

## 【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成26年3月25日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 村上 雅彦
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	雄谷 敦史
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

有価証券報告書を提出しましたので平成25年9月25日付をもって提出しました有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出します。

## 2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部\_\_\_\_\_は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書が更新されます。なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」および「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」は原届出書の更新後の内容を記載しています。

## 第一部【証券情報】

## (5)【申込手数料】

## &lt;更新後&gt;

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「(8) 申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

・販売会社における申込手数料率は3.15%<sup>\*</sup>（税抜3%）が上限となっております。

\*消費税率が8%になった場合は、3.24%となります。

## 第二部【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】

<更新後>

ファンドの特色

#### **1 日本、海外先進国および新興国の経済規模に応じた資産配分を行ないます。**

- 日本、海外先進国および新興国への資産配分比率は、各地域のGDP比率に基づいて決定し、年に一度（原則として6月）見直しを行ないます。
  - 各地域の経済成長度合いを反映した資産配分により、世界経済全体の成長ベースにあわせた資産の長期的な成長をめざします。
- ※当ファンドでは海外先進国をIMFの定義する先進国から日本を除いたものと定義し、新興国を日本と海外先進国以外の国と定義しています。

#### **2 資産の安定成長をめざすため、株式と債券に分散投資を行ないます。**

- 分散投資効果を勘案し、「株式」と「債券」の資産配分は50%ずつを基本とします。
  - 各資産への投資は、各資産を主要投資対象とするマザーファンドを通じて行ないます。
- ※各マザーファンドは各市場全体の値動きを表す指数に連動する投資成果をめざす運用（インデックス運用）を行ないます。

#### **3 毎月安定的な分配を行なうことをめざします。**

- インカム収益などを原資として、毎月の決算時に、安定した分配を行なうことをめざします。
  - 年4回（3月、6月、9月および12月）の決算時には、基準価額水準などを勘案し、上記安定分配相当額に加えて、キャピタル収益などを積極的に分配する場合があります。
- ※分配金額は収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により分配金額を変更する場合や分配を行なわない場合もあります。

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

## 1 日本・海外先進国・新興国の経済規模に応じた資産配分を行ないます。

各地域の資産配分比率は各地域のGDP比率に基づいて決定します。



【各地域のGDP比率】  
（IMFの2013年予想の値をもとに日興アセットマネジメントが作成。）  
※端数処理の関係で合計が100%にならない場合があります。

## 2 資産の安定成長をめざすため、株式と債券に分散投資を行ないます。

分散投資効果を勘案し、「株式」と「債券」の資産配分比率は50%ずつを基本とします。

【株式部分:50%】

【債券部分:50%】



### 【ワールドクルーズの資産配分比率】

- 上記は2014年1月現在の目標とする資産配分比率であり、将来変更になる場合があります。
- 各マザーファンドへの実際の資産配分比率は時価の影響などにより、必ずしも上記数値とは一致しません。



## 投資対象国・地域

日本および、海外先進国、新興国など計46の国や地域にグローバル分散投資を行ないます。



### 日本

### 海外先進国

- 【欧州】 アイルランド、イギリス、イタリア、オーストリア、オランダ、スイス、スウェーデン、スペイン、デンマーク、ドイツ、ノルウェー、フィンランド、フランス、ベルギー、ポルトガル
  - 【中東】 イスラエル
  - 【北米】 アメリカ、カナダ
  - 【アジア】 シンガポール、香港
  - 【オセアニア】 オーストラリア、ニュージーランド
- (22の国と地域)

### 新興国

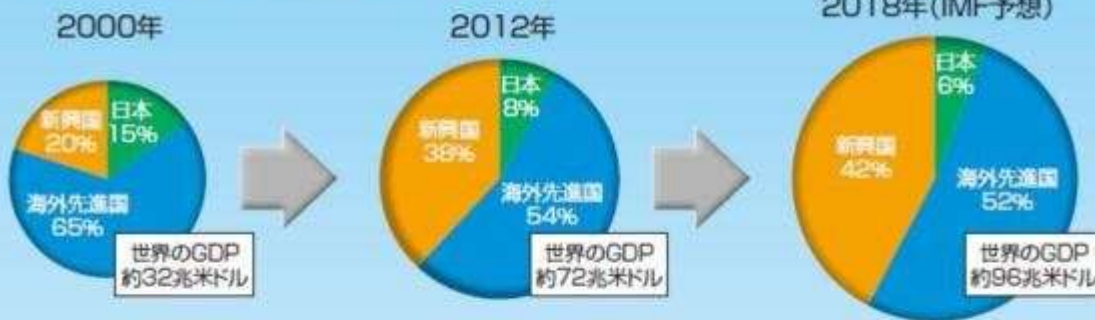
- 【欧州】 チェコ、ハンガリー、ポーランド、ルーマニア、ギリシア
  - 【中東・ロシア】 トルコ、ロシア
  - 【北米・南米】 メキシコ、コロンビア、チリ、ブラジル、ペルー
  - 【アジア】 インド、インドネシア、タイ、フィリピン、マレーシア、韓国、台湾、中国
  - 【アフリカ】 エジプト、ナイジェリア、南アフリカ
- (23の国と地域)

●上図は2014年1月末現在の当ファンドが連動をめざす各指数をもとに作成した投資対象国・地域であり、将来変更になる可能性があります。

## (参考)グローバル分散投資の意義 ～ワールドクルーズをめざすもの～

世界の経済成長に伴なう

- ①株価の長期的な上昇が期待できます。
- ②相対的に高い利子収入が期待できます。
- ③通貨価値の上昇による為替差益の獲得が期待できます。

**(参考)世界経済は力強い成長を続けており、新興国の比率も高まっています。****世界のGDPと日本・海外先進国・新興国の割合**

- IMFの地域定義とデータをもとに日興アセットマネジメントが作成。
- 上記グラフデータは過去のものおよび予想値であり将来の運用成果等を約束するものではありません。

**(参考)世界経済の成長を牽引していくのは、BRICsなどの新興国となることが予想されています。****新興国とは**

経済が初期・中期の成長過程にあり、今後も高い経済成長が期待される国・地域をいいます。

**BRICsとは**

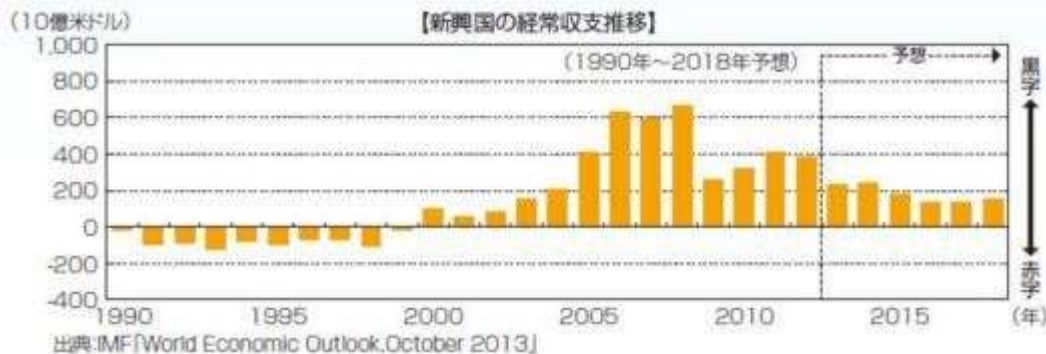
新興国の中でも経済発展が著しい、ブラジル・ロシア・インド・中国(Brazil, Russia, India, China)の頭文字を合わせた4か国の総称です。

いずれの国も2050年までには、米国に並ぶ経済大国になることが予想されています。

- 右記はIMFの過去のデータおよびゴールドマンサックスグループの予想であり将来の運用成果等を約束するものではありません。

**【各国GDP規模の順位】****(参考)新興国経済を取り巻く環境は、近年大きく改善しています。**

かつて、多くの新興国には経常赤字や対外債務の問題がありましたが、現在では、対外債務の着実な削減が進み、2000年以降では経常収支も安定した推移となっています。

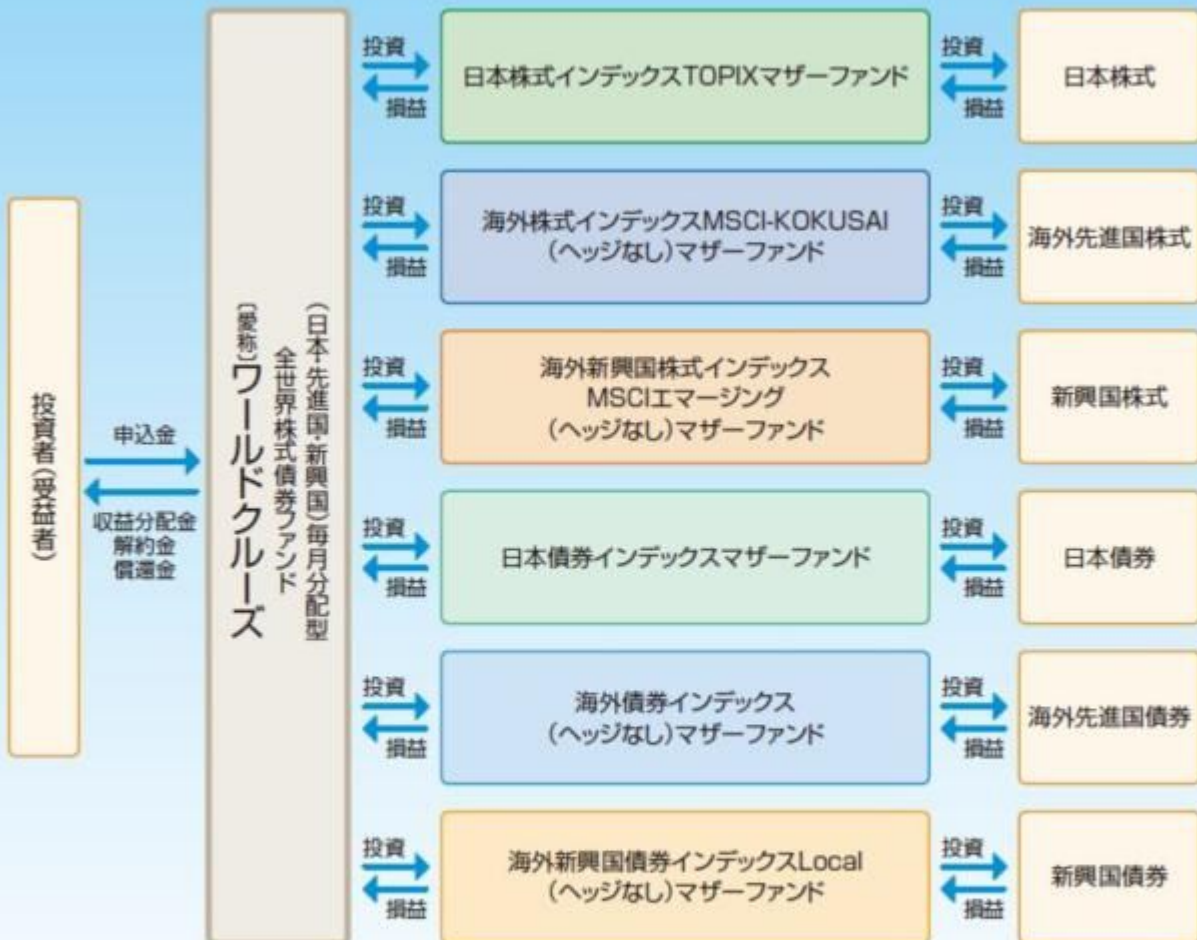


- IMFの地域定義とデータをもとに日興アセットマネジメントが作成。なお、2013年以降の値はIMFによる予想値です。
- 上記は過去のものおよび予想値であり、将来の運用成果等を約束するものではありません。



## 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) ・株式への実質投資割合は、信託財産の総額の70%未満とします。  
・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

(分配方針) ・毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として安定した分配を継続的に行なうことをめざします。ただし、基準価額水準などを勘案し、上記安定分配相当額のほか、委託会社が決定する金額を付加して分配を行なう場合があります。  
※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。



## 収益分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

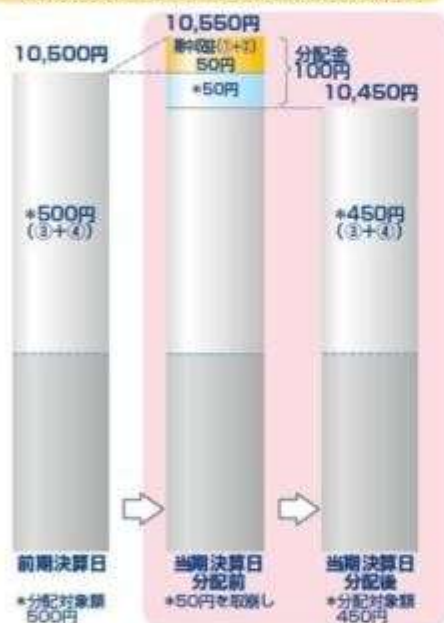
### 投資信託で分配金が支払われるイメージ



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

### 計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

#### 前期決算から基準価額が上昇した場合



#### 前期決算から基準価額が下落した場合



(注)分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※上記はイメージであり、将来の分配金の支払いおよび金額ならびに基準価額について示唆、保証するものではありません。

- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

#### 分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



#### 分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



※元本払戻金（特別分配金）は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金（特別分配金）部分は非課税扱いとなります。

- ・普通分配金：個別元本（投資者のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。
- ・元本払戻金：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、（特別分配金）元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

### （３）【ファンドの仕組み】

<更新後>

委託会社の概況（平成26年1月末現在）

## 1) 資本金

17,363百万円

## 2) 沿革

昭和34年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

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

## 3) 大株主の状況

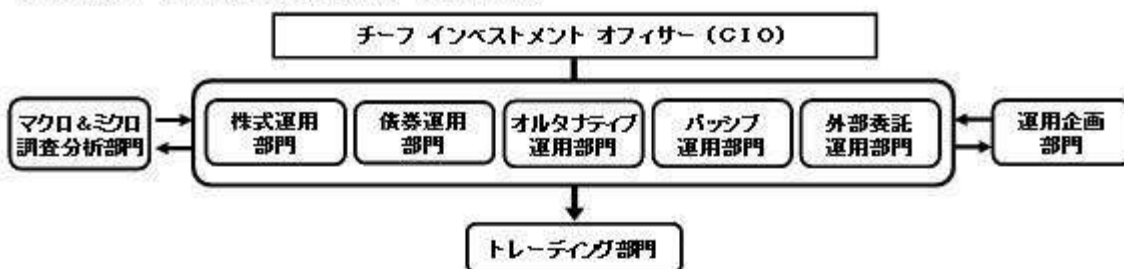
名 称	住 所	所有株数	所有比率
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	179,869,100株	91.29%
DBS Bank Ltd.	6 Shenton Way, #46-00, DBS Building Tower One, Singapore 068809	14,283,400株	7.24%

## 2 【投資方針】

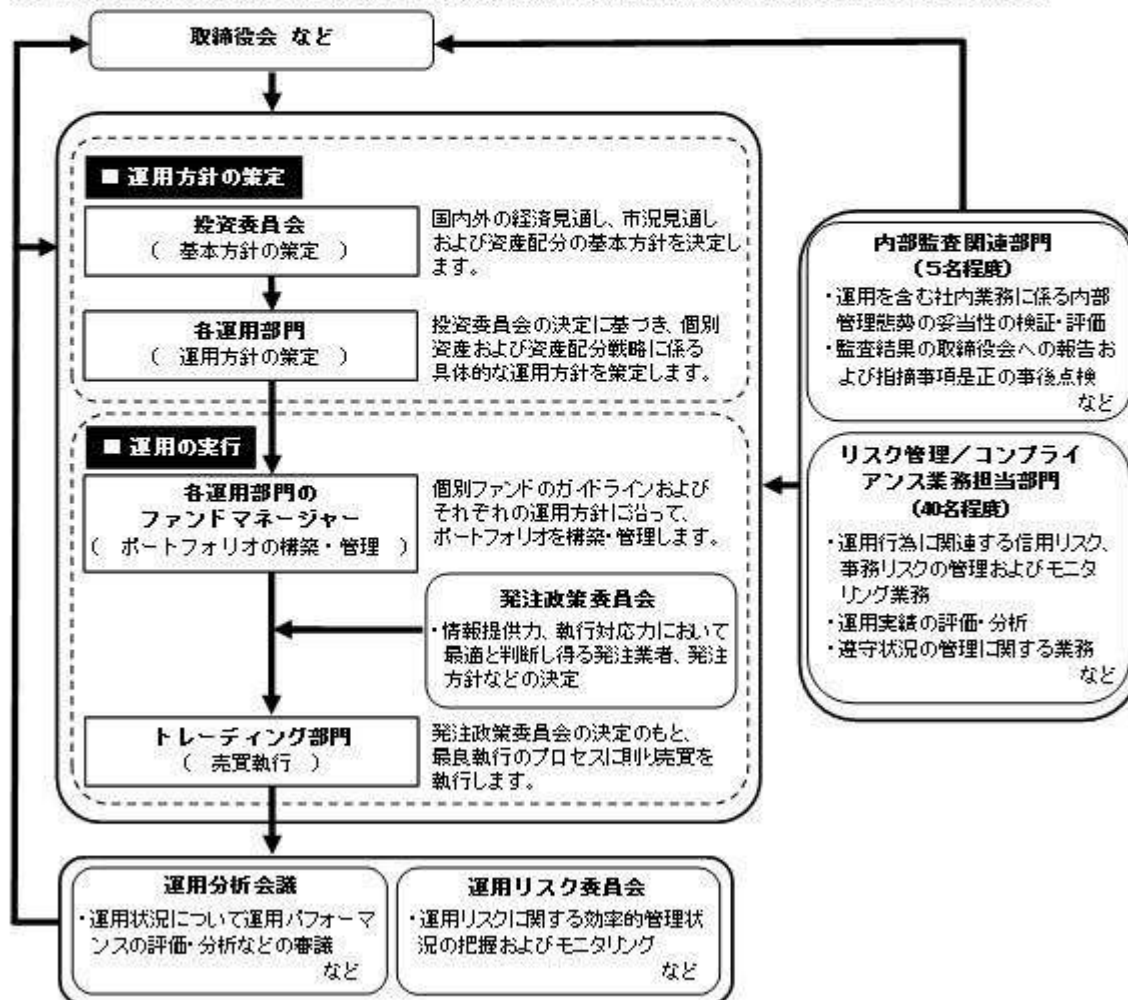
## (3) 【運用体制】

&lt; 更新後 &gt;

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



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

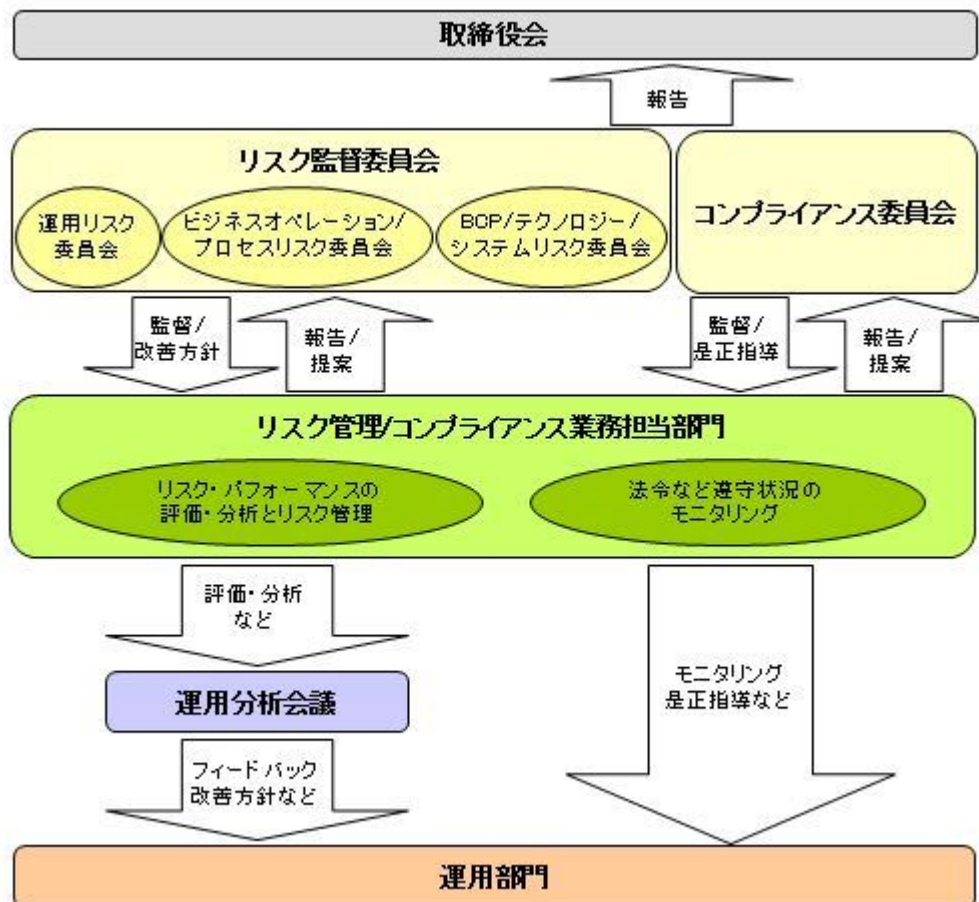
「受託会社」に対しては、日々の純資産照会、月次の勘定残高照会などを行っております。また、独立した監査法人が所定の手続きで受託業務について監査を行っており、内部統制が有効に機能している旨の監査報告書を定期的に受け取っております。

上記体制は平成26年1月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

### 3【投資リスク】

<更新後>

#### (2) リスク管理体制



### 全社的なリスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、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いません。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、リスク管理/コンプライアンス業務担当部門が管理を行いません。問題点についてはリスク管理/コンプライアンス関連の委員会に報告され、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・監督を行いません。

上記体制は平成26年1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】

#### <更新後>

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

- ・販売会社における申込手数料率は3.15%<sup>\*</sup>（税抜3%）が上限となっております。
- ・消費税率が8%になった場合は、3.24%となります。
- ・申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
- ・<分配金再投資コース>の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。



- ・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができます場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

### （３）【信託報酬等】

#### <更新後>

##### 信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年1.1025%\*（税抜1.05%）の率を乗じて得た額とします。

\*消費税率が8%になった場合は、1.134%となります。

##### 信託報酬の配分

信託報酬の配分は、以下の通りとします。

信託報酬率（年率）			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
1.05%	0.50%	0.50%	0.05%

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

##### 支払時期

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

### （４）【その他の手数料等】

#### <更新後>

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、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、支払金額の支弁を信託財産から受けることができます。（以下「実費方式」といいます。）また、実際に支払う金額の支弁を受ける代わりに、その金額をあらかじめ合理的に見積もった上で、見積額に基づいて見積率を算出し、かかる見積率を信託財産の純資産総額に乘じて得た額をかかるとする諸費用の合計額とみなして、信託財産から支弁を受けることができます。（以下「見積方式」といいます。）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。委託会社は、実費方式または見積方式のいずれを用いるかについて、信託期間を通じて随時、見直すことができます。これら諸費用は、委託会社が定めた時期に、信託財産から支払います。

振替受益権に係る費用ならびにやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合における発行および管理事務に係る費用。

有価証券届出書、有価証券報告書および臨時報告書（これらの訂正に係る書類を含みます。）の作成、印刷および提出に係る費用。

目論見書および仮目論見書（これらの訂正事項分を含みます。）の作成、印刷および交付に係る費用（これらを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。

信託約款の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。

運用報告書の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。

ファンドの受益者に対して行なう公告に係る費用ならびに信託約款の変更または信託契約の解約に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用。

格付の取得に要する費用。

ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。

#### <更新後>

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賃料（マザーファンド（当該マザーファンドの約款において、品賃料の一部を、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收受する規定のあるもの）に限ります。）における品賃料については、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。

\*消費税率が8%になった場合は、0.54となります。

## (5) 【課税上の取扱い】

## &lt;更新後&gt;

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

## 個人受益者の場合

## 1) 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）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。

## 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、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座（源泉徴収選択口座）を選択している場合は、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）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

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。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

## 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、15.315%（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。

## 2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

## 個別元本

1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。

2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

## 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

## 2) 受益者が収益分配金を受け取る際

イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。

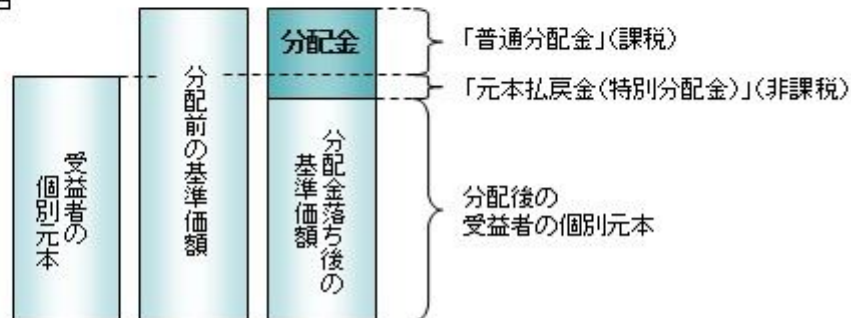
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

## &lt;分配金に関するイメージ図&gt;

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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】

## 【全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型】

以下の運用状況は2014年 1月31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	235,502,120	98.80
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		2,853,533	1.20
合計(純資産総額)		238,355,653	100.00

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	32,363,172	2.0159	65,240,919	2.0223	65,448,042	27.46
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	40,809,122	1.5531	63,380,647	1.5562	63,507,155	26.64

日本	親投資信託受益証券	海外新興国債券インデックスLocal(ヘッジなし)マザーファンド	37,327,918	1.2162	45,398,213	1.2106	45,189,177	18.96
日本	親投資信託受益証券	海外新興国株式インデックスMSCIEマージング(ヘッジなし)マザーファンド	33,800,609	1.3311	44,991,990	1.3186	44,569,483	18.70
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	6,715,046	1.2888	8,654,352	1.2892	8,657,037	3.63
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	8,181,955	1.0008	8,188,500	0.9938	8,131,226	3.41

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.80
合計	98.80

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

### 【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1特定期間末 (2008年 6月25日)	71	72	1.0477	1.0577
第2特定期間末 (2008年12月25日)	136	137	0.6665	0.6715
第3特定期間末 (2009年 6月25日)	207	208	0.7365	0.7395
第4特定期間末 (2009年12月25日)	245	246	0.7965	0.7995
第5特定期間末 (2010年 6月25日)	251	252	0.7402	0.7422
第6特定期間末 (2010年12月27日)	261	261	0.7528	0.7548
第7特定期間末 (2011年 6月27日)	268	269	0.7427	0.7447
第8特定期間末 (2011年12月26日)	254	254	0.6637	0.6657
第9特定期間末 (2012年 6月25日)	264	265	0.6832	0.6852
第10特定期間末 (2012年12月25日)	277	278	0.7710	0.7730
第11特定期間末 (2013年 6月25日)	290	291	0.8368	0.8388
第12特定期間末 (2013年12月25日)	254	255	0.9506	0.9526
2013年 1月末日	301		0.8426	
2月末日	297		0.8458	
3月末日	295		0.8590	
4月末日	317		0.9084	



5月末日	320		0.9224
6月末日	297		0.8606
7月末日	300		0.8739
8月末日	294		0.8554
9月末日	305		0.8860
10月末日	311		0.9181
11月末日	285		0.9396
12月末日	250		0.9619
2014年 1月末日	238		0.9128

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

### 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	2008年 3月31日～2008年 6月25日	0.0100
第2特定期間	2008年 6月26日～2008年12月25日	0.0300
第3特定期間	2008年12月26日～2009年 6月25日	0.0220
第4特定期間	2009年 6月26日～2009年12月25日	0.0180
第5特定期間	2009年12月26日～2010年 6月25日	0.0140
第6特定期間	2010年 6月26日～2010年12月27日	0.0120
第7特定期間	2010年12月28日～2011年 6月27日	0.0120
第8特定期間	2011年 6月28日～2011年12月26日	0.0120
第9特定期間	2011年12月27日～2012年 6月25日	0.0120
第10特定期間	2012年 6月26日～2012年12月25日	0.0120
第11特定期間	2012年12月26日～2013年 6月25日	0.0120
第12特定期間	2013年 6月26日～2013年12月25日	0.0120

### 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1特定期間	2008年 3月31日～2008年 6月25日	5.77
第2特定期間	2008年 6月26日～2008年12月25日	33.52
第3特定期間	2008年12月26日～2009年 6月25日	13.80
第4特定期間	2009年 6月26日～2009年12月25日	10.59
第5特定期間	2009年12月26日～2010年 6月25日	5.31
第6特定期間	2010年 6月26日～2010年12月27日	3.32
第7特定期間	2010年12月28日～2011年 6月27日	0.25
第8特定期間	2011年 6月28日～2011年12月26日	9.02
第9特定期間	2011年12月27日～2012年 6月25日	4.75
第10特定期間	2012年 6月26日～2012年12月25日	14.61

第11特定期間	2012年12月26日～2013年 6月25日	10.09
第12特定期間	2013年 6月26日～2013年12月25日	15.03

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

#### (4)【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第1特定期間	2008年 3月31日～2008年 6月25日	68,627,181	492,248
第2特定期間	2008年 6月26日～2008年12月25日	150,398,994	13,045,092
第3特定期間	2008年12月26日～2009年 6月25日	79,936,680	3,811,962
第4特定期間	2009年 6月26日～2009年12月25日	41,895,256	15,332,859
第5特定期間	2009年12月26日～2010年 6月25日	48,450,268	16,434,622
第6特定期間	2010年 6月26日～2010年12月27日	27,295,398	20,486,733
第7特定期間	2010年12月28日～2011年 6月27日	28,082,441	13,729,140
第8特定期間	2011年 6月28日～2011年12月26日	49,606,430	28,118,385
第9特定期間	2011年12月27日～2012年 6月25日	30,543,945	26,331,654
第10特定期間	2012年 6月26日～2012年12月25日	22,027,047	48,957,699
第11特定期間	2012年12月26日～2013年 6月25日	28,054,964	40,966,320
第12特定期間	2013年 6月26日～2013年12月25日	14,911,733	94,240,960

(注)第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(参考)

#### 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2014年 1月31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。

#### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	26,573,935,270	99.73
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		70,654,604	0.27
合計(純資産総額)		26,644,589,874	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	72,900,000	0.27

(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。

#### 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	213,300	6,313.64	1,346,699,412	5,922.00	1,263,162,600	4.74
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,146,000	629.00	720,834,000	623.00	713,958,000	2.68
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	74,300	7,480.00	555,764,000	7,563.00	561,930,900	2.11
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	114,400	4,725.00	540,540,000	4,824.00	551,865,600	2.07
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	138,000	3,907.75	539,269,500	3,893.00	537,234,000	2.02
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,958,700	209.00	409,368,300	219.00	428,955,300	1.61
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	59,400	5,140.00	305,316,000	5,561.00	330,323,400	1.24
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	95,200	3,395.00	323,204,000	3,197.00	304,354,400	1.14
日本	株式	日立製作所	電気機器	368,000	673.00	247,664,000	792.00	291,456,000	1.09
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	60,100	4,650.00	279,465,000	4,793.00	288,059,300	1.08
日本	株式	ファナック	電気機器	17,100	16,416.68	280,725,228	16,770.00	286,767,000	1.08
日本	株式	三菱地所	不動産業	106,000	2,835.00	300,510,000	2,545.00	269,770,000	1.01
日本	株式	KDDI	情報・通信業	47,000	5,126.37	240,939,390	5,705.00	268,135,000	1.01
日本	株式	キヤノン	電気機器	88,900	3,150.00	280,035,000	3,006.00	267,233,400	1.00
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	63,300	3,615.00	228,829,500	4,102.00	259,656,600	0.97
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	37,000	5,393.27	199,550,990	6,398.00	236,726,000	0.89
日本	株式	三井不動産	不動産業	71,000	3,285.00	233,235,000	3,289.00	233,519,000	0.88
日本	株式	三菱商事	卸売業	118,000	1,989.00	234,702,000	1,903.00	224,554,000	0.84
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	309,300	742.00	229,500,600	725.00	224,242,500	0.84
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	28,200	8,760.00	247,032,000	7,632.00	215,222,400	0.81
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	679,000	338.00	229,502,000	315.00	213,885,000	0.80
日本	株式	パナソニック	電気機器	175,200	946.00	165,739,200	1,184.00	207,436,800	0.78
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	124,600	1,535.00	191,261,000	1,663.00	207,209,800	0.78
日本	株式	デンソー	輸送用機器	37,900	4,740.00	179,646,000	5,339.00	202,348,100	0.76
日本	株式	三井物産	卸売業	139,300	1,418.04	197,532,972	1,385.00	192,930,500	0.72
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	215,100	1,009.50	217,143,450	885.00	190,363,500	0.71
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	50,300	3,405.00	171,271,500	3,734.00	187,820,200	0.70
日本	株式	三菱重工業	機械	273,000	631.79	172,478,670	670.00	182,910,000	0.69
日本	株式	三菱電機	電気機器	153,000	1,063.00	162,639,000	1,178.00	180,234,000	0.68
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	58,600	3,155.00	184,883,000	3,034.00	177,792,400	0.67

## 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	0.07
		鉱業	0.45
		建設業	2.63
		食料品	3.80
		繊維製品	0.71
		パルプ・紙	0.29
		化学	5.34
		医薬品	4.52
		石油・石炭製品	0.59
		ゴム製品	0.92
		ガラス・土石製品	1.00
		鉄鋼	1.71
		非鉄金属	1.07
		金属製品	0.69
		機械	5.36
		電気機器	12.08
		輸送用機器	11.84
		精密機器	1.36
		その他製品	1.42
		電気・ガス業	2.16
		陸運業	3.63
		海運業	0.38
		空運業	0.51
		倉庫・運輸関連業	0.23
		情報・通信業	7.13
		卸売業	4.49
		小売業	4.29
		銀行業	9.74
		証券、商品先物取引業	1.78
		保険業	2.20
		その他金融業	1.36
不動産業	3.46		
サービス業	2.52		
合 計		99.73	

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
-------	-----	----	----	----	----	---------	--------	---------



株価指数先物取引	東京証券取引所	東証株価指数先物 03月	2014年	買建	6日本円	75,605,391	72,900,000	0.27
----------	---------	-----------------	-------	----	------	------------	------------	------

(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。

## 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2014年 1月31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。

### 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	41,619,951,787	54.83
	カナダ	3,256,325,302	4.29
	モーリシャス	9,232,080	0.01
	ドイツ	3,150,467,012	4.15
	イタリア	740,140,741	0.98
	フランス	3,069,628,302	4.04
	オランダ	1,174,781,982	1.55
	スペイン	1,134,512,633	1.49
	ベルギー	385,043,707	0.51
	オーストリア	96,005,220	0.13
	ルクセンブルク	113,816,527	0.15
	フィンランド	300,596,113	0.40
	アイルランド	637,997,056	0.84
	ポルトガル	58,639,768	0.08
	イギリス	6,943,723,490	9.15
	スイス	3,320,069,886	4.37
	スウェーデン	1,076,198,906	1.42
	ノルウェー	264,358,067	0.35
	デンマーク	406,518,745	0.54
	ケイマン	95,165,849	0.13
	オーストラリア	2,246,859,119	2.96
	パミューダ	104,860,175	0.14
	ニュージーランド	38,730,249	0.05
	香港	811,513,901	1.07
	シンガポール	462,265,540	0.61
	イスラエル	152,716,966	0.20
ジャージー	394,802,932	0.52	
ガーンジー	22,271,932	0.03	
英ヴァージン諸島	42,171,469	0.06	
	小計	72,129,365,456	95.02
投資証券	アメリカ	1,092,711,267	1.44
	カナダ	15,521,292	0.02

	フランス	90,378,290	0.12
	オランダ	8,817,725	0.01
	イギリス	94,266,170	0.12
	オーストラリア	193,323,817	0.25
	香港	27,651,078	0.04
	シンガポール	26,076,268	0.03
	小計	1,548,745,907	2.04
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		2,230,581,739	2.94
合計（純資産総額）		75,908,693,102	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,511,517,414	1.99
	買建	ドイツ	652,495,536	0.86

(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（％）
為替予約取引	買建		1,022,247,570	1.35
	売建		32,405,100	0.04

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
アメリカ	株式	APPLE COMPUTER INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	23,016	54,124.93	1,245,739,435	51,372.39	1,182,387,122	1.56
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	111,601	9,048.59	1,009,832,161	9,667.81	1,078,937,420	1.42
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	6,940	104,422.44	724,691,757	116,592.83	809,154,300	1.07
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	200,344	3,675.18	736,301,824	3,792.44	759,794,242	1.00
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	258,393	2,662.01	687,846,507	2,622.92	677,746,751	0.89
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	71,351	9,472.37	675,863,599	9,205.96	656,855,165	0.87
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	81,633	7,471.38	609,911,898	7,516.98	613,633,710	0.81

アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	128,020	4,408.57	564,386,360	4,736.70	606,392,718	0.80
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	48,911	12,403.88	606,686,537	11,978.04	585,858,257	0.77
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	95,540	5,427.92	518,583,687	5,760.15	550,325,686	0.72
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	69,319	8,228.79	570,412,187	7,906.84	548,094,810	0.72
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	167,560	3,148.54	527,570,133	3,170.14	531,189,530	0.70
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	473,541	1,153.82	546,382,971	1,069.32	506,368,453	0.67
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	17,778	28,346.82	503,949,872	28,415.21	505,165,674	0.67
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	26,332	18,190.79	478,999,908	18,243.24	480,381,248	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	58,213	8,018.49	466,780,533	8,235.05	479,387,257	0.63
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORPORATION	各種金融	272,109	1,466.78	399,125,018	1,741.41	473,856,000	0.62
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	1,226,405	383.47	470,297,865	382.88	469,569,527	0.62
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	134,406	3,619.64	486,501,791	3,430.38	461,063,789	0.61
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	74,023	4,787.10	354,355,829	5,504.03	407,425,449	0.54
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	101,012	4,014.62	405,525,381	3,926.16	396,589,900	0.52
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	476,858	765.25	364,918,827	810.90	386,684,495	0.51
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	9,245	37,378.29	345,562,341	41,416.57	382,896,273	0.50
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	各種金融	76,927	5,149.17	396,110,324	4,968.13	382,183,952	0.50
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	72,513	5,216.03	378,230,027	4,899.22	355,257,270	0.47
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	96,908	3,612.48	350,078,909	3,643.87	353,120,929	0.47
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	87,773	3,409.80	299,289,165	3,846.96	337,659,571	0.44
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	41,018	9,113.39	373,813,277	8,135.19	333,689,527	0.44
イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	123,891	2,721.66	337,190,071	2,675.00	331,409,068	0.44
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	28,130	12,037.70	338,620,664	11,623.17	326,960,053	0.43

## 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	9.73
		素材	5.49
		資本財	7.53
		商業・専門サービス	0.90
		運輸	1.88
		自動車・自動車部品	1.74
		耐久消費財・アパレル	1.56
		消費者サービス	1.70
		メディア	3.03
		小売	3.05
		食品・生活必需品小売り	2.11
		食品・飲料・タバコ	5.87
		家庭用品・パーソナル用品	1.75
		ヘルスケア機器・サービス	3.00
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.95
		銀行	7.78
		各種金融	5.86
		保険	4.11
		不動産	0.56
		ソフトウェア・サービス	6.65
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.82		
電気通信サービス	3.35		
公益事業	3.16		
半導体・半導体製造装置	1.46		
投資証券			2.04
合計			97.06

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

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)	契約額等(円)	評価額 (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 1403	買建	33	米ドル	14,785,975	1,520,885,389	14,694,900	1,511,517,414	1.99
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1403	買建	165	ユーロ	4,667,740	650,869,666	4,679,400	652,495,536	0.86

(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	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	買建	7,316,000.00	757,592,453	752,358,250	0.99
	ユーロ	買建	1,936,000.00	271,761,391	269,889,320	0.36
	スウェーデンクローナ	売建	795,000.00	12,543,510	12,545,100	0.02
	香港ドル	売建	1,500,000.00	19,858,500	19,860,000	0.03

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

#### 海外新興国株式インデックスMSCIE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2014年1月31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。

#### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	メキシコ	429,624,779	5.13
	ブラジル	828,795,058	9.89
	チリ	120,212,811	1.44
	コロンビア	74,830,094	0.89
	ペルー	37,747,182	0.45
	スペイン	4,139,100	0.05
	ルクセンブルク	2,691,873	0.03
	ギリシャ	41,212,886	0.49
	トルコ	110,470,653	1.32
	チェコ	21,355,573	0.25
	ハンガリー	21,393,300	0.26
	ポーランド	138,030,335	1.65
	ロシア	483,886,007	5.78
	ケイマン	68,067,238	0.81
	バミューダ	35,793,546	0.43
	香港	457,248,677	5.46
	マレーシア	319,432,749	3.81
	タイ	181,467,312	2.17
	フィリピン	75,491,086	0.90
	インドネシア	203,816,527	2.43
	韓国	1,312,394,904	15.67
	台湾	973,219,159	11.62
	中国	1,065,633,487	12.72
インド	526,225,402	6.28	
エジプト	16,880,559	0.20	
南アフリカ	576,761,527	6.89	
小計		8,126,821,824	97.02

投資証券	メキシコ	9,933,942	0.12
	トルコ	2,533,388	0.03
	南アフリカ	4,447,960	0.05
	小計	16,915,290	0.20
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		232,826,347	2.78
合計（純資産総額）		8,376,563,461	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	223,253,515	2.67

(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。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	半導体・半 導体製造装 置	2,455	142,925.80	350,882,852	122,112.00	299,784,960	3.58
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半 導体製造装 置	553,355	389.84	215,725,446	355.94	196,966,712	2.35
中国	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェ ア・サービ ス	23,100	3,633.05	83,923,594	7,195.94	166,226,214	1.98
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信 サービス	137,700	1,140.62	157,064,200	980.42	135,004,109	1.61
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,625,920	85.79	139,496,132	71.36	116,031,505	1.39
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	134,200	796.13	106,841,505	863.50	115,883,002	1.38
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA - H	銀行	1,634,575	73.21	119,679,005	63.68	104,096,928	1.24
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	電気通信 サービス	836,800	98.35	82,303,548	110.42	92,406,485	1.10
南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	8,910	6,527.84	58,163,062	10,247.21	91,302,709	1.09
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自 動車部品	3,800	18,412.20	69,966,360	22,371.30	85,010,940	1.01
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	66,000	1,359.80	89,747,408	1,122.20	74,065,372	0.88
中国	株式	BANK OF CHINA LTD - H	銀行	1,661,000	50.04	83,128,400	43.55	72,352,496	0.86
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲 料・タバコ	102,000	752.03	76,707,099	677.33	69,087,823	0.82
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	239,286	239.60	57,334,170	287.81	68,869,143	0.82
南アフリ カ	株式	MTN GROUP LTD	電気通信 サービス	37,115	1,662.10	61,688,968	1,839.37	68,268,533	0.81
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S- PREF	銀行	54,020	1,361.49	73,547,798	1,259.91	68,060,533	0.81
ロシア	株式	LUKOIL OAO-SPON ADR	エネルギー	11,585	6,598.46	76,443,263	5,868.16	67,982,668	0.81
香港	株式	CNOOC LTD	エネルギー	388,000	191.18	74,180,013	161.52	62,672,864	0.75



インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	10,035	3,946.10	39,599,136	6,149.05	61,705,767	0.74
南アフリカ	株式	SASOL LTD	エネルギー	12,300	3,818.07	46,962,352	4,943.66	60,807,124	0.73
ブラジル	株式	VALE SA-PREF A	素材	46,150	1,299.17	59,957,120	1,270.15	58,617,736	0.70
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	92,600	835.24	77,343,928	627.39	58,096,870	0.69
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	46,390	1,425.51	66,129,502	1,097.72	50,923,676	0.61
中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	596,300	86.65	51,671,984	81.82	48,791,174	0.58
中国	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	169,000	285.98	48,331,296	280.68	47,436,272	0.57
中国	株式	PETROCHINA CO LTD-H	エネルギー	467,000	132.66	61,954,462	99.43	46,434,931	0.55
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	32,575	1,510.68	49,210,499	1,376.38	44,835,872	0.54
韓国	株式	HYUNDAI MOBIS	自動車・自動車部品	1,500	25,137.90	37,706,850	29,574.00	44,361,000	0.53
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	半導体・半導体製造装置	460	85,522.50	39,340,353	91,107.00	41,909,220	0.50
韓国	株式	POSCO	素材	1,470	30,384.90	44,665,803	28,476.90	41,861,043	0.50

#### 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	10.65
		素材	9.38
		資本財	4.74
		商業・専門サービス	0.09
		運輸	1.51
		自動車・自動車部品	3.97
		耐久消費財・アパレル	0.87
		消費者サービス	0.77
		メディア	1.72
		小売	1.42
		食品・生活必需品小売り	2.22
		食品・飲料・タバコ	4.87
		家庭用品・パーソナル用品	1.09
		ヘルスケア機器・サービス	0.63
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.07
		銀行	17.77
		各種金融	2.54
		保険	3.31
		不動産	1.73
		ソフトウェア・サービス	4.56
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.45		
電気通信サービス	7.06		
公益事業	3.34		
半導体・半導体製造装置	8.24		

投資証券		0.20
合計		97.22

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

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)	契約額等(円)	評価額 (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	MINMSCIE1403	買建	47	米ドル	2,300,455	236,624,801	2,170,460	223,253,515	2.67

(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。

## 日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2014年 1月31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。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	27,078,699,448	79.00
地方債証券	日本	2,315,862,000	6.76
特殊債券	日本	2,471,033,317	7.21
社債券	日本	2,076,580,000	6.06
	オーストラリア	202,381,000	0.59
	小計	2,278,961,000	6.65
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		130,951,529	0.38
合計(純資産総額)		34,275,507,294	100.00

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	750,000,000	105.80	793,537,500	105.62	792,217,500	1.300	2019/3/20	2.31
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	673,000,000	106.22	714,860,600	106.23	714,941,360	1.300	2019/12/20	2.09
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	581,000,000	106.70	619,961,860	106.61	619,433,150	1.400	2019/9/20	1.81
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	545,000,000	107.49	585,820,500	107.46	585,678,800	1.400	2022/12/20	1.71

日本	国債証券	第284回利付国債(10年)	462,000,000	104.90	484,679,580	104.57	483,113,400	1.700	2016/12/20	1.41
日本	国債証券	第93回利付国債(5年)	445,000,000	100.84	448,751,350	100.78	448,493,250	0.500	2015/12/20	1.31
日本	国債証券	第290回利付国債(10年)	406,000,000	105.30	427,554,540	105.09	426,693,820	1.400	2018/3/20	1.24
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	380,000,000	106.41	404,358,000	106.48	404,658,200	1.300	2021/3/20	1.18
日本	国債証券	第268回利付国債(10年)	361,000,000	101.96	368,097,260	101.58	366,736,290	1.500	2015/3/20	1.07
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	300,000,000	117.82	353,475,000	117.74	353,247,000	2.300	2026/6/20	1.03
日本	国債証券	第97回利付国債(5年)	350,000,000	100.73	352,576,000	100.72	352,527,000	0.400	2016/6/20	1.03
日本	国債証券	第292回利付国債(10年)	331,000,000	106.52	352,606,140	106.32	351,935,750	1.700	2018/3/20	1.03
日本	国債証券	第106回利付国債(5年)	340,000,000	100.13	340,459,000	100.21	340,734,400	0.200	2017/9/20	0.99
日本	国債証券	第36回利付国債(30年)	310,000,000	108.44	336,173,300	108.49	336,331,400	2.000	2042/3/20	0.98
日本	国債証券	第89回利付国債(5年)	330,000,000	100.51	331,699,500	100.43	331,445,400	0.400	2015/6/20	0.97
日本	国債証券	第29回利付国債(30年)	276,000,000	116.41	321,308,160	116.60	321,824,280	2.400	2038/9/20	0.94
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	260,000,000	117.80	306,287,800	117.87	306,475,000	2.300	2026/9/20	0.89
日本	国債証券	第291回利付国債(10年)	287,000,000	104.87	300,988,380	104.68	300,454,560	1.300	2018/3/20	0.88
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	280,000,000	104.17	291,676,000	105.36	295,022,000	1.700	2032/9/20	0.86
日本	国債証券	第102回利付国債(5年)	280,000,000	100.51	281,442,000	100.55	281,562,400	0.300	2016/12/20	0.82
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	270,000,000	102.16	275,837,400	102.35	276,353,100	0.800	2022/9/20	0.81
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	275,000,000	100.13	275,365,750	100.34	275,954,250	0.600	2023/3/20	0.81
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	261,000,000	105.25	274,720,770	104.94	273,903,840	1.700	2017/3/20	0.80
日本	国債証券	第50回利付国債(20年)	237,000,000	110.80	262,617,330	110.77	262,539,120	1.900	2021/3/22	0.77
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	240,000,000	101.87	244,496,400	101.86	244,478,400	0.800	2023/9/20	0.71
日本	国債証券	第99回利付国債(5年)	240,000,000	100.77	241,871,600	100.78	241,884,000	0.400	2016/9/20	0.71
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	208,000,000	115.40	240,036,160	115.78	240,841,120	2.400	2034/3/20	0.70
日本	国債証券	第301回利付国債(10年)	223,000,000	107.09	238,828,540	106.93	238,471,740	1.500	2019/6/20	0.70
日本	国債証券	第298回利付国債(10年)	221,000,000	105.59	233,367,160	105.36	232,845,600	1.300	2018/12/20	0.68
日本	国債証券	第141回利付国債(20年)	215,000,000	103.97	223,535,500	105.10	225,977,900	1.700	2032/12/20	0.66

