

【表紙】  
【提出書類】 有価証券届出書  
【提出先】 関東財務局長  
【提出日】 平成24年10月25日  
【発行者名】 三菱UFJ投信株式会社  
【代表者の役職氏名】 取締役社長 後藤 俊夫  
【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目4番5号  
【事務連絡者氏名】 井上 靖  
連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目4番5号  
【電話番号】 03-6250-4740  
【届出の対象とした募集内国投資信託受益 eMAXIS バランス（8資産均等型）  
証券に係るファンドの名称】  
【届出の対象とした募集内国投資信託受益 継続募集額 上限1兆円  
証券の金額】  
【縦覧に供する場所】 該当ありません

## 第一部【証券情報】

### (1) 【ファンドの名称】

e M A X I S バランス(8資産均等型)(「ファンド」といいます。)

### (2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託です。

当初元本は1口当たり1円です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律(「社振法」といいます。)の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関(社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、「振替機関等」といいます。)の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります(振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。)。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### (3) 【発行(売出)価額の総額】

1兆円を上限とします。

### (4) 【発行(売出)価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

(略称：eバ8均)

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034(受付時間：毎営業日の9:00~17:00)

ホームページアドレス <http://www.am.mufg.jp/>

e M A X I S 専用サイト <http://maxis.muam.jp/e/>

(注) 基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権総口数で除して得た額をいいます。

なお、当ファンドでは1万口当たりの価額で表示されます。

毎営業日とは、土曜日、日曜日、「国民の祝日に関する法律」に定める休日ならびに12月31日、1月2日および1月3日以外の日とします。以下、同じ。

### (5) 【申込手数料】

申込手数料はかかりません。

### (6) 【申込単位】

申込単位は販売会社にご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034(受付時間：毎営業日の9:00~17:00)

申込みには分配金受取りコース(一般コース)と分配金再投資コース(累積投資コース)があり、分配金再投資コース(累積投資コース)の場合、再投資される収益分配金については1口単位とします。

### (7) 【申込期間】

平成24年10月26日から平成25年4月26日までです。

(注) 上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

### (8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

三菱UFJ投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間: 毎営業日の9:00~17:00)

(9) 【払込期日】

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

払込期日は販売会社により異なる場合がありますので、販売会社にご確認ください。

振替受益権に係る各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に委託会社の指定する口座を經由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社とします。

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権の振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、振替機関の振替業に係る業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。ファンドの分配金、償還金、解約代金は、社振法および振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

(12) 【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、東証株価指数（TOPIX）、MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（円換算ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）、NOMURA - BPI総合、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、JPモルガンGBI EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）、東証REIT指数（配当込み）およびS&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）を12.5%ずつ組み合わせた合成ベンチマークと連動する投資成果をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、5,000億円です。

当ファンドは、社団法人投資信託協会が定める商品の分類方法において、以下の商品分類および属性区分に該当します。

#### 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式 債券	MMF	インデックス型
	海外	不動産投信	MRF	
追加型	内外	その他資産 ( )	ETF	特殊型 ( )
		資産複合		

#### 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式 一般	年1回 年2回	グローバル (日本を含む)	ファミリー ファンド	あり ( )	日経225	ブル・ベア型
大型株 中小型株 債券 一般	年4回 年6回 (隔月)	日本 北米 欧州	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX	条件付運用型
公債 社債 その他債券 クレジット 属性 ( ) 不動産投信	年12回 (毎月) 日々 その他 ( )	アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング			その他 (合成ベンチ マーク)	ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、不動産 投信))) 資産複合						その他 ( )

( )						
-----	--	--	--	--	--	--

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

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

#### 商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいいます。
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	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。
投資対象資産	株式	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMMFをいいます。
	MRF（マネー・リザーブ・ファンド）	社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMRFをいいます。
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	特殊型	信託約款において、投資家（受益者）に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

上記定義は社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

#### 属性区分の定義

投資対象 資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（BBB格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（BBB格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信	信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。	
	その他資産	信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。	
資産複合	信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。		
決算頻度	年1回	信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年2回	信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年4回	信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年6回（隔月）	信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年12回（毎月）	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。	
	日々	信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。	
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。	

投資対象地域	グローバル	信託約款において、組入資産による投資収益が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。
	日本	信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）	信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	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。
	ファンド・オブ・ファンズ	社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
	なし	信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	日経225	信託約款において、日経225に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	TOPIX	信託約款において、TOPIXに連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記以外の指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
	ロング・ショート型 / 絶対収益追求型	信託約款において、ロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

上記定義は社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

## [ ファンドの目的・特色 ]

## ファンドの目的

日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券市場の値動きに連動する投資成果をめざします。

## ファンドの特色

### 1 各投資対象資産の指数を均等比率で組み合わせた合成ベンチマークに連動する成果をめざして運用を行います。

東証株価指数(TOPIX)、MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(円換算ベース)、MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)、NOMURA-BPI総合、シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)、東証REIT指数(配当込み)およびS&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)を12.5%ずつ組み合わせた合成指数をいいます。

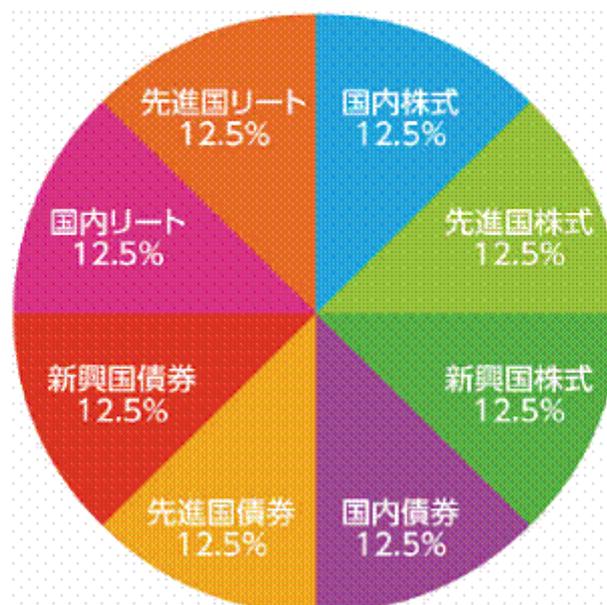
### 2 各マザーファンド等を通じて、日本を含む世界各国の株式(DR(預託証券)を含みます。)、公社債および不動産投資信託証券(リート)に実質的な投資を行います。

- 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式、公社債および不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。

DR(預託証券)とは、Depository Receiptの略で、ある国の企業の株式を当該国外の市場で流通させるため、現地法に従い発行した代替証券です。株式と同様に金融商品取引所等で取引されます。

資金動向および取引コスト等を勘案し、上場投資信託証券に直接投資することがあります。

### <基本投資割合>



### ＜各マザーファンドの主要投資対象と運用目標および基本投資割合＞

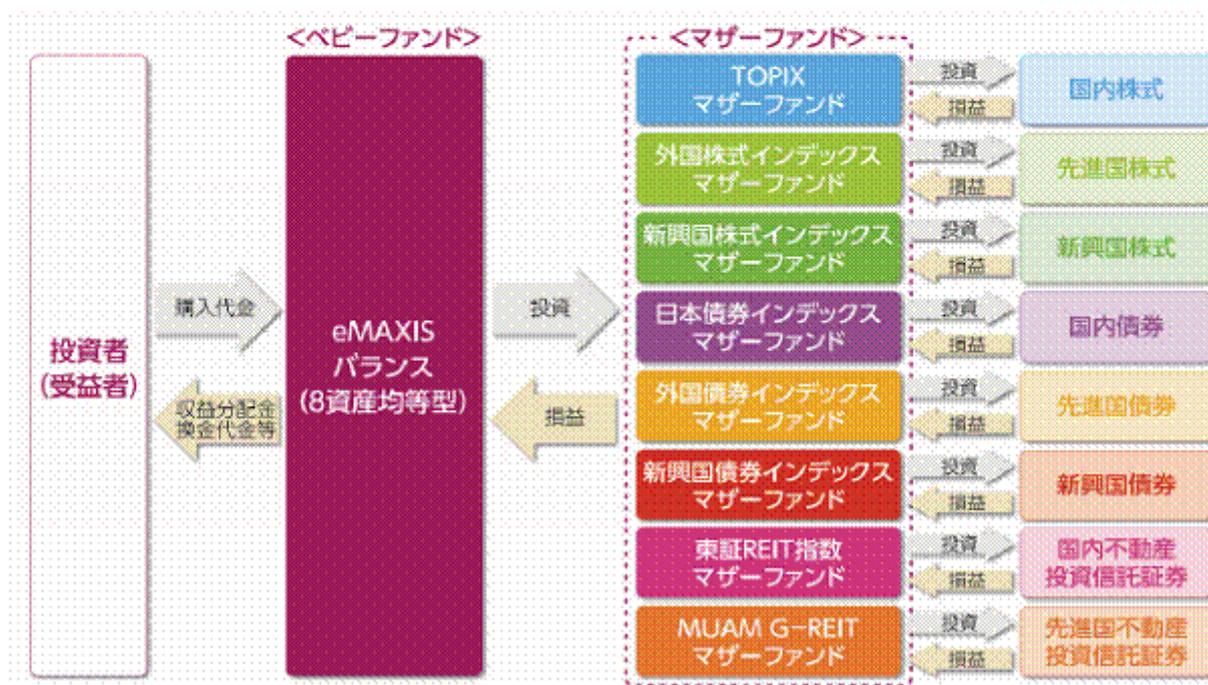
	主要投資対象	運用目標	基本投資割合
TOPIXマザーファンド	国内株式	東証株価指数(TOPIX)と連動する投資成果をめざして運用を行います。	12.5%
外国株式インデックスマザーファンド	先進国株式	MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。	12.5%
新興国株式インデックスマザーファンド	新興国株式	MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)と連動した投資成果をめざして運用を行います。	12.5%
日本債券インデックスマザーファンド	国内債券	NOMURA-BPI総合と連動する投資成果をめざして運用を行います。	12.5%
外国債券インデックスマザーファンド	先進国債券	シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。	12.5%
新興国債券インデックスマザーファンド	新興国債券	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。	12.5%
東証REIT指数マザーファンド	国内不動産投資信託証券	東証REIT指数(配当込み)と連動する投資成果をめざして運用を行います。	12.5%
MUAM G-REITマザーファンド	先進国不動産投資信託証券	S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。	12.5%

### 3 原則として、為替ヘッジは行いません。

- 為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

### ファンドの仕組み

運用は主に各マザーファンドへの投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券へ実質的に投資するファミリーファンド方式により行います。



## 主な投資制限

株式	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
株式の一銘柄制限	同一銘柄の株式への実質投資割合に制限を設けません。
外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
デリバティブ	デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。

## 分配方針

- 年1回の決算時(1月26日(休業日の場合は翌営業日))に分配を行います。
- 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。
- 分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、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。

## 指数について

- 東証株価指数(TOPIX)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す代表的な株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
- MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要国で構成されています。MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(円換算ベース)は、MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。また、MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)はMSCI Inc.の財産であり、「MSCI」はMSCI Inc.のサービスマークです。
- MSCI エマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)は、MSCI エマージング・マーケット・インデックス(米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。また、MSCI エマージング・マーケット・インデックスはMSCI Inc.の財産であり、「MSCI」はMSCI Inc.のサービスマークです。
- NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債および円建外債等で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI総合は野村證券株式会社の知的財産であり、当ファンドの運用成果に関し、野村證券株式会社は一切関係ありません。
- シティグループ世界国債インデックス(除く日本)とは、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、日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均し指数化した債券インデックスです。シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)とは、シティグループ世界国債インデックス(除く日本)をもとに、委託会社が計算したものです。
- JPMorgan GBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。JPMorgan GBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)とは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表しているJPモルガン GBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。当指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。
- 東証REIT指数(配当込み)とは、東京証券取引所に上場している不動産投資信託全銘柄を対象として算出した東証REIT指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。東証REIT指数の商標に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は東証REIT指数の内容の変更、公表の停止または商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。東京証券取引所は東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対して、責任を負いません。
- S&P先進国REITインデックスとは、スタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービスズ エル エル シーが有するS&Pグローバル株価指数の採用銘柄の中から、不動産投資信託(REIT)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指数です。S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)は、S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み)をもとに、委託会社が計算したものです。スタンダード&プアーズ及びその関連会社(以下、S&P)は、S&P先進国REITインデックスの計算及びその元になるデータの正確性や完全性を保証するものではありません。S&Pは、S&P先進国REITインデックスに含まれるいかなる誤り、欠落又は障害に対する責任を負いません。S&Pは、S&P先進国REITインデックス 又はそれらに含まれるデータの使用により、委託会社、本商品の所有者又はその他の人や組織に生じた結果に対して、明示的にも暗示的にも保証しません。S&Pは、S&P先進国REITインデックス 又はそれらに含まれるデータに関して、商品性の保証や適合性について何ら保証するものではないことを明示し、かつそれに関して明示もしくは暗示の保証を行いません。以上のことに関わらず、特定の、罰則的、間接的あるいは結果的な損害(利益の損失を含む)について、仮にその可能性について事前に通知されていたとしても、S&Pが責任を負うことはありません。

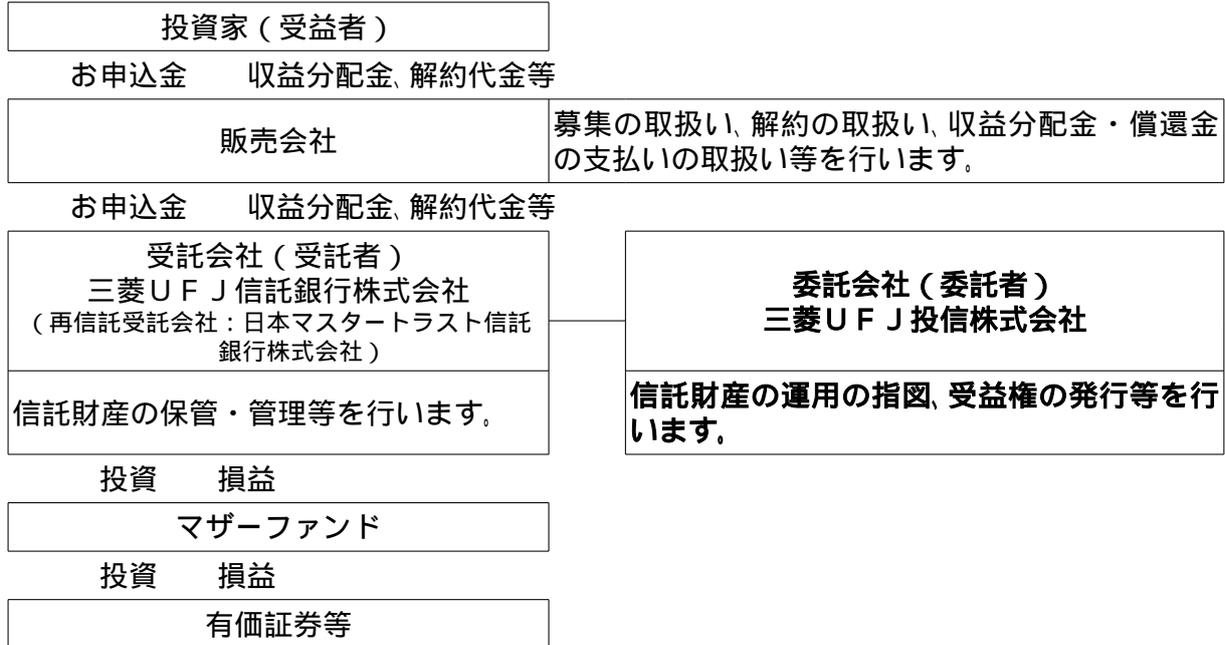
市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

## (2) 【ファンドの沿革】

平成23年10月31日 設定日、信託契約締結、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

委託会社およびファンドの関係法人の役割



## 委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「募集・販売の取扱い等に関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。

## 委託会社の概況

## ・資本金

2,000百万円（平成24年8月末現在）

## ・沿革

- 平成9年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始  
平成16年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更  
平成17年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更

## ・大株主の状況（平成24年8月末現在）

株主名	住所	所有株式数	所有比率
三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	62,050株	50.0%
株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区丸の内二丁目7番1号	31,025株	25.0%
株式会社三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区丸の内二丁目7番1号	31,023株	25.0%

## 2 【投資方針】

## (1) 【投資方針】

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券等への投資を

通じて、東証株価指数(TOPIX)、MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイインデックス)(円換算ベース)、MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)、NOMURA - BPI 総合、シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)、JPモルガンGBI EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)、東証REIT指数(配当込み)およびS&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)を12.5%ずつ組み合わせ合わせた合成ベンチマークに連動する成果をめざして運用を行います。このほか、日本を含む世界各国の株式(DR(預託証券)を含みます。以下同じ。)、公社債および上場投資信託証券(不動産投資信託証券を含みます。)に直接投資することがあります。

国内株式、先進国株式、新興国株式、国内債券、先進国債券、新興国債券、国内不動産投資信託証券および先進国不動産投資信託証券への実質的な基本投資割合は、純資産総額に対してそれぞれ12.5%とします。

対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し、株式、公社債および不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

## (2)【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款に定める次のものに限り、)

a. 有価証券先物取引等

b. スワップ取引

c. 金利先渡し取引および為替先渡し取引

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

### 有価証券の指図範囲

この信託において投資の対象とする有価証券(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。)は、三菱UFJ投信株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社とするTOPIXマザーファンド、外国株式インデックスマザーファンド、新興国株式インデックスマザーファンド、日本債券インデックスマザーファンド、外国債券インデックスマザーファンド、新興国債券インデックスマザーファンド、東証REIT指数マザーファンドおよびMUAM G - REITマザーファンド(「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。)の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)
6. 資産の流動化に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第13号で定める

ものをいいます。)

11. コマーシャル・ペーパー
12. 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
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から12. の証券または証書の性質を有するもの
14. 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。)
15. 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。16. において同じ。)
16. 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16. において同じ。)
17. 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。)
18. 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。)
19. 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。)
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
21. 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。)
22. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
23. 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
24. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいい、1. から23. に該当するものを除きます。)
25. 外国の者に対する権利で23. および24. の有価証券の性質を有するもの

なお、1. の証券または証書ならびに13. および19. の証券または証書のうち1. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2. から6. までの証券ならびに16. の証券ならびに13. および19. の証券または証書のうち2. から6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14. および15. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品の指図範囲

この信託において投資の対象とする金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号で定め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. 信託の受益権（金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものをいい、1. から5. に該当するものを除きます。)
7. 投資事業有限責任組合契約に基づく権利（金融商品取引法第2条第2項第5号に該当するものをいいます。)
8. 外国の者に対する権利で5. から7. の権利の性質を有するもの

その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

- ・外国為替予約取引

#### < マザーファンドの概要 >

##### TOPIXマザーファンド

##### (基本方針)

この投資信託は、東証株価指数（TOPIX）と連動する投資成果をめざして運用を行います。

##### (運用方法)

投資対象

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

#### 投資態度

東証株価指数（TOPIX）からカイ離するリスクと運用コストの極小化を目的として、定量的なリスク管理に基づいたポートフォリオ構築と適切な売買執行を行います。

株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

#### （投資制限）

株式への投資割合に制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

#### 外国株式インデックスマザーファンド

##### （基本方針）

この投資信託は、MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。

##### （運用方法）

#### 投資対象

MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（円換算ベース）に採用されている株式を主要投資対象とします。

#### 投資態度

投資成果をMSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（円換算ベース）の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。

- ・ 株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。

- ・ 銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

##### （投資制限）

株式への投資割合に制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

#### 新興国株式インデックスマザーファンド

##### （基本方針）

この投資信託は、MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)と連動した投資成果をめざして運用を行います。

(運用方法)

投資対象

新興国の株式等(DR(預託証券)を含みます。以下同じ。)を主要投資対象とします。

投資態度

新興国の株式等を主要投資対象とし、MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。

株式等の組入比率は原則として高位を保ちます。

対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式等の投資比率が100%を超える場合があります。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

株式への投資割合に制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するために行うことができます。

金利先渡取引および為替先渡取引は効率的な運用に資するために行うことができます。

外国為替予約取引は効率的な運用に資するために行うことができます。

## 日本債券インデックスマザーファンド

(基本方針)

この投資信託は、NOMURA - B P I 総合と連動する投資成果をめざして運用を行います。

(運用方法)

投資対象

NOMURA - B P I 総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。

投資態度

投資成果をNOMURA - B P I 総合の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。

・ 公社債の実質投資比率(組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。)は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。

・ 銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

## 外国債券インデックスマザーファンド

### （基本方針）

この投資信託は、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。

### （運用方法）

#### 投資対象

シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。

#### 投資態度

投資成果をシティグループ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。

- ・ 公社債の実質投資比率（組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。

- ・ 銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

### （投資制限）

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

## 新興国債券インデックスマザーファンド

### （基本方針）

この投資信託は、JPモルガンGBI EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

### （運用方法）

#### 投資対象

新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とします。

#### 投資態度

新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とし、JPモルガンGBI EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債、および新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価額等が連動する債券に投資することがあります。

対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の投資比率が100%を超える場合があります。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

### （投資制限）

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以

下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、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制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するために行うことができます。

金利先渡取引および為替先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

## 東証REIT指数マザーファンド

### （基本方針）

この投資信託は、東証REIT指数（配当込み）と連動する投資成果をめざして運用を行います。

### （運用方法）

#### 投資対象

東証REIT指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券（社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

#### 投資態度

わが国の金融商品取引所に上場している（上場予定を含みます。）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

原則として、不動産投資信託証券の組入比率は高位を維持します。

対象インデックスとの連動を維持するため、不動産投信指数先物取引を利用し不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。

市場動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

### （投資制限）

株式への投資は行いません。

投資信託証券への投資割合に制限を設けません。

外貨建資産への投資は行いません。

不動産投信指数先物取引を行うことができます。

## MUAM G - REITマザーファンド

### （基本方針）

この投資信託は、信託財産の成長を目指して運用を行います。

### （運用方法）

#### 投資対象

S & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券（社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

#### 投資態度

S & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果を目指して、運用を行います。

銘柄選定にあたっては、時価総額および流動性等を勘案します。

原則として、不動産投資信託証券の組入比率は高位を維持します。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

市場動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

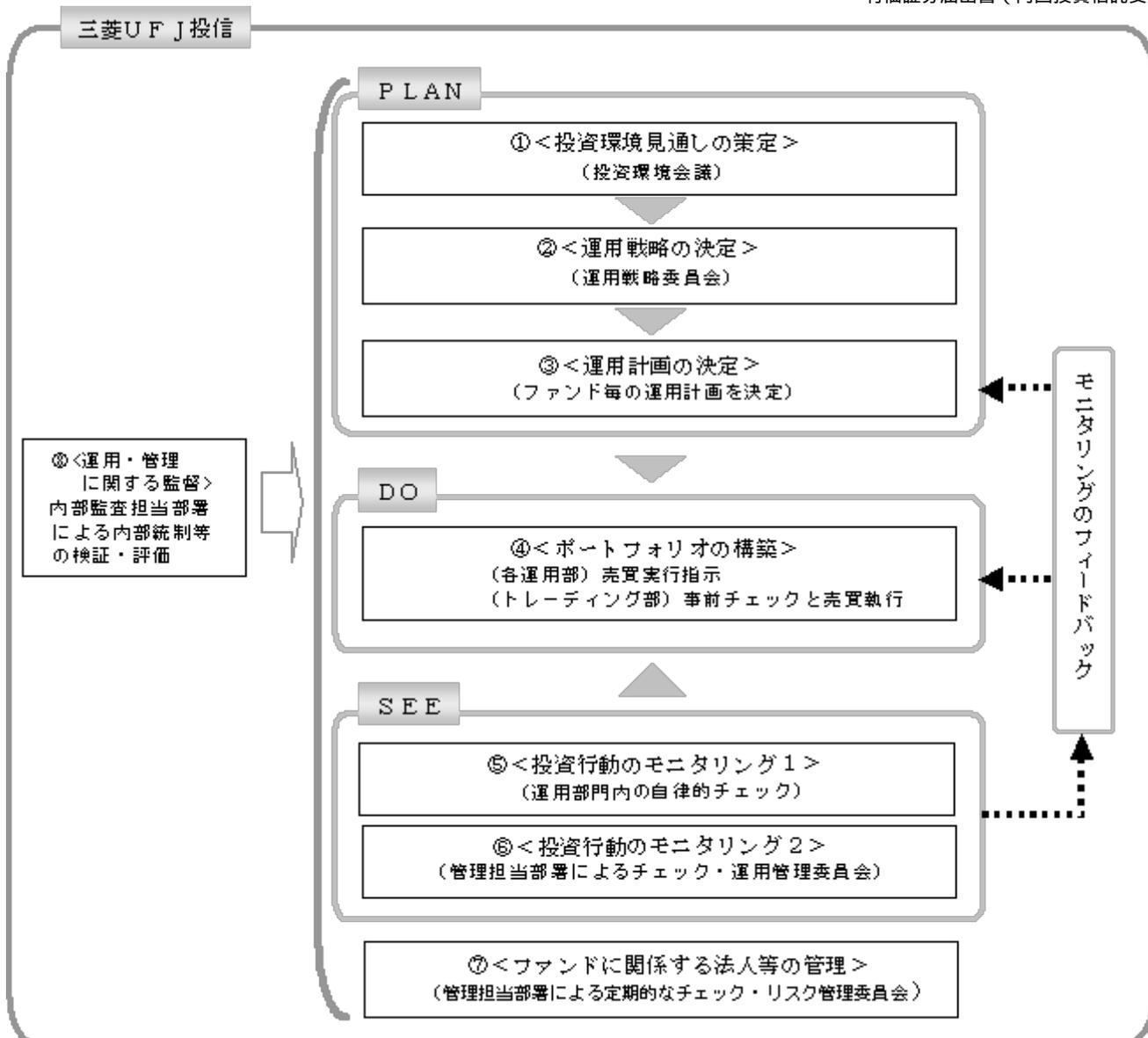
### （投資制限）

株式への直接投資は行いません。

投資信託証券への投資割合に制限を設けません。

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

## （3）【運用体制】



#### 投資環境見通しの策定

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

#### 運用戦略の決定

運用戦略委員会において、で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

#### 運用計画の決定

で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

#### ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部門から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

#### 投資行動のモニタリング1

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

#### 投資行動のモニタリング2

運用部門から独立した管理担当部署は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

#### ファンドに関係する法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に関係する法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

### 運用・管理に関する監督

内部監査担当部署（5名程度）は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

さらに、委託会社は、三菱UFJ信託銀行からの投資環境および全資産に関する助言を活用して、質の高い運用サービスの提供に努めています。

ファンドの運用体制等は平成24年10月26日現在のものであり、今後変更される可能性があります。

### （４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

分配対象額は、経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。

収益の分配にあてなかつた利益については、信託約款に定める運用の基本方針に基づいて運用を行います。

### （５）【投資制限】

#### < 信託約款に定められた投資制限 >

##### 株式

a. 委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。

b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める株式の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

##### 新株引受権証券および新株予約権証券

a. 委託会社は、取得時において信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

##### 投資信託証券

a. 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券（金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券をいいます。）を除きます。以下 a. および b. において同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

##### 同一銘柄の株式

同一銘柄の株式への実質投資割合に制限を設けません。

##### 同一銘柄の転換社債等

a. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債（新株予約権付社債のうち、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに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号の定めがあるものをいいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および

当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

#### スワップ取引

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### 信用取引

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- b. a. の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券により取得する株券
  2. 株式分割により取得する株券
  3. 有償増資により取得する株券
  4. 売出しにより取得する株券
  5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権( に規定する転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)の行使により取得可能な株券
  6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権( 5. に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

#### 外国為替予約取引

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- b. a. の予約取引の指図は、信託財産に係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時価総額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。
- c. b. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- d. b. の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

#### 有価証券の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- b. a. の指図は、当該借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

#### 資金の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または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わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の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、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- c. 収益分配金の再投資に係る借入期間は、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、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

#### 投資する株式等の範囲

- a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券についてはこの限りではありません。
- b. a. の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができます。

#### 金利先渡取引および為替先渡取引

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- b. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### 有価証券の貸付

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
  1. 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。
  2. 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。
- b. a. に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### 有価証券の空売り

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券またはの規定により借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- b. a. の売付けの指図は、当該売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

<その他法令等に定められた投資制限>

・同一の法人の発行する株式への投資制限

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

・デリバティブ取引の投資制限

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

### 3【投資リスク】

#### (1) 投資リスク

当ファンドの基準価額は、組み入れている有価証券等の価格変動による影響を受けますが、これらの運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。

したがって、投資者のみなさまの投資元金が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。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。このため、お申込みの際は、当ファンドのリスクを認識・検討し、慎重に投資のご判断を行っていただく必要があります。

#### 市場リスク

##### (価格変動リスク)

一般に、株式の価格は個々の企業の活動や業績、市場・経済の状況等を反映して変動し、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動し、また、不動産投資信託証券の価格は保有不動産等の価値やそこから得られる収益の増減等により変動するため、当ファンドはその影響を受け株式や公社債、不動産投資信託証券の価格が下落した場合には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。

保有不動産等の価値は、不動産市況、社会情勢等のマクロ的な要因の他、不動産の質や収益増減等の個別の要因によって変動しますが、災害等による保有不動産の滅失、劣化または毀損があった場合には、その影響を大きく受けることがあります。なお、保有不動産等から得られる収益は、賃料水準、稼働率、借入金利等の要因により変動します。

また、不動産投資信託証券は、株式と同様に上場市場で取引が行われ市場の需給を受けて価格が決定しますが、利回りに着目して取引される傾向もあるため、公社債と同様に、金利の影響を受けることがあります。よって、金利の上昇局面では、不動産投資信託証券に対する投資価値が相対的に低下し、不動産投資信託証券の市場価格が下落する場合があります。この場合、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。

##### (為替変動リスク)

実質的な主要投資対象である海外の株式や公社債、不動産投資信託証券は外貨建資産であり、原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を大きく受けます。そのため、為替相場が円高方向に進んだ場合には、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。

#### 信用リスク

信用リスクとは、有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等に、当該有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払いや償還金の支払いが滞る等の債務が不履行となること等をいいます。当ファンドは、信用リスクを伴い、その影響を受けますので、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。

#### 流動性リスク

有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない、または取引が不可能となるリスクのことを流動性リスクといい、当ファンドはそのリスクを伴います。例えば、組み入れている株式や公社債、不動産投資信託証券の売却を十分な流動性の下で行えないときは、市場実勢から期待される価格で売却できない可能性があります。この場合、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。

また、不動産投資信託証券は、株式と比べ市場規模が小さく、また、一般的に取引量も少ないため、流動性リスクも高い傾向にあります。

#### カントリーリスク

新興国への投資は、先進国への投資を行う場合に比べ、投資対象国におけるクーデターや重大な政治体制の変更、資産凍結を含む重大な規制の導入、政府のデフォルト等の発生による影響を受けることにより、市場・信用・流動性の各リスクが大きくなる可能性があります。この場合、基準価額の下落により損失を被り、投資元金を割り込む可能性が高まる場合があります。

#### 留意事項

- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- 収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- 当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- 当ファンドは、合成ベンチマークの動きに連動することをめざして運用を行いますが、信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比に違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因によりカイ離を生じることがあります。
- 不動産投資信託証券および不動産投資信託証券が保有する不動産に係る法律、税制、会計などの制度変更が、不動産投資信託証券の価格や配当率に影響を及ぼすことがあります。不動産投資信託証券の投資口数が増加する場合、1口当たりの不動産投資信託証券の収益性が低下することがあります。

#### (2) 投資リスクに対する管理体制

「投資リスク」をファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うこと、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行うこと、を基本の考え方として、投資リスクの管理体制を構築しています。

各投資リスクに関する管理体制は以下の通りです。

##### 市場リスク

##### (価格変動リスク・為替変動リスク)

市場リスクは、運用部門において、資産構成比率に関する事項や、その他のファンドのリスク特性に関する事項を主な対象項目として常時把握し、ファンドコンセプトに沿ったリスクの範囲でコントロールしています。

また、市場リスクは、運用部門から独立した管理担当部署によってリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行う体制をとっており、この結果は運用管理委員会等に報告されます。

##### 信用リスク

信用リスクについては、運用部門においてリスクの把握、ファンド毎に定められたリスクの範囲で

の運用、を行っているほか、運用部門から独立した管理担当部署でモニタリングを行うなど、市場リスクと同様の管理体制をとっています。

信用リスクは、財務・格付基準に関する事項や、分散投資に関する事項などを主な対象項目として管理していますが、格付等の外形的基準にとどまらず、発行体情報の収集と詳細な分析を行うよう努めています。

#### 流動性リスク

流動性リスクは、運用部門で市場の流動性の把握に努め、投資対象・売買数量等を適切に選択することによりコントロールしています。また、運用部門から独立した管理担当部署においても流動性についての情報収集や分析・管理を行い、この結果は運用管理委員会等に報告されます。

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

申込手数料はかかりません。

### (2)【換金(解約)手数料】

解約手数料はかかりません。

ただし、解約時に信託財産留保額(当該基準価額の0.15%)が差し引かれます。

換金の詳細については販売会社にご確認ください。

### (3)【信託報酬等】

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、以下により計算されます。

信託財産の純資産総額 × 年0.525% (税抜 年0.5%)

委託会社は、信託報酬から、販売会社に対し、販売会社の行う業務に対する報酬を支払います。したがって、実質的な信託報酬の配分は、次の通りとなります。

取扱純資産総額 <sup>(注)</sup>	委託会社	販売会社	受託会社
50億円未満の部分	年0.231% (税抜 年0.22%)	年0.231% (税抜 年0.22%)	年0.063% (税抜 年0.06%)
50億円以上100億円未満の部分	年0.2205% (税抜 年0.21%)	年0.2415% (税抜 年0.23%)	年0.063% (税抜 年0.06%)
100億円以上の部分	年0.21% (税抜 年0.2%)	年0.252% (税抜 年0.24%)	年0.063% (税抜 年0.06%)

(注) 各販売会社における取扱純資産総額に応じて配分されます。

信託報酬は、毎計算期間の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。

消費税および地方消費税に相当する金額(「消費税等相当額」といいます。)を含みます。なお、消費税率に応じて変更となることがあります。

ファンドは実質的に上場投資信託(リート)を投資対象としており、上場投資信託は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託の費用は表示しておりません。

### (4)【その他の手数料等】

信託財産に係る監査報酬および当該監査報酬に係る消費税等相当額は、毎計算期間の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外国株式インデックスマザーファンド、新興国株式インデックスマザーファンド、外国債券インデックスマザーファンド、新興国債券インデックスマザーファンド、東証REIT指数マザーファンドおよびMUAMG-REITマザーファンドの解約に伴う信託財産留保額、受託会社の立て替えた立替金の利息、借入金の利息および借入れに係る品借料は、受益者の負担として信託財産から支払われます。

上記の信託事務の処理に要する諸費用には、有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等、外国での資産の保管等に要する費用等が含まれます。

(\*) 「その他の手数料等」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。

ご投資家のみなさまにご負担いただく手数料等の合計額については、お申込金額や保有期間等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。

##### 個人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける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譲渡益については、次の通り課税されます。

##### １．収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。元本払戻金（特別分配金）は課税されません。

原則として、10%（所得税7%および地方税3%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除は適用されません。）・申告分離課税を選択することもできます。申告分離課税を選択した場合、10%（所得税7%および地方税3%）の税率となります。

##### ２．解約時および償還時の課税

解約価額および償還価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得とみなされて課税されます。

10%（所得税7%および地方税3%）の税率による申告分離課税が適用されます。

特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、10%（所得税7%および地方税3%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

解約時および償還時の損失（譲渡損）については、確定申告により収益分配金を含む上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。）との損益通算が可能となる仕組みがあります。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

平成24年12月31日までの税率です。平成25年12月31日までは軽減税率が適用されます。なお、復興特別所得税が付加されることにより、平成25年1月1日以降は10.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%、地方税3%）、軽減税率の適用終了後の平成26年1月1日以降は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率となる予定です。

##### 法人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける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7%）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、当ファンドは、益金不算入制度は適用されません。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

平成24年12月31日までの税率です。平成25年12月31日までは軽減税率が適用されます。なお、復興特別所得税が付加されることにより、平成25年1月1日以降は7.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%）、軽減税率の適用終了後の平成26年1月1日以降は15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）の税率となる予定です。

##### 個別元本について

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料（税込）は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。

受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

##### 収益分配金について

受益者が収益分配金を受け取る際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払

戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

上記は平成24年8月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

平成24年8月31日現在  
(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	337,113,790	98.99
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		3,443,835	1.01
純資産総額		340,557,625	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## a 評価額上位30銘柄

平成24年8月31日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	口数 (口)	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	外国債券インデックスマザー ファンド	親投資信託 受益証券		32,449,466	1.3140 1.3201	42,640,003 42,836,540		12.58
日本	MUAM G-REITマザー ファンド	親投資信託 受益証券		56,009,664	0.7152 0.7645	40,058,262 42,819,388		12.57
日本	東証REIT指数マザーファ ンド	親投資信託 受益証券		34,618,360	1.1239 1.2326	38,908,531 42,670,590		12.53
日本	外国株式インデックスマザー ファンド	親投資信託 受益証券		42,150,113	0.9854 1.0085	41,537,807 42,508,388		12.48
日本	新興国債券インデックスマ ザーファンド	親投資信託 受益証券		41,441,687	1.0250 1.0254	42,478,007 42,494,305		12.48
日本	新興国株式インデックスマ ザーファンド	親投資信託 受益証券		31,109,026	1.4199 1.3616	44,173,324 42,358,049		12.44
日本	TOPIXマザーファンド	親投資信託 受益証券		61,146,546	0.7204 0.6859	44,050,843 41,940,415		12.32
日本	日本債券インデックスマザー ファンド	親投資信託 受益証券		33,125,936	1.1802 1.1920	39,097,908 39,486,115		11.59

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

## b 全銘柄の種類/業種別投資比率

平成24年8月31日現在

種類/業種別	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.99
合計	98.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3)【運用実績】

## 【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成24年8月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額	基準価額 (1万口当たりの純資産価額)
第1計算期間末日 (平成24年1月26日)	111,381,675 (分配付) 111,381,675 (分配落)	10,093 (分配付) 10,093 (分配落)
平成23年10月末日	10,099,585	10,100
11月末日	19,594,602	9,558
12月末日	97,861,368	9,670
平成24年1月末日	112,605,143	10,002
2月末日	148,049,702	10,873
3月末日	205,913,542	11,053
4月末日	215,261,908	10,894

5月末日	225,855,707	10,070
6月末日	269,722,175	10,352
7月末日	295,462,686	10,463
8月末日	340,557,625	10,556

## 【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	0円

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.93
第1計算期間末日から 平成24年8月末日までの期間	4.58

(注)「収益率」とは、計算期間末の基準価額(分配付の額)から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額(分配落ちの額、以下「前期末基準価額」)を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数。ただし、第1計算期間末日から平成24年8月末日までの期間については平成24年8月末日の基準価額から前期末基準価額を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	116,680,281	6,320,932	110,359,349
第2計算期間期首から 平成24年8月31日までの期間	252,325,311	40,058,046	322,626,614

## &lt;参考&gt;

## 「TOPIXマザーファンド」

## (1) 投資状況

平成24年8月31日現在  
(単位:円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
株式	日本	170,805,503,772	98.72
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		2,215,995,507	1.28
純資産総額		173,021,499,279	100.00

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## その他の資産の投資状況

平成24年8月31日現在  
(単位:円)

資産の種類	時価合計	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2,215,825,000	1.28

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## a 評価額上位30銘柄

平成24年8月31日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	株式数	上段:帳簿価額 下段:評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	2,214,900	3,440.49 3,095.00	7,620,341,301 6,855,115,500		3.96
日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	12,764,000	418.42 356.00	5,340,712,880 4,543,984,000		2.63
日本	本田技研工業	株式	輸送用機器	1,441,100	3,110.19 2,472.00	4,482,094,809 3,562,399,200		2.06
日本	三井住友フィナンシャルグループ	株式	銀行業	1,280,100	2,775.69 2,424.00	3,553,160,769 3,102,962,400		1.79
日本	日本電信電話	株式	情報・通信業	776,400	3,776.74 3,615.00	2,932,260,936 2,806,686,000		1.62

日本	キヤノン	株式	電気機器	1,061,100	3,815.46 2,595.00	4,048,584,606 2,753,554,500	1.59
日本	みずほフィナンシャルグループ	株式	銀行業	21,685,500	139.33 126.00	3,021,440,715 2,732,373,000	1.58
日本	武田薬品工業	株式	医薬品	670,100	3,741.98 3,670.00	2,507,500,798 2,459,267,000	1.42
日本	ソフトバンク	株式	情報・通信業	763,800	2,456.87 3,190.00	1,876,557,306 2,436,522,000	1.41
日本	ファナック	株式	電気機器	177,800	14,849.36 12,790.00	2,640,216,208 2,274,062,000	1.31
日本	日本たばこ産業	株式	食料品	848,600	2,278.69 2,361.00	1,933,696,334 2,003,544,600	1.16
日本	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	株式	情報・通信業	13,890	139,911.51 133,200.00	1,943,370,873 1,850,148,000	1.07
日本	日立製作所	株式	電気機器	3,936,000	512.54 449.00	2,017,357,440 1,767,264,000	1.02
日本	三菱商事	株式	卸売業	1,227,800	1,949.39 1,439.00	2,393,461,042 1,766,804,200	1.02
日本	セブン&アイ・ホールディングス	株式	小売業	705,200	2,365.90 2,375.00	1,668,432,680 1,674,850,000	0.97
日本	三菱地所	株式	不動産業	1,180,000	1,434.30 1,373.00	1,692,474,000 1,620,140,000	0.94
日本	三井物産	株式	卸売業	1,455,200	1,380.49 1,093.00	2,008,889,048 1,590,533,600	0.92
日本	日産自動車	株式	輸送用機器	2,173,200	865.72 730.00	1,881,382,704 1,586,436,000	0.92
日本	東日本旅客鉄道	株式	陸運業	297,000	5,261.03 5,240.00	1,562,525,910 1,556,280,000	0.90
日本	アステラス製薬	株式	医薬品	397,100	3,424.21 3,820.00	1,359,753,791 1,516,922,000	0.88
日本	KDDI	株式	情報・通信業	2,616	535,316.19 560,000.00	1,400,387,153 1,464,960,000	0.85
日本	信越化学工業	株式	化学	320,800	4,718.30 4,185.00	1,513,630,640 1,342,548,000	0.78
日本	小松製作所	株式	機械	834,300	2,349.80 1,540.00	1,960,438,140 1,284,822,000	0.74
日本	東京海上ホールディングス	株式	保険業	612,200	2,204.13 1,874.00	1,349,368,386 1,147,262,800	0.66
日本	花王	株式	化学	474,500	2,146.20 2,364.00	1,018,371,900 1,121,718,000	0.65
日本	デンソー	株式	輸送用機器	422,000	2,735.62 2,610.00	1,154,431,640 1,101,420,000	0.64
日本	三井不動産	株式	不動産業	748,000	1,533.84 1,453.00	1,147,312,320 1,086,844,000	0.63
日本	三菱電機	株式	電気機器	1,708,000	703.83 636.00	1,202,141,640 1,086,288,000	0.63
日本	伊藤忠商事	株式	卸売業	1,344,900	936.23 794.00	1,259,135,727 1,067,850,600	0.62
日本	パナソニック	株式	電気機器	1,951,500	736.77 532.00	1,437,806,655 1,038,198,000	0.60

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

## b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成24年8月31日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	水産・農林業	0.09
	鉱業	0.68
	建設業	2.52
	食料品	4.25
	繊維製品	0.84
	パルプ・紙	0.28
	化学	5.71
	医薬品	5.51
	石油・石炭製品	0.75
	ゴム製品	0.82
	ガラス・土石製品	0.94
	鉄鋼	1.40
	非鉄金属	1.04
	金属製品	0.71
	機械	4.63
	電気機器	12.01
	輸送用機器	10.33
	精密機器	1.50
	その他製品	1.47
	電気・ガス業	2.41
陸運業	4.46	

海運業	0.29
空運業	0.31
倉庫・運輸関連業	0.23
情報・通信業	7.04
卸売業	5.40
小売業	4.54
銀行業	9.72
証券・商品先物取引業	1.02
保険業	2.13
その他金融業	0.89
不動産業	2.68
サービス業	2.11
合計	98.72

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

平成24年8月31日現在

資産の種類	取引所名	建別	数量 (枚)	簿価(円)	評価額(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引						
TOPIX 12年9月限	東京証券取引所	買建	305	2,273,431,200	2,215,825,000	1.28

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該投資資産の評価金額の比率です。

### <参考>

#### 「外国株式インデックスマザーファンド」

#### (1) 投資状況

平成24年8月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
株式	アメリカ	81,528,208,251	56.59
	イギリス	14,547,435,047	10.10
	カナダ	7,644,411,873	5.31
	スイス	5,409,963,109	3.76
	フランス	5,381,913,517	3.74
	オーストラリア	5,262,023,337	3.65
	ドイツ	5,186,260,950	3.60
	スウェーデン	2,004,061,129	1.39
	香港	1,838,065,673	1.28
	オランダ	1,733,116,343	1.20
	スペイン	1,655,427,828	1.15
	イタリア	1,294,510,512	0.90
	シンガポール	1,159,204,445	0.80
	デンマーク	759,415,017	0.53
	ベルギー	723,230,040	0.50
	ノルウェー	620,814,480	0.43
	フィンランド	457,701,707	0.32
	イスラエル	373,360,406	0.26
	ルクセンブルグ	191,493,383	0.13
	オーストリア	166,411,013	0.12
	アイルランド	162,087,022	0.11
	ポルトガル	101,590,852	0.07
	ニュージーランド	73,280,153	0.05
ギリシャ	22,929,937	0.02	
投資証券	アメリカ	2,267,058,935	1.57
	オーストラリア	418,289,463	0.29
	イギリス	179,170,495	0.12
	フランス	173,084,675	0.12
	香港	64,573,431	0.04
	シンガポール	48,078,705	0.03

	カナダ	37,008,244	0.03
	オランダ	17,102,925	0.01
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		2,560,166,538	1.78
純資産総額		144,061,449,435	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## その他の資産の投資状況

平成24年8月31日現在

（単位：円）

資産の種類	時価合計	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）	1,344,243,297	0.93

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## （2）投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### a 評価額上位30銘柄

