

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成24年 3 月23日
【計算期間】	第 8 特定期間 (自 平成23年 6 月28日 至 平成23年12月26日)
【ファンド名】	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国） 毎月分配型
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 ビリー・ウェード・ワイルダー
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目 7 番 1 号
【事務連絡者氏名】	雄谷 敦史
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目 7 番 1 号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

各地域のGDP比率をもとに株式および債券に投資を行ない、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざします。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券）））

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

「資産配分固定型」とは、目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。

年12回（毎月）

目論見書または投資信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。

グローバル（含む日本）

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジなし

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

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

ファンドの特色

1 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ペ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。

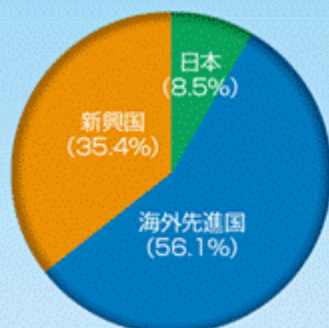
- インカム収益などを原資として、毎月の決算時に、安定した分配を行なうことをめざします。
- 年4回（3月、6月、9月および12月）の決算時には、基準価額水準などを勘案し、上記安定分配相当額に加えて、キャピタル収益などを積極的に分配する場合があります。

※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。



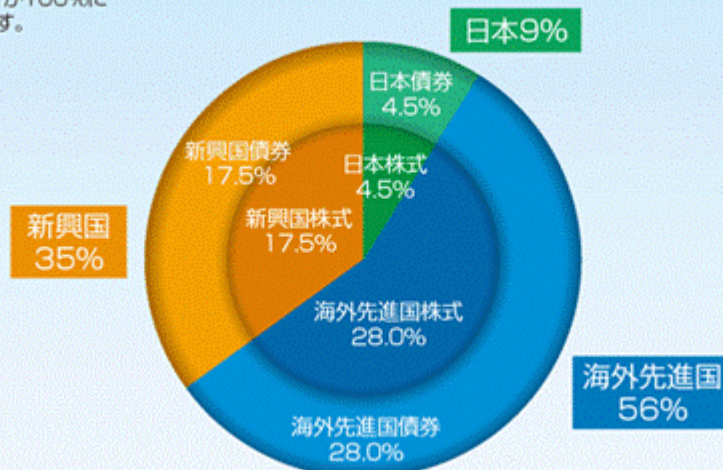
【各地域のGDP比率】
（IMFの2011年予想の値をもとに
日興アセットマネジメントが作成。）
※端数処理の関係で合計が100%にならない場合があります。

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%】

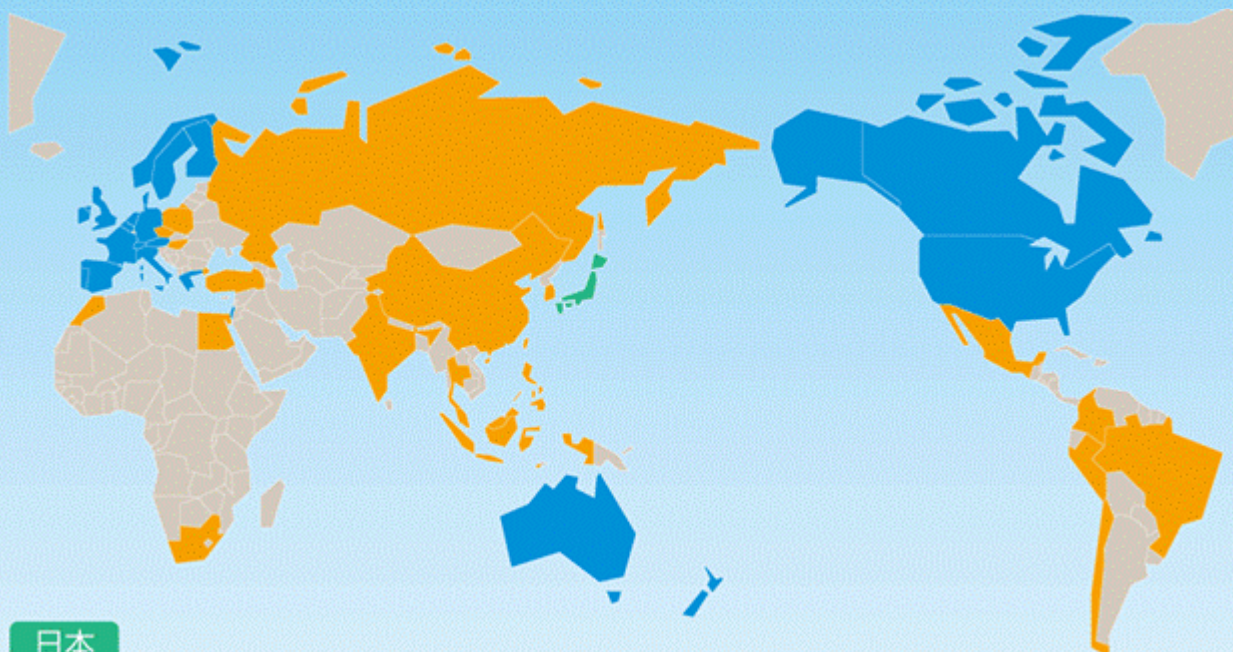


【ワールドクルーズの資産配分比率】

- 上記は2012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45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、ギリシア、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
- （23の国と地域）

新興国

- 【欧州】 チェコ、ハンガリー、ポーランド
 - 【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、モロッコ、南アフリカ
- （21の国と地域）

●上図は2012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。

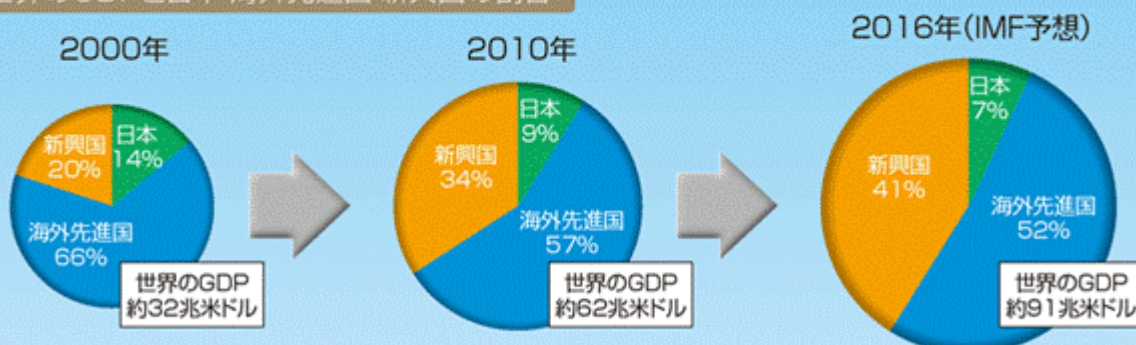
（参考）グローバル分散投資の意義 ～ワールドクルーズをめざすもの～

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カ国の総称です。

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予想、並びにゴールドマンサックスグループ インク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。

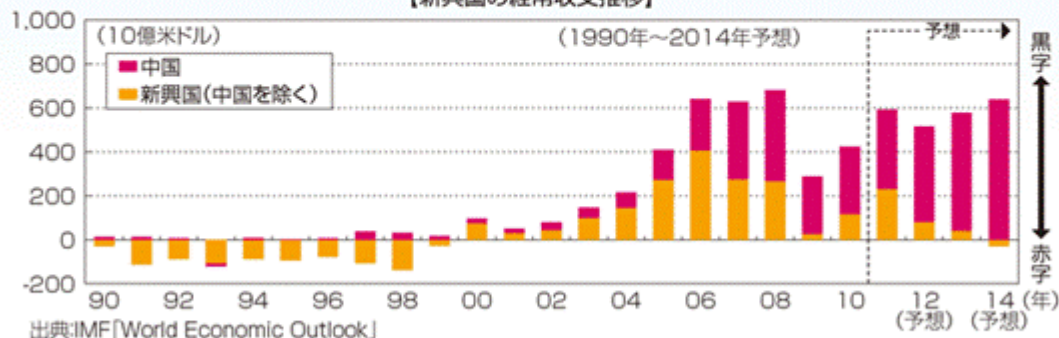
【各国GDP規模の順位】

	1位	2位	3位	4位	5位	6位
	アメリカ	日本	ドイツ	イギリス	フランス	中国
2000年						
2005年						
2010年						
2016年 IMF予想						
2050年 ゴールドマン サックス予想						

（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。

【新興国の経常収支推移】

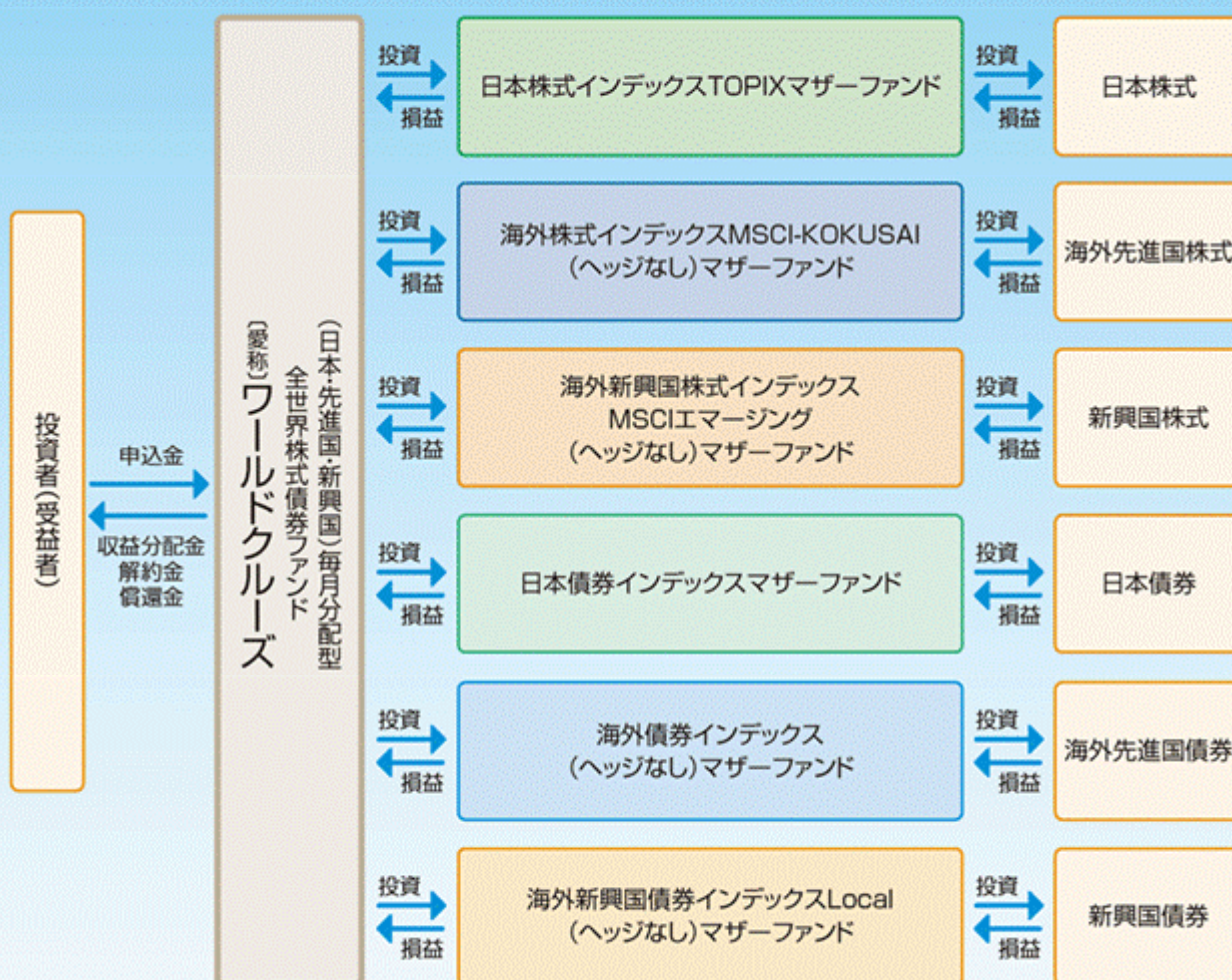


●IMFの地域定義とデータをもとに日興アセットマネジメントが作成。なお、2011年以降の値はIMFによる予想値です。

●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。

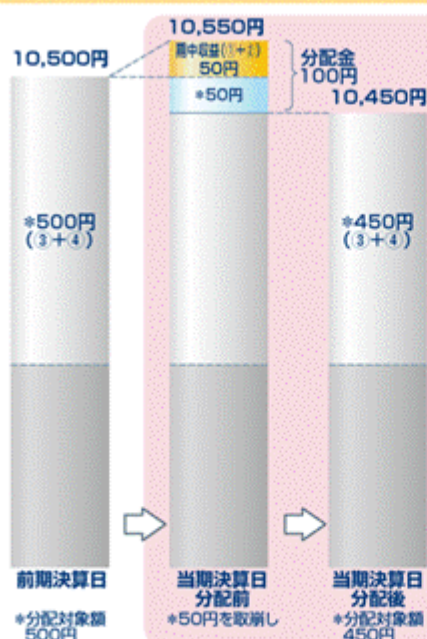
投資信託で分配金が支払われるイメージ



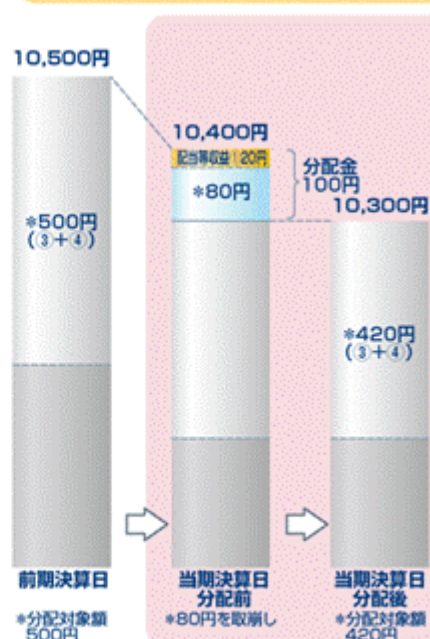
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

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率が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。

信託金限度額

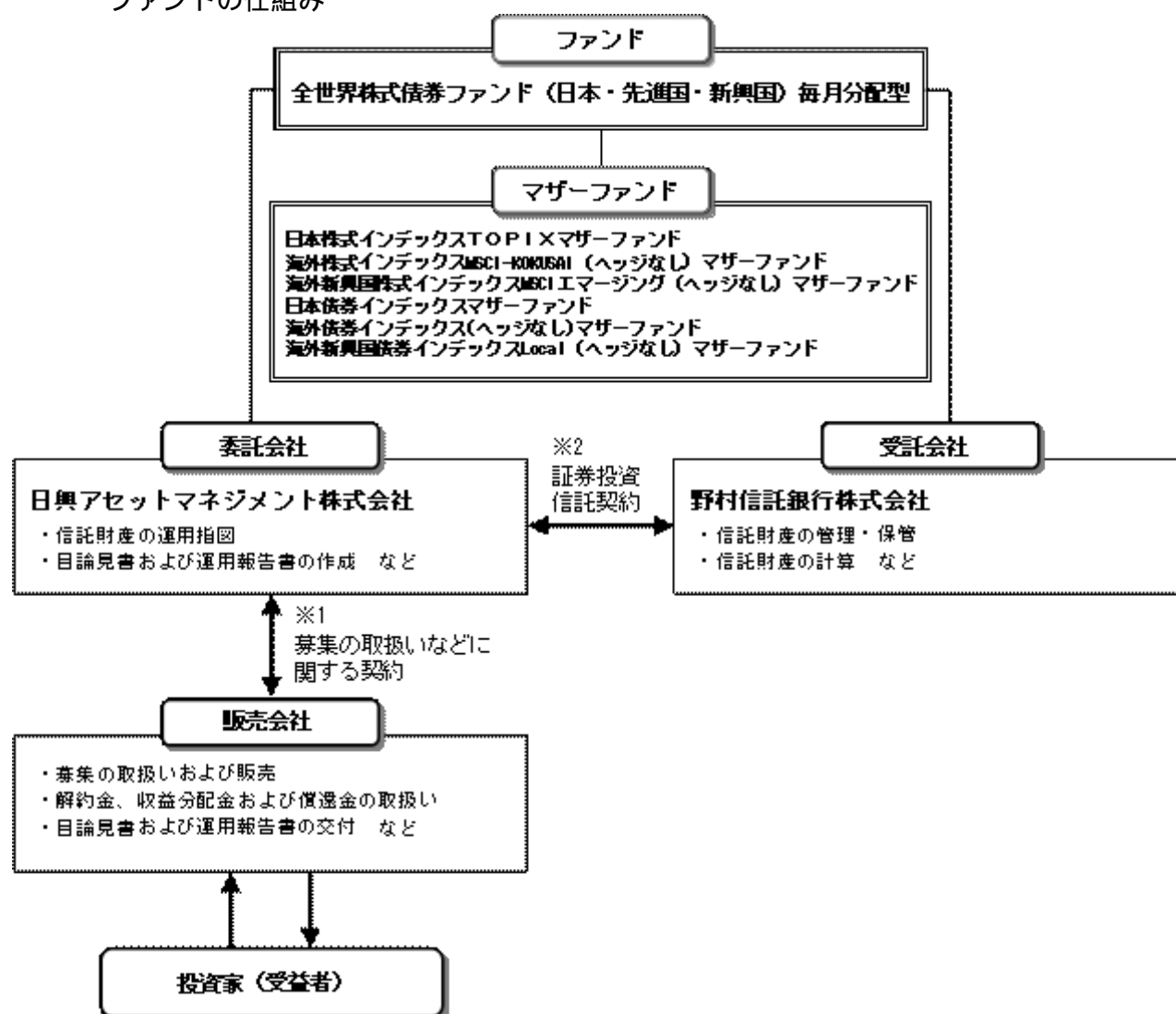
- ・ 1兆円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ 委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

(2) 【ファンドの沿革】

平成20年3月31日 ファンドの信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

委託会社の概況（平成24年1月末現在）

1) 資本金

17,363百万円

2) 沿革

昭和34年：日興證券投資信託委託株式会社として設立

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

3) 大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

- ・主として、「投資対象」に掲げる各マザーファンド受益証券に投資を行ない、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざします。各マザーファンド受益証券の合計組入比率は、高位を保つことを原則とします。
- ・各マザーファンド受益証券が実質的に保有する株式または債券の信託財産の純資産総額に対する割合は、50%を基本とします。
- ・各マザーファンド受益証券への投資比率は、日本、海外先進国、新興国のGDP比率をもとに決定します。なお、当該投資比率は各地域のGDP比率に基づいて、毎年見直すことを原則とします。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

(2)【投資対象】

<全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型>

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」

証券投資信託「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」

証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

証券投資信託「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」

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1) 有価証券

2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条、第21条および第22条に定めるものに限りま。）

3) 金銭債権

4) 約束手形

5) 為替手形

主として次のマザーファンドの受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。

1) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

2) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」

3) 証券投資信託「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」

4) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」

5) 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

6) 証券投資信託「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」

7) 株券または新株引受権証券

8) 国債証券

9) 地方債証券

10) 特別の法律により法人の発行する債券

11) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

12) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

13) コマーシャル・ペーパー

- 14) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)
および新株予約権証券
- 15) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)~14)の証券または証書の性質
を有するもの
- 16) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定める
ものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。)
- 17) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい
ます。以下同じ。)で18)に定めるもの以外のもの
- 18) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同
じ。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
- 19) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいま
す。)
- 20) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるも
のをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 21) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 22) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 23) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信
託の受益証券に限ります。)
- 24) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行
信託の受益証券に表示されるべきもの
- 25) 外国の者に対する権利で24)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同
項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除き
ます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引
 - 10) 資金の借入

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型
新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)

- 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 7) コマーシャル・ペーパー
 - 8) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 - 9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)～8)の証券の性質を有するもの
 - 10) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
 - 11) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限り、ます。）
 - 12) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 13) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り、ます。）
 - 14) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 次の取引ができます。
- 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡し取引
 - 5) 有価証券の貸付
 - 6) 公社債の空売
 - 7) 公社債の借入

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限り、ます。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)～7)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 11) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で12)に定めるもの以外のもの

- 12) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
- 13) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 14) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- 15) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 17) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの次の取引ができます。
 - 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引

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

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

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第17条、第18条および第19条に定めるものに限ります。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)～8)の証券または証書の性質を有するもの
- 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 11) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で12)に定めるものの以外のもの
- 12) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限ります。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限ります。）
- 5) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの
- 8) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
- 9) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信

託の受益証券に限ります。）

- 10) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 次の取引ができます。
- 1) 先物取引等
 - 2) スワップ取引
 - 3) 金利先渡し取引
 - 4) 有価証券の貸付
 - 5) 公社債の空売
 - 6) 公社債の借入

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限りします。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 1) 国債証券
 - 2) 地方債証券
 - 3) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限りします。）
 - 5) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 6) コマーシャル・ペーパー
 - 7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの
 - 8) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
 - 9) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 - 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 11) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りします。）
 - 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの
- 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形

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

6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

次の取引ができます。

- 1) 先物取引等
- 2) スワップ取引
- 3) 金利先渡取引
- 4) 為替先渡取引
- 5) 有価証券の貸付
- 6) 公社債の空売
- 7) 公社債の借入
- 8) 外国為替予約取引

< 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 >

新興国の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限りま。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限りま。）
- 5) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)～6)の証券または証書の性質を有するもの
- 8) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
- 9) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 11) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りま。）
- 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの

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

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

次の取引ができます。

- 1) 先物取引等
- 2) スワップ取引
- 3) 金利先渡取引
- 4) 為替先渡取引
- 5) 有価証券の貸付
- 6) 公社債の空売

- 7) 公社債の借入
- 8) 外国為替予約取引

投資対象とするマザーファンドの概要

< 日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド >

運用の基本方針

基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	・主としてわが国の株式に投資し、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

その他

委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成11年10月29日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

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

運用の基本方針

基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	・主として日本を除く世界各国の株式（ＤＲ（預託証券）およびカントリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成12年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

* MSCI -KOKUSAI インデックスは、MSCI Inc. が発表している、日本を除く世界の主要国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（円ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

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

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

* MSCI エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が発表している、世界の新興国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（円ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

< 日本債券インデックスマザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、日興債券パフォーマンスインデックス（総合） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	・主としてわが国の公社債に投資し、日興債券パフォーマンスインデックス（総合）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	・株式への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.1%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成10年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

* 日興債券パフォーマンスインデックス（総合）は、日興フィナンシャル・インテリジェンス株式会社が発表している、日本の債券市場の動きを表す指数です。国債、地方債、政府保証債、財投機関債、金融債、事業債などの円建て公募利付債で構成されています。対象となる債券は残存年数1年以上、残存額面10億円以上で、格付会社からB B B格相当以上の格付を取得している発行体に限られます。

同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はS M B C日興証券株式会社に帰属します。また、S M B C日興証券株式会社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	・主として世界各国の債券に投資し、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	・株式への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成10年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

^{*}シティグループ世界国債インデックス（除く日本）は、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した、日本を除く世界の主要国の国債市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。

同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケット・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケット・インクは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

< 海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	主として新興国の債券に投資し、ＪＰモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル・ディバーシファイド（円ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	・主として、新興国の現地通貨建債券に投資し、ＪＰモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル・ディバーシファイド（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。なお、新興国の現地通貨建債券の騰落率に償還価額などが連動する債券を活用することもあります。 ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	・株式（新株引受権証券、新株予約権証券および新株引受権付社債券を含みます。）への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（１口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成20年３月31日設定）
決算日	毎年５月16日（休業日の場合は翌営業日）

^{*} ＪＰモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル・ディバーシファイドは、ＪＰモルガンが発表している、エマージング・カントリーの債券市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（円ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はJPMorgan Chase & Co.に帰属します。また、JPMorgan Chase & Co.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



上記体制は平成24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）【分配方針】**収益分配方針**

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

１）分配対象額の範囲

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

２）分配対象額についての分配方針

分配金額は、委託会社が決定するものとし、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。

３）留保益の運用方針

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

収益分配金の支払い**< 分配金再投資コース >**

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

< 分配金受取りコース >

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

（５）【投資制限】**約款に定める投資制限****< 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）株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の70%未満とします。
- ２）投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。以下同じ。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。また、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、投資することを指図することができるものとします。
- ３）投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。
- ４）外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ５）信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ６）わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- ７）わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- ８）わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- ９）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- １０）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- １１）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ）株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式

の時価合計額を超えないものとします。

ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

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

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

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

ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の範囲内

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

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

< 日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド >

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

2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

3) 外貨建資産への投資は行ないません。

4) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

5) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

6) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

- ん。
- 8) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
 - 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

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

かかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

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

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

予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

< 日本債券インデックスマザーファンド >

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 3) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 4) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 7) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 3) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 4) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りでは

ありません。

- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

< 海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド >

- 1) 株式（新株引受権証券、新株予約権証券および新株引受権付社債券を含みます。）への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 3) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 4) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

- ・一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。
- ・一般に新興国の株式および債券は、先進国の株式および債券に比べて価格変動が大きくなる傾向があり、基準価額にも大きな影響を与える場合があります。

流動性リスク

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

信用リスク

- ・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れや廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト（債務不履行）が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。
- ・一般に新興国の債券は、先進国の債券に比べて利回りが高い反面、価格変動が大きく、デフォルトが生じるリスクが高まる場合があります。
- ・格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。
- ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

為替変動リスク

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

カントリー・リスク

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

ることもあります。以上のような要因は、ファンドの信託財産の価値に影響を与える可能性があります。

<その他の留意事項>

・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。

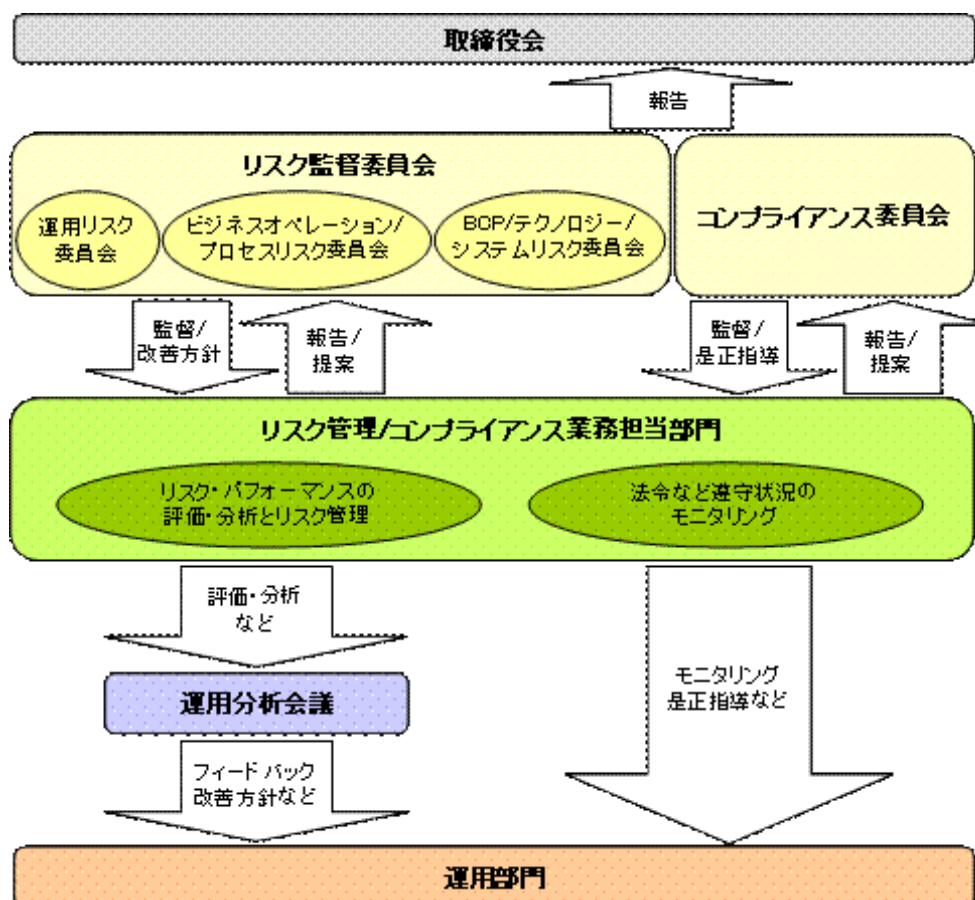
・運用制限や規制上の制限に関する事項

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

・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

(2) リスク管理体制



■全社リスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況およびリスク管理状況については、リスクマネジメント部が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告し

ております。本委員会およびその部門別委員会においては、各種リスク（運用リスク、事務リスク、システムリスクなど）に関するモニタリングとその報告に加えて、重大なリスクの洗い出し、より予防的なリスクの軽減に繋がる施策、管理手法の構築などに努めております。

■ リスク・パフォーマンスの評価・分析とリスク管理

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

■ 法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は平成24年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】

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%（税抜3%）が上限となっております。
- ・申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
- ・＜分配金再投資コース＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
- ・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.2%の率を乗じて得た額（1口当たり）が差し引かれます。

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬

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

信託報酬の配分

信託報酬の配分は、以下の通りとします。

信託報酬率（年率）			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
1.1025%	0.5250%	0.5250%	0.0525%
（1.05%）	（0.50%）	（0.50%）	（0.05%）

括弧内は税抜です。

支払時期

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

有価証券届出書、有価証券報告書および臨時報告書（これらの訂正に係る書類を含みま

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

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

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

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

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

< 投資対象とするマザーファンドに係る費用 >

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人受益者の場合

１）収益分配金に対する課税

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

２）解約金および償還金に対する課税

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

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

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

法人受益者の場合

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

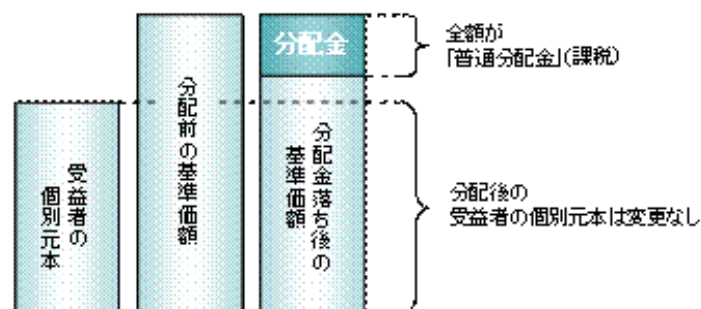
- 1) 各受益者の買付時の基準価額(申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。)が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

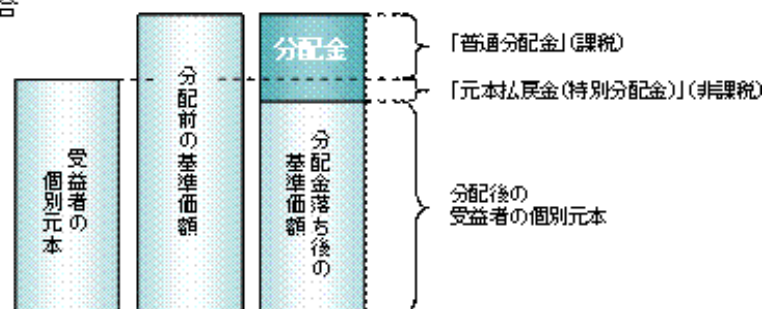
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
- 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

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

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

5【運用状況】

以下の運用状況は2012年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	258,694,460	98.93
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	-	2,806,920	1.07
合計（純資産総額）		261,501,380	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	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	86,243,192	0.8556	73,789,676	0.8403	72,470,154	27.71
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	50,252,368	1.4072	70,715,132	1.4032	70,514,122	26.97
日本	親投資信託受益証券	海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド	46,467,028	1.0207	47,428,896	1.0101	46,936,344	17.95
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	47,059,260	0.9735	45,812,190	0.9733	45,802,777	17.52
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスT O P I Xマザーファンド	19,901,199	0.5974	11,888,977	0.5881	11,703,895	4.48
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	9,120,998	1.2323	11,239,805	1.2353	11,267,168	4.31

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.93
合 計	98.93

【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
2011年 1月末日		261	-	0.7513	-
2月末日		263	-	0.7543	-
3月末日		274	-	0.7765	-
4月末日		279	-	0.7904	-
5月末日		272	-	0.7644	-
6月末日		273	-	0.7556	-
7月末日		267	-	0.7309	-
8月末日		256	-	0.6926	-
9月末日		233	-	0.6469	-
10月末日		262	-	0.6953	-
11月末日		248	-	0.6539	-
12月末日		252	-	0.6587	-
2012年 1月末日		261	-	0.6784	-

(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】

特定期間	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

【収益率の推移】

特定期間	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

(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】

特定期間	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

(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2012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（％）
株式	日本	25,198,205,080	99.52
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	-	121,230,708	0.48
合計（純資産総額）		25,319,435,788	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	113,475,000	0.45

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

（２）投資資産

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	317,000	2,528.32	801,477,440	2,810.00	890,770,000	3.52
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	1,826,400	331.00	604,538,400	349.00	637,413,600	2.52
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	206,200	2,329.43	480,328,466	2,666.00	549,729,200	2.17
日本	株式	キヤノン	電気機器	151,800	3,508.54	532,596,372	3,290.00	499,422,000	1.97
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	182,500	2,126.33	388,055,225	2,425.00	442,562,500	1.75
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	111,100	3,852.63	428,027,193	3,810.00	423,291,000	1.67
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	3,098,600	107.93	334,431,898	115.00	356,339,000	1.41
日本	株式	ファナック	電気機器	25,500	12,506.50	318,915,750	12,810.00	326,655,000	1.29
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	95,900	3,506.43	336,266,637	3,310.00	317,429,000	1.25
日本	株式	三菱商事	卸売業	175,700	1,526.49	268,204,293	1,739.00	305,542,300	1.21
日本	株式	三井物産	卸売業	208,300	1,108.11	230,819,313	1,294.00	269,540,200	1.06
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	1,987	135,844.88	269,923,776	135,400.00	269,039,800	1.06
日本	株式	小松製作所	機械	121,300	1,843.62	223,631,106	2,149.00	260,673,700	1.03
日本	株式	日立製作所	電気機器	549,000	423.84	232,688,160	426.00	233,874,000	0.92
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	109,300	2,427.56	265,332,308	2,123.00	232,043,900	0.92
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	607	378,422.88	229,702,688	375,000.00	227,625,000	0.90
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	308,800	690.04	213,084,352	719.00	222,027,200	0.88
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	100,900	2,085.47	210,423,923	2,146.00	216,531,400	0.86
日本	株式	ソニー	電気機器	152,500	1,575.01	240,189,025	1,391.00	212,127,500	0.84
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	42,500	4,528.23	192,449,775	4,935.00	209,737,500	0.83
日本	株式	三菱地所	不動産業	169,000	1,327.55	224,355,950	1,217.00	205,673,000	0.81
日本	株式	信越化学工業	化学	45,900	3,954.32	181,503,288	3,960.00	181,764,000	0.72
日本	株式	KDDI	情報・通信業	374	561,242.97	209,904,870	483,000.00	180,642,000	0.71
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	56,800	2,821.90	160,283,920	3,130.00	177,784,000	0.70

日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	91,600	1,809.78	165,775,848	1,909.00	174,864,400	0.69
日本	株式	国際石油開発帝石	鉱業	333	523,813.38	174,429,855	520,000.00	173,160,000	0.68
日本	株式	パナソニック	電気機器	279,300	780.56	218,010,408	617.00	172,328,100	0.68
日本	株式	三菱電機	電気機器	245,000	729.71	178,778,950	684.00	167,580,000	0.66
日本	株式	東芝	電気機器	515,000	350.35	180,430,250	323.00	166,345,000	0.66
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	192,400	768.24	147,809,376	829.00	159,499,600	0.63

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	0.11
		鉱業	0.77
		建設業	2.52
		食料品	3.58
		繊維製品	0.95
		パルプ・紙	0.40
		化学	5.95
		医薬品	4.91
		石油・石炭製品	0.87
		ゴム製品	0.76
		ガラス・土石製品	1.15
		鉄鋼	1.81
		非鉄金属	1.20
		金属製品	0.70
		機械	5.27
		電気機器	13.45
		輸送用機器	9.95
		精密機器	1.38
		その他製品	1.60
		電気・ガス業	3.12
		陸運業	4.11
		海運業	0.38
		空運業	0.29
		倉庫・運輸関連業	0.24
		情報・通信業	6.36
		卸売業	5.70
		小売業	4.22
		銀行業	9.51
		証券、商品先物取引業	1.03
		保険業	2.26
		その他金融業	0.82
		不動産業	2.27
		サービス業	1.90
合 計			99.52

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
< 有価証券先物取引等 >

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 （各通貨）	評価額（円）	投資 比率 （％）
株価指数先物取引	日本	東京証券取引所	東証株価指数先物 2012年03月	買建	15	日本円	113,443,102	113,475,000	0.45

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

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

以下の運用状況は2012年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（％）
株式	アメリカ	33,646,451,228	54.23
	カナダ	3,480,866,678	5.61
	ドイツ	2,334,778,907	3.76
	イタリア	642,217,876	1.04
	フランス	2,409,247,326	3.88
	オーストラリア	2,341,462,457	3.77
	イギリス	6,206,371,660	10.00
	スイス	2,494,057,104	4.02
	バミューダ	133,662,327	0.22
	香港	725,274,350	1.17
	シンガポール	497,086,225	0.80
	ニュージーランド	33,442,532	0.05
	オランダ	722,998,342	1.17
	スペイン	889,692,117	1.43
	ベルギー	267,562,909	0.43
	スウェーデン	859,235,078	1.38
	ノルウェー	209,892,792	0.34
	オーストリア	75,796,979	0.12
	ルクセンブルグ	136,784,755	0.22
	フィンランド	241,698,250	0.39
	デンマーク	291,294,201	0.47
	アイルランド	381,578,251	0.61
	ギリシャ	26,066,008	0.04
	イスラエル	183,894,635	0.30
	ポルトガル	53,200,736	0.09
	中国	3,810,374	0.01
	ケイマン島	60,501,677	0.10
	モーリシャス	9,886,844	0.02
	ジャージー	141,066,081	0.23
	ガーンジー	16,855,972	0.03
	小計	59,516,734,671	95.92
投資証券	アメリカ	841,371,311	1.36
	カナダ	10,464,168	0.02
	フランス	76,112,166	0.12
	オーストラリア	179,630,035	0.29
	イギリス	71,399,943	0.12
	香港	23,856,700	0.04
	シンガポール	14,572,648	0.02
	オランダ	7,090,127	0.01
	小計	1,224,497,098	1.97
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	-	1,305,531,474	2.10
合計（純資産総額）		62,046,763,243	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	899,764,038	1.45
	買建	ドイツ	433,031,508	0.70

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約先物取引	買建	—	960,986,980	1.55

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

（２）投資資産

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	34,316	30,374.80	1,042,341,581	34,600.90	1,187,364,614	1.91
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	179,966	6,067.63	1,091,966,596	6,529.73	1,175,128,705	1.89
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	44,202	13,775.90	608,922,190	14,703.15	649,908,636	1.05
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	279,099	2,048.51	571,737,539	2,261.61	631,213,591	1.02
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	74,136	7,981.71	591,732,052	7,898.46	585,559,919	0.94
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	392,358	1,238.88	486,085,891	1,443.58	566,400,946	0.91
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	122,143	4,251.36	519,273,864	4,434.75	541,673,913	0.87
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	101,429	4,864.64	493,415,793	5,018.93	509,065,030	0.82
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	219,346	2,169.96	475,971,124	2,240.99	491,552,017	0.79
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	101,714	4,927.27	501,172,727	4,827.98	491,073,137	0.79
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	288,785	1,441.29	416,223,105	1,648.28	475,998,655	0.77
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	660,571	630.37	416,402,489	633.37	418,385,358	0.67
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	9,411	44,550.16	419,261,580	44,123.96	415,250,608	0.67
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	185,655	1,951.51	362,307,403	2,234.11	414,774,620	0.67
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	144,320	2,557.97	369,165,681	2,826.82	407,967,210	0.66
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	194,362	1,881.24	365,641,452	2,042.40	396,965,182	0.64
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	76,486	5,113.64	391,121,945	5,152.59	394,101,365	0.64
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	1,881,450	208.92	393,075,920	206.28	388,105,995	0.63
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	701,158	548.72	384,739,347	550.46	385,960,074	0.62
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	65,013	5,258.00	341,838,301	5,720.86	371,930,401	0.60
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	118,871	3,015.97	358,511,821	3,056.54	363,334,418	0.59
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	86,383	4,176.34	360,764,432	4,153.00	358,748,184	0.58

イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	133,953	2,678.76	358,828,166	2,676.36	358,506,491	0.58
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	114,033	2,513.67	286,640,852	2,970.42	338,725,698	0.55
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	26,003	11,770.43	306,066,543	12,945.81	336,629,845	0.54
アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC	食品・生活必需品小売り	70,167	4,331.51	303,929,048	4,682.09	328,528,489	0.53
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	149,793	2,472.42	370,351,298	2,184.47	327,218,015	0.53
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	187,821	1,659.37	311,664,044	1,714.00	321,925,052	0.52
フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	78,567	3,791.49	297,885,814	4,000.51	314,307,825	0.51
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	203,585	1,344.29	273,676,872	1,493.23	303,999,025	0.49

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	12.21
		素材	7.56
		資本財	7.44
		商業・専門サービス	0.82
		運輸	1.82
		自動車・自動車部品	1.33
		耐久消費財・アパレル	1.21
		消費者サービス	1.72
		メディア	2.49
		小売	2.68
		食品・生活必需品小売り	2.26
		食品・飲料・タバコ	6.64
		家庭用品・パーソナル用品	1.72
		ヘルスケア機器・サービス	2.68
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.73
		銀行	7.18
		各種金融	4.37
		保険	3.88
		不動産	0.64
		ソフトウェア・サービス	5.72
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.55
		電気通信サービス	3.92
		公益事業	3.63
		半導体・半導体製造装置	1.71
投資証券	—	-	1.97
合 計			97.90

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
 < 有価証券先物取引等 >

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業 取引所	S P 5 0 0 1203	買建	36	米ドル	11,006,138	899,764,038	1.45
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	D J S T X 5 1203	買建	180	ユーロ	4,095,050	433,031,508	0.70

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

< 為替予約取引 >

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率(%)
為替予約先物取引	米ドル	買建	8,713,000	677,294,509	665,180,160	1.07
	ユーロ	買建	2,945,000	298,299,725	295,806,820	0.48

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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

以下の運用状況は2012年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（％）
株式	バミューダ	10,972,013	0.17
	香港	341,144,638	5.19
	マレーシア	212,322,575	3.23
	タイ	121,182,669	1.84
	フィリピン	48,462,645	0.74
	インドネシア	181,946,760	2.77
	メキシコ	295,082,031	4.49
	ブラジル	993,818,820	15.11
	チリ	109,663,866	1.67
	韓国	949,240,149	14.43
	台湾	673,264,734	10.24
	トルコ	85,520,067	1.30
	インド	424,022,874	6.45
	チェコ	20,505,088	0.31
	エジプト	19,691,702	0.30
	コロンビア	57,960,730	0.88
	ハンガリー	20,699,059	0.31
	モロッコ	7,257,436	0.11
	ペルー	45,194,389	0.69
	ポーランド	90,905,563	1.38
	南アフリカ	484,415,639	7.36
	ロシア	414,897,364	6.31
	中国	740,560,983	11.26
	ケイマン島	48,950,200	0.74
	小計	6,397,681,994	97.26
投資証券	トルコ	2,386,930	0.04
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	-	177,860,623	2.70
合計（純資産総額）		6,577,929,547	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	154,791,708	2.35

（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。

[次へ](#)

(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	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	半導体・半導体製造装置	2,560	61,562.27	157,599,423	75,597.00	193,528,320	2.94
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	584,355	194.37	113,581,118	201.47	117,731,170	1.79
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	122,200	1,078.58	131,802,218	918.85	112,283,641	1.71
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	99,200	1,010.01	100,193,126	1,072.73	106,414,439	1.62
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	139,200	703.00	97,858,221	763.38	106,261,800	1.62
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,442,920	65.79	94,930,441	59.99	86,555,720	1.32
ブラジル	株式	VALE SA-PREF A	素材	45,150	1,845.51	83,324,695	1,817.57	82,063,095	1.25
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	69,860	1,144.54	79,957,480	1,170.09	81,742,347	1.24
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	電気通信サービス	904,800	88.32	79,911,041	90.00	81,431,276	1.24
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	52,200	1,558.95	81,377,301	1,549.93	80,906,346	1.23
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA - H	銀行	1,390,575	61.22	85,134,018	53.39	74,238,627	1.13
香港	株式	CNOOC LTD	エネルギー	432,000	177.58	76,715,352	155.63	67,232,160	1.02
中国	株式	PETROCHINA CO LTD-H	エネルギー	511,000	104.83	53,565,656	110.32	56,373,520	0.86
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車部品	3,800	15,550.36	59,091,381	14,644.80	55,650,240	0.85
中国	株式	BANK OF CHINA LTD - H	銀行	1,665,000	39.41	65,619,220	32.31	53,792,820	0.82
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	37,873	1,342.54	50,846,206	1,415.46	53,607,610	0.81
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	56,500	1,055.03	59,609,444	903.58	51,052,010	0.78
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	211,849	252.51	53,493,798	240.13	50,870,876	0.77
ロシア	株式	LUKOIL OAO-SPON ADR	エネルギー	11,485	4,690.15	53,866,336	4,422.40	50,791,286	0.77
南アフリカ	株式	MTN GROUP LTD	電気通信サービス	39,515	1,362.94	53,856,485	1,275.34	50,395,028	0.77
南アフリカ	株式	SASOL LTD	エネルギー	12,700	3,515.45	44,646,270	3,854.22	48,948,644	0.74
ブラジル	株式	VALE SA	素材	25,760	2,083.91	53,681,457	1,898.77	48,912,402	0.74
ブラジル	株式	CIA DE BEBIDAS DAS AME-PREF	食品・飲料・タバコ	16,700	2,239.93	37,406,913	2,788.13	46,561,730	0.71
韓国	株式	POSCO	素材	1,600	30,868.07	49,388,910	28,238.70	45,181,920	0.69
中国	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	24,400	2,111.08	51,510,323	1,816.34	44,318,696	0.67
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	9,835	4,461.44	43,878,286	4,204.06	41,346,979	0.63
中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	407,000	76.78	31,250,567	90.92	37,002,608	0.56
中国	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	169,000	263.98	44,612,620	218.18	36,871,997	0.56
メキシコ	株式	WALMART DE MEXICO -SER V	食品・生活必需品小売り	154,200	202.62	31,243,387	233.66	36,029,801	0.55
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	28,346	1,469.40	41,651,612	1,231.86	34,918,374	0.53

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	14.15
		素材	13.40
		資本財	4.94
		運輸	1.36
		自動車・自動車部品	3.65
		耐久消費財・アパレル	1.05
		消費者サービス	0.48
		メディア	0.80
		小売	1.67
		食品・生活必需品小売り	2.13
		食品・飲料・タバコ	4.46
		家庭用品・パーソナル用品	0.88
		ヘルスケア機器・サービス	0.30
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.73
		銀行	17.41
		各種金融	2.38
		保険	2.32
		不動産	1.40
		ソフトウェア・サービス	2.65
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.43
		電気通信サービス	7.65
		公益事業	3.48
		半導体・半導体製造装置	6.55
投資証券	—	-	0.04
合 計			97.30

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
 < 有価証券先物取引等 >

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	ニューヨーク証券取引所	MINMSCIE1203	買建	40	米ドル	1,854,775	154,791,708	2.35

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

（参考）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2012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（％）
国債証券	日本	23,967,907,010	75.71
地方債証券	日本	2,202,552,000	6.96
特殊債券	日本	2,906,664,000	9.18
社債券	日本	2,272,138,382	7.18
	オーストラリア	199,503,000	0.63
	小計	2,471,641,382	7.81
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	-	107,564,418	0.34
合計（純資産総額）		31,656,328,810	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	利率（％）	償還期限	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	国債証券	第２９９回利付国債（１０年）	1.300	2019/03/20	750,000,000	104.98	787,395,000	105.11	788,287,500	2.49
日本	国債証券	第６０回利付国債（２０年）	1.400	2022/12/20	545,000,000	102.97	561,219,200	103.37	563,344,700	1.78
日本	国債証券	第８１回利付国債（５年）	0.800	2014/03/20	494,000,000	101.50	501,423,080	101.41	500,950,580	1.58
日本	国債証券	第２９０回利付国債（１０年）	1.400	2018/03/20	446,000,000	105.69	471,413,080	105.69	471,386,320	1.49
日本	国債証券	第７０回利付国債（５年）	0.800	2013/03/20	407,000,000	100.88	410,568,240	100.76	410,101,340	1.30
日本	国債証券	第３０３回利付国債（１０年）	1.400	2019/09/20	361,000,000	105.46	380,739,480	105.72	381,645,590	1.21
日本	国債証券	第２６８回利付国債（１０年）	1.500	2015/03/20	361,000,000	104.28	376,454,410	104.02	375,504,980	1.19
日本	国債証券	第３０５回利付国債（１０年）	1.300	2019/12/20	343,000,000	104.49	358,400,700	104.79	359,433,130	1.14
日本	国債証券	第２８５回利付国債（１０年）	1.700	2017/03/20	331,000,000	106.93	353,948,320	106.85	353,666,880	1.12
日本	国債証券	第３１３回利付国債（１０年）	1.300	2021/03/20	340,000,000	103.37	351,461,400	103.77	352,804,400	1.11
日本	国債証券	第８８回利付国債（２０年）	2.300	2026/06/20	300,000,000	111.13	333,402,000	111.44	334,311,000	1.06
日本	国債証券	第９３回利付国債（５年）	0.500	2015/12/20	300,000,000	100.85	302,574,000	100.90	302,703,000	0.96
日本	国債証券	第２９１回利付国債（１０年）	1.300	2018/03/20	287,000,000	105.04	301,482,020	105.10	301,625,520	0.95
日本	国債証券	第２８２回利付国債（１０年）	1.700	2016/09/20	274,000,000	106.53	291,914,120	106.34	291,374,340	0.92
日本	国債証券	第２５０回利付国債（１０年）	0.500	2013/06/20	285,000,000	100.59	286,695,750	100.52	286,484,850	0.90
日本	国債証券	第２６１回利付国債（１０年）	1.800	2014/06/20	270,000,000	104.26	281,510,100	103.91	280,543,500	0.89
日本	国債証券	第２９回利付国債（３０年）	2.400	2038/09/20	246,000,000	110.57	272,002,200	111.30	273,798,000	0.86