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	79.00
地方債証券	6.76
特殊債券	7.21
社債券	6.65

合 計	99.62
-----	-------

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2014年 1月31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。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	83,057,405,632	38.87
	カナダ	4,891,592,863	2.29
	メキシコ	2,023,576,027	0.95
	ドイツ	18,796,156,333	8.80
	イタリア	21,313,798,601	9.97
	フランス	21,449,203,594	10.04
	オランダ	5,958,041,660	2.79
	スペイン	11,354,869,055	5.31
	ベルギー	5,832,106,729	2.73
	オーストリア	3,615,282,693	1.69
	フィンランド	1,388,198,592	0.65
	アイルランド	1,760,224,481	0.82
	イギリス	16,911,129,879	7.91
	スイス	799,399,203	0.37
	スウェーデン	1,192,857,789	0.56
	ノルウェー	696,236,219	0.33
	デンマーク	1,662,877,782	0.78
	ポーランド	1,734,107,816	0.81
	オーストラリア	3,167,262,411	1.48
	シンガポール	742,317,888	0.35
マレーシア	1,072,739,704	0.50	
南アフリカ	918,220,034	0.43	
	小計	210,337,604,985	98.43
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		3,358,864,054	1.57
合計（純資産総額）		213,696,469,039	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		356,561,550	0.17

(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。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	32,700,000	10,791.46	3,528,807,573	10,696.63	3,497,800,105	4.000	2015/2/15	1.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	26,000,000	10,636.36	2,765,455,387	10,584.13	2,751,874,653	2.500	2015/4/30	1.29
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	23,100,000	10,902.35	2,518,444,329	10,806.72	2,496,354,341	4.125	2015/5/15	1.17
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	22,200,000	11,164.32	2,478,480,809	11,059.05	2,455,110,696	4.500	2015/11/15	1.15
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	22,200,000	11,018.07	2,446,012,407	10,921.64	2,424,604,669	4.250	2015/8/15	1.13
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	19,600,000	11,507.97	2,255,563,453	11,386.92	2,231,836,994	5.125	2016/5/15	1.04
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	17,700,000	11,256.99	1,992,488,716	11,153.07	1,974,094,744	4.500	2016/2/15	0.92
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	18,700,000	10,580.17	1,978,493,586	10,519.04	1,967,060,889	2.625	2014/12/31	0.92
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	16,300,000	11,501.83	1,874,799,487	11,330.67	1,846,899,516	3.625	2020/2/15	0.86
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	16,500,000	11,026.10	1,819,308,124	10,953.78	1,807,374,756	3.250	2016/5/31	0.85
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	15,900,000	11,466.83	1,823,226,415	11,284.86	1,794,293,858	3.625	2021/2/15	0.84
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	15,700,000	11,327.45	1,778,410,827	11,227.00	1,762,640,299	3.500	2018/2/15	0.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,000,000	14,798.17	1,775,781,469	14,500.84	1,740,101,906	8.000	2021/11/15	0.81
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	15,200,000	11,517.10	1,750,600,055	11,375.67	1,729,102,315	3.750	2018/11/15	0.81
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	14,500,000	11,007.48	1,596,085,691	10,927.26	1,584,453,832	2.750	2017/12/31	0.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,800,000	11,352.36	1,566,626,909	11,193.25	1,544,669,513	3.375	2019/11/15	0.72
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	14,700,000	10,552.79	1,551,260,590	10,502.16	1,543,818,507	2.250	2015/1/31	0.72
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	10,550,000	14,479.44	1,527,581,933	14,514.00	1,531,227,445	3.750	2015/8/1	0.72
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	14,300,000	10,678.09	1,526,967,325	10,637.17	1,521,115,376	2.125	2015/12/31	0.71
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,600,000	11,637.58	1,466,335,130	11,488.17	1,447,510,207	4.000	2018/8/15	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,000,000	10,617.08	1,380,220,481	10,564.04	1,373,325,647	2.500	2015/3/31	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,500,000	11,001.74	1,375,218,734	10,925.66	1,365,707,578	2.750	2018/2/28	0.64
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,450,000	15,947.75	1,347,585,111	16,004.67	1,352,395,154	3.250	2021/7/4	0.63
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	9,000,000	14,598.83	1,313,894,804	14,736.17	1,326,256,160	3.750	2016/8/1	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	14,074.94	1,266,745,007	13,808.15	1,242,733,626	8.125	2019/8/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,700,000	12,418.73	1,204,617,567	12,235.51	1,186,845,288	7.500	2016/11/15	0.56
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	7,700,000	15,413.69	1,186,854,715	15,398.39	1,185,676,235	3.750	2017/4/25	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,950,000	14,897.82	1,184,377,050	14,590.85	1,159,972,711	8.750	2020/8/15	0.54
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,400,000	15,290.99	1,131,533,290	15,485.42	1,145,921,696	5.250	2017/8/1	0.54
ドイツ	国債証券	BUNDESOBLIGATION	8,000,000	14,365.13	1,149,211,159	14,298.36	1,143,869,491	2.250	2015/4/10	0.54

#### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.43
合 計	98.43

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	売建	1,280,000.00	131,424,494	131,648,000	0.06
	加ドル	売建	156,000.00	14,427,348	14,380,080	0.01
	ユーロ	売建	1,000,000.00	139,474,000	139,430,000	0.07
	英ポンド	売建	335,000.00	57,039,029	56,837,750	0.03
	南アフリカランド	売建	1,554,000.00	14,043,964	14,265,720	0.01

(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。

## 海外新興国債券インデックスLocal(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2014年 1月31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。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	メキシコ	137,246,652	10.10
	ブラジル	132,865,579	9.78
	コロンビア	45,180,576	3.32
	ペルー	23,018,728	1.69
	トルコ	121,871,371	8.97
	ハンガリー	78,544,975	5.78
	ポーランド	132,369,367	9.74
	ロシア	89,924,604	6.62
	ルーマニア	19,447,269	1.43
	マレーシア	138,058,958	10.16
	タイ	110,726,717	8.15
	インドネシア	93,523,437	6.88
	南アフリカ	125,189,922	9.21
	ナイジェリア	25,973,194	1.91
小計		1,273,941,349	93.74
特殊債券	国際機関	43,911,480	3.23
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		41,221,817	3.03



合計(純資産総額)	1,359,074,646	100.00
-----------	---------------	--------

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
ロシア	国債証券	RUSSIA FOREIGN BOND	20,000,000	314.28	62,857,200	296.94	59,388,000	7.850	2018/3/10	4.37
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	840,000	3,376.88	28,365,872	3,396.82	28,533,313		2016/1/1	2.10
コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	482,000,000	6.02	29,028,615	5.69	27,465,136	12.000	2015/10/22	2.02
ナイジェリア	国債証券	NIGERIA TREASURY BOND	36,100,000	78.94	28,498,641	71.94	25,973,194	16.390	2022/1/27	1.91
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,350,000	1,190.18	27,969,406	1,036.27	24,352,522	10.500	2026/12/21	1.79
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	530,000	4,366.43	23,142,091	3,980.67	21,097,576	10.000	2017/1/1	1.55
ブラジル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	450,000	4,940.21	22,230,946	4,433.38	19,950,233	12.500	2016/1/5	1.47
トルコ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	350,000	5,078.10	17,773,371	4,364.31	15,275,106	9.000	2017/3/8	1.12
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	4,700,000	323.36	15,197,925	319.80	15,030,673	3.875	2019/6/13	1.11
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	430,000	3,577.64	15,383,878	3,465.58	14,902,026	6.250	2015/10/24	1.10
トルコ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	380,000	4,210.82	16,001,132	3,761.56	14,293,928	7.100	2023/3/8	1.05
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	400,000	3,724.70	14,898,838	3,516.76	14,067,051	5.500	2019/10/25	1.04
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	4,620,000	321.76	14,865,549	304.25	14,056,592	3.850	2025/12/12	1.03
トルコ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	350,000	4,274.97	14,962,398	3,913.38	13,696,837	6.300	2018/2/14	1.01
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,560,000	967.29	15,089,870	870.70	13,582,922	7.250	2020/1/15	1.00
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	410,000	3,417.98	14,013,721	3,280.30	13,449,248	3.750	2018/4/25	0.99
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	4,200,000	315.40	13,247,197	315.97	13,270,958	3.250	2017/6/16	0.98
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,410,000	1,006.58	14,192,865	928.76	13,095,557	8.250	2017/9/15	0.96
ルーマニア	国債証券	ROMANIA GOVERNMENT BOND	400,000	3,247.18	12,988,742	3,260.36	13,041,449	5.900	2017/7/26	0.96
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,280,000	1,069.50	13,689,697	1,004.33	12,855,532	13.500	2015/9/15	0.95
トルコ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	275,000	5,554.21	15,274,086	4,604.51	12,662,408	10.500	2020/1/15	0.93
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	370,000	3,477.59	12,867,119	3,395.81	12,564,528	5.500	2015/4/25	0.92
トルコ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	300,000	4,410.39	13,231,174	4,183.03	12,549,108	8.300	2018/6/20	0.92
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	4,300,000	297.64	12,798,946	287.13	12,346,999	6.500	2016/9/30	0.91

南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,350,000	1,011.21	13,651,345	913.43	12,331,328	8.000	2018/12/21	0.91
マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	380,000	3,213.62	12,211,791	3,166.61	12,033,118	4.240	2018/2/7	0.89
マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	380,000	3,312.84	12,588,799	3,133.88	11,908,745	4.378	2019/11/29	0.88
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	330,000	3,934.28	12,983,140	3,561.68	11,753,560	5.750	2022/9/23	0.86
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	3,670,000	317.59	11,655,791	317.17	11,640,437	3.625	2015/5/22	0.86
トルコ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	260,000	4,949.64	12,869,067	4,400.57	11,441,487	9.000	2016/1/27	0.84

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	93.74
特殊債券	3.23
合計	96.97

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 参考情報

< 更新後 >

## 運用実績

2014年1月31日現在

### 基準価額・純資産の推移



基準価額……………9,128円  
純資産総額……………2.38億円

※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)

2013年9月	2013年10月	2013年11月	2013年12月	2014年1月	直近1年間累計	設定来累計
20円	20円	20円	20円	20円	240円	1,800円

## 主要な資産の状況

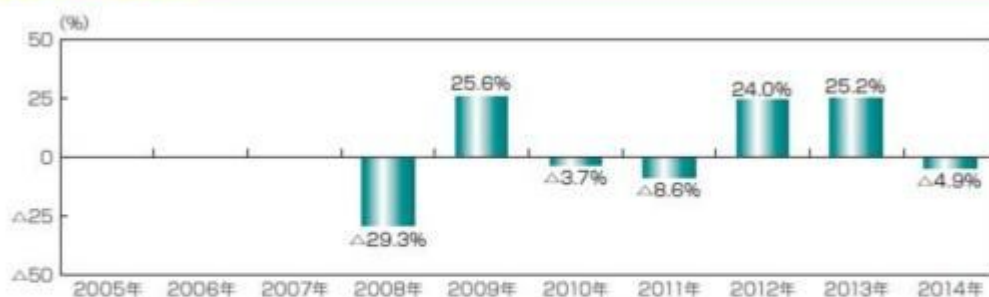
組入資産	投資対象	比率 <sup>※1</sup>	組入上位銘柄	国・地域名	比率 <sup>※2</sup>
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	日本株式	3.4%	トヨタ自動車	日本	4.7%
			三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	2.7%
			ソフトバンク	日本	2.1%
			三井住友フィナンシャルグループ	日本	2.1%
			本田技研工業	日本	2.0%
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI(ヘッジなし) マザーファンド	海外先進国株式	26.6%	アップル	アメリカ	1.6%
			エクソンモービル	アメリカ	1.4%
			グーグル	アメリカ	1.1%
			マイクロソフト	アメリカ	1.0%
			ゼネラルエレクトリック	アメリカ	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	新興国株式	18.7%	サムスン電子	韓国	3.6%
			台湾セミコンダクター	台湾	2.4%
			テンセント・ホールディングス	中国	2.0%
			チャイナモバイル	香港	1.6%
			中国建設銀行	中国	1.4%
日本債券インデックス マザーファンド	日本債券	3.6%	第299回利付国庫債券(10年)	日本	2.3%
			第305回利付国庫債券(10年)	日本	2.1%
			第303回利付国庫債券(10年)	日本	1.8%
			第60回利付国庫債券(20年)	日本	1.7%
			第284回利付国庫債券(10年)	日本	1.4%
海外債券インデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外先進国債券	27.5%	アメリカ国債(クーポン4.00%)	アメリカ	1.6%
			アメリカ国債(クーポン2.50%)	アメリカ	1.3%
			アメリカ国債(クーポン4.125%)	アメリカ	1.2%
			アメリカ国債(クーポン4.50%)	アメリカ	1.1%
			アメリカ国債(クーポン4.25%)	アメリカ	1.1%
海外新興国債券インデックス Local(ヘッジなし) マザーファンド	新興国債券	19.0%	ロシア国債(クーポン7.85%)	ロシア	4.4%
			コロンビア国債(クーポン12.00%)	コロンビア	2.0%
			ブラジル国債(割引国債)	ブラジル	2.0%
			ナイジェリア国債(クーポン16.39%)	ナイジェリア	1.9%
			南アフリカ国債(クーポン10.50%)	南アフリカ	1.8%
現金その他		1.2%			

※1:当ファンドの純資産総額比率です。上記比率は四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。

※2:各マザーファンドの純資産総額比率です。

●組入上位銘柄は信用できると判断した情報をもとに日興アセットマネジメントが和訳しています。

## 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。

※2008年は設定時から2008年末までの騰落率です。

※2014年は2014年1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3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は、6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、平成25年6月26日から平成25年12月25日までの特定期間の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 平成25年6月25日現在	当期 平成25年12月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	4,630,024	4,248,598
親投資信託受益証券	287,028,188	251,719,095
未収入金	-	5,803,031
未収利息	7	6
流動資産合計	291,658,219	261,770,730
資産合計	291,658,219	261,770,730
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	694,423	535,765
未払解約金	-	6,052,236
未払受託者報酬	12,785	11,766
未払委託者報酬	255,864	235,521
その他未払費用	146,024	288,197
流動負債合計	1,109,096	7,123,485
負債合計	1,109,096	7,123,485
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	347,211,890	267,882,663
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	56,662,767	13,235,418
（分配準備積立金）	47,862,509	42,366,180
元本等合計	290,549,123	254,647,245
純資産合計	290,549,123	254,647,245
負債純資産合計	291,658,219	261,770,730

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 平成24年12月26日 至 平成25年6月25日	当期 自 平成25年6月26日 至 平成25年12月25日
<b>営業収益</b>		
受取利息	1,212	1,147
有価証券売買等損益	29,976,740	43,457,555

	前期 自 平成24年12月26日 至 平成25年 6月25日	当期 自 平成25年 6月26日 至 平成25年12月25日
営業収益合計	29,977,952	43,458,702
営業費用		
受託者報酬	80,111	78,729
委託者報酬	1,603,385	1,575,708
その他費用	152,574	149,932
営業費用合計	1,836,070	1,804,369
営業利益又は営業損失（ ）	28,141,882	41,654,333
経常利益又は経常損失（ ）	28,141,882	41,654,333
当期純利益又は当期純損失（ ）	28,141,882	41,654,333
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（ ）	671,042	629,745
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	82,467,035	56,662,767
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,897,155	7,908,584
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,897,155	7,908,584
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	3,355,545	1,564,013
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	3,355,545	1,564,013
分配金	4,208,182	3,941,810
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	56,662,767	13,235,418

## ( 3 ) 【注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

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

( 貸借対照表に関する注記 )

		前期 平成25年 6月25日現在	当期 平成25年12月25日現在
1.	期首元本額	360,123,246円	347,211,890円
	期中追加設定元本額	28,054,964円	14,911,733円
	期中一部解約元本額	40,966,320円	94,240,960円
2.	受益権の総数	347,211,890口	267,882,663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	56,662,767円	13,235,418円

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

前期 自 平成24年12月26日 至 平成25年 6月25日	当期 自 平成25年 6月26日 至 平成25年12月25日
分配金の計算過程	分配金の計算過程

自 平成24年12月26日		自 平成25年 6月26日	
至 平成25年 1月25日		至 平成25年 7月25日	
A 計算期末における費用控除後の配 当等収益	712,212円	A 計算期末における費用控除後の配 当等収益	862,799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	20,022,327円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後の 有価証券売買等損益	0円
C 信託約款に定める収益調整金	3,622,236円	C 信託約款に定める収益調整金	5,913,181円
D 信託約款に定める分配準備積立金	357円	D 信託約款に定める分配準備積立金	46,959,154円
E 分配対象収益 ( A+B+C+D )	24,357,132円	E 分配対象収益 ( A+B+C+D )	53,735,134円
F 分配対象収益(1万口当たり)	675円	F 分配対象収益(1万口当たり)	1,566円
G 分配金額	721,175円	G 分配金額	685,881円
H 分配金額(1万口当たり)	20円	H 分配金額(1万口当たり)	20円
自 平成25年 1月26日		自 平成25年 7月26日	
至 平成25年 2月25日		至 平成25年 8月26日	
A 計算期末における費用控除後の配 当等収益	782,586円	A 計算期末における費用控除後の配 当等収益	606,244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	8,427,713円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後の 有価証券売買等損益	0円
C 信託約款に定める収益調整金	3,734,788円	C 信託約款に定める収益調整金	6,255,037円
D 信託約款に定める分配準備積立金	19,432,690円	D 信託約款に定める分配準備積立金	46,930,981円
E 分配対象収益 ( A+B+C+D )	32,377,777円	E 分配対象収益 ( A+B+C+D )	53,792,262円
F 分配対象収益(1万口当たり)	916円	F 分配対象収益(1万口当たり)	1,564円
G 分配金額	706,359円	G 分配金額	687,576円
H 分配金額(1万口当たり)	20円	H 分配金額(1万口当たり)	20円
自 平成25年 2月26日		自 平成25年 8月27日	
至 平成25年 3月25日		至 平成25年 9月25日	
A 計算期末における費用控除後の配 当等収益	717,519円	A 計算期末における費用控除後の配 当等収益	882,645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	1,621,627円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後の 有価証券売買等損益	0円
C 信託約款に定める収益調整金	3,909,101円	C 信託約款に定める収益調整金	6,588,150円
D 信託約款に定める分配準備積立金	27,077,568円	D 信託約款に定める分配準備積立金	46,559,331円
E 分配対象収益 ( A+B+C+D )	33,325,815円	E 分配対象収益 ( A+B+C+D )	54,030,126円
F 分配対象収益(1万口当たり)	965円	F 分配対象収益(1万口当たり)	1,570円
G 分配金額	690,631円	G 分配金額	688,043円
H 分配金額(1万口当たり)	20円	H 分配金額(1万口当たり)	20円
自 平成25年 3月26日		自 平成25年 9月26日	
至 平成25年 4月25日		至 平成25年10月25日	
A 計算期末における費用控除後の配 当等収益	999,138円	A 計算期末における費用控除後の配 当等収益	749,695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	17,107,635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	5,077,334円	C 信託約款に定める収益調整金	6,807,552円
D 信託約款に定める分配準備積立金	27,919,472円	D 信託約款に定める分配準備積立金	45,789,928円
E 分配対象収益 ( A+B+C+D )	51,103,579円	E 分配対象収益 ( A+B+C+D )	53,347,175円
F 分配対象収益(1万口当たり)	1,465円	F 分配対象収益(1万口当たり)	1,573円
G 分配金額	697,595円	G 分配金額	678,247円
H 分配金額(1万口当たり)	20円	H 分配金額(1万口当たり)	20円

自 平成25年 4月26日		自 平成25年10月26日	
至 平成25年 5月27日		至 平成25年11月25日	
A 計算期末における費用控除後の配 当等収益	1,083,842円	A 計算期末における費用控除後の配 当等収益	827,106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	2,941,056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	1,698,587円
C 信託約款に定める収益調整金	5,382,525円	C 信託約款に定める収益調整金	6,985,344円
D 信託約款に定める分配準備積立金	45,058,803円	D 信託約款に定める分配準備積立金	44,770,724円
E 分配対象収益 ( A+B+C+D )	54,466,226円	E 分配対象収益 ( A+B+C+D )	54,281,761円
F 分配対象収益(1万口当たり)	1,560円	F 分配対象収益(1万口当たり)	1,629円
G 分配金額	697,999円	G 分配金額	666,298円
H 分配金額(1万口当たり)	20円	H 分配金額(1万口当たり)	20円
自 平成25年 5月28日		自 平成25年11月26日	
至 平成25年 6月25日		至 平成25年12月25日	
A 計算期末における費用控除後の配 当等収益	709,717円	A 計算期末における費用控除後の配 当等収益	589,093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	5,121,643円
C 信託約款に定める収益調整金	5,655,892円	C 信託約款に定める収益調整金	6,033,066円
D 信託約款に定める分配準備積立金	47,847,215円	D 信託約款に定める分配準備積立金	37,191,209円
E 分配対象収益 ( A+B+C+D )	54,212,824円	E 分配対象収益 ( A+B+C+D )	48,935,011円
F 分配対象収益(1万口当たり)	1,561円	F 分配対象収益(1万口当たり)	1,826円
G 分配金額	694,423円	G 分配金額	535,765円
H 分配金額(1万口当たり)	20円	H 分配金額(1万口当たり)	20円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

	前期 自 平成24年12月26日 至 平成25年 6月25日	当期 自 平成25年 6月26日 至 平成25年12月25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
----------------	---	----

## 金融商品の時価等に関する事項

	前期 平成25年 6月25日現在	当期 平成25年12月25日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

前期（平成25年 6月25日現在）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	29,831,171
合計	29,831,171

当期（平成25年12月25日現在）

売買目的有価証券

(単位：円)

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



親投資信託受益証券	6,073,116
合計	6,073,116

（関連当事者との取引に関する注記）  
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

前期 平成25年 6月25日現在		当期 平成25年12月25日現在	
1口当たり純資産額	0.8368円	1口当たり純資産額	0.9506円
(1万口当たり純資産額)	(8,368円)	(1万口当たり純資産額)	(9,506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	42,691,029	68,659,981	
	日本債券インデックスマザーファンド	6,829,716	8,761,159	
	海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド	33,222,466	67,514,695	
	日本株式インデックストOPIXマザーファンド	8,537,247	8,737,872	
	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	34,495,779	49,111,640	
	海外新興国債券インデックスLocal(ヘッジなし) マザーファンド	38,009,747	48,933,748	
合計		163,785,984	251,719,095	

(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。

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-KOKUSA I（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」「日本債券インデックスマザーファンド」「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」「海外新興国債券インデックスLocal（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。ただし、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

（参考）

#### 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

##### 貸借対照表

	平成25年 6月25日現在	平成25年12月25日現在
（単位：円）		
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	118,389,880	65,709,057
株式	26,010,247,010	27,805,447,580
派生商品評価勘定	779,411	384,636
未収入金	-	104,707,390
未収配当金	140,788,347	1,570,025
未収利息	193	101
前払金	1,890,000	-
<b>流動資産合計</b>	<b>26,272,094,841</b>	<b>27,977,818,789</b>
<b>資産合計</b>	<b>26,272,094,841</b>	<b>27,977,818,789</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	3,665,507	-
前受金	-	220,000
未払金	730,917	-
未払解約金	7,469,861	111,982,623
<b>流動負債合計</b>	<b>11,866,285</b>	<b>112,202,623</b>
<b>負債合計</b>	<b>11,866,285</b>	<b>112,202,623</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	30,191,408,982	27,226,626,229
<b>剰余金</b>		
剰余金又は欠損金（ ）	3,931,180,426	638,989,937
<b>元本等合計</b>	<b>26,260,228,556</b>	<b>27,865,616,166</b>
<b>純資産合計</b>	<b>26,260,228,556</b>	<b>27,865,616,166</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>26,272,094,841</b>	<b>27,977,818,789</b>

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 6月25日現在	平成25年12月25日現在
1. 期首	平成24年12月26日	平成25年 6月26日
期首元本額	39,102,949,338円	30,191,408,982円
期首からの追加設定元本額	747,294,345円	534,612,546円
期首からの一部解約元本額	9,658,834,701円	3,499,395,299円
元本の内訳		
DCインデックスバランス（株式20）	179,449,213円	163,117,203円
DCインデックスバランス（株式40）	656,151,402円	632,015,986円
DCインデックスバランス（株式60）	1,244,313,108円	1,202,380,839円
DCインデックスバランス（株式80）	1,482,739,080円	1,457,166,556円
インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,008,404,987円	1,057,458,435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	10,536,059,172円	8,815,513,687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	12,046,379円	8,537,247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）	29,485,083円	28,627,449円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	132,644,360円	100,043,844円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	111,594,568円	81,432,401円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	173,193,541円	128,755,241円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	206,633,385円	157,470,522円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	10,461,847,633円	9,596,515,780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）	67,826,234円	46,195,804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）	84,013,820円	70,005,649円
グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	60,578,802円	54,004,954円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	322,547,225円	301,452,645円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	900,523,170円	877,082,177円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,249,520,206円	1,214,608,151円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,271,837,614円	1,234,241,659円
計	30,191,408,982円	27,226,626,229円
2. 受益権の総数	30,191,408,982口	27,226,626,229口
3. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	3,931,180,426円	- 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	334,577,500円	366,608,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成24年12月26日 至 平成25年 6月25日	自 平成25年 6月26日 至 平成25年12月25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

金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 6月25日現在	平成25年12月25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25年 6月25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	7,908,092,267
合計	7,908,092,267

(平成25年12月25日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,317,902,265
合計	1,317,902,265

(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25年 6月25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	207,456,000	-	204,630,000	2,826,000
合計		207,456,000	-	204,630,000	2,826,000

(平成25年12月25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	75,490,000	-	75,900,000	410,000
合計		75,490,000	-	75,900,000	410,000

## (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25年 6月25日現在		平成25年12月25日現在	
1口当たり純資産額	0.8698円	1口当たり純資産額	1.0235円
(1万口当たり純資産額)	(8,698円)	(1万口当たり純資産額)	(10,235円)

## 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	
極洋	7,000	260.00	1,820,000	
日本水産	21,800	234.00	5,101,200	
マルハニチロホールディングス	34,000	186.00	6,324,000	
サカタのタネ	2,600	1,298.00	3,374,800	
ホクト	2,000	1,937.00	3,874,000	
住石ホールディングス	5,100	129.00	657,900	
日鉄鉱業	4,000	477.00	1,908,000	
三井松島産業	12,000	153.00	1,836,000	
国際石油開発帝石	85,100	1,299.00	110,544,900	
日本海洋掘削	400	6,020.00	2,408,000	
関東天然瓦斯開発	2,000	708.00	1,416,000	
石油資源開発	2,500	3,795.00	9,487,500	
ショーボンドホールディングス	1,600	4,605.00	7,368,000	
ミライト・ホールディングス	5,000	890.00	4,450,000	
タマホーム	800	922.00	737,600	
ダイセキ環境ソリューション	200	1,850.00	370,000	
安藤・間	11,300	333.00	3,762,900	
東急建設	6,300	471.00	2,967,300	
コムシスホールディングス	8,500	1,606.00	13,651,000	
ミサワホーム	1,900	1,534.00	2,914,600	
高松コンストラクショングループ	1,300	1,745.00	2,268,500	
東建コーポレーション	650	4,810.00	3,126,500	
ヤマウラ	800	276.00	220,800	
大成建設	89,000	449.00	39,961,000	
大林組	52,000	559.00	29,068,000	
清水建設	54,000	505.00	27,270,000	
飛鳥建設	11,000	160.00	1,760,000	
長谷工コーポレーション	23,500	757.00	17,789,500	
松井建設	2,000	400.00	800,000	
銭高組	2,000	261.00	522,000	

鹿島建設	77,000	378.00	29,106,000	
不動テトラ	12,800	173.00	2,214,400	
大末建設	7,000	119.00	833,000	
鉄建建設	10,000	297.00	2,970,000	
日鉄住金テックスエンジ	3,000	414.00	1,242,000	
西松建設	23,000	303.00	6,969,000	
三井住友建設	47,500	119.00	5,652,500	
大豊建設	5,000	368.00	1,840,000	
前田建設工業	11,000	656.00	7,216,000	
ナカノフドー建設	1,400	233.00	326,200	
奥村組	16,000	457.00	7,312,000	
大和小田急建設	1,000	252.00	252,000	
東鉄工業	2,100	1,855.00	3,895,500	
イチケン	2,000	175.00	350,000	
浅沼組	6,000	154.00	924,000	
戸田建設	20,000	340.00	6,800,000	
熊谷組	15,000	273.00	4,095,000	
青木あすなる建設	1,100	570.00	627,000	
北野建設	4,000	229.00	916,000	
植木組	2,000	204.00	408,000	
三井ホーム	2,000	493.00	986,000	
矢作建設工業	2,400	828.00	1,987,200	
ピーエス三菱	1,400	455.00	637,000	
大東建託	6,600	9,530.00	62,898,000	
新日本建設	2,100	308.00	646,800	
N I P P O	4,000	1,678.00	6,712,000	
東亜道路工業	3,000	478.00	1,434,000	
前田道路	5,000	1,636.00	8,180,000	
日本道路	5,000	539.00	2,695,000	
東亜建設工業	15,000	218.00	3,270,000	
若築建設	10,000	125.00	1,250,000	
東洋建設	5,500	341.00	1,875,500	
五洋建設	21,000	348.00	7,308,000	
大林道路	2,000	534.00	1,068,000	
福田組	3,000	465.00	1,395,000	



住友林業	12,100	1,188.00	14,374,800	
日本基礎技術	2,000	335.00	670,000	
日成ビルド工業	5,000	233.00	1,165,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	8,000	129.00	1,032,000	
巴コーポレーション	2,300	477.00	1,097,100	
パナホーム	6,000	748.00	4,488,000	
大和ハウス工業	48,000	1,973.00	94,704,000	
ライト工業	3,700	704.00	2,604,800	
積水ハウス	46,000	1,460.00	67,160,000	
日特建設	2,200	377.00	829,400	
北陸電気工事	1,000	387.00	387,000	
ユアテック	3,000	325.00	975,000	
西部電気工業	2,000	435.00	870,000	
四電工	2,000	349.00	698,000	
中電工	2,600	1,855.00	4,823,000	
関電工	8,000	570.00	4,560,000	
きんでん	12,000	1,056.00	12,672,000	
東京エネシス	2,000	498.00	996,000	
トーエネック	2,000	593.00	1,186,000	
住友電設	1,200	1,472.00	1,766,400	
日本電設工業	3,000	1,334.00	4,002,000	
協和エクシオ	6,900	1,320.00	9,108,000	
新日本空調	1,500	610.00	915,000	
N D S	3,000	282.00	846,000	
九電工	3,000	642.00	1,926,000	
三機工業	4,000	646.00	2,584,000	
日揮	18,000	4,060.00	73,080,000	
中外炉工業	5,000	249.00	1,245,000	
ヤマト	2,000	344.00	688,000	
太平電業	2,000	624.00	1,248,000	
高砂熱学工業	5,000	847.00	4,235,000	
三晃金属工業	2,000	241.00	482,000	
朝日工業社	2,000	369.00	738,000	
明星工業	3,000	401.00	1,203,000	
大気社	2,300	2,222.00	5,110,600	

ダイダン	2,000	540.00	1,080,000	
日比谷総合設備	2,200	1,185.00	2,607,000	
東芝プラントシステム	3,000	1,495.00	4,485,000	
東洋エンジニアリング	9,000	387.00	3,483,000	
千代田化工建設	14,000	1,462.00	20,468,000	
新興プランテック	3,600	754.00	2,714,400	
日本製粉	11,000	500.00	5,500,000	
日清製粉グループ本社	17,400	1,069.00	18,600,600	
日東富士製粉	1,000	308.00	308,000	
昭和産業	7,000	305.00	2,135,000	
鳥越製粉	1,400	671.00	939,400	
協同飼料	6,000	109.00	654,000	
中部飼料	1,700	560.00	952,000	
日本配合飼料	6,000	118.00	708,000	
東洋精糖	3,000	101.00	303,000	
日本甜菜製糖	9,000	181.00	1,629,000	
三井製糖	7,000	382.00	2,674,000	
森永製菓	17,000	207.00	3,519,000	
中村屋	4,000	387.00	1,548,000	
江崎グリコ	6,000	1,153.00	6,918,000	
名糖産業	800	1,014.00	811,200	
不二家	10,000	200.00	2,000,000	
山崎製パン	13,000	1,085.00	14,105,000	
第一屋製パン	3,000	136.00	408,000	
モロゾフ	3,000	309.00	927,000	
亀田製菓	1,000	2,673.00	2,673,000	
カルビー	6,400	2,436.00	15,590,400	
森永乳業	15,000	302.00	4,530,000	
六甲バター	800	860.00	688,000	
ヤクルト本社	10,200	5,030.00	51,306,000	
明治ホールディングス	5,200	6,660.00	34,632,000	
雪印メグミルク	3,800	1,269.00	4,822,200	
プリマハム	9,000	190.00	1,710,000	
日本ハム	12,000	1,818.00	21,816,000	
伊藤ハム	10,000	456.00	4,560,000	

林兼産業	6,000	80.00	480,000	
丸大食品	8,000	301.00	2,408,000	
米久	600	799.00	479,400	
S Foods	1,000	989.00	989,000	
サッポロホールディングス	29,000	450.00	13,050,000	
アサヒグループホールディングス	35,200	2,946.00	103,699,200	
キリンホールディングス	75,000	1,513.00	113,475,000	
宝ホールディングス	14,000	971.00	13,594,000	
オエノンホールディングス	4,000	249.00	996,000	
養命酒製造	1,000	804.00	804,000	
コカ・コーラウエスト	5,400	2,231.00	12,047,400	
コカ・コーライーストジャパン	3,600	2,071.00	7,455,600	
サントリー食品インターナショナル	9,000	3,395.00	30,555,000	
ダイトードリンコ	800	4,290.00	3,432,000	
伊藤園	4,700	2,162.00	10,161,400	
キーコーヒー	1,600	1,554.00	2,486,400	
ユニカフェ	500	572.00	286,000	
ジャパンフーズ	200	1,206.00	241,200	
日清オイリオグループ	8,000	328.00	2,624,000	
不二製油	4,300	1,552.00	6,673,600	
かどや製油	100	2,595.00	259,500	
J - オイルミルズ	8,000	270.00	2,160,000	
キッコーマン	14,000	1,990.00	27,860,000	
味の素	42,000	1,495.00	62,790,000	
キューピー	8,900	1,409.00	12,540,100	
ハウス食品グループ本社	6,100	1,551.00	9,461,100	
カゴメ	6,800	1,678.00	11,410,400	
焼津水産化学工業	800	864.00	691,200	
アリアケジャパン	1,600	2,520.00	4,032,000	
ニチレイ	19,000	522.00	9,918,000	
東洋水産	9,000	3,060.00	27,540,000	
日清食品ホールディングス	6,800	4,325.00	29,410,000	
永谷園	2,000	894.00	1,788,000	
フジッコ	2,000	1,165.00	2,330,000	
ロック・フィールド	900	1,804.00	1,623,600	

日本たばこ産業	97,100	3,335.00	323,828,500	
ケンコーマヨネーズ	500	864.00	432,000	
わらべや日洋	1,000	1,839.00	1,839,000	
なとり	800	988.00	790,400	
ミヨシ油脂	6,000	154.00	924,000	
片倉工業	1,900	1,152.00	2,188,800	
ゲンゼ	13,000	250.00	3,250,000	
東洋紡	69,000	185.00	12,765,000	
ユニチカ	46,000	62.00	2,852,000	
富士紡ホールディングス	9,000	204.00	1,836,000	
日清紡ホールディングス	10,000	983.00	9,830,000	
倉敷紡績	17,000	176.00	2,992,000	
シキボウ	10,000	131.00	1,310,000	
日本毛織	5,000	720.00	3,600,000	
大東紡織	3,000	77.00	231,000	
トーア紡コーポレーション	7,000	80.00	560,000	
ダイドーリミテッド	1,900	639.00	1,214,100	
帝国繊維	1,700	1,085.00	1,844,500	
帝人	67,000	225.00	15,075,000	
東レ	119,000	707.00	84,133,000	
サカイオーベックス	4,000	207.00	828,000	
住江織物	5,000	279.00	1,395,000	
日本フェルト	800	440.00	352,000	
イチカワ	1,000	289.00	289,000	
日本バイリーン	2,000	571.00	1,142,000	
日東製網	2,000	125.00	250,000	
芦森工業	3,000	129.00	387,000	
アツギ	14,000	117.00	1,638,000	
ダイニック	3,000	176.00	528,000	
セーレン	4,400	762.00	3,352,800	
東海染工	3,000	118.00	354,000	
小松精練	3,000	533.00	1,599,000	
ワコールホールディングス	10,000	1,042.00	10,420,000	
ホギメディカル	1,000	5,430.00	5,430,000	
レナウン	4,100	132.00	541,200	

クラウディア	200	1,131.00	226,200	
T S Iホールディングス	7,900	646.00	5,103,400	
三陽商会	9,000	288.00	2,592,000	
ナイガイ	6,000	102.00	612,000	
オンワードホールディングス	11,000	764.00	8,404,000	
ルック	3,000	267.00	801,000	
キムラタン	57,000	12.00	684,000	
ゴールドウイン	4,000	449.00	1,796,000	
デサント	4,000	676.00	2,704,000	
キング	800	417.00	333,600	
ヤマトインターナショナル	900	429.00	386,100	
特種東海製紙	9,000	205.00	1,845,000	
王子ホールディングス	72,000	530.00	38,160,000	
日本製紙	8,500	1,999.00	16,991,500	
三菱製紙	24,000	87.00	2,088,000	
北越紀州製紙	11,000	494.00	5,434,000	
中越パルプ工業	6,000	195.00	1,170,000	
巴川製紙所	3,000	190.00	570,000	
大王製紙	6,000	985.00	5,910,000	
レンゴー	13,000	606.00	7,878,000	
トーモク	5,000	332.00	1,660,000	
ザ・パック	1,200	1,881.00	2,257,200	
クラレ	26,000	1,245.00	32,370,000	
旭化成	102,000	794.00	80,988,000	
共和レザー	1,100	438.00	481,800	
コープケミカル	3,000	134.00	402,000	
昭和電工	109,000	150.00	16,350,000	
住友化学	120,000	408.00	48,960,000	
日本化成	3,000	136.00	408,000	
住友精化	3,000	799.00	2,397,000	
日産化学工業	11,200	1,627.00	18,222,400	
ラサ工業	7,000	167.00	1,169,000	
クレハ	12,000	483.00	5,796,000	
多木化学	1,000	764.00	764,000	
テイカ	3,000	286.00	858,000	

石原産業	30,000	108.00	3,240,000	
片倉チッカリン	1,000	262.00	262,000	
日本曹達	10,000	659.00	6,590,000	
東ソー	44,000	459.00	20,196,000	
トクヤマ	25,000	377.00	9,425,000	
セントラル硝子	16,000	332.00	5,312,000	
東亜合成	19,000	438.00	8,322,000	
ダイソー	7,000	336.00	2,352,000	
関東電化工業	4,000	239.00	956,000	
電気化学工業	33,000	416.00	13,728,000	
信越化学工業	29,400	6,050.00	177,870,000	
日本カーバイド工業	5,000	298.00	1,490,000	
堺化学工業	7,000	312.00	2,184,000	
エア・ウォーター	13,000	1,372.00	17,836,000	
大陽日酸	21,000	701.00	14,721,000	
日本化学工業	6,000	133.00	798,000	
日本パーカラライジング	4,000	2,076.00	8,304,000	
高压ガス工業	2,000	587.00	1,174,000	
四国化成工業	2,000	775.00	1,550,000	
戸田工業	3,000	279.00	837,000	
ステラ ケミファ	900	1,505.00	1,354,500	
保土谷化学工業	5,000	207.00	1,035,000	
日本触媒	14,000	1,124.00	15,736,000	
大日精化工業	6,000	456.00	2,736,000	
カネカ	20,000	656.00	13,120,000	
三菱瓦斯化学	26,000	795.00	20,670,000	
三井化学	75,000	254.00	19,050,000	
J S R	15,000	1,948.00	29,220,000	
東京応化工業	3,200	2,107.00	6,742,400	
大阪有機化学工業	1,100	434.00	477,400	
三菱ケミカルホールディングス	102,500	470.00	48,175,000	
日本合成化学工業	3,000	887.00	2,661,000	
ダイセル	21,000	817.00	17,157,000	
住友ベークライト	13,000	363.00	4,719,000	
積水化学工業	34,000	1,222.00	41,548,000	

日本ゼオン	13,000	945.00	12,285,000	
アイカ工業	4,600	1,975.00	9,085,000	
宇部興産	82,000	211.00	17,302,000	
積水樹脂	2,000	1,423.00	2,846,000	
タキロン	4,000	413.00	1,652,000	
旭有機材工業	6,000	214.00	1,284,000	
日立化成	7,100	1,661.00	11,793,100	
ニチバン	2,000	351.00	702,000	
リケンテクノス	3,000	506.00	1,518,000	
大倉工業	4,000	361.00	1,444,000	
積水化成成品工業	5,000	272.00	1,360,000	
群栄化学工業	4,000	453.00	1,812,000	
タイガースポリマー	800	428.00	342,400	
ミライアル	400	1,506.00	602,400	
日本化薬	12,000	1,485.00	17,820,000	
カーリットホールディングス	1,300	485.00	630,500	
日本精化	1,400	632.00	884,800	
A D E K A	7,000	1,091.00	7,637,000	
日油	13,000	704.00	9,152,000	
新日本理化	2,000	278.00	556,000	
ハリマ化成グループ	1,400	452.00	632,800	
花王	42,600	3,215.00	136,959,000	
第一工業製薬	3,000	238.00	714,000	
三洋化成工業	5,000	667.00	3,335,000	
大日本塗料	9,000	163.00	1,467,000	
日本ペイント	14,000	1,679.00	23,506,000	
関西ペイント	20,000	1,482.00	29,640,000	
神東塗料	1,000	219.00	219,000	
中国塗料	5,000	528.00	2,640,000	
日本特殊塗料	1,200	586.00	703,200	
藤倉化成	2,100	520.00	1,092,000	
太陽ホールディングス	1,300	3,110.00	4,043,000	
D I C	58,000	300.00	17,400,000	
サカティンクス	3,000	957.00	2,871,000	
東洋インキ S C ホールディングス	15,000	508.00	7,620,000	

T & K T O K A	600	2,137.00	1,282,200	
富士フィルムホールディングス	37,500	2,862.00	107,325,000	
資生堂	29,100	1,636.00	47,607,600	
ライオン	19,000	595.00	11,305,000	
高砂香料工業	6,000	564.00	3,384,000	
マンダム	1,700	3,220.00	5,474,000	
ミルボン	980	3,955.00	3,875,900	
ファンケル	3,800	1,070.00	4,066,000	
コーセー	2,600	3,260.00	8,476,000	
ドクターシーラボ	11	303,000.00	3,333,000	
シーボン	200	2,081.00	416,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	1,700	3,870.00	6,579,000	
ノエビアホールディングス	1,100	1,821.00	2,003,100	
エステー	1,000	979.00	979,000	
コニシ	1,200	1,858.00	2,229,600	
長谷川香料	2,100	1,423.00	2,988,300	
星光P M C	700	450.00	315,000	
小林製薬	2,700	5,640.00	15,228,000	
荒川化学工業	1,300	898.00	1,167,400	
メック	1,300	649.00	843,700	
日本高純度化学	5	205,500.00	1,027,500	
J C U	300	5,070.00	1,521,000	
新田ゼラチン	1,000	905.00	905,000	
アース製薬	1,200	3,800.00	4,560,000	
イハラケミカル工業	3,000	738.00	2,214,000	
北興化学工業	2,000	287.00	574,000	
大成ラミック	400	2,489.00	995,600	
クミアイ化学工業	3,000	674.00	2,022,000	
日本農薬	4,000	1,448.00	5,792,000	
アキレス	13,000	140.00	1,820,000	
有沢製作所	2,800	562.00	1,573,600	
日東電工	13,500	4,385.00	59,197,500	
レック	500	1,156.00	578,000	
きもと	1,200	917.00	1,100,400	
藤森工業	1,400	2,462.00	3,446,800	



前澤化成工業	1,100	1,038.00	1,141,800	
J S P	1,100	1,516.00	1,667,600	
エフピコ	800	7,090.00	5,672,000	
天馬	1,300	1,426.00	1,853,800	
信越ポリマー	3,200	365.00	1,168,000	
東リ	4,000	207.00	828,000	
ニフコ	3,600	2,636.00	9,489,600	
日本バルカー工業	7,000	270.00	1,890,000	
ユニ・チャーム	10,100	5,830.00	58,883,000	
協和発酵キリン	19,000	1,143.00	21,717,000	
武田薬品工業	61,300	5,010.00	307,113,000	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	37,700	6,080.00	229,216,000	
大日本住友製薬	11,600	1,567.00	18,177,200	
塩野義製薬	25,600	2,228.00	57,036,800	
田辺三菱製薬	13,600	1,414.00	19,230,400	
わかもと製薬	2,000	263.00	526,000	
あすか製薬	2,000	749.00	1,498,000	
日本新薬	4,000	1,889.00	7,556,000	
ビオフェルミン製薬	300	2,286.00	685,800	
中外製薬	16,300	2,293.00	37,375,900	
科研製薬	6,000	1,490.00	8,940,000	
エーザイ	20,200	3,950.00	79,790,000	
ロート製薬	7,000	1,539.00	10,773,000	
小野薬品工業	7,400	8,590.00	63,566,000	
久光製薬	5,100	5,010.00	25,551,000	
有機合成薬品工業	1,000	264.00	264,000	
持田製薬	1,200	5,710.00	6,852,000	
参天製薬	6,000	4,735.00	28,410,000	
扶桑薬品工業	6,000	327.00	1,962,000	
日本ケミファ	2,000	436.00	872,000	
ツムラ	4,800	2,633.00	12,638,400	
日医工	2,600	1,513.00	3,933,800	
日医工(新)	2,600	404.00	1,050,400	
キッセイ薬品工業	3,000	2,430.00	7,290,000	
生化学工業	3,400	1,214.00	4,127,600	

栄研化学	1,300	1,869.00	2,429,700	
日水製薬	700	1,058.00	740,600	
鳥居薬品	1,100	2,902.00	3,192,200	
東和薬品	800	4,215.00	3,372,000	
富士製薬工業	500	1,735.00	867,500	
沢井製薬	2,500	6,560.00	16,400,000	
ゼリア新薬工業	2,600	2,206.00	5,735,600	
第一三共	51,600	1,877.00	96,853,200	
キョーリン製薬ホールディングス	4,400	2,130.00	9,372,000	
大幸薬品	800	2,235.00	1,788,000	
ダイト	500	1,377.00	688,500	
大塚ホールディングス	32,500	2,849.00	92,592,500	
大正製薬ホールディングス	3,900	7,020.00	27,378,000	
日本コークス工業	13,700	129.00	1,767,300	
昭和シェル石油	14,600	1,097.00	16,016,200	
コスモ石油	46,000	194.00	8,924,000	
ニチレキ	2,000	897.00	1,794,000	
東燃ゼネラル石油	25,000	975.00	24,375,000	
ユシロ化学工業	900	959.00	863,100	
ビーピー・カストロール	600	473.00	283,800	
富士石油	4,300	315.00	1,354,500	
MORESCO	400	1,724.00	689,600	
出光興産	1,900	9,110.00	17,309,000	
JXホールディングス	181,600	522.00	94,795,200	
横浜ゴム	18,000	1,045.00	18,810,000	
東洋ゴム工業	14,000	587.00	8,218,000	
ブリヂストン	51,300	3,940.00	202,122,000	
住友ゴム工業	12,800	1,484.00	18,995,200	
藤倉ゴム工業	1,100	620.00	682,000	
オカモト	6,000	317.00	1,902,000	
フコク	600	958.00	574,800	
ニッタ	1,600	2,149.00	3,438,400	
東海ゴム工業	3,000	977.00	2,931,000	
三ツ星ベルト	4,000	573.00	2,292,000	
バンドー化学	6,000	398.00	2,388,000	