平成24年8月31日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	株式数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
アメリカ	APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	75,600	44,563.05 52,195.11	3,368,967,033 3,945,950,769		2.74
アメリカ	EXXON MOBIL CORP	株式	エネルギー	382,400	6,525.37 6,853.92	2,495,302,252 2,620,939,008		1.82
アメリカ	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	612,100	2,442.88 2,383.15	1,495,291,744 1,458,727,339		1.01
アメリカ	CHEVRON CORP	株式	エネルギー	160,600	8,063.57 8,719.09	1,295,009,984 1,400,287,138		0.97
アメリカ	GENERAL ELECTRIC CO	株式	資本財	857,100	1,494.18 1,622.30	1,280,666,820 1,390,476,758		0.97
アメリカ	AT&T INC	株式	電気通信サービス	479,700	2,640.96 2,883.83	1,266,868,512 1,383,375,169		0.96
アメリカ	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	ソフトウェア・サービス	89,100	15,793.09 15,198.88	1,407,165,031 1,354,220,386		0.94
スイス	NESTLE SA-REG	株式	食品・飲料・タバコ	267,277	4,513.22 4,884.14	1,206,281,398 1,305,418,821		0.91
アメリカ	JOHNSON & JOHNSON	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	222,000	5,046.12 5,282.70	1,120,238,640 1,172,760,732		0.81
アメリカ	PROCTER & GAMBLE CO/THE	株式	家庭用品・パーソナル用品	222,900	5,001.31 5,256.76	1,114,793,782 1,171,733,587		0.81
アメリカ	PFIZER INC	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	609,700	1,778.71 1,873.82	1,084,484,364 1,142,470,492		0.79
アメリカ	GOOGLE INC-CL A	株式	ソフトウェア・サービス	21,000	47,499.55 53,580.04	997,490,592 1,125,181,008		0.78
アメリカ	WELLS FARGO & CO	株式	銀行	407,000	2,611.87 2,662.18	1,063,034,346 1,083,508,074		0.75
イギリス	HSBC HOLDINGS PLC	株式	銀行	1,461,867	685.14 680.05	1,001,587,064 994,147,740		0.69
アメリカ	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	株式	食品・飲料・タバコ	139,200	6,763.53 7,117.23	941,483,376 990,718,416		0.69
アメリカ	COCA-COLA CO/THE	株式	食品・飲料・タバコ	330,800	3,039.46 2,919.20	1,005,454,029 965,672,683		0.67
イギリス	VODAFONE GROUP PLC	株式	電気通信サービス	4,045,554	212.24 227.26	858,649,417 919,407,651		0.64
アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	株式	各種金融	307,500	2,893.26 2,900.34	889,679,295 891,854,550		0.62
アメリカ	WAL-MART STORES INC	株式	食品・生活必需品 小売り	152,900	4,686.13 5,678.85	716,509,582 868,296,165		0.60
スイス	NOVARTIS AG-REG	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	186,530	4,069.43 4,622.12	759,071,897 862,165,162		0.60
イギリス	BP PLC	株式	エネルギー	1,540,216	513.85 548.67	791,450,465 845,074,100		0.59
アメリカ	MERCK & CO. INC.	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	247,100	2,988.37 3,389.23	738,426,721 837,479,227		0.58
イギリス	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	株式	エネルギー	298,237	2,561.83 2,741.81	764,034,521 817,709,427		0.57
スイス	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	57,005	12,845.33 14,124.30	732,248,287 805,155,721		0.56

アメリカ	ORACLE CORP	株式	ソフトウェア・サービス	325,100	2,122.20 2,450.74	689,927,220 796,738,174		0.55
アメリカ	INTEL CORP	株式	半導体・半導体製造装置	406,100	2,166.21 1,907.62	879,700,317 774,685,294		0.54
アメリカ	VERIZON COMMUNICATIONS INC	株式	電気通信サービス	230,100	3,235.96 3,361.72	744,594,856 773,532,232		0.54
イギリス	GLAXOSMITHKLINE PLC	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	409,648	1,767.46 1,787.32	724,040,058 732,175,340		0.51
アメリカ	PEPSICO INC	株式	食品・飲料・タバコ	127,400	5,253.62 5,673.34	669,311,697 722,784,535		0.50
オーストラリア	BHP BILLITON LTD	株式	素材	261,223	2,768.39 2,587.99	723,169,230 676,042,772		0.47

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

#### b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成24年8月31日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	エネルギー	11.48
	素材	6.50
	資本財	7.11
	商業・専門サービス	0.82
	運輸	1.74
	自動車・自動車部品	1.18
	耐久消費財・アパレル	1.25
	消費者サービス	1.65
	メディア	2.73
	小売	3.04
	食品・生活必需品小売り	2.38
	食品・飲料・タバコ	7.08
	家庭用品・パーソナル用品	1.82
	ヘルスケア機器・サービス	2.65
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.11
	銀行	7.28
	各種金融	4.25
	保険	3.94
	不動産	0.69
	ソフトウェア・サービス	6.10
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.04
	電気通信サービス	4.04
	公益事業	3.58
半導体・半導体製造装置	1.54	
小計	96.00	
投資証券		2.22
合計		98.22

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

平成24年8月31日現在

資産の種類	取引所名	建別	数量 (枚)	通貨	簿価	評価額	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引								
S&P 500 (2012年9月限)	シカゴ商業取引所	買建	30	アメリカ ドル	10,580,465.00	10,478,250.00	823,590,450	0.57
FTSE100 (2012年9月限)	ロンドン国際金融先物 オプション取引所	買建	17	イギリス ポンド	988,339.50	972,485.00	120,704,838	0.08
SP/TSE60 (2012年9月限)	モントリオール取引所	買建	5	カナダドル	689,825.00	680,400.00	53,853,660	0.04
SPI 200 (2012年9月限)	シドニー先物取引所	買建	15	オーストラ リアドル	1,516,957.50	1,614,375.00	130,602,937	0.09
EURO ST (2012年9月限)	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	買建	80	ユーロ	1,969,500.00	1,925,600.00	189,363,504	0.13
SWISS IX (2012年9月限)	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	買建	5	スイス フラン	325,275.00	319,100.00	26,127,908	0.02

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該投資資産の評価金額の比率です。

## &lt;参考&gt;

「新興国株式インデックスマザーファンド」

## (1) 投資状況

平成24年8月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
株式	香港	2,659,425,004	17.00
	韓国	2,312,577,023	14.78
	アメリカ	1,948,099,548	12.45
	ブラジル	1,853,457,016	11.85
	台湾	1,535,651,581	9.81
	南アフリカ	1,198,733,050	7.66
	インド	807,013,164	5.16
	メキシコ	729,772,432	4.66
	マレーシア	578,018,271	3.69
	インドネシア	416,961,808	2.66
	タイ	334,477,191	2.14
	トルコ	266,350,362	1.70
	ポーランド	212,053,321	1.36
	チリ	169,707,740	1.08
	フィリピン	137,520,108	0.88
	チェコ	52,386,840	0.33
	ハンガリー	43,445,036	0.28
	モロッコ	8,496,576	0.05
投資証券	フランス	16,391,802	0.10
	アメリカ	15,822,180	0.10
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		350,923,496	2.26
純資産総額		15,647,283,549	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## その他の資産の投資状況

平成24年8月31日現在

(単位：円)

資産の種類	時価合計	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）	324,536,256	2.07

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## a 評価額上位30銘柄

平成24年8月31日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	株式数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
韓国	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	半導体・ 半導体製造装置	6,210	89,582.49 84,321.00	556,307,643 523,633,410		3.35
台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	株式	半導体・ 半導体製造装置	1,344,000	221.80 216.67	298,122,720 291,209,856		1.86
香港	CHINA MOBILE LTD	株式	電気通信 サービス	340,000	876.04 842.30	297,885,230 286,385,230		1.83
アメリカ	GAZPROM OAO-SPON ADR	株式	エネルギー	309,500	806.43 749.84	249,731,655 232,076,718		1.48
香港	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	株式	銀行	4,105,550	55.91 51.96	229,680,763 213,352,706		1.36
メキシコ	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	株式	電気通信 サービス	1,980,000	101.01 99.18	200,089,455 196,391,448		1.26
ブラジル	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	株式	エネルギー	215,000	745.91 807.30	160,393,609 173,570,532		1.11
香港	IND & COMM BK OF CHINA-H	株式	銀行	3,646,350	48.82 42.44	178,205,564 154,768,231		0.99
韓国	HYUNDAI MOTOR CO	株式	自動車・ 自動車部品	8,750	17,155.81 17,072.40	150,113,560 149,383,500		0.95
香港	CNOOC LTD	株式	エネルギー	985,000	150.83 149.31	148,591,809 147,076,457		0.94
南アフリ カ	MTN GROUP LTD	株式	電気通信 サービス	99,000	1,278.71 1,444.56	126,593,156 143,011,440		0.91
ブラジル	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	株式	エネルギー	171,000	786.96 833.01	134,617,870 142,445,171		0.91
ブラジル	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	株式	銀行	112,400	1,119.25 1,247.02	125,832,486 140,165,610		0.90
ブラジル	VALE SA-PREF	株式	素材	113,000	1,435.80 1,240.11	162,269,415 140,133,379		0.90
香港	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ソフトウェア・ サービス	56,500	2,267.29 2,410.94	128,107,397 136,218,110		0.87
アメリカ	LUKOIL OAO-SPON ADR	株式	エネルギー	29,000	4,341.86 4,527.36	125,925,208 131,293,440		0.84
香港	BANK OF CHINA LTD-H	株式	銀行	4,330,000	30.18 28.87	131,019,503 125,009,265		0.80
アメリカ	SBERBANK-SPONSORED ADR	株式	銀行	137,000	936.91 903.90	128,430,785 123,834,300		0.79
ブラジル	BANCO BRADESCO SA-PREF	株式	銀行	93,186	1,146.11 1,293.06	106,828,099 120,495,927		0.77
香港	PETROCHINA CO LTD-H	株式	エネルギー	1,219,000	105.04 95.62	128,175,301 116,569,556		0.74
ブラジル	CIA DE BEBIDAS DAS AME-PREF	株式	食品・飲料・ タバコ	36,500	2,935.68 2,883.50	107,155,719 105,247,950		0.67
南アフリ カ	NASPERS LTD-N SHS	株式	メディア	22,600	4,164.12 4,470.17	94,110,762 101,025,896		0.65
アメリカ	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	株式	エネルギー	22,000	4,878.70 4,534.43	107,343,150 99,757,548		0.64
台湾	HON HAI PRECISION INDUSTRY	株式	テクノロジー・ ハードウェア および機器	442,124	205.95 224.01	91,068,420 99,040,197		0.63
南アフリ カ	SASOL LTD	株式	エネルギー	27,400	3,375.36 3,324.34	92,486,488 91,086,916		0.58
韓国	POSCO	株式	素材	3,400	26,655.29 25,469.80	90,628,050 86,597,320		0.55
香港	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	株式	保険	409,000	200.16 211.71	81,869,326 86,592,253		0.55
韓国	HYUNDAI MOBIS	株式	自動車・ 自動車部品	3,950	19,746.24 21,375.20	77,997,875 84,432,040		0.54
ブラジル	VALE SA	株式	素材	67,000	1,492.59 1,258.53	100,021,314 84,321,912		0.54
韓国	KIA MOTORS CORPORATION	株式	自動車・ 自動車部品	15,200	5,561.23 5,239.70	84,531,268 79,643,440		0.51

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

## b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成24年8月31日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	エネルギー	12.66
	素材	11.31
	資本財	4.92
	商業・専門サービス	0.07
	運輸	1.53

自動車・自動車部品	3.79
耐久消費財・アパレル	0.91
消費者サービス	0.41
メディア	1.07
小売	1.79
食品・生活必需品小売り	2.15
食品・飲料・タバコ	4.98
家庭用品・パーソナル用品	1.20
ヘルスケア機器・サービス	0.54
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.74
銀行	17.54
各種金融	2.38
保険	2.74
不動産	1.75
ソフトウェア・サービス	2.76
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.39
電気通信サービス	8.10
公益事業	3.71
半導体・半導体製造装置	7.15
小計	97.55
投資証券	0.21
合計	97.76

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

平成24年8月31日現在

資産の種類	取引所名	建別	数量 (枚)	通貨	簿価	評価額	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引								
MINI MS (2012年9月限)	ニューヨーク証券取引所	買建	88	アメリカ ドル	4,233,405.00	4,128,960.00	324,536,256	2.07

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該投資資産の評価金額の比率です。

[次へ](#)

&lt; 参考 &gt;

「日本債券インデックスマザーファンド」

( 1 ) 投資状況

平成24年8月31日現在

( 単位：円 )

資産の種類	国 / 地域名	時価合計	投資比率 (%)
国債証券	日本	151,189,199,490	75.84
地方債証券	日本	13,298,389,966	6.67
特殊債券	日本	19,338,914,516	9.70
社債券	日本	13,975,652,720	7.01
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		1,553,297,413	0.78
純資産総額		199,355,454,105	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

平成24年8月31日現在

( 単位：円 )

資産の種類	時価合計	投資比率 (%)
債券先物取引 (買建)	432,000,000	0.22

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## a 評価額上位30銘柄

平成24年8月31日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	券面総額 (千円)	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	第259回利付国債(10年)	国債証券		6,515,000	102.56 102.1600	6,681,947,100 6,655,724,000	1.500000 2014/03/20	3.34
日本	第256回利付国債(10年)	国債証券		6,210,000	102.07 101.6850	6,338,547,000 6,314,638,500	1.400000 2013/12/20	3.17
日本	第262回利付国債(10年)	国債証券		5,420,000	103.66 103.2280	5,618,458,000 5,594,957,600	1.900000 2014/06/20	2.81
日本	第263回利付国債(10年)	国債証券		4,858,000	103.37 103.0700	5,022,157,800 5,007,140,600	1.600000 2014/09/20	2.51
日本	第284回利付国債(10年)	国債証券		4,146,000	106.76 106.5660	4,426,269,600 4,418,226,360	1.700000 2016/12/20	2.22
日本	第285回利付国債(10年)	国債証券		3,998,000	107.05 106.8440	4,279,921,680 4,271,623,120	1.700000 2017/03/20	2.14
日本	第283回利付国債(10年)	国債証券		3,792,000	106.91 106.6740	4,054,042,800 4,045,078,080	1.800000 2016/09/20	2.03
日本	第276回利付国債(10年)	国債証券		3,590,000	105.19 104.9060	3,776,678,400 3,766,125,400	1.600000 2015/12/20	1.89
日本	第281回利付国債(10年)	国債証券		3,483,000	107.38 107.0760	3,740,355,050 3,729,457,080	2.000000 2016/06/20	1.87
日本	第268回利付国債(10年)	国債証券		3,562,000	103.90 103.5590	3,701,093,900 3,688,771,580	1.500000 2015/03/20	1.85
日本	第287回利付国債(10年)	国債証券		3,230,000	108.27 108.0680	3,497,252,500 3,490,596,400	1.900000 2017/06/20	1.75
日本	第270回利付国債(10年)	国債証券		3,089,000	103.62 103.3550	3,200,968,500 3,192,635,950	1.300000 2015/06/20	1.60
日本	第265回利付国債(10年)	国債証券		2,988,000	103.59 103.2140	3,095,538,120 3,084,034,320	1.500000 2014/12/20	1.55
日本	第279回利付国債(10年)	国債証券		2,855,000	107.02 106.6450	3,055,421,000 3,044,714,750	2.000000 2016/03/20	1.53
日本	第323回利付国債(10年)	国債証券		2,475,000	100.88 100.9990	2,496,876,300 2,499,725,250	0.900000 2022/06/20	1.25
日本	第273回利付国債(10年)	国債証券		2,388,000	104.56 104.2480	2,496,941,800 2,489,442,240	1.500000 2015/09/20	1.25
日本	第310回利付国債(10年)	国債証券		2,361,000	102.73 103.3860	2,425,455,300 2,440,943,460	1.000000 2020/09/20	1.22
日本	第308回利付国債(10年)	国債証券		2,114,000	105.33 105.8010	2,226,836,600 2,236,633,140	1.300000 2020/06/20	1.12
日本	第319回利付国債(10年)	国債証券		2,029,000	102.58 103.2640	2,081,348,200 2,095,226,560	1.100000 2021/12/20	1.05
日本	第303回利付国債(10年)	国債証券		1,945,000	106.33 106.6310	2,068,190,000 2,073,972,950	1.400000 2019/09/20	1.04
日本	第313回利付国債(10年)	国債証券		1,859,000	104.87 105.5150	1,949,606,100 1,961,523,850	1.300000 2021/03/20	0.98
日本	第315回利付国債(10年)	国債証券		1,863,000	103.88 104.5300	1,935,312,100 1,947,393,900	1.200000 2021/06/20	0.98
日本	第292回利付国債(10年)	国債証券		1,794,000	107.88 107.8630	1,935,435,400 1,935,062,220	1.700000 2018/03/20	0.97
日本	第305回利付国債(10年)	国債証券		1,668,000	105.53 105.9270	1,760,240,400 1,766,862,360	1.300000 2019/12/20	0.89
日本	第317回利付国債(10年)	国債証券		1,707,000	102.82 103.4900	1,755,152,080 1,766,574,300	1.100000 2021/09/20	0.89
日本	第321回利付国債(10年)	国債証券		1,705,000	101.52 102.1340	1,731,037,350 1,741,384,700	1.000000 2022/03/20	0.87
日本	第297回利付国債(10年)	国債証券		1,626,000	106.29 106.5300	1,728,275,400 1,732,177,800	1.400000 2018/12/20	0.87
日本	第288回利付国債(10年)	国債証券		1,561,000	107.51 107.3820	1,678,293,500 1,676,233,020	1.700000 2017/09/20	0.84
日本	第306回利付国債(10年)	国債証券		1,548,000	106.21 106.6160	1,644,162,250 1,650,415,680	1.400000 2020/03/20	0.83
日本	第312回利付国債(10年)	国債証券		1,550,000	104.18 104.8220	1,614,862,300 1,624,741,000	1.200000 2020/12/20	0.81

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

## b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成24年8月31日現在

種類 / 業種別	投資比率(%)
国債証券	75.84
地方債証券	6.67
特殊債証券	9.70
社債証券	7.01
合計	99.22

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

平成24年8月31日現在

資産の種類	取引所名	建別	数量	簿価(円)	評価額(円)	投資比率 (%)
債券先物取引						
長期国債先物 1 2 年 9 月 限	東京証券取引所	買建	3	430,863,150	432,000,000	0.22

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該投資資産の評価金額の比率です。

## &lt;参考&gt;

「外国債券インデックスマザーファンド」

## (1) 投資状況

平成24年8月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	67,438,497,129	42.62
	フランス	15,200,448,956	9.61
	ドイツ	13,942,464,549	8.81
	イタリア	13,421,932,687	8.48
	イギリス	13,225,553,135	8.36
	スペイン	5,943,297,383	3.76
	カナダ	4,632,775,269	2.93
	オランダ	4,145,823,325	2.62
	ベルギー	4,072,213,671	2.57
	オーストリア	2,760,251,373	1.74
	オーストラリア	2,373,472,353	1.50
	メキシコ	1,480,826,168	0.94
	デンマーク	1,371,447,198	0.87
	ポーランド	1,130,406,845	0.71
	アイルランド	1,022,195,130	0.65
	スウェーデン	966,707,091	0.61
	フィンランド	892,333,718	0.56
	マレーシア	835,433,127	0.53
スイス	622,991,103	0.39	
シンガポール	588,744,684	0.37	
ノルウェー	378,323,805	0.24	
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		1,788,951,723	1.13
純資産総額		158,235,090,422	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## (2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 30 銘柄

平成24年8月31日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	券面総額	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
アメリカ	3.625 T-NOTE 200215	国債証券		9,700,000.00	9,160.58 9,258.2203	888,576,683 898,047,370	3.625000 2020/02/15	0.57
アメリカ	2 T-NOTE 220215	国債証券		10,000,000.00	8,008.15 8,179.0054	800,815,117 817,900,546	2.000000 2022/02/15	0.52
アメリカ	2.625 T-NOTE 200815	国債証券		8,500,000.00	8,544.37 8,677.3171	726,271,675 737,571,960	2.625000 2020/08/15	0.47
アメリカ	3.5 T-NOTE 200515	国債証券		7,200,000.00	9,092.42 9,198.6562	654,654,487 662,303,250	3.500000 2020/05/15	0.42
アメリカ	4.25 T-BOND 401115	国債証券		6,300,000.00	9,842.80 10,375.8140	620,096,891 653,676,285	4.250000 2040/11/15	0.41
アメリカ	3.125 T-NOTE 210515	国債証券		7,100,000.00	8,833.90 8,986.8046	627,207,121 638,063,132	3.125000 2021/05/15	0.40
アメリカ	4.625 T-BOND 400215	国債証券		5,800,000.00	10,428.00 10,965.3140	604,824,543 635,988,215	4.625000 2040/02/15	0.40

アメリカ	4.375 T-BOND 400515	国債証券	6,000,000.00	10,036.85 10,568.6296	602,211,093 634,117,781	4.375000 2040/05/15	0.40
アメリカ	3.625 T-NOTE 210215	国債証券	6,800,000.00	9,170.10 9,302.4328	623,566,958 632,565,431	3.625000 2021/02/15	0.40
アメリカ	3.875 T-BOND 400815	国債証券	6,400,000.00	9,251.46 9,766.3570	592,093,800 625,046,849	3.875000 2040/08/15	0.40
アメリカ	4.75 T-BOND 410215	国債証券	5,500,000.00	10,638.01 11,196.2015	585,091,031 615,791,085	4.750000 2041/02/15	0.39
アメリカ	4.375 T-BOND 410515	国債証券	5,700,000.00	10,044.22 10,585.8234	572,520,557 603,391,935	4.375000 2041/05/15	0.38
アメリカ	4.375 T-BOND 391115	国債証券	5,500,000.00	10,035.00 10,559.4187	551,925,515 580,768,031	4.375000 2039/11/15	0.37
アメリカ	2 T-NOTE 211115	国債証券	6,900,000.00	8,083.96 8,202.0328	557,793,494 565,940,263	2.000000 2021/11/15	0.36
アメリカ	3.125 T-NOTE 190515	国債証券	6,300,000.00	8,877.87 8,948.7328	559,305,810 563,770,166	3.125000 2019/05/15	0.36
アメリカ	0.25 T-NOTE 140531	国債証券	7,000,000.00	7,857.95 7,859.6929	550,056,948 550,178,506	0.250000 2014/05/31	0.35
アメリカ	2.625 T-NOTE 201115	国債証券	6,300,000.00	8,526.87 8,672.4046	537,192,927 546,361,495	2.625000 2020/11/15	0.35
フランス	4.25 O.A.T 231025	国債証券	4,600,000.00	11,061.28 11,672.9580	508,819,027 536,956,068	4.250000 2023/10/25	0.34
イギリス	3.75 GILT 210907	国債証券	3,600,000.00	14,393.57 14,905.5708	518,168,728 536,600,548	3.750000 2021/09/07	0.34
アメリカ	3.625 T-NOTE 190815	国債証券	5,800,000.00	9,151.37 9,231.2015	530,779,658 535,409,690	3.625000 2019/08/15	0.34
フランス	3.75 O.A.T 210425	国債証券	4,700,000.00	10,679.23 11,241.2454	501,923,918 528,338,533	3.750000 2021/04/25	0.33
アメリカ	2.25 T-NOTE 150131	国債証券	6,400,000.00	8,257.08 8,230.5867	528,453,282 526,757,548	2.250000 2015/01/31	0.33
アメリカ	2.5 T-NOTE 150331	国債証券	6,300,000.00	8,337.74 8,306.7304	525,277,658 523,324,019	2.500000 2015/03/31	0.33
フランス	3 O.A.T 151025	国債証券	4,900,000.00	10,471.73 10,641.8631	513,115,010 521,451,291	3.000000 2015/10/25	0.33
イギリス	5 GILT 140907	国債証券	3,800,000.00	13,722.08 13,640.1674	521,439,290 518,326,361	5.000000 2014/09/07	0.33
アメリカ	2.75 T-NOTE 190215	国債証券	5,900,000.00	8,679.15 8,744.2500	512,070,402 515,910,750	2.750000 2019/02/15	0.33
アメリカ	2.125 T-NOTE 210815	国債証券	6,200,000.00	8,144.96 8,309.8007	504,987,806 515,207,647	2.125000 2021/08/15	0.33
イギリス	2.25 GILT 140307	国債証券	3,900,000.00	12,825.94 12,817.2518	500,211,667 499,872,820	2.250000 2014/03/07	0.32
フランス	3.5 O.A.T 260425	国債証券	4,600,000.00	10,134.27 10,832.6427	466,176,482 498,301,564	3.500000 2026/04/25	0.31
アメリカ	0.375 T-NOTE 130731	国債証券	6,300,000.00	7,874.12 7,873.8164	496,069,776 496,050,432	0.375000 2013/07/31	0.31

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

#### b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成24年8月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	98.87
合計	98.87

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### < 参考 >

「新興国債券インデックスマザーファンド」

#### (1) 投資状況

平成24年8月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国 / 地域名	時価合計	投資比率 (%)
国債証券	ブラジル	202,734,556	10.04
	メキシコ	199,581,978	9.88
	マレーシア	199,313,261	9.87
	ポーランド	195,893,510	9.70
	南アフリカ	192,778,541	9.54

	インドネシア	191,457,901	9.48
	トルコ	188,720,715	9.34
	タイ	142,922,447	7.08
	ハンガリー	122,362,871	6.06
	コロンビア	82,098,159	4.06
	ロシア	77,718,300	3.85
	ペルー	50,700,371	2.51
	フィリピン	9,814,076	0.49
	特殊債券 ロシア	100,952,937	5.00
	コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	62,958,245	3.10
	純資産総額	2,020,007,868	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## (2) 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### a 評価額上位30銘柄

平成24年8月31日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	券面総額	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
ロシア	7.85 RUSSIA (GL) 180310	国債証券		30,000,000.00	254.30 259.0610	76,290,500 77,718,300	7.850000 2018/03/10	3.85
ロシア	7.5 INTL BK(GL) 170302	特殊債券		24,000,000.00	246.54 250.1554	59,171,904 60,037,296	7.500000 2017/03/02	2.97
コロンビ ア	12 COLOMBIA (GL) 151022	国債証券		1,020,000,000.00	5.42 5.3316	55,317,756 54,382,442	12.000000 2015/10/22	2.69
ロシア	4.875 INTL BK(GL) 130916	特殊債券		17,300,000.00	237.08 236.5066	41,016,120 40,915,641	4.875000 2013/09/16	2.03
ブラジル	10(IN)BRAZIL NTN-F170101	国債証券		1,000,000.00	3,692.04 4,025.0360	36,920,496 40,250,360	10.000000 2017/01/01	1.99
タイ	3.875 THAILAND 190613	国債証券		14,500,000.00	263.62 258.0380	38,225,625 37,415,510	3.875000 2019/06/13	1.85
南アフリ カ	10.5 SOUTH AFRICA 261221	国債証券		2,900,000.00	1,095.06 1,173.8902	31,757,012 34,042,815	10.500000 2026/12/21	1.69
ブラジル	BRAZIL-LTN 150101	国債証券		1,000,000.00	2,949.94 3,167.1518	29,499,422 31,671,518	2015/01/01	1.57
ブラジル	BRAZIL-LTN 140101	国債証券		800,000.00	3,162.92 3,467.6925	25,303,418 27,741,540	2014/01/01	1.37
トルコ	10.5 TURKEY GOVT 200115	国債証券		500,000.00	4,550.85 4,835.7544	22,754,264 24,178,772	10.500000 2020/01/15	1.20
南アフリ カ	7.25 SOUTH AFRICA 200115	国債証券		2,500,000.00	892.79 963.0214	22,319,835 24,075,537	7.250000 2020/01/15	1.19
ペルー	7.84 PERU 200812	国債証券		650,000.00	3,433.56 3,664.0292	22,318,204 23,816,189	7.840000 2020/08/12	1.18
ブラジル	BRAZIL-LTN 140401	国債証券		700,000.00	3,305.16 3,392.5142	23,136,150 23,747,599	2014/04/01	1.18
ブラジル	12.5 BRAZIL (GL) 160105	国債証券		500,000.00	4,714.71 4,727.5677	23,573,568 23,637,838	12.500000 2016/01/05	1.17
マレーシ ア	4.262MALAYSIAGOV 160915	国債証券		900,000.00	2,625.35 2,608.2761	23,628,173 23,474,485	4.262000 2016/09/15	1.16
マレーシ ア	4.012 MALAYSIAGOV 170915	国債証券		900,000.00	2,600.26 2,592.3061	23,402,417 23,330,755	4.012000 2017/09/15	1.15
南アフリ カ	8 SOUTH AFRICA 181221	国債証券		2,300,000.00	947.78 1,009.1362	21,799,136 23,210,134	8.000000 2018/12/21	1.15
コロンビ ア	7.75 COLOMBI (GL) 210414	国債証券		420,000,000.00	5.11 5.3517	21,468,519 22,477,455	7.750000 2021/04/14	1.11
南アフリ カ	8.25 SOUTH AFRICA 170915	国債証券		2,200,000.00	966.09 1,017.2573	21,254,107 22,379,660	8.250000 2017/09/15	1.11
トルコ	9 TURKEY GOVT 160127	国債証券		500,000.00	4,251.53 4,431.4445	21,257,680 22,157,222	9.000000 2016/01/27	1.10
トルコ	10 TURKEY GOVT 131204	国債証券		500,000.00	4,363.54 4,426.6682	21,817,716 22,133,341	10.000000 2013/12/04	1.10
ポーラン ド	5.75 POLAND 140425	国債証券		900,000.00	2,393.18 2,406.0341	21,538,626 21,654,307	5.750000 2014/04/25	1.07
トルコ	8 TURKEY GOVT 140604	国債証券		500,000.00	4,156.69 4,324.7301	20,783,490 21,623,650	8.000000 2014/06/04	1.07
南アフリ カ	13.5 SOUTH AFRICA 150915	国債証券		1,900,000.00	1,126.26 1,130.9330	21,398,963 21,487,728	13.500000 2015/09/15	1.06
マレーシ ア	4.378MALAYSIAGOV 191129	国債証券		800,000.00	2,673.46 2,649.6825	21,387,693 21,197,460	4.378000 2019/11/29	1.05
マレーシ ア	5.094MALAYSIAGOV 140430	国債証券		800,000.00	2,627.50 2,594.8674	21,020,070 20,758,939	5.094000 2014/04/30	1.03

南アフリカ	6.75 SOUTH AFRICA 210331	国債証券		2,200,000.00	863.92 927.4538	19,006,395 20,403,984	6.750000 2021/03/31	1.01
ブラジル	10(IN)BRAZIL NTN-F210101	国債証券		500,000.00	3,548.24 4,002.8658	17,741,232 20,014,329	10.000000 2021/01/01	0.99
ポーランド	5.5 POLAND 150425	国債証券		800,000.00	2,389.97 2,426.1159	19,119,782 19,408,927	5.500000 2015/04/25	0.96
インドネシア	10.5 INDONESIA 300815	国債証券		1,650,000,000.00	1.16 1.1292	19,251,061 18,632,595	10.500000 2030/08/15	0.92

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

#### b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成24年8月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	91.89
特殊債券	5.00
合計	96.88

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### < 参考 >

「東証REIT指数マザーファンド」

#### (1) 投資状況

平成24年8月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国 / 地域名	時価合計	投資比率 (%)
投資証券	日本	1,465,651,960	97.85
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		32,156,975	2.15
純資産総額		1,497,808,935	100.00

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### (2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

平成24年8月31日現在

国 / 地域	銘柄	種類	業種	口数 (口)	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率 (%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)		
日本	日本ビルファンド投資法人	投資証券		243	679,100.31 792,000	165,021,375 192,456,000		12.85
日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券		217	676,936.18 764,000	146,895,151 165,788,000		11.07
日本	日本リテールファンド投資法人	投資証券		745	112,750.62 133,800	83,999,211 99,681,000		6.66
日本	ユナイテッド・アーバン投資法人	投資証券		833	82,533.56 87,400	68,750,455 72,804,200		4.86
日本	日本プライムリアルティ投資法人	投資証券		323	190,698.61 219,800	61,595,651 70,995,400		4.74
日本	アドバンス・レジデンス投資法人	投資証券		436	141,623.56 157,700	61,747,872 68,757,200		4.59
日本	森トラスト総合リート投資法人	投資証券		96	651,499.44 692,000	62,543,946 66,432,000		4.44
日本	フロンティア不動産投資法人	投資証券		90	624,677.63 659,000	56,220,986 59,310,000		3.96
日本	野村不動産オフィスファンド投資法人	投資証券		121	417,821.59 450,500	50,556,412 54,510,500		3.64
日本	日本ロジスティクスファンド投資法人	投資証券		59	650,218.66 702,000	38,362,901 41,418,000		2.77
日本	オリックス不動産投資法人	投資証券		113	334,279.36 358,000	37,773,568 40,454,000		2.70
日本	日本アコモデーションファンド投資法人	投資証券		77	505,845.51 524,000	38,950,104 40,348,000		2.69
日本	アクティビア・プロパティーズ投資法人	投資証券		81	461,018.29 464,000	37,342,481 37,584,000		2.51
日本	大和証券オフィス投資法人	投資証券		157	178,924.25 231,000	28,091,107 36,267,000		2.42

日本	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	投資証券	64	494,589.59 556,000	31,653,734 35,584,000		2.38
日本	産業ファンド投資法人	投資証券	56	420,375.84 561,000	23,541,047 31,416,000		2.10
日本	森ヒルズリート投資法人	投資証券	92	267,675.54 333,500	24,626,150 30,682,000		2.05
日本	ジャパンエクセレント投資法人	投資証券	75	329,025.12 401,000	24,676,884 30,075,000		2.01
日本	ケネディクス不動産投資法人	投資証券	113	233,709.21 257,000	26,409,140 29,041,000		1.94
日本	福岡リート投資法人	投資証券	49	514,515.96 548,000	25,211,282 26,852,000		1.79
日本	東急リアル・エステート投資法人	投資証券	67	390,709.94 383,000	26,177,565 25,661,000		1.71
日本	野村不動産レジデンシャル投資法人	投資証券	60	355,721.30 422,000	21,343,278 25,320,000		1.69
日本	トップリート投資法人	投資証券	61	367,854.74 365,000	22,439,139 22,265,000		1.49
日本	日本賃貸住宅投資法人	投資証券	527	35,757.49 41,900	18,844,197 22,081,300		1.47
日本	プレミアム投資法人	投資証券	78	260,672.04 283,000	20,332,419 22,074,000		1.47
日本	グローバル・ワン不動産投資法人	投資証券	38	513,108.84 482,000	19,498,135 18,316,000		1.22
日本	積水ハウス・S I投資法人	投資証券	46	299,428.95 364,500	13,773,732 16,767,000		1.12
日本	ジャパン・ホテル・リート投資法人	投資証券	736	16,879.06 21,460	12,422,988 15,794,560		1.05
日本	M I Dリート投資法人	投資証券	73	188,070.96 198,100	13,729,180 14,461,300		0.97
日本	平和不動産リート投資法人	投資証券	277	40,379.50 49,000	11,185,121 13,573,000		0.91

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

#### b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成24年8月31日現在

種類 / 業種別	投資比率(%)
投資証券	97.85
合計	97.85

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### < 参考 >

#### 「MUAMG - REITマザーファンド」

#### (1) 投資状況

平成24年8月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国 / 地域名	時価合計	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	2,521,960,022	65.78
	オーストラリア	434,820,863	11.34
	イギリス	219,357,133	5.72
	フランス	182,912,506	4.77
	シンガポール	134,936,707	3.52
	カナダ	122,409,685	3.19
	香港	77,104,950	2.01
	オランダ	43,202,222	1.13
	ベルギー	21,153,288	0.55
	ニュージーランド	12,176,381	0.32
	ドイツ	5,455,273	0.14
	イタリア	2,781,777	0.07
	コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		55,388,422
純資産総額		3,833,659,229	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## a 評価額上位30銘柄

平成24年8月31日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	口数 (口)	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
アメリカ	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券		22,123	10,133.62 12,372.42	224,186,141 273,715,180		7.14
オースト ラリア	WESTFIELD GROUP	投資証券		152,600	674.70 804.14	102,960,135 122,712,679		3.20
アメリカ	PUBLIC STORAGE	投資証券		10,394	10,335.11 11,366.34	107,423,174 118,141,800		3.08
アメリカ	HCP INC	投資証券		30,670	3,182.15 3,586.51	97,596,721 109,998,507		2.87
アメリカ	VENTAS INC	投資証券		21,126	4,234.18 5,122.36	89,451,328 108,215,019		2.82
フランス	UNIBAIL-RODAMCO SE	投資証券		6,660	13,479.46 15,832.74	89,773,228 105,446,048		2.75
アメリカ	EQUITY RESIDENTIAL	投資証券		21,950	4,433.04 4,764.73	97,305,228 104,585,867		2.73
アメリカ	BOSTON PROPERTIES INC	投資証券		10,930	7,816.76 8,756.04	85,437,296 95,703,517		2.50
アメリカ	PROLOGIS INC	投資証券		33,573	2,240.09 2,677.90	75,206,877 89,905,203		2.35
アメリカ	VORNADO REALTY TRUST	投資証券		13,548	5,961.80 6,351.66	80,770,601 86,052,370		2.24
アメリカ	AVALONBAY COMMUNITIES INC	投資証券		6,947	10,055.29 11,143.90	69,854,155 77,416,728		2.02
アメリカ	HEALTH CARE REIT INC	投資証券		16,330	4,257.76 4,583.16	69,529,302 74,843,100		1.95
アメリカ	GENERAL GROWTH PROPERTIES	投資証券		42,848	1,153.84 1,614.44	49,440,079 69,175,696		1.80
アメリカ	HOST HOTELS & RESORTS INC	投資証券		51,732	1,159.34 1,190.00	59,975,494 61,561,286		1.61
香港	LINK REIT	投資証券		164,500	285.15 349.99	46,908,737 57,573,601		1.50
イギリス	LAND SECURITIES GROUP PLC	投資証券		56,590	783.19 978.06	44,321,129 55,348,732		1.44
アメリカ	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券		8,750	5,274.06 5,880.06	46,148,025 51,450,577		1.34
オースト ラリア	WESTFIELD RETAIL TRUST	投資証券		206,700	207.10 237.03	42,808,396 48,995,547		1.28
アメリカ	KIMCO REALTY CORP	投資証券		29,490	1,285.89 1,599.51	37,921,073 47,169,549		1.23
アメリカ	MACERICH CO/THE	投資証券		9,756	4,007.81 4,679.05	39,100,233 45,648,889		1.19
イギリス	BRITISH LAND CO PLC	投資証券		64,415	575.91 664.66	37,097,680 42,814,240		1.12
オースト ラリア	STOCKLAND	投資証券		163,500	269.39 256.45	44,046,409 41,930,065		1.09
アメリカ	SL GREEN REALTY CORP	投資証券		6,590	5,381.70 6,281.71	35,465,437 41,396,482		1.08
アメリカ	FEDERAL REALTY INVS TRUST	投資証券		4,717	7,013.47 8,457.36	33,082,575 39,893,367		1.04
アメリカ	UDR INC	投資証券		18,146	1,975.21 1,984.65	35,842,305 36,013,458		0.94
オースト ラリア	GPT GROUP	投資証券		121,000	251.59 288.81	30,443,479 34,946,373		0.91
オースト ラリア	GOODMAN GROUP	投資証券		98,456	244.31 331.69	24,054,573 32,656,870		0.85
アメリカ	CAMDEN PROPERTY TRUST	投資証券		5,890	4,815.82 5,476.06	28,365,191 32,254,005		0.84
アメリカ	REALTY INCOME CORP	投資証券		9,620	2,745.49 3,322.42	26,411,690 31,961,699		0.83
アメリカ	ESSEX PROPERTY TRUST INC	投資証券		2,610	10,939.22 11,905.54	28,551,387 31,073,464		0.81

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

## b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成24年8月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
投資証券	98.56
合計	98.56

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

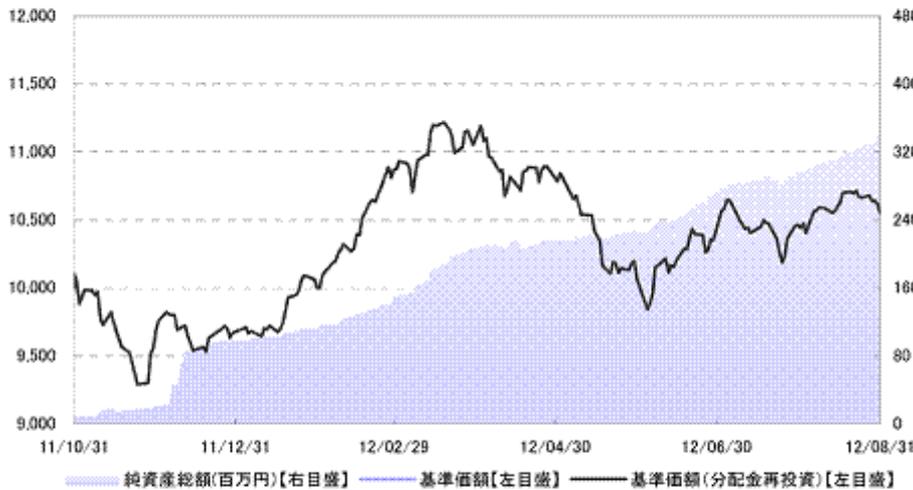
その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## [ 参考情報 ]

## 運用実績

## 1 基準価額・純資産の推移(設定日～2012年8月31日)



- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は10,000を起点として表示
- ・基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を再投資したもとして計算

## 2 分配の推移

2012年1月	0円
設定来累計	0円

・分配金は1万口当たり、税引前

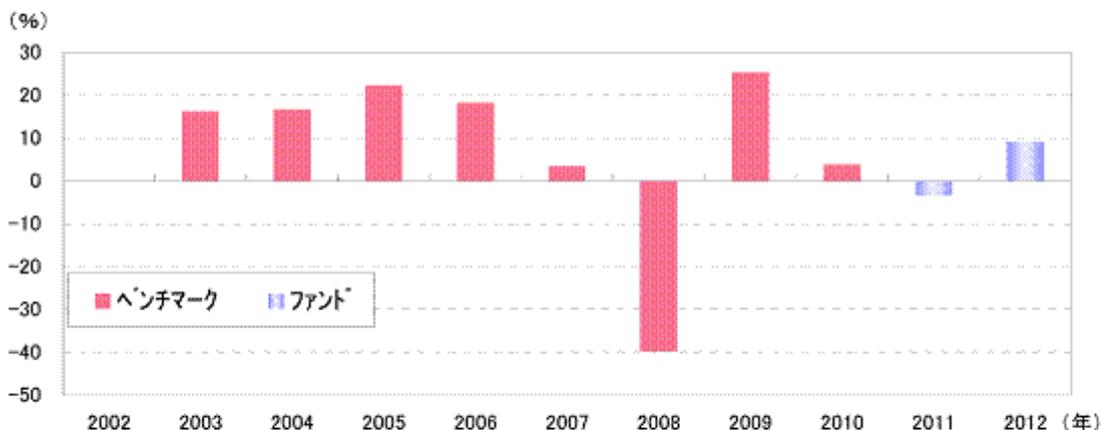
## 3 主要な資産の状況(2012年8月31日現在)

資産別構成	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄	種類	業種/種別	国・地域	比率
国内株式	12.2%	円	38.1%	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	日本	0.5%
国内債券	11.5%	アメリカドル	22.7%	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	半導体・半導体製造装置	韓国	0.4%
国内リート	12.3%	ユーロ	7.3%	APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	0.3%
外国株式	24.1%	イギリスポンド	3.1%	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	日本	0.3%
外国債券	24.5%	ブラジルレアル	2.8%	7.85 RUSSIA (GL) 180310	債券	国債	ロシア	0.5%
外国リート	12.7%	香港ドル	2.6%	第259回利付国債(10年)	債券	国債	日本	0.4%
		南アフリカランド	2.2%	7.5 INTL BK(GL) 170302	債券	特殊債	ロシア	0.4%
		オーストラリアドル	2.1%	日本ビルファンド投資法人	リート	-	日本	1.6%
コールローン他 (負債控除後)	2.7%	その他	19.1%	ジャパンリアルエステイト投資法人	リート	-	日本	1.4%
合計	100.0%	合計	100.0%	SIMON PROPERTY GROUP INC	リート	-	アメリカ	0.9%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引(買建)	0.5%

・各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)

## 4 年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- ・2011年は設定日から年末までの、2012年は8月31日までの収益率を表示
- ・2010年以前はベンチマークの年間収益率(委託会社の計算日基準)、2003年はベンチマーク算出日(3月31日)から年末までの収益率を表示

- ・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。
- ・ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
- ・ファンドの運用状況等は別途、委託会社のホームページで開示している場合があります。

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

申込みの受付	原則として、いつでも申込みができます。 ただし、以下の日は申込みができません。 ニューヨーク証券取引所の休業日 ニューヨークの銀行の休業日 ロンドン証券取引所の休業日 ロンドンの銀行の休業日 香港取引所の休業日 香港の銀行の休業日 オーストラリア証券取引所の休業日 シドニーの銀行の休業日 その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日
申込単位	販売会社が定める単位
申込価額	申込受付日の翌営業日の基準価額
申込価額の算出頻度	原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。
申込単位・申込価額の照会方法	申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。 また、下記においてもご照会いただけます。 三菱UFJ投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 （受付時間：毎営業日の9:00～17:00） なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。 ホームページアドレス <a href="http://www.am.mufg.jp/">http://www.am.mufg.jp/</a> eMAXIS専用サイト <a href="http://maxis.muam.jp/e/">http://maxis.muam.jp/e/</a>
申込手数料	ありません。
申込方法	取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。 取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。 なお、申込みには分配金受取りコース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があり、分配金再投資コース（累積投資コース）を選択する場合には、取得申込者と販売会社との間で別に定める累積投資契約（販売会社によっては別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を使用する場合があります。この場合は当該別の名称に読み替えます。）を締結するものとします。申込みコースの取扱いは販売会社により異なる場合がありますので、販売会社にご確認ください。 取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。
申込受付時間	原則、午後3時までに受け付けた取得申込み（当該申込みの受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを）当日の申込みとします。当該時刻を過ぎての申込みは、翌営業日に受け付けたものとして取り扱います。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に取得申込みを締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。
その他	金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（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、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、取得申込みの受付を中止することおよびすでに受け付けた取得申込みを取り消すことがあります。

## 2【換金(解約)手続等】

解約の受付	原則として、いつでも解約の請求ができます。 ただし、以下の日は解約の請求ができません。 ニューヨーク証券取引所の休業日 ニューヨークの銀行の休業日 ロンドン証券取引所の休業日 ロンドンの銀行の休業日 香港取引所の休業日 香港の銀行の休業日 オーストラリア証券取引所の休業日 シドニーの銀行の休業日 その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日
解約単位	販売会社が定める単位
解約価額	解約請求受付日の翌営業日の基準価額 - 信託財産留保額
信託財産留保額	解約請求受付日の翌営業日の基準価額 × 0.15%
解約価額の算出頻度	原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。
解約価額の照会方法	解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。 なお、下記においてもご照会いただけます。 三菱UFJ投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：毎営業日の9:00～17:00) ホームページアドレス <a href="http://www.am.mufg.jp/">http://www.am.mufg.jp/</a>
支払開始日	原則として解約請求受付日から起算して6営業日目から販売会社において支払います。
解約請求受付時間	原則、午後3時までに受け付けた解約請求(当該解約請求の受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したもの)を当日の請求とします。当該時刻を過ぎての請求は、翌営業日に受け付けたものとして取り扱います。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に解約請求を締め切ることとしている場合があります。 詳しくは販売会社にご確認ください。
その他	委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情(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、戦争等)による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等)があるときは、解約請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた解約請求を取り消すことがあります。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約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に解約請求を受け付けたものとします。 委託会社は、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。 受益者の解約請求に係る受益権の口数の減少は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

換金の詳細については販売会社にご確認ください。

## 3【資産管理等の概要】

## (1)【資産の評価】

基準価額の算出方法	<p>基準価額 = 信託財産の純資産総額 ÷ 受益権総口数</p> <p>なお、当ファンドでは1万口当たりの価額で表示されます。</p> <p>(注)「信託財産の純資産総額」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。）を法令および社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。</p> <p>(主な評価方法)</p> <p>マザーファンド：計算日における基準価額で評価します。</p> <p>株式および不動産投資信託証券：原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場（外国で取引されているものについては、原則として、外国金融商品市場における計算時に知りうる直近の日の最終相場）で評価します。</p> <p>公社債等：原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、第一種金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額で評価します。</p> <p>外貨建資産：原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円換算します。</p> <p>外国為替予約取引：原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値により評価します。</p>
基準価額の算出頻度	原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。
基準価額の照会方法	<p>基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。</p> <p>また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。</p> <p>なお、下記においてもご照会いただけます。</p> <p>三菱UFJ投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：毎営業日の9:00～17:00) ホームページアドレス <a href="http://www.am.mufg.jp/">http://www.am.mufg.jp/</a> eMAXIS専用サイト <a href="http://maxis.muam.jp/e/">http://maxis.muam.jp/e/</a></p>