日本	国債証券	第 3 1 0 回利付国債（ 1 0 年）	1.000	2020/09/20	268,000,000	101.23	271,320,520	101.70	272,545,280	0.86
日本	国債証券	第 2 8 9 回利付国債（ 1 0 年）	1.500	2017/12/20	254,000,000	106.23	269,844,520	106.22	269,808,960	0.85
日本	国債証券	第 2 9 2 回利付国債（ 1 0 年）	1.700	2018/03/20	241,000,000	107.58	259,289,490	107.51	259,103,920	0.82
日本	国債証券	第 5 0 回利付国債（ 2 0 年）	1.900	2021/03/22	237,000,000	108.70	257,628,480	109.03	258,408,210	0.82
日本	国債証券	第 3 1 1 回利付国債（ 2 年）	0.200	2013/12/15	250,000,000	100.13	250,347,500	100.14	250,347,500	0.79
日本	国債証券	第 2 9 8 回利付国債（ 1 0 年）	1.300	2018/12/20	221,000,000	105.04	232,138,400	105.11	232,288,680	0.73
日本	国債証券	第 3 3 回利付国債（ 2 0 年）	3.800	2016/09/20	200,000,000	116.77	233,550,000	116.00	232,000,000	0.73
日本	国債証券	第 1 4 回利付国債（ 3 0 年）	2.400	2034/03/20	208,000,000	110.72	230,299,680	111.25	231,406,240	0.73
日本	国債証券	第 2 5 2 回利付国債（ 1 0 年）	1.000	2013/06/20	228,000,000	101.41	231,217,080	101.21	230,754,240	0.73
日本	国債証券	第 2 5 1 回利付国債（ 1 0 年）	0.900	2013/06/20	227,000,000	101.24	229,832,960	101.07	229,428,900	0.72
日本	国債証券	第 9 2 回利付国債（ 2 0 年）	2.100	2026/12/20	210,000,000	108.13	227,083,500	108.55	227,957,100	0.72
日本	国債証券	第 8 8 回利付国債（ 5 年）	0.500	2015/03/20	225,000,000	100.92	227,070,000	100.90	227,022,750	0.72
日本	国債証券	第 9 5 回利付国債（ 5 年）	0.600	2016/03/20	220,000,000	101.25	222,758,800	101.28	222,822,600	0.70

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	75.71
地方債証券	6.96
特殊債券	9.18
社債券	7.81
合 計	99.66

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）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2012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（％）
国債証券	アメリカ	169,008,574,454	40.44
	カナダ	12,422,762,013	2.97
	ドイツ	40,005,489,058	9.57
	イタリア	37,234,712,352	8.91
	フランス	40,195,666,805	9.62
	オーストラリア	6,187,556,494	1.48
	イギリス	35,814,428,463	8.57
	スイス	1,855,069,358	0.44
	シンガポール	1,607,954,491	0.38
	マレーシア	2,290,230,406	0.55
	オランダ	11,701,639,989	2.80
	スペイン	17,969,046,346	4.30
	ベルギー	10,376,224,984	2.48
	スウェーデン	2,566,103,497	0.61
	ノルウェー	1,268,698,024	0.30
	オーストリア	7,882,545,262	1.89
	フィンランド	2,981,253,564	0.71
	デンマーク	3,532,468,165	0.85
	メキシコ	3,660,633,452	0.88
	ポーランド	3,083,411,338	0.74
	小計	411,644,468,515	98.49
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	-	6,297,020,049	1.51
合計（純資産総額）		417,941,488,564	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（％）
為替予約先物取引	売建	—	778,465,880	0.19

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

（２）投資資産

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	利率（％）	償還期限	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	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2020/02/15	46,300,000	8,704.93	4,030,384,036	8,903.04	4,122,109,256	0.99
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2021/02/15	40,000,000	8,676.15	3,470,460,397	8,895.88	3,558,353,250	0.85
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2013/05/15	43,200,000	8,040.19	3,473,361,405	7,976.94	3,446,036,460	0.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.125	2013/08/31	41,100,000	8,040.79	3,304,762,699	7,994.84	3,285,878,340	0.79

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2015/08/15	37,200,000	8,673.90	3,226,692,195	8,669.13	3,224,916,360	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2020/05/15	34,500,000	8,627.36	2,976,439,091	8,835.02	3,048,081,144	0.73
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.000	2014/02/15	36,280,000	8,282.46	3,004,875,127	8,223.98	2,983,659,150	0.71
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2016/02/15	33,500,000	8,832.63	2,958,931,363	8,856.50	2,966,927,394	0.71
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5.125	2016/05/15	31,000,000	9,089.79	2,817,834,575	9,113.09	2,825,057,512	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2013/08/15	34,400,000	8,185.79	2,815,911,007	8,118.96	2,792,920,627	0.67
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.500	2016/01/04	24,500,000	11,055.27	2,708,541,710	11,204.05	2,744,991,547	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2015/11/15	30,400,000	8,784.89	2,670,607,605	8,802.80	2,676,049,680	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.750	2014/05/15	30,550,000	8,487.73	2,593,000,751	8,422.09	2,572,948,017	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.375	2013/06/30	31,650,000	8,040.79	2,544,908,501	7,988.27	2,528,288,690	0.60
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3.250	2016/04/25	22,700,000	10,566.01	2,398,484,269	10,666.34	2,421,259,457	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.375	2019/11/15	27,000,000	8,556.95	2,310,375,656	8,752.67	2,363,221,068	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2012/12/31	28,300,000	7,951.16	2,250,177,714	7,882.36	2,230,706,841	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.125	2013/09/30	27,400,000	8,056.90	2,207,589,658	8,012.14	2,195,327,087	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2014/06/30	26,700,000	8,092.34	2,160,654,778	8,075.99	2,156,289,746	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2019/08/15	24,200,000	8,697.39	2,104,768,525	8,882.76	2,149,626,785	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2039/08/15	21,000,000	9,613.14	2,018,759,203	9,956.85	2,090,938,303	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.250	2016/07/31	24,200,000	8,475.70	2,051,118,220	8,537.85	2,066,160,153	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.750	2041/02/15	19,800,000	10,021.06	1,984,169,088	10,365.00	2,052,270,928	0.49
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.250	2013/08/01	20,150,000	10,008.69	2,016,751,732	10,147.14	2,044,649,426	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.750	2017/08/15	22,000,000	9,138.15	2,010,393,206	9,246.75	2,034,285,825	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2017/11/15	22,400,000	8,936.46	2,001,767,040	9,066.54	2,030,906,010	0.49
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4.000	2013/10/25	18,800,000	10,600.04	1,992,807,819	10,590.75	1,991,060,552	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.125	2015/05/15	23,100,000	8,591.56	1,984,649,565	8,577.24	1,981,341,356	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2018/02/15	22,400,000	8,607.07	1,927,983,960	8,755.06	1,961,132,880	0.47
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.750	2016/08/01	20,200,000	9,407.97	1,900,410,400	9,645.25	1,948,341,164	0.47

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.49
合 計	98.49

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

< 為替予約取引 >

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資 比率（%）
為替予約先物取引	ユーロ	売建	3,800,000	383,759,590	381,824,000	0.09
	米ドル	売建	4,230,000	324,102,062	323,045,100	0.08
	英ポンド	売建	613,000	73,786,439	73,596,780	0.02

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

（参考）海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2012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（％）
国債証券	マレーシア	64,806,141	9.57
	タイ	57,056,269	8.42
	インドネシア	65,642,489	9.69
	メキシコ	68,152,131	10.06
	ブラジル	65,199,226	9.63
	トルコ	66,585,418	9.83
	コロンビア	28,338,773	4.18
	ハンガリー	36,167,754	5.34
	ペルー	14,487,607	2.14
	ポーランド	65,774,113	9.71
	南アフリカ	65,385,201	9.65
	小計	597,595,122	88.23
特殊債券	国際機関	59,108,799	8.73
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	-	20,600,464	3.04
合計（純資産総額）		677,304,385	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（％）
為替予約先物取引	買建	—	7,062,814	1.04
	売建	—	2,292,046	0.34

（注）為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

（２）投資資産

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	利率（％）	償還期限	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（％）
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	7.500	2017/03/02	17,400,000	265.83	46,254,754	254.53	44,288,832	6.54
ブラジル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	12.500	2016/01/05	500,000	5,173.71	25,868,550	5,081.15	25,405,754	3.75
コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	12.000	2015/10/22	380,000,000	5.44	20,678,240	5.32	20,225,948	2.99
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	10.000	2014/01/01	420,000	4,263.86	17,908,226	4,358.63	18,306,251	2.70
トルコ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	10.000	2013/04/10	390,000	4,381.21	17,086,703	4,308.43	16,802,877	2.48
トルコ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	8.000	2013/10/09	400,000	4,118.04	16,472,165	4,188.87	16,755,480	2.47
トルコ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	11.000	2014/08/06	350,000	4,505.21	15,768,223	4,417.31	15,460,602	2.28
マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.814	2017/02/15	520,000	2,498.31	12,991,224	2,566.43	13,345,417	1.97

ブラジル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	10.250	2028/01/10	250,000	4,706.55	11,766,370	4,884.68	12,211,702	1.80
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.250	2017/09/15	1,080,000	1,002.88	10,831,145	1,024.91	11,068,979	1.63
国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	6.250	2013/12/11	4,500,000	248.82	11,196,964	244.47	11,001,005	1.62
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.000	2020/06/11	1,470,000	630.61	9,269,916	679.81	9,993,175	1.48
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.500	2026/12/21	840,000	1,131.75	9,506,696	1,167.70	9,808,689	1.45
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	5.125	2018/03/13	3,500,000	268.23	9,388,046	272.69	9,544,017	1.41
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	5.250	2013/04/25	400,000	2,373.51	9,494,053	2,378.94	9,515,774	1.40
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	10.000	2017/01/01	220,000	3,943.74	8,676,230	4,216.15	9,275,519	1.37
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	6.250	2015/10/24	360,000	2,450.59	8,822,112	2,466.18	8,878,257	1.31
トルコ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	10.500	2020/01/15	195,000	4,569.57	8,910,653	4,521.93	8,817,763	1.30
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.250	2020/01/15	910,000	906.43	8,248,484	951.88	8,662,142	1.28
マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	5.094	2014/04/30	320,000	2,617.04	8,374,520	2,620.72	8,386,303	1.24
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	10.250	2022/07/15	720,000,000	1.00	7,233,963	1.16	8,384,772	1.24
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	5.850	2021/03/31	2,710,000	291.28	7,893,630	297.02	8,049,354	1.19
マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.160	2021/07/15	290,000	2,586.18	7,499,920	2,622.10	7,604,078	1.12
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.750	2021/03/31	800,000	866.97	6,935,781	913.84	7,310,754	1.08
ペルー	国債証券	PERU BONO SOBERANO	7.840	2020/08/12	220,000	3,057.46	6,726,403	3,248.60	7,146,926	1.06
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.000	2018/12/21	700,000	975.54	6,828,792	1,004.35	7,030,432	1.04
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	5.500	2015/04/25	280,000	2,362.00	6,613,609	2,404.91	6,733,760	0.99
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.500	2018/12/13	960,000	658.95	6,325,927	695.06	6,672,565	0.99
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	5.000	2013/10/24	280,000	2,363.25	6,617,103	2,373.87	6,646,828	0.98
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	5.000	2016/04/25	280,000	2,314.11	6,479,519	2,358.17	6,602,867	0.97

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	88.23
特殊債券	8.73
合 計	96.96

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

< 為替予約取引 >

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資 比率（％）
為替予約先物取引	米ドル	買建	29,000	2,214,730	2,214,730	0.33
	タイバーツ	買建	677,729	1,664,027	1,660,435	0.25
	コロンビアペソ	買建	31,723,677	1,343,662	1,332,394	0.20
	フィリピンペソ	買建	538,750	960,989	958,975	0.14
	トルコリラ	買建	21,000	905,730	896,280	0.13
	米ドル	売建	30,012	2,304,651	2,292,046	0.34

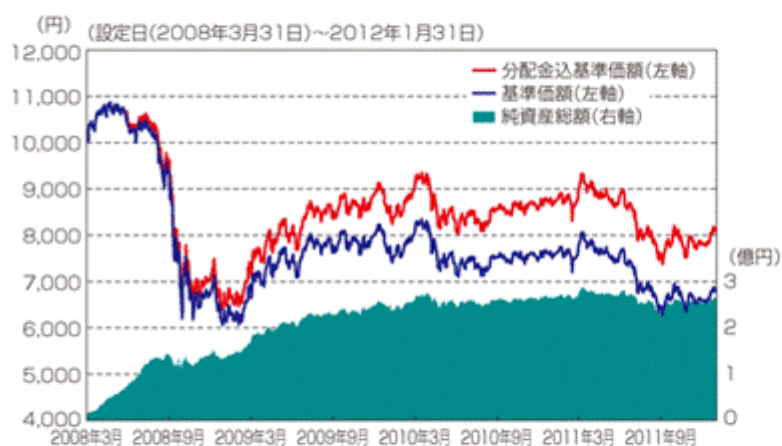
(注) 為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(参考情報)

運用実績

2012年1月31日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額……………6,784円

純資産総額……………2.61億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

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

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2011年9月	2011年10月	2011年11月	2011年12月	2012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	1,320円

主要な資産の状況

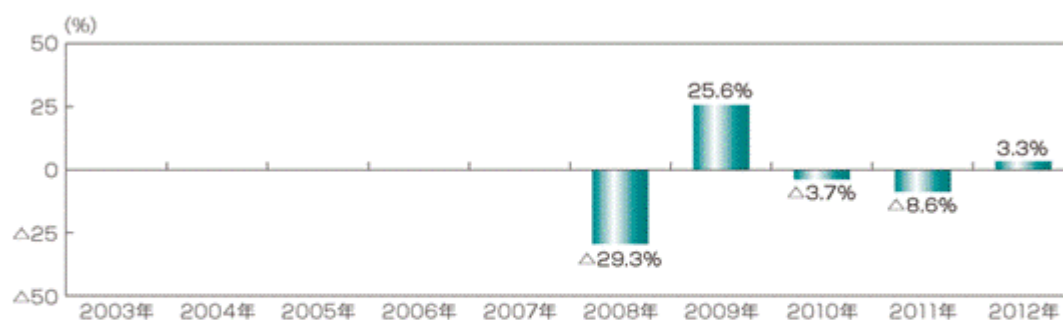
組入資産	投資対象	銘柄数	比率※1	組入上位銘柄	国・地域名	比率※2
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	日本株式	1,638	4.5%	トヨタ自動車	日本	3.5%
				三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	2.5%
				本田技研工業	日本	2.2%
				キャノン	日本	2.0%
				三井住友フィナンシャルグループ	日本	1.7%
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI(ヘッジなし) マザーファンド	海外先進国株式	1,285	27.7%	アップル	アメリカ	1.9%
				エクソンモービル	アメリカ	1.9%
				IBM	アメリカ	1.0%
				マイクロソフト	アメリカ	1.0%
				シェブロン	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	682	17.9%	サムスン電子	韓国	2.9%
				台湾セミコンダクター	台湾	1.8%
				ガスプロム	ロシア	1.7%
				ブラジル石油公社	ブラジル	1.6%
				チャイナ・モバイル	香港	1.6%
日本債券インデックス マザーファンド	日本債券	257	4.3%	第299回利付国債(10年)	日本	2.5%
				第60回利付国債(20年)	日本	1.8%
				第81回利付国債(5年)	日本	1.6%
				第290回利付国債(10年)	日本	1.5%
				第70回利付国債(5年)	日本	1.3%
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	470	27.0%	アメリカ国債(クーポン3.625%)	アメリカ	1.0%
				アメリカ国債(クーポン3.625%)	アメリカ	0.9%
				アメリカ国債(クーポン3.625%)	アメリカ	0.8%
				アメリカ国債(クーポン3.125%)	アメリカ	0.8%
				アメリカ国債(クーポン4.25%)	アメリカ	0.8%
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	111	17.5%	国際復興開発銀行(IBRD)(クーポン7.5%)	国際機関	6.5%
				ブラジル国債(クーポン12.5%)	ブラジル	3.8%
				コロンビア国債(クーポン12%)	コロンビア	3.0%
				ブラジル国債(クーポン10%)	ブラジル	2.7%
				トルコ国債(クーポン10%)	トルコ	2.5%
現金その他			1.1%			

※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。

※2012年は2012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2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

（1）申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

（2）コースの選択

収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース＞と＜分配金受取りコース＞の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。

＜分配金再投資コース＞

- ・収益分配金を自動的に再投資するコースです。
- ・なお、販売会社によっては、収益分配金を定期的に受け取るための「定期引出契約」を結ぶことができる場合があります。

＜分配金受取りコース＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

（3）申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（4）取扱時間

原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

（5）取得申込不可日

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

（6）申込金額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。

（7）申込単位

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

＜委託会社の照会先＞

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

（8）申込代金の支払い

取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。

（9）受付の中止および取消

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少など、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。

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

（10）償還乗換

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

（11）乗換優遇

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

2【換金（解約）手続等】

＜解約請求による換金＞

- (1) 解約の受付
販売会社の営業日に受け付けます。
- (2) 取扱時間
原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
- (3) 解約請求不可日
販売会社の営業日であっても、解約請求日がニューヨーク証券取引所の休業日またはニューヨークの銀行休業日に該当する場合は、解約請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (4) 解約制限
ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (5) 解約価額
解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額（当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た額）を控除した価額とします。
・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。
< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

- (6) 手取額
1 口当たりの手取額は、解約価額から所得税および地方税を差し引いた金額となります。
税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。
詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。
- (7) 解約単位
1 口単位
販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (8) 解約代金の支払い
原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。
- (9) 受付の中止および取消
・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少など、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

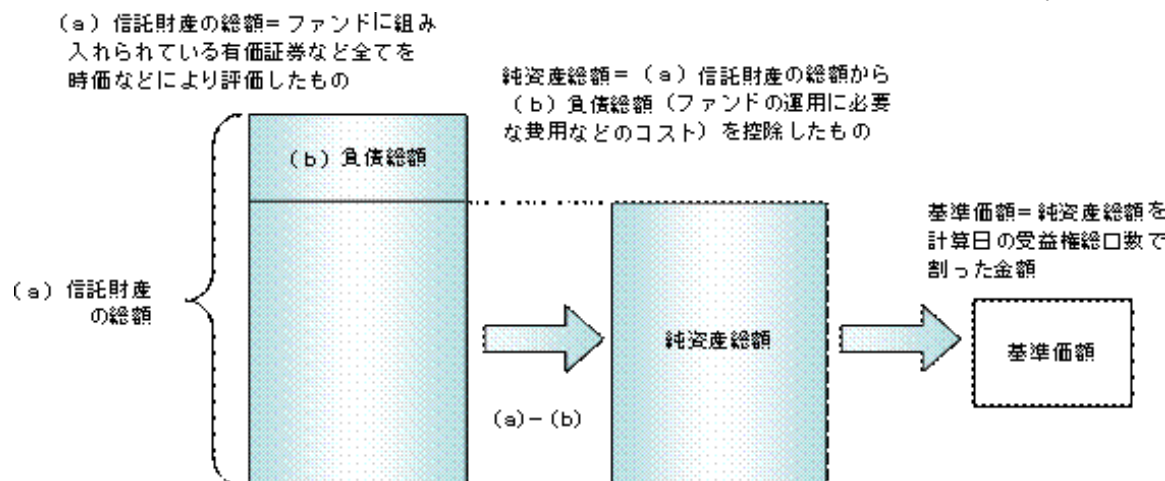
3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

基準価額の算出

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

< 基準価額算出の流れ >



有価証券などの評価基準

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

< 主な資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

外国株式

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

公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日^{*}における以下のいずれかの価額で評価します。

a) 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b) 金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）

c) 価格情報会社の提供する価額

残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができ

ます。

^{*} 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

平成30年12月25日までとします（平成20年3月31日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎月26日から翌月25日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5) 【その他】

信託の終了（繰上償還）

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

イ) 受益者の解約により純資産総額が10億円を下回ることとなった場合

ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

- ハ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、委託会社は書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）
- 3) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
- イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、書面決議が困難な場合
- ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
- ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。）
- ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき

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

償還金について

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

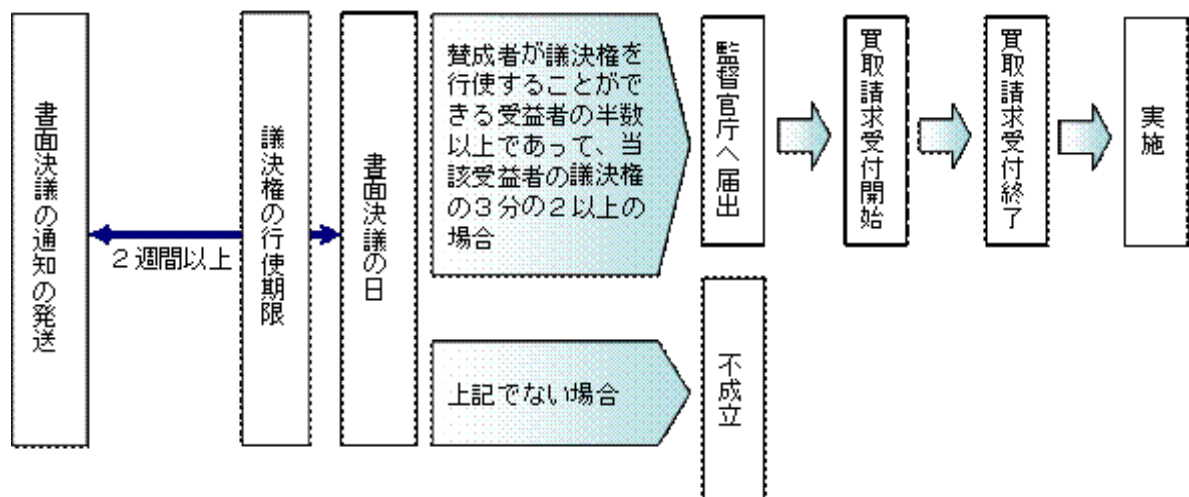
信託約款の変更など

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

書面決議

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

<書面決議の主な流れ>



公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

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

運用報告書の作成

委託会社は、年2回（6月、12月）および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。運用報告書は原則として知れている受益者に対して交付されます。

関係法人との契約について

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

他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

（1）収益分配金・償還金受領権

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

（2）解約請求権

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

（3）帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（2）当ファンドの計算期間は、6ヶ月未満であるため、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23年6月28日から平成23年12月26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23年 6 月27日現在	当期 平成23年12月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,451,734	3,999,937
親投資信託受益証券	265,408,116	251,337,609
未収利息	7	7
流動資産合計	269,859,857	255,337,553
資産合計	269,859,857	255,337,553
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	722,707	765,683
未払解約金	350,515	-
未払受託者報酬	12,872	11,199
未払委託者報酬	257,631	224,220
その他未払費用	125,435	241,603
流動負債合計	1,469,160	1,242,705
負債合計	1,469,160	1,242,705
純資産の部		
元本等		
元本	361,353,562	382,841,607
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	92,962,865	128,746,759
（分配準備積立金）	1,593,849	398,428
元本等合計	268,390,697	254,094,848
純資産合計	268,390,697	254,094,848
負債純資産合計	269,859,857	255,337,553

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自 平成22年12月28日 至 平成23年 6 月27日	当期 自 平成23年 6 月28日 至 平成23年12月26日
営業収益		
受取利息	1,024	1,226
有価証券売買等損益	2,061,603	22,764,448
営業収益合計	2,062,627	22,763,222
営業費用		
受託者報酬	70,694	66,703
委託者報酬	1,415,019	1,335,296
その他費用	134,646	127,055
営業費用合計	1,620,359	1,529,054
営業利益又は営業損失（ ）	442,268	24,292,276
経常利益又は経常損失（ ）	442,268	24,292,276
当期純利益又は当期純損失（ ）	442,268	24,292,276
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（ ）	52,043	161,262
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	85,773,136	92,962,865
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,265,149	9,095,458
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,265,149	9,095,458
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	6,599,754	16,280,863
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	6,599,754	16,280,863
分配金	4,245,349	4,467,475
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	92,962,865	128,746,759

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 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。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎月26日から翌月25日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものいたしますので、当特定期間は平成23年6月28日から平成23年12月26日までとなっております。

（追加情報）

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

（貸借対照表に関する注記）

前期 平成23年 6月27日現在		当期 平成23年12月26日現在	
1.	期首元本額 347,000,261円	1.	期首元本額 361,353,562円
	期中追加設定元本額 28,082,441円		期中追加設定元本額 49,606,430円
	期中一部解約元本額 13,729,140円		期中一部解約元本額 28,118,385円
2.	当特定期間末日における 受益権の総数 361,353,562口	2.	当特定期間末日における 受益権の総数 382,841,607口
3.	元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、 その差額は92,962,865円であります。	3.	元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、 その差額は128,746,759円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期 自 平成22年12月28日 至 平成23年 6月27日		当期 自 平成23年 6月28日 至 平成23年12月26日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
	自 平成22年12月28日 至 平成23年1月25日		自 平成23年6月28日 至 平成23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 569,858円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益 545,383円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益 0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金 3,435,943円	C	信託約款に定める収益調整金 3,781,884円
D	信託約款に定める分配準備積立金 2,040,757円	D	信託約款に定める分配準備積立金 1,592,704円
E	分配対象収益(A+B+C+D) 6,046,558円	E	分配対象収益(A+B+C+D) 5,919,971円
F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり) 0.0173円 173円	F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり) 0.0161円 161円
G	分配金額 695,773円	G	分配金額 731,298円
H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり) 0.0020円 20円	H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり) 0.0020円 20円
	自 平成23年1月26日 至 平成23年2月25日		自 平成23年7月26日 至 平成23年8月25日
A	計算期末における費用控除後の配当等収益 438,529円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益 550,581円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益 0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金 3,476,558円	C	信託約款に定める収益調整金 3,843,091円
D	信託約款に定める分配準備積立金 1,901,269円	D	信託約款に定める分配準備積立金 1,403,016円
E	分配対象収益(A+B+C+D) 5,816,356円	E	分配対象収益(A+B+C+D) 5,796,688円
F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり) 0.0166円 166円	F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり) 0.0157円 157円
G	分配金額 698,301円	G	分配金額 738,310円
H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり) 0.0020円 20円	H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり) 0.0020円 20円
	自 平成23年2月26日 至 平成23年3月25日		自 平成23年8月26日 至 平成23年9月26日
A	計算期末における費用控除後の配当等収益 507,587円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益 462,048円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益 0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金 3,540,127円	C	信託約款に定める収益調整金 3,795,457円
D	信託約款に定める分配準備積立金 1,638,077円	D	信託約款に定める分配準備積立金 1,179,033円
E	分配対象収益(A+B+C+D) 5,685,791円	E	分配対象収益(A+B+C+D) 5,436,538円
F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり) 0.0161円 161円	F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり) 0.0150円 150円
G	分配金額 705,759円	G	分配金額 721,133円
H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり) 0.0020円 20円	H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり) 0.0020円 20円
	自 平成23年3月26日 至 平成23年4月25日		自 平成23年9月27日 至 平成23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 970,801円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益 699,801円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益 0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益 0円

C	信託約款に定める収益調整金	3,586,301円	C	信託約款に定める収益調整金	4,041,344円
D	信託約款に定める分配準備積立金	1,432,656円	D	信託約款に定める分配準備積立金	910,844円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	5,989,758円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	5,651,989円
F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0168円 168円	F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0149円 149円
G	分配金額	710,426円	G	分配金額	753,909円
H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0.0020円 20円	H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0.0020円 20円
		自 平成23年4月26日 至 平成23年5月25日			自 平成23年10月26日 至 平成23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	772,537円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	449,965円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	3,622,245円	C	信託約款に定める収益調整金	4,072,131円
D	信託約款に定める分配準備積立金	1,681,924円	D	信託約款に定める分配準備積立金	851,699円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	6,076,706円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	5,373,795円
F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0170円 170円	F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0141円 141円
G	分配金額	712,383円	G	分配金額	757,142円
H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0.0020円 20円	H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0.0020円 20円
		自 平成23年5月26日 至 平成23年6月27日			自 平成23年11月26日 至 平成23年12月26日
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	577,198円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	620,382円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	3,711,740円	C	信託約款に定める収益調整金	4,129,118円
D	信託約款に定める分配準備積立金	1,739,358円	D	信託約款に定める分配準備積立金	543,729円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	6,028,296円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	5,293,229円
F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0166円 166円	F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.0138円 138円
G	分配金額	722,707円	G	分配金額	765,683円
H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0.0020円 20円	H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0.0020円 20円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	前期 自 平成22年12月28日 至 平成23年 6月27日	当期 自 平成23年 6月28日 至 平成23年12月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	前期 平成23年 6月27日現在	当期 平成23年12月26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23年6月27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	6,019,219
合計	6,019,219

当期（平成23年12月26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	11,290,266
合計	11,290,266

（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23年 6月27日現在		当期 平成23年12月26日現在	
1口当たり純資産額	0.7427円	1口当たり純資産額	0.6637円
（1万口当たり純資産額）	（7,427円）	（1万口当たり純資産額）	（6,637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	87,568,300	71,630,869	
	日本債券インデックスマザーファンド	9,112,432	11,234,717	
	海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド	49,758,961	69,841,677	
	日本株式インデックスTOPIXマ ザーファンド	19,553,782	11,045,931	
	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	46,184,562	43,884,570	
	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	46,454,604	43,699,845	
親投資信託受益証券 合計		258,632,641	251,337,609	
合計		258,632,641	251,337,609	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド」、「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」、「海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド」、「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とおりです。

１．「日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

対象年月日		平成23年 6月27日現在	平成23年12月26日現在
科目		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		144,497,075	91,439,690
株式		28,143,021,100	24,398,592,080
派生商品評価勘定		4,413,523	45,157
前払金		—	2,229,000
未収入金		45,342,350	—
未収配当金		135,755,859	2,317,250
未収利息		246	170
流動資産合計		28,473,030,153	24,494,623,347
資産合計		28,473,030,153	24,494,623,347
負債の部			
流動負債			
前受金		7,680,000	—
派生商品評価勘定		—	1,786,332
未払解約金		71,813,718	—
流動負債合計		79,493,718	1,786,332
負債合計		79,493,718	1,786,332
純資産の部			
元本等			
元本		44,733,256,971	43,355,172,207
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		16,339,720,536	18,862,335,192
元本等合計		28,393,536,435	24,492,837,015
純資産合計		28,393,536,435	24,492,837,015
負債純資産合計		28,473,030,153	24,494,623,347

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

（追加情報）

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

（貸借対照表に関する注記）

平成23年 6月27日現在		平成23年12月26日現在	
1. 期首	平成22年12月28日	1. 期首	平成23年 6月28日
期首元本額	45,790,408,467円	期首元本額	44,733,256,971円
期首からの追加設定元本額	3,965,960,583円	期首からの追加設定元本額	1,767,712,728円
期首からの一部解約元本額	5,023,112,079円	期首からの一部解約元本額	3,145,797,492円
平成23年 6月27日現在の元本の内訳		平成23年12月26日現在の元本の内訳	
DCインデックスバラン ス（株式20）	185,784,524円	DCインデックスバラン ス（株式20）	216,204,285円
DCインデックスバラン ス（株式40）	667,053,703円	DCインデックスバラン ス（株式40）	747,710,970円
DCインデックスバラン ス（株式60）	1,283,002,003円	DCインデックスバラン ス（株式60）	1,394,403,330円
DCインデックスバラン ス（株式80）	1,420,820,685円	DCインデックスバラン ス（株式80）	1,509,813,404円
インデックスファンド日 本株式（DC専用）	828,388,966円	インデックスファンド日 本株式（DC専用）	884,727,394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	19,861,092,597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	17,308,140,288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	19,331,197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	19,553,782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）	127,486,326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）	118,365,522円
アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式80）	194,187,085円	アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式80）	192,692,698円
アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式60）	182,134,833円	アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式60）	177,447,598円
アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式40）	285,773,228円	アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式40）	284,345,903円
アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式20）	362,594,760円	アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式20）	372,473,393円
国際分散型ファンド40 （適格機関投資家向け）	14,942,605,343円	国際分散型ファンド40 （適格機関投資家向け）	15,407,737,370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）	107,776,664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）	103,443,856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）	116,591,298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）	122,967,723円
3資産バランスファンド （適格機関投資家向け）	90,100,162円	3資産バランスファンド （適格機関投資家向け）	89,641,490円
グローバルバランスファ ンド35（適格機関投資家 向け）	81,372,148円	グローバルバランスファ ンド35（適格機関投資家 向け）	82,879,530円

年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式20）	378,228,242円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド （株式20）	433,093,452円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式40）	995,620,111円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド （株式40）	1,100,695,804円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式60）	1,303,345,618円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド （株式60）	1,414,329,436円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式80）	1,299,967,478円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド （株式80）	1,374,504,979円
計	44,733,256,971円	計	43,355,172,207円
2. 本報告書における開示対 象ファンドの当特定期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	44,733,256,971口	2. 本報告書における開示対 象ファンドの当特定期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	43,355,172,207口
3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、そ の差額は16,339,720,536円であります。		3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、 その差額は18,862,335,192円であります。	
4. 担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券 として担保に供している資産は次のとおりであります。		4. 担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券 として担保に供している資産は次のとおりでありま す。	
株式	232,302,000円	株式	203,617,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 平成22年12月28日 至 平成23年 6月27日	自 平成23年 6月28日 至 平成23年12月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成23年 6月27日現在	平成23年12月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（平成23年6月27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	213,987,027
合計	213,987,027

（平成23年12月26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	678,415,136
合計	678,415,136

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（平成23年6月27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	193,776,000	—	198,240,000	4,464,000
	合計	193,776,000	—	198,240,000	4,464,000

（平成23年12月26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	95,764,000	—	94,055,000	1,709,000
	合計	95,764,000	—	94,055,000	1,709,000

（注）1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（ 1口当たり情報 ）

平成23年 6月27日現在		平成23年12月26日現在	
1口当たり純資産額	0.6347円	1口当たり純資産額	0.5649円
（ 1万口当たり純資産額 ）	（ 6,347円 ）	（ 1万口当たり純資産額 ）	（ 5,649円 ）

（ 3 ） 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

（ 単位：円 ）

	銘 柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
1301	極洋	11,000	177.00	1,947,000	
1332	日本水産	32,100	260.00	8,346,000	
1334	マルハニチロホールディングス	55,000	140.00	7,700,000	
1377	サカタのタネ	4,100	1,077.00	4,415,700	
1379	ホクト	2,800	1,691.00	4,734,800	
1514	住石ホールディングス	8,800	65.00	572,000	
1515	日鉄鉱業	7,000	308.00	2,156,000	
1518	三井松島産業	18,000	141.00	2,538,000	
1605	国際石油開発帝石	336	490,000.00	164,640,000	
1606	日本海洋掘削	700	2,248.00	1,573,600	
1661	関東天然瓦斯開発	3,000	387.00	1,161,000	
1662	石油資源開発	4,000	3,025.00	12,100,000	
1414	ショーボンドホールディングス	2,500	1,712.00	4,280,000	
1417	ミライト・ホールディングス	7,800	574.00	4,477,200	
1712	ダイセキ環境ソリューション	3	150,400.00	451,200	
1719	間組	10,200	165.00	1,683,000	
1720	東急建設	9,610	186.00	1,787,460	
1721	コムシスホールディングス	13,400	804.00	10,773,600	
1722	ミサワホーム	2,700	603.00	1,628,100	
1762	高松コンストラクショングループ	2,100	1,192.00	2,503,200	
1766	東建コーポレーション	1,030	2,561.00	2,637,830	
1780	ヤマウラ	1,500	227.00	340,500	
1801	大成建設	140,000	190.00	26,600,000	
1802	大林組	83,000	332.00	27,556,000	
1803	清水建設	84,000	313.00	26,292,000	
1808	長谷工コーポレーション	173,000	50.00	8,650,000	
1810	松井建設	3,000	298.00	894,000	
1812	鹿島建設	130,000	228.00	29,640,000	
1813	不動テトラ	19,900	143.00	2,845,700	
1814	大末建設	12,000	39.00	468,000	
1815	鉄建建設	16,000	86.00	1,376,000	
1816	安藤建設	10,000	95.00	950,000	
1819	太平工業	5,000	403.00	2,015,000	
1820	西松建設	36,000	125.00	4,500,000	
1821	三井住友建設	17,800	49.00	872,200	
1822	大豊建設	7,000	94.00	658,000	
1824	前田建設工業	17,000	272.00	4,624,000	
1827	ナカノフドー建設	2,000	171.00	342,000	
1833	奥村組	26,000	308.00	8,008,000	

[次へ](#)

1834	大和小田急建設	1,500	196.00	294,000	
1835	東鉄工業	4,000	658.00	2,632,000	
1852	浅沼組	9,000	61.00	549,000	
1860	戸田建設	30,000	271.00	8,130,000	
1861	熊谷組	20,000	66.00	1,320,000	
1865	青木あすなろ建設	2,000	393.00	786,000	
1866	北野建設	6,000	187.00	1,122,000	
1867	植木組	4,000	169.00	676,000	
1868	三井ホーム	3,000	398.00	1,194,000	
1870	矢作建設工業	3,400	387.00	1,315,800	
1871	ピーエス三菱	2,000	217.00	434,000	
1878	大東建託	10,500	6,590.00	69,195,000	
1879	新日本建設	3,300	200.00	660,000	
1881	N I P P O	6,000	722.00	4,332,000	
1882	東亜道路工業	5,000	147.00	735,000	
1883	前田道路	8,000	808.00	6,464,000	
1884	日本道路	8,000	215.00	1,720,000	
1885	東亜建設工業	24,000	128.00	3,072,000	
1888	若築建設	15,000	100.00	1,500,000	
1890	東洋建設	42,000	68.00	2,856,000	
1893	五洋建設	35,500	231.00	8,200,500	
1896	大林道路	4,000	179.00	716,000	
1899	福田組	4,000	233.00	932,000	
1911	住友林業	19,000	661.00	12,559,000	
1914	日本基礎技術	3,300	235.00	775,500	
1916	日成ビルド工業	8,000	180.00	1,440,000	
1919	エス・バイ・エル	14,000	166.00	2,324,000	
1921	巴コーポレーション	3,600	274.00	986,400	
1924	パナホーム	10,000	521.00	5,210,000	
1925	大和ハウス工業	69,000	918.00	63,342,000	
1926	ライト工業	5,900	413.00	2,436,700	
1928	積水ハウス	78,000	686.00	53,508,000	
1929	日特建設	7,000	96.00	672,000	
1930	北陸電気工事	2,000	207.00	414,000	
1934	ユアテック	4,000	391.00	1,564,000	
1937	西部電気工業	3,000	338.00	1,014,000	
1939	四電工	2,000	323.00	646,000	
1941	中電工	4,000	804.00	3,216,000	
1942	関電工	13,000	358.00	4,654,000	
1944	きんでん	18,000	624.00	11,232,000	
1945	東京エネシス	3,000	399.00	1,197,000	
1946	トーエネック	4,000	394.00	1,576,000	
1949	住友電設	2,000	443.00	886,000	
1950	日本電設工業	5,000	737.00	3,685,000	
1951	協和エクシオ	9,000	719.00	6,471,000	
1952	新日本空調	2,200	406.00	893,200	
1956	日本電話施設	5,000	250.00	1,250,000	
1959	九電工	5,000	456.00	2,280,000	
1961	三機工業	6,000	409.00	2,454,000	

1963	日揮	26,000	1,833.00	47,658,000	
1964	中外炉工業	9,000	255.00	2,295,000	
1967	ヤマト	3,000	306.00	918,000	
1968	太平電業	4,000	572.00	2,288,000	
1969	高砂熱学工業	7,900	639.00	5,048,100	
1972	三晃金属工業	3,000	216.00	648,000	
1975	朝日工業社	3,000	334.00	1,002,000	
1979	大氣社	4,200	1,642.00	6,896,400	
1980	ダイダン	4,000	520.00	2,080,000	
1982	日比谷総合設備	3,400	804.00	2,733,600	
1983	東芝プラントシステム	4,000	764.00	3,056,000	
6330	東洋エンジニアリング	15,000	282.00	4,230,000	
6366	千代田化工建設	22,000	762.00	16,764,000	
6379	新興ブランテック	5,600	615.00	3,444,000	
2001	日本製粉	17,000	335.00	5,695,000	
2002	日清製粉グループ本社	25,000	945.00	23,625,000	
2003	日東富士製粉	2,000	291.00	582,000	
2004	昭和産業	11,000	238.00	2,618,000	
2009	鳥越製粉	2,400	693.00	1,663,200	
2052	協同飼料	10,000	92.00	920,000	
2053	中部飼料	2,500	475.00	1,187,500	
2056	日本配合飼料	9,000	109.00	981,000	
2107	東洋精糖	5,000	91.00	455,000	
2108	日本甜菜製糖	15,000	152.00	2,280,000	
2109	三井製糖	10,000	266.00	2,660,000	
2201	森永製菓	27,000	178.00	4,806,000	
2204	中村屋	6,000	378.00	2,268,000	
2206	江崎グリコ	10,000	866.00	8,660,000	
2207	名糖産業	1,300	990.00	1,287,000	
2211	不二家	16,000	161.00	2,576,000	
2212	山崎製パン	20,000	1,039.00	20,780,000	
2215	第一屋製パン	5,000	82.00	410,000	
2217	モロゾフ	5,000	275.00	1,375,000	
2229	カルビー	1,500	3,600.00	5,400,000	
2264	森永乳業	23,000	295.00	6,785,000	
2267	ヤクルト本社	14,800	2,424.00	35,875,200	
2269	明治ホールディングス	8,100	3,210.00	26,001,000	
2270	雪印メグミルク	5,900	1,479.00	8,726,100	
2281	プリマハム	16,000	128.00	2,048,000	
2282	日本ハム	21,000	975.00	20,475,000	
2284	伊藤ハム	15,000	309.00	4,635,000	
2286	林兼産業	10,000	65.00	650,000	
2288	丸大食品	13,000	278.00	3,614,000	
2290	米久	2,500	729.00	1,822,500	
2292	S F o o d s	1,500	635.00	952,500	
2501	サッポロホールディングス	45,000	305.00	13,725,000	
2502	アサヒグループホールディングス	51,800	1,706.00	88,370,800	
2503	キリンホールディングス	111,000	951.00	105,561,000	

2531	宝ホールディングス	23,000	497.00	11,431,000	
2533	オエノンホールディングス	7,000	190.00	1,330,000	
2540	養命酒製造	2,000	716.00	1,432,000	
2572	三国コカ・コーラボトリング	2,800	695.00	1,946,000	
2579	コカ・コーラウエスト	9,300	1,331.00	12,378,300	
2580	コカ・コーラ セントラル ジャパン	3,100	1,013.00	3,140,300	
2590	ダイドードリンコ	1,300	3,040.00	3,952,000	
2593	伊藤園	8,300	1,335.00	11,080,500	
2594	キーコーヒー	2,400	1,369.00	3,285,600	
2597	ユニカフェ	800	336.00	268,800	
2599	ジャパンフーズ	400	761.00	304,400	
2602	日清オイリオグループ	10,000	320.00	3,200,000	
2607	不二製油	6,700	1,111.00	7,443,700	
2613	J - オイルミルズ	10,000	216.00	2,160,000	
2801	キッコーマン	23,000	889.00	20,447,000	
2802	味の素	73,000	938.00	68,474,000	
2809	キューピー	14,000	1,100.00	15,400,000	
2810	ハウス食品	9,800	1,457.00	14,278,600	
2811	カゴメ	10,700	1,513.00	16,189,100	
2812	焼津水産化学工業	1,300	698.00	907,400	
2815	アリアケジャパン	2,500	1,451.00	3,627,500	
2871	ニチレイ	31,000	378.00	11,718,000	
2875	東洋水産	12,000	1,895.00	22,740,000	
2897	日清食品ホールディングス	10,800	2,999.00	32,389,200	
2899	永谷園	3,000	872.00	2,616,000	
2908	フジッコ	3,000	952.00	2,856,000	
2910	ロック・フィールド	1,300	1,262.00	1,640,600	
2914	日本たばこ産業	612	364,500.00	223,074,000	
2918	わらべや日洋	1,500	950.00	1,425,000	
2922	なとり	1,300	824.00	1,071,200	
4404	ミヨシ油脂	9,000	105.00	945,000	
3001	片倉工業	3,300	714.00	2,356,200	
3002	グンゼ	19,000	219.00	4,161,000	
3101	東洋紡績	109,000	103.00	11,227,000	
3103	ユニチカ	58,000	42.00	2,436,000	
3104	富士紡ホールディングス	11,000	160.00	1,760,000	
3105	日清紡ホールディングス	16,000	686.00	10,976,000	
3106	倉敷紡績	27,000	145.00	3,915,000	
3109	シキボウ	17,000	107.00	1,819,000	
3201	日本毛織	9,000	557.00	5,013,000	
3202	大東紡織	5,000	62.00	310,000	
3204	トーア紡コーポレーション	12,000	58.00	696,000	
3205	ダイドーリミテッド	3,200	654.00	2,092,800	
3302	帝国繊維	3,000	515.00	1,545,000	
3401	帝人	106,000	237.00	25,122,000	
3402	東レ	187,000	549.00	102,663,000	
3408	サカイオーベックス	8,000	112.00	896,000	
3501	住江織物	7,000	136.00	952,000	

3512	日本フェルト	1,400	384.00	537,600	
3513	イチカワ	2,000	150.00	300,000	
3514	日本バイリーン	3,000	327.00	981,000	
3524	日東製網	4,000	138.00	552,000	
3526	芦森工業	6,000	104.00	624,000	
3529	アツギ	20,000	92.00	1,840,000	
3551	ダイニック	5,000	134.00	670,000	
3569	セーレン	6,400	446.00	2,854,400	
3577	東海染工	4,000	83.00	332,000	
3580	小松精練	4,000	364.00	1,456,000	
3591	ワコールホールディングス	15,000	1,000.00	15,000,000	
3593	ホギメディカル	1,600	3,225.00	5,160,000	
3606	レナウン	5,900	142.00	837,800	
3607	クラウドディア	300	994.00	298,200	
3608	T S Iホールディングス	11,500	369.00	4,243,500	
8011	三陽商会	12,000	196.00	2,352,000	
8013	ナイガイ	8,000	43.00	344,000	
8016	オンワードホールディングス	16,000	549.00	8,784,000	
8029	ルック	5,000	202.00	1,010,000	
8111	ゴールドウイン	6,000	297.00	1,782,000	
8114	デサント	6,000	427.00	2,562,000	
8127	ヤマトインターナショナル	1,500	358.00	537,000	
3708	特種東海製紙	16,000	168.00	2,688,000	
3861	王子製紙	114,000	387.00	44,118,000	
3864	三菱製紙	37,000	71.00	2,627,000	
3865	北越紀州製紙	16,000	520.00	8,320,000	
3877	中越パルプ工業	10,000	132.00	1,320,000	
3878	巴川製紙所	4,000	163.00	652,000	
3880	大王製紙	11,000	540.00	5,940,000	
3893	日本製紙グループ本社	12,500	1,642.00	20,525,000	
3941	レンゴー	21,000	537.00	11,277,000	
3946	トーモク	8,000	202.00	1,616,000	
3950	ザ・バック	1,500	1,169.00	1,753,500	
3405	クラレ	41,000	1,084.00	44,444,000	
3407	旭化成	150,000	459.00	68,850,000	
3553	共和レザー	1,700	277.00	470,900	
4003	コープケミカル	4,000	101.00	404,000	
4004	昭和電工	160,000	161.00	25,760,000	
4005	住友化学	177,000	277.00	49,029,000	
4007	日本化成	5,000	132.00	660,000	
4008	住友精化	5,000	321.00	1,605,000	
4021	日産化学工業	19,700	747.00	14,715,900	
4022	ラサ工業	11,000	120.00	1,320,000	
4023	クレハ	17,000	355.00	6,035,000	
4027	テイカ	5,000	292.00	1,460,000	
4028	石原産業	44,000	88.00	3,872,000	
4031	片倉チッカリン	2,000	189.00	378,000	
4041	日本曹達	15,000	343.00	5,145,000	
4042	東ソー	69,000	212.00	14,628,000	