日東紡績	12,000	535.00	6,420,000	
旭硝子	81,000	645.00	52,245,000	
日本板硝子	79,000	127.00	10,033,000	
石塚硝子	2,000	370.00	740,000	
日本山村硝子	6,000	177.00	1,062,000	
日本電気硝子	34,000	537.00	18,258,000	
オハラ	600	626.00	375,600	
住友大阪セメント	31,000	387.00	11,997,000	
太平洋セメント	96,000	391.00	37,536,000	
デイ・シイ	1,700	595.00	1,011,500	
日本ヒューム	2,000	896.00	1,792,000	
日本コンクリート工業	3,000	449.00	1,347,000	
三谷セキサン	800	1,254.00	1,003,200	
ジャパンパイル	1,300	979.00	1,272,700	
東海カーボン	15,000	357.00	5,355,000	
日本カーボン	9,000	197.00	1,773,000	
東洋炭素	900	1,914.00	1,722,600	
ノリタケカンパニーリミテド	9,000	245.00	2,205,000	
TOTO	24,000	1,656.00	39,744,000	
日本碍子	21,000	1,886.00	39,606,000	
日本特殊陶業	14,000	2,391.00	33,474,000	
ダントーホールディングス	2,000	123.00	246,000	
MARUWA	400	3,340.00	1,336,000	
品川リフラクトリーズ	4,000	215.00	860,000	
黒崎播磨	4,000	237.00	948,000	
ヨータイ	1,000	293.00	293,000	
イソライト工業	600	184.00	110,400	
東京窯業	2,000	224.00	448,000	
ニッカトー	500	396.00	198,000	
フジインコーポレーテッド	1,500	1,244.00	1,866,000	
エーアンドエーマテリアル	3,000	135.00	405,000	
ニチアス	8,000	690.00	5,520,000	
ニチハ	2,000	1,380.00	2,760,000	
新日鐵住金	692,000	339.00	234,588,000	
神戸製鋼所	227,000	174.00	39,498,000	

合同製鐵	9,000	172.00	1,548,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	41,800	2,397.00	100,194,600	
日新製鋼ホールディングス	7,000	1,198.00	8,386,000	
東京製鐵	9,200	496.00	4,563,200	
共英製鋼	1,600	1,836.00	2,937,600	
大和工業	3,400	3,160.00	10,744,000	
東京鐵鋼	3,000	361.00	1,083,000	
大阪製鐵	800	1,723.00	1,378,400	
淀川製鋼所	12,000	423.00	5,076,000	
東洋鋼鈹	4,000	460.00	1,840,000	
丸一鋼管	5,500	2,559.00	14,074,500	
モリ工業	2,000	397.00	794,000	
大同特殊鋼	27,000	514.00	13,878,000	
日本高周波鋼業	7,000	100.00	700,000	
日本冶金工業	13,000	340.00	4,420,000	
山陽特殊製鋼	8,000	480.00	3,840,000	
愛知製鋼	9,000	409.00	3,681,000	
日立金属	15,000	1,407.00	21,105,000	
日本金属	5,000	136.00	680,000	
大平洋金属	11,000	364.00	4,004,000	
日本電工	7,000	290.00	2,030,000	
栗本鐵工所	9,000	229.00	2,061,000	
虹技	2,000	194.00	388,000	
日本鑄鉄管	2,000	220.00	440,000	
三菱製鋼	10,000	242.00	2,420,000	
日亜鋼業	2,000	391.00	782,000	
日本精線	1,000	439.00	439,000	
シンニッタン	1,600	383.00	612,800	
新家工業	4,000	161.00	644,000	
大紀アルミニウム工業所	3,000	262.00	786,000	
日本軽金属ホールディングス	37,300	134.00	4,998,200	
三井金属鉱業	42,000	316.00	13,272,000	
東邦亜鉛	9,000	336.00	3,024,000	
三菱マテリアル	102,000	369.00	37,638,000	
住友金属鉱山	42,000	1,301.00	54,642,000	

DOWAホールディングス	18,000	998.00	17,964,000	
古河機械金属	28,000	195.00	5,460,000	
エス・サイエンス	5,800	50.00	290,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,800	1,666.00	2,998,800	
東邦チタニウム	2,800	674.00	1,887,200	
UACJ	21,000	360.00	7,560,000	
古河電気工業	52,000	247.00	12,844,000	
住友電気工業	61,700	1,708.00	105,383,600	
フジクラ	26,000	474.00	12,324,000	
昭和電線ホールディングス	22,000	98.00	2,156,000	
タツタ電線	2,500	556.00	1,390,000	
沖電線	2,000	190.00	380,000	
カナレ電気	200	1,513.00	302,600	
平河ヒューテック	300	769.00	230,700	
リョービ	10,000	405.00	4,050,000	
アサヒホールディングス	2,500	1,712.00	4,280,000	
稲葉製作所	700	1,253.00	877,100	
宮地エンジニアリンググループ	6,000	267.00	1,602,000	
トーカロ	1,000	1,535.00	1,535,000	
アルファC o	500	1,013.00	506,500	
SUMCO	10,000	893.00	8,930,000	
川田テクノロジーズ	400	2,521.00	1,008,400	
東洋製罐グループホールディングス	11,600	2,197.00	25,485,200	
ホッカンホールディングス	4,000	322.00	1,288,000	
コロナ	800	1,109.00	887,200	
横河ブリッジホールディングス	3,000	1,389.00	4,167,000	
駒井ハルテック	3,000	299.00	897,000	
高田機工	2,000	214.00	428,000	
三和ホールディングス	14,000	698.00	9,772,000	
文化シャッター	4,000	606.00	2,424,000	
三協立山	2,200	2,016.00	4,435,200	
東洋シャッター	500	564.00	282,000	
LIXILグループ	22,800	2,825.00	64,410,000	
日本フィルコン	1,100	430.00	473,000	
ノーリツ	3,200	2,198.00	7,033,600	

長府製作所	1,700	2,321.00	3,945,700	
リンナイ	2,500	7,860.00	19,650,000	
ダイニチ工業	900	771.00	693,900	
日東精工	2,000	333.00	666,000	
三洋工業	2,000	177.00	354,000	
岡部	3,200	1,196.00	3,827,200	
中国工業	300	742.00	222,600	
東プレ	3,200	1,505.00	4,816,000	
高周波熱錬	2,400	814.00	1,953,600	
東京製綱	11,000	155.00	1,705,000	
サンコール	1,000	649.00	649,000	
モリテック スチール	900	284.00	255,600	
パイオラックス	800	3,730.00	2,984,000	
日本発條	13,000	1,122.00	14,586,000	
中央発條	2,000	303.00	606,000	
アドバネクス	4,000	118.00	472,000	
三益半導体工業	1,300	863.00	1,121,900	
アタカ大機	1,000	495.00	495,000	
日本製鋼所	23,000	556.00	12,788,000	
三浦工業	2,400	2,581.00	6,194,400	
タクマ	5,000	887.00	4,435,000	
ツガミ	5,000	603.00	3,015,000	
オークマ	11,000	1,167.00	12,837,000	
東芝機械	9,000	567.00	5,103,000	
アマダ	25,000	914.00	22,850,000	
アイダエンジニアリング	3,900	1,063.00	4,145,700	
滝澤鉄工所	4,000	140.00	560,000	
富士機械製造	5,000	866.00	4,330,000	
牧野フライス製作所	8,000	885.00	7,080,000	
オーエスジー	6,700	1,739.00	11,651,300	
ダイジェット工業	2,000	147.00	294,000	
旭ダイヤモンド工業	4,200	1,025.00	4,305,000	
D M G 森精機	8,600	1,790.00	15,394,000	
ディスコ	1,800	6,840.00	12,312,000	
日東工器	900	1,830.00	1,647,000	

豊和工業	1,000	829.00	829,000	
大阪機工	7,000	135.00	945,000	
東洋機械金属	1,300	423.00	549,900	
津田駒工業	4,000	164.00	656,000	
島精機製作所	2,200	1,872.00	4,118,400	
日阪製作所	2,000	924.00	1,848,000	
やまびこ	600	3,060.00	1,836,000	
ペガサスミシン製造	1,600	376.00	601,600	
ナプテスコ	7,500	2,395.00	17,962,500	
三井海洋開発	1,400	2,935.00	4,109,000	
レオン自動機	1,000	579.00	579,000	
S M C	4,700	25,570.00	120,179,000	
新川	1,400	592.00	828,800	
ホソカワミクロン	3,000	646.00	1,938,000	
ユニオンツール	700	2,286.00	1,600,200	
オイレス工業	1,600	2,014.00	3,222,400	
日精エー・エス・ビー機械	500	2,235.00	1,117,500	
サトーホールディングス	1,700	2,342.00	3,981,400	
日本エアータック	500	504.00	252,000	
日精樹脂工業	1,200	584.00	700,800	
ワイエイシイ	700	525.00	367,500	
小松製作所	76,400	2,104.00	160,745,600	
住友重機械工業	45,000	464.00	20,880,000	
日立建機	8,300	2,208.00	18,326,400	
日工	2,000	599.00	1,198,000	
巴工業	600	1,627.00	976,200	
井関農機	17,000	294.00	4,998,000	
T O W A	1,400	471.00	659,400	
丸山製作所	3,000	261.00	783,000	
北川鉄工所	8,000	183.00	1,464,000	
クボタ	85,000	1,676.00	142,460,000	
荏原実業	400	1,360.00	544,000	
三菱化工機	6,000	164.00	984,000	
月島機械	3,000	1,023.00	3,069,000	
帝国電機製作所	600	2,488.00	1,492,800	

新東工業	3,900	755.00	2,944,500	
澁谷工業	1,000	1,680.00	1,680,000	
アイチ コーポレーション	2,300	450.00	1,035,000	
小森コーポレーション	4,000	1,753.00	7,012,000	
鶴見製作所	1,000	1,018.00	1,018,000	
住友精密工業	3,000	437.00	1,311,000	
酒井重工業	3,000	376.00	1,128,000	
荏原製作所	36,000	656.00	23,616,000	
石井鐵工所	2,000	295.00	590,000	
西島製作所	1,800	1,006.00	1,810,800	
ダイキン工業	21,400	6,440.00	137,816,000	
オルガノ	3,000	452.00	1,356,000	
トーヨーカネツ	9,000	282.00	2,538,000	
栗田工業	9,800	2,113.00	20,707,400	
椿本チエイン	8,000	768.00	6,144,000	
大同工業	3,000	299.00	897,000	
日本コンベヤ	5,000	130.00	650,000	
木村化工機	1,600	447.00	715,200	
アネスト岩田	3,000	627.00	1,881,000	
ダイフク	6,500	1,275.00	8,287,500	
加藤製作所	4,000	634.00	2,536,000	
油研工業	3,000	216.00	648,000	
タダノ	7,000	1,353.00	9,471,000	
フジテック	4,000	1,284.00	5,136,000	
C K D	4,400	1,090.00	4,796,000	
キトー	900	1,891.00	1,701,900	
平和	3,400	1,615.00	5,491,000	
理想科学工業	1,200	2,070.00	2,484,000	
S A N K Y O	4,700	4,710.00	22,137,000	
日本金銭機械	1,500	1,968.00	2,952,000	
マースエンジニアリング	900	1,865.00	1,678,500	
福島工業	900	1,419.00	1,277,100	
オーイズミ	600	1,083.00	649,800	
ダイコク電機	700	2,033.00	1,423,100	
アマノ	4,400	920.00	4,048,000	



J U K I	10,000	227.00	2,270,000	
サンデン	9,000	437.00	3,933,000	
蛇の目マシン工業	16,000	82.00	1,312,000	
マックス	2,000	1,103.00	2,206,000	
グローリー	4,600	2,632.00	12,107,200	
新晃工業	1,100	776.00	853,600	
大和冷機工業	2,000	669.00	1,338,000	
セガサミーホールディングス	16,800	2,645.00	44,436,000	
日本ピストンリング	6,000	190.00	1,140,000	
リケン	6,000	424.00	2,544,000	
T P R	1,700	1,717.00	2,918,900	
ホシザキ電機	3,400	3,530.00	12,002,000	
大豊工業	1,100	1,175.00	1,292,500	
日本精工	35,000	1,246.00	43,610,000	
N T N	36,000	449.00	16,164,000	
ジェイテクト	16,600	1,767.00	29,332,200	
不二越	15,000	577.00	8,655,000	
日本トムソン	5,000	549.00	2,745,000	
T H K	9,700	2,524.00	24,482,800	
ユーシン精機	700	2,185.00	1,529,500	
前澤給装工業	600	1,250.00	750,000	
イーグル工業	2,000	1,657.00	3,314,000	
前澤工業	1,200	323.00	387,600	
日本ピラー工業	2,000	677.00	1,354,000	
キッツ	7,000	497.00	3,479,000	
日立工機	4,200	746.00	3,133,200	
マキタ	10,200	5,340.00	54,468,000	
日立造船	11,600	764.00	8,862,400	
三菱重工業	278,000	628.00	174,584,000	
I H I	107,000	433.00	46,331,000	
イビデン	9,500	1,903.00	18,078,500	
コニカミノルタ	41,500	1,015.00	42,122,500	
ブラザー工業	20,200	1,376.00	27,795,200	
ミネベア	21,000	753.00	15,813,000	
日立製作所	376,000	763.00	286,888,000	

東芝	309,000	423.00	130,707,000	
三菱電機	156,000	1,255.00	195,780,000	
富士電機	44,000	468.00	20,592,000	
東洋電機製造	3,000	303.00	909,000	
安川電機	17,000	1,589.00	27,013,000	
シンフォニアテクノロジー	10,000	159.00	1,590,000	
明電舎	14,000	378.00	5,292,000	
オリジン電気	2,000	305.00	610,000	
山洋電気	2,000	616.00	1,232,000	
デンヨー	1,500	1,364.00	2,046,000	
東芝テック	10,000	694.00	6,940,000	
芝浦メカトロニクス	3,000	225.00	675,000	
マブチモーター	2,200	6,120.00	13,464,000	
日本電産	8,500	9,800.00	83,300,000	
東光高岳ホールディングス	900	1,785.00	1,606,500	
宮越ホールディングス	600	279.00	167,400	
ダイヘン	9,000	459.00	4,131,000	
ヤーマン	200	1,256.00	251,200	
JVCケンウッド	11,100	191.00	2,120,100	
第一精工	700	1,204.00	842,800	
日新電機	3,000	603.00	1,809,000	
大崎電気工業	3,000	524.00	1,572,000	
オムロン	17,700	4,445.00	78,676,500	
日東工業	2,300	1,646.00	3,785,800	
I D E C	2,000	877.00	1,754,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	30,000	588.00	17,640,000	
サクサホールディングス	4,000	152.00	608,000	
メルコホールディングス	700	1,298.00	908,600	
テクノメディカ	400	2,067.00	826,800	
日本電気	215,000	223.00	47,945,000	
富士通	151,000	533.00	80,483,000	
沖電気工業	60,000	237.00	14,220,000	
岩崎通信機	8,000	94.00	752,000	
電気興業	4,000	698.00	2,792,000	
サンケン電気	8,000	741.00	5,928,000	

ナカヨ通信機	1,000	314.00	314,000	
アイホン	900	1,690.00	1,521,000	
ルネサスエレクトロニクス	8,100	620.00	5,022,000	
セイコーエプソン	10,700	2,775.00	29,692,500	
ワコム	12,300	659.00	8,105,700	
アルバック	2,700	1,367.00	3,690,900	
アクセル	800	1,685.00	1,348,000	
E I Z O	1,400	2,542.00	3,558,800	
日本信号	3,900	846.00	3,299,400	
京三製作所	4,000	333.00	1,332,000	
能美防災	2,000	970.00	1,940,000	
ホーチキ	1,000	556.00	556,000	
エレコム	600	1,314.00	788,400	
日本無線	4,000	337.00	1,348,000	
パナソニック	178,600	1,199.00	214,141,400	
シャープ	113,000	324.00	36,612,000	
アンリツ	9,100	1,079.00	9,818,900	
富士通ゼネラル	4,000	1,058.00	4,232,000	
日立国際電気	3,000	1,384.00	4,152,000	
ソニー	85,800	1,792.00	153,753,600	
T D K	9,500	4,955.00	47,072,500	
帝国通信工業	4,000	169.00	676,000	
ミツミ電機	6,000	882.00	5,292,000	
タムラ製作所	6,000	289.00	1,734,000	
アルプス電気	11,500	1,205.00	13,857,500	
池上通信機	5,000	101.00	505,000	
パイオニア	21,800	210.00	4,578,000	
日本電波工業	1,400	853.00	1,194,200	
日本トリム	300	8,270.00	2,481,000	
ローランド ディー . ジー .	700	3,385.00	2,369,500	
フォスター電機	1,600	1,868.00	2,988,800	
クラリオン	10,000	148.00	1,480,000	
S M K	5,000	658.00	3,290,000	
ヨコオ	1,300	503.00	653,900	
東光	8,000	349.00	2,792,000	

ティアック	9,000	95.00	855,000	
ホシデン	4,600	535.00	2,461,000	
ヒロセ電機	2,700	14,980.00	40,446,000	
日本航空電子工業	4,000	1,338.00	5,352,000	
TOA	1,700	978.00	1,662,600	
古野電気	1,500	706.00	1,059,000	
ユニデン	5,000	364.00	1,820,000	
アルパイン	3,400	1,382.00	4,698,800	
スミダコーポレーション	1,300	517.00	672,100	
アイコム	800	2,390.00	1,912,000	
リオン	500	1,506.00	753,000	
船井電機	1,600	1,260.00	2,016,000	
横河電機	17,000	1,576.00	26,792,000	
新電元工業	5,000	625.00	3,125,000	
アズビル	4,700	2,358.00	11,082,600	
東亜ディーケーケー	600	475.00	285,000	
日本光電工業	3,300	3,440.00	11,352,000	
チノー	3,000	211.00	633,000	
共和電業	2,000	398.00	796,000	
日本電子材料	700	360.00	252,000	
堀場製作所	2,900	3,515.00	10,193,500	
アドバンテスト	10,700	1,287.00	13,770,900	
小野測器	1,000	453.00	453,000	
エスベック	1,600	780.00	1,248,000	
パナソニック デバイスSUNX	1,300	453.00	588,900	
キーエンス	3,500	43,500.00	152,250,000	
日置電機	800	1,370.00	1,096,000	
シスメックス	6,500	6,020.00	39,130,000	
メガチップス	1,400	1,515.00	2,121,000	
OBARA GROUP	1,000	3,065.00	3,065,000	
日本電産コパル電子	1,600	573.00	916,800	
澤藤電機	1,000	214.00	214,000	
コーセル	2,200	1,213.00	2,668,600	
日立メディコ	1,000	1,782.00	1,782,000	
新日本無線	1,000	366.00	366,000	

オブテックス	1,000	1,652.00	1,652,000	
千代田インテグレ	700	1,732.00	1,212,400	
レーザーテック	1,100	909.00	999,900	
スタンレー電気	11,300	2,293.00	25,910,900	
岩崎電気	6,000	205.00	1,230,000	
ウシオ電機	9,400	1,366.00	12,840,400	
岡谷電機産業	700	353.00	247,100	
ヘリオス テクノ ホールディング	1,400	377.00	527,800	
日本セラミック	900	1,610.00	1,449,000	
遠藤照明	700	1,991.00	1,393,700	
日本デジタル研究所	1,200	1,381.00	1,657,200	
古河電池	1,000	553.00	553,000	
双信電機	800	355.00	284,000	
山一電機	1,800	226.00	406,800	
図研	1,000	762.00	762,000	
日本電子	6,000	469.00	2,814,000	
カシオ計算機	16,300	1,278.00	20,831,400	
ファナック	17,400	19,130.00	332,862,000	
日本シイエムケイ	3,700	281.00	1,039,700	
エンプラス	600	7,210.00	4,326,000	
大真空	2,000	380.00	760,000	
ローム	8,300	4,855.00	40,296,500	
浜松ホトニクス	6,100	3,990.00	24,339,000	
三井ハイテック	2,100	712.00	1,495,200	
新光電気工業	5,300	840.00	4,452,000	
京セラ	27,900	5,230.00	145,917,000	
太陽誘電	7,600	1,355.00	10,298,000	
村田製作所	16,400	9,030.00	148,092,000	
ユーシン	2,200	713.00	1,568,600	
双葉電子工業	2,900	1,292.00	3,746,800	
北陸電気工業	6,000	159.00	954,000	
ニチコン	4,900	998.00	4,890,200	
日本ケミコン	11,000	402.00	4,422,000	
K O A	2,000	1,032.00	2,064,000	
市光工業	4,000	160.00	640,000	

小糸製作所	9,000	1,912.00	17,208,000	
ミツバ	2,900	1,609.00	4,666,100	
スター精密	3,000	1,219.00	3,657,000	
大日本スクリーン製造	15,000	592.00	8,880,000	
キヤノン電子	1,400	1,943.00	2,720,200	
キヤノン	90,600	3,375.00	305,775,000	代用有価証券 10,000株
リコー	47,000	1,090.00	51,230,000	
MUTOHホールディングス	2,000	508.00	1,016,000	
東京エレクトロン	14,000	5,730.00	80,220,000	
トヨタ紡織	5,500	1,270.00	6,985,000	
鬼怒川ゴム工業	3,000	505.00	1,515,000	
ユニプレス	2,500	1,985.00	4,962,500	
豊田自動織機	14,200	4,455.00	63,261,000	
モリタホールディングス	3,000	811.00	2,433,000	
三櫻工業	2,000	696.00	1,392,000	
デンソー	38,600	5,270.00	203,422,000	
東海理化電機製作所	4,100	1,999.00	8,195,900	
三井造船	60,000	206.00	12,360,000	
佐世保重工業	12,000	112.00	1,344,000	
川崎重工業	122,000	423.00	51,606,000	
名村造船所	2,300	1,306.00	3,003,800	
サノヤスホールディングス	1,500	217.00	325,500	
日本車輛製造	6,000	492.00	2,952,000	
ニチユ三菱フォークリフト	2,000	666.00	1,332,000	
近畿車輛	3,000	286.00	858,000	
日産自動車	219,400	872.00	191,316,800	
いすゞ自動車	91,000	622.00	56,602,000	
トヨタ自動車	217,600	6,160.00	1,340,416,000	代用有価証券 35,000株
日野自動車	19,000	1,607.00	30,533,000	
三菱自動車工業	36,300	1,093.00	39,675,900	
エフテック	500	1,525.00	762,500	
G M B	100	1,194.00	119,400	
武蔵精密工業	1,700	2,219.00	3,772,300	
日産車体	8,000	1,459.00	11,672,000	

新明和工業	6,000	836.00	5,016,000	
極東開発工業	2,700	1,280.00	3,456,000	
日信工業	3,200	2,133.00	6,825,600	
トピー工業	13,000	186.00	2,418,000	
ティラド	6,000	268.00	1,608,000	
曙ブレーキ工業	7,300	435.00	3,175,500	
タチエス	2,300	1,379.00	3,171,700	
NOK	7,600	1,633.00	12,410,800	
フタバ産業	4,800	374.00	1,795,200	
カヤバ工業	13,000	519.00	6,747,000	
シロキ工業	3,000	212.00	636,000	
大同メタル工業	2,000	988.00	1,976,000	
プレス工業	6,000	407.00	2,442,000	
カルソニックカンセイ	11,000	534.00	5,874,000	
太平洋工業	3,200	665.00	2,128,000	
ケーヒン	3,600	1,585.00	5,706,000	
河西工業	2,000	669.00	1,338,000	
アイシン精機	14,300	4,125.00	58,987,500	
富士機工	2,000	322.00	644,000	
マツダ	233,000	513.00	119,529,000	
ダイハツ工業	16,600	1,698.00	28,186,800	
今仙電機製作所	1,100	1,440.00	1,584,000	
本田技研工業	140,700	4,275.00	601,492,500	
スズキ	32,700	2,774.00	90,709,800	
富士重工業	53,200	2,925.00	155,610,000	
ヤマハ発動機	23,800	1,556.00	37,032,800	
ショーワ	3,700	1,614.00	5,971,800	
T B K	2,000	534.00	1,068,000	
エクセディ	1,900	3,020.00	5,738,000	
豊田合成	5,000	2,361.00	11,805,000	
愛三工業	1,900	961.00	1,825,900	
ヨロズ	1,100	1,866.00	2,052,600	
エフ・シー・シー	2,600	2,031.00	5,280,600	
シマノ	6,800	8,850.00	60,180,000	
タカタ	2,800	2,951.00	8,262,800	

テイ・エス テック	3,300	3,435.00	11,335,500	
テルモ	12,000	5,090.00	61,080,000	
クリエートメディック	500	980.00	490,000	
日機装	5,000	1,273.00	6,365,000	
島津製作所	20,000	926.00	18,520,000	
JMS	3,000	287.00	861,000	
ショットモリテックス	400	349.00	139,600	
長野計器	1,000	674.00	674,000	
ブイ・テクノロジー	3	265,600.00	796,800	
東京計器	5,000	296.00	1,480,000	
愛知時計電機	2,000	289.00	578,000	
東京精密	2,800	2,145.00	6,006,000	
マニー	500	3,475.00	1,737,500	
ニコン	29,200	1,973.00	57,611,600	
トプコン	4,200	1,516.00	6,367,200	
オリンパス	23,300	3,280.00	76,424,000	
理研計器	1,400	842.00	1,178,800	
タムロン	1,200	2,464.00	2,956,800	
HOYA	38,000	2,856.00	108,528,000	
ノーリツ鋼機	1,400	616.00	862,400	
エー・アンド・デイ	1,500	610.00	915,000	
シチズンホールディングス	19,300	871.00	16,810,300	
リズム時計工業	7,000	133.00	931,000	
大研医器	600	1,577.00	946,200	
松風	700	854.00	597,800	
セイコーホールディングス	10,000	504.00	5,040,000	
ニプロ	8,400	907.00	7,618,800	
パラマウントベッドホールディングス	1,500	3,225.00	4,837,500	
SHO-BI	500	401.00	200,500	
前田工織	1,100	1,118.00	1,229,800	
永大産業	2,000	506.00	1,012,000	
ダンロップスポーツ	900	1,282.00	1,153,800	
バンダイナムコホールディングス	17,200	2,299.00	39,542,800	
共立印刷	3,000	272.00	816,000	
フランスベッドホールディングス	10,000	192.00	1,920,000	



パイロットコーポレーション	1,400	3,490.00	4,886,000	
トッパン・フォームズ	2,800	923.00	2,584,400	
フジシールインターナショナル	1,900	3,100.00	5,890,000	
タカラトミー	5,300	453.00	2,400,900	
廣済堂	1,500	514.00	771,000	
アーク	4,800	279.00	1,339,200	
タカノ	700	507.00	354,900	
プロネクサス	1,700	627.00	1,065,900	
ホクシン	1,200	144.00	172,800	
ウッドワン	3,000	298.00	894,000	
大建工業	6,000	267.00	1,602,000	
凸版印刷	44,000	821.00	36,124,000	
大日本印刷	48,000	1,080.00	51,840,000	
図書印刷	3,000	330.00	990,000	
共同印刷	5,000	278.00	1,390,000	
日本写真印刷	2,700	1,584.00	4,276,800	
光村印刷	2,000	268.00	536,000	
宝印刷	900	679.00	611,100	
アシックス	15,600	1,707.00	26,629,200	
ツツミ	800	2,326.00	1,860,800	
ローランド	1,500	1,356.00	2,034,000	
小松ウオール工業	600	1,985.00	1,191,000	
ヤマハ	11,500	1,649.00	18,963,500	
河合楽器製作所	6,000	182.00	1,092,000	
クリナップ	1,600	870.00	1,392,000	
ピジョン	2,600	4,825.00	12,545,000	
兼松日産農林	3,000	158.00	474,000	
キングジム	1,200	649.00	778,800	
リンテック	3,700	1,898.00	7,022,600	
T A S A K I	300	725.00	217,500	
イトーキ	3,300	576.00	1,900,800	
任天堂	9,600	13,810.00	132,576,000	
三菱鉛筆	1,300	2,261.00	2,939,300	
タカラスタンダード	6,000	745.00	4,470,000	
コクヨ	8,100	781.00	6,326,100	

ナカバヤシ	4,000	202.00	808,000	
岡村製作所	6,000	870.00	5,220,000	
美津濃	8,000	509.00	4,072,000	
アデランス	2,000	1,102.00	2,204,000	
東京電力	132,700	501.00	66,482,700	
中部電力	51,500	1,287.00	66,280,500	
関西電力	63,800	1,141.00	72,795,800	
中国電力	21,600	1,568.00	33,868,800	
北陸電力	15,300	1,341.00	20,517,300	
東北電力	39,100	1,115.00	43,596,500	
四国電力	14,100	1,487.00	20,966,700	
九州電力	34,500	1,254.00	43,263,000	
北海道電力	14,700	1,142.00	16,787,400	
沖縄電力	1,000	3,235.00	3,235,000	
電源開発	9,700	2,946.00	28,576,200	
東京瓦斯	183,000	504.00	92,232,000	
大阪瓦斯	162,000	404.00	65,448,000	
東邦瓦斯	40,000	486.00	19,440,000	
北海道瓦斯	3,000	270.00	810,000	
西部瓦斯	18,000	243.00	4,374,000	
静岡瓦斯	4,100	609.00	2,496,900	
東武鉄道	89,000	488.00	43,432,000	
相鉄ホールディングス	27,000	334.00	9,018,000	
東京急行電鉄	92,000	652.00	59,984,000	
京浜急行電鉄	40,000	822.00	32,880,000	
小田急電鉄	50,000	910.00	45,500,000	
京王電鉄	44,000	677.00	29,788,000	
京成電鉄	23,000	933.00	21,459,000	
富士急行	4,000	809.00	3,236,000	
東日本旅客鉄道	28,800	8,180.00	235,584,000	
西日本旅客鉄道	14,400	4,535.00	65,304,000	
東海旅客鉄道	14,000	12,160.00	170,240,000	
鴻池運輸	800	1,423.00	1,138,400	
西日本鉄道	20,000	374.00	7,480,000	
ハマキョウレックス	400	2,744.00	1,097,600	

サカイ引越センター	200	3,130.00	626,000	
近畿日本鉄道	157,000	356.00	55,892,000	
阪急阪神ホールディングス	105,000	540.00	56,700,000	
南海電気鉄道	33,000	357.00	11,781,000	
京阪電気鉄道	33,000	384.00	12,672,000	
神戸電鉄	4,000	304.00	1,216,000	
名糖運輸	700	646.00	452,200	
名古屋鉄道	55,000	291.00	16,005,000	
山陽電気鉄道	6,000	398.00	2,388,000	
日本通運	62,000	504.00	31,248,000	
ヤマトホールディングス	29,100	2,103.00	61,197,300	
山九	19,000	398.00	7,562,000	
丸運	1,000	240.00	240,000	
丸全昭和運輸	5,000	349.00	1,745,000	
センコー	6,000	528.00	3,168,000	
トナミホールディングス	3,000	214.00	642,000	
日本梱包運輸倉庫	4,800	1,813.00	8,702,400	
日本石油輸送	2,000	226.00	452,000	
福山通運	9,000	562.00	5,058,000	
セイノーホールディングス	11,000	1,068.00	11,748,000	
神奈川中央交通	2,000	502.00	1,004,000	
日立物流	3,300	1,523.00	5,025,900	
日本郵船	132,000	322.00	42,504,000	
商船三井	88,000	462.00	40,656,000	
川崎汽船	69,000	251.00	17,319,000	
N S ユナイテッド海運	7,000	301.00	2,107,000	
乾汽船	1,900	368.00	699,200	
明治海運	1,500	458.00	687,000	
飯野海運	6,600	627.00	4,138,200	
共栄タンカー	2,000	238.00	476,000	
日本航空	13,200	4,930.00	65,076,000	
A N A ホールディングス	308,000	207.00	63,756,000	
パスコ	2,000	458.00	916,000	
トランコム	500	3,135.00	1,567,500	
日新	6,000	281.00	1,686,000	

三菱倉庫	10,000	1,635.00	16,350,000	
三井倉庫	8,000	449.00	3,592,000	
住友倉庫	10,000	566.00	5,660,000	
澁澤倉庫	4,000	370.00	1,480,000	
東陽倉庫	3,000	252.00	756,000	
日本トランスシティ	3,000	326.00	978,000	
ケイヒン	3,000	170.00	510,000	
中央倉庫	900	873.00	785,700	
安田倉庫	1,200	1,067.00	1,280,400	
東洋埠頭	5,000	231.00	1,155,000	
宇徳	1,300	337.00	438,100	
上組	19,000	924.00	17,556,000	
サンリツ	400	526.00	210,400	
キムラユニティー	400	941.00	376,400	
キューソー流通システム	500	1,016.00	508,000	
郵船ロジスティクス	1,500	1,273.00	1,909,500	
近鉄エクスプレス	1,400	4,040.00	5,656,000	
東海運	900	270.00	243,000	
エーアイテイー	600	681.00	408,600	
NEC ネットエスアイ	1,700	2,391.00	4,064,700	
システナ	1,500	708.00	1,062,000	
デジタルアーツ	400	921.00	368,400	
新日鉄住金ソリューションズ	1,300	2,236.00	2,906,800	
コア	600	734.00	440,400	
ソフトクリエイトホールディングス	500	908.00	454,000	
ITホールディングス	5,600	1,596.00	8,937,600	
ネオス	300	1,418.00	425,400	
電算システム	400	1,430.00	572,000	
グリー	8,000	1,005.00	8,040,000	
コーエーテクモホールディングス	3,100	1,213.00	3,760,300	
三菱総合研究所	600	2,088.00	1,252,800	
ボルテージ	200	1,209.00	241,800	
電算	100	1,869.00	186,900	
ヒト・コミュニケーションズ	200	1,605.00	321,000	
ブレインパッド	100	1,469.00	146,900	

K L a b	1,100	813.00	894,300
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	500	3,260.00	1,630,000
イーブックイニシアティブジャパン	200	2,169.00	433,800
ネクソン	12,800	947.00	12,121,600
アイスタイル	500	604.00	302,000
エムアップ	300	858.00	257,400
エイチーム	100	7,350.00	735,000
ブロードリーフ	1,600	1,911.00	3,057,600
ハーツユナイテッドグループ	400	2,306.00	922,400
ドワンゴ	1,400	2,780.00	3,892,000
ベリサーブ	100	1,646.00	164,600
マクロミル	2,500	780.00	1,950,000
ティーガイア	1,500	1,118.00	1,677,000
豆蔵ホールディングス	900	434.00	390,600
テクマトリックス	500	615.00	307,500
GMOペイメントゲートウェイ	600	4,215.00	2,529,000
ザッパラス	900	732.00	658,800
インターネットイニシアティブ	2,300	2,777.00	6,387,100
ビットアイル	1,200	801.00	961,200
S R Aホールディングス	800	1,214.00	971,200
朝日ネット	1,400	483.00	676,200
パナソニック インフォメーションシステムズ	300	2,831.00	849,300
フェイス	500	1,089.00	544,500
野村総合研究所	8,700	3,150.00	27,405,000
サイバネットシステム	1,300	348.00	452,400
インテージホールディングス	900	1,253.00	1,127,700
ソースネクスト	800	876.00	700,800
クレスコ	300	911.00	273,300
フジ・メディア・ホールディングス	14,900	2,143.00	31,930,700
オービック	5,300	2,960.00	15,688,000
TDCソフトウェアエンジニアリング	300	800.00	240,000
ヤフー	111,700	576.00	64,339,200
トレンドマイクロ	6,800	3,745.00	25,466,000
日本オラクル	3,100	3,705.00	11,485,500

アルファシステムズ	500	1,377.00	688,500	
フューチャーアーキテクト	1,800	548.00	986,400	
シーエーシー	1,000	925.00	925,000	
ソフトバンク・テクノロジー	400	1,611.00	644,400	
トーセ	400	719.00	287,600	
オービックビジネスコンサルタント	800	3,300.00	2,640,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	1,800	4,125.00	7,425,000	
アイティフォー	1,700	435.00	739,500	
東計電算	200	1,500.00	300,000	
エクスネット	100	1,355.00	135,500	
大塚商会	1,400	12,200.00	17,080,000	
サイボウズ	24	41,400.00	993,600	
ソフトブレーン	2,200	143.00	314,600	
アグレックス	300	948.00	284,400	
電通国際情報サービス	900	1,086.00	977,400	
E Mシステムズ	200	1,902.00	380,400	
ウェザーニューズ	400	2,297.00	918,800	
C I J	1,400	408.00	571,200	
WOWOW	500	3,375.00	1,687,500	
日本コロムビア	800	549.00	439,200	
ネットワンシステムズ	6,100	651.00	3,971,100	
アルゴグラフィックス	600	1,693.00	1,015,800	
マーベラスAQL	2,400	725.00	1,740,000	
エイベックス・グループ・ホールディングス	2,900	2,177.00	6,313,300	
日本ユニシス	3,800	885.00	3,363,000	
兼松エレクトロニクス	900	1,262.00	1,135,800	
東京放送ホールディングス	8,300	1,259.00	10,449,700	
日本テレビホールディングス	15,400	1,852.00	28,520,800	
テレビ朝日	3,900	2,287.00	8,919,300	
スカパーJ S A Tホールディングス	11,700	559.00	6,540,300	
テレビ東京ホールディングス	1,300	1,618.00	2,103,400	
コネクシオ	1,400	795.00	1,113,000	
日本電信電話	60,600	5,460.00	330,876,000	代用有価証券 12,300株
K D D I	47,900	6,490.00	310,871,000	
光通信	1,400	7,710.00	10,794,000	

NTTドコモ	127,100	1,673.00	212,638,300	
GMOインターネット	5,100	1,368.00	6,976,800	
学研ホールディングス	5,000	290.00	1,450,000	
ゼンリン	2,100	993.00	2,085,300	
昭文社	900	615.00	553,500	
KADOKAWA	1,500	3,535.00	5,302,500	
インプレスホールディングス	1,100	143.00	157,300	
アイネット	700	761.00	532,700	
松竹	10,000	903.00	9,030,000	
東宝	11,000	2,202.00	24,222,000	
東映	6,000	560.00	3,360,000	
AOI Pro.	700	645.00	451,500	
エヌ・ティ・ティ・データ	10,900	3,785.00	41,256,500	
DTS	1,500	1,772.00	2,658,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,600	1,792.00	10,035,200	
シーイーシー	900	641.00	576,900	
カブコン	4,000	1,837.00	7,348,000	
ジャステック	1,000	718.00	718,000	
SCSK	3,700	2,576.00	9,531,200	
日本システムウエア	600	508.00	304,800	
アイネス	2,100	640.00	1,344,000	
TKC	1,300	1,704.00	2,215,200	
富士ソフト	2,000	2,339.00	4,678,000	
NSD	3,300	1,212.00	3,999,600	
コナミ	7,000	2,442.00	17,094,000	
福井コンピュータホールディングス	200	804.00	160,800	
JBCCHホールディングス	1,300	751.00	976,300	
ミロク情報サービス	1,000	387.00	387,000	
ソフトバンク	75,800	8,770.00	664,766,000	
ハウスイ	1,000	129.00	129,000	
高千穂交易	600	969.00	581,400	
伊藤忠食品	400	3,285.00	1,314,000	
エレマテック	700	1,577.00	1,103,900	
JALUX	500	1,113.00	556,500	
あらた	4,000	310.00	1,240,000	

トーメンデバイス	200	1,714.00	342,800	
東京エレクトロン デバイス	300	1,520.00	456,000	
双日	103,500	179.00	18,526,500	
アルフレッサ ホールディングス	4,600	4,850.00	22,310,000	
横浜冷凍	3,800	771.00	2,929,800	
神栄	2,000	257.00	514,000	
山下医科器械	100	1,746.00	174,600	
ラサ商事	700	451.00	315,700	
アルコニックス	500	2,199.00	1,099,500	
神戸物産	200	2,245.00	449,000	
あい ホールディングス	2,800	1,227.00	3,435,600	
ダイワボウホールディングス	14,000	200.00	2,800,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,900	710.00	2,059,000	
八洲電機	1,300	421.00	547,300	
U K Cホールディングス	1,000	1,655.00	1,655,000	
T O K A Iホールディングス	7,500	336.00	2,520,000	
三洋貿易	500	878.00	439,000	
ミタチ産業	300	491.00	147,300	
シップヘルスケアホールディングス	2,200	3,885.00	8,547,000	
富士興産	600	645.00	387,000	
協栄産業	2,000	180.00	360,000	
小野建	1,300	1,280.00	1,664,000	
佐島電機	1,200	567.00	680,400	
エコートレーディング	400	727.00	290,800	
伯東	900	986.00	887,400	
コンドーテック	1,300	704.00	915,200	
中山福	900	754.00	678,600	
ナガイレーベン	2,000	1,505.00	3,010,000	
三菱食品	1,700	2,464.00	4,188,800	
松田産業	1,100	1,320.00	1,452,000	
メディバルホールディングス	15,400	1,294.00	19,927,600	
アドヴァン	800	1,132.00	905,600	
S P K	400	1,784.00	713,600	
アズワン	1,000	2,373.00	2,373,000	
スズデン	600	519.00	311,400	



シモジマ	1,100	954.00	1,049,400	
ドウシシャ	1,600	1,424.00	2,278,400	
高速	900	873.00	785,700	
黒田電気	2,200	1,526.00	3,357,200	
丸文	1,300	528.00	686,400	
ハビネット	900	852.00	766,800	
トーメンエレクトロニクス	700	1,123.00	786,100	
エクセル	700	1,145.00	801,500	
マルカキカイ	500	1,289.00	644,500	
ガリバーインターナショナル	5,200	560.00	2,912,000	
日本エム・ディ・エム	1,400	302.00	422,800	
進和	900	1,115.00	1,003,500	
エスケイジャパン	400	272.00	108,800	
ダイトエレクトロン	700	381.00	266,700	
シークス	1,000	1,246.00	1,246,000	
田中商事	500	576.00	288,000	
オーハシテクニカ	800	930.00	744,000	
マクニカ	800	2,745.00	2,196,000	
白銅	500	854.00	427,000	
伊藤忠商事	123,100	1,247.00	153,505,700	
丸紅	135,000	719.00	97,065,000	
高島	3,000	246.00	738,000	
長瀬産業	8,700	1,200.00	10,440,000	
蝶理	1,000	1,135.00	1,135,000	
豊田通商	17,200	2,545.00	43,774,000	
三共生興	2,600	343.00	891,800	
兼松	33,000	155.00	5,115,000	
ツカモトコーポレーション	3,000	154.00	462,000	
三井物産	142,000	1,395.00	198,090,000	
日本紙パルプ商事	8,000	327.00	2,616,000	
日立ハイテクノロジーズ	4,700	2,547.00	11,970,900	
カメイ	2,000	764.00	1,528,000	
東都水産	3,000	203.00	609,000	
OUGホールディングス	2,000	187.00	374,000	
スターゼン	6,000	267.00	1,602,000	

山善	5,900	614.00	3,622,600	
椿本興業	2,000	281.00	562,000	
住友商事	91,000	1,270.00	115,570,000	
内田洋行	4,000	273.00	1,092,000	
三菱商事	120,300	1,950.00	234,585,000	
第一実業	3,000	445.00	1,335,000	
キャノンマーケティングジャパン	4,400	1,432.00	6,300,800	
西華産業	5,000	240.00	1,200,000	
佐藤商事	1,300	645.00	838,500	
菱洋エレクトロ	1,800	1,016.00	1,828,800	
東京産業	1,500	379.00	568,500	
ユアサ商事	16,000	204.00	3,264,000	
神鋼商事	4,000	226.00	904,000	
小林産業	1,100	326.00	358,600	
阪和興業	15,000	522.00	7,830,000	
カナデン	2,000	674.00	1,348,000	
菱電商事	2,000	679.00	1,358,000	
フルサト工業	900	1,225.00	1,102,500	
岩谷産業	17,000	501.00	8,517,000	
すてきナイスグループ	7,000	240.00	1,680,000	
昭光通商	5,000	170.00	850,000	
ニチモウ	3,000	188.00	564,000	
極東貿易	2,000	211.00	422,000	
イワキ	3,000	204.00	612,000	
三愛石油	4,000	462.00	1,848,000	
稲畑産業	3,800	1,093.00	4,153,400	
G S I クレオス	4,000	156.00	624,000	
明和産業	1,500	361.00	541,500	
ワキタ	2,000	1,168.00	2,336,000	
東邦ホールディングス	4,900	1,586.00	7,771,400	
サンゲツ	2,700	2,489.00	6,720,300	
ミツウロコグループホールディングス	2,400	538.00	1,291,200	
シナネン	3,000	396.00	1,188,000	
伊藤忠エネクス	3,400	548.00	1,863,200	
サンリオ	3,900	4,305.00	16,789,500	

サンワテクノス	800	849.00	679,200
リョーサン	2,300	2,119.00	4,873,700
新光商事	1,700	838.00	1,424,600
トーホー	3,000	370.00	1,110,000
三信電気	1,900	705.00	1,339,500
東陽テクニカ	2,100	1,044.00	2,192,400
モスフードサービス	2,000	1,936.00	3,872,000
加賀電子	1,400	1,127.00	1,577,800
ソーダニッカ	2,000	418.00	836,000
立花エレテック	900	1,265.00	1,138,500
P a l t a c	2,200	1,300.00	2,860,000
太平洋興発	6,000	104.00	624,000
ヤマタネ	8,000	168.00	1,344,000
丸紅建材リース	2,000	202.00	404,000
日鉄住金物産	10,000	361.00	3,610,000
トラスコ中山	1,800	2,248.00	4,046,400
オートバックスセブン	5,400	1,573.00	8,494,200
加藤産業	2,200	1,823.00	4,010,600
イノテック	1,400	457.00	639,800
イエローハット	1,300	1,805.00	2,346,500
富士エレクトロニクス	700	1,317.00	921,900
J Kホールディングス	1,300	565.00	734,500
日伝	700	2,180.00	1,526,000
北沢産業	1,500	187.00	280,500
杉本商事	800	950.00	760,000
因幡電機産業	2,100	3,050.00	6,405,000
バイテック	600	894.00	536,400
ミスミグループ本社	6,200	3,275.00	20,305,000
江守商事	500	1,988.00	994,000
アルテック	800	245.00	196,000
タキヒヨー	3,000	402.00	1,206,000
スズケン	6,400	3,145.00	20,128,000
ジェコス	1,100	749.00	823,900
ローソン	6,300	7,680.00	48,384,000
サンエー	1,200	2,784.00	3,340,800

キリン堂	600	667.00	400,200
ダイユーエイト	300	668.00	200,400
カワチ薬品	1,100	1,852.00	2,037,200
エーピーシー・マート	2,200	4,535.00	9,977,000
ハードオフコーポレーション	800	812.00	649,600
アスクル	1,300	3,080.00	4,004,000
ゲオホールディングス	2,700	906.00	2,446,200
アダストリアホールディングス	1,200	3,790.00	4,548,000
シー・ヴィ・エス・バイエリア	2,000	248.00	496,000
くらコーポレーション	900	1,500.00	1,350,000
キャンドウ	800	1,419.00	1,135,200
パル	900	2,491.00	2,241,900
エディオン	7,100	606.00	4,302,600
サーラコーポレーション	1,300	481.00	625,300
あみやき亭	300	3,540.00	1,062,000
ひらまつ	1,600	584.00	934,400
ゲンキー	200	2,075.00	415,000
大黒天物産	300	2,765.00	829,500
ハニーズ	1,230	1,001.00	1,231,230
アルペン	1,200	1,870.00	2,244,000
クオール	1,200	575.00	690,000
ジェイアイエヌ	800	4,410.00	3,528,000
ビックカメラ	59	52,200.00	3,079,800
D C Mホールディングス	7,600	676.00	5,137,600
MonotaRO	2,400	1,942.00	4,660,800
J.フロント リテイリング	37,000	760.00	28,120,000
ドトール・日レスホールディングス	2,700	1,649.00	4,452,300
マツモトキヨシホールディングス	3,200	3,230.00	10,336,000
ブロンコビリー	300	1,900.00	570,000
スタートトゥデイ	4,800	2,520.00	12,096,000
物語コーポレーション	200	3,145.00	629,000
ココカラファイン	1,600	2,609.00	4,174,400
三越伊勢丹ホールディングス	30,700	1,470.00	45,129,000
ウエルシアホールディングス	600	5,290.00	3,174,000
クリエイトSDホールディングス	700	3,420.00	2,394,000