## (2)【保管】

受益証券の保管	該当事項はありません。
---------	-------------

## (3)【信託期間】

信託期間	平成23年10月31日から無期限 ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることがあります。
------	--

## (4)【計算期間】

計算期間	原則として、毎年1月27日から翌年1月26日まで 上記にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日が休業日のとき、各計算期間終了日は、この該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日はファンドの信託期間終了日とします。
------	---

## (5) 【その他】

ファンドの償還条件等	<p>委託会社は、以下の場合には、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、ファンドを償還させることができます。（任意償還）</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合</li> <li>・ 信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したとき</li> </ul> <p>このほか、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたとき、委託会社の登録取消・解散・業務廃止のときは、原則として、ファンドを償還させます。</p> <p>委託会社は、ファンドを償還しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。</p>
信託約款の変更等	<p>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、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは受託会社を同一とする他ファンドとの併合を行うことができます。委託会社は、変更または併合しようとするときは、あらかじめその旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。</p> <p>委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記の手続きにしたがいます。</p>
ファンドの償還等に関する開示方法	<p>委託会社は、ファンドの任意償還、信託約款の変更のうち重大な内容の変更または併合について、書面による決議（「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに任意償還等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、受益者に対し書面をもって書面決議の通知を發します。受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、受益者が議決権を行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。書面決議は、議決権を行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以上をもって行います。書面決議の効力は、ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。</p> <p>併合に係るいずれかのファンドにおいて、書面決議が否決された場合、併合を行うことはできません。</p>
反対者の買取請求権	<p>委託会社がファンドの任意償還、信託約款について重大な内容の変更または併合を行う場合、書面決議において反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。</p>
関係法人との契約の更改	<p>委託会社と販売会社との間で締結された「募集・販売の取扱い等に関する契約」の期間は、契約締結日から1ヵ年とし、期間満了3ヵ月前までに相手方に対し、何らの意思表示のないときは、同一の条件で契約を更新するものとし、その後も同様とします。</p>
運用報告書の作成	<p>委託会社は、毎計算期間の末日および償還時に、運用経過、信託財産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、原則として受益者に交付します。なお、信託約款の内容に委託会社が重要と判断した変更等があった場合は、その内容を運用報告書に記載します。</p>
委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い	<p>委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。また、委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。</p>
受託会社の辞任および解任に伴う取扱い	<p>受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。</p>
信託事務処理の再信託	<p>受託会社は、ファンドの信託事務の処理の一部について日本マスタートラスト信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託します。日本マスタートラスト信託銀行株式会社は、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。</p>

公告	<p>委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。  ただし、平成25年6月21日以降は、以下の通り変更される予定です。  委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。  <a href="http://www.am.mufg.jp/">http://www.am.mufg.jp/</a>  なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。</p>
----	---

#### 4【受益者の権利等】

受益者の権利の主な内容は以下の通りです。

収益分配金に対する請求権	<p>受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。</p> <p>「分配金受取りコース（一般コース）」</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・収益分配金は、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。</li> <li>・収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。</li> <li>・受益者が、収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失います。</li> </ul> <p>「分配金再投資コース（累積投資コース）」</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・収益分配金は、課税後、原則として毎計算期間の終了日（決算日）の翌営業日に、累積投資契約に基づいて再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。詳しくは販売会社にご確認ください。</li> </ul>
償還金に対する請求権	<p>受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・償還金は、原則として償還日（休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日までに支払いを開始します。</li> <li>・償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。</li> <li>・受益者が、信託終了による償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失います。</li> </ul>
換金（解約）請求権	<p>受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約を請求する権利を有します。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・解約代金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。</li> </ul> <p>（「2 換金（解約）手続等」をご参照ください。）</p>

### 第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドの第1期計算期間は、約款第39条により、平成23年10月31日から平成24年1月26日までとしております。
- 3 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(平成23年10月31日から平成24年1月26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【財務諸表】

## 【eMAXIS バランス(8資産均等型)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

		第1期
		[平成24年1月26日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		1,261,036
親投資信託受益証券		110,283,617
未収入金		5,210
未収利息		2
流動資産合計		111,549,865
資産合計		111,549,865
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		92,294
未払受託者報酬		9,048
未払委託者報酬		66,333
その他未払費用		515
流動負債合計		168,190
負債合計		168,190
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		110,359,349
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		1,022,326
(分配準備積立金)		3,932,858
元本等合計		111,381,675
純資産合計		111,381,675
負債純資産合計		111,549,865

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期 自平成23年10月31日 至平成24年1月26日
営業収益	
受取利息	144
有価証券売買等損益	3,878,142
営業収益合計	3,878,286
営業費用	
受託者報酬	9,048
委託者報酬	66,333
その他費用	515
営業費用合計	75,896
営業利益	3,802,390
経常利益	3,802,390
当期純利益	3,802,390
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	130,468
期首剰余金又は期首欠損金( )	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	44,379
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	44,379
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,954,911
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,954,911
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,022,326

## (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	<p>(1) 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 親投資信託受益証券以外の有価証券 個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 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最終相場で評価しております。 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、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）また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。 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また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、委託会社が忠実義務に基づいて合理的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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
-------------------	---

## (貸借対照表に関する注記)

	第 1 期 [ 平成24年1月26日現在 ]
1 期首元本額	10,000,000円
期中追加設定元本額	106,680,281円
期中一部解約元本額	6,320,932円
2 受益権の総数	110,359,349口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0093円 (10,093円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 1 期 (自 平成23年10月31日 至 平成24年1月26日)

## 1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	535,705円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	3,397,153円
収益調整金額	C	276,124円
分配準備積立金額	D	
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,208,982円
当ファンドの期末残存口数	F	110,359,349口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	381円
1万口当たり分配金額	H	
収益分配金金額	I=F*H/10,000	

## (金融商品に関する注記)

## 1 金融商品の状況に関する事項

区 分	第 1 期 (自 平成23年10月31日 至 平成24年 1月26日 )
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資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。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドは、親投資信託受益証券を実質的な主要投資対象としております。投資する親投資信託受益証券の詳細は「(4) 附属明細表」に記載しております。親投資信託受益証券は、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスクおよびカントリーリスクに晒されております。</p> <p>(1) 親投資信託受益証券は、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、株価の変動による価格変動リスクを有しております。</p> <p>(2) 親投資信託受益証券は、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。</p> <p>また、親投資信託受益証券に係るデリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## 3 金融商品に係るリスク管理体制

ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。

また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 1 期 [ 平成24年1月26日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2 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)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 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 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。
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第 1 期 [ 平成24年1月26日現在 ]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	3,964,489
合計	3,964,489

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (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	口数(口)	評 価 額	備 考
親投資信託受益証券	MUAM G - REITマザーファンド	20,844,807	14,186,975	
	新興国株式インデックスマザーファンド	9,945,628	13,989,520	
	東証REIT指数マザーファンド	13,310,941	13,747,539	
	新興国債券インデックスマザーファンド	14,106,559	14,021,919	
	TOPIXマザーファンド	19,693,488	13,935,112	
	外国株式インデックスマザーファンド	14,597,580	13,943,608	
	日本債券インデックスマザーファンド	10,721,718	12,579,791	
	外国債券インデックスマザーファンド	10,864,308	13,879,153	
	親投資信託受益証券 小計	114,085,029	110,283,617	
	合計	114,085,029	110,283,617	

## 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。

&lt;参考&gt;

当ファンドは「TOPIXマザーファンド」、「外国株式インデックスマザーファンド」、「新興国株式インデックスマザーファンド」、「日本債券インデックスマザーファンド」、「外国債券インデックスマザーファンド」、「新興国債券インデックスマザーファンド」、「東証REIT指数マザーファンド」および「MUAM G - REITマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、これら親投資信託の受益証券です。

なお、これら親投資信託の状況は次の通りです。

[次へ](#)

## 「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。

## (1) 貸借対照表

		[ 平成24年1月26日現在 ]
		金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		56,054,808,334
株式	2,3	174,976,069,945
派生商品評価勘定		100,600,480
未収入金		4,423,760
未収配当金		184,705,075
未収利息		129,325
その他未収収益		10,296,722
流動資産合計		231,331,033,641
資産合計		231,331,033,641
負債の部		
流動負債		
前受金		112,428,000
未払解約金		149,626,054
未払利息		1,826,807
受入担保金		53,913,391,035
流動負債合計		54,177,271,896
負債合計		54,177,271,896
純資産の部		
元本等		
元本	1	250,369,277,064
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	4	73,215,515,319
元本等合計		177,153,761,745
純資産合計		177,153,761,745
負債純資産合計		231,331,033,641

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年3月26日から翌年3月25日までであります。

## (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	<p>株式は移動平均法、株式以外の有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合また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、委託会社が忠実義務に基づいて合理的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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	[ 平成24年1月26日現在 ]
1 期首	平成23年10月31日
期首元本額	246,720,849,285円
期首からの追加設定元本額	8,191,064,460円
期首からの一部解約元本額	4,542,636,681円
元本の内訳*	
ファンド・マネジャー（国内株式）	435,824,979円
eMAXIS TOPIXインデックス	2,902,613,349円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	19,693,488円
eMAXIS バランス（波乗り型）	2,573,548円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	57,673,018,536円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	31,587,141,668円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	1,519,967,344円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	9,986,560,139円
MUAM 日本株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	9,678,815,101円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	34,572,195,094円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型（適格機関投資家限定）	10,667,811,360円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	2,531,100,705円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型（適格機関投資家限定）	990,597,865円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	838,138,300円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,435,616,315円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	2,048,741,057円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	11,447,152円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	18,432,287,060円
三菱UFJ TOPIX・ライト	1,285,419,433円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	194,359,744円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	491,679,633円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	617,401,777円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	724,373,200円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	8,265,083,050円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	5,407,552,820円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	912,492,841円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	6,831,276,815円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	867,922,444円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	3,931,964,742円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	2,084,782,863円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	966,308,766円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	3,406,228,932円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	2,234,372,652円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	1,429,112,305円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	25,384,801,987円
（合計）	250,369,277,064円
2 貸付有価証券	
株券貸借取引契約により、以下の通り有価証券の貸付を行っております。	
株式	51,861,897,530円
3 差入委託証拠金代用有価証券	
先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の通り差入れを行っております。	
株式	976,750,000円
4 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	73,215,515,319円
5 受益権の総数	250,369,277,064口
6 1口当たり純資産額	0.7076円
（1万口当たり純資産額）	（7,076円）

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

## 1 金融商品の状況に関する事項

区分	(自平成23年10月31日 至平成24年1月26日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資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。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式を実質的な主要投資対象としております。株式の投資に係る価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。

3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。
------------------	--

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[ 平成24年1月26日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2 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）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関係に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	

## （有価証券関係に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	[ 平成24年1月26日現在 ]	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		18,932,895,684
合計		18,932,895,684

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

## （デリバティブ取引等関係に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

## 株式関連

区 分	種 類	[ 平成24年1月26日現在 ]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,023,086,000		2,123,920,000	100,834,000
	合 計	2,023,086,000		2,123,920,000	100,834,000

## （注）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、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、最も近い最終相場値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 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。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

[次へ](#)

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

(単位:円)

コード	銘柄 銘柄名	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
1301	極洋	74,000	184	13,616,000	
1332	日本水産	216,900	270	58,563,000	
1334	マルハニチロホールディングス	372,000	142	52,824,000	
1377	サカタのタネ	27,800	1,072	29,801,600	
1379	ホクト	19,100	1,698	32,431,800	
1514	住石ホールディングス	55,300	103	5,695,900	
1515	日鉄鉱業	48,000	342	16,416,000	
1518	三井松島産業	123,000	156	19,188,000	
1605	国際石油開発帝石	2,288	513,000	1,173,744,000	
1606	日本海洋掘削	4,700	2,490	11,703,000	
1661	関東天然瓦斯開発	19,000	429	8,151,000	
1662	石油資源開発	26,800	3,375	90,450,000	
1414	ショーボンドホールディングス	16,700	1,941	32,414,700	
1417	ミライト・ホールディングス	53,400	618	33,001,200	
1712	ダイセキ環境ソリューション	16	161,100	2,577,600	
1719	間組	67,800	225	15,255,000	
1720	東急建設	66,830	214	14,301,620	
1721	コムシスホールディングス	91,400	866	79,152,400	
1722	ミサワホーム	18,200	663	12,066,600	
1762	高松コンストラクショングループ	14,200	1,258	17,863,600	
1766	東建コーポレーション	7,030	2,739	19,255,170	
1780	ヤマウラ	7,500	237	1,777,500	
1801	大成建設	952,000	212	201,824,000	
1802	大林組	564,000	367	206,988,000	
1803	清水建設	576,000	347	199,872,000	
1805	飛鳥建設	115,700	122	14,115,400	
1808	長谷工コーポレーション	1,176,500	55	64,707,500	
1810	松井建設	21,000	314	6,594,000	
1812	鹿島建設	882,000	256	225,792,000	
1813	不動テトラ	132,900	165	21,928,500	
1814	大末建設	73,000	62	4,526,000	
1815	鉄建建設	107,000	117	12,519,000	
1816	安藤建設	63,000	113	7,119,000	
1819	太平工業	33,000	429	14,157,000	
1820	西松建設	246,000	169	41,574,000	
1821	三井住友建設	117,900	75	8,842,500	
1822	大豊建設	50,000	125	6,250,000	
1824	前田建設工業	116,000	316	36,656,000	
1826	佐田建設	64,000	83	5,312,000	
1827	ナカノフドー建設	14,000	183	2,562,000	
1833	奥村組	179,000	333	59,607,000	
1834	大和小田急建設	9,000	214	1,926,000	
1835	東鉄工業	24,000	782	18,768,000	
1847	イチケン	21,000	139	2,919,000	
1852	浅沼組	57,000	74	4,218,000	
1860	戸田建設	202,000	306	61,812,000	
1861	熊谷組	135,000	87	11,745,000	
1865	青木あすなる建設	12,500	431	5,387,500	
1866	北野建設	41,000	188	7,708,000	
1867	植木組	23,000	201	4,623,000	
1868	三井ホーム	24,000	414	9,936,000	
1870	矢作建設工業	23,400	382	8,938,800	
1871	ピーエス三菱	11,900	536	6,378,400	
1878	大東建託	71,500	7,130	509,795,000	
1879	新日本建設	22,400	236	5,286,400	
1881	N I P P O	44,000	845	37,180,000	
1882	東亜道路工業	35,000	228	7,980,000	
1883	前田道路	54,000	939	50,706,000	
1884	日本道路	56,000	317	17,752,000	
1885	東亜建設工業	164,000	166	27,224,000	
1888	若築建設	101,000	115	11,615,000	
1890	東洋建設	284,000	85	24,140,000	

1893	五洋建設	238,500	271	64,633,500	
1896	大林道路	22,000	257	5,654,000	
1898	世紀東急工業	50,000	61	3,050,000	
1899	福田組	28,000	281	7,868,000	
1911	住友林業	129,600	685	88,776,000	
1914	日本基礎技術	20,900	329	6,876,100	
1916	日成ビルド工業	56,000	192	10,752,000	
1919	エス・バイ・エル	96,000	168	16,128,000	
1921	バコーレーション	23,200	288	6,681,600	
1924	パナホーム	70,000	542	37,940,000	
1925	大和ハウス工業	469,000	972	455,868,000	
1926	ライト工業	39,200	479	18,776,800	
1928	積水ハウス	530,000	732	387,960,000	
1929	日特建設	46,000	120	5,520,000	
1930	北陸電気工事	10,000	234	2,340,000	
1934	ユアテック	25,000	437	10,925,000	
1937	西部電気工業	16,000	358	5,728,000	
1939	四電工	16,000	334	5,344,000	
1941	中電工	27,200	856	23,283,200	
1942	関電工	86,000	388	33,368,000	
1944	きんでん	125,000	658	82,250,000	
1945	東京エネシス	19,000	516	9,804,000	
1946	トーエネック	26,000	455	11,830,000	
1949	住友電設	12,900	510	6,579,000	
1950	日本電設工業	34,000	764	25,976,000	
1951	協和エクシオ	61,400	761	46,725,400	
1952	新日本空調	14,400	444	6,393,600	
1956	日本電話施設	31,000	250	7,750,000	
1959	九電工	35,000	493	17,255,000	
1961	三機工業	43,000	423	18,189,000	
1963	日揮	176,000	2,047	360,272,000	
1964	中外炉工業	60,000	280	16,800,000	
1967	ヤマト	17,000	309	5,253,000	
1968	太平電業	24,000	600	14,400,000	
1969	高砂熱学工業	53,700	648	34,797,600	
1972	三晃金属工業	21,000	253	5,313,000	
1975	朝日工業社	20,000	330	6,600,000	
1979	大気社	28,800	1,719	49,507,200	
1980	ダイダン	25,000	554	13,850,000	
1982	日比谷総合設備	23,100	841	19,427,100	
1983	東芝プラントシステム	31,000	877	27,187,000	
6330	東洋エンジニアリング	101,000	320	32,320,000	
6366	千代田化工建設	149,000	847	126,203,000	
6379	新興プラントック	38,700	641	24,806,700	
2001	日本製粉	118,000	346	40,828,000	
2002	日清製粉グループ本社	170,500	919	156,689,500	
2003	日東富士製粉	15,000	303	4,545,000	
2004	昭和産業	77,000	249	19,173,000	
2009	鳥越製粉	16,300	671	10,937,300	
2052	協同飼料	65,000	96	6,240,000	
2053	中部飼料	16,600	500	8,300,000	
2056	日本配合飼料	58,000	112	6,496,000	
2107	東洋精糖	29,000	99	2,871,000	
2108	日本甜菜製糖	104,000	167	17,368,000	
2109	三井製糖	67,000	257	17,219,000	
2201	森永製菓	184,000	182	33,488,000	
2204	中村屋	44,000	396	17,424,000	
2206	江崎グリコ	68,000	881	59,908,000	
2207	名糖産業	8,400	1,006	8,450,400	
2211	不二家	108,000	157	16,956,000	
2212	山崎製パン	138,000	1,004	138,552,000	
2215	第一屋製パン	26,000	90	2,340,000	
2217	モロゾフ	29,000	275	7,975,000	
2229	カルビー	10,100	3,725	37,622,500	
2264	森永乳業	159,000	298	47,382,000	
2267	ヤクルト本社	100,900	2,325	234,592,500	
2269	明治ホールディングス	55,700	3,230	179,911,000	
2270	雪印メグミルク	40,600	1,455	59,073,000	
2281	プリマハム	105,000	132	13,860,000	

2282	日本ハム	143,000	969	138,567,000	
2284	伊藤ハム	103,000	309	31,827,000	
2286	林兼産業	61,000	71	4,331,000	
2288	丸大食品	90,000	279	25,110,000	
2290	米久	16,600	756	12,549,600	
2292	S F o o d s	12,000	698	8,376,000	
2501	サッポロホールディングス	308,000	294	90,552,000	
2502	アサヒグループホールディングス	353,100	1,679	592,854,900	
2503	キリンホールディングス	755,000	942	711,210,000	
2531	宝ホールディングス	159,000	485	77,115,000	
2533	オエノンホールディングス	48,000	181	8,688,000	
2540	養命酒製造	14,000	766	10,724,000	
2572	三国コカ・コーラボトリング	19,600	681	13,347,600	
2579	コカ・コーラウエスト	63,800	1,322	84,343,600	
2580	コカ・コーラ セントラル ジャパン	21,100	1,017	21,458,700	
2590	ガイドードリンコ	8,600	3,105	26,703,000	
2593	伊藤園	57,100	1,302	74,344,200	
2594	キーコーヒー	16,400	1,450	23,780,000	
2597	ユニカフェ	4,400	360	1,584,000	
2599	ジャパンフーズ	2,400	812	1,948,800	
2602	日清オイリオグループ	72,000	330	23,760,000	
2607	不二製油	45,700	1,057	48,304,900	
2613	J - オイルミルズ	70,000	223	15,610,000	
2801	キッコーマン	154,000	874	134,596,000	
2802	味の素	496,000	913	452,848,000	
2809	キュービー	95,800	1,108	106,146,400	
2810	ハウス食品	66,800	1,436	95,924,800	
2811	カゴメ	72,700	1,514	110,067,800	
2812	焼津水産化学工業	8,700	709	6,168,300	
2815	アリアケジャパン	17,100	1,463	25,017,300	
2871	ニチレイ	211,000	374	78,914,000	
2875	東洋水産	81,000	1,844	149,364,000	
2897	日清食品ホールディングス	73,500	2,924	214,914,000	
2899	永谷園	18,000	880	15,840,000	
2908	フジッコ	20,000	996	19,920,000	
2910	ロック・フィールド	9,100	1,317	11,984,700	
2914	日本たばこ産業	4,173	384,000	1,602,432,000	
2918	わらべや日洋	10,400	1,047	10,888,800	
2922	なとり	8,600	854	7,344,400	
4404	ミヨシ油脂	59,000	106	6,254,000	
3001	片倉工業	22,000	708	15,576,000	
3002	ゲンゼ	131,000	236	30,916,000	
3101	東洋紡績	743,000	110	81,730,000	
3103	ユニチカ	389,000	45	17,505,000	
3104	富士紡ホールディングス	73,000	173	12,629,000	
3105	日清紡ホールディングス	112,000	763	85,456,000	
3106	倉敷紡績	180,000	155	27,900,000	
3109	シキボウ	114,000	118	13,452,000	
3201	日本毛織	60,000	554	33,240,000	
3202	大東紡織	27,000	71	1,917,000	
3204	トーア紡コーポレーション	75,000	57	4,275,000	
3205	ガイドーリミテッド	21,600	688	14,860,800	
3302	帝国繊維	18,000	482	8,676,000	
3401	帝人	719,000	247	177,593,000	
3402	東レ	1,277,000	582	743,214,000	
3408	サカイオーベックス	50,000	127	6,350,000	
3501	住江織物	48,000	153	7,344,000	
3512	日本フェルト	9,900	397	3,930,300	
3513	イチカワ	12,000	165	1,980,000	
3514	日本バイリーン	22,000	341	7,502,000	
3524	日東製網	22,000	164	3,608,000	
3526	芦森工業	41,000	113	4,633,000	
3529	アツギ	138,000	95	13,110,000	
3551	ダイニック	33,000	152	5,016,000	
3569	セーレン	43,800	442	19,359,600	
3577	東海染工	25,000	90	2,250,000	
3580	小松精練	27,000	364	9,828,000	
3591	ワコールホールディングス	105,000	977	102,585,000	
3593	ホギメディカル	11,100	3,190	35,409,000	

3606	レナウン	37,700	150	5,655,000
3607	クラウドディア	2,000	1,062	2,124,000
3608	T S Iホールディングス	78,500	388	30,458,000
8011	三陽商会	86,000	188	16,168,000
8013	ナイガイ	49,000	51	2,499,000
8016	オンワードホールディングス	108,000	601	64,908,000
8029	ルック	29,000	199	5,771,000
8111	ゴールドウイン	40,000	370	14,800,000
8114	デサント	44,000	396	17,424,000
8127	ヤマトインターナショナル	10,500	373	3,916,500
3708	特種東海製紙	111,000	179	19,869,000
3861	王子製紙	777,000	386	299,922,000
3864	三菱製紙	250,000	76	19,000,000
3865	北越紀州製紙	109,000	520	56,680,000
3877	中越パルプ工業	67,000	146	9,782,000
3878	巴川製紙所	30,000	185	5,550,000
3880	大王製紙	74,000	511	37,814,000
3893	日本製紙グループ本社	84,900	1,619	137,453,100
3941	レンゴー	141,000	537	75,717,000
3946	トモク	55,000	222	12,210,000
3950	ザ・バック	10,400	1,140	11,856,000
3405	クラレ	279,600	1,132	316,507,200
3407	旭化成	1,024,000	488	499,712,000
3553	共和レザー	10,000	308	3,080,000
4003	コープケミカル	26,000	126	3,276,000
4004	昭和電工	1,093,000	167	182,531,000
4005	住友化学	1,209,000	312	377,208,000
4007	日本化成	33,000	145	4,785,000
4008	住友精化	33,000	345	11,385,000
4021	日産化学工業	133,800	775	103,695,000
4022	ラサ工業	70,000	124	8,680,000
4023	クレハ	114,000	372	42,408,000
4027	テイカ	30,000	313	9,390,000
4028	石原産業	295,000	93	27,435,000
4031	片倉チッカリン	12,000	209	2,508,000
4041	日本曹達	105,000	360	37,800,000
4042	東ソー	470,000	222	104,340,000
4043	トクヤマ	274,000	278	76,172,000
4044	セントラル硝子	168,000	370	62,160,000
4045	東亜合成	220,000	339	74,580,000
4046	ダイソー	70,000	251	17,570,000
4047	関東電化工業	39,000	321	12,519,000
4061	電気化学工業	369,000	310	114,390,000
4063	信越化学工業	315,500	3,990	1,258,845,000
4064	日本カーバイド工業	56,000	121	6,776,000
4078	堺化学工業	55,000	305	16,775,000
4088	エア・ウォーター	143,000	1,015	145,145,000
4091	大陽日酸	231,000	539	124,509,000
4092	日本化学工業	70,000	141	9,870,000
4095	日本パーカライジング	42,000	995	41,790,000
4097	高圧ガス工業	26,000	474	12,324,000
4098	チタン工業	19,000	376	7,144,000
4099	四国化成工業	25,000	440	11,000,000
4100	戸田工業	23,000	705	16,215,000
4109	ステラケミファ	8,300	2,266	18,807,800
4112	保土谷化学工業	35,000	249	8,715,000
4114	日本触媒	128,000	882	112,896,000
4116	大日精化工業	63,000	339	21,357,000
4118	カネカ	219,000	443	97,017,000
4182	三菱瓦斯化学	303,000	446	135,138,000
4183	三井化学	746,000	248	185,008,000
4185	J S R	160,200	1,588	254,397,600
4186	東京応化工業	31,600	1,677	52,993,200
4188	三菱ケミカルホールディングス	1,100,000	444	488,400,000
4201	日本合成化学工業	36,000	480	17,280,000
4202	ダイセル	228,000	502	114,456,000
4203	住友ベークライト	151,000	460	69,460,000
4204	積水化学工業	366,000	681	249,246,000
4205	日本ゼオン	164,000	690	113,160,000

4206	アイカ工業	45,800	1,085	49,693,000	
4208	宇部興産	737,000	223	164,351,000	
4212	積水樹脂	25,000	799	19,975,000	
4215	タキロン	41,000	264	10,824,000	
4216	旭有機材工業	62,000	219	13,578,000	
4217	日立化成工業	76,100	1,401	106,616,100	
4218	ニチバン	17,000	261	4,437,000	
4220	リケンテクノス	28,000	227	6,356,000	
4221	大倉工業	42,000	243	10,206,000	
4228	積水化成成品工業	45,000	297	13,365,000	
4229	群栄化学工業	47,000	203	9,541,000	
4231	タイガースポリマー	8,800	305	2,684,000	
4271	日本カーリット	14,000	406	5,684,000	
4272	日本化薬	124,000	735	91,140,000	
4362	日本精化	14,600	538	7,854,800	
4401	A D E K A	75,700	763	57,759,100	
4403	日油	140,000	393	55,020,000	
4410	ハリマ化成	15,000	616	9,240,000	
4452	花王	466,600	2,117	987,792,200	
4461	第一工業製薬	32,000	238	7,616,000	
4471	三洋化成工業	55,000	512	28,160,000	
4611	大日本塗料	101,000	89	8,989,000	
4612	日本ペイント	166,000	573	95,118,000	
4613	関西ペイント	199,000	719	143,081,000	
4614	トウベ	14,000	97	1,358,000	
4617	中国塗料	54,000	491	26,514,000	
4619	日本特殊塗料	13,500	323	4,360,500	
4620	藤倉化成	22,300	404	9,009,200	
4626	太陽ホールディングス	14,300	2,029	29,014,700	
4631	D I C	671,000	148	99,308,000	
4633	サカタインクス	33,000	355	11,715,000	
4634	東洋インキ S Cホールディングス	158,000	309	48,822,000	
4901	富士フイルムホールディングス	375,800	2,025	760,995,000	
4911	資生堂	292,100	1,389	405,726,900	
4912	ライオン	203,000	459	93,177,000	
4914	高砂香料工業	58,000	374	21,692,000	
4917	マンダム	17,600	1,970	34,672,000	
4919	ミルボン	9,400	2,318	21,789,200	
4921	ファンケル	44,200	1,053	46,542,600	
4922	コーセー	28,400	1,897	53,874,800	
4924	ドクターシーラボ	106	390,500	41,393,000	
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	17,900	1,997	35,746,300	
4951	エステー	10,700	1,014	10,849,800	
4956	コニシ	12,700	1,084	13,766,800	
4958	長谷川香料	22,300	1,211	27,005,300	
4967	小林製薬	24,400	3,910	95,404,000	
4968	荒川化学工業	13,700	692	9,480,400	
4971	メック	12,600	283	3,565,800	
4973	日本高純度化学	49	203,400	9,966,600	
4975	荏原ユーザライト	2,400	1,946	4,670,400	
4985	アース製薬	12,600	2,889	36,401,400	
4989	イハラケミカル工業	30,000	298	8,940,000	
4992	北興化学工業	17,000	231	3,927,000	
4994	大成ラミック	4,900	2,473	12,117,700	
4996	クミアイ化学工業	41,000	323	13,243,000	
4997	日本農薬	40,000	321	12,840,000	
5142	アキレス	143,000	114	16,302,000	
5208	有沢製作所	29,300	292	8,555,600	
6988	日東電工	145,000	2,918	423,110,000	
7874	レック	5,300	1,190	6,307,000	
7908	きもと	14,200	516	7,327,200	
7917	藤森工業	12,600	1,152	14,515,200	
7925	前澤化成工業	12,400	831	10,304,400	
7942	J S P	11,500	1,215	13,972,500	
7947	エフビコ	7,800	5,140	40,092,000	
7958	天馬	13,900	692	9,618,800	
7970	信越ポリマー	34,600	369	12,767,400	
7971	東リ	45,000	162	7,290,000	
7988	ニフコ	39,300	2,078	81,665,400	

7995	日本バルカー工業	68,000	213	14,484,000	
8113	ユニ・チャーム	97,100	3,910	379,661,000	
4151	協和発酵キリン	241,000	923	222,443,000	
4502	武田薬品工業	659,000	3,310	2,181,290,000	
4503	アステラス製薬	390,600	3,095	1,208,907,000	
4506	大日本住友製薬	124,500	857	106,696,500	
4507	塩野義製薬	274,700	986	270,854,200	
4508	田辺三菱製薬	175,700	1,062	186,593,400	
4512	わかもと製薬	20,000	241	4,820,000	
4514	あすか製薬	21,000	483	10,143,000	
4516	日本新薬	37,000	921	34,077,000	
4519	中外製薬	204,400	1,197	244,666,800	
4521	科研製薬	69,000	999	68,931,000	
4523	エーザイ	216,600	3,120	675,792,000	
4527	ロート製薬	74,000	929	68,746,000	
4528	小野薬品工業	86,100	4,290	369,369,000	
4530	久光製薬	54,600	3,320	181,272,000	
4531	有機合成薬品工業	13,000	182	2,366,000	
4534	持田製薬	62,000	860	53,320,000	
4536	参天製薬	59,100	3,065	181,141,500	
4538	扶桑薬品工業	59,000	202	11,918,000	
4539	日本ケミファ	27,000	294	7,938,000	
4540	ツムラ	48,000	2,241	107,568,000	
4541	日医工	29,700	1,785	53,014,500	
4547	キッセイ薬品工業	32,700	1,558	50,946,600	
4548	生化学工業	33,600	862	28,963,200	
4549	栄研化学	13,600	1,047	14,239,200	
4550	日水製薬	7,000	699	4,893,000	
4551	鳥居薬品	12,000	1,430	17,160,000	
4553	東和薬品	9,000	3,290	29,610,000	
4555	沢井製薬	11,600	7,880	91,408,000	
4559	ゼリア新薬工業	25,000	1,346	33,650,000	
4568	第一三共	591,700	1,456	861,515,200	
4569	キョーリン製薬ホールディングス	43,000	1,318	56,674,000	
4574	大幸薬品	8,200	803	6,584,600	
4577	ダイト	4,900	1,195	5,855,500	
4578	大塚ホールディングス	349,200	2,149	750,430,800	
4581	大正製薬ホールディングス	42,300	6,510	275,373,000	
3315	日本コークス工業	142,000	116	16,472,000	
5002	昭和シェル石油	157,300	540	84,942,000	
5007	コスモ石油	486,000	228	110,808,000	
5011	ニチレキ	23,000	425	9,775,000	
5012	東燃ゼネラル石油	265,000	747	197,955,000	
5013	ユシロ化学工業	9,600	859	8,246,400	
5015	ピーピー・カストロール	7,100	334	2,371,400	
5017	AOCホールディングス	40,800	546	22,276,800	
5018	MORESCO	3,600	807	2,905,200	
5019	出光興産	20,900	8,390	175,351,000	
5020	JXホールディングス	1,952,500	472	921,580,000	
5101	横浜ゴム	214,000	453	96,942,000	
5105	東洋ゴム工業	133,000	194	25,802,000	
5108	ブリヂストン	551,400	1,731	954,473,400	
5110	住友ゴム工業	137,200	915	125,538,000	
5121	藤倉ゴム工業	11,200	294	3,292,800	
5122	オカモト	64,000	294	18,816,000	
5185	フコク	7,300	723	5,277,900	
5186	ニッタ	17,400	1,412	24,568,800	
5191	東海ゴム工業	32,600	893	29,111,800	
5192	三ツ星ベルト	46,000	410	18,860,000	
5195	バンドー化学	63,000	303	19,089,000	
3110	日東紡績	129,000	269	34,701,000	
5201	旭硝子	867,000	671	581,757,000	
5202	日本板硝子	754,000	158	119,132,000	
5204	石塚硝子	23,000	146	3,358,000	

(単位:円)

コード	銘柄 銘柄名	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
5210	日本山村硝子	70,000	215	15,050,000	
5214	日本電気硝子	337,000	761	256,457,000	
5218	オハラ	6,700	803	5,380,100	
5232	住友大阪セメント	357,000	237	84,609,000	
5233	太平洋セメント	1,033,000	164	169,412,000	
5234	デイ・シイ	16,200	271	4,390,200	
5262	日本ヒューム	17,000	382	6,494,000	
5269	日本コンクリート工業	27,000	282	7,614,000	
5301	東海カーボン	153,000	410	62,730,000	
5302	日本カーボン	80,000	216	17,280,000	
5310	東洋炭素	9,700	3,145	30,506,500	
5331	ノリタケカンパニーリミテド	91,000	239	21,749,000	
5332	TOTO	271,000	621	168,291,000	
5333	日本碍子	229,000	976	223,504,000	
5334	日本特殊陶業	152,000	982	149,264,000	
5337	ダントーホールディングス	24,000	86	2,064,000	
5344	MARUWA	5,200	3,285	17,082,000	
5351	品川リフラクトリーズ	44,000	236	10,384,000	
5352	黒崎播磨	38,000	274	10,412,000	
5363	東京窯業	21,000	210	4,410,000	
5367	ニッカトー	6,100	459	2,799,900	
5384	フジインコーポレーテッド	16,100	1,021	16,438,100	
5391	エーアンドエーマテリアル	36,000	89	3,204,000	
5393	ニチアス	78,000	433	33,774,000	
7943	ニチハ	19,500	873	17,023,500	
5401	新日本製鐵	4,616,000	201	927,816,000	
5405	住友金属工業	3,259,000	143	466,037,000	
5406	神戸製鋼所	2,437,000	131	319,247,000	
5407	日新製鋼	622,000	123	76,506,000	
5408	中山製鋼所	89,000	90	8,010,000	
5410	合同製鐵	98,000	197	19,306,000	
5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	416,700	1,464	610,048,800	
5423	東京製鐵	89,000	600	53,400,000	
5440	共英製鋼	18,700	1,483	27,732,100	
5444	大和工業	40,200	2,386	95,917,200	
5445	東京鐵鋼	34,000	258	8,772,000	
5449	大阪製鐵	11,000	1,497	16,467,000	
5451	淀川製鋼所	125,000	354	44,250,000	
5453	東洋鋼鈹	42,000	292	12,264,000	
5457	住友鋼管	10,300	645	6,643,500	
5463	丸一鋼管	53,900	1,803	97,181,700	
5464	モリ工業	27,000	278	7,506,000	
5471	大同特殊鋼	295,000	514	151,630,000	
5476	日本高周波鋼業	68,000	108	7,344,000	
5479	日本金属工業	136,000	76	10,336,000	
5480	日本冶金工業	129,500	130	16,835,000	
5481	山陽特殊製鋼	87,000	444	38,628,000	
5482	愛知製鋼	93,000	422	39,246,000	
5486	日立金属	115,000	868	99,820,000	
5491	日本金属	42,000	170	7,140,000	
5541	大平洋金属	122,000	439	53,558,000	
5563	日本電工	63,000	383	24,129,000	
5602	栗本鐵工所	84,000	190	15,960,000	
5606	旭テック	143,000	32	4,576,000	
5612	日本鑄鉄管	19,000	178	3,382,000	
5632	三菱製鋼	106,000	225	23,850,000	
5658	日亜鋼業	27,000	206	5,562,000	
5659	日本精線	12,000	391	4,692,000	
6319	シンニッタン	15,100	357	5,390,700	
7305	新家工業	38,000	128	4,864,000	
5701	日本軽金属	398,000	110	43,780,000	
5702	大紀アルミニウム工業所	27,000	322	8,694,000	
5706	三井金属鋳業	478,000	220	105,160,000	
5707	東邦亜鉛	99,000	322	31,878,000	
5711	三菱マテリアル	1,097,000	240	263,280,000	
5713	住友金属鋳山	455,000	1,099	500,045,000	

5714	DOWAホールディングス	210,000	505	106,050,000
5715	古河機械金属	295,000	72	21,240,000
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	17,300	3,670	63,491,000
5727	東邦チタニウム	28,500	1,353	38,560,500
5738	住友軽金属工業	425,000	77	32,725,000
5741	古河スカイ	71,000	210	14,910,000
5801	古河電気工業	553,000	208	115,024,000
5802	住友電気工業	621,200	907	563,428,400
5803	フジクラ	263,000	245	64,435,000
5805	昭和電線ホールディングス	225,000	82	18,450,000
5807	東京特殊電線	24,000	109	2,616,000
5809	タツタ電線	33,000	362	11,946,000
5812	日立電線	137,000	183	25,071,000
5815	沖電線	18,000	165	2,970,000
5819	カナレ電気	2,200	1,193	2,624,600
5821	平河ヒューテック	3,400	742	2,522,800
5851	リョービ	98,000	303	29,694,000
5857	アサヒホールディングス	24,600	1,605	39,483,000
3421	稲葉製作所	8,500	925	7,862,500
3431	宮地エンジニアリンググループ	54,000	211	11,394,000
3432	三協・立山ホールディングス	237,000	146	34,602,000
3433	トーカロ	9,900	1,723	17,057,700
3434	アルファC o	5,900	936	5,522,400
3436	SUMCO	107,600	685	73,706,000
3443	川田テクノロジーズ	3,900	1,285	5,011,500
5901	東洋製罐	124,300	1,120	139,216,000
5902	ホッカンホールディングス	42,000	237	9,954,000
5909	コロナ	8,000	1,259	10,072,000
5911	横河ブリッジホールディングス	36,000	560	20,160,000
5912	日本橋梁	6,300	921	5,802,300
5915	駒井ハルテック	34,000	307	10,438,000
5917	サクラダ	154,000	32	4,928,000
5923	高田機工	15,000	245	3,675,000
5929	三和ホールディングス	175,000	253	44,275,000
5930	文化シャッター	45,000	294	13,230,000
5936	東洋シャッター	5,100	388	1,978,800
5938	住生活グループ	228,600	1,595	364,617,000
5942	日本フィルコン	12,800	405	5,184,000
5943	ノーリツ	34,400	1,353	46,543,200
5946	長府製作所	16,900	1,957	33,073,300
5947	リンナイ	28,300	5,390	152,537,000
5951	ダイニチ工業	8,900	753	6,701,700
5957	日東精工	23,000	216	4,968,000
5958	三洋工業	22,000	170	3,740,000
5959	岡部	34,600	391	13,528,600
5974	中国工業	27,000	97	2,619,000
5975	東プレ	33,800	788	26,634,400
5976	高周波熱錬	23,300	627	14,609,100
5981	東京製網	110,000	188	20,680,000
5988	パイオラックス	7,500	1,755	13,162,500
5991	日本発條	127,300	732	93,183,600
5992	中央発條	22,000	293	6,446,000
5998	アドバネクス	35,000	68	2,380,000
8155	三益半導体工業	14,900	700	10,430,000
1978	アタカ大機	11,000	267	2,937,000
5631	日本製鋼所	271,000	598	162,058,000
5963	日立ツール	10,000	866	8,660,000
6005	三浦工業	26,100	2,203	57,498,300
6013	タクマ	60,000	356	21,360,000
6101	ツガミ	43,000	557	23,951,000
6103	オークマ	106,000	564	59,784,000
6104	東芝機械	96,000	418	40,128,000
6113	アマダ	248,000	524	129,952,000
6118	アイダエンジニアリング	45,400	373	16,934,200
6135	牧野フライス製作所	88,000	536	47,168,000
6136	オーエスジー	77,400	1,126	87,152,400
6138	ダイジェット工業	20,000	158	3,160,000
6140	旭ダイヤモンド工業	43,200	993	42,897,600
6141	森精機製作所	92,700	738	68,412,600

6146	ディスコ	17,700	4,150	73,455,000
6151	日東工器	10,200	1,804	18,400,800
6203	豊和工業	92,000	73	6,716,000
6205	大阪機工	68,000	111	7,548,000
6208	石川製作所	37,000	78	2,886,000
6210	東洋機械金属	13,200	197	2,600,400
6217	津田駒工業	43,000	203	8,729,000
6218	エンシュウ	44,000	96	4,224,000
6222	島精機製作所	22,900	1,429	32,724,100
6247	日阪製作所	22,000	851	18,722,000
6250	やまびこ	6,900	950	6,555,000
6262	ベガサスミシン製造	16,100	241	3,880,100
6268	ナブテスコ	73,000	1,630	118,990,000
6269	三井海洋開発	14,500	1,375	19,937,500
6272	レオン自動機	16,000	194	3,104,000
6273	S M C	52,500	13,150	690,375,000
6274	新川	13,500	401	5,413,500
6277	ホソカワミクロン	27,000	367	9,909,000
6278	ユニオンツール	9,600	1,357	13,027,200
6282	オイレス工業	19,500	1,554	30,303,000
6287	サトーホールディングス	18,400	965	17,756,000
6291	日本エアータック	5,200	372	1,934,400
6293	日精樹脂工業	13,900	387	5,379,300
6298	ワイエイシイ	7,000	648	4,536,000
6301	小松製作所	833,500	2,067	1,722,844,500
6302	住友重機械工業	449,000	490	220,010,000
6305	日立建機	89,800	1,469	131,916,200
6306	日工	24,000	325	7,800,000
6309	巴工業	6,600	1,470	9,702,000
6310	井関農機	180,000	177	31,860,000
6315	T O W A	15,800	428	6,762,400
6316	丸山製作所	39,000	185	7,215,000
6317	北川鉄工所	81,000	147	11,907,000
6326	クボタ	805,000	688	553,840,000
6328	荏原実業	4,200	1,204	5,056,800
6331	三菱化工機	54,000	149	8,046,000
6332	月島機械	26,000	611	15,886,000
6333	帝国電機製作所	5,900	1,412	8,330,800
6335	東京機械製作所	55,000	58	3,190,000
6339	新東工業	38,300	725	27,767,500
6340	澁谷工業	9,900	886	8,771,400
6345	アイチ コーポレーション	29,100	345	10,039,500
6349	小森コーポレーション	49,900	539	26,896,100
6351	鶴見製作所	13,000	564	7,332,000
6355	住友精密工業	25,000	506	12,650,000
6358	酒井重工業	33,000	171	5,643,000
6361	荏原製作所	287,000	310	88,970,000
6362	石井鐵工所	26,000	163	4,238,000
6363	西島製作所	20,300	1,082	21,964,600
6367	ダイキン工業	214,000	2,239	479,146,000
6368	オルガノ	33,000	593	19,569,000
6369	トーヨーカネツ	94,000	171	16,074,000
6370	栗田工業	97,000	2,085	202,245,000
6371	椿本チエイン	90,000	455	40,950,000
6373	大同工業	34,000	146	4,964,000
6375	日本コンベヤ	53,000	85	4,505,000
6378	木村化工機	16,200	341	5,524,200
6381	アネスト岩田	28,000	341	9,548,000
6383	ダイフク	77,000	437	33,649,000
6390	加藤製作所	40,000	271	10,840,000
6393	油研工業	31,000	169	5,239,000
6395	タダノ	81,000	509	41,229,000
6406	フジテック	49,000	525	25,725,000
6407	シーケーディ	47,100	589	27,741,900
6409	キトー	70	58,700	4,109,000
6412	平和	36,400	1,341	48,812,400
6413	理想科学工業	12,100	1,145	13,854,500
6417	S A N K Y O	50,900	3,715	189,093,500
6418	日本金銭機械	15,500	589	9,129,500

6419	マースエンジニアリング	9,500	1,369	13,005,500
6420	福島工業	4,500	963	4,333,500
6428	オーイズミ	5,700	237	1,350,900
6430	ダイコク電機	7,700	784	6,036,800
6436	アマノ	50,900	675	34,357,500
6440	JUKI	101,000	183	18,483,000
6444	サンデン	88,000	263	23,144,000
6445	蛇の目ミシン工業	163,000	60	9,780,000
6454	マックス	26,000	964	25,064,000
6457	グローリー	50,100	1,685	84,418,500
6459	大和冷機工業	24,000	418	10,032,000
6460	セガサミーホールディングス	180,500	1,565	282,482,500
6461	日本ビストンリング	61,000	163	9,943,000
6462	リケン	61,000	313	19,093,000
6463	T P R	18,600	1,023	19,027,800
6465	ホシザキ電機	33,800	1,786	60,366,800
6470	大豊工業	11,700	721	8,435,700
6471	日本精工	374,000	567	212,058,000
6472	N T N	389,000	332	129,148,000
6473	ジェイテクト	160,600	841	135,064,600
6474	不二越	169,000	392	66,248,000
6480	日本トムソン	54,000	479	25,866,000
6481	T H K	111,700	1,668	186,315,600
6482	ユーシン精機	8,400	1,410	11,844,000
6485	前澤給装工業	6,400	1,063	6,803,200
6486	イーグル工業	21,000	690	14,490,000
6489	前澤工業	12,000	246	2,952,000
6490	日本ビラー工業	17,000	565	9,605,000
6498	キッツ	69,100	345	23,839,500
6581	日立工機	44,900	619	27,793,100
6586	マキタ	109,500	2,909	318,535,500
7004	日立造船	664,500	110	73,095,000
7011	三菱重工業	2,816,000	354	996,864,000
7013	I H I	1,148,000	202	231,896,000
4062	イビデン	110,200	1,637	180,397,400
4902	コニカミノルタホールディングス	443,500	574	254,569,000
6448	ブラザー工業	217,100	1,066	231,428,600
6479	ミネベア	250,000	342	85,500,000
6501	日立製作所	3,772,000	436	1,644,592,000
6502	東芝	3,537,000	340	1,202,580,000
6503	三菱電機	1,680,000	763	1,281,840,000
6504	富士電機	506,000	210	106,260,000
6505	東洋電機製造	29,000	297	8,613,000
6506	安川電機	197,000	688	135,536,000
6507	シンフォニアテクノロジー	101,000	185	18,685,000
6508	明電舎	166,000	280	46,480,000
6513	オリジン電気	24,000	272	6,528,000
6517	デンヨー	15,900	1,040	16,536,000
6588	東芝テック	105,000	287	30,135,000
6590	芝浦メカトロニクス	30,000	212	6,360,000
6592	マブチモーター	22,900	3,290	75,341,000
6594	日本電産	90,800	7,250	658,300,000
6620	宮越ホールディングス	5,500	552	3,036,000
6621	高岳製作所	66,000	237	15,642,000
6622	ダイヘン	99,000	301	29,799,000
6632	J V C ケンウッド	101,500	311	31,566,500
6640	第一精工	3,900	2,245	8,755,500
6641	日新電機	34,000	486	16,524,000
6644	大崎電気工業	24,000	761	18,264,000
6645	オムロン	187,100	1,660	310,586,000
6651	日東工業	25,200	949	23,914,800
6652	I D E C	21,900	838	18,352,200
6665	エルピーダメモリ	226,800	364	82,555,200
6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	324,000	451	146,124,000
6675	サクサホールディングス	42,000	171	7,182,000
6676	メルコホールディングス	9,300	1,890	17,577,000
6678	テクノメディカ	13	290,000	3,770,000
6701	日本電気	2,310,000	168	388,080,000
6702	富士通	1,620,000	433	701,460,000

