF INTL INC	3,425	35.20	120,560.00	
STERICYCLE INC	3,025	96.44	291,731.00	
TYCO INTERNATIONAL LTD	14,885	31.87	474,384.95	
VERISK ANALYTICS INC	4,000	54.27	217,080.00	
WASTE MANAGEMENT INC	14,694	37.14	545,735.16	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,250	58.08	304,920.00	

CSX CORP	32,543	22.93	746,210.99	
DELTA AIR LINES INC	6,905	14.24	98,327.20	
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,227	42.40	264,024.80	
FEDEX CORP	9,438	106.56	1,005,713.28	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	9,780	19.83	193,937.40	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,080	67.41	207,622.80	

[次へ](#)

HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	200,000	0.83	166,000.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	3,450	97.61	336,754.50	
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,950	71.97	716,101.50	
SOUTHWEST AIRLINES CO	7,030	11.47	80,634.10	
UNION PACIFIC CORP	15,048	136.17	2,049,086.16	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	2,495	25.87	64,545.65	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	23,137	82.69	1,913,198.53	
AUTOLIV INC	2,610	67.79	176,931.90	
BORGWARNER INC	3,215	75.14	241,575.10	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	9,500	39.97	379,715.00	
FORD MOTOR COMPANY	113,035	13.11	1,481,888.85	
GENERAL MOTORS CORP	25,855	27.75	717,476.25	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	9,385	14.17	132,985.45	
HARLEY-DAVIDSON INC	7,689	53.45	410,977.05	
JOHNSON CONTROLS INC	21,248	31.83	676,323.84	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	3,805	59.83	227,653.15	
COACH INC	9,706	48.20	467,829.20	
DR HORTON INC	10,076	23.78	239,607.28	
FOSSIL INC	2,035	104.40	212,454.00	
GARMIN LTD	3,575	38.97	139,317.75	
HASBRO INC	3,368	40.88	137,683.84	
LEGGETT & PLATT INC	4,468	30.60	136,720.80	
LENNAR CORP-CL A	5,360	40.64	217,830.40	
LULULEMON ATHLETICA INC	3,600	66.99	241,164.00	
MATTEL INC	11,459	41.15	471,537.85	
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,738	107.05	186,052.90	
NEWELL RUBBERMAID INC	9,310	24.28	226,046.80	
NIKE INC -CL B	23,144	54.62	1,264,125.28	
POLARIS INDUSTRIES INC	2,180	85.58	186,564.40	
PULTE GROUP INC	11,600	20.27	235,132.00	
PVH CORP	2,030	120.30	244,209.00	
RALPH LAUREN CORP	2,095	174.86	366,331.70	
TOLL BROTHERS INC	4,501	37.50	168,787.50	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	2,640	48.90	129,096.00	
VF CORP	2,975	152.81	454,609.75	
WHIRLPOOL CORP	2,394	111.00	265,734.00	
CARNIVAL CORP	14,907	37.35	556,776.45	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	975	317.72	309,777.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	4,383	45.52	199,514.16	
H&R BLOCK INC	8,610	24.86	214,044.60	
INTL GAME TECHNOLOGY	7,626	16.48	125,676.48	
LAS VEGAS SANDS CORP	13,660	53.40	729,444.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	7,936	41.16	326,645.76	
MCDONALD'S CORP	32,251	93.56	3,017,403.56	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	14,000	13.29	186,060.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,908	35.66	175,019.28	
STARBUCKS CORP	24,142	55.55	1,341,088.10	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	6,567	62.21	408,533.07	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	4,550	58.83	267,676.50	
WYNN RESORTS LTD	2,370	123.20	291,984.00	
YUM! BRANDS INC	14,834	63.89	947,744.26	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	5,725	14.96	85,646.00	
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	19,208	42.94	824,791.52	
CHARTER COMMUNICATION-A	1,400	79.48	111,272.00	

COMCAST CORP-CLASS A	67,246	40.34	2,712,703.64	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	19,341	38.61	746,756.01	
DIRECTV	20,294	50.21	1,018,961.74	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	4,960	70.84	351,366.40	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	3,095	63.76	197,337.20	
DISH NETWORK CORP-A	7,659	36.84	282,157.56	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,846	12.49	197,916.54	
LIBERTY GLOBAL INC-A	4,473	66.10	295,665.30	
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	3,223	60.75	195,797.25	
LIBERTY MEDIA CORP	3,255	110.73	360,426.15	
NEWS CORP-CL A	49,632	28.49	1,414,015.68	
NEWS CORP-CLASS B	15,079	28.96	436,687.84	
OMNICOM GROUP	7,877	57.35	451,745.95	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	3,320	62.37	207,068.40	
SIRIUS XM RADIO INC	118,460	3.17	375,518.20	
THE WALT DISNEY CO.	54,213	54.88	2,975,209.44	
TIME WARNER CABLE	10,087	86.24	869,902.88	
TIME WARNER INC	30,118	53.63	1,615,228.34	
VIACOM INC-CLASS B	14,568	59.95	873,351.60	
VIRGIN MEDIA INC	9,025	45.22	408,110.50	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,708	78.84	213,498.72	
AMAZON.COM INC	11,495	269.24	3,094,913.80	
AUTOZONE INC	1,102	373.61	411,718.22	
BED BATH & BEYOND INC	7,102	58.74	417,171.48	
BEST BUY CO INC	9,654	15.71	151,664.34	
CARMAX INC	7,589	39.72	301,435.08	
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,770	48.76	135,065.20	
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	7,440	45.03	335,023.20	
DOLLAR TREE INC	7,944	39.93	317,203.92	
EXPEDIA INC	3,642	65.17	237,349.14	
FAMILY DOLLAR STORES	3,343	56.61	189,247.23	
GAMESTOP CORP-CLASS A	3,440	25.75	88,580.00	
GAP INC/THE	10,356	31.36	324,764.16	
GENUINE PARTS CO	4,731	70.79	334,907.49	
HOME DEPOT INC	47,960	67.34	3,229,626.40	
J.C. PENNEY CO INC	6,061	19.94	120,856.34	
KOHL'S CORP	6,782	46.98	318,618.36	
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	16,020	21.92	351,158.40	
LIMITED INC/THE	7,808	44.05	343,942.40	
LKQ CORP	9,950	23.08	229,646.00	
LOWE'S COS INC	37,322	39.57	1,476,831.54	
MACY'S INC	12,869	39.54	508,840.26	
NETFLIX INC	1,830	187.40	342,942.00	
NORDSTROM INC	4,740	55.25	261,885.00	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,755	101.68	381,808.40	
PETSMART INC	3,430	65.94	226,174.20	
PRICELINE.COM INC	1,630	705.62	1,150,160.60	
ROSS STORES INC	7,506	60.38	453,212.28	
STAPLES INC	22,854	12.88	294,359.52	
TARGET CORP	20,120	63.09	1,269,370.80	
TIFFANY & CO	4,560	63.70	290,472.00	
TJX COMPANIES INC	23,133	45.21	1,045,842.93	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,220	103.75	230,325.00	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	1,770	87.80	155,406.00	

URBAN OUTFITTERS INC	3,320	41.43	137,547.60	
COSTCO WHOLESALE CORP	13,739	102.02	1,401,652.78	
CVS CAREMARK CORP	40,507	51.89	2,101,908.23	
KROGER CO	16,285	28.24	459,888.40	
SAFEWAY INC	8,473	20.87	176,831.51	
SYSCO CORP	18,236	32.03	584,099.08	
WALGREEN CO	28,972	41.86	1,212,767.92	
WAL-MART STORES INC	59,312	70.82	4,200,475.84	
WHOLE FOODS MARKET INC	5,545	87.49	485,132.05	
ALTRIA GROUP INC	65,138	34.11	2,221,857.18	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	20,373	31.40	639,712.20	
BEAM INC	4,336	61.63	267,227.68	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,517	64.33	226,248.61	
BUNGE LTD	4,657	73.99	344,571.43	
CAMPBELL SOUP CO	5,715	38.72	221,284.80	
COCA COLA HELLENIC BTLNG-ADR	3,000	26.49	79,470.00	
COCA-COLA CO/THE	129,512	36.84	4,771,222.08	
COCA-COLA ENTERPRISES	8,900	35.92	319,688.00	
CONAGRA FOODS INC	14,060	33.78	474,946.80	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	5,580	43.75	244,125.00	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	6,909	42.80	295,705.20	
GENERAL MILLS INC	21,239	44.31	941,100.09	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	4,875	45.55	222,056.25	
HERSHEY CO/THE	5,095	80.89	412,134.55	
HJ HEINZ CO	10,670	72.50	773,575.00	
HORMEL FOODS CORP	3,770	35.91	135,380.70	
JM SMUCKER CO/THE	3,380	92.16	311,500.80	
KELLOGG CO	7,808	59.58	465,200.64	
KRAFT FOODS GROUP INC	17,941	47.16	846,097.56	
LORILLARD INC	12,570	40.78	512,604.60	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,005	64.39	257,881.95	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	6,361	78.40	498,702.40	
MOLSON COORS BREWING CO -B	5,080	43.97	223,367.60	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	54,055	26.57	1,436,241.35	
MONSTER BEVERAGE CORP	4,550	47.69	216,989.50	
PEPSICO INC	49,761	72.28	3,596,725.08	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	53,748	90.01	4,837,857.48	
REYNOLDS AMERICAN INC	11,440	43.44	496,953.60	
TYSON FOODS INC-CL A	7,806	24.22	189,061.32	
AVON PRODUCTS	15,953	21.10	336,608.30	
CHURCH & DWIGHT CO INC	4,225	59.28	250,458.00	
CLOROX COMPANY	4,156	81.39	338,256.84	
COLGATE-PALMOLIVE CO	15,220	108.33	1,648,782.60	
ENERGIZER HOLDINGS INC	2,061	91.04	187,633.44	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	7,390	63.54	469,560.60	
HERBALIFE LTD	4,450	38.27	170,301.50	
KIMBERLY-CLARK CORP	12,973	90.19	1,170,034.87	
PROCTER & GAMBLE CO	87,999	76.78	6,756,563.22	
ABBOTT LABORATORIES	49,937	34.70	1,732,813.90	
AETNA INC	10,523	49.56	521,519.88	
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,304	46.77	341,608.08	
BAXTER INTERNATIONAL INC	17,359	68.17	1,183,363.03	
BECTON DICKINSON AND CO	6,326	88.39	559,155.14	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	42,488	7.53	319,934.64	

CARDINAL HEALTH INC	10,465	46.00	481,390.00	
CAREFUSION CORP	8,275	32.74	270,923.50	
CERNER CORP	4,605	87.90	404,779.50	
CIGNA CORP	9,150	61.45	562,267.50	
COVENTRY HEALTH CARE INC	5,075	46.40	235,480.00	
COVIDIEN PLC	15,725	62.99	990,517.75	
CR BARD INC	2,344	101.00	236,744.00	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	3,059	119.21	364,663.39	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	4,562	42.91	195,755.42	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	3,660	86.35	316,041.00	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	25,734	55.10	1,417,943.40	
HCA HOLDINGS INC	6,715	36.83	247,313.45	
HENRY SCHEIN INC	3,010	88.40	266,084.00	
HOLOGIC INC	8,758	22.10	193,551.80	
HUMANA INC	4,825	77.83	375,529.75	
INTUITIVE SURGICAL INC	1,340	571.26	765,488.40	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,875	89.19	256,421.25	
MCKESSON CORP	7,624	104.21	794,497.04	
MEDTRONIC INC	32,572	47.17	1,536,421.24	
OMNICARE INC	3,640	39.74	144,653.60	
PATTERSON COS INC	3,142	37.08	116,505.36	
QUEST DIAGNOSTICS	4,826	56.53	272,813.78	
RESMED INC	4,790	43.18	206,832.20	
ST JUDE MEDICAL INC	10,490	43.01	451,174.90	
STRYKER CORP	9,683	64.02	619,905.66	
UNITEDHEALTH GROUP INC	32,800	57.05	1,871,240.00	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	3,164	70.96	224,517.44	
WELLPOINT INC	10,126	63.29	640,874.54	
ZIMMER HOLDINGS INC	5,762	76.34	439,871.08	
ABBVIE INC	49,757	36.57	1,819,613.49	
ACTAVIS INC	4,105	86.49	355,041.45	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	10,530	44.58	469,427.40	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	6,450	87.63	565,213.50	
ALLERGAN INC	10,085	107.66	1,085,751.10	
AMGEN INC	24,501	84.74	2,076,214.74	
BIOGEN IDEC INC	7,347	164.59	1,209,242.73	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	53,321	36.58	1,950,482.18	
CELGENE CORP	13,462	99.51	1,339,603.62	
ELI LILLY & CO	33,153	53.50	1,773,685.50	
FOREST LABORATORIES INC	7,745	35.73	276,728.85	
GILEAD SCIENCES INC	48,054	41.60	1,999,046.40	
HOSPIRA INC	6,181	30.05	185,739.05	
ILLUMINA INC	3,745	48.79	182,718.55	
JOHNSON & JOHNSON	87,831	75.81	6,658,468.11	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	5,316	64.11	340,808.76	
MERCK & CO. INC.	96,953	41.19	3,993,494.07	
MYLAN INC	11,865	29.16	345,983.40	
PERRIGO CO	2,650	113.16	299,874.00	
PFIZER INC	237,930	27.06	6,438,385.80	
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,350	169.24	397,714.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	11,694	74.88	875,646.72	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	7,300	45.66	333,318.00	
WARNER CHILCOTT PLC	4,500	14.24	64,080.00	
WATERS CORP	3,106	93.47	290,317.82	