丸善C H Iホールディングス	1,400	291.00	407,400
エー・ピーカンパニー	200	1,973.00	394,600
ブックオフコーポレーション	800	673.00	538,400
あさひ	900	1,433.00	1,289,700
日本調剤	190	2,697.00	512,430
コスモス薬品	800	10,920.00	8,736,000
一六堂	200	445.00	89,000
セブン&アイ・ホールディングス	64,500	4,025.00	259,612,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	200	2,900.00	580,000
ツルハホールディングス	1,500	9,320.00	13,980,000
サンマルクホールディングス	500	4,845.00	2,422,500
フェリシモ	500	975.00	487,500
トリドール	1,300	899.00	1,168,700
クスリのアオキ	200	5,640.00	1,128,000
メディカルシステムネットワーク	1,300	451.00	586,300
総合メディカル	400	3,895.00	1,558,000
はるやま商事	700	705.00	493,500
カップ・クリエイトホールディングス	1,150	1,920.00	2,208,000
ライトオン	1,200	704.00	844,800
ジーンズメイト	500	236.00	118,000
良品計画	1,600	11,140.00	17,824,000
三城ホールディングス	1,900	450.00	855,000
コナカ	2,000	857.00	1,714,000
ハウス オブ ローゼ	200	1,316.00	263,200
G - 7ホールディングス	500	744.00	372,000
イオン北海道	1,000	631.00	631,000
コジマ	2,300	271.00	623,300
ヒマラヤ	400	1,231.00	492,400
コーナン商事	2,100	1,032.00	2,167,200
エコス	600	611.00	366,600
ワタミ	1,800	1,309.00	2,356,200
マルシェ	400	800.00	320,000
ドンキホーテホールディングス	4,600	6,000.00	27,600,000
西松屋チェーン	3,100	790.00	2,449,000
ゼンショーホールディングス	5,900	1,057.00	6,236,300

幸楽苑	1,000	1,253.00	1,253,000	
ハークスレイ	400	753.00	301,200	
サイゼリヤ	2,300	1,241.00	2,854,300	
ポプラ	400	522.00	208,800	
ユナイテッドアローズ	2,000	3,730.00	7,460,000	
ハイデイ日高	800	2,035.00	1,628,000	
京都きもの友禅	1,000	1,033.00	1,033,000	
コロワイド	5,000	1,000.00	5,000,000	
壱番屋	600	3,630.00	2,178,000	
トップカルチャー	600	442.00	265,200	
P L A N T	300	919.00	275,700	
スギホールディングス	2,800	4,045.00	11,326,000	
スクロール	2,100	318.00	667,800	
ヨンドシーホールディングス	1,200	1,502.00	1,802,400	
ファミリーマート	5,200	4,675.00	24,310,000	
木曽路	1,900	1,809.00	3,437,100	
サトレストランシステムズ	1,500	680.00	1,020,000	
千趣会	2,800	880.00	2,464,000	
タカキュー	1,200	293.00	351,600	
ケーヨー	2,600	457.00	1,188,200	
上新電機	3,000	781.00	2,343,000	
日本瓦斯	2,300	1,073.00	2,467,900	
ベスト電器	5,200	148.00	769,600	
マルエツ	3,000	331.00	993,000	
ロイヤルホールディングス	2,600	1,585.00	4,121,000	
東天紅	1,000	194.00	194,000	
いなげや	1,700	968.00	1,645,600	
島忠	3,500	2,360.00	8,260,000	
チヨダ	1,800	1,910.00	3,438,000	
ライフコーポレーション	1,200	1,499.00	1,798,800	
カスミ	3,200	626.00	2,003,200	
リンガーハット	1,500	1,428.00	2,142,000	
さが美	1,000	103.00	103,000	
MrMax	1,600	317.00	507,200	
テンアライド	1,200	301.00	361,200	

A O K Iホールディングス	1,300	3,400.00	4,420,000	
オークワ	2,000	891.00	1,782,000	
コメリ	2,400	2,568.00	6,163,200	
青山商事	4,200	2,765.00	11,613,000	
しまむら	1,800	10,030.00	18,054,000	
C F Sコーポレーション	1,100	381.00	419,100	
はせがわ	600	687.00	412,200	
高島屋	21,000	1,012.00	21,252,000	
松屋	3,100	1,032.00	3,199,200	
エイチ・ツー・オー リテイリング	9,000	796.00	7,164,000	
近鉄百貨店	6,000	346.00	2,076,000	
丸栄	3,000	216.00	648,000	
ニッセンホールディングス	3,100	393.00	1,218,300	
パルコ	1,500	922.00	1,383,000	
丸井グループ	20,100	1,057.00	21,245,700	
アクシアル リテイリング	900	1,497.00	1,347,300	
ダイエー	9,700	320.00	3,104,000	
イズミヤ	6,000	445.00	2,670,000	
イオン	61,000	1,377.00	83,997,000	
ユニーグループ・ホールディングス	14,800	644.00	9,531,200	
イズミ	3,400	3,180.00	10,812,000	
東武ストア	2,000	257.00	514,000	
平和堂	3,100	1,449.00	4,491,900	
フジ	1,700	1,755.00	2,983,500	
ヤオコー	800	3,990.00	3,192,000	
ゼビオ	1,900	1,940.00	3,686,000	
ケーズホールディングス	3,300	2,960.00	9,768,000	
O l y m p i cグループ	1,000	706.00	706,000	
日産東京販売ホールディングス	2,000	428.00	856,000	
アインファーマシーズ	900	4,870.00	4,383,000	
元気寿司	500	1,330.00	665,000	
ヤマダ電機	61,200	337.00	20,624,400	
アークランドサカモト	1,000	1,697.00	1,697,000	
ニトリホールディングス	3,050	9,710.00	29,615,500	
愛眼	1,300	270.00	351,000	

吉野家ホールディングス	4,200	1,203.00	5,052,600	
松屋フーズ	700	1,673.00	1,171,100	
サガミチェーン	2,000	878.00	1,756,000	
関西スーパーマーケット	1,200	830.00	996,000	
王将フードサービス	800	3,095.00	2,476,000	
プレナス	1,700	2,239.00	3,806,300	
ミニストップ	1,200	1,590.00	1,908,000	
アークス	2,600	1,943.00	5,051,800	
バロー	3,300	1,316.00	4,342,800	
藤久	100	1,677.00	167,700	
ベルク	800	1,748.00	1,398,400	
大庄	700	1,270.00	889,000	
ファーストリテイリング	3,600	44,350.00	159,660,000	
サンドラッグ	3,200	4,545.00	14,544,000	
東京デリカ	800	1,401.00	1,120,800	
ヤマザワ	400	1,514.00	605,600	
やまや	300	1,737.00	521,100	
ベルーナ	3,900	489.00	1,907,100	
島根銀行	300	1,286.00	385,800	
じもとホールディングス	11,100	202.00	2,242,200	
新生銀行	134,000	249.00	33,366,000	
あおぞら銀行	80,000	295.00	23,600,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,168,800	654.00	764,395,200	
りそなホールディングス	146,700	513.00	75,257,100	
三井住友トラスト・ホールディングス	301,000	541.00	162,841,000	
三井住友フィナンシャルグループ	116,700	5,240.00	611,508,000	
第四銀行	20,000	344.00	6,880,000	
北越銀行	17,000	206.00	3,502,000	
西日本シティ銀行	54,000	268.00	14,472,000	
千葉銀行	60,000	686.00	41,160,000	
横浜銀行	102,000	557.00	56,814,000	
常陽銀行	57,000	514.00	29,298,000	
群馬銀行	35,000	560.00	19,600,000	
武蔵野銀行	2,500	3,370.00	8,425,000	
千葉興業銀行	3,200	739.00	2,364,800	



筑波銀行	6,400	344.00	2,201,600	
東京都民銀行	2,800	1,029.00	2,881,200	
七十七銀行	24,000	485.00	11,640,000	
青森銀行	11,000	267.00	2,937,000	
秋田銀行	11,000	273.00	3,003,000	
山形銀行	9,000	414.00	3,726,000	
岩手銀行	1,000	4,995.00	4,995,000	
東邦銀行	14,000	315.00	4,410,000	
東北銀行	8,000	147.00	1,176,000	
みちのく銀行	8,000	203.00	1,624,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	63,000	447.00	28,161,000	
静岡銀行	45,000	1,088.00	48,960,000	
十六銀行	19,000	364.00	6,916,000	
スルガ銀行	15,000	1,803.00	27,045,000	
八十二銀行	28,000	582.00	16,296,000	
山梨中央銀行	10,000	443.00	4,430,000	
大垣共立銀行	19,000	277.00	5,263,000	
福井銀行	13,000	232.00	3,016,000	
北國銀行	17,000	361.00	6,137,000	
清水銀行	500	2,759.00	1,379,500	
滋賀銀行	15,000	514.00	7,710,000	
南都銀行	15,000	381.00	5,715,000	
百五銀行	14,000	398.00	5,572,000	
京都銀行	29,000	834.00	24,186,000	
紀陽銀行	6,100	1,346.00	8,210,600	
三重銀行	6,000	212.00	1,272,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	105,000	199.00	20,895,000	
広島銀行	45,000	413.00	18,585,000	
山陰合同銀行	10,000	714.00	7,140,000	
中国銀行	11,500	1,280.00	14,720,000	
鳥取銀行	5,000	188.00	940,000	
伊予銀行	16,500	989.00	16,318,500	
百十四銀行	17,000	349.00	5,933,000	
四国銀行	11,000	231.00	2,541,000	
阿波銀行	13,000	507.00	6,591,000	

鹿児島銀行	11,000	627.00	6,897,000	
大分銀行	10,000	378.00	3,780,000	
宮崎銀行	10,000	288.00	2,880,000	
肥後銀行	13,000	546.00	7,098,000	
佐賀銀行	9,000	218.00	1,962,000	
十八銀行	10,000	233.00	2,330,000	
沖縄銀行	1,200	3,800.00	4,560,000	
琉球銀行	3,000	1,229.00	3,687,000	
八千代銀行	700	2,593.00	1,815,100	
セブン銀行	57,800	391.00	22,599,800	
みずほフィナンシャルグループ	1,997,100	211.00	421,388,100	
山口フィナンシャルグループ	15,000	927.00	13,905,000	
長野銀行	5,000	181.00	905,000	
名古屋銀行	14,000	341.00	4,774,000	
北洋銀行	23,300	412.00	9,599,600	
愛知銀行	600	4,815.00	2,889,000	
第三銀行	9,000	171.00	1,539,000	
中京銀行	6,000	178.00	1,068,000	
東日本銀行	7,000	236.00	1,652,000	
大光銀行	6,000	224.00	1,344,000	
愛媛銀行	9,000	216.00	1,944,000	
トマト銀行	6,000	174.00	1,044,000	
みなと銀行	14,000	170.00	2,380,000	
京葉銀行	13,000	487.00	6,331,000	
関西アーバン銀行	22,000	116.00	2,552,000	
栃木銀行	8,000	391.00	3,128,000	
北日本銀行	500	2,538.00	1,269,000	
東和銀行	18,000	90.00	1,620,000	
福島銀行	20,000	83.00	1,660,000	
大東銀行	10,000	110.00	1,100,000	
トモニホールディングス	11,800	388.00	4,578,400	
フィデアホールディングス	8,700	192.00	1,670,400	
池田泉州ホールディングス	11,500	469.00	5,393,500	
F P G	1,100	1,000.00	1,100,000	
S B Iホールディングス	18,600	1,464.00	27,230,400	

ジャフコ	2,100	5,540.00	11,634,000	
大和証券グループ本社	153,000	1,001.00	153,153,000	
野村ホールディングス	315,500	770.00	242,935,000	
岡三証券グループ	12,000	909.00	10,908,000	
丸三証券	4,600	857.00	3,942,200	
東洋証券	6,000	345.00	2,070,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	16,300	895.00	14,588,500	
光世証券	4,000	267.00	1,068,000	
水戸証券	5,000	472.00	2,360,000	
いちよし証券	3,000	1,561.00	4,683,000	
松井証券	7,800	1,303.00	10,163,400	
だいこう証券ビジネス	800	972.00	777,600	
マネックスグループ	16,800	421.00	7,072,800	
カブドットコム証券	6,000	559.00	3,354,000	
極東証券	1,900	1,910.00	3,629,000	
岩井コスモホールディングス	1,500	1,351.00	2,026,500	
マネーパートナーズグループ	1,200	261.00	313,200	
N K S Jホールディングス	34,300	2,887.00	99,024,100	
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	46,100	2,729.00	125,806,900	
ソニーフィナンシャルホールディングス	14,800	1,852.00	27,409,600	
第一生命保険	77,700	1,698.00	131,934,600	
東京海上ホールディングス	59,800	3,430.00	205,114,000	
T & Dホールディングス	53,000	1,412.00	74,836,000	
全国保証	1,800	4,495.00	8,091,000	
クレディセゾン	12,600	2,787.00	35,116,200	
芙蓉総合リース	1,600	3,765.00	6,024,000	
興銀リース	2,700	2,886.00	7,792,200	
東京センチュリーリース	3,600	3,250.00	11,700,000	
日本証券金融	6,900	749.00	5,168,100	
アイフル	28,300	416.00	11,772,800	
ポケットカード	1,600	789.00	1,262,400	
リコーリース	1,100	2,962.00	3,258,200	
イオンフィナンシャルサービス	9,000	2,836.00	25,524,000	
アコム	31,100	339.00	10,542,900	
ジャックス	10,000	467.00	4,670,000	

オリエントコーポレーション	34,800	232.00	8,073,600	
日立キャピタル	3,000	3,010.00	9,030,000	
アプラスフィナンシャル	5,800	140.00	812,000	
オリックス	94,500	1,780.00	168,210,000	
三菱UFJリース	39,200	624.00	24,460,800	
日本取引所グループ	22,700	2,955.00	67,078,500	
イー・ギャランティ	500	2,477.00	1,238,500	
アサックス	300	1,317.00	395,100	
NECキャピタルソリューション	500	2,856.00	1,428,000	
日本駐車場開発	168	7,510.00	1,261,680	
ヒューリック	26,000	1,487.00	38,662,000	
東京建物不動産販売	800	446.00	356,800	
三栄建築設計	500	809.00	404,500	
野村不動産ホールディングス	10,200	2,241.00	22,858,200	
プレサンスコーポレーション	300	2,858.00	857,400	
常和ホールディングス	500	2,809.00	1,404,500	
フージャースホールディングス	2,300	700.00	1,610,000	
オープンハウス	600	2,311.00	1,386,600	
東急不動産ホールディングス	34,200	947.00	32,387,400	
飯田グループホールディングス	6,800	2,124.00	14,443,200	
パーク24	8,000	1,916.00	15,328,000	
パラカ	400	738.00	295,200	
三井不動産	73,000	3,620.00	264,260,000	
三菱地所	108,000	2,989.00	322,812,000	
平和不動産	3,100	1,733.00	5,372,300	
東京建物	31,000	1,138.00	35,278,000	
ダイビル	4,500	1,172.00	5,274,000	
京阪神ビルディング	2,500	516.00	1,290,000	
住友不動産	37,000	4,965.00	183,705,000	
大京	26,000	261.00	6,786,000	
テオーシー	5,300	760.00	4,028,000	
東京楽天地	2,000	466.00	932,000	
レオパレス21	17,800	521.00	9,273,800	
フジ住宅	1,900	650.00	1,235,000	
空港施設	1,900	799.00	1,518,100	

明和地所	800	475.00	380,000	
住友不動産販売	1,100	3,015.00	3,316,500	
ゴールドクレスト	1,200	2,502.00	3,002,400	
日本エスリード	600	1,047.00	628,200	
日神不動産	2,100	375.00	787,500	
タカラレーベン	5,200	331.00	1,721,200	
サンヨーハウジング名古屋	800	1,117.00	893,600	
イオンモール	10,000	2,730.00	27,300,000	
ファースト住建	400	1,394.00	557,600	
トーセイ	2,200	763.00	1,678,600	
穴吹興産	1,000	289.00	289,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	9,600	1,126.00	10,809,600	
サンフロンティア不動産	1,500	1,480.00	2,220,000	
エフ・ジェー・ネクスト	600	518.00	310,800	
ランドビジネス	1,100	428.00	470,800	
グランディハウス	800	329.00	263,200	
日本空港ビルデング	5,300	2,269.00	12,025,700	
日本工営	5,000	392.00	1,960,000	
ネクスト	500	2,790.00	1,395,000	
日本M&Aセンター	800	6,720.00	5,376,000	
ノバレーゼ	400	767.00	306,800	
アコーディア・ゴルフ	6,700	1,248.00	8,361,600	
タケエイ	1,200	1,222.00	1,466,400	
パソナグループ	1,700	708.00	1,203,600	
リンクアンドモチベーション	22	17,120.00	376,640	
G C A サヴィアン	1,000	925.00	925,000	
エス・エム・エス	900	2,149.00	1,934,100	
テンプホールディングス	3,600	2,727.00	9,817,200	
リニカル	300	1,088.00	326,400	
クックパッド	1,000	3,190.00	3,190,000	
エスクリ	600	900.00	540,000	
アイ・ケイ・ケイ	400	717.00	286,800	
学情	600	988.00	592,800	
スタジオアリス	700	1,407.00	984,900	
シミックホールディングス	700	1,244.00	870,800	

NECフィールドディング	1,300	1,134.00	1,474,200
総合警備保障	6,000	2,010.00	12,060,000
カカクコム	9,900	1,833.00	18,146,700
ルネサンス	700	741.00	518,700
オプト	700	962.00	673,400
ツクイ	1,800	953.00	1,715,400
総合臨床ホールディングス	500	521.00	260,500
キャリアデザインセンター	4	100,000.00	400,000
エムスリー	54	256,800.00	13,867,200
ベストプライダル	1,000	660.00	660,000
アウトソーシング	600	1,115.00	669,000
ディー・エヌ・エー	8,800	2,124.00	18,691,200
博報堂DYホールディングス	22,600	799.00	18,057,400
ぐるなび	1,100	3,150.00	3,465,000
一休	12	146,100.00	1,753,200
ジャパンベストレスキューシステム	11	63,700.00	700,700
ジェイコムホールディングス	300	755.00	226,500
PGMホールディングス	2,300	994.00	2,286,200
バリューコマース	1,000	1,283.00	1,283,000
J Pホールディングス	2,800	381.00	1,066,800
イーピーエス	18	125,800.00	2,264,400
アミューズ	500	1,905.00	952,500
ドリームインキュベータ	5	160,300.00	801,500
TAC	1,000	344.00	344,000
ケネディクス	19,400	503.00	9,758,200
電通	15,400	4,190.00	64,526,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	2,171.00	1,302,600
ぴあ	500	1,698.00	849,000
イオンファンタジー	500	1,539.00	769,500
みらかホールディングス	4,300	4,755.00	20,446,500
アルプス技研	700	1,064.00	744,800
サニックス	2,400	858.00	2,059,200
ダイオーズ	300	765.00	229,500
日本空調サービス	400	1,068.00	427,200
オリエンタルランド	4,400	14,680.00	64,592,000

ダスキン	4,400	1,910.00	8,404,000
明光ネットワークジャパン	1,600	1,071.00	1,713,600
ファルコSDホールディングス	800	1,207.00	965,600
秀英予備校	300	326.00	97,800
田谷	300	761.00	228,300
ラウンドワン	4,700	832.00	3,910,400
リゾートトラスト	2,800	3,650.00	10,220,000
ピー・エム・エル	1,100	3,385.00	3,723,500
ワタベウェディング	600	634.00	380,400
もしもしホットライン	3,100	1,062.00	3,292,200
リソー教育	1,900	507.00	963,300
早稲田アカデミー	200	775.00	155,000
ユー・エス・エス	19,800	1,377.00	27,264,600
東京個別指導学院	800	225.00	180,000
テー・オー・ダブリュー	600	622.00	373,200
セントラルスポーツ	500	1,432.00	716,000
リゾートソリューション	2,000	233.00	466,000
リブセンス	400	4,705.00	1,882,000
ジャパンマテリアル	100	1,984.00	198,400
E R Iホールディングス	300	1,143.00	342,900
リロ・ホールディング	600	4,875.00	2,925,000
エイチ・アイ・エス	1,300	5,150.00	6,695,000
共立メンテナンス	800	3,585.00	2,868,000
イチネンホールディングス	1,800	733.00	1,319,400
建設技術研究所	1,000	972.00	972,000
スペース	800	894.00	715,200
燦ホールディングス	300	1,359.00	407,700
スバル興業	1,000	374.00	374,000
東京テアトル	7,000	147.00	1,029,000
よみうりランド	3,000	727.00	2,181,000
東京都競馬	13,000	388.00	5,044,000
常磐興産	5,000	157.00	785,000
カナモト	2,000	2,544.00	5,088,000
東京ドーム	12,000	675.00	8,100,000
西尾レントオール	900	2,583.00	2,324,700

トランス・コスモス	2,100	1,850.00	3,885,000	
乃村工藝社	3,000	831.00	2,493,000	
藤田観光	4,000	383.00	1,532,000	
KNT - CTホールディングス	6,000	162.00	972,000	
日本管財	700	1,875.00	1,312,500	
トーカイ	700	2,818.00	1,972,600	
白洋舎	2,000	246.00	492,000	
セコム	17,000	6,210.00	105,570,000	
セントラル警備保障	800	926.00	740,800	
丹青社	2,000	691.00	1,382,000	
メイテック	2,200	2,800.00	6,160,000	
アサツー ディ・ケイ	2,900	2,635.00	7,641,500	
応用地質	1,600	1,533.00	2,452,800	
船井総合研究所	1,700	840.00	1,428,000	
進学会	700	408.00	285,600	
ベネッセホールディングス	5,500	3,945.00	21,697,500	
イオンディライト	1,600	1,953.00	3,124,800	
ナック	800	1,532.00	1,225,600	
ニチイ学館	3,600	798.00	2,872,800	
ダイセキ	2,400	1,947.00	4,672,800	
ステップ	400	775.00	310,000	
合 計	25,034,846		27,805,447,580	

## (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。



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

## 貸借対照表

（単位：円）

	平成25年 6月25日現在	平成25年12月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	421,839,603	1,873,808,412
コール・ローン	930,833,664	370,301,288
株式	68,298,956,598	76,161,355,566
投資証券	1,535,998,383	1,532,235,620
派生商品評価勘定	-	31,398,775
未収入金	415,955	25,803,136
未収配当金	144,766,505	85,753,834
未収利息	1,518	574
差入委託証拠金	255,714,930	319,890,162
流動資産合計	71,588,527,156	80,400,547,367
<b>資産合計</b>		
71,588,527,156		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	92,871,619	3,003,854
未払金	1,455,573	-
未払解約金	56,793,667	794,182,296
流動負債合計	151,120,859	797,186,150
<b>負債合計</b>		
151,120,859		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	56,451,798,976	49,496,786,303
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	14,985,607,321	30,106,574,914
元本等合計	71,437,406,297	79,603,361,217
<b>純資産合計</b>		
71,437,406,297		
<b>負債純資産合計</b>		
71,588,527,156		

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>（1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>（2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>（3）時価が入手できなかった有価証券</p>
--------------------	---

	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25年 6月25日現在	平成25年12月25日現在
1.	期首	平成24年12月26日	平成25年 6月26日
	期首元本額	64,774,606,893円	56,451,798,976円
	期首からの追加設定元本額	1,080,394,859円	728,249,112円
	期首からの一部解約元本額	9,403,202,776円	7,683,261,785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）	14,015,990,522円	13,831,820,968円
	DCインデックスバランス（株式20）	40,344,427円	35,539,219円
	DCインデックスバランス（株式40）	146,830,593円	139,198,481円
	DCインデックスバランス（株式60）	276,008,402円	262,244,308円
	DCインデックスバランス（株式80）	330,860,604円	319,737,168円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	7,299,297,712円	5,733,026,055円
	日興五大陸株式ファンド	14,550,520,920円	11,892,406,183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	61,432,073円	42,691,029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）	24,350,039円	24,095,247円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	14,918,580円	10,802,554円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	12,155,563円	8,817,235円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	19,072,185円	13,901,745円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	23,329,805円	17,005,681円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	12,096,253,987円	10,517,168,635円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	15,659,094円	14,265,412円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	35,136,052円	32,863,290円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	97,782,987円	96,272,995円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	137,824,946円	132,673,062円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	143,039,476円	134,307,522円
	年金積立 インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	7,110,991,009円	6,237,949,514円
	計	56,451,798,976円	49,496,786,303円
2.	受益権の総数	56,451,798,976口	49,496,786,303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）

## 金融商品の状況に関する事項

	自 平成24年12月26日 至 平成25年 6月25日	自 平成25年 6月26日 至 平成25年12月25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

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 6月25日現在	平成25年12月25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ぬ。	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25年 6月25日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	4,994,178,846
投資証券	12,120,158
合計	4,982,058,688

（平成25年12月25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	2,047,054,918
投資証券	114,115,768
合計	1,932,939,150

（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25年 6月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,648,055,856	-	1,576,336,107	71,719,749

合計	1,648,055,856	-	1,576,336,107	71,719,749
----	---------------	---	---------------	------------

(平成25年12月25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	1,495,441,490	-	1,524,504,415	29,062,925
合計		1,495,441,490	-	1,524,504,415	29,062,925

(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25年 6月25日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,046,935,660	-	1,025,783,790	21,151,870
	米ドル	697,922,588	-	681,725,240	16,197,348
	ユーロ	349,013,072	-	344,058,550	4,954,522
合計		1,046,935,660	-	1,025,783,790	21,151,870

(平成25年12月25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	778,708,030	-	780,986,280	2,278,250
	米ドル	569,385,625	-	571,470,180	2,084,555
	ユーロ	209,322,405	-	209,516,100	193,695
	売建	1,567,503,046	-	1,570,449,300	2,946,254
	米ドル	761,536,000	-	761,682,000	146,000
	加ドル	94,177,300	-	95,506,200	1,328,900
	ユーロ	313,475,300	-	313,588,000	112,700
	英ポンド	177,197,280	-	177,382,400	185,120
	スイスフラン	68,622,900	-	68,711,400	88,500
	スウェーデンクローナ	22,919,135	-	22,997,000	77,865
	豪ドル	72,538,116	-	73,525,300	987,184
	香港ドル	28,239,540	-	28,245,000	5,460
	シンガポールドル	28,797,475	-	28,812,000	14,525
合計		2,346,211,076	-	2,351,435,580	668,004

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	平成25年 6月25日現在		平成25年12月25日現在
1口当たり純資産額	1.2655円	1口当たり純資産額	1.6083円
(1万口当たり純資産額)	(12,655円)	(1万口当たり純資産額)	(16,083円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	12,933	78.40	1,013,947.20	
	APACHE CORP	10,264	86.21	884,859.44	
	BAKER HUGHES INC	11,055	54.00	596,970.00	
	CABOT OIL & GAS CORP	11,240	38.93	437,573.20	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	6,471	59.13	382,630.23	
	CHENIERE ENERGY INC	5,580	44.15	246,357.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	13,880	27.61	383,226.80	
	CHEVRON CORP	49,961	123.51	6,170,683.11	
	CIMAREX ENERGY CO	2,535	103.45	262,245.75	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	8,000	16.25	130,000.00	
	CONCHO RESOURCES INC	2,935	106.57	312,782.95	
	CONOCOPHILLIPS	30,120	69.93	2,106,291.60	
	CONSOL ENERGY INC	5,288	37.86	200,203.68	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	980	111.66	109,426.80	
	CORE LABORATORIES N.V.	1,240	189.84	235,401.60	
	DENBURY RESOURCES INC	10,745	16.39	176,110.55	
	DEVON ENERGY CORPORATION	9,751	61.26	597,346.26	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	1,525	56.11	85,567.75	
	ENERGEN CORP	2,310	68.56	158,373.60	
	ENSCO PLC-CL A	5,990	56.08	335,919.20	
	EOG RESOURCES INC	7,046	168.26	1,185,559.96	
	EQT CORP	3,735	90.32	337,345.20	
	EXXON MOBIL CORP	113,771	99.22	11,288,358.62	
	FMC TECHNOLOGIES INC	5,645	52.21	294,725.45	
HALLIBURTON CO	21,377	50.68	1,083,386.36		
HELMERICH & PAYNE	2,800	83.03	232,484.00		
HESS CORP	8,000	81.14	649,120.00		

HOLLYFRONTIER CORP	5,590	49.34	275,810.60
KINDER MORGAN INC	18,310	35.51	650,188.10
MARATHON OIL CORP	17,977	35.25	633,689.25
MARATHON PETROLEUM CORP	7,906	89.35	706,401.10
MURPHY OIL CORP	4,295	63.72	273,677.40
NABORS INDUSTRIES LTD	7,671	16.48	126,418.08
NATIONAL OILWELL VARCO INC	10,771	78.53	845,846.63
NOBLE CORP PLC	5,872	36.70	215,502.40
NOBLE ENERGY INC	9,192	67.92	624,320.64
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	20,731	93.48	1,937,933.88
OCEANEERING INTL INC	3,070	78.52	241,056.40
PEABODY ENERGY CORP	7,060	18.53	130,821.80
PHILLIPS 66	15,275	74.74	1,141,653.50
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,600	183.84	661,824.00
QEP RESOURCES INC	4,290	30.97	132,861.30
RANGE RESOURCES CORP	4,430	83.43	369,594.90
ROWAN COMPANIES PLC	3,300	34.36	113,388.00
SCHLUMBERGER LTD	34,109	88.31	3,012,165.79
SOUTHWESTERN ENERGY CO	9,595	40.18	385,527.10
SPECTRA ENERGY CORP	16,934	34.47	583,714.98
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	3,820	25.79	98,517.80
TESORO CORP	3,820	58.21	222,362.20
VALERO ENERGY CORP	13,772	48.63	669,732.36
WEATHERFORD INTL LTD	21,119	15.24	321,853.56
WHITING PETROLEUM CORP	3,275	60.73	198,890.75
WILLIAMS COS INC	16,994	37.70	640,673.80
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	5,675	112.79	640,083.25
AIRGAS INC	1,430	110.85	158,515.50
ALBEMARLE CORP	1,630	62.66	102,135.80
ALCOA INC	30,889	10.36	320,010.04
ASHLAND INC	2,050	96.62	198,071.00
AVERY DENNISON CORP	2,260	49.89	112,751.40
BALL CORP	4,113	51.17	210,462.21
CELANESE CORP-SERIES A	4,510	55.01	248,095.10
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1,470	231.62	340,481.40



CROWN HOLDINGS INC	4,035	43.79	176,692.65
DOW CHEMICAL	31,093	44.42	1,381,151.06
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	23,738	63.83	1,515,196.54
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,705	78.22	289,805.10
ECOLAB INC	7,350	104.93	771,235.50
FMC CORP	3,270	74.46	243,484.20
FREEMONT-MCMORAN COPPER	26,828	36.30	973,856.40
INTERNATIONAL PAPER CO	10,390	49.12	510,356.80
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,494	86.07	214,658.58
LYONDELLBASELL INDU-CL A	11,380	79.17	900,954.60
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,445	97.23	140,497.35
MEADWESTVACO CORP	4,879	36.64	178,766.56
MONSANTO CO	13,711	114.93	1,575,805.23
MOSAIC CO/THE	7,850	46.69	366,516.50
NEWMONT MINING CORP	13,420	23.15	310,673.00
NUCOR CORP	8,419	53.32	448,901.08
OWENS-ILLINOIS INC	4,955	35.38	175,307.90
PPG INDUSTRIES INC	3,577	187.58	670,973.66
PRAXAIR INC	7,710	128.97	994,358.70
ROCK-TENN COMPANY-CL A	1,830	104.12	190,539.60
SEALED AIR CORP	4,356	33.99	148,060.44
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,167	182.69	395,889.23
SIGMA-ALDRICH	2,705	92.19	249,373.95
VULCAN MATERIALS CO	3,643	57.99	211,257.57
3M CO	16,826	136.99	2,304,993.74
AGCO CORP	2,710	58.68	159,022.80
AMETEK INC	6,343	52.55	333,324.65
B/E AEROSPACE INC	2,570	86.22	221,585.40
BOEING CO	18,532	136.83	2,535,733.56
CATERPILLAR INC	16,646	90.91	1,513,287.86
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	2,410	81.68	196,848.80
CUMMINS INC	4,535	139.40	632,179.00
DANAHER CORP	15,259	76.79	1,171,738.61
DEERE & CO	9,170	90.86	833,186.20
DOVER CORP	4,520	95.48	431,569.60

EATON CORP PLC	12,246	75.73	927,389.58
EMERSON ELECTRIC CO	18,350	69.76	1,280,096.00
FASTENAL CO	7,453	46.30	345,073.90
FLOWSERVE CORP	3,325	76.53	254,462.25
FLUOR CORP	4,223	79.27	334,757.21
GENERAL DYNAMICS CORP	7,672	93.77	719,403.44
GENERAL ELECTRIC CO.	263,323	27.61	7,270,348.03
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	19,296	90.45	1,745,323.20
ILLINOIS TOOL WORKS	10,780	83.34	898,405.20
INGERSOLL-RAND PLC	8,006	60.86	487,245.16
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3,330	61.47	204,695.10
JOY GLOBAL INC	3,005	56.36	169,361.80
KBR INC	4,120	30.19	124,382.80
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	2,591	106.73	276,537.43
LOCKHEED MARTIN CORP	7,071	146.14	1,033,355.94
MASCO CORP	10,699	22.61	241,904.39
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,734	114.22	654,937.48
PACCAR INC	9,454	58.14	549,655.56
PALL CORP	2,596	85.21	221,205.16
PARKER HANNIFIN CORP	3,920	127.21	498,663.20
PENTAIR LTD-REGISTERED	5,148	76.55	394,079.40
PRECISION CASTPARTS CORP	3,740	270.98	1,013,465.20
QUANTA SERVICES INC	6,025	31.16	187,739.00
RAYTHEON COMPANY	8,342	89.60	747,443.20
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,723	117.10	435,963.30
ROCKWELL COLLINS INC.	3,315	73.73	244,414.95
ROPER INDUSTRIES INC	2,710	137.00	371,270.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,100	38.50	119,350.00
SPX CORP	887	98.18	87,085.66
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,776	80.65	304,534.40
TEXTRON INC	6,606	36.00	237,816.00
TRANSDIGM GROUP INC	1,460	159.97	233,556.20
UNITED TECHNOLOGIES CORP	22,555	111.47	2,514,205.85
WW GRAINGER INC	1,577	254.33	401,078.41
XYLEM INC	4,368	34.33	149,953.44

ADT CORP/THE	4,917	40.16	197,466.72
CINTAS CORP	2,037	59.27	120,732.99
DUN & BRADSTREET CORP	1,162	122.90	142,809.80
EQUIFAX INC	3,584	69.00	247,296.00
IHS INC-CLASS A	1,710	117.68	201,232.80
IRON MOUNTAIN INC	3,064	30.55	93,605.20
MANPOWERGROUP INC	1,937	86.17	166,911.29
NIELSEN HOLDINGS NV	5,645	45.64	257,637.80
REPUBLIC SERVICES INC	7,000	33.69	235,830.00
ROBERT HALF INTL INC	3,425	41.98	143,781.50
STERICYCLE INC	2,285	115.54	264,008.90
TOWERS WATSON & CO-CL-A	1,630	126.52	206,227.60
TYCO INTERNATIONAL LTD	12,505	40.25	503,326.25
VERISK ANALYTICS INC	4,000	65.97	263,880.00
WASTE MANAGEMENT INC	12,204	44.92	548,203.68
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,410	57.04	251,546.40
CSX CORP	27,163	28.36	770,342.68
DELTA AIR LINES INC	5,335	27.84	148,526.40
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,747	43.47	206,352.09
FEDEX CORP	7,578	142.00	1,076,076.00
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	9,780	26.01	254,377.80
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,310	77.27	178,493.70
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	158,000	0.65	103,490.00
KANSAS CITY SOUTHERN	2,910	123.09	358,191.90
NORFOLK SOUTHERN CORP	8,130	92.20	749,586.00
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,190	18.93	79,316.70
UNION PACIFIC CORP	11,938	165.64	1,977,410.32
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	2,495	37.60	93,812.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	18,567	104.46	1,939,508.82
AUTOLIV INC	2,610	90.99	237,483.90
BORGWARNER INC	6,430	55.85	359,115.50
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	7,980	59.99	478,720.20
FORD MOTOR COMPANY	94,295	15.19	1,432,341.05
GENERAL MOTORS CORP	24,385	40.88	996,858.80
HARLEY-DAVIDSON INC	5,619	69.22	388,947.18

JOHNSON CONTROLS INC	17,938	51.03	915,376.14
TESLA MOTORS INC	2,200	151.41	333,102.00
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	2,955	74.75	220,886.25
COACH INC	7,636	56.43	430,899.48
DR HORTON INC	6,906	21.29	147,028.74
FOSSIL GROUP INC	1,165	120.02	139,823.30
GARMIN LTD	3,575	46.20	165,165.00
HASBRO INC	3,368	53.45	180,019.60
LEGGETT & PLATT INC	4,468	30.97	138,373.96
LENNAR CORP-CL A	3,660	38.97	142,630.20
LULULEMON ATHLETICA INC	2,790	58.98	164,554.20
MATTEL INC	8,499	45.79	389,169.21
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	5,100	81.40	415,140.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,738	146.36	254,373.68
NEWELL RUBBERMAID INC	8,160	32.11	262,017.60
NIKE INC -CL B	18,304	77.66	1,421,488.64
POLARIS INDUSTRIES INC	1,580	142.96	225,876.80
PULTE GROUP INC	9,270	19.73	182,897.10
PVH CORP	2,030	134.44	272,913.20
RALPH LAUREN CORP	1,365	176.03	240,280.95
TOLL BROTHERS INC	4,501	36.66	165,006.66
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	2,140	86.25	184,575.00
VF CORP	2,265	61.20	138,618.00
VF CORP(N)	6,795	61.20	415,854.00
WHIRLPOOL CORP	2,144	156.94	336,479.36
CARNIVAL CORP	10,117	39.44	399,014.48
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	825	533.11	439,815.75
DARDEN RESTAURANTS INC	2,853	54.01	154,090.53
H&R BLOCK INC	7,080	28.74	203,479.20
INTL GAME TECHNOLOGY	7,626	17.81	135,819.06
LAS VEGAS SANDS CORP	11,040	77.65	857,256.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	6,406	48.67	311,780.02
MCDONALD'S CORP	25,781	96.54	2,488,897.74
MGM RESORTS INTERNATIONAL	9,790	23.08	225,953.20
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,538	47.44	167,842.72

STARBUCKS CORP	19,312	78.57	1,517,343.84
STARWOOD HOTELS & RESORTS	5,037	79.16	398,728.92
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,980	72.71	216,675.80
WYNN RESORTS LTD	2,000	189.25	378,500.00
YUM! BRANDS INC	11,654	74.10	863,561.40
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	5,725	17.71	101,389.75
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	14,908	61.66	919,227.28
CHARTER COMMUNICATION-A	1,400	132.27	185,178.00
COMCAST CORP-CLASS A	54,856	51.28	2,813,015.68
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	12,881	49.24	634,260.44
DIRECTV	13,214	67.47	891,548.58
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,930	88.87	349,259.10
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	2,635	81.85	215,674.75
DISH NETWORK CORP-A	6,029	57.25	345,160.25
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	11,796	17.19	202,773.24
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,355	87.42	468,134.10
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	4,673	82.49	385,475.77
LIBERTY MEDIA CORP	2,465	145.37	358,337.05
NEWS CORP - CLASS A	11,240	17.90	201,196.00
OMNICOM GROUP	6,427	71.83	461,651.41
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	2,320	84.24	195,436.80
SIRIUS XM HOLDINGS INC	80,330	3.60	289,188.00
THE WALT DISNEY CO.	43,913	73.85	3,242,975.05
TIME WARNER CABLE	7,317	134.04	980,770.68
TIME WARNER INC	23,768	69.40	1,649,499.20
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	11,909	34.14	406,573.26
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	38,942	34.79	1,354,792.18
VIACOM INC-CLASS B	11,068	85.60	947,420.80
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,088	110.28	230,264.64
AMAZON.COM INC	9,425	399.20	3,762,460.00
AUTOZONE INC	972	475.57	462,254.04
BED BATH & BEYOND INC	5,282	78.65	415,429.30
BEST BUY CO INC	6,504	40.22	261,590.88
CARMAX INC	5,869	47.60	279,364.40
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,770	57.55	159,413.50

DOLLAR GENERAL CORP/OLD	7,780	61.47	478,236.60
DOLLAR TREE INC	5,264	56.40	296,889.60
EXPEDIA INC	2,232	68.50	152,892.00
FAMILY DOLLAR STORES	2,623	65.55	171,937.65
GAMESTOP CORP-CLASS A	3,440	50.97	175,336.80
GAP INC/THE	8,356	38.61	322,625.16
GENUINE PARTS CO	4,011	82.74	331,870.14
HOME DEPOT INC	36,910	80.64	2,976,422.40
KOHL'S CORP	5,202	55.82	290,375.64
L BRANDS INC	6,408	61.25	392,490.00
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	11,400	29.12	331,968.00
LKQ CORP	6,990	33.36	233,186.40
LOWE'S COS INC	27,012	48.70	1,315,484.40
MACY'S INC	10,109	52.71	532,845.39
NETFLIX INC	1,390	378.39	525,962.10
NORDSTROM INC	3,690	61.60	227,304.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,905	129.21	375,355.05
PETSMART INC	2,240	73.30	164,192.00
PRICELINE.COM INC	1,325	1,179.90	1,563,367.50
ROSS STORES INC	5,586	73.99	413,308.14
STAPLES INC	17,384	15.91	276,579.44
TARGET CORP	15,390	61.71	949,716.90
TIFFANY & CO	3,360	91.03	305,860.80
TJX COMPANIES INC	18,363	63.03	1,157,419.89
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,600	76.08	273,888.00
TRIPADVISOR INC	3,220	82.82	266,680.40
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	1,770	94.42	167,123.40
URBAN OUTFITTERS INC	3,320	36.76	122,043.20
COSTCO WHOLESALE CORP	11,199	118.69	1,329,209.31
CVS CAREMARK CORP	31,507	70.98	2,236,366.86
KROGER CO	13,275	39.89	529,539.75
SAFEWAY INC	7,013	32.67	229,114.71
SYSCO CORP	14,886	36.47	542,892.42
WAL-MART STORES INC	42,282	78.01	3,298,418.82
WALGREEN CO	23,062	57.61	1,328,601.82

WHOLE FOODS MARKET INC	9,570	57.99	554,964.30
ALTRIA GROUP INC	51,748	38.08	1,970,563.84
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	17,063	43.27	738,316.01
BEAM INC	3,396	67.08	227,803.68
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,517	75.06	263,986.02
BUNGE LTD	3,647	82.67	301,497.49
CAMPBELL SOUP CO	5,715	42.83	244,773.45
COCA-COLA CO/THE	103,242	40.19	4,149,295.98
COCA-COLA ENTERPRISES	6,670	43.41	289,544.70
CONAGRA FOODS INC	11,730	33.49	392,837.70
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,990	69.71	278,142.90
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	5,129	48.50	248,756.50
GENERAL MILLS INC	16,229	49.28	799,765.12
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	3,185	74.84	238,365.40
HERSHEY CO/THE	4,165	95.95	399,631.75
HORMEL FOODS CORP	3,770	44.86	169,122.20
JM SMUCKER CO/THE	2,680	102.36	274,324.80
KELLOGG CO	6,618	60.25	398,734.50
KRAFT FOODS GROUP INC	15,611	53.32	832,378.52
LORILLARD INC	9,250	50.30	465,275.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,365	68.68	231,108.20
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	5,141	83.33	428,399.53
MOLSON COORS BREWING CO -B	4,240	55.04	233,369.60
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	43,435	34.72	1,508,063.20
MONSTER BEVERAGE CORP	3,710	67.36	249,905.60
PEPSICO INC	39,921	82.04	3,275,118.84
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	41,778	85.43	3,569,094.54
REYNOLDS AMERICAN INC	9,080	49.23	447,008.40
TYSON FOODS INC-CL A	7,806	33.44	261,032.64
AVON PRODUCTS	10,013	17.24	172,624.12
CHURCH & DWIGHT CO INC	3,255	66.37	216,034.35
CLOROX COMPANY	3,246	92.66	300,774.36
COLGATE-PALMOLIVE CO	23,850	64.71	1,543,333.50
ENERGIZER HOLDINGS INC	1,571	107.12	168,285.52
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	5,740	74.62	428,318.80

HERBALIFE LTD	2,430	78.55	190,876.50
KIMBERLY-CLARK CORP	9,783	104.79	1,025,160.57
PROCTER & GAMBLE CO	70,709	81.31	5,749,348.79
ABBOTT LABORATORIES	39,947	38.19	1,525,575.93
AETNA INC	9,759	67.37	657,463.83
AMERISOURCEBERGEN CORP	6,314	70.14	442,863.96
BAXTER INTERNATIONAL INC	14,069	69.06	971,605.14
BECTON DICKINSON AND CO	4,946	109.68	542,477.28
BOSTON SCIENTIFIC CORP	36,958	11.99	443,126.42
CARDINAL HEALTH INC	9,165	67.12	615,154.80
CAREFUSION CORP	6,075	39.80	241,785.00
CERNER CORP	8,430	55.38	466,853.40
CIGNA CORP	7,300	86.17	629,041.00
COVIDIEN PLC	11,605	67.53	783,685.65
CR BARD INC	1,854	133.29	247,119.66
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	4,638	63.25	293,353.50
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	2,972	48.74	144,855.28
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	3,050	65.62	200,141.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	20,924	69.52	1,454,636.48
HCA HOLDINGS INC	8,215	46.53	382,243.95
HENRY SCHEIN INC	2,170	114.23	247,879.10
HOLOGIC INC	5,928	22.57	133,794.96
HUMANA INC	4,105	103.26	423,882.30
INTUITIVE SURGICAL INC	1,090	370.96	404,346.40
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,155	91.03	196,169.65
MCKESSON CORP	5,834	160.27	935,015.18
MEDTRONIC INC	25,952	57.37	1,488,866.24
OMNICARE INC	2,710	60.31	163,440.10
PATTERSON COS INC	2,042	40.89	83,497.38
QUEST DIAGNOSTICS	3,656	54.50	199,252.00
RESMED INC	3,370	46.95	158,221.50
ST JUDE MEDICAL INC	7,400	62.51	462,574.00
STRYKER CORP	7,533	75.00	564,975.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	26,250	74.13	1,945,912.50
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,250	80.53	181,192.50



VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,474	76.73	189,830.02
WELLPOINT INC	7,766	91.39	709,734.74
ZIMMER HOLDINGS INC	4,122	93.10	383,758.20
ABBVIE INC	40,817	52.36	2,137,178.12
ACTAVIS PLC	4,655	164.90	767,609.50
AGILENT TECHNOLOGIES INC	8,010	57.23	458,412.30
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	5,210	131.06	682,822.60
ALLERGAN INC	7,785	108.62	845,606.70
AMGEN INC	19,471	112.25	2,185,619.75
BIOGEN IDEC INC	6,113	280.65	1,715,613.45
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,500	69.20	242,200.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	42,451	53.20	2,258,393.20
CELGENE CORP	10,592	167.42	1,773,312.64
ELI LILLY & CO	26,043	50.74	1,321,421.82
FOREST LABORATORIES INC	6,145	58.60	360,097.00
GILEAD SCIENCES INC	39,504	74.96	2,961,219.84
HOSPIRA INC	3,921	41.29	161,898.09
ILLUMINA INC	3,195	108.12	345,443.40
JOHNSON & JOHNSON	72,821	92.06	6,703,901.26
LIFE TECHNOLOGIES CORP	4,476	75.78	339,191.28
MERCK & CO. INC.	75,553	49.41	3,733,073.73
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	740	242.85	179,709.00
MYLAN INC	9,655	42.56	410,965.07
PERRIGO CO PLC	2,200	151.60	333,520.00
PERRIGO CO PLC(N)	839	151.60	127,192.40
PFIZER INC	171,060	30.29	5,181,407.40
PHARMACYCLICS INC	1,550	107.74	166,997.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,040	275.69	562,407.60
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	9,054	109.41	990,598.14
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	6,430	73.49	472,540.70
WATERS CORP	2,276	99.60	226,689.60
ZOETIS INC	12,480	32.37	403,977.60
BB&T CORP	17,778	37.24	662,052.72
CIT GROUP INC	4,465	51.49	229,902.85
COMERICA INC	5,130	47.37	243,008.10