4043	トクヤマ	40,000	245.00	9,800,000	
4044	セントラル硝子	25,000	359.00	8,975,000	
4045	東亜合成	32,000	315.00	10,080,000	
4046	ダイソー	10,000	237.00	2,370,000	
4047	関東電化工業	6,000	276.00	1,656,000	
4061	電気化学工業	54,000	283.00	15,282,000	
4063	信越化学工業	46,300	3,790.00	175,477,000	
4064	日本カーバイド工業	8,000	117.00	936,000	
4078	堺化学工業	8,000	285.00	2,280,000	
4088	エア・ウォーター	21,000	982.00	20,622,000	
4091	大陽日酸	34,000	533.00	18,122,000	
4092	日本化学工業	10,000	129.00	1,290,000	
4095	日本パーカライジング	6,000	958.00	5,748,000	
4097	高圧ガス工業	4,000	471.00	1,884,000	
4099	四国化成工業	4,000	420.00	1,680,000	
4100	戸田工業	3,000	652.00	1,956,000	
4109	ステラ ケミファ	1,200	2,323.00	2,787,600	
4112	保土谷化学工業	5,000	247.00	1,235,000	
4114	日本触媒	19,000	833.00	15,827,000	
4116	大日精化工業	9,000	342.00	3,078,000	
4118	カネカ	32,000	405.00	12,960,000	
4182	三菱瓦斯化学	44,000	427.00	18,788,000	
4183	三井化学	110,000	245.00	26,950,000	
4185	J S R	23,500	1,417.00	33,299,500	
4186	東京応化工業	4,600	1,573.00	7,235,800	
4188	三菱ケミカルホールディングス	161,500	433.00	69,929,500	
4201	日本合成化学工業	5,000	429.00	2,145,000	
4202	ダイセル	34,000	449.00	15,266,000	
4203	住友ベークライト	22,000	428.00	9,416,000	
4204	積水化学工業	54,000	625.00	33,750,000	
4205	日本ゼオン	24,000	658.00	15,792,000	
4206	アイカ工業	6,900	1,028.00	7,093,200	
4208	宇部興産	108,000	217.00	23,436,000	
4212	積水樹脂	4,000	737.00	2,948,000	
4215	タキロン	6,000	263.00	1,578,000	
4216	旭有機材工業	9,000	200.00	1,800,000	
4217	日立化成工業	11,200	1,354.00	15,164,800	
4218	ニチバン	3,000	248.00	744,000	
4220	リケンテクノス	4,000	219.00	876,000	
4221	大倉工業	6,000	240.00	1,440,000	
4228	積水化成成品工業	7,000	296.00	2,072,000	
4229	群栄化学工業	7,000	190.00	1,330,000	
4231	タイガースポリマー	1,300	297.00	386,100	
4271	日本カーリット	2,100	392.00	823,200	
4272	日本化薬	18,000	747.00	13,446,000	
4362	日本精化	2,200	501.00	1,102,200	
4401	A D E K A	11,100	726.00	8,058,600	
4403	日油	20,000	383.00	7,660,000	
4410	ハリマ化成	2,200	600.00	1,320,000	

4452	花王	68,400	2,062.00	141,040,800	
4461	第一工業製薬	5,000	212.00	1,060,000	
4471	三洋化成工業	8,000	481.00	3,848,000	
4611	大日本塗料	15,000	79.00	1,185,000	
4612	日本ペイント	24,000	542.00	13,008,000	
4613	関西ペイント	29,000	682.00	19,778,000	
4614	トウベ	3,000	85.00	255,000	
4617	中国塗料	8,000	481.00	3,848,000	
4619	日本特殊塗料	2,000	300.00	600,000	
4620	藤倉化成	3,200	367.00	1,174,400	
4626	太陽ホールディングス	2,100	1,968.00	4,132,800	
4631	D I C	99,000	129.00	12,771,000	
4633	サカタインクス	5,000	348.00	1,740,000	
4634	東洋インキ S C ホールディングス	23,000	281.00	6,463,000	
4901	富士フイルムホールディングス	55,100	1,853.00	102,100,300	
4911	資生堂	42,800	1,413.00	60,476,400	
4912	ライオン	30,000	464.00	13,920,000	
4914	高砂香料工業	8,000	362.00	2,896,000	
4917	マンダム	2,600	2,010.00	5,226,000	
4919	ミルボン	1,400	2,418.00	3,385,200	
4921	ファンケル	6,500	1,050.00	6,825,000	
4922	コーセー	4,200	1,894.00	7,954,800	
4924	ドクターシーラボ	16	398,500.00	6,376,000	
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	2,600	2,053.00	5,337,800	
4951	エステー	1,600	972.00	1,555,200	
4956	コニシ	1,900	1,016.00	1,930,400	
4958	長谷川香料	3,300	1,145.00	3,778,500	
4967	小林製薬	3,600	4,025.00	14,490,000	
4968	荒川化学工業	2,000	658.00	1,316,000	
4971	メック	1,900	271.00	514,900	
4973	日本高純度化学	7	199,500.00	1,396,500	
4975	荏原ユーザライト	400	1,895.00	758,000	
4985	アース製薬	1,800	2,944.00	5,299,200	
4989	イハラケミカル工業	5,000	277.00	1,385,000	
4992	北興化学工業	3,000	208.00	624,000	
4994	大成ラミック	700	2,390.00	1,673,000	
4996	クミアイ化学工業	6,000	289.00	1,734,000	
4997	日本農薬	6,000	316.00	1,896,000	
5142	アキレス	21,000	105.00	2,205,000	
5208	有沢製作所	4,300	289.00	1,242,700	
6988	日東電工	21,300	2,810.00	59,853,000	
7874	レック	800	1,102.00	881,600	
7908	きもと	2,100	501.00	1,052,100	
7917	藤森工業	1,900	1,079.00	2,050,100	
7925	前澤化成工業	1,800	775.00	1,395,000	
7942	J S P	1,700	1,122.00	1,907,400	
7947	エフビコ	1,100	5,000.00	5,500,000	

7958	天馬	2,100	693.00	1,455,300	
7970	信越ポリマー	5,000	326.00	1,630,000	
7971	東リ	7,000	144.00	1,008,000	
7988	ニフコ	5,800	2,132.00	12,365,600	
7995	日本バルカー工業	10,000	200.00	2,000,000	
8113	ユニ・チャーム	14,200	3,755.00	53,321,000	
4151	協和発酵キリン	35,000	951.00	33,285,000	
4502	武田薬品工業	96,600	3,325.00	321,195,000	代用有価証券10,000株
4503	アステラス製薬	57,300	3,100.00	177,630,000	
4506	大日本住友製薬	18,300	876.00	16,030,800	
4507	塩野義製薬	40,300	986.00	39,735,800	
4508	田辺三菱製薬	25,700	1,225.00	31,482,500	
4512	わかもと製薬	3,000	232.00	696,000	
4514	あすか製薬	3,000	464.00	1,392,000	
4516	日本新薬	5,000	931.00	4,655,000	
4519	中外製薬	29,900	1,282.00	38,331,800	
4521	科研製薬	10,000	1,028.00	10,280,000	
4523	エーザイ	31,700	3,175.00	100,647,500	
4527	ロート製薬	11,000	952.00	10,472,000	
4528	小野薬品工業	12,600	4,250.00	53,550,000	
4530	久光製薬	8,000	3,230.00	25,840,000	
4531	有機合成薬品工業	2,000	186.00	372,000	
4534	持田製薬	9,000	872.00	7,848,000	
4536	参天製薬	8,700	3,040.00	26,448,000	
4538	扶桑薬品工業	9,000	206.00	1,854,000	
4539	日本ケミファ	4,000	284.00	1,136,000	
4540	ツムラ	7,100	2,238.00	15,889,800	
4541	日医工	4,400	1,770.00	7,788,000	
4547	キッセイ薬品工業	4,800	1,565.00	7,512,000	
4548	生化学工業	4,900	826.00	4,047,400	
4549	栄研化学	2,000	1,019.00	2,038,000	
4550	日水製薬	1,100	685.00	753,500	
4551	鳥居薬品	1,800	1,442.00	2,595,600	
4553	東和薬品	1,300	3,285.00	4,270,500	
4555	沢井製薬	1,700	7,910.00	13,447,000	
4559	ゼリア新薬工業	4,000	1,318.00	5,272,000	
4568	第一三共	86,700	1,518.00	131,610,600	
4569	キョーリン製薬ホールディングス	6,000	1,342.00	8,052,000	
4574	大幸薬品	1,200	783.00	939,600	
4577	ダイト	700	1,206.00	844,200	
4578	大塚ホールディングス	51,100	2,150.00	109,865,000	
4581	大正製薬ホールディングス	6,200	5,750.00	35,650,000	
3315	日本コークス工業	21,000	99.00	2,079,000	
5002	昭和シェル石油	23,100	528.00	12,196,800	
5007	コスモ石油	71,000	209.00	14,839,000	
5011	ニチレキ	3,000	363.00	1,089,000	
5012	東燃ゼネラル石油	39,000	871.00	33,969,000	
5013	ユシロ化学工業	1,400	840.00	1,176,000	

5015	ビーピー・カストロール	900	345.00	310,500	
5017	A O C ホールディングス	6,000	458.00	2,748,000	
5018	M O R E S C O	600	724.00	434,400	
5019	出光興産	3,100	8,030.00	24,893,000	
5020	J X ホールディングス	286,200	462.00	132,224,400	
5101	横浜ゴム	31,000	439.00	13,609,000	
5105	東洋ゴム工業	19,000	179.00	3,401,000	

[次へ](#)

5108	ブリヂストン	80,800	1,715.00	138,572,000	
5110	住友ゴム工業	20,100	924.00	18,572,400	
5121	藤倉ゴム工業	1,500	291.00	436,500	
5122	オカモト	9,000	294.00	2,646,000	
5185	フコク	1,100	661.00	727,100	
5186	ニッタ	2,500	1,414.00	3,535,000	
5191	東海ゴム工業	4,800	855.00	4,104,000	
5192	三ツ星ベルト	7,000	394.00	2,758,000	
5195	バンドー化学	9,000	287.00	2,583,000	
3110	日東紡績	19,000	284.00	5,396,000	
5201	旭硝子	127,000	668.00	84,836,000	
5202	日本板硝子	111,000	143.00	15,873,000	
5204	石塚硝子	4,000	137.00	548,000	
5210	日本山村硝子	10,000	195.00	1,950,000	
5214	日本電気硝子	49,000	758.00	37,142,000	
5218	オハラ	1,000	755.00	755,000	
5232	住友大阪セメント	53,000	208.00	11,024,000	
5233	太平洋セメント	152,000	145.00	22,040,000	
5234	デイ・シイ	2,600	212.00	551,200	
5262	日本ヒューム	3,000	282.00	846,000	
5269	日本コンクリート工業	4,000	170.00	680,000	
5301	東海カーボン	22,000	426.00	9,372,000	
5302	日本カーボン	12,000	218.00	2,616,000	
5310	東洋炭素	1,400	3,205.00	4,487,000	
5331	ノリタケカンパニーリミテド	13,000	223.00	2,899,000	
5332	ＴＯＴＯ	40,000	594.00	23,760,000	
5333	日本碍子	33,000	925.00	30,525,000	
5334	日本特殊陶業	22,000	934.00	20,548,000	
5337	ダントーホールディングス	4,000	75.00	300,000	
5344	ＭＡＲＵＷＡ	800	3,710.00	2,968,000	
5351	品川リフラクトリーズ	6,000	218.00	1,308,000	
5352	黒崎播磨	6,000	228.00	1,368,000	
5363	東京窯業	3,000	177.00	531,000	
5367	ニッカトー	900	481.00	432,900	
5384	フジミインコーポレーテッド	2,300	903.00	2,076,900	
5391	エーアンドエーマテリアル	6,000	69.00	414,000	
5393	ニチアス	11,000	412.00	4,532,000	
7943	ニチハ	2,900	829.00	2,404,100	
5401	新日本製鐵	676,000	191.00	129,116,000	
5405	住友金属工業	478,000	138.00	65,964,000	
5406	神戸製鋼所	357,000	119.00	42,483,000	
5407	日新製鋼	91,000	116.00	10,556,000	
5408	中山製鋼所	13,000	70.00	910,000	
5410	合同製鐵	14,000	184.00	2,576,000	
5411	ジェイ エフ イー ホールディ ングス	61,100	1,407.00	85,967,700	
5423	東京製鐵	13,100	636.00	8,331,600	
5440	共英製鋼	2,800	1,407.00	3,939,600	
5444	大和工業	5,900	2,183.00	12,879,700	

5445	東京鐵鋼	5,000	215.00	1,075,000	
5449	大阪製鐵	1,600	1,411.00	2,257,600	
5451	淀川製鋼所	18,000	323.00	5,814,000	
5453	東洋鋼鈑	6,000	265.00	1,590,000	
5457	住友鋼管	1,500	596.00	894,000	
5463	丸一鋼管	7,900	1,697.00	13,406,300	
5464	モリ工業	4,000	261.00	1,044,000	
5471	大同特殊鋼	43,000	482.00	20,726,000	
5476	日本高周波鋼業	11,000	82.00	902,000	
5479	日本金属工業	20,000	62.00	1,240,000	
5480	日本冶金工業	19,000	120.00	2,280,000	
5481	山陽特殊製鋼	13,000	400.00	5,200,000	
5482	愛知製鋼	14,000	367.00	5,138,000	
5486	日立金属	17,000	819.00	13,923,000	
5491	日本金属	6,000	140.00	840,000	
5541	大平洋金属	18,000	376.00	6,768,000	
5563	日本電工	9,000	356.00	3,204,000	
5602	栗本鐵工所	13,000	159.00	2,067,000	
5606	旭テック	23,000	28.00	644,000	
5612	日本鑄鉄管	3,000	149.00	447,000	
5632	三菱製鋼	16,000	199.00	3,184,000	
5658	日亜鋼業	4,000	196.00	784,000	
5659	日本精線	2,000	373.00	746,000	
6319	シンニッタン	2,300	328.00	754,400	
7305	新家工業	6,000	118.00	708,000	
5701	日本輕金属	59,000	99.00	5,841,000	
5702	大紀アルミニウム工業所	4,000	306.00	1,224,000	
5706	三井金属鉱業	70,000	204.00	14,280,000	
5707	東邦亜鉛	15,000	290.00	4,350,000	
5711	三菱マテリアル	161,000	211.00	33,971,000	
5713	住友金属鉱山	67,000	991.00	66,397,000	
5714	DOWAホールディングス	31,000	488.00	15,128,000	
5715	古河機械金属	43,000	65.00	2,795,000	
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	2,500	3,390.00	8,475,000	
5727	東邦チタニウム	4,200	1,303.00	5,472,600	
5738	住友輕金属工業	63,000	71.00	4,473,000	
5741	古河スカイ	11,000	180.00	1,980,000	
5801	古河電気工業	81,000	179.00	14,499,000	
5802	住友電気工業	91,100	830.00	75,613,000	
5803	フジクラ	39,000	227.00	8,853,000	
5805	昭和電線ホールディングス	34,000	70.00	2,380,000	
5809	タツタ電線	5,000	333.00	1,665,000	
5812	日立電線	20,000	165.00	3,300,000	
5815	沖電線	3,000	148.00	444,000	
5819	カナレ電気	300	1,294.00	388,200	
5821	平河ヒューテック	500	716.00	358,000	
5851	リョービ	14,000	277.00	3,878,000	
5857	アサヒホールディングス	3,600	1,497.00	5,389,200	
3421	稲葉製作所	1,300	921.00	1,197,300	

3431	宮地エンジニアリンググループ	9,000	131.00	1,179,000	
3432	三協・立山ホールディングス	35,000	115.00	4,025,000	
3433	トーカロ	1,500	1,630.00	2,445,000	
3434	アルファＣｏ	900	846.00	761,400	
3436	ＳＵＭＣＯ	15,800	586.00	9,258,800	
3443	川田テクノロジーズ	600	1,016.00	609,600	
5901	東洋製罐	18,200	1,061.00	19,310,200	
5902	ホッカンホールディングス	6,000	219.00	1,314,000	
5909	コロナ	1,200	1,228.00	1,473,600	
5911	横河ブリッジホールディングス	5,000	503.00	2,515,000	
5915	駒井ハルテック	5,000	178.00	890,000	
5929	三和ホールディングス	26,000	230.00	5,980,000	
5930	文化シャッター	7,000	259.00	1,813,000	
5936	東洋シャッター	800	357.00	285,600	
5938	住生活グループ	33,500	1,435.00	48,072,500	
5942	日本フィルコン	1,900	401.00	761,900	
5943	ノーリツ	5,100	1,400.00	7,140,000	
5946	長府製作所	2,500	1,934.00	4,835,000	
5947	リンナイ	4,100	5,420.00	22,222,000	
5951	ダイニチ工業	1,400	687.00	961,800	
5957	日東精工	3,000	206.00	618,000	
5958	三洋工業	4,000	149.00	596,000	
5959	岡部	5,100	388.00	1,978,800	
5974	中国工業	5,000	87.00	435,000	
5975	東プレ	4,900	736.00	3,606,400	
5976	高周波熱錬	3,400	554.00	1,883,600	
5981	東京製綱	16,000	151.00	2,416,000	
5988	パイオラックス	1,100	1,665.00	1,831,500	
5991	日本発條	18,700	666.00	12,454,200	
5992	中央発條	3,000	268.00	804,000	
5998	アドバネクス	6,000	61.00	366,000	
8155	三益半導体工業	2,200	643.00	1,414,600	
1978	アタカ大機	2,000	237.00	474,000	
5631	日本製鋼所	40,000	528.00	21,120,000	
5963	日立ツール	1,500	808.00	1,212,000	
6005	三浦工業	3,800	2,147.00	8,158,600	
6013	タクマ	9,000	314.00	2,826,000	
6101	ツガミ	6,000	496.00	2,976,000	
6103	オークマ	15,000	497.00	7,455,000	
6104	東芝機械	14,000	383.00	5,362,000	
6113	アマダ	36,000	480.00	17,280,000	
6118	アイダエンジニアリング	6,700	352.00	2,358,400	
6135	牧野フライス製作所	13,000	476.00	6,188,000	
6136	オーエスジー	11,400	965.00	11,001,000	
6138	ダイジェット工業	3,000	141.00	423,000	
6140	旭ダイヤモンド工業	6,400	932.00	5,964,800	
6141	森精機製作所	13,600	681.00	9,261,600	
6146	ディスコ	2,600	4,090.00	10,634,000	
6151	日東工器	1,500	1,756.00	2,634,000	

6203	豊和工業	14,000	68.00	952,000	
6205	大阪機工	11,000	87.00	957,000	
6210	東洋機械金属	2,000	191.00	382,000	
6217	津田駒工業	7,000	154.00	1,078,000	
6222	島精機製作所	3,400	1,338.00	4,549,200	
6247	日阪製作所	3,000	815.00	2,445,000	
6250	やまびこ	1,000	850.00	850,000	
6262	ペガサスミシン製造	2,500	213.00	532,500	
6268	ナブテスコ	10,700	1,436.00	15,365,200	
6269	三井海洋開発	2,100	1,302.00	2,734,200	
6272	レオン自動機	3,000	186.00	558,000	
6273	S M C	7,700	12,230.00	94,171,000	
6274	新川	2,100	380.00	798,000	
6277	ホソカワミクロン	4,000	378.00	1,512,000	
6278	ユニオンツール	1,400	1,327.00	1,857,800	
6282	オイレス工業	2,900	1,454.00	4,216,600	
6287	サトーホールディングス	2,700	942.00	2,543,400	
6291	日本エアーテック	800	363.00	290,400	
6293	日精樹脂工業	2,100	340.00	714,000	
6298	ワイエイシイ	1,100	615.00	676,500	
6301	小松製作所	122,300	1,831.00	223,931,300	
6302	住友重機械工業	66,000	447.00	29,502,000	
6305	日立建機	13,200	1,298.00	17,133,600	
6306	日工	4,000	274.00	1,096,000	
6309	巴工業	1,000	1,356.00	1,356,000	
6310	井関農機	26,000	166.00	4,316,000	
6315	T O W A	2,300	383.00	880,900	
6316	丸山製作所	6,000	169.00	1,014,000	
6317	北川鉄工所	12,000	133.00	1,596,000	
6326	クボタ	118,000	627.00	73,986,000	
6328	荏原実業	600	1,225.00	735,000	
6331	三菱化工機	8,000	131.00	1,048,000	
6332	月島機械	4,000	625.00	2,500,000	
6333	帝国電機製作所	900	1,341.00	1,206,900	
6339	新東工業	5,600	676.00	3,785,600	
6340	澁谷工業	1,500	767.00	1,150,500	
6345	アイチ コーポレーション	4,300	305.00	1,311,500	
6349	小森コーポレーション	7,400	498.00	3,685,200	
6351	鶴見製作所	2,000	560.00	1,120,000	
6355	住友精密工業	4,000	478.00	1,912,000	
6358	酒井重工業	5,000	135.00	675,000	
6361	荏原製作所	42,000	278.00	11,676,000	
6362	石井鐵工所	4,000	142.00	568,000	
6363	西島製作所	3,000	984.00	2,952,000	
6367	ダイキン工業	31,400	2,084.00	65,437,600	
6368	オルガノ	5,000	583.00	2,915,000	
6369	トーヨーカネツ	14,000	141.00	1,974,000	
6370	栗田工業	14,200	1,987.00	28,215,400	
6371	椿本チエイン	13,000	395.00	5,135,000	

6373	大同工業	5,000	124.00	620,000	
6375	日本コンベヤ	8,000	75.00	600,000	
6378	木村化工機	2,400	310.00	744,000	
6381	アネスト岩田	4,000	310.00	1,240,000	
6383	ダイフク	11,500	388.00	4,462,000	
6390	加藤製作所	6,000	216.00	1,296,000	
6393	油研工業	5,000	160.00	800,000	
6395	タダノ	12,000	476.00	5,712,000	
6406	フジテック	7,000	474.00	3,318,000	
6407	シーケーディ	7,000	545.00	3,815,000	
6409	キトー	11	54,400.00	598,400	
6412	平和	5,300	1,336.00	7,080,800	
6413	理想科学工業	1,800	1,111.00	1,999,800	
6417	SANKYO	7,400	3,850.00	28,490,000	
6418	日本金銭機械	2,300	587.00	1,350,100	
6419	マースエンジニアリング	1,400	1,310.00	1,834,000	
6420	福島工業	700	906.00	634,200	
6428	オーイズミ	1,000	259.00	259,000	
6430	ダイコク電機	1,200	730.00	876,000	
6436	アマノ	7,400	678.00	5,017,200	
6440	JUKI	15,000	171.00	2,565,000	
6444	サンデン	13,000	234.00	3,042,000	
6445	蛇の目ミシン工業	25,000	52.00	1,300,000	
6454	マックス	4,000	936.00	3,744,000	
6457	グローリー	7,300	1,634.00	11,928,200	
6459	大和冷機工業	3,000	389.00	1,167,000	
6460	セガサミーホールディングス	26,500	1,647.00	43,645,500	
6461	日本ビストンリング	9,000	156.00	1,404,000	
6462	リケン	9,000	284.00	2,556,000	
6463	T P R	2,700	897.00	2,421,900	
6465	ホシザキ電機	4,900	1,839.00	9,011,100	
6470	大豊工業	1,700	679.00	1,154,300	
6471	日本精工	55,000	500.00	27,500,000	
6472	NTN	57,000	303.00	17,271,000	
6473	ジェイテクト	23,600	747.00	17,629,200	
6474	不二越	25,000	329.00	8,225,000	
6480	日本トムソン	8,000	434.00	3,472,000	
6481	THK	16,400	1,544.00	25,321,600	
6482	ユーシン精機	1,200	1,391.00	1,669,200	
6485	前澤給装工業	900	1,043.00	938,700	
6486	イーグル工業	3,000	593.00	1,779,000	
6489	前澤工業	2,000	172.00	344,000	
6490	日本ビラー工業	2,000	544.00	1,088,000	
6498	キッツ	10,100	313.00	3,161,300	
6581	日立工機	6,600	574.00	3,788,400	
6586	マキタ	16,100	2,537.00	40,845,700	
7004	日立造船	97,500	99.00	9,652,500	
7011	三菱重工業	413,000	328.00	135,464,000	
7013	I H I	168,000	184.00	30,912,000	

4062	イビデン	16,200	1,535.00	24,867,000	
4902	コニカミノルタホールディングス	65,000	584.00	37,960,000	
6448	ブラザー工業	31,900	943.00	30,081,700	
6479	ミネベア	37,000	316.00	11,692,000	
6501	日立製作所	553,000	406.00	224,518,000	
6502	東芝	519,000	314.00	162,966,000	
6503	三菱電機	246,000	714.00	175,644,000	
6504	富士電機	75,000	215.00	16,125,000	
6505	東洋電機製造	4,000	299.00	1,196,000	
6506	安川電機	29,000	660.00	19,140,000	
6507	シンフォニアテクノロジー	15,000	156.00	2,340,000	
6508	明電舎	24,000	263.00	6,312,000	
6513	オリジン電気	4,000	232.00	928,000	
6517	デンヨー	2,300	1,029.00	2,366,700	
6588	東芝テック	15,000	266.00	3,990,000	
6590	芝浦メカトロニクス	5,000	200.00	1,000,000	
6592	マブチモーター	3,400	3,240.00	11,016,000	
6594	日本電産	13,300	6,680.00	88,844,000	
6621	高岳製作所	10,000	164.00	1,640,000	
6622	ダイヘン	15,000	267.00	4,005,000	
6632	JVCケンウッド	15,000	266.00	3,990,000	
6640	第一精工	600	2,135.00	1,281,000	
6641	日新電機	5,000	423.00	2,115,000	
6644	大崎電気工業	3,000	741.00	2,223,000	
6645	オムロン	27,400	1,550.00	42,470,000	
6651	日東工業	3,700	857.00	3,170,900	
6652	I D E C	3,200	792.00	2,534,400	
6665	エルピーダメモリ	33,400	371.00	12,391,400	
6674	ジーエス・ユアサコーポレーション	48,000	416.00	19,968,000	
6675	サクサホールディングス	7,000	108.00	756,000	
6676	メルコホールディングス	1,400	2,075.00	2,905,000	
6678	テクノメディカ	2	290,000.00	580,000	
6701	日本電気	339,000	156.00	52,884,000	
6702	富士通	237,000	406.00	96,222,000	
6703	沖電気工業	96,000	67.00	6,432,000	
6704	岩崎通信機	11,000	66.00	726,000	
6706	電気興業	7,000	337.00	2,359,000	
6707	サンケン電気	12,000	244.00	2,928,000	
6715	ナカヨ通信機	2,000	237.00	474,000	
6718	アイホン	1,400	1,454.00	2,035,600	
6723	ルネサスエレクトロニクス	6,400	469.00	3,001,600	
6724	セイコーエプソン	16,800	1,017.00	17,085,600	
6727	ワコム	49	114,100.00	5,590,900	
6728	アルバック	4,500	955.00	4,297,500	
6730	アクセル	1,100	1,553.00	1,708,300	
6737	ナナオ	2,100	1,565.00	3,286,500	
6741	日本信号	5,700	449.00	2,559,300	

6742	京三製作所	5,000	317.00	1,585,000	
6744	能美防災	3,000	465.00	1,395,000	
6745	ホーチキ	2,000	379.00	758,000	
6751	日本無線	5,000	168.00	840,000	
6752	パナソニック	281,500	645.00	181,567,500	
6753	シャープ	119,000	721.00	85,799,000	
6754	アンリツ	12,000	811.00	9,732,000	
6755	富士通ゼネラル	6,000	429.00	2,574,000	
6756	日立国際電気	6,000	622.00	3,732,000	
6758	ソニー	153,700	1,394.00	214,257,800	
6762	T D K	12,900	3,420.00	44,118,000	
6763	帝国通信工業	6,000	120.00	720,000	
6767	ミツミ電機	8,700	589.00	5,124,300	
6768	タムラ製作所	8,000	186.00	1,488,000	
6770	アルプス電気	19,500	539.00	10,510,500	
6771	池上通信機	9,000	50.00	450,000	
6773	パイオニア	35,100	355.00	12,460,500	
6779	日本電波工業	1,900	922.00	1,751,800	
6788	日本トリム	300	1,858.00	557,400	
6789	ローランド ディー . ジー .	1,100	853.00	938,300	
6794	フォスター電機	2,300	1,100.00	2,530,000	
6796	クラリオン	15,000	129.00	1,935,000	
6798	S M K	8,000	240.00	1,920,000	
6800	ヨコオ	1,900	372.00	706,800	
6801	東光	12,000	132.00	1,584,000	
6803	ティアック	15,000	27.00	405,000	
6804	ホシデン	6,700	529.00	3,544,300	
6806	ヒロセ電機	4,300	6,770.00	29,111,000	
6807	日本航空電子工業	6,000	521.00	3,126,000	
6809	T O A	3,000	467.00	1,401,000	
6815	ユニデン	7,000	265.00	1,855,000	
6816	アルパイン	4,800	815.00	3,912,000	
6817	スミダコーポレーション	1,500	509.00	763,500	
6820	アイコム	1,400	1,969.00	2,756,600	
6839	船井電機	2,200	1,731.00	3,808,200	
6841	横河電機	26,800	718.00	19,242,400	
6844	新電元工業	9,000	311.00	2,799,000	
6845	山武	6,300	1,636.00	10,306,800	
6849	日本光電工業	4,900	1,898.00	9,300,200	
6850	チノー	4,000	185.00	740,000	
6853	共和電業	2,000	240.00	480,000	
6855	日本電子材料	1,000	355.00	355,000	
6856	堀場製作所	4,600	2,310.00	10,626,000	
6857	アドバンテスト	18,400	748.00	13,763,200	
6858	小野測器	3,000	203.00	609,000	
6859	エスベック	2,600	459.00	1,193,400	
6860	パナソニック電工 S U N X	2,100	380.00	798,000	
6861	キーエンス	5,500	18,420.00	101,310,000	
6866	日置電機	1,200	1,335.00	1,602,000	

6869	シスメックス	8,700	2,530.00	22,011,000	
6875	メガチップス	2,000	1,209.00	2,418,000	
6877	O B A R A G R O U P	1,800	888.00	1,598,400	
6883	日本電産コパル電子	2,500	461.00	1,152,500	
6885	ミヤチテクノス	1,200	641.00	769,200	
6900	東京電波	800	353.00	282,400	
6901	澤藤電機	2,000	221.00	442,000	

[次へ](#)

6905	コーセル	3,600	1,077.00	3,877,200	
6910	日立メディコ	2,000	796.00	1,592,000	
6911	新日本無線	2,000	112.00	224,000	
6914	オプテックス	1,700	1,000.00	1,700,000	
6915	千代田インテグレ	1,200	910.00	1,092,000	
6921	東光電気	1,000	297.00	297,000	
6923	スタンレー電気	16,500	1,126.00	18,579,000	
6924	岩崎電気	9,000	161.00	1,449,000	
6925	ウシオ電機	14,900	1,116.00	16,628,400	
6926	岡谷電機産業	1,300	339.00	440,700	
6927	ヘリオス テクノ ホールディング	2,200	143.00	314,600	
6929	日本セラミック	1,600	1,413.00	2,260,800	
6934	新神戸電機	2,000	1,705.00	3,410,000	
6935	日本デジタル研究所	2,100	757.00	1,589,700	
6937	古河電池	2,000	346.00	692,000	
6938	双信電機	1,300	327.00	425,100	
6941	山一電機	2,600	164.00	426,400	
6947	図研	1,600	530.00	848,000	
6951	日本電子	9,000	195.00	1,755,000	
6952	カシオ計算機	23,500	468.00	10,998,000	
6954	ファナック	25,700	11,780.00	302,746,000	
6958	日本シイエムケイ	5,400	244.00	1,317,600	
6961	エンブラス	1,300	1,635.00	2,125,500	
6963	ローム	12,100	3,575.00	43,257,500	
6965	浜松ホトニクス	9,600	2,708.00	25,996,800	
6966	三井ハイテック	3,200	320.00	1,024,000	
6967	新光電気工業	8,300	529.00	4,390,700	
6971	京セラ	20,500	6,250.00	128,125,000	
6976	太陽誘電	11,100	585.00	6,493,500	
6981	村田製作所	25,900	3,960.00	102,564,000	
6985	ユーシン	3,500	640.00	2,240,000	
6986	双葉電子工業	4,200	1,210.00	5,082,000	
6989	北陸電気工業	10,000	105.00	1,050,000	
6996	ニチコン	7,800	786.00	6,130,800	
6997	日本ケミコン	14,000	256.00	3,584,000	
6999	K O A	3,100	665.00	2,061,500	
7244	市光工業	6,000	126.00	756,000	
7276	小糸製作所	12,000	1,059.00	12,708,000	
7280	ミツバ	4,000	560.00	2,240,000	
7718	スター精密	4,000	708.00	2,832,000	
7735	大日本スクリーン製造	23,000	637.00	14,651,000	
7739	キャノン電子	2,200	1,952.00	4,294,400	
7751	キャノン	153,000	3,460.00	529,380,000	代用有価証券10,000株
7752	リコー	74,000	669.00	49,506,000	
7757	日本電産サンキョー	6,000	502.00	3,012,000	
7999	M U T O Hホールディングス	2,000	191.00	382,000	
8035	東京エレクトロン	20,700	4,015.00	83,110,500	
3116	トヨタ紡織	8,600	781.00	6,716,600	
5196	鬼怒川ゴム工業	6,000	655.00	3,930,000	

5949	ユニプレス	3,900	2,176.00	8,486,400	
6201	豊田自動織機	22,400	2,050.00	45,920,000	
6455	モリタホールディングス	4,000	410.00	1,640,000	
6584	三櫻工業	3,100	522.00	1,618,200	
6902	デンソー	60,900	2,111.00	128,559,900	
6995	東海理化電機製作所	5,800	1,134.00	6,577,200	
7003	三井造船	95,000	121.00	11,495,000	
7007	佐世保重工業	16,000	124.00	1,984,000	
7012	川崎重工業	179,000	194.00	34,726,000	
7102	日本車輛製造	9,000	285.00	2,565,000	
7105	日本輸送機	3,000	204.00	612,000	
7122	近畿車輛	4,000	238.00	952,000	
7201	日産自動車	311,200	696.00	216,595,200	
7202	いすゞ自動車	156,000	353.00	55,068,000	
7203	トヨタ自動車	316,500	2,512.00	795,048,000	代用有価証券35,000株
7205	日野自動車	35,000	463.00	16,205,000	
7211	三菱自動車工業	550,000	90.00	49,500,000	
7212	エフテック	900	883.00	794,700	
7220	武蔵精密工業	2,400	1,630.00	3,912,000	
7221	トヨタ車体	4,500	1,126.00	5,067,000	
7222	日産車体	7,000	746.00	5,222,000	
7223	関東自動車工業	3,800	626.00	2,378,800	
7224	新明和工業	11,000	311.00	3,421,000	
7226	極東開発工業	4,300	502.00	2,158,600	
7230	日信工業	4,500	1,065.00	4,792,500	
7231	トピー工業	18,000	187.00	3,366,000	
7236	ティラド	9,000	245.00	2,205,000	
7238	曙ブレーキ工業	12,500	325.00	4,062,500	
7239	タチエス	3,200	1,266.00	4,051,200	
7240	N O K	11,900	1,306.00	15,541,400	
7241	フタバ産業	7,000	445.00	3,115,000	
7242	カヤバ工業	17,000	352.00	5,984,000	
7243	シロキ工業	5,000	208.00	1,040,000	
7245	大同メタル工業	4,000	835.00	3,340,000	
7246	プレス工業	11,000	361.00	3,971,000	
7248	カルソニックカンセイ	15,000	439.00	6,585,000	
7250	太平洋工業	5,000	348.00	1,740,000	
7251	ケーヒン	5,100	1,226.00	6,252,600	
7256	河西工業	3,000	380.00	1,140,000	
7259	アイシン精機	20,300	2,163.00	43,908,900	
7260	富士機工	3,000	209.00	627,000	
7261	マツダ	205,000	137.00	28,085,000	
7262	ダイハツ工業	23,000	1,364.00	31,372,000	
7263	愛知機械工業	6,000	275.00	1,650,000	
7266	今仙電機製作所	1,800	862.00	1,551,600	
7267	本田技研工業	207,800	2,354.00	489,161,200	
7269	スズキ	51,500	1,608.00	82,812,000	
7270	富士重工業	78,000	467.00	36,426,000	
7272	ヤマハ発動機	40,100	1,004.00	40,260,400	

7274	ショーワ	5,300	428.00	2,268,400	
7277	T B K	3,000	365.00	1,095,000	
7278	エクセディ	3,300	2,194.00	7,240,200	
7282	豊田合成	7,000	1,214.00	8,498,000	
7283	愛三工業	2,600	605.00	1,573,000	
7294	ヨロズ	1,500	1,651.00	2,476,500	
7296	エフ・シー・シー	4,000	1,526.00	6,104,000	
7309	シマノ	9,300	3,585.00	33,340,500	
7312	タカタ	4,400	1,530.00	6,732,000	
7313	テイ・エス テック	5,200	1,172.00	6,094,400	
7728	日本電産トーソク	1,200	880.00	1,056,000	
4543	テルモ	19,400	3,785.00	73,429,000	
5187	クリエートメディック	700	819.00	573,300	
6376	日機装	8,000	652.00	5,216,000	
7701	島津製作所	29,000	648.00	18,792,000	
7702	J M S	4,000	239.00	956,000	
7714	モリテックス	600	338.00	202,800	
7715	長野計器	1,700	760.00	1,292,000	
7717	ブイ・テクノロジー	3	317,000.00	951,000	
7721	東京計器	9,000	142.00	1,278,000	
7723	愛知時計電機	3,000	273.00	819,000	
7729	東京精密	4,400	1,484.00	6,529,600	
7731	ニコン	43,000	1,721.00	74,003,000	
7732	トプコン	5,700	347.00	1,977,900	
7733	オリンパス	29,100	1,026.00	29,856,600	
7734	理研計器	2,000	555.00	1,110,000	
7740	タムロン	2,200	1,918.00	4,219,600	
7741	H O Y A	59,900	1,642.00	98,355,800	
7744	ノーリツ鋼機	2,300	354.00	814,200	
7745	エー・アンド・デイ	2,400	262.00	628,800	
7756	日本電産コパル	1,900	846.00	1,607,400	
7762	シチズンホールディングス	29,600	440.00	13,024,000	
7769	リズム時計工業	11,000	140.00	1,540,000	
7775	大研医器	300	847.00	254,100	
8050	セイコーホールディングス	14,000	157.00	2,198,000	
8086	ニプロ	9,800	651.00	6,379,800	
7817	パラマウントベッドホールディングス	2,100	2,252.00	4,729,200	
7819	S H O - B I	400	440.00	176,000	
7825	S R I スポーツ	1,500	861.00	1,291,500	
7832	バンダイナムコホールディングス	26,500	1,092.00	28,938,000	
7838	共立印刷	3,100	191.00	592,100	
7840	フランスベッドホールディングス	17,000	124.00	2,108,000	
7846	パイロットコーポレーション	22	158,100.00	3,478,200	
7862	トッパン・フォームズ	5,200	583.00	3,031,600	
7864	フジシールインターナショナル	2,800	1,333.00	3,732,400	
7867	タカラトミー	8,100	535.00	4,333,500	
7868	廣済堂	2,300	194.00	446,200	

7885	タカノ	1,000	430.00	430,000	
7893	プロネクス	2,700	383.00	1,034,100	
7897	ホクシン	2,000	145.00	290,000	
7898	ウッドワン	4,000	257.00	1,028,000	
7905	大建工業	10,000	225.00	2,250,000	
7911	凸版印刷	75,000	571.00	42,825,000	
7912	大日本印刷	75,000	750.00	56,250,000	
7913	図書印刷	4,000	129.00	516,000	
7914	共同印刷	8,000	181.00	1,448,000	
7915	日本写真印刷	4,200	932.00	3,914,400	
7916	光村印刷	3,000	240.00	720,000	
7921	宝印刷	1,400	558.00	781,200	
7936	アシックス	23,000	873.00	20,079,000	
7937	ツツミ	1,200	1,795.00	2,154,000	
7944	ローランド	2,600	688.00	1,788,800	
7949	小松ウオール工業	1,000	772.00	772,000	
7951	ヤマハ	18,200	727.00	13,231,400	
7952	河合楽器製作所	9,000	144.00	1,296,000	
7955	クリナップ	2,900	468.00	1,357,200	
7956	ビジョン	2,200	3,105.00	6,831,000	
7961	兼松日産農林	4,000	156.00	624,000	
7962	キングジム	2,100	562.00	1,180,200	
7966	リンテック	4,700	1,400.00	6,580,000	
7968	田崎真珠	6,000	47.00	282,000	
7972	イトーキ	5,400	171.00	923,400	
7974	任天堂	14,100	10,610.00	149,601,000	
7976	三菱鉛筆	2,100	1,367.00	2,870,700	
7981	タカラスタンダード	11,000	582.00	6,402,000	
7984	コクヨ	12,800	552.00	7,065,600	
7987	ナカバヤシ	6,000	191.00	1,146,000	
7994	岡村製作所	9,000	521.00	4,689,000	
8022	美津濃	12,000	395.00	4,740,000	
8170	アデランス	3,100	983.00	3,047,300	
9501	東京電力	196,800	213.00	41,918,400	
9502	中部電力	81,200	1,422.00	115,466,400	
9503	関西電力	100,500	1,125.00	113,062,500	
9504	中国電力	34,000	1,294.00	43,996,000	
9505	北陸電力	24,100	1,366.00	32,920,600	
9506	東北電力	61,600	723.00	44,536,800	
9507	四国電力	22,700	2,124.00	48,214,800	
9508	九州電力	54,400	1,063.00	57,827,200	
9509	北海道電力	23,100	1,054.00	24,347,400	
9511	沖縄電力	1,500	3,265.00	4,897,500	
9513	電源開発	15,300	1,944.00	29,743,200	
9531	東京瓦斯	297,000	348.00	103,356,000	
9532	大阪瓦斯	239,000	302.00	72,178,000	
9533	東邦瓦斯	63,000	479.00	30,177,000	
9534	北海道瓦斯	4,000	266.00	1,064,000	
9536	西部瓦斯	28,000	209.00	5,852,000	

9543	静岡瓦斯	6,500	501.00	3,256,500	
9001	東武鉄道	140,000	390.00	54,600,000	
9003	相鉄ホールディングス	39,000	233.00	9,087,000	
9005	東京急行電鉄	145,000	379.00	54,955,000	
9006	京浜急行電鉄	63,000	685.00	43,155,000	
9007	小田急電鉄	79,000	745.00	58,855,000	
9008	京王電鉄	69,000	550.00	37,950,000	
9009	京成電鉄	40,000	573.00	22,920,000	
9010	富士急行	7,000	459.00	3,213,000	
9020	東日本旅客鉄道	42,900	4,875.00	209,137,500	
9021	西日本旅客鉄道	21,400	3,310.00	70,834,000	
9022	東海旅客鉄道	214	649,000.00	138,886,000	
9031	西日本鉄道	32,000	366.00	11,712,000	
9037	ハマキョウレックス	700	2,363.00	1,654,100	
9039	サカイ引越センター	400	1,603.00	641,200	
9041	近畿日本鉄道	223,000	299.00	66,677,000	
9042	阪急阪神ホールディングス	165,000	323.00	53,295,000	
9044	南海電気鉄道	51,000	334.00	17,034,000	
9045	京阪電気鉄道	55,000	366.00	20,130,000	
9047	名糖運輸	1,100	604.00	664,400	
9048	名古屋鉄道	86,000	200.00	17,200,000	
9062	日本通運	97,000	298.00	28,906,000	
9064	ヤマトホールディングス	50,100	1,295.00	64,879,500	
9065	山九	30,000	287.00	8,610,000	
9067	丸運	1,300	189.00	245,700	
9068	丸全昭和運輸	8,000	253.00	2,024,000	
9069	センコー	10,000	303.00	3,030,000	
9070	トナミホールディングス	5,000	164.00	820,000	
9072	日本梱包運輸倉庫	7,400	778.00	5,757,200	
9074	日本石油輸送	3,000	188.00	564,000	
9075	福山通運	15,000	461.00	6,915,000	
9076	セイノーホールディングス	19,000	593.00	11,267,000	
9081	神奈川中央交通	3,000	419.00	1,257,000	
9086	日立物流	5,100	1,318.00	6,721,800	
9101	日本郵船	195,000	200.00	39,000,000	
9104	商船三井	129,000	295.00	38,055,000	
9107	川崎汽船	76,000	141.00	10,716,000	
9110	N S ユナイテッド海運	11,000	119.00	1,309,000	
9113	乾汽船	2,800	269.00	753,200	
9115	明治海運	2,300	222.00	510,600	
9119	飯野海運	12,000	332.00	3,984,000	
9130	共栄タンカー	2,000	118.00	236,000	
9132	第一中央汽船	16,000	103.00	1,648,000	
9202	全日本空輸	329,000	219.00	72,051,000	
9232	バスコ	3,000	252.00	756,000	
9234	国際航業ホールディングス	2,000	199.00	398,000	
9066	日新	9,000	181.00	1,629,000	
9301	三菱倉庫	17,000	863.00	14,671,000	
9302	三井倉庫	11,000	288.00	3,168,000	

9303	住友倉庫	18,000	365.00	6,570,000	
9304	澁澤倉庫	6,000	210.00	1,260,000	
9306	東陽倉庫	4,000	170.00	680,000	
9310	日本トランスシティ	5,000	266.00	1,330,000	
9312	ケイヒン	5,000	89.00	445,000	
9324	安田倉庫	1,900	464.00	881,600	
9351	東洋埠頭	7,000	122.00	854,000	
9358	宇徳	1,800	245.00	441,000	
9364	上組	27,000	660.00	17,820,000	
9366	サンリツ	800	504.00	403,200	
9368	キムラユニティー	500	670.00	335,000	
9369	キューソー流通システム	700	856.00	599,200	
9370	郵船ロジスティクス	1,900	987.00	1,875,300	
9375	近鉄エクスプレス	2,200	2,267.00	4,987,400	
9380	東海運	1,700	201.00	341,700	
1973	N E C ネットエスアイ	2,300	1,116.00	2,566,800	
2317	システナ	29	52,800.00	1,531,200	
2327	新日鉄ソリューションズ	1,600	1,506.00	2,409,600	
2359	コア	1,000	675.00	675,000	
3371	ソフトクリエイト	300	1,045.00	313,500	
3620	デジタルハーツ	2	147,300.00	294,600	
3626	I T ホールディングス	7,400	907.00	6,711,800	
3632	グリー	10,700	2,573.00	27,531,100	
3635	コーエーテクモホールディングス	4,800	626.00	3,004,800	
3636	三菱総合研究所	900	1,375.00	1,237,500	
3639	ボルテージ	300	996.00	298,800	
3715	ドワンゴ	12	120,800.00	1,449,600	
3724	ベリサーブ	2	135,900.00	271,800	
3730	マクロミル	2,800	795.00	2,226,000	
3738	ティーガイア	16	142,900.00	2,286,400	
3769	G M O ペイメントゲートウェイ	5	323,000.00	1,615,000	
3770	ザッパラス	13	76,400.00	993,200	
3774	インターネットイニシアティブ	14	271,900.00	3,806,600	
3789	ソネットエンタテインメント	14	267,800.00	3,749,200	
3817	S R A ホールディングス	1,300	783.00	1,017,900	
3820	J B I S ホールディングス	2,600	230.00	598,000	
3834	朝日ネット	2,000	360.00	720,000	
4283	パナソニック電工インフォメーションシステム	600	1,984.00	1,190,400	
4295	フェイス	85	7,970.00	677,450	
4307	野村総合研究所	13,700	1,704.00	23,344,800	
4312	サイバネットシステム	21	18,670.00	392,070	
4326	インテージ	700	1,400.00	980,000	
4340	シンプレクス・ホールディングス	41	27,040.00	1,108,640	
4344	ソースネクスト	8	14,900.00	119,200	
4674	クレスコ	700	616.00	431,200	
4676	フジ・メディア・ホールディングス	253	111,900.00	28,310,700	

4684	オービック	760	14,400.00	10,944,000	
4687	ティーディーシーソフトウェア エンジニアリ	500	798.00	399,000	

[次へ](#)