BB&T CORP	22,738	30.36	690,325.68	
CIT GROUP INC	5,695	42.45	241,752.75	
COMERICA INC	7,190	35.32	253,950.80	
FIFTH THIRD BANCORP	27,389	16.13	441,784.57	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,330	37.24	86,769.20	
HUDSON CITY BANCORP INC	14,060	8.68	122,040.80	
KEYCORP	26,168	9.48	248,072.64	
M & T BANK CORP	3,463	104.60	362,229.80	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	16,064	13.60	218,470.40	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	10,750	12.91	138,782.50	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	16,600	63.87	1,060,242.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	45,874	7.91	362,863.34	
SUNTRUST BANKS INC	16,347	28.79	470,630.13	
US BANCORP	60,411	33.99	2,053,369.89	
WELLS FARGO & CO	159,800	35.21	5,626,558.00	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,540	147.34	226,903.60	
AMERICAN EXPRESS CO	32,864	62.34	2,048,741.76	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,670	69.04	460,496.80	
BANK OF AMERICA CORPORATION	343,359	12.13	4,164,944.67	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	38,412	28.10	1,079,377.20	
BLACKROCK INC	4,415	245.57	1,084,191.55	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	18,475	55.59	1,027,025.25	
CITIGROUP INC	93,327	44.32	4,136,252.64	
CME GROUP INC	10,380	58.44	606,607.20	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,970	39.52	670,654.40	
EATON VANCE CORP	3,790	40.46	153,343.40	
FRANKLIN RESOURCES INC	5,035	144.43	727,205.05	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	14,498	155.93	2,260,673.14	
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	2,160	155.52	335,923.20	
INVESCO LTD	13,827	27.78	384,114.06	
JPMORGAN CHASE & CO	121,210	49.22	5,965,956.20	
LEGG MASON INC	3,635	27.84	101,198.40	
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	27.57	201,398.85	
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	7,782	44.86	349,100.52	
MOODY'S CORP	5,927	46.68	276,672.36	
MORGAN STANLEY	47,565	23.83	1,133,473.95	
NASDAQ OMX GROUP/THE	3,055	30.60	93,483.00	
NORTHERN TRUST CORP	7,340	53.09	389,680.60	
NYSE EURONEXT	6,790	37.40	253,946.00	
SCHWAB (CHARLES) CORP	36,334	16.92	614,771.28	
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,325	28.07	121,402.75	
SLM CORP	16,092	18.94	304,782.48	
STATE STREET CORP	15,177	57.20	868,124.40	
T ROWE PRICE GROUP INC	7,865	73.84	580,751.60	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	8,530	20.16	171,964.80	
ACE LTD	11,073	86.44	957,150.12	
AFLAC INC	14,922	48.83	728,641.26	
ALLEGHANY CORP	400	373.64	149,456.00	
ALLSTATE CORP	15,763	45.88	723,206.44	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	44,435	39.21	1,742,296.35	
AON PLC	10,247	57.30	587,153.10	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,985	47.69	190,044.65	
ASSURANT INC	2,500	42.01	105,025.00	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,995	40.13	120,189.35	

BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	29,540	99.21	2,930,663.40	
CHUBB CORP	8,343	83.52	696,807.36	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,030	44.69	224,790.70	
EVEREST RE GROUP LTD	1,434	120.45	172,725.30	
FIDELITY NATIONAL FINL-A	5,881	26.14	153,729.34	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	14,002	24.49	342,908.98	
LINCOLN NATIONAL CORP	9,373	30.45	285,407.85	
LOEWS CORP	10,945	44.08	482,455.60	
MARSH & MCLENNAN COS	18,393	36.07	663,435.51	
METLIFE INC	26,395	36.69	968,432.55	

[次へ](#)

PARTNERRE LTD	2,372	86.00	203,992.00	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,290	31.62	325,369.80	
PROGRESSIVE CORP	17,870	24.00	428,880.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	15,282	57.06	871,990.92	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,497	84.03	125,792.91	
TORCHMARK CORP	3,101	55.98	173,593.98	
TRAVELERS COS INC/THE	12,164	80.34	977,255.76	
UNUM GROUP	7,828	24.40	191,003.20	
WILLIS GROUP HOLDING	6,260	36.87	230,806.20	
WR BERKLEY CORP	4,253	41.64	177,094.92	
XL GROUP PLC	9,680	28.22	273,169.60	
CBRE GROUP INC	11,490	24.70	283,803.00	
ACCENTURE PLC-CL A	20,138	73.13	1,472,691.94	
ACTIVISION BLIZZARD INC	13,350	13.99	186,766.50	
ADOBE SYSTEMS INC	15,099	38.62	583,123.38	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,270	37.87	237,444.90	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,595	152.37	243,030.15	
ANSYS INC	2,800	75.51	211,428.00	
AUTODESK INC	7,690	38.68	297,449.20	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	14,926	60.74	906,605.24	
BMC SOFTWARE INC	5,554	41.46	230,268.84	
CA INC	11,450	25.19	288,425.50	
CITRIX SYSTEMS INC	5,648	72.00	406,656.00	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	9,259	76.18	705,350.62	
COMPUTER SCIENCES CORP	5,583	47.61	265,806.63	
EBAY INC	36,897	56.83	2,096,856.51	
ELECTRONIC ARTS INC	9,244	17.15	158,534.60	
EQUINIX INC	1,450	226.00	327,700.00	
FACEBOOK INC-A	32,360	28.50	922,260.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	7,595	36.98	280,863.10	
FISERV INC	4,069	80.16	326,171.04	
GOOGLE INC-CL A	8,356	787.82	6,583,023.92	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	34,582	199.65	6,904,296.30	
INTUIT INC	9,066	60.76	550,850.16	
LINKEDIN CORP - A	2,110	161.34	340,427.40	
MASTERCARD INC-CLASS A	3,420	522.16	1,785,787.20	
MICROSOFT CORP	240,334	28.04	6,738,965.36	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	6,980	19.13	133,527.40	
ORACLE CORP	124,333	34.90	4,339,221.70	
PAYCHEX INC	9,402	33.72	317,035.44	
RACKSPACE HOSTING INC	3,210	60.94	195,617.40	
RED HAT INC	5,810	54.07	314,146.70	
SAIC INC	10,745	12.07	129,692.15	
SALESFORCE.COM INC	4,160	174.46	725,753.60	
SYMANTEC CORP	24,085	22.67	546,006.95	
SYNOPSYS INC	4,627	34.33	158,844.91	
TERADATA CORP	5,595	62.15	347,729.25	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,506	23.03	103,773.18	
VERIFONE SYSTEMS INC	3,110	33.01	102,661.10	
VERISIGN INC	5,190	45.67	237,027.30	
VISA INC-CLASS A SHARES	16,775	155.98	2,616,564.50	
VMWARE INC	2,405	73.38	176,478.90	
WESTERN UNION CO	20,081	14.14	283,945.34	
YAHOO! INC	36,985	21.18	783,342.30	

AMPHENOL CORP-CL A	5,650	70.10	396,065.00	
APPLE COMPUTER INC	29,896	466.59	13,949,174.64	
ARROW ELECTRONICS INC	3,110	41.03	127,603.30	
AVNET INC	4,620	36.32	167,798.40	
CISCO SYSTEMS INC	170,510	21.00	3,580,710.00	
CORNING INC	46,778	12.95	605,775.10	
DELL INC	45,166	13.70	618,774.20	
DOLBY LABORATORIES INC CLASS A	1,250	32.18	40,225.00	
EMC CORP/MASS	66,729	24.04	1,604,165.16	
F5 NETWORKS INC	2,365	100.89	238,604.85	
FLEXTRONICS INTL LTD	22,836	6.60	150,717.60	
FLIR SYSTEMS INC	5,565	26.70	148,585.50	
HARRIS CORP	3,080	47.74	147,039.20	
HEWLETT-PACKARD CO	62,545	17.03	1,065,141.35	
JUNIPER NETWORKS INC	16,303	21.68	353,449.04	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,755	61.12	535,105.60	
NETAPP INC	12,226	35.86	438,424.36	
QUALCOMM INC	54,212	65.53	3,552,512.36	
SANDISK CORP	7,303	50.03	365,369.09	
SEAGATE TECHNOLOGY	12,394	34.95	433,170.30	
TE CONNECTIVITY LTD	14,455	41.08	593,811.40	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	3,770	61.56	232,081.20	
WESTERN DIGITAL CORP	6,685	48.81	326,294.85	
XEROX CORP	45,964	8.03	369,090.92	
AT&T INC	183,776	35.29	6,485,455.04	
CENTURYLINK INC	20,176	32.27	651,079.52	
CROWN CASTLE INTL CORP	9,150	66.66	609,939.00	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	39,734	4.24	168,472.16	
METROPCS COMMUNICATIONS INC	8,725	10.24	89,344.00	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	3,980	68.11	271,077.80	
SPRINT NEXTEL CORP	94,922	5.87	557,192.14	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	90,753	44.33	4,023,080.49	
WINDSTREAM CORP	20,465	9.09	186,026.85	
AES CORP	17,438	11.21	195,479.98	
ALLIANT ENERGY CORP	3,610	47.00	169,670.00	
AMEREN CORPORATION	6,522	33.14	216,139.08	
AMERICAN ELECTRIC POWER	16,098	44.77	720,707.46	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5,875	39.15	230,006.25	
CALPINE CORP	9,640	18.71	180,364.40	
CENTERPOINT ENERGY INC	14,762	20.43	301,587.66	
CMS ENERGY CORP	7,820	25.75	201,365.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	9,396	56.36	529,558.56	
DOMINION RESOURCES INC/VA	17,847	54.47	972,126.09	
DTE ENERGY COMPANY	5,638	64.36	362,861.68	
DUKE ENERGY CORP	22,336	68.00	1,518,848.00	
EDISON INTERNATIONAL	9,159	46.18	422,962.62	
ENTERGY CORP	5,977	61.80	369,378.60	
EXELON CORP	26,956	30.71	827,818.76	
FIRSTENERGY CORP	13,185	40.49	533,860.65	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	2,420	56.00	135,520.00	
MDU RESOURCES GROUP INC	5,280	23.72	125,241.60	
NEXTERA ENERGY INC	12,805	72.20	924,521.00	
NISOURCE INC	8,025	26.91	215,952.75	
NORTHEAST UTILITIES	9,690	40.76	394,964.40	

NRG ENERGY INC	9,360	23.89	223,610.40	
OGE ENERGY CORP	3,310	59.53	197,044.30	
ONEOK INC	6,490	47.61	308,988.90	
P G & E CORP	12,901	42.43	547,389.43	
PEPCO HOLDINGS INC	7,192	19.73	141,898.16	
PINNACLE WEST CAPITAL	3,569	54.33	193,903.77	
PPL CORPORATION	19,788	30.53	604,127.64	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	16,738	31.12	520,886.56	
SCANA CORP	3,443	47.86	164,781.98	
SEMPRA ENERGY	7,777	75.35	585,996.95	
SOUTHERN CO	27,725	43.91	1,217,404.75	
WISCONSIN ENERGY CORP	7,644	39.45	301,555.80	
XCEL ENERGY INC	15,294	27.89	426,549.66	
ALTERA CORPORATION	11,116	36.25	402,955.00	
ANALOG DEVICES INC	10,261	46.54	477,546.94	
APPLIED MATERIALS INC	37,713	13.89	523,833.57	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	8,140	35.63	290,028.20	
BROADCOM CORP-CL A	15,346	34.57	530,511.22	
CREE INC	3,840	46.41	178,214.40	
INTEL CORP	158,962	21.23	3,374,763.26	
KLA-TENCOR CORPORATION	4,819	56.10	270,345.90	
LAM RESEARCH CORP	5,127	42.90	219,948.30	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	7,544	37.86	285,615.84	
LSI CORP	20,595	7.29	150,137.55	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	12,624	9.52	120,180.48	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	9,910	32.94	326,435.40	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6,334	37.32	236,384.88	
MICRON TECHNOLOGY INC	32,857	8.08	265,484.56	
NVIDIA CORP	18,575	12.73	236,459.75	
TEXAS INSTRUMENTS INC	36,052	33.79	1,218,197.08	
XILINX INC	7,715	38.44	296,564.60	
米ドル小計	9,949,484		445,169,744.00 (41,378,527,704)	
加ドル				
ARC RESOURCES LTD	10,615	25.20	267,498.00	
ATHABASCA OIL CORP	11,180	10.28	114,930.40	
BAYTEX ENERGY CORP	4,425	45.49	201,293.25	
BONAVISTA ENERGY CORP	4,985	12.82	63,907.70	
CAMECO CORP	13,702	21.51	294,730.02	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	34,234	31.18	1,067,416.12	
CANADIAN OIL SANDS LTD	14,490	21.47	311,100.30	
CENOVUS ENERGY INC	24,673	31.79	784,354.67	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	11,225	38.61	433,397.25	
ENBRIDGE INC	23,955	44.13	1,057,134.15	
ENCANA CORP	24,748	18.20	450,413.60	
ENERPLUS CORP	6,630	13.18	87,383.40	
HUSKY ENERGY INC	10,659	30.83	328,616.97	
IMPERIAL OIL LTD	10,162	42.11	427,921.82	
MEG ENERGY CORP	4,510	34.44	155,324.40	
NEXEN INC	18,090	27.44	496,389.60	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	9,390	24.17	226,956.30	
PEMBINA PIPELINE CORP	10,105	28.94	292,438.70	
PENGROWTH ENERGY CORP	12,780	4.53	57,893.40	
PENN WEST PETROLEUM LTD	15,493	10.65	165,000.45	
SUNCOR ENERGY INC	49,065	32.19	1,579,402.35	

TALISMAN ENERGY INC	35,392	12.51	442,753.92	
TOURMALINE OIL CORP	4,005	35.46	142,017.30	
TRANSCANADA CORP	23,153	47.09	1,090,274.77	
VERMILION ENERGY INC	3,000	50.89	152,670.00	
AGNICO-EAGLE MINES LTD	5,325	43.77	233,075.25	
AGRIUM INC	4,635	111.00	514,485.00	
BARRICK GOLD CORP	31,694	32.44	1,028,153.36	
CENTERRA GOLD INC	6,530	7.87	51,391.10	
ELDORADO GOLD CORP	20,510	10.67	218,841.70	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	14,760	20.18	297,856.80	
FRANCO-NEVADA CORP	4,495	51.81	232,885.95	
GOLDCORP INC	25,807	34.67	894,728.69	
IAMGOLD CORP	14,165	8.32	117,852.80	
INMET MINING CORPORATION	1,520	70.62	107,342.40	
KINROSS GOLD CORP	34,515	8.34	287,855.10	
NEW GOLD INC	16,160	9.96	160,953.60	
OSISKO MINING CORP	13,590	6.38	86,704.20	
PAN AMERICAN SILVER CORP	4,115	17.38	71,518.70	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	27,197	41.84	1,137,922.48	
SILVER WHEATON CORP	10,485	36.49	382,597.65	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	18,085	34.20	618,507.00	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	13,419	7.40	99,300.60	
YAMANA GOLD INC	24,996	15.65	391,187.40	
BOMBARDIER INC 'B'	52,816	4.04	213,376.64	
CAE INC	6,315	10.49	66,244.35	
FINNING INTERNATIONAL INC	4,625	26.75	123,718.75	
SNC-LAVALIN GROUP INC	4,385	48.86	214,251.10	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3,295	22.40	73,808.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	13,784	99.33	1,369,164.72	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	5,285	119.49	631,504.65	
MAGNA INTERNATIONAL INC	7,039	53.67	377,783.13	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,920	36.60	143,472.00	
TIM HORTONS INC	4,585	50.09	229,662.65	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	13,305	23.66	314,796.30	
THOMSON REUTERS CORP	11,524	30.23	348,370.52	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,040	68.35	139,434.00	
DOLLARAMA INC	2,360	59.16	139,617.60	
ALIMENTATION COUCHE SUB VTG	4,700	53.05	249,335.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	1,000	62.61	62,610.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	3,849	39.95	153,767.55	
METRO INC	3,090	64.35	198,841.50	
SHOPPERS DRUG MART INC	7,155	42.24	302,227.20	
WESTON (GEORGE) LTD	1,872	71.93	134,652.96	
SAPUTO INC	3,520	49.19	173,148.80	
CATAMARAN CORP	6,760	53.18	359,496.80	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	9,324	66.47	619,766.28	
BANK OF MONTREAL	20,511	62.68	1,285,629.48	
BANK OF NOVA SCOTIA	36,239	58.72	2,127,954.08	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	12,795	83.30	1,065,823.50	
NATIONAL BANK OF CANADA	5,470	78.85	431,309.50	
ROYAL BANK OF CANADA	45,739	63.38	2,898,937.82	
TORONTO-DOMINION BANK	28,840	83.16	2,398,334.40	
CI FINANCIAL CORP	5,690	26.78	152,378.20	
IGM FINANCIAL INC	2,535	44.46	112,706.10	