FIFTH THIRD BANCORP	23,509	20.98	493,218.82
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,330	52.50	122,325.00
HUDSON CITY BANCORP INC	14,060	9.34	131,320.40
KEYCORP	26,168	13.45	351,959.60
M & T BANK CORP	2,953	115.74	341,780.22
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	9,654	16.69	161,125.26
OCWEN FINANCIAL CORP	2,820	54.89	154,789.80
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	6,370	14.98	95,422.60
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	14,080	77.13	1,085,990.40
REGIONS FINANCIAL CORP	37,184	9.85	366,262.40
SUNTRUST BANKS INC	14,207	36.77	522,391.39
US BANCORP	47,781	40.60	1,939,908.60
WELLS FARGO & CO	130,470	45.39	5,922,033.30
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,540	214.01	329,575.40
AMERICAN EXPRESS CO	25,204	88.69	2,235,342.76
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,250	112.88	592,620.00
BANK OF AMERICA CORPORATION	277,029	15.70	4,349,355.30
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	29,432	34.41	1,012,755.12
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	28,720	117.43	3,372,589.60
BLACKROCK INC	3,465	316.20	1,095,633.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	15,575	75.38	1,174,043.50
CITIGROUP INC	78,407	52.43	4,110,879.01
CME GROUP INC	8,410	80.03	673,052.30
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	12,760	54.36	693,633.60
EATON VANCE CORP	3,790	43.24	163,879.60
FRANKLIN RESOURCES INC	10,445	56.73	592,544.85
GOLDMAN SACHS GROUP INC	10,978	176.16	1,933,884.48
INTERCONTINENTALEXCHANGE GRO	2,996	226.01	677,125.96
INVESCO LTD	11,767	36.43	428,671.81
JPMORGAN CHASE & CO	97,260	58.25	5,665,395.00
LEGG MASON INC	2,185	43.88	95,877.80
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	28.24	206,293.20
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	7,142	76.74	548,077.08
MOODY'S CORP	5,337	77.42	413,190.54
MORGAN STANLEY	37,715	31.01	1,169,542.15

NASDAQ OMX GROUP/THE	3,055	39.91	121,925.05
NORTHERN TRUST CORP	6,410	61.30	392,933.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,380	51.81	175,117.80
SCHWAB (CHARLES) CORP	30,634	25.71	787,600.14
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,325	34.77	150,380.25
SLM CORP	12,552	26.05	326,979.60
STATE STREET CORP	11,917	72.23	860,764.91
T ROWE PRICE GROUP INC	6,755	83.37	563,164.35
TD AMERITRADE HOLDING CORP	5,050	30.44	153,722.00
ACE LTD	8,893	102.07	907,708.51
AFLAC INC	11,722	66.48	779,278.56
ALLEGHANY CORP	400	398.50	159,400.00
ALLSTATE CORP	12,243	53.97	660,754.71
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	36,085	51.28	1,850,438.80
AON PLC	7,837	83.62	655,329.94
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,985	58.61	233,560.85
ASSURANT INC	1,530	66.25	101,362.50
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,995	47.06	140,944.70
CHUBB CORP	6,873	95.22	654,447.06
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,940	52.22	205,746.80
EVEREST RE GROUP LTD	1,014	153.45	155,598.30
FIDELITY NATIONAL FINL-A	5,881	32.94	193,720.14
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	11,832	36.62	433,287.84
LINCOLN NATIONAL CORP	6,703	51.83	347,416.49
LOEWS CORP	8,005	48.00	384,240.00
MARSH & MCLENNAN COS	14,633	48.29	706,627.57
METLIFE INC	23,935	53.67	1,284,591.45
PARTNERRE LTD	1,052	102.37	107,693.24
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	7,970	49.40	393,718.00
PROGRESSIVE CORP	15,290	26.93	411,759.70
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	12,162	91.91	1,117,809.42
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	887	92.26	81,834.62
TORCHMARK CORP	2,071	78.27	162,097.17
TRAVELERS COS INC/THE	9,414	89.49	842,458.86
UNUM GROUP	6,098	34.86	212,576.28

WILLIS GROUP HOLDING	4,510	44.96	202,769.60
MR BERKLEY CORP	2,573	42.97	110,561.81
XL GROUP PLC	8,070	31.54	254,527.80
CBRE GROUP INC	6,610	26.20	173,182.00
REALOGY HOLDINGS CORP	3,160	49.38	156,040.80
ACCENTURE PLC-CL A	16,558	81.31	1,346,330.98
ACTIVISION BLIZZARD INC	13,350	18.17	242,569.50
ADOBE SYSTEMS INC	11,959	59.53	711,919.27
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	5,140	47.73	245,332.20
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,275	254.22	324,130.50
ANSYS INC	2,090	87.29	182,436.10
AUTODESK INC	6,280	49.70	312,116.00
AUTOMATIC DATA PROCESSING	12,416	80.22	996,011.52
CA INC	8,520	33.41	284,653.20
CITRIX SYSTEMS INC	4,968	61.18	303,942.24
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	7,689	98.84	759,980.76
COMPUTER SCIENCES CORP	4,363	55.53	242,277.39
EBAY INC	29,947	55.17	1,652,175.99
ELECTRONIC ARTS INC	9,244	23.83	220,284.52
EQUINIX INC	1,450	175.62	254,649.00
FACEBOOK INC-A	44,500	57.96	2,579,220.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	7,595	52.47	398,509.65
FISERV INC	7,238	58.37	422,482.06
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,740	118.09	205,476.60
GOOGLE INC-CL A	7,070	1,111.84	7,860,708.80
INTL BUSINESS MACHINES CORP	26,842	183.22	4,917,991.24
INTUIT INC	6,846	76.42	523,171.32
LEIDOS HOLDINGS INC	2,056	45.94	94,452.64
LINKEDIN CORP - A	2,580	220.30	568,374.00
MASTERCARD INC-CLASS A	2,688	813.20	2,185,881.60
MICROSOFT CORP	204,214	37.08	7,572,255.12
NETSUITE INC	740	98.69	73,030.60
NUANCE COMMUNICATIONS INC	6,980	15.34	107,073.20
ORACLE CORP	89,463	37.32	3,338,759.16
PAYCHEX INC	7,962	45.43	361,713.66

RACKSPACE HOSTING INC	3,210	38.36	123,135.60
RED HAT INC	4,630	55.98	259,187.40
SALESFORCE.COM INC	14,760	54.80	808,848.00
SERVICENOW INC	3,030	55.05	166,801.50
SYMANTEC CORP	18,825	22.92	431,469.00
SYNOPSYS INC	4,627	40.06	185,357.62
TERADATA CORP	4,175	44.35	185,161.25
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,506	33.08	149,058.48
VANTIV INC - CL-A	2,410	31.77	76,565.70
VERISIGN INC	3,750	59.27	222,262.50
VISA INC-CLASS A SHARES	13,255	218.73	2,899,266.15
VMWARE INC	2,405	89.44	215,103.20
WESTERN UNION CO	15,831	17.18	271,976.58
WORKDAY INC-CLASS A	1,580	82.37	130,144.60
YAHOO! INC	25,155	40.85	1,027,581.75
AMPHENOL CORP-CL A	4,040	88.19	356,287.60
APPLE COMPUTER INC	23,456	567.67	13,315,267.52
ARROW ELECTRONICS INC	3,110	53.44	166,198.40
AVNET INC	3,460	43.11	149,160.60
CISCO SYSTEMS INC	137,720	21.69	2,987,146.80
CORNING INC	37,878	17.64	668,167.92
EMC CORP/MASS	53,439	25.01	1,336,509.39
F5 NETWORKS INC	1,775	89.44	158,756.00
FLEXTRONICS INTL LTD	14,686	7.71	113,229.06
FLIR SYSTEMS INC	3,195	29.48	94,188.60
HARRIS CORP	3,080	68.97	212,427.60
HEWLETT-PACKARD CO	49,555	28.16	1,395,468.80
JUNIPER NETWORKS INC	13,013	21.81	283,813.53
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,605	67.10	443,195.50
NETAPP INC	8,356	40.38	337,415.28
QUALCOMM INC	44,232	73.04	3,230,705.28
SANDISK CORP	6,413	70.34	451,090.42
SEAGATE TECHNOLOGY	8,564	55.94	479,070.16
TE CONNECTIVITY LTD	10,795	54.47	588,003.65
TRIMBLE NAVIGATION LTD	7,540	34.32	258,772.80

WESTERN DIGITAL CORP	5,865	82.56	484,214.40
XEROX CORP	30,914	12.18	376,532.52
AT&T INC	137,166	34.95	4,793,951.70
CENTURYLINK INC	16,326	31.69	517,370.94
CROWN CASTLE INTL CORP	8,910	72.44	645,440.40
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	30,694	4.70	144,261.80
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	3,010	88.14	265,301.40
SPRINT CORP	28,000	9.66	270,480.00
T-MOBILE US INC	4,362	32.19	140,412.78
VERIZON COMMUNICATIONS INC	73,933	48.98	3,621,238.34
WINDSTREAM HOLDINGS INC	17,485	8.37	146,349.45
AES CORP	17,438	14.47	252,327.86
ALLIANT ENERGY CORP	2,160	51.75	111,780.00
AMEREN CORPORATION	6,522	36.04	235,052.88
AMERICAN ELECTRIC POWER	12,988	46.59	605,110.92
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,095	42.04	172,153.80
CALPINE CORP	9,640	19.07	183,834.80
CENTERPOINT ENERGY INC	11,092	23.15	256,779.80
CMS ENERGY CORP	7,820	26.79	209,497.80
CONSOLIDATED EDISON INC	7,056	55.23	389,702.88
DOMINION RESOURCES INC/VA	14,947	64.65	966,323.55
DTE ENERGY COMPANY	4,478	66.68	298,593.04
DUKE ENERGY CORP	18,276	69.28	1,266,161.28
EDISON INTERNATIONAL	8,219	46.53	382,430.07
ENERGY CORP	4,147	62.73	260,141.31
EXELON CORP	22,666	27.29	618,555.14
FIRSTENERGY CORP	9,905	32.22	319,139.10
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	2,420	54.70	132,374.00
MDU RESOURCES GROUP INC	5,280	30.45	160,776.00
NEXTERA ENERGY INC	10,955	84.73	928,217.15
NISOURCE INC	8,025	32.76	262,899.00
NORTHEAST UTILITIES	8,390	42.25	354,477.50
NRG ENERGY INC	9,360	28.38	265,636.80
OGE ENERGY CORP	5,180	33.97	175,964.60
ONEOK INC	5,160	60.01	309,651.60

	P G & E CORP	11,831	41.03	485,425.93	
	PEPCO HOLDINGS INC	7,192	19.00	136,648.00	
	PINNACLE WEST CAPITAL	2,199	53.20	116,986.80	
	PPL CORPORATION	15,848	29.86	473,221.28	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	13,568	31.85	432,140.80	
	SCANA CORP	3,443	47.28	162,785.04	
	SEMPRA ENERGY	5,877	89.46	525,756.42	
	SOUTHERN CO	23,285	40.96	953,753.60	
	WISCONSIN ENERGY CORP	5,774	41.51	239,678.74	
	XCEL ENERGY INC	11,814	27.98	330,555.72	
	ALTERA CORPORATION	7,436	32.10	238,695.60	
	ANALOG DEVICES INC	8,741	50.63	442,556.83	
	APPLIED MATERIALS INC	32,603	17.39	566,966.17	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	6,260	52.62	329,401.20	
	BROADCOM CORP-CL A	12,686	29.16	369,923.76	
	CREE INC	3,160	60.83	192,222.80	
	INTEL CORP	128,422	25.43	3,265,771.46	
	KLA-TENCOR CORPORATION	3,779	64.04	242,007.16	
	LAM RESEARCH CORP	4,167	54.40	226,684.80	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	5,594	45.20	252,848.80	
	LSI CORP	11,795	10.99	129,627.05	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	9,254	13.42	124,188.68	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	7,570	28.31	214,306.70	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5,124	44.42	227,633.70	
	MICRON TECHNOLOGY INC	26,237	21.82	572,491.34	
	NVIDIA CORP	15,155	15.82	239,752.10	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	28,272	43.43	1,227,852.96	
	XILINX INC	6,125	45.23	277,033.75	
米ドル小計		7,962,715		435,414,402.27 (45,435,492,876)	
加ドル	ALTAGAS LTD	3,050	40.61	123,860.50	
	ARC RESOURCES LTD	7,925	29.45	233,391.25	
	ATHABASCA OIL CORP	8,020	6.25	50,125.00	
	BAYTEX ENERGY CORP	3,375	41.51	140,096.25	
	CAMECO CORP	10,492	22.12	232,083.04	

CANADIAN NATURAL RESOURCES	27,594	35.23	972,136.62
CANADIAN OIL SANDS LTD	11,160	19.98	222,976.80
CENOVUS ENERGY INC	19,883	29.94	595,297.02
CRESCENT POINT ENERGY CORP	10,045	41.14	413,251.30
ENBRIDGE INC	19,625	45.80	898,825.00
ENCANA CORP	17,968	19.25	345,884.00
ENERPLUS CORP	4,690	19.33	90,657.70
HUSKY ENERGY INC	9,069	33.24	301,453.56
IMPERIAL OIL LTD	8,212	46.71	383,582.52
KEYERA CORP	2,060	63.25	130,295.00
MEG ENERGY CORP	4,510	30.40	137,104.00
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	9,390	18.78	176,344.20
PEMBINA PIPELINE CORP	8,085	37.05	299,549.25
PENGROWTH ENERGY CORP	12,780	6.62	84,603.60
PENN WEST PETROLEUM LTD	15,493	9.15	141,760.95
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	3,680	32.69	120,299.20
SUNCOR ENERGY INC	38,555	36.89	1,422,293.95
TALISMAN ENERGY INC	25,922	12.45	322,728.90
TOURMALINE OIL CORP	4,005	44.96	180,064.80
TRANSCANADA CORP	18,973	48.52	920,569.96
VERMILION ENERGY INC	3,000	61.86	185,580.00
AGNICO EAGLE MINES LTD	5,325	28.25	150,431.25
AGRIUM INC	3,765	97.37	366,598.05
BARRICK GOLD CORP	28,214	18.40	519,137.60
ELDORADO GOLD CORP	20,510	5.92	121,419.20
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	12,590	18.40	231,656.00
FRANCO-NEVADA CORP	2,925	43.45	127,091.25
GOLDCORP INC	21,277	22.94	488,094.38
KINROSS GOLD CORP	34,515	4.67	161,185.05
METHANEX CORP	2,330	61.83	144,063.90
NEW GOLD INC	16,160	5.39	87,102.40
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	23,017	34.64	797,308.88
SILVER WHEATON CORP	8,645	21.47	185,608.15
TECK RESOURCES LTD-CLS B	13,885	26.81	372,256.85
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	13,419	3.49	46,832.31



YAMANA GOLD INC	19,626	9.32	182,914.32
BOMBARDIER INC 'B'	34,746	4.62	160,526.52
CAE INC	6,315	13.58	85,757.70
FINNING INTERNATIONAL INC	4,625	26.67	123,348.75
SNC-LAVALIN GROUP INC	4,385	47.81	209,646.85
CANADIAN NATL RAILWAY CO	21,608	60.41	1,305,339.28
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	4,465	161.54	721,276.10
MAGNA INTERNATIONAL INC	6,089	85.20	518,782.80
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,070	56.39	173,117.30
TIM HORTONS INC	3,275	62.15	203,541.25
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	10,695	25.48	272,508.60
THOMSON REUTERS CORP	10,274	40.35	414,555.90
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,040	98.75	201,450.00
DOLLARAMA INC	1,660	87.22	144,785.20
ALIMENTATION COUCHE SUB VTG	3,810	79.47	302,780.70
EMPIRE CO LTD 'A'	1,000	72.34	72,340.00
LOBLAW COMPANIES LTD	2,709	42.04	113,886.36
METRO INC	1,930	65.21	125,855.30
SHOPPERS DRUG MART INC	5,365	57.96	310,955.40
WESTON (GEORGE) LTD	1,572	77.31	121,531.32
SAPUTO INC	3,520	48.40	170,368.00
CATAMARAN CORP	5,730	51.20	293,376.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	8,044	120.15	966,486.60
BANK OF MONTREAL	16,511	70.28	1,160,393.08
BANK OF NOVA SCOTIA	30,959	65.53	2,028,743.27
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	10,095	90.24	910,972.80
NATIONAL BANK OF CANADA	4,550	88.37	402,083.50
ROYAL BANK OF CANADA	37,159	71.10	2,642,004.90
TORONTO-DOMINION BANK	23,770	99.00	2,353,230.00
CI FINANCIAL CORP	3,410	35.18	119,963.80
IGM FINANCIAL INC	2,535	56.17	142,390.95
ONEX CORPORATION	1,905	55.82	106,337.10
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	230	422.89	97,264.70
GREAT-WEST LIFECO INC	7,724	32.27	249,253.48
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	2,905	47.38	137,638.90

	INTACT FINANCIAL CORP	3,045	68.46	208,460.70	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	48,731	20.83	1,015,066.73	
	POWER CORP OF CANADA	7,800	32.20	251,160.00	
	POWER FINANCIAL CORP	5,715	36.65	209,454.75	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	15,704	37.34	586,387.36	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	14,622	40.46	591,606.12	
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES CORP	8,664	20.46	177,265.44	
	CGI GROUP INC - CL A	5,870	37.42	219,655.40	
	OPEN TEXT CORPORATION	1,535	97.70	149,969.50	
	BLACKBERRY LTD	13,928	8.25	114,906.00	
	BCE INC	7,240	45.75	331,230.00	
	BELL ALIANT INC	1,680	26.54	44,587.20	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	9,235	47.31	436,907.85	
	TELUS CORP	5,976	36.38	217,406.88	
	ATCO LTD -CLASS I	1,920	46.84	89,932.80	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,590	35.70	92,463.00	
	FORTIS INC	4,785	30.42	145,559.70	
	TRANSALTA CORP	7,950	13.45	106,927.50	
加ドル小計		989,434		35,457,953.30 (3,491,544,661)	
ユーロ	CGG	4,720	11.76	55,507.20	
	ENI SPA	66,036	17.29	1,141,762.44	
	FUGRO NV-CVA	1,660	41.87	69,504.20	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	9,315	11.75	109,451.25	
	NESTE OIL OYJ	3,590	14.30	51,337.00	
	OMV AG	3,490	34.23	119,480.15	
	REPSOL SA	21,681	18.28	396,437.08	
	REPSOL SA-RTS	21,681	0.49	10,688.73	
	SAIPEM SPA	7,220	15.13	109,238.60	
	TECHNIP SA	2,468	66.19	163,356.92	
	TENARIS SA	12,625	15.78	199,222.50	
	TOTAL SA	55,377	44.00	2,436,588.00	
	VOPAK	1,890	41.86	79,124.85	
	AIR LIQUIDE	8,186	100.25	820,646.50	
	AKZO NOBEL NV	6,468	55.57	359,426.76	

ARCELORMITTAL	26,441	12.42	328,529.42
ARKEMA	1,615	82.47	133,189.05
BASF SE	23,655	76.90	1,819,069.50
CRH PLC	18,570	17.95	333,331.50
FUCHS PETROLUB SE-PRF	860	71.78	61,730.80
HEIDELBERGCEMENT AG	3,965	53.78	213,237.70
IMERYS SA	910	62.89	57,229.90
K+S AG	5,420	21.38	115,879.60
KONINKLIJKE DSM NV	4,382	56.58	247,933.56
LAFARGE SA	5,258	54.20	284,983.60
LANXESS AG	1,935	47.74	92,376.90
LINDE AG	4,865	151.25	735,831.25
SOLVAY ET CIE SA -A	1,711	112.75	192,915.25
STORA ENSO OYJ-R SHS	12,085	7.15	86,468.17
THYSSENKRUPP AG	9,395	17.17	161,359.12
UMICORE	3,460	33.29	115,200.70
UPM-KYMMENE OYJ	12,618	12.08	152,425.44
VOESTALPINE AG	2,509	34.36	86,209.24
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4,176	24.65	102,938.40
ALSTOM	5,800	25.73	149,263.00
ANDRITZ AG	1,980	44.92	88,941.60
BOSKALIS WESTMINSTER	1,695	38.22	64,782.90
BOUYGUES SA	4,210	26.44	111,333.45
BRENTAG AG	1,465	132.65	194,332.25
CNH INDUSTRIAL NV	24,730	8.11	200,560.30
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	10,846	39.27	425,922.42
EADS NV	15,248	56.15	856,175.20
FERROVIAL SA	12,315	13.90	171,240.07
FINMECCANICA SPA	9,630	5.44	52,387.20
GEA GROUP AG	5,040	34.35	173,124.00
HOCHTIEF AG	625	62.05	38,781.25
KONE OYJ-B	7,854	32.65	256,433.10
KONINKLIJKE PHILIPS NV	25,861	26.38	682,213.18
LEGRAND SA	7,428	39.79	295,597.26
MAN SE	1,054	89.06	93,869.24

METSO OYJ	3,260	30.04	97,930.40
OCI NV	2,300	31.94	73,462.00
OSRAM LICHT AG	2,332	40.53	94,515.96
PRYSMIAN SPA	5,635	18.55	104,529.25
REXEL SA	4,200	18.60	78,120.00
SAFRAN SA	6,190	49.83	308,478.65
SCHNEIDER ELECTRIC SA	13,988	62.22	870,333.36
SIEMENS AG-REG	20,446	99.06	2,025,380.76
THALES SA	2,345	45.89	107,612.05
VALLOUREC	2,495	39.06	97,467.17
VINCI SA	12,830	46.97	602,689.25
WARTSILA OYJ	4,810	35.33	169,937.30
ZARDOYA OTIS SA	5,219	12.72	66,385.68
ZODIAC AEROSPACE	910	127.10	115,661.00
BUREAU VERITAS SA	5,650	20.93	118,282.75
EDENRED	6,096	24.70	150,571.20
RANDSTAD HOLDING NV	2,865	46.67	133,709.55
SOCIETE BIC SA	735	86.31	63,437.85
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	10,531	16.11	169,654.41
ADP	650	82.43	53,579.50
ATLANTIA SPA	9,360	15.96	149,385.60
DEUTCHE LUFTHANSA	5,680	15.27	86,762.00
DEUTSCHE POST AG	22,413	26.49	593,720.37
FRAPORT AG	980	54.95	53,851.00
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	17,530	7.48	131,282.17
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	23,442	4.80	112,521.60
RYANAIR HOLDINGS PLC	2,835	6.22	17,639.37
TNT EXPRESS NV	9,060	6.71	60,801.66
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	8,595	84.55	726,707.25
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,650	61.20	100,980.00
CONTINENTAL AG	2,725	160.75	438,043.75
DAIMLER AG	24,772	62.30	1,543,295.60
FIAT SPA	26,775	5.85	156,633.75
MICHELIN (CGDE)-B	4,749	75.90	360,449.10
NOKIAN RENKAAT OYJ	2,915	35.65	103,919.75

PIRELLI & C.	5,506	12.31	67,778.86
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	4,080	74.97	305,877.60
RENAULT SA	5,127	58.30	298,904.10
VALEO SA	1,880	80.70	151,716.00
VOLKSWAGEN AG	771	191.70	147,800.70
VOLKSWAGEN AG-PFD	3,653	201.45	735,896.85
ADIDAS AG	5,361	91.37	489,834.57
CHRISTIAN DIOR	1,420	132.85	188,647.00
HUGO BOSS AG -ORD	900	102.20	91,980.00
KERING	2,037	150.00	305,550.00
LUXOTTICA GROUP SPA	3,976	37.77	150,173.52
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	6,519	129.95	847,144.05
ACCOR SA	3,686	33.36	122,983.39
SODEXO	2,330	72.49	168,901.70
AXEL SPRINGER SE	995	46.56	46,327.20
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	22.11	83,907.45
JC DECAUX SA .	1,910	30.00	57,300.00
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	700	94.81	66,367.00
LAGARDERE S.C.A.	2,980	26.42	78,731.60
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-REG	2,855	35.64	101,752.20
PUBLICIS GROUPE	4,725	65.06	307,408.50
REED ELSEVIER NV	18,858	15.36	289,753.17
RTL GROUP	920	91.96	84,603.20
SES	7,690	23.50	180,753.45
SKY DEUTSCHLAND AG	10,300	8.12	83,708.10
TELENET GROUP HOLDING NV	1,440	43.00	61,920.00
WOLTERS KLUWER	7,557	20.77	156,958.89
INDITEX	5,705	117.85	672,334.25
CARREFOUR SA	16,343	28.24	461,608.03
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,344	85.01	114,253.44
COLRUYT SA	2,035	40.79	83,017.82
DELHAIZE GROUP	2,426	43.78	106,222.41
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	16,598	6.51	108,052.98
JERONIMO MARTINS	7,685	14.15	108,742.75
KONINKLIJKE AHOLD NV	25,774	13.05	336,350.70

METRO AG	3,260	35.01	114,132.60
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	20,751	76.01	1,577,283.51
DANONE	14,854	51.20	760,524.80
HEINEKEN HOLDING NV	2,595	44.92	116,580.37
HEINEKEN NV	6,333	47.92	303,477.36
KERRY GROUP PLC-A	3,750	49.45	185,437.50
PERNOD-RICARD SA	5,466	81.00	442,746.00
REMY COINTREAU	780	59.75	46,605.00
SUEDZUCKER AG	2,400	19.18	46,032.00
UNILEVER NV-CVA	41,885	28.70	1,202,308.92
BEIERSDORF AG	2,655	73.11	194,107.05
HENKEL AG & CO KGAA	3,360	75.14	252,470.40
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	4,463	83.76	373,820.88
L'OREAL	6,336	124.90	791,366.40
CELESIO AG	2,150	23.03	49,514.50
ESSILOR INTERNATIONAL	5,205	75.15	391,155.75
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	5,723	51.18	292,903.14
FRESENIUS SE & CO KGAA	3,115	111.95	348,724.25
BAYER AG	21,310	101.50	2,162,965.00
GRIFOLS SA	3,810	34.68	132,130.80
MERCK KGAA	1,745	129.85	226,588.25
ORION OYJ-CLASS B	2,590	20.07	51,981.30
QIAGEN N.V.	7,635	17.05	130,176.75
SANOFI	30,846	75.50	2,328,873.00
UCB SA	2,798	53.64	150,084.72
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	153,605	0.17	27,157.36
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	149,793	8.86	1,327,914.94
BANCO DE SABADELL SA	84,048	1.86	156,329.28
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	21,145	1.06	22,582.86
BANCO POPULAR ESPANOL	29,339	4.41	129,590.36
BANCO SANTANDER SA	294,277	6.45	1,898,380.92
BANK OF IRELAND	558,550	0.26	145,781.55
BANKIA SA	65,000	1.16	75,725.00
BNP PARIBAS	25,642	55.66	1,427,233.72
CAIXABANK S.A	26,440	3.74	99,017.80

COMMERZBANK AG	26,244	11.40	299,312.82
CREDIT AGRICOLE SA	26,092	9.16	239,185.36
ERSTE GROUP BANK AG	7,118	25.63	182,434.34
INTESA SANPAOLO	298,543	1.78	531,406.54
KBC GROEP NV	6,119	41.10	251,490.90
NATIXIS	27,130	4.27	115,953.62
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	1,470	25.67	37,734.90
SOCIETE GENERALE	18,299	41.50	759,408.50
UBI BANCA SCPA	22,584	4.84	109,442.06
UNICREDIT SPA	115,153	5.35	616,068.55
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	26,175	34.38	900,027.37
DEUTSCHE BOERSE AG	5,320	59.56	316,859.20
EURAZEO	829	57.18	47,402.22
EXOR SPA	1,714	28.21	48,351.94
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,882	65.70	123,647.40
ING GROEP NV-CVA	98,555	9.98	984,071.67
MEDIOBANCA SPA	16,140	6.31	101,843.40
POHJOLA BANK PLC	3,875	14.50	56,187.50
WENDEL	750	105.00	78,750.00
AEGON NV	44,779	6.82	305,527.11
AGEAS	5,954	31.00	184,603.77
ALLIANZ SE-REG	11,728	129.65	1,520,535.20
ASSICURAZIONI GENERALI	30,298	16.88	511,430.24
AXA	46,062	19.77	910,876.05
CNP ASSURANCES	3,530	14.50	51,185.00
DELTA LLOYD NV	3,600	17.98	64,728.00
HANNOVER RUECK SE-REG	1,845	62.34	115,017.30
MAPFRE SA	20,814	3.10	64,689.91
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	4,506	159.40	718,256.40
SAMPO OYJ-A SHS	10,779	35.30	380,498.70
SCOR SE	4,142	25.78	106,801.47
VIENNA INSURANCE GROUP	1,120	35.59	39,860.80
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	7,800	14.18	110,643.00
IMMOEAST AG-TEMPORARY	16,150	-	-
IMMOFINANZ AG	25,580	3.34	85,539.52

IMMOFINANZ AG-TEMPORARY	13,000	-	-
AMADEUS IT HOLDING SA	10,060	30.51	306,930.60
ATOS	1,650	64.90	107,085.00
CAP GEMINI SA	4,079	48.58	198,178.21
DASSAULT SYSTEMES SA	1,765	89.46	157,896.90
SAP AG-COMMON	23,712	61.84	1,466,350.08
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2,930	30.81	90,287.95
ALCATEL-LUCENT	70,000	3.11	217,980.00
GEMALTO	2,370	81.00	191,970.00
NOKIA OYJ	96,286	5.75	553,644.50
BELGACOM SA	3,780	21.48	81,213.30
DEUTSCHE TELEKOM AG	75,106	12.43	933,943.11
ELISA OYJ	4,205	19.24	80,904.20
ILIAD SA	730	148.80	108,624.00
KONINKLIJKE KPN NV	80,906	2.31	187,621.01
ORANGE S.A.	47,964	8.85	424,913.07
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	15,833	3.23	51,140.59
TELECOM ITALIA SPA	277,303	0.70	194,389.40
TELECOM ITALIA-RSP	125,887	0.56	70,685.55
TELEFONICA SA	105,478	11.75	1,239,366.50
TELEKOM AUSTRIA AG	6,570	5.45	35,813.07
VIVENDI	31,680	18.82	596,217.60
ZIGGO NV	4,030	33.08	133,332.55
E.ON SE	45,589	13.33	607,701.37
EDF	6,885	25.40	174,879.00
ENAGAS	4,190	18.67	78,227.30
ENEL GREEN POWER SPA	43,650	1.80	78,875.55
ENEL SPA	170,904	3.10	530,827.82
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	49,221	2.65	130,632.53
FORTUM OYJ	12,255	16.50	202,207.50
GAS NATURAL SDG SA	9,162	18.45	169,084.71
GDF SUEZ	35,264	17.03	600,722.24
IBERDROLA SA	124,702	4.60	573,629.20
RED ELECTRICA CORPORACION SA	3,040	48.12	146,284.80
RWE AG	12,505	26.41	330,257.05



	SNAM SPA	47,520	3.96	188,179.20
	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	8,549	13.02	111,350.72
	TERNA SPA	43,127	3.60	155,257.20
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	9,184	11.60	106,580.32
	ASML HOLDING NV	9,162	67.75	620,725.50
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	29,335	7.69	225,791.49
	STMICROELECTRONICS NV	16,783	5.79	97,274.26
ユーロ小計		5,215,551		74,607,009.99 (10,635,229,274)
英ポンド	AMEC PLC	8,850	10.75	95,137.50
	BG GROUP PLC	87,654	12.83	1,124,600.82
	BP PLC	487,118	4.86	2,368,367.71
	PETROFAC LTD	6,995	11.87	83,030.65
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	98,928	21.62	2,138,823.36
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	64,684	22.65	1,465,416.02
	TULLOW OIL PLC	25,600	8.38	214,528.00
	ANGLO AMERICAN PLC	35,774	12.75	456,297.37
	ANTOFAGASTA PLC	11,360	8.05	91,448.00
	BHP BILLITON PLC	54,811	18.34	1,005,233.74
	CRODA INTERNATIONAL PLC	3,900	24.30	94,770.00
	FRESNILLO PLC	5,160	7.09	36,610.20
	GLENCORE XSTRATA PLC	275,543	3.08	848,810.21
	JOHNSON MATTHEY PLC	5,517	32.34	178,419.78
	RANDGOLD RESOURCES LTD	2,250	37.79	85,027.50
	REXAM PLC	22,222	5.18	115,221.07
	RIO TINTO PLC	32,975	33.25	1,096,418.75
	BAE SYSTEMS PLC ORD	81,385	4.31	351,094.89
	BUNZL PLC	7,276	14.29	103,974.04
	COBHAM PLC	34,695	2.76	96,070.45
	IMI PLC	9,210	15.10	139,071.00
	INVENSYS PLC	16,604	5.06	84,016.24
	MEGGITT PLC	20,865	5.23	109,228.27
	MELROSE INDUSTRIES PLC	26,610	2.96	78,951.87
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS -PRF C	4,548,970	0.00	4,548.97
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	48,795	12.55	612,377.25

SMITHS GROUP PLC	11,363	14.76	167,717.88
TRAVIS PERKINS PLC	6,600	18.14	119,724.00
WEIR GROUP PLC/THE	5,660	21.31	120,614.60
WOLSELEY PLC	7,174	33.66	241,476.84
AGGREKO PLC	6,311	16.90	106,655.90
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	9,775	13.29	129,909.75
CAPITA PLC	18,349	10.25	188,077.25
EXPERIAN PLC	27,408	10.97	300,665.76
G4S PLC	42,539	2.55	108,474.45
INTERTEK GROUP PLC	4,815	30.70	147,820.50
SERCO GROUP PLC	14,965	4.82	72,221.09
EASYJET PLC	3,840	15.21	58,406.40
GKN PLC	44,825	3.72	167,152.42
BURBERRY GROUP PLC	11,004	14.66	161,318.64
PERSIMMON PLC	8,190	12.19	99,836.10
CARNIVAL PLC	5,300	24.55	130,115.00
COMPASS GROUP PLC	48,318	9.50	459,262.59
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	6,249	20.00	124,980.00
TUI TRAVEL PLC	14,295	4.04	57,837.57
WHITBREAD PLC	4,140	36.99	153,138.60
WILLIAM HILL PLC	23,300	3.92	91,475.80
BRITISH SKY BROADCASTING GRO	28,404	8.33	236,605.32
ITV PLC	103,355	1.93	199,475.15
PEARSON PLC	20,339	13.26	269,695.14
REED ELSEVIER PLC	32,106	8.94	287,188.17
WPP PLC	34,754	13.74	477,519.96
KINGFISHER PLC	62,157	3.87	240,547.59
MARKS & SPENCER GROUP PLC	42,080	4.45	187,466.40
NEXT PLC	3,697	54.35	200,931.95
SAINSBURY (J) PLC	34,011	3.71	126,452.89
TESCO PLC	212,264	3.36	714,268.36
WM MORRISON SUPERMARKETS	59,995	2.63	158,266.81
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	10,125	24.63	249,378.75
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	49,147	32.13	1,579,338.84
COCA-COLA HBC AG-CDI	5,000	17.36	86,800.00

DIAGEO PLC	64,802	19.56	1,267,527.12
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	24,602	23.18	570,274.36
SABMILLER PLC	24,711	30.39	751,090.84
TATE & LYLE PLC	12,180	8.07	98,292.60
UNILEVER PLC	32,967	24.47	806,702.49
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	16,605	48.02	797,372.10
SMITH & NEPHEW PLC	22,326	8.67	193,678.05
ASTRAZENECA PLC	32,203	36.12	1,163,172.36
GLAXOSMITHKLINE PLC	126,371	15.89	2,008,035.19
SHIRE PLC	13,785	28.27	389,701.95
BARCLAYS PLC	392,771	2.65	1,042,610.61
HSBC HOLDINGS PLC	482,581	6.61	3,190,825.57
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,284,556	0.78	1,004,522.79
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	57,230	3.32	190,118.06
STANDARD CHARTERED PLC	62,209	13.49	839,199.41
3I GROUP PLC	29,809	3.83	114,317.51
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	22,730	4.84	110,035.93
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,720	13.05	74,646.00
ICAP PLC	12,270	4.53	55,632.18
INVESTEC PLC	13,185	4.27	56,418.61
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	4,068	17.09	69,522.12
SCHRODERS PLC	2,231	25.59	57,091.29
ADMIRAL GROUP PLC	4,925	13.04	64,222.00
AVIVA PLC	79,430	4.42	351,160.03
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	19,560	2.45	48,098.04
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	151,821	2.21	335,676.23
OLD MUTUAL PLC	120,149	1.92	231,647.27
PRUDENTIAL PLC	65,762	13.34	877,265.08
RESOLUTION LTD	37,353	3.48	130,249.91
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	89,957	0.92	83,165.24
STANDARD LIFE PLC	60,295	3.57	215,253.15
SAGE GROUP PLC/THE	27,620	4.03	111,336.22
BT GROUP PLC	203,072	3.78	768,424.44
INMARSAT PLC	10,010	7.57	75,775.70
VODAFONE GROUP PLC	1,251,355	2.36	2,958,203.22

	CENTRICA PLC	129,855	3.45	448,389.31	
	NATIONAL GRID PLC	96,295	7.86	757,360.17	
	SEVERN TRENT PLC	6,283	16.87	105,994.21	
	SSE PLC	26,377	13.68	360,837.36	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	18,525	6.65	123,191.25	
	ARM HOLDINGS PLC	37,080	10.95	406,026.00	
英債券小計		12,221,241		44,601,372.10 (7,607,656,039)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	9,705	42.40	411,492.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	240	312.75	75,060.00	
	GIVAUDAN-REG	213	1,264.00	269,232.00	
	HOLCIM LTD-REG	5,743	65.55	376,453.65	
	SIKA AG-BR	47	3,135.00	147,345.00	
	SYNGENTA AG-REG	2,408	352.90	849,783.20	
	ABB LTD-REG	56,495	23.29	1,315,768.55	
	GEBERIT AG-REG	925	266.70	246,697.50	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	620	131.30	81,406.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,090	129.80	141,482.00	
	SULZER AG-REG	520	142.30	73,996.00	
	ADECCO SA-REG	3,557	69.15	245,966.55	
	SGS SA-REG	133	2,001.00	266,133.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,550	116.80	181,040.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	13,409	87.70	1,175,969.30	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	830	586.00	486,380.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	930	99.80	92,814.00	
	ARYZTA AG	2,630	67.90	178,577.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	25	3,995.00	99,875.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	3	48,165.00	144,495.00	
	NESTLE SA-REG	83,403	64.75	5,400,344.25	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,510	118.10	178,331.00	
	ACTELION LTD-REG	2,560	75.25	192,640.00	
	LONZA GROUP AG-REG	1,650	84.35	139,177.50	
	NOVARTIS AG-REG	59,393	70.35	4,178,297.55	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	18,148	244.40	4,435,371.20	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	38,878	27.02	1,050,483.56	

	JULIUS BAER GROUP LTD	5,960	42.22	251,631.20	
	PARGESA HOLDING SA-BR	655	71.45	46,799.75	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	500	231.00	115,500.00	
	UBS AG-REG	93,742	16.84	1,578,615.28	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,390	111.90	155,541.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	850	183.50	155,975.00	
	SWISS RE AG	9,049	81.25	735,231.25	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,711	255.80	949,273.80	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,370	68.90	94,393.00	
	SWISSCOM AG-REG	634	467.50	296,395.00	
	スイスフラン小計	424,476		26,813,966.09 (3,122,754,490)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	6,180	122.50	757,050.00	
	BOLIDEN AB	7,620	95.05	724,281.00	
	ALFA LAVAL AB	7,470	164.00	1,225,080.00	
	ASSA ABLOY AB-B	8,310	336.90	2,799,639.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	17,995	176.30	3,172,518.50	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	8,620	162.00	1,396,440.00	
	SANDVIK AB	25,500	88.85	2,265,675.00	
	SCANIA AB-B SHS	8,560	125.10	1,070,856.00	
	SKANSKA AB-B SHS	10,520	129.90	1,366,548.00	
	SKF AB-B SHS	10,209	166.30	1,697,756.70	
	VOLVO AB-B SHARES	40,370	82.85	3,344,654.50	
	SECURITAS AB-B SHS	7,249	67.30	487,857.70	
	ELECTROLUX AB - B	6,765	166.40	1,125,696.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	8,480	38.19	323,851.20	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	24,158	296.00	7,150,768.00	
	SWEDISH MATCH AB	4,860	205.70	999,702.00	
	SVENSKA CELLULOOSA AB-B SHS	15,365	195.20	2,999,248.00	
	ELEKTA AB-B SHS	10,440	97.70	1,019,988.00	
	GETINGE AB-B SHS	5,730	218.70	1,253,151.00	
	NORDEA BANK AB	76,178	85.25	6,494,174.50	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	42,100	83.90	3,532,190.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	12,750	314.00	4,003,500.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	24,570	179.10	4,400,487.00	

	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,630	121.40	319,282.00	
	INVESTOR AB-B SHS	11,795	220.20	2,597,259.00	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	5,505	303.60	1,671,318.00	
	ERICSSON LM-B SHS	78,565	77.65	6,100,572.25	
	HEXAGON AB-B SHS	6,960	201.00	1,398,960.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,370	643.50	881,595.00	
	TELE2 AB-B SHS	8,705	73.05	635,900.25	
	TELIASONERA AB	65,210	53.20	3,469,172.00	
スウェーデンクローナ小計		570,739		70,685,170.60	(1,121,773,657)
ノルウェークローネ	AKER SOLUTIONS ASA	4,430	104.60	463,378.00	
	SEADRILL LTD	9,735	240.60	2,342,241.00	
	STATOIL ASA	29,984	146.50	4,392,656.00	
	SUBSEA 7 SA	7,505	112.10	841,310.50	
	NORSK HYDRO A S	20,410	26.50	540,865.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,560	260.00	1,185,600.00	
	ORKLA ASA	19,380	46.89	908,728.20	
	DNB ASA	25,535	108.90	2,780,761.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,200	114.40	480,480.00	
	TELENOR ASA	17,535	146.00	2,560,110.00	
ノルウェークローネ小計		143,274		16,496,130.20	(279,609,406)
デンマーククローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	13	54,500.00	708,500.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - B	33	57,550.00	1,899,150.00	
	DSV A/S	5,060	176.80	894,608.00	
	CARLSBERG AS-B	2,940	586.50	1,724,310.00	
	COLOPLAST-B	2,545	353.40	899,403.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	600	515.50	309,300.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	10,245	975.50	9,993,997.50	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,645	228.50	1,289,882.50	
	DANSKE BANK A/S	18,375	124.30	2,284,012.50	
	TRYG A/S	615	520.50	320,107.50	
TDC A/S	14,545	52.45	762,885.25		
デンマーククローネ小計		60,616		21,086,156.25	(402,956,445)

豪ドル	ORORA LTD(N)	29,730	1.23	36,716.55
	CALTEX AUSTRALIA LTD	2,735	19.80	54,153.00
	ORIGIN ENERGY LTD	30,980	13.99	433,410.20
	SANTOS LTD	23,715	14.58	345,764.70
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	16,528	39.10	646,244.80
	WORLEYPARSONS LTD	4,340	16.79	72,868.60
	ALUMINA LTD	68,742	1.06	72,866.52
	AMCOR LIMITED	29,730	10.52	312,759.60
	BHP BILLITON LTD	83,186	37.29	3,102,005.94
	BORAL LTD	17,115	4.77	81,638.55
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	46,275	5.68	262,842.00
	ILUKA RESOURCES LTD	12,115	8.50	102,977.50
	INCITEC PIVOT LTD	31,550	2.70	85,185.00
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	13,935	12.94	180,318.90
	NEWCREST MINING LTD	20,969	7.61	159,574.09
	ORICA LIMITED	10,785	23.79	256,575.15
	RIO TINTO LTD	11,838	66.84	791,251.92
	LEIGHTON HOLDINGS LTD	3,517	16.23	57,080.91
	ALS LTD	8,301	8.81	73,131.81
	BRAMBLES LTD	37,828	9.21	348,395.88
	SEEK LTD	8,040	13.33	107,173.20
	ASCIANO LTD	24,833	5.71	141,796.43
	AURIZON HOLDINGS LTD	46,150	4.94	227,981.00
	QANTAS AIRWAYS LTD	34,245	1.10	37,669.50
	SYDNEY AIRPORT	5,340	3.78	20,185.20
	SYDNEY AIRPORT(N)	8,026	3.78	30,338.28
	TOLL HOLDINGS LTD	16,805	5.66	95,116.30
	TRANSURBAN GROUP	35,045	6.86	240,408.70
	CROWN RESORTS LTD	10,705	16.89	180,807.45
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	17,212	2.47	42,513.64
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	1,640	47.20	77,408.00
	TABCORP HOLDINGS LTD	23,977	3.60	86,317.20
TATTS GROUP LTD	42,460	3.06	129,927.60	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	15,840	3.15	49,896.00	
METCASH LTD	18,890	3.30	62,337.00	

	WESFARMERS LTD	25,713	43.79	1,125,972.27
	WOOLWORTHS LTD	31,312	33.70	1,055,214.40
	COCA-COLA AMATIL LTD	15,150	12.17	184,375.50
	TREASURY WINE ESTATES LTD	14,070	4.79	67,395.30
	COCHLEAR LTD	1,277	58.76	75,036.52
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,935	42.84	125,735.40
	SONIC HEALTHCARE LTD	9,830	16.60	163,178.00
	CSL LTD	12,532	68.83	862,577.56
	AUST AND NZ BANKING GROUP	70,969	32.13	2,280,233.97
	BANK OF QUEENSLAND LIMITED	7,280	12.10	88,088.00
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	10,478	11.73	122,906.94
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	41,747	77.16	3,221,198.52
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	60,603	34.78	2,107,772.34
	WESTPAC BANKING CORP	80,431	32.14	2,585,052.34
	ASX LTD	4,995	36.94	184,515.30
	MACQUARIE GROUP LTD	7,574	55.95	423,765.30
	AMP LTD	70,127	4.42	309,961.34
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	50,298	5.75	289,213.50
	QBE INSURANCE GROUP LTD	31,820	11.68	371,657.60
	SUNCORP GROUP LTD	33,060	13.04	431,102.40
	COMPUTERSHARE LTD	11,490	11.41	131,100.90
	TELSTRA CORPORATION LTD	110,214	5.23	576,419.22
	AGL ENERGY LTD	12,751	14.88	189,734.88
	SP AUSNET	49,750	1.24	61,690.00
豪ドル小計		1,579,528		26,039,534.62 (2,424,020,277)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	19,060	8.72	166,203.20
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	30,950	3.56	110,336.75
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	55,837	2.34	130,658.58
	CONTACT ENERGY LIMITED	9,430	5.06	47,715.80
ニュージーランドドル小計		115,277		454,914.33 (38,776,897)
香港ドル	KERRY LOGISTICS NETWORK LTD	8,475	10.22	86,614.50
	HOPEWELL HOLDINGS	16,000	25.90	414,400.00
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	52,823	104.10	5,498,874.30