6703	沖電気工業	649,000	76	49,324,000	
6704	岩崎通信機	73,000	77	5,621,000	
6706	電気興業	51,000	345	17,595,000	
6707	サンケン電気	85,000	280	23,800,000	
6715	ナカヨ通信機	16,000	335	5,360,000	
6718	アイホン	9,700	1,561	15,141,700	
6723	ルネサスエレクトロニクス	43,500	508	22,098,000	
6724	セイコーエプソン	114,600	1,009	115,631,400	
6727	ワコム	331	115,500	38,230,500	
6728	アルバック	30,900	1,091	33,711,900	
6730	アクセル	7,800	1,571	12,253,800	
6731	ピクセラ	7,200	205	1,476,000	
6737	ナナオ	14,200	1,573	22,336,600	
6741	日本信号	39,100	490	19,159,000	
6742	京三製作所	36,000	358	12,888,000	
6744	能美防災	22,000	526	11,572,000	
6745	ホーチキ	15,000	402	6,030,000	
6751	日本無線	36,000	219	7,884,000	
6752	パナソニック	1,919,300	650	1,247,545,000	70,000株
6753	シャープ	811,000	666	540,126,000	
6754	アンリツ	80,000	814	65,120,000	
6755	富士通ゼネラル	40,000	463	18,520,000	
6756	日立国際電気	38,000	687	26,106,000	
6758	ソニー	1,048,100	1,434	1,502,975,400	70,000株
6762	T D K	87,900	3,670	322,593,000	
6763	帝国通信工業	40,000	142	5,680,000	
6767	ミツミ電機	59,300	631	37,418,300	
6768	タムラ製作所	56,000	220	12,320,000	
6770	アルプス電気	132,600	591	78,366,600	
6771	池上通信機	52,000	59	3,068,000	
6773	パイオニア	238,100	359	85,477,900	
6779	日本電波工業	12,900	944	12,177,600	
6788	日本トリム	1,950	1,831	3,570,450	
6789	ローランド ディー . ジー .	7,500	863	6,472,500	
6793	山水電気	1,069,000	2	2,138,000	
6794	フォスター電機	15,900	1,085	17,251,500	
6796	クラリオン	103,000	142	14,626,000	
6798	S M K	54,000	257	13,878,000	
6800	ヨコオ	13,100	390	5,109,000	
6801	東光	76,000	151	11,476,000	
6803	ティアック	89,000	41	3,649,000	
6804	ホシデン	45,500	570	25,935,000	
6806	ヒロセ電機	29,200	7,260	211,992,000	
6807	日本航空電子工業	39,000	595	23,205,000	
6809	T O A	19,000	533	10,127,000	
6815	ユニデン	49,000	288	14,112,000	
6816	アルパイン	32,800	954	31,291,200	
6817	スミダコーポレーション	10,300	497	5,119,100	
6820	アイコム	9,300	2,000	18,600,000	
6839	船井電機	15,100	1,887	28,493,700	
6841	横河電機	182,100	734	133,661,400	
6844	新電元工業	59,000	357	21,063,000	
6845	山武	43,100	1,700	73,270,000	
6849	日本光電工業	33,400	1,875	62,625,000	
6850	チノー	30,000	215	6,450,000	
6853	共和電業	17,000	237	4,029,000	
6855	日本電子材料	6,700	385	2,579,500	
6856	堀場製作所	31,100	2,377	73,924,700	
6857	アドバンテスト	124,900	748	93,425,200	
6858	小野測器	18,000	301	5,418,000	
6859	エスベック	17,400	526	9,152,400	
6860	パナソニック電工 S U N X	14,700	391	5,747,700	
6861	キーエンス	37,500	19,700	738,750,000	
6866	日置電機	8,000	1,310	10,480,000	
6869	シスメックス	59,100	2,495	147,454,500	
6875	メガチップス	13,800	1,192	16,449,600	
6877	O B A R A G R O U P	11,900	959	11,412,100	
6883	日本電産コバル電子	17,200	466	8,015,200	
6885	ミヤチテクノス	8,200	670	5,494,000	

6900	東京電波	4,900	395	1,935,500	
6901	澤藤電機	9,000	225	2,025,000	
6905	コーセル	24,400	1,143	27,889,200	
6910	日立メディコ	12,000	830	9,960,000	
6911	新日本無線	10,000	217	2,170,000	
6914	オプテックス	11,500	1,021	11,741,500	
6915	千代田インテグレ	8,100	958	7,759,800	
6921	東光電気	11,000	355	3,905,000	
6923	スタンレー電気	112,700	1,235	139,184,500	
6924	岩崎電気	61,000	173	10,553,000	
6925	ウシオ電機	102,000	1,132	115,464,000	
6926	岡谷電機産業	9,000	353	3,177,000	
6927	ヘリオス テクノ ホールディング	14,600	158	2,306,800	
6929	日本セラミック	11,000	1,389	15,279,000	
6935	日本デジタル研究所	14,200	787	11,175,400	
6937	古河電池	12,000	372	4,464,000	
6938	双信電機	8,100	338	2,737,800	
6941	山一電機	16,700	180	3,006,000	
6947	図研	11,000	588	6,468,000	
6951	日本電子	62,000	215	13,330,000	
6952	カシオ計算機	160,100	471	75,407,100	
6954	ファナック	174,900	12,800	2,238,720,000	
6958	日本シイエムケイ	36,400	281	10,228,400	
6961	エンブラス	8,400	1,688	14,179,200	
6963	ローム	82,800	3,820	316,296,000	
6965	浜松ホトニクス	65,500	2,781	182,155,500	
6966	三井ハイテック	22,000	320	7,040,000	
6967	新光電気工業	56,400	591	33,332,400	
6971	京セラ	139,700	6,640	927,608,000	
6976	太陽誘電	75,400	709	53,458,600	
6981	村田製作所	176,200	4,310	759,422,000	
6985	ユーシン	23,400	611	14,297,400	
6986	双葉電子工業	28,700	1,284	36,850,800	
6989	北陸電気工業	68,000	123	8,364,000	
6996	ニチコン	52,900	796	42,108,400	
6997	日本ケミコン	97,000	274	26,578,000	
6999	K O A	21,100	724	15,276,400	
7244	市光工業	40,000	139	5,560,000	
7276	小糸製作所	84,000	1,249	104,916,000	
7280	ミツバ	31,000	651	20,181,000	
7718	スター精密	26,900	740	19,906,000	
7735	大日本スクリーン製造	159,000	636	101,124,000	
7739	キヤノン電子	15,400	1,965	30,261,000	
7751	キヤノン	1,043,500	3,485	3,636,597,500	
7752	リコー	505,000	667	336,835,000	
7757	日本電産サンキョー	40,000	520	20,800,000	
7999	M U T O Hホールディングス	17,000	478	8,126,000	
8035	東京エレクトロン	141,300	4,340	613,242,000	
3116	トヨタ紡織	58,700	864	50,716,800	
5196	鬼怒川ゴム工業	39,000	644	25,116,000	
5949	ユニプレス	26,800	2,402	64,373,600	
6201	豊田自動織機	153,000	2,262	346,086,000	
6455	モリタホールディングス	27,000	461	12,447,000	
6584	三櫻工業	21,300	568	12,098,400	
6902	デンソー	415,000	2,318	961,970,000	
6995	東海理化電機製作所	39,300	1,320	51,876,000	
7003	三井造船	650,000	140	91,000,000	
7007	佐世保重工業	110,000	139	15,290,000	
7012	川崎重工業	1,221,000	221	269,841,000	
7102	日本車輛製造	61,000	324	19,764,000	
7105	日本輸送機	22,000	222	4,884,000	
7122	近畿車輛	25,000	245	6,125,000	
7201	日産自動車	2,122,200	734	1,557,694,800	70,000株
7202	いすゞ自動車	1,062,000	390	414,180,000	
7203	トヨタ自動車	2,178,300	2,887	6,288,752,100	270,000株

(単位:円)

コード	銘柄 銘柄名	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
7205	日野自動車	240,000	511	122,640,000	
7211	三菱自動車工業	3,755,000	94	352,970,000	
7212	エフテック	5,900	1,013	5,976,700	
7220	武蔵精密工業	16,300	1,812	29,535,600	
7222	日産車体	49,000	796	39,004,000	
7224	新明和工業	75,000	370	27,750,000	
7226	極東開発工業	29,000	612	17,748,000	
7230	日信工業	30,700	1,191	36,563,700	
7231	トピー工業	126,000	211	26,586,000	
7236	ティラド	61,000	301	18,361,000	
7238	曙ブレーキ工業	85,100	385	32,763,500	
7239	タチエス	21,900	1,434	31,404,600	
7240	NOK	81,300	1,459	118,616,700	
7241	フタバ産業	47,500	475	22,562,500	
7242	カヤバ工業	116,000	412	47,792,000	
7243	シロキ工業	37,000	220	8,140,000	
7245	大同メタル工業	26,000	910	23,660,000	
7246	プレス工業	77,000	387	29,799,000	
7248	カルソニックカンセイ	100,000	487	48,700,000	
7250	太平洋工業	34,000	378	12,852,000	
7251	ケーヒン	34,700	1,481	51,390,700	
7256	河西工業	21,000	400	8,400,000	
7259	アイシン精機	138,300	2,460	340,218,000	
7260	富士機工	19,000	219	4,161,000	
7261	マツダ	1,393,000	133	185,269,000	
7262	ダイハツ工業	156,000	1,489	232,284,000	
7263	愛知機械工業	38,000	292	11,096,000	
7266	今仙電機製作所	12,400	950	11,780,000	
7267	本田技研工業	1,417,300	2,742	3,886,236,600	
7269	スズキ	351,200	1,735	609,332,000	
7270	富士重工業	531,000	530	281,430,000	
7272	ヤマハ発動機	273,700	1,052	287,932,400	
7274	ショーワ	35,700	520	18,564,000	
7277	T B K	17,000	387	6,579,000	
7278	エクセディ	22,800	2,299	52,417,200	
7282	豊田合成	47,500	1,269	60,277,500	
7283	愛三工業	17,400	669	11,640,600	
7294	ヨロズ	10,100	1,823	18,412,300	
7296	エフ・シー・シー	27,500	1,640	45,100,000	
7309	シマノ	63,600	3,720	236,592,000	
7312	タカタ	30,400	1,778	54,051,200	
7313	テイ・エス テック	35,500	1,330	47,215,000	
7728	日本電産トーソク	8,000	918	7,344,000	
4543	テルモ	118,900	3,615	429,823,500	
5187	クリエートメディック	5,100	789	4,023,900	
6376	日機装	54,000	691	37,314,000	
7701	島津製作所	201,000	661	132,861,000	
7702	J M S	25,000	246	6,150,000	
7709	クボテック	34	22,260	756,840	
7714	モリテックス	3,800	312	1,185,600	
7715	長野計器	11,900	777	9,246,300	
7717	バイ・テクノロジー	22	311,500	6,853,000	
7721	東京計器	58,000	160	9,280,000	
7723	愛知時計電機	18,000	287	5,166,000	
7729	東京精密	30,100	1,561	46,986,100	
7731	ニコン	292,700	1,847	540,616,900	
7732	トプコン	38,700	396	15,325,200	
7733	オリンパス	198,100	1,279	253,369,900	
7734	理研計器	13,500	589	7,951,500	
7740	タムロン	14,300	1,940	27,742,000	
7741	HOYA	408,400	1,672	682,844,800	
7744	ノーリツ鋼機	15,100	351	5,300,100	
7745	エー・アンド・デイ	16,200	254	4,114,800	
7756	日本電産コバル	13,200	840	11,088,000	
7762	シチズンホールディングス	201,000	470	94,470,000	
7769	リズム時計工業	76,000	142	10,792,000	

7775	大研医器	2,000	814	1,628,000	
8050	セイコーホールディングス	97,000	171	16,587,000	
8086	ニプロ	66,600	676	45,021,600	
7817	パラマウントベッドホールディングス	14,400	2,305	33,192,000	
7819	SHO - B I	2,500	486	1,215,000	
7825	S R Iスポーツ	10,600	845	8,957,000	
7832	バンダイナムコホールディングス	180,000	1,049	188,820,000	
7838	共立印刷	19,700	302	5,949,400	
7840	フランスベッドホールディングス	112,000	156	17,472,000	
7846	パイロットコーポレーション	147	153,000	22,491,000	
7862	トッパン・フォームズ	36,000	587	21,132,000	
7864	フジシールインターナショナル	18,800	1,396	26,244,800	
7867	タカラトミー	55,200	547	30,194,400	
7868	廣済堂	14,500	202	2,929,000	
7873	アーク	57,100	76	4,339,600	
7885	タカノ	6,700	456	3,055,200	
7893	プロネクサス	18,300	394	7,210,200	
7897	ホクシン	12,100	158	1,911,800	
7898	ウッドワン	28,000	279	7,812,000	
7905	大建工業	68,000	253	17,204,000	
7911	凸版印刷	511,000	607	310,177,000	
7912	大日本印刷	512,000	809	414,208,000	
7913	図書印刷	27,000	134	3,618,000	
7914	共同印刷	56,000	194	10,864,000	
7915	日本写真印刷	28,200	1,001	28,228,200	
7916	光村印刷	16,000	257	4,112,000	
7921	宝印刷	9,500	568	5,396,000	
7936	アシックス	156,500	869	135,998,500	
7937	ツツミ	8,400	1,805	15,162,000	
7944	ローランド	17,400	682	11,866,800	
7949	小松ウオール工業	6,300	838	5,279,400	
7951	ヤマハ	123,500	709	87,561,500	
7952	河合楽器製作所	63,000	152	9,576,000	
7955	クリナップ	19,700	487	9,593,900	
7956	ビジョン	14,800	2,958	43,778,400	
7961	兼松日産農林	26,000	174	4,524,000	
7962	キングジム	14,000	607	8,498,000	
7966	リンテック	31,900	1,495	47,690,500	
7968	田崎真珠	33,000	49	1,617,000	
7972	イトーキ	35,400	181	6,407,400	
7974	任天堂	96,100	10,750	1,033,075,000	
7976	三菱鉛筆	14,300	1,357	19,405,100	
7981	タカラスタANDARD	77,000	608	46,816,000	
7984	コクヨ	87,300	546	47,665,800	
7987	ナカバヤシ	35,000	190	6,650,000	
7990	グローブライド	81,000	91	7,371,000	
7994	岡村製作所	59,000	577	34,043,000	
8022	美津濃	83,000	408	33,864,000	
8170	アデランス	21,000	916	19,236,000	
9501	東京電力	1,341,200	213	285,675,600	
9502	中部電力	553,500	1,450	802,575,000	
9503	関西電力	685,500	1,265	867,157,500	
9504	中国電力	232,300	1,427	331,492,100	
9505	北陸電力	164,600	1,501	247,064,600	
9506	東北電力	419,700	834	350,029,800	
9507	四国電力	154,700	2,293	354,727,100	
9508	九州電力	371,000	1,162	431,102,000	
9509	北海道電力	157,200	1,146	180,151,200	
9511	沖縄電力	10,100	3,285	33,178,500	
9513	電源開発	104,300	2,051	213,919,300	
9531	東京瓦斯	2,027,000	352	713,504,000	
9532	大阪瓦斯	1,630,000	304	495,520,000	
9533	東邦瓦斯	427,000	479	204,533,000	
9534	北海道瓦斯	30,000	284	8,520,000	
9536	西部瓦斯	189,000	214	40,446,000	
9543	静岡瓦斯	43,500	519	22,576,500	
9001	東武鉄道	954,000	394	375,876,000	
9003	相鉄ホールディングス	269,000	245	65,905,000	
9005	東京急行電鉄	989,000	373	368,897,000	

9006	京浜急行電鉄	431,000	690	297,390,000	
9007	小田急電鉄	538,000	742	399,196,000	
9008	京王電鉄	469,000	550	257,950,000	
9009	京成電鉄	270,000	564	152,280,000	
9010	富士急行	46,000	480	22,080,000	
9014	新京成電鉄	22,000	355	7,810,000	
9020	東日本旅客鉄道	292,100	4,720	1,378,712,000	
9021	西日本旅客鉄道	146,000	3,195	466,470,000	
9022	東海旅客鉄道	1,458	650,000	947,700,000	
9031	西日本鉄道	217,000	378	82,026,000	
9037	ハマキョウレックス	4,800	2,305	11,064,000	
9039	サカイ引越センター	3,100	1,685	5,223,500	
9041	近畿日本鉄道	1,517,000	299	453,583,000	
9042	阪急阪神ホールディングス	1,127,000	333	375,291,000	
9044	南海電気鉄道	350,000	343	120,050,000	
9045	京阪電気鉄道	376,000	375	141,000,000	
9047	名糖運輸	6,900	620	4,278,000	
9048	名古屋鉄道	586,000	217	127,162,000	
9062	日本通運	665,000	308	204,820,000	
9064	ヤマトホールディングス	341,800	1,271	434,427,800	
9065	山九	204,000	295	60,180,000	
9067	丸運	9,200	210	1,932,000	
9068	丸全昭和運輸	56,000	265	14,840,000	
9069	センコー	67,000	320	21,440,000	
9070	トナミホールディングス	34,000	178	6,052,000	
9072	日本梱包運輸倉庫	50,300	811	40,793,300	
9074	日本石油輸送	19,000	203	3,857,000	
9075	福山通運	102,000	443	45,186,000	
9076	セイノーホールディングス	130,000	592	76,960,000	
9081	神奈川中央交通	20,000	421	8,420,000	
9086	日立物流	35,000	1,292	45,220,000	
9101	日本郵船	1,331,000	199	264,869,000	
9104	商船三井	881,000	299	263,419,000	
9107	川崎汽船	519,000	147	76,293,000	
9110	N S ユナイテッド海運	72,000	139	10,008,000	
9113	乾汽船	18,300	337	6,167,100	
9115	明治海運	15,000	361	5,415,000	
9119	飯野海運	81,100	363	29,439,300	
9130	共栄タンカー	14,000	216	3,024,000	
9132	第一中央汽船	110,000	128	14,080,000	
9202	全日本空輸	2,239,000	224	501,536,000	
9232	パスコ	15,000	293	4,395,000	
9234	国際航業ホールディングス	10,000	198	1,980,000	
9066	日新	63,000	213	13,419,000	
9301	三菱倉庫	119,000	865	102,935,000	
9302	三井倉庫	78,000	310	24,180,000	
9303	住友倉庫	123,000	377	46,371,000	
9304	澁澤倉庫	40,000	242	9,680,000	
9306	東陽倉庫	27,000	179	4,833,000	
9310	日本トランスシティ	35,000	270	9,450,000	
9312	ケイヒン	30,000	121	3,630,000	
9324	安田倉庫	13,100	498	6,523,800	
9351	東洋埠頭	48,000	150	7,200,000	
9358	宇徳	11,500	292	3,358,000	
9364	上組	186,000	673	125,178,000	
9366	サンリツ	4,300	521	2,240,300	
9368	キムラユニティー	3,700	705	2,608,500	
9369	キューソー流通システム	5,200	862	4,482,400	
9370	郵船ロジスティクス	13,300	998	13,273,400	
9375	近鉄エクスプレス	15,000	2,283	34,245,000	
9380	東海運	10,700	273	2,921,100	
9382	バンテック	19	231,700	4,402,300	
1973	NEC ネットエスアイ	15,600	1,134	17,690,400	
2317	システナ	198	50,900	10,078,200	
2327	新日鉄ソリューションズ	11,100	1,532	17,005,200	
2359	コア	6,200	673	4,172,600	
3371	ソフトクリエイト	1,800	1,100	1,980,000	
3620	デジタルハーツ	14	135,800	1,901,200	
3626	ITホールディングス	50,400	924	46,569,600	

3632	グリー	72,500	2,069	150,002,500	
3635	コーエーテクモホールディングス	32,800	617	20,237,600	
3636	三菱総合研究所	6,400	1,480	9,472,000	
3639	ポルテージ	1,500	1,011	1,516,500	
3715	ダウンゴ	83	136,500	11,329,500	
3724	ベリサーブ	10	143,000	1,430,000	
3730	マクロミル	19,300	722	13,934,600	
3738	ティーガイア	107	144,000	15,408,000	
3769	GMOペイメントゲートウェイ	36	325,000	11,700,000	
3770	ザッパラス	90	84,100	7,569,000	
3774	インターネットイニシアティブ	97	249,500	24,201,500	
3789	ソネットエンタテインメント	93	275,600	25,630,800	
3817	SRAホールディングス	8,800	824	7,251,200	
3820	JBIホールディングス	16,900	242	4,089,800	
3834	朝日ネット	14,000	360	5,040,000	
4283	パナソニック電工インフォメーションシステムズ	3,900	2,055	8,014,500	
4295	フェイス	555	8,710	4,834,050	
4307	野村総合研究所	93,900	1,740	163,386,000	
4312	サイバネットシステム	134	20,750	2,780,500	
4326	インテージ	4,900	1,494	7,320,600	
4340	シンプレクス・ホールディングス	275	25,630	7,048,250	
4344	ソースネクスト	40	15,000	600,000	
4674	クレスコ	4,200	670	2,814,000	
4676	フジ・メディア・ホールディングス	1,726	114,700	197,972,200	
4684	オービック	5,190	14,550	75,514,500	
4687	ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	3,200	800	2,560,000	
4689	ヤフー	12,139	24,390	296,070,210	
4704	トレンドマイクロ	73,200	2,385	174,582,000	
4716	日本オラクル	26,500	2,654	70,331,000	
4719	アルファシステムズ	4,500	1,210	5,445,000	
4722	フューチャーアーキテクト	199	30,350	6,039,650	
4725	シーエーシー	11,300	636	7,186,800	
4726	ソフトバンク・テクノロジー	3,800	602	2,287,600	
4728	トーセ	4,000	526	2,104,000	
4733	オービックビジネスコンサルタント	4,200	3,605	15,141,000	
4738	日立ビジネスソリューション	5,200	1,006	5,231,200	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	19,600	3,545	69,482,000	
4743	アイティフォー	18,200	286	5,205,200	
4746	東計電算	2,900	1,024	2,969,600	
4762	エクスネット	15	115,100	1,726,500	
4768	大塚商会	13,200	5,350	70,620,000	
4776	サイボウズ	300	22,670	6,801,000	
4779	ソフトブレイン	242	8,100	1,960,200	
4799	アグレックス	4,400	750	3,300,000	
4812	電通国際情報サービス	10,200	730	7,446,000	
4825	ウェザーニューズ	4,900	2,007	9,834,300	
4826	C I J	16,300	295	4,808,500	
4839	WOWOW	51	207,500	10,582,500	
6791	日本コロムビア	163,000	31	5,053,000	
7518	ネットワンシステムズ	374	207,100	77,455,400	
7595	アルゴグラフィックス	6,000	1,064	6,384,000	
7860	エイベックス・グループ・ホールディングス	31,300	944	29,547,200	
8056	日本ユニシス	40,000	500	20,000,000	
8096	兼松エレクトロニクス	10,400	801	8,330,400	
9401	東京放送ホールディングス	99,300	1,018	101,087,400	
9404	日本テレビ放送網	14,550	11,510	167,470,500	
9409	テレビ朝日	420	130,200	54,684,000	
9412	スカパーJ S A Tホールディングス	1,258	39,150	49,250,700	
9413	テレビ東京ホールディングス	10,500	1,049	11,014,500	
9422	アイ・ティ・シーネットワーク	14,000	501	7,014,000	
9427	イー・アクセス	1,265	17,780	22,491,700	
9430	NECモバイル	6,100	2,639	16,097,900	
9432	日本電信電話	763,500	3,910	2,985,285,000	
9433	KDDI	2,573	487,000	1,253,051,000	
9435	光通信	15,200	2,018	30,673,600	
9437	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	13,661	140,200	1,915,272,200	
9449	GMOインターネット	49,200	301	14,809,200	

9470	学研ホールディングス	50,000	148	7,400,000	
9474	ゼンリン	23,900	708	16,921,200	
9475	昭文社	9,000	592	5,328,000	
9477	角川グループホールディングス	15,600	2,585	40,326,000	
9479	インプレスホールディングス	13,300	108	1,436,400	
9600	アイネット	7,200	475	3,420,000	
9601	松竹	109,000	770	83,930,000	
9602	東宝	118,300	1,322	156,392,600	
9605	東映	69,000	362	24,978,000	
9607	葵プロモーション	7,500	409	3,067,500	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	1,024	248,300	254,259,200	
9682	D T S	17,100	1,023	17,493,300	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	54,200	1,484	80,432,800	
9692	シーイーシー	9,800	381	3,733,800	
9697	カプコン	31,800	1,593	50,657,400	
9717	ジャステック	10,600	461	4,886,600	
9719	S C S K	33,800	1,269	42,892,200	
9739	日本システムウエア	5,300	317	1,680,100	
9742	アイネス	20,000	579	11,580,000	
9746	T K C	13,900	1,615	22,448,500	
9749	富士ソフト	22,400	1,430	32,032,000	
9759	N S D	32,000	606	19,392,000	
9766	コナミ	74,800	1,882	140,773,600	
9790	福井コンピュータ	2,400	393	943,200	
9889	J B C Cホールディングス	13,000	537	6,981,000	
9984	ソフトバンク	751,100	2,236	1,679,459,600	
1352	ハウスイ	13,000	120	1,560,000	
2657	インターニックス	6,700	357	2,391,900	
2676	高千穂交易	6,800	882	5,997,600	
2692	伊藤忠食品	4,100	2,763	11,328,300	
2715	エレマテック	13,200	1,370	18,084,000	
2729	J A L U X	4,600	767	3,528,200	
2737	トーメンデバイス	2,500	1,871	4,677,500	
2760	東京エレクトロン デバイス	33	145,300	4,794,900	
2768	双日	1,109,700	136	150,919,200	
2784	アルフレッサ ホールディングス	43,400	3,335	144,739,000	
2874	横浜冷凍	38,300	624	23,899,200	
3004	神栄	21,000	164	3,444,000	
3022	山下医科器械	1,300	944	1,227,200	
3023	ラサ商事	7,000	366	2,562,000	
3036	アルコニックス	4,300	1,673	7,193,900	
3076	あい ホールディングス	29,300	324	9,493,200	
3107	ダイワボウホールディングス	161,000	190	30,590,000	
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	31,100	623	19,375,300	
3156	U K Cホールディングス	9,800	795	7,791,000	
3167	T O K A Iホールディングス	81,000	396	32,076,000	
3321	ミタチ産業	3,900	374	1,458,600	
3332	J F E 商事ホールディングス	111,000	354	39,294,000	
3360	シップヘルスケアホールディングス	21,500	1,606	34,529,000	
5009	富士興産	59,000	80	4,720,000	
6973	協栄産業	20,000	148	2,960,000	
7414	小野建	14,300	658	9,409,400	
7420	佐鳥電機	12,300	502	6,174,600	
7427	エコトレーディング	4,000	724	2,896,000	
7433	伯東	10,100	778	7,857,800	
7438	コンドーテック	11,700	487	5,697,900	
7442	中山福	9,500	610	5,795,000	
7447	ナガイレーベン	21,900	1,112	24,352,800	
7451	三菱食品	15,200	2,148	32,649,600	
7456	松田産業	12,100	1,206	14,592,600	
7459	メディカルホールディングス	178,600	835	149,131,000	
7463	アドヴァン	9,800	726	7,114,800	
7466	S P K	3,900	1,341	5,229,900	
7476	アズワン	10,800	1,654	17,863,200	
7480	スズデン	5,400	525	2,835,000	
7481	尾家産業	5,400	825	4,455,000	
7482	シモジマ	10,200	1,048	10,689,600	
7483	ドウシシャ	7,800	2,442	19,047,600	
7504	高速	9,800	657	6,438,600	

7517	黒田電気	20,500	829	16,994,500
7537	丸文	13,300	358	4,761,400
7552	ハビネット	8,800	675	5,940,000
7558	トーマンエレクトロニクス	7,600	1,032	7,843,200
7591	エクセル	7,600	786	5,973,600
7594	マルカキカイ	5,400	702	3,790,800
7599	ガリバーインターナショナル	5,020	2,902	14,568,040
7600	日本エム・ディ・エム	13,600	264	3,590,400
7607	進和	9,800	918	8,996,400
7608	エスケイジャパン	3,800	257	976,600
7609	ダイトエレクトロン	7,700	416	3,203,200
7613	シークス	10,600	960	10,176,000
7619	田中商事	5,100	439	2,238,900
7628	オーハシテクニカ	9,300	601	5,589,300
7631	マクニカ	8,500	1,755	14,917,500
7637	白銅	5,400	818	4,417,200
8001	伊藤忠商事	1,322,700	812	1,074,032,400
8002	丸紅	1,450,000	517	749,650,000
8007	高島	29,000	204	5,916,000
8008	F & A アクアホールディングス	12,700	771	9,791,700
8012	長瀬産業	93,900	908	85,261,200
8014	蝶理	99,000	95	9,405,000
8015	豊田通商	184,700	1,449	267,630,300
8018	三共生興	28,300	287	8,122,100
8020	兼松	353,000	81	28,593,000
8025	ツカモトコーポレーション	30,000	98	2,940,000
8031	三井物産	1,431,200	1,272	1,820,486,400
8032	日本紙パルプ商事	86,000	283	24,338,000
8036	日立ハイテクノロジーズ	50,300	1,737	87,371,100
8037	カメイ	22,000	868	19,096,000
8038	東都水産	27,000	151	4,077,000
8043	スターゼン	55,000	246	13,530,000
8051	山善	63,600	582	37,015,200
8052	椿本興業	17,000	225	3,825,000
8053	住友商事	978,500	1,089	1,065,586,500
8057	内田洋行	38,000	230	8,740,000
8058	三菱商事	1,207,500	1,718	2,074,485,000
8059	第一実業	35,000	371	12,985,000
8060	キヤノンマーケティングジャパン	55,200	955	52,716,000
8061	西華産業	62,000	217	13,454,000
8065	佐藤商事	14,800	465	6,882,000
8068	菱洋エレクトロ	18,700	905	16,923,500
8070	東京産業	16,500	260	4,290,000
8074	ユアサ商事	169,000	123	20,787,000
8075	神鋼商事	42,000	201	8,442,000
8078	阪和興業	166,000	365	60,590,000
8081	カナデン	16,000	507	8,112,000
8084	菱電商事	24,000	485	11,640,000
8087	フルサト工業	9,700	690	6,693,000
8088	岩谷産業	184,000	264	48,576,000
8089	すてきナイスグループ	72,000	174	12,528,000
8090	昭光通商	59,000	122	7,198,000
8091	ニチモウ	24,000	173	4,152,000
8093	極東貿易	19,000	213	4,047,000
8095	イワキ	25,000	199	4,975,000
8097	三愛石油	40,000	360	14,400,000
8098	稲畑産業	44,200	479	21,171,800
8101	G S イクレオス	40,000	110	4,400,000
8103	明和産業	13,100	273	3,576,300
8129	東邦ホールディングス	53,100	1,226	65,100,600
8130	サンゲツ	29,300	2,100	61,530,000
8131	ミツウロコグループホールディングス	26,700	485	12,949,500
8132	シナネン	36,000	345	12,420,000
8133	伊藤忠エネクス	36,600	442	16,177,200
8136	サンリオ	41,800	3,330	139,194,000

(単位:円)

コード	銘柄 銘柄名	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
8137	サンワテクノス	8,000	819	6,552,000	
8140	リョーサン	27,000	1,682	45,414,000	
8141	新光商事	18,200	630	11,466,000	
8142	トーホー	34,000	316	10,744,000	
8150	三信電気	23,700	656	15,547,200	
8151	東陽テクニカ	24,000	835	20,040,000	
8153	モスフードサービス	21,700	1,551	33,656,700	
8154	加賀電子	18,000	870	15,660,000	
8158	ソーダニッカ	17,000	337	5,729,000	
8159	立花エレテック	10,000	703	7,030,000	
8283	P a l t a c	17,400	970	16,878,000	
8835	太平洋興発	57,000	82	4,674,000	
9305	ヤマタネ	83,000	123	10,209,000	
9763	丸紅建材リース	16,000	172	2,752,000	
9810	日鐵商事	37,000	217	8,029,000	
9830	トラスコ中山	20,700	1,437	29,745,900	
9832	オートボックスセブン	19,700	3,555	70,033,500	
9869	加藤産業	23,900	1,511	36,112,900	
9880	イノテック	9,900	542	5,365,800	
9882	イエローハット	15,600	1,179	18,392,400	
9883	富士エレクトロニクス	8,500	1,188	10,098,000	
9896	J Kホールディングス	13,700	385	5,274,500	
9902	日伝	6,900	2,184	15,069,600	
9930	北沢産業	13,500	183	2,470,500	
9932	杉本商事	9,000	727	6,543,000	
9934	因幡電機産業	19,500	2,239	43,660,500	
9938	住金物産	77,000	218	16,786,000	
9962	ミスミグループ本社	61,300	1,782	109,236,600	
9963	江守商事	3,300	900	2,970,000	
9972	アルテック	7,800	227	1,770,600	
9982	タキヒヨー	25,000	454	11,350,000	
9987	スズケン	63,700	2,223	141,605,100	
9991	ジェコス	11,400	345	3,933,000	
2651	ローソン	52,300	4,535	237,180,500	
2659	サンエー	5,600	3,065	17,164,000	
2660	キリン堂	7,000	505	3,535,000	
2662	ダイユーエイト	2,600	887	2,306,200	
2664	カワチ薬品	11,500	1,595	18,342,500	
2670	エービーシー・マート	23,600	2,685	63,366,000	
2674	ハードオフコーポレーション	7,900	546	4,313,400	
2678	アスクル	13,000	1,205	15,665,000	
2681	ゲオホールディングス	275	82,000	22,550,000	
2685	ポイント	14,000	3,110	43,540,000	
2687	シー・ヴィ・エス・ベイエリア	11,000	161	1,771,000	
2695	くらコーポレーション	8,600	1,043	8,969,800	
2698	キャンドウ	88	85,000	7,480,000	
2726	パル	4,850	3,105	15,059,250	
2730	エディオン	66,100	595	39,329,500	
2734	サーラコーポレーション	14,000	499	6,986,000	
2753	あみやき亭	25	200,000	5,000,000	
2764	ひらまつ	70	66,600	4,662,000	
2772	ゲンキー	1,200	1,632	1,958,400	
2792	ハニーズ	14,550	1,283	18,667,650	
3028	アルペン	10,600	1,423	15,083,800	
3048	ビックカメラ	629	44,000	27,676,000	
3050	D C Mホールディングス	85,800	589	50,536,200	
3064	M o n o t a R O	9,400	798	7,501,200	
3086	J . フロント リテイリング	392,000	371	145,432,000	
3087	ドトール・日レスホールディングス	26,400	1,057	27,904,800	
3088	マツモトキヨシホールディングス	30,700	1,579	48,475,300	
3097	物語コーポレーション	1,700	1,294	2,199,800	
3098	ココカラファイン	17,300	1,961	33,925,300	
3099	三越伊勢丹ホールディングス	329,400	857	282,295,800	
3148	クリエイトSDホールディングス	7,000	1,720	12,040,000	
3159	丸善C H Iホールディングス	5,500	209	1,149,500	
3313	ブックオフコーポレーション	9,100	695	6,324,500	

3333	あさひ	9,600	1,518	14,572,800	
3337	サークルKサンクス	36,000	1,290	46,440,000	
3341	日本調剤	2,090	2,628	5,492,520	
3349	コスモス薬品	8,300	3,705	30,751,500	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	693,600	2,124	1,473,206,400	
3391	ツルハホールディングス	14,800	4,080	60,384,000	
3395	サンマルクホールディングス	4,800	2,951	14,164,800	
3396	フェリシモ	4,800	1,083	5,198,400	
3397	トリドール	14,400	733	10,555,200	
3398	クスリのアオキ	2,400	1,444	3,465,600	
4350	メディカルシステムネットワーク	2,700	845	2,281,500	
4775	総合メディカル	4,000	2,521	10,084,000	
7416	はるやま商事	7,000	396	2,772,000	
7421	カップ・クリエイト	12,150	1,808	21,967,200	
7445	ライトオン	12,300	594	7,306,200	
7448	ジーンズメイト	5,500	190	1,045,000	
7453	良品計画	17,600	3,625	63,800,000	
7455	三城ホールディングス	20,500	616	12,628,000	
7494	コナカ	19,500	652	12,714,000	
7506	ハウス オブ ローゼ	1,800	1,265	2,277,000	
7508	G-7ホールディングス	5,000	403	2,015,000	
7512	イオン北海道	10,400	365	3,796,000	
7513	コジマ	22,300	511	11,395,300	
7516	コーナン商事	18,100	1,163	21,050,300	
7520	エコス	5,500	489	2,689,500	
7522	ワタミ	19,600	1,747	34,241,200	
7524	マルシェ	4,100	707	2,898,700	
7532	ドン・キホーテ	32,200	2,767	89,097,400	
7541	メガネトップ	23,700	834	19,765,800	
7545	西松屋チェーン	36,300	604	21,925,200	
7550	ゼンショーホールディングス	63,200	1,031	65,159,200	
7554	幸楽苑	10,200	1,222	12,464,400	
7561	ハークスレイ	4,100	547	2,242,700	
7581	サイゼリヤ	24,500	1,206	29,547,000	
7601	ポプラ	4,100	491	2,013,100	
7606	ユナイテッドアローズ	17,900	1,510	27,029,000	
7611	ハイデイ日高	7,300	1,364	9,957,200	
7615	京都きもの友禅	11,500	935	10,752,500	
7616	コロワイド	55,000	574	31,570,000	
7630	荳番屋	6,700	2,230	14,941,000	
7640	トップカルチャー	5,900	397	2,342,300	
7649	スギホールディングス	29,700	2,135	63,409,500	
8005	スクロール	21,300	300	6,390,000	
8028	ファミリーマート	50,900	2,992	152,292,800	
8160	木曽路	18,900	1,458	27,556,200	
8165	千趣会	29,800	513	15,287,400	
8166	タカキュー	13,000	159	2,067,000	
8168	ケーヨー	31,000	511	15,841,000	
8173	上新電機	36,000	855	30,780,000	
8174	日本瓦斯	15,800	1,228	19,402,400	
8175	ベスト電器	51,500	204	10,506,000	
8178	マルエツ	34,000	293	9,962,000	
8179	ロイヤルホールディングス	27,700	927	25,677,900	
8181	東天紅	12,000	186	2,232,000	
8182	いなげや	18,500	925	17,112,500	
8184	島忠	37,500	1,784	66,900,000	
8185	チヨダ	21,700	1,435	31,139,500	
8194	ライフコーポレーション	10,500	1,395	14,647,500	
8196	カスミ	33,900	516	17,492,400	
8200	リンガーハット	15,000	1,061	15,915,000	
8201	さが美	13,000	93	1,209,000	
8203	MrMax	16,700	337	5,627,900	
8207	テンアライド	12,500	275	3,437,500	
8214	AOKIホールディングス	14,600	1,271	18,556,600	
8217	オークワ	24,000	1,142	27,408,000	
8218	コメリ	22,700	2,288	51,937,600	
8219	青山商事	45,700	1,325	60,552,500	
8227	しまむら	19,200	7,950	152,640,000	
8229	CFSコーポレーション	11,000	392	4,312,000	

8233	高島屋	224,000	583	130,592,000	
8237	松屋	33,400	450	15,030,000	
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	86,000	610	52,460,000	
8245	丸栄	27,000	90	2,430,000	
8248	ニッセンホールディングス	33,100	369	12,213,900	
8251	パルコ	30,100	606	18,240,600	
8252	丸井グループ	216,100	608	131,388,800	
8255	原信ナルスホールディングス	9,200	1,337	12,300,400	
8260	井筒屋	89,000	49	4,361,000	
8263	ダイエー	102,300	271	27,723,300	
8266	イズミヤ	58,000	392	22,736,000	
8267	イオン	584,500	1,015	593,267,500	
8270	ユニー	124,300	712	88,501,600	
8273	イズミ	49,700	1,353	67,244,100	
8274	東武ストア	22,000	275	6,050,000	
8276	平和堂	30,500	994	30,317,000	
8278	フジ	18,400	1,838	33,819,200	
8279	ヤオコー	7,300	2,570	18,761,000	
8281	ゼビオ	20,000	1,832	36,640,000	
8282	ケーズホールディングス	41,400	2,657	109,999,800	
8289	O l y m p i c	10,900	783	8,534,700	
8291	日産東京販売ホールディングス	24,000	148	3,552,000	
9627	アインファーマシーズ	9,100	3,455	31,440,500	
9828	元気寿司	5,000	976	4,880,000	
9831	ヤマダ電機	80,660	4,910	396,040,600	
9842	アークランドサカモト	10,800	1,402	15,141,600	
9843	ニトリホールディングス	32,850	6,990	229,621,500	
9850	グルメ杵屋	12,000	440	5,280,000	
9854	愛眼	13,200	370	4,884,000	
9861	吉野家ホールディングス	449	106,800	47,953,200	
9887	松屋フーズ	8,000	1,628	13,024,000	
9900	サガミチェーン	20,000	531	10,620,000	
9945	ブレナス	18,500	1,318	24,383,000	
9946	ミニストップ	12,300	1,399	17,207,700	
9948	アークス	22,800	1,485	33,858,000	
9956	パロー	33,000	1,216	40,128,000	
9974	ベルク	8,200	1,202	9,856,400	
9979	大庄	7,700	1,023	7,877,100	
9983	ファーストリテイリング	38,700	14,970	579,339,000	
9989	サンドラッグ	31,500	2,274	71,631,000	
9993	ヤマザワ	4,300	1,402	6,028,600	
9994	やまや	2,600	1,187	3,086,200	
9997	ベルーナ	20,700	602	12,461,400	
8303	新生銀行	1,291,000	84	108,444,000	
8304	あおぞら銀行	516,000	212	109,392,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	12,551,300	356	4,468,262,800	
8308	りそなホールディングス	1,443,000	346	499,278,000	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	3,250,000	245	796,250,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	1,253,900	2,409	3,020,645,100	
8324	第四銀行	216,000	254	54,864,000	
8325	北越銀行	172,000	159	27,348,000	
8327	西日本シティ銀行	582,000	228	132,696,000	
8328	札幌北洋ホールディングス	250,000	286	71,500,000	
8331	千葉銀行	654,000	478	312,612,000	
8332	横浜銀行	1,065,000	361	384,465,000	
8333	常陽銀行	639,000	341	217,899,000	
8334	群馬銀行	379,000	419	158,801,000	
8336	武蔵野銀行	26,700	2,624	70,060,800	
8337	千葉興業銀行	31,800	416	13,228,800	
8338	筑波銀行	68,900	276	19,016,400	
8339	東京都民銀行	31,300	993	31,080,900	
8341	七十七銀行	260,000	356	92,560,000	
8342	青森銀行	124,000	240	29,760,000	
8343	秋田銀行	114,000	234	26,676,000	
8344	山形銀行	101,000	391	39,491,000	
8345	岩手銀行	11,200	3,540	39,648,000	
8346	東邦銀行	140,000	246	34,440,000	
8349	東北銀行	89,000	135	12,015,000	
8350	みちのく銀行	83,000	153	12,699,000	

8354	ふくおかフィナンシャルグループ	673,000	326	219,398,000	
8355	静岡銀行	500,000	790	395,000,000	
8356	十六銀行	208,000	261	54,288,000	
8358	スルガ銀行	162,000	687	111,294,000	
8359	八十二銀行	306,000	453	138,618,000	
8360	山梨中央銀行	101,000	344	34,744,000	
8361	大垣共立銀行	221,000	258	57,018,000	
8362	福井銀行	143,000	244	34,892,000	
8363	北國銀行	198,000	302	59,796,000	
8364	清水銀行	5,600	3,160	17,696,000	
8366	滋賀銀行	156,000	522	81,432,000	
8367	南都銀行	154,000	424	65,296,000	
8368	百五銀行	150,000	331	49,650,000	
8369	京都銀行	297,000	676	200,772,000	
8374	三重銀行	69,000	182	12,558,000	
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	1,161,000	157	182,277,000	
8379	広島銀行	489,000	362	177,018,000	
8381	山陰合同銀行	98,000	589	57,722,000	
8382	中国銀行	136,000	1,055	143,480,000	
8383	鳥取銀行	53,000	151	8,003,000	
8385	伊予銀行	177,000	750	132,750,000	
8386	百十四銀行	182,000	370	67,340,000	
8387	四国銀行	120,000	307	36,840,000	
8388	阿波銀行	146,000	525	76,650,000	
8390	鹿児島銀行	107,000	533	57,031,000	
8392	大分銀行	107,000	228	24,396,000	
8393	宮崎銀行	110,000	199	21,890,000	
8394	肥後銀行	129,000	457	58,953,000	
8395	佐賀銀行	101,000	197	19,897,000	
8396	十八銀行	106,000	226	23,956,000	
8397	沖縄銀行	12,600	3,340	42,084,000	
8399	琉球銀行	34,900	995	34,725,500	
8409	八千代銀行	8,700	1,867	16,242,900	
8411	みずほフィナンシャルグループ	21,297,800	117	2,491,842,600	
8415	紀陽ホールディングス	661,000	120	79,320,000	
8418	山口フィナンシャルグループ	165,000	741	122,265,000	
8521	長野銀行	54,000	165	8,910,000	
8522	名古屋銀行	150,000	267	40,050,000	
8527	愛知銀行	6,000	4,690	28,140,000	
8529	第三銀行	94,000	179	16,826,000	
8530	中京銀行	68,000	210	14,280,000	
8536	東日本銀行	79,000	171	13,509,000	
8537	大光銀行	59,000	257	15,163,000	
8541	愛媛銀行	104,000	227	23,608,000	
8542	トマト銀行	64,000	136	8,704,000	
8543	みなと銀行	150,000	150	22,500,000	
8544	京葉銀行	137,000	380	52,060,000	
8545	関西アーバン銀行	231,000	129	29,799,000	
8550	栃木銀行	83,000	282	23,406,000	
8551	北日本銀行	5,200	2,018	10,493,600	
8558	東和銀行	167,000	91	15,197,000	
8562	福島銀行	193,000	51	9,843,000	
8563	大東銀行	105,000	70	7,350,000	
8600	トモニホールディングス	127,600	352	44,915,200	
8713	フィデアホールディングス	95,400	219	20,892,600	
8714	池田泉州ホールディングス	684,100	118	80,723,800	
8473	SBIホールディングス	17,507	6,000	105,042,000	
8518	日本アジア投資	118,000	59	6,962,000	
8595	ジャフコ	20,200	1,478	29,855,600	
8601	大和証券グループ本社	1,642,000	280	459,760,000	
8604	野村ホールディングス	3,589,000	280	1,004,920,000	
8609	岡三証券グループ	141,000	257	36,237,000	
8613	丸三証券	55,900	275	15,372,500	
8614	東洋証券	62,000	116	7,192,000	
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	190,000	235	44,650,000	
8617	光世証券	39,000	63	2,457,000	
8622	水戸証券	48,000	105	5,040,000	
8624	いちよし証券	37,100	395	14,654,500	
8628	松井証券	98,300	416	40,892,800	