4689	ヤフー	1,778	24,520.00	43,596,560	
4704	トレンドマイクロ	10,700	2,407.00	25,754,900	
4716	日本オラクル	3,900	2,604.00	10,155,600	
4719	アルファシステムズ	600	1,114.00	668,400	
4722	フューチャーアーキテクト	28	31,000.00	868,000	
4725	シーエーシー	1,700	635.00	1,079,500	
4726	ソフトバンク・テクノロジー	600	594.00	356,400	
4728	トーセ	600	509.00	305,400	
4733	オービックビジネスコンサルタン ト	600	3,650.00	2,190,000	
4738	日立ビジネスソリューション	800	1,002.00	801,600	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	2,900	3,330.00	9,657,000	
4743	アイティフォー	2,800	266.00	744,800	
4746	東計電算	400	1,104.00	441,600	
4762	エックスネット	2	113,400.00	226,800	
4768	大塚商会	1,900	5,320.00	10,108,000	
4776	サイボウズ	46	24,200.00	1,113,200	
4779	ソフトブレーン	40	8,760.00	350,400	
4799	アグレックス	700	745.00	521,500	
4812	電通国際情報サービス	1,500	762.00	1,143,000	
4825	ウェザーニューズ	800	2,056.00	1,644,800	
4826	C I J	2,400	305.00	732,000	
4839	WOWOW	7	183,000.00	1,281,000	
6791	日本コロムビア	26,000	28.00	728,000	
7518	ネットワンシステムズ	55	195,400.00	10,747,000	
7595	アルゴグラフィックス	900	1,004.00	903,600	
7860	エイベックス・グループ・ホー ルディングス	4,600	973.00	4,475,800	
8056	日本ユニシス	5,900	502.00	2,961,800	
8096	兼松エレクトロニクス	1,500	781.00	1,171,500	
9401	東京放送ホールディングス	14,600	962.00	14,045,200	
9404	日本テレビ放送網	2,130	11,380.00	24,239,400	
9409	テレビ朝日	62	123,500.00	7,657,000	
9412	スカパーＪＳＡＴホールディング ス	185	38,450.00	7,113,250	
9413	テレビ東京ホールディングス	1,500	1,001.00	1,501,500	
9422	アイ・ティー・シーネットワー ク	2,200	487.00	1,071,400	
9427	イー・アクセス	186	18,660.00	3,470,760	
9430	N E C モバイルリング	900	2,511.00	2,259,900	
9432	日本電信電話	111,900	3,890.00	435,291,000	代用有価証券12,300株
9433	K D D I	378	500,000.00	189,000,000	
9435	光通信	2,200	1,890.00	4,158,000	
9437	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	2,003	138,000.00	276,414,000	
9449	G M O インターネット	7,300	290.00	2,117,000	
9470	学研ホールディングス	8,000	138.00	1,104,000	
9474	ゼンリン	3,500	678.00	2,373,000	
9475	昭文社	1,400	578.00	809,200	
9477	角川グループホールディングス	2,300	2,548.00	5,860,400	

9479	インプレスホールディングス	2,300	103.00	236,900	
9600	アイネット	1,100	456.00	501,600	
9601	松竹	16,000	725.00	11,600,000	
9602	東宝	17,300	1,354.00	23,424,200	
9605	東映	10,000	360.00	3,600,000	
9607	葵プロモーション	1,000	394.00	394,000	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	150	247,900.00	37,185,000	
9682	D T S	2,500	891.00	2,227,500	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	8,000	1,501.00	12,008,000	
9692	シーイーシー	1,500	355.00	532,500	
9697	カプコン	4,700	1,788.00	8,403,600	
9717	ジャステック	1,600	423.00	676,800	
9719	S C S K	5,000	1,201.00	6,005,000	
9739	日本システムウエア	800	305.00	244,000	
9742	アイネス	3,000	529.00	1,587,000	
9746	T K C	2,000	1,560.00	3,120,000	
9749	富士ソフト	3,300	1,360.00	4,488,000	
9759	N S D	4,700	601.00	2,824,700	
9766	コナミ	11,000	2,299.00	25,289,000	
9790	福井コンピュータ	400	346.00	138,400	
9889	J B C C ホールディングス	1,900	527.00	1,001,300	
9984	ソフトバンク	110,200	2,336.00	257,427,200	
1352	ハウスイ	2,000	100.00	200,000	
2657	インターニックス	1,000	363.00	363,000	
2676	高千穂交易	1,000	817.00	817,000	
2692	伊藤忠食品	600	2,738.00	1,642,800	
2715	エレマテック	1,900	1,269.00	2,411,100	
2729	J A L U X	700	724.00	506,800	
2737	トーメンデバイス	300	1,691.00	507,300	
2760	東京エレクトロン デバイス	5	137,000.00	685,000	
2768	双日	162,800	118.00	19,210,400	
2784	アルフレッサ ホールディングス	6,400	3,145.00	20,128,000	
2874	横浜冷凍	5,600	612.00	3,427,200	
3004	神栄	3,000	159.00	477,000	
3022	山下医科器械	200	946.00	189,200	
3023	ラサ商事	1,100	350.00	385,000	
3036	アルコニックス	700	1,458.00	1,020,600	
3076	あい ホールディングス	4,300	336.00	1,444,800	
3107	ダイワボウホールディングス	24,000	176.00	4,224,000	
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	4,600	578.00	2,658,800	
3156	U K C ホールディングス	1,400	711.00	995,400	
3167	T O K A I ホールディングス	11,800	387.00	4,566,600	
3321	ミタチ産業	500	367.00	183,500	
3332	J F E 商事ホールディングス	16,000	318.00	5,088,000	
3360	シップヘルスケアホールディングス	3,200	1,685.00	5,392,000	
5009	富士興産	9,000	69.00	621,000	

6973	協栄産業	3,000	142.00	426,000	
7414	小野建	2,000	620.00	1,240,000	
7420	佐鳥電機	1,700	459.00	780,300	
7427	エコートレーディング	600	700.00	420,000	
7433	伯東	1,400	728.00	1,019,200	
7438	コンドーテック	900	942.00	847,800	
7442	中山福	1,300	588.00	764,400	
7447	ナガイレーベン	3,200	999.00	3,196,800	
7451	三菱食品	2,200	1,986.00	4,369,200	
7456	松田産業	1,800	1,173.00	2,111,400	
7459	メディパルホールディングス	26,200	802.00	21,012,400	
7463	アドヴァン	1,500	651.00	976,500	
7466	S P K	600	1,314.00	788,400	
7476	アズワン	1,600	1,548.00	2,476,800	
7480	スズデン	800	511.00	408,800	
7482	シモジマ	1,500	977.00	1,465,500	
7483	ドウシシャ	1,200	2,174.00	2,608,800	
7504	高速	1,500	619.00	928,500	
7517	黒田電気	3,000	812.00	2,436,000	
7537	丸文	1,900	311.00	590,900	
7552	ハピネット	1,300	696.00	904,800	
7558	トーメンエレクトロニクス	1,100	919.00	1,010,900	
7591	エクセル	1,100	750.00	825,000	
7594	マルカキカイ	800	655.00	524,000	
7599	ガリバーインターナショナル	740	3,085.00	2,282,900	
7600	日本エム・ディ・エム	2,200	212.00	466,400	
7607	進和	1,400	853.00	1,194,200	
7608	エスケイジャパン	700	240.00	168,000	
7609	ダイトエレクトロン	1,100	455.00	500,500	
7613	シークス	1,500	986.00	1,479,000	
7619	田中商事	800	409.00	327,200	
7628	オーハシテクニカ	1,300	578.00	751,400	
7631	マクニカ	1,200	1,712.00	2,054,400	
7637	白銅	800	769.00	615,200	
8001	伊藤忠商事	193,900	769.00	149,109,100	
8002	丸紅	213,000	462.00	98,406,000	
8007	高島	4,000	185.00	740,000	
8008	F & A アクアホールディングス	1,800	742.00	1,335,600	
8012	長瀬産業	13,700	823.00	11,275,100	
8014	蝶理	14,000	87.00	1,218,000	
8015	豊田通商	27,100	1,346.00	36,476,600	
8018	三共生興	4,100	265.00	1,086,500	
8020	兼松	51,000	73.00	3,723,000	
8025	ツカモトコーポレーション	5,000	84.00	420,000	
8031	三井物産	209,800	1,185.00	248,613,000	
8032	日本紙パルプ商事	12,000	266.00	3,192,000	
8036	日立ハイテクノロジー	7,400	1,646.00	12,180,400	
8037	カメイ	3,000	699.00	2,097,000	
8038	東都水産	5,000	135.00	675,000	

8043	スターゼン	8,000	227.00	1,816,000	
8051	山善	9,400	559.00	5,254,600	
8052	椿本興業	3,000	203.00	609,000	
8053	住友商事	143,400	1,032.00	147,988,800	
8057	内田洋行	6,000	212.00	1,272,000	
8058	三菱商事	177,100	1,539.00	272,556,900	
8059	第一実業	5,000	312.00	1,560,000	
8060	キャノンマーケティングジャ パン	8,100	901.00	7,298,100	
8061	西華産業	9,000	208.00	1,872,000	
8065	佐藤商事	2,100	445.00	934,500	
8068	菱洋エレクトロ	2,700	835.00	2,254,500	
8070	東京産業	2,500	242.00	605,000	
8074	ユアサ商事	25,000	110.00	2,750,000	
8075	神鋼商事	6,000	179.00	1,074,000	
8078	阪和興業	24,000	331.00	7,944,000	
8081	カナデン	2,000	496.00	992,000	
8084	菱電商事	4,000	431.00	1,724,000	
8087	フルサト工業	1,500	600.00	900,000	
8088	岩谷産業	27,000	253.00	6,831,000	
8089	すてきナイスグループ	11,000	158.00	1,738,000	
8090	昭光通商	9,000	130.00	1,170,000	
8091	ニチモウ	4,000	161.00	644,000	
8093	極東貿易	3,000	202.00	606,000	
8095	イワキ	4,000	191.00	764,000	
8097	三愛石油	6,000	340.00	2,040,000	
8098	稲畑産業	6,400	454.00	2,905,600	
8101	G S I クレオス	6,000	104.00	624,000	
8103	明和産業	2,000	208.00	416,000	
8129	東邦ホールディングス	7,800	1,033.00	8,057,400	
8130	サンゲツ	4,300	1,940.00	8,342,000	
8131	ミツウロコグループホールディ ングス	3,900	428.00	1,669,200	
8132	シナネン	5,000	335.00	1,675,000	
8133	伊藤忠エネクス	5,400	436.00	2,354,400	
8136	サンリオ	6,100	3,760.00	22,936,000	
8137	サンワテクノス	1,200	701.00	841,200	
8140	リョーサン	3,900	1,598.00	6,232,200	
8141	新光商事	2,600	608.00	1,580,800	
8142	トーヨー	5,000	306.00	1,530,000	
8150	三信電気	3,400	632.00	2,148,800	
8151	東陽テクニカ	3,500	801.00	2,803,500	
8153	モスフードサービス	3,200	1,510.00	4,832,000	
8154	加賀電子	2,600	805.00	2,093,000	
8158	ソーダニッカ	3,000	343.00	1,029,000	
8159	立花エレクトック	1,400	728.00	1,019,200	
8283	P a l t a c	1,700	1,457.00	2,476,900	
8835	太平洋興発	9,000	73.00	657,000	
9305	ヤマタネ	13,000	110.00	1,430,000	

9763	丸紅建材リース	3,000	140.00	420,000	
9810	日鐵商事	5,000	205.00	1,025,000	
9830	トラスコ中山	3,000	1,381.00	4,143,000	
9832	オートバックスセブン	2,900	3,580.00	10,382,000	
9869	加藤産業	3,500	1,473.00	5,155,500	
9880	イノテック	1,500	516.00	774,000	
9882	イエローハット	2,300	1,239.00	2,849,700	
9883	富士エレクトロニクス	1,200	1,042.00	1,250,400	
9896	J Kホールディングス	2,100	355.00	745,500	
9902	日伝	1,000	2,551.00	2,551,000	
9930	北沢産業	2,500	156.00	390,000	
9932	杉本商事	1,300	689.00	895,700	
9934	因幡電機産業	2,800	2,144.00	6,003,200	
9938	住金物産	11,000	189.00	2,079,000	
9962	ミスミグループ本社	9,000	1,734.00	15,606,000	
9963	江守商事	400	879.00	351,600	
9972	アルテック	1,300	200.00	260,000	
9982	タキヒヨー	4,000	413.00	1,652,000	
9987	スズケン	9,300	2,093.00	19,464,900	
9991	ジェコス	1,700	301.00	511,700	
2651	ローソン	7,700	4,715.00	36,305,500	
2659	サンエー	800	3,020.00	2,416,000	
2660	キリン堂	1,100	503.00	553,300	
2662	ダイユーエイト	400	720.00	288,000	
2664	カワチ薬品	1,700	1,514.00	2,573,800	
2670	エービーシー・マート	3,500	2,880.00	10,080,000	
2674	ハードオフコーポレーション	1,200	518.00	621,600	
2678	アスクル	1,900	1,099.00	2,088,100	
2681	ゲオホールディングス	40	79,000.00	3,160,000	
2685	ポイント	2,060	3,230.00	6,653,800	
2687	シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,000	109.00	218,000	
2695	くらコーポレーション	1,300	985.00	1,280,500	
2698	キャンドゥ	13	83,100.00	1,080,300	
2726	パル	700	2,961.00	2,072,700	
2730	エディオン	9,700	607.00	5,887,900	
2734	サーラコーポレーション	2,000	451.00	902,000	
2753	あみやき亭	4	178,700.00	714,800	
2764	ひらまつ	10	63,400.00	634,000	
2772	ゲンキー	200	1,763.00	352,600	
2792	ハニーズ	2,170	1,100.00	2,387,000	
3028	アルペン	1,500	1,358.00	2,037,000	
3048	ビックカメラ	92	42,350.00	3,896,200	
3050	D C Mホールディングス	12,600	600.00	7,560,000	
3064	M o n o t a R O	1,400	795.00	1,113,000	
3086	J . フロント リテイリング	58,000	362.00	20,996,000	
3087	ドトール・日レスホールディングス	3,800	1,001.00	3,803,800	
3088	マツモトキヨシホールディングス	4,500	1,554.00	6,993,000	

3097	物語コーポレーション	300	1,304.00	391,200	
3098	ココカラファイン	2,500	2,016.00	5,040,000	
3099	三越伊勢丹ホールディングス	48,300	799.00	38,591,700	
3148	クリエイイトS Dホールディングス	1,000	1,583.00	1,583,000	
3159	丸善C H Iホールディングス	900	199.00	179,100	
3313	ブックオフコーポレーション	1,400	672.00	940,800	
3333	あさひ	1,400	1,627.00	2,277,800	
3337	サークルKサンクス	5,300	1,244.00	6,593,200	
3341	日本調剤	300	2,675.00	802,500	
3349	コスモス薬品	1,200	3,785.00	4,542,000	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	101,700	2,127.00	216,315,900	
3391	ツルハホールディングス	2,200	4,315.00	9,493,000	
3395	サンマルクホールディングス	700	2,965.00	2,075,500	
3396	フェリシモ	700	968.00	677,600	
3397	トリドール	2,100	731.00	1,535,100	
3398	クスリのアオキ	400	1,317.00	526,800	
4350	メディカルシステムネットワーク	400	784.00	313,600	
4775	総合メディカル	600	2,598.00	1,558,800	
7416	はるやま商事	1,100	384.00	422,400	
7421	カップ・クリエイト	1,800	1,796.00	3,232,800	
7445	ライトオン	1,900	595.00	1,130,500	
7448	ジーンズメイト	1,000	181.00	181,000	
7453	良品計画	2,600	3,625.00	9,425,000	
7455	三城ホールディングス	3,100	591.00	1,832,100	
7494	コナカ	2,900	517.00	1,499,300	
7506	ハウス オブ ローゼ	300	1,241.00	372,300	
7508	G - 7ホールディングス	700	368.00	257,600	
7512	イオン北海道	1,600	350.00	560,000	
7513	コジマ	3,300	497.00	1,640,100	
7516	コーナン商事	2,500	1,239.00	3,097,500	
7520	エコス	1,000	459.00	459,000	
7522	ワタミ	2,900	1,825.00	5,292,500	
7524	マルシェ	700	692.00	484,400	
7532	ドン・キホーテ	4,700	2,675.00	12,572,500	
7541	メガネトップ	3,500	838.00	2,933,000	
7545	西松屋チェーン	5,300	584.00	3,095,200	
7550	ゼンショーホールディングス	9,300	1,023.00	9,513,900	
7554	幸楽苑	1,500	1,178.00	1,767,000	
7561	ハークスレイ	500	525.00	262,500	
7581	サイゼリヤ	3,600	1,270.00	4,572,000	
7601	ボブラ	800	470.00	376,000	
7606	ユニテッドアローズ	2,600	1,461.00	3,798,600	
7611	ハイデイ日高	1,000	1,245.00	1,245,000	
7615	京都きもの友禅	1,700	902.00	1,533,400	
7616	コロワイド	8,000	528.00	4,224,000	
7630	壱番屋	1,000	2,260.00	2,260,000	
7640	トップカルチャー	900	355.00	319,500	

7649	スギホールディングス	4,400	2,258.00	9,935,200	
8005	スクロール	3,200	271.00	867,200	
8028	ファミリーマート	7,500	3,080.00	23,100,000	

[次へ](#)

8160	木曽路	2,800	1,430.00	4,004,000	
8165	千趣会	4,400	522.00	2,296,800	
8166	タカキュー	2,000	134.00	268,000	
8168	ケーヨー	4,600	476.00	2,189,600	
8173	上新電機	5,000	842.00	4,210,000	
8174	日本瓦斯	2,300	1,099.00	2,527,700	
8175	ベスト電器	7,500	184.00	1,380,000	
8178	マルエツ	5,000	280.00	1,400,000	
8179	ロイヤルホールディングス	4,100	922.00	3,780,200	
8181	東天紅	2,000	111.00	222,000	
8182	いなげや	2,700	897.00	2,421,900	
8184	島忠	5,500	1,707.00	9,388,500	
8185	チヨダ	3,200	1,337.00	4,278,400	
8194	ライフコーポレーション	1,500	1,444.00	2,166,000	
8196	カスミ	5,000	488.00	2,440,000	
8200	リンガーハット	2,200	1,043.00	2,294,600	
8201	さが美	3,000	88.00	264,000	
8203	M r M a x	2,500	308.00	770,000	
8207	テンアライド	2,100	259.00	543,900	
8214	A O K Iホールディングス	2,200	1,169.00	2,571,800	
8217	オークワ	3,000	1,170.00	3,510,000	
8218	コメリ	3,300	2,285.00	7,540,500	
8219	青山商事	6,700	1,388.00	9,299,600	
8227	しまむら	2,800	7,660.00	21,448,000	
8229	C F Sコーポレーション	1,500	341.00	511,500	
8233	高島屋	33,000	581.00	19,173,000	
8237	松屋	5,000	434.00	2,170,000	
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	13,000	591.00	7,683,000	
8245	丸栄	5,000	86.00	430,000	
8248	ニッセンホールディングス	4,900	345.00	1,690,500	
8251	バルコ	4,400	585.00	2,574,000	
8252	丸井グループ	31,900	599.00	19,108,100	
8255	原信ナルスホールディングス	1,400	1,264.00	1,769,600	
8263	ダイエー	15,300	276.00	4,222,800	
8266	イズミヤ	9,000	405.00	3,645,000	
8267	イオン	85,700	1,067.00	91,441,900	
8270	ユニー	18,300	706.00	12,919,800	
8273	イズミ	7,300	1,255.00	9,161,500	
8274	東武ストア	3,000	258.00	774,000	
8276	平和堂	4,500	950.00	4,275,000	
8278	フジ	2,700	1,796.00	4,849,200	
8279	ヤオコー	1,100	2,595.00	2,854,500	
8281	ゼビオ	2,900	1,772.00	5,138,800	
8282	ケーズホールディングス	6,100	2,995.00	18,269,500	
8289	O l y m p i c	1,700	715.00	1,215,500	
8291	日産東京販売ホールディングス	4,000	130.00	520,000	
9627	アインファーマシーズ	1,300	3,700.00	4,810,000	
9828	元気寿司	800	933.00	746,400	

9831	ヤマダ電機	11,830	5,270.00	62,344,100	
9842	アークランドサカモト	1,600	1,435.00	2,296,000	
9843	ニトリホールディングス	4,800	7,120.00	34,176,000	
9854	愛眼	2,100	350.00	735,000	
9861	吉野家ホールディングス	66	104,600.00	6,903,600	
9887	松屋フーズ	1,100	1,546.00	1,700,600	
9900	サガミチェーン	3,000	523.00	1,569,000	
9945	ブレナス	2,700	1,251.00	3,377,700	
9946	ミニストップ	1,800	1,405.00	2,529,000	
9948	アークス	3,300	1,416.00	4,672,800	
9956	パロー	4,900	1,151.00	5,639,900	
9974	ベルク	1,200	1,158.00	1,389,600	
9979	大庄	1,200	979.00	1,174,800	
9983	ファーストリテイリング	5,700	13,600.00	77,520,000	
9989	サンドラッグ	4,600	2,302.00	10,589,200	
9993	ヤマザワ	600	1,381.00	828,600	
9994	やまや	400	1,016.00	406,400	
9997	ベルーナ	3,100	598.00	1,853,800	
8303	新生銀行	190,000	78.00	14,820,000	
8304	あおぞら銀行	76,000	212.00	16,112,000	
8306	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	1,840,400	326.00	599,970,400	
8308	りそなホールディングス	211,600	339.00	71,732,400	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	480,000	224.00	107,520,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	183,900	2,171.00	399,246,900	
8324	第四銀行	32,000	248.00	7,936,000	
8325	北越銀行	26,000	153.00	3,978,000	
8327	西日本シティ銀行	85,000	219.00	18,615,000	
8328	札幌北洋ホールディングス	36,700	270.00	9,909,000	
8331	千葉銀行	96,000	494.00	47,424,000	
8332	横浜銀行	156,000	365.00	56,940,000	
8333	常陽銀行	94,000	333.00	31,302,000	
8334	群馬銀行	55,000	414.00	22,770,000	
8336	武蔵野銀行	3,900	2,522.00	9,835,800	
8337	千葉興業銀行	4,700	395.00	1,856,500	
8338	筑波銀行	10,200	251.00	2,560,200	
8339	東京都民銀行	4,700	920.00	4,324,000	
8341	七十七銀行	38,000	330.00	12,540,000	
8342	青森銀行	18,000	230.00	4,140,000	
8343	秋田銀行	17,000	218.00	3,706,000	
8344	山形銀行	15,000	368.00	5,520,000	
8345	岩手銀行	1,600	3,285.00	5,256,000	
8346	東邦銀行	20,000	219.00	4,380,000	
8349	東北銀行	14,000	121.00	1,694,000	
8350	みちのく銀行	12,000	143.00	1,716,000	
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	99,000	323.00	31,977,000	
8355	静岡銀行	73,000	799.00	58,327,000	

8356	十六銀行	30,000	244.00	7,320,000	
8358	スルガ銀行	24,000	683.00	16,392,000	
8359	八十二銀行	45,000	436.00	19,620,000	
8360	山梨中央銀行	15,000	312.00	4,680,000	
8361	大垣共立銀行	33,000	246.00	8,118,000	
8362	福井銀行	21,000	228.00	4,788,000	
8363	北國銀行	29,000	268.00	7,772,000	
8364	清水銀行	800	2,821.00	2,256,800	
8366	滋賀銀行	23,000	513.00	11,799,000	
8367	南都銀行	23,000	427.00	9,821,000	
8368	百五銀行	22,000	303.00	6,666,000	
8369	京都銀行	43,000	660.00	28,380,000	
8374	三重銀行	10,000	173.00	1,730,000	
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	170,000	147.00	24,990,000	
8379	広島銀行	72,000	354.00	25,488,000	
8381	山陰合同銀行	14,000	572.00	8,008,000	
8382	中国銀行	20,000	1,049.00	20,980,000	
8383	鳥取銀行	8,000	145.00	1,160,000	
8385	伊予銀行	26,000	747.00	19,422,000	
8386	百十四銀行	27,000	339.00	9,153,000	
8387	四国銀行	18,000	287.00	5,166,000	
8388	阿波銀行	21,000	509.00	10,689,000	
8390	鹿児島銀行	16,000	527.00	8,432,000	
8392	大分銀行	16,000	222.00	3,552,000	
8393	宮崎銀行	16,000	184.00	2,944,000	
8394	肥後銀行	19,000	435.00	8,265,000	
8395	佐賀銀行	15,000	188.00	2,820,000	
8396	十八銀行	16,000	190.00	3,040,000	
8397	沖縄銀行	1,800	3,265.00	5,877,000	
8399	琉球銀行	5,100	938.00	4,783,800	
8409	八千代銀行	1,300	1,849.00	2,403,700	
8411	みずほフィナンシャルグループ	3,122,100	104.00	324,698,400	
8415	紀陽ホールディングス	97,000	119.00	11,543,000	
8418	山口フィナンシャルグループ	24,000	715.00	17,160,000	
8521	長野銀行	8,000	151.00	1,208,000	
8522	名古屋銀行	22,000	240.00	5,280,000	
8527	愛知銀行	900	4,375.00	3,937,500	
8529	第三銀行	14,000	158.00	2,212,000	
8530	中京銀行	10,000	193.00	1,930,000	
8536	東日本銀行	12,000	160.00	1,920,000	
8537	大光銀行	9,000	243.00	2,187,000	
8541	愛媛銀行	15,000	228.00	3,420,000	
8542	トマト銀行	9,000	129.00	1,161,000	
8543	みなと銀行	22,000	143.00	3,146,000	
8544	京葉銀行	20,000	380.00	7,600,000	
8545	関西アーバン銀行	34,000	125.00	4,250,000	
8550	栃木銀行	12,000	274.00	3,288,000	
8551	北日本銀行	800	1,830.00	1,464,000	

8558	東和銀行	25,000	90.00	2,250,000	
8562	福島銀行	29,000	40.00	1,160,000	
8563	大東銀行	17,000	63.00	1,071,000	
8600	トモニホールディングス	18,700	326.00	6,096,200	
8713	フィデアホールディングス	13,900	201.00	2,793,900	
8714	池田泉州ホールディングス	99,900	112.00	11,188,800	
8473	S B Iホールディングス	2,583	5,530.00	14,283,990	
8595	ジャフコ	3,100	1,373.00	4,256,300	
8601	大和証券グループ本社	241,000	241.00	58,081,000	
8604	野村ホールディングス	526,400	238.00	125,283,200	
8609	岡三証券グループ	21,000	241.00	5,061,000	
8613	丸三証券	8,300	229.00	1,900,700	
8614	東洋証券	9,000	104.00	936,000	
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	28,000	209.00	5,852,000	
8617	光世証券	7,000	55.00	385,000	
8622	水戸証券	8,000	96.00	768,000	
8624	いちよし証券	5,500	344.00	1,892,000	
8628	松井証券	14,500	385.00	5,582,500	
8692	だいこう証券ビジネス	1,400	245.00	343,000	
8698	マネックスグループ	197	11,590.00	2,283,230	
8703	カブドットコム証券	9,900	232.00	2,296,800	
8706	極東証券	3,200	410.00	1,312,000	
8707	岩井コスモホールディングス	2,400	228.00	547,200	
8742	小林洋行	900	171.00	153,900	
8630	N K S Jホールディングス	50,800	1,480.00	75,184,000	
8725	M S & A Dインシュアランスグループホール	72,600	1,420.00	103,092,000	
8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	23,300	1,149.00	26,771,700	
8750	第一生命保険	1,301	76,900.00	100,046,900	
8766	東京海上ホールディングス	92,300	1,708.00	157,648,400	
8795	T & Dホールディングス	88,700	724.00	64,218,800	
8253	クレディセゾン	20,000	1,560.00	31,200,000	
8424	芙蓉総合リース	2,400	2,617.00	6,280,800	
8425	興銀リース	3,500	1,683.00	5,890,500	
8439	東京センチュリーリース	6,600	1,440.00	9,504,000	
8511	日本証券金融	10,300	347.00	3,574,100	
8512	大阪証券金融	4,200	149.00	625,800	
8519	ポケットカード	3,100	259.00	802,900	
8566	リコーリース	1,800	1,696.00	3,052,800	
8570	イオンクレジットサービス	11,000	1,182.00	13,002,000	
8572	アコム	5,030	1,364.00	6,860,920	
8574	プロミス	12,550	759.00	9,525,450	
8584	ジャックス	15,000	235.00	3,525,000	
8585	オリエントコーポレーション	37,000	70.00	2,590,000	
8586	日立キャピタル	5,000	1,035.00	5,175,000	
8591	オリックス	12,660	6,410.00	81,150,600	
8593	三菱ＵＦＪリース	6,230	2,945.00	18,347,350	
8772	アサックス	4	83,000.00	332,000	

8793	N E C キャピタルソリューション	1,000	1,141.00	1,141,000	
2353	日本駐車場開発	266	3,535.00	940,310	
3003	昭栄	4,500	328.00	1,476,000	
3225	東京建物不動産販売	1,000	210.00	210,000	
3231	野村不動産ホールディングス	11,700	1,135.00	13,279,500	
3258	常和ホールディングス	400	1,260.00	504,000	
3265	ヒューリック	7,900	927.00	7,323,300	
4666	パーク 2 4	12,500	1,015.00	12,687,500	
8801	三井不動産	108,000	1,147.00	123,876,000	
8802	三菱地所	170,000	1,190.00	202,300,000	
8803	平和不動産	23,000	161.00	3,703,000	
8804	東京建物	46,000	232.00	10,672,000	
8806	ダイビル	7,100	480.00	3,408,000	
8809	サンケイビル	4,200	297.00	1,247,400	
8815	東急不動産	49,000	302.00	14,798,000	
8818	京阪神ビルディング	2,900	332.00	962,800	
8830	住友不動産	58,000	1,405.00	81,490,000	
8833	東宝不動産	2,600	401.00	1,042,600	
8840	大京	38,000	151.00	5,738,000	
8841	テーオーシー	9,400	344.00	3,233,600	
8842	東京楽天地	4,000	282.00	1,128,000	
8848	レオパレス 2 1	19,000	154.00	2,926,000	
8860	フジ住宅	3,000	364.00	1,092,000	
8864	空港施設	2,600	303.00	787,800	
8869	明和地所	1,200	339.00	406,800	
8870	住友不動産販売	870	2,981.00	2,593,470	
8871	ゴールドクレスト	2,210	1,233.00	2,724,930	
8875	東栄住宅	1,600	752.00	1,203,200	
8877	日本エスリード	900	650.00	585,000	
8879	東急リパブル	2,200	595.00	1,309,000	
8880	飯田産業	2,700	573.00	1,547,100	
8881	日神不動産	1,400	431.00	603,400	
8895	アーネストワン	4,000	770.00	3,080,000	
8897	タカラレーベン	2,800	449.00	1,257,200	
8904	サンヨーハウジング名古屋	10	73,300.00	733,000	
8905	イオンモール	11,100	1,641.00	18,215,100	
8907	フージャースコーポレーション	39	29,660.00	1,156,740	
8915	タクトホーム	12	62,500.00	750,000	
8918	ランド	5,600	15.00	84,000	
8923	トーセイ	25	19,030.00	475,750	
8933	エヌ・ティ・ティ都市開発	151	52,900.00	7,987,900	
8934	サンフロンティア不動産	22	8,250.00	181,500	
8944	ランドビジネス	18	15,140.00	272,520	
9706	日本空港ビルデング	7,800	975.00	7,605,000	
1954	日本工営	9,000	274.00	2,466,000	
2120	ネクスト	1,000	297.00	297,000	
2127	日本 M & A センター	5	408,500.00	2,042,500	
2128	ノバレーゼ	5	52,100.00	260,500	

2131	アコーディア・ゴルフ	104	56,200.00	5,844,800	
2168	パソナグループ	26	75,100.00	1,952,600	
2170	リンクアンドモチベーション	6	40,100.00	240,600	
2181	テンブホールディングス	3,500	700.00	2,450,000	
2301	学情	1,000	257.00	257,000	
2305	スタジオアリス	1,200	1,198.00	1,437,600	
2309	シミック	800	1,255.00	1,004,000	
2322	N E C フィールドディング	2,100	979.00	2,055,900	
2331	総合警備保障	9,400	816.00	7,670,400	
2371	カカクコム	4,000	2,847.00	11,388,000	
2378	ルネサンス	1,200	380.00	456,000	
2395	新日本科学	1,700	188.00	319,600	
2413	エムスリー	20	321,000.00	6,420,000	
2418	ベストプライダル	5	70,700.00	353,500	
2432	ディー・エヌ・エー	11,500	2,269.00	26,093,500	
2433	博報堂 D Y ホールディングス	3,280	4,360.00	14,300,800	
2440	ぐるなび	1,800	838.00	1,508,400	
2450	一休	19	32,050.00	608,950	
2453	ジャパンベストレスキューシステム	4	70,900.00	283,600	
2462	ジェイコムホールディングス	500	699.00	349,500	
2466	P G M ホールディングス	63	55,200.00	3,477,600	
4282	イーピーエス	14	148,800.00	2,083,200	
4301	アミューズ	700	970.00	679,000	
4310	ドリームインキュベータ	9	55,700.00	501,300	
4319	T A C	1,400	163.00	228,200	
4321	ケネディクス	284	10,880.00	3,089,920	
4324	電通	23,400	2,352.00	55,036,800	
4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	113	4,610.00	520,930	
4337	びあ	800	779.00	623,200	
4343	イオンファンタジー	900	1,211.00	1,089,900	
4544	みらかホールディングス	6,700	3,005.00	20,133,500	
4641	アルプス技研	1,200	746.00	895,200	
4651	サニックス	3,900	223.00	869,700	
4653	ダイオーズ	500	477.00	238,500	
4658	日本空調サービス	600	709.00	425,400	
4661	オリエンタルランド	6,900	8,100.00	55,890,000	
4665	ダスキン	7,700	1,488.00	11,457,600	
4668	明光ネットワークジャパン	2,300	676.00	1,554,800	
4671	ファルコ S D ホールディングス	1,400	880.00	1,232,000	
4678	秀英予備校	500	289.00	144,500	
4679	田谷	400	646.00	258,400	
4680	ラウンドワン	8,100	499.00	4,041,900	
4681	リゾートトラスト	4,000	1,105.00	4,420,000	
4694	ビー・エム・エル	1,700	1,763.00	2,997,100	
4696	ワタベウェディング	800	664.00	531,200	
4708	もしもしホットライン	4,300	713.00	3,065,900	
4711	東急コミュニティー	600	2,412.00	1,447,200	
4714	リソー教育	260	4,660.00	1,211,600	

4724	ウェアハウス	600	223.00	133,800	
4732	ユー・エス・エス	3,350	6,800.00	22,780,000	
4745	東京個別指導学院	1,300	133.00	172,900	
4767	テー・オー・ダブリュー	800	474.00	379,200	
4801	セントラルスポーツ	800	962.00	769,600	
5261	リゾートソリューション	2,000	142.00	284,000	
9603	エイチ・アイ・エス	2,600	2,141.00	5,566,600	
9616	共立メンテナンス	1,300	1,397.00	1,816,100	
9619	イチネンホールディングス	2,700	390.00	1,053,000	
9621	建設技術研究所	1,500	547.00	820,500	
9628	燦ホールディングス	500	1,385.00	692,500	
9632	スバル興業	2,000	232.00	464,000	
9633	東京テアトル	11,000	104.00	1,144,000	
9667	ホリプロ	800	1,045.00	836,000	
9671	よみうりランド	5,000	241.00	1,205,000	
9672	東京都競馬	20,000	106.00	2,120,000	
9675	常盤興産	8,000	80.00	640,000	
9678	カナモト	3,000	568.00	1,704,000	
9681	東京ドーム	21,000	188.00	3,948,000	
9715	トランス・コスモス	3,400	910.00	3,094,000	
9716	乃村工藝社	5,000	238.00	1,190,000	
9722	藤田観光	7,000	251.00	1,757,000	
9726	近畿日本ツーリスト	9,000	83.00	747,000	
9728	日本管財	900	1,388.00	1,249,200	
9729	トーカイ	1,000	1,664.00	1,664,000	
9731	白洋舎	3,000	218.00	654,000	
9735	セコム	25,000	3,575.00	89,375,000	
9740	セントラル警備保障	1,200	781.00	937,200	
9743	丹青社	3,000	190.00	570,000	
9744	メイテック	4,000	1,474.00	5,896,000	
9747	アサツー ディ・ケイ	4,500	2,046.00	9,207,000	
9755	応用地質	2,700	878.00	2,370,600	
9757	船井総合研究所	2,700	537.00	1,449,900	
9760	進学会	1,300	277.00	360,100	
9783	ベネッセホールディングス	7,900	3,575.00	28,242,500	
9787	イオンディライト	2,900	1,554.00	4,506,600	
9788	ナック	700	1,471.00	1,029,700	
9792	ニチイ学館	5,000	902.00	4,510,000	
9793	ダイセキ	4,100	1,284.00	5,264,400	
合 計		37,613,115	—	24,398,592,080	

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第 2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

科目	対象年月日	平成23年 6月27日現在	平成23年12月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		245,361,408	294,123,764
コール・ローン		1,253,703,062	1,252,440,559
株式		63,760,551,610	58,083,902,770
投資証券		1,141,540,860	1,116,994,717
派生商品評価勘定		1,626,140	62,652,645
未収入金		20,034,633	195,981
未収配当金		124,020,356	88,887,306
未収利息		2,135	2,339
差入委託証拠金		302,088,083	285,567,227
流動資産合計		66,848,928,287	61,184,767,308
資産合計		66,848,928,287	61,184,767,308
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		40,965,838	6,893,493
未払金		—	1,915,409
未払解約金		15,463,749	72,821,216
流動負債合計		56,429,587	81,630,118
負債合計		56,429,587	81,630,118
純資産の部			
元本等			
元本		74,341,249,071	74,699,067,348
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		7,548,750,371	13,595,930,158
元本等合計		66,792,498,700	61,103,137,190
純資産合計		66,792,498,700	61,103,137,190
負債純資産合計		66,848,928,287	61,184,767,308

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(追加情報)

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

(貸借対照表に関する注記)

平成23年 6月27日現在		平成23年12月26日現在	
1. 期首	平成22年12月28日	1. 期首	平成23年 6月28日
期首元本額	79,698,898,081円	期首元本額	74,341,249,071円
期首からの追加設定元本額	2,449,549,245円	期首からの追加設定元本額	6,476,497,300円
期首からの一部解約元本額	7,807,198,255円	期首からの一部解約元本額	6,118,679,023円
平成23年 6月27日現在の元本の内訳		平成23年12月26日現在の元本の内訳	
インデックスファンド海外株式ヘッジなし（DC専用）	12,483,906,990円	インデックスファンド海外株式ヘッジなし（DC専用）	13,225,377,704円
DCインデックスバランス（株式20）	41,887,038円	DCインデックスバランス（株式20）	52,009,425円
DCインデックスバランス（株式40）	149,266,535円	DCインデックスバランス（株式40）	179,634,972円
DCインデックスバランス（株式60）	287,159,229円	DCインデックスバランス（株式60）	339,763,596円
DCインデックスバランス（株式80）	317,163,912円	DCインデックスバランス（株式80）	360,531,296円

世界の財産 3 分法ファン ド（不動産・債券・株 式）毎月分配型	13,606,527,054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	12,357,529,643円
日興五大陸株式ファンド	22,176,246,986円	日興五大陸株式ファンド	20,600,879,404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	80,955,746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	87,568,300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）	106,747,677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）	108,098,871円
アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式80）	22,260,209円	アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式80）	22,965,996円
アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式60）	20,784,683円	アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式60）	20,910,483円
アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式40）	32,498,670円	アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式40）	33,808,106円
アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式20）	41,199,272円	アセット・ナビゲーショ ン・ファンド（株式20）	44,092,221円
国際分散型ファンド40 （適格機関投資家向け）	16,688,085,584円	国際分散型ファンド40 （適格機関投資家向け）	18,372,142,926円
3 資産バランスファンド （適格機関投資家向け）	58,222,476円	3 資産バランスファンド （適格機関投資家向け）	65,758,597円
グローバルバランスファ ンド35（適格機関投資家 向け）	21,759,649円	グローバルバランスファ ンド35（適格機関投資家 向け）	23,488,100円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式20）	43,710,765円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド （株式20）	52,064,250円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式40）	113,075,885円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド （株式40）	131,842,107円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式60）	149,250,182円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド （株式60）	171,515,833円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式80）	147,853,486円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド （株式80）	167,280,086円
年金積立 インデックス ファンド海外株式（ヘッ ジなし）	7,752,687,043円	年金積立 インデックス ファンド海外株式（ヘッ ジなし）	8,281,805,432円
計	74,341,249,071円	計	74,699,067,348円
2. 本報告書における開示対 象ファンドの当特定期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	74,341,249,071口	2. 本報告書における開示対 象ファンドの当特定期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	74,699,067,348口
3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、そ の差額は7,548,750,371円であります。		3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、 その差額は13,595,930,158円であります。	

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 平成22年12月28日 至 平成23年 6月27日	自 平成23年 6月28日 至 平成23年12月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成23年 6月27日現在	平成23年12月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（平成23年6月27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	1,489,503,929
投資証券	64,156,955
合計	1,553,660,884

（平成23年12月26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	608,421,711
投資証券	31,962,159
合計	640,383,870

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（平成23年6月27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	1,890,441,589	—	1,866,351,705	24,089,884
合計		1,890,441,589	—	1,866,351,705	24,089,884

（平成23年12月26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	1,757,108,722	—	1,818,315,262	61,206,540
合計		1,757,108,722	—	1,818,315,262	61,206,540

（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同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

[次へ](#)

(通貨関連)

(平成23年6月27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	1,478,339,394	—	1,463,119,580	15,219,814
	米ドル	1,019,328,515	—	1,011,238,470	8,090,045
	ユーロ	459,010,879	—	451,881,110	7,129,769
	売建	80,810,000	—	80,840,000	30,000
	米ドル	80,810,000	—	80,840,000	30,000
合計		1,559,149,394	—	1,543,959,580	15,249,814

(平成23年12月26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	1,399,710,548	—	1,394,074,040	5,636,508
	米ドル	962,334,847	—	961,909,070	425,777
	ユーロ	437,375,701	—	432,164,970	5,210,731
	売建	194,992,820	—	194,803,700	189,120
	米ドル	156,200,000	—	155,880,000	320,000
	豪ドル	22,033,200	—	22,173,200	140,000
	英ポンド	14,593,680	—	14,589,600	4,080
	イスラエルシェケル	2,165,940	—	2,160,900	5,040
合計		1,594,703,368	—	1,588,877,740	5,447,388

(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23年 6月27日現在		平成23年12月26日現在	
1口当たり純資産額	0.8985円	1口当たり純資産額	0.8180円
(1万口当たり純資産額)	(8,985円)	(1万口当たり純資産額)	(8,180円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
米ドル				
ALPHA NATURAL RESOURCES INC	8,280	20.73	171,644.40	
ANADARKO PETROLEUM CORP	18,348	76.67	1,406,741.16	
APACHE CORP	14,119	91.17	1,287,229.23	
ARCH COAL INC	7,385	14.82	109,445.70	
BAKER HUGHES INC	15,965	49.89	796,493.85	
CABOT OIL & GAS CORP	3,950	77.99	308,060.50	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	9,281	49.63	460,616.03	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	24,685	23.73	585,775.05	
CHEVRON CORP	74,136	107.50	7,969,620.00	
CIMAREX ENERGY CO	3,355	63.13	211,801.15	
CONCHO RESOURCES INC	3,645	93.82	341,973.90	
CONOCOPHILLIPS	48,280	72.43	3,496,920.40	
CONSOL ENERGY INC	8,638	38.05	328,675.90	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,630	69.09	112,616.70	
DENBURY RESOURCES INC	15,145	15.45	233,990.25	
DEVON ENERGY CORPORATION	14,531	62.51	908,332.81	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	2,585	56.67	146,491.95	
EL PASO CORP	29,105	26.20	762,551.00	
ENERGEN CORP	2,310	49.79	115,014.90	
EOG RESOURCES INC	9,916	98.27	974,445.32	
EQT CORP	5,345	55.97	299,159.65	
EXXON MOBIL CORP	179,966	85.22	15,336,702.52	
FMC TECHNOLOGIES INC	9,065	51.88	470,292.20	
HALLIBURTON CO	33,807	33.80	1,142,676.60	
HELMERICH & PAYNE	4,100	59.00	241,900.00	
HESS CORP	11,580	56.96	659,596.80	
HOLLYFRONTIER CORP	7,800	23.34	182,052.00	
KINDER MORGAN INC	4,010	31.37	125,793.70	
MARATHON OIL CORP	26,707	29.22	780,378.54	
MARATHON PETROLEUM CORP	13,426	33.53	450,173.78	
MURPHY OIL CORP	6,965	56.33	392,338.45	
NABORS INDUSTRIES LTD	10,741	18.24	195,915.84	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	15,676	68.47	1,073,335.72	
NEWFIELD EXPLORATION CO	4,950	37.59	186,070.50	
NOBLE CORP	9,482	31.63	299,915.66	
NOBLE ENERGY INC	6,471	95.38	617,203.98	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	30,081	94.62	2,846,264.22	
PEABODY ENERGY CORP	10,365	34.23	354,793.95	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,990	88.51	353,154.90	
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	5,655	36.00	203,580.00	
QEP RESOURCES INC	6,820	29.86	203,645.20	
RANGE RESOURCES CORP	6,030	62.62	377,598.60	
ROWAN COMPANIES INC	4,980	31.71	157,915.80	
SCHLUMBERGER LTD	49,944	69.14	3,453,128.16	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	12,765	32.89	419,840.85	
SPECTRA ENERGY CORP	25,424	30.87	784,838.88	
SUNOCO INC	4,938	40.73	201,124.74	
ULTRA PETROLEUM CORP	5,524	30.95	170,967.80	
VALERO ENERGY CORP	21,157	21.04	445,143.28	

WEATHERFORD INTL LTD	28,429	14.38	408,809.02	
WHITING PETROLEUM CORP	4,285	47.43	203,237.55	
WILLIAMS COS INC	21,944	32.71	717,788.24	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	7,905	86.05	680,225.25	
AIRGAS INC	2,650	79.90	211,735.00	
ALCOA INC	39,339	8.87	348,936.93	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	4,010	48.12	192,961.20	
BALL CORP	6,328	35.80	226,542.40	
CELANESE CORP-SERIES A	6,010	44.31	266,303.10	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,695	144.15	388,484.25	
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	5,350	65.31	349,408.50	
CROWN HOLDINGS INC	6,195	34.49	213,665.55	
DOW CHEMICAL	44,128	28.84	1,272,651.52	
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	34,328	46.17	1,584,923.76	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,510	39.44	217,314.40	
ECOLAB INC	10,900	56.91	620,319.00	
FMC CORP	2,780	87.37	242,888.60	
FREEPORT-MCMORAN COPPER	34,943	38.34	1,339,714.62	
INTERNATIONAL PAPER CO	15,520	29.24	453,804.80	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,224	53.13	171,291.12	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,450	32.99	344,745.50	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,070	75.99	157,299.30	
MEADWESTVACO CORP	6,889	29.97	206,463.33	
MONSANTO CO	19,671	70.98	1,396,247.58	
MOSAIC CO/THE	11,390	52.45	597,405.50	
NEWMONT MINING CORP	18,190	61.88	1,125,597.20	
NUCOR CORP	11,649	40.45	471,202.05	
OWENS-ILLINOIS INC	6,475	19.09	123,607.75	
PPG INDUSTRIES INC	5,937	83.51	495,798.87	
PRAXAIR INC	11,085	106.59	1,181,550.15	
ROCK-TENN COMPANY-CL A	2,500	58.37	145,925.00	
SEALED AIR CORP	4,356	17.05	74,269.80	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,327	89.68	298,365.36	
SIGMA-ALDRICH	4,395	62.86	276,269.70	
UNITED STATES STEEL CORP	5,237	26.21	137,261.77	
VULCAN MATERIALS CO	4,443	39.57	175,809.51	
WALTER ENERGY INC	2,240	63.99	143,337.60	
3M CO	24,826	82.20	2,040,697.20	
AGCO CORP	3,790	42.43	160,809.70	
AMETEK INC	6,317	42.04	265,566.68	
BOEING CO	25,922	73.97	1,917,450.34	
CATERPILLAR INC	23,801	92.25	2,195,642.25	
COOPER INDUSTRIES PLC	6,093	55.00	335,115.00	
CUMMINS INC	6,955	89.07	619,481.85	
DANAHER CORP	21,329	47.78	1,019,099.62	
DEERE & CO	15,225	78.69	1,198,055.25	
DOVER CORP	7,065	58.74	414,998.10	
EATON CORP	12,221	44.36	542,123.56	
EMERSON ELECTRIC CO	27,310	46.29	1,264,179.90	
FASTENAL CO	10,363	43.69	452,759.47	
FLOWERVE CORP	2,185	101.88	222,607.80	
FLUOR CORP	6,508	50.74	330,215.92	
GENERAL DYNAMICS CORP	11,152	66.36	740,046.72	
GENERAL ELECTRIC CO.	392,358	18.23	7,152,686.34	