NWS HOLDINGS LTD	28,500	11.56	329,460.00
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	37,000	16.20	599,400.00
MTR CORP	39,500	29.30	1,157,350.00
LI & FUNG LTD	138,000	10.00	1,380,000.00
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	14,500	25.10	363,950.00
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	57,000	68.60	3,910,200.00
MGM CHINA HOLDINGS LTD	28,000	32.10	898,800.00
SANDS CHINA LTD	60,600	62.45	3,784,470.00
SHANGRI-LA ASIA LTD	48,000	15.30	734,400.00
SJM HOLDINGS LTD	57,000	25.40	1,447,800.00
WYNN MACAU LTD	44,600	34.95	1,558,770.00
BANK OF EAST ASIA	36,440	32.70	1,191,588.00
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	93,000	24.85	2,311,050.00
HANG SENG BANK LTD	21,400	125.50	2,685,700.00
FIRST PACIFIC CO	74,250	8.67	643,747.50
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	26,800	130.90	3,508,120.00
AIA GROUP LTD	309,600	38.35	11,873,160.00
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	36,682	121.40	4,453,194.80
HANG LUNG PROPERTIES LTD	57,000	24.45	1,393,650.00
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	30,168	44.30	1,336,442.40
HYSAN DEVELOPMENT CO	15,000	33.95	509,250.00
KERRY PROPERTIES LTD	16,950	27.05	458,497.50
NEW WORLD DEVELOPMENT	101,000	9.80	989,800.00
SINO LAND CO	63,050	10.60	668,330.00
SUN HUNG KAI PROPERTIES	40,480	97.50	3,946,800.00
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	18,017	91.10	1,641,348.70
SWIRE PROPERTIES LTD	23,200	19.54	453,328.00
WHARF HOLDINGS LTD	35,800	60.40	2,162,320.00
WHEELOCK & CO LTD	19,600	35.85	702,660.00
HKT TRUST AND HKT LTD	67,000	7.56	506,520.00
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	15,000	49.10	736,500.00
CLP HOLDINGS LTD	48,000	61.70	2,961,600.00
HONG KONG & CHINA GAS	154,438	17.68	2,730,463.84
POWER ASSETS HOLDINGS	37,500	61.45	2,304,375.00
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	64.70	420,550.00

香港ドル小計		1,976,873		72,753,484.54 (979,261,901)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	34,660	11.09	384,379.40
	NOBLE GROUP LTD	82,854	1.04	86,168.16
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	21,000	5.42	113,820.00
	SEMBCORP MARINE LTD	16,000	4.37	69,920.00
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,000	3.91	129,030.00
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	42,010	1.18	49,571.80
	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,000	1.99	91,540.00
	SINGAPORE AIRLINES LTD	15,800	10.26	162,108.00
	GENTING SINGAPORE PLC	172,000	1.46	251,980.00
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	45,050	4.07	183,353.50
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,000	35.36	70,720.00
	OLAM INTERNATIONAL LTD	47,000	1.52	71,440.00
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	220,000	0.54	118,800.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	53,000	3.39	179,670.00
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	45,215	16.84	761,420.60
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	67,240	10.12	680,468.80
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	34,700	20.90	725,230.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	20,000	7.23	144,600.00
	CAPITALAND LTD	71,000	3.02	214,420.00
	CAPITAMALLS ASIA LTD	29,880	1.96	58,564.80
CITY DEVELOPMENTS LTD	13,000	9.61	124,930.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	60,000	2.86	171,600.00	
KEPPEL LAND LTD	18,000	3.37	60,660.00	
UOL GROUP LTD	12,250	6.11	74,847.50	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	204,280	3.60	735,408.00	
シンガポールドル小計		1,405,939		5,714,650.56 (470,487,180)
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	9,770	29.20	285,284.00
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	78	1,867.00	145,626.00
	TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	22,840	136.10	3,108,524.00
	BANK HAPOLIM BM	27,725	19.89	551,450.25
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	29,355	14.34	420,950.70
	NICE SYSTEMS LTD	1,825	143.80	262,435.00

	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	48,790	6.05	295,618.61	
イスラエルシュケル小計		140,383		5,069,888.56 (151,792,463)	
合 計		32,806,046		76,161,355,566 (76,161,355,566)	

(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	8,720	173,789.60	
		AMERICAN TOWER CORP	10,449	822,440.79	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	24,910	251,840.10	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,475	410,988.25	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,117	425,780.14	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,200	126,412.00	
		COLE REAL ESTATE INVESTMENT	11,570	160,360.20	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,735	183,388.50	
		DUKE REALTY CORPORATION	6,875	101,956.25	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	8,890	457,923.90	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,825	186,423.75	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	11,315	230,147.10	
		HCP INC	12,455	452,863.80	
		HEALTH CARE REIT INC	6,990	371,099.10	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	17,919	347,986.98	
		KIMCO REALTY CORPORATION	11,985	241,018.35	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	107,865.45	
		PLUM CREEK TIMBER CO	4,548	211,618.44	
		PROLOGIS INC	13,432	496,581.04	
		PUBLIC STORAGE	3,959	600,184.40	
		RAYONIER INC	3,507	150,380.16	
REALTY INCOME CORP	5,400	205,902.00			
REGENCY CENTERS CORPORATION	2,805	131,217.90			
SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	7,964	1,227,411.68			

		SL GREEN REALTY CORP	2,650	245,549.00	
		THE MACERICH COMPANY	3,250	193,050.00	
		UDR INC	7,800	181,818.00	
		VENTAS INC	8,095	462,467.35	
		VORNADO REALTY TRUST	4,671	416,139.39	
		WEYERHAEUSER CO	16,116	504,108.48	
米ドル小計			234,740	10,078,712.10 (1,051,713,607)	
加ドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	4,000	83,760.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,380	83,080.40	
加ドル小計			7,380	166,840.40 (16,428,774)	
ユーロ	投資証券	CORIO NV	1,998	63,686.25	
		FONCIERE DES REGIONS	595	36,800.75	
		GECINA SA	580	55,784.40	
		ICADE	685	44,846.95	
		KLEPIERRE	2,445	80,599.42	
		UNIBAIL-RODAMCO SE-NA	2,440	437,492.00	
ユーロ小計			8,743	719,209.77 (102,523,352)	
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	27,311	171,513.08	
		HAMMERSON PLC	15,295	76,780.90	
		INTU PROPERTIES PLC	19,860	61,009.92	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	18,919	182,000.78	
		SEGRO PLC	20,223	68,293.07	
英ポンド小計			101,608	559,597.75 (95,450,588)	
豪ドル	投資証券	APA GROUP	19,805	120,018.30	
		CFS RETAIL PROPERTY TRUST GR	67,010	127,989.10	
		DEXUS PROPERTY GROUP	110,925	113,143.50	
		FEDERATION CENTRES	45,000	103,950.00	
		GOODMAN GROUP	43,442	208,087.18	
		GPT GROUP	47,615	163,319.45	
		LEND LEASE GROUP	17,037	188,769.96	
		MIRVAC GROUP	108,455	184,915.77	

		STOCKLAND	55,310	202,987.70	
		WESTFIELD GROUP	55,295	572,303.25	
		WESTFIELD RETAIL TRUST	86,505	256,054.80	
豪ドル小計			656,399	2,241,539.01	(208,664,866)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	59,500	2,246,125.00	
香港ドル小計			59,500	2,246,125.00	(30,232,842)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	62,000	137,020.00	
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	40,000	57,200.00	
		CAPITAMALL TRUST	71,800	136,420.00	
シンガポールドル小計			173,800	330,640.00	(27,221,591)
合計				1,532,235,620	(1,532,235,620)

(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 580銘柄	97.7%		58.6%
	投資証券 30銘柄		2.3%	1.4%
加ドル	株式 93銘柄	99.5%		4.5%
	投資証券 2銘柄		0.5%	0.0%
ユーロ	株式 232銘柄	99.0%		13.7%
	投資証券 6銘柄		1.0%	0.1%
英ポンド	株式 102銘柄	98.8%		9.8%
	投資証券 5銘柄		1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 37銘柄	100.0%		4.0%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	100.0%		1.4%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%		0.4%
デンマーククローネ	株式 11銘柄	100.0%		0.5%
豪ドル	株式 59銘柄	92.1%		3.1%

	投資証券	11銘柄		7.9%	0.3%
ニュージーランドドル	株式	4銘柄	100.0%		0.0%
香港ドル	株式	38銘柄	97.0%		1.3%
	投資証券	1銘柄		3.0%	0.0%
シンガポールドル	株式	25銘柄	94.5%		0.6%
	投資証券	3銘柄		5.5%	0.0%
イスラエルシケル	株式	7銘柄	100.0%		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。

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

### 貸借対照表

（単位：円）

	平成25年 6月25日現在	平成25年12月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	79,830,221	135,143,921
コール・ローン	61,783,370	33,049,317
株式	7,665,608,674	8,725,525,548
投資証券	12,119,458	13,033,939
派生商品評価勘定	-	1,667,513
未収入金	-	75,864,143
未収配当金	45,276,520	4,598,000
未収利息	100	51
差入委託証拠金	35,762,717	34,343,881
流動資産合計	7,900,381,060	9,023,226,313
<b>資産合計</b>		
7,900,381,060		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	17,436,156	35,411
未払金	4,119,274	-
未払解約金	672,000	52,809,250
流動負債合計	22,227,430	52,844,661
<b>負債合計</b>		
22,227,430		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,703,893,698	6,300,961,943
剰余金		

	平成25年 6月25日現在	平成25年12月25日現在
剰余金又は欠損金( )	1,174,259,932	2,669,419,709
元本等合計	7,878,153,630	8,970,381,652
純資産合計	7,878,153,630	8,970,381,652
負債純資産合計	7,900,381,060	9,023,226,313

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 6月25日現在	平成25年12月25日現在
1. 期首	平成24年12月26日	平成25年 6月26日
期首元本額	6,624,867,445円	6,703,893,698円
期首からの追加設定元本額	603,347,590円	421,227,568円
期首からの一部解約元本額	524,321,337円	824,159,323円
元本の内訳		
日興五大陸株式ファンド	3,795,262,604円	3,301,500,138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	44,390,047円	34,495,779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	2,858,469,423円	2,958,705,617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）	5,771,624円	6,260,409円
計	6,703,893,698円	6,300,961,943円
2. 受益権の総数	6,703,893,698口	6,300,961,943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）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成24年12月26日 至 平成25年 6月25日	自 平成25年 6月26日 至 平成25年12月25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

金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 6月25日現在	平成25年12月25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	(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



	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。	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25年 6月25日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,015,696,027
投資証券	1,788,162
合計	1,017,484,189

(平成25年12月25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	7,853,400
投資証券	1,665,060
合計	9,518,460

(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25年 6月25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	198,449,115	-	181,012,959	17,436,156
合計		198,449,115	-	181,012,959	17,436,156

(平成25年12月25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	206,531,607	-	208,199,120	1,667,513
合計		206,531,607	-	208,199,120	1,667,513

## (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25年 6月25日現在)

該当事項はありません。

(平成25年12月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	44,886,189	-	44,921,600	35,411
	米ドル	14,592,200	-	14,607,600	15,400
	香港ドル	18,818,800	-	18,830,000	11,200

	台湾ドル	11,475,189	-	11,484,000	8,811
	合計	44,886,189	-	44,921,600	35,411

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

平成25年 6月25日現在		平成25年12月25日現在	
1口当たり純資産額	1.1752円	1口当たり純資産額	1.4237円
(1万口当たり純資産額)	(11,752円)	(1万口当たり純資産額)	(14,237円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	2,440	38.88	94,867.20	
	GAZPROM OAO-SPON ADR	134,200	8.65	1,160,830.00	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	26,400	1.75	46,200.00	
	LUKOIL OAO-SPON ADR	11,585	61.75	715,373.75	
	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	1,926	135.70	261,358.20	
	ROSNEFT OJSC-REG S GDR	26,540	7.54	200,111.60	

SURGUTNEFTGAS-SP ADR	32,700	8.60	281,220.00	
TATNEFT-SPONSORED-ADR	5,449	38.44	209,459.56	
BRASKEM SA-SPON ADR	1,780	17.51	31,167.80	
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	4,650	11.02	51,243.00	
CIA SIDERURGICA NACL-SP ADR	10,170	6.18	62,850.60	
FIBRIA CELULO SA-ADR	3,094	11.92	36,880.48	
GERDAU SA -SPON ADR	3,600	7.94	28,584.00	
MMC NORILSK NICKEL JSC-ADR	13,394	16.69	223,545.86	
SEVERSTAL - GDR REG S	2,470	9.68	23,921.95	
SOUTHERN COPPER CORP(US)	4,280	27.55	117,914.00	
URALKALI-SPON GDR-REG S	6,220	26.71	166,136.20	
LATAM AIRLINES GROUP-SP -ADR	2,280	15.77	35,955.60	
LATAM AIRLINES GROUP-SP -ADR-RTS	497	0.55	273.35	
GRUPO TELEVISA SA-SPONS ADR	1,800	30.02	54,036.00	
CIA BRASILEIRA-SP ADR PRAF	2,380	43.77	104,172.60	
MAGNIT OJSC-SPON GDR REGS	6,300	65.10	410,130.00	
BRF SA-ADR	6,180	20.53	126,875.40	
BANCO BRADESCO-ADR	1,716	12.36	21,209.76	
BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	983	22.79	22,402.57	
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	2,350	48.09	113,011.50	
CREDICORP LTD	1,430	130.58	186,729.40	
SBERBANK-SPONSORED ADR	66,000	12.58	830,280.00	
VTB BANK OJSC-GDR-REG S	47,530	2.95	140,213.50	
MEGAFON-GDR	2,600	33.01	85,826.00	
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	13,112	21.23	278,367.76	
OI SA-ADR	1,635	1.66	2,714.10	
ROSTELECOM-SPONSORED-ADR	3,657	20.81	76,102.17	
SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR	2,515	32.00	80,480.00	
TELEF BRASIL-ADR	3,924	18.60	72,986.40	
CEMIG SA -SPONS ADR	3,363	7.91	26,601.33	
CIA SANEAMENTO BASICO DE-ADR	6,180	11.24	69,463.20	
RUSHYDRO MANAGEMENT CO-ADR	18,000	1.77	31,896.00	
米ドル小計	485,330		6,481,390.84 (676,333,134)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	243,537	15.25	3,713,939.25

GRUPO MEXICO SA-SER B	91,578	42.91	3,929,611.98	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	3,700	318.96	1,180,152.00	
MEXICHEM SAB DE CV-*	23,185	55.97	1,297,664.45	
MINERA FRISCO SAB DE CV-A1	11,000	26.37	290,070.00	
ALFA S.A.B. -A	61,000	38.02	2,319,220.00	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	11,000	68.61	754,710.00	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	7,700	154.18	1,187,186.00	
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	5,300	164.02	869,306.00	
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	10,000	68.44	684,400.00	
GRUPO TELEVISA SAB	43,100	78.31	3,375,161.00	
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	2,900	150.31	435,899.00	
WALMART DE MEXICO -SER V	137,200	34.20	4,692,240.00	
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	9,300	81.05	753,765.00	
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	8,100	158.66	1,285,146.00	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	41,700	127.00	5,295,900.00	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	43,500	39.04	1,698,240.00	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	41,670	36.90	1,537,623.00	
GENOMMA LAB INTERNACIONAL-B	23,000	34.58	795,340.00	
GRUPO FIN SANTANDER-B	32,000	35.44	1,134,080.00	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	56,900	90.32	5,139,208.00	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	45,000	35.67	1,605,150.00	
COMPARTAMOS SAB DE CV	30,000	24.69	740,700.00	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	836,800	15.00	12,552,000.00	
メキシコペソ小計	1,819,170		57,266,711.68 (458,706,360)	
ブラジルリアル				
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	2,600	39.83	103,558.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	69,860	15.87	1,108,678.20	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	92,600	17.06	1,579,756.00	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	6,800	55.62	378,216.00	
BRADSPAR SA -PREF	5,600	24.35	136,360.00	
BRASKEM SA-PREF A	1,000	20.54	20,540.00	
CIA SIDERURGICA NACIONAL	7,800	14.32	111,696.00	
DURATEX SA	6,600	12.94	85,404.00	
FIBRIA CELULOSE SA	829	27.90	23,129.10	
GERDAU SA-PREF	16,000	18.84	301,440.00	

KLABIN SA-PRF	7,300	12.30	89,790.00
METALURGICA GERDAU SA-PREF	7,100	23.65	167,915.00
USINAS SIDER MINAS GER-PF A	8,600	14.50	124,700.00
VALE SA	25,760	34.56	890,265.60
VALE SA-PREF A	46,150	31.80	1,467,570.00
EMBRAER SA	10,500	18.60	195,300.00
MARCOPOLO SA-PREF	17,000	5.10	86,700.00
WEG SA	5,700	30.85	175,845.00
ALL AMERICA LATINA LOGISTICA	12,500	7.10	88,750.00
CCR SA	20,600	17.50	360,500.00
ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	7,000	14.40	100,800.00
LOCALIZA RENT A CAR	2,940	33.03	97,108.20
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP	6,700	14.32	95,944.00
MRV ENGENHARIA	12,000	8.68	104,160.00
ANHANGUERA EDUCACIONAL PART	7,950	14.35	114,082.50
ESTACIO PARTICIPACOES SA	9,000	20.78	187,020.00
KROTON EDUCACIONAL SA	3,100	38.50	119,350.00
CIA HERING	3,750	30.05	112,687.50
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	8,728	15.90	138,775.20
LOJAS RENNER S.A.	2,800	63.41	177,548.00
RAIA DROGASIL SA	5,500	15.40	84,700.00
AMBEV SA	102,000	17.07	1,741,140.00
BRF SA	8,400	48.56	407,904.00
JBS SA	24,900	8.65	215,385.00
SOUZA CRUZ SA	8,000	23.67	189,360.00
HYPERMARCAS SA	5,000	17.70	88,500.00
NATURA COSMETICOS SA	5,300	40.98	217,194.00
ODONTOPREV S.A.	9,300	10.17	94,581.00
QUALICORP SA	5,000	21.95	109,750.00
BANCO BRADESCO S.A.	14,300	31.36	448,448.00
BANCO BRADESCO SA-PREF	46,390	29.05	1,347,629.50
BANCO DO BRASIL S.A.	13,500	24.52	331,020.00
BANCO ESTADO RIO GRANDE SUL-PRF-B	6,500	12.55	81,575.00
BANCO SAN. BRASIL-UNIT	18,700	13.93	260,491.00
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	54,020	31.47	1,700,009.40

	ITAUSA- INVESTIMENTOS ITAU-PRF	62,675	8.90	557,807.50	
	BM&FBOVESPA SA	45,573	10.63	484,440.99	
	CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	4,700	24.24	113,928.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	14,000	23.95	335,300.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	6,000	17.30	103,800.00	
	BR PROPERTIES SA	6,300	18.45	116,235.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	1,500	50.00	75,000.00	
	CIELO SA	8,004	66.49	532,185.96	
	TOTVS SA	3,250	36.24	117,780.00	
	OI SA-PRF	17,004	3.81	64,785.24	
	TELEFONICA BRASIL S.A. -PREF	2,830	43.50	123,105.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	14,605	12.15	177,450.75	
	AES TIETE SA-PREF	3,500	19.32	67,620.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS	5,880	6.01	35,338.80	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	2,300	10.35	23,805.00	
	CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	5,700	22.62	128,934.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	11,012	18.21	200,528.52	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	2,160	26.10	56,376.00	
	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS	2,300	36.13	83,099.00	
	CPFL ENERGIA SA	6,800	19.27	131,036.00	
	TRACTEBEL ENERGIA SA ORD	3,700	36.00	133,200.00	
	ブラジルリアル小計	991,470		19,723,030.96	(872,941,350)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	11,490	7,051.80	81,025,182.00	
	CAP SA	2,045	10,208.00	20,875,360.00	
	EMPRESAS CMPC SA	37,000	1,288.60	47,678,200.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B-PRF	1,400	13,319.00	18,646,600.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	2,500	8,216.00	20,540,000.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	19,800	4,639.90	91,870,020.00	
	CENCOSUD SA	30,150	1,891.40	57,025,710.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PRF B	9,000	2,519.80	22,678,200.00	
	BANCO DE CHILE	405,477	74.63	30,260,748.51	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	832	29,160.00	24,261,120.00	
	BANCO SANTANDER CHILE SA	747,000	30.34	22,663,980.00	
	CORPBANCA	2,600,000	7.32	19,039,800.00	

	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	2,700	7,152.90	19,312,830.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	91,000	329.16	29,953,560.00	
	COLBUN SA	268,000	119.27	31,964,360.00	
	EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	57,700	772.84	44,592,868.00	
	ENERSIS SA	419,500	156.61	65,697,895.00	
チリペソ小計		4,705,594		648,086,433.51 (127,932,261)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	50,000	3,800.00	190,000,000.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	8,890	9,900.00	88,011,000.00	
	CEMEX LATAM HOLDINGS SA	6,000	14,500.00	87,000,000.00	
	GRUPO ARGOS SA	8,660	19,180.00	166,098,800.00	
	GRUPO ARGOS SA-PRF	2,755	18,780.00	51,738,900.00	
	ALMACENES EXITO SA	4,500	29,500.00	132,750,000.00	
	BANCO DAVIVIENDA SA-PRF	4,000	23,680.00	94,720,000.00	
	CORP FINANCIERA COLOMBIANA	2,500	39,580.00	98,950,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	8,300	34,200.00	283,860,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	13,000	8,970.00	116,610,000.00	
コロンビアペソ小計		108,605		1,309,738,700.00 (71,118,811)	
ユーロ	OPAP SA	6,700	9.22	61,774.00	
	NATIONAL BANK OF GREECE	11,000	3.93	43,230.00	
	PIRAEUS BANK S.A	33,400	1.43	47,762.00	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	7,200	9.01	64,872.00	
	PUBLIC POWER CORP	4,100	9.91	40,631.00	
ユーロ小計		62,400		258,269.00 (36,816,245)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	3,470	42.90	148,863.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	46,017	2.45	112,741.65	
	ENKA INSAAT VE SANAYI AS	17,596	5.76	101,352.96	
	KOC HOLDING AS	12,124	8.92	108,146.08	
	TURK HAVA YOLLARI AO	19,550	6.58	128,639.00	
	ARCELIK A.S.	6,500	12.00	78,000.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	4,400	42.50	187,000.00	
	ANADOLU EFES BIRACILIK	5,581	21.75	121,386.75	
	AKBANK T.A.S.	49,259	6.96	342,842.64	



	TURKIYE GARANTI BANKASI	52,740	6.98	368,125.20	
	TURKIYE HALK BANKASI	14,660	12.85	188,381.00	
	TURKIYE IS BANKASI-C	39,904	4.84	193,135.36	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	19,682	4.08	80,302.56	
	YAPI VE KREDI BANKASI	18,033	3.89	70,148.37	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	27,753	8.72	242,006.16	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	17,056	11.60	197,849.60	
トルコリラ小計		354,325		2,668,920.33	(133,846,354)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	360	4,360.00	1,569,600.00	
	TELEFONICA CZECH REPUBLIC AS	1,925	292.20	562,485.00	
	CEZ AS	4,130	515.00	2,126,950.00	
チェココルナ小計		6,415		4,259,035.00	(22,061,801)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	660	14,360.00	9,477,600.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	4,150	4,320.00	17,928,000.00	
	OTP BANK PLC	4,585	4,059.00	18,610,515.00	
ハンガリーフォリント小計		9,395		46,016,115.00	(22,133,751)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	3,000	35.97	107,910.00	
	POLISH OIL & GAS	37,985	5.27	200,180.95	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	6,130	41.27	252,985.10	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	1,200	54.21	65,052.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	3,710	114.65	425,351.50	
	CYFROWY POLSAT SA	9,000	19.84	178,560.00	
	EUROCASH SA	2,100	46.97	98,637.00	
	KERNEL HOLDING SA	2,100	39.31	82,551.00	
	ALIOR BANK SA	1,500	80.00	120,000.00	
	BANK PEKAO SA	3,152	178.60	562,947.20	
	BANK ZACHODNI WBK SA	550	391.00	215,050.00	
	MBANK	230	500.00	115,000.00	
	PKO BANK POLSKI SA	18,445	39.66	731,528.70	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	1,400	452.30	633,220.00	
	TELEKOMUNIKACJA POLSKA SA	14,105	9.77	137,805.85	
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	18,400	17.00	312,800.00		

	TAURON POLSKA ENERGIA SA	37,000	4.53	167,610.00	
ポーランドズロチ小計		160,007		4,407,189.30 (151,651,383)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	115,000	4.48	515,200.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	30,000	23.85	715,500.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	542,300	6.31	3,421,913.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	81,000	24.30	1,968,300.00	
	CNOOC LTD	388,000	14.34	5,563,920.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	66,000	13.86	914,760.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	467,000	8.54	3,988,180.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	50,000	7.28	364,000.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	89,000	2.67	237,630.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	33,000	29.70	980,100.00	
	CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	44,000	5.15	226,600.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	74,000	8.34	617,160.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	64,000	5.40	345,600.00	
	FOSUN INTERNATIONAL	58,000	7.19	417,020.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	31,000	13.86	429,660.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	42,000	6.80	285,600.00	
	SHOUGANG FUSHAN RESOURCES GR	110,000	2.75	302,500.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	64,500	2.24	144,480.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD	147,750	1.71	252,652.50	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	52,000	4.47	232,440.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	12,000	74.80	897,600.00	
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	114,000	6.25	712,500.00	
	CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	26,876	14.32	384,864.32	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	46,000	7.84	360,640.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	100,000	4.07	407,000.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	52,000	13.48	700,960.00	
	CITIC PACIFIC LTD	29,000	11.80	342,200.00	
	CSR CORP LTD	41,000	6.57	269,370.00	
	SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	70,000	2.79	195,300.00	
	SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	13,000	28.40	369,200.00	
	WEICHAH POWER CO LTD-H	9,600	31.70	304,320.00	
	ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	9,000	28.10	252,900.00	

ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TE-H	32,500	7.26	235,950.00	
AIR CHINA LTD-H	58,000	5.61	325,380.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	60,000	6.25	375,000.00	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	65,825	3.76	247,502.00	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	33,000	28.05	925,650.00	
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	100,750	2.02	203,515.00	
COSCO PACIFIC LTD	32,000	10.50	336,000.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	24,000	9.56	229,440.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	43,000	7.20	309,600.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	64,000	12.38	792,320.00	
BYD CO LTD-H	10,000	36.95	369,500.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	82,000	12.68	1,039,760.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	100,000	3.76	376,000.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	25,000	43.45	1,086,250.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	76,318	8.85	675,414.30	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	25,000	9.47	236,750.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	20,000	27.60	552,000.00	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	126,000	8.91	1,122,660.00	
GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP	23,000	10.24	235,520.00	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	191,160	1.39	265,712.40	
INTIME RETAIL GROUP CO LTD	32,000	7.70	246,400.00	
CHINA RESOURCES ENTERPRISES	37,000	25.95	960,150.00	
SUN ART RETAIL GROUP	43,000	10.92	469,560.00	
WUMART STORES INC-H	24,000	12.30	295,200.00	
CHAODA MODERN AGRICULTURE	54,756	1.10	60,231.60	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	48,000	3.87	185,760.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	35,000	36.00	1,260,000.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	38,000	23.00	874,000.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	6,000	62.50	375,000.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	132,000	11.18	1,475,760.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	20,000	91.65	1,833,000.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	32,000	10.46	334,720.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	26,000	18.66	485,160.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	26,400	22.50	594,000.00	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	38,000	7.11	270,180.00	

SINO BIOPHARMACEUTICAL	68,000	6.01	408,680.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	485,000	3.79	1,838,150.00
BANK OF CHINA LTD - H	1,661,000	3.58	5,946,380.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	168,245	5.44	915,252.80
CHINA CITIC BANK - H	150,000	4.17	625,500.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,625,920	5.91	9,609,187.20
CHINA MERCHANTS BANK - H	98,150	16.32	1,601,808.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	141,000	8.52	1,201,320.00
IND & COMM BK OF CHINA - H	1,634,575	5.26	8,597,864.50
CHINA EVERBRIGHT LTD	18,000	12.12	218,160.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	28,000	21.10	590,800.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	40,000	13.44	537,600.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	169,000	24.10	4,072,900.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	54,600	30.35	1,657,110.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	14,000	15.84	221,760.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO-H	14,000	26.45	370,300.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	93,000	3.80	353,400.00
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	59,940	11.46	686,912.40
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	42,000	69.95	2,937,900.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	42,000	8.35	350,700.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	86,320	21.90	1,890,408.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	44,000	19.28	848,320.00
CHINA VANKE CO LTD -B	23,360	11.40	266,304.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	94,419	4.82	455,099.58
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	146,000	2.92	426,320.00
FRANSHION PROPERTIES	110,000	2.63	289,300.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	25,000	11.84	296,000.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	26,400	11.22	296,208.00
LONGFOR PROPERTIES	15,000	10.88	163,200.00
POLY PROPERTY GROUP CO LTD	34,000	4.12	140,080.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	37,500	17.82	668,250.00
SHUI ON LAND LTD	42,900	2.40	102,960.00
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	65,000	5.01	325,650.00
SOHO CHINA LTD	65,000	6.72	436,800.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	160,000	1.89	302,400.00

	TENCENT HOLDINGS LTD	23,100	469.20	10,838,520.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	21,500	37.60	808,400.00	
	KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	16,800	20.40	342,720.00	
	LENOVO GROUP LTD	130,000	9.35	1,215,500.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	60,000	4.76	285,600.00	
	CHINA MOBILE LTD	137,700	80.95	11,146,815.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD	315,000	3.89	1,225,350.00	
	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	97,882	11.70	1,145,219.40	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	54,000	10.42	562,680.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	48,000	9.57	459,360.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	30,000	25.80	774,000.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	47,000	17.94	843,180.00	
	DATANG INTL POWER GEN CO-H	23,000	3.53	81,190.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	12,000	55.95	671,400.00	
	GUANGDONG INVEST	62,000	7.62	472,440.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	106,000	6.96	737,760.00	
	GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	198,000	2.33	461,340.00	
香港ドル小計		13,818,046		128,499,574.00 (1,729,604,266)	
マレーシアリン ギット	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD(N)	30,558	2.88	88,210.75	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	5,000	30.40	152,000.00	
	SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	70,000	4.77	333,900.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	71,000	6.81	483,510.00	
	GAMUDA BHD	56,000	4.67	261,520.00	
	IJM CORP BHD	35,000	5.74	200,900.00	
	SIME DARBY BERHAD	64,720	9.40	608,368.00	
	AIRASIA BHD	47,000	2.22	104,340.00	
	MISC BHD	30,000	5.49	164,700.00	
	UMW HOLDINGS BHD	20,000	12.04	240,800.00	
	BERJAYA SPORTS TOTO BERHAD	26,833	4.01	107,600.33	
	GENTING BHD	45,300	10.16	460,248.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	90,500	4.30	389,150.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	2,500	64.00	160,000.00	
	FELDA GLOBAL VENTURES	43,000	4.37	187,910.00	
	IOI CORPORATION BERHAD	91,675	4.49	411,620.75	

	IOI CORPORATION BERHAD-RTS(N)	15,279	1.12	17,214.33	
	KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	16,000	24.22	387,520.00	
	PPB GROUP BERHAD	11,700	15.50	181,350.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	34,000	3.78	128,520.00	
	ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	37,000	4.80	177,600.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	93,800	7.61	713,818.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	17,800	14.40	256,320.00	
	MALAYAN BANKING BHD	103,150	9.95	1,026,342.50	
	PUBLIC BANK BHD-FOREIGN MKT	23,700	18.82	446,034.00	
	RHB CAPITAL BHD	25,000	7.91	197,750.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	32,600	7.29	237,654.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	61,900	6.75	417,825.00	
	DIGI.COM BHD	74,000	4.83	357,420.00	
	MAXIS BHD	44,000	7.20	316,800.00	
	PETRONAS GAS BERHAD	14,000	23.80	333,200.00	
	TENAGA NASIONAL BERHAD	47,125	11.08	522,145.00	
	YTL CORPORATION BERHAD	144,704	1.64	237,314.56	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	70,000	1.90	133,000.00	
マレーシアリングット小計		1,594,844		10,442,605.22	(330,821,733)
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	35,000	30.75	1,076,250.00	
	IRPC PCL - NVDR	191,800	3.30	632,940.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	28,710	168.50	4,837,635.00	
	PTT PCL-NVDR	21,600	288.00	6,220,800.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	28,000	59.25	1,659,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	39,000	21.40	834,600.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	20,045	79.75	1,598,588.75	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	2,600	400.00	1,040,000.00	
	SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	8,800	406.00	3,572,800.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	8,000	165.00	1,320,000.00	
	BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	31,000	51.75	1,604,250.00	
	CP ALL PCL-NVDR	132,800	44.50	5,909,600.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	70,000	30.25	2,117,500.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	11,000	124.00	1,364,000.00	
BANGKOK BANK-FOREIGN REG	32,040	179.50	5,751,180.00		

	BANK OF AYUDHYA PUBLIC-NVDR	73,000	29.75	2,171,750.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	24,200	167.50	4,053,500.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	20,000	165.00	3,300,000.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	115,125	17.50	2,014,687.50	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	36,300	152.00	5,517,600.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	31,000	42.50	1,317,500.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	20,800	208.00	4,326,400.00	
タイパーツ小計		980,820		62,240,581.25 (198,547,454)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	52,000	53.15	2,763,800.00	
	SM INVESTMENTS CORP	3,312	716.50	2,373,048.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	21,000	115.10	2,417,100.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	30,741	85.00	2,612,985.00	
	BDO UNIBANK INC	31,000	69.90	2,166,900.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	16,250	75.10	1,220,375.00	
	AYALA CORPORATION	4,942	519.00	2,564,898.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	320,000	4.28	1,369,600.00	
	AYALA LAND INC	177,960	24.30	4,324,428.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	217,710	14.50	3,156,795.00	
	PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	810	2,640.00	2,138,400.00	
	ABOITIZ POWER CORP	86,000	33.50	2,881,000.00	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	350,000	5.25	1,837,500.00	
フィリピンペソ小計		1,311,725		31,826,829.00 (75,111,316)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	270,000	1,120.00	302,400,000.00	
	INDO TAMBANGRAYA MEGAH PT	18,000	28,400.00	511,200,000.00	
	TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	25,000	10,300.00	257,500,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	32,000	19,750.00	632,000,000.00	
	SEMEN GRESIK (PERSERO) PT	66,000	14,000.00	924,000,000.00	
	PT UNITED TRACTORS	53,500	18,750.00	1,003,125,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	495,000	6,600.00	3,267,000,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	200,000	3,350.00	670,000,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	15,000	41,250.00	618,750,000.00	
	PT INDOFOOD SUKSES MAK TBK	136,000	6,500.00	884,000,000.00	
	PT UNILEVER INDONESIA TBK	30,000	26,100.00	783,000,000.00	

	KALBE FARMA TBK PT	750,000	1,220.00	915,000,000.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	48,000	3,700.00	177,600,000.00	
	BANK MANDIRI TBK	243,000	7,800.00	1,895,400,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	284,000	7,000.00	1,988,000,000.00	
	PT BANK CENTRAL ASIA	294,000	9,450.00	2,778,300,000.00	
	PT BANK NEGARA INDONESIA	180,000	3,900.00	702,000,000.00	
	LIPPO KARAWACI TBK/PT	450,000	900.00	405,000,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	1,315,000	2,125.00	2,794,375,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	213,500	4,475.00	955,412,500.00	
	インドネシアルピア小計	5,118,000		22,464,062,500.00 (193,190,937)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	1,270	56,400.00	71,628,000.00	
	S-OIL CORPORATION	825	74,200.00	61,215,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	1,482	140,000.00	207,480,000.00	
	CHEIL INDUSTRIES INC	1,240	87,600.00	108,624,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	2,000	21,250.00	42,500,000.00	
	HANWHA CORPORATION	1,160	39,450.00	45,762,000.00	
	HYOSUNG CORPORATION	550	67,900.00	37,345,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	1,130	83,800.00	94,694,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	115	305,500.00	35,132,500.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	460	93,300.00	42,918,000.00	
	LG CHEM LTD	1,002	294,500.00	295,089,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	370	226,000.00	83,620,000.00	
	OCI CO LTD	320	180,000.00	57,600,000.00	
	POSCO	1,470	332,500.00	488,775,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	610	91,300.00	55,693,000.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	3,686	7,080.00	26,096,880.00	
	DAEWOO INTERNATIONAL CORP	1,431	40,300.00	57,669,300.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,340	34,750.00	81,315,000.00	
	DOOSAN CORP	230	137,000.00	31,510,000.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	800	34,950.00	27,960,000.00	
	DOOSAN INFRACORE CO LTD	2,030	12,100.00	24,563,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	910	27,750.00	25,252,500.00	
	HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	1,595	22,800.00	36,366,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	1,310	60,100.00	78,731,000.00	



HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	895	255,500.00	228,672,500.00	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	245	179,000.00	43,855,000.00	
KCC CORP	120	454,000.00	54,480,000.00	
LG CORP	2,000	63,000.00	126,000,000.00	
LS CORP	650	79,700.00	51,805,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	3,250	59,200.00	192,400,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	835	61,800.00	51,603,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	3,690	37,600.00	138,744,000.00	
SAMSUNG TECHWIN CO LTD	841	53,600.00	45,077,600.00	
SK HOLDINGS CO LTD	450	189,500.00	85,275,000.00	
SK NETWORKS CO LTD	1,950	7,460.00	14,547,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	400	223,000.00	89,200,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	864	29,250.00	25,272,000.00	
HANKOOK TIRE CO LTD	2,132	61,000.00	130,052,000.00	
HYUNDAI MOBIS	1,500	287,000.00	430,500,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	3,800	226,000.00	858,800,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	850	127,000.00	107,950,000.00	
HYUNDAI WIA CORP	320	186,000.00	59,520,000.00	
KIA MOTORS CORPORATION	5,490	55,400.00	304,146,000.00	
COWAY CO LTD	1,090	65,600.00	71,504,000.00	
LG ELECTRONICS INC	2,785	67,400.00	187,709,000.00	
KANGWON LAND INC	2,770	31,300.00	86,701,000.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	380	157,000.00	59,660,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	215	395,500.00	85,032,500.00	
SHINSEGAE CO LTD	167	255,500.00	42,668,500.00	
E-MART CO LTD	472	267,000.00	126,024,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	194	266,500.00	51,701,000.00	
KT&G CORP	2,295	77,400.00	177,633,000.00	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	25	1,835,000.00	45,875,000.00	
ORION CORP	80	921,000.00	73,680,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	90	984,000.00	88,560,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	250	532,000.00	133,000,000.00	
CELLTRION INC	1,725	38,650.00	66,671,250.00	
BS FINANCIAL ROUP INC	4,549	16,250.00	73,921,250.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	4,140	16,650.00	68,931,000.00	

	HANA FINANCIAL GROUP	5,738	41,950.00	240,709,100.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	4,640	12,150.00	56,376,000.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	8,805	40,950.00	360,564,750.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	9,400	47,500.00	446,500,000.00	
	WOORI FINANCE HOLDINGS CO	6,450	12,800.00	82,560,000.00	
	DAEWOO SECURITIES CO.	4,575	8,860.00	40,534,500.00	
	HYUNDAI SECURITIES CO	3,610	5,870.00	21,190,700.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	955	39,700.00	37,913,500.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	570	37,300.00	21,261,000.00	
	SAMSUNG CARD CO	690	37,100.00	25,599,000.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,517	43,950.00	66,672,150.00	
	WOORI INVESTMENT & SECURITIE	3,171	10,000.00	31,710,000.00	
	DONGBU INSURANCE CO LTD	800	55,600.00	44,480,000.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	2,000	31,700.00	63,400,000.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	795	254,000.00	201,930,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	1,300	104,500.00	135,850,000.00	
	NAVER CORP	628	734,000.00	460,952,000.00	
	NCSOFT CORPORATION	450	243,500.00	109,575,000.00	
	NHN ENTERTAINMENT CORP	316	94,400.00	29,830,400.00	
	SK C&C CO LTD	500	133,000.00	66,500,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	4,560	25,200.00	114,912,000.00	
	LG INNOTEK CO LTD	450	82,800.00	37,260,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,330	72,800.00	96,824,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	680	161,000.00	109,480,000.00	
	KT CORP	1,027	32,100.00	32,966,700.00	
	LG UPLUS CORP.	8,000	10,600.00	84,800,000.00	
	SK TELECOM	230	238,500.00	54,855,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	5,890	34,300.00	202,027,000.00	
	KOREA GAS CORPORATION	828	67,100.00	55,558,800.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	2,455	1,415,000.00	3,473,825,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	460	1,041,000.00	478,860,000.00	
	SK HYNIX INC	11,430	36,750.00	420,052,500.00	
韓国ウォン小計		174,095		14,300,238,880.00	(1,410,003,553)
台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	32,080	80.50	2,582,440.00	

ASIA CEMENT CORP	56,842	38.35	2,179,890.70
CHINA PETROCHEMICAL DEV CORP	77,550	13.75	1,066,312.50
CHINA STEEL CORP	281,511	25.95	7,305,210.45
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	79,047	83.80	6,624,138.60
FORMOSA PLASTICS CORP	85,424	79.00	6,748,496.00
NAN YA PLASTICS CORP	103,145	67.80	6,993,231.00
TAIWAN CEMENT	73,170	45.40	3,321,918.00
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	20,000	66.30	1,326,000.00
TSRC CORP	19,800	44.50	881,100.00
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	100,459	33.60	3,375,422.40
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	6,489	252.00	1,635,228.00
TECO ELECTRIC & MACHINERY	52,000	34.15	1,775,800.00
WALSIN LIHWA CORP	185,000	9.42	1,742,700.00
EVA AIRWAYS CORP	62,000	16.65	1,032,300.00
EVERGREEN MARINE	44,769	18.20	814,795.80
YANG MING MARINE TRANSPORT	52,443	13.50	707,980.50
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	45,947	76.10	3,496,566.70
YULON MOTOR COMPANY	35,020	52.60	1,842,052.00
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	3,000	338.00	1,014,000.00
GIANT MANUFACTURING	5,000	200.50	1,002,500.00
MERIDA INDUSTRY CO LTD	5,000	215.00	1,075,000.00
POU CHEN	38,145	43.80	1,670,751.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	7,000	353.00	2,471,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	12,448	205.00	2,551,840.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	99,514	53.10	5,284,193.40
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	136,024	17.95	2,441,630.80
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	350,715	8.82	3,093,306.30
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	293,017	19.90	5,831,038.30
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	138,814	19.60	2,720,754.40
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	153,390	17.90	2,745,681.00
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	156,635	17.15	2,686,290.25
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	205,660	24.75	5,090,085.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	101,063	14.45	1,460,360.35
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	147,161	14.35	2,111,760.35
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	144,281	16.25	2,344,566.25

CHAILEASE HOLDING CO LTD	13,400	78.60	1,053,240.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	170,743	42.60	7,273,651.80
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	143,127	16.80	2,404,533.60
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	176,703	47.00	8,305,041.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	62,231	29.60	1,842,037.60
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	110,581	10.20	1,127,926.20
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	25,000	57.80	1,445,000.00
ACER INC	59,680	18.05	1,077,224.00
ADVANTECH CO LTD	5,968	194.00	1,157,792.00
ASUSTEK COMPUTER INC	15,797	266.50	4,209,900.50
AU OPTRONICS CORP	173,994	9.12	1,586,825.28
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	15,405	191.50	2,950,057.50
COMPAL ELECTRONICS	111,955	22.10	2,474,205.50
DELTA ELECTRONICS INC	40,419	167.00	6,749,973.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	22,209	70.40	1,563,513.60
HON HAI PRECISION INDUSTRY	239,286	79.10	18,927,522.60
HTC CORP	17,011	141.00	2,398,551.00
INNOLUX CORP	133,269	10.75	1,432,641.75
INVENTEC CORP	62,162	25.80	1,603,779.60
LARGAN PRECISION CO LTD	2,236	1,205.00	2,694,380.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	45,109	46.85	2,113,356.65
PEGATRON CORP	34,854	36.90	1,286,112.60
QUANTA COMPUTER INC	63,416	68.60	4,350,337.60
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	11,000	133.00	1,463,000.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	30,591	44.00	1,346,004.00
TPK HOLDING CO LTD	6,721	156.50	1,051,836.50
WISTRON CORP	46,025	25.00	1,150,625.00
WPG HOLDINGS LTD	40,000	33.55	1,342,000.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	92,371	92.40	8,535,080.40
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	27,000	64.80	1,749,600.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	33,188	96.40	3,199,323.20
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	146,784	27.40	4,021,881.60
EPISTAR CORP	10,292	54.00	555,768.00
MEDIATEK INC	28,030	427.50	11,982,825.00
MSTAR SEMICONDUCTOR INC	3,908	335.50	1,311,134.00

	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	12,522	118.50	1,483,857.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	6,000	178.00	1,068,000.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	19,635	44.30	869,830.50	
	RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	13,791	106.50	1,468,741.50	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	11,815	77.80	919,207.00	
	SILICONWARE PRECISION INDS	50,082	35.20	1,762,886.40	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	553,355	103.00	56,995,565.00	
	TRANSCEND INFORMATION INC	7,346	83.50	613,391.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	288,592	12.25	3,535,252.00	
台湾ドル小計		6,593,166		287,499,751.53 (1,000,499,135)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	6,400	348.00	2,227,200.00	
	CAIRN INDIA LTD	9,100	323.80	2,946,580.00	
	COAL INDIA LTD	9,000	283.20	2,548,800.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	15,460	285.75	4,417,695.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	28,946	898.05	25,994,955.30	
	ACC LIMITED	1,330	1,109.65	1,475,834.50	
	AMBUJA CEMENTS LIMITED	10,970	181.50	1,991,055.00	
	ASIAN PAINTS LTD	5,000	487.40	2,437,000.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	29,280	122.00	3,572,160.00	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	13,500	261.25	3,526,875.00	
	JSW STEEL LIMITED	2,000	988.65	1,977,300.00	
	SESA STERLITE LTD	23,260	199.00	4,628,740.00	
	TATA STEEL LIMITED	5,416	418.40	2,266,054.40	
	ADANI ENTERPRISES LTD	5,500	268.50	1,476,750.00	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	13,150	172.90	2,273,635.00	
	JAIPRAKASH ASSOCIATES LTD	18,060	54.40	982,464.00	
	LARSEN & TOUBRO LTD	9,780	1,076.00	10,523,280.00	
	SIEMENS INDIA LIMITED	1,890	658.10	1,243,809.00	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	15,000	159.30	2,389,500.00	
	BAJAJ AUTO LTD	2,400	1,990.35	4,776,840.00	
	HERO MOTOCORP LTD	2,200	2,130.70	4,687,540.00	
	MAHINDRA & MAHINDRA LIMITED	10,600	963.50	10,213,100.00	
	TATA MOTORS LTD	20,500	372.65	7,639,325.00	
	ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	12,780	279.35	3,570,093.00	

	ITC LTD	50,510	319.05	16,115,215.50	
	UNITED SPIRITS LIMITED	1,330	2,522.75	3,355,257.50	
	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	3,700	830.25	3,071,925.00	
	HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	15,520	565.10	8,770,352.00	
	CIPLA LTD	7,650	399.65	3,057,322.50	
	DR. REDDY'S LABORATORIES	2,190	2,539.55	5,561,614.50	
	LUPIN LTD	2,600	918.95	2,389,270.00	
	RANBAXY LABORATORIES LTD	4,755	467.50	2,222,962.50	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	11,000	567.30	6,240,300.00	
	HDFC BANK LTD	33,775	657.30	22,200,307.50	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	32,575	779.90	25,405,242.50	
	ICICI BANK LTD	3,865	1,098.85	4,247,055.25	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	12,000	215.90	2,590,800.00	
	STATE BANK OF INDIA	2,300	1,759.25	4,046,275.00	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	5,810	728.80	4,234,328.00	
	RELIANCE CAPITAL LIMITED	3,510	356.75	1,252,192.50	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	4,000	667.75	2,671,000.00	
	DLF LTD	4,900	170.95	837,655.00	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	3,700	1,237.75	4,579,675.00	
	INFOSYS LTD	10,035	3,486.40	34,986,024.00	
	TATA CONSULTANCY SVS LTD	11,050	2,110.70	23,323,235.00	
	TECH MAHINDRA LTD	2,800	1,832.20	5,130,160.00	
	WIPRO LTD	13,640	540.10	7,366,964.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	10,000	325.65	3,256,500.00	
	IDEA CELLULAR LTD	26,000	168.20	4,373,200.00	
	RELIANCE COMMUNICATION LTD	9,055	131.30	1,188,921.50	
	GAIL INDIA LTD	10,875	338.25	3,678,468.75	
	NTPC LIMITED	31,850	137.80	4,388,930.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	28,300	98.55	2,788,965.00	
	TATA POWER CO LTD	26,000	86.25	2,242,500.00	
	インドルピー小計	656,817		325,359,203.70	(553,110,646)
エジプトポンド	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	24,750	32.88	813,780.00	
	GLOBAL TELECOM HOLDING	60,000	4.80	288,000.00	
		84,750		1,101,780.00	