8692	だいこう証券ビジネス	9,200	273	2,511,600	
8698	マネックスグループ	1,334	12,330	16,448,220	
8703	カブドットコム証券	67,600	245	16,562,000	
8706	極東証券	22,300	502	11,194,600	
8707	岩井コスモホールディングス	15,800	277	4,376,600	
8742	小林洋行	4,600	191	878,600	
8630	N K S Jホールディングス	346,600	1,529	529,951,400	
8725	M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	495,500	1,540	763,070,000	
8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	158,800	1,263	200,564,400	
8750	第一生命保険	8,868	82,100	728,062,800	
8766	東京海上ホールディングス	629,500	1,889	1,189,125,500	
8795	T & Dホールディングス	604,300	801	484,044,300	
8253	クレディセゾン	135,400	1,484	200,933,600	
8423	フィデック	94	8,510	799,940	
8424	芙蓉総合リース	15,800	2,847	44,982,600	
8425	興銀リース	23,100	1,892	43,705,200	
8439	東京センチュリーリース	44,500	1,569	69,820,500	
8511	日本証券金融	68,400	394	26,949,600	
8512	大阪証券金融	19,100	173	3,304,300	
8515	アイフル	150,800	114	17,191,200	
8519	ポケットカード	16,400	265	4,346,000	
8566	リコーリース	11,400	1,853	21,124,200	
8570	イオンクレジットサービス	73,700	1,139	83,944,300	
8572	アコム	33,310	1,390	46,300,900	
8574	プロミス	14,450	847	12,239,150	
8584	ジャックス	101,000	251	25,351,000	
8585	オリエントコーポレーション	240,000	77	18,480,000	
8586	日立キャピタル	32,600	1,085	35,371,000	
8591	オリックス	86,260	7,170	618,484,200	
8593	三菱UFJリース	42,050	3,260	137,083,000	
8772	アサックス	22	84,900	1,867,800	
8793	NECキャピタルソリューション	5,600	1,240	6,944,000	
2353	日本駐車場開発	1,781	3,560	6,340,360	
3003	昭栄	30,300	342	10,362,600	
3225	東京建物不動産販売	6,600	217	1,432,200	
3231	野村不動産ホールディングス	79,500	1,196	95,082,000	
3258	常和ホールディングス	2,900	1,339	3,883,100	
3265	ヒューリック	53,700	933	50,102,100	
3521	エコナックホールディングス	50,000	34	1,700,000	
4666	パーク24	85,500	948	81,054,000	
8801	三井不動産	736,000	1,283	944,288,000	
8802	三菱地所	1,160,000	1,272	1,475,520,000	
8803	平和不動産	156,500	178	27,857,000	
8804	東京建物	316,000	275	86,900,000	
8806	ダイビル	48,800	522	25,473,600	
8809	サンケイビル	28,700	737	21,151,900	
8815	東急不動産	334,000	326	108,884,000	
8818	京阪神ビルディング	19,600	359	7,036,400	
8830	住友不動産	397,000	1,489	591,133,000	
8833	東宝不動産	17,300	442	7,646,600	
8840	大京	255,000	171	43,605,000	
8841	テーオーシー	64,300	391	25,141,300	
8842	東京楽天地	27,000	292	7,884,000	
8848	レオパレス21	128,100	171	21,905,100	
8860	フジ住宅	21,000	398	8,358,000	
8864	空港施設	17,000	324	5,508,000	
8869	明和地所	8,200	354	2,902,800	
8870	住友不動産販売	5,970	3,250	19,402,500	
8871	ゴールドクレスト	14,930	1,409	21,036,370	
8875	東栄住宅	11,300	864	9,763,200	
8876	リロ・ホールディング	5,300	1,997	10,584,100	
8877	日本エスリード	6,500	700	4,550,000	
8879	東急リパブル	15,100	632	9,543,200	
8880	飯田産業	18,800	634	11,919,200	
8881	日神不動産	9,700	454	4,403,800	
8895	アーネストワン	27,400	852	23,344,800	
8897	タカラレーベン	19,000	467	8,873,000	
8904	サンヨーハウジング名古屋	69	77,900	5,375,100	
8905	イオンモール	75,600	1,715	129,654,000	

8907	フージャースコーポレーション	255	37,250	9,498,750
8915	タクトホーム	87	66,500	5,785,500
8918	ランド	25,300	14	354,200
8923	トーセイ	161	19,990	3,218,390
8933	エヌ・ティ・ティ都市開発	1,030	57,500	59,225,000
8934	サンフロンティア不動産	131	9,340	1,223,540
8944	ランドビジネス	115	14,840	1,706,600
9706	日本空港ビルディング	52,900	1,080	57,132,000
1954	日本工営	59,000	285	16,815,000
2120	ネクスト	7,000	307	2,149,000
2127	日本M&Aセンター	35	387,000	13,545,000
2128	ノバレーゼ	34	50,600	1,720,400
2131	アコーディア・ゴルフ	714	57,300	40,912,200
2168	パソナグループ	173	72,800	12,594,400
2170	リンクアンドモチベーション	34	39,800	1,353,200
2181	テンブホールディングス	23,900	749	17,901,100
2301	学情	5,800	256	1,484,800
2305	スタジオアリス	8,100	1,106	8,958,600
2309	シミックホールディングス	5,700	1,161	6,617,700
2322	N E Cフィールドینگ	14,300	1,013	14,485,900
2331	総合警備保障	63,900	864	55,209,600
2371	カカコム	27,200	2,345	63,784,000
2372	アイロムホールディングス	371	2,725	1,010,975
2378	ルネサンス	7,700	419	3,226,300
2395	新日本科学	10,600	196	2,077,600
2413	エムスリー	138	321,000	44,298,000
2418	ベストプライダル	38	71,700	2,724,600
2432	ディー・エヌ・エー	78,700	1,903	149,766,100
2433	博報堂D Yホールディングス	22,290	4,620	102,979,800
2440	ぐるなび	12,100	851	10,297,100
2450	一休	126	33,300	4,195,800
2453	ジャパンベストレスキューシステム	26	74,600	1,939,600
2462	ジェイコムホールディングス	3,000	714	2,142,000
2466	P G Mホールディングス	211	50,600	10,676,600
4282	イービーエス	94	143,000	13,442,000
4301	アミューズ	4,900	1,004	4,919,600
4310	ドリームインキュベータ	55	58,900	3,239,500
4319	T A C	9,500	170	1,615,000
4321	ケネディクス	1,912	11,020	21,070,240
4324	電通	159,600	2,493	397,882,800
4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	749	5,480	4,104,520
4337	びあ	5,200	836	4,347,200
4343	イオンファンタジー	5,700	1,246	7,102,200
4346	ネクシィーズ	718	1,895	1,360,610
4544	みらかホールディングス	45,800	2,813	128,835,400
4641	アルプス技研	7,600	629	4,780,400
4651	サニックス	25,500	235	5,992,500
4653	ダイオーズ	3,000	490	1,470,000
4658	日本空調サービス	4,300	729	3,134,700
4661	オリエンタルランド	47,400	7,980	378,252,000
4665	ダスキン	52,700	1,498	78,944,600
4668	明光ネットワークジャパン	16,000	691	11,056,000
4671	ファルコS Dホールディングス	9,400	910	8,554,000
4678	秀英予備校	3,100	301	933,100
4679	田谷	2,700	681	1,838,700
4680	ラウンドワン	54,800	466	25,536,800
4681	リゾートトラスト	27,000	1,180	31,860,000
4694	ビー・エム・エル	11,500	1,826	20,999,000
4696	ワタベウェディング	5,200	718	3,733,600
4708	もしもしホットライン	29,000	701	20,329,000
4711	東急コミュニティー	4,500	2,467	11,101,500
4714	リソー教育	1,780	5,000	8,900,000
4724	ウェアハウス	2,900	256	742,400
4732	ユー・エス・エス	22,870	7,340	167,865,800
4745	東京個別指導学院	8,200	172	1,410,400
4767	テー・オー・ダブリュー	5,200	471	2,449,200
4801	セントラルスポーツ	5,400	1,013	5,470,200
4848	フルキャストホールディングス	142	16,140	2,291,880
5261	リゾートソリューション	15,000	152	2,280,000

9603	エイチ・アイ・エス	17,900	2,170	38,843,000	
9616	共立メンテナンス	8,700	1,422	12,371,400	
9619	イチネンホールディングス	18,300	410	7,503,000	
9621	建設技術研究所	9,500	517	4,911,500	
9628	燦ホールディングス	3,800	1,419	5,392,200	
9632	スバル興業	12,000	272	3,264,000	
9633	東京テアトル	67,000	111	7,437,000	
9667	ホリプロ	5,900	1,048	6,183,200	
9671	よみうりランド	35,000	248	8,680,000	
9672	東京都競馬	135,000	110	14,850,000	
9675	常磐興産	54,000	91	4,914,000	
9678	カナモト	22,000	712	15,664,000	
9681	東京ドーム	140,000	200	28,000,000	
9704	東海観光	70,000	22	1,540,000	
9715	トランス・コスモス	22,900	971	22,235,900	
9716	乃村工藝社	34,000	262	8,908,000	
9722	藤田観光	45,000	260	11,700,000	
9726	近畿日本ツーリスト	55,000	92	5,060,000	
9728	日本管財	6,400	1,454	9,305,600	
9729	トーカイ	7,000	1,703	11,921,000	
9731	白洋舎	18,000	218	3,924,000	
9735	セコム	170,400	3,560	606,624,000	
9740	セントラル警備保障	7,800	812	6,333,600	
9743	丹青社	17,000	234	3,978,000	
9744	メイテック	27,500	1,468	40,370,000	
9747	アサツー ディ・ケイ	30,600	2,128	65,116,800	
9755	応用地質	18,400	953	17,535,200	
9757	船井総合研究所	18,000	527	9,486,000	
9760	進学会	8,500	307	2,609,500	
9783	ベネッセホールディングス	54,300	3,515	190,864,500	
9787	イオンディライト	19,800	1,508	29,858,400	
9788	ナック	4,400	1,513	6,657,200	
9792	ニチイ学館	34,300	894	30,664,200	
9793	ダイセキ	28,200	1,347	37,985,400	
	合計	257,998,928		174,976,069,945	

(注)備考欄の数値は、差入委託証拠金代用有価証券としての担保差入れ株式数です。

[前へ](#) [次へ](#)

## 貸付有価証券一覧表

(株式)

コード	銘柄	株式数	
	銘柄名		
1301	極洋	52,000	(52,000)
1332	日本水産	141,300	(141,300)
1334	マルハニチロホールディングス	225,000	(225,000)
1352	ハウスイ	9,000	(9,000)
1379	ホクト	11,300	(11,300)
1414	ショーボンドホールディングス	10,900	(10,900)
1514	住石ホールディングス	34,400	(34,400)
1515	日鉄鉱業	19,000	(19,000)
1606	日本海洋掘削	2,800	(2,800)
1661	関東天然瓦斯開発	2,000	(2,000)
1720	東急建設	4,530	(4,530)
1762	高松コンストラクシヨングループ	300	(300)
1801	大成建設	581,000	(581,000)
1803	清水建設	344,000	(344,000)
1808	長谷工コーポレーション	652,000	(652,000)
1812	鹿島建設	513,000	(513,000)
1813	不動テトラ	55,200	(55,200)
1814	大末建設	30,000	(30,000)
1815	鉄建建設	62,000	(62,000)
1816	安藤建設	41,000	(41,000)
1822	大豊建設	33,000	(33,000)
1824	前田建設工業	61,000	(61,000)
1826	佐田建設	46,000	(46,000)
1827	ナカノフドー建設	7,500	(7,500)
1833	奥村組	80,000	(80,000)
1834	大和小田急建設	3,000	(3,000)
1847	イチケン	12,000	(12,000)
1852	浅沼組	29,000	(29,000)
1860	戸田建設	121,000	(121,000)
1865	青木あすなる建設	5,500	(5,500)
1866	北野建設	15,000	(15,000)
1867	植木組	15,000	(15,000)
1870	矢作建設工業	14,500	(14,500)
1871	ピーエス三菱	8,000	(8,000)
1878	大東建託	47,000	(47,000)
1883	前田道路	14,000	(14,000)
1884	日本道路	40,000	(40,000)
1885	東亜建設工業	108,000	(108,000)
1890	東洋建設	18,000	(18,000)
1893	五洋建設	20,000	(20,000)
1896	大林道路	14,000	(14,000)
1899	福田組	15,000	(15,000)
1914	日本基礎技術	15,900	(15,900)
1916	日成ビルド工業	36,000	(36,000)
1921	巴コーポレーション	7,000	(7,000)
1925	大和ハウス工業	265,000	(265,000)
1930	北陸電気工事	6,000	(6,000)
1937	西部電気工業	1,000	(1,000)
1939	四電工	3,000	(3,000)
1946	トーエネック	14,000	(14,000)
1950	日本電設工業	25,000	(25,000)
1952	新日本空調	8,500	(8,500)
1954	日本工営	38,000	(38,000)
1956	日本電話施設	16,000	(16,000)
1959	九電工	19,000	(19,000)
1964	中外炉工業	32,000	(32,000)
1967	ヤマト	12,000	(12,000)
1969	高砂熱学工業	35,000	(35,000)
1972	三晃金属工業	8,000	(8,000)
1975	朝日工業社	3,000	(3,000)
1978	アタカ大機	3,000	(3,000)
1979	大気社	12,300	(12,300)
1980	ダイダン	17,000	(17,000)
1982	日比谷総合設備	1,400	(1,400)
2003	日東富士製粉	8,000	(8,000)

2004	昭和産業	5,000	(5,000)
2009	鳥越製粉	10,700	(10,700)
2052	協同飼料	24,000	(24,000)
2107	東洋精糖	7,000	(7,000)
2108	日本甜菜製糖	37,000	(37,000)
2127	日本M&Aセンター	20	(20)
2128	ノバレーゼ	13	(13)
2131	アコーディア・ゴルフ	124	(124)
2168	パソナグループ	67	(67)
2170	リンクアンドモチベーション	15	(15)
2181	テンプホールディングス	8,300	(8,300)
2201	森永製菓	105,000	(105,000)
2204	中村屋	29,000	(29,000)
2206	江崎グリコ	44,000	(44,000)
2207	名糖産業	5,000	(5,000)
2211	不二家	20,000	(20,000)
2215	第一屋製パン	17,000	(17,000)
2217	モロゾフ	7,000	(7,000)
2267	ヤクルト本社	65,800	(65,800)
2269	明治ホールディングス	34,700	(34,700)
2270	雪印メグミルク	26,900	(26,900)
2284	伊藤ハム	62,000	(62,000)
2286	林兼産業	23,000	(23,000)
2301	学情	3,300	(3,300)
2317	システナ	115	(115)
2359	コア	4,000	(4,000)
2371	カカクコム	17,600	(17,600)
2378	ルネサンス	4,100	(4,100)
2395	新日本科学	2,100	(2,100)
2413	エムスリー	106	(106)
2418	ベストブライダル	20	(20)
2453	ジャパンベストレスキューシステム	4	(4)
2462	ジェイコムホールディングス	2,200	(2,200)
2501	サッポロホールディングス	42,000	(42,000)
2502	アサヒグループホールディングス	56,000	(56,000)
2531	宝ホールディングス	104,000	(104,000)
2540	養命酒製造	9,000	(9,000)
2572	三国コカ・コーラボトリング	1,700	(1,700)
2593	伊藤園	34,100	(34,100)
2594	キーコーヒー	9,900	(9,900)
2597	ユニカフェ	2,300	(2,300)
2651	ローソン	33,800	(33,800)
2657	インターニックス	4,000	(4,000)
2659	サンエー	700	(700)
2662	ダイユーエイト	1,000	(1,000)
2670	エービーシー・マート	13,700	(13,700)
2676	高千穂交易	3,600	(3,600)
2678	アスクル	9,200	(9,200)
2681	ゲオホールディングス	111	(111)
2687	シー・ヴィ・エス・ベイエリア	4,000	(4,000)
2695	くらコーポレーション	1,300	(1,300)
2698	キャンドウ	26	(26)
2715	エレマテック	7,700	(7,700)
2734	サーラコーポレーション	7,500	(7,500)
2737	トーマンデバイス	1,400	(1,400)
2753	あみやき亭	19	(19)
2760	東京エレクトロン デバイス	4	(4)
2764	ひらまつ	41	(41)
2768	双日	670,700	(670,700)
2801	キッコーマン	107,000	(107,000)
2802	味の素	85,000	(85,000)
2809	キュービー	61,400	(61,400)
2810	ハウス食品	18,700	(18,700)
2811	カゴメ	47,400	(47,400)
2812	焼津水産化学工業	5,300	(5,300)
2871	ニチレイ	4,000	(4,000)
2897	日清食品ホールディングス	42,800	(42,800)
2899	永谷園	11,000	(11,000)
2908	フジッコ	6,000	(6,000)

2910	ロック・フィールド	5,700	(5,700)
2922	なとり	5,300	(5,300)
3001	片倉工業	13,000	(13,000)
3003	昭栄	11,000	(11,000)
3004	神栄	14,000	(14,000)
3022	山下医科器械	800	(800)
3048	ビックカメラ	240	(240)
3050	D C Mホールディングス	54,200	(54,200)
3088	マツモトキヨシホールディングス	20,000	(20,000)
3099	三越伊勢丹ホールディングス	197,700	(197,700)
3103	ユニチカ	202,000	(202,000)
3104	富士紡ホールディングス	39,000	(39,000)
3107	ダイワボウホールディングス	94,000	(94,000)
3109	シキボウ	74,000	(74,000)
3110	日東紡績	75,000	(75,000)
3116	トヨタ紡織	38,300	(38,300)
3148	クリエイティブS Dホールディングス	4,100	(4,100)
3151	パイタルケーエスケー・ホールディングス	17,000	(17,000)
3159	丸善C H Iホールディングス	2,000	(2,000)
3167	T O K A Iホールディングス	36,500	(36,500)
3201	日本毛織	34,000	(34,000)
3202	大東紡織	17,000	(17,000)
3204	トーア紡コーポレーション	40,000	(40,000)
3205	ダイドーリミテッド	15,000	(15,000)
3225	東京建物不動産販売	3,600	(3,600)
3258	常和ホールディングス	1,700	(1,700)
3265	ヒューリック	19,900	(19,900)
3302	帝国繊維	12,000	(12,000)
3313	ブックオフコーポレーション	500	(500)
3315	日本コークス工業	84,500	(84,500)
3321	ミタチ産業	2,200	(2,200)
3333	あさひ	5,600	(5,600)
3341	日本調剤	80	(80)
3349	コスモス薬品	4,900	(4,900)
3371	ソフトクリエイティブ	600	(600)
3397	トリドール	100	(100)
3401	帝人	299,000	(299,000)
3402	東レ	762,000	(762,000)
3405	クラレ	15,200	(15,200)
3407	旭化成	16,000	(16,000)
3408	サカイオーベックス	21,000	(21,000)
3421	稲葉製作所	5,500	(5,500)
3432	三協・立山ホールディングス	96,000	(96,000)
3436	S U M C O	62,600	(62,600)
3443	川田テクノロジーズ	2,000	(2,000)
3501	住江織物	29,000	(29,000)
3513	イチカワ	5,000	(5,000)
3521	エコナックホールディングス	25,000	(25,000)
3524	日東製網	1,000	(1,000)
3551	ダイニック	22,000	(22,000)
3569	セーレン	17,900	(17,900)
3577	東海染工	5,000	(5,000)
3591	ワコールホールディングス	68,000	(68,000)
3607	クラウドディア	1,200	(1,200)
3632	グリー	10,000	(10,000)
3636	三菱総合研究所	1,600	(1,600)
3715	ダウンゴ	61	(61)
3724	ベリサーブ	1	(1)
3738	ティーガイア	54	(54)
3769	G M Oペイメントゲートウェイ	23	(23)
3774	インターネットイニシアティブ	64	(64)
3817	S R Aホールディングス	4,000	(4,000)
3820	J B I Sホールディングス	9,600	(9,600)
3861	王子製紙	427,000	(427,000)
3864	三菱製紙	132,000	(132,000)
3878	巴川製紙所	15,000	(15,000)
3946	トーモク	23,000	(23,000)
3950	ザ・バック	7,400	(7,400)
4003	コープケミカル	10,000	(10,000)

4005	住友化学	844,000	(844,000)
4007	日本化成	2,000	(2,000)
4021	日産化学工業	77,800	(77,800)
4022	ラサ工業	47,000	(47,000)
4023	クレハ	74,000	(74,000)
4031	片倉チッカリン	7,000	(7,000)
4042	東ソー	306,000	(306,000)
4044	セントラル硝子	12,000	(12,000)
4046	ダイソー	36,000	(36,000)
4047	関東電化工業	26,000	(26,000)
4062	イビデン	57,600	(57,600)
4063	信越化学工業	190,900	(190,900)
4064	日本カーバイド工業	32,000	(32,000)
4088	エア・ウォーター	76,000	(76,000)
4091	太陽日酸	178,000	(178,000)
4092	日本化学工業	5,000	(5,000)
4095	日本パーカライジング	27,000	(27,000)
4098	チタン工業	10,000	(10,000)
4100	戸田工業	13,000	(13,000)
4109	ステラ ケミファ	5,400	(5,400)
4183	三井化学	434,000	(434,000)
4185	J S R	104,300	(104,300)
4202	ダイセル	133,000	(133,000)
4203	住友ベークライト	116,000	(116,000)
4208	宇部興産	267,000	(267,000)
4212	積水樹脂	5,000	(5,000)
4215	タキロン	3,000	(3,000)
4216	旭有機材工業	13,000	(13,000)
4217	日立化成工業	49,600	(49,600)
4228	積水化成成品工業	30,000	(30,000)
4229	群栄化学工業	28,000	(28,000)
4231	タイガースポリマー	200	(200)
4271	日本カーリット	9,200	(9,200)
4282	イーピーエス	62	(62)
4283	パナソニック電工インフォメーションシステムズ	2,300	(2,300)
4295	フェイス	326	(326)
4319	T A C	5,300	(5,300)
4321	ケネディクス	1,172	(1,172)
4324	電通	113,400	(113,400)
4326	インテージ	2,900	(2,900)
4337	ぴあ	2,300	(2,300)
4340	シンプレクス・ホールディングス	161	(161)
4346	ネクシィーズ	140	(140)
4362	日本精化	8,700	(8,700)
4404	ミヨシ油脂	8,000	(8,000)
4410	ハリマ化成	6,500	(6,500)
4471	三洋化成工業	36,000	(36,000)
4506	大日本住友製薬	81,200	(81,200)
4507	塩野義製薬	167,000	(167,000)
4512	わかもと製薬	13,000	(13,000)
4523	エーザイ	141,100	(141,100)
4528	小野薬品工業	39,100	(39,100)
4530	久光製薬	35,600	(35,600)
4531	有機合成薬品工業	9,000	(9,000)
4534	持田製薬	10,000	(10,000)
4540	ツムラ	33,700	(33,700)
4541	日医工	7,900	(7,900)
4543	テルモ	76,800	(76,800)
4549	栄研化学	7,900	(7,900)
4550	日水製薬	2,000	(2,000)
4553	東和薬品	5,200	(5,200)
4555	沢井製薬	3,600	(3,600)
4559	ゼリア新薬工業	10,000	(10,000)
4578	大塚ホールディングス	176,800	(176,800)
4581	大正製薬ホールディングス	27,000	(27,000)
4611	大日本塗料	65,000	(65,000)
4612	日本ペイント	126,000	(126,000)
4613	関西ペイント	130,000	(130,000)
4617	中国塗料	21,000	(21,000)

4619	日本特殊塗料	7,400	(7,400)
4626	太陽ホールディングス	8,400	(8,400)
4631	D I C	71,000	(71,000)
4641	アルプス技研	2,500	(2,500)
4651	サニックス	3,600	(3,600)
4653	ダイオーズ	2,000	(2,000)
4658	日本空調サービス	2,600	(2,600)
4661	オリエンタルランド	30,900	(30,900)
4665	ダスキン	6,800	(6,800)
4666	パーク24	33,600	(33,600)
4671	ファルコSDホールディングス	6,000	(6,000)
4674	クレスコ	2,400	(2,400)
4676	フジ・メディア・ホールディングス	778	(778)
4678	秀英予備校	1,100	(1,100)
4679	田谷	1,400	(1,400)
4687	ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	1,400	(1,400)
4689	ヤフー	7,060	(7,060)
4694	ビー・エム・エル	1,000	(1,000)
4696	ワタベウエディング	3,200	(3,200)
4704	トレンドマイクロ	52,500	(52,500)
4711	東急コミュニティー	2,900	(2,900)
4714	リソー教育	1,173	(1,173)
4716	日本オラクル	17,300	(17,300)
4724	ウェアハウス	100	(100)
4728	トーセ	2,200	(2,200)
4733	オービックビジネスコンサルタント	150	(150)
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	14,000	(14,000)
4745	東京個別指導学院	4,400	(4,400)
4746	東計電算	1,700	(1,700)
4762	エクスネット	5	(5)
4767	テー・オー・ダブリュー	2,700	(2,700)
4779	ソフトブレーン	25	(25)
4799	アグレックス	2,100	(2,100)
4801	セントラルスポーツ	2,400	(2,400)
4825	ウェザーニューズ	200	(200)
4901	富士フイルムホールディングス	279,800	(279,800)
4902	コニカミノルタホールディングス	289,000	(289,000)
4911	資生堂	195,000	(195,000)
4912	ライオン	132,000	(132,000)
4914	高砂香料工業	8,000	(8,000)
4921	ファンケル	25,700	(25,700)
4922	コーセー	18,500	(18,500)
4924	ドクターシーラボ	77	(77)
4951	エステー	6,100	(6,100)
4958	長谷川香料	14,500	(14,500)
4968	荒川化学工業	700	(700)
4975	荏原ユージライト	1,400	(1,400)
4989	イハラケミカル工業	21,000	(21,000)
4994	大成ラミック	1,100	(1,100)
4996	クミアイ化学工業	29,000	(29,000)
5002	昭和シェル石油	93,400	(93,400)
5007	コスモ石油	317,000	(317,000)
5009	富士興産	42,000	(42,000)
5011	ニチレキ	11,000	(11,000)
5012	東燃ゼネラル石油	150,000	(150,000)
5015	ビービー・カストロール	4,000	(4,000)
5017	AOCホールディングス	19,700	(19,700)
5018	MORESCO	2,200	(2,200)
5105	東洋ゴム工業	63,000	(63,000)
5121	藤倉ゴム工業	6,000	(6,000)
5122	オカモト	48,000	(48,000)
5142	アキレス	42,000	(42,000)
5187	クリエートメディック	3,200	(3,200)
5192	三ツ星ベルト	18,000	(18,000)
5195	バンドー化学	4,000	(4,000)
5201	旭硝子	565,000	(565,000)
5210	日本山村硝子	32,000	(32,000)
5214	日本電気硝子	196,000	(196,000)
5232	住友大阪セメント	127,000	(127,000)

5233	太平洋セメント	589,000	(589,000)
5261	リゾートソリューション	10,000	(10,000)
5262	日本ヒューム	4,000	(4,000)
5310	東洋炭素	4,900	(4,900)
5332	TOTO	177,000	(177,000)
5334	日本特殊陶業	101,000	(101,000)
5344	MARUWA	3,400	(3,400)
5352	黒崎播磨	28,000	(28,000)
5363	東京窯業	4,000	(4,000)
5367	ニッカトー	1,900	(1,900)
5384	フジインコーポレーテッド	10,100	(10,100)
5391	エーアンドエーマテリアル	20,000	(20,000)
5393	ニチアス	52,000	(52,000)
5401	新日本製鐵	3,007,000	(3,007,000)
5405	住友金属工業	1,492,000	(1,492,000)
5407	日新製鋼	440,000	(440,000)
5408	中山製鋼所	62,000	(62,000)
5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	292,300	(292,300)
5423	東京製鐵	51,700	(51,700)
5440	共英製鋼	10,900	(10,900)
5457	住友鋼管	6,500	(6,500)
5471	大同特殊鋼	177,000	(177,000)
5476	日本高周波鋼業	8,000	(8,000)
5479	日本金属工業	79,000	(79,000)
5480	日本冶金工業	75,500	(75,500)
5486	日立金属	75,000	(75,000)
5541	大平洋金属	74,000	(74,000)
5602	栗本鐵工所	53,000	(53,000)
5612	日本鑄鉄管	11,000	(11,000)
5631	日本製鋼所	164,000	(164,000)
5659	日本精線	1,000	(1,000)
5702	大紀アルミニウム工業所	18,000	(18,000)
5707	東邦亜鉛	60,000	(60,000)
5711	三菱マテリアル	95,000	(95,000)
5713	住友金属鉱山	23,000	(23,000)
5714	DOWAホールディングス	122,000	(122,000)
5715	古河機械金属	193,000	(193,000)
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	11,300	(11,300)
5727	東邦チタニウム	11,500	(11,500)
5738	住友軽金属工業	247,000	(247,000)
5741	古河スカイ	15,000	(15,000)
5801	古河電気工業	360,000	(360,000)
5805	昭和電線ホールディングス	137,000	(137,000)
5807	東京特殊電線	12,000	(12,000)
5809	タツタ電線	7,000	(7,000)
5812	日立電線	89,000	(89,000)
5819	カナレ電気	1,300	(1,300)
5821	平河ヒューテック	100	(100)
5857	アサヒホールディングス	5,600	(5,600)
5912	日本橋梁	1,950	(1,950)
5915	駒井ハルテック	23,000	(23,000)
5917	サクラダ	89,000	(89,000)
5923	高田機工	9,000	(9,000)
5929	三和ホールディングス	39,000	(39,000)
5936	東洋シャッター	2,900	(2,900)
5938	住生活グループ	27,500	(27,500)
5942	日本フィルコン	6,300	(6,300)
5946	長府製作所	3,100	(3,100)
5947	リンナイ	16,400	(16,400)
5951	ダイニチ工業	4,100	(4,100)
5957	日東精工	1,000	(1,000)
5958	三洋工業	13,000	(13,000)
5959	岡部	16,000	(16,000)
5963	日立ツール	600	(600)
5981	東京製網	43,000	(43,000)
5988	パイオラックス	700	(700)
5992	中央発條	11,000	(11,000)
5998	アドバネクス	21,000	(21,000)
6005	三浦工業	17,000	(17,000)

6101	ツガミ	23,000	(23,000)
6103	オークマ	69,000	(69,000)
6118	アイダエンジニアリング	2,400	(2,400)
6135	牧野フライス製作所	52,000	(52,000)
6136	オーエスジー	47,100	(47,100)
6138	ダイジェット工業	2,000	(2,000)
6140	旭ダイヤモンド工業	28,000	(28,000)
6141	森精機製作所	52,100	(52,100)
6151	日東工器	6,600	(6,600)
6201	豊田自動織機	26,200	(26,200)
6203	豊和工業	60,000	(60,000)
6205	大阪機工	40,000	(40,000)
6208	石川製作所	8,000	(8,000)
6210	東洋機械金属	7,700	(7,700)
6218	エンシュウ	9,000	(9,000)
6250	やまびこ	3,100	(3,100)
6262	ペガサスミシン製造	9,600	(9,600)
6268	ナプテスコ	47,000	(47,000)
6269	三井海洋開発	8,600	(8,600)
6272	レオン自動機	1,000	(1,000)
6274	新川	10,200	(10,200)
6277	ホソカワミクロン	1,000	(1,000)
6278	ユニオンツール	3,100	(3,100)
6282	オイレス工業	12,700	(12,700)
6287	サトーホールディングス	11,900	(11,900)
6291	日本エアータック	500	(500)
6293	日精樹脂工業	4,900	(4,900)
6298	ワイエイシイ	3,300	(3,300)
6301	小松製作所	509,000	(509,000)
6306	日工	5,000	(5,000)
6309	巴工業	1,400	(1,400)
6310	井関農機	116,000	(116,000)
6316	丸山製作所	26,000	(26,000)
6326	クボタ	524,000	(524,000)
6328	荏原実業	2,800	(2,800)
6331	三菱化工機	35,000	(35,000)
6332	月島機械	13,000	(13,000)
6335	東京機械製作所	15,000	(15,000)
6340	澁谷工業	6,500	(6,500)
6345	アイチ コーポレーション	9,100	(9,100)
6358	酒井重工業	19,000	(19,000)
6363	西島製作所	4,400	(4,400)
6366	千代田化工建設	98,000	(98,000)
6367	ダイキン工業	124,500	(124,500)
6369	トーヨーカネツ	71,000	(71,000)
6370	栗田工業	63,200	(63,200)
6373	大同工業	8,000	(8,000)
6375	日本コンベヤ	26,000	(26,000)
6376	日機装	32,000	(32,000)
6379	新興プランテック	12,700	(12,700)
6383	ダイフク	4,000	(4,000)
6409	キトー	36	(36)
6417	SANKYO	22,300	(22,300)
6418	日本金銭機械	9,000	(9,000)
6420	福島工業	800	(800)
6444	サンデン	62,000	(62,000)
6445	蛇の目ミシン工業	88,000	(88,000)
6448	ブラザー工業	114,800	(114,800)
6455	モリタホールディングス	12,000	(12,000)
6459	大和冷機工業	12,000	(12,000)
6463	T P R	13,400	(13,400)
6471	日本精工	50,000	(50,000)
6472	N T N	226,000	(226,000)
6474	不二越	77,000	(77,000)
6479	ミネベア	163,000	(163,000)
6480	日本トムソン	28,000	(28,000)
6481	T H K	68,300	(68,300)
6482	ユースン精機	4,900	(4,900)
6489	前澤工業	7,500	(7,500)

6498	キッツ	49,000	(49,000)
6501	日立製作所	2,135,000	(2,135,000)
6502	東芝	2,160,000	(2,160,000)
6504	富士電機	295,000	(295,000)
6505	東洋電機製造	17,000	(17,000)
6506	安川電機	120,000	(120,000)
6507	シンフォニアテクノロジー	71,000	(71,000)
6508	明電舎	101,000	(101,000)
6517	デンヨー	11,200	(11,200)
6581	日立工機	3,800	(3,800)
6584	三櫻工業	7,800	(7,800)
6586	マキタ	22,800	(22,800)
6594	日本電産	54,200	(54,200)
6620	宮越ホールディングス	1,700	(1,700)
6622	ダイヘン	30,000	(30,000)
6632	JVCケンウッド	59,000	(59,000)
6640	第一精工	2,300	(2,300)
6651	日東工業	14,600	(14,600)
6665	エルピーダメモリ	131,900	(131,900)
6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	101,000	(101,000)
6675	サクサホールディングス	4,000	(4,000)
6678	テクノメディカ	6	(6)
6701	日本電気	1,343,000	(1,343,000)

[前へ](#)   [次へ](#)

銘柄		株式数	
コード	銘柄名		
6702	富士通	800,000	(800,000)
6704	岩崎通信機	49,000	(49,000)
6706	電気興業	29,000	(29,000)
6707	サンケン電気	64,000	(64,000)
6715	ナカヨ通信機	2,000	(2,000)
6724	セイコーエプソン	82,900	(82,900)
6727	ワコム	215	(215)
6728	アルバック	17,400	(17,400)
6731	ピクセラ	4,000	(4,000)
6741	日本信号	27,600	(27,600)
6742	京三製作所	12,000	(12,000)
6744	能美防災	7,000	(7,000)
6745	ホーチキ	11,000	(11,000)
6751	日本無線	12,000	(12,000)
6752	パナソニック	1,166,900	(1,166,900)
6753	シャープ	528,000	(528,000)
6755	富士通ゼネラル	26,000	(26,000)
6758	ソニー	609,600	(609,600)
6762	T D K	50,500	(50,500)
6763	帝国通信工業	26,000	(26,000)
6767	ミツミ電機	38,600	(38,600)
6768	タムラ製作所	33,000	(33,000)
6771	池上通信機	5,000	(5,000)
6773	バイオニア	138,500	(138,500)
6779	日本電波工業	8,500	(8,500)
6789	ローランド ディー . ジー .	1,100	(1,100)
6791	日本コロムビア	61,000	(61,000)
6798	S M K	32,000	(32,000)
6800	ヨコオ	5,100	(5,100)
6801	東光	9,000	(9,000)
6803	ティアック	53,000	(53,000)
6806	ヒロセ電機	19,100	(19,100)
6815	ユニデン	14,000	(14,000)
6820	アイコム	6,100	(6,100)
6841	横河電機	114,900	(114,900)
6844	新電元工業	38,000	(38,000)
6850	チノー	2,000	(2,000)
6853	共和電業	8,000	(8,000)
6855	日本電子材料	3,000	(3,000)
6857	アドバンテスト	30,400	(30,400)
6866	日置電機	4,200	(4,200)
6869	シスメックス	41,800	(41,800)
6875	メガチップス	10,100	(10,100)
6883	日本電産コバル電子	11,200	(11,200)
6885	ミヤチテクノス	3,800	(3,800)
6900	東京電波	2,000	(2,000)
6905	コーセル	14,600	(14,600)
6911	新日本無線	6,000	(6,000)
6914	オプテックス	7,200	(7,200)
6923	スタンレー電気	76,700	(76,700)
6924	岩崎電気	37,000	(37,000)
6925	ウシオ電機	61,700	(61,700)
6927	ヘリオス テクノ ホールディング	7,100	(7,100)
6937	古河電池	8,000	(8,000)
6938	双信電機	1,900	(1,900)
6947	図研	2,400	(2,400)
6951	日本電子	41,000	(41,000)
6952	カシオ計算機	104,300	(104,300)
6954	ファナック	95,800	(95,800)
6961	エンプラス	6,400	(6,400)
6963	ローム	54,800	(54,800)
6965	浜松ホトニクス	39,800	(39,800)
6973	協栄産業	13,000	(13,000)
6981	村田製作所	122,500	(122,500)
6985	ユーシン	11,100	(11,100)
6988	日東電工	100,400	(100,400)
6989	北陸電気工業	50,000	(50,000)

6997	日本ケミコン	56,000	(56,000)
6999	K O A	3,600	(3,600)
7011	三菱重工業	1,136,000	(1,136,000)
7012	川崎重工業	907,000	(907,000)
7013	I H I	748,000	(748,000)
7102	日本車輛製造	37,000	(37,000)
7105	日本輸送機	1,000	(1,000)
7201	日産自動車	1,382,300	(1,382,300)
7202	いすゞ自動車	116,000	(116,000)
7203	トヨタ自動車	1,074,600	(1,074,600)
7205	日野自動車	156,000	(156,000)
7211	三菱自動車工業	2,446,000	(2,446,000)
7212	エフテック	1,100	(1,100)
7226	極東開発工業	19,300	(19,300)
7230	日信工業	9,100	(9,100)
7238	曙ブレーキ工業	49,500	(49,500)
7239	タチエス	14,300	(14,300)
7240	N O K	58,800	(58,800)
7241	フタバ産業	30,400	(30,400)
7242	カヤバ工業	76,000	(76,000)
7244	市光工業	26,000	(26,000)
7245	大同メタル工業	4,000	(4,000)
7248	カルソニックカンセイ	41,000	(41,000)
7256	河西工業	15,000	(15,000)
7261	マツダ	13,000	(13,000)
7262	ダイハツ工業	116,000	(116,000)
7263	愛知機械工業	24,000	(24,000)
7269	スズキ	221,300	(221,300)
7280	ミツバ	20,000	(20,000)
7282	豊田合成	6,800	(6,800)
7296	エフ・シー・シー	16,100	(16,100)
7305	新家工業	23,000	(23,000)
7312	タカタ	16,800	(16,800)
7313	テイ・エス テック	23,100	(23,100)
7420	佐島電機	4,600	(4,600)
7421	カップバ・クリエイト	4,450	(4,450)
7427	エコートレーディング	2,400	(2,400)
7438	コンドーテック	6,800	(6,800)
7442	中山福	6,900	(6,900)
7445	ライトオン	8,000	(8,000)
7447	ナガイレーベン	5,100	(5,100)
7451	三菱食品	800	(800)
7455	三城ホールディングス	15,200	(15,200)
7463	アドヴァン	900	(900)
7466	S P K	2,600	(2,600)
7476	アズワン	3,600	(3,600)
7480	スズデン	2,900	(2,900)
7481	尾家産業	2,600	(2,600)
7482	シモジマ	7,400	(7,400)
7494	コナカ	12,700	(12,700)
7504	高速	4,800	(4,800)
7506	ハウス オブ ローゼ	1,000	(1,000)
7516	コーナン商事	2,000	(2,000)
7520	エコス	2,200	(2,200)
7524	マルシェ	1,200	(1,200)
7532	ドン・キホーテ	9,100	(9,100)
7537	丸文	2,500	(2,500)
7550	ゼンショーホールディングス	33,600	(33,600)
7554	幸楽苑	4,900	(4,900)
7561	ハークスレイ	600	(600)
7581	サイゼリヤ	16,000	(16,000)
7595	アルゴグラフィックス	400	(400)
7599	ガリバーインターナショナル	2,800	(2,800)
7600	日本エム・ディ・エム	4,400	(4,400)
7601	ポプラ	2,000	(2,000)
7608	エスケイジャパン	2,000	(2,000)
7609	ダイトエレクトロン	1,100	(1,100)
7613	シークス	700	(700)
7616	コロワイド	32,000	(32,000)

7619	田中商事	3,300	(3,300)
7637	白銅	2,800	(2,800)
7649	スギホールディングス	17,300	(17,300)
7701	島津製作所	121,000	(121,000)
7702	JMS	18,000	(18,000)
7714	モリテックス	1,200	(1,200)
7715	長野計器	6,800	(6,800)
7723	愛知時計電機	11,000	(11,000)
7728	日本電産トソク	4,700	(4,700)
7731	ニコン	191,000	(191,000)
7732	トプコン	16,600	(16,600)
7733	オリンパス	110,800	(110,800)
7734	理研計器	8,400	(8,400)
7735	大日本スクリーン製造	121,000	(121,000)
7741	HOYA	251,300	(251,300)
7745	エー・アンド・デイ	4,600	(4,600)
7752	リコー	354,000	(354,000)
7756	日本電産コバル	7,600	(7,600)
7757	日本電産サンキョー	23,000	(23,000)
7762	シチズンホールディングス	56,800	(56,800)
7769	リズム時計工業	54,000	(54,000)
7775	大研医器	1,200	(1,200)
7817	パラマウントベッドホールディングス	10,900	(10,900)
7825	SRIスポーツ	4,900	(4,900)
7838	共立印刷	11,300	(11,300)
7840	フランスベッドホールディングス	74,000	(74,000)
7846	パイロットコーポレーション	104	(104)
7893	プロネクス	7,800	(7,800)
7897	ホクシン	7,900	(7,900)
7898	ウッドワン	14,000	(14,000)
7905	大建工業	16,000	(16,000)
7908	きもと	9,500	(9,500)
7911	凸版印刷	333,000	(333,000)
7912	大日本印刷	333,000	(333,000)
7913	図書印刷	3,000	(3,000)
7915	日本写真印刷	4,500	(4,500)
7916	光村印刷	6,000	(6,000)
7921	宝印刷	5,500	(5,500)
7925	前澤化成工業	3,100	(3,100)
7936	アシックス	109,000	(109,000)
7942	JSP	7,600	(7,600)
7947	エフビコ	5,700	(5,700)
7949	小松ウオール工業	2,200	(2,200)
7955	クリナップ	11,800	(11,800)
7958	天馬	2,000	(2,000)
7961	兼松日産農林	17,000	(17,000)
7962	キングジム	8,400	(8,400)
7968	田崎真珠	12,000	(12,000)
7971	東リ	27,000	(27,000)
7972	イトーキ	23,300	(23,300)
7974	任天堂	47,400	(47,400)
7981	タカラスタンダード	28,000	(28,000)
7987	ナカバヤシ	11,000	(11,000)
7988	ニフコ	23,800	(23,800)
7995	日本バルカー工業	44,000	(44,000)
7999	MUTOHホールディングス	8,000	(8,000)
8008	F&Aアクアホールディングス	800	(800)
8013	ナイガイ	13,000	(13,000)
8015	豊田通商	73,000	(73,000)
8018	三共生興	11,700	(11,700)
8020	兼松	230,000	(230,000)
8022	美津濃	29,000	(29,000)
8025	ツカモトコーポレーション	16,000	(16,000)
8032	日本紙パルプ商事	56,000	(56,000)
8043	スターゼン	36,000	(36,000)
8050	セイコーホールディングス	56,000	(56,000)
8051	山善	41,500	(41,500)
8052	椿本興業	7,000	(7,000)
8061	西華産業	7,000	(7,000)

8065	佐藤商事	5,600	(5,600)
8070	東京産業	9,000	(9,000)
8074	ユアサ商事	118,000	(118,000)
8081	カナデン	3,000	(3,000)
8084	菱電商事	7,000	(7,000)
8088	岩谷産業	119,000	(119,000)
8091	二チモウ	11,000	(11,000)
8093	極東貿易	3,000	(3,000)
8095	イワキ	12,000	(12,000)
8096	兼松エレクトロニクス	1,900	(1,900)
8103	明和産業	8,500	(8,500)
8111	ゴールドウイン	6,000	(6,000)
8113	ユニ・チャーム	70,200	(70,200)
8131	ミツウロコグループホールディングス	17,800	(17,800)
8132	シナネン	26,000	(26,000)
8140	リョーサン	4,200	(4,200)
8141	新光商事	6,900	(6,900)
8142	トーホー	14,000	(14,000)
8150	三信電気	11,500	(11,500)
8153	モスフードサービス	15,200	(15,200)
8154	加賀電子	11,800	(11,800)
8158	ソーダニッカ	5,000	(5,000)
8160	木曽路	12,300	(12,300)
8166	タカキュー	1,500	(1,500)
8168	ケーヨー	22,200	(22,200)
8170	アデランス	12,800	(12,800)
8173	上新電機	16,000	(16,000)
8174	日本瓦斯	11,600	(11,600)
8178	マルエツ	2,000	(2,000)
8182	いなげや	8,100	(8,100)
8194	ライフコーポレーション	6,900	(6,900)
8196	カスミ	2,300	(2,300)
8201	さが美	4,000	(4,000)
8203	MrMax	6,600	(6,600)
8207	テンアライド	4,200	(4,200)
8217	オークワ	2,000	(2,000)
8218	コメリ	14,800	(14,800)
8229	CFSコーポレーション	3,500	(3,500)
8237	松屋	21,800	(21,800)
8242	エイチ・ツー・オーリテイリング	50,000	(50,000)
8245	丸栄	12,000	(12,000)
8248	ニッセンホールディングス	19,300	(19,300)
8252	丸井グループ	140,800	(140,800)
8255	原信ナルスホールディングス	6,200	(6,200)
8263	ダイエー	3,350	(3,350)
8266	イズミヤ	9,000	(9,000)
8267	イオン	435,200	(435,200)
8273	イズミ	24,500	(24,500)
8274	東武ストア	11,000	(11,000)
8278	フジ	12,000	(12,000)
8282	ケーズホールディングス	24,100	(24,100)
8289	Olympic	1,400	(1,400)
8324	第四銀行	4,000	(4,000)
8325	北越銀行	25,000	(25,000)
8331	千葉銀行	81,000	(81,000)
8332	横浜銀行	740,000	(740,000)
8333	常陽銀行	396,000	(396,000)
8337	千葉興業銀行	1,500	(1,500)
8338	筑波銀行	5,100	(5,100)
8339	東京都民銀行	20,400	(20,400)
8341	七十七銀行	180,000	(180,000)
8343	秋田銀行	18,000	(18,000)
8344	山形銀行	65,000	(65,000)
8345	岩手銀行	7,300	(7,300)
8346	東邦銀行	3,000	(3,000)
8349	東北銀行	13,000	(13,000)
8350	みちのく銀行	19,000	(19,000)
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	153,000	(153,000)
8355	静岡銀行	338,000	(338,000)