GOODRICH CORP	4,615	123.40	569,491.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	27,321	54.98	1,502,108.58	
ILLINOIS TOOL WORKS	16,100	47.72	768,292.00	
INGERSOLL-RAND PLC	12,056	31.24	376,629.44	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,810	40.89	196,680.90	
JOY GLOBAL INC	3,935	77.35	304,372.25	
KBR INC	5,860	28.43	166,599.80	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	3,816	67.39	257,160.24	
LOCKHEED MARTIN CORP	10,281	81.41	836,976.21	
MASCO CORP	14,899	10.20	151,969.80	
NORTHROP GRUMMAN CORP	9,524	58.49	557,058.76	
PACCAR INC	11,999	37.98	455,722.02	
PALL CORP	4,486	57.56	258,214.16	
PARKER HANNIFIN CORP	5,785	77.42	447,874.70	
PENTAIR INC	3,864	33.51	129,482.64	
PRECISION CASTPARTS CORP	5,365	164.53	882,703.45	
QUANTA SERVICES INC	8,315	21.86	181,765.90	
RAYTHEON COMPANY	12,662	48.37	612,460.94	
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,398	74.17	400,369.66	
ROCKWELL COLLINS INC.	5,725	55.64	318,539.00	
ROPER INDUSTRIES INC	3,660	88.20	322,812.00	
SPX CORP	2,087	61.18	127,682.66	
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,081	68.50	416,548.50	
TEXTRON INC	10,336	18.77	194,006.72	
TYCO INTERNATIONAL LTD	16,935	47.10	797,638.50	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	31,810	74.18	2,359,665.80	
URS CORP	3,410	36.19	123,407.90	
WW GRAINGER INC	2,157	189.34	408,406.38	
XYLEM INC	6,518	24.91	162,363.38	
AVERY DENNISON CORP	4,680	28.64	134,035.20	
CINTAS CORP	4,727	34.88	164,877.76	
DUN & BRADSTREET CORP	2,082	74.75	155,629.50	
EQUIFAX INC	5,159	39.09	201,665.31	
IHS INC-CLASS A	1,710	84.79	144,990.90	
IRON MOUNTAIN INC	6,817	30.73	209,486.41	
MANPOWERGROUP	3,767	36.61	137,909.87	
NIelsen HOLDINGS NV	3,245	29.87	96,928.15	
PITNEY BOWES INC	8,543	18.64	159,241.52	
REPUBLIC SERVICES INC	11,045	27.87	307,824.15	
ROBERT HALF INTL INC	5,715	28.55	163,163.25	
RR DONNELLEY & SONS CO	8,005	14.82	118,634.10	
STERICYCLE INC	3,025	78.21	236,585.25	
VERISK ANALYTICS INC	4,000	39.63	158,520.00	
WASTE MANAGEMENT INC	16,164	32.73	529,047.72	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,095	70.02	426,771.90	
CSX CORP	40,333	21.34	860,706.22	
DELTA AIR LINES INC	6,905	8.33	57,518.65	
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,907	41.07	324,740.49	
FEDEX CORP	11,143	84.92	946,263.56	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	9,780	11.46	112,078.80	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,875	45.17	175,033.75	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	200,000	0.61	123,000.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	4,130	67.83	280,137.90	
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,830	72.76	933,510.80	

SOUTHWEST AIRLINES CO	7,030	8.58	60,317.40	
UNION PACIFIC CORP	17,968	105.53	1,896,163.04	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	2,495	19.85	49,525.75	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	27,127	73.47	1,993,020.69	
AUTOLIV INC	3,510	53.15	186,556.50	
BORGWARNER INC	4,135	65.58	271,173.30	
FORD MOTOR COMPANY	130,580	10.95	1,429,851.00	
GENERAL MOTORS CORP	28,115	20.50	576,357.50	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	9,385	14.31	134,299.35	
HARLEY-DAVIDSON INC	8,894	39.19	348,555.86	
JOHNSON CONTROLS INC	24,848	31.05	771,530.40	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	3,805	32.53	123,776.65	
COACH INC	10,686	61.19	653,876.34	
DR HORTON INC	12,086	12.45	150,470.70	
FOSSIL INC	2,035	85.90	174,806.50	
GARMIN LTD	4,625	39.99	184,953.75	
HASBRO INC	4,458	32.43	144,572.94	
LEGGETT & PLATT INC	4,468	23.67	105,757.56	
LULULEMON ATHLETICA INC	3,600	47.91	172,476.00	
MATTEL INC	12,894	28.14	362,837.16	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,318	60.45	140,123.10	
NEWELL RUBBERMAID INC	11,190	16.08	179,935.20	
NIKE INC -CL B	13,187	96.90	1,277,820.30	
RALPH LAUREN CORP	2,385	139.30	332,230.50	
TOLL BROTHERS INC	4,501	20.13	90,605.13	
VF CORP	3,315	129.01	427,668.15	
WHIRLPOOL CORP	2,934	51.19	150,191.46	
APOLLO GROUP INC-CL A	4,612	53.77	247,987.24	
CARNIVAL CORP	17,087	33.19	567,117.53	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,155	335.32	387,294.60	
DARDEN RESTAURANTS INC	5,223	45.70	238,691.10	
DEVRY INC	2,085	38.50	80,272.50	
H&R BLOCK INC	12,000	16.09	193,080.00	
INTL GAME TECHNOLOGY	11,686	16.55	193,403.30	
LAS VEGAS SANDS CORP	13,660	43.54	594,756.40	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,746	29.71	319,263.66	
MCDONALD'S CORP	38,191	100.15	3,824,828.65	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	14,000	9.96	139,440.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,908	25.68	126,037.44	
STARBUCKS CORP	27,537	45.44	1,251,281.28	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	7,417	48.75	361,578.75	
WYNN RESORTS LTD	3,060	110.00	336,600.00	
YUM! BRANDS INC	17,094	59.03	1,009,058.82	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	8,425	14.64	123,342.00	
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	23,163	26.89	622,853.07	
COMCAST CORP-CLASS A	76,926	23.84	1,833,915.84	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	24,091	23.60	568,547.60	
DIRECTV-CLASS A	26,989	43.23	1,166,734.47	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	4,960	40.52	200,979.20	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	4,635	37.18	172,329.30	
DISH NETWORK CORP-A	7,659	29.00	222,111.00	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	19,376	9.69	187,753.44	
LIBERTY GLOBAL INC-A	5,413	41.50	224,639.50	
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	4,683	40.24	188,443.92	

LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-A	4,085	77.54	316,750.90	
MCGRRAW-HILL COMPANIES INC	11,137	45.15	502,835.55	
NEWS CORP-CL A	67,572	17.62	1,190,618.64	
NEWS CORP-CLASS B	15,779	18.20	287,177.80	
OMNICOM GROUP	10,512	43.91	461,581.92	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	3,320	43.39	144,054.80	
SIRIUS XM RADIO INC	135,530	1.81	245,309.30	
THE WALT DISNEY CO.	64,978	37.70	2,449,670.60	
TIME WARNER CABLE	11,907	63.85	760,261.95	
TIME WARNER INC	38,343	35.96	1,378,814.28	
VIACOM INC-CLASS B	19,183	45.28	868,606.24	
VIRGIN MEDIA INC	11,460	21.34	244,556.40	
WASHINGTON POST-CLASS B	212	380.96	80,763.52	
ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	3,321	48.53	161,168.13	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,708	70.25	190,237.00	
AMAZON.COM INC	13,440	177.28	2,382,643.20	
AUTOZONE INC	932	330.30	307,839.60	
BED BATH & BEYOND INC	9,172	57.46	527,023.12	
BEST BUY CO INC	11,434	23.28	266,183.52	
CARMAX INC	8,679	30.30	262,973.70	
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	4,840	41.22	199,504.80	
DOLLAR TREE INC	4,557	83.26	379,415.82	
EXPEDIA INC	3,642	30.04	109,405.68	
FAMILY DOLLAR STORES	4,623	58.76	271,647.48	
GAMESTOP CORP-CLASS A	5,150	23.92	123,188.00	
GAP INC/THE	13,956	18.61	259,721.16	
GENUINE PARTS CO	5,771	61.57	355,320.47	
HOME DEPOT INC	57,640	42.10	2,426,644.00	
J.C. PENNEY CO INC	6,061	35.67	216,195.87	
KOHL'S CORP	9,687	49.97	484,059.39	
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	22,020	16.39	360,907.80	
LIMITED INC/THE	9,518	40.25	383,099.50	
LOWE'S COS INC	46,132	25.27	1,165,755.64	
MACY'S INC	16,209	32.20	521,929.80	
NETFLIX INC	1,830	72.62	132,894.60	
NORDSTROM INC	6,625	49.83	330,123.75	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,135	81.55	418,759.25	
PETSMART INC	4,460	51.92	231,563.20	
PRICELINE.COM INC	1,825	481.73	879,157.25	
ROSS STORES INC	8,656	48.24	417,565.44	
SEARS HOLDINGS CORP	1,516	45.85	69,508.60	
STAPLES INC	25,644	14.18	363,631.92	
TARGET CORP	23,500	51.70	1,214,950.00	
TIFFANY & CO	4,560	65.18	297,220.80	
TJX COMPANIES INC	13,989	65.31	913,621.59	
TRIPADVISOR INC	3,642	26.02	94,764.84	
URBAN OUTFITTERS INC	4,770	27.55	131,413.50	
COSTCO WHOLESALE CORP	16,139	84.66	1,366,327.74	
CVS CAREMARK CORP	49,517	40.99	2,029,701.83	
KROGER CO	21,620	24.48	529,257.60	
SAFEWAY INC	13,113	21.12	276,946.56	
SYSCO CORP	22,006	29.43	647,636.58	
WALGREEN CO	33,152	35.34	1,171,591.68	
WAL-MART STORES INC	70,167	59.99	4,209,318.33	

WHOLE FOODS MARKET INC	5,545	68.74	381,163.30	
ALTRIA GROUP INC	76,308	29.84	2,277,030.72	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	24,373	29.06	708,279.38	
BEAM INC	5,276	50.60	266,965.60	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,145	80.54	253,298.30	
BUNGE LTD	5,487	58.09	318,739.83	
CAMPBELL SOUP CO	7,215	33.16	239,249.40	
COCA-COLA CO/THE	76,486	69.94	5,349,430.84	
COCA-COLA ENTERPRISES	12,290	26.05	320,154.50	
CONAGRA FOODS INC	15,880	26.60	422,408.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,965	20.75	165,273.75	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	8,259	39.83	328,955.97	
GENERAL MILLS INC	23,974	40.57	972,625.18	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	4,875	45.41	221,373.75	
HANSEN NATURAL CORPORATION	2,825	94.96	268,262.00	
HERSHEY CO/THE	6,065	61.00	369,965.00	
HJ HEINZ CO	11,835	54.15	640,865.25	
HORMEL FOODS CORP	5,800	29.47	170,926.00	
JM SMUCKER CO/THE	4,230	78.80	333,324.00	
KELLOGG CO	9,318	50.34	469,068.12	
KRAFT FOODS INC-CLASS A	61,820	37.74	2,333,086.80	
LORILLARD INC	5,120	113.67	581,990.40	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,765	50.34	239,870.10	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	7,816	65.29	510,306.64	
MOLSON COORS BREWING CO -B	5,920	44.00	260,480.00	
PEPSICO INC	58,576	66.57	3,899,404.32	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	65,013	78.75	5,119,773.75	
RALCORP HOLDINGS INC	1,820	85.86	156,265.20	
REYNOLDS AMERICAN INC	13,220	41.72	551,538.40	
SARA LEE CORP	20,968	18.87	395,666.16	
TYSON FOODS INC-CL A	11,206	20.91	234,317.46	
AVON PRODUCTS	15,953	17.48	278,858.44	
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,515	46.00	253,690.00	
CLOROX COMPANY	4,926	66.59	328,022.34	
COLGATE-PALMOLIVE CO	17,900	93.09	1,666,311.00	
ENERGIZER HOLDINGS INC	2,751	76.72	211,056.72	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,525	113.43	513,270.75	
HERBALIFE LTD	4,450	51.79	230,465.50	
KIMBERLY-CLARK CORP	14,373	73.73	1,059,721.29	
PROCTER & GAMBLE CO	101,714	66.65	6,779,238.10	
AETNA INC	13,803	43.40	599,050.20	
AMERISOURCEBERGEN CORP	10,214	37.42	382,207.88	
BAXTER INTERNATIONAL INC	20,934	50.05	1,047,746.70	
BECTON DICKINSON AND CO	7,966	74.44	592,989.04	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	58,938	5.23	308,245.74	
CARDINAL HEALTH INC	12,760	40.96	522,649.60	
CAREFUSION CORP	8,275	25.25	208,943.75	
CERNER CORP	5,335	61.15	326,235.25	
CIGNA CORP	10,330	43.13	445,532.90	
COVENTRY HEALTH CARE INC	5,075	31.47	159,710.25	
COVIDIEN PLC	18,155	45.50	826,052.50	
CR BARD INC	3,174	85.12	270,170.88	
DAVITA INC	3,499	76.49	267,638.51	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	5,687	35.63	202,627.81	

EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,300	70.98	305,214.00	
EXPRESS SCRIPTS INC	17,032	45.26	770,868.32	
HCA HOLDINGS INC	6,715	21.46	144,103.90	
HENRY SCHEIN INC	3,595	65.13	234,142.35	
HOLOGIC INC	10,708	17.30	185,248.40	
HUMANA INC	6,315	89.60	565,824.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	1,450	457.66	663,607.00	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,685	87.32	321,774.20	
MCKESSON CORP	9,064	78.73	713,608.72	
MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	14,182	56.10	795,610.20	
MEDTRONIC INC	39,042	37.84	1,477,349.28	
OMNICARE INC	3,640	35.02	127,472.80	
PATTERSON COS INC	3,142	29.56	92,877.52	
QUEST DIAGNOSTICS	5,866	58.97	345,918.02	
ST JUDE MEDICAL INC	12,080	34.85	420,988.00	
STRYKER CORP	10,688	50.01	534,506.88	
UNITEDHEALTH GROUP INC	39,705	51.35	2,038,851.75	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,304	66.21	284,967.84	
WELLPOINT INC	13,311	68.05	905,813.55	
ZIMMER HOLDINGS INC	6,962	53.21	370,448.02	
ABBOTT LABORATORIES	57,617	56.02	3,227,704.34	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	13,235	35.36	467,989.60	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	6,820	69.08	471,125.60	
ALLERGAN INC	11,485	87.42	1,004,018.70	
AMGEN INC	29,401	63.70	1,872,843.70	
BIOGEN IDEC INC	8,617	110.79	954,677.43	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	62,946	35.11	2,210,034.06	
CELGENE CORP	17,372	67.32	1,169,483.04	
COVANCE INC	2,000	46.84	93,680.00	
ELI LILLY & CO	38,503	41.64	1,603,264.92	
FOREST LABORATORIES INC	10,990	30.45	334,645.50	
GILEAD SCIENCES INC	29,542	39.27	1,160,114.34	
HOSPIRA INC	6,181	30.92	191,116.52	
ILLUMINA INC	4,745	29.10	138,079.50	
JOHNSON & JOHNSON	101,429	65.98	6,692,285.42	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	6,776	39.92	270,497.92	
MERCK & CO. INC.	114,033	37.90	4,321,850.70	
MYLAN INC	16,250	21.82	354,575.00	
PERRIGO CO	3,180	100.96	321,052.80	
PFIZER INC	288,785	21.83	6,304,176.55	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	14,129	45.69	645,554.01	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	7,990	32.84	262,391.60	
WARNER CHILCOTT PLC	4,500	15.72	70,740.00	
WATERS CORP	3,526	74.59	263,004.34	
WATSON PHARMACEUTICALS INC	4,705	62.08	292,086.40	
BB&T CORP	25,818	25.48	657,842.64	
CIT GROUP INC	7,175	36.02	258,443.50	
COMERICA INC	7,190	26.23	188,593.70	
FIFTH THIRD BANCORP	35,519	12.84	456,063.96	
HUDSON CITY BANCORP INC	19,870	6.29	124,982.30	
KEYCORP	34,838	7.78	271,039.64	
M & T BANK CORP	4,273	76.89	328,550.97	
NATIONAL BANK OF GREECE-ADR	20,000	2.08	41,600.00	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	16,064	12.40	199,193.60	

PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	14,980	12.73	190,695.40	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	19,370	58.57	1,134,500.90	
REGIONS FINANCIAL CORP	45,874	4.40	201,845.60	
SUNTRUST BANKS INC	20,582	17.75	365,330.50	
US BANCORP	70,746	27.49	1,944,807.54	
WELLS FARGO & CO	185,655	27.80	5,161,209.00	
AMERICAN EXPRESS CO	39,664	47.95	1,901,888.80	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	9,035	50.61	457,261.35	
BANK OF AMERICA CORPORATION	373,269	5.60	2,090,306.40	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	45,167	20.08	906,953.36	
BLACKROCK INC	3,465	178.41	618,190.65	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	17,185	43.10	740,673.50	
CITIGROUP INC	108,002	27.46	2,965,734.92	
CME GROUP INC	2,306	246.39	568,175.34	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	20,765	24.49	508,534.85	
EATON VANCE CORP	3,790	23.72	89,898.80	
FRANKLIN RESOURCES INC	5,845	95.92	560,652.40	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	17,688	93.79	1,658,957.52	
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	2,760	120.12	331,531.20	
INVESCO LTD	17,037	20.22	344,488.14	
JPMORGAN CHASE & CO	144,320	33.57	4,844,822.40	
LEGG MASON INC	5,775	24.45	141,198.75	
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	23.55	172,032.75	
MOODY'S CORP	7,797	34.54	269,308.38	
MORGAN STANLEY	52,185	15.76	822,435.60	
NASDAQ OMX GROUP/THE	5,095	24.69	125,795.55	
NORTHERN TRUST CORP	8,255	40.69	335,895.95	
NYSE EURONEXT	9,700	26.38	255,886.00	
SCHWAB (CHARLES) CORP	40,144	11.54	463,261.76	
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,325	17.30	74,822.50	
SLM CORP	19,832	13.86	274,871.52	
STATE STREET CORP	18,822	41.39	779,042.58	
T ROWE PRICE GROUP INC	9,655	57.45	554,679.75	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	8,530	15.50	132,215.00	
ACE LTD	12,563	70.47	885,314.61	
AFLAC INC	17,422	43.08	750,539.76	
ALLSTATE CORP	18,543	27.62	512,157.66	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	17,935	24.20	434,027.00	
AON CORP	11,057	46.86	518,131.02	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	5,295	37.50	198,562.50	
ASSURANT INC	3,640	41.22	150,040.80	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	4,795	32.62	156,412.90	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	33,570	77.74	2,609,731.80	
CHUBB CORP	10,453	69.87	730,351.11	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,340	30.52	193,496.80	
EVEREST RE GROUP LTD	2,074	85.91	178,177.34	
FIDELITY NATIONAL FINL-A	5,881	16.08	94,566.48	
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	18,645	6.46	120,446.70	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	16,187	16.80	271,941.60	
LINCOLN NATIONAL CORP	11,528	19.72	227,332.16	
LOEWS CORP	12,325	38.22	471,061.50	
MARSH & MCLENNAN COS	20,428	31.74	648,384.72	
METLIFE INC	38,870	31.10	1,208,857.00	
PARTNERRE LTD	2,372	64.29	152,495.88	

PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,120	24.95	302,394.00	
PROGRESSIVE CORP	22,020	19.28	424,545.60	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	17,782	50.92	905,459.44	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,497	74.48	111,496.56	
TORCHMARK CORP	4,271	43.51	185,831.21	
TRAVELERS COS INC/THE	15,224	59.35	903,544.40	
UNUM GROUP	10,918	21.30	232,553.40	
WILLIS GROUP HOLDING	6,260	39.01	244,202.60	
WR BERKLEY CORP	5,288	34.11	180,373.68	
XL GROUP PLC	11,880	20.27	240,807.60	
CBRE GROUP INC	11,490	15.39	176,831.10	
ACCENTURE PLC-CL A	23,828	52.89	1,260,262.92	
ACTIVISION BLIZZARD INC	19,170	12.20	233,874.00	
ADOBE SYSTEMS INC	18,109	28.28	512,122.52	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	7,210	31.93	230,215.30	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,025	105.74	214,123.50	
AUTODESK INC	8,720	30.81	268,663.20	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	18,036	54.33	979,895.88	
BMC SOFTWARE INC	6,394	33.11	211,705.34	
CA INC	14,815	20.40	302,226.00	
CITRIX SYSTEMS INC	7,178	62.04	445,323.12	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	11,154	64.56	720,102.24	
COMPUTER SCIENCES CORP	5,583	26.48	147,837.84	
EBAY INC	42,737	30.84	1,318,009.08	
ELECTRONIC ARTS INC	12,614	20.71	261,235.94	
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	9,055	26.60	240,863.00	
FISERV INC	5,139	58.79	302,121.81	
GOOGLE INC-CL A	9,411	633.14	5,958,480.54	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	44,202	184.75	8,166,319.50	
INTUIT INC	10,826	53.10	574,860.60	
MASTERCARD INC-CLASS A	4,005	378.15	1,514,490.75	
MICROSOFT CORP	279,099	26.03	7,264,946.97	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	9,350	25.71	240,388.50	
ORACLE CORP	149,793	26.06	3,903,605.58	
PAYCHEX INC	11,862	29.85	354,080.70	
RED HAT INC	7,270	41.59	302,359.30	
SAIC INC	10,745	12.43	133,560.35	
SALESFORCE.COM INC	4,690	98.02	459,713.80	
SYMANTEC CORP	27,165	15.78	428,663.70	
SYNOPSYS INC	4,627	27.32	126,409.64	
TERADATA CORP	6,370	48.97	311,938.90	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,506	19.68	88,678.08	
VERISIGN INC	6,275	35.85	224,958.75	
VISA INC-CLASS A SHARES	19,190	102.48	1,966,591.20	
VMWARE INC	3,115	83.67	260,632.05	
WESTERN UNION CO	23,401	18.47	432,216.47	
YAHOO! INC	44,155	16.20	715,311.00	
AMPHENOL CORP-CL A	6,280	45.70	286,996.00	
APPLE COMPUTER INC	34,316	403.38	13,842,388.08	
ARROW ELECTRONICS INC	4,490	37.22	167,117.80	
AVNET INC	6,080	31.37	190,729.60	
CISCO SYSTEMS INC	203,585	18.47	3,760,214.95	
CORNING INC	57,428	13.38	768,386.64	
DELL INC	60,546	14.90	902,135.40	

DOLBY LABORATORIES INC CLASS A	2,100	31.27	65,667.00	
EMC CORP/MASS	76,009	21.84	1,660,036.56	
F5 NETWORKS INC	3,005	106.39	319,701.95	
FLEXTRONICS INTL LTD	27,456	5.93	162,814.08	
FLIR SYSTEMS INC	5,565	25.72	143,131.80	
HARRIS CORP	4,560	36.88	168,172.80	
HEWLETT-PACKARD CO	76,400	25.89	1,977,996.00	
JUNIPER NETWORKS INC	19,573	20.83	407,705.59	

[次へ](#)

MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS I	10,493	38.76	406,708.68	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11,725	47.12	552,482.00	
NETAPP INC	13,486	36.51	492,373.86	
QUALCOMM INC	62,072	54.62	3,390,372.64	
SANDISK CORP	8,963	50.52	452,810.76	
SEAGATE TECHNOLOGY	15,444	16.16	249,575.04	
TE CONNECTIVITY LTD	15,970	31.29	499,701.30	
WESTERN DIGITAL CORP	8,555	32.14	274,957.70	
XEROX CORP	52,349	8.29	433,973.21	
AMERICAN TOWER CORP-CL A	14,624	60.44	883,874.56	
AT&T INC	219,346	29.87	6,551,865.02	
CENTURYLINK INC	22,876	37.10	848,699.60	
CROWN CASTLE INTL CORP	10,700	44.39	474,973.00	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	39,734	5.12	203,438.08	
METROPCS COMMUNICATIONS INC	11,720	8.17	95,752.40	
NII HOLDINGS INC	6,497	21.29	138,321.13	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	4,610	42.44	195,648.40	
SPRINT NEXTEL CORP	111,942	2.31	258,586.02	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	104,788	39.98	4,189,424.24	
WINDSTREAM CORP	20,465	12.01	245,784.65	
AES CORP	24,528	11.87	291,147.36	
ALLIANT ENERGY CORP	3,610	43.87	158,370.70	
AMEREN CORPORATION	8,922	32.83	292,909.26	
AMERICAN ELECTRIC POWER	18,058	41.57	750,671.06	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,080	32.09	227,197.20	
CALPINE CORP	12,490	16.23	202,712.70	
CENTERPOINT ENERGY INC	14,762	20.22	298,487.64	
CONSOLIDATED EDISON INC	10,856	61.98	672,854.88	
CONSTELLATION ENERGY GROUP	7,245	39.71	287,698.95	
DOMINION RESOURCES INC/VA	21,167	52.95	1,120,792.65	
DTE ENERGY COMPANY	6,468	54.70	353,799.60	
DUKE ENERGY CORP	49,023	21.89	1,073,113.47	
EDISON INTERNATIONAL	11,819	41.19	486,824.61	
ENTERGY CORP	6,547	73.14	478,847.58	
EXELON CORP	24,439	43.52	1,063,585.28	
FIRSTENERGY CORP	15,755	44.38	699,206.90	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	2,420	53.83	130,268.60	
MDU RESOURCES GROUP INC	8,455	21.33	180,345.15	
NEXTERA ENERGY INC	14,755	60.25	888,988.75	
NISOURCE INC	10,915	23.42	255,629.30	
NORTHEAST UTILITIES	6,920	35.71	247,113.20	
NRG ENERGY INC	9,360	18.57	173,815.20	
NSTAR	3,415	45.89	156,714.35	
ONEOK INC	3,910	86.49	338,175.90	
P G & E CORP	14,601	41.09	599,955.09	
PEPCO HOLDINGS INC	7,192	20.30	145,997.60	
PINNACLE WEST CAPITAL	4,514	48.39	218,432.46	
PPL CORPORATION	21,108	29.65	625,852.20	
PROGRESS ENERGY INC	11,073	55.62	615,880.26	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	18,763	32.54	610,548.02	
SCANA CORP	4,853	44.75	217,171.75	
SEMPRA ENERGY	8,592	54.62	469,295.04	
SOUTHERN CO	31,875	45.90	1,463,062.50	
WISCONSIN ENERGY CORP	8,949	34.76	311,067.24	

XCEL ENERGY INC	18,014	27.20	489,980.80	
ADVANCED MICRO DEVICES	23,671	5.41	128,060.11	
ALTERA CORPORATION	12,226	37.57	459,330.82	
ANALOG DEVICES INC	11,196	36.21	405,407.16	
APPLIED MATERIALS INC	48,423	10.82	523,936.86	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	8,140	29.39	239,234.60	
BROADCOM CORP-CL A	17,556	29.75	522,291.00	
CREE INC	3,840	21.66	83,174.40	
FIRST SOLAR INC	2,040	34.72	70,828.80	
INTEL CORP	194,362	24.37	4,736,601.94	
KLA-TENCOR CORPORATION	6,269	48.51	304,109.19	
LAM RESEARCH CORP	4,827	36.93	178,261.11	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	8,904	30.37	270,414.48	
LSI CORP	20,595	5.91	121,716.45	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	18,834	14.15	266,501.10	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	11,295	26.45	298,752.75	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	7,429	36.60	271,901.40	
MICRON TECHNOLOGY INC	32,857	6.40	210,284.80	
NVIDIA CORP	22,805	14.17	323,146.85	
TEXAS INSTRUMENTS INC	42,522	29.73	1,264,179.06	
XILINX INC	9,885	32.35	319,779.75	
米ドル小計	11,409,713		432,221,251.33 (33,691,646,541)	
加ドル				
ARC RESOURCES LTD	10,615	24.84	263,676.60	
ATHABASCA OIL SANDS CORP	11,180	12.12	135,501.60	
BAYTEX ENERGY CORP	4,425	57.02	252,313.50	
BONAVISTA ENERGY CORP	4,985	26.28	131,005.80	
CAMECO CORP	15,332	18.30	280,575.60	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	40,359	37.77	1,524,359.43	
CANADIAN OIL SANDS LTD	17,840	22.99	410,141.60	
CENOVUS ENERGY INC	28,298	33.62	951,378.76	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	9,325	45.10	420,557.50	
ENBRIDGE INC	27,915	37.60	1,049,604.00	
ENCANA CORP	27,648	19.16	529,735.68	
ENERPLUS CORP	6,630	25.90	171,717.00	
HUSKY ENERGY INC	10,659	24.46	260,719.14	
IMPERIAL OIL LTD	10,992	44.54	489,583.68	
MEG ENERGY CORP	4,510	40.81	184,053.10	
NEXEN INC	20,125	15.99	321,798.75	
NIKO RESOURCES LTD	1,695	48.23	81,749.85	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	9,390	18.94	177,846.60	
PEMBINA PIPELINE CORP	6,305	30.09	189,717.45	
PENGROWTH ENERGY CORP	12,780	11.10	141,858.00	
PENN WEST PETROLEUM LTD	17,873	20.66	369,256.18	
PRECISION DRILLING CORP	8,865	10.75	95,298.75	
PROGRESS ENERGY RESOURCES CORP	8,615	12.76	109,927.40	
SUNCOR ENERGY INC	58,115	29.28	1,701,607.20	
TALISMAN ENERGY INC	37,632	12.75	479,808.00	
TOURMALINE OIL CORP	4,005	27.53	110,257.65	
TRANSCANADA CORP	26,368	44.45	1,172,057.60	
VERMILION ENERGY INC	3,000	45.83	137,490.00	
AGNICO-EAGLE MINES LTD	6,375	37.55	239,381.25	
AGRIUM INC	5,965	70.65	421,427.25	
BARRICK GOLD CORP	36,789	46.94	1,726,875.66	

CENTERRA GOLD INC	6,530	18.27	119,303.10	
ELDORADO GOLD CORP	20,510	14.59	299,240.90	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	17,720	19.58	346,957.60	
FRANCO-NEVADA CORP	4,495	38.59	173,462.05	
GOLDCORP INC	29,632	45.70	1,354,182.40	
IAMGOLD CORP	14,165	16.57	234,714.05	
INMET MINING CORPORATION	2,100	65.50	137,550.00	
IVANHOE MINES LTD	9,940	18.31	182,001.40	
KINROSS GOLD CORP	42,395	12.01	509,163.95	
NEW GOLD INC	16,160	10.28	166,124.80	
OSISKO MINING CORP	13,590	9.98	135,628.20	
PAN AMERICAN SILVER CORP	4,115	22.77	93,698.55	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	31,442	43.46	1,366,469.32	
SILVER WHEATON CORP	13,240	30.20	399,848.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	21,740	36.28	788,727.20	
YAMANA GOLD INC	27,931	15.41	430,416.71	
BOMBARDIER INC 'B'	52,816	3.86	203,869.76	
CAE INC	10,675	9.77	104,294.75	
FINNING INTERNATIONAL INC	6,675	22.62	150,988.50	
SNC-LAVALIN GROUP INC	5,715	49.31	281,806.65	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	4,495	22.58	101,497.10	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	16,639	78.45	1,305,329.55	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,245	66.51	415,354.95	
MAGNA INTERNATIONAL INC	8,149	34.15	278,288.35	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,920	19.34	75,812.80	
TIM HORTONS INC	6,045	49.33	298,199.85	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	13,305	20.02	266,366.10	
THOMSON REUTERS CORP	13,504	26.93	363,662.72	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,970	66.10	196,317.00	
ALIMENTATION COUCHE SUB VTG	4,700	30.95	145,465.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	1,000	57.95	57,950.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	3,849	37.45	144,145.05	
METRO INC -A	3,975	53.70	213,457.50	
SHOPPERS DRUG MART INC	8,180	42.00	343,560.00	
WESTON (GEORGE) LTD	1,872	65.85	123,271.20	
SAPUTO INC	5,200	38.90	202,280.00	
VITERRA INC	14,445	10.50	151,672.50	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	10,754	47.29	508,556.66	
BANK OF MONTREAL	23,256	55.50	1,290,708.00	
BANK OF NOVA SCOTIA	39,979	50.91	2,035,330.89	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	14,655	73.42	1,075,970.10	
NATIONAL BANK OF CANADA	6,080	72.01	437,820.80	
ROYAL BANK OF CANADA	53,179	51.30	2,728,082.70	
TORONTO-DOMINION BANK	32,750	75.02	2,456,905.00	
CI FINANCIAL CORP	5,690	20.76	118,124.40	
IGM FINANCIAL INC	4,295	45.37	194,864.15	
ONEX CORPORATION	3,845	32.56	125,193.20	
TMX GROUP INC	2,295	41.83	95,999.85	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	752	433.38	325,901.76	
GREAT-WEST LIFECO INC	11,084	19.82	219,684.88	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	3,955	25.87	102,315.85	
INTACT FINANCIAL CORP	4,025	58.75	236,468.75	
MANULIFE FINANCIAL CORP	66,461	10.60	704,486.60	
POWER CORP OF CANADA	12,990	23.26	302,147.40	

POWER FINANCIAL CORP	9,735	25.59	249,118.65	
SUN LIFE FINANCIAL INC	21,564	18.49	398,718.36	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	21,397	27.97	598,474.09	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES CORP	8,664	16.35	141,656.40	
CGI GROUP INC - CL A	8,920	19.00	169,480.00	
OPEN TEXT CORPORATION	2,255	51.94	117,124.70	
RESEARCH IN MOTION	16,878	14.20	239,667.60	
BCE INC	10,310	41.55	428,380.50	
BELL ALIANT INC	2,800	27.97	78,316.00	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	15,720	39.03	613,551.60	
TELUS CORP	2,500	57.19	142,975.00	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	5,628	54.27	305,431.56	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	3,115	61.75	192,351.25	
FORTIS INC	7,035	33.05	232,506.75	
TRANSALTA CORP	7,950	20.86	165,837.00	
加ドル小計	1,405,205		43,724,508.59 (3,333,993,779)	
豪ドル				
CALTEX AUSTRALIA LTD	6,385	12.30	78,535.50	
ORIGIN ENERGY LTD	40,210	13.46	541,226.60	
SANTOS LTD	33,605	12.36	415,357.80	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	23,318	31.53	735,216.54	
WORLEYPARSONS LTD	7,260	26.16	189,921.60	
ALUMINA LTD	94,332	1.17	110,840.10	
AMCOR LIMITED	44,030	7.27	320,098.10	
BHP BILLITON LTD	118,871	35.15	4,178,315.65	
BORAL LTD	28,545	3.62	103,332.90	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	46,275	4.49	207,774.75	
ILUKA RESOURCES LTD	15,185	15.69	238,252.65	
INCITEC PIVOT LTD	64,675	3.11	201,139.25	
JAMES HARDIE INDUSTRIES SE	13,935	6.96	96,987.60	
LYNAS CORP LTD	61,300	1.16	71,414.50	
NEWCREST MINING LTD	27,889	31.44	876,830.16	
ONESTEEL LTD	33,285	0.75	24,963.75	
ORICA LIMITED	13,435	24.75	332,516.25	
OZ MINERALS LTD	14,421	10.39	149,834.19	
RIO TINTO LTD	15,983	61.84	988,388.72	
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	6,495	13.08	84,954.60	
LEIGHTON HOLDINGS LTD	5,867	19.63	115,169.21	
BRAMBLES LTD	53,968	7.25	391,268.00	
CAMPBELL BROTHERS LTD	2,540	49.69	126,212.60	
ASCIANO LTD	36,333	4.65	168,948.45	
QANTAS AIRWAYS LTD	34,245	1.50	51,367.50	
QR NATIONAL LTD	59,950	3.50	209,825.00	
SYDNEY AIRPORT	16,920	2.72	46,022.40	
TOLL HOLDINGS LTD	24,745	4.41	109,125.45	
TRANSURBAN GROUP	47,535	5.59	265,720.65	
CROWN LTD	17,690	8.10	143,289.00	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	23,977	3.62	86,796.74	
TABCORP HOLDINGS LTD	23,977	2.75	65,936.75	
TATTS GROUP LTD	60,640	2.41	146,142.40	
FAIRFAX MEDIA LTD	100,125	0.72	72,590.62	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	25,515	1.85	47,202.75	
METCASH LTD	31,790	4.16	132,246.40	
WESFARMERS LTD	37,030	30.29	1,121,638.70	

WOOLWORTHS LTD	44,647	25.50	1,138,498.50	
COCA-COLA AMATIL LTD	20,630	11.67	240,752.10	
COCHLEAR LTD	2,157	62.20	134,165.40	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	4,895	19.41	95,011.95	
SONIC HEALTHCARE LTD	14,760	11.55	170,478.00	
CSL LTD	19,732	32.14	634,186.48	
AUST AND NZ BANKING GROUP	96,829	20.85	2,018,884.65	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	15,708	8.30	130,376.40	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	57,692	49.81	2,873,638.52	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	81,168	23.70	1,923,681.60	
WESTPAC BANKING CORP	111,671	20.54	2,293,722.34	
ASX LTD	6,590	30.70	202,313.00	
MACQUARIE GROUP LTD	13,366	24.10	322,120.60	
AMP LTD	106,402	4.20	446,888.40	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	73,478	3.07	225,577.46	
QBE INSURANCE GROUP LTD	40,780	13.25	540,335.00	
SUNCORP GROUP LTD	46,700	8.47	395,549.00	
COMPUTERSHARE LTD	17,960	8.05	144,578.00	
TELSTRA CORPORATION LTD	165,734	3.32	550,236.88	
AGL ENERGY LTD	17,300	14.45	249,985.00	
豪ドル小計	2,270,480		27,976,383.11 (2,216,289,069)	
英bond				
AMEC PLC	13,270	9.02	119,761.75	
BG GROUP PLC	125,474	13.48	1,692,016.89	
BP PLC	701,158	4.59	3,223,223.32	
CAIRN ENERGY PLC	54,760	2.64	145,059.24	
ESSAR ENERGY PLC	10,660	1.74	18,591.04	
PETROFAC LTD	9,765	14.49	141,494.85	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	133,953	23.27	3,117,086.31	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	99,359	24.27	2,411,442.93	
TULLOW OIL PLC	33,380	13.85	462,313.00	
ANGLO AMERICAN PLC	48,709	23.58	1,148,801.76	
ANTOFAGASTA PLC	14,880	12.28	182,726.40	
BHP BILLITON PLC	77,826	18.74	1,458,459.24	
EURASIAN NATURAL RESOURCES	10,270	6.30	64,701.00	
FRESNILLO PLC	6,750	15.34	103,545.00	
GLENCORE INTERNATIONAL-WI	32,380	3.97	128,548.60	
JOHNSON MATTHEY PLC	8,419	18.19	153,141.61	
KAZAKHMYN PLC-	7,325	9.26	67,866.12	
LONMIN PLC	7,445	9.70	72,216.50	
RANDGOLD RESOURCES LTD	3,455	66.50	229,757.50	
REXAM PLC	32,225	3.49	112,755.27	
RIO TINTO PLC	51,780	31.57	1,634,953.50	
VEDANTA RESOURCES PLC	3,810	10.19	38,823.90	
XSTRATA PLC	76,330	9.79	747,881.34	
BAE SYSTEMS PLC ORD	120,170	2.78	334,553.28	
BALFOUR BEATTY PLC	18,710	2.61	48,926.65	
BUNZL PLC	10,376	8.61	89,389.24	
COBHAM PLC	34,695	1.73	60,022.35	
INVENSYS PLC	27,080	2.05	55,676.48	
MEGGITT PLC	29,235	3.50	102,585.61	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS -C SHR	4,947,645	—	4,947.64	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	69,575	7.25	504,766.62	
SMITHS GROUP PLC	14,563	9.01	131,212.63	

WEIR GROUP PLC/THE	8,360	19.65	164,274.00	
WOLSELEY PLC	10,805	20.81	224,852.05	
AGGREKO PLC	10,021	20.02	200,620.42	
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	9,775	7.08	69,207.00	
CAPITA GROUP PLC	23,289	6.27	146,022.03	
EXPERIAN PLC	37,623	8.39	315,845.08	
G4S PLC	55,329	2.64	146,345.20	
INTERTEK GROUP PLC	6,595	19.40	127,943.00	
SERCO GROUP PLC	19,895	4.68	93,227.97	
GKN PLC	58,715	1.83	107,976.88	
BURBERRY GROUP PLC	16,414	11.96	196,311.44	
CARNIVAL PLC	6,710	21.15	141,916.50	
COMPASS GROUP PLC	69,263	5.92	410,383.27	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	11,647	11.20	130,446.40	
TUI TRAVEL PLC	21,725	1.58	34,477.57	
WHITBREAD PLC	6,950	15.38	106,891.00	
BRITISH SKY BROADCASTING GRO	41,474	7.19	298,198.06	
ITV PLC	147,795	0.64	95,253.87	
PEARSON PLC	30,264	12.14	367,404.96	
REED ELSEVIER PLC	46,281	5.16	238,809.96	
WPP PLC	46,044	6.60	303,890.40	
KINGFISHER PLC	88,782	2.46	218,403.72	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	58,200	3.07	178,674.00	
NEXT PLC	6,637	26.92	178,668.04	
SAINSBURY (J) PLC	44,131	2.95	130,274.71	
TESCO PLC	295,104	3.91	1,153,856.64	
WM MORRISON SUPERMARKETS	79,475	3.20	254,876.32	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,365	11.04	147,549.60	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	73,172	29.98	2,194,062.42	
DIAGEO PLC	92,302	13.78	1,271,921.56	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	37,317	23.98	894,861.66	
SABMILLER PLC	35,271	22.38	789,364.98	
TATE & LYLE PLC	17,580	6.90	121,302.00	
UNILEVER PLC	47,232	21.28	1,005,096.96	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	22,620	31.80	719,316.00	
SMITH & NEPHEW PLC	33,686	6.06	204,137.16	
ASTRAZENECA PLC	49,523	29.54	1,463,157.03	
GLAXOSMITHKLINE PLC	187,821	14.56	2,734,673.76	
SHIRE PLC	21,315	21.88	466,372.20	
BARCLAYS PLC	425,991	1.79	762,523.89	
HSBC HOLDINGS PLC	660,571	4.90	3,237,128.18	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,500,886	0.25	385,577.61	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	681,204	0.20	139,919.30	
STANDARD CHARTERED PLC	87,749	13.88	1,218,394.86	
3I GROUP PLC	45,264	1.75	79,257.26	
ICAP PLC	23,340	3.44	80,429.64	
INVESTEC PLC	13,185	3.35	44,275.23	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	4,068	7.86	31,974.48	
MAN GROUP PLC	68,256	1.27	87,299.42	
SCHRODERS PLC	4,981	13.00	64,753.00	
ADMIRAL GROUP PLC	6,965	8.31	57,913.97	
AVIVA PLC	107,165	3.00	321,495.00	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	224,901	1.02	230,523.52	
OLD MUTUAL PLC	208,740	1.35	282,425.22	

PRUDENTIAL PLC	93,757	6.24	585,512.46	
RESOLUTION LTD	51,593	2.48	128,105.41	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	123,607	1.04	129,045.70	
STANDARD LIFE PLC	87,275	2.02	177,080.97	
SAGE GROUP PLC/THE	53,555	2.89	155,148.83	
BT GROUP PLC	293,952	1.92	565,857.60	
INMARSAT PLC	16,910	4.08	69,128.08	
VODAFONE GROUP PLC	1,881,450	1.76	3,316,996.35	
CENTRICA PLC	188,610	2.90	547,534.83	
INTERNATIONAL POWER PLC	58,505	3.31	194,002.58	
NATIONAL GRID PLC	131,805	6.18	814,554.90	
SEVERN TRENT PLC	9,623	14.81	142,516.63	
SSE PLC	34,057	12.58	428,437.06	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,735	5.97	159,741.62	
ARM HOLDINGS PLC	50,630	5.79	293,400.85	
英ボンド小計	15,889,269		51,585,067.84 (6,272,744,249)	
スイスフラン				
TRANSOCEAN LTD	11,995	37.85	454,010.75	
GIVAUDAN-REG	328	882.50	289,460.00	
HOLCIM LIMITED-REG SHRS	9,383	50.05	469,619.15	
SIKA AG-BR	85	1,729.00	146,965.00	
SYNGENTA AG-REG	3,471	271.10	940,988.10	
ABB LTD-REG	80,555	17.46	1,406,490.30	
GEBERIT AG-REG	1,525	180.40	275,110.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	780	108.90	84,942.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,900	108.90	206,910.00	
SULZER AG-REG	870	99.30	86,391.00	
ADECCO SA-REG	4,757	39.50	187,901.50	
SGS SA-REG	201	1,546.00	310,746.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,020	106.20	214,524.00	
CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	19,594	47.27	926,208.38	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,170	347.50	406,575.00	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,520	61.60	93,632.00	
ARYZTA AG	2,630	44.60	117,298.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	40	2,755.00	110,200.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	5	30,850.00	154,250.00	
NESTLE SA-REG	122,143	53.20	6,498,007.60	
SONOVA HOLDING AG-REG	1,940	93.20	180,808.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	211	161.50	34,076.50	
SYNTHES INC	2,494	157.00	391,558.00	
ACTELION LTD-REG	4,640	32.13	149,083.20	
LONZA GROUP AG-REG	1,650	54.65	90,172.50	
NOVARTIS AG-REG	86,383	53.30	4,604,213.90	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	26,003	157.60	4,098,072.80	
CREDIT SUISSE GROUP-REG	42,085	22.29	938,074.65	
GAM HOLDING LTD	5,635	10.15	57,195.25	
JULIUS BAER GROUP LTD	8,140	37.04	301,505.60	
PARGESA HOLDING SA-BR	1,280	62.25	79,680.00	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	500	163.00	81,500.00	
UBS AG-REG	134,447	11.37	1,528,662.39	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,390	64.90	90,211.00	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	850	87.05	73,992.50	
SWISS RE LTD	12,679	47.70	604,788.30	
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	5,341	210.00	1,121,610.00	

SWISSCOM AG-REG	894	350.00	312,900.00	
スイスフラン小計	601,534		28,118,333.37 (2,341,694,803)	
香港ドル				
HUTCHISON WHAMPOA LTD	78,823	66.00	5,202,318.00	
NWS HOLDINGS LTD	48,500	11.64	564,540.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	37,000	13.24	489,880.00	
MTR CORP	54,500	25.20	1,373,400.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	10,500	42.90	450,450.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	24,500	24.70	605,150.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	45,000	14.68	660,600.00	
SANDS CHINA LTD	92,600	21.95	2,032,570.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	48,000	13.52	648,960.00	
SJM HOLDINGS LTD	57,000	12.78	728,460.00	
WYNN MACAU LTD	58,200	19.18	1,116,276.00	
LI & FUNG LTD	210,000	14.32	3,007,200.00	
LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	26,500	17.42	461,630.00	
BANK OF EAST ASIA	60,440	28.60	1,728,584.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	137,500	18.58	2,554,750.00	
HANG SENG BANK LTD	28,600	93.10	2,662,660.00	
WING HANG BANK LTD	7,500	62.70	470,250.00	
FIRST PACIFIC CO	80,000	8.18	654,400.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	38,200	126.10	4,817,020.00	
AIA GROUP LTD	311,800	24.15	7,529,970.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	51,682	92.95	4,803,841.90	
HANG LUNG GROUP LTD	33,000	43.50	1,435,500.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	90,000	22.75	2,047,500.00	
HENDERSON LAND DVLP CO LTD	37,426	37.30	1,395,989.80	
HOPEWELL HOLDINGS	29,000	20.20	585,800.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	22,000	25.85	568,700.00	
KERRY PROPERTIES LTD	27,950	26.00	726,700.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	131,000	6.26	820,060.00	
SINO LAND CO	105,050	10.60	1,113,530.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	51,480	97.60	5,024,448.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	28,017	93.65	2,623,792.05	
WHARF HOLDINGS LTD	57,800	35.65	2,060,570.00	
WHEELLOCK & CO LTD	34,000	19.26	654,840.00	
FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	76,000	4.99	379,240.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	15,000	44.80	672,000.00	
CLP HOLDINGS LTD	72,000	66.05	4,755,600.00	
HONG KONG & CHINA GAS	183,156	18.00	3,296,808.00	
POWER ASSETS HOLDINGS	52,500	57.05	2,995,125.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	86.95	565,175.00	
香港ドル小計	2,558,724		74,284,287.75 (744,328,563)	
シンガポールドル				
COSCO CORP SINGAPORE LTD	47,000	0.88	41,595.00	
FRASER AND NEAVE LTD	37,000	6.31	233,470.00	
KEPPEL CORP LTD	55,660	9.53	530,439.80	
NOBLE GROUP LTD	141,854	1.19	168,806.26	
SEBACORP INDUSTRIES LTD	32,000	4.10	131,200.00	
SEBACORP MARINE LTD	27,000	3.89	105,030.00	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	64,000	2.70	172,800.00	
YANGZIJANG SHIPBUILDING	71,000	0.92	65,675.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	77,000	1.41	108,570.00	

NEPTUNE ORIENT LINES LTD	30,000	1.15	34,500.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	20,800	10.20	212,160.00	
GENTING SINGAPORE PLC	222,000	1.53	340,770.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	55,050	3.72	204,786.00	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,000	49.69	198,760.00	
OLAM INTERNATIONAL LTD	47,000	2.18	102,460.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	220,000	0.72	158,400.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	74,000	5.03	372,220.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	65,625	11.64	763,875.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	96,240	7.89	759,333.60	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	48,300	15.48	747,684.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,000	6.09	213,150.00	
CAPITALAND LTD	101,000	2.29	231,290.00	
CAPITAMALLS ASIA LTD	50,000	1.17	58,500.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	20,000	9.00	180,000.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	60,000	1.73	103,800.00	
KEPPEL LAND LTD	30,000	2.28	68,400.00	
UOL GROUP LTD	22,250	4.10	91,225.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	294,810	3.13	922,755.30	
シンガポールドル小計	2,048,589		7,321,654.96 (441,349,360)	
ニュージーランドドル				
FLETCHER BUILDING LTD	23,390	5.98	139,872.20	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	43,390	2.42	105,003.80	
SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	19,990	3.40	67,966.00	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	72,897	2.00	145,794.00	
CONTACT ENERGY LIMITED	9,430	5.10	48,093.00	
ニュージーランドドル小計	169,097		506,729.00 (30,570,960)	
スウェーデンクローナ				
LUNDIN PETROLEUM AB	8,370	167.40	1,401,138.00	
BOLIDEN AB	10,875	102.10	1,110,337.50	
HOLMEN AB-B SHS	1,885	196.90	371,156.50	
SSAB AB-A SHARES	6,295	59.75	376,126.25	
SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS	21,345	102.60	2,189,997.00	
ALFA LAVAL AB	12,110	127.50	1,544,025.00	
ASSA ABLOY AB-B	11,670	169.50	1,978,065.00	
ATLAS COPCO AB-A SHS	24,945	145.70	3,634,486.50	
ATLAS COPCO AB-B SHS	14,760	129.80	1,915,848.00	
SANDVIK AB	37,770	82.85	3,129,244.50	
SCANIA AB-B SHS	12,030	102.10	1,228,263.00	
SKANSKA AB-B SHS	14,750	110.70	1,632,825.00	
SKF AB-B SHS	14,614	141.80	2,072,265.20	
VOLVO AB-B SHARES	50,800	74.90	3,804,920.00	
SECURITAS AB-B SHS	12,199	60.35	736,209.65	
ELECTROLUX AB - B	8,875	111.70	991,337.50	
HUSQVARNA AB-B SHS	14,220	32.12	456,746.40	
MODERN TIMES GROUP-B SHS	2,085	327.50	682,837.50	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	37,358	219.10	8,185,137.80	
SWEDISH MATCH AB	8,145	241.30	1,965,388.50	
GETINGE AB-B SHS	7,610	170.10	1,294,461.00	
NORDEA BANK AB	96,108	54.00	5,189,832.00	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	53,625	41.00	2,198,625.00	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	18,130	184.40	3,343,172.00	
SWEDBANK AB - A SHARES	30,470	89.40	2,724,018.00	

INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,390	82.95	364,150.50	
INVESTOR AB-B SHS	17,415	129.70	2,258,725.50	
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	6,715	135.80	911,897.00	
RATOS AB-B SHS	7,000	81.50	570,500.00	
ERICSSON LM-B SHS	110,650	68.60	7,590,590.00	

[次へ](#)

HEXAGON AB-B SHS	8,970	99.00	888,030.00	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2,970	696.50	2,068,605.00	
TELE2 AB-B SHS	12,235	130.80	1,600,338.00	
TELIASONERA AB	80,590	46.48	3,745,823.20	
スウェーデン کرونا小計	781,979		74,155,122.00 (839,435,981)	
ノルウェー クローネ				
AKER SOLUTIONS ASA	6,800	62.80	427,040.00	
SEADRILL LTD	12,500	200.00	2,500,000.00	
STATOIL ASA	41,084	152.70	6,273,526.80	
SUBSEA 7 SA	10,615	109.70	1,164,465.50	
NORSK HYDRO A S	34,250	27.56	943,930.00	
YARA INTERNATIONAL ASA	7,150	235.70	1,685,255.00	
ORKLA ASA	28,690	43.95	1,260,925.50	
DNB ASA	36,510	58.05	2,119,405.50	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,250	69.10	500,975.00	
TELENOR ASA	27,340	96.65	2,642,411.00	
ノルウェー クローネ小計	212,189		19,517,934.30 (254,709,042)	
デンマーク クローネ				
NOVOZYMES A/S-B SHARES	8,275	174.00	1,439,850.00	
VESTAS WIND SYSTEMS AS	7,500	59.50	446,250.00	
A P MOLLER - MAERSK A/S - A	23	35,000.00	805,000.00	
A P MOLLER - MAERSK A/S - B	48	36,800.00	1,766,400.00	
DSV A/S	7,370	101.60	748,792.00	
CARLSBERG AS-B	3,930	400.90	1,575,537.00	
COLOPLAST-B	881	802.50	707,002.50	
WILLIAM DEMANT HOLDING	1,000	463.50	463,500.00	
NOVO NORDISK A/S-B	15,660	646.00	10,116,360.00	
DANSKE BANK A/S	23,595	72.70	1,715,356.50	
TRYG A/S	1,045	318.10	332,414.50	
TDC A/S	14,545	45.50	661,797.50	
デンマーク クローネ小計	83,872		20,778,260.00 (284,246,596)	
イスラエル シケル				
ISRAEL CHEMICALS LTD	18,570	41.00	761,370.00	
ISRAEL CORP LIMITED/THE	108	2,420.00	261,360.00	
TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	34,765	157.50	5,475,487.50	
BANK HAPOLIM BM	50,865	13.10	666,331.50	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	56,605	11.57	654,919.85	
NICE SYSTEMS LTD	2,860	131.20	375,232.00	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	81,755	7.18	587,409.67	
イスラエル シケル小計	245,528		8,782,110.52 (180,823,655)	
ユーロ				
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	5,990	17.92	107,370.75	
ENI SPA	88,481	15.74	1,392,690.94	
FUGRO NV-CVA	2,640	44.78	118,219.20	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	9,315	11.76	109,544.40	
NESTE OIL OYJ	3,590	7.69	27,607.10	
OMV AG	6,300	23.77	149,751.00	
REPSOL YPF SA	29,891	23.44	700,645.04	
SAIPEM SPA	10,135	32.64	330,806.40	
SBM OFFSHORE NV	6,700	15.69	105,156.50	
TECHNIP SA	3,748	72.25	270,793.00	

TENARIS SA	17,925	14.25	255,431.25	
TOTAL SA	78,567	38.63	3,035,436.04	
ACERINOX SA	4,717	9.84	46,457.73	
AIR LIQUIDE	10,412	92.89	967,170.68	
AKZO NOBEL NV	8,668	35.91	311,267.88	
ARCELORMITTAL	32,076	14.01	449,384.76	
ARKEMA	2,005	53.30	106,866.50	
BASF SE	33,845	52.83	1,788,031.35	
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	5,550	5.13	28,488.15	
CRH PLC	27,255	14.95	407,598.52	
HEIDELBERGCEMENT AG	5,055	32.37	163,630.35	
IMERYS SA	1,520	35.11	53,374.80	
K+S AG	6,500	35.22	228,930.00	
KONINKLIJKE DSM NV	5,682	35.47	201,568.95	
LAFARGE SA	7,458	26.39	196,853.91	
LANXESS AG	3,300	39.29	129,673.50	
LINDE AG	6,345	113.25	718,571.25	
SALZGITTER AG	1,685	38.72	65,251.62	
SOLVAY ET CIE SA -A	2,181	63.08	137,577.48	
STORA ENSO OYJ-R SHS	20,375	4.48	91,280.00	
THYSENKRUPP AG	14,570	17.70	257,961.85	
UMICORE	4,445	31.55	140,261.97	
UPM-KYMMENE OYJ	18,648	8.28	154,405.44	
VOESTALPINE AG	4,239	21.46	90,990.13	
WACKER CHEMIE AG	580	60.81	35,269.80	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	5,146	23.00	118,358.00	
ALSTOM	7,390	23.12	170,856.80	
BEKAERT NV	1,540	24.86	38,284.40	
BOSKALIS WESTMINSTER	2,855	26.70	76,228.50	
BOUYGUES SA	6,820	24.19	165,009.90	
BRENTAG AG	1,125	71.66	80,617.50	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	14,831	28.90	428,690.05	
EADS NV	14,968	23.60	353,244.80	
EIFFAGE	1,915	18.51	35,446.65	
FERROVIAL SA	13,715	9.37	128,536.98	
FIAT INDUSTRIAL	28,270	6.60	186,582.00	
FINMECCANICA SPA	14,290	2.69	38,554.42	
FOMENTO DE CONSTRUCC Y CONTRA	2,535	20.17	51,130.95	
GEA GROUP AG	6,740	21.55	145,247.00	
HOCHTIEF AG	1,655	44.12	73,018.60	
KONE OYJ-B	5,907	39.30	232,145.10	
KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRON	37,821	15.63	591,142.23	
LEGRAND SA	7,405	23.97	177,534.87	
MAN SE	2,414	67.41	162,727.74	
METSO OYJ	4,900	27.65	135,485.00	
PRYSMIAN SPA	8,610	9.73	83,775.30	
SAFRAN SA	6,190	22.60	139,924.95	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	18,033	38.70	697,877.10	
SIEMENS AG-REG	30,456	72.67	2,213,237.52	
THALES SA	3,505	23.15	81,140.75	
VALLOUREC	4,265	49.00	208,985.00	
VINCI SA	16,635	32.98	548,622.30	
WARTSILA OYJ	6,100	22.38	136,518.00	
WENDEL	1,190	50.38	59,952.20	

ZARDOYA OTIS SA	5,219	10.52	54,903.88	
BUREAU VERITAS SA	1,770	54.99	97,332.30	
EDENRED	6,096	18.78	114,482.88	
RANDSTAD HOLDING NV	4,405	22.93	101,028.67	
SOCIETE BIC SA	1,265	67.96	85,969.40	
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	14,551	12.31	179,195.56	
ADP	1,210	52.77	63,851.70	
ATLANTIA SPA	11,496	12.25	140,826.00	
DEUTCHE LUFTHANSA	7,870	9.17	72,238.73	
DEUTSCHE POST AG	31,433	11.65	366,351.61	
FRAPORT AG	1,740	38.42	66,859.50	
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	22,420	5.19	116,404.64	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	31,722	1.79	57,004.43	
RYANAIR HOLDINGS PLC	8,345	3.76	31,377.20	
TNT EXPRESS NV	13,270	5.68	75,493.03	
VOPAK	2,440	40.04	97,697.60	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	12,430	52.50	652,575.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,090	36.72	76,744.80	
CONTINENTAL AG	2,915	49.20	143,418.00	
DAIMLER AG	33,262	34.39	1,143,880.18	
FIAT SPA	26,775	3.65	97,942.95	
MICHELIN (CGDE)-B	6,704	45.42	304,495.68	
NOKIAN RENKAAT OYJ	4,245	24.81	105,318.45	
PEUGEOT SA	5,872	12.43	72,988.96	
PIRELLI & C.	9,236	6.57	60,726.70	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,740	42.52	244,064.80	
RENAULT SA	6,797	26.82	182,295.54	
VOLKSWAGEN AG	1,151	105.70	121,660.70	
VOLKSWAGEN AG-PFD	5,343	117.90	629,939.70	
ADIDAS AG	7,721	50.29	388,289.09	
CHRISTIAN DIOR	2,000	91.67	183,340.00	
LUXOTTICA GROUP SPA	3,976	21.39	85,046.64	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	9,369	108.40	1,015,599.60	
ACCOR SA	5,606	18.77	105,252.65	
AUTOGRILL SPA	6,045	7.45	45,065.47	
OPAP SA	8,450	6.80	57,460.00	
SODEXO	3,470	54.74	189,947.80	
AXEL SPRINGER AG	1,665	33.12	55,153.12	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	29.90	113,489.47	
JC DECAUX SA .	2,520	17.46	43,999.20	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	3,080	39.99	123,169.20	
LAGARDERE S.C.A.	5,040	19.83	99,968.40	
MEDIASET SPA	25,926	2.12	55,118.67	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	2,855	14.12	40,312.60	
PUBLICIS GROUPE	4,725	34.71	164,004.75	
REED ELSEVIER NV	25,748	8.86	228,153.02	
SANOMA OYJ	3,275	8.97	29,376.75	
SES	11,190	18.21	203,769.90	
TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	5,550	7.78	43,195.65	
WOLTERS KLUWER	11,107	13.14	146,001.51	
INDITEX	8,045	63.10	507,639.50	
PPR	2,892	111.20	321,590.40	
CARREFOUR SA	21,653	17.05	369,183.65	
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,004	63.36	126,973.44	

COLRUYT SA	2,725	28.74	78,316.50	
DELHAIZE GROUP	3,666	43.25	158,554.50	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	22,688	3.25	73,940.19	
JERONIMO MARTINS	7,685	12.77	98,137.45	
KESKO OYJ-B SHS	2,230	25.63	57,154.90	
KONINKLIJKE AHOLD NV	44,169	10.00	441,910.84	
METRO AG	4,940	28.15	139,085.70	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	29,551	45.96	1,358,311.71	
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	6,798	12.85	87,354.30	
DANONE	21,559	47.34	1,020,603.06	
HEINEKEN HOLDING NV	4,275	31.15	133,187.62	
HEINEKEN NV	9,673	35.14	339,909.22	
KERRY GROUP PLC-A	5,390	27.64	149,006.55	
PERNOD-RICARD SA	7,436	69.72	518,437.92	
SUEDZUCKER AG	2,400	24.63	59,124.00	
UNILEVER NV-CVA	59,995	26.15	1,568,869.25	
BEIERSDORF AG	3,745	43.58	163,225.82	
HENKEL AG & CO KGAA	5,110	37.34	190,807.40	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,493	44.43	288,516.45	
L'OREAL	8,836	79.68	704,052.48	
CELESIO AG	3,620	12.39	44,869.90	
ESSILOR INTERNATIONAL	7,395	53.65	396,741.75	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	7,933	51.99	412,436.67	
FRESENIUS SE & CO KGAA	4,370	71.49	312,411.30	
BAYER AG	30,530	48.13	1,469,561.55	
ELAN CORP PLC	18,000	9.90	178,200.00	
GRIFOLS SA	5,290	12.76	67,500.40	
MERCK KGAA	2,405	76.75	184,583.75	
ORION OYJ-CLASS B	4,485	15.01	67,319.85	
QIAGEN N.V.	7,635	10.51	80,282.02	
SANOFI	42,421	55.41	2,350,547.61	
UCB SA	3,708	32.20	119,397.60	
BANCA CARIGE SPA	28,825	1.45	41,796.25	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	153,605	0.25	39,630.09	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	168,658	6.59	1,112,468.16	
BANCO DE SABADELL SA	41,782	3.10	129,524.20	
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	21,145	1.17	24,781.94	
BANCO POPOLARE SCARL	62,764	1.04	65,839.43	
BANCO POPULAR ESPANOL	36,697	3.58	131,411.95	
BANCO SANTANDER SA	311,022	5.83	1,814,813.37	
BANKIA SAU	27,425	3.59	98,592.87	
BANKINTER SA	13,435	4.82	64,864.18	
BNP PARIBAS	35,552	30.30	1,077,225.60	
CAIXABANK	26,440	3.94	104,358.68	
COMMERZBANK AG	134,443	1.34	180,288.06	
CREDIT AGRICOLE SA	37,252	4.41	164,504.83	
ERSTE GROUP BANK AG	7,118	13.30	94,669.40	
INTESA SANPAOLO	377,913	1.31	495,066.03	
INTESA SANPAOLO-RSP	31,990	1.03	32,949.70	
KBC GROEP NV	6,119	9.82	60,125.29	
NATIONAL BANK OF GREECE	22,263	1.61	35,843.43	
NATIXIS	32,490	2.00	64,980.00	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	2,310	20.72	47,874.75	
SOCIETE GENERALE	23,749	17.22	408,957.78	

UBI BANCA SCPA	28,684	3.27	93,968.78	
UNICREDIT SPA	506,731	0.69	349,897.75	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	34,205	29.79	1,019,137.97	
DEUTSCHE BOERSE AG-SHARES	7,280	40.33	293,638.80	
EURAZEO	1,442	27.17	39,186.35	
EXOR SPA	1,714	15.21	26,069.94	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,912	51.58	150,200.96	
ING GROEP NV-CVA	141,655	5.68	804,600.40	
MEDIOBANCA SPA	19,150	4.75	91,077.40	
POHJOLA BANK PLC	6,535	7.70	50,319.50	
AEGON NV	66,229	3.14	208,488.89	
AGEAS	84,144	1.19	100,888.65	
ALLIANZ SE-REG	16,768	75.97	1,273,864.96	
ASSICURAZIONI GENERALI	43,088	11.45	493,357.60	
AXA	64,167	10.26	658,353.42	
CNP ASSURANCES	6,070	9.69	58,872.93	
DELTA LLOYD NV	3,600	12.94	46,584.00	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNGS	2,455	38.19	93,768.72	
MAPFRE SA	26,034	2.49	64,928.79	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,536	93.70	612,423.20	
SAMPO OYJ-A SHS	15,819	18.93	299,453.67	
SCOR SE	6,822	17.75	121,124.61	
VIENNA INSURANCE GROUP	1,410	30.06	42,384.60	
IMMOEAST AG-TEMPORARY	16,150	—	—	
IMMOFINANZ AG	37,225	2.30	85,878.07	
IMMOFINANZ AG-TEMPORARY	13,000	—	—	
AMADEUS IT HOLDING SA	10,060	12.15	122,229.00	
ATOS	1,650	33.95	56,025.75	
CAP GEMINI SA	5,469	24.67	134,920.23	
DASSAULT SYSTEMES SA	2,315	59.80	138,437.00	
INDRA SISTEMAS SA	4,269	9.90	42,280.17	
SAP AG-COMMON	33,902	40.56	1,375,065.12	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,720	13.75	64,900.00	
ALCATEL-LUCENT	91,534	1.24	113,502.16	
NEOPOST SA	867	52.11	45,179.37	
NOKIA OYJ	137,696	3.75	517,186.17	
BELGACOM SA	5,820	23.74	138,195.90	
DEUTSCHE TELEKOM AG	103,906	8.82	916,658.73	
ELISA OYJ	6,295	15.98	100,594.10	
FRANCE TELECOM SA	69,599	11.97	833,100.03	
ILIAD SA	815	94.06	76,658.90	
KONINKLIJKE KPN NV	54,906	9.12	500,907.43	
MOBISTAR SA	1,279	39.25	50,207.14	
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	27,363	4.54	124,255.38	
TELECOM ITALIA SPA	354,593	0.81	288,106.81	
TELECOM ITALIA-RSP	234,007	0.67	157,603.71	
TELEFONICA SA	152,038	13.28	2,019,064.64	
TELEKOM AUSTRIA AG	14,020	9.29	130,245.80	
VIVENDI	46,457	16.51	767,237.35	
A2A SPA	50,790	0.73	37,457.62	
ACCIONA SA	976	66.84	65,235.84	
E.ON AG	66,359	16.65	1,105,209.14	
EDP RENOVAVEIS SA	8,115	4.65	37,759.09	
ELECTRICITE DE FRANCE	8,795	18.42	162,003.90	

ENAGAS	7,050	14.16	99,828.00	
ENEL GREEN POWER SPA	64,340	1.60	103,394.38	
ENEL SPA	241,704	3.06	740,097.64	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	71,841	2.32	166,886.64	
FORTUM OYJ	16,355	16.50	269,857.50	
GAS NATURAL SDG SA	11,902	13.29	158,237.09	
GDF SUEZ	45,409	20.47	929,749.27	
IBERDROLA SA	140,427	4.84	679,666.68	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,050	33.22	134,541.00	
RWE AG	17,965	27.58	495,564.52	
RWE AG-NON VTG PFD	1,845	25.34	46,752.30	
SNAM RETE GAS	58,840	3.41	200,997.44	
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	10,319	8.86	91,457.29	
TERNA SPA	43,127	2.60	112,216.45	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	13,334	8.41	112,205.61	
VERBUND AG	2,370	20.08	47,589.60	
ASML HOLDING NV	15,977	31.77	507,669.17	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	42,120	5.81	245,054.16	
STMICROELECTRONICS NV	23,623	4.55	107,484.65	
ユーロ小計	6,734,329		73,282,232.00 (7,452,070,172)	
合 計	44,410,508		58,083,902,770 (58,083,902,770)	

(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	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	34,640	586,801.60	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,475	458,526.25	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,397	545,150.97	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,735	247,966.65	
		DUKE REALTY CORPORATION	6,875	83,325.00	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	11,275	647,974.25	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	2,475	228,442.50	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	17,145	257,175.00	
		HCP INC	14,985	617,082.30	
		HEALTH CARE REIT INC	6,530	352,815.90	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	26,659	387,088.68	
		KIMCO REALTY CORPORATION	15,255	257,809.50	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	98,215.15	
		PLUM CREEK TIMBER CO	6,458	238,300.20	
		PROLOGIS INC	17,042	493,195.48	
		PUBLIC STORAGE	5,389	724,874.39	
		RAYONIER INC	5,057	222,508.00	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	2,805	105,664.35	
		SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	10,859	1,414,493.34	
		THE MACERICH COMPANY	5,120	262,041.60	
		VENTAS INC	10,295	565,607.30	
		VORNADO REALTY TRUST	6,396	493,131.60	
		WEYERHAEUSER CO	20,336	369,505.12	
	投資証券小計		241,316	9,657,695.13 (752,817,335)	

米ドル合計				9,657,695.13 (752,817,335)	
加ドル	投資証券	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,250	136,710.00	
	投資証券小計		5,250	136,710.00 (10,424,137)	
加ドル合計				136,710.00 (10,424,137)	
豪ドル	投資証券	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	67,010	119,612.85	
		DEXUS PROPERTY GROUP	163,705	141,604.82	
		GOODMAN GROUP	273,860	165,685.30	
		GPT GROUP	63,695	201,913.15	
		LEND LEASE GROUP	21,287	158,162.41	
		MIRVAC GROUP	137,930	169,653.90	
		STOCKLAND	86,100	280,686.00	
		WESTFIELD GROUP	80,385	654,333.90	
		WESTFIELD RETAIL TRUST	107,475	271,911.75	
	投資証券小計		1,001,447	2,163,564.08 (171,397,546)	
豪ドル合計				2,163,564.08 (171,397,546)	
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	32,561	147,826.94	
		CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	24,090	72,848.16	
		HAMMERSON PLC	30,035	105,963.48	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	28,889	180,845.14	
		SEGRO PLC	20,223	40,890.90	
		投資証券小計		135,798	548,374.62 (66,682,353)
英ポンド合計				548,374.62 (66,682,353)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	86,500	2,434,975.00	
	投資証券小計		86,500	2,434,975.00 (24,398,449)	
香港ドル合計				2,434,975.00 (24,398,449)	
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	62,000	115,320.00	
		CAPITAMALL TRUST	71,800	122,778.00	
		投資証券小計		133,800	238,098.00 (14,352,547)
シンガポールドル合計				238,098.00 (14,352,547)	
ユーロ	投資証券	CORIO NV	1,970	64,330.35	
		FONCIERE DES REGIONS	1,005	48,209.85	
		GECINA SA	740	45,798.60	
		ICADE	1,080	61,808.40	
		KLEPIERRE	3,895	83,372.47	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	3,380	452,920.00	
		投資証券小計		12,070	756,439.67 (76,922,350)
ユーロ合計				756,439.67 (76,922,350)	
合計				1,116,994,717 (1,116,994,717)	

(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 564銘柄	97.8%	—	57.0%
	投資証券 23銘柄	—	2.2%	1.3%
加ドル	株式 100銘柄	99.7%	—	5.6%
	投資証券 1銘柄	—	0.3%	0.0%
豪ドル	株式 57銘柄	92.8%	—	3.7%
	投資証券 9銘柄	—	7.2%	0.3%
英ポンド	株式 101銘柄	98.9%	—	10.6%
	投資証券 5銘柄	—	1.1%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%	—	4.0%
香港ドル	株式 39銘柄	96.8%	—	1.3%
	投資証券 1銘柄	—	3.2%	0.0%
シンガポールドル	株式 28銘柄	96.9%	—	0.7%
	投資証券 2銘柄	—	3.1%	0.0%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.0%	—	0.1%
スウェーデンクローナ	株式 34銘柄	100.0%	—	1.4%
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 12銘柄	100.0%	—	0.5%
イスラエルシェケル	株式 7銘柄	100.0%	—	0.3%
ユーロ	株式 245銘柄	99.0%	—	12.6%
	投資証券 6銘柄	—	1.0%	0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

[次へ](#)

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

海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

科目	対象年月日	平成23年 6月27日現在	平成23年12月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		64,375,509	29,410,991
コール・ローン		65,307,366	138,653,374
株式		6,757,044,082	5,815,806,450
投資証券		3,436,984	2,138,240
派生商品評価勘定		—	3,847,612
未収配当金		25,470,591	3,804,345
未収利息		111	259
差入委託証拠金		34,907,634	43,175,414
流動資産合計		6,950,542,277	6,036,836,685
資産合計		6,950,542,277	6,036,836,685
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,922,323	—
未払解約金		1,785,200	2,166,200
流動負債合計		4,707,523	2,166,200
負債合計		4,707,523	2,166,200
純資産の部			
元本等			
元本		5,953,706,438	6,350,811,860
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		992,128,316	316,141,375
元本等合計		6,945,834,754	6,034,670,485
純資産合計		6,945,834,754	6,034,670,485
負債純資産合計		6,950,542,277	6,036,836,685

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

（追加情報）

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

（貸借対照表に関する注記）

平成23年 6月27日現在		平成23年12月26日現在	
1. 期首	平成22年12月28日	1. 期首	平成23年 6月28日
期首元本額	5,837,045,208円	期首元本額	5,953,706,438円
期首からの追加設定元本額	645,362,353円	期首からの追加設定元本額	720,464,948円
期首からの一部解約元本額	528,701,123円	期首からの一部解約元本額	323,359,526円
平成23年 6月27日現在の元本の内訳		平成23年12月26日現在の元本の内訳	
日興五大陸株式ファンド	4,348,117,676円	日興五大陸株式ファンド	4,383,104,717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	39,481,122円	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	46,184,562円
年金積立 インデックスファンド海外新興国（エマージング）株式	1,546,050,255円	年金積立 インデックスファンド海外新興国（エマージング）株式	1,898,948,136円
日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産）	20,057,385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）	22,574,445円
計	5,953,706,438円	計	6,350,811,860円
2. 本報告書における開示対象ファンドの当特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	5,953,706,438口	2. 本報告書における開示対象ファンドの当特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	6,350,811,860口
		3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は316,141,375円であります。	

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 平成22年12月28日 至 平成23年 6月27日	自 平成23年 6月28日 至 平成23年12月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成23年 6月27日現在	平成23年12月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（平成23年6月27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	184,246,800
投資証券	262,987
合計	184,509,787

（平成23年12月26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	775,767,522
投資証券	934,732
合計	776,702,254

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（平成23年6月27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	154,592,881	—	151,670,558	2,922,323
合計		154,592,881	—	151,670,558	2,922,323

（平成23年12月26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	184,777,357	—	188,624,969	3,847,612
合計		184,777,357	—	188,624,969	3,847,612

（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同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成23年 6月27日現在		平成23年12月26日現在	
1口当たり純資産額	1.1666円	1口当たり純資産額	0.9502円
(1万口当たり純資産額)	(11,666円)	(1万口当たり純資産額)	(9,502円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
米ドル				
ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	3,550	44.70	158,685.00	
GAZPROM OAO	3,000	5.45	16,350.00	
GAZPROM OAO-SPON ADR	122,200	10.92	1,334,424.00	
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	13,200	5.08	67,095.60	
LUKOIL OAO-SPON ADR	11,485	53.10	609,853.50	
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	1,976	130.50	257,868.00	
PETROLEO BRASILEIRO-SPON ADR	450	24.22	10,899.00	
ROSNEFT OJSC-REG S GDR	41,540	6.80	282,472.00	
SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	26,000	8.00	208,000.00	
TATNEFT-GDR	5,449	29.44	160,418.56	
TMK-GDR REG S	1,860	9.34	17,372.40	
BRASKEM SA-SPON ADR	1,780	14.81	26,361.80	
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	4,650	39.73	184,744.50	
CIA SIDERURGICA NACL-SP ADR	10,170	8.09	82,275.30	
FIBRIA CELULO SA-ADR	3,094	7.78	24,071.32	
GERDAU SA -SPON ADR	3,600	7.81	28,116.00	
MECHEL-SPONSORED ADR	1,380	8.37	11,550.60	
MMC NORILSK NICKEL JSC-ADR	12,495	15.07	188,299.65	
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	2,110	20.20	42,622.00	
QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	1,600	54.19	86,704.00	
SEVERSTAL - GDR REG S	6,470	11.80	76,346.00	
SOUTHERN COPPER CORP(US)	3,385	31.02	105,002.70	
URALKALI-SPON GDR-REG S	6,220	36.74	228,522.80	
VALE SA-SP ADR	4,800	22.13	106,224.00	
ORASCOM CONSTRUCTION-GDR	2,200	33.74	74,228.00	
LAN AIRLINES SA-SPON ADR	3,880	23.79	92,305.20	
GRUPO TELEvisa SA-SPONS ADR	1,800	20.58	37,044.00	
CIA BRASILEIRA-SP ADR PREF	2,380	36.08	85,870.40	
MAGNIT OJSC-SPON GDR REGS	7,000	20.95	146,650.00	
BRF - BRASIL FOODS SA-ADR	6,180	19.93	123,167.40	
FOMENTO ECONOMICO MEX-SP ADR	1,200	69.71	83,652.00	
BANCO BRADESCO-ADR	5,360	16.77	89,887.20	
BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	860	73.95	63,597.00	
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	3,350	61.47	205,924.50	
COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	9,120	3.03	27,633.60	
CREDICORP LTD	1,760	107.69	189,534.40	
ITAU UNIBANCO HLDNG-PREF ADR	2,775	18.67	51,809.25	
SBERBANK-SPONSORED ADR	51,750	10.35	535,612.50	
STATE BANK OF INDIA-SPON GDR	930	62.85	58,450.50	
VTB BANK OJSC-GDR-REG S	30,030	3.82	114,834.72	
EGYPTIAN KUWAITI HOLDING CO	19,965	0.98	19,565.70	
LSR GROUP OJSC-GDR REGS	7,000	3.50	24,500.00	
AMERICA MOVIL-ADR SERIES L	2,000	22.74	45,480.00	

MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	10,012	14.95	149,679.40	
ROSTELECOM-SPONSORED-ADR	5,330	29.00	154,570.00	
SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR	2,515	16.85	42,377.75	
TELE NORTE LESTE PART-ADR	850	9.45	8,032.50	
TELEF BRASIL-ADR	3,924	27.44	107,674.56	
TIM PARTICIPACOES SA-ADR	1,840	25.61	47,122.40	
CEMIG SA -SPONS ADR	2,384	18.03	42,983.52	
CIA PARANAENSE ENER-SP ADR P	3,675	21.38	78,571.50	
FEDERAL GRID CO UNIFIED-CLS	4,000,000	0.01	41,320.00	
FEDERAL HYDROGENERATING CO-ADR	35,000	3.29	115,150.00	
SABESP-ADR	1,030	55.48	57,144.40	
米ドル小計	4,518,564		7,228,651.13 (563,473,355)	
香港ドル				
CHINA COAL ENERGY CO - H	115,000	8.67	997,050.00	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	44,000	12.26	539,440.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	339,000	8.31	2,817,090.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	81,000	34.60	2,802,600.00	
CNOOC LTD	391,000	13.72	5,364,520.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	80,000	11.40	912,000.00	
PETROCHINA CO LTD-H	445,000	9.48	4,218,600.00	
YANZHOU COAL MINING CO-H	50,000	16.74	837,000.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	63,000	3.48	219,240.00	
ANGANG STEEL CO LTD-H	24,000	5.84	140,160.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	33,000	24.05	793,650.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	74,000	9.14	676,360.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	64,000	5.79	370,560.00	
CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP	70,000	5.20	364,000.00	
HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	45,000	4.12	185,400.00	
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	31,000	17.20	533,200.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	42,000	5.04	211,680.00	
SINOERT HOLDINGS LTD	40,000	2.13	85,200.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	43,000	2.62	112,660.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	40,000	12.80	512,000.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	147,750	3.00	443,250.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	12,000	45.50	546,000.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	114,000	6.10	695,400.00	
CHINA INTL MARINE CONTAINER-B	26,876	8.51	228,714.76	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	46,000	4.47	205,620.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	100,000	2.59	259,000.00	
CHINA RONGSHENG HEAVY INDUST	63,000	2.21	139,230.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	52,000	5.48	284,960.00	
CITIC PACIFIC LTD	29,000	13.76	399,040.00	
CSR CORP LTD	41,000	5.16	211,560.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-H	12,000	23.10	277,200.00	
METALLURGICAL CORP OF CHINA-H	110,000	1.68	184,800.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	70,000	3.62	253,400.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	13,000	21.95	285,350.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	8,000	38.75	310,000.00	
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	9,000	18.84	169,560.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TE-H	32,500	8.87	288,275.00	
AIR CHINA LTD-H	58,000	5.78	335,240.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPORT-H	60,000	3.90	234,000.00	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	65,825	3.80	250,135.00	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	35,000	23.65	827,750.00	

CHINA SHIPPING CONTAINER-H	100,750	1.73	174,297.50	
----------------------------	---------	------	------------	--

[次へ](#)

CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	36,000	4.85	174,600.00	
COSCO PACIFIC LTD	30,000	9.14	274,200.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	62,000	6.93	429,660.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	43,000	5.00	215,000.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	64,000	8.60	550,400.00	
BYD CO LTD-H	10,000	17.20	172,000.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	50,000	14.10	705,000.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	100,000	1.71	171,000.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	35,000	11.90	416,500.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	76,318	6.62	505,225.16	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	50,000	9.19	459,500.00	
CHINA DONGXIANG GROUP CO	90,000	1.34	120,600.00	
DAPHNE INTERNATIONAL HOLDING	44,000	8.67	381,480.00	
SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	50,000	2.84	142,000.00	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	108,000	13.86	1,496,880.00	
DAH CHONG HONG	40,000	9.27	370,800.00	
GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP	23,000	16.30	374,900.00	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	191,160	1.91	365,115.60	
INTIME DEPARTMENT STORE	32,000	8.24	263,680.00	
PARKSON RETAIL GROUP LTD	44,000	9.35	411,400.00	
CHINA RESOURCES ENTERPRISES	37,000	27.40	1,013,800.00	
SUN ART RETAIL GROUP	43,000	10.14	436,020.00	
WUMART STORES INC-H	24,000	16.08	385,920.00	
CHAODA MODERN AGRICULTURE	54,756	1.10	60,231.60	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	48,000	5.77	276,960.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	35,000	26.30	920,500.00	
CHINA YURUN FOOD GROUP LTD	31,000	10.38	321,780.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	36,000	24.00	864,000.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	14,000	43.60	610,400.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	130,000	7.97	1,036,100.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	20,000	74.00	1,480,000.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	32,000	7.40	236,800.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	16,400	18.82	308,648.00	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	75,000	2.83	212,250.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	365,000	3.38	1,233,700.00	
BANK OF CHINA LTD - H	1,457,000	2.92	4,254,440.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	168,245	5.53	930,394.85	
CHINA CITIC BANK - H	150,000	4.50	675,000.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,322,920	5.52	7,302,518.40	
CHINA MERCHANTS BANK - H	98,150	16.16	1,586,104.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	84,000	6.81	572,040.00	
IND & COMM BK OF CHINA - H	1,390,575	4.86	6,758,194.50	
CHINA EVERBRIGHT LTD	18,000	12.22	219,960.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	169,000	19.28	3,258,320.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	32,600	22.35	728,610.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	14,000	14.82	207,480.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	54,000	11.00	594,000.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	40,000	51.95	2,078,000.00	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	42,000	7.16	300,720.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	86,320	14.22	1,227,470.40	
CHINA RESOURCES LAND LTD	44,000	13.20	580,800.00	
CHINA VANKE CO LTD -B	23,360	7.60	177,536.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	90,000	3.08	277,200.00	
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	146,000	3.36	490,560.00	

GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	26,400	6.54	172,656.00	
LONGFOR PROPERTIES	15,000	9.03	135,450.00	
POLY HONG KONG INVESTMENTS	34,000	3.44	116,960.00	
RENHE COMMERCIAL HOLDINGS	250,000	0.85	212,500.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	37,500	6.87	257,625.00	
SHUI ON LAND LTD	42,900	2.39	102,531.00	
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	65,000	3.50	227,500.00	
SOHO CHINA LTD	65,000	5.11	332,150.00	
ALIBABA.COM LTD	24,500	7.97	195,265.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	21,800	159.00	3,466,200.00	
KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	14,000	22.60	316,400.00	
LENOVO GROUP LTD	204,000	5.47	1,115,880.00	
ZTE CORP-H	9,621	24.65	237,157.65	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	50,000	3.45	172,500.00	
CHINA MOBILE LTD	134,200	74.30	9,971,060.00	
CHINA TELECOM CORP LTD	304,000	4.51	1,371,040.00	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	123,882	16.52	2,046,530.64	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	48,000	5.92	284,160.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	47,000	14.68	689,960.00	
DATANG INTL POWER GEN CO-H	23,000	2.50	57,500.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	24,000	25.00	600,000.00	
GUANGDONG INVEST	62,000	4.88	302,560.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	106,000	4.16	440,960.00	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	198,000	2.18	431,640.00	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	580,000	0.37	217,500.00	
香港ドル小計	13,399,308		102,785,276.06 (1,029,908,466)	
マレーシアリングット				
PETRONAS DAGANGAN BHD	10,000	17.30	173,000.00	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	42,000	6.20	260,400.00	
GAMUDA BHD	56,000	3.19	178,640.00	
IJM CORP BHD	35,000	5.58	195,300.00	
SIME DARBY BERHAD	64,720	8.99	581,832.80	
AIRASIA BHD	47,000	3.70	173,900.00	
MISC BHD	31,000	5.52	171,120.00	
BERJAYA SPORTS TOTO BERHAD	26,250	4.38	114,975.00	
GENTING BHD	45,300	10.88	492,864.00	
GENTING MALAYSIA BHD	46,500	3.84	178,560.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	2,500	49.20	123,000.00	
IOI CORPORATION BERHAD	91,675	5.19	475,793.25	
KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	16,000	22.20	355,200.00	
PPB GROUP BERHAD	11,700	16.98	198,666.00	
BUMIPUTRA-COMMERCE HLDGS BHD	100,800	7.09	714,672.00	
HONG LEONG BANK BERHAD	31,800	10.94	347,892.00	
MALAYAN BANKING BHD	72,150	8.35	602,452.50	
PUBLIC BANK BHD-FOREIGN MKT	32,700	13.10	428,370.00	
RHB CAPITAL BHD	25,000	6.99	174,750.00	
AMMB HOLDINGS BHD	52,600	5.93	311,918.00	
SP SETIA BHD	15,975	3.87	61,823.25	
AXIATA GROUP BERHAD	61,900	4.98	308,262.00	
DIGI.COM BHD	107,000	3.74	400,180.00	
MAXIS BHD	40,000	5.49	219,600.00	
PETRONAS GAS BERHAD	20,000	14.14	282,800.00	
TENAGA NASIONAL BERHAD	47,125	5.84	275,210.00	
YTL CORPORATION BERHAD	135,660	1.49	202,133.40	

YTL POWER INTERNATIONAL BHD	70,000	1.80	126,000.00	
マレーシアリングット小計	1,338,355		8,129,314.20 (201,037,940)	
タイパーツ				
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	3,500	548.00	1,918,000.00	
IRPC PCL - NVDR	191,800	4.40	843,920.00	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	30,700	171.50	5,265,050.00	
PTT PCL-NVDR	15,100	319.00	4,816,900.00	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	39,000	30.50	1,189,500.00	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	20,045	61.50	1,232,767.50	
SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	12,600	367.00	4,624,200.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	70,000	32.50	2,275,000.00	
BANGKOK BANK-FOREIGN REG	32,040	163.00	5,222,520.00	
BANK OF AYUDHYA PUBLIC-NVDR	94,000	22.10	2,077,400.00	
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	24,200	123.00	2,976,600.00	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	20,000	122.00	2,440,000.00	
KRUNG THAI BANK - NVDR	129,700	15.00	1,945,500.00	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	36,300	115.00	4,174,500.00	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	28,600	143.00	4,089,800.00	
タイパーツ小計	747,585		45,091,657.50 (112,278,227)	
フィリピンペソ				
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	52,000	40.20	2,090,400.00	
SM INVESTMENTS CORP	4,410	585.50	2,582,055.00	
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	30,741	55.85	1,716,884.85	
METROPOLITAN BANK & TRUST	25,000	68.00	1,700,000.00	
AYALA CORPORATION	9,442	307.00	2,898,694.00	
AYALA LAND INC	177,960	15.40	2,740,584.00	
AYALA LAND INC-PREFERENCE	177,960	0.10	17,796.00	
SM PRIME HOLDINGS INC	174,168	13.52	2,354,751.36	
PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	810	2,530.00	2,049,300.00	
ABOITIZ POWER CORP	86,000	29.90	2,571,400.00	
MANILA ELECTRIC COMPANY	10,000	248.00	2,480,000.00	
フィリピンペソ小計	748,491		23,201,865.21 (41,531,338)	
インドネシアルピア				
ADARO ENERGY TBK PT	270,000	1,770.00	477,900,000.00	
BUMI RESOURCES TBK PT	450,000	2,150.00	967,500,000.00	
TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	25,000	17,200.00	430,000,000.00	
ANEKA TAMBANG TBK PT	92,500	1,620.00	149,850,000.00	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	32,000	17,200.00	550,400,000.00	
PT INTERNATIONAL NICKEL INDO	45,000	3,050.00	137,250,000.00	
SEMEN GRESIK (PERSERO) PT	66,000	10,750.00	709,500,000.00	
PT UNITED TRACTORS	53,500	24,900.00	1,332,150,000.00	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	42,000	73,700.00	3,095,400,000.00	
GUDANG GARAM TBK PT	15,000	61,800.00	927,000,000.00	
PT INDOFOOD SUKSES MAK TBK	136,000	4,725.00	642,600,000.00	
KALBE FARMA TBK PT	150,000	3,375.00	506,250,000.00	
BANK DANAMON INDONESIA TBK	48,000	4,150.00	199,200,000.00	
BANK MANDIRI TBK	197,000	6,800.00	1,339,600,000.00	
BANK RAKYAT INDONESIA	284,000	6,850.00	1,945,400,000.00	
PT BANK CENTRAL ASIA	294,000	8,050.00	2,366,700,000.00	
PT BANK NEGARA INDONESIA	180,000	3,925.00	706,500,000.00	
INDOSAT TBK PT	75,000	5,250.00	393,750,000.00	
PT TELEKOMUNIKASI	263,000	7,150.00	1,880,450,000.00	

PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	413,500	3,225.00	1,333,537,500.00	
インドネシアルピア小計	3,131,500		20,090,937,500.00 (174,791,156)	
メキシコペソ				
CEMEX SAB-CPO	187,627	7.47	1,401,573.69	
GRUPO MEXICO SA-SER B	91,578	38.04	3,483,627.12	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	2,500	613.51	1,533,775.00	
MEXICHEM SAB DE CV-*	12,000	44.95	539,400.00	
MINERA FRISCO SAB DE CV-A1	11,000	51.01	561,110.00	
ALFA S.A.B. -A	10,800	160.54	1,733,832.00	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	11,000	33.43	367,730.00	
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	10,000	47.59	475,900.00	
URBI DESARROLLOS URBANOS SA	21,000	16.33	342,930.00	
GRUPO TELEVISA SAB	43,100	56.98	2,455,838.00	
GRUPO ELEKTRA SA-CPO	1,500	1,399.28	2,098,920.00	
WALMART DE MEXICO -SER V	154,200	37.19	5,734,698.00	
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	8,100	134.20	1,087,020.00	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	41,700	96.21	4,011,957.00	
GRUPO MODELO S.A.B. -SER C	17,600	88.75	1,562,000.00	
KIMBERLY CLARK MEXICO-CL A	22,890	74.29	1,700,498.10	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	26,900	43.50	1,170,150.00	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	66,000	25.34	1,672,440.00	
COMPARTAMOS SAB DE CV	30,000	17.20	516,000.00	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	858,000	15.77	13,530,660.00	
メキシコペソ小計	1,627,495		45,980,058.91 (257,948,130)	
ブラジルリアル				
HRT PARTICIPACOES EM PETROLE	100	554.51	55,451.00	
OGX PETROLEO E GAS PARTICIPA	26,300	13.79	362,677.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	64,360	23.90	1,538,204.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	99,200	22.22	2,204,224.00	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	6,800	31.65	215,220.00	
BRADSPAR SA -PREF	5,600	32.30	180,880.00	
BRASKEM SA-PREF A	1,000	13.68	13,680.00	
CIA SIDERURGICA NACIONAL	7,800	14.99	116,922.00	
DURATEX SA	6,000	9.00	54,000.00	
FIBRIA CELULOSE SA	829	14.45	11,979.05	
GERDAU SA-PREF	12,600	14.62	184,212.00	
INDS KLABIN PAPEL E CELU-PRF	15,300	7.87	120,411.00	
METALURGICA GERDAU SA-PREF	7,100	18.24	129,504.00	
MMX MINERACAO E METALICOS SA	14,000	6.40	89,600.00	
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	4,500	6.89	31,005.00	
USINAS SIDER MINAS GER	4,000	16.52	66,080.00	
USINAS SIDER MINAS GER-PF A	8,600	10.48	90,128.00	
VALE SA	25,760	40.95	1,054,872.00	
VALE SA-PREF A	45,150	38.95	1,758,592.50	
EMBRAER SA	15,900	11.30	179,670.00	
ALL AMERICA LATINA LOGISTICA	12,500	9.35	116,875.00	
CCR SA	18,000	12.05	216,900.00	
ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	7,000	13.38	93,660.00	
GOL LINHAS AEREAS - PREF	4,000	12.80	51,200.00	
LOCALIZA RENT A CAR	2,800	25.99	72,772.00	
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP	6,700	15.17	101,639.00	
MRV ENGENHARIA	5,700	10.75	61,275.00	
PDG REALTY SA	23,600	5.98	141,128.00	

ROSSI RESIDENCIAL S.A.	10,000	8.28	82,800.00	
ANHANGUERA EDUCACIONAL PART	2,650	20.15	53,397.50	
CIA HERING	3,750	33.60	126,000.00	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	6,828	14.85	101,395.80	
LOJAS RENNER S.A.	2,800	50.25	140,700.00	
BRF - BRASIL FOODS SA	7,800	36.60	285,480.00	
CIA DE BEBIDAS DAS AME-PREF	15,000	66.59	998,850.00	
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	1,400	26.71	37,394.00	
SOUZA CRUZ SA	11,500	23.20	266,800.00	
HYPERMARCAS SA	5,000	8.64	43,200.00	
NATURA COSMETICOS SA	5,300	36.65	194,245.00	
AMIL PARTICIPACOES SA	5,000	16.39	81,950.00	
DIAGNOSTICOS DA AMERICA SA	6,150	15.30	94,095.00	
ODONTOPREV S.A.	3,100	26.16	81,096.00	
BANCO BRADESCO SA-PREF	37,873	30.98	1,173,305.54	
BANCO DO BRASIL S.A.	13,500	23.93	323,055.00	
BANCO ESTADO RIO GRANDE SUL	6,500	19.70	128,050.00	
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	12,000	15.13	181,560.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	47,300	34.69	1,640,837.00	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	51,799	11.45	593,098.55	
BM&FBOVESPA SA	45,573	10.11	460,743.03	
CETIP SA-BALCAO ORGANIZADO	4,700	27.00	126,900.00	
PORTO SEGURO SA	4,200	21.74	91,308.00	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	13,000	18.06	234,780.00	
CIELO SA	6,600	47.50	313,500.00	
REDECARD SA	6,400	28.50	182,400.00	
TOTVS SA	3,250	31.22	101,465.00	
BRASIL TELECOM SA-PREFERENCE	7,000	11.25	78,750.00	
TELE NORTE LESTE PART	1,400	21.51	30,114.00	
TELE NORTE LESTE PART-PREF	2,700	17.59	47,493.00	
TELEFONICA BRASIL S.A. -PREF	930	51.12	47,541.60	
TELEMAR NORTE LESTE SA-PR A	1,200	46.40	55,680.00	
TIM PARTICIPACOES SA	14,605	9.38	136,994.90	
AES TIETE SA-PREF	3,500	26.58	93,030.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS	5,880	18.16	106,780.80	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	2,300	26.93	61,939.00	
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	5,700	34.15	194,655.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	4,207	33.14	139,419.98	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	720	51.65	37,188.00	
CPFL ENERGIA SA	6,800	26.26	178,568.00	
ELETROPAULO METROPOLI-PREF	2,640	35.55	93,852.00	
TRACTEBEL ENERGIA SA ORD	3,700	30.70	113,590.00	
ブラジルリアル小計	853,454		18,866,762.25 (792,404,014)	
チリペソ				
CAP SA	2,045	18,870.00	38,589,150.00	
EMPRESAS CMPC SA	37,000	1,956.00	72,372,000.00	
EMPRESAS COPEC SA	11,490	7,138.50	82,021,365.00	
S.A.C.I. FALABELLA	9,000	4,183.10	37,647,900.00	
CENCOSUD SA	19,150	2,939.20	56,285,680.00	
BANCO DE CHILE	390,000	69.90	27,261,000.00	
BANCO DE CREDITO E INVERSION	810	28,925.00	23,429,250.00	
BANCO SANTANDER CHILE SA	747,000	36.78	27,474,660.00	
CORPBANCA	2,600,000	7.04	18,314,400.00	
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	2,700	9,715.70	26,232,390.00	