エジプトポンド小計				(16,614,842)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	3,510	143.14	502,421.40
	SASOL LTD	12,300	504.65	6,207,195.00
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	1,800	179.00	322,200.00
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	1,660	387.00	642,420.00
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	8,520	115.90	987,468.00
	ASSORE LTD	1,300	342.00	444,600.00
	GOLD FIELDS LTD	16,590	31.94	529,884.60
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	11,200	24.64	275,968.00
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	11,430	117.00	1,337,310.00
	KUMBA IRON ORE LTD	1,680	426.01	715,696.80
	NAMPAK LTD	13,000	40.50	526,500.00
	NORTHAM PLATINUM LTD	12,000	40.50	486,000.00
	PPC LTD	14,010	30.85	432,208.50
	SAPPI LIMITED	8,415	30.33	255,226.95
	BARLOWORLD LTD	6,500	95.40	620,100.00
	BIDVEST GROUP LTD	6,372	266.59	1,698,711.48
	REUNERT LTD	6,010	67.65	406,576.50
	STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	25,460	44.70	1,138,062.00
	NASPERS LTD-N SHS	8,910	1,042.11	9,285,200.10
	FOSCHINI GROUP LTD/THE	6,775	99.75	675,806.25
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	3,655	201.00	734,655.00
	MR PRICE GROUP LTD	4,300	160.35	689,505.00
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	8,420	76.50	644,130.00
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	15,405	75.50	1,163,077.50
	MASSMART HOLDINGS LTD	2,739	134.00	367,026.00
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	9,710	163.90	1,591,469.00
	SPAR GROUP LIMITED/THE	4,760	133.19	633,984.40
	TIGER BRANDS LTD	3,490	263.33	919,021.70
	LIFE HEALTHCARE GROUP	20,000	41.91	838,200.00
	MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD	9,000	75.01	675,090.00
NETCARE LTD	16,150	25.75	415,862.50	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	7,341	270.00	1,982,070.00	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	6,900	131.85	909,765.00	
NEDBANK GROUP LTD	3,350	204.37	684,639.50	

STANDARD BANK GROUP LTD	25,316	128.50	3,253,106.00	
AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	18,069	11.30	204,179.70	
FIRSTRAND LTD	75,870	34.04	2,582,614.80	
INVESTEC LTD	6,500	71.36	463,840.00	
REMGRO LTD	9,840	202.33	1,990,927.20	
RMB HOLDINGS LTD	19,830	45.90	910,197.00	
DISCOVERY LTD	5,400	81.75	441,450.00	
LIBERTY HOLDINGS LTD	4,000	119.50	478,000.00	
MMI HOLDINGS LTD	24,429	25.46	621,962.34	
RMI HOLDINGS LTD	19,830	27.00	535,410.00	
SANLAM LTD	41,835	51.96	2,173,746.60	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	41,000	23.79	975,390.00	
REDEFINE PROPERTIES LTD	55,000	9.60	528,000.00	
MTN GROUP LTD	37,115	206.80	7,675,382.00	
VODACOM GROUP LTD	9,035	130.00	1,174,550.00	
南アフリカランド小計	685,731		63,746,806.82 (644,480,216)	
合計	39,720,705		8,725,525,548 (8,725,525,548)	

(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
メキシコ ペソ	投資証券	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	30,000	1,264,200.00	
メキシコペソ小計			30,000	1,264,200.00 (10,126,242)	
トルコリラ	投資証券	EMLAK KONUT GAYRIMEN	26,000	57,980.00	
トルコリラ小計			26,000	57,980.00 (2,907,697)	
合計				13,033,939 (13,033,939)	

(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 38銘柄	100.0%		7.7%
メキシコペソ	株式 24銘柄	97.8%		5.2%
	投資証券 1銘柄		2.2%	0.1%
ブラジルリアル	株式 66銘柄	100.0%		10.0%
チリペソ	株式 17銘柄	100.0%		1.5%
コロンビアペソ	株式 10銘柄	100.0%		0.8%
ユーロ	株式 5銘柄	100.0%		0.4%
トルコリラ	株式 16銘柄	97.9%		1.5%
	投資証券 1銘柄		2.1%	0.0%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%		0.3%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%		0.3%
ポーランドズロチ	株式 17銘柄	100.0%		1.7%
香港ドル	株式 119銘柄	100.0%		19.9%
マレーシアリングット	株式 34銘柄	100.0%		3.8%
タイバーツ	株式 22銘柄	100.0%		2.3%
フィリピンペソ	株式 13銘柄	100.0%		0.9%
インドネシアルピア	株式 20銘柄	100.0%		2.2%
韓国ウォン	株式 91銘柄	100.0%		16.1%
台湾ドル	株式 80銘柄	100.0%		11.4%
インドルピー	株式 54銘柄	100.0%		6.3%
エジプトポンド	株式 2銘柄	100.0%		0.2%
南アフリカランド	株式 49銘柄	100.0%		7.4%

### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

## 日本債券インデックスマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

	平成25年 6月25日現在	平成25年12月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	62,167,054	14,918,980
国債証券	27,068,391,270	26,848,086,383
地方債証券	2,293,018,000	2,308,796,000
特殊債券	2,575,006,000	2,471,920,494
社債券	2,167,130,000	2,276,662,000
未収入金	42,043,600	24,707,840
未収利息	84,282,970	81,648,384
前払費用	2,288,972	1,452,524
流動資産合計	34,294,327,866	34,028,192,605
資産合計	34,294,327,866	34,028,192,605
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	82,487,447	31,218,159
流動負債合計	82,487,447	31,218,159
負債合計	82,487,447	31,218,159
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	27,166,550,228	26,502,576,211
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	7,045,290,191	7,494,398,235
元本等合計	34,211,840,419	33,996,974,446
純資産合計	34,211,840,419	33,996,974,446
負債純資産合計	34,294,327,866	34,028,192,605

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>（1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>（2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>（3）時価が入手できなかった有価証券</p>
-----------------	---

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。

（貸借対照表に関する注記）

		平成25年 6月25日現在	平成25年12月25日現在
1.	期首	平成24年12月26日	平成25年 6月26日
	期首元本額	25,184,836,581円	27,166,550,228円
	期首からの追加設定元本額	3,307,405,354円	954,837,041円
	期首からの一部解約元本額	1,325,691,707円	1,618,811,058円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	540,749,047円	559,030,095円
	DCインデックスバランス（株式40）	693,054,773円	740,003,488円
	DCインデックスバランス（株式60）	484,468,193円	525,570,455円
	DCインデックスバランス（株式80）	85,789,509円	96,161,389円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	1,138,139,567円	1,190,603,624円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	7,844,411,022円	7,013,510,221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	8,629,665円	6,829,716円
	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（債券資産）	63,622,666円	57,197,422円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	7,723,853円	6,669,774円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	42,211,996円	35,660,442円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	182,891,228円	154,502,650円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	630,173,510円	545,923,459円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	7,599,053,524円	7,401,918,468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）	124,277,525円	92,082,898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）	214,514,198円	195,247,030円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	33,102,951円	33,295,646円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	953,299,491円	1,027,503,032円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	923,501,450円	1,015,746,157円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	486,488,051円	529,837,742円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	75,141,925円	80,640,333円
	年金積立 インデックスファンド日本債券	4,873,249,573円	5,028,143,908円
	日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	162,056,511円	166,498,262円
	計	27,166,550,228円	26,502,576,211円
2.	受益権の総数	27,166,550,228口	26,502,576,211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）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成24年12月26日 至 平成25年 6月25日	自 平成25年 6月26日 至 平成25年12月25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

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 6月25日現在	平成25年12月25日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

（平成25年 6月25日現在）

## 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	170,728,400
地方債証券	27,134,000
特殊債証券	22,951,000
社債証券	14,978,000
合計	235,791,400

（平成25年12月25日現在）

## 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	84,538,117
地方債証券	7,606,000
特殊債証券	4,434,506
社債証券	3,154,000
合計	99,732,623

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成25年 6月25日現在		平成25年12月25日現在	
1口当たり純資産額	1.2593円	1口当たり純資産額	1.2828円
(1万口当たり純資産額)	(12,593円)	(1万口当たり純資産額)	(12,828円)

附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第3 2 3 回利付国債（2年）	70,000,000	70,016,458	
	第3 2 4 回利付国債（2年）	100,000,000	100,021,000	
	第3 2 9 回利付国債（2年）	75,000,000	75,126,000	
	第3 3 2 回利付国債（2年）	150,000,000	150,025,500	
	第8 7 回利付国債（5年）	460,000,000	461,896,975	
	第8 8 回利付国債（5年）	140,000,000	140,721,000	
	第8 9 回利付国債（5年）	330,000,000	331,534,500	
	第9 0 回利付国債（5年）	50,000,000	50,158,500	
	第9 1 回利付国債（5年）	50,000,000	50,267,500	
	第9 2 回利付国債（5年）	15,000,000	15,054,450	
	第9 3 回利付国債（5年）	445,000,000	448,604,500	
	第9 4 回利付国債（5年）	70,000,000	70,705,600	
	第9 5 回利付国債（5年）	220,000,000	222,468,400	
	第9 6 回利付国債（5年）	150,000,000	151,350,000	
	第9 7 回利付国債（5年）	350,000,000	352,593,500	
	第9 8 回利付国債（5年）	55,000,000	55,271,700	
	第9 9 回利付国債（5年）	200,000,000	201,578,000	
	第1 0 0 回利付国債（5年）	110,000,000	110,568,700	
	第1 0 1 回利付国債（5年）	170,000,000	171,412,700	
	第1 0 2 回利付国債（5年）	280,000,000	281,495,200	
	第1 0 4 回利付国債（5年）	50,000,000	50,112,000	
	第1 0 5 回利付国債（5年）	100,000,000	100,207,000	
	第1 0 6 回利付国債（5年）	340,000,000	340,629,000	
第1 0 7 回利付国債（5年）	210,000,000	210,289,800		
第1 0 9 回利付国債（5年）	100,000,000	99,664,000		
第1 1 1 回利付国債（5年）	40,000,000	40,369,200		

第112回利付国債（5年）	160,000,000	161,491,200	
第114回利付国債（5年）	90,000,000	90,421,200	
第1回利付国債（40年）	25,000,000	29,488,250	
第2回利付国債（40年）	165,000,000	186,253,650	
第3回利付国債（40年）	20,000,000	22,570,800	
第4回利付国債（40年）	75,000,000	84,610,500	
第5回利付国債（40年）	20,000,000	21,439,800	
第6回利付国債（40年）	50,000,000	52,169,000	
第265回利付国債（10年）	50,000,000	50,692,415	
第266回利付国債（10年）	13,000,000	13,167,335	
第268回利付国債（10年）	361,000,000	367,285,010	
第269回利付国債（10年）	90,000,000	91,345,500	
第270回利付国債（10年）	88,000,000	89,579,600	
第271回利付国債（10年）	146,000,000	148,404,620	
第272回利付国債（10年）	178,000,000	182,029,920	
第273回利付国債（10年）	111,000,000	113,705,070	
第274回利付国債（10年）	143,000,000	146,985,410	
第276回利付国債（10年）	35,000,000	36,044,750	
第278回利付国債（10年）	80,000,000	83,031,200	
第279回利付国債（10年）	30,000,000	31,270,200	
第280回利付国債（10年）	156,000,000	162,943,560	
第281回利付国債（10年）	182,000,000	190,552,180	
第282回利付国債（10年）	24,000,000	25,042,560	
第283回利付国債（10年）	25,000,000	26,154,000	
第284回利付国債（10年）	462,000,000	483,677,040	
第285回利付国債（10年）	261,000,000	274,211,820	
第286回利付国債（10年）	186,000,000	196,724,760	
第287回利付国債（10年）	35,000,000	37,139,200	
第288回利付国債（10年）	18,000,000	19,038,780	
第289回利付国債（10年）	199,000,000	209,547,000	
第290回利付国債（10年）	406,000,000	426,868,400	
第291回利付国債（10年）	287,000,000	300,546,400	
第292回利付国債（10年）	241,000,000	256,421,590	
第293回利付国債（10年）	96,000,000	102,887,040	
第294回利付国債（10年）	32,000,000	34,153,600	

第295回利付国債(10年)	13,000,000	13,759,460	
第296回利付国債(10年)	84,000,000	89,160,120	
第297回利付国債(10年)	148,000,000	156,680,200	
第298回利付国債(10年)	221,000,000	232,872,120	
第299回利付国債(10年)	750,000,000	791,655,000	
第300回利付国債(10年)	36,000,000	38,371,320	
第301回利付国債(10年)	223,000,000	238,130,550	
第302回利付国債(10年)	14,000,000	14,874,160	
第303回利付国債(10年)	581,000,000	618,398,970	
第305回利付国債(10年)	673,000,000	712,956,010	
第306回利付国債(10年)	203,000,000	216,450,780	
第308回利付国債(10年)	140,000,000	148,472,800	
第309回利付国債(10年)	34,000,000	35,626,900	
第310回利付国債(10年)	88,000,000	91,580,720	
第311回利付国債(10年)	93,000,000	95,563,080	
第312回利付国債(10年)	205,000,000	215,916,250	
第313回利付国債(10年)	380,000,000	402,746,800	
第315回利付国債(10年)	85,000,000	89,450,600	
第316回利付国債(10年)	35,000,000	36,579,900	
第317回利付国債(10年)	165,000,000	172,368,900	
第318回利付国債(10年)	205,000,000	212,628,050	
第319回利付国債(10年)	180,000,000	187,999,200	
第320回利付国債(10年)	100,000,000	103,678,000	
第321回利付国債(10年)	215,000,000	222,789,450	
第322回利付国債(10年)	200,000,000	205,590,000	
第323回利付国債(10年)	45,000,000	46,219,500	
第324回利付国債(10年)	75,000,000	76,425,750	
第325回利付国債(10年)	270,000,000	274,706,100	
第326回利付国債(10年)	30,000,000	30,229,800	
第327回利付国債(10年)	140,000,000	142,263,800	
第328回利付国債(10年)	275,000,000	274,158,500	
第329回利付国債(10年)	210,000,000	212,811,900	
第330回利付国債(10年)	240,000,000	242,848,800	
第14回利付国債(30年)	208,000,000	238,160,000	
第15回利付国債(30年)	162,000,000	188,263,440	



第18回利付国債(30年)	80,000,000	90,231,200	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	64,137,700	
第24回利付国債(30年)	158,000,000	184,313,320	
第26回利付国債(30年)	30,000,000	34,472,700	
第27回利付国債(30年)	59,000,000	69,023,510	
第28回利付国債(30年)	14,000,000	16,414,720	
第29回利付国債(30年)	276,000,000	318,509,520	
第30回利付国債(30年)	127,000,000	144,142,460	
第31回利付国債(30年)	60,000,000	66,927,600	
第32回利付国債(30年)	40,000,000	45,509,200	
第33回利付国債(30年)	50,000,000	53,694,000	
第34回利付国債(30年)	165,000,000	184,298,400	
第35回利付国債(30年)	120,000,000	128,848,800	
第36回利付国債(30年)	310,000,000	332,816,000	
第37回利付国債(30年)	70,000,000	73,553,900	
第38回利付国債(30年)	50,000,000	51,377,500	
第39回利付国債(30年)	75,000,000	78,718,500	
第40回利付国債(30年)	60,000,000	61,549,200	
第29回利付国債(20年)	110,000,000	117,827,600	
第31回利付国債(20年)	40,000,000	43,035,600	
第33回利付国債(20年)	200,000,000	220,128,000	
第34回利付国債(20年)	85,000,000	94,205,500	
第37回利付国債(20年)	63,000,000	69,895,980	
第39回利付国債(20年)	86,000,000	94,751,360	
第41回利付国債(20年)	27,000,000	28,770,930	
第42回利付国債(20年)	178,000,000	199,840,600	
第43回利付国債(20年)	73,000,000	83,906,930	
第44回利付国債(20年)	51,000,000	57,841,140	
第47回利付国債(20年)	21,000,000	23,525,040	
第48回利付国債(20年)	99,000,000	113,123,340	
第49回利付国債(20年)	57,000,000	63,654,750	
第50回利付国債(20年)	237,000,000	261,344,640	
第51回利付国債(20年)	39,000,000	43,312,620	
第54回利付国債(20年)	15,000,000	16,963,500	
第55回利付国債(20年)	66,000,000	73,679,760	

第57回利付国債（20年）	137,000,000	152,106,990	
第58回利付国債（20年）	135,000,000	149,995,800	
第59回利付国債（20年）	33,000,000	36,124,110	
第60回利付国債（20年）	545,000,000	582,397,900	
第61回利付国債（20年）	27,000,000	27,883,170	
第63回利付国債（20年）	31,000,000	34,244,150	
第64回利付国債（20年）	54,000,000	60,205,140	
第65回利付国債（20年）	140,000,000	156,255,400	
第66回利付国債（20年）	34,000,000	37,629,160	
第67回利付国債（20年）	84,000,000	93,933,840	
第68回利付国債（20年）	38,000,000	43,627,420	
第70回利付国債（20年）	49,000,000	57,356,460	
第72回利付国債（20年）	42,000,000	47,964,840	
第73回利付国債（20年）	13,000,000	14,730,690	
第74回利付国債（20年）	78,000,000	89,225,760	
第76回利付国債（20年）	151,000,000	169,772,320	
第88回利付国債（20年）	300,000,000	351,858,000	
第90回利付国債（20年）	156,000,000	181,130,040	
第91回利付国債（20年）	260,000,000	305,060,600	
第92回利付国債（20年）	110,000,000	126,370,200	
第94回利付国債（20年）	50,000,000	57,397,000	
第95回利付国債（20年）	32,000,000	37,520,640	
第96回利付国債（20年）	98,000,000	112,406,980	
第97回利付国債（20年）	45,000,000	52,149,150	
第98回利付国債（20年）	44,000,000	50,421,800	
第99回利付国債（20年）	117,000,000	133,935,750	
第100回利付国債（20年）	30,000,000	34,699,800	
第101回利付国債（20年）	66,000,000	78,091,860	
第102回利付国債（20年）	106,000,000	125,323,800	
第103回利付国債（20年）	11,000,000	12,857,460	
第104回利付国債（20年）	33,000,000	37,686,330	
第105回利付国債（20年）	127,000,000	144,843,500	
第106回利付国債（20年）	122,000,000	140,796,540	
第107回利付国債（20年）	80,000,000	91,108,800	
第108回利付国債（20年）	134,000,000	148,935,640	

第109回利付国債（20年）	107,000,000	118,705,800	
第110回利付国債（20年）	98,000,000	111,435,800	
第111回利付国債（20年）	25,000,000	28,732,250	
第113回利付国債（20年）	190,000,000	215,334,600	
第114回利付国債（20年）	52,000,000	58,867,120	
第116回利付国債（20年）	185,000,000	211,708,450	
第117回利付国債（20年）	30,000,000	33,897,300	
第118回利付国債（20年）	70,000,000	77,919,100	
第119回利付国債（20年）	50,000,000	54,164,500	
第120回利付国債（20年）	70,000,000	73,750,600	
第121回利付国債（20年）	22,000,000	24,095,280	
第122回利付国債（20年）	80,000,000	86,447,200	
第123回利付国債（20年）	55,000,000	61,764,450	
第124回利付国債（20年）	50,000,000	55,408,000	
第125回利付国債（20年）	50,000,000	56,813,500	
第126回利付国債（20年）	25,000,000	27,638,000	
第128回利付国債（20年）	35,000,000	38,045,000	
第129回利付国債（20年）	115,000,000	123,276,550	
第130回利付国債（20年）	80,000,000	85,516,800	
第131回利付国債（20年）	25,000,000	26,327,000	
第132回利付国債（20年）	90,000,000	94,489,200	
第133回利付国債（20年）	30,000,000	31,976,400	
第134回利付国債（20年）	30,000,000	31,881,300	
第135回利付国債（20年）	30,000,000	31,398,000	
第136回利付国債（20年）	210,000,000	216,411,300	
第137回利付国債（20年）	140,000,000	146,165,600	
第138回利付国債（20年）	50,000,000	50,548,500	
第140回利付国債（20年）	280,000,000	291,382,000	
第141回利付国債（20年）	215,000,000	223,000,150	
第142回利付国債（20年）	25,000,000	26,341,500	
第143回利付国債（20年）	115,000,000	117,065,400	
第144回利付国債（20年）	40,000,000	40,059,600	
第145回利付国債（20年）	125,000,000	128,962,500	
第146回利付国債（20年）	95,000,000	97,743,600	
国債証券 合計	25,243,000,000	26,848,086,383	

地方債証券	第 6 3 6 回東京都公募公債	100,000,000	104,693,000	
	第 6 8 2 回東京都公募公債	100,000,000	105,850,000	
	第 7 0 8 回東京都公募公債	100,000,000	102,133,000	
	第 1 回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	117,670,000	
	平成 2 4 年度第 2 回京都府公募公債	200,000,000	204,506,000	
	平成 1 9 年度第 4 回兵庫県公募公債	100,000,000	105,900,000	
	平成 1 9 年度第 1 回静岡県公募公債	100,000,000	105,398,000	
	平成 2 1 年度第 5 回静岡県公募公債	100,000,000	105,849,000	
	平成 1 8 年度第 1 回広島県公募公債	100,000,000	105,150,000	
	平成 2 4 年度第 1 回埼玉県公募公債	100,000,000	103,447,000	
	平成 2 4 年度第 1 0 回埼玉県公募公債	100,000,000	101,118,000	
	平成 2 3 年度第 4 回福岡県公募公債	100,000,000	100,536,000	
	平成 2 4 年度第 9 回福岡県公募公債	100,000,000	100,251,000	
	平成 1 7 年度第 1 回新潟県公募公債	100,000,000	101,817,000	
	第 5 5 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,268,000	
	第 5 6 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,869,000	
	平成 2 4 年度第 1 回長崎県公募公債	100,000,000	101,288,000	
	第 4 回京都市公募公債(20年)	100,000,000	118,457,000	
	平成 2 3 年度第 1 4 回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	104,642,000	
	平成 1 8 年度第 1 回鹿児島県公募公債(10年)	100,000,000	104,891,000	
平成 2 3 年度第 2 回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	103,063,000		
地方債証券 合計	2,200,000,000	2,308,796,000		
特殊債券	第 2 回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	105,678,000	
	第 5 回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	105,929,000	
	第 6 回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	105,129,000	
	第 1 4 回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,347,000	
	第 2 1 回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,745,000	
	第 2 9 回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,881,000	
	第 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,127,000	
	第 3 3 5 回政府保証道路債券	100,000,000	101,279,494	
	第 3 3 6 回政府保証道路債券	100,000,000	101,402,000	
	第 3 3 8 回政府保証道路債券	100,000,000	101,731,000	
	第 3 4 3 回政府保証道路債券	100,000,000	101,781,000	
	第 4 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,288,000	
	第 2 0 回公営企業債券	100,000,000	104,627,000	

	第 8 5 8 回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,733,000	
	第 1 9 9 回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	102,120,000	
	第 2 5 回国際協力銀行債券	100,000,000	104,091,000	
	第 8 回農林漁業金融公庫債券	200,000,000	203,146,000	
	第 5 回沖縄振興開発金融公庫債券	200,000,000	202,900,000	
	い第 7 2 2 号農林債	100,000,000	100,584,000	
	い第 7 4 5 号農林債	100,000,000	100,364,000	
	第 2 6 7 回信金中金債(5年)	100,000,000	100,772,000	
	第 2 7 2 回信金中金債(5年)	100,000,000	100,266,000	
特殊債券 合計		2,400,000,000	2,471,920,494	
社債券	第 3 2 4 回東京交通債券	100,000,000	109,804,000	
	第 5 回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債(2010)	100,000,000	101,083,000	
	第 6 回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債(2011)	100,000,000	101,470,000	
	第 8 回帝人株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,247,000	
	第 2 8 回東レ株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,613,000	
	第 3 2 回住友化学株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,594,000	
	第 1 2 回武田薬品工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,590,000	
	第 2 回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,535,000	
	第 6 回株式会社資生堂無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,484,000	
	第 1 5 回株式会社豊田自動織機無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,509,000	
	第 1 5 回ダイキン工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,978,000	
	第 1 1 回パナソニック株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,685,000	
	第 1 8 回株式会社ニコン無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,603,000	
	第 2 6 回三井不動産株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	104,805,000	
	第 6 5 回三菱地所株式会社無担保社債(担保提供制限等財務上特約無)	100,000,000	105,140,000	

第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	108,517,000	
第25回日本郵船株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	112,565,000	
第7回KDDI株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,252,000	
第523回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	96,009,000	
第306回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	109,178,000	
第257回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,258,000	
第19回沖縄電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,743,000	
社債券 合計	2,200,000,000	2,276,662,000	
合計	32,043,000,000	33,905,464,877	

## 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。

## 海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド

### 貸借対照表

(単位:円)

	平成25年 6月25日現在	平成25年12月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	213,352,502	2,056,638,684
コール・ローン	61,117,838	1,335,659,086
国債証券	227,535,666,633	214,440,240,867
派生商品評価勘定	1,256,593	630,729
未収入金	467,939,537	703,163,433
未収利息	2,895,493,292	2,738,722,707
前払費用	123,048,794	105,572,026
流動資産合計	231,297,875,189	221,380,627,532
<b>資産合計</b>		
231,297,875,189		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	376,382	621,972
未払解約金	384,968,497	2,382,908,606

	平成25年 6月25日現在	平成25年12月25日現在
流動負債合計	385,344,879	2,383,530,578
負債合計	385,344,879	2,383,530,578
純資産の部		
元本等		
元本	125,714,410,166	107,766,135,540
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	105,198,120,144	111,230,961,414
元本等合計	230,912,530,310	218,997,096,954
純資産合計	230,912,530,310	218,997,096,954
負債純資産合計	231,297,875,189	221,380,627,532

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 6月25日現在	平成25年12月25日現在
1. 期首	平成24年12月26日	平成25年 6月26日
期首元本額	142,352,514,513円	125,714,410,166円
期首からの追加設定元本額	1,983,278,302円	747,792,362円
期首からの一部解約元本額	18,621,382,649円	18,696,066,988円
元本の内訳		
インデックスファンド海外債券ヘッジなし(DC専用)	10,147,957,063円	10,148,350,812円
DCインデックスバランス(株式20)	56,536,414円	54,668,164円
DCインデックスバランス(株式40)	103,422,104円	106,838,225円

DCインデックスバランス（株式60）	130,019,289円	134,395,532円
DCインデックスバランス（株式80）	116,441,137円	122,352,373円
財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	37,986,519,810円	33,542,555,035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	5,195,117,265円	4,443,863,369円
日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	57,121,562,352円	45,667,919,249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	43,825,482円	33,222,466円
日興外国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,270,261,385円	1,201,701,062円
財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	14,535,012円	24,016,114円
日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（債券資産）	35,071,945円	29,938,248円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	5,272,062円	4,205,569円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	5,686,757円	4,513,260円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	13,565,652円	10,824,679円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	32,889,735円	26,478,938円
世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	797,810,792円	894,265,254円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,699,112,642円	1,618,220,341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）	112,976,941円	82,647,975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）	159,324,694円	143,077,417円
グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	49,347,835円	49,603,666円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	49,494,867円	50,621,027円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	68,525,955円	73,495,451円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	65,108,520円	67,820,073円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	50,618,234円	51,820,196円
年金積立 インデックスファンド海外債券（ヘッジなし）	10,157,692,896円	8,957,130,129円
海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	225,713,326円	221,590,916円
計	125,714,410,166円	107,766,135,540円
2. 受益権の総数	125,714,410,166口	107,766,135,540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）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成24年12月26日 至 平成25年 6月25日	自 平成25年 6月26日 至 平成25年12月25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

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 6月25日現在	平成25年12月25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25年 6月25日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	6,526,253,666
合計	6,526,253,666

(平成25年12月25日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	2,598,737,313
合計	2,598,737,313

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(平成25年 6月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	653,423,571	-	652,543,360	880,211
	米ドル	210,202,425	-	210,141,000	61,425
	加ドル	18,976,916	-	18,980,160	3,244
	メキシコペソ	86,597,725	-	86,465,200	132,525
	ユーロ	262,311,626	-	261,711,600	600,026
	英ポンド	43,569,504	-	43,476,480	93,024
	ポーランドズロチ	31,765,375	-	31,768,920	3,545
合計		653,423,571	-	652,543,360	880,211

(平成25年12月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	2,709,695,057	-	2,709,686,300	8,757
	米ドル	1,063,895,580	-	1,064,268,000	372,420
	メキシコペソ	88,871,569	-	88,744,000	127,569
	ユーロ	1,291,854,180	-	1,291,412,400	441,780
	英ポンド	124,718,079	-	124,849,920	131,841
	スイスフラン	27,131,918	-	27,135,180	3,262
	スウェーデンクローナ	36,151,569	-	36,176,660	25,091
	シンガポールドル	21,155,957	-	21,156,240	283
	南アフリカランド	55,916,205	-	55,943,900	27,695
	合計	2,709,695,057	-	2,709,686,300	8,757

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

平成25年 6月25日現在		平成25年12月25日現在	
1口当たり純資産額	1.8368円	1口当たり純資産額	2.0322円
(1万口当たり純資産額)	(18,368円)	(1万口当たり純資産額)	(20,322円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-2.125%-14/11/30	10,700,000.00	10,893,937.50	
		US TREASURY N/B-2.625%-14/12/31	22,900,000.00	23,463,554.68	
		US TREASURY N/B-2.25%-15/01/31	14,700,000.00	15,031,898.43	
		US TREASURY N/B-11.25%-15/02/15	3,000,000.00	3,376,640.62	
		US TREASURY N/B-4.0%-15/02/15	32,700,000.00	34,112,742.18	
		US TREASURY N/B-2.375%-15/02/28	2,300,000.00	2,358,757.81	
		US TREASURY N/B-2.5%-15/03/31	13,000,000.00	13,369,687.50	
		US TREASURY N/B-2.5%-15/04/30	26,000,000.00	26,790,156.25	
		US TREASURY N/B-4.125%-15/05/15	23,100,000.00	24,339,820.31	
		US TREASURY N/B-2.125%-15/05/31	9,500,000.00	9,750,859.37	
		US TREASURY N/B-4.25%-15/08/15	22,200,000.00	23,625,656.25	
		US TREASURY N/B-4.5%-15/11/15	22,200,000.00	23,922,234.37	
		US TREASURY N/B-2.125%-15/12/31	14,300,000.00	14,792,679.68	
		US TREASURY N/B-4.5%-16/02/15	17,700,000.00	19,229,390.62	
		US TREASURY N/B-5.125%-16/05/15	19,600,000.00	21,722,312.50	
		US TREASURY N/B-7.25%-16/05/15	9,000,000.00	10,429,453.12	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/05/31	16,500,000.00	17,568,632.81	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/06/30	10,000,000.00	10,667,968.74	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/07/31	4,200,000.00	4,484,156.25	
		US TREASURY N/B-4.875%-16/08/15	8,000,000.00	8,893,750.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-16/08/31	4,000,000.00	4,248,750.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-16/09/30	5,200,000.00	5,525,812.50	
		US TREASURY N/B-3.125%-16/10/31	6,900,000.00	7,361,437.50	
		US TREASURY N/B-4.625%-16/11/15	6,000,000.00	6,661,406.25	
		US TREASURY N/B-7.5%-16/11/15	9,700,000.00	11,568,765.62	
		US TREASURY N/B-2.75%-16/11/30	1,000,000.00	1,056,796.87	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/12/31	8,700,000.00	9,328,031.25	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/01/31	9,000,000.00	9,620,156.25	
US TREASURY N/B-4.625%-17/02/15	9,250,000.00	10,318,808.59			

US TREASURY N/B-3.0%-17/02/28	5,400,000.00	5,753,109.37	
US TREASURY N/B-3.25%-17/03/31	8,800,000.00	9,453,812.50	
US TREASURY N/B-3.125%-17/04/30	7,000,000.00	7,486,171.87	
US TREASURY N/B-4.5%-17/05/15	8,800,000.00	9,820,937.50	
US TREASURY N/B-8.75%-17/05/15	8,000,000.00	10,064,375.00	
US TREASURY N/B-2.75%-17/05/31	8,800,000.00	9,312,875.00	
US TREASURY N/B-2.5%-17/06/30	4,000,000.00	4,196,562.50	
US TREASURY N/B-4.75%-17/08/15	10,100,000.00	11,407,476.56	
US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	9,800,000.00	10,918,578.12	
US TREASURY N/B-2.75%-17/12/31	14,500,000.00	15,320,156.25	
US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	15,700,000.00	17,052,898.43	
US TREASURY N/B-2.75%-18/02/28	12,500,000.00	13,208,984.37	
US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	7,550,000.00	8,328,593.75	
US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	12,600,000.00	13,989,937.50	
US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	15,200,000.00	16,696,250.00	
US TREASURY N/B-8.875%-19/02/15	5,000,000.00	6,765,234.37	
US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	5,600,000.00	5,870,375.00	
US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	4,400,000.00	4,692,531.25	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	3,000,000.00	3,272,109.37	
US TREASURY N/B-8.125%-19/08/15	9,000,000.00	12,003,046.87	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	13,800,000.00	14,853,328.12	
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	16,300,000.00	17,751,718.75	
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	10,000,000.00	10,790,625.00	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	7,950,000.00	11,170,992.18	
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	2,000,000.00	2,040,468.75	
US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	2,500,000.00	2,542,968.75	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	16,400,000.00	17,706,875.00	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	12,000,000.00	16,692,187.50	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	9,300,000.00	8,643,914.06	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	8,500,000.00	7,673,906.25	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,500,000.00	5,291,171.87	
US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,700,000.00	3,616,945.31	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	3,100,000.00	4,045,742.18	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	3,800,000.00	5,094,078.12	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	3,500,000.00	4,308,007.81	

		US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	2,900,000.00	3,473,882.81	
		US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	3,500,000.00	3,834,687.50	
		US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	3,900,000.00	4,353,984.37	
		US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	6,300,000.00	6,765,117.18	
		US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	8,000,000.00	8,931,875.00	
		US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	7,000,000.00	7,668,828.12	
		US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	8,100,000.00	9,216,281.25	
		US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	7,800,000.00	8,535,515.62	
		US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	4,900,000.00	4,942,492.18	
		US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	6,700,000.00	7,189,414.06	
		US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,600,000.00	1,856,250.00	
		US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	5,300,000.00	5,797,703.12	
		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	5,100,000.00	5,013,140.62	
		US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	1,727,343.75	
		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	6,300,000.00	5,150,250.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	5,700,000.00	5,429,250.00	
	米ドル小計		739,550,000.00	802,237,214.63 (83,713,453,346)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-14/12/01	1,200,000.00	1,211,100.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-15/02/01	3,080,000.00	3,079,846.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-15/06/01	2,100,000.00	2,143,155.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.5%-15/06/01	3,400,000.00	3,565,478.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-15/11/01	1,100,000.00	1,098,183.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-15/12/01	2,350,000.00	2,433,542.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-16/06/01	4,900,000.00	5,232,808.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-16/06/01	1,200,000.00	1,224,300.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-16/09/01	500,000.00	519,725.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-17/06/01	4,800,000.00	5,205,744.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/03/01	1,900,000.00	1,861,202.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	2,220,000.00	2,452,300.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/09/01	650,000.00	631,150.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	2,600,000.00	2,830,490.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	2,070,000.00	2,234,295.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	1,650,000.00	1,748,191.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	1,850,000.00	1,871,090.00	

		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	2,000,000.00	1,798,600.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	820,000.00	795,998.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	700,000.00	1,091,461.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	1,300,000.00	1,735,006.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	1,850,000.00	2,554,739.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	2,050,000.00	2,668,218.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	2,260,000.00	2,589,960.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	2,050,000.00	2,170,089.00	
加ドル小計			50,600,000.00	54,746,674.70	(5,390,905,057)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-9.5%-14/12/18	29,300,000.00	31,150,998.20	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-15/12/17	32,100,000.00	34,654,229.42	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.25%- 16/06/16	3,700,000.00	3,892,123.94	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%- 16/12/15	25,600,000.00	27,596,391.42	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-17/06/15	4,000,000.00	4,045,919.36	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 17/12/14	17,000,000.00	18,771,696.99	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	26,800,000.00	29,992,831.66	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	4,000,000.00	4,436,587.56	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	30,200,000.00	38,473,130.24	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	6,000,000.00	6,379,041.54	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	28,700,000.00	32,406,078.35	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	6,100,000.00	6,350,758.43	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	11,900,000.00	15,105,031.64	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	21,300,000.00	23,325,673.45	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	5,200,000.00	5,263,937.58	
メキシコペソ小計			251,900,000.00	281,844,429.78	(2,257,573,882)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-3.5%-15/03/28	1,150,000.00	1,196,082.45	
		BELGIUM KINGDOM-8.0%-15/03/28	1,350,000.00	1,478,991.01	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-15/09/28	1,720,000.00	1,824,148.92	

BELGIUM KINGDOM-2.75%-16/03/28	1,500,000.00	1,578,133.95
BELGIUM KINGDOM-3.25%-16/09/28	2,090,000.00	2,244,792.08
BELGIUM KINGDOM-4.0%-17/03/28	2,430,000.00	2,686,172.30
BELGIUM KINGDOM-3.5%-17/06/28	250,000.00	273,203.95
BELGIUM KINGDOM-5.5%-17/09/28	2,130,000.00	2,492,309.16
BELGIUM KINGDOM-4.0%-18/03/28	3,130,000.00	3,514,727.39
BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	2,050,000.00	2,324,781.79
BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	2,700,000.00	3,037,073.94
BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	2,270,000.00	2,630,328.45
BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	2,050,000.00	2,331,787.87
BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,500,000.00	1,730,826.90
BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	1,450,000.00	1,699,965.79
BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	2,640,000.00	3,412,285.27
BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	850,000.00	942,554.63
BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	2,690,000.00	3,393,899.02
BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	2,130,000.00	2,456,020.78
BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	850,000.00	891,474.39
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 15/01/31	5,200,000.00	5,379,065.12
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.0%- 15/04/30	1,300,000.00	1,329,104.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%- 15/07/30	4,620,000.00	4,807,937.90
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.75%- 15/10/31	1,000,000.00	1,040,567.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%- 16/01/31	4,300,000.00	4,428,806.07
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.25%- 16/04/30	3,750,000.00	3,870,690.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.25%- 16/10/31	4,700,000.00	4,982,667.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 17/01/31	2,550,000.00	2,675,011.45
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 17/07/30	3,750,000.00	4,151,597.25
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.5%- 18/01/31	1,900,000.00	2,039,227.63
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%-	3,700,000.00	3,921,542.31



18/07/30		
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.75%- 18/10/31	600,000.00	623,329.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%- 19/07/30	2,900,000.00	3,120,895.32
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%- 19/10/31	3,000,000.00	3,175,802.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%- 20/04/30	3,000,000.00	3,098,137.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%- 20/10/31	2,800,000.00	3,016,506.92
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	3,800,000.00	4,222,621.94
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	1,100,000.00	1,243,626.12
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%- 23/01/31	2,000,000.00	2,189,165.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	1,250,000.00	1,268,349.25
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	3,100,000.00	3,238,570.62
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,500,000.00	1,531,770.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,700,000.00	1,926,895.43
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	2,430,000.00	2,763,911.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	2,420,000.00	2,706,467.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	2,750,000.00	2,469,567.65
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	2,150,000.00	2,118,759.42
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	2,100,000.00	2,003,884.89
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	400,000.00	403,900.00
BUNDESobligation-2.5%-15/02/27	4,500,000.00	4,615,276.95
BUNDESobligation-2.25%-15/04/10	8,000,000.00	8,195,727.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 15/01/04	4,200,000.00	4,352,534.76
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-	5,000,000.00	5,228,436.00

15/07/04			
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%- 16/01/04	3,350,000.00	3,569,488.65	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.0%- 16/06/20	5,200,000.00	5,921,045.52	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 16/07/04	5,460,000.00	5,964,874.73	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 17/01/04	5,750,000.00	6,331,132.95	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 17/07/04	6,650,000.00	7,507,678.43	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 18/01/04	6,200,000.00	7,019,782.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 18/07/04	5,600,000.00	6,464,914.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 19/01/04	3,100,000.00	3,529,311.87	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%- 19/07/04	4,200,000.00	4,759,011.18	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 20/01/04	4,300,000.00	4,828,310.47	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%- 20/07/04	4,800,000.00	5,326,482.72	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	8,450,000.00	9,523,250.55	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 21/09/04	200,000.00	211,254.78	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	2,000,000.00	2,066,930.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 22/07/04	300,000.00	302,146.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	500,000.00	487,506.85	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	1,000,000.00	969,935.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	1,950,000.00	2,723,564.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,800,000.00	2,677,799.16	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	2,200,000.00	3,049,055.46	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-	1,930,000.00	2,479,669.01	

28/07/04			
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	1,640,000.00	2,446,689.26	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	2,650,000.00	3,713,595.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	3,600,000.00	4,780,357.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	3,900,000.00	4,751,326.32	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	3,100,000.00	3,977,961.23	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	3,350,000.00	4,638,188.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	1,500,000.00	1,662,302.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,450,000.00	1,390,165.46	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 15/02/01	4,500,000.00	4,657,446.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 15/04/15	1,000,000.00	1,024,187.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 15/06/15	1,600,000.00	1,641,786.56	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 15/07/15	2,450,000.00	2,571,081.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 15/08/01	10,550,000.00	10,960,545.86	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 15/11/01	700,000.00	721,666.82	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 16/04/15	4,000,000.00	4,196,249.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 16/08/01	9,000,000.00	9,463,852.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 17/02/01	6,700,000.00	7,096,463.79	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 17/08/01	7,400,000.00	8,148,973.98	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/02/01	4,200,000.00	4,526,673.06	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/06/01	1,000,000.00	1,037,948.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-	4,200,000.00	4,540,890.48	

18/08/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/02/01	4,000,000.00	4,272,430.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 19/03/01	4,050,000.00	4,367,641.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/09/01	3,590,000.00	3,824,806.82	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 20/02/01	3,300,000.00	3,538,351.74	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 20/03/01	3,300,000.00	3,494,371.98	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	4,050,000.00	4,236,181.74	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	5,100,000.00	5,194,290.84	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 21/09/01	5,400,000.00	5,823,863.82	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	2,400,000.00	2,609,183.04	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,500,000.00	1,676,763.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	500,000.00	558,862.65	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	500,000.00	519,579.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,000,000.00	1,062,950.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	5,410,000.00	7,579,159.51	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,000,000.00	1,029,367.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	3,400,000.00	3,625,111.28	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	3,800,000.00	4,847,706.74	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	5,600,000.00	6,736,162.16	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	4,700,000.00	5,039,768.17	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	5,100,000.00	5,887,915.83	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%-	2,400,000.00	2,710,288.08	

33/02/01		
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	2,300,000.00	2,372,294.06
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	3,200,000.00	2,920,208.64
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	4,300,000.00	4,410,059.79
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	3,200,000.00	3,267,104.32
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,000,000.00	980,753.00
FINNISH GOVERNMENT-4.25%-15/07/04	760,000.00	806,259.37
FINNISH GOVERNMENT-1.75%-16/04/15	880,000.00	907,639.12
FINNISH GOVERNMENT-3.875%-17/09/15	1,420,000.00	1,581,400.60
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	1,050,000.00	1,223,966.83
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	1,320,000.00	1,469,447.10
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	1,050,000.00	1,178,377.62
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	200,000.00	194,465.86
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	220,000.00	209,536.60
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	1,380,000.00	1,604,114.07
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	400,000.00	406,959.04
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	440,000.00	423,279.73
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-15/04/25	6,150,000.00	6,413,129.59
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-15/10/25	6,760,000.00	7,094,722.07
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-16/04/25	7,950,000.00	8,474,932.93
FRANCE (GOVT OF)-5.0%-16/10/25	6,710,000.00	7,556,605.39
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-17/04/25	8,200,000.00	9,031,348.80
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-17/10/25	6,250,000.00	7,057,195.00
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-18/04/25	5,100,000.00	5,753,649.15
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-18/05/25	4,600,000.00	4,597,606.16
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-18/10/25	2,300,000.00	2,637,194.03
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25	4,900,000.00	5,647,276.95
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-19/10/25	1,050,000.00	1,465,195.93
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	4,500,000.00	5,089,679.10
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	6,400,000.00	7,160,077.44
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	3,000,000.00	3,164,419.80
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	5,570,000.00	6,318,849.73

FRANCE (GOVT OF) -3.25%-21/10/25	5,500,000.00	6,033,965.30	
FRANCE (GOVT OF) -3.0%-22/04/25	4,350,000.00	4,671,286.65	
FRANCE (GOVT OF) -2.25%-22/10/25	900,000.00	905,726.79	
FRANCE (GOVT OF) -8.5%-23/04/25	4,000,000.00	6,105,149.60	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-23/05/25	1,400,000.00	1,336,071.38	
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-23/10/25	4,150,000.00	4,829,182.36	
FRANCE (GOVT OF) -6.0%-25/10/25	3,800,000.00	5,097,099.60	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-26/04/25	4,600,000.00	4,974,291.42	
FRANCE (GOVT OF) -2.75%-27/10/25	1,000,000.00	986,284.10	
FRANCE (GOVT OF) -5.5%-29/04/25	3,070,000.00	4,037,312.79	
FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	4,200,000.00	5,806,942.26	
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	3,350,000.00	4,164,841.27	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	3,250,000.00	3,655,804.42	
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	4,490,000.00	5,456,356.65	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	2,350,000.00	2,647,605.41	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	1,150,000.00	1,301,138.17	
FRENCH TREASURY NOTE-2.5%-15/01/15	1,200,000.00	1,228,469.04	
FRENCH TREASURY NOTE-2.0%-15/07/12	2,100,000.00	2,155,934.55	
FRENCH TREASURY NOTE-2.25%-16/02/25	2,100,000.00	2,185,339.59	
IRISH TREASURY-4.5%-15/02/18	520,000.00	545,124.52	
IRISH TREASURY-4.6%-16/04/18	1,470,000.00	1,593,009.74	
IRISH TREASURY-5.5%-17/10/18	800,000.00	910,230.32	
IRISH TREASURY-4.5%-18/10/18	1,350,000.00	1,496,147.89	
IRISH TREASURY-4.4%-19/06/18	1,000,000.00	1,099,307.50	
IRISH TREASURY-5.9%-19/10/18	1,000,000.00	1,175,900.00	
IRISH TREASURY-4.5%-20/04/18	1,750,000.00	1,915,371.67	
IRISH TREASURY-5.0%-20/10/18	1,300,000.00	1,460,504.76	
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	650,000.00	673,642.64	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	1,670,000.00	1,897,564.05	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-15/01/15	2,980,000.00	3,058,680.64	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-15/07/15	3,600,000.00	3,766,395.24	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-16/07/15	3,950,000.00	4,306,332.66	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.5%-17/07/15	4,280,000.00	4,840,917.54	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-18/01/15	220,000.00	223,452.21	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	3,420,000.00	3,867,247.08	

		NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	2,600,000.00	2,981,672.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	2,550,000.00	2,866,684.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	2,100,000.00	2,321,613.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	500,000.00	511,095.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	2,200,000.00	2,508,143.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	1,500,000.00	2,175,210.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	200,000.00	192,786.66	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	2,070,000.00	2,782,653.39	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	500,000.00	479,025.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	2,480,000.00	2,976,517.82	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	2,400,000.00	2,824,240.31	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-15/07/15	2,050,000.00	2,151,738.63	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.0%-16/09/15	1,720,000.00	1,883,904.82	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.2%-17/02/20	1,550,000.00	1,672,921.66	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-17/09/15	1,040,000.00	1,173,263.83	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	1,520,000.00	1,748,369.51	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.15%-18/10/19	500,000.00	501,556.55	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	2,400,000.00	2,779,105.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.95%-19/06/18	220,000.00	228,157.16	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	1,780,000.00	2,039,693.99	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	2,060,000.00	2,308,298.59	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	1,100,000.00	1,240,868.86	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	1,400,000.00	1,551,714.92	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	280,000.00	268,877.84	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	1,100,000.00	1,372,464.83	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	1,000,000.00	1,416,026.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,710,000.00	2,068,558.95	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	550,000.00	573,752.02	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	580,000.00	704,858.45	
	ユーロ小計		589,070,000.00	656,706,320.01 (93,613,485,917)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-2.75%-15/01/22	950,000.00	972,531.53	
		UK TREASURY-4.75%-15/09/07	2,730,000.00	2,920,920.91	
		UK TREASURY-8.0%-15/12/07	4,130,000.00	4,721,724.92	
		UK TREASURY-2.0%-16/01/22	400,000.00	410,280.00	