8356	十六銀行	37,000	(37,000)
8358	スルガ銀行	94,000	(94,000)
8360	山梨中央銀行	8,000	(8,000)
8361	大垣共立銀行	88,000	(88,000)
8362	福井銀行	17,000	(17,000)
8363	北國銀行	90,000	(90,000)
8364	清水銀行	1,700	(1,700)
8366	滋賀銀行	91,000	(91,000)
8367	南都銀行	107,000	(107,000)
8368	百五銀行	50,000	(50,000)
8369	京都銀行	186,000	(186,000)
8379	広島銀行	319,000	(319,000)
8382	中国銀行	89,000	(89,000)
8383	鳥取銀行	17,000	(17,000)
8385	伊予銀行	121,000	(121,000)
8386	百十四銀行	53,000	(53,000)
8387	四国銀行	66,000	(66,000)
8388	阿波銀行	96,000	(96,000)
8390	鹿児島銀行	53,000	(53,000)
8393	宮崎銀行	21,000	(21,000)
8394	肥後銀行	11,000	(11,000)
8395	佐賀銀行	2,000	(2,000)
8397	沖縄銀行	6,700	(6,700)
8399	琉球銀行	12,700	(12,700)
8411	みずほフィナンシャルグループ	100	(100)
8415	紀陽ホールディングス	134,000	(134,000)
8439	東京センチュリーリース	25,900	(25,900)
8473	SBIホールディングス	10,497	(10,497)
8511	日本証券金融	41,400	(41,400)
8515	アイフル	5,150	(5,150)
8518	日本アジア投資	69,000	(69,000)
8522	名古屋銀行	53,000	(53,000)
8527	愛知銀行	3,200	(3,200)
8530	中京銀行	27,000	(27,000)
8537	大光銀行	34,000	(34,000)
8541	愛媛銀行	41,000	(41,000)
8542	トマト銀行	29,000	(29,000)
8543	みなと銀行	60,000	(60,000)
8545	関西アーバン銀行	151,000	(151,000)
8551	北日本銀行	3,400	(3,400)
8563	大東銀行	1,000	(1,000)
8570	イオンクレジットサービス	28,800	(28,800)
8585	オリエン트コーポレーション	140,000	(140,000)
8586	日立キャピタル	19,000	(19,000)
8591	オリックス	63,920	(63,920)
8595	ジャフコ	11,700	(11,700)
8600	トモニホールディングス	74,200	(74,200)
8601	大和証券グループ本社	955,000	(955,000)
8609	岡三証券グループ	35,000	(35,000)
8613	丸三証券	35,800	(35,800)
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	126,000	(126,000)
8617	光世証券	26,000	(26,000)
8624	いちよし証券	24,200	(24,200)
8630	NK S Jホールディングス	77,500	(77,500)
8703	カブドットコム証券	37,200	(37,200)
8707	岩井コスモホールディングス	2,700	(2,700)
8713	フィデアホールディングス	54,900	(54,900)
8714	池田泉州ホールディングス	277,000	(277,000)
8725	M S & A D インシュアランスグループホールディングス	82,900	(82,900)
8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	92,400	(92,400)
8742	小林洋行	1,400	(1,400)
8750	第一生命保険	5,158	(5,158)
8793	N E C キャピタルソリューション	2,500	(2,500)
8802	三菱地所	756,000	(756,000)
8803	平和不動産	91,000	(91,000)
8804	東京建物	201,000	(201,000)
8806	ダイビル	28,400	(28,400)
8809	サンケイビル	2,200	(2,200)

8830	住友不動産	275,000	(275,000)
8833	東宝不動産	1,700	(1,700)
8835	太平洋興発	17,000	(17,000)
8840	大京	149,000	(149,000)
8841	テオーシー	41,900	(41,900)
8869	明和地所	900	(900)
8870	住友不動産販売	1,950	(1,950)
8871	ゴールドクレスト	6,090	(6,090)
8877	日本エスリード	100	(100)
8905	イオンモール	49,200	(49,200)
8933	エヌ・ティ・ティ都市開発	671	(671)
8944	ランドビジネス	22	(22)
9001	東武鉄道	555,000	(555,000)
9003	相鉄ホールディングス	157,000	(157,000)
9006	京浜急行電鉄	281,000	(281,000)
9007	小田急電鉄	338,000	(338,000)
9008	京王電鉄	284,000	(284,000)
9009	京成電鉄	104,000	(104,000)
9010	富士急行	21,000	(21,000)
9014	新京成電鉄	10,000	(10,000)
9022	東海旅客鉄道	877	(877)
9031	西日本鉄道	143,000	(143,000)
9041	近畿日本鉄道	889,000	(889,000)
9044	南海電気鉄道	229,000	(229,000)
9045	京阪電気鉄道	246,000	(246,000)
9047	名糖運輸	3,600	(3,600)
9048	名古屋鉄道	383,000	(383,000)
9066	日新	27,000	(27,000)
9067	丸運	5,300	(5,300)
9068	丸全昭和運輸	11,000	(11,000)
9070	トナミホールディングス	7,000	(7,000)
9074	日本石油輸送	13,000	(13,000)
9075	福山通運	12,000	(12,000)
9081	神奈川中央交通	4,000	(4,000)
9086	日立物流	22,800	(22,800)
9101	日本郵船	625,000	(625,000)
9104	商船三井	52,000	(52,000)
9107	川崎汽船	302,000	(302,000)
9115	明治海運	9,800	(9,800)
9119	飯野海運	44,900	(44,900)
9132	第一中央汽船	72,000	(72,000)
9202	全日本空輸	1,453,000	(1,453,000)
9234	国際航業ホールディングス	1,000	(1,000)
9301	三菱倉庫	78,000	(78,000)
9306	東陽倉庫	18,000	(18,000)
9312	ケイヒン	19,000	(19,000)
9324	安田倉庫	6,800	(6,800)
9351	東洋埠頭	28,000	(28,000)
9366	サンリツ	2,400	(2,400)
9368	キムラユニティー	2,100	(2,100)
9380	東海運	5,600	(5,600)
9382	バンテック	10	(10)
9401	東京放送ホールディングス	26,400	(26,400)
9404	日本テレビ放送網	10,340	(10,340)
9430	N E C モバイリング	800	(800)
9432	日本電信電話	405,900	(405,900)
9433	K D D I	541	(541)
9437	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	1,848	(1,848)
9449	G M O インターネット	28,600	(28,600)
9477	角川グループホールディングス	9,200	(9,200)
9479	インプレスホールディングス	9,000	(9,000)
9501	東京電力	287,500	(287,500)
9502	中部電力	370,600	(370,600)
9503	関西電力	454,100	(454,100)
9504	中国電力	163,900	(163,900)
9505	北陸電力	112,300	(112,300)
9506	東北電力	173,200	(173,200)
9507	四国電力	113,300	(113,300)
9508	九州電力	241,700	(241,700)

9509	北海道電力	82,400	(82,400)
9513	電源開発	79,200	(79,200)
9532	大阪瓦斯	834,000	(834,000)
9533	東邦瓦斯	285,000	(285,000)
9534	北海道瓦斯	21,000	(21,000)
9536	西部瓦斯	56,000	(56,000)
9543	静岡瓦斯	12,500	(12,500)
9600	アイネット	3,400	(3,400)
9601	松竹	62,000	(62,000)
9602	東宝	77,000	(77,000)
9607	葵プロモーション	3,500	(3,500)
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	667	(667)
9616	共立メンテナンス	5,000	(5,000)
9619	イテネンホールディングス	11,100	(11,100)
9621	建設技術研究所	300	(300)
9627	アインファーマシーズ	5,300	(5,300)
9628	燦ホールディングス	1,200	(1,200)
9633	東京テアトル	23,000	(23,000)
9675	常磐興産	36,000	(36,000)
9681	東京ドーム	81,000	(81,000)
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	31,500	(31,500)
9692	シーイーシー	1,500	(1,500)
9704	東海観光	24,000	(24,000)
9706	日本空港ビルデング	31,400	(31,400)
9716	乃村工藝社	23,000	(23,000)
9717	ジャステック	500	(500)
9719	S C S K	20,100	(20,100)
9722	藤田観光	33,000	(33,000)
9728	日本管財	2,300	(2,300)
9731	白洋舎	6,000	(6,000)
9740	セントラル警備保障	5,100	(5,100)
9744	メイテック	19,100	(19,100)
9746	T K C	2,500	(2,500)
9749	富士ソフト	11,700	(11,700)
9755	応用地質	13,100	(13,100)
9757	船井総合研究所	6,200	(6,200)
9760	進学会	4,100	(4,100)
9763	丸紅建材リース	11,000	(11,000)
9766	コナミ	11,200	(11,200)
9783	ベネッセホールディングス	22,000	(22,000)
9787	イオンディライト	11,100	(11,100)
9788	ナック	2,900	(2,900)
9793	ダイセキ	16,900	(16,900)
9810	日鐵商事	9,000	(9,000)
9828	元気寿司	3,400	(3,400)
9831	ヤマダ電機	52,430	(52,430)
9843	二トリホールディングス	23,350	(23,350)
9850	グルメ杵屋	6,000	(6,000)
9854	愛眼	600	(600)
9861	吉野家ホールディングス	266	(266)
9883	富士エレクトロニクス	2,900	(2,900)
9887	松屋フーズ	2,200	(2,200)
9889	J B C Cホールディングス	3,300	(3,300)
9900	サガミチェーン	13,000	(13,000)
9902	日伝	4,400	(4,400)
9930	北沢産業	3,000	(3,000)
9932	杉本商事	1,500	(1,500)
9945	ブレナス	400	(400)
9948	アークス	8,100	(8,100)
9962	ミスミグループ本社	36,300	(36,300)
9963	江守商事	1,900	(1,900)
9972	アルテック	4,700	(4,700)
9979	大庄	3,700	(3,700)
9982	タキヒヨー	8,000	(8,000)
9983	ファーストリテイリング	23,000	(23,000)
9989	サンドラッグ	20,600	(20,600)
9991	ジェコス	6,600	(6,600)
9993	ヤマザワ	1,500	(1,500)
9994	やまや	1,500	(1,500)

9997	ペルーナ	6,350	(6,350)
合 計		73,846,015	(73,846,015)

(注)貸付株式の( )内は、委託者の利害関係人であるモルガン・スタンレーMUFJ証券株式会社に対する貸付で、内書であります。

(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関係に関する注記)」に記載しております。

[前へ](#)   [次へ](#)

「外国株式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。

(1) 貸借対照表

		[ 平成24年1月26日現在 ]
		金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金		1,103,723,955
コール・ローン		240,705,766
株式		140,598,452,842
投資証券		2,838,231,659
派生商品評価勘定		116,572,712
未収入金		15,142,201
未収配当金		157,821,977
未収利息		555
差入委託証拠金		1,196,501,235
流動資産合計		146,267,152,902
資産合計		146,267,152,902
負債の部		
流動負債		
未払解約金		154,589,777
流動負債合計		154,589,777
負債合計		154,589,777
純資産の部		
元本等		
元本	1	152,966,217,901
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	2	6,853,654,776
元本等合計		146,112,563,125
純資産合計		146,112,563,125
負債純資産合計		146,267,152,902

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年5月13日から翌年5月12日までであります。

(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	<p>株式および投資証券は移動平均法、株式および投資証券以外の有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場（外貨建証券の場合は知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合また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、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	[平成24年1月26日現在]
1 期首	平成23年10月31日
期首元本額	160,631,176,540円
期首からの追加設定元本額	7,824,298,221円
期首からの一部解約元本額	15,489,256,860円
元本の内訳*	
ファンド・マネジャー（海外株式）	395,154,854円
eMAXIS 先進国株式インデックス	6,843,380,397円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	14,597,580円
eMAXIS バランス（波乗り型）	7,788,874円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	1,331,229,001円
eMAXIS 全世界株式インデックス	909,297,717円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	54,122,058,304円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	39,452,589,454円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	1,134,750,555円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	7,419,043,560円
MUAM 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	7,564,059,426円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型（適格機関投資家限定）	925,851,386円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	630,286,271円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	5,345,334,335円
MSCIコクサイインデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）	2,083,256,017円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	25,344,882円
MUAM 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	5,792,069,515円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,590,536,930円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	72,088,548円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	185,270,735円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	263,581,280円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	336,615,868円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	2,912,661,401円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	356,695,992円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	2,608,846,212円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	677,534,675円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	2,969,919,359円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	2,742,334,817円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	361,940,449円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	1,272,085,497円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	954,526,538円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	665,487,472円
（合計）	152,966,217,901円
2 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	6,853,654,776円
3 受益権の総数	152,966,217,901口
4 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9552円 (9,552円)

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

## 1 金融商品の状況に関する事項

区分	(自平成23年10月31日 至平成24年1月26日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資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。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式および投資証券を実質的な主要投資対象としております。株式および投資証券の投資に係る価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成24年1月26日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。
2 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)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関係に関する注記)に記載しております。

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。</p>
---------------------------	--

(有価証券関係に関する注記)  
 売買目的有価証券

種類	[平成24年1月26日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	4,366,907,894	
投資証券	48,244,821	
合計	4,318,663,073	

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項  
 株式関連

区分	種類	[平成24年1月26日現在]			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち1年超			
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,212,406,664		2,328,955,426	116,548,762
合計		2,212,406,664		2,328,955,426	116,548,762

(注) 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、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、最も近い最終相場値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 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。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

通貨関連

区分	種類	[平成24年1月26日現在]			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち1年超			
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカドル	101,112,700		101,101,000	11,700
	イギリスポンド	18,263,100		18,262,500	600
	スイスフラン	16,862,400		16,862,000	400
	香港ドル	25,050,000		25,050,000	
	スウェーデンクローネ	17,306,250		17,295,000	11,250
合計		178,594,450		178,570,500	23,950

(注) 時価の算定方法

- 対顧客先物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。  
 為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。  
 当該日の対顧客先物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。  
 (イ) 当該日を超える対顧客先物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相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。  
 (ロ) 当該日を超える対顧客先物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相場の仲値を用いております。
- 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

(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。

[前へ](#)   [次へ](#)

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

(単位:円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル					
	3M CO	57,000	86.480000	4,929,360.00	
	ABBOTT LABORATORIES	132,200	55.230000	7,301,406.00	
	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	6,900	46.840000	323,196.00	
	ACCENTURE PLC-CL A	54,700	57.190000	3,128,293.00	
	ACE LTD	28,400	71.670000	2,035,428.00	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	42,500	11.950000	507,875.00	
	ADOBE SYSTEMS INC	42,100	31.340000	1,319,414.00	
	ADVANCE AUTO PARTS INC	6,700	75.980000	509,066.00	
	ADVANCED MICRO DEVICES	46,700	6.730000	314,291.00	
	AES CORP	58,700	13.110000	769,557.00	
	AETNA INC	31,800	42.630000	1,355,634.00	
	AFLAC INC	39,900	49.160000	1,961,484.00	
	AGCO CORP	7,900	52.940000	418,226.00	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	30,300	44.050000	1,334,715.00	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	18,600	87.740000	1,631,964.00	
	AIRGAS INC	6,300	80.230000	505,449.00	
	AKAMA I TECHNOLOGIES INC	14,700	31.870000	468,489.00	
	ALCOA INC	89,200	10.480000	934,816.00	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	16,200	74.940000	1,214,028.00	
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	9,200	50.030000	460,276.00	
	ALLERGAN INC	26,200	89.300000	2,339,660.00	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,300	111.140000	477,902.00	
	ALLIANT ENERGY CORP	9,100	43.040000	391,664.00	
	ALLSTATE CORP	45,300	29.180000	1,321,854.00	
	ALPHA NATURAL RESOURCES INC	20,700	20.920000	433,044.00	
	ALTERA CORP	27,300	40.570000	1,107,561.00	
	ALTRIA GROUP INC	175,900	28.670000	5,043,053.00	
	AMAZON.COM INC	30,800	187.800000	5,784,240.00	
	AMEREN CORPORATION	22,000	31.920000	702,240.00	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	40,400	41.380000	1,671,752.00	
	AMERICAN EXPRESS CO	92,000	50.170000	4,615,640.00	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	39,900	25.310000	1,009,869.00	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,000	32.900000	526,400.00	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	20,000	54.280000	1,085,600.00	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	22,700	39.720000	901,644.00	
	AMETEK INC	13,300	46.830000	622,839.00	
	AMGEN INC	67,300	69.220000	4,658,506.00	
	AMPHENOL CORP-CL A	14,500	54.700000	793,150.00	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	42,500	81.080000	3,445,900.00	
	ANALOG DEVICES INC	25,000	39.780000	994,500.00	
	AON CORP	24,800	47.500000	1,178,000.00	
	APACHE CORP	32,800	99.830000	3,274,424.00	
	APOLLO GROUP INC-CL A	10,600	55.980000	593,388.00	
	APPLE INC	79,100	446.660000	35,330,806.00	
	APPLIED MATERIALS INC	116,900	12.370000	1,446,053.00	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	13,100	37.020000	484,962.00	
	ARCH COAL INC	16,900	14.550000	245,895.00	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	57,300	30.080000	1,723,584.00	
	ARROW ELECTRONICS INC	11,100	41.360000	459,096.00	
	ASSURANT INC	8,700	39.470000	343,389.00	
	AT&T INC	504,600	30.210000	15,243,966.00	
	AUTODESK INC	19,300	36.230000	699,239.00	
	AUTOLIV INC	7,400	63.790000	472,046.00	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	41,200	56.920000	2,345,104.00	
	AUTOZONE INC	2,000	348.580000	697,160.00	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	20,000	33.970000	679,400.00	
	AVERY DENNISON CORP	8,000	28.700000	229,600.00	
	AVNET INC	12,300	33.830000	416,109.00	
	AVON PRODUCTS INC	35,800	18.410000	659,078.00	
	AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	9,700	30.780000	298,566.00	

BAKER HUGHES INC	37,300	48.160000	1,796,368.00
BALL CORP	13,900	37.700000	524,030.00
BANK OF AMERICA CORP	863,100	7.350000	6,343,785.00
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	106,200	20.570000	2,184,534.00
BAXTER INTERNATIONAL INC	47,700	54.370000	2,593,449.00
BB&T CORP	59,400	27.700000	1,645,380.00
BEAM INC	13,100	52.870000	692,597.00
BECTON DICKINSON AND CO	19,100	79.250000	1,513,675.00
BED BATH & BEYOND INC	21,300	62.930000	1,340,409.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	76,900	79.850000	6,140,465.00
BEST BUY CO INC	28,000	25.710000	719,880.00
BIOGEN IDEC INC	19,600	118.370000	2,320,052.00
BLACKROCK INC	8,100	188.240000	1,524,744.00
BMC SOFTWARE INC	15,600	35.250000	549,900.00
BOEING CO/THE	59,700	75.820000	4,526,454.00
BORGWARNER INC	9,300	76.530000	711,729.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	135,700	6.130000	831,841.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	144,200	32.700000	4,715,340.00
BROADCOM CORP-CL A	42,300	35.790000	1,513,917.00
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	7,900	83.240000	657,596.00
BUNGE LTD	12,900	59.210000	763,809.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	13,900	68.110000	946,729.00
CA INC	34,600	25.020000	865,692.00
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	18,300	14.730000	269,559.00
CABOT OIL & GAS CORP	8,600	66.620000	572,932.00
CALPINE CORP	30,100	14.800000	445,480.00
CAMERON INTERNATIONAL CORP	21,400	54.200000	1,159,880.00
CAMPBELL SOUP CO	16,700	31.720000	529,724.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	39,600	45.610000	1,806,156.00
CARDINAL HEALTH INC	29,500	42.080000	1,241,360.00
CAREFUSION CORP	18,900	24.020000	453,978.00
CARMAX INC	18,400	32.350000	595,240.00
CARNIVAL CORP	40,500	31.150000	1,261,575.00
CATERPILLAR INC	54,800	109.050000	5,975,940.00
CBRE GROUP INC - A	26,900	18.150000	488,235.00
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	54,300	28.760000	1,561,668.00
CELANESE CORP-SERIES A	13,200	49.040000	647,328.00
CELGENE CORP	39,000	73.830000	2,879,370.00
CENTERPOINT ENERGY INC	35,500	18.720000	664,560.00
CENTURYLINK INC	53,000	37.530000	1,989,090.00
CERNER CORP	12,500	60.640000	758,000.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	6,200	181.060000	1,122,572.00
CHESAPEAKE ENERGY CORP	57,200	23.380000	1,337,336.00
CHEVRON CORP	170,800	107.730000	18,400,284.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,600	363.140000	944,164.00
CHUBB CORP	24,000	70.420000	1,690,080.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,500	45.900000	527,850.00
CIGNA CORP	25,300	45.770000	1,157,981.00
CIMAREX ENERGY CO	7,000	59.950000	419,650.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,200	32.730000	464,766.00
CINTAS CORP	11,200	37.430000	419,216.00
CISCO SYSTEMS INC	468,900	19.830000	9,298,287.00
CIT GROUP INC	16,100	38.050000	612,605.00
CITIGROUP INC	248,700	29.960000	7,451,052.00
CITRIX SYSTEMS INC	16,600	67.610000	1,122,326.00
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	12,200	76.550000	933,910.00
CLOROX COMPANY	10,900	68.640000	748,176.00
CME GROUP INC	5,500	242.060000	1,331,330.00
COACH INC	25,500	69.300000	1,767,150.00
COCA-COLA CO/THE	175,900	68.430000	12,036,837.00
COCA-COLA ENTERPRISES	27,300	27.330000	746,109.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	25,600	71.780000	1,837,568.00
COLGATE-PALMOLIVE CO	41,600	89.440000	3,720,704.00
COMCAST CORP-CLASS A	178,300	26.130000	4,658,979.00
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	56,100	25.150000	1,410,915.00
COMERICA INC	18,400	29.190000	537,096.00
COMPUTER SCIENCES CORP	13,400	26.320000	352,688.00
CONAGRA FOODS INC	36,200	27.170000	983,554.00
CONCHO RESOURCES INC	8,300	107.630000	893,329.00

CONOCOPHILLIPS	111,100	69.980000	7,774,778.00
CONSOL ENERGY INC	20,300	35.870000	728,161.00
CONSOLIDATED EDISON INC	24,100	59.370000	1,430,817.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	15,300	21.150000	323,595.00
CONSTELLATION ENERGY GROUP	16,000	36.620000	585,920.00
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	4,000	82.470000	329,880.00
COOPER INDUSTRIES PLC	14,100	60.120000	847,692.00
CORNING INC	136,000	13.050000	1,774,800.00
COSTCO WHOLESALE CORP	37,000	82.720000	3,060,640.00
COVANCE INC	4,900	47.150000	231,035.00
COVENTRY HEALTH CARE INC	12,200	30.360000	370,392.00
COVIDIEN PLC	43,300	49.720000	2,152,876.00
CR BARD INC	7,800	93.510000	729,378.00
CREE INC	8,900	26.510000	235,939.00
CROWN CASTLE INTL CORP	26,100	46.700000	1,218,870.00
CROWN HOLDINGS INC	13,100	35.360000	463,216.00
CSX CORP	95,600	22.660000	2,166,296.00
CUMMINS INC	15,500	108.960000	1,688,880.00
CVS CAREMARK CORP	114,300	42.180000	4,821,174.00
DANAHER CORP	50,100	53.030000	2,656,803.00
DARDEN RESTAURANTS INC	12,300	46.740000	574,902.00
DAVITA INC	8,500	81.860000	695,810.00
DEERE & CO	35,500	87.760000	3,115,480.00
DELL INC	141,800	16.790000	2,380,822.00
DELTA AIR LINES INC	17,300	9.960000	172,308.00
DENBURY RESOURCES INC	36,000	19.100000	687,600.00
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	12,200	38.900000	474,580.00
DEVON ENERGY CORPORATION	33,600	66.170000	2,223,312.00
DEVRY INC	5,100	41.070000	209,457.00
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	5,400	62.340000	336,636.00
DIRECTV-CLASS A	63,800	44.440000	2,835,272.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	47,100	27.450000	1,292,895.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	12,300	44.470000	546,981.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	10,600	40.030000	424,318.00
DISH NETWORK CORP-A	17,000	28.710000	488,070.00
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	5,200	36.590000	190,268.00
DOLLAR GENERAL CORP	12,500	42.700000	533,750.00
DOLLAR TREE INC	10,600	85.340000	904,604.00
DOMINION RESOURCES INC/VA	49,400	51.110000	2,524,834.00
DOVER CORP	16,600	60.860000	1,010,276.00
DOW CHEMICAL CO/THE	100,100	33.740000	3,377,374.00
DR HORTON INC	24,800	14.490000	359,352.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	18,500	38.760000	717,060.00
DTE ENERGY COMPANY	15,600	54.060000	843,336.00
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	79,600	50.590000	4,026,964.00
DUKE ENERGY CORP	112,100	21.360000	2,394,456.00
DUN & BRADSTREET CORP	4,200	82.730000	347,466.00
EASTMAN CHEMICAL CO	12,600	46.940000	591,444.00
EATON CORP	26,400	49.540000	1,307,856.00
EATON VANCE CORP	12,100	26.600000	321,860.00
EBAY INC	97,800	31.940000	3,123,732.00
ECOLAB INC	25,900	60.940000	1,578,346.00
EDISON INTERNATIONAL	25,900	40.910000	1,059,569.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	10,300	79.000000	813,700.00
EL PASO CORP	67,400	27.000000	1,819,800.00
ELECTRONIC ARTS INC	27,100	18.040000	488,884.00
ELI LILLY & CO	88,700	39.890000	3,538,243.00
EMC CORP/MASS	176,700	25.690000	4,539,423.00
EMERSON ELECTRIC CO	63,100	52.100000	3,287,510.00
ENERGEN CORP	7,000	54.110000	378,770.00
ENERGIZER HOLDINGS INC	6,100	79.130000	482,693.00
ENERGY CORP	14,800	70.890000	1,049,172.00
EOG RESOURCES INC	22,600	106.810000	2,413,906.00
EQT CORP	11,700	50.960000	596,232.00
EQUIFAX INC	10,200	39.770000	405,654.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	19,800	59.210000	1,172,358.00
EVEREST RE GROUP LTD	5,200	85.460000	444,392.00
EXELON CORP	57,300	40.010000	2,292,573.00
EXPEDIA INC	8,100	31.220000	252,882.00

EXPEDITORS INTL WASH INC	19,300	44.250000	854,025.00
EXPRESS SCRIPTS INC	39,600	52.500000	2,079,000.00
EXXON MOBIL CORP	414,800	87.220000	36,178,856.00
F5 NETWORKS INC	6,600	122.480000	808,368.00
FAMILY DOLLAR STORES	10,800	57.030000	615,924.00
FASTENAL CO	23,700	46.740000	1,107,738.00
FEDEX CORP	25,800	92.590000	2,388,822.00
FIDELITY NATIONAL FINL-A	15,100	18.150000	274,065.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	20,000	28.330000	566,600.00
FIFTH THIRD BANCORP	77,900	13.490000	1,050,871.00
FIRST SOLAR INC	4,700	38.610000	181,467.00
FIRSTENERGY CORP	35,600	42.130000	1,499,828.00
FISERV INC	12,100	63.420000	767,382.00
FLEXTRONICS INTL LTD	58,200	6.750000	392,850.00
FLIR SYSTEMS INC	12,900	26.490000	341,721.00
FLOWSERVE CORP	5,000	108.760000	543,800.00
FLUOR CORP	14,900	56.730000	845,277.00
FMC CORP	6,000	92.740000	556,440.00
FMC TECHNOLOGIES INC	20,700	53.920000	1,116,144.00
FORD MOTOR CO	304,900	12.930000	3,942,357.00
FOREST LABORATORIES INC	25,400	31.800000	807,720.00
FOSSIL INC	4,900	95.070000	465,843.00
FRANKLIN RESOURCES INC	13,300	105.090000	1,397,697.00
FREEPORT-MCMORAN COPPER	79,900	46.080000	3,681,792.00
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	89,600	4.745000	425,152.00
GAMESTOP CORP-CLASS A	11,600	25.000000	290,000.00
GAP INC/THE	32,500	19.000000	617,500.00
GARMIN LTD	11,400	41.870000	477,318.00
GENERAL DYNAMICS CORP	26,400	71.570000	1,889,448.00
GENERAL ELECTRIC CO	903,600	19.130000	17,285,868.00
GENERAL MILLS INC	54,900	40.620000	2,230,038.00
GENERAL MOTORS CO	66,300	24.920000	1,652,196.00
GENUINE PARTS CO	13,000	64.490000	838,370.00
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	47,700	8.060000	384,462.00
GILEAD SCIENCES INC	65,500	48.290000	3,162,995.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	41,300	108.270000	4,471,551.00
GOODRICH CORP	10,900	124.530000	1,357,377.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	20,100	13.580000	272,958.00
GOOGLE INC-CL A	21,700	569.490000	12,357,933.00
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	11,000	51.050000	561,550.00
H&R BLOCK INC	25,100	16.900000	424,190.00
HALLIBURTON CO	78,200	36.410000	2,847,262.00
HARLEY-DAVIDSON INC	21,100	44.750000	944,225.00
HARRIS CORP	11,200	38.840000	435,008.00
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	35,100	18.200000	638,820.00
HASBRO INC	10,600	35.010000	371,106.00
HCA HOLDINGS INC	13,600	27.000000	367,200.00
HELMERICH & PAYNE	8,900	62.950000	560,255.00
HENRY SCHEIN INC	7,300	70.630000	515,599.00
HERBALIFE LTD	9,900	57.490000	569,151.00
HERSHEY CO/THE	14,500	61.600000	893,200.00
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	21,000	13.610000	285,810.00
HESS CORP	26,400	57.310000	1,512,984.00
HEWLETT-PACKARD CO	177,100	28.320000	5,015,472.00
HJ HEINZ CO	27,100	52.320000	1,417,872.00
HOLLYFRONTIER CORP	18,400	29.350000	540,040.00
HOLOGIC INC	23,100	19.630000	453,453.00
HOME DEPOT INC	133,800	45.260000	6,055,788.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	63,100	58.100000	3,666,110.00
HORMEL FOODS CORP	12,900	29.600000	381,840.00
HOSPIRA INC	15,300	35.520000	543,456.00
HUDSON CITY BANCORP INC	39,100	7.240000	283,084.00
HUMANA INC	14,500	89.550000	1,298,475.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	9,100	48.640000	442,624.00
IHS INC-CLASS A	4,000	92.180000	368,720.00
ILLINOIS TOOL WORKS	37,500	52.820000	1,980,750.00
ILLUMINA INC	10,500	55.150000	579,075.00
INGERSOLL-RAND PLC	29,300	35.700000	1,046,010.00
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	6,500	52.630000	342,095.00

INTEL CORP	447,400	26.890000	12,030,586.00
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	6,600	117.530000	775,698.00
INTERNATIONAL PAPER CO	36,400	31.280000	1,138,592.00
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	39,200	10.480000	410,816.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	101,800	191.730000	19,518,114.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,100	56.790000	403,209.00
INTL GAME TECHNOLOGY	25,300	15.830000	400,499.00
INTUIT INC	24,800	57.520000	1,426,496.00
INTUITIVE SURGICAL INC	3,400	455.660000	1,549,244.00
INVESCO LTD	38,000	22.180000	842,840.00
IRON MOUNTAIN INC	16,700	31.760000	530,392.00
J.C. PENNEY CO INC	12,900	34.280000	442,212.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,200	46.310000	472,362.00
JM SMUCKER CO/THE	9,800	81.190000	795,662.00
JOHNSON & JOHNSON	233,400	65.220000	15,222,348.00
JOHNSON CONTROLS INC	55,900	31.920000	1,784,328.00
JOY GLOBAL INC	9,400	93.030000	874,482.00
JPMORGAN CHASE & CO	332,700	37.600000	12,509,520.00
JUNIPER NETWORKS INC	44,100	22.620000	997,542.00
KANSAS CITY SOUTHERN	8,900	67.380000	599,682.00
KBR INC	12,400	32.950000	408,580.00
KELLOGG CO	21,900	50.910000	1,114,929.00
KEYCORP	86,900	8.240000	716,056.00
KIMBERLY-CLARK CORP	34,000	71.870000	2,443,580.00
KLA-TENCOR CORPORATION	14,000	51.290000	718,060.00
KOHL'S CORP	23,300	47.750000	1,112,575.00
KRAFT FOODS INC-CLASS A	142,200	38.370000	5,456,214.00
KROGER CO	48,100	24.650000	1,185,665.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	9,500	70.610000	670,795.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,600	91.780000	789,308.00
LAM RESEARCH CORP	10,100	43.550000	439,855.00
LAS VEGAS SANDS CORP	30,700	49.740000	1,527,018.00
LEGG MASON INC	11,100	27.630000	306,693.00
LEGGETT & PLATT INC	11,100	23.330000	258,963.00
LEUCADIA NATIONAL CORP	16,500	28.060000	462,990.00
LIBERTY GLOBAL INC-A	11,300	45.710000	516,523.00
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	11,000	43.960000	483,560.00
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	51,000	16.650000	849,150.00
LIBERTY MEDIA CORP - LIBER-A	8,900	83.000000	738,700.00
LIFE TECHNOLOGIES CORP	15,600	49.080000	765,648.00
LIMITED BRANDS INC	21,300	41.990000	894,387.00
LINCOLN NATIONAL CORP	26,200	21.940000	574,828.00
LINEAR TECHNOLOGY CORP	19,300	33.500000	646,550.00
LOCKHEED MARTIN CORP	24,900	81.730000	2,035,077.00
LOEWS CORP	26,900	38.180000	1,027,042.00
LORILLARD INC	11,900	114.410000	1,361,479.00
LOWE'S COS INC	107,600	26.910000	2,895,516.00
LSI CORP	54,500	7.080000	385,860.00
LULULEMON ATHLETICA INC	7,900	63.360000	500,544.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	24,800	40.220000	997,456.00
M & T BANK CORP	9,600	82.000000	787,200.00
MACY'S INC	37,200	34.190000	1,271,868.00
MANPOWER INC	6,400	42.890000	274,496.00
MARATHON OIL CORP	63,100	32.570000	2,055,167.00
MARATHON PETROLEUM CORP	31,400	38.760000	1,217,064.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	24,300	35.160000	854,388.00
MARSH & MCLENNAN COS	45,800	31.510000	1,443,158.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,700	81.670000	302,179.00
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	46,300	16.010000	741,263.00
MASCO CORP	29,200	12.600000	367,920.00
MASTERCARD INC-CLASS A	9,300	348.770000	3,243,561.00
MATTEL INC	29,800	29.530000	879,994.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	26,700	27.560000	735,852.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	11,600	51.860000	601,576.00
MCDONALD'S CORP	87,600	99.230000	8,692,548.00
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	25,100	47.390000	1,189,489.00
MCKESSON CORP	20,600	77.850000	1,603,710.00
MDU RESOURCES GROUP INC	15,800	21.660000	342,228.00
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	17,500	72.600000	1,270,500.00

MEADWESTVACO CORP	15,400	30.730000	473,242.00
MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	33,200	62.540000	2,076,328.00
MEDTRONIC INC	90,400	39.960000	3,612,384.00
MERCK & CO. INC.	262,000	38.680000	10,134,160.00
METLIFE INC	91,500	35.950000	3,289,425.00
METROPCS COMMUNICATIONS INC	26,500	8.820000	233,730.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	26,400	13.110000	346,104.00
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	16,900	36.780000	621,582.00
MICRON TECHNOLOGY INC	81,300	7.850000	638,205.00
MICROSOFT CORP	642,400	29.560000	18,989,344.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,400	63.740000	344,196.00
MOLSON COORS BREWING CO -B	13,600	42.990000	584,664.00
MONSANTO CO	45,800	81.320000	3,724,456.00
MONSTER BEVERAGE CORP	6,200	108.485000	672,607.00
MOODY'S CORP	17,500	38.260000	669,550.00
MORGAN STANLEY	124,000	18.130000	2,248,120.00
MOSAIC CO/THE	26,300	56.020000	1,473,326.00
MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS I	24,900	38.600000	961,140.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	26,400	44.940000	1,186,416.00
MURPHY OIL CORP	16,500	60.650000	1,000,725.00
MYLAN INC	39,200	21.210000	831,432.00
NABORS INDUSTRIES LTD	24,000	17.840000	428,160.00
NASDAQ OMX GROUP/THE	10,800	25.900000	279,720.00
NATIONAL OILWELL VARCO INC	36,100	77.200000	2,786,920.00
NETAPP INC	30,800	37.800000	1,164,240.00
NETFLIX INC	4,200	95.040000	399,168.00
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	42,300	12.870000	544,401.00
NEWELL RUBBERMAID INC	22,700	17.330000	393,391.00
NEWFIELD EXPLORATION CO	10,900	41.280000	449,952.00
NEWMONT MINING CORP	42,100	60.250000	2,536,525.00
NEWS CORP-B	37,100	19.490000	723,079.00
NEWS CORP-CL A	156,700	18.780000	2,942,826.00
NEXTERA ENERGY INC	33,600	60.050000	2,017,680.00
NII HOLDINGS INC	15,900	19.980000	317,682.00
NIKE INC -CL B	31,200	103.210000	3,220,152.00
NISOURCE INC	25,400	23.120000	587,248.00
NOBLE CORP	21,500	34.790000	747,985.00
NOBLE ENERGY INC	15,400	102.110000	1,572,494.00
NORDSTROM INC	14,200	48.740000	692,108.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	30,500	75.170000	2,292,685.00
NORTHEAST UTILITIES	16,200	34.910000	565,542.00
NORTHERN TRUST CORP	18,500	42.270000	781,995.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	23,900	59.590000	1,424,201.00
NRG ENERGY INC	21,300	17.330000	369,129.00
NSTAR	10,000	45.140000	451,400.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	22,000	27.950000	614,900.00
NUCOR CORP	27,300	43.740000	1,194,102.00
NVIDIA CORP	53,600	14.850000	795,960.00
NYSE EURONEXT	21,400	27.460000	587,644.00
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	69,300	103.460000	7,169,778.00
OMNICARE INC	11,700	33.470000	391,599.00
OMNICOM GROUP	23,400	46.670000	1,092,078.00
ONEOK INC	8,300	87.650000	727,495.00
ORACLE CORP	345,700	28.510000	9,855,907.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	12,100	82.570000	999,097.00
OWENS-ILLINOIS INC	13,000	23.220000	301,860.00
P G & E CORP	34,600	41.090000	1,421,714.00
PACCAR INC	27,700	45.540000	1,261,458.00
PALL CORP	10,400	60.520000	629,408.00
PARKER HANNIFIN CORP	13,000	82.370000	1,070,810.00
PARTNERRE LTD	6,200	63.890000	396,118.00
PATTERSON COS INC	7,500	32.100000	240,750.00
PAYCHEX INC	28,400	32.450000	921,580.00
PEABODY ENERGY CORP	23,500	37.330000	877,255.00
PENTAIR INC	9,000	37.210000	334,890.00

(単位:円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル					
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	34,400	12.730000	437,912.00	
	PEPCO HOLDINGS INC	19,000	20.170000	383,230.00	
	PEPSICO INC	134,500	66.700000	8,971,150.00	
	PERRIGO CO	7,100	98.760000	701,196.00	
	PETSMART INC	10,300	54.000000	556,200.00	
	PFIZER INC	664,300	21.720000	14,428,596.00	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	149,900	76.810000	11,513,819.00	
	PINNACLE WEST CAPITAL	10,500	48.240000	506,520.00	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	9,400	101.490000	954,006.00	
	PITNEY BOWES INC	15,700	19.400000	304,580.00	
	PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	11,800	38.180000	450,524.00	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	45,000	59.620000	2,682,900.00	
	PPG INDUSTRIES INC	13,100	89.420000	1,171,402.00	
	PPL CORPORATION	48,900	28.230000	1,380,447.00	
	PRAXAIR INC	25,700	106.070000	2,725,999.00	
	PRECISION CASTPARTS CORP	12,200	176.280000	2,150,616.00	
	PRICELINE.COM INC	4,200	528.610000	2,220,162.00	
	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	26,200	27.290000	714,998.00	
	PROCTER & GAMBLE CO/THE	234,000	64.980000	15,205,320.00	
	PROGRESS ENERGY INC	25,100	54.380000	1,364,938.00	
	PROGRESSIVE CORP	54,100	20.560000	1,112,296.00	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	42,200	57.780000	2,438,316.00	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	42,600	30.930000	1,317,618.00	
	QEP RESOURCES INC	15,100	30.000000	453,000.00	
	QUALCOMM INC	142,800	59.000000	8,425,200.00	
	QUANTA SERVICES INC	18,700	21.480000	401,676.00	
	QUEST DIAGNOSTICS INC	13,400	60.550000	811,370.00	
	RALCORP HOLDINGS INC	4,600	87.220000	401,212.00	
	RALPH LAUREN CORP	5,400	151.730000	819,342.00	
	RANGE RESOURCES CORP	14,300	59.860000	855,998.00	
	RAYTHEON COMPANY	30,800	49.710000	1,531,068.00	
	RED HAT INC	16,300	47.770000	778,651.00	
	REGIONS FINANCIAL CORP	104,300	5.320000	554,876.00	
	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,400	72.160000	317,504.00	
	REPUBLIC SERVICES INC	28,800	28.560000	822,528.00	
	REYNOLDS AMERICAN INC	30,500	40.320000	1,229,760.00	
	ROBERT HALF INTL INC	12,300	30.260000	372,198.00	
	ROCK-TENN COMPANY -CL A	6,500	61.250000	398,125.00	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	12,400	79.420000	984,808.00	
	ROCKWELL COLLINS INC	12,800	59.650000	763,520.00	
	ROPER INDUSTRIES INC	8,400	95.300000	800,520.00	
	ROSS STORES INC	19,800	52.380000	1,037,124.00	
	ROWAN COMPANIES INC	10,700	35.440000	379,208.00	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,100	28.110000	340,131.00	
	RR DONNELLEY & SONS CO	15,400	11.820000	182,028.00	
	SAFEWAY INC	31,400	22.880000	718,432.00	
	SAIC INC	24,400	12.990000	316,956.00	
	SALESFORCE.COM INC	11,000	118.140000	1,299,540.00	
	SANDISK CORP	19,900	52.360000	1,041,964.00	
	SARA LEE CORP	49,600	19.160000	950,336.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	10,200	45.080000	459,816.00	
	SCANA CORP	10,800	45.050000	486,540.00	
	SCHLUMBERGER LTD	114,700	76.190000	8,738,993.00	
	SCHWAB (CHARLES) CORP	90,600	12.140000	1,099,884.00	
	SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	7,400	45.690000	338,106.00	
	SEAGATE TECHNOLOGY	34,900	19.770000	689,973.00	
	SEALED AIR CORP	12,700	20.120000	255,524.00	
	SEARS HOLDINGS CORP	3,100	44.870000	139,097.00	
	SEI INVESTMENTS COMPANY	13,000	18.130000	235,690.00	
	SEMPRA ENERGY	20,100	57.190000	1,149,519.00	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,700	96.060000	739,662.00	
	SIGMA-ALDRICH	11,100	70.210000	779,331.00	
	SIRIUS XM RADIO INC	317,400	2.080000	660,192.00	
	SLM CORP	42,800	14.620000	625,736.00	
	SOUTHERN CO/THE	72,300	45.120000	3,262,176.00	

SOUTHWEST AIRLINES CO	15,400	9.510000	146,454.00
SOUTHWESTERN ENERGY CO	30,000	32.620000	978,600.00
SPECTRA ENERGY CORP	57,000	31.650000	1,804,050.00
SPRINT NEXTEL CORP	244,900	2.200000	538,780.00
SPX CORP	4,000	70.050000	280,200.00
ST JUDE MEDICAL INC	29,100	40.300000	1,172,730.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	14,000	72.340000	1,012,760.00
STAPLES INC	61,800	16.180000	999,924.00
STARBUCKS CORP	62,700	47.790000	2,996,433.00
STARWOOD HOTELS & RESORTS	16,500	54.770000	903,705.00
STATE STREET CORP	43,200	39.910000	1,724,112.00
STERICYCLE INC	7,500	84.170000	631,275.00
STRYKER CORP	24,300	55.060000	1,337,958.00
SUNOCO INC	10,600	38.660000	409,796.00
SUNTRUST BANKS INC	44,800	21.620000	968,576.00
SYMANTEC CORP	62,000	17.060000	1,057,720.00
SYNOPSIS INC	14,300	29.180000	417,274.00
SYSCO CORP	51,400	30.430000	1,564,102.00
T ROWE PRICE GROUP INC	21,900	60.970000	1,335,243.00
TARGET CORP	54,500	51.140000	2,787,130.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,600	16.800000	362,880.00
TE CONNECTIVITY LTD	36,000	34.680000	1,248,480.00
TERADATA CORP	13,900	54.010000	750,739.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	98,500	32.800000	3,230,800.00
TEXTRON INC	22,700	24.760000	562,052.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,800	53.540000	1,702,572.00
TIFFANY & CO	10,700	63.730000	681,911.00
TIME WARNER CABLE	28,000	69.110000	1,935,080.00
TIME WARNER INC	89,000	38.210000	3,400,690.00
TJX COMPANIES INC	32,300	67.960000	2,195,108.00
TOLL BROTHERS INC	15,200	23.230000	353,096.00
TORCHMARK CORP	10,800	45.510000	491,508.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	12,100	21.830000	264,143.00
TRAVELERS COS INC/THE	36,000	59.150000	2,129,400.00
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	9,500	39.740000	377,530.00
TYCO INTERNATIONAL LTD	40,000	49.740000	1,989,600.00
TYSON FOODS INC-CL A	24,900	18.840000	469,116.00
ULTRA PETROLEUM CORP	14,400	26.140000	376,416.00
UNION PACIFIC CORP	41,300	113.630000	4,692,919.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	6,016	20.410000	122,786.56
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	63,000	75.620000	4,764,060.00
UNITED STATES STEEL CORP	11,800	30.400000	358,720.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	73,200	77.650000	5,683,980.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	92,000	51.570000	4,744,440.00
UNUM GROUP	24,200	23.230000	562,166.00
URBAN OUTFITTERS INC	9,900	27.540000	272,646.00
URS CORP	6,100	40.660000	248,026.00
US BANCORP	163,100	28.600000	4,664,660.00
VALERO ENERGY CORP	51,000	24.650000	1,257,150.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	10,400	69.240000	720,096.00
VERISIGN INC	15,100	36.390000	549,489.00
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	10,800	40.310000	435,348.00
VERIZON COMMUNICATIONS INC	240,800	37.690000	9,075,752.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	18,400	35.460000	652,464.00
VF CORP	7,100	134.220000	952,962.00
VIACOM INC-CLASS B	45,000	48.350000	2,175,750.00
VIRGIN MEDIA INC	27,500	24.060000	661,650.00
VISA INC-CLASS A SHARES	44,100	100.560000	4,434,696.00
VMWARE INC-CLASS A	7,000	92.150000	645,050.00
VULCAN MATERIALS CO	10,800	43.270000	467,316.00
WALGREEN CO	76,200	34.690000	2,643,378.00
WAL-MART STORES INC	161,200	61.470000	9,908,964.00
WALT DISNEY CO/THE	150,700	39.560000	5,961,692.00
WALTER ENERGY INC	5,700	70.140000	399,798.00
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	11,700	16.850000	197,145.00
WASHINGTON POST-CLASS B	500	397.180000	198,590.00
WASTE MANAGEMENT INC	37,300	34.610000	1,290,953.00
WATERS CORP	7,700	87.910000	676,907.00
WATSON PHARMACEUTICALS INC	11,500	57.610000	662,515.00