COLBUN SA	268,000	128.97	34,563,960.00	
EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	57,700	762.71	44,008,367.00	
ENERSIS SA	269,500	184.52	49,728,140.00	
チリペソ小計	4,414,395		537,928,262.00 (80,635,446)	
韓国ウォン				
GS HOLDINGS	1,270	52,100.00	66,167,000.00	
SK INNOVATION CO LTD	1,482	151,000.00	223,782,000.00	
S-OIL CORPORATION	865	107,000.00	92,555,000.00	
CHEIL INDUSTRIES INC	1,240	103,000.00	127,720,000.00	
DONGKUK STEEL MILL CO LTD	1,090	21,100.00	22,999,000.00	
HANWHA CHEMICAL CORP	2,000	25,450.00	50,900,000.00	
HANWHA CORPORATION	1,160	34,500.00	40,020,000.00	
HONAM PETROCHEMICAL CORP	370	306,000.00	113,220,000.00	
HYOSUNG CORPORATION	550	55,400.00	30,470,000.00	
HYUNDAI STEEL CO	1,130	99,200.00	112,096,000.00	
KOREA KUMHO PETROCHEMICAL CO	460	175,000.00	80,500,000.00	
KOREA ZINC CO LTD	295	313,500.00	92,482,500.00	
LG CHEM LTD	982	333,500.00	327,497,000.00	
OCI CO LTD	320	212,000.00	67,840,000.00	
POSCO	1,385	393,500.00	544,997,500.00	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	610	90,800.00	55,388,000.00	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	3,686	10,500.00	38,703,000.00	
DAEWOO INTERNATIONAL CORP	1,431	28,800.00	41,212,800.00	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,340	25,800.00	60,372,000.00	
DOOSAN CORP	230	146,500.00	33,695,000.00	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	800	67,700.00	54,160,000.00	
DOOSAN INFRACORE CO LTD	2,030	17,850.00	36,235,500.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	910	93,800.00	85,358,000.00	
HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	1,595	18,050.00	28,789,750.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	1,110	72,300.00	80,253,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	915	275,000.00	251,625,000.00	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	245	116,500.00	28,542,500.00	
KCC CORP	120	287,000.00	34,440,000.00	
LG CORP	2,000	62,900.00	125,800,000.00	
LS CORP	650	78,900.00	51,285,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	2,210	70,000.00	154,700,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	835	211,000.00	176,185,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	3,690	29,750.00	109,777,500.00	
SAMSUNG TECHWIN CO LTD	841	54,100.00	45,498,100.00	
SK HOLDINGS CO LTD	450	128,000.00	57,600,000.00	
SK NETWORKS CO LTD	1,950	9,990.00	19,480,500.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	1,073	43,700.00	46,890,100.00	
STX PAN OCEAN CO LTD	2,670	5,970.00	15,939,900.00	
HANKOOK TIRE CO LTD	2,620	43,600.00	114,232,000.00	
HYUNDAI MOBIS	1,520	299,500.00	455,240,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	3,500	215,000.00	752,500,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	850	65,400.00	55,590,000.00	
KIA MOTORS CORPORATION	5,490	67,900.00	372,771,000.00	
MANDO CORP	450	206,000.00	92,700,000.00	
LG ELECTRONICS INC	2,545	75,400.00	191,893,000.00	
LG ELECTRONICS INC(N)	240	75,400.00	18,096,000.00	
WOONGJIN COWAY CO LTD	1,090	37,550.00	40,929,500.00	
KANGWON LAND INC	2,770	28,150.00	77,975,500.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	380	160,500.00	60,990,000.00	

LOTTE SHOPPING CO	215	340,000.00	73,100,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	167	247,000.00	41,249,000.00	

[次へ](#)

E-MART CO LTD	472	269,000.00	126,968,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	194	291,000.00	56,454,000.00	
KT&G CORP	3,295	83,300.00	274,473,500.00	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	25	1,750,000.00	43,750,000.00	
ORION CORP	80	664,000.00	53,120,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	90	1,111,000.00	99,990,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	250	518,000.00	129,500,000.00	
CELLTRION INC	2,000	35,400.00	70,800,000.00	
YUHAN CORPORATION	367	135,000.00	49,545,000.00	
BS FINANCIAL ROUP INC	4,549	11,150.00	50,721,350.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	4,140	13,150.00	54,441,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	5,700	37,050.00	211,185,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	4,640	13,050.00	60,552,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	8,805	37,250.00	327,986,250.00	
KOREA EXCHANGE BANK	6,540	7,870.00	51,469,800.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	9,040	41,450.00	374,708,000.00	
WOORI FINANCE HOLDINGS CO	5,950	9,650.00	57,417,500.00	
DAEWOO SECURITIES CO.	4,575	10,700.00	48,952,500.00	
HYUNDAI SECURITIES CO	3,610	8,670.00	31,298,700.00	
HYUNDAI SECURITIES CO-RTS	1,453	1.00	1,453.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	955	36,100.00	34,475,500.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	570	31,450.00	17,926,500.00	
SAMSUNG CARD CO	690	39,200.00	27,048,000.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,517	50,700.00	76,911,900.00	
WOORI INVESTMENT & SECURITIE	3,171	10,800.00	34,246,800.00	
DONGBU INSURANCE CO LTD	800	53,100.00	42,480,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	725	217,000.00	157,325,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	1,100	83,200.00	91,520,000.00	
NCSOFT CORPORATION	200	303,500.00	60,700,000.00	
NHN CORP	1,005	219,500.00	220,597,500.00	
SK C&C CO LTD	500	128,000.00	64,000,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	4,560	23,500.00	107,160,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,330	86,600.00	115,178,000.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	620	134,000.00	83,080,000.00	
KT CORP	2,127	38,150.00	81,145,050.00	
LG UPLUS CORP.	8,000	7,750.00	62,000,000.00	
SK TELECOM	990	153,500.00	151,965,000.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	7,390	26,400.00	195,096,000.00	
KOREA GAS CORPORATION	710	42,400.00	30,104,000.00	
HYNIX SEMICONDUCTOR INC	11,230	21,700.00	243,691,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	2,560	1,068,000.00	2,734,080,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	350	658,000.00	230,300,000.00	
韓国ウォン小計	185,702		13,006,806,953.00 (885,763,553)	
新台湾ドル				
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	20,080	96.10	1,929,688.00	
ASIA CEMENT CORP	54,105	33.40	1,807,107.00	
CHINA PETROCHEMICAL DEV CORP	66,000	27.80	1,834,800.00	
CHINA STEEL CORP	274,605	28.90	7,936,084.50	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	76,745	82.70	6,346,811.50	
FORMOSA PLASTICS CORP	87,408	85.10	7,438,420.80	
NAN YA PLASTICS CORP	134,857	58.80	7,929,591.60	
TAIWAN CEMENT	51,170	35.00	1,790,950.00	
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	20,000	69.90	1,398,000.00	

FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	95,622	34.00	3,251,148.00	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	6,000	262.50	1,575,000.00	
WALSIN LIHWA CORP	185,000	8.80	1,628,000.00	
EVERGREEN MARINE	44,769	14.80	662,581.20	
YANG MING MARINE TRANSPORT	52,443	11.10	582,117.30	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	56,100	66.70	3,741,870.00	
YULON MOTOR COMPANY	35,020	53.00	1,856,060.00	
POU CHEN	77,145	24.45	1,886,195.25	
TATUNG CO LTD	46,344	7.76	359,629.44	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	20,448	163.00	3,333,024.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	87,741	44.10	3,869,378.10	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	118,810	16.80	1,996,008.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	250,715	8.54	2,141,106.10	
CHINATRUST FINANCIAL HOLDING	220,757	19.15	4,227,496.55	
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	120,186	13.15	1,580,445.90	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	135,877	17.90	2,432,198.30	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	125,918	16.90	2,128,014.20	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C(N)	16,156	16.90	273,036.40	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	187,680	20.40	3,828,672.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	90,741	9.35	848,428.35	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	124,018	10.80	1,339,394.40	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	114,268	18.30	2,091,104.40	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	103,623	32.45	3,362,566.35	
KGI SECURITIES CO LTD	91,782	11.30	1,037,136.60	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	116,127	15.65	1,817,387.55	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	153,546	33.30	5,113,081.80	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	53,000	25.00	1,325,000.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	107,754	8.83	951,467.82	
ACER INC	59,680	35.00	2,088,800.00	
ADVANTECH CO LTD	10,968	82.00	899,376.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	15,797	215.50	3,404,253.50	
AU OPTRONICS CORP	173,994	13.75	2,392,417.50	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	15,405	147.50	2,272,237.50	
CHENG UEI PRECISION INDUSTRY	6,881	59.50	409,419.50	
CHIMEI INNOLUX CORP	125,061	12.55	1,569,515.55	
COMPAL ELECTRONICS	111,955	30.00	3,358,650.00	
DELTA ELECTRONICS INC	40,419	70.70	2,857,623.30	
E INK HOLDINGS INC	35,000	42.00	1,470,000.00	
EVERLIGHT ELECTRONICS CO LTD	11,749	54.00	634,446.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	20,145	95.50	1,923,847.50	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	211,849	82.90	17,562,282.10	
HTC CORP	17,011	513.00	8,726,643.00	
INVENTEC CO LTD	60,060	11.10	666,666.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	3,236	570.00	1,844,520.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	33,455	34.75	1,162,561.25	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	5,391	63.10	340,172.10	
PEGATRON CORP	34,854	32.75	1,141,468.50	
QUANTA COMPUTER INC	63,416	61.70	3,912,767.20	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	30,591	72.40	2,214,788.40	
TPK HOLDING CO LTD	2,100	377.50	792,750.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	21,000	36.15	759,150.00	
WINTEK CORP	51,696	21.65	1,119,218.40	
WISTRON CORP	41,747	38.90	1,623,958.30	
WPG HOLDINGS LTD	40,000	35.45	1,418,000.00	

CHUNGHWA TELECOM CO LTD	92,371	100.50	9,283,285.50	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	27,000	57.00	1,539,000.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	46,188	93.50	4,318,578.00	
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	128,772	26.90	3,463,966.80	
EPISTAR CORP	10,292	66.50	684,418.00	
INOTERA MEMORIES INC	78,440	4.56	357,686.40	
MACRONIX INTERNATIONAL	94,028	12.40	1,165,947.20	
MEDIATEK INC	22,530	281.50	6,342,195.00	
MOTECH INDUSTRIES INC	9,194	52.70	484,523.80	
MSTAR SEMICONDUCTOR INC	9,908	160.00	1,585,280.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	12,522	75.80	949,167.60	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	19,635	68.10	1,337,143.50	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	11,584	43.85	507,958.40	
RICHTEK TECHNOLOGY CORP	5,512	126.00	694,512.00	
SILICONWARE PRECISION INDS	92,082	26.85	2,472,401.70	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	532,355	75.40	40,139,567.00	
TRANSCEND INFORMATION INC	7,346	80.40	590,618.40	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	288,592	12.70	3,665,118.40	
新台湾ドル小計	6,354,371		243,795,900.71 (628,993,423)	
インドルピー				
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	3,200	506.50	1,620,800.00	
COAL INDIA LTD	9,000	299.95	2,699,550.00	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	25,460	262.00	6,670,520.00	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	28,346	746.40	21,157,454.40	
ACC LIMITED	1,330	1,139.05	1,514,936.50	
AMBUJA CEMENTS LIMITED	10,970	156.00	1,711,320.00	
ASIAN PAINTS LTD	1,000	2,663.25	2,663,250.00	
HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	29,280	121.75	3,564,840.00	
JINDAL STEEL & POWER LTD	13,500	486.30	6,565,050.00	
JSW STEEL LIMITED	2,000	512.95	1,025,900.00	
SESA GOA LTD	8,500	161.70	1,374,450.00	
STERLITE INDUSTRIES INDIA LT	24,600	91.55	2,252,130.00	
TATA STEEL LIMITED	5,416	347.30	1,880,976.80	
ADANI ENTERPRISES LTD	5,500	321.15	1,766,325.00	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	13,150	241.90	3,180,985.00	
JAIPRAKASH ASSOCIATES LTD	18,060	53.65	968,919.00	
LARSEN & TOUBRO LIMITED	4,220	1,008.85	4,257,347.00	
SIEMENS INDIA LIMITED	1,890	657.90	1,243,431.00	
MUNDRA PORT AND SEZ LTD	15,000	124.90	1,873,500.00	
BAJAJ AUTO LTD	2,400	1,598.55	3,836,520.00	
HERO MOTOCORP LTD	2,200	1,850.00	4,070,000.00	
MAHINDRA & MAHINDRA LIMITED	10,600	696.45	7,382,370.00	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,105	975.50	2,053,427.50	
TATA MOTORS LTD	31,500	184.95	5,825,925.00	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	12,780	117.90	1,506,762.00	
ITC LTD	50,510	204.00	10,304,040.00	
UNITED SPIRITS LIMITED	1,330	594.40	790,552.00	
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	15,520	411.70	6,389,584.00	
CIPLA LTD	7,650	330.60	2,529,090.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	1,740	1,589.60	2,765,904.00	
LUPIN LTD	5,200	427.90	2,225,080.00	
RANBAXY LABORATORIES LTD	4,755	405.65	1,928,865.75	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	5,500	498.75	2,743,125.00	
AXIS BANK LIMITED	6,160	879.95	5,420,492.00	

HDFC BANK LTD	30,275	437.55	13,246,826.25	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	26,575	660.90	17,563,417.50	
ICICI BANK LTD	15,265	721.75	11,017,513.75	
INDUSIND BANK LTD	9,000	239.60	2,156,400.00	
INFRASTRUCTURE DEV FINANCE	17,300	98.70	1,707,510.00	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	5,810	457.05	2,655,460.50	
RELIANCE CAPITAL LIMITED	3,510	246.00	863,460.00	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	4,000	444.95	1,779,800.00	
DLF LTD	4,900	193.95	950,355.00	
UNITECH LTD	40,000	19.85	794,000.00	
HCL TECHNOLOGIES LTD	7,300	389.45	2,842,985.00	
INFOSYS LTD	9,835	2,694.75	26,502,866.25	
TATA CONSULTANCY SVS LTD	12,050	1,157.15	13,943,657.50	
WIPRO LTD	12,166	406.00	4,939,396.00	
BHARTI AIRTEL LTD	10,000	330.65	3,306,500.00	
RELIANCE COMMUNICATION LTD	9,055	67.15	608,043.25	
GAIL INDIA LTD	10,875	391.15	4,253,756.25	
GMR INFRASTRUCTURE LTD	22,980	19.55	449,259.00	
NTPC LIMITED	13,850	158.30	2,192,455.00	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	28,300	101.25	2,865,375.00	
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	2,940	360.00	1,058,400.00	
RELIANCE POWER LTD	15,875	71.95	1,142,206.25	
TATA POWER CO LTD	26,000	88.05	2,289,300.00	
インドルピー小計	718,233		246,892,364.45 (367,869,623)	
チェココルナ				
KOMERCNI BANKA AS	360	3,265.00	1,175,400.00	
TELEFONICA CZECH REPUBLIC AS	1,925	374.10	720,142.50	
CEZ AS	4,130	769.00	3,175,970.00	
チェココルナ小計	6,415		5,071,512.50 (20,032,474)	
エジプトbond				
COMMERCIAL INTL BANK	7,500	19.61	147,075.00	
EGYPTIAN FINANCIAL GROUP	6,625	9.88	65,455.00	
MOBINIL-EGYPTIAN MOBILE SERV	1,570	80.55	126,463.50	
ORASCOM TELECOM HOLDING	60,000	2.98	178,800.00	
エジプトbond小計	75,695		517,793.50 (6,720,959)	
コロンビアペソ				
ECOPETROL SA	25,000	4,285.00	107,125,000.00	
CEMENTOS ARGOS SA	8,890	10,860.00	96,545,400.00	
INVERSIONES ARGOS SA	8,660	16,940.00	146,700,400.00	
ALMACENES EXITO SA	4,500	25,500.00	114,750,000.00	
CORP FINANCIERA COLOMBIANA	2,500	34,600.00	86,500,000.00	
GRUPO DE INV SURAMERICANA	4,500	32,300.00	145,350,000.00	
コロンビアペソ小計	54,050		696,970,800.00 (28,297,014)	
ハンガリーフォリント				
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	1,210	17,925.00	21,689,250.00	
RICHTER GEDEON NYRT.	320	35,750.00	11,440,000.00	
OTP BANK PLC	4,585	3,340.00	15,313,900.00	
MAGYAR TELEKOM TELECOMMUNICA	13,420	520.00	6,978,400.00	
ハンガリーフォリント小計	19,535		55,421,550.00 (18,383,328)	
モロッコディルハム				

DOUJA PROM ADDOHA	3,700	74.00	273,800.00	
モロッコデイルハム小計	3,700		273,800.00 (2,497,056)	
ポーランドズロチ				
GRUPA LOTOS SA	6,000	23.00	138,000.00	
POLISH OIL & GAS	37,985	4.10	155,738.50	
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	9,130	33.75	308,137.50	
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	1,200	87.50	105,000.00	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	3,910	115.00	449,650.00	
TVN SA	8,000	10.30	82,400.00	
BANK PEKAO SA	3,152	145.00	457,040.00	
BRE BANK SA	230	241.20	55,476.00	
GETIN HOLDING SA	9,300	7.25	67,425.00	
PKO BANK POLSKI SA	13,445	32.74	440,189.30	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	1,400	311.50	436,100.00	
GLOBE TRADE CENTRE SA	3,640	9.50	34,580.00	
ASSECO POLAND SA	2,400	48.50	116,400.00	
TELEKOMUNIKACJA POLSKA SA	14,105	17.20	242,606.00	
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	8,400	20.98	176,232.00	
TAURON POLSKA ENERGIA SA	37,000	5.14	190,180.00	
ポーランドズロチ小計	159,297		3,455,154.30 (79,192,136)	
南アフリカランド				
SASOL LTD	12,700	379.15	4,815,205.00	
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	1,800	170.00	306,000.00	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	1,660	534.00	886,440.00	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	8,570	352.88	3,024,181.60	
ARCELORMITTAL SOUTH AFRICA	4,451	68.75	306,006.25	
EXXARO RESOURCES LTD	3,510	167.99	589,644.90	
GOLD FIELDS LTD	15,090	130.49	1,969,094.10	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	11,200	99.99	1,119,888.00	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	10,280	166.17	1,708,227.60	
KUMBA IRON ORE LTD	1,680	505.00	848,400.00	
PRETORIA PORTLAND CEMENT CO	14,010	27.24	381,632.40	
SAPPI LIMITED	8,415	23.64	198,930.60	
AVENG LTD	15,626	32.80	512,532.80	
BARLOWORLD LTD	6,500	74.95	487,175.00	
BIDVEST GROUP LTD	6,122	157.00	961,154.00	
REUNERT LTD	6,010	62.70	376,827.00	
STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	25,460	22.85	581,761.00	
NASPERS LTD-N SHS	8,610	356.30	3,067,743.00	
FOSCHINI GROUP LTD/THE	6,775	105.00	711,375.00	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	3,655	125.05	457,057.75	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	13,420	74.77	1,003,413.40	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	21,905	39.50	865,247.50	
MASSMART HOLDINGS LTD	2,739	172.37	472,121.43	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	12,210	134.00	1,636,140.00	
SPAR GROUP LIMITED/THE	4,760	107.00	509,320.00	
TIGER BRANDS LTD	3,490	250.02	872,569.80	
NETCARE LTD	16,150	13.50	218,025.00	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	3,791	96.45	365,641.95	
ABSA GROUP LTD	6,900	140.20	967,380.00	
NEDBANK GROUP LTD	3,050	143.00	436,150.00	
STANDARD BANK GROUP LTD	29,616	97.75	2,894,964.00	
AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	18,069	33.85	611,635.65	

FIRSTRAND LTD	55,870	20.75	1,159,302.50	
INVESTEC LTD	6,500	44.20	287,300.00	
REMGRO LTD	8,040	119.18	958,207.20	
RMB HOLDINGS LTD	19,830	26.99	535,211.70	
DISCOVERY HOLDINGS LTD	9,400	43.50	408,900.00	
MMI HOLDINGS LTD	24,429	17.20	420,178.80	
RMI HOLDINGS LTD	19,830	13.70	271,671.00	
SANLAM LTD	41,835	28.90	1,209,031.50	
ARROWHEAD-A(N)	1,735	5.70	9,889.50	
ARROWHEAD-B(N)	1,735	4.25	7,373.75	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	41,000	19.04	780,640.00	
REDEFINE PROPERTIES LTD	55,000	7.44	409,200.00	
MTN GROUP LTD	39,515	140.50	5,551,857.50	
TELKOM SA LTD	3,035	29.10	88,318.50	
VODACOM GROUP LTD	9,035	88.50	799,597.50	
南アフリカランド小計	645,013		47,058,564.18 (449,409,287)	
トルコリラ				
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	3,470	39.20	136,024.00	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	28,268	3.37	95,263.16	
ENKA INSAAT VE SANAYI AS	13,748	4.48	61,591.04	
KOC HOLDING AS	11,547	5.84	67,434.48	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	2,200	52.00	114,400.00	
ANADOLU EFES BIRACILIK	5,581	23.50	131,153.50	
AKBANK T.A.S.	29,759	6.08	180,934.72	
TURKIYE GARANTI BANKASI	49,740	5.98	297,445.20	
TURKIYE HALK BANKASI	14,660	10.00	146,600.00	
TURKIYE IS BANKASI-C	39,904	3.36	134,077.44	
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	19,682	2.47	48,614.54	
YAPI VE KREDI BANKASI	18,033	2.71	48,869.43	
HACI OMER SABANCI HOLDING	13,753	5.60	77,016.80	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	17,056	9.06	154,527.36	
トルコリラ小計	267,401		1,693,951.67 (69,655,292)	
ユーロ				
MAROC TELECOM	3,890	12.60	49,014.00	
ユーロ小計	3,890		49,014.00 (4,984,233)	
合 計	39,272,449		5,815,806,450 (5,815,806,450)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
トルコリラ	投資証券	EMLAK KONUT GAYRIMEN	26,000	52,000.00	
	投資証券小計		26,000	52,000.00 (2,138,240)	
トルコリラ合計				52,000.00 (2,138,240)	
合計				2,138,240 (2,138,240)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 54銘柄	100.0%	—	9.7%
香港ドル	株式 121銘柄	100.0%	—	17.9%
マレーシアリングット	株式 28銘柄	100.0%	—	3.5%
タイバーツ	株式 15銘柄	100.0%	—	1.9%
フィリピンペソ	株式 11銘柄	100.0%	—	0.7%
インドネシアルピア	株式 20銘柄	100.0%	—	3.0%
メキシコペソ	株式 20銘柄	100.0%	—	4.4%
ブラジルレアル	株式 70銘柄	100.0%	—	13.6%
チリペソ	株式 13銘柄	100.0%	—	1.4%
韓国ウォン	株式 93銘柄	100.0%	—	15.2%
新台湾ドル	株式 81銘柄	100.0%	—	10.8%
インドルピー	株式 57銘柄	100.0%	—	6.3%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%	—	0.3%
エジプトポンド	株式 4銘柄	100.0%	—	0.1%
コロンビアペソ	株式 6銘柄	100.0%	—	0.5%
ハンガリーフォリント	株式 4銘柄	100.0%	—	0.3%
モロッコディルハム	株式 1銘柄	100.0%	—	0.0%
ポーランドズロチ	株式 16銘柄	100.0%	—	1.4%
南アフリカランド	株式 47銘柄	100.0%	—	7.7%
トルコリラ	株式 14銘柄	97.0%	—	1.2%
	投資証券 1銘柄	—	3.0%	0.0%
ユーロ	株式 1銘柄	100.0%	—	0.1%

第 2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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

日本債券インデックスマザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

科目	対象年月日	平成23年 6月27日現在	平成23年12月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		9,881,807	29,463,861
国債証券		26,191,340,001	23,790,430,958
地方債証券		2,406,780,000	2,203,577,000
特殊債券		3,321,254,000	2,908,494,000
社債券		2,653,474,610	2,442,649,000
未収入金		42,187,200	52,844,000
未収利息		89,013,001	85,747,636
前払費用		1,918,075	785,294
流動資産合計		34,715,848,694	31,513,991,749
資産合計		34,715,848,694	31,513,991,749
負債の部			
流動負債			
未払解約金		27,420,723	69,826,076
流動負債合計		27,420,723	69,826,076
負債合計		27,420,723	69,826,076
純資産の部			
元本等			
元本		28,499,109,276	25,505,096,699
剰余金			
剰余金又は欠損金 ()		6,189,318,695	5,939,068,974
元本等合計		34,688,427,971	31,444,165,673
純資産合計		34,688,427,971	31,444,165,673
負債純資産合計		34,715,848,694	31,513,991,749

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

(追加情報)

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

(貸借対照表に関する注記)

平成23年 6月27日現在		平成23年12月26日現在	
1. 期首	平成22年12月28日	1. 期首	平成23年 6月28日
期首元本額	30,555,097,434円	期首元本額	28,499,109,276円
期首からの追加設定元本額	1,121,446,177円	期首からの追加設定元本額	701,911,166円
期首からの一部解約元本額	3,177,434,335円	期首からの一部解約元本額	3,695,923,743円
平成23年 6月27日現在の元本の内訳		平成23年12月26日現在の元本の内訳	
DCインデックスバランス（株式20）	419,592,375円	DCインデックスバランス（株式20）	433,779,221円
DCインデックスバランス（株式40）	523,368,928円	DCインデックスバランス（株式40）	514,499,536円
DCインデックスバランス（株式60）	375,006,026円	DCインデックスバランス（株式60）	355,216,143円
DCインデックスバランス（株式80）	62,268,175円	DCインデックスバランス（株式80）	58,783,151円
インデックスファンド日本債券（DC専用）	910,897,738円	インデックスファンド日本債券（DC専用）	965,841,252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	10,272,290,028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	8,013,778,786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	10,066,311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	9,112,432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）	109,802,521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）	106,928,217円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	8,380,323円	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	7,462,433円

アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	52,268,038円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	45,492,795円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	223,930,770円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	198,485,197円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	822,240,543円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	750,073,638円
国際分散型ファンド40 (適格機関投資家向け)	8,043,615,297円	国際分散型ファンド40 (適格機関投資家向け)	7,152,589,710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)	143,334,341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)	119,565,483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)	217,168,311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)	199,022,072円
3資産バランスファンド (適格機関投資家向け)	48,473,384円	3資産バランスファンド (適格機関投資家向け)	39,958,345円
グローバルバランスファ ンド35(適格機関投資家 向け)	34,512,963円	グローバルバランスファ ンド35(適格機関投資家 向け)	31,065,660円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式20)	852,830,737円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式20)	858,597,619円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式40)	781,690,508円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式40)	764,257,456円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式60)	380,632,450円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式60)	365,528,784円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式80)	57,215,440円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式80)	53,191,284円
年金積立 インデックス ファンド日本債券	4,040,451,073円	年金積立 インデックス ファンド日本債券	4,343,026,538円
日本債券インデックス ファンド(個人型年金向 け)	109,072,996円	日本債券インデックス ファンド(個人型年金向 け)	118,840,947円
計	28,499,109,276円	計	25,505,096,699円
2. 本報告書における開示対 象ファンドの当特定期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	28,499,109,276口	2. 本報告書における開示対 象ファンドの当特定期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	25,505,096,699口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 平成22年12月28日 至 平成23年 6月27日	自 平成23年 6月28日 至 平成23年12月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成23年 6月27日現在	平成23年12月26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

[次へ](#)

（有価証券に関する注記）

（平成23年6月27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	222,101,270
地方債証券	22,320,000
特殊債券	26,898,000
社債券	71,644,000
合計	342,963,270

（平成23年12月26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	19,989,050
地方債証券	2,038,000
特殊債券	2,689,000
社債券	9,153,000
合計	24,415,050

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成23年 6月27日現在		平成23年12月26日現在	
1口当たり純資産額	1.2172円	1口当たり純資産額	1.2329円
（1万口当たり純資産額）	（12,172円）	（1万口当たり純資産額）	（12,329円）

（3）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 0 1 回利付国債（2年）	70,000,000	70,058,800	
	第3 0 2 回利付国債（2年）	120,000,000	120,108,000	
	第3 0 4 回利付国債（2年）	70,000,000	70,071,400	
	第3 0 7 回利付国債（2年）	40,000,000	40,048,400	
	第3 0 8 回利付国債（2年）	220,000,000	219,905,400	
	第3 1 0 回利付国債（2年）	40,000,000	40,056,000	
	第6 8 回利付国債（5年）	170,000,000	171,621,970	
	第6 9 回利付国債（5年）	633,000,000	637,813,194	
	第7 0 回利付国債（5年）	227,000,000	228,881,830	
	第7 1 回利付国債（5年）	45,000,000	45,647,550	
	第7 2 回利付国債（5年）	30,000,000	30,609,000	

第74回利付国債（5年）	57,000,000	57,737,580	
第75回利付国債（5年）	176,000,000	178,970,880	
第76回利付国債（5年）	138,000,000	140,554,380	
第78回利付国債（5年）	113,000,000	114,725,510	
第79回利付国債（5年）	143,000,000	144,620,190	
第81回利付国債（5年）	494,000,000	501,217,340	
第83回利付国債（5年）	62,000,000	63,138,320	
第84回利付国債（5年）	27,000,000	27,362,610	
第85回利付国債（5年）	47,000,000	47,675,860	
第87回利付国債（5年）	20,000,000	20,183,400	
第88回利付国債（5年）	225,000,000	227,049,750	
第89回利付国債（5年）	210,000,000	211,192,800	
第90回利付国債（5年）	50,000,000	50,111,500	
第91回利付国債（5年）	80,000,000	80,428,000	
第92回利付国債（5年）	15,000,000	15,024,900	
第93回利付国債（5年）	300,000,000	302,652,000	
第94回利付国債（5年）	70,000,000	70,894,600	
第95回利付国債（5年）	220,000,000	222,796,200	
第97回利付国債（5年）	220,000,000	220,873,400	
第98回利付国債（5年）	55,000,000	54,975,250	
第99回利付国債（5年）	150,000,000	150,487,500	
第100回利付国債（5年）	50,000,000	49,941,500	
第2回利付国債（40年）	205,000,000	210,381,250	
第4回利付国債（40年）	30,000,000	30,612,000	
第245回利付国債（10年）	160,000,000	161,216,604	
第247回利付国債（10年）	17,000,000	17,140,930	
第250回利付国債（10年）	285,000,000	286,593,150	
第251回利付国債（10年）	227,000,000	229,603,690	
第252回利付国債（10年）	228,000,000	230,950,320	
第253回利付国債（10年）	35,000,000	35,892,150	
第254回利付国債（10年）	52,000,000	53,146,080	
第256回利付国債（10年）	88,000,000	90,201,760	
第258回利付国債（10年）	40,000,000	41,027,600	
第259回利付国債（10年）	7,000,000	7,210,840	
第261回利付国債（10年）	270,000,000	280,945,800	
第262回利付国債（10年）	85,000,000	88,655,000	
第264回利付国債（10年）	141,000,000	146,087,280	
第265回利付国債（10年）	100,000,000	103,875,000	
第266回利付国債（10年）	118,000,000	122,223,220	
第268回利付国債（10年）	361,000,000	375,902,080	
第269回利付国債（10年）	90,000,000	93,139,200	
第270回利付国債（10年）	88,000,000	91,244,560	
第271回利付国債（10年）	146,000,000	150,880,780	
第272回利付国債（10年）	178,000,000	185,556,100	
第273回利付国債（10年）	111,000,000	116,121,540	
第274回利付国債（10年）	73,000,000	76,531,010	
第276回利付国債（10年）	35,000,000	36,830,850	
第278回利付国債（10年）	80,000,000	85,037,600	
第279回利付国債（10年）	70,000,000	75,007,800	

第 2 8 0 回利付国債（ 1 0 年 ）	156,000,000	167,018,280	
第 2 8 1 回利付国債（ 1 0 年 ）	182,000,000	195,659,100	
第 2 8 2 回利付国債（ 1 0 年 ）	274,000,000	291,601,760	
第 2 8 3 回利付国債（ 1 0 年 ）	50,000,000	53,445,000	
第 2 8 4 回利付国債（ 1 0 年 ）	107,000,000	114,118,710	
第 2 8 5 回利付国債（ 1 0 年 ）	216,000,000	230,834,880	
第 2 8 6 回利付国債（ 1 0 年 ）	156,000,000	167,877,840	
第 2 8 7 回利付国債（ 1 0 年 ）	35,000,000	37,852,500	
第 2 8 8 回利付国債（ 1 0 年 ）	18,000,000	19,304,460	
第 2 8 9 回利付国債（ 1 0 年 ）	254,000,000	269,753,080	
第 2 9 0 回利付国債（ 1 0 年 ）	446,000,000	471,355,100	
第 2 9 1 回利付国債（ 1 0 年 ）	287,000,000	301,579,600	
第 2 9 2 回利付国債（ 1 0 年 ）	241,000,000	259,075,000	
第 2 9 3 回利付国債（ 1 0 年 ）	96,000,000	103,923,840	
第 2 9 4 回利付国債（ 1 0 年 ）	32,000,000	34,440,320	
第 2 9 5 回利付国債（ 1 0 年 ）	13,000,000	13,828,230	
第 2 9 6 回利付国債（ 1 0 年 ）	176,000,000	187,269,280	
第 2 9 7 回利付国債（ 1 0 年 ）	148,000,000	156,502,600	
第 2 9 8 回利付国債（ 1 0 年 ）	221,000,000	232,211,330	
第 2 9 9 回利付国債（ 1 0 年 ）	750,000,000	787,972,500	
第 3 0 0 回利付国債（ 1 0 年 ）	31,000,000	33,022,440	
第 3 0 1 回利付国債（ 1 0 年 ）	148,000,000	157,526,760	
第 3 0 2 回利付国債（ 1 0 年 ）	29,000,000	30,659,380	
第 3 0 3 回利付国債（ 1 0 年 ）	361,000,000	381,057,160	
第 3 0 5 回利付国債（ 1 0 年 ）	358,000,000	374,647,000	
第 3 0 6 回利付国債（ 1 0 年 ）	115,000,000	120,975,400	
第 3 0 8 回利付国債（ 1 0 年 ）	140,000,000	145,959,800	
第 3 0 9 回利付国債（ 1 0 年 ）	59,000,000	60,524,560	
第 3 1 0 回利付国債（ 1 0 年 ）	268,000,000	272,038,760	
第 3 1 1 回利付国債（ 1 0 年 ）	93,000,000	92,848,410	
第 3 1 2 回利付国債（ 1 0 年 ）	15,000,000	15,437,700	
第 3 1 3 回利付国債（ 1 0 年 ）	340,000,000	352,029,200	
第 3 1 5 回利付国債（ 1 0 年 ）	85,000,000	87,074,000	
第 3 1 6 回利付国債（ 1 0 年 ）	35,000,000	35,533,400	
第 3 1 7 回利付国債（ 1 0 年 ）	165,000,000	167,202,750	
第 3 1 8 回利付国債（ 1 0 年 ）	150,000,000	150,600,000	
第 1 4 回利付国債（ 3 0 年 ）	208,000,000	230,923,680	
第 1 5 回利付国債（ 3 0 年 ）	162,000,000	183,072,960	
第 2 3 回利付国債（ 3 0 年 ）	55,000,000	62,281,450	
第 2 4 回利付国債（ 3 0 年 ）	158,000,000	178,758,040	
第 2 6 回利付国債（ 3 0 年 ）	140,000,000	155,650,600	
第 2 7 回利付国債（ 3 0 年 ）	134,000,000	151,827,360	
第 2 8 回利付国債（ 3 0 年 ）	54,000,000	61,224,120	
第 2 9 回利付国債（ 3 0 年 ）	246,000,000	273,869,340	
第 3 0 回利付国債（ 3 0 年 ）	127,000,000	138,600,180	
第 3 1 回利付国債（ 3 0 年 ）	20,000,000	21,361,000	
第 3 2 回利付国債（ 3 0 年 ）	40,000,000	43,498,400	
第 3 3 回利付国債（ 3 0 年 ）	50,000,000	50,976,500	
第 3 4 回利付国債（ 3 0 年 ）	110,000,000	116,748,500	

第 3 5 回利付国債（ 3 0 年）	40,000,000	40,605,200	
第 2 3 回利付国債（ 2 0 年）	100,000,000	109,266,000	
第 2 6 回利付国債（ 2 0 年）	37,000,000	41,350,090	
第 2 7 回利付国債（ 2 0 年）	16,000,000	18,098,560	
第 2 9 回利付国債（ 2 0 年）	110,000,000	126,097,400	
第 3 1 回利付国債（ 2 0 年）	40,000,000	45,377,600	
第 3 3 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	232,564,000	
第 3 4 回利付国債（ 2 0 年）	85,000,000	98,832,050	
第 3 7 回利付国債（ 2 0 年）	63,000,000	72,562,140	
第 3 9 回利付国債（ 2 0 年）	86,000,000	97,219,560	
第 4 1 回利付国債（ 2 0 年）	27,000,000	28,751,490	
第 4 2 回利付国債（ 2 0 年）	178,000,000	203,416,620	
第 4 3 回利付国債（ 2 0 年）	73,000,000	85,334,080	
第 4 4 回利付国債（ 2 0 年）	51,000,000	58,113,990	
第 4 7 回利付国債（ 2 0 年）	21,000,000	23,436,840	
第 4 8 回利付国債（ 2 0 年）	99,000,000	113,050,080	
第 4 9 回利付国債（ 2 0 年）	57,000,000	63,069,360	
第 5 0 回利付国債（ 2 0 年）	237,000,000	257,960,280	
第 5 1 回利付国債（ 2 0 年）	39,000,000	42,820,440	
第 5 4 回利付国債（ 2 0 年）	15,000,000	16,746,600	
第 5 5 回利付国債（ 2 0 年）	66,000,000	72,390,780	
第 5 7 回利付国債（ 2 0 年）	137,000,000	148,829,950	
第 5 8 回利付国債（ 2 0 年）	135,000,000	146,556,000	
第 5 9 回利付国債（ 2 0 年）	33,000,000	35,110,680	
第 6 0 回利付国債（ 2 0 年）	545,000,000	562,663,450	
第 6 1 回利付国債（ 2 0 年）	27,000,000	26,690,040	
第 6 3 回利付国債（ 2 0 年）	31,000,000	33,210,610	
第 6 4 回利付国債（ 2 0 年）	54,000,000	58,335,120	
第 6 5 回利付国債（ 2 0 年）	140,000,000	151,051,600	
第 6 6 回利付国債（ 2 0 年）	34,000,000	36,306,900	
第 6 7 回利付国債（ 2 0 年）	54,000,000	58,183,920	
第 6 8 回利付国債（ 2 0 年）	38,000,000	42,207,740	
第 7 0 回利付国債（ 2 0 年）	49,000,000	55,469,960	
第 7 2 回利付国債（ 2 0 年）	42,000,000	46,071,060	
第 7 3 回利付国債（ 2 0 年）	13,000,000	14,080,560	
第 7 4 回利付国債（ 2 0 年）	78,000,000	85,449,780	
第 7 6 回利付国債（ 2 0 年）	206,000,000	220,317,000	
第 8 8 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	333,699,000	
第 9 0 回利付国債（ 2 0 年）	156,000,000	171,445,560	
第 9 1 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	222,246,000	
第 9 2 回利付国債（ 2 0 年）	210,000,000	227,633,700	
第 9 4 回利付国債（ 2 0 年）	100,000,000	108,240,000	
第 9 5 回利付国債（ 2 0 年）	182,000,000	201,805,240	
第 9 6 回利付国債（ 2 0 年）	98,000,000	105,916,440	
第 9 7 回利付国債（ 2 0 年）	195,000,000	213,181,800	
第 9 8 回利付国債（ 2 0 年）	44,000,000	47,479,960	
第 9 9 回利付国債（ 2 0 年）	97,000,000	104,500,040	
第 1 0 0 回利付国債（ 2 0 年）	140,000,000	152,586,000	
第 1 0 1 回利付国債（ 2 0 年）	96,000,000	107,412,480	

	第102回利付国債（20年）	106,000,000	118,522,840	
	第103回利付国債（20年）	11,000,000	12,146,310	
	第104回利付国債（20年）	33,000,000	35,451,570	
	第105回利付国債（20年）	82,000,000	87,990,100	
	第106回利付国債（20年）	142,000,000	154,464,760	
	第107回利付国債（20年）	30,000,000	32,152,500	
	第108回利付国債（20年）	134,000,000	139,645,420	
	第109回利付国債（20年）	119,000,000	123,819,500	
	第110回利付国債（20年）	148,000,000	158,417,720	
	第111回利付国債（20年）	90,000,000	97,573,500	
	第113回利付国債（20年）	20,000,000	21,351,400	
	第114回利付国債（20年）	52,000,000	55,436,160	
	第116回利付国債（20年）	185,000,000	199,953,550	
	第117回利付国債（20年）	30,000,000	31,958,400	
	第118回利付国債（20年）	70,000,000	73,364,200	
	第119回利付国債（20年）	50,000,000	50,845,500	
	第120回利付国債（20年）	70,000,000	68,966,800	
	第121回利付国債（20年）	22,000,000	22,689,260	
	第122回利付国債（20年）	80,000,000	81,193,600	
	第123回利付国債（20年）	55,000,000	58,449,600	
	第124回利付国債（20年）	50,000,000	52,302,000	
	第125回利付国債（20年）	80,000,000	86,294,400	
	第126回利付国債（20年）	25,000,000	26,143,250	
	第128回利付国債（20年）	20,000,000	20,570,000	
	第129回利付国債（20年）	20,000,000	20,248,000	
	第130回利付国債（20年）	80,000,000	80,882,400	
	第131回利付国債（20年）	25,000,000	24,853,000	
	国債証券 合計	22,564,000,000	23,790,430,958	
地方債証券	第597回東京都公募公債	100,000,000	100,587,000	
	第598回東京都公募公債	100,000,000	100,476,000	
	第636回東京都公募公債	100,000,000	107,414,000	
	第682回東京都公募公債	100,000,000	104,087,000	
	第1回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	113,701,000	
	第123回神奈川県公募公債	100,000,000	102,496,000	
	第1回大阪府公募公債（7年）	100,000,000	102,564,000	
	第261回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,445,000	
	平成19年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	107,595,000	
	平成15年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	102,209,000	
	平成19年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	107,027,000	
	平成21年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	104,598,000	
	平成18年度第1回広島県公募公債	100,000,000	107,874,000	
	平成16年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	102,983,000	
	平成16年度第3回千葉県公募公債	100,000,000	104,407,000	
	平成17年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	103,521,000	
	第55回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,751,000	
	第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,043,000	
	平成16年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	103,639,000	
	第12回め号名古屋市長公募公債	100,000,000	104,011,000	

	平成18年度第1回鹿児島県公募公債 (10年)	100,000,000	107,149,000	
地方債証券 合計		2,100,000,000	2,203,577,000	
特殊債券	第5回政府保証株式会社日本政策投資 銀行社債	100,000,000	105,463,000	
	第21回政府保証日本政策投資銀行債 券	100,000,000	106,621,000	
	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,788,000	
	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	107,747,000	
	第332回政府保証道路債券	100,000,000	103,542,000	
	第335回政府保証道路債券	100,000,000	103,481,000	
	第336回政府保証道路債券	100,000,000	103,564,000	
	第338回政府保証道路債券	100,000,000	104,028,000	
	第343回政府保証道路債券	100,000,000	103,579,000	
	第4回政府保証地方公営企業等金融機 構債券	100,000,000	104,794,000	
	第12回公営企業債券	100,000,000	103,409,000	
	第20回公営企業債券	100,000,000	107,234,000	
	第858回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,702,000	
	第199回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	104,052,000	
	第176回政府保証中小企業債券	100,000,000	102,477,000	
	第25回国際協力銀行債券	100,000,000	106,743,000	
	第14回政府保証国民生活債券	100,000,000	103,499,000	
	第8回農林漁業金融公庫債券	200,000,000	207,040,000	
	第3回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	102,906,000	
	第5回沖縄振興開発金融公庫債券	200,000,000	206,396,000	
	い第709号農林債	100,000,000	101,969,000	
	い第714号農林債	100,000,000	101,486,000	
	い第722号農林債	100,000,000	100,383,000	
	第227回信金中金債(5年)	100,000,000	102,128,000	
	第231回信金中金債(5年)	100,000,000	102,351,000	
	第234回信金中金債(5年)	100,000,000	102,112,000	
特殊債券 合計		2,800,000,000	2,908,494,000	

社債券	第324回東京交通債券	100,000,000	114,555,000	
	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	99,702,000	
	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	98,122,000	
	第32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	104,555,000	
	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	100,531,000	
	第16回太平洋セメント株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	101,257,000	
	第49回新日本製鐵株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,831,000	
	第20回三菱マテリアル株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	101,809,000	
	第15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	104,640,000	
	第15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	104,271,000	
	第11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	102,376,000	
	第17回三菱重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	100,685,000	
	第26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	106,931,000	
	第65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	100,570,000	
	第31回東日本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	102,914,000	
	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	108,132,000	
	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	111,914,000	
	第47回日本電信電話株式会社電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	100,799,000	
	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	104,543,000	
	第510回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	85,410,000	
	第523回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	71,279,000	
	第461回中部電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,668,000	
	第306回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	113,558,000	
	第257回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,597,000	
社債券 合計		2,400,000,000	2,442,649,000	
合計		29,864,000,000	31,345,150,958	

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。

5. 「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」の状況
 なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

科目	対象年月日	平成23年 6月27日現在	平成23年12月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		220,050,708	641,088,096
コール・ローン		42,064,416	30,727,370
国債証券		522,838,443,572	423,993,365,988
派生商品評価勘定		1,705,810	2,537,810
未収入金		437,529,341	1,069,856,566
未収利息		7,247,073,919	5,693,775,049
前払費用		326,242,906	170,165,953
流動資産合計		531,113,110,672	431,601,516,832
資産合計		531,113,110,672	431,601,516,832
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,280,730	552,643
未払解約金		295,966,428	1,270,404,207
流動負債合計		297,247,158	1,270,956,850
負債合計		297,247,158	1,270,956,850
純資産の部			
元本等			
元本		365,939,902,714	306,595,905,696
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		164,875,960,800	123,734,654,286
元本等合計		530,815,863,514	430,330,559,982
純資産合計		530,815,863,514	430,330,559,982
負債純資産合計		531,113,110,672	431,601,516,832

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

[次へ](#)

（追加情報）

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

（貸借対照表に関する注記）

平成23年 6月27日現在		平成23年12月26日現在	
1. 期首	平成22年12月28日	1. 期首	平成23年 6月28日
期首元本額	404,950,204,845円	期首元本額	365,939,902,714円
期首からの追加設定元本額	5,967,548,513円	期首からの追加設定元本額	1,001,421,177円
期首からの一部解約元本額	44,977,850,644円	期首からの一部解約元本額	60,345,418,195円
平成23年 6月27日現在の元本の内訳		平成23年12月26日現在の元本の内訳	
インデックスファンド海外債券ヘッジなし（DC専用）	9,388,117,713円	インデックスファンド海外債券ヘッジなし（DC専用）	9,702,643,803円
DCインデックスバランス（株式20）	53,575,808円	DCインデックスバランス（株式20）	58,638,904円
DCインデックスバランス（株式40）	96,519,154円	DCインデックスバランス（株式40）	101,260,889円
DCインデックスバランス（株式60）	124,001,210円	DCインデックスバランス（株式60）	125,653,823円
DCインデックスバランス（株式80）	103,167,894円	DCインデックスバランス（株式80）	103,136,473円
財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	211,019,559,939円	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	172,202,057,451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	8,581,449,546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	7,036,966,702円
日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	116,448,875,324円	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	99,089,247,134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	51,796,189円	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	49,758,961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）	1,467,679,641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）	1,411,087,492円
財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	8,752,582円	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	10,492,563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）	76,005,988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）	76,715,712円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	6,960,600円	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	6,549,782円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	8,710,624円	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	8,012,496円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	20,735,711円	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	19,376,447円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	52,769,009円	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	50,611,339円

世界国債インデックス ファンド（適格機関投資 家向け）	2,686,860,273円	世界国債インデックス ファンド（適格機関投資 家向け）	1,387,686,464円
国際分散型ファンド40 （適格機関投資家向け）	2,193,196,125円	国際分散型ファンド40 （適格機関投資家向け）	2,090,372,311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）	166,154,164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）	147,157,497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）	205,481,413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）	199,949,809円
3資産バランスファンド （適格機関投資家向け）	38,834,570円	3資産バランスファンド （適格機関投資家向け）	35,721,062円
グローバルバランスファ ンド35（適格機関投資家 向け）	64,122,725円	グローバルバランスファ ンド35（適格機関投資家 向け）	61,049,211円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式20）	54,800,845円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド （株式20）	58,405,763円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式40）	72,302,549円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド （株式40）	74,743,012円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式60）	63,463,981円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド （株式60）	63,978,820円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式80）	47,337,633円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド （株式80）	46,690,217円
年金積立 インデックス ファンド海外債券（ヘッ ジなし）	12,626,856,816円	年金積立 インデックス ファンド海外債券（ヘッ ジなし）	12,154,123,816円
海外債券インデックス ファンド（個人型年金向 け）	211,814,688円	海外債券インデックス ファンド（個人型年金向 け）	223,817,743円
計	365,939,902,714円	計	306,595,905,696円
2. 本報告書における開示対 象ファンドの当特定期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	365,939,902,714口	2. 本報告書における開示対 象ファンドの当特定期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	306,595,905,696口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 平成22年12月28日 至 平成23年 6月27日	自 平成23年 6月28日 至 平成23年12月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成23年 6月27日現在	平成23年12月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（平成23年6月27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	17,864,368,270
合計	17,864,368,270

（平成23年12月26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	2,723,194,650
合計	2,723,194,650

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（平成23年6月27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	588,086,130	—	587,661,050	425,080
	米ドル	173,445,297	—	173,806,000	360,703
	メキシコペソ	201,904,063	—	202,824,090	920,027
	ポーランドズロチ	28,673,570	—	28,518,960	154,610
	ユーロ	184,063,200	—	182,512,000	1,551,200
合計		588,086,130	—	587,661,050	425,080

（平成23年12月26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	1,705,447,407	—	1,703,462,240	1,985,167
	米ドル	775,889,233	—	775,580,940	308,293
	シンガポールドル	36,031,800	—	36,162,000	130,200
	ノルウェークローネ	32,540,521	—	32,208,800	331,721
	デンマーククローネ	34,619,494	—	34,500,960	118,534
	ポーランドズロチ	45,982,238	—	46,140,740	158,502
	ユーロ	780,384,121	—	778,868,800	1,515,321
合計		1,705,447,407	—	1,703,462,240	1,985,167