ONEX CORPORATION	3,225	44.95	144,963.75	
GREAT-WEST LIFECO INC	9,334	26.51	247,444.34	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	2,905	36.31	105,480.55	
INTACT FINANCIAL CORP	4,025	63.31	254,822.75	
MANULIFE FINANCIAL CORP	57,531	15.37	884,251.47	
POWER CORP OF CANADA	10,160	26.78	272,084.80	
POWER FINANCIAL CORP	7,645	28.99	221,628.55	
SUN LIFE FINANCIAL INC	18,214	28.86	525,656.04	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	17,922	38.43	688,742.46	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES CORP	8,664	16.96	146,941.44	
CGI GROUP INC - CL A	5,870	27.09	159,018.30	
OPEN TEXT CORPORATION	2,255	57.54	129,752.70	
RESEARCH IN MOTION	16,878	15.05	254,013.90	
BCE INC	8,930	44.34	395,956.20	
BELL ALIANT INC	2,800	27.00	75,600.00	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	12,625	45.47	574,058.75	
TELUS CORP	4,788	66.78	319,742.64	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,205	73.05	161,075.25	
FORTIS INC	7,035	33.07	232,647.45	
TRANSALTA CORP	7,950	16.16	128,472.00	
加ドル小計	1,227,997		40,658,855.54 (3,775,581,325)	
豪ドル				
CALTEX AUSTRALIA LTD	4,575	19.15	87,611.25	
ORIGIN ENERGY LTD	36,640	12.12	444,076.80	
SANTOS LTD	28,415	12.45	353,766.75	
WHITEHAVEN COAL LTD	15,000	3.26	48,900.00	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	20,388	36.39	741,919.32	
WORLEYPARSONS LTD	7,260	27.11	196,818.60	
ALUMINA LTD	94,332	1.29	121,688.28	
AMCOR LIMITED	35,520	8.94	317,548.80	
BHP BILLITON LTD	102,486	38.89	3,985,680.54	
BORAL LTD	28,545	5.00	142,725.00	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	46,275	5.39	249,422.25	
ILUKA RESOURCES LTD	15,185	10.53	159,898.05	
INCITEC PIVOT LTD	53,090	3.22	170,949.80	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	13,935	9.68	134,890.80	
NEWCREST MINING LTD	25,149	23.36	587,480.64	
ORICA LIMITED	10,785	26.99	291,087.15	
OZ MINERALS LTD	10,381	7.65	79,414.65	
RIO TINTO LTD	13,828	72.07	996,583.96	
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	6,495	10.96	71,185.20	
LEIGHTON HOLDINGS LTD	5,867	23.37	137,111.79	
ALS LTD	12,700	12.15	154,305.00	
BRAMBLES LTD	45,708	8.25	377,091.00	
ASCIANO LTD	36,333	5.17	187,841.61	
AURIZON HOLDINGS LTD	59,950	4.18	250,591.00	
QANTAS AIRWAYS LTD	34,245	1.62	55,648.12	
SYDNEY AIRPORT	5,340	3.18	16,981.20	
TOLL HOLDINGS LTD	24,745	5.50	136,097.50	
TRANSURBAN GROUP	47,535	6.12	290,914.20	
CROWN LTD	10,705	11.85	126,854.25	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	28,772	3.66	105,305.52	
TABCORP HOLDINGS LTD	23,977	3.15	75,527.55	
TATTS GROUP LTD	42,460	3.32	140,967.20	

HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	15,840	2.29	36,273.60	
METCASH LTD	31,790	4.08	129,703.20	
WESFARMERS LTD	31,860	38.88	1,238,716.80	
WOOLWORTHS LTD	39,062	32.88	1,284,358.56	
COCA-COLA AMATIL LTD	20,630	13.54	279,330.20	
TREASURY WINE ESTATES LTD	21,730	4.94	107,346.20	
COCHLEAR LTD	2,157	70.50	152,068.50	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	4,895	29.75	145,626.25	
SONIC HEALTHCARE LTD	9,830	13.95	137,128.50	
CSL LTD	16,662	56.40	939,736.80	
AUST AND NZ BANKING GROUP	86,339	28.06	2,422,672.34	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	15,708	9.95	156,294.60	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	50,657	66.90	3,388,953.30	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	72,213	29.35	2,119,451.55	
WESTPAC BANKING CORP	97,961	28.76	2,817,358.36	
ASX LTD	4,520	36.25	163,850.00	
MACQUARIE GROUP LTD	10,076	38.10	383,895.60	
AMP LTD	96,747	5.33	515,661.51	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	59,878	5.16	308,970.48	
QBE INSURANCE GROUP LTD	36,130	13.35	482,335.50	
SUNCORP GROUP LTD	41,880	11.02	461,517.60	
COMPUTERSHARE LTD	11,490	9.75	112,027.50	
TELSTRA CORPORATION LTD	135,414	4.64	628,320.96	
AGL ENERGY LTD	16,671	15.07	251,231.97	
豪ドル小計	1,876,761		29,899,713.66 (2,875,754,459)	
英ポンド				
AMEC PLC	8,850	10.42	92,217.00	
BG GROUP PLC	107,844	11.37	1,226,725.50	
BP PLC	605,658	4.50	2,725,763.82	
PETROFAC LTD	6,995	16.22	113,458.90	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	118,288	21.24	2,512,437.12	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	83,674	21.71	1,816,980.91	
TULLOW OIL PLC	28,810	12.40	357,244.00	
ANGLO AMERICAN PLC	44,104	20.13	887,813.52	
ANTOFAGASTA PLC	11,360	11.16	126,777.60	
BHP BILLITON PLC	67,581	22.25	1,503,677.25	
CRODA INTERNATIONAL PLC	3,900	25.20	98,280.00	
EURASIAN NATURAL RESOURCES	6,170	4.06	25,081.05	
FRESNILLO PLC	5,160	16.55	85,398.00	
GLENORE INTERNATIONAL-WI	118,495	3.93	466,751.80	
JOHNSON MATTHEY PLC	6,847	22.99	157,412.53	
KAZAKHMYS PLC-	7,325	7.49	54,864.25	
RANDGOLD RESOURCES LTD	3,050	58.00	176,900.00	
REXAM PLC	29,002	4.71	136,599.42	
RIO TINTO PLC	42,705	37.45	1,599,515.77	
VEDANTA RESOURCES PLC	3,810	12.82	48,844.20	
XSTRATA PLC	66,710	11.85	790,513.50	
BAE SYSTEMS PLC ORD	108,535	3.30	358,165.50	
BALFOUR BEATTY PLC	18,710	2.73	51,153.14	
BUNZL PLC	10,376	11.83	122,748.08	
COBHAM PLC	34,695	2.19	76,190.22	
IMI PLC	9,210	11.80	108,678.00	
INVENSYS PLC	27,080	3.46	93,940.52	
MEGGITT PLC	29,235	4.48	131,118.97	

MELROSE INDUSTRIES PLC	40,000	2.37	94,840.00	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	61,585	10.17	626,319.45	
SMITHS GROUP PLC	11,363	12.36	140,446.68	
WEIR GROUP PLC/THE	6,800	21.70	147,560.00	
WOLSELEY PLC	8,924	30.54	272,538.96	
AGGREKO PLC	8,361	16.41	137,204.01	
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	9,775	10.43	101,953.25	
CAPITA PLC	23,289	8.20	190,969.80	
EXPERIAN PLC	34,088	10.82	368,832.16	
G4S PLC	42,539	2.84	120,938.37	
INTERTEK GROUP PLC	4,815	32.36	155,813.40	
SERCO GROUP PLC	14,965	5.62	84,103.30	
GKN PLC	58,715	2.56	150,721.40	
BURBERRY GROUP PLC	13,234	13.60	179,982.40	
CARNIVAL PLC	6,710	25.00	167,750.00	
COMPASS GROUP PLC	60,018	7.80	468,140.40	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	8,369	19.44	162,693.36	
TUI TRAVEL PLC	14,295	3.16	45,272.26	
WHITBREAD PLC	5,940	26.51	157,469.40	
BRITISH SKY BROADCASTING GRO	36,214	8.31	300,938.34	
ITV PLC	119,005	1.13	134,951.67	
PEARSON PLC	27,619	12.07	333,361.33	
REED ELSEVIER PLC	39,836	6.88	274,071.68	
WPP PLC	39,544	10.19	402,953.36	
KINGFISHER PLC	77,657	2.75	214,100.34	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	47,910	3.89	186,609.45	
NEXT PLC	5,027	41.82	210,229.14	
SAINSBURY (J) PLC	44,131	3.35	148,191.89	
TESCO PLC	255,434	3.70	946,510.68	
WM MORRISON SUPERMARKETS	79,475	2.60	207,032.37	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	11,695	18.03	210,860.85	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	62,027	33.43	2,073,872.74	
DIAGEO PLC	80,052	19.29	1,544,603.34	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	31,572	23.12	729,944.64	
SABMILLER PLC	30,341	32.00	970,912.00	
TATE & LYLE PLC	17,580	8.01	140,903.70	
UNILEVER PLC	41,057	25.83	1,060,502.31	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	20,655	44.10	910,885.50	
SMITH & NEPHEW PLC	26,646	7.02	187,188.15	
ASTRAZENECA PLC	39,623	29.27	1,159,963.32	
GLAXOSMITHKLINE PLC	158,291	14.65	2,318,963.15	
SHIRE PLC	17,715	20.27	359,083.05	
BARCLAYS PLC	367,671	3.19	1,172,870.49	
HSBC HOLDINGS PLC	582,591	7.24	4,219,124.02	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,369,186	0.54	751,409.27	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	68,120	3.47	236,989.48	
STANDARD CHARTERED PLC	76,319	17.27	1,318,410.72	
3I GROUP PLC	29,809	2.98	89,099.10	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	22,730	4.26	96,920.72	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	7,960	8.38	66,704.80	
ICAP PLC	18,640	3.50	65,407.76	
INVESTEC PLC	13,185	4.93	65,081.16	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	4,068	13.41	54,551.88	
SCHRODERS PLC	4,181	19.69	82,323.89	

ADMIRAL GROUP PLC	6,965	12.73	88,664.45	
AVIVA PLC	87,890	3.62	318,249.69	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	198,871	1.50	299,101.98	
OLD MUTUAL PLC	143,879	1.96	282,002.84	
PRUDENTIAL PLC	81,002	9.45	765,873.91	
RESOLUTION LTD	51,593	2.63	135,947.55	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	123,607	1.33	164,891.73	
STANDARD LIFE PLC	70,055	3.38	236,785.90	
SAGE GROUP PLC/THE	43,845	3.33	146,266.92	
BT GROUP PLC	246,352	2.73	674,265.42	
INMARSAT PLC	16,910	6.49	109,745.90	
VODAFONE GROUP PLC	1,565,185	1.67	2,622,467.46	
CENTRICA PLC	165,785	3.44	571,129.32	
NATIONAL GRID PLC	115,375	6.86	792,049.37	
SEVERN TRENT PLC	8,803	15.79	138,999.37	
SSE PLC	30,057	14.09	423,503.13	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	21,925	7.18	157,531.12	
ARM HOLDINGS PLC	42,150	9.25	389,887.50	
英ボンド小計	8,941,779		51,281,689.02 (7,387,640,120)	
スイスフラン				
TRANSOCEAN LTD	11,995	53.35	639,933.25	
GIVAUDAN-REG	258	1,099.00	283,542.00	
HOLCIM LIMITED-REG SHRS	7,573	72.60	549,799.80	
SIKA AG-BR	67	2,333.00	156,311.00	
SYNGENTA AG-REG	2,965	396.00	1,174,140.00	
ABB LTD-REG	69,625	20.81	1,448,896.25	
GEBERIT AG-REG	1,255	222.20	278,861.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	780	135.80	105,924.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,490	139.50	207,855.00	
SULZER AG-REG	870	156.40	136,068.00	
ADECCO SA-REG	4,757	53.55	254,737.35	
SGS SA-REG	191	2,260.00	431,660.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,020	108.20	218,564.00	
CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	16,559	74.95	1,241,097.05	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	935	523.50	489,472.50	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,520	92.25	140,220.00	
ARYZTA AG	2,630	53.35	140,310.50	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	25	3,386.00	84,650.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	38,760.00	155,040.00	
NESTLE SA-REG	102,963	63.00	6,486,669.00	
SONOVA HOLDING AG-REG	1,510	113.40	171,234.00	
ACTELION LTD-REG	3,860	46.41	179,142.60	
LONZA GROUP AG-REG	1,650	59.50	98,175.00	
NOVARTIS AG-REG	73,313	63.20	4,633,381.60	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	22,448	205.30	4,608,574.40	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	39,495	26.90	1,062,415.50	
JULIUS BAER GROUP LTD	6,780	37.58	254,792.40	
PARGESA HOLDING SA-BR	975	66.45	64,788.75	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	500	215.80	107,900.00	
UBS AG-REG	116,262	15.48	1,799,735.76	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,390	82.15	114,188.50	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	850	145.70	123,845.00	
SWISS RE LTD	11,589	73.80	855,268.20	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,681	260.20	1,217,996.20	