WEATHERFORD INTL LTD	64,500	16.790000	1,082,955.00	
WELLPOINT INC	30,200	66.100000	1,996,220.00	
WELLS FARGO & CO	428,300	30.200000	12,934,660.00	
WESTERN DIGITAL CORP	20,900	37.400000	781,660.00	
WESTERN UNION CO	51,100	19.510000	996,961.00	
WHIRLPOOL CORP	6,500	54.890000	356,785.00	
WHITING PETROLEUM CORP	10,600	51.880000	549,928.00	
WHOLE FOODS MARKET INC	13,200	77.160000	1,018,512.00	
WILLIAMS COS INC	50,200	29.410000	1,476,382.00	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	14,400	39.000000	561,600.00	
WINDSTREAM CORP	47,600	12.220000	581,672.00	
WISCONSIN ENERGY CORP	19,500	34.560000	673,920.00	
WR BERKLEY CORP	10,500	34.880000	366,240.00	
WW GRAINGER INC	5,000	195.170000	975,850.00	
WYNN RESORTS LTD	7,000	120.420000	842,940.00	
XCEL ENERGY INC	40,800	27.080000	1,104,864.00	
XEROX CORP	122,900	7.810000	959,849.00	
XILINX INC	23,300	35.520000	827,616.00	
XL GROUP PLC	25,500	20.730000	528,615.00	
XYLEM INC	14,800	26.600000	393,680.00	
YAHOO! INC	101,400	15.560000	1,577,784.00	
YUM! BRANDS INC	40,200	62.650000	2,518,530.00	
ZIMMER HOLDINGS INC	16,500	57.750000	952,875.00	
アメリカドル 小計	25,733,416		1,042,212,891.56 (81,063,318,705)	
カナダドル				
AGNICO-EAGLE MINES LTD	15,100	37.760000	570,176.00	
AGRIUM INC	13,400	81.020000	1,085,668.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	10,800	30.420000	328,536.00	
ARC RESOURCES LTD	24,300	24.060000	584,658.00	
ATHABASCA OIL SANDS CORP	27,000	11.480000	309,960.00	
BANK OF MONTREAL	55,100	60.690000	3,344,019.00	
BANK OF NOVA SCOTIA	92,100	53.520000	4,929,192.00	
BARRICK GOLD CORP	84,900	48.600000	4,126,140.00	
BAYTEX ENERGY CORP	10,700	58.560000	626,592.00	
BCE INC	23,300	40.950000	954,135.00	
BOMBARDIER INC-B	126,300	4.810000	607,503.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	47,400	30.810000	1,460,394.00	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	20,800	17.960000	373,568.00	
CAE INC	26,500	11.040000	292,560.00	
CAMECO CORP	33,600	23.850000	801,360.00	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	34,800	76.880000	2,675,424.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	39,000	76.740000	2,992,860.00	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	94,200	40.300000	3,796,260.00	
CANADIAN OIL SANDS LTD	42,600	24.980000	1,064,148.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	14,200	71.650000	1,017,430.00	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	6,500	62.810000	408,265.00	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	8,000	60.400000	483,200.00	
CENOVUS ENERGY INC	65,600	36.470000	2,392,432.00	
CENTERRA GOLD INC	15,400	20.280000	312,312.00	
CGI GROUP INC - CLASS A	21,200	19.320000	409,584.00	
CI FINANCIAL CORP	16,900	21.130000	357,097.00	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	22,600	46.170000	1,043,442.00	
ELDORADO GOLD CORP	45,600	14.130000	644,328.00	
ENBRIDGE INC	64,500	37.210000	2,400,045.00	
ENCANA CORP	63,400	20.750000	1,315,550.00	
ENERPLUS CORP	16,700	23.890000	398,963.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,700	422.270000	717,859.00	
FINNING INTERNATIONAL INC	17,500	26.570000	464,975.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	41,000	23.950000	981,950.00	
FORTIS INC	17,000	33.360000	567,120.00	
FRANCO-NEVADA CORP	11,400	42.940000	489,516.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,600	22.450000	260,420.00	
GOLDCORP INC	68,300	47.710000	3,258,593.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	25,400	22.520000	572,008.00	
HUSKY ENERGY INC	28,700	24.280000	696,836.00	
IAMGOLD CORP	32,500	17.040000	553,800.00	
IGM FINANCIAL INC	9,900	44.820000	443,718.00	
IMPERIAL OIL LTD	26,800	47.710000	1,278,628.00	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	8,800	27.550000	242,440.00	

INMET MINING CORPORATION	4,500	67.890000	305,505.00	
INTACT FINANCIAL CORP	11,400	58.070000	661,998.00	
IVANHOE MINES LTD	22,800	17.670000	402,876.00	
KINROSS GOLD CORP	95,400	11.300000	1,078,020.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	10,600	37.460000	397,076.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	18,600	42.650000	793,290.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	152,800	12.550000	1,917,640.00	
MEG ENERGY CORP	11,500	44.500000	511,750.00	
METRO INC -A	8,900	51.900000	461,910.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	14,800	76.740000	1,135,752.00	
NEW GOLD INC	34,900	11.110000	387,739.00	
NEXEN INC	43,700	18.400000	804,080.00	
NIKO RESOURCES LTD	3,700	51.870000	191,919.00	
ONEX CORPORATION	8,800	36.380000	320,144.00	
OPEN TEXT CORP	5,700	51.670000	294,519.00	
OSISKO MINING CORP	33,500	11.800000	395,300.00	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	21,900	25.050000	548,595.00	
PAN AMERICAN SILVER CORP	8,800	22.480000	197,824.00	
PEMBINA PIPELINE CORP	15,700	26.620000	417,934.00	
PENN WEST PETROLEUM LTD	41,900	21.960000	920,124.00	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	73,500	45.480000	3,342,780.00	
POWER CORP OF CANADA	30,900	25.500000	787,950.00	
POWER FINANCIAL CORP	21,300	27.360000	582,768.00	
PRECISION DRILLING CORP	21,300	10.220000	217,686.00	
PROGRESS ENERGY RESOURCES CO	18,600	11.120000	206,832.00	
RESEARCH IN MOTION	40,600	16.400000	665,840.00	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	9,600	23.680000	227,328.00	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	35,200	39.210000	1,380,192.00	
ROYAL BANK OF CANADA	122,000	53.230000	6,494,060.00	
SAPUTO INC	13,600	40.100000	545,360.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	30,900	19.900000	614,910.00	
SHOPPERS DRUG MART CORP	19,800	41.510000	821,898.00	
SILVER WHEATON CORP	30,400	34.670000	1,053,968.00	
SINO-FOREST CORP	16,800			
SNC-LAVALIN GROUP INC	12,500	52.750000	659,375.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	47,600	21.110000	1,004,836.00	
SUNCOR ENERGY INC	136,600	34.430000	4,703,138.00	
TALISMAN ENERGY INC	90,300	12.250000	1,106,175.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	50,200	42.470000	2,131,994.00	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	13,800	53.480000	738,024.00	
THOMSON REUTERS CORP	33,700	28.900000	973,930.00	
TIM HORTONS INC	13,700	48.980000	671,026.00	
TMX GROUP INC	8,100	42.200000	341,820.00	
TORONTO-DOMINION BANK	75,500	78.730000	5,944,115.00	
TOURMALINE OIL CORP	11,600	24.950000	289,420.00	
TRANSALTA CORP	21,300	20.210000	430,473.00	
TRANSCANADA CORP	60,100	41.790000	2,511,579.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	24,800	50.960000	1,263,808.00	
VERMILION ENERGY INC	8,500	45.100000	383,350.00	
VITERRA INC	30,900	10.410000	321,669.00	
WESTON (GEORGE) LTD	4,500	65.530000	294,885.00	
YAMANA GOLD INC	62,100	16.980000	1,054,458.00	
カナダドル 小計	3,243,300		106,543,306.00	(8,248,582,750)
オーストラリアドル				
AGL ENERGY LTD	37,010	14.560000	538,865.60	
ALUMINA LTD	211,345	1.295000	273,691.77	
AMCOR LIMITED	111,277	7.020000	781,164.54	
AMP LTD	247,942	4.330000	1,073,588.86	
ASCIANO LTD	80,533	4.730000	380,921.09	
ASX LTD	16,674	30.460000	507,890.04	
AUST AND NZ BANKING GROUP	223,604	21.420000	4,789,597.68	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	31,612	8.270000	261,431.24	
BHP BILLITON LTD	273,261	37.420000	10,225,426.62	
BORAL LTD	58,154	4.180000	243,083.72	
BRAMBLES LTD	129,111	7.360000	950,256.96	
CALTEX AUSTRALIA LTD	12,898	12.200000	157,355.60	
CAMPBELL BROTHERS LTD	4,449	49.830000	221,693.67	
COCA-COLA AMATIL LTD	47,686	11.580000	552,203.88	
COCHLEAR LTD	4,643	60.260000	279,787.18	

COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	132,461	51.000000	6,755,511.00	
COMPUTERSHARE LTD	38,258	7.790000	298,029.82	
CROWN LTD	38,746	8.180000	316,942.28	
CSL LTD	45,445	30.960000	1,406,977.20	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	70,424	3.630000	255,639.12	
FAIRFAX MEDIA LTD	152,684	0.760000	116,039.84	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,021	4.860000	554,142.06	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	44,167	2.030000	89,659.01	
ILUKA RESOURCES LTD	37,926	18.000000	682,668.00	
INCITEC PIVOT LTD	137,980	3.220000	444,295.60	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	190,803	2.930000	559,052.79	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	35,024	7.350000	257,426.40	
LEIGHTON HOLDINGS LTD	11,861	23.370000	277,191.57	
LEND LEASE GROUP	51,495	7.600000	391,362.00	
LYNAS CORP LTD	130,000	1.345000	174,850.00	
MACQUARIE GROUP LTD	27,865	25.570000	712,508.05	
METCASH LTD	58,721	4.050000	237,820.05	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	189,906	24.200000	4,595,725.20	
NEWCREST MINING LTD	64,561	33.150000	2,140,197.15	
ONESTEEL LTD	144,601	0.835000	120,741.83	
ORICA LTD	30,097	24.900000	749,415.30	
ORIGIN ENERGY LTD	92,208	13.830000	1,275,236.64	
OZ MINERALS LTD	26,401	11.030000	291,203.03	
QANTAS AIRWAYS LTD	84,658	1.595000	135,029.51	
QBE INSURANCE GROUP LTD	97,151	11.780000	1,144,438.78	
QR NATIONAL LTD	141,692	3.670000	520,009.64	
RIO TINTO LTD	37,054	68.350000	2,532,640.90	
SANTOS LTD	83,554	13.630000	1,138,841.02	
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	17,784	14.990000	266,582.16	
SONIC HEALTHCARE LTD	35,560	11.340000	403,250.40	
SUNCORP LTD	108,392	8.360000	906,157.12	
TABCORP HOLDINGS LTD	76,696	2.900000	222,418.40	
TATTS GROUP LTD	107,000	2.490000	266,430.00	
TELSTRA CORP LTD	371,349	3.340000	1,240,305.66	
TOLL HOLDINGS LTD	72,022	4.990000	359,389.78	
TRANSURBAN GROUP	110,181	5.540000	610,402.74	
WESFARMERS LTD	85,180	30.380000	2,587,768.40	
WESTPAC BANKING CORP	261,635	21.300000	5,572,825.50	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	55,910	33.970000	1,899,262.70	
WOOLWORTHS LTD	106,039	24.910000	2,641,431.49	
WORLEYPARSONS LTD	17,576	27.750000	487,734.00	
オーストラリアドル 小計	5,225,287		66,874,510.59 (5,515,140,888)	
イギリスポンド				
3I GROUP PLC	85,351	1.850000	157,899.35	
ADMIRAL GROUP PLC	15,622	9.030000	141,066.66	
AGGREKO PLC	24,010	20.790000	499,167.90	
AMEC PLC	29,954	10.080000	301,936.32	
ANGLO AMERICAN PLC	111,584	26.545000	2,961,997.28	
ANTOFAGASTA PLC	33,706	13.560000	457,053.36	
ARM HOLDINGS PLC	114,182	5.975000	682,237.45	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	33,124	11.600000	384,238.40	
ASTRAZENECA PLC	115,964	30.350000	3,519,507.40	
AVIVA PLC	244,203	3.544000	865,455.43	
BABCOCK INTL GROUP PLC	28,798	7.400000	213,105.20	
BAE SYSTEMS PLC	288,260	3.146000	906,865.96	
BALFOUR BEATTY PLC	53,446	2.803000	149,809.13	
BARCLAYS PLC	992,338	2.172500	2,155,854.30	
BG GROUP PLC	290,029	14.585000	4,230,072.96	
BHP BILLITON PLC	179,439	21.290000	3,820,256.31	
BP PLC	1,615,663	4.745500	7,667,128.76	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	168,583	29.390000	4,954,654.37	
BRITISH SKY BROADCASTING GRO	101,381	6.725000	681,787.22	
BT GROUP PLC	677,547	2.074000	1,405,232.47	
BUNZL PLC	27,504	8.555000	235,296.72	
BURBERRY GROUP PLC	35,037	13.140000	460,386.18	
CAIRN ENERGY PLC	128,607	2.823000	363,057.56	
CAPITA PLC	53,759	6.445000	346,476.75	
CARNIVAL PLC	15,012	19.430000	291,683.16	
CENTRICA PLC	441,320	2.885000	1,273,208.20	

COBHAM PLC	103,941	1.868000	194,161.78
COMPASS GROUP PLC	163,156	5.990000	977,304.44
DIAGEO PLC	213,198	14.180000	3,023,147.64
ESSAR ENERGY PLC	29,117	1.360000	39,599.12
EURASIAN NATURAL RESOURCES	23,840	7.315000	174,389.60
EXPERIAN PLC	84,802	8.765000	743,289.53
FRESNILLO PLC	16,470	17.430000	287,072.10
G4S PLC	116,629	2.698000	314,665.04
GKN PLC	127,117	2.100000	266,945.70
GLAXOSMITHKLINE PLC	431,568	14.260000	6,154,159.68
GLENCORE INTERNATIONAL PLC	74,478	4.184500	311,653.19
HSBC HOLDINGS PLC	1,520,558	5.370000	8,165,396.46
ICAP PLC	41,055	3.327000	136,589.98
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	86,411	22.630000	1,955,480.93
INMARSAT PLC	35,299	4.120000	145,431.88
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	25,065	13.250000	332,111.25
INTERNATIONAL POWER PLC	129,564	3.247000	420,694.30
INTERTEK GROUP PLC	12,257	21.240000	260,338.68
INVENSYS PLC	62,894	2.005000	126,102.47
INVESTEC PLC	37,700	3.767000	142,015.90
ITV PLC	344,995	0.752000	259,436.24
JOHNSON MATTHEY PLC	19,786	20.100000	397,698.60
KAZAKHMYS PLC	18,604	11.130000	207,062.52
KINGFISHER PLC	198,111	2.584000	511,918.82
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	501,914	1.172000	588,243.20
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,491,831	0.309250	1,079,848.73
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	14,437	8.675000	125,240.97
LONMIN PLC	12,600	10.430000	131,418.00
MAN GROUP PLC	176,311	1.180000	208,046.98
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,418	3.294000	446,066.89
MEGGITT PLC	57,941	3.694000	214,034.05
NATIONAL GRID PLC	307,215	6.190000	1,901,660.85
NEXT PLC	15,338	25.890000	397,100.82
OLD MUTUAL PLC	482,967	1.443000	696,921.38
PEARSON PLC	71,201	11.800000	840,171.80
PETROFAC LTD	23,743	14.390000	341,661.77
PRUDENTIAL PLC	217,181	7.045000	1,530,040.14
RANDGOLD RESOURCES LTD	8,031	68.250000	548,115.75
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	52,803	33.650000	1,776,820.95
REED ELSEVIER PLC	100,701	5.360000	539,757.36
RESOLUTION LTD	116,321	2.723000	316,742.08
REXAM PLC	80,847	3.825000	309,239.77
RIO TINTO PLC	119,583	37.115000	4,438,323.04
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	161,122	7.390000	1,190,691.58
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	1,466,953	0.267500	392,409.92
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	308,929	22.780000	7,037,402.62
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	228,494	23.560000	5,383,318.64
RSA INSURANCE GROUP PLC	305,788	1.076000	329,027.88
SABMILLER PLC	82,088	23.920000	1,963,544.96
SAGE GROUP PLC/THE	104,276	3.052000	318,250.35
SAINSBURY (J) PLC	99,565	2.897000	288,439.80
SCHRODERS PLC	11,625	14.720000	171,120.00
SERCO GROUP PLC	40,290	5.125000	206,486.25
SEVERN TRENT PLC	22,255	15.200000	338,276.00
SHIRE PLC	47,891	21.130000	1,011,936.83
SMITH & NEPHEW PLC	79,803	6.055000	483,207.16
SMITHS GROUP PLC	32,971	9.780000	322,456.38
SSE PLC	78,299	12.240000	958,379.76
STANDARD CHARTERED PLC	202,600	15.530000	3,146,378.00
STANDARD LIFE PLC	199,724	2.167000	432,801.90
TATE & LYLE PLC	37,539	6.760000	253,763.64
TESCO PLC	679,460	3.228500	2,193,636.61

(単位:円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
イギリスポンド					
	TUI TRAVEL PLC	48,761	1.907000	92,987.22	
	TULLOW OIL PLC	78,564	13.880000	1,090,468.32	
	UNILEVER PLC	109,456	20.500000	2,243,848.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	56,530	6.010000	339,745.30	
	VEDANTA RESOURCES PLC	11,069	11.520000	127,514.88	
	VODAFONE GROUP PLC	4,325,502	1.745500	7,550,163.74	
	WEIR GROUP PLC/THE	17,581	19.640000	345,290.84	
	WHITBREAD PLC	14,119	16.800000	237,199.20	
	WM MORRISON SUPERMARKETS	189,293	2.957000	559,739.40	
	WOLSELEY PLC	24,633	21.850000	538,231.05	
	WPP PLC	109,590	7.490000	820,829.10	
	XSTRATA PLC	174,666	10.790000	1,884,646.14	
	イギリスポンド 小計	25,156,857		123,353,746.65 (15,019,552,192)	
スイスフラン					
	ABB LTD-REG	186,388	19.340000	3,604,743.92	
	ACTELION LTD-REG	8,929	35.320000	315,372.28	
	ADECCO SA-REG	11,687	43.900000	513,059.30	
	ARYZTA AG	7,350	40.550000	298,042.50	
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,043	70.350000	284,425.05	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	44,651	52.400000	2,339,712.40	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	97,254	24.270000	2,360,354.58	
	GAM HOLDING AG	20,607	11.600000	239,041.20	
	GEBERIT AG-REG	3,662	190.000000	695,780.00	
	GIVAUDAN-REG	733	865.000000	634,045.00	
	HOLCIM LTD-REG	22,270	55.050000	1,225,963.50	
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,368	38.900000	714,515.20	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,269	115.300000	607,515.70	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	10	31,470.000000	314,700.00	
	LONZA GROUP AG-REG	3,916	53.150000	208,135.40	
	NESTLE SA-REG	282,264	53.600000	15,129,350.40	
	NOVARTIS AG-REG	199,379	50.700000	10,108,515.30	
	PARGESA HOLDING SA-BR	2,257	64.050000	144,560.85	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	60,148	160.000000	9,623,680.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,250	107.600000	242,100.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,476	108.000000	483,408.00	
	SGS SA-REG	491	1,641.000000	805,731.00	
	SIKA AG-BR	182	1,920.000000	349,440.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,590	95.650000	439,033.50	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	635	164.100000	104,203.50	
	SULZER AG-REG	2,458	113.900000	279,966.20	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	2,608	389.000000	1,014,512.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,882	68.700000	266,693.40	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,956	92.750000	274,169.00	
	SWISS RE AG	29,348	51.500000	1,511,422.00	
	SWISSCOM AG-REG	2,168	359.700000	779,829.60	
	SYNGENTA AG-REG	7,990	286.400000	2,288,336.00	
	SYNTHES INC-144A/REGS	5,576	156.800000	874,316.80	
	TRANSOCEAN LTD	28,410	42.840000	1,217,084.40	
	UBS AG-REG	312,729	12.720000	3,977,912.88	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	12,312	227.400000	2,799,748.80	
	スイスフラン 小計	1,402,246		67,069,419.66 (5,654,622,771)	
香港ドル					
	AIA GROUP LTD	723,000	25.850000	18,689,550.00	
	BANK OF EAST ASIA	143,820	31.000000	4,458,420.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	338,500	20.650000	6,990,025.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	105,000	14.680000	1,541,400.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	118,000	104.000000	12,272,000.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	38,000	42.750000	1,624,500.00	
	CLP HOLDINGS LTD	166,000	62.750000	10,416,500.00	
	FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	159,000	5.070000	806,130.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	75,000	48.150000	3,611,250.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	213,000	26.200000	5,580,600.00	
	HANG SENG BANK LTD	68,400	99.400000	6,798,960.00	

HENDERSON LAND DEVELOPMENT	78,000	42.500000	3,315,000.00	
HONG KONG & CHINA GAS	425,893	18.280000	7,785,324.04	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	89,900	131.700000	11,839,830.00	
HOPEWELL HOLDINGS LTD	55,500	20.250000	1,123,875.00	
HUTCHISON WHAMPOA LTD	185,000	73.050000	13,514,250.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	51,000	30.100000	1,535,100.00	
KERRY PROPERTIES LTD	57,000	28.900000	1,647,300.00	
LI & FUNG LTD	504,000	17.200000	8,668,800.00	
LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	68,000	17.680000	1,202,240.00	
MTR CORP	148,000	25.400000	3,759,200.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	342,000	8.100000	2,770,200.00	
NWS HOLDINGS LTD	106,500	11.760000	1,252,440.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	15,500	43.900000	680,450.00	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	124,000	53.300000	6,609,200.00	
SANDS CHINA LTD	224,000	25.300000	5,667,200.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	116,000	16.120000	1,869,920.00	
SINO LAND CO	257,400	12.480000	3,212,352.00	
SJM HOLDINGS LTD	133,000	13.160000	1,750,280.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	127,000	109.100000	13,855,700.00	
SWIRE PACIFIC LTD-A	64,000	79.100000	5,062,400.00	
WHARF HOLDINGS LTD	139,000	42.900000	5,963,100.00	
WHEELLOCK & CO LTD	83,000	23.850000	1,979,550.00	
WING HANG BANK LTD	15,500	69.200000	1,072,600.00	
WYNN MACAU LTD	135,200	19.400000	2,622,880.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	60,000	25.000000	1,500,000.00	
香港ドル 小計	5,752,113		183,048,526.04 (1,834,146,230)	
シンガポールドル				
CAPITALAND LTD	232,000	2.580000	598,560.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	43,000	10.110000	434,730.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	187,000	1.450000	271,150.00	
COSCO CORP SINGAPORE LTD	86,000	1.185000	101,910.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	159,000	13.240000	2,105,160.00	
FRASER AND NEAVE LTD	88,000	6.530000	574,640.00	
GENTING SINGAPORE PLC	512,000	1.635000	837,120.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	196,000	1.935000	379,260.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	657,360	0.730000	479,872.80	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	50.110000	400,880.00	
KEPPEL CORP LTD	129,000	10.690000	1,379,010.00	
KEPPEL LAND LTD	84,000	2.870000	241,080.00	
NEPTUNE ORIENT LINES LTD	98,000	1.330000	130,340.00	
NOBLE GROUP LTD	374,090	1.355000	506,891.95	
OLAM INTERNATIONAL LTD	117,000	2.640000	308,880.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	229,000	8.490000	1,944,210.00	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	102,000	4.750000	484,500.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	48,340	11.000000	531,740.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	77,000	6.500000	500,500.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	146,250	3.670000	536,737.50	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	151,000	2.850000	430,350.00	
SINGAPORE TELECOM LTD	686,260	3.030000	2,079,367.80	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	114,000	17.400000	1,983,600.00	
UOL GROUP LTD	49,000	4.260000	208,740.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	162,000	5.400000	874,800.00	
シンガポールドル 小計	4,735,300		18,324,030.05 (1,132,608,297)	
ニュージーランドドル				
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	81,688	2.510000	205,036.88	
CONTACT ENERGY LTD	15,339	4.770000	73,167.03	
FLETCHER BUILDING LTD	42,857	6.350000	272,141.95	
SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	49,774	3.560000	177,195.44	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	138,786	2.135000	296,308.11	
ニュージーランドドル 小計	328,444		1,023,849.41 (65,116,822)	
スウェーデンクローネ				
ALFA LAVAL AB	27,920	138.600000	3,869,712.00	
ASSA ABLOY AB-B	25,670	181.900000	4,669,373.00	
ATLAS COPCO AB-A SHS	56,979	161.200000	9,185,014.80	
ATLAS COPCO AB-B SHS	31,597	144.000000	4,549,968.00	
BOLIDEN AB	24,756	116.500000	2,884,074.00	
ELECTROLUX AB-SER B	22,535	125.400000	2,825,889.00	

ERICSSON LM-B SHS	259,246	58.850000	15,256,627.10	
GETINGE AB-B SHS	17,017	179.500000	3,054,551.50	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	86,159	224.200000	19,316,847.80	
HEXAGON AB-B SHS	21,156	116.900000	2,473,136.40	
HOLMEN AB-B SHARES	4,448	200.500000	891,824.00	
HUSQVARNA AB-B SHS	43,159	37.650000	1,624,936.35	
INVESTOR AB-B SHS	38,062	137.100000	5,218,300.20	
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	18,921	140.300000	2,654,616.30	
LUNDIN PETROLEUM AB	18,976	152.800000	2,899,532.80	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	7,049	690.000000	4,863,810.00	
MODERN TIMES GROUP-B SHS	3,572	332.300000	1,186,975.60	
NORDEA BANK AB	229,047	57.300000	13,124,393.10	
RATOS AB-B SHS	15,854	88.700000	1,406,249.80	
SANDVIK AB	87,003	98.000000	8,526,294.00	
SCANIA AB-B SHS	27,270	116.100000	3,166,047.00	
SECURITAS AB-B SHS	26,395	63.700000	1,681,361.50	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	118,838	42.750000	5,080,324.50	
SKANSKA AB-B SHS	37,022	117.100000	4,335,276.20	
SKF AB-B SHARES	32,473	157.900000	5,127,486.70	
SSAB AB-A SHARES	12,259	72.800000	892,455.20	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	46,824	112.800000	5,281,747.20	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	41,771	200.000000	8,354,200.00	
SWEDBANK AB - A SHARES	69,311	97.950000	6,789,012.45	
SWEDISH MATCH AB	20,240	235.400000	4,764,496.00	
TELE2 AB-B SHS	29,407	128.600000	3,781,740.20	
TELIASONERA AB	188,326	44.760000	8,429,471.76	
VOLVO AB-B SHS	115,864	87.100000	10,091,754.40	
スウェーデンクローネ 小計	1,805,126		178,257,498.86 (2,057,091,536)	
ノルウェークローネ				
AKER SOLUTIONS ASA	15,085	71.050000	1,071,789.25	
DNB ASA	88,813	61.150000	5,430,914.95	
NORSK HYDRO ASA	80,019	30.800000	2,464,585.20	
ORKLA ASA	72,595	46.240000	3,356,792.80	
SEADRILL LTD	28,484	211.900000	6,035,759.60	
STATOIL ASA	95,301	148.200000	14,123,608.20	
SUBSEA 7 SA	25,563	118.200000	3,021,546.60	
TELENOR ASA	64,472	92.000000	5,931,424.00	
YARA INTERNATIONAL ASA	15,375	243.000000	3,736,125.00	
ノルウェークローネ 小計	485,707		45,172,545.60 (600,794,856)	
デンマーククローネ				
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	56	38,480.000000	2,154,880.00	
AP MOELLER-MAERSK A/S-B	105	40,240.000000	4,225,200.00	
CARLSBERG AS-B	8,712	415.000000	3,615,480.00	
COLOPLAST-B	2,027	833.500000	1,689,504.50	
DANSKE BANK A/S	58,410	83.850000	4,897,678.50	
DSV A/S	18,500	114.500000	2,118,250.00	
NOVO NORDISK A/S-B	36,505	672.000000	24,531,360.00	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	19,190	157.400000	3,020,506.00	
TDC A/S	30,000	43.840000	1,315,200.00	
TRYG A/S	2,468	309.000000	762,612.00	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	18,414	63.450000	1,168,368.30	
WILLIAM DEMANT HOLDING	2,242	464.800000	1,042,081.60	
デンマーククローネ 小計	196,629		50,541,120.90 (692,413,356)	
イスラエルシェケル				
BANK HAPOLIM BM	103,230	12.880000	1,329,602.40	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	114,273	11.940000	1,364,419.62	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	174,078	6.447000	1,122,280.86	
ELBIT SYSTEMS LTD	3,000	156.300000	468,900.00	
ISRAEL CHEMICALS LTD	43,756	39.430000	1,725,299.08	
ISRAEL CORP LIMITED/THE	227	2,240.000000	508,480.00	
NICE SYSTEMS LTD	5,776	134.400000	776,294.40	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	80,845	173.500000	14,026,607.50	
イスラエルシェケル 小計	525,185		21,321,883.86 (439,657,245)	
ユーロ				
A2A SPA	101,437	0.701500	71,158.05	
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	37,191	12.940000	481,251.54	

ACCIONA SA	2,042	61.050000	124,664.10
ACCOR SA	12,412	22.400000	278,028.80
ACERINOX SA	7,250	10.905000	79,061.25
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11,624	22.705000	263,922.92
ADIDAS AG	18,339	55.220000	1,012,679.58
ADP	3,469	56.590000	196,310.71
AEGON NV	143,678	3.810000	547,413.18
AGEAS	208,984	1.455000	304,071.72
AIR LIQUIDE SA	23,951	95.650000	2,290,913.15
AKZO NOBEL	19,408	40.255000	781,269.04
ALCATEL-LUCENT	185,432	1.381000	256,081.59
ALLIANZ SE-REG	38,427	84.900000	3,262,452.30
ALSTOM	16,380	28.360000	464,536.80
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	29,648	12.780000	378,901.44
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	68,868	47.200000	3,250,569.60
ARCELORMITTAL	72,650	16.110000	1,170,391.50
ARKEMA	4,273	60.130000	256,935.49
ASML HOLDING NV	36,585	32.955000	1,205,658.67
ASSICURAZIONI GENERALI	98,437	12.350000	1,215,696.95
ATLANTIA SPA	26,976	12.170000	328,297.92
ATOS	4,454	36.745000	163,662.23
AUTOGRILL SPA	15,022	8.125000	122,053.75
AXA SA	148,151	11.940000	1,768,922.94
BANCA CARIGE SPA	50,410	1.540000	77,631.40
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	432,224	0.293200	126,728.07
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	389,716	6.799000	2,649,679.08
BANCO DE SABADELL SA	100,620	2.935000	295,319.70
BANCO POPOLARE SCARL	130,709	1.185000	154,890.16
BANCO POPULAR ESPANOL	87,695	3.413000	299,303.03
BANCO SANTANDER SA	722,536	6.019000	4,348,944.18
BANKINTER SA	20,449	5.250000	107,357.25
BASF SE	78,785	59.250000	4,668,011.25
BAYER AG-REG	70,485	52.660000	3,711,740.10
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,064	63.590000	1,784,589.76
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,986	41.850000	208,664.10
BEIERSDORF AG	8,500	45.435000	386,197.50
BEKAERT NV	2,836	32.005000	90,766.18
BELGACOM SA	13,508	23.700000	320,139.60
BNP PARIBAS	84,077	35.790000	3,009,115.83
BOSKALIS WESTMINSTER	5,800	29.965000	173,797.00
BOUYGUES SA	16,855	24.010000	404,688.55
BRENNTAG AG	2,707	79.100000	214,123.70
BUREAU VERITAS SA	5,275	55.640000	293,501.00
CAIXABANK	64,431	3.970000	255,791.07
CAP GEMINI	12,392	27.500000	340,780.00
CARREFOUR SA	48,880	16.890000	825,583.20
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,810	68.290000	328,474.90
CELESIO AG	6,516	14.305000	93,211.38
CHRISTIAN DIOR	4,613	105.850000	488,286.05
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	12,695	20.930000	265,706.35
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	23,315	5.061000	117,997.21
CNP ASSURANCES	11,531	10.940000	126,149.14
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	20,683	14.900000	308,176.70
COLRUYT SA	5,864	29.330000	171,991.12
COMMERZBANK AG	322,417	1.895000	610,980.21
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	35,017	34.470000	1,207,035.99
CONTINENTAL AG	7,088	60.110000	426,059.68
CREDIT AGRICOLE SA	82,083	4.930000	404,669.19
CRH PLC	61,544	15.390000	947,162.16
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	76,731	41.970000	3,220,400.07
DANONE	49,830	47.365000	2,360,197.95
DASSAULT SYSTEMES SA	5,100	62.840000	320,484.00
DELHAIZE GROUP	9,243	41.810000	386,449.83
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	78,567	33.040000	2,595,853.68
DEUTSCHE BOERSE AG-NEW	17,338	43.545000	754,983.21
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	20,804	10.355000	215,425.42
DEUTSCHE POST AG-REG	74,755	12.520000	935,932.60
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	243,248	8.693000	2,114,554.86
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	45,659	3.652000	166,746.66

E.ON AG	151,929	15.905000	2,416,430.74
EADS NV	35,496	25.810000	916,151.76
EDENRED	12,975	18.795000	243,865.12
EDF	19,286	17.115000	330,079.89
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	165,382	2.211000	365,659.60
EIFFAGE	2,991	23.220000	69,451.02
ELAN CORP PLC	42,186	10.535000	444,429.51
ELISA OYJ	14,934	15.880000	237,151.92
ENAGAS SA	18,125	14.780000	267,887.50
ENEL GREEN POWER SPA	136,769	1.528000	208,983.03
ENEL SPA	547,641	3.048000	1,669,209.76
ENI SPA	207,351	16.830000	3,489,717.33
ERSTE GROUP BANK AG	15,734	16.030000	252,216.02
ESSILOR INTERNATIONAL	17,413	56.510000	984,008.63
EURAZEO	2,642	34.505000	91,162.21
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,804	28.710000	252,762.84
EXOR SPA	5,660	17.400000	98,484.00
FERROVIAL SA	34,016	9.005000	306,314.08
FIAT INDUSTRIAL	66,053	7.940000	524,460.82
FIAT SPA	69,726	4.564000	318,229.46
FINMECCANICA SPA	31,249	3.540000	110,621.46
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	6,314	18.580000	117,314.12
FORTUM OYJ	38,342	16.070000	616,155.94
FRANCE TELECOM SA	160,934	11.200000	1,802,460.80
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	18,038	54.020000	974,412.76
FRESENIUS SE & CO KGAA	9,634	78.000000	751,452.00
FUGRO NV-CVA	6,062	48.945000	296,704.59
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	20,637	12.880000	265,804.56
GAS NATURAL SDG SA	31,713	12.540000	397,681.02
GDF SUEZ	105,811	20.540000	2,173,357.94
GEA GROUP AG	16,974	24.290000	412,298.46
GRIFOLS SA	10,838	13.850000	150,106.30
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	7,092	55.900000	396,442.80
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	48,434	5.988000	290,022.79
HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	5,200	40.635000	211,302.00
HEIDELBERGCEMENT AG	11,630	38.000000	441,940.00
HEINEKEN HOLDING NV	9,660	31.200000	301,392.00
HEINEKEN NV	22,830	35.850000	818,455.50
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	39,080	3.080000	120,366.40
HENKEL AG & CO KGAA	11,849	39.345000	466,198.90
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	14,917	47.220000	704,380.74
HOCHTIEF AG	4,352	50.480000	219,688.96
IBERDROLA SA	330,325	4.463000	1,474,240.47
ILIAD SA	2,132	90.710000	193,393.72
IMERYS SA	2,595	41.860000	108,626.70
IMMOFINANZ AG	84,750	2.390000	202,552.50
INDITEX	18,558	67.070000	1,244,685.06
INDRA SISTEMAS SA	7,291	10.535000	76,810.68
INFINEON TECHNOLOGIES AG	88,747	6.986000	619,986.54
ING GROEP NV-CVA	324,386	6.900000	2,238,263.40
INTESA SANPAOLO	863,491	1.448000	1,250,334.96
INTESA SANPAOLO-RSP	65,939	1.117000	73,653.86
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	69,461	2.060000	143,089.66
IRISH BANK RESOLUTION CORPOR	47,248		
JERONIMO MARTINS	21,139	12.860000	271,847.54
K+S AG-REG	14,506	36.785000	533,603.21
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	8,737	40.245000	351,620.56
KBC GROEP NV	14,084	14.075000	198,232.30
KERRY GROUP PLC-A	13,581	27.950000	379,588.95
KESKO OYJ-B SHS	5,314	27.430000	145,763.02
KONE OYJ-B	12,856	40.200000	516,811.20
KONINKLIJKE AHOLD NV	103,450	10.235000	1,058,810.75
KONINKLIJKE DSM NV	13,269	39.800000	528,106.20
KONINKLIJKE KPN NV	126,584	8.152000	1,031,912.76
KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRON	87,248	15.375000	1,341,438.00
LAFARGE SA	16,831	30.965000	521,171.91
LAGARDERE S.C.A.	9,629	21.775000	209,671.47
LANXESS AG	6,956	48.390000	336,600.84
LEGRAND SA	20,557	26.775000	550,413.67

LINDE AG	14,475	117.900000	1,706,602.50
L'OREAL	20,362	80.610000	1,641,380.82
LUXOTTICA GROUP SPA	9,901	24.690000	244,455.69
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	21,659	121.050000	2,621,821.95
MAN SE	5,649	79.710000	450,281.79
MAPFRE SA	76,775	2.545000	195,392.37
MEDIASET SPA	58,500	2.246000	131,391.00
MEDIOBANCA SPA	47,627	4.914000	234,039.07
MERCK KGAA	5,442	77.400000	421,210.80
METRO AG	11,047	29.160000	322,130.52
METSO OYJ	10,105	32.420000	327,604.10
MICHELIN (CGDE)-B	16,164	52.380000	846,670.32
MOBISTAR SA	2,475	37.975000	93,988.12
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	15,653	99.610000	1,559,195.33
NATIXIS	79,227	2.352000	186,341.90
NEOPOST SA	2,514	54.230000	136,334.22
NESTE OIL OYJ	13,107	8.785000	115,144.99
NOKIA OYJ	318,919	4.056000	1,293,535.46
NOKIAN RENKAAT OYJ	8,978	27.590000	247,703.02
OMV AG	15,844	25.480000	403,705.12
OPAP SA	23,661	7.380000	174,618.18
ORION OYJ-CLASS B	7,072	14.710000	104,029.12
PERNOD-RICARD SA	17,023	73.990000	1,259,531.77
PEUGEOT SA	13,862	14.585000	202,177.27
PIRELLI & C.	17,226	7.155000	123,252.03
POHJOLA BANK PLC-A SHS	11,086	8.440000	93,565.84
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	13,067	47.385000	619,179.79
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	62,476	4.024000	251,403.42
PPR	6,272	118.200000	741,350.40
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	8,983	17.635000	158,415.20
PRYSMIAN SPA	16,699	11.440000	191,036.56
PUBLICIS GROUPE	13,425	38.500000	516,862.50
QIAGEN N.V.	19,850	12.530000	248,720.50
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	3,565	24.305000	86,647.32
RANDSTAD HOLDING NV	9,474	26.000000	246,324.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	9,508	34.700000	329,927.60
REED ELSEVIER NV	62,145	9.195000	571,423.27
RENAULT SA	16,182	32.820000	531,093.24
REPSOL YPF SA	68,038	21.560000	1,466,899.28
RWE AG	42,011	27.070000	1,137,237.77
RWE AG-NON VTG PFD	1,944	25.300000	49,183.20
SAFRAN SA	13,834	23.700000	327,865.80
SAIPEM SPA	21,972	35.380000	777,369.36
SALZGITTER AG	4,479	45.580000	204,152.82
SAMPO OYJ-A SHS	32,903	19.840000	652,795.52
SANOFI	97,236	55.690000	5,415,072.84
SANOMA OYJ	6,963	10.220000	71,161.86
SAP AG	79,530	44.500000	3,539,085.00
SBM OFFSHORE NV	11,995	12.835000	153,955.82
SCHNEIDER ELECTRIC SA	41,562	48.230000	2,004,535.26
SCOR SE	14,050	18.810000	264,280.50
SES	25,479	18.145000	462,316.45
SIEMENS AG-REG	70,462	73.520000	5,180,366.24
SNAM SPA	137,098	3.390000	464,762.22
SOCIETE BIC SA	2,250	66.820000	150,345.00
SOCIETE GENERALE	54,595	21.000000	1,146,495.00
SODEXO	8,745	57.150000	499,776.75
SOLVAY SA	4,644	75.950000	352,711.80
STMICROELECTRONICS NV	59,819	5.169000	309,204.41
STORA ENSO OYJ-R SHS	53,639	5.765000	309,228.83
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	23,106	9.509000	219,714.95
TECHNIP SA	8,567	71.600000	613,397.20
TELECOM ITALIA SPA	837,574	0.769000	644,094.40
TELECOM ITALIA-RSP	515,529	0.648000	334,062.79
TELEFONICA SA	352,504	13.150000	4,635,427.60

(単位:円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ユーロ	TELEKOM AUSTRIA AG	29,788	8.880000	264,517.44	
	TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	9,519	8.283000	78,845.87	
	TENARIS SA	41,807	15.090000	630,867.63	
	TERNA SPA	104,532	2.748000	287,253.93	
	THALES SA	9,260	25.270000	234,000.20	
	THYSSENKRUPP AG	32,362	21.175000	685,265.35	
	TNT EXPRESS NV	28,487	6.150000	175,195.05	
	TOTAL SA	181,853	40.330000	7,334,131.49	
	UBI BANCA SCPA	65,520	3.462000	226,830.24	
	UCB SA	9,829	31.005000	304,748.14	
	UMICORE	10,464	35.430000	370,739.52	
	UNICREDIT SPA	302,973	3.800000	1,151,297.40	
	UNILEVER NV-CVA	139,436	25.415000	3,543,765.94	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	11,899	14.200000	168,965.80	
	UPM-KYMMENE OYJ	46,202	10.190000	470,798.38	
	VALLOUREC	10,210	51.280000	523,568.80	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	32,554	8.206000	267,138.12	
	VEBUND AG	6,128	20.225000	123,938.80	
	VIENNA INSURANCE GROUP AG	3,950	33.665000	132,976.75	
	VINCI SA	37,046	36.395000	1,348,289.17	
	VIVENDI	107,790	15.875000	1,711,166.25	
	VOESTALPINE AG	8,689	26.610000	231,214.29	
	VOLKSWAGEN AG	2,309	123.150000	284,353.35	
	VOLKSWAGEN AG-PFD	12,354	137.050000	1,693,115.70	
	VOPAK	7,117	40.445000	287,847.06	
	WACKER CHEMIE AG	1,300	67.270000	87,451.00	
	WARTSILA OYJ ABP	13,374	26.270000	351,334.98	
	WENDEL	2,600	57.920000	150,592.00	
	WOLTERS KLUWER	29,096	13.835000	402,543.16	
	ZARDOYA OTIS SA	17,350	10.500000	182,175.00	
	ユーロ 小計	14,515,171		179,434,533.08 (18,275,407,194)	
	合計	89,104,781		140,598,452,842 (140,598,452,842)	

(注1) 通貨の種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

## (2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

通貨種類	銘柄	口数(口)	評価額	備考
投資証券	AMERICAN TOWER CORP	34,500.00	2,172,465.00	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	81,000.00	1,353,510.00	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	8,200.00	1,097,242.00	
	BOSTON PROPERTIES INC	12,200.00	1,265,750.00	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	8,000.00	550,720.00	
	DUKE REALTY CORP	19,400.00	262,482.00	
	EQUITY RESIDENTIAL	24,800.00	1,441,624.00	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,300.00	499,101.00	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	38,500.00	608,685.00	
	HCP INC	34,700.00	1,434,845.00	
	HEALTH CARE REIT INC	16,600.00	940,224.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	60,600.00	1,007,778.00	
	KIMCO REALTY CORP	34,700.00	652,360.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,300.00	387,929.00	
	MACERICH CO/THE	10,800.00	592,380.00	
	PLUM CREEK TIMBER CO	13,300.00	532,399.00	
	PROLOGIS INC	39,300.00	1,272,141.00	
	PUBLIC STORAGE	12,400.00	1,685,284.00	
	RAYONIER INC	10,650.00	493,734.00	
	REGENCY CENTERS CORP	8,500.00	347,395.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	25,200.00	3,422,160.00	
	VENTAS INC	23,900.00	1,384,288.00	
	VORNADO REALTY TRUST	13,800.00	1,132,152.00	

	WEYERHAEUSER CO	43,700.00	886,236.00	
	投資証券 小計	591,350.00	25,422,884.00 (1,977,391,917)	
	アメリカドル 小計	591,350.00	25,422,884.00 (1,977,391,917)	
	オーストラリアドル			
投資証券	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	182,319.00	314,500.27	
	DEXUS PROPERTY GROUP	452,999.00	400,904.11	
	GOODMAN GROUP	651,743.00	426,891.66	
	GPT GROUP	144,101.00	445,272.09	
	MIRVAC GROUP	271,719.00	338,290.15	
	STOCKLAND	212,441.00	720,174.99	
	WESTFIELD GROUP	186,816.00	1,586,067.84	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	256,392.00	640,980.00	
	投資証券 小計	2,358,530.00	4,873,081.11 (401,882,999)	
	オーストラリアドル 小計	2,358,530.00	4,873,081.11 (401,882,999)	
	イギリスポンド			
投資証券	BRITISH LAND CO PLC	69,938.00	344,025.02	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GRO	50,078.00	163,254.28	
	HAMMERSON PLC	57,875.00	223,166.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	66,722.00	458,380.14	
	SEGRO PLC	57,308.00	126,020.29	
	投資証券 小計	301,921.00	1,314,845.73 (160,095,616)	
	イギリスポンド 小計	301,921.00	1,314,845.73 (160,095,616)	
	香港ドル			
投資証券	LINK REIT	197,000.00	5,673,600.00	
	投資証券 小計	197,000.00	5,673,600.00 (56,849,472)	
	香港ドル 小計	197,000.00	5,673,600.00 (56,849,472)	
	シンガポールドル			
投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	195,000.00	373,425.00	
	CAPITAMALL TRUST	201,000.00	345,720.00	
	投資証券 小計	396,000.00	719,145.00 (44,450,352)	
	シンガポールドル 小計	396,000.00	719,145.00 (44,450,352)	
	ユーロ			
投資証券	CORIO NV	5,100.00	182,988.00	
	FONCIERE DES REGIONS	2,994.00	145,598.22	
	GECINA SA	2,289.00	164,647.77	
	ICADE	1,941.00	118,498.05	
	KLEPIERRE	7,368.00	173,037.48	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,957.00	1,154,958.55	
	投資証券 小計	27,649.00	1,939,728.07 (197,561,303)	
	ユーロ 小計	27,649.00	1,939,728.07 (197,561,303)	
	合計		2,838,231,659 (2,838,231,659)	

(注1) 通貨の種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

## 外貨建有価証券の内訳

通貨	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
アメリカドル	株式 558銘柄	97.62%		56.52%
	投資証券 24銘柄		2.38%	1.38%
カナダドル	株式 96銘柄	100.00%		5.75%
オーストラリアドル	株式 56銘柄	93.21%		3.85%
	投資証券 8銘柄		6.79%	0.28%
イギリスポンド	株式 100銘柄	98.95%		10.47%
	投資証券 5銘柄		1.05%	0.11%
スイスフラン	株式 36銘柄	100.00%		3.94%
香港ドル	株式 36銘柄	96.99%		1.28%
	投資証券 1銘柄		3.01%	0.04%
シンガポールドル	株式 25銘柄	96.22%		0.79%
	投資証券 2銘柄		3.78%	0.03%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.00%		0.05%
スウェーデンクローネ	株式 33銘柄	100.00%		1.43%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.00%		0.42%
デンマーククローネ	株式 12銘柄	100.00%		0.48%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.00%		0.31%
ユーロ	株式 235銘柄	98.93%		12.74%
	投資証券 6銘柄		1.07%	0.14%