		UK TREASURY-4.0%-16/09/07	6,290,000.00	6,804,160.95	
		UK TREASURY-1.75%-17/01/22	2,200,000.00	2,238,583.82	
		UK TREASURY-8.75%-17/08/25	3,700,000.00	4,666,793.35	
		UK TREASURY-1.0%-17/09/07	1,000,000.00	983,800.00	
		UK TREASURY-5.0%-18/03/07	3,250,000.00	3,693,993.55	
		UK TREASURY-1.25%-18/07/22	2,250,000.00	2,193,701.40	
		UK TREASURY-4.5%-19/03/07	3,650,000.00	4,096,696.12	
		UK TREASURY-3.75%-19/09/07	2,150,000.00	2,332,460.18	
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	4,000,000.00	4,576,411.60	
		UK TREASURY-3.75%-20/09/07	1,600,000.00	1,735,518.40	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	2,550,000.00	3,499,077.61	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	2,300,000.00	2,487,131.91	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	3,000,000.00	3,293,263.20	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	1,200,000.00	1,102,265.52	
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	900,000.00	845,222.94	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	2,390,000.00	2,810,884.25	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	1,950,000.00	2,145,998.40	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	1,510,000.00	1,976,532.01	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	2,500,000.00	2,916,161.75	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	3,000,000.00	3,306,270.00	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	3,900,000.00	4,440,183.93	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,900,000.00	2,093,137.46	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,550,000.00	1,844,978.79	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,950,000.00	2,156,186.56	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	3,250,000.00	3,597,972.30	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	3,150,000.00	3,646,795.32	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,220,000.00	1,127,255.84	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	3,450,000.00	3,860,663.85	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	3,100,000.00	3,503,919.77	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	500,000.00	513,848.50	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	3,420,000.00	3,920,610.70	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,700,000.00	1,863,769.33	
		英債券小計	88,690,000.00	99,299,706.67 (16,937,550,966)	
スイス	国債証券	SWITZERLAND-2.5%-16/03/12	1,610,000.00	1,703,410.59	



ラン		SWITZERLAND-4.25%-17/06/05	1,500,000.00	1,716,235.50	
		SWITZERLAND-2.25%-20/07/06	400,000.00	441,315.60	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	2,520,000.00	3,165,064.56	
スイスフラン小計			6,030,000.00	7,026,026.25	(818,251,017)
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-4.5%-15/08/12	10,180,000.00	10,778,472.02	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.0%-16/07/12	7,500,000.00	7,857,367.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.75%-17/08/12	9,700,000.00	10,505,846.90	
		SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	12,000,000.00	13,479,960.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	8,300,000.00	9,858,333.30	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	9,000,000.00	9,845,199.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	3,850,000.00	3,534,292.30	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	8,600,000.00	9,071,434.80	
スウェーデンクローナ小計			69,130,000.00	74,930,905.82	(1,189,153,475)
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-5.0%-15/05/15	10,900,000.00	11,430,274.10	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.25%-17/05/19	8,950,000.00	9,657,220.05	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	7,050,000.00	7,824,097.05	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	8,950,000.00	9,585,432.10	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	5,000,000.00	4,626,005.00	
ノルウェークローネ小計			40,850,000.00	43,123,028.30	(730,935,329)
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-4.0%-15/11/15	11,750,000.00	12,599,971.50	
		KINGDOM OF DENMARK-2.5%-16/11/15	600,000.00	637,909.20	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-17/11/15	14,500,000.00	16,407,591.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	18,000,000.00	20,929,176.00	
		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	500,000.00	554,137.50	
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	10,500,000.00	10,140,952.50	
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	4,350,000.00	6,529,915.50	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	17,550,000.00	23,689,902.60	
デンマーククローネ小計			77,750,000.00	91,489,555.80	(1,748,365,411)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-15/04/25	5,500,000.00	5,700,475.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.25%-15/10/24	4,500,000.00	4,771,800.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-16/04/25	6,550,000.00	6,838,200.00	

		POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-16/10/25	2,800,000.00	2,922,640.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-17/04/25	2,100,000.00	2,198,385.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	7,500,000.00	8,005,500.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-18/04/25	900,000.00	910,125.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-18/07/25	1,900,000.00	1,817,255.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	4,100,000.00	4,464,080.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	4,000,000.00	4,307,800.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	3,200,000.00	3,543,200.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	3,900,000.00	4,323,735.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	2,350,000.00	2,298,300.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	1,950,000.00	2,181,757.50	
ポーランドズロチ小計			51,250,000.00	54,283,252.50	(1,867,886,718)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.25%-15/04/15	2,850,000.00	2,986,908.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-15/10/21	1,240,000.00	1,286,704.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-16/06/15	2,950,000.00	3,089,508.45	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.0%-17/02/15	3,070,000.00	3,350,017.77	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-17/07/21	1,600,000.00	1,663,451.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-18/01/21	2,600,000.00	2,824,416.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	2,220,000.00	2,410,507.08	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	2,650,000.00	2,774,239.95	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	2,630,000.00	2,945,121.34	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	2,450,000.00	2,748,681.95	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	2,810,000.00	3,105,249.51	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	1,750,000.00	1,533,749.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	1,000,000.00	904,927.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,420,000.00	1,455,786.84	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	950,000.00	806,280.20	
AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	750,000.00	721,824.00			
豪ドル小計			32,940,000.00	34,607,373.59	(3,221,600,407)
シンガ ポールド ル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-15/07/01	1,210,000.00	1,254,407.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.125%-16/04/01	500,000.00	507,649.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.75%-16/09/01	900,000.00	979,290.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-17/04/01	670,000.00	707,922.00	

		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-18/04/01	100,000.00	97,870.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	770,000.00	865,480.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01	700,000.00	728,980.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	950,000.00	1,014,315.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	100,000.00	99,560.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	580,000.00	608,478.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	650,000.00	661,700.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	760,000.00	804,004.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	500,000.00	490,150.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	130,000.00	136,171.36	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	470,000.00	441,706.00	
シンガポールドル小計			8,990,000.00	9,397,682.86 (773,711,229)	
マレーシア アリン ギット	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT-3.741%-15/02/27	2,200,000.00	2,212,100.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.835%-15/08/12	1,650,000.00	1,664,850.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.72%-15/09/30	850,000.00	872,100.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.197%-15/10/15	1,000,000.00	998,500.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.172%-16/07/15	1,400,000.00	1,394,400.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.262%-16/09/15	2,900,000.00	2,967,280.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.814%-17/02/15	1,900,000.00	1,915,770.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.012%-17/09/15	3,050,000.00	3,091,175.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	4,100,000.00	4,229,596.90	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	1,500,000.00	1,630,350.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	3,800,000.00	3,868,400.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	2,700,000.00	2,702,700.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	650,000.00	614,900.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,150,000.00	1,095,257.70	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	2,250,000.00	2,227,500.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	427,500.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	1,300,000.00	1,170,000.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	300,000.00	280,890.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000.00	817,500.00	
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	950,000.00	897,750.00			
マレーシアアリンギット小計			34,850,000.00	35,078,519.60 (1,111,287,500)	

南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 17/09/15	12,400,000.00	12,968,232.48	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 18/12/21	11,000,000.00	11,420,037.20	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	14,000,000.00	13,904,695.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	11,000,000.00	10,511,494.40	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	1,000,000.00	997,788.90	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	22,800,000.00	27,061,203.72	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	6,850,000.00	5,795,246.59	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	8,600,000.00	6,380,943.72	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	2,800,000.00	2,655,872.80	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	10,700,000.00	7,966,101.85	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	6,000,000.00	5,786,515.20	
南アフリカランド小計			107,150,000.00	105,448,131.86 (1,066,080,613)	
合計				214,440,240,867 (214,440,240,867)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 80銘柄	100.0%	39.0%
加ドル	国債証券 25銘柄	100.0%	2.5%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	1.1%
ユーロ	国債証券 211銘柄	100.0%	43.6%
英ポンド	国債証券 36銘柄	100.0%	7.9%
スイスフラン	国債証券 4銘柄	100.0%	0.4%

スウェーデンクローナ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券	5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.8%
ポーランドズロチ	国債証券	14銘柄	100.0%	0.9%
豪ドル	国債証券	16銘柄	100.0%	1.5%
シンガポールドル	国債証券	15銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券	20銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券	11銘柄	100.0%	0.5%

## 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。

## 海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

	平成25年 6月25日現在	平成25年12月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	8,199,831	13,521,861
コール・ローン	6,877,923	15,211,556
国債証券	1,182,627,913	1,279,627,617
特殊債券	96,434,513	82,791,499
派生商品評価勘定	-	22,269
未収入金	-	3,929,923
未収利息	26,118,616	27,570,204
前払費用	3,073,463	1,757,489
流動資産合計	1,323,332,259	1,424,432,418
資産合計	1,323,332,259	1,424,432,418
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	24,780
未払解約金	1,886,796	10,490,634
流動負債合計	1,886,796	10,515,414
負債合計	1,886,796	10,515,414
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,093,038,324	1,098,260,350
剰余金		

	平成25年 6月25日現在	平成25年12月25日現在
剰余金又は欠損金( )	228,407,139	315,656,654
元本等合計	1,321,445,463	1,413,917,004
純資産合計	1,321,445,463	1,413,917,004
負債純資産合計	1,323,332,259	1,424,432,418

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 6月25日現在	平成25年12月25日現在
1. 期首	平成24年12月26日	平成25年 6月26日
期首元本額	998,427,721円	1,093,038,324円
期首からの追加設定元本額	237,522,475円	159,994,484円
期首からの一部解約元本額	142,911,872円	154,772,458円
元本の内訳		
全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	45,719,434円	38,009,747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)債券	1,046,389,531円	1,060,250,603円
新興国債券ローカルインデックスファンド(適格機関投資家向け)	929,359円	- 円
計	1,093,038,324円	1,098,260,350円

2. 受益権の総数	1,093,038,324口	1,098,260,350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)

金融商品の状況に関する事項

	自 平成24年12月26日 至 平成25年 6月25日	自 平成25年 6月26日 至 平成25年12月25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

金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 6月25日現在	平成25年12月25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 「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  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25年 6月25日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	89,168,219
特殊債券	1,727,365
合計	90,895,584

（平成25年12月25日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	94,581,158
特殊債券	1,225,025
合計	95,806,183

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（平成25年 6月25日現在）

該当事項はありません。

（平成25年12月25日現在）

（単位：円）



区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,871,303	-	1,885,307	14,004
	米ドル	1,871,303	-	1,885,307	14,004
	売建	10,059,380	-	10,075,895	16,515
	米ドル	4,172,492	-	4,173,600	1,108
	メキシコペソ	1,839,385	-	1,832,000	7,385
	コロンビアペソ	1,871,303	-	1,888,695	17,392
	南アフリカランド	2,176,200	-	2,181,600	5,400
合計		11,930,683	-	11,961,202	2,511

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

平成25年 6月25日現在		平成25年12月25日現在	
1口当たり純資産額	1.2090円	1口当たり純資産額	1.2874円
(1万口当たり純資産額)	(12,090円)	(1万口当たり純資産額)	(12,874円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-6.0%-15/06/18	550,000.00	568,227.90	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-15/12/17	1,050,000.00	1,133,549.56	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.25%- 16/06/16	1,370,000.00	1,441,137.78	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%- 16/12/15	900,000.00	970,185.63	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-17/06/15	1,150,000.00	1,163,201.81	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 17/12/14	680,000.00	750,867.87	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-4.75%- 18/06/14	500,000.00	489,602.57	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-18/12/13	360,000.00	409,025.45	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	670,000.00	749,820.79	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	1,050,000.00	1,079,589.36	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	1,050,000.00	1,060,748.43	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	630,000.00	698,762.54	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	1,010,000.00	1,286,684.15	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	730,000.00	776,116.72	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	1,010,000.00	1,140,422.96	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	950,000.00	989,052.54	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	550,000.00	698,131.71	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	1,000,000.00	1,095,102.04	
MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	440,000.00	445,410.10			
メキシコペソ小計			15,650,000.00	16,945,639.91 (135,734,575)	
ブラジル レアル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL-12.5%-16/01/05	450,000.00	466,875.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL-10.25%- 28/01/10	250,000.00	241,250.00	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-15/01/01	250,000.00	213,548.70	

		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-15/04/01	150,000.00	125,290.49	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-15/07/01	200,000.00	167,559.26	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-16/01/01	590,000.00	445,108.12	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-16/07/01	300,000.00	215,660.74	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-17/01/01	350,000.00	236,742.24	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-17/01/01	530,000.00	500,151.29	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-18/01/01	100,000.00	92,177.34	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-19/01/01	100,000.00	90,250.00	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-21/01/01	150,000.00	130,571.55	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-23/01/01	100,000.00	84,250.14	
ブラジルリアル小計			3,520,000.00	3,009,434.87	(133,197,588)
チリペソ	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP-4.25%-16/02/05	10,000,000.00	10,025,000.00	
チリペソ小計			10,000,000.00	10,025,000.00	(1,978,935)
コロンビアペソ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA-12.0%-15/10/22	447,000,000.00	504,081,900.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA-7.75%-21/04/14	130,000,000.00	143,546,000.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA-4.375%-23/03/21	45,000,000.00	39,919,500.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA-9.85%-27/06/28	122,000,000.00	152,561,000.00	
コロンビアペソ小計			744,000,000.00	840,108,400.00	(45,617,886)
ペルーヌエボソル	国債証券	PERU BONO SOBERANO-9.91%-15/05/05	30,000.00	32,437.40	
		PERU BONO SOBERANO-8.6%-17/08/12	60,000.00	69,022.73	
		PERU BONO SOBERANO-7.84%-20/08/12	180,000.00	205,193.20	
		PERU BONO SOBERANO-8.2%-26/08/12	100,000.00	117,983.66	
		PERU BONO SOBERANO-6.95%-31/08/12	100,000.00	100,639.94	
		PERU BONO SOBERANO-6.9%-37/08/12	130,000.00	127,976.86	
ペルーヌエボソル小計			600,000.00	653,253.79	(24,477,419)
トルコリラ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND-6.5%-15/01/07	150,000.00	145,755.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-5.0%-15/05/13	130,000.00	122,525.00	

		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.0%-15/06/17	200,000.00	201,400.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.0%-16/01/27	260,000.00	257,660.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.0%-17/03/08	350,000.00	344,050.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-6.3%-18/02/14	350,000.00	310,975.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.3%-18/06/20	200,000.00	189,800.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.5%-20/01/15	275,000.00	284,625.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.5%-22/01/12	230,000.00	225,170.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.5%-22/09/14	240,000.00	221,520.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-7.1%-23/03/08	330,000.00	275,715.00	
トルコリラ小計			2,715,000.00	2,579,195.00	(129,346,629)
ハンガリーフォロント	国債証券	HUNGARY GOVERNMENT BOND-8.0%-15/02/12	14,800,000.00	15,610,226.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-7.75%-15/08/24	12,000,000.00	12,866,520.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-5.5%-16/02/12	18,500,000.00	19,245,735.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-5.5%-16/12/22	13,000,000.00	13,544,505.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.75%-17/02/24	16,800,000.00	18,095,028.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.75%-17/11/24	21,200,000.00	23,067,402.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-5.5%-18/12/20	11,000,000.00	11,426,525.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.5%-19/06/24	14,300,000.00	15,500,270.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-7.5%-20/11/12	16,200,000.00	18,394,047.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-7.0%-22/06/24	13,300,000.00	14,590,698.50	
ハンガリーフォロント小計			160,100,000.00	171,642,727.00	(82,560,151)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-15/04/25	370,000.00	383,486.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.25%-15/10/24	430,000.00	455,972.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-16/04/25	330,000.00	344,520.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-16/10/25	290,000.00	302,702.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-17/04/25	160,000.00	167,496.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	310,000.00	330,894.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-18/04/25	410,000.00	414,612.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-18/07/25	210,000.00	200,854.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	400,000.00	435,520.00	

		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	260,000.00	280,007.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	200,000.00	221,450.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	330,000.00	365,854.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	180,000.00	176,040.00	
ポーランドズロチ小計			3,880,000.00	4,079,409.00	(140,372,463)
ロシア ルーブル	国債証券	RUSSIA FOREIGN BOND-7.85%-18/03/10	20,000,000.00	20,660,000.00	
	国債証券小計		20,000,000.00	20,660,000.00	(66,112,000)
	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK-6.5%- 16/09/30	4,300,000.00	4,317,741.80	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK-6.75%- 17/06/13	8,600,000.00	8,676,264.80	
		INTL BK RECON & DEVELOP-7.5%-17/03/02	2,000,000.00	2,053,440.00	
		INTL BK RECON & DEVELOP-6.25%- 17/07/05	8,000,000.00	8,045,664.00	
	特殊債券小計		22,900,000.00	23,093,110.60	(73,897,953)
ロシアルーブル小計			42,900,000.00	43,753,110.60	(140,009,953)
ルーマニ アレイ	国債証券	ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.75%- 16/01/27	150,000.00	156,082.15	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.9%-17/07/26	400,000.00	421,037.36	
ルーマニアレイ小計			550,000.00	577,119.51	(18,450,510)
マレーシ アリン ギット	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT-3.741%-15/02/27	340,000.00	341,870.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.835%-15/08/12	130,000.00	131,170.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.197%-15/10/15	140,000.00	139,790.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.172%-16/07/15	160,000.00	159,360.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.262%-16/09/15	320,000.00	327,424.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.012%-17/09/15	280,000.00	283,780.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.314%-17/10/31	200,000.00	197,600.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	280,000.00	288,850.52	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.26%-18/03/01	100,000.00	98,690.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.58%-18/09/28	150,000.00	148,950.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	290,000.00	315,201.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	380,000.00	386,840.00	

		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.492%-20/03/31	210,000.00	204,141.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.889%-20/07/31	80,000.00	79,360.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	310,000.00	310,310.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	160,000.00	151,360.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	150,000.00	142,859.70	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	180,000.00	178,200.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	130,000.00	123,500.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	60,000.00	56,178.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	50,000.00	49,000.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	130,000.00	122,850.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	60,000.00	54,721.26	
		マレーシアリングット小計	4,290,000.00	4,292,005.98 (135,970,749)	
タイバー ツ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND-3.625%- 15/05/22	3,670,000.00	3,725,363.82	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.125%- 15/12/11	3,400,000.00	3,432,107.66	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-4.125%- 16/11/18	1,400,000.00	1,444,964.41	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.25%- 17/06/16	4,200,000.00	4,228,490.02	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.8%- 17/10/10	2,200,000.00	2,169,799.87	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-5.125%- 18/03/13	2,200,000.00	2,356,889.83	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.45%- 19/03/08	1,600,000.00	1,594,395.80	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.875%- 19/06/13	3,900,000.00	3,976,570.96	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.65%- 21/12/17	3,320,000.00	3,275,617.70	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.625%- 23/06/16	1,100,000.00	1,069,797.65	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-4.75%- 24/12/20	760,000.00	804,255.90	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.85%- 25/12/12	4,620,000.00	4,500,019.20	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.58%- 27/12/17	400,000.00	374,505.56	

		THAILAND GOVERNMENT BOND-4.875%- 29/06/22	1,500,000.00	1,602,530.05	
タイパーツ小計			34,270,000.00	34,555,308.43 (110,231,433)	
フィリピン	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK-5.0%- 15/08/03	2,800,000.00	2,929,920.00	
フィリピンペソ小計			2,800,000.00	2,929,920.00 (6,914,611)	
インドネシア アルピア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT-10.75%-16/05/15	300,000,000.00	318,666,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.375%-16/09/15	400,000,000.00	395,160,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-10.0%-17/07/15	550,000,000.00	584,034,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-5.25%-18/05/15	500,000,000.00	449,995,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-20/11/15	500,000,000.00	568,000,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-12.8%-21/06/15	500,000,000.00	619,055,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-21/07/15	600,000,000.00	593,964,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-22/05/15	850,000,000.00	776,211,500.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-5.625%-23/05/15	750,000,000.00	614,235,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-24/03/15	250,000,000.00	249,025,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-25/09/15	760,000,000.00	879,654,400.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-26/09/15	580,000,000.00	555,147,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-27/05/15	600,000,000.00	508,992,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.125%-28/05/15	800,000,000.00	618,160,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.0%-29/03/15	500,000,000.00	502,735,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-10.5%-30/08/15	550,000,000.00	618,986,500.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.5%-31/07/15	320,000,000.00	333,158,400.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-32/06/15	1,350,000,000.00	1,256,256,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.625%-33/05/15	500,000,000.00	390,920,000.00	
INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-34/03/15	250,000,000.00	237,970,000.00			
インドネシアアルピア小計			11,410,000,000.00	11,070,324,800.00 (95,204,793)	
南アフリカ ランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-13.5%- 15/09/15	980,000.00	1,096,656.16	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 17/09/15	1,410,000.00	1,474,613.53	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 18/12/21	1,350,000.00	1,401,550.02	

		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	1,560,000.00	1,549,380.30	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	1,250,000.00	1,194,488.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	600,000.00	598,673.34	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	2,350,000.00	2,789,203.01	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	1,230,000.00	1,040,606.32	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	1,190,000.00	882,944.53	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	990,000.00	737,050.54	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	620,000.00	597,939.90	
南アフリカランド小計			13,530,000.00	13,363,105.65 (135,100,998)	
ナイジェ リアナイ ラ	国債証券	NIGERIA TREASURY BOND-16.39%-22/01/27	36,100,000.00	41,648,209.00	
ナイジェリアナイラ小計			36,100,000.00	41,648,209.00 (27,250,423)	
合計				1,362,419,116 (1,362,419,116)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 19銘柄	100.0%	10.0%
ブラジルリアル	国債証券 13銘柄	100.0%	9.8%
チリペソ	特殊債券 1銘柄	100.0%	0.1%
コロンビアペソ	国債証券 4銘柄	100.0%	3.3%
ペルーヌエボソル	国債証券 6銘柄	100.0%	1.8%
トルコリラ	国債証券 11銘柄	100.0%	9.5%
ハンガリーフォリント	国債証券 11銘柄	100.0%	6.1%



ポーランドズロチ	国債証券	13銘柄	100.0%	10.2%
ロシアルーブル	国債証券	1銘柄	47.2%	4.9%
	特殊債券	4銘柄	52.8%	5.4%
ルーマニアレイ	国債証券	2銘柄	100.0%	1.4%
マレーシアリングギット	国債証券	23銘柄	100.0%	10.0%
タイバーツ	国債証券	14銘柄	100.0%	8.1%
フィリピンペソ	特殊債券	1銘柄	100.0%	0.5%
インドネシアアルピア	国債証券	20銘柄	100.0%	7.0%
南アフリカランド	国債証券	11銘柄	100.0%	9.9%
ナイジェリアナイラ	国債証券	1銘柄	100.0%	2.0%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

### 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2014年 1月31日現在です。

#### 【全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型】

#### 【純資産額計算書】

資産総額	238,408,352円
負債総額	52,699円
純資産総額( - )	238,355,653円
発行済口数	261,138,908口
1口当たり純資産額( / )	0.9128円

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	26,779,621,239円
負債総額	135,031,365円
純資産総額（ - ）	26,644,589,874円
発行済口数	26,810,470,674口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9938円

## 海外株式インデックスMSCI - K O K U S A I（ヘッジなし）マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	75,941,248,204円
負債総額	32,555,102円
純資産総額（ - ）	75,908,693,102円
発行済口数	48,779,202,911口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5562円

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

## 純資産額計算書

資産総額	8,395,146,312円
負債総額	18,582,851円
純資産総額（ - ）	8,376,563,461円
発行済口数	6,352,493,188口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3186円

## 日本債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	34,317,672,488円
負債総額	42,165,194円
純資産総額（ - ）	34,275,507,294円
発行済口数	26,586,774,091口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2892円

## 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	213,983,609,953円
負債総額	287,140,914円
純資産総額（ - ）	213,696,469,039円
発行済口数	105,672,497,508口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0223円

## 海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	1,386,999,617円
負債総額	27,924,971円
純資産総額（ - ）	1,359,074,646円
発行済口数	1,122,623,014口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2106円

### 第三部【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】

< 更新後 >

##### (1) 資本金の額

平成26年1月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減

年月日	変更後（変更前）
平成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（平成26年1月末現在）

###### ・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。

##### (3) 運用の意思決定プロセス（平成26年1月末現在）

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。

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

< 更新後 >

- ・「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26年1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	478	94,020
株式投資信託	418	70,673
単位型	48	1,001
追加型	370	69,672
公社債投資信託	60	23,346
単位型	44	425
追加型	16	22,920
投資法人合計	1	84

### 3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

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54期事業年度（平成24年4月1日から平成25年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により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期事業年度 有限責任 あずさ監査法人

#### (1)【貸借対照表】

<更新後>

(単位：百万円)

	第53期 (平成24年3月31日)		第54期 (平成25年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	17,352	3	15,820
前払費用		332	3	380
未収入金		1		4
未収委託者報酬		5,872		7,472
未収収益	3	543	3	342
関係会社短期貸付金		33		606
立替金		1,094		335
繰延税金資産		1,084		869
その他	2	30	2	30
流動資産合計		26,345		25,862
固定資産				

有形固定資産				
建物	1	66	1	48
器具備品	1	137	1	124
有形固定資産合計		203		172
無形固定資産				
ソフトウェア		72		70
無形固定資産合計		72		70
投資その他の資産				
投資有価証券		3,002		7,170
関係会社株式		24,320		22,935
関係会社長期貸付金		60		60
長期差入保証金		774		706
繰延税金資産		723		500
投資その他の資産合計		28,880		31,373
固定資産合計		29,156		31,616
資産合計		55,502		57,478

(単位：百万円)

	第53期 (平成24年3月31日)		第54期 (平成25年3月31日)	
負債の部				
流動負債				
預り金		194		305
未払金		3,086		3,862
未払収益分配金		7		6
未払償還金		129		115
未払手数料	3	2,486	3	3,195
その他未払金		462		545
未払費用	3	2,807	3	3,282
未払法人税等		1,295		589
未払消費税等	4	281	4	123
賞与引当金		2,039		1,770
役員賞与引当金		105		80
流動負債合計		9,809		10,012
固定負債				
退職給付引当金		907		1,001
その他		55		55
固定負債合計		963		1,057
負債合計		10,773		11,070
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
資本剰余金合計		5,220		5,220
利益剰余金				

その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	22,172	23,530
利益剰余金合計	22,172	23,530
自己株式	68	68
株主資本合計	44,687	46,045
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	42	362
評価・換算差額等合計	42	362
純資産合計	44,729	46,408
負債純資産合計	55,502	57,478

## (2) 【損益計算書】

&lt;更新後&gt;

(単位：百万円)

	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	56,698	52,848
その他営業収益	2,025	1,922
営業収益合計	58,724	54,771
営業費用		
支払手数料	29,251	26,955
広告宣伝費	673	649
公告費	3	7
調査費	11,397	10,797
調査費	719	691
委託調査費	10,660	10,089
図書費	18	17
委託計算費	348	406
営業雑経費	577	530
通信費	206	188
印刷費	247	214
協会費	43	46
諸会費	9	16
その他	70	64
営業費用計	42,252	39,347
一般管理費		
給料	6,991	6,759
役員報酬	237	256
役員賞与引当金繰入額	105	80
給料・手当	4,508	4,565
賞与	101	87
賞与引当金繰入額	2,039	1,770
交際費	74	100
寄付金	111	66
旅費交通費	328	313
租税公課	145	188
不動産賃借料	749	753
退職給付費用	307	312

退職金	8	83
固定資産減価償却費	143	124
諸経費	3,110	3,061
一般管理費計	11,971	11,764
営業利益	4,500	3,659

(単位：百万円)

	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
営業外収益		
受取利息	15	12
受取配当金	1 757	1 601
有価証券償還益	19	-
時効成立分配金・償還金	35	4
為替差益	-	64
その他	18	16
営業外収益合計	846	699
営業外費用		
支払利息	10	19
有価証券償還損	-	1
時効成立後支払分配金・償還金	77	15
支払源泉所得税	74	55
為替差損	35	-
弁護士報酬等	180	-
その他	4	2
営業外費用合計	381	93
経常利益	4,965	4,265
特別利益		
投資有価証券売却益	1	226
関係会社株式売却益	-	239
特別利益合計	1	465
特別損失		
投資有価証券売却損	0	84
固定資産処分損	6	3
役員退職一時金	369	75
特別損失合計	376	163
税引前当期純利益	4,590	4,568
法人税、住民税及び事業税	1,795	1,480
法人税等調整額	224	260
法人税等合計	2,020	1,740
当期純利益	2,570	2,827

## (3) 【株主資本等変動計算書】

&lt; 更新後 &gt;

(単位：百万円)



	第53期 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月 31日)	第54期 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25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	-
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	-	-
資本剰余金合計		
当期首残高	5,225	5,220
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	5,220	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	21,703	22,172
当期変動額		
剰余金の配当	1,502	1,468
当期純利益	2,570	2,827
自己株式の処分	599	-
当期変動額合計	468	1,358
当期末残高	22,172	23,530
利益剰余金合計		
当期首残高	21,703	22,172
当期変動額		
剰余金の配当	1,502	1,468
当期純利益	2,570	2,827
自己株式の処分	599	-
当期変動額合計	468	1,358
当期末残高	22,172	23,530

(単位：百万円)

	第53期 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月 31日)	第54期 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月 31日)
自己株式		
当期首残高	68	68

当期変動額		
自己株式の取得	8,700	-
自己株式の処分	8,700	-
当期変動額合計	-	-
当期末残高	68	68
株主資本合計		
当期首残高	44,224	44,687
当期変動額		
剰余金の配当	1,502	1,468
当期純利益	2,570	2,827
自己株式の取得	8,700	-
自己株式の処分	8,095	-
当期変動額合計	463	1,358
当期末残高	44,687	46,045
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	63	42
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	21	320
当期変動額合計	21	320
当期末残高	42	362
評価・換算差額等合計		
当期首残高	63	42
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	21	320
当期変動額合計	21	320
当期末残高	42	362
純資産合計		
当期首残高	44,287	44,729
当期変動額		
剰余金の配当	1,502	1,468
当期純利益	2,570	2,827
自己株式の取得	8,700	-
自己株式の処分	8,095	-
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	21	320
当期変動額合計	441	1,678
当期末残高	44,729	46,408

## 重要な会計方針

項目	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法

2 固定資産の減価償却の方法	<p>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)</p> <p>時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(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</p> <p>(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。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>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。</p>

## 会計方針の変更

<p style="text-align: center;">第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)</p> <p>(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、当事業年度より、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。 この変更による当事業年度の損益に与える影響は軽微であります。</p>
--

## 未適用の会計基準等

1. 「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日）

### (1) 概要

当該会計基準等は、財務報告を改善する観点及び国際的な動向を踏まえ、主に 未認識数理計算上の差異及び未認識過去勤務費用の処理方法を変更し、開示項目を拡充するほか、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を改正するものであります。

### (2) 適用予定日

当社は については、平成25年4月1日に開始する事業年度の年度末に係る財務諸表から適用し、については、平成26年4月1日に開始する事業年度の期首から適用する予定であります。

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、現在評価中であります。

## 注記事項

## （貸借対照表関係）

第53期 (平成24年3月31日)	第54期 (平成25年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,012百万円</p> <p>器具備品 590百万円</p> <p>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。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 5,802百万円</p> <p>未収収益 217百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 42百万円</p> <p>未払費用 259百万円</p> <p>4 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。</p> <p>5 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。</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,054百万円</p> <p>器具備品 618百万円</p> <p>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。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 3,818百万円</p> <p>前払費用 2百万円</p> <p>未収収益 58百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 143百万円</p> <p>未払費用 297百万円</p> <p>4 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。</p> <p>5 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87百万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243百万円に対して保証を行っております。</p>

## （損益計算書関係）

第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p>受取配当金 743百万円</p>	<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p>受取配当金 552百万円</p>

## （株主資本等変動計算書関係）

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

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

2 第1回新株予約権の増加は、新株予約権の発行によるものであります。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。

3 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。

4 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

第54期（自 平成24年4月1日 至 平成25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	-	-	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	
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	-	161,700	5,930,100	-
合計		32,249,300	-	2,448,600	29,800,700	-

(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 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。

3 平成21年度ストックオプション(1)13,625,700株、平成21年度ストックオプション(2)1,287,000株、平成22年度ストックオプション(1)1,732,500株及び第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25年5月27日取締役会	普通株式	利益剰余金	1,380	7.01	平成25年3月31日	平成25年6月18日

## (リース取引関係)

第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
オペレーティング・リース取引	オペレーティング・リース取引

解約不能のものに係る未経過リース料		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年内	750百万円
1年超	1,548百万円	1年超	807百万円
合計	2,288百万円	合計	1,558百万円

## (金融商品関係)

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

## 1 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

## 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

## 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

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

( )負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、株式は市場価格、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されており、また一部外貨建て預金を保有しているため為替変動リスクにも晒されております。営業債権である未収委託者報酬、未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の



信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻または債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されております。

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

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

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25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	15,820	15,820	-
(2) 未収委託者報酬	7,472	7,472	-
(3) 未収収益	342	342	-
(4) 投資有価証券			
其他有価証券	7,091	7,091	-
(5) 未払金	(3,862)	(3,862)	-
(6) 未払費用	(3,282)	(3,282)	-

( )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、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

投資信託は基準価額によっております。

(5) 未払金及び(6) 未払費用

これらは短期間で決済され、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79百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(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20,042百万円）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、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表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	15,820	-	-	-
未収委託者報酬	7,472	-	-	-
未収収益	342	-	-	-
投資有価証券				
投資信託	-	385	1,299	920
合計	23,635	385	1,299	920

（有価証券関係）

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) 時価を把握することが極めて困難と認められる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
子会社株式	20,023
関連会社株式	2,892

これらについては、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「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

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

#### 1 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式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、子会社株式及び関連会社株式の時価を記載しておりません。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式及び関連会社株式の貸借対照表計上額は次のとおりです。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	20,042
関連会社株式	2,892

#### 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	その他	6,366	5,708	658
	小計	6,366	5,708	658
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	その他	724	821	96
	小計	724	821	96
合計		7,091	6,529	561

- (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 79百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

### 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
株式	43	35	67
投資信託	1,099	190	17

合計	1,143	226	84
----	-------	-----	----

## (持分法損益等)

第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位:百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位:百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額 4,407	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,069
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 6,834	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 6,280
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 927	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,159

## (退職給付関係)

第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25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。	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)	2 退職給付債務に関する事項 (単位:百万円)
イ 退職給付債務 985	イ 退職給付債務 1,101
ロ 未積立退職給付債務 985	ロ 未積立退職給付債務 1,101
ハ 未認識数理計算上の差異 77	ハ 未認識数理計算上の差異 99
ニ 退職給付引当金残高 907	ニ 退職給付引当金残高 1,001
3 退職給付費用に関する事項 (単位:百万円)	3 退職給付費用に関する事項 (単位:百万円)
イ 勤務費用 97	イ 勤務費用 102
ロ 利息費用 14	ロ 利息費用 13
ハ 数理計算上の差異の費用処理額 27	ハ 数理計算上の差異の費用処理額 24
ニ 確定拠出型企業年金への掛金 168	ニ 確定拠出型企業年金への掛金 171
ホ 退職給付費用合計 307	ホ 退職給付費用合計 312
4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項	4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項
イ 退職給付見込額の期間配分方法 勤続期間比例	イ 退職給付見込額の期間配分方法 勤続期間比例
ロ 割引率 1.4%	ロ 割引率 0.9%
ハ 数理計算上の差異の処理年数 10年	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	当社及び関係会社の取締役・従業員 186名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 2,310,000株	普通株式 6,101,700株
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日
権利確定条件	平成24年1月22日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	平成25年10月7日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	平成24年1月22日から 平成32年1月21日まで	平成25年10月7日から 平成33年10月6日まで

（注） 株式数に換算して記載しております。

## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

### ストックオプション（新株予約権）の数

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

#### 単価情報

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

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

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値（取引事例比準法による評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。
- 2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額  
当事業年度末における本源的価値の合計額 - 百万円
- 3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するよう調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第54期(自 平成24年 4 月 1 日 至 平成25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)	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	当社及び関係会社の取締役・従業員 186名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 2,310,000株	普通株式 6,101,700株
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日
権利確定条件	平成24年1月22日（以下「権利行使可能初日」といいます。）当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	平成25年10月7日（以下「権利行使可能初日」といいます。）当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	平成24年1月22日から 平成32年1月21日まで	平成25年10月7日から 平成33年10月6日まで

（注） 株式数に換算して記載しております。

## （2）ストックオプション（新株予約権）の規模及びその変動状況

### ストックオプション（新株予約権）の数

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定前(株)		
期首	19,215,900	1,676,400
付与	0	0
失効	2,237,400	49,500
権利確定	0	0
権利未確定残	16,978,500	1,626,900
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	6,091,800
付与	0	0
失効	0	161,700
権利確定	0	0
権利未確定残	2,310,000	5,930,100
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

#### 単価情報

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

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

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値（取引事例比準法による評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。
- 2 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額  
当事業年度末における本源的価値の合計額 - 百万円
- 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53期 (平成24年 3月31日)	第54期 (平成25年 3月31日)
-----------------------	-----------------------



第53期 (平成24年3月31日)	第54期 (平成25年3月31日)																																																																						
<p>1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <p>繰延税金資産(流動)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">賞与引当金繰入超過額</td> <td style="text-align: right;">775</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">309</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,084</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">投資有価証券評価損</td> <td style="text-align: right;">52</td> </tr> <tr> <td>関係会社株式評価損</td> <td style="text-align: right;">205</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金超過額</td> <td style="text-align: right;">329</td> </tr> <tr> <td>固定資産減価償却超過額</td> <td style="text-align: right;">190</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">28</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">806</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産小計</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;"></td> <td style="text-align: right;">1,890</td> </tr> <tr> <td>評価性引当金</td> <td style="text-align: right;">61</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,829</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">22</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">22</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産の純額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;"></td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,807</td> </tr> </table> <p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">法定実効税率 (調整)</td> <td style="text-align: right;">40.6%</td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">2.5%</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">5.6%</td> </tr> <tr> <td>税率変更による期末繰延税金資産の減額修正</td> <td style="text-align: right;">3.8%</td> </tr> <tr> <td>海外子会社の留保利益の影響額等</td> <td style="text-align: right;">2.7%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">44.0%</td> </tr> </table>	賞与引当金繰入超過額	775	その他	309	小計	1,084	投資有価証券評価損	52	関係会社株式評価損	205	退職給付引当金超過額	329	固定資産減価償却超過額	190	その他	28	小計	806		1,890	評価性引当金	61	繰延税金資産合計	1,829	その他有価証券評価差額金	22	繰延税金負債合計	22		1,807	法定実効税率 (調整)	40.6%	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	5.6%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	3.8%	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%	<p>1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <p>繰延税金資産(流動)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">賞与引当金繰入超過額</td> <td style="text-align: right;">672</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">196</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">869</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">投資有価証券評価損</td> <td style="text-align: right;">149</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金超過額</td> <td style="text-align: right;">361</td> </tr> <tr> <td>固定資産減価償却超過額</td> <td style="text-align: right;">174</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">75</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">760</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産小計</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;"></td> <td style="text-align: right;">1,630</td> </tr> <tr> <td>評価性引当金</td> <td style="text-align: right;">61</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,568</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">199</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">199</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産の純額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;"></td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,369</td> </tr> </table> <p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <p>法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。</p>	賞与引当金繰入超過額	672	その他	196	小計	869	投資有価証券評価損	149	退職給付引当金超過額	361	固定資産減価償却超過額	174	その他	75	小計	760		1,630	評価性引当金	61	繰延税金資産合計	1,568	その他有価証券評価差額金	199	繰延税金負債合計	199		1,369
賞与引当金繰入超過額	775																																																																						
その他	309																																																																						
小計	1,084																																																																						
投資有価証券評価損	52																																																																						
関係会社株式評価損	205																																																																						
退職給付引当金超過額	329																																																																						
固定資産減価償却超過額	190																																																																						
その他	28																																																																						
小計	806																																																																						
	1,890																																																																						
評価性引当金	61																																																																						
繰延税金資産合計	1,829																																																																						
その他有価証券評価差額金	22																																																																						
繰延税金負債合計	22																																																																						
	1,807																																																																						
法定実効税率 (調整)	40.6%																																																																						
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	5.6%																																																																						
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	3.8%																																																																						
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%																																																																						
賞与引当金繰入超過額	672																																																																						
その他	196																																																																						
小計	869																																																																						
投資有価証券評価損	149																																																																						
退職給付引当金超過額	361																																																																						
固定資産減価償却超過額	174																																																																						
その他	75																																																																						
小計	760																																																																						
	1,630																																																																						
評価性引当金	61																																																																						
繰延税金資産合計	1,568																																																																						
その他有価証券評価差額金	199																																																																						
繰延税金負債合計	199																																																																						
	1,369																																																																						

第53期 (平成24年3月31日)	第54期 (平成25年3月31日)
----------------------	----------------------

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

（関連当事者情報）

第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(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)	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

第54期(自平成24年4月1日至平成25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

重要な該当事項はありません。

##### (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)	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	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	525 (千SGD8,000)	関係会社短期貸付金	606 (千SGD8,000)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	5 (千SGD76)	未収収益	5 (千SGD76)

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 融資枠SGD11百万、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

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)

三井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24年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	10,930百万円
負債合計	1,103百万円
純資産合計	9,826百万円

営業収益	7,917百万円
税引前当期純利益	2,801百万円
当期純利益	2,091百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

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。

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25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53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

## 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

## 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第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。

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25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。

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25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。

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

該当事項はありません。

## (1株当たり情報)

項目	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
1株当たり純資産額	227円16銭	235円69銭
1株当たり当期純利益金額	13円09銭	14円35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53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25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)	2,570	2,827
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)	2,570	2,827
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,278	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) 19,215,900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	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) 5,930,100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53期 (平成24年3月31日)	第54期 (平成25年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	44,729	46,408
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)	44,729	46,408
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55期中間会計期間(平成25年4月1日から平成25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。

#### 中間財務諸表等

##### (1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		第55期中間会計期間 (平成25年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		16,689
未収委託者報酬		6,483
未収収益		570
関係会社短期貸付金		850
繰延税金資産		526
その他	2	786
流動資産合計		25,905
固定資産		
有形固定資産	1	192
無形固定資産		81
投資その他の資産		
投資有価証券		7,723
関係会社株式		22,935

関係会社長期貸付金	60
長期差入保証金	686
繰延税金資産	552
投資その他の資産合計	31,958
固定資産合計	32,233
資産合計	58,138

(単位：百万円)

第55期中間会計期間  
(平成25年9月30日)

## 負債の部

## 流動負債

未払金		3,260
未払費用		3,331
未払法人税等		1,288
未払消費税等	3	266
賞与引当金		881
役員賞与引当金		170
その他		303
流動負債合計		9,501

## 固定負債

退職給付引当金		1,032
その他		55
固定負債合計		1,088

## 負債合計

10,590

## 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		24,690
利益剰余金合計		24,690

自己株式 68

株主資本合計 47,206

## 評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金 342

評価・換算差額等合計 342

純資産合計 47,548

負債純資産合計 58,138

## (2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第55期中間会計期間  
(自 平成25年 4月 1日  
至 平成25年 9月30日)

営業収益		
委託者報酬		32,440
その他営業収益		1,179
営業収益合計		33,620
営業費用及び一般管理費	1	30,198
営業利益		3,421
営業外収益	2	822
営業外費用	3	89
経常利益		4,155
特別利益	4	56
特別損失	5	35
税引前中間純利益		4,175
法人税、住民税及び事業税		1,333
法人税等調整額		302
中間純利益		2,540

## ( 3 ) 中間株主資本等変動計算書

(単位：百万円)

第55期中間会計期間  
(自 平成25年 4月 1日  
至 平成25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		23,530
当中間期変動額		
剰余金の配当		1,380
中間純利益		2,540
当中間期変動額合計		1,160
当中間期末残高		24,690
利益剰余金合計		
当期首残高		23,530
当中間期変動額		
剰余金の配当		1,380
中間純利益		2,540
当中間期変動額合計		1,160
当中間期末残高		24,690



(単位：百万円)

第55期中間会計期間  
(自 平成25年 4月 1日  
至 平成25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	46,045
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,380
中間純利益	2,540
当中間期変動額合計	1,160
当中間期末残高	47,206
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	362
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)	19
当中間期変動額合計	19
当中間期末残高	342
評価・換算差額等合計	
当期首残高	362
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)	19
当中間期変動額合計	19
当中間期末残高	342
純資産合計	
当期首残高	46,408
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,380
中間純利益	2,540
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	19
当中間期変動額合計	1,140
当中間期末残高	47,548

## 重要な会計方針

項目	第55期中間会計期間 (自 平成25年 4月 1日 至 平成25年 9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法

	<p>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)</p> <p>時価のないもの 総平均法による原価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。</p> <p>(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。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>
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	<p>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。</p>

## 注記事項

(中間貸借対照表関係)

第55期中間会計期間 (平成25年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 1,700百万円
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78百万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202百万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55期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	34百万円
無形固定資産	11百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	11百万円
受取配当金	804百万円
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	21百万円
支払源泉所得税	57百万円
4 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	56百万円
5 特別損失のうち主要なもの	
割増退職金	34百万円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第55期中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25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	16,978,500	-	1,059,300	15,919,200	-
平成21年度 ストックオプション(2)	普通株式	1,626,900	-	42,900	1,584,000	-
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	5,930,100	-	468,600	5,461,500	-
合計		29,800,700	-	1,570,800	28,229,900	-

(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 第1回新株予約権の新株予約権の目的となる株式の数は、新株予約権の行使に関する通知が当社に提出された日における、当社の発行済株式数×0.25%に6を乗じた数で算出され、当中間会計期間末の発行済株式に基づき算出しております。
- 3 平成21年度ストックオプション(1)13,830,300株、平成21年度ストックオプション(2)1,287,000株、平成22年度ストックオプション(1)1,732,500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25年5月27日 取締役会	普通株式	1,380	7.01	平成25年3月31日	平成25年6月18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55期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25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	744百万円
1年超	437百万円
合計	1,182百万円

##### (金融商品関係)

##### 第55期中間会計期間(平成25年9月30日)

##### 1 金融商品の時価等に関する事項

平成25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。

(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	16,689	16,689	-
(2) 未収委託者報酬	6,483	6,483	-
(3) 未収収益	570	570	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	7,643	7,643	-
(5) 未払金	(3,260)	(3,260)	-
(6) 未払費用	(3,331)	(3,331)	-

( )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

投資信託は基準価額によっております。

## (5) 未払金及び(6) 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79百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(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、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

## (有価証券関係)

第55期中間会計期間(平成25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
子会社株式	20,042
関連会社株式	2,892

(注) 子会社株式及び関連会社株式は市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価を記載しておりません。

## 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	投資信託	6,524	5,871	652
	小計	6,524	5,871	652
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	1,119	1,241	122
	小計	1,119	1,241	122
合計		7,643	7,113	530

(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 79百万円）については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、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55期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25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	3,073百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	6,686百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	635百万円

## (ストックオプション等関係)

第55期中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25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55期中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25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、記載していません。

関連情報

第55期中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25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、記載していません。

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、記載を省略してあります。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載していません。

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55期中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30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55期中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30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55期中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第55期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)
1株当たり純資産額	241円48銭
1株当たり中間純利益金額	12円90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いません。

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55期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

中間純利益（百万円）	2,540
普通株主に帰属しない金額（百万円）	-
普通株式に係る中間純利益（百万円）	2,540
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) 15,919,200株、平成21年度ストックオプション(2) 1,584,000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) 5,461,500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55期中間会計期間 (平成25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）	47,548
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）	47,548
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。

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】

<更新後>

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (平成25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。

<更新後>

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (平成25年9月末現在)	事業の内容
-----	-----------------------	-------

農林中央金庫	3,425,909百万円	全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
日興アセットマネジメント株式会社	17,363百万円	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。



## 独立監査人の監査報告書

平成26年2月5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 鶴田 光夫  
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」に掲げられている全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型の平成25年6月26日から平成25年12月25日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型の平成25年12月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

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

2.財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成25年6月14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期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成25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。

#### その他の事項

会社の平成24年3月31日をもって終了した前事業年度の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して平成24年6月15日付けで無限定適正意見を表明している。

#### 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。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成25年12月6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25年4月1日から平成26年3月31日までの第55期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25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25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25年4月1日から平成25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。