SWISS PRIME SITE-REG	1,370	74.80	102,476.00	
SWISSCOM AG-REG	744	413.50	307,644.00	
スイスフラン小計	515,899		30,325,308.61 (3,058,004,120)	
香港ドル				
HOPEWELL HOLDINGS	22,500	34.05	766,125.00	
HUTCHISON WHAMPOA LTD	69,823	84.75	5,917,499.25	
NWS HOLDINGS LTD	48,500	14.34	695,490.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	37,000	15.24	563,880.00	
MTR CORP	54,500	31.85	1,735,825.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	6,000	53.60	321,600.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	24,500	27.05	662,725.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	65,000	34.55	2,245,750.00	
SANDS CHINA LTD	78,600	36.50	2,868,900.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	48,000	17.88	858,240.00	
SJM HOLDINGS LTD	57,000	20.75	1,182,750.00	
WYNN MACAU LTD	58,200	20.75	1,207,650.00	
LI & FUNG LTD	182,000	10.26	1,867,320.00	
BANK OF EAST ASIA	36,440	31.50	1,147,860.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	128,500	26.75	3,437,375.00	
HANG SENG BANK LTD	23,500	126.50	2,972,750.00	
WING HANG BANK LTD	5,500	87.00	478,500.00	
FIRST PACIFIC CO	80,000	9.68	774,400.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	34,900	145.70	5,084,930.00	
AIA GROUP LTD	345,800	31.20	10,788,960.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	42,682	124.50	5,313,909.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	77,000	30.40	2,340,800.00	
HENDERSON LAND DVLP CO LTD	27,426	54.25	1,487,860.50	
HYSAN DEVELOPMENT CO	22,000	39.00	858,000.00	
KERRY PROPERTIES LTD	27,950	40.25	1,124,987.50	
NEW WORLD DEVELOPMENT	131,000	13.98	1,831,380.00	
SINO LAND CO	105,050	14.32	1,504,316.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	51,480	124.00	6,383,520.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	24,017	100.40	2,411,306.80	
SWIRE PROPERTIES LTD	39,400	29.00	1,142,600.00	
WHARF HOLDINGS LTD	47,800	68.85	3,291,030.00	
WHELOCK & CO LTD	34,000	43.35	1,473,900.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	15,000	50.45	756,750.00	
CLP HOLDINGS LTD	59,000	66.50	3,923,500.00	
HONG KONG & CHINA GAS	157,671	21.50	3,389,926.50	
POWER ASSETS HOLDINGS	45,500	70.20	3,194,100.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	103.70	674,050.00	
香港ドル小計	2,319,739		86,680,465.55 (1,039,298,781)	
シンガポールドル				
FRASER AND NEAVE LTD	31,800	9.43	299,874.00	
KEPPEL CORP LTD	49,660	11.65	578,539.00	
NOBLE GROUP LTD	141,854	1.20	170,934.07	
SEMBICORP INDUSTRIES LTD	32,000	5.48	175,360.00	
SEMBICORP MARINE LTD	27,000	4.66	125,820.00	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	55,000	4.04	222,200.00	
YANGZIJIAN SHIPBUILDING	71,000	0.96	68,515.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	46,000	1.90	87,400.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	20,800	10.86	225,888.00	
GENTING SINGAPORE PLC	172,000	1.60	275,200.00	

SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	55,050	4.10	225,705.00	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,000	51.97	207,880.00	
OLAM INTERNATIONAL LTD	47,000	1.66	78,255.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	220,000	0.65	143,000.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	53,000	3.70	196,100.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	60,625	15.01	909,981.25	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	86,240	10.03	864,987.20	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	42,700	19.37	827,099.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	28,000	7.82	218,960.00	
CAPITALAND LTD	71,000	3.90	276,900.00	
CAPITAMALLS ASIA LTD	50,000	2.13	106,500.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	15,000	11.42	171,300.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	60,000	2.69	161,400.00	

[次へ](#)

KEPPEL LAND LTD	30,000	4.24	127,200.00	
UOL GROUP LTD	12,250	6.28	76,930.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	246,810	3.50	863,835.00	
シンガポールドル小計	1,728,789		7,685,762.52 (577,892,483)	
ニュージーランドドル				
FLETCHER BUILDING LTD	23,390	9.03	211,211.70	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	30,950	2.94	90,993.00	
SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	19,990	4.02	80,359.80	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	72,897	2.22	161,831.34	
CONTACT ENERGY LIMITED	9,430	5.21	49,130.30	
ニュージーランドドル小計	156,657		593,526.14 (46,947,917)	
スウェーデンクローナ				
LUNDIN PETROLEUM AB	8,370	149.20	1,248,804.00	
BOLIDEN AB	7,620	112.80	859,536.00	
ALFA LAVAL AB	12,110	146.00	1,768,060.00	
ASSA ABLOY AB-B	9,660	248.30	2,398,578.00	
ATLAS COPCO AB-A SHS	21,205	184.80	3,918,684.00	
ATLAS COPCO AB-B SHS	11,280	165.90	1,871,352.00	
SANDVIK AB	30,250	106.40	3,218,600.00	
SCANIA AB-B SHS	8,560	136.60	1,169,296.00	
SKANSKA AB-B SHS	10,520	113.60	1,195,072.00	
SKF AB-B SHS	12,949	157.90	2,044,647.10	
VOLVO AB-B SHARES	44,630	97.80	4,364,814.00	
SECURITAS AB-B SHS	12,199	57.05	695,952.95	
ELECTROLUX AB - B	6,765	160.60	1,086,459.00	
HUSQVARNA AB-B SHS	14,220	37.87	538,511.40	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	30,238	227.90	6,891,240.20	
SWEDISH MATCH AB	6,530	224.70	1,467,291.00	
SVENSKA CELLULOSEA AB-B SHS	17,395	156.00	2,713,620.00	
ELEKTA AB-B SHS	10,440	100.50	1,049,220.00	
GETINGE AB-B SHS	5,730	194.00	1,111,620.00	
NORDEA BANK AB	85,988	73.70	6,337,315.60	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	44,630	65.95	2,943,348.50	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	16,760	265.50	4,449,780.00	
SWEDBANK AB - A SHARES	24,570	153.50	3,771,495.00	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,390	117.40	515,386.00	
INVESTOR AB-B SHS	14,365	186.10	2,673,326.50	
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	6,715	140.90	946,143.50	
RATOS AB-B SHS	7,000	64.95	454,650.00	
ERICSSON LM-B SHS	97,085	78.20	7,592,047.00	
HEXAGON AB-B SHS	8,970	180.10	1,615,497.00	
MILICOM INTL CELLULAR-SDR	2,160	530.00	1,144,800.00	
TELE2 AB-B SHS	8,705	103.30	899,226.50	
TELIASONERA AB	73,750	43.45	3,204,437.50	
スウェーデンクローナ小計	675,759		76,158,810.75 (1,121,057,694)	
ノルウェークローネ				
AKER SOLUTIONS ASA	4,430	119.80	530,714.00	
SEADRILL LTD	11,325	209.10	2,368,057.50	
STATOIL ASA	36,224	143.20	5,187,276.80	
SUBSEA 7 SA	7,505	131.80	989,159.00	
NORSK HYDRO A S	34,250	27.49	941,532.50	
YARA INTERNATIONAL ASA	6,300	285.00	1,795,500.00	

ORKLA ASA	28,690	46.99	1,348,143.10	
DNB ASA	31,955	83.60	2,671,438.00	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,250	90.05	652,862.50	
TELENOR ASA	23,945	122.60	2,935,657.00	
ノルウェークローネ小計	191,874		19,420,340.40 (326,067,515)	
デンマーククローネ				
NOVOZYMES A/S-B SHARES	8,275	191.00	1,580,525.00	
A P MOLLER - MAERSK A/S - A	13	42,560.00	553,280.00	
A P MOLLER - MAERSK A/S - B	43	44,600.00	1,917,800.00	
DSV A/S	5,060	143.10	724,086.00	
CARLSBERG AS-B	3,360	592.50	1,990,800.00	
COLOPLAST-B	3,385	291.30	986,050.50	
WILLIAM DEMANT HOLDING	1,000	494.30	494,300.00	
NOVO NORDISK A/S-B	12,945	959.00	12,414,255.00	
DANSKE BANK A/S	20,135	107.40	2,162,499.00	
TRYG A/S	615	446.00	274,290.00	
TDC A/S	14,545	41.39	602,017.55	
デンマーククローネ小計	69,376		23,699,903.05 (394,366,386)	
イスラエルシュケル				
ISRAEL CHEMICALS LTD	15,760	49.42	778,859.20	
ISRAEL CORP LIMITED/THE	78	2,637.00	205,686.00	
TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	30,160	141.90	4,279,704.00	
BANK HAPOLIM BM	27,725	16.56	459,126.00	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	44,895	13.08	587,226.60	
NICE SYSTEMS LTD	2,325	133.80	311,085.00	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	68,880	4.62	318,776.64	
MELLANOX TECHNOLOGIES LTD	1,400	198.00	277,200.00	
イスラエルシュケル小計	191,223		7,217,663.44 (182,173,825)	
ユーロ				
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	4,720	20.80	98,176.00	
ENI SPA	80,826	17.32	1,399,906.32	
FUGRO NV-CVA	2,640	38.65	102,036.00	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	9,315	11.90	110,848.50	
NESTE OIL OYJ	3,590	11.24	40,351.60	
OMV AG	4,890	30.23	147,824.70	
REPSOL SA	25,171	15.80	397,701.80	
SAIPEM SPA	8,980	20.85	187,233.00	
TECHNIP SA	3,008	78.45	235,977.60	
TENARIS SA	15,515	15.19	235,672.85	
TOTAL SA	67,747	37.73	2,556,433.04	
AIR LIQUIDE	10,086	90.77	915,506.22	
AKZO NOBEL NV	7,208	52.43	377,915.44	
ARCELORMITTAL	30,061	12.21	367,044.81	
ARKEMA	2,005	85.06	170,545.30	
BASF SE	29,375	71.32	2,095,025.00	
CRH PLC	24,440	16.42	401,304.80	
HEIDELBERGCEMENT AG	3,965	50.11	198,686.15	
IMERYS SA	910	52.10	47,411.00	
K+S AG	5,420	33.57	181,976.50	
KONINKLIJKE DSM NV	4,382	45.26	198,329.32	
LAFARGE SA	6,368	45.58	290,253.44	
LANXESS AG	2,765	64.20	177,513.00	

LINDE AG	6,035	131.30	792,395.50	
SALZGITTER AG	1,005	35.25	35,431.27	
SOLVAY ET CIE SA -A	1,711	117.15	200,443.65	
STORA ENSO OYJ-R SHS	20,375	4.88	99,552.25	
THYSSENKRUPP AG	13,275	17.62	233,905.50	
UMICORE	3,460	36.77	127,224.20	
UPM-KYMMENE OYJ	18,648	8.61	160,652.52	
VOESTALPINE AG	4,239	26.42	111,994.38	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	5,146	17.67	90,929.82	
ALSTOM	7,390	33.62	248,488.75	
ANDRITZ AG	1,980	49.92	98,841.60	
BOSKALIS WESTMINSTER	2,855	32.73	93,444.15	
BOUYGUES SA	6,820	19.87	135,513.40	
BRENTAG AG	1,125	109.05	122,681.25	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	12,276	30.37	372,883.50	
EADS NV	13,438	34.88	468,784.63	
FERROVIAL SA	13,715	11.77	161,425.55	
FIAT INDUSTRIAL	28,270	9.55	269,978.50	
FINMECCANICA SPA	14,290	4.16	59,474.98	
GEA GROUP AG	5,040	26.47	133,434.00	
HOCHTIEF AG	1,045	53.16	55,552.20	
KONE OYJ-B	5,277	64.75	341,685.75	
KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRON	33,461	22.62	757,055.12	
LEGRAND SA	7,428	33.56	249,283.68	
MAN SE	1,554	88.36	137,311.44	
METSO OYJ	3,260	33.76	110,057.60	
PRYSMIAN SPA	5,635	15.76	88,807.60	
SAFRAN SA	6,190	33.84	209,500.55	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	16,658	54.31	904,695.98	
SIEMENS AG-REG	26,306	78.52	2,065,547.12	
THALES SA	3,505	27.40	96,054.52	
VALLOUREC	3,345	39.35	131,625.75	
VINCI SA	14,290	35.73	510,653.15	
WARTSILA OYJ	4,810	36.62	176,142.20	
ZARDOYA OTIS SA	5,219	10.49	54,747.31	
ZODIAC AEROSPACE	910	85.12	77,459.20	
BUREAU VERITAS SA	1,770	92.26	163,300.20	
EDENRED	6,096	24.95	152,095.20	
RANDSTAD HOLDING NV	4,405	31.27	137,744.35	
SOCIETE BIC SA	735	87.12	64,033.20	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	12,641	12.91	163,195.31	
ADP	970	61.50	59,655.00	
ATLANTIA SPA	12,070	13.57	163,789.90	
DEUTCHE LUFTHANSA	7,870	15.32	120,607.75	
DEUTSCHE POST AG	28,343	16.91	479,421.84	
FRAPORT AG	980	44.28	43,394.40	
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	17,530	6.50	114,050.18	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	31,722	2.64	83,746.08	
RYANAIR HOLDINGS PLC	2,835	5.75	16,309.75	
TNT EXPRESS NV	9,060	5.45	49,458.54	
VOPAK	2,440	53.70	131,028.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	10,605	71.68	760,166.40	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,650	49.93	82,392.75	
CONTINENTAL AG	3,485	87.43	304,693.55	

DAIMLER AG	28,952	44.23	1,280,691.72	
FIAT SPA	26,775	4.38	117,488.70	
MICHELIN (CGDE)-B	5,589	66.91	373,959.99	
NOKIAN RENKAAT OYJ	4,245	35.66	151,376.70	
PEUGEOT SA	8,372	6.37	53,379.87	
PIRELLI & C.	9,236	8.63	79,752.86	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	4,500	64.87	291,915.00	
RENAULT SA	5,577	46.50	259,330.50	
VOLKSWAGEN AG	771	167.55	129,181.05	
VOLKSWAGEN AG-PFD	4,733	177.40	839,634.20	
ADIDAS AG	6,661	69.33	461,807.13	
CHRISTIAN DIOR	1,760	124.30	218,768.00	
HUGO BOSS AG -ORD	900	87.23	78,507.00	
LUXOTTICA GROUP SPA	3,976	33.84	134,547.84	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	8,089	131.95	1,067,343.55	
ACCOR SA	5,606	29.26	164,031.56	
SODEXO	2,850	68.25	194,512.50	
AXEL SPRINGER AG	995	35.74	35,566.27	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	26.01	98,707.95	
JC DECAUX SA .	2,520	21.34	53,789.40	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	3,080	69.96	215,476.80	
LAGARDERE S.C.A.	2,980	25.96	77,360.80	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	2,855	23.82	68,006.10	
PUBLICIS GROUPE	4,725	49.11	232,044.75	
REED ELSEVIER NV	20,248	11.39	230,725.96	
SES	9,570	22.91	219,296.55	
WOLTERS KLUWER	11,107	15.16	168,437.65	
INDITEX	7,225	103.85	750,316.25	
PPR	2,397	159.80	383,040.60	
CARREFOUR SA	18,903	20.18	381,462.54	
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,004	76.34	152,985.36	
COLRUYT SA	2,725	35.31	96,219.75	
DELHAIZE GROUP	3,666	36.25	132,892.50	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	22,688	5.84	132,634.04	
JERONIMO MARTINS	7,685	15.69	120,616.07	
KESKO OYJ-B SHS	2,230	24.30	54,189.00	
KONINKLIJKE AHOLD NV	29,474	10.90	321,413.97	
METRO AG	4,940	24.23	119,696.20	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	25,541	69.59	1,777,398.19	
DANONE	18,444	50.37	929,024.28	
DE MASTER BLENDERS1753 NVW/I	20,968	8.73	183,071.60	
HEINEKEN HOLDING NV	2,595	45.96	119,279.17	
HEINEKEN NV	7,493	54.54	408,668.22	
KERRY GROUP PLC-A	5,390	40.30	217,217.00	
PERNOD-RICARD SA	7,036	96.03	675,667.08	
REMY COINTREAU	780	96.30	75,114.00	
SUEDZUCKER AG	2,400	32.80	78,732.00	
UNILEVER NV-CVA	51,755	29.69	1,536,605.95	
BEIERSDORF AG	3,205	65.83	210,985.15	
HENKEL AG & CO KGAA	4,580	55.09	252,312.20	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	5,873	65.17	382,743.41	
L'OREAL	7,686	111.10	853,914.60	
CELESIO AG	2,150	13.31	28,627.25	
ESSILOR INTERNATIONAL	6,685	73.64	492,283.40	

FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	6,823	52.10	355,478.30	
FRESENIUS SE & CO KGAA	3,985	89.74	357,613.90	
BAYER AG	26,290	69.64	1,830,835.60	
ELAN CORP PLC	18,000	7.71	138,798.00	
GRIFOLS SA	5,290	26.41	139,708.90	
MERCK KGAA	1,985	101.95	202,370.75	
ORION OYJ-CLASS B	2,590	22.71	58,818.90	
QIAGEN N.V.	7,635	15.68	119,716.80	
SANOFI	37,956	72.03	2,733,970.68	
UCB SA	3,708	41.00	152,046.54	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	153,605	0.23	36,235.41	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	172,503	7.59	1,310,332.78	
BANCO DE SABADELL SA	69,154	1.71	118,737.41	
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	21,145	1.02	21,610.19	
BANCO POPOLARE SCARL	62,764	1.42	89,187.64	
BANCO POPULAR ESPANOL	146,697	0.66	97,993.59	
BANCO SANTANDER SA	328,247	5.97	1,962,260.56	
BNP PARIBAS	31,852	46.75	1,489,081.00	
CAIXABANK	26,440	2.96	78,473.92	
COMMERZBANK AG	134,443	1.47	198,168.98	
CREDIT AGRICOLE SA	29,942	7.39	221,301.32	
ERSTE GROUP BANK AG	7,118	23.49	167,237.41	
INTESA SANPAOLO	339,823	1.38	470,315.03	
INTESA SANPAOLO-RSP	31,990	1.17	37,524.27	
KBC GROEP NV	6,119	30.15	184,518.44	
NATIXIS	32,490	2.84	92,336.58	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	1,470	30.50	44,835.00	
SOCIETE GENERALE	22,099	30.40	671,920.09	
UBI BANCA SCPA	28,684	3.57	102,401.88	
UNICREDIT SPA	128,513	4.35	559,288.57	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	29,595	36.32	1,074,890.40	
DEUTSCHE BOERSE AG	5,790	48.41	280,293.90	
EURAZEO	1,104	39.89	44,044.08	
EXOR SPA	1,714	22.12	37,913.68	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,912	60.20	175,302.40	
ING GROEP NV-CVA	121,345	6.68	810,705.94	
MEDIOBANCA SPA	19,150	5.49	105,133.50	
POHJOLA BANK PLC	3,875	11.99	46,461.25	
WENDEL	1,190	80.17	95,402.30	
AEGON NV	56,759	4.92	279,311.03	
AGEAS	8,414	25.37	213,505.25	
ALLIANZ SE-REG	14,488	103.25	1,495,886.00	
ASSICURAZIONI GENERALI	36,358	13.16	478,471.28	
AXA	56,422	13.55	764,518.10	
CNP ASSURANCES	6,070	12.33	74,843.10	
DELTA LLOYD NV	3,600	14.23	51,246.00	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNGS	1,845	57.60	106,272.00	
MAPFRE SA	26,034	2.40	62,481.60	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,786	134.55	778,506.30	
SAMPO OYJ-A SHS	13,759	27.85	383,188.15	
SCOR SE	5,322	21.64	115,194.69	
VIENNA INSURANCE GROUP	1,410	37.97	53,537.70	
IMMOEAST AG-TEMPORARY	16,150	—	—	
IMMOFINANZ AG	25,580	3.33	85,232.56	

IMMOFINANZ AG-TEMPORARY	13,000	—	—	
AMADEUS IT HOLDING SA	10,060	19.78	199,037.10	
ATOS	1,650	56.60	93,390.00	
CAP GEMINI SA	5,469	35.77	195,653.47	
DASSAULT SYSTEMES SA	2,315	83.35	192,955.25	
SAP AG-COMMON	29,482	59.77	1,762,139.14	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,570	17.88	63,831.60	
GEMALTO	2,370	69.48	164,667.60	
NOKIA OYJ	121,576	2.93	356,947.13	
BELGACOM SA	3,780	20.87	78,907.50	
DEUTSCHE TELEKOM AG	91,336	8.47	773,615.92	
ELISA OYJ	4,205	15.92	66,943.60	
FRANCE TELECOM SA	57,644	7.66	441,841.26	
ILIAD SA	815	143.85	117,237.75	
KONINKLIJKE KPN NV	35,906	3.25	116,694.50	
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	15,833	4.11	65,168.62	
TELECOM ITALIA SPA	277,303	0.63	174,700.89	
TELECOM ITALIA-RSP	189,867	0.54	103,667.38	
TELEFONICA SA	130,078	9.95	1,294,276.10	
TELEKOM AUSTRIA AG	6,570	5.30	34,834.14	
TELENET GROUP HOLDING NV	2,000	38.11	76,230.00	
VIVENDI	41,370	15.40	637,304.85	
ZIGGO NV	4,030	25.74	103,732.20	
ACCIONA SA	566	47.41	26,836.89	
E.ON SE	56,679	13.14	745,045.45	
ELECTRICITE DE FRANCE	8,795	14.95	131,485.25	
ENAGAS	7,050	17.65	124,467.75	
ENEL GREEN POWER SPA	64,340	1.46	94,515.46	
ENEL SPA	210,294	2.92	614,899.65	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	71,841	2.34	168,467.14	
FORTUM OYJ	14,195	14.92	211,789.40	
GAS NATURAL SDG SA	11,902	15.42	183,528.84	
GDF SUEZ	39,774	14.63	581,893.62	
IBERDROLA SA	129,702	3.81	494,424.02	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,050	41.24	167,022.00	
RWE AG	15,395	27.65	425,671.75	
RWE AG-NON VTG PFD	1,060	26.23	27,809.10	
SNAM SPA	58,840	3.58	210,882.56	
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	10,319	9.57	98,794.10	
TERNA SPA	43,127	3.19	137,575.13	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	13,334	9.28	123,752.85	
VERBUND AG	2,370	17.10	40,527.00	
ASML HOLDING NV	9,512	55.54	528,296.48	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	37,545	6.28	236,007.87	
STMICROELECTRONICS NV	23,623	6.45	152,580.95	
ユーロ小計	5,534,139		76,464,672.45 (9,491,559,791)	
合 計	33,379,476		71,654,872,120 (71,654,872,120)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	11,760	382,788.00	
		AMERICAN TOWER CORP	12,879	946,348.92	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	32,570	494,086.90	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,475	451,923.75	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,687	503,149.45	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,200	152,724.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,735	244,156.95	
		DUKE REALTY CORPORATION	6,875	109,381.25	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	10,300	592,868.00	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,825	198,067.25	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	13,915	275,517.00	
		HCP INC	14,745	695,226.75	
		HEALTH CARE REIT INC	8,730	545,188.50	
		HOTEL & RESORTS INC	21,749	372,995.35	
		KIMCO REALTY CORPORATION	11,985	258,156.90	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	123,088.02	
		PLUM CREEK TIMBER CO	4,548	217,394.40	
		PROLOGIS INC	15,622	612,538.62	
		PUBLIC STORAGE	4,719	727,669.80	
		RAYONIER INC	3,507	192,499.23	
		REALTY INCOME CORP	5,400	239,166.00	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	2,805	144,709.95	
		SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	9,714	1,559,776.98	
		SL GREEN REALTY CORP	2,650	217,697.50	
		THE MACERICH COMPANY	4,370	269,279.40	
		UDR INC	7,800	189,696.00	
		VENTAS INC	9,175	621,881.50	
		VORNADO REALTY TRUST	5,091	432,938.64	
		WEYERHAEUSER CO	18,296	556,930.24	
	投資証券小計		258,240	12,327,845.25 (1,145,873,215)	
米ドル合計				12,327,845.25 (1,145,873,215)	
加ドル	投資証券	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,380	92,645.80	
	投資証券小計		3,380	92,645.80 (8,603,088)	
加ドル合計				92,645.80 (8,603,088)	
豪ドル	投資証券	APA GROUP	19,805	113,284.60	
		CFS RETAIL PROPERTY TRUST GR	67,010	138,040.60	
		DEXUS PROPERTY GROUP	163,705	171,071.72	
		FEDERATION CENTRES	45,000	105,300.00	
		GOODMAN GROUP	54,772	253,046.64	
		GPT GROUP	47,615	180,460.85	
		LEND LEASE GROUP	17,037	178,888.50	
		MIRVAC GROUP	108,455	168,647.52	
		STOCKLAND	75,690	270,970.20	
		WESTFIELD GROUP	70,185	772,736.85	
		WESTFIELD RETAIL TRUST	86,505	267,300.45	
	投資証券小計		755,779	2,619,747.93 (251,967,355)	
豪ドル合計				2,619,747.93 (251,967,355)	

有価証券分報告書（内国投資信託支店）

英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	27,311	158,540.35	
		CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	19,860	71,714.46	
		HAMMERSON PLC	24,955	121,480.94	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	25,999	215,531.71	
		SEGRO PLC	20,223	50,860.84	
	投資証券小計		118,348	618,128.30 (89,047,562)	
英ポンド合計				618,128.30 (89,047,562)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	74,500	3,129,000.00	
	投資証券小計		74,500	3,129,000.00 (37,516,710)	
香港ドル合計				3,129,000.00 (37,516,710)	
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	62,000	161,820.00	
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	67,000	110,550.00	
		CAPITAMALL TRUST	71,800	154,370.00	
	投資証券小計		200,800	426,740.00 (32,086,580)	
シンガポールドル合計				426,740.00 (32,086,580)	
ユーロ	投資証券	CORIO NV	1,998	70,149.78	
		FONCIERE DES REGIONS	1,005	62,782.35	
		GECINA SA	740	62,996.20	
		ICADE	685	46,854.00	
		KLEPIERRE	3,895	116,382.60	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	3,070	532,798.50	
	投資証券小計		11,393	891,963.43 (110,719,420)	
ユーロ合計				891,963.43 (110,719,420)	
合計				1,675,813,930 (1,675,813,930)	

(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 574銘柄	97.3%	—	56.6%
	投資証券 29銘柄	—	2.7%	1.6%
加ドル	株式 95銘柄	99.8%	—	5.1%
	投資証券 1銘柄	—	0.2%	0.0%
豪ドル	株式 56銘柄	91.9%	—	3.9%
	投資証券 11銘柄	—	8.1%	0.3%
英ポンド	株式 100銘柄	98.8%	—	10.1%
	投資証券 5銘柄	—	1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 36銘柄	100.0%	—	4.2%
香港ドル	株式 37銘柄	96.5%	—	1.4%
	投資証券 1銘柄	—	3.5%	0.1%
シンガポールドル	株式 26銘柄	94.7%	—	0.8%
	投資証券 3銘柄	—	5.3%	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 32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 11銘柄	100.0%	—	0.5%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%	—	0.2%
ユーロ	株式 230銘柄	98.8%	—	12.9%
	投資証券 6銘柄	—	1.2%	0.2%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

3. 「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24年 8月15日現在	平成25年 2月15日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		54,276,606	29,395,315
コール・ローン		113,052,945	101,985,353
株式		6,739,753,728	8,602,148,415
投資証券		2,806,414	3,842,225
派生商品評価勘定		7,818,969	1,737,236
未収入金		192,674	—
未収配当金		15,814,526	14,257,124
未収利息		212	186
差入委託証拠金		27,822,360	53,376,723
流動資産合計		6,961,538,434	8,806,742,577
資産合計		6,961,538,434	8,806,742,577
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		—	220,292
未払解約金		4,461,276	1,759,741
流動負債合計		4,461,276	1,980,033
負債合計		4,461,276	1,980,033
純資産の部			
元本等			
元本		6,759,018,462	6,600,334,593
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		198,058,696	2,204,427,951
元本等合計		6,957,077,158	8,804,762,544
純資産合計		6,957,077,158	8,804,762,544
負債純資産合計		6,961,538,434	8,806,742,577

(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。

(貸借対照表に関する注記)

		平成24年 8月15日現在	平成25年 2月15日現在
1.	期首	平成24年 2月16日	平成24年 8月16日
	期首元本額	6,465,102,913円	6,759,018,462円
	期首からの追加設定元本額	614,251,500円	428,475,393円
	期首からの一部解約元本額	320,335,951円	587,159,262円
	元本の内訳 ※		
	日興五大株株式ファンド	4,129,895,600円	3,690,144,232円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	49,000,108円	42,987,479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	2,556,241,614円	2,843,889,995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）	23,881,140円	23,312,887円
	計	6,759,018,462円	6,600,334,593円
2.	受益権の総数	6,759,018,462口	6,600,334,593口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

	自 平成24年 2月16日 至 平成24年 8月15日	自 平成24年 8月16日 至 平成25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管理部門を設置し、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24年 8月15日現在	平成25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24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	232,332,664
投資証券	215,878
合計	232,548,542

(平成25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	884,548,417
投資証券	724,690
合計	885,273,107

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成24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	126,556,494	—	134,375,463	7,818,969
	合計	126,556,494	—	134,375,463	7,818,969

(平成25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	162,662,958	—	164,179,902	1,516,944
	合計	162,662,958	—	164,179,902	1,516,944