## 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関係に関する注記）」に記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「新興国株式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。

(1) 貸借対照表

		[ 平成24年1月26日現在 ]
		金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金		285,596,161
コール・ローン		66,228,570
株式		12,517,424,739
投資証券		123,598,583
派生商品評価勘定		46,637,666
未収配当金		13,525,326
未収利息		152
差入委託証拠金		123,010,487
流動資産合計		13,176,021,684
資産合計		13,176,021,684
負債の部		
流動負債		
未払解約金		7,760,426
流動負債合計		7,760,426
負債合計		7,760,426
純資産の部		
元本等		
元本	1	9,361,956,272
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		3,806,304,986
元本等合計		13,168,261,258
純資産合計		13,168,261,258
負債純資産合計		13,176,021,684

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年5月13日から翌年5月12日までであります。

(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	<p>株式および投資証券は移動平均法、株式および投資証券以外の有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場（外貨建証券の場合は知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合また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、委託会社が忠実義務に基づいて合理的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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	[ 平成24年1月26日現在 ]
1 期首	平成23年10月31日
期首元本額	8,529,931,787円
期首からの追加設定元本額	980,282,025円
期首からの一部解約元本額	148,257,540円
元本の内訳*	
F P バランスファンド（安定型）	6,276,576円
F P バランスファンド（安定成長型）	42,732,885円
e M A X I S 新興国株式インデックス	7,938,153,268円
e M A X I S バランス（8資産均等型）	9,945,628円
e M A X I S バランス（波乗り型）	2,388,202円
三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド	518,388,873円
新興国株式インデックスオープン	88,742,635円
e M A X I S 全世界株式インデックス	101,760,173円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	5,803,933円
M U A M 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	647,764,099円
（合計）	9,361,956,272円
2 受益権の総数	9,361,956,272口
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4066円 (14,066円)

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 1 金融商品の状況に関する事項

区分	（自平成23年10月31日 至平成24年1月26日）
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資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。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式および投資証券を実質的な主要投資対象としております。株式および投資証券の投資に係る価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスクおよびカントリーリスクに晒されております。 デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[ 平成24年1月26日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2 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）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関係に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。

## （有価証券関係に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	[ 平成24年1月26日現在 ]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	628,717,128
投資証券	17,959,633
合計	646,676,761

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

## (デリバティブ取引等関係に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## 株式関連

区分	種類	[平成24年1月26日現在]			
		契約額等(円)		時価	評価損益
			うち1年超	(円)	(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	440,630,700		487,268,366	46,637,666
	合計	440,630,700		487,268,366	46,637,666

## (注)時価の算定方法

- 1 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、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、最も近い最終相場値や気配値等、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。

## (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。

[前へ](#)   [次へ](#)

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

(単位:円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル					
	ADVANCED SEMICONDUCTOR E-ADR	42,096	5.150000	216,794.40	
	AMERICA MOVIL-ADR SERIES L	10,400	23.580000	245,232.00	
	AU OPTRONICS CORP-SPON ADR	26,392	5.280000	139,349.76	
	AXIS BANK LTD- GDR REG S	10,000	20.860000	208,600.00	
	BANCO BRADESCO-ADR	54,199	18.960000	1,027,613.04	
	BANCO DE CHILE-ADR	4,000	90.080000	360,320.00	
	BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	5,900	82.350000	485,865.00	
	BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	11,000	58.170000	639,870.00	
	CEMIG SA -SPONS ADR	18,487	19.740000	364,933.38	
	CENTRAIS ELETRICAS BR-SP ADR	13,500	10.160000	137,160.00	
	CHUNGHWA TELECOM LTD-ADR	20,340	31.480000	640,303.20	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	5,500	61.970000	340,835.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	7,500	41.290000	309,675.00	
	CIA SIDERURGICA NAEL-SP ADR	28,000	10.510000	294,280.00	
	COMPANHIA DE BEBIDAS-PRF ADR	17,000	37.100000	630,700.00	
	CPFL ENERGIA SA-ADR	3,300	29.560000	97,548.00	
	CREDICORP LTD	3,500	112.790000	394,765.00	
	DOCTOR REDDY'S LAB-ADR	9,000	33.210000	298,890.00	
	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	15,000	50.710000	760,650.00	
	EMPRESA NAC ELEC-CHIL-SP ADR	10,500	46.130000	484,365.00	
	ENERSIS S.A. -SPONS ADR	20,000	17.620000	352,400.00	
	FEDERAL HYDROGENERATING-ADR	75,000	3.510000	263,250.00	
	FIBRIA CELULOSE SA-SPON ADR	5,819	8.730000	50,799.87	
	GAZPROM OAO-SPON ADR	241,000	12.090000	2,913,690.00	
	GERDAU SA -SPON ADR	40,000	9.760000	390,400.00	
	HDFC BANK LTD-ADR	16,000	31.730000	507,680.00	
	HON HAI PRECISION-GDR REG S	39,424	6.180000	243,640.32	
	ICICI BANK LTD-SPON ADR	14,000	35.600000	498,400.00	
	INFOSYS LTD-SP ADR	14,000	54.220000	759,080.00	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	20,000	4.998000	99,960.00	
	ITAU UNIBANCO HLDNG-PREF ADR	40,590	20.860000	846,707.40	
	KB FINANCIAL GROUP INC-ADR	2,300	37.310000	85,813.00	
	KOREA ELEC POWER CORP-SP ADR	8,500	12.060000	102,510.00	
	KT CORP-SP ADR	11,000	15.370000	169,070.00	
	LAN AIRLINES SA-SPON ADR	14,000	24.860000	348,040.00	
	LARSEN & TOUBRO-GDR REG S	8,500	26.130000	222,105.00	
	LG DISPLAY CO LTD-ADR	3,000	12.660000	37,980.00	
	LUKOIL OAO-SPON ADR	23,500	57.900000	1,360,650.00	
	MAGNIT OJSC-SPON GDR REGS	10,000	24.710000	247,100.00	
	MAHINDRA & MAHINDRA-SPON GDR	17,000	13.770000	234,090.00	
	MECHEL-SPONSORED ADR	5,400	11.470000	61,938.00	
	MMC NORILSK NICKEL JSC-ADR	20,000	18.650000	373,000.00	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	25,000	16.700000	417,500.00	
	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	4,300	128.800000	553,840.00	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	7,000	23.620000	165,340.00	
	ORASCOM CONSTRUCTION-GDR	11,500	38.600000	443,900.00	
	PETROLEO BRASILEIRO S.A.-ADR	76,000	31.810000	2,417,560.00	
	POSCO-ADR	500	93.580000	46,790.00	
	QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	7,000	58.140000	406,980.00	
	RELIANCE INDS-SPONS GDR 144A	26,000	31.670000	823,420.00	
	ROSNEFT OJSC-REG S GDR	86,000	7.410000	637,260.00	
	ROSTELECOM-SPONSORED ADR	10,000	29.300000	293,000.00	
	SAMSUNG ELECTR-GDR REG S	1,300	493.000000	640,900.00	
	SASOL LTD-SPONSORED ADR	9,000	50.250000	452,250.00	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	115,000	11.450000	1,316,750.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	9,000	13.800000	124,200.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP-ADR	1,400	78.790000	110,306.00	
	SILICONWARE PRECISION-SP ADR	45,000	5.450000	245,250.00	
	SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR	4,000	19.040000	76,160.00	
	SK TELECOM CO LTD-ADR	2,700	14.080000	38,016.00	

SOUTHERN COPPER CORP	10,000	36.090000	360,900.00	
STATE BANK OF INDIA-SPON GDR	1,800	80.950000	145,710.00	
STERLITE INDUSTRIES INDI-ADR	23,500	9.260000	217,610.00	
SURGUTNEFTGAS-SP ADR	58,000	9.150000	530,700.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	30,114	14.160000	426,414.24	
TATA MOTORS LTD-SPON ADR	15,500	23.260000	360,530.00	
TATA STEEL LTD-GDR REG S	22,466	8.660000	194,555.56	
TATNEFT-SPONSORED ADR	12,866	34.040000	437,958.64	
TELE NORTE LESTE PART-ADR	2,500	9.610000	24,025.00	
TELEKOMUNIK INDONESIA-SP ADR	2,800	31.210000	87,388.00	
TURKCELL ILETISIM HIZMET-ADR	22,000	12.450000	273,900.00	
UNITED MICROELECTRON-SP ADR	150,000	2.530000	379,500.00	
URALKALI-SPON GDR-REG S	15,400	35.150000	541,310.00	
VALE SA-SP ADR	58,000	25.040000	1,452,320.00	
VTB BANK OJSC-GDR-REG S	71,000	4.430000	314,530.00	
WIPRO LTD-ADR	18,000	11.030000	198,540.00	
WOORI FINANCE HOLDINGS-ADR	2,600	28.410000	73,866.00	
アメリカドル 小計	1,921,893		33,475,231.81 (2,603,703,530)	
香港ドル				
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	120,000	8.810000	1,057,200.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	750,000	3.760000	2,820,000.00	
AIR CHINA LTD-H	26,000	6.180000	160,680.00	
ALIBABA.COM LTD	50,000	8.760000	438,000.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	210,000	3.990000	837,900.00	
ANGANG STEEL CO LTD-H	24,000	6.460000	155,040.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	48,000	26.900000	1,291,200.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	65,000	8.420000	547,300.00	
BANK OF CHINA LTD-H	3,050,000	3.270000	9,973,500.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	401,900	6.020000	2,419,438.00	
BBMG CORPORATION-H	80,000	6.170000	493,600.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	10,000	3.950000	39,500.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	42,000	44.050000	1,850,100.00	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	240,000	12.520000	3,004,800.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	150,000	8.000000	1,200,000.00	
BYD CO LTD-H	10,500	22.450000	235,725.00	
CHAODA MODERN AGRICULTURE	40,000	1.100000	44,000.00	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	14,000	6.290000	88,060.00	
CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	200,000	5.800000	1,160,000.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	200,000	4.880000	976,000.00	
CHINA COAL ENERGY CO-H	150,000	9.900000	1,485,000.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	195,000	6.910000	1,347,450.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	10,000	3.400000	34,000.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	2,675,550	6.080000	16,267,344.00	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	70,000	4.420000	309,400.00	
CHINA DONGXIANG GROUP CO	140,000	1.370000	191,800.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	54,000	12.600000	680,400.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	250,000	3.560000	890,000.00	
CHINA INTL MARINE CONTAINERS-B	9,300	9.570000	89,001.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	375,000	22.150000	8,306,250.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	206,000	5.950000	1,225,700.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	76,000	21.000000	1,596,000.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	142,550	17.460000	2,488,923.00	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	42,000	25.400000	1,066,800.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	180,000	7.150000	1,287,000.00	
CHINA MOBILE LTD	273,000	76.700000	20,939,100.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	150,000	9.570000	1,435,500.00	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	68,000	12.640000	859,520.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	224,000	15.160000	3,395,840.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	90,000	25.200000	2,268,000.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	800,000	9.030000	7,224,000.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	60,000	4.920000	295,200.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	83,000	2.550000	211,650.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	140,000	5.700000	798,000.00	
CHINA RESOURCES ENTERPRISE	50,000	27.700000	1,385,000.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	100,000	13.920000	1,392,000.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	110,000	14.680000	1,614,800.00	
CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP	100,000	5.890000	589,000.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	155,000	34.850000	5,401,750.00	
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	161,000	1.820000	293,020.00	

CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	40,000	5.410000	216,400.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	150,000	6.000000	900,000.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	26,000	13.760000	357,760.00
CHINA TELECOM CORP LTD-H	670,000	4.210000	2,820,700.00
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	284,000	14.660000	4,163,440.00
CHINA VANKE CO LTD -B	84,951	8.350000	709,340.85
CHINA YURUN FOOD GROUP LTD	90,000	13.160000	1,184,400.00
CITIC PACIFIC LTD	50,000	14.380000	719,000.00
CNOOC LTD	770,000	15.500000	11,935,000.00
COSCO PACIFIC LTD	80,000	10.900000	872,000.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	188,000	3.500000	658,000.00
CSR CORP LTD - H	80,000	5.170000	413,600.00
DATANG INTL POWER GEN CO-H	200,000	2.540000	508,000.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-H	5,600	25.300000	141,680.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	168,000	14.680000	2,466,240.00
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	52,000	22.550000	1,172,600.00
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	240,000	3.760000	902,400.00
FOSUN INTERNATIONAL	93,000	4.640000	431,520.00
FRANSHION PROPERTIES	380,000	1.680000	638,400.00
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	400,000	2.520000	1,008,000.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	40,000	2.290000	91,600.00
GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP	40,000	17.500000	700,000.00
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	310,000	2.000000	620,000.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	60,000	13.380000	802,800.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD	116,000	4.330000	502,280.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	60,675	7.830000	475,085.25
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	39,200	7.440000	291,648.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	40,000	70.200000	2,808,000.00
HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	120,000	4.550000	546,000.00
HUANENG POWER INTL INC-H	86,000	4.550000	391,300.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	2,816,350	5.370000	15,123,799.50
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	150,000	7.560000	1,134,000.00
JIANGXI COPPER CO LTD-H	50,000	19.860000	993,000.00
KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	45,000	26.100000	1,174,500.00
KUNLUN ENERGY CO LTD	106,000	12.320000	1,305,920.00
LENOVO GROUP LTD	218,000	5.900000	1,286,200.00
LONGFOR PROPERTIES	100,000	9.690000	969,000.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	18,000	5.450000	98,100.00
PARKSON RETAIL GROUP LTD	64,000	10.300000	659,200.00
PETROCHINA CO LTD-H	1,041,000	11.320000	11,784,120.00
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	100,000	10.100000	1,010,000.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	86,000	59.150000	5,086,900.00
POLY HONG KONG INVESTMENTS	90,000	3.850000	346,500.00
RENHE COMMERCIAL HOLDINGS	354,000	0.920000	325,680.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	32,000	7.070000	226,240.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	300,000	4.090000	1,227,000.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	50,000	24.850000	1,242,500.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	54,500	8.040000	438,180.00
SHOUGANG FUSHAN RESOURCES GR	28,000	2.950000	82,600.00
SHUI ON LAND LTD	67,600	2.680000	181,168.00
SINOFERT HOLDINGS LTD	20,000	2.250000	45,000.00
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	130,000	3.900000	507,000.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	24,000	2.870000	68,880.00
SINOPHARM GROUP CO-H	30,000	18.400000	552,000.00
SOHO CHINA LTD	150,000	5.490000	823,500.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	140,000	9.990000	1,398,600.00
TENCENT HOLDINGS LTD	43,000	181.700000	7,813,100.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	72,000	23.400000	1,684,800.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	30,000	42.550000	1,276,500.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	335,000	7.510000	2,515,850.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	36,000	40.050000	1,441,800.00
WUMART STORES INC-H	70,000	17.000000	1,190,000.00
YANZHOU COAL MINING CO-H	70,000	18.880000	1,321,600.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	50,000	12.620000	631,000.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	100,000	5.370000	537,000.00
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	31,000	17.960000	556,760.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	240,000	3.390000	813,600.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	52,000	10.780000	560,560.00
ZTE CORP-H	38,276	22.550000	863,123.80

香港ドル 小計	25,265,952		222,901,966.40 (2,233,477,703)
マレーシアリングット			
AIRASIA BHD	130,000	3.600000	468,000.00
AMMB HOLDINGS BHD	114,000	5.790000	660,060.00
AXIATA GROUP BERHAD	95,000	4.810000	456,950.00
BERJAYA SPORTS TOTO BHD	92,928	4.450000	413,529.60
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	10,000	50.000000	500,000.00
BURSA MALAYSIA BHD	22,500	6.940000	156,150.00
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	231,800	6.990000	1,620,282.00
DIGI.COM BHD	105,000	3.950000	414,750.00
GAMUDA BHD	105,000	3.600000	378,000.00
GENTING BHD	114,900	10.900000	1,252,410.00
GENTING MALAYSIA BHD	127,900	3.900000	498,810.00
HONG LEONG BANK BERHAD	29,000	11.300000	327,700.00
IJM CORP BHD	59,100	5.450000	322,095.00
IOI CORPORATION BHD	106,400	5.440000	578,816.00
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	11,700	25.900000	303,030.00
LAFARGE MALAYAN CEMENT BHD	45,000	6.850000	308,250.00
MALAYAN BANKING BHD	102,000	8.200000	836,400.00
MAXIS BHD	100,000	5.690000	569,000.00
MISC BHD	60,000	5.900000	354,000.00
MMC CORP BHD	14,000	2.760000	38,640.00
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	75,000	6.600000	495,000.00
PETRONAS DAGANGAN BHD	20,000	17.500000	350,000.00
PETRONAS GAS BHD	33,700	15.200000	512,240.00
PPB GROUP BERHAD	16,300	17.000000	277,100.00
PUBLIC BANK BHD-FOREIGN MKT	44,000	13.340000	586,960.00
RHB CAPITAL BHD	45,000	7.270000	327,150.00
SIME DARBY BERHAD	130,000	9.090000	1,181,700.00
SP SETIA BHD	113,950	3.940000	448,963.00
TELEKOM MALAYSIA BHD	90,000	4.820000	433,800.00
TENAGA NASIONAL BHD	100,000	6.100000	610,000.00
UMW HOLDINGS BHD	6,500	7.000000	45,500.00
YTL CORPORATION BERHAD	113,560	1.520000	172,611.20
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	200,000	1.850000	370,000.00
マレーシアリングット 小計	2,664,238		16,267,896.80 (414,994,047)
タイバーツ			
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	23,700	149.500000	3,543,150.00
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	75,000	151.500000	11,362,500.00
BANK OF AYUDHYA PUBLIC-NVDR	23,300	21.600000	503,280.00
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	6,000	574.000000	3,444,000.00
BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	100,000	41.500000	4,150,000.00
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	150,000	34.750000	5,212,500.00
CP ALL PCL-NVDR	98,600	56.250000	5,546,250.00
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	60,000	32.500000	1,950,000.00
IRPC PCL - NVDR	650,000	4.400000	2,860,000.00
KASIKORNBANK PCL-NVDR	70,000	124.500000	8,715,000.00
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	63,000	173.000000	10,899,000.00
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	81,561	62.000000	5,056,782.00
PTT PCL-NVDR	40,000	326.000000	13,040,000.00
SIAM CEMENT PCL-NVDR	22,000	324.000000	7,128,000.00
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	65,000	118.000000	7,670,000.00
タイバーツ 小計	1,528,161		91,080,462.00 (225,879,545)
フィリピンペソ			
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	150,000	41.500000	6,225,000.00
AYALA CORPORATION	1,920	354.000000	679,680.00
AYALA LAND INC	500,000	17.800000	8,900,000.00
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	100,000	59.850000	5,985,000.00
JOLLIBEE FOODS CORPORATION	10,200	93.000000	948,600.00
MANILA ELECTRIC COMPANY	21,400	267.800000	5,730,920.00
PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	2,500	2,776.000000	6,940,000.00
SM INVESTMENTS CORP	9,400	620.000000	5,828,000.00
SM PRIME HOLDINGS INC	450,000	14.800000	6,660,000.00
フィリピンペソ 小計	1,245,420		47,897,200.00 (86,693,932)
インドネシアルピア			
ADARO ENERGY TBK PT	400,000	1,840.000000	736,000,000.00

ANEKA TAMBANG TBK PT	46,500	1,730.000000	80,445,000.00	
ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	36,000	21,200.000000	763,200,000.00	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	103,000	78,000.000000	8,034,000,000.00	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	630,000	8,050.000000	5,071,500,000.00	
BANK DANAMON INDONESIA TBK	116,000	4,575.000000	530,700,000.00	
BANK MANDIRI TBK PT	327,000	6,950.000000	2,272,650,000.00	
BANK NEGARA INDONESIA PT	330,000	3,700.000000	1,221,000,000.00	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	560,000	6,950.000000	3,892,000,000.00	
BUMI RESOURCES TBK PT	1,000,000	2,450.000000	2,450,000,000.00	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	600,000	2,425.000000	1,455,000,000.00	
GUDANG GARAM TBK PT	25,000	57,500.000000	1,437,500,000.00	
INDO TAMBANGRAYA MEGAH TBK P	22,000	38,100.000000	838,200,000.00	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	110,000	17,850.000000	1,963,500,000.00	
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	247,000	4,875.000000	1,204,125,000.00	
KALBE FARMA TBK PT	250,000	3,575.000000	893,750,000.00	
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	382,500	3,400.000000	1,300,500,000.00	
SEMEN GRESIK (PERSERO) PT	116,000	11,650.000000	1,351,400,000.00	
TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	6,500	19,700.000000	128,050,000.00	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA TBK	300,000	6,900.000000	2,070,000,000.00	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	55,000	20,600.000000	1,133,000,000.00	
UNITED TRACTORS TBK PT	65,000	28,100.000000	1,826,500,000.00	
VALE INDONESIA TBK	24,000	3,600.000000	86,400,000.00	
インドネシアルピア 小計	5,751,500		40,739,420,000.00 (358,506,896)	
メキシコペソ				
ALFA S.A.B. -A	11,000	169.810000	1,867,910.00	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	1,610,000	15.380000	24,761,800.00	
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	34,866	60.010000	2,092,308.66	
CEMEX SAB-CPO	645,222	8.560000	5,523,100.32	
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	14,200	128.180000	1,820,156.00	
COMPARTAMOS SAB DE CV	56,000	16.030000	897,680.00	
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	21,000	98.640000	2,071,440.00	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	101,000	90.900000	9,180,900.00	
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	27,000	47.980000	1,295,460.00	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	108,000	28.690000	3,098,520.00	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	18,700	37.050000	692,835.00	
GRUPO ELEKTRA SA	4,000	1,140.530000	4,562,120.00	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	70,000	51.980000	3,638,600.00	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	80,000	27.120000	2,169,600.00	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	166,770	41.000000	6,837,570.00	
GRUPO MODELO S.A.B.-SER C	19,200	79.500000	1,526,400.00	
GRUPO TELEVISION SAB-SER CPO	111,000	54.140000	6,009,540.00	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	5,500	622.770000	3,425,235.00	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	12,200	73.850000	900,970.00	
MEXICHEM SAB DE CV-*	14,000	44.980000	629,720.00	
MINERA FRISCO SAB DE CV-A1	18,700	56.440000	1,055,428.00	
URBI DESARROLLOS URBANOS SAB	9,300	19.290000	179,397.00	
WALMART DE MEXICO-SER V	280,000	38.090000	10,665,200.00	
メキシコペソ 小計	3,437,658		94,901,889.98 (565,615,264)	
ブラジルリアル				
AES TIETE SA-PREF	700	25.190000	17,633.00	
ALL AMERICA LATINA LOGISTICA	33,000	10.100000	333,300.00	
ANHANGUERA EDUCACIONAL PARTI	5,000	23.280000	116,400.00	
BANCO BRADESCO SA-PREF	25,686	32.410000	832,483.26	
BANCO DO BRASIL S.A.	30,900	26.000000	803,400.00	
BANCO ESTADO RIO GRANDE SUL	10,000	19.740000	197,400.00	
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	35,000	16.250000	568,750.00	
BM&FBOVESPA SA	96,000	10.410000	999,360.00	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	18,000	19.500000	351,000.00	
BRADESPAR SA -PREF	9,000	33.800000	304,200.00	
BRASIL TELECOM SA-PREFERENCE	16,000	10.790000	172,640.00	
BRASKEM SA-PREF A	2,000	14.600000	29,200.00	
BRF - BRASIL FOODS SA	26,000	34.990000	909,740.00	
BROOKFIELD INCORPORACOES SA	22,000	6.000000	132,000.00	
CCR SA	28,000	11.800000	330,400.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	2,500	17.220000	43,050.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	2,000	24.890000	49,780.00	
CETIP SA-BALCAO ORGANIZADO	8,000	26.890000	215,120.00	
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	4,500	72.140000	324,630.00	

CIA DE BEBIDAS DAS AME-PREF	14,000	64.920000	908,880.00
CIA DE TRANSMISSAO DE ENE-PF	300	55.170000	16,551.00
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	3,700	32.300000	119,510.00
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	2,667	34.090000	90,918.03
CIA HERING	7,000	40.260000	281,820.00
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	8,000	37.750000	302,000.00
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	5,000	54.600000	273,000.00
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	9,200	18.130000	166,796.00
CIELO SA	13,120	51.500000	675,680.00
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	7,500	27.700000	207,750.00
CPFL ENERGIA SA	1,000	25.350000	25,350.00
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP	20,000	15.900000	318,000.00
DIAGNOSTICOS DA AMERICA SA	10,000	16.230000	162,300.00
DURATEX SA	14,760	9.500000	140,220.00
ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	12,000	12.390000	148,680.00
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	6,000	39.390000	236,340.00
ELETROPAULO METROPOLI-PREF	6,000	35.700000	214,200.00
EMBRAER SA	20,900	11.900000	248,710.00
FIBRIA CELULOSE SA	1,000	15.520000	15,520.00
GERDAU SA-PREF	7,200	16.470000	118,584.00
HYPERMARCAS SA	7,000	11.350000	79,450.00
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	68,900	35.740000	2,462,486.00
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	104,520	11.700000	1,222,884.00
JBS SA	5,100	5.900000	30,090.00
KLABIN SA-PREF	34,000	8.060000	274,040.00
LOCALIZA RENT A CAR	6,000	27.500000	165,000.00
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	22,853	16.150000	369,075.95
LOJAS RENNER S.A.	7,500	59.160000	443,700.00
METALURGICA GERDAU SA-PREF	8,500	20.760000	176,460.00
MMX MINERACAO E METALICOS SA	15,000	7.820000	117,300.00
MRV ENGENHARIA	6,000	13.450000	80,700.00
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	5,000	38.780000	193,900.00
NATURA COSMETICOS SA	6,500	38.320000	249,080.00
ODONTOPREV S.A.	7,000	29.180000	204,260.00
OGX PETROLEO E GAS PARTICIPA	68,000	15.830000	1,076,440.00
PDG REALTY SA	39,000	7.090000	276,510.00
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	63,000	27.730000	1,746,990.00
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	100,000	25.400000	2,540,000.00
PORTO SEGURO SA	900	20.650000	18,585.00
RAIA DROGASIL SA	21,000	14.000000	294,000.00
REDECARD SA	20,000	31.500000	630,000.00
ROSSI RESIDENCIAL SA	12,000	9.130000	109,560.00
SOUZA CRUZ SA	15,000	22.240000	333,600.00
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	2,500	7.790000	19,475.00
TELE NORTE LESTE PART	400	20.150000	8,060.00
TELE NORTE LESTE PART-PREF	24,200	16.430000	397,606.00
TELEFONICA BRASIL S.A.	12,975	50.950000	661,076.25
TELEMAR NORTE LESTE SA-PR A	300	47.270000	14,181.00
TIM PARTICIPACOES SA	54,377	9.780000	531,807.06
TOTVS SA	6,000	30.500000	183,000.00
TRACTEBEL ENERGIA SA	7,500	30.650000	229,875.00
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	18,000	34.440000	619,920.00
USINAS SIDER MINAS GER-PF A	17,000	11.650000	198,050.00
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS	5,200	17.090000	88,868.00
VALE SA	36,000	43.010000	1,548,360.00
VALE SA-PREF A	60,000	41.580000	2,494,800.00
ブラジルリアル 小計	1,430,858		31,490,484.55 (1,389,360,178)

[前へ](#) [次へ](#)

(単位:円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
韓国ウォン					
	AMOREPACIFIC CORP	150	1,021,000.000000	153,150,000.00	
	BS FINANCIAL GROUP INC	15,000	12,300.000000	184,500,000.00	
	CELLTRION INC	3,500	37,800.000000	132,300,000.00	
	CHEIL INDUSTRIES INC	1,600	103,000.000000	164,800,000.00	
	CJ CHEILJEDANG CORP	500	296,500.000000	148,250,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	2,000	106,500.000000	213,000,000.00	
	DAEWOO INTERNATIONAL CORP	618	29,900.000000	18,478,200.00	
	DAEWOO SECURITIES CO LTD	18,738	12,750.000000	238,909,500.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	4,500	26,700.000000	120,150,000.00	
	DGB FINANCIAL GROUP INC	7,000	13,750.000000	96,250,000.00	
	DONGBU INSURANCE CO LTD	450	47,600.000000	21,420,000.00	
	DONGKUK STEEL MILL CO LTD	400	22,700.000000	9,080,000.00	
	DOOSAN CORP	1,200	151,500.000000	181,800,000.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	3,100	67,000.000000	207,700,000.00	
	DOOSAN INFACORE CO LTD	5,000	19,100.000000	95,500,000.00	
	E-MART CO LTD	1,200	262,000.000000	314,400,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,300	100,000.000000	130,000,000.00	
	GS HOLDINGS	2,500	58,900.000000	147,250,000.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	12,000	38,100.000000	457,200,000.00	
	HANKOOK TIRE CO LTD	3,700	47,650.000000	176,305,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	4,000	28,000.000000	112,000,000.00	
	HANWHA CORPORATION	2,500	34,900.000000	87,250,000.00	
	HONAM PETROCHEMICAL CORP	600	362,500.000000	217,500,000.00	
	HYNIX SEMICONDUCTOR INC	24,000	27,450.000000	658,800,000.00	
	HYOSUNG CORPORATION	1,200	59,900.000000	71,880,000.00	
	HYUNDAI DEPT STORE CO	900	181,000.000000	162,900,000.00	
	HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	1,400	20,850.000000	29,190,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	2,500	73,000.000000	182,500,000.00	
	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	750	203,500.000000	152,625,000.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	1,800	317,500.000000	571,500,000.00	
	HYUNDAI HYSKO	2,500	39,600.000000	99,000,000.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	6,000	31,800.000000	190,800,000.00	
	HYUNDAI MIPO DOCKYARD	550	124,000.000000	68,200,000.00	
	HYUNDAI MOBIS	3,150	310,000.000000	976,500,000.00	
	HYUNDAI MOTOR CO	6,500	234,000.000000	1,521,000,000.00	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	700	69,900.000000	48,930,000.00	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	2,000	69,200.000000	138,400,000.00	
	HYUNDAI SECURITIES CO	8,500	10,200.000000	86,700,000.00	
	HYUNDAI SECURITIES CO-PFD	3,421	8,950.000000	30,617,950.00	
	HYUNDAI STEEL CO	1,800	109,000.000000	196,200,000.00	
	HYUNDAI WIA CORP	800	132,500.000000	106,000,000.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	3,500	12,250.000000	42,875,000.00	
	KANGWON LAND INC	5,500	26,150.000000	143,825,000.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	12,500	41,200.000000	515,000,000.00	
	KCC CORP	60	320,000.000000	19,200,000.00	
	KIA MOTORS CORPORATION	10,500	68,500.000000	719,250,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	8,000	27,050.000000	216,400,000.00	
	KOREA EXCHANGE BANK	4,000	8,050.000000	32,200,000.00	
	KOREA GAS CORPORATION	400	42,700.000000	17,080,000.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	3,000	40,250.000000	120,750,000.00	
	KOREA KUMHO PETROCHEMICAL CO	650	161,000.000000	104,650,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	350	370,000.000000	129,500,000.00	
	KOREAN AIR LINES CO LTD	800	47,300.000000	37,840,000.00	
	KT&G CORP	6,000	72,800.000000	436,800,000.00	
	LG CHEM LTD	2,150	377,500.000000	811,625,000.00	
	LG CORP	6,100	67,800.000000	413,580,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	8,500	28,550.000000	242,675,000.00	
	LG ELECTRONICS INC	5,471	77,100.000000	421,814,100.00	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	400	507,000.000000	202,800,000.00	
	LG UPLUS CORP	11,000	6,640.000000	73,040,000.00	
	LOTTE SHOPPING CO	600	375,500.000000	225,300,000.00	
	LS CORP	230	85,100.000000	19,573,000.00	
	LS INDUSTRIAL SYSTEMS	250	65,100.000000	16,275,000.00	
	MANDO CORP	500	195,000.000000	97,500,000.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	300	36,600.000000	10,980,000.00	

NCSOFT CORPORATION	600	282,500.000000	169,500,000.00	
NHN CORP	2,250	217,000.000000	488,250,000.00	
OCI CO LTD	450	243,500.000000	109,575,000.00	
ORION CORP	300	641,000.000000	192,300,000.00	
POSCO	2,650	421,500.000000	1,116,975,000.00	
S1 CORPORATION	2,500	58,700.000000	146,750,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	6,900	69,100.000000	476,790,000.00	
SAMSUNG CARD CO	3,000	41,500.000000	124,500,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	4,000	88,100.000000	352,400,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	4,650	1,114,000.000000	5,180,100,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	390	680,000.000000	265,200,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,100	221,500.000000	243,650,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	1,850	213,000.000000	394,050,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	5,300	35,000.000000	185,500,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	1,600	84,800.000000	135,680,000.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	2,350	141,500.000000	332,525,000.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	2,463	56,600.000000	139,405,800.00	
SAMSUNG TECHWIN CO LTD	1,080	53,500.000000	57,780,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	17,000	43,650.000000	742,050,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	234	272,000.000000	63,648,000.00	
SK C&C CO LTD	1,200	131,000.000000	157,200,000.00	
SK HOLDINGS CO LTD	800	137,500.000000	110,000,000.00	
SK INNOVATION CO LTD	2,700	168,000.000000	453,600,000.00	
SK TELECOM	900	142,000.000000	127,800,000.00	
S-OIL CORPORATION	1,700	118,500.000000	201,450,000.00	
WOONGJIN COWAY CO LTD	600	38,950.000000	23,370,000.00	
WOORI INVESTMENT & SECURITIE	8,539	13,000.000000	111,007,000.00	
YUHAN CORPORATION	582	135,500.000000	78,861,000.00	
韓国ウォン 小計	328,476		26,169,384,550.00 (1,818,772,226)	
ニュー台湾ドル				
ACER INC	113,168	37.850000	4,283,408.80	
ASIA CEMENT CORP	47,277	35.100000	1,659,422.70	
ASUSTEK COMPUTER INC	24,774	230.000000	5,698,020.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	25,000	167.500000	4,187,500.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	332,274	32.150000	10,682,609.10	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	174,400	15.900000	2,772,960.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	91,200	67.900000	6,192,480.00	
CHIMEI INNOLUX CORP	220,112	13.000000	2,861,456.00	
CHINA AIRLINES LTD	180,000	13.750000	2,475,000.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	615,255	8.120000	4,995,870.60	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	109,500	24.650000	2,699,175.00	
CHINA PETROCHEMICAL DEV CORP	110,000	32.100000	3,531,000.00	
CHINA STEEL CORP	608,093	28.950000	17,604,292.35	
CHINATRUST FINANCIAL HOLDING	495,446	17.750000	8,794,166.50	
CLEVO COMPANY	8,403	48.500000	407,545.50	
COMPAL ELECTRONICS	231,775	32.000000	7,416,800.00	
DELTA ELECTRONICS INC	102,220	79.900000	8,167,378.00	
E INK HOLDINGS INC	48,000	38.550000	1,850,400.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	235,400	12.700000	2,989,580.00	
EPISTAR CORP	40,000	67.600000	2,704,000.00	
EVA AIRWAYS CORP	132,000	19.450000	2,567,400.00	
EVERGREEN MARINE	153,999	16.300000	2,510,183.70	
FAR EASTERN DEPARTMENT STORE	68,900	38.400000	2,645,760.00	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	135,350	36.500000	4,940,275.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	108,000	55.300000	5,972,400.00	
FARGLORY LAND DEVELOPMENT CO	8,000	52.000000	416,000.00	
FENG HSIN IRON & STEEL CO	7,000	48.100000	336,700.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	146,677	17.150000	2,515,510.55	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	161,000	82.000000	13,202,000.00	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	81,150	91.000000	7,384,650.00	
FORMOSA PLASTICS CORP	190,000	84.700000	16,093,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	30,762	101.500000	3,122,343.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	181,529	30.950000	5,618,322.55	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	10,300	239.500000	2,466,850.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	319,124	87.700000	27,987,174.80	
HTC CORP	30,744	488.500000	15,018,444.00	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	179,598	16.200000	2,909,487.60	
INVENTEC CORP	29,400	11.750000	345,450.00	
KGI SECURITIES CO LTD	265,148	11.200000	2,969,657.60	

KINSUS INTERCONNECT TECH	25,000	84.000000	2,100,000.00
LARGAN PRECISION CO LTD	6,020	589.000000	3,545,780.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	57,570	36.400000	2,095,548.00
MACRONIX INTERNATIONAL	180,000	12.200000	2,196,000.00
MEDIATEK INC	45,042	263.000000	11,846,046.00
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	270,300	19.000000	5,135,700.00
MSTAR SEMICONDUCTOR INC	25,320	175.000000	4,431,000.00
NAN YA PLASTICS CORP	223,750	63.100000	14,118,625.00
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	8,000	86.000000	688,000.00
PEGATRON CORP	136,976	35.550000	4,869,496.80
POU CHEN	150,500	26.000000	3,913,000.00
POWERTECH TECHNOLOGY INC	36,300	67.500000	2,450,250.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	30,000	162.000000	4,860,000.00
QUANTA COMPUTER INC	92,150	65.300000	6,017,395.00
RICHTEK TECHNOLOGY CORP	4,200	159.000000	667,800.00
RUENTEX INDUSTRIES LTD	35,000	53.800000	1,883,000.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	100,000	8.530000	853,000.00
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	16,500	196.000000	3,234,000.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	299,341	8.720000	2,610,253.52
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	68,137	75.600000	5,151,157.20
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	305,363	10.150000	3,099,434.45
TAIWAN CEMENT	155,706	36.250000	5,644,342.50
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	190,800	17.900000	3,415,320.00
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	70,000	72.400000	5,068,000.00
TAIWAN GLASS IND CORP	66,000	32.100000	2,118,600.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	96,400	91.700000	8,839,880.00
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	930,000	76.700000	71,331,000.00
TATUNG CO LTD	18,959	8.060000	152,809.54
TPK HOLDING CO LTD	4,200	385.500000	1,619,100.00
TRIPOD TECHNOLOGY CORP	27,750	84.300000	2,339,325.00
TSRC CORP	60,000	74.100000	4,446,000.00
U-MING MARINE TRANSPORT CORP	7,000	44.650000	312,550.00
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	35,000	37.050000	1,296,750.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	143,948	45.600000	6,564,028.80
WALSIN LIHWA CORP	190,000	9.300000	1,767,000.00
WINTEK CORP	76,994	22.350000	1,720,815.90
WISTRON CORP	61,756	42.000000	2,593,752.00
WPG HOLDINGS LTD	65,400	37.650000	2,462,310.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	436,909	15.650000	6,837,625.85
YULON MOTOR COMPANY	13,000	54.700000	711,100.00
ニュー台湾ドル 小計	10,816,269		436,000,468.91 (1,133,601,219)
インドルピー			
ADANI ENTERPRISES LTD	13,000	399.900000	5,198,700.00
AMBUJA CEMENTS LTD	60,000	161.300000	9,678,000.00
ASIAN PAINTS LTD	2,000	2,848.450000	5,696,900.00
BAJAJ AUTO LTD	5,000	1,587.850000	7,939,250.00
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	22,500	282.450000	6,355,125.00
BHARTI AIRTEL LTD	30,000	359.300000	10,779,000.00
CIPLA LTD	25,000	342.300000	8,557,500.00
COAL INDIA LTD	20,000	342.900000	6,858,000.00
GAIL INDIA LTD	15,000	366.150000	5,492,250.00
HERO MOTOCORP LTD	3,500	1,853.900000	6,488,650.00
HINDALCO INDUSTRIES LTD	55,000	142.050000	7,812,750.00
HINDUSTAN UNILEVER LTD	30,000	393.550000	11,806,500.00
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	44,000	709.200000	31,204,800.00
INFOSYS LTD	4,500	2,665.800000	11,996,100.00
INFRASTRUCTURE DEV FINANCE	50,000	129.550000	6,477,500.00
ITC LTD	65,000	206.050000	13,393,250.00
JINDAL STEEL & POWER LTD	13,000	540.550000	7,027,150.00
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	13,000	495.550000	6,442,150.00
NTPC LTD	45,000	174.750000	7,863,750.00
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	30,000	272.550000	8,176,500.00
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	70,000	100.850000	7,059,500.00
SESA GOA LTD	35,000	200.700000	7,024,500.00
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	10,000	582.400000	5,824,000.00
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	15,000	517.300000	7,759,500.00
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	14,000	1,098.000000	15,372,000.00
TATA POWER CO LTD	75,000	105.450000	7,908,750.00

インドルピー 小計	764,500		236,192,075.00 (370,821,557)
チェココルナ			
CEZ AS	5,000	751.000000	3,755,000.00
KOMERCNI BANKA AS	1,000	3,560.000000	3,560,000.00
TELEFONICA CZECH REPUBLIC AS	4,600	379.000000	1,743,400.00
チェココルナ 小計	10,600		9,058,400.00 (36,505,352)
ハンガリーフォリント			
MAGYAR TELEKOM TELECOMMUNICA	35,000	550.000000	19,250,000.00
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	1,000	18,860.000000	18,860,000.00
OTP BANK PLC	7,400	3,840.000000	28,416,000.00
RICHTER GEDEON NYRT	1,150	36,020.000000	41,423,000.00
ハンガリーフォリント 小計	44,550		107,949,000.00 (36,972,532)
ポーランドズロチ			
ASSECO POLAND SA	700	48.490000	33,943.00
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	500	70.500000	35,250.00
BANK PEKAO SA	7,500	149.900000	1,124,250.00
BRE BANK SA	1,000	281.900000	281,900.00
CYFROWY POLSAT SA	1,200	12.790000	15,348.00
GLOBE TRADE CENTRE SA	35,000	9.510000	332,850.00
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	3,000	97.000000	291,000.00
KERNEL HOLDING SA	3,500	67.100000	234,850.00
KGHM POLSKA MIEDZ SA	7,000	128.500000	899,500.00
PGE SA	39,500	20.480000	808,960.00
PKO BANK POLSKI SA	34,000	33.700000	1,145,800.00
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	11,500	37.000000	425,500.00
POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	80,200	3.660000	293,532.00
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	2,000	323.900000	647,800.00
TAURON POLSKA ENERGIA SA	60,000	5.310000	318,600.00
TELEKOMUNIKACJA POLSKA SA	29,000	17.650000	511,850.00
TVN SA	1,700	10.200000	17,340.00
ポーランドズロチ 小計	317,300		7,418,273.00 (176,999,993)
南アフリカランド			
ABSA GROUP LTD	10,400	146.500000	1,523,600.00
AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	32,000	36.300000	1,161,600.00
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	3,500	183.560000	642,460.00
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	4,400	543.050000	2,389,420.00
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	18,900	340.160000	6,429,024.00
ARCELORMITTAL SOUTH AFRICA	4,260	68.000000	289,680.00
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	9,300	99.450000	924,885.00
AVENG LTD	25,000	34.780000	869,500.00
BARLOWORLD LTD	15,000	85.900000	1,288,500.00
BIDVEST GROUP LTD	13,000	164.480000	2,138,240.00
DISCOVERY HOLDINGS LTD	20,000	44.950000	899,000.00
EXXARO RESOURCES LTD	6,000	187.510000	1,125,060.00
FIRSTRAND LTD	110,000	22.200000	2,442,000.00
GOLD FIELDS LTD	33,000	123.700000	4,082,100.00
HARMONY GOLD MINING CO LTD	22,000	90.810000	1,997,820.00
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	23,000	174.490000	4,013,270.00
IMPERIAL HOLDINGS LTD	10,000	133.500000	1,335,000.00
INVESTEC LTD	25,000	48.080000	1,202,000.00
KUMBA IRON ORE LTD	3,000	527.000000	1,581,000.00
LIBERTY HOLDINGS LTD	10,000	83.990000	839,900.00
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	65,000	21.330000	1,386,450.00
MASSMART HOLDINGS LTD	3,430	179.100000	614,313.00
MMI HOLDINGS LTD	50,000	17.750000	887,500.00
MTN GROUP LTD	74,000	135.000000	9,990,000.00
NASPERS LTD-N SHS	17,500	382.000000	6,685,000.00
NEDBANK GROUP LTD	8,000	153.870000	1,230,960.00
NETCARE LTD	55,900	13.450000	751,855.00
PICK N PAY STORES LTD	4,500	45.170000	203,265.00
PRETORIA PORTLAND CEMENT CO	17,200	27.800000	478,160.00
REMGRO LTD	15,000	123.070000	1,846,050.00
REUNERT LTD	20,000	63.000000	1,260,000.00
RMB HOLDINGS LTD	21,500	29.250000	628,875.00
RMI HOLDINGS	21,500	14.700000	316,050.00
SANLAM LTD	100,000	29.890000	2,989,000.00

SAPPI LIMITED	22,700	26.380000	598,826.00	
SASOL LTD	14,500	393.600000	5,707,200.00	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	23,000	131.280000	3,019,440.00	
SPAR GROUP LIMITED/THE	8,000	111.000000	888,000.00	
STANDARD BANK GROUP LTD	51,834	105.300000	5,458,120.20	
STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	68,147	24.900000	1,696,860.30	
TELKOM SA LTD	22,000	28.750000	632,500.00	
THE FOSCHINI GROUP LTD	11,000	108.800000	1,196,800.00	
TIGER BRANDS LTD	10,300	251.220000	2,587,566.00	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	29,200	78.500000	2,292,200.00	
VODACOM GROUP LTD	16,400	92.350000	1,514,540.00	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	39,000	42.280000	1,648,920.00	
南アフリカランド 小計	1,187,371		93,682,509.50 (925,583,193)	
トルコリラ				
AKBANK T.A.S.	43,666	6.500000	283,829.00	
ANADOLU EFES BIRACILIK VE	7,000	23.350000	163,450.00	
ARCELIK AS	35,000	7.280000	254,800.00	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	3,200	55.250000	176,800.00	
ENKA INSAAT VE SANAYI AS	13,888	4.740000	65,829.12	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	70,000	3.590000	251,300.00	
HACI OMER SABANCI HOLDING	20,000	6.100000	122,000.00	
KOC HOLDING AS	27,000	6.420000	173,340.00	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	5,500	38.300000	210,650.00	
TURK HAVA YOLLARI AO	6,856	2.200000	15,083.20	
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	18,000	7.520000	135,360.00	
TURKIYE GARANTI BANKASI	123,000	6.280000	772,440.00	
TURKIYE HALK BANKASI	24,000	11.100000	266,400.00	
TURKIYE IS BANKASI-C	57,726	3.590000	207,236.34	
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	11,000	2.620000	28,820.00	
YAPI VE KREDI BANKASI	40,000	3.100000	124,000.00	
トルコリラ 小計	505,836		3,251,337.66 (139,937,572)	
合計	57,220,582		12,517,424,739 (12,517,424,739)	

(注1) 通貨の種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨種類	銘柄	口数(口)	評価額	備考
アメリカドル				
投資証券	ISHARES MSCI INDIA ETF	131,600.00	794,864.00	
	投資証券 小計	131,600.00	794,864.00 (61,824,521)	
アメリカドル 小計		131,600.00	794,864.00 (61,824,521)	
ユーロ				
投資証券	LYXOR ETF MSCI INDIA	59,000.00	606,520.00	
	投資証券 小計	59,000.00	606,520.00 (61,774,062)	
ユーロ 小計		59,000.00	606,520.00 (61,774,062)	
合計			123,598,583 (123,598,583)	

(注1) 通貨の種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

## 外貨建有価証券の内訳

通貨	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
アメリカドル	