（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23年 6月27日現在		平成23年12月26日現在	
1口当たり純資産額	1.4506円	1口当たり純資産額	1.4036円
（1万口当たり純資産額）	（14,506円）	（1万口当たり純資産額）	（14,036円）

（3）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-3.5%-13/05/31	22,900,000	23,975,226.56	
		US TREASURY N/B-4.25%-13/11/15	22,000,000	23,629,375.00	
		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	6,000,000	6,840,937.50	
		US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	10,500,000	13,277,578.12	
		US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	20,300,000	27,179,796.87	
		US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	19,500,000	24,143,437.50	
		US TREASURY N/B-1.375%-13/03/15	10,000,000	10,137,500.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-13/03/31	12,800,000	13,163,000.00	
		US TREASURY N/B-1.75%-13/04/15	13,200,000	13,455,750.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-16/09/30	10,700,000	11,728,203.12	
		US TREASURY N/B-5.125%-16/05/15	27,000,000	32,007,656.25	
		US TREASURY N/B-3.125%-16/10/31	11,900,000	13,121,609.37	
		US TREASURY N/B-1.125%-13/06/15	9,500,000	9,616,523.43	
		US TREASURY N/B-3.375%-13/06/30	31,650,000	33,141,011.71	
		US TREASURY N/B-1.0%-13/07/15	8,500,000	8,593,632.81	
		US TREASURY N/B-3.375%-13/07/31	12,500,000	13,121,093.75	
		US TREASURY N/B-4.25%-13/08/15	34,400,000	36,619,875.00	
		US TREASURY N/B-3.125%-13/08/31	41,100,000	43,058,671.87	
		US TREASURY N/B-3.125%-13/09/30	27,400,000	28,763,578.12	
		US TREASURY N/B-4.75%-17/08/15	22,000,000	26,382,812.50	
		US TREASURY N/B-3.625%-13/05/15	43,200,000	45,225,000.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-12/12/31	29,800,000	30,838,343.75	
		US TREASURY N/B-2.5%-17/06/30	15,200,000	16,347,125.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-17/05/31	11,100,000	12,081,656.25	
		US TREASURY N/B-8.75%-17/05/15	8,000,000	11,250,000.00	
		US TREASURY N/B-4.5%-17/05/15	14,100,000	16,633,593.75	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/04/30	7,000,000	7,752,500.00	
		US TREASURY N/B-3.25%-17/03/31	14,200,000	15,813,031.25	
		US TREASURY N/B-3.0%-17/02/28	5,400,000	5,940,843.75	
		US TREASURY N/B-4.625%-17/02/15	13,250,000	15,657,773.43	
		US TREASURY N/B-3.0%-16/08/31	9,800,000	10,741,718.75	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/12/31	13,400,000	14,882,375.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-13/11/30	21,900,000	22,613,460.93	
		US TREASURY N/B-1.375%-13/01/15	20,600,000	20,854,281.25	
		US TREASURY N/B-2.875%-13/01/31	10,000,000	10,292,968.75	
		US TREASURY N/B-1.375%-13/02/15	21,100,000	21,376,937.50	
		US TREASURY N/B-3.875%-13/02/15	17,050,000	17,761,304.68	
		US TREASURY N/B-2.75%-13/02/28	10,900,000	11,224,445.31	
		US TREASURY N/B-2.75%-16/11/30	1,600,000	1,737,500.00	
		US TREASURY N/B-7.5%-16/11/15	10,200,000	13,411,406.25	
		US TREASURY N/B-4.625%-16/11/15	15,000,000	17,610,937.50	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/01/31	10,400,000	11,500,125.00	
		US TREASURY N/B-4.5%-15/11/15	30,400,000	34,808,000.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-13/10/31	10,500,000	10,975,781.25	
		US TREASURY N/B-2.5%-15/04/30	15,000,000	15,963,281.25	
		US TREASURY N/B-4.125%-15/05/15	23,100,000	25,828,687.50	
		US TREASURY N/B-2.125%-15/05/31	14,300,000	15,040,695.31	
		US TREASURY N/B-1.875%-15/06/30	11,000,000	11,478,671.87	

US TREASURY N/B-1.75%-15/07/31	3,000,000	3,117,187.50	
US TREASURY N/B-6.125%-29/08/15	5,600,000	8,321,250.00	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	7,100,000	10,764,265.62	
US TREASURY N/B-2.375%-15/02/28	19,600,000	20,760,687.50	
US TREASURY N/B-4.25%-15/08/15	37,200,000	42,018,562.50	
US TREASURY N/B-4.0%-15/02/15	17,000,000	18,848,750.00	
US TREASURY N/B-4.5%-16/02/15	33,500,000	38,603,515.62	
US TREASURY N/B-2.625%-16/02/29	8,700,000	9,370,171.87	
US TREASURY N/B-2.375%-16/03/31	9,200,000	9,816,687.50	
US TREASURY N/B-2.625%-16/04/30	6,800,000	7,324,875.00	
US TREASURY N/B-3.25%-16/07/31	24,200,000	26,771,250.00	
US TREASURY N/B-3.25%-16/06/30	11,000,000	12,155,000.00	
US TREASURY N/B-3.25%-16/05/31	10,600,000	11,709,687.50	
US TREASURY N/B-7.25%-16/05/15	9,000,000	11,512,968.75	
US TREASURY N/B-4.875%-16/08/15	12,000,000	14,178,750.00	
US TREASURY N/B-4.25%-14/08/15	13,000,000	14,304,062.50	
US TREASURY N/B-1.5%-13/12/31	16,600,000	17,000,734.37	
US TREASURY N/B-1.75%-14/01/31	13,800,000	14,212,921.87	
US TREASURY N/B-4.0%-14/02/15	36,280,000	39,131,381.25	
US TREASURY N/B-1.875%-14/02/28	11,300,000	11,676,960.93	
US TREASURY N/B-1.75%-14/03/31	9,700,000	10,003,125.00	
US TREASURY N/B-1.875%-14/04/30	4,000,000	4,139,375.00	
US TREASURY N/B-4.75%-14/05/15	30,550,000	33,710,015.62	
US TREASURY N/B-2.25%-14/05/31	6,600,000	6,895,453.12	
US TREASURY N/B-2.5%-15/03/31	12,500,000	13,301,757.81	
US TREASURY N/B-2.625%-14/07/31	17,000,000	17,980,156.25	
US TREASURY N/B-3.125%-13/04/30	14,600,000	15,164,609.37	
US TREASURY N/B-2.375%-14/08/31	24,000,000	25,258,125.00	
US TREASURY N/B-2.375%-14/09/30	23,100,000	24,343,429.68	
US TREASURY N/B-2.375%-14/10/31	21,200,000	22,361,031.25	
US TREASURY N/B-4.25%-14/11/15	22,800,000	25,293,750.00	
US TREASURY N/B-2.125%-14/11/30	10,700,000	11,219,953.12	
US TREASURY N/B-2.625%-14/12/31	18,000,000	19,161,562.50	
US TREASURY N/B-2.25%-15/01/31	16,800,000	17,718,750.00	
US TREASURY N/B-11.25%-15/02/15	3,000,000	4,005,000.00	
US TREASURY N/B-2.625%-14/06/30	26,700,000	28,199,789.06	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	21,000,000	27,011,250.00	
US TREASURY N/B-4.75%-37/02/15	7,200,000	9,520,875.00	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	7,950,000	12,436,781.25	
US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	17,900,000	20,923,421.87	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	27,000,000	30,488,906.25	
US TREASURY N/B-8.875%-19/02/15	5,000,000	7,532,812.50	
US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	14,400,000	15,626,250.00	
US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	23,400,000	25,999,593.75	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	26,200,000	30,060,406.25	
US TREASURY N/B-8.125%-19/08/15	9,000,000	13,297,500.00	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	8,400,000	10,569,562.50	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	12,600,000	16,149,656.25	
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	7,300,000	9,310,921.86	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	16,800,000	20,779,500.00	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	10,500,000	14,386,640.62	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	19,000,000	23,975,625.00	
US TREASURY N/B-7.5%-24/11/15	6,500,000	10,231,406.25	
US TREASURY N/B-6.25%-23/08/15	7,300,000	10,316,953.12	

		US TREASURY N/B-7.125%-23/02/15	8,000,000	11,953,750.00	
		US TREASURY N/B-7.25%-22/08/15	4,000,000	5,986,875.00	
		US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	12,000,000	18,558,750.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	40,000,000	45,918,749.99	
		US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	2,000,000	2,132,812.50	
		US TREASURY N/B-1.375%-13/05/15	11,500,000	11,675,195.31	
		US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	34,500,000	39,297,656.25	
		US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	46,300,000	53,194,359.37	
		US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	4,450,000	4,861,625.00	
		US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	17,550,000	20,336,062.50	
		US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	9,700,000	11,283,828.12	
		US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	17,700,000	22,335,187.50	
		US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	18,300,000	23,993,015.62	
		US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	4,500,000	6,279,609.37	
		US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	16,500,000	19,036,875.00	
		US TREASURY N/B-8.875%-17/08/15	4,000,000	5,708,750.00	
		US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	22,400,000	26,316,500.00	
		US TREASURY N/B-3.375%-12/11/30	10,650,000	10,967,835.93	
		US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	22,400,000	25,382,000.00	
		US TREASURY N/B-1.125%-12/12/15	9,800,000	9,888,812.50	
		US TREASURY N/B-6.375%-27/08/15	4,000,000	5,955,625.00	
		US TREASURY N/B-7.625%-25/02/15	3,000,000	4,784,531.25	
		US TREASURY N/B-6.875%-25/08/15	5,000,000	7,585,937.50	
		US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	7,900,000	11,205,656.25	
		US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,700,000	4,030,171.87	
		US TREASURY N/B-6.625%-27/02/15	4,000,000	6,052,500.00	
		US TREASURY N/B-5.25%-29/02/15	4,700,000	6,366,296.87	
		US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	3,900,000	5,274,140.62	
		US TREASURY N/B-5.5%-28/08/15	4,870,000	6,746,471.87	
		US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	6,700,000	9,780,953.12	
		国債証券小計	1,978,550,000	2,249,463,864.60 (175,345,708,245)	
	米ドル合計			2,249,463,864.60 (175,345,708,245)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-14/06/01	9,700,000	10,171,420.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	6,050,000	9,229,698.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	4,200,000	7,265,034.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	7,350,000	10,643,608.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	2,800,000	4,104,688.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-23/06/01	2,900,000	4,613,146.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-15/12/01	2,900,000	3,098,447.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-14/06/01	9,800,000	10,745,112.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-14/12/01	5,700,000	5,857,605.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-9.0%-25/06/01	1,430,000	2,541,210.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.5%-15/06/01	8,850,000	9,855,448.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-12/12/01	1,500,000	1,507,395.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-16/06/01	12,350,000	13,791,615.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-17/06/01	5,400,000	6,124,464.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	5,300,000	6,171,426.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	7,700,000	8,770,454.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	7,400,000	9,608,900.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-13/03/01	3,800,000	3,835,188.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	1,000,000	1,105,800.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-13/09/01	6,300,000	6,463,674.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.25%-13/06/01	14,500,000	15,381,745.00	

		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-13/06/01	10,100,000	10,464,812.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	5,450,000	6,120,404.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-15/06/01	2,300,000	2,406,927.00	
	国債証券小計		144,780,000	169,878,222.60 (12,953,214,473)	
加ドル合計				169,878,222.60 (12,953,214,473)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.25%-15/04/15	8,000,000	8,767,576.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	3,900,000	4,538,527.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	6,250,000	7,234,168.75	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	7,300,000	7,745,008.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	6,500,000	7,204,125.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-18/01/21	1,300,000	1,445,637.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-16/06/15	4,700,000	4,989,148.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-14/10/21	2,700,000	2,799,875.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.25%-14/06/15	6,200,000	6,657,783.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.5%-13/05/15	7,600,000	7,929,498.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,450,000	1,550,645.95	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.0%-17/02/15	8,700,000	9,781,497.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-13/12/15	4,400,000	4,596,482.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	1,800,000	2,050,592.40	
	国債証券小計		70,800,000	77,290,566.40 (6,122,958,670)	
豪ドル合計				77,290,566.40 (6,122,958,670)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-4.5%-34/09/07	7,750,000	9,713,763.82	
		UK TREASURY-2.0%-16/01/22	1,900,000	1,989,917.50	
		UK TREASURY-4.75%-15/09/07	10,330,000	11,881,618.88	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	8,700,000	13,268,382.96	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	8,440,000	10,931,328.14	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	5,800,000	6,808,385.21	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	9,150,000	11,357,060.61	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	8,400,000	10,511,727.91	
		UK TREASURY-4.0%-16/09/07	12,100,000	13,800,851.98	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,700,000	2,083,494.50	
		UK TREASURY-8.0%-15/12/07	6,600,000	8,477,037.16	
		UK TREASURY-2.75%-15/01/22	10,000,000	10,675,697.30	
		UK TREASURY-5.0%-14/09/07	12,550,000	14,097,020.93	
		UK TREASURY-2.25%-14/03/07	10,000,000	10,417,261.90	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	6,300,000	9,218,566.16	
		UK TREASURY-8.0%-13/09/27	2,800,000	3,171,954.57	
		UK TREASURY-4.5%-13/03/07	13,200,000	13,850,416.80	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	5,900,000	7,511,133.88	
		UK TREASURY-3.75%-19/09/07	9,500,000	10,910,952.44	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	3,200,000	3,679,050.65	
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	11,000,000	13,513,410.57	
		UK TREASURY-8.75%-17/08/25	5,300,000	7,502,401.90	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	7,450,000	9,021,014.72	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	7,900,000	10,152,851.53	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	8,900,000	10,828,855.08	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	8,100,000	10,657,709.78	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	8,750,000	10,668,513.53	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	8,950,000	11,437,155.14	
		UK TREASURY-4.5%-19/03/07	8,800,000	10,559,898.44	
		UK TREASURY-5.0%-18/03/07	5,300,000	6,458,177.94	

		UK TREASURY-3.75%-20/09/07	4,400,000	5,064,961.79	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	7,000,000	8,525,835.64	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	8,200,000	9,939,503.06	
	国債証券小計		254,370,000	308,685,912.42 (37,536,206,950)	
英ポンド合計				308,685,912.42 (37,536,206,950)	
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-3.0%-19/05/12	1,600,000	1,882,185.60	
		SWITZERLAND-2.5%-16/03/12	5,700,000	6,274,075.50	
		SWITZERLAND-3.0%-18/01/08	2,200,000	2,540,749.20	
		SWITZERLAND-4.0%-13/02/11	890,000	932,087.21	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	4,350,000	5,791,141.95	
		SWITZERLAND-4.25%-14/01/06	3,640,000	3,955,784.56	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	1,330,000	1,912,821.96	
	国債証券小計		19,710,000	23,288,845.98 (1,939,495,093)	
スイスフラン合計				23,288,845.98 (1,939,495,093)	
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-1.375%-14/10/01	600,000	614,160.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-15/07/01	2,050,000	2,213,180.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.625%-14/07/01	2,770,000	2,989,529.70	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	1,000,000	1,098,200.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	1,470,000	1,575,496.99	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-13/04/01	1,300,000	1,321,294.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	1,650,000	1,888,012.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.75%-16/09/01	2,750,000	3,124,260.04	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	1,710,000	1,912,891.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	2,150,000	2,428,281.65	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01	800,000	861,280.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-13/07/01	3,000,000	3,087,000.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	2,300,000	2,707,811.62	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-17/04/01	1,000,000	1,076,900.00	
		国債証券小計		24,550,000	26,898,298.00 (1,621,429,403)
	シンガポールドル合計				26,898,298.00 (1,621,429,403)
マレーシア リンギット	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT-4.72%-15/09/30	6,200,000	6,526,905.35	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.702%-13/02/25	6,500,000	6,566,516.64	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.094%-14/04/30	13,300,000	13,930,420.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.741%-15/02/27	4,000,000	4,070,000.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.835%-15/08/12	2,000,000	2,042,000.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.21%-13/05/31	3,900,000	3,922,749.98	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.012%-17/09/15	4,000,000	4,125,000.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	3,800,000	4,331,050.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.461%-13/07/31	5,000,000	5,054,750.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	2,650,000	3,041,290.17	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	2,800,000	2,629,992.06	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	4,000,000	4,192,400.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	4,800,000	4,966,320.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	6,900,000	7,248,450.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.814%-17/02/15	4,500,000	4,588,875.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	9,000,000	9,563,275.98	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.262%-16/09/15	6,000,000	6,264,750.00	
		国債証券小計		89,350,000	93,064,745.18 (2,301,491,148)

マレーシアリングット合計				93,064,745.18 (2,301,491,148)	
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	18,000,000	21,059,946.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	29,400,000	34,908,374.94	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.75%-17/08/12	23,200,000	26,327,642.34	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	18,300,000	23,662,702.98	
		SWEDISH GOVERNMENT-4.5%-15/08/12	26,180,000	29,461,234.38	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	27,500,000	35,514,971.38	
		SWEDISH GOVERNMENT-6.75%-14/05/05	34,100,000	38,785,596.29	
		国債証券小計		196,580,000	231,324,218.73 (2,618,590,156)
スウェーデンクローナ合計				231,324,218.73 (2,618,590,156)	
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-6.5%-13/05/15	25,000,000	26,730,300.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-5.0%-15/05/15	22,400,000	24,879,926.40	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	12,300,000	14,166,795.60	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	12,150,000	13,486,767.30	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.25%-17/05/19	15,200,000	17,244,918.86	
	国債証券小計		87,050,000	96,508,708.16 (1,259,438,641)	
ノルウェークローネ合計				96,508,708.16 (1,259,438,641)	
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	43,650,000	64,026,867.60	
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	13,750,000	21,417,866.25	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	45,600,000	53,987,800.80	
		KINGDOM OF DENMARK-5.0%-13/11/15	34,100,000	37,223,287.20	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-15/11/15	52,800,000	59,799,537.60	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-17/11/15	25,600,000	29,772,544.00	
	国債証券小計		215,500,000	266,227,903.45 (3,641,997,719)	
デンマーククローネ合計				266,227,903.45 (3,641,997,719)	
メキシコペ ソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-13/12/19	73,000,000	77,334,520.27	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	81,300,000	91,861,465.92	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%-16/12/15	41,200,000	44,430,168.16	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	31,700,000	40,060,248.60	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-17/12/14	45,800,000	50,795,322.18	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	68,500,000	89,744,000.21	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-9.0%-12/12/20	82,000,000	86,988,534.78	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-9.5%-14/12/18	69,000,000	77,415,765.09	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	59,500,000	66,795,061.76	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	33,200,000	36,412,346.67	
	国債証券小計		585,200,000	661,837,433.64 (3,712,908,002)	
メキシコペソ合計				661,837,433.64 (3,712,908,002)	

ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	13,500,000	13,400,775.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.25%-15/10/24	12,900,000	13,408,905.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	10,100,000	9,724,280.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-13/10/24	14,300,000	14,356,485.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-14/04/25	13,800,000	14,056,680.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	5,000,000	4,857,900.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-15/04/25	10,600,000	10,749,990.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	8,300,000	8,240,240.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	11,000,000	10,899,900.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-16/04/25	11,500,000	11,416,050.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-13/04/25	20,200,000	20,345,440.00	
	国債証券小計		131,200,000	131,456,645.00 (3,012,986,303)	
ポーランドズロチ合計				131,456,645.00 (3,012,986,303)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.0%-13/03/28	4,300,000	4,414,209.72	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-13/09/28	6,600,000	6,808,926.96	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-14/09/28	5,300,000	5,492,582.92	
		BELGIUM KINGDOM-3.5%-15/03/28	2,650,000	2,683,684.94	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-18/03/28	4,100,000	4,183,094.29	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-14/03/28	5,400,000	5,543,135.64	
		BELGIUM KINGDOM-8.0%-15/03/28	3,300,000	3,791,905.26	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-15/09/28	5,200,000	5,336,505.20	
		BELGIUM KINGDOM-2.75%-16/03/28	1,500,000	1,477,392.30	
		BELGIUM KINGDOM-8.0%-12/12/24	4,400,000	4,697,988.68	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-17/03/28	6,000,000	6,141,171.60	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-17/09/28	5,600,000	6,143,249.28	
		BELGIUM KINGDOM-3.25%-16/09/28	7,340,000	7,349,477.40	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	6,500,000	6,390,858.50	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	4,800,000	4,849,698.24	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	5,800,000	5,776,118.50	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	1,900,000	1,952,953.95	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	6,650,000	7,572,037.13	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	6,550,000	7,195,171.72	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	3,350,000	3,302,061.16	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	4,450,000	4,512,790.39	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-3.15%-16/01/31	13,300,000	12,809,208.72	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.1%-18/07/30	6,700,000	6,437,589.14	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-3.8%-17/01/31	8,150,000	7,859,305.80	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.4%-15/01/31	13,100,000	13,283,441.92	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-3.0%-15/04/30	1,300,000	1,262,588.47	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-3.3%-14/10/31	6,500,000	6,407,724.05	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.9%-40/07/30	7,000,000	5,777,788.10	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.7%-41/07/30	4,200,000	3,378,181.38	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.25%-14/01/31	9,200,000	9,282,330.80	

B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-2.5%-13/10/31	1,000,000	979,854.90	
B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.2%-13/07/30	8,950,000	9,038,545.93	
B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-2.3%-13/04/30	4,500,000	4,428,818.55	
B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-6.15%-13/01/31	9,750,000	10,030,774.65	
B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-5.5%-17/07/30	8,050,000	8,357,146.94	
B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-5.5%-21/04/30	4,200,000	4,236,686.16	
B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.65%-25/07/30	4,100,000	3,634,889.85	
B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-6.0%-29/01/31	7,850,000	7,720,778.01	
B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-5.75%-32/07/30	6,500,000	6,203,173.60	
B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.2%-37/01/31	7,500,000	5,668,717.50	
B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-5.9%-26/07/30	2,200,000	2,176,997.02	
B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.8%-24/01/31	8,300,000	7,608,418.27	
B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.85%-20/10/31	9,300,000	9,087,099.75	
B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.0%-20/04/30	5,200,000	4,836,595.92	
B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.3%-19/10/31	7,100,000	6,794,591.37	
B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.6%-19/07/30	6,300,000	6,171,088.77	
B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.75%-14/07/30	9,100,000	9,311,217.37	
BUNDESOBLIGATION-2.5%-14/10/10	5,750,000	6,086,331.87	
BUNDESOBLIGATION-2.5%-15/02/27	8,900,000	9,453,760.67	
BUNDESOBLIGATION-2.25%-15/04/10	5,500,000	5,806,593.10	
BUNDESOBLIGATION-3.5%-13/04/12	18,500,000	19,310,620.05	
BUNDESOBLIGATION-4.0%-13/10/11	9,800,000	10,461,903.76	
BUNDESOBLIGATION-2.25%-14/04/11	7,000,000	7,329,788.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-19/01/04	11,300,000	13,010,225.62	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-16/07/04	10,860,000	12,393,762.14	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-17/01/04	8,800,000	10,002,146.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-17/07/04	8,750,000	10,225,610.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-40/07/04	6,600,000	9,583,749.12	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-18/07/04	8,900,000	10,513,674.13	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-39/07/04	7,000,000	9,388,928.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%-19/07/04	10,100,000	11,467,817.75	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-20/01 /04	12,900,000	14,433,272.07	
---	------------	---------------	--

[次へ](#)

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%-20/07/04	13,600,000	14,953,928.96	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-21/07/04	12,500,000	13,987,993.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	7,400,000	10,552,909.12	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-14/01/04	12,800,000	13,837,451.52	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-18/01/04	9,300,000	10,802,370.36	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-15/07/04	12,700,000	13,884,036.24	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	6,700,000	9,435,654.22	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.0%-16/06/20	4,400,000	5,370,763.64	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-28/07/04	4,280,000	5,541,533.42	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-30/01/04	4,650,000	7,078,605.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	6,550,000	9,369,047.95	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-34/07/04	9,000,000	12,308,599.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%-27/07/04	7,600,000	11,535,195.64	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04	9,800,000	12,385,864.26	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-15/01/04	14,500,000	15,920,047.35	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-14/07/04	11,500,000	12,630,977.85	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%-16/01/04	24,500,000	27,245,102.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-13/07/04	14,300,000	15,079,524.45	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.5%-13/01/04	20,300,000	21,222,462.45	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-42/07/04	5,500,000	6,403,797.95	
B U O N I P O L I E N N A L I D E L T E S-5.25%-17/08/01	11,500,000	10,948,210.45	
B U O N I P O L I E N N A L I D E L T E S-4.5%-18/02/01	10,500,000	9,521,932.35	
B U O N I P O L I E N N A L I D E L T E S-4.5%-18/08/01	10,900,000	9,808,177.52	
B U O N I P O L I E N N A L I D E L T E S-4.25%-19/02/01	10,400,000	9,158,772.48	
B U O N I P O L I E N N A L I D E L T E S-4.0%-17/02/01	9,600,000	8,708,059.20	
B U O N I P O L I E N N A L I D E L T E S-3.75%-16/08/01	20,200,000	18,380,410.26	
B U O N I P O L I E N N A L I D E L T E S-3.75%-15/08/01	18,700,000	17,485,717.37	
B U O N I P O L I E N N A L I D E L T E S-3.0%-15/06/15	1,600,000	1,465,130.72	

BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%-15/04/15	6,700,000	6,172,031.96	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-15/02/01	16,000,000	15,432,832.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-14/08/01	15,300,000	14,906,435.04	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-14/06/01	5,500,000	5,263,163.95	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-13/12/15	19,300,000	18,822,531.51	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-13/08/01	20,150,000	19,966,975.53	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-13/06/01	2,900,000	2,791,039.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-13/04/15	12,300,000	12,209,800.41	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-13/02/01	11,500,000	11,492,912.55	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-12/12/15	3,800,000	3,717,774.46	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-19/03/01	10,600,000	9,410,382.14	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	8,400,000	6,576,199.56	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	10,800,000	8,905,116.24	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01	14,700,000	13,034,588.49	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%-33/02/01	7,700,000	6,553,526.98	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	9,800,000	7,703,341.94	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-39/08/01	10,600,000	8,299,890.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	10,600,000	9,992,580.78	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-26/11/01	7,000,000	7,205,437.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-25/03/01	14,500,000	12,147,202.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%-23/11/01	8,210,000	9,068,285.71	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-23/08/01	8,500,000	7,063,237.35	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-21/09/01	7,700,000	6,729,174.76	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	8,700,000	6,075,734.61	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-21/08/01	18,000,000	14,571,676.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-19/09/01	10,290,000	8,911,168.81	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-20/02/01	9,700,000	8,501,356.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-20/03/01	10,300,000	8,900,688.35	

BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-20/09/01	10,350,000	8,682,273.45	
FINNISH GOVERNMENT-5.375%-13/07/04	3,350,000	3,599,294.60	
FINNISH GOVERNMENT-4.25%-15/07/04	4,550,000	5,043,127.18	
FINNISH GOVERNMENT-3.875%-17/09/15	3,550,000	3,933,240.60	
FINNISH GOVERNMENT-1.75%-16/04/15	1,180,000	1,203,871.63	
FINNISH GOVERNMENT-3.125%-14/09/15	3,100,000	3,294,985.66	
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	2,900,000	3,315,752.41	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	4,350,000	4,941,573.46	
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	1,200,000	1,304,724.48	
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	2,550,000	2,741,906.11	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-13/10/25	18,800,000	19,853,204.20	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	13,900,000	14,543,875.80	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	2,300,000	2,221,033.18	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	19,500,000	20,693,856.30	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-14/10/25	11,900,000	12,775,569.87	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	3,600,000	3,845,427.48	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	7,500,000	7,968,434.25	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-14/04/25	12,000,000	12,783,166.80	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-17/04/25	10,000,000	10,783,183.00	
FRANCE (GOVT OF)-5.0%-16/10/25	14,600,000	16,607,792.00	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-16/04/25	22,700,000	24,006,698.26	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-15/10/25	18,360,000	19,236,522.92	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-15/04/25	16,850,000	17,910,940.03	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	7,600,000	8,794,915.32	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-19/10/25	6,550,000	9,168,310.75	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25	10,800,000	11,906,101.44	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-18/10/25	8,400,000	9,268,489.44	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-18/04/25	10,500,000	11,447,643.90	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-17/10/25	10,600,000	11,704,160.66	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	7,800,000	9,188,485.80	
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	9,900,000	12,941,197.83	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	9,570,000	11,911,284.23	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	9,200,000	9,821,609.04	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	6,000,000	6,114,520.20	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	9,800,000	12,589,763.06	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	10,700,000	11,761,264.52	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	9,650,000	10,281,503.72	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	9,000,000	13,452,592.50	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-12/12/26	4,360,000	4,704,736.04	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-13/04/25	9,600,000	10,045,990.08	
FRANCE(GOVT OF)-3.5%-26/04/25	7,000,000	7,048,487.60	
FRENCH TREASURY NOTE-2.5%-14/01/12	8,810,000	9,070,534.60	
FRENCH TREASURY NOTE-3.0%-14/07/12	7,300,000	7,620,343.71	
FRENCH TREASURY NOTE-2.5%-15/01/15	7,100,000	7,319,817.42	
FRENCH TREASURY NOTE-3.75%-13/01/12	6,300,000	6,520,797.36	
FRENCH TREASURY NOTE-2.0%-15/07/12	1,600,000	1,622,289.28	
FRENCH TREASURY NOTE-4.5%-13/07/12	12,900,000	13,650,933.51	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	4,450,000	5,536,391.85	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	7,200,000	8,106,961.68	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	5,650,000	7,061,534.98	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	4,600,000	6,274,917.04	
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	5,500,000	8,167,817.35	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	4,400,000	4,938,417.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	2,000,000	2,158,475.60	

	NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-13/01/15	5,100,000	5,181,170.58	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	6,800,000	7,714,074.36	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-4.5%-17/07/15	7,800,000	8,943,735.06	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-16/07/15	8,100,000	9,048,127.68	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-15/07/15	7,120,000	7,664,919.94	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-15/01/15	7,550,000	7,964,356.08	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-14/07/15	8,150,000	8,778,479.91	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-4.25%-13/07/15	10,500,000	11,134,135.95	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	9,300,000	10,245,006.48	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-13/10/20	5,500,000	5,788,382.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-14/07/15	5,150,000	5,552,251.05	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-14/10/20	5,200,000	5,503,748.64	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.0%-16/09/15	5,000,000	5,438,579.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.2%-17/02/20	2,700,000	2,804,896.08	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-17/09/15	3,550,000	3,877,099.48	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	5,600,000	6,217,166.48	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	5,700,000	6,224,719.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	6,280,000	6,691,800.32	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	6,300,000	6,564,256.65	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	3,400,000	3,551,696.44	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	3,550,000	4,142,275.61	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	3,600,000	4,823,613.36	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	5,350,000	5,979,473.51	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-15/07/15	5,700,000	6,057,819.21	
国債証券小計		1,613,460,000	1,690,696,638.66 (171,926,941,185)	
ユーロ合計			1,690,696,638.66 (171,926,941,185)	
合計			423,993,365,988 (423,993,365,988)	

(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 132銘柄	100.0%	41.3%
加ドル	国債証券 24銘柄	100.0%	3.1%
豪ドル	国債証券 14銘柄	100.0%	1.4%
英ポンド	国債証券 33銘柄	100.0%	8.9%
スイスフラン	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
シンガポールドル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 17銘柄	100.0%	0.5%
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 6銘柄	100.0%	0.9%
メキシコペソ	国債証券 10銘柄	100.0%	0.9%
ポーランドズロチ	国債証券 11銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 196銘柄	100.0%	40.5%

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。

6. 「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」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

科目	対象年月日	平成23年 6月27日現在	平成23年12月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		3,204,254	5,237,077
コール・ローン		8,539,401	6,485,518
国債証券		457,757,478	484,039,229
特殊債券		43,517,180	48,882,767
未収利息		10,519,621	11,893,189
前払費用		1,445,685	1,279,294
流動資産合計		524,983,619	557,817,074
資産合計		524,983,619	557,817,074
負債の部			
流動負債			
未払解約金		—	500
流動負債合計		—	500
負債合計		—	500
純資産の部			
元本等			
元本		503,155,149	592,962,822
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		21,828,470	35,146,248
元本等合計		524,983,619	557,816,574
純資産合計		524,983,619	557,816,574
負債純資産合計		524,983,619	557,817,074

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

（追加情報）

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

（貸借対照表に関する注記）

平成23年 6月27日現在		平成23年12月26日現在	
1. 期首	平成22年12月28日	1. 期首	平成23年 6月28日
期首元本額	430,373,172円	期首元本額	503,155,149円
期首からの追加設定元本額	98,350,891円	期首からの追加設定元本額	119,739,577円
期首からの一部解約元本額	25,568,914円	期首からの一部解約元本額	29,931,904円
平成23年 6月27日現在の元本の内訳		平成23年12月26日現在の元本の内訳	
全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	44,999,932円	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	46,454,604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	457,213,543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	545,569,510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）	941,674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）	938,708円
計	503,155,149円	計	592,962,822円
2. 本報告書における開示対象ファンドの当特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	503,155,149口	2. 本報告書における開示対象ファンドの当特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	592,962,822口
		3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は35,146,248円であります。	

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 平成22年12月28日 至 平成23年 6月27日	自 平成23年 6月28日 至 平成23年12月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成23年 6月27日現在	平成23年12月26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23年6月27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	1,089,852
特殊債券	302,671
合計	787,181

（平成23年12月26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	8,988,655
特殊債券	1,937,986
合計	7,050,669

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成23年 6月27日現在		平成23年12月26日現在	
1口当たり純資産額	1.0434円	1口当たり純資産額	0.9407円
（1万口当たり純資産額）	（10,434円）	（1万口当たり純資産額）	（9,407円）

（3）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
マレーシア リンギット	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT-3.835%-15/08/12	130,000	132,730.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.262%-16/09/15	170,000	177,501.25	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	160,000	165,544.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	230,000	241,615.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	170,000	193,757.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	100,000	106,258.62	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.012%-17/09/15	100,000	103,125.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.461%-13/07/31	100,000	101,095.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.094%-14/04/30	320,000	335,168.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.702%-13/02/25	150,000	151,534.99	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.814%-17/02/15	450,000	458,887.50	
	国債証券小計		2,080,000	2,167,216.86 (53,595,272)	
マレーシアリンギット合計				2,167,216.86 (53,595,272)	

タイバーツ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND-3.875%-19/06/13	2,100,000	2,186,745.96	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-4.75%-24/12/20	260,000	292,416.14	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-5.125%-18/03/13	2,900,000	3,206,510.25	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.8%-17/10/10	800,000	784,296.44	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-5.25%-14/05/12	1,850,000	1,942,971.56	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.625%-15/05/22	1,970,000	2,007,728.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-6.15%-26/07/07	1,400,000	1,794,039.80	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-4.25%-13/03/13	1,300,000	1,318,702.46	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-5.25%-13/07/13	600,000	619,439.17	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-5.85%-21/03/31	2,310,000	2,778,880.90	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-5.4%-16/07/27	1,400,000	1,535,304.44	
		国債証券小計		16,890,000	18,467,035.12 (45,982,917)
	タイバーツ合計				18,467,035.12 (45,982,917)
インドネシ アルピア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT-10.25%-27/07/15	300,000,000	392,559,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.5%-31/07/15	320,000,000	398,467,200.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-10.0%-28/02/15	270,000,000	345,786,300.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.0%-18/09/15	270,000,000	314,533,800.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-10.0%-24/09/15	250,000,000	321,377,500.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-14/10/15	300,000,000	344,043,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-10.5%-30/08/15	300,000,000	402,168,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-10.0%-17/07/15	300,000,000	362,535,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-11.5%-19/09/15	300,000,000	399,327,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-20/11/15	250,000,000	333,177,500.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-12.8%-21/06/15	250,000,000	368,297,500.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-10.25%-22/07/15	720,000,000	925,668,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.5%-23/07/15	370,000,000	457,183,100.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-25/09/15	390,000,000	539,069,700.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-10.75%-16/05/15	300,000,000	361,533,000.00	
	国債証券小計		4,890,000,000	6,265,725,600.00 (54,511,812)	
インドネシアルピア合計				6,265,725,600.00 (54,511,812)	

メキシコペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	260,000	328,569.86	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	450,000	508,458.29	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-9.0%-13/06/20	530,000	562,369.07	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-15/12/17	450,000	493,566.28	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	250,000	274,189.35	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-18/12/13	960,000	1,116,306.12	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-17/12/14	580,000	643,259.53	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-9.5%-14/12/18	780,000	875,134.73	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	790,000	1,035,003.79	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	470,000	494,883.01	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	550,000	556,637.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	1,470,000	1,650,230.93	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-13/12/19	800,000	847,501.59	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%-16/12/15	300,000	323,520.64	
	国債証券小計		8,640,000	9,709,630.94 (54,471,029)	
メキシコペソ合計				9,709,630.94 (54,471,029)	
ブラジルリアル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL-10.25%-28/01/10	250,000	285,000.00	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-13/01/01	530,000	528,785.16	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-17/01/01	220,000	210,686.76	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-14/01/01	220,000	217,392.74	
	国債証券小計		1,220,000	1,241,864.66 (52,158,315)	
ブラジルリアル合計				1,241,864.66 (52,158,315)	
コロンビアペソ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA-9.85%-27/06/28	88,000,000	124,875,520.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA-12.0%-15/10/22	335,000,000	430,796,600.00	
	国債証券小計		423,000,000	555,672,120.00 (22,560,288)	
コロンビアペソ合計				555,672,120.00 (22,560,288)	
ハンガリーフォリント	国債証券	HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.75%-13/02/12	7,000,000	6,905,640.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-7.5%-20/11/12	12,200,000	10,920,098.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.0%-23/11/24	3,000,000	2,302,200.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.75%-17/11/24	5,000,000	4,458,800.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.75%-17/02/24	7,800,000	7,044,414.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-5.5%-16/02/12	14,500,000	12,866,502.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-8.0%-15/02/12	12,300,000	12,036,042.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.75%-14/08/22	6,500,000	6,213,837.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.5%-19/06/24	8,800,000	7,517,884.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-7.5%-13/10/24	7,400,000	7,315,714.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-5.5%-14/02/12	9,900,000	9,323,077.50	

	国債証券小計		94,400,000	86,904,209.50 (28,826,126)	
ハンガリーフォリント合計				86,904,209.50 (28,826,126)	
ペルーヌエボソル	国債証券	PERU BONO SOBERANO-7.84%-20/08/12	220,000	251,168.31	
		PERU BONO SOBERANO-6.95%-31/08/12	50,000	52,641.04	
		PERU BONO SOBERANO-6.9%-37/08/12	70,000	73,154.74	
	国債証券小計		340,000	376,964.09 (10,905,571)	
ペルーヌエボソル合計				376,964.09 (10,905,571)	
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	220,000	218,383.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-15/04/25	280,000	283,962.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-14/04/25	200,000	203,720.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-13/04/25	400,000	402,880.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.25%-15/10/24	360,000	374,202.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	180,000	173,304.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	230,000	228,344.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-16/04/25	170,000	168,759.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	130,000	128,817.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-13/10/24	140,000	140,553.00	
	国債証券小計		2,310,000	2,322,924.00 (53,241,418)	
ポーランドズロチ合計				2,322,924.00 (53,241,418)	
南アフリカランド	国債証券	R E P U B L I C O F S O U T H AFRICA-8.75%-14/12/21	400,000	426,470.80	
		R E P U B L I C O F S O U T H AFRICA-6.25%-36/03/31	580,000	428,975.36	
		R E P U B L I C O F S O U T H AFRICA-10.5%-26/12/21	840,000	980,027.24	
		R E P U B L I C O F S O U T H AFRICA-6.75%-21/03/31	800,000	736,284.56	
		R E P U B L I C O F S O U T H AFRICA-7.25%-20/01/15	910,000	872,873.72	
		R E P U B L I C O F S O U T H AFRICA-8.0%-18/12/21	500,000	508,506.85	
		R E P U B L I C O F S O U T H AFRICA-13.5%-15/09/15	510,000	621,176.12	
		R E P U B L I C O F S O U T H AFRICA-7.5%-14/01/15	390,000	400,693.05	
		R E P U B L I C O F S O U T H AFRICA-7.0%-31/02/28	180,000	148,814.44	
		R E P U B L I C O F S O U T H AFRICA-8.25%-17/09/15	620,000	644,125.87	
	国債証券小計		5,730,000	5,767,948.01 (55,083,903)	
南アフリカランド合計				5,767,948.01 (55,083,903)	
ロシアルーブル	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP-7.5%-17/03/02	17,400,000	17,607,971.63	
		I N T L B K R E C O N & DEVELOP-6.25%-13/12/11	2,000,000	1,945,135.27	
	特殊債券小計		19,400,000	19,553,106.90 (48,882,767)	
ロシアルーブル合計				19,553,106.90 (48,882,767)	

トルコリラ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND-10.0%-13/01/09	250,000	249,250.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.0%-14/01/29	85,000	81,897.50	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.0%-13/10/09	100,000	96,700.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.0%-13/04/10	290,000	289,275.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-11.0%-14/08/06	350,000	358,050.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.5%-20/01/15	195,000	206,505.00	
		国債証券小計		1,270,000	1,281,677.50 (52,702,578)
トルコリラ合計				1,281,677.50 (52,702,578)	
合計				532,921,996 (532,921,996)	

(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
マレーシアリングット	国債証券 11銘柄	100.0%	10.1%
タイバーツ	国債証券 11銘柄	100.0%	8.6%
インドネシアルピア	国債証券 15銘柄	100.0%	10.2%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	10.2%
ブラジルリアル	国債証券 4銘柄	100.0%	9.8%
コロンビアペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	4.2%
ハンガリーフォリント	国債証券 11銘柄	100.0%	5.4%
ペルーヌエボソル	国債証券 3銘柄	100.0%	2.0%
ポーランドズロチ	国債証券 10銘柄	100.0%	10.0%
南アフリカランド	国債証券 10銘柄	100.0%	10.4%
ロシアルーブル	特殊債券 2銘柄	100.0%	9.2%
トルコリラ	国債証券 6銘柄	100.0%	9.9%

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。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2012年1月31日現在です。

【純資産額計算書】

資産総額	261,669,431 円
負債総額	168,051 円
純資産総額（ - ）	261,501,380 円
発行済口数	385,449,064 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.6784 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	25,405,109,803 円
負債総額	85,674,015 円
純資産総額（ - ）	25,319,435,788 円
発行済口数	43,050,476,345 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.5881 円

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

純資産額計算書

資産総額	62,191,104,842 円
負債総額	144,341,599 円
純資産総額（ - ）	62,046,763,243 円
発行済口数	73,839,086,146 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8403 円

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

純資産額計算書

資産総額	6,602,286,929 円
負債総額	24,357,382 円
純資産総額（ - ）	6,577,929,547 円
発行済口数	6,511,921,973 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0101 円

（参考）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	31,810,901,674 円
------	------------------

負債総額	154,572,864 円
純資産総額（ - ）	31,656,328,810 円
発行済口数	25,625,714,174 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2353 円

（参考）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	418,504,317,406 円
負債総額	562,828,842 円
純資産総額（ - ）	417,941,488,564 円
発行済口数	297,841,075,596 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4032 円

（参考）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	692,727,898 円
負債総額	15,423,513 円
純資産総額（ - ）	677,304,385 円
発行済口数	695,850,497 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9733 円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】**(1) 名義書換**

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

平成24年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19年4月13日	16,287,728,400円（16,223,228,400円）
平成20年6月23日	16,403,045,900円（16,287,728,400円）
平成21年10月1日	17,363,045,900円（16,403,045,900円）

(2) 会社の意思決定機関

・株主総会

取締役・監査役の選任および定款変更に係る決議などを行ないます。

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

・取締役会

当社の業務執行を決定し、取締役の職務の執行について監督します。

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

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

・監査役会

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

（平成24年1月末現在）

(3) 運用の意思決定プロセス

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

（平成24年1月末現在）

2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、平成24年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	421	68,506
株式投資信託	355	55,162
単位型	43	1,326
追加型	312	53,836
公社債投資信託	66	13,344
単位型	49	614
追加型	17	12,730
投資法人合計	1	32

3【委託会社等の経理状況】

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

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

（２）【損益計算書】

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

（３）【株主資本等変動計算書】

(単位：百万円)

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

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

重要な会計方針

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

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

会計方針の変更

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

追加情報

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

注記事項

（貸借対照表関係）

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

（損益計算書関係）

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

（株主資本等変動計算書関係）

第51期（自 平成21年 4 月 1 日 至 平成22年 3 月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

(注) 自己株式の増加及び減少は、自己株式の取得及び処分であります。

3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

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

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

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

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

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

平成22年 5 月20日 取締役会	普通株式	利益剰余金	305	1. 55	平成22年 3 月31日	平成22年 6 月23日
----------------------	------	-------	-----	-------	--------------	--------------

第52期（自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

(注) 自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

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

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

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

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

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(リース取引関係)

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

（金融商品関係）

第51期(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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、月次ペースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また投資有価証券に関しては、毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュー・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ペ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22年3月31日（当期の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

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

() 負債に計上されているものについては、() で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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、バリュー・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。これらの結果、当社の財政状態、経営成績に与える影響が著しいと判断される場合には、必要に応じて、ヘッジ取引規程に則り、それを回避する目的で、ヘッジ取引を行うことが可能であります。

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

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

() 負債に計上されているものについては、() で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

第51期(自 平成21年4月1日至 平成22年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

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

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

2 その他有価証券

（単位：百万円）

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

（単位：百万円）

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

第52期(自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

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

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

(持分法損益等)

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

（退職給付関係）

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

（ストックオプション等関係）

第51期(自 平成21年 4 月 1 日 至 平成22年 3 月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

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

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

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

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

(2) スtockオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション（新株予約権）の数

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

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

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

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

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

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

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

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

単価情報

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 1 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション（新株予約権）の数

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

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

(注) 1 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

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

（税効果会計関係）

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

（関連当事者情報）

第51期(自 平成21年 4 月 1 日 至 平成22年 3 月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

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

第52期(自 平成22年4月1日至 平成23年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

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

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

(注) 1 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

(注) 1 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

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

(セグメント情報等)

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1 セグメント情報

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

2 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

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。

有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

3 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(1 株当たり情報)

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

(注) 算定上の基礎

1 1 株当たり純資産額

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

2 1 株当たり当期純利益又は 1 株当たり当期純損失

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

(重要な後発事象)

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

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

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第53期中間会計期間
(平成23年9月30日)

資産の部

流動資産

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

固定資産

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

固定資産合計		29,214
--------	--	--------

資産合計		54,773
------	--	--------

(単位：百万円)

第53期中間会計期間
(平成23年9月30日)

負債の部

流動負債

未払金	2,944
未払費用	3,149
未払法人税等	687
未払消費税等	231
賞与引当金	1,130
役員賞与引当金	100
その他	1,588
流動負債合計	9,831

固定負債

退職給付引当金	859
その他	55
固定負債合計	915

負債合計

10,746

純資産の部

株主資本

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

利益剰余金

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

自己株式	68
------	----

株主資本合計	44,119
--------	--------

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	92
評価・換算差額等合計	92

純資産合計	44,027
-------	--------

負債純資産合計	54,773
---------	--------

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第53期中間会計期間
(自 平成23年4月1日
至 平成23年9月30日)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：百万円)

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

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

重要な会計方針

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

追加情報

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

注記事項

(中間貸借対照表関係)

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

(中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第53期中間会計期間（自 平成23年 4 月 1 日 至 平成23年 9 月30日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

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

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

2 第1回新株予約権の増加は、新株予約権の発行によるものであります。

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

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

該当事項はありません。

(リース取引関係)

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

(金融商品関係)

第53期中間会計期間（平成23年 9 月30日）

1 金融商品の時価等に関する事項

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

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

() 負債に計上されているものについては、() で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、株式は市場価格、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

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

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

(有価証券関係)

第53期中間会計期間(平成23年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

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

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

2 その他有価証券

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

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

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

(持分法損益等)

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

(ストックオプション等関係)

第53期中間会計期間(自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

第53期中間会計期間(自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)

1 セグメント情報

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

2 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービスは単一であるため、記載しておりません。

(2) 地域ごとの情報

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。

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

(1 株当たり情報)

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

(注) 算定上の基礎

1 1 株当たり純資産額

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

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

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

(重要な後発事象)

第53期中間会計期間（自 平成23年 4 月 1 日 至 平成23年 9 月30日）

新株予約権（ストックオプション）の付与

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

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

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (平成23年9月末現在)	事業の内容
農林中央金庫	3,425,909百万円 (出資の総額)	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。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
平成23年 6 月29日	臨時報告書
平成23年 9 月22日	有価証券報告書
平成23年 9 月22日	有価証券届出書
平成23年 9 月29日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

平成24年2月1日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴 司
業務執行社員指定社員 公認会計士 辻 村 和 之
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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23年6月28日から平成23年12月26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23年12月26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22年6月18日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指 定 社 員 公認会計士 佐々木 貴 司
業務執行社員

指 定 社 員 公認会計士 辻 村 和 之
業務執行社員

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

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

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

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成23年 6 月17日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴 司
業務執行社員

指 定 社 員 公認会計士 辻 村 和 之
業務執行社員

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

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

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

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

以 上

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

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成23年12月9日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴 司
業務執行社員

指定社員 公認会計士 辻 村 和 之
業務執行社員

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以 上

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