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(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24年 8月15日現在		平成25年 2月15日現在	
1口当たり純資産額	1.0293円	1口当たり純資産額	1.3340円
(1万口当たり純資産額)	(10,293円)	(1万口当たり純資産額)	(13,340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	3,190	61.04	194,717.60	
GAZPROM OAO-SPON ADR	130,200	8.83	1,149,666.00	
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	13,200	5.90	77,906.40	
LUKOIL OAO-SPON ADR	12,285	66.95	822,480.75	
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	2,276	117.50	267,430.00	
PETROLEO BRASILEIRO-SPON ADR	450	18.09	8,140.50	
ROSNEFT OJSC-REG S GDR	31,540	8.54	269,509.30	
SURGUTNEFTGAS-SP ADR	32,700	10.14	331,578.00	
TATNEFT-GDR	5,449	45.09	245,695.41	
TMK-GDR REG S	1,860	15.10	28,086.00	
BRASKEM SA-SPON ADR	1,780	15.10	26,878.00	
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	4,650	27.20	126,480.00	
CIA SIDERURGICA NACL-SP ADR	10,170	5.43	55,223.10	
FIBRIA CELULO SA-ADR	3,094	11.74	36,323.56	
GERDAU SA -SPON ADR	3,600	8.93	32,148.00	
MMC NORILSK NICKEL JSC-ADR	12,494	18.71	233,762.74	
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	2,110	20.49	43,233.90	
QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	300	56.85	17,055.00	
SEVERSTAL - GDR REG S	2,470	12.19	30,109.30	
SOUTHERN COPPER CORP(US)	4,280	40.26	172,312.80	
URALKALI-SPON GDR-REG S	6,220	38.73	240,900.60	
VALE SA-SP ADR	4,800	19.79	94,992.00	
LATAM AIRLINES GROUP-SP -ADR	3,880	24.64	95,603.20	
GRUPO TELEVISA SA-SPONS ADR	1,800	27.63	49,734.00	
CIA BRASILEIRA-SP ADR PEF	2,380	48.36	115,096.80	
MAGNIT OJSC-SPON GDR REGS	7,000	45.00	315,000.00	
BRF - BRASIL FOODS SA-ADR	6,180	21.26	131,386.80	
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	2,500	32.01	80,025.00	
FOMENTO ECONOMICO MEX-SP ADR	1,200	110.41	132,492.00	
BANCO BRADESCO-ADR	1,560	17.95	28,002.00	
BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	2,233	30.08	67,168.64	
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	2,975	68.93	205,066.75	
CREDICORP LTD	1,580	147.98	233,808.40	
ITAU UNIBANCO HLDNG-PREF ADR	2,775	17.23	47,813.25	
SBERBANK-SPONSORED ADR	69,000	14.41	994,290.00	
STATE BANK OF INDIA-SPON GDR	930	86.20	80,166.00	
VTB BANK OJSC-GDR-REG S	30,030	3.74	112,312.20	
EGYPTIAN KUWAITI HOLDING CO	19,965	1.28	25,555.20	
LSR GROUP OJSC-GDR REGS	7,000	5.08	35,560.00	
AMERICA MOVIL-ADR SERIES L	2,000	21.98	43,960.00	
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	15,712	19.93	313,140.16	

01 SA-ADR	159	4.40	699.60	
01 SA-ADR	1,635	3.75	6,131.25	

[次へ](#)

ROSTELECOM-SPONSORED-ADR	5,330	23.92	127,493.60	
SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR	2,515	21.33	53,644.95	
TELEF BRASIL-ADR	3,924	25.38	99,591.12	
TIM PARTICIPACOES SA-ADR	1,840	21.43	39,431.20	
CEMIG SA -SPONS ADR	2,980	11.42	34,031.60	
CIA PARANAENSE ENER-SP ADR P	3,675	15.89	58,395.75	
CIA SANEAMENTO BASICO DE-ADR	2,060	46.82	96,449.20	
FEDERAL HYDROGENERATING CO-ADR	35,000	2.37	82,950.00	
米ドル小計	528,936		8,209,627.63 (763,084,888)	
香港ドル				
CHINA COAL ENERGY CO - H	115,000	8.25	948,750.00	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	44,000	17.30	761,200.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	407,000	8.62	3,508,340.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	81,000	30.90	2,502,900.00	
CNOOC LTD	416,000	15.88	6,606,080.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	66,000	16.00	1,056,000.00	
PETROCHINA CO LTD-H	511,000	10.62	5,426,820.00	
YANZHOU COAL MINING CO-H	50,000	12.88	644,000.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	89,000	3.55	315,950.00	
ANGANG STEEL CO LTD-H	24,000	5.71	137,040.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	33,000	30.45	1,004,850.00	
CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	88,000	5.61	493,680.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	74,000	12.36	914,640.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	64,000	5.00	320,000.00	
CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP	70,000	5.89	412,300.00	
HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	45,000	4.31	193,950.00	
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	31,000	20.20	626,200.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	42,000	6.68	280,560.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	43,000	3.04	130,720.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	40,000	11.14	445,600.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	147,750	2.84	419,610.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	132,000	3.87	510,840.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	12,000	59.35	712,200.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	114,000	7.61	867,540.00	
CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	26,876	16.32	438,616.32	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	46,000	8.31	382,260.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	100,000	4.36	436,000.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	52,000	10.86	564,720.00	
CITIC PACIFIC LTD	29,000	12.16	352,640.00	
CSR CORP LTD	41,000	6.57	269,370.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-H	12,000	15.10	181,200.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	70,000	3.23	226,100.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	13,000	26.50	344,500.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	9,600	31.75	304,800.00	
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	9,000	26.95	242,550.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TE-H	32,500	10.30	334,750.00	
AIR CHINA LTD-H	58,000	6.87	398,460.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	60,000	6.95	417,000.00	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	65,825	4.19	275,806.75	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	33,000	27.95	922,350.00	
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	100,750	2.45	246,837.50	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	36,000	4.19	150,840.00	
COSCO PACIFIC LTD	64,000	12.90	825,600.00	

JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	62,000	8.12	503,440.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	43,000	6.64	285,520.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	64,000	10.98	702,720.00	
BYD CO LTD-H	10,000	29.95	299,500.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	82,000	12.06	988,920.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	100,000	4.31	431,000.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	35,000	31.00	1,085,000.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	76,318	6.61	504,461.98	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	50,000	7.65	382,500.00	
DAPHNE INTERNATIONAL HOLDING	44,000	10.60	466,400.00	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	126,000	17.66	2,225,160.00	
DAH CHONG HONG	40,000	9.15	366,000.00	
GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP	23,000	16.20	372,600.00	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	191,160	0.95	181,602.00	
INTIME DEPARTMENT STORE	32,000	10.44	334,080.00	
PARKSON RETAIL GROUP LTD	44,000	5.12	225,280.00	
CHINA RESOURCES ENTERPRISES	37,000	25.40	939,800.00	
SUN ART RETAIL GROUP	43,000	11.18	480,740.00	
WUMART STORES INC-H	24,000	15.50	372,000.00	
CHAODA MODERN AGRICULTURE	54,756	1.10	60,231.60	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	48,000	4.60	220,800.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	35,000	22.65	792,750.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	38,000	21.80	828,400.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	6,000	47.15	282,900.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	170,000	10.98	1,866,600.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	20,000	80.90	1,618,000.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	32,000	7.46	238,720.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	26,400	24.05	634,920.00	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	75,000	3.50	262,500.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	485,000	4.24	2,056,400.00	
BANK OF CHINA LTD - H	1,821,000	3.83	6,974,430.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	168,245	6.30	1,059,943.50	
CHINA CITIC BANK - H	150,000	5.20	780,000.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,719,920	6.54	11,248,276.80	
CHINA MERCHANTS BANK - H	98,150	18.10	1,776,515.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	154,000	11.34	1,746,360.00	
IND & COMM BK OF CHINA - H	1,559,575	5.77	8,998,747.75	
CHINA EVERBRIGHT LTD	18,000	14.74	265,320.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	169,000	24.45	4,132,050.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	49,600	29.90	1,483,040.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	14,000	16.00	224,000.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	54,000	11.54	623,160.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	42,000	68.20	2,864,400.00	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	42,000	10.12	425,040.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	86,320	22.60	1,950,832.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	44,000	21.95	965,800.00	
CHINA VANKE CO LTD -B	23,360	15.29	357,174.40	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	94,419	4.00	377,676.00	
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	146,000	3.93	573,780.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	26,400	13.26	350,064.00	
LONGFOR PROPERTIES	15,000	13.40	201,000.00	
POLY PROPERTY GROUP CO LTD	34,000	5.71	194,140.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	37,500	15.56	583,500.00	
SHUI ON LAND LTD	42,900	3.69	158,301.00	

SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	65,000	5.68	369,200.00	
SOHO CHINA LTD	65,000	6.22	404,300.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	24,400	271.80	6,631,920.00	
KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	14,000	25.05	350,700.00	
LENOVO GROUP LTD	130,000	8.55	1,111,500.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	60,000	4.98	298,800.00	
CHINA MOBILE LTD	145,200	85.80	12,458,160.00	
CHINA TELECOM CORP LTD	315,000	4.07	1,282,050.00	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	123,882	11.62	1,439,508.84	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	48,000	7.11	341,280.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	30,000	16.98	509,400.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	47,000	22.20	1,043,400.00	
DATANG INTL POWER GEN CO-H	23,000	3.35	77,050.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	12,000	38.35	460,200.00	
GUANGDONG INVEST	62,000	6.54	405,480.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	106,000	7.82	828,920.00	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	198,000	2.18	431,640.00	
香港ドル小計	13,791,806		133,320,175.44 (1,598,508,903)	
マレーシアリングット				
PETRONAS DAGANGAN BHD	10,000	22.78	227,800.00	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	71,000	6.15	436,650.00	
GAMUDA BHD	56,000	3.70	207,200.00	
IJM CORP BHD	35,000	4.98	174,300.00	
SIME DARBY BERHAD	64,720	9.24	598,012.80	
AIRASIA BHD	47,000	2.70	126,900.00	
MISC BHD	31,000	5.31	164,610.00	
UMW HOLDINGS BHD	20,000	12.36	247,200.00	
BERJAYA SPORTS TOTO BERHAD	26,833	4.30	115,381.90	
GENTING BHD	45,300	9.78	443,034.00	
GENTING MALAYSIA BHD	90,500	3.72	336,660.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	2,500	58.20	145,500.00	
FELDA GLOBAL VENTURES	43,000	4.49	193,070.00	
IOI CORPORATION BERHAD	91,675	4.86	445,540.50	
KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	16,000	21.70	347,200.00	
PPB GROUP BERHAD	11,700	12.02	140,634.00	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	129,800	7.16	929,368.00	
HONG LEONG BANK BERHAD	17,800	14.54	258,812.00	
MALAYAN BANKING BHD	72,150	8.98	647,907.00	
PUBLIC BANK BHD-FOREIGN MKT	32,700	15.98	522,546.00	
RHB CAPITAL BHD	25,000	7.73	193,250.00	
AMMB HOLDINGS BHD	52,600	6.34	333,484.00	
AXIATA GROUP BERHAD	61,900	6.30	389,970.00	
DIGI.COM BHD	107,000	4.80	513,600.00	
MAXIS BHD	68,000	6.41	435,880.00	
PETRONAS GAS BERHAD	20,000	18.44	368,800.00	
TENAGA NASIONAL BERHAD	47,125	7.00	329,875.00	
YTL CORPORATION BERHAD	144,704	1.56	225,738.24	
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	70,000	1.56	109,200.00	
マレーシアリングット小計	1,511,007		9,608,123.44 (288,339,784)	
タイパーツ				
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	3,500	383.00	1,340,500.00	
IRPC PCL - NVDR	191,800	4.38	840,084.00	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	36,710	164.00	6,020,440.00	

PTT PCL-NVDR	21,600	362.00	7,819,200.00	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	39,000	24.80	967,200.00	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	20,045	80.50	1,613,622.50	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	5,100	458.00	2,335,800.00	
SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	12,600	474.00	5,972,400.00	
CP ALL PCL-NVDR	132,800	48.25	6,407,600.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	70,000	33.25	2,327,500.00	
BANGKOK BANK-FOREIGN REG	32,040	226.00	7,241,040.00	
BANK OF AYUDHYA PUBLIC-NVDR	94,000	32.50	3,055,000.00	
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	24,200	207.00	5,009,400.00	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	20,000	203.00	4,060,000.00	
KRUNG THAI BANK - NVDR	162,125	25.50	4,134,187.50	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	36,300	173.00	6,279,900.00	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	28,600	202.00	5,777,200.00	
タイパーツ小計	930,420		71,201,074.00 (221,435,340)	
フィリピンペソ				
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	52,000	57.50	2,990,000.00	
SM INVESTMENTS CORP	4,410	997.00	4,396,770.00	
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	30,741	107.00	3,289,287.00	
BDO UNIBANK INC	31,000	85.50	2,650,500.00	
METROPOLITAN BANK & TRUST	25,000	111.90	2,797,500.00	
AYALA CORPORATION	4,942	566.50	2,799,643.00	
AYALA LAND INC	177,960	30.90	5,498,964.00	
SM PRIME HOLDINGS INC	217,710	18.32	3,988,447.20	
PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	810	2,860.00	2,316,600.00	
ABOITIZ POWER CORP	86,000	37.90	3,259,400.00	
ENERGY DEVELOPMENT CORP	350,000	7.47	2,614,500.00	
フィリピンペソ小計	980,573		36,601,611.20 (83,817,689)	
インドネシアルピア				
ADARO ENERGY TBK PT	270,000	1,630.00	440,100,000.00	
INDO TAMBANGRAYA MEGAH PT	18,000	40,750.00	733,500,000.00	
TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	25,000	15,450.00	386,250,000.00	
INDOCEMENT TUNGKAL PRAKARSA	32,000	22,000.00	704,000,000.00	
SEMEN GRESIK (PERSERO) PT	66,000	16,500.00	1,089,000,000.00	
PT UNITED TRACTORS	53,500	19,600.00	1,048,600,000.00	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	495,000	7,750.00	3,836,250,000.00	
GUDANG GARAM TBK PT	15,000	50,000.00	750,000,000.00	
PT INDOFOOD SUKSES MAK TBK	136,000	6,600.00	897,600,000.00	
PT UNILEVER INDONESIA TBK	30,000	22,750.00	682,500,000.00	
KALBE FARMA TBK PT	750,000	1,130.00	847,500,000.00	
BANK DANAMON INDONESIA TBK	48,000	5,950.00	285,600,000.00	
BANK MANDIRI TBK	197,000	9,100.00	1,792,700,000.00	
BANK RAKYAT INDONESIA	284,000	8,550.00	2,428,200,000.00	
PT BANK CENTRAL ASIA	294,000	10,000.00	2,940,000,000.00	
PT BANK NEGARA INDONESIA	180,000	4,375.00	787,500,000.00	
INDOSAT TBK PT	75,000	7,000.00	525,000,000.00	
PT TELEKOMUNIKASI	263,000	9,750.00	2,564,250,000.00	
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	413,500	4,725.00	1,953,787,500.00	
インドネシアルピア小計	3,645,000		24,692,337,500.00 (239,515,673)	
メキシコペソ				
CEMEX SAB-CPO	285,132	13.97	3,983,294.04	
GRUPO MEXICO SA-SER B	91,578	48.74	4,463,511.72	

INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	3,700	609.08	2,253,596.00	
MEXICHEM SAB DE CV-*	23,185	65.44	1,517,226.40	
MINERA FRISCO SAB DE CV-A1	11,000	54.20	596,200.00	
ALFA S.A.B.-A	108,000	27.46	2,965,680.00	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	11,000	61.01	671,110.00	
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	10,000	79.24	792,400.00	
GRUPO TELEVISA SAB	43,100	70.03	3,018,293.00	
WALMART DE MEXICO -SER V	137,200	41.85	5,741,820.00	
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	8,100	201.67	1,633,527.00	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	41,700	140.40	5,854,680.00	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	43,500	32.89	1,430,715.00	
GRUPO MODELO S.A.B.-SER C	17,600	113.58	1,999,008.00	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	41,670	38.53	1,605,545.10	
GRUPO FIN SANTANDER-B	32,000	38.37	1,227,840.00	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	43,900	86.14	3,781,546.00	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	66,000	35.55	2,346,300.00	
COMPARTAMOS SAB DE CV	30,000	18.76	562,800.00	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	904,800	13.99	12,658,152.00	
メキシコペソ小計	1,953,165		59,103,244.26 (433,817,812)	
ブラジルリアル				
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	2,600	46.00	119,600.00	
OGX PETROLEO E GAS PARTICIPA	26,300	3.70	97,310.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	69,860	15.79	1,103,089.40	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	99,200	17.67	1,752,864.00	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	6,800	49.40	335,920.00	
BRADSPAR SA -PREF	5,600	29.97	167,832.00	
BRASKEM SA-PREF A	1,000	14.50	14,500.00	
CIA SIDERURGICA NACIONAL	7,800	10.62	82,836.00	
DURATEX SA	6,000	14.10	84,600.00	
FIBRIA CELULOSE SA	829	22.48	18,635.92	
GERDAU SA-PREF	16,000	17.54	280,640.00	
INDS KLABIN PAPEL E CELU-PRF	15,300	13.60	208,080.00	
METALURGICA GERDAU SA-PREF	7,100	22.38	158,898.00	
USINAS SIDER MINAS GER-PF A	8,600	10.40	89,440.00	
VALE SA	25,760	38.58	993,820.80	
VALE SA-PREF A	48,650	36.75	1,787,887.50	
EMBRAER SA	15,900	16.05	255,195.00	
ALL AMERICA LATINA LOGISTICA	12,500	9.09	113,625.00	
CCR SA	20,600	21.45	441,870.00	
ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	7,000	18.00	126,000.00	
LOCALIZA RENT A CAR	2,800	37.91	106,148.00	
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP	6,700	17.40	116,580.00	
MRV ENGENHARIA	12,000	11.58	138,960.00	
PDG REALTY SA	23,600	3.06	72,216.00	
ANHANGUERA EDUCACIONAL PART	2,650	41.19	109,153.50	
CIA HERING	3,750	39.99	149,962.50	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	8,728	18.45	161,031.60	
LOJAS RENNER S.A.	2,800	78.49	219,772.00	
BRF - BRASIL FOODS SA	8,400	41.40	347,760.00	
CIA DE BEBIDAS DAS AME-PREF	18,700	91.53	1,711,611.00	
CIA DE BEBIDAS DAS AMERICAS	3,300	90.00	297,000.00	
CIA DE BEBIDAS DAS AMER-RTS	4	0.80	3.20	
CIA DE BEBIDAS DAS AMER-RTS	26	0.42	10.92	
JBS SA	24,900	7.25	180,525.00	

SOUZA CRUZ SA	11,500	32.14	369,610.00	
HYPERMARCAS SA	5,000	17.89	89,450.00	
NATURA COSMETICOS SA	5,300	53.73	284,769.00	
AMIL PARTICIPACOES SA	5,000	31.24	156,200.00	
DIAGNOSTICOS DA AMERICA SA	6,150	14.44	88,806.00	
ODONTOPREV S.A.	9,300	10.16	94,488.00	
BANCO BRADESCO S.A.	13,000	34.88	453,440.00	
BANCO BRADESCO SA-PREF	42,173	34.82	1,468,463.86	
BANCO DO BRASIL S.A.	13,500	23.80	321,300.00	
BANCO ESTADO RIO GRANDE SUL-PRF-B	6,500	16.25	105,625.00	
BANCO SAN. BRASIL-UNIT	16,200	14.17	229,554.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	52,200	33.62	1,754,964.00	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PRF	56,978	9.85	561,233.30	
BM&FBOVESPA SA	45,573	13.48	614,324.04	
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	4,700	24.65	115,855.00	
PORTO SEGURO SA	4,200	24.16	101,472.00	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	12,000	27.00	324,000.00	
BR PROPERTIES SA	6,300	25.45	160,335.00	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	3,000	57.00	171,000.00	
CIELO SA	7,920	54.99	435,520.80	
TOTVS SA	3,250	42.30	137,475.00	
OI SA	4,212	8.68	36,560.16	
OI SA-PREFERENCE	17,004	7.43	126,339.72	
TELEFONICA BRASIL S.A. -PREF	2,830	49.80	140,934.00	
TIM PARTICIPACOES SA	14,605	8.36	122,097.80	
AES TIETE SA-PREF	3,500	20.43	71,505.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS	5,880	6.88	40,454.40	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	2,300	11.66	26,818.00	
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	5,700	19.15	109,155.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	9,758	22.36	218,188.88	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	720	92.10	66,312.00	
CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS	2,300	49.01	112,723.00	
CPFL ENERGIA SA	6,800	19.65	133,620.00	
ELETROPAULO METROPOLI-PREF	2,640	13.99	36,933.60	
TRACTEBEL ENERGIA SA ORD	3,700	34.80	128,760.00	
ブラジルリアル小計	933,450		21,251,663.90 (1,009,029,001)	
チリペソ				
EMPRESAS COPEC SA	11,490	7,435.20	85,430,448.00	
CAP SA	2,045	17,624.00	36,041,080.00	
EMPRESAS CMPC SA	37,000	1,915.50	70,873,500.00	
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B-PRF	1,400	26,889.00	37,644,600.00	
LATAM AIRLINES GROUP SA	2,500	11,591.00	28,977,500.00	
S.A.C.I. FALABELLA	14,700	5,473.30	80,457,510.00	
CENCOSUD SA	19,150	2,930.60	56,120,990.00	
CENCOSUD SA-RTS	2,289	325.18	744,337.02	
BANCO DE CHILE	397,393	79.77	31,700,039.61	
BANCO DE CREDITO E INVERSION	822	35,647.00	29,301,834.00	
BANCO SANTANDER CHILE SA	747,000	35.37	26,421,390.00	
CORPBANCA	2,600,000	6.98	18,148,000.00	
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	2,700	9,836.60	26,558,820.00	
AGUAS ANDINAS SA-A	91,000	356.00	32,396,000.00	
COLBUN SA	268,000	152.82	40,955,760.00	
EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	57,700	829.94	47,887,538.00	
ENERSIS SA	269,500	186.94	50,380,330.00	

チリペソ小計	4,524,689		700,039,676.63 (138,257,836)	
韓国ウォン				
GS HOLDINGS	1,270	70,100.00	89,027,000.00	
SK INNOVATION CO LTD	1,482	178,000.00	263,796,000.00	
S-OIL CORPORATION	825	98,400.00	81,180,000.00	
CHEIL INDUSTRIES INC	1,240	88,900.00	110,236,000.00	
HANWHA CHEMICAL CORP	2,000	18,900.00	37,800,000.00	
HANWHA CORPORATION	1,160	33,050.00	38,338,000.00	
HYOSUNG CORPORATION	550	61,500.00	33,825,000.00	
HYUNDAI STEEL CO	1,130	85,900.00	97,067,000.00	
KOREA ZINC CO LTD	115	399,000.00	45,885,000.00	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	460	122,000.00	56,120,000.00	
LG CHEM LTD	1,222	302,500.00	369,655,000.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	370	257,500.00	95,275,000.00	
OCI CO LTD	320	170,000.00	54,400,000.00	
POSCO	1,600	363,500.00	581,600,000.00	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	610	92,000.00	56,120,000.00	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	3,686	8,970.00	33,063,420.00	
DAEWOO INTERNATIONAL CORP	1,431	37,950.00	54,306,450.00	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,340	29,400.00	68,796,000.00	
DOOSAN CORP	230	125,000.00	28,750,000.00	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	800	42,600.00	34,080,000.00	
DOOSAN INFRACORE CO LTD	2,030	15,750.00	31,972,500.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	910	52,700.00	47,957,000.00	
HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	1,595	22,700.00	36,206,500.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	2,210	67,700.00	149,617,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	1,115	209,500.00	233,592,500.00	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	245	114,000.00	27,930,000.00	
KCC CORP	120	280,500.00	33,660,000.00	
LG CORP	2,000	62,800.00	125,600,000.00	
LS CORP	650	88,100.00	57,265,000.00	
NEO HOLDINGS CO LTD	230	—	—	
SAMSUNG C&T CORP	3,250	65,800.00	213,850,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	835	158,500.00	132,347,500.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	3,690	37,800.00	139,482,000.00	
SAMSUNG TECHWIN CO LTD	841	59,800.00	50,291,800.00	
SK HOLDINGS CO LTD	450	180,500.00	81,225,000.00	
SK NETWORKS CO LTD	1,950	7,820.00	15,249,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	400	206,000.00	82,400,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	1,073	44,700.00	47,963,100.00	
HANKOOK TIRE CO LTD	2,132	44,500.00	94,874,000.00	
HYUNDAI MOBIS	1,720	299,000.00	514,280,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	3,800	216,500.00	822,700,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	850	74,100.00	62,985,000.00	
KIA MOTORS CORPORATION	6,490	54,000.00	350,460,000.00	
MANDO CORP	450	123,500.00	55,575,000.00	
COWAY CO LTD	1,090	46,950.00	51,175,500.00	
LG ELECTRONICS INC	2,785	74,100.00	206,368,500.00	
KANGWON LAND INC	2,770	32,100.00	88,917,000.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	380	150,000.00	57,000,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	215	394,500.00	84,817,500.00	
SHINSEGAE CO LTD	167	214,000.00	35,738,000.00	
E-MART CO LTD	472	228,500.00	107,852,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	194	359,000.00	69,646,000.00	

KT&G CORP	3,295	76,800.00	253,056,000.00	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	25	1,690,000.00	42,250,000.00	
ORION CORP	80	941,000.00	75,280,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	90	1,007,000.00	90,630,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	250	601,000.00	150,250,000.00	
CELLTRION INC	3,000	27,250.00	81,750,000.00	
CELLTRION INC(N)	445	27,250.00	12,126,250.00	
BS FINANCIAL ROUP INC	4,549	14,950.00	68,007,550.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	4,140	16,500.00	68,310,000.00	

[次へ](#)

HANA FINANCIAL GROUP	5,700	40,200.00	229,140,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	4,640	12,100.00	56,144,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	8,805	38,000.00	334,590,000.00	
KOREA EXCHANGE BANK	6,540	7,500.00	49,050,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	10,640	40,200.00	427,728,000.00	
WOORI FINANCE HOLDINGS CO	10,950	12,600.00	137,970,000.00	
DAEWOO SECURITIES CO.	4,575	12,000.00	54,900,000.00	
HYUNDAI SECURITIES CO	3,610	8,620.00	31,118,200.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	955	43,300.00	41,351,500.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	570	39,450.00	22,486,500.00	
SAMSUNG CARD CO	690	37,550.00	25,909,500.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,517	56,100.00	85,103,700.00	
WOORI INVESTMENT & SECURITIE	3,171	12,450.00	39,478,950.00	
DONGBU INSURANCE CO LTD	800	47,500.00	38,000,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	1,025	217,000.00	222,425,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	1,700	105,500.00	179,350,000.00	
NCSOFT CORPORATION	450	134,000.00	60,300,000.00	
NHN CORP	1,005	243,000.00	244,215,000.00	
SK C&C CO LTD	500	105,500.00	52,750,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	4,560	29,350.00	133,836,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,330	94,300.00	125,419,000.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	620	141,500.00	87,730,000.00	
KT CORP	1,027	35,250.00	36,201,750.00	
LG UPLUS CORP.	8,000	8,430.00	67,440,000.00	
SK TELECOM	490	174,000.00	85,260,000.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	7,390	30,700.00	226,873,000.00	
KOREA GAS CORPORATION	710	65,900.00	46,789,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	2,600	1,490,000.00	3,874,000,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	445	900,000.00	400,500,000.00	
SK HYNIX INC	11,430	25,700.00	293,751,000.00	
韓国ウォン小計	192,269		14,889,787,170.00 (1,283,499,654)	
台湾ドル				
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	32,080	84.70	2,717,176.00	
ASIA CEMENT CORP	55,728	37.20	2,073,081.60	
CHINA PETROCHEMICAL DEV CORP	77,550	18.20	1,411,410.00	
CHINA STEEL CORP	278,724	27.60	7,692,782.40	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	76,745	79.00	6,062,855.00	
FORMOSA PLASTICS CORP	100,408	80.00	8,032,640.00	
NAN YA PLASTICS CORP	128,857	58.80	7,576,791.60	
TAIWAN CEMENT	105,170	39.15	4,117,405.50	
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	20,000	72.80	1,456,000.00	
TSRC CORP	19,800	60.00	1,188,000.00	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	98,490	34.50	3,397,905.00	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	6,300	228.50	1,439,550.00	
TECO ELECTRIC & MACHINERY	85,000	24.00	2,040,000.00	
WALSIN LIHWA CORP	185,000	9.82	1,816,700.00	
EVA AIRWAYS CORP	62,000	18.30	1,134,600.00	
EVERGREEN MARINE	44,769	18.25	817,034.25	
YANG MING MARINE TRANSPORT	52,443	13.90	728,957.70	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	39,954	78.20	3,124,402.80	
YULON MOTOR COMPANY	35,020	53.80	1,884,076.00	
POU CHEN	77,145	30.00	2,314,350.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	7,000	237.50	1,662,500.00	

PRESIDENT CHAIN STORE CORP	20,448	162.50	3,322,800.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	93,882	51.50	4,834,923.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	127,126	16.65	2,116,647.90	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	350,715	8.79	3,082,784.85	
CHINATRUST FINANCIAL HOLDING	252,184	18.05	4,551,921.20	
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	126,195	17.45	2,202,102.75	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	144,029	18.85	2,714,946.65	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	149,177	17.25	2,573,303.25	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	190,495	25.40	4,838,573.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	93,608	13.60	1,273,068.80	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	135,123	12.00	1,621,476.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	136,115	17.05	2,320,760.75	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	170,743	39.80	6,795,571.40	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	143,127	16.20	2,318,657.40	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	161,223	35.30	5,691,171.90	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	54,589	29.80	1,626,752.20	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	107,754	8.79	947,157.66	
ACER INC	59,680	25.10	1,497,968.00	
ADVANTECH CO LTD	10,968	130.50	1,431,324.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	15,797	356.00	5,623,732.00	
AU OPTRONICS CORP	173,994	11.30	1,966,132.20	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	15,405	134.50	2,071,972.50	
CHENG UEI PRECISION INDUSTRY	6,949	54.80	380,805.20	
COMPAL ELECTRONICS	111,955	20.75	2,323,066.25	
DELTA ELECTRONICS INC	40,419	108.00	4,365,252.00	
E INK HOLDINGS INC	35,000	20.40	714,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	21,152	84.50	1,787,344.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	249,533	83.60	20,860,958.80	
HTC CORP	17,011	271.50	4,618,486.50	
INNOLUX CORP	133,269	15.05	2,005,698.45	
INVENTEC CORP	62,162	11.85	736,619.70	
LARGAN PRECISION CO LTD	3,236	805.00	2,604,980.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	65,782	42.50	2,795,735.00	
PEGATRON CORP	34,854	39.60	1,380,218.40	
QUANTA COMPUTER INC	63,416	68.00	4,312,288.00	
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	11,000	132.00	1,452,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	30,591	61.10	1,869,110.10	
TPK HOLDING CO LTD	6,721	516.00	3,468,036.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	21,000	28.50	598,500.00	
WINTEK CORP	51,696	13.45	695,311.20	
WISTRON CORP	43,834	33.45	1,466,247.30	
WPG HOLDINGS LTD	40,000	35.00	1,400,000.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	92,371	93.90	8,673,636.90	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	27,000	73.70	1,989,900.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	33,188	104.00	3,451,552.00	
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	146,784	24.00	3,522,816.00	
EPISTAR CORP	10,292	53.70	552,680.40	
MACRONIX INTERNATIONAL	97,599	8.25	805,191.75	
MEDIATEK INC	26,530	325.00	8,622,250.00	
MSTAR SEMICONDUCTOR INC	3,908	221.50	865,622.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	12,522	117.50	1,471,335.00	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	19,635	43.45	853,140.75	
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	13,390	110.00	1,472,900.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	11,699	68.90	806,061.10	

RICTEK TECHNOLOGY CORP	5,512	178.50	983,892.00	
SILICONWARE PRECISION INDS	95,082	30.20	2,871,476.40	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	586,355	105.00	61,567,275.00	
TRANSCEND INFORMATION INC	7,346	81.40	597,964.40	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	288,592	11.35	3,275,519.20	
台湾ドル小計	6,847,945		290,329,835.06 (911,635,682)	
インドルピー				
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	6,400	387.35	2,479,040.00	
CAIRN INDIA LTD	9,100	312.40	2,842,840.00	
COAL INDIA LTD	9,000	350.90	3,158,100.00	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	25,460	322.30	8,205,758.00	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	28,946	856.05	24,779,223.30	
ACC LIMITED	1,330	1,246.05	1,657,246.50	
AMBUJA CEMENTS LIMITED	10,970	190.80	2,093,076.00	
ASIAN PAINTS LTD	1,000	4,526.10	4,526,100.00	
HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	29,280	110.65	3,239,832.00	
JINDAL STEEL & POWER LTD	13,500	390.30	5,269,050.00	
JSW STEEL LIMITED	2,000	785.80	1,571,600.00	
SESA GOA LTD	8,500	163.15	1,386,775.00	
STERLITE INDUSTRIES INDIA LT	24,600	98.00	2,410,800.00	
TATA STEEL LIMITED	5,416	380.90	2,062,954.40	
ADANI ENTERPRISES LTD	5,500	215.55	1,185,525.00	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	13,150	203.80	2,679,970.00	
JAIPRAKASH ASSOCIATES LTD	18,060	71.35	1,288,581.00	
LARSEN & TOUBRO LIMITED	6,520	1,441.10	9,395,972.00	
SIEMENS INDIA LIMITED	1,890	576.20	1,089,018.00	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	15,000	148.40	2,226,000.00	
BAJAJ AUTO LTD	2,400	2,002.60	4,806,240.00	
HERO MOTOCORP LTD	2,200	1,670.45	3,674,990.00	
MAHINDRA & MAHINDRA LIMITED	10,600	900.80	9,548,480.00	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,105	1,485.25	3,126,451.25	
TATA MOTORS LTD	20,500	297.20	6,092,600.00	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	12,780	227.60	2,908,728.00	
ITC LTD	50,510	300.75	15,190,882.50	
UNITED SPIRITS LIMITED	1,330	1,894.40	2,519,552.00	
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	15,520	464.55	7,209,816.00	
CIPLA LTD	7,650	381.70	2,920,005.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	3,090	1,874.35	5,791,741.50	
LUPIN LTD	5,200	590.20	3,069,040.00	
RANBAXY LABORATORIES LTD	4,755	413.05	1,964,052.75	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	5,500	778.95	4,284,225.00	
AXIS BANK LIMITED	6,160	1,432.30	8,822,968.00	
HDFC BANK LTD	39,775	674.80	26,840,170.00	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	32,575	816.20	26,587,715.00	
ICICI BANK LTD	12,065	1,126.20	13,587,603.00	
STATE BANK OF INDIA	2,300	2,215.75	5,096,225.00	
IDFC LTD	36,300	154.70	5,615,610.00	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	5,810	665.40	3,865,974.00	
RELIANCE CAPITAL LIMITED	3,510	397.25	1,394,347.50	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	4,000	731.50	2,926,000.00	
DLF LTD	4,900	253.85	1,243,865.00	
UNITECH LTD	40,000	29.70	1,188,000.00	
HCL TECHNOLOGIES LTD	7,300	708.25	5,170,225.00	
INFOSYS LTD	9,835	2,812.75	27,663,396.25	

TATA CONSULTANCY SVS LTD	12,050	1,447.70	17,444,785.00	
WIPRO LTD	12,166	395.80	4,815,302.80	
BHARTI AIRTEL LTD	10,000	311.70	3,117,000.00	
RELIANCE COMMUNICATION LTD	9,055	67.25	608,948.75	
GAIL INDIA LTD	10,875	334.65	3,639,318.75	
NTPC LIMITED	13,850	149.30	2,067,805.00	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	28,300	105.70	2,991,310.00	
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	2,940	470.50	1,383,270.00	
RELIANCE POWER LTD	15,875	79.60	1,263,650.00	
TATA POWER CO LTD	26,000	95.00	2,470,000.00	
インドルピー小計	725,403		326,457,754.25 (568,036,492)	
チェココルナ				
KOMERCNI BANKA AS	360	3,940.00	1,418,400.00	
TELEFONICA CZECH REPUBLIC AS	1,925	308.50	593,862.50	
CEZ AS	4,130	625.00	2,581,250.00	
チェココルナ小計	6,415		4,593,512.50 (22,508,211)	
エジプトポンド				
COMMERCIAL INTL BANK	16,500	34.97	577,005.00	
EGYPTIAN FINANCIAL GROUP	6,625	11.72	77,645.00	
ORASCOM TELECOM HOLDING	60,000	4.36	261,600.00	
エジプトポンド小計	83,125		916,250.00 (12,653,412)	
コロンビアペソ				
ECOPETROL SA	50,000	5,450.00	272,500,000.00	
CEMENTOS ARGOS SA	8,890	10,500.00	93,345,000.00	
GRUPO ARGOS SA	8,660	23,460.00	203,163,600.00	
GRUPO ARGOS SA-PRF	2,755	23,140.00	63,750,700.00	
ALMACENES EXITO SA	4,500	34,760.00	156,420,000.00	
BANCO DAVIVIENDA SA-PRF	4,000	25,000.00	100,000,000.00	
CORP FINANCIERA COLOMBIANA	2,500	35,140.00	87,850,000.00	
GRUPO DE INV SURAMERICANA	8,300	37,620.00	312,246,000.00	
INTERCONEXION ELECTRICA SA	13,000	10,080.00	131,040,000.00	
コロンビアペソ小計	102,605		1,420,315,300.00 (73,998,427)	
ハンガリーフォリント				
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	1,210	17,490.00	21,162,900.00	
OTP BANK PLC	4,585	4,801.00	22,012,585.00	
MAGYAR TELEKOM TELECOMMUNICA	13,420	394.00	5,287,480.00	
ハンガリーフォリント小計	19,215		48,462,965.00 (20,640,376)	
モロッコディルハム				
DOUJA PROM ADDOHA	3,700	60.50	223,850.00	
モロッコディルハム小計	3,700		223,850.00 (2,486,973)	
ポーランドズロチ				
GRUPA LOTOS SA	3,000	37.97	113,910.00	
POLISH OIL & GAS	37,985	5.67	215,374.95	
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	5,930	50.70	300,651.00	
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	1,200	94.20	113,040.00	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	3,710	187.80	696,738.00	
EUROCASH SA	4,200	49.30	207,060.00	
KERNEL HOLDING SA	2,100	66.95	140,595.00	
BANK PEKAO SA	3,152	158.70	500,222.40	

BRE BANK SA	230	329.60	75,808.00	
PKO BANK POLSKI SA	18,445	35.50	654,797.50	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	1,400	404.90	566,860.00	
ASSECO POLAND SA	2,400	43.05	103,320.00	
TELEKOMUNIKACJA POLSKA SA	14,105	7.00	98,735.00	
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	18,400	16.98	312,432.00	
TAURON POLSKA ENERGIA SA	37,000	4.56	168,720.00	
ポーランドズロチ小計	153,257		4,268,263.85 (126,810,118)	
南アフリカランド				
EXXARO RESOURCES LTD	3,510	180.96	635,169.60	
SASOL LTD	12,700	398.38	5,059,426.00	
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	1,800	203.06	365,508.00	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	1,660	467.50	776,050.00	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	8,520	254.66	2,169,703.20	
ARCELORMITTAL SOUTH AFRICA	4,451	32.20	143,322.20	
GOLD FIELDS LTD	16,590	90.26	1,497,413.40	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	11,200	64.25	719,600.00	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	11,430	161.00	1,840,230.00	
KUMBA IRON ORE LTD	1,680	599.90	1,007,832.00	
PPC LTD	14,010	33.82	473,818.20	
SAPPI LIMITED	8,415	28.65	241,089.75	
SIBANYE GOLD LTD(N)	16,590	16.30	270,417.00	
AVENG LTD	15,626	32.50	507,845.00	
BARLOWORLD LTD	6,500	87.90	571,350.00	
BIDVEST GROUP LTD	8,172	226.50	1,850,958.00	
REUNERT LTD	6,010	74.90	450,149.00	
STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	25,460	28.03	713,643.80	
NASPERS LTD-N SHS	9,810	597.60	5,862,456.00	
FOSCHINI GROUP LTD/THE	6,775	118.30	801,482.50	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	3,655	202.00	738,310.00	
MR PRICE GROUP LTD	7,300	126.76	925,348.00	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	13,420	102.97	1,381,857.40	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	21,905	65.40	1,432,587.00	
MASSMART HOLDINGS LTD	2,739	185.32	507,591.48	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	9,710	172.10	1,671,091.00	
SPAR GROUP LIMITED/THE	4,760	116.00	552,160.00	
TIGER BRANDS LTD	3,490	295.83	1,032,446.70	
LIFE HEALTHCARE GROUP	20,000	32.00	640,000.00	
NETCARE LTD	16,150	19.80	319,770.00	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	9,041	158.38	1,431,913.58	
ABSA GROUP LTD	6,900	166.00	1,145,400.00	
NEDBANK GROUP LTD	3,350	189.45	634,657.50	
STANDARD BANK GROUP LTD	29,616	119.51	3,539,408.16	
AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	18,069	31.70	572,787.30	
FIRSTRAND LTD	75,870	31.49	2,389,146.30	
INVESTEC LTD	6,500	67.70	440,050.00	
REMGRO LTD	8,040	165.62	1,331,584.80	
RMB HOLDINGS LTD	19,830	42.28	838,412.40	
DISCOVERY LTD	9,400	64.85	609,590.00	
MMI HOLDINGS LTD	24,429	23.03	562,599.87	
RMI HOLDINGS LTD	19,830	22.11	438,441.30	
SANLAM LTD	41,835	43.00	1,798,905.00	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	41,000	25.86	1,060,260.00	
REDEFINE PROPERTIES LTD	55,000	9.80	539,000.00	

MTN GROUP LTD	39,515	178.48	7,052,637.20	
VODACOM GROUP LTD	9,035	115.01	1,039,115.35	
南アフリカランド小計	711,298		60,582,533.99 (641,569,034)	
トルコリラ				
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	3,470	48.50	168,295.00	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	40,627	2.35	95,473.45	
ENKA INSAAT VE SANAYI AS	15,397	5.28	81,296.16	
KOC HOLDING AS	12,124	8.94	108,388.56	
ARCELIK A.S.	6,500	10.80	70,200.00	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	2,200	82.50	181,500.00	
ANADOLU EFES BIRACILIK	5,581	25.50	142,315.50	
AKBANK T.A.S.	49,259	8.50	418,701.50	
TURKIYE GARANTI BANKASI	65,740	8.58	564,049.20	
TURKIYE HALK BANKASI	14,660	16.75	245,555.00	
TURKIYE IS BANKASI-C	39,904	6.38	254,587.52	
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	19,682	5.36	105,495.52	
YAPI VE KREDI BANKASI	18,033	5.04	90,886.32	
HACI OMER SABANCI HOLDING	27,753	10.30	285,855.90	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	17,056	11.15	190,174.40	
トルコリラ小計	337,986		3,002,774.03 (157,915,886)	
ユーロ				
MAROC TELECOM	3,890	9.50	36,955.00	
ユーロ小計	3,890		36,955.00 (4,587,224)	
合 計	37,986,154		8,602,148,415 (8,602,148,415)	

(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	73,060.00	
	投資証券小計		26,000	73,060.00 (3,842,225)	
トルコリラ合計				73,060.00 (3,842,225)	
合計				3,842,225 (3,842,225)	

(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 51銘柄	100.0%	—	8.9%
香港ドル	株式 114銘柄	100.0%	—	18.5%
マレーシアリングット	株式 29銘柄	100.0%	—	3.4%
タイバーツ	株式 17銘柄	100.0%	—	2.6%
フィリピンペソ	株式 11銘柄	100.0%	—	1.0%
インドネシアルピア	株式 19銘柄	100.0%	—	2.8%
メキシコペソ	株式 20銘柄	100.0%	—	5.0%
ブラジルリアル	株式 69銘柄	100.0%	—	11.7%

チリペソ	株式	17銘柄	100.0%	—	1.6%
韓国ウォン	株式	91銘柄	100.0%	—	14.9%
台湾ドル	株式	80銘柄	100.0%	—	10.6%
インドルピー	株式	57銘柄	100.0%	—	6.6%
チェココルナ	株式	3銘柄	100.0%	—	0.3%
エジプトポンド	株式	3銘柄	100.0%	—	0.1%
コロンビアペソ	株式	9銘柄	100.0%	—	0.9%
ハンガリーフォリント	株式	3銘柄	100.0%	—	0.2%
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%	—	1.5%
南アフリカランド	株式	47銘柄	100.0%	—	7.5%
トルコリラ	株式	15銘柄	97.6%	—	1.8%
	投資証券	1銘柄	—	2.4%	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25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24年8月16日から平成25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25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24年6月15日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴 司
業務執行社員

指定社員 公認会計士 辻 村 和 之
業務執行社員

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成24年12月7日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽太典明
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 秋宗勝彦
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24年4月1日から平成25年3月31日までの第54期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24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24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24年4月1日から平成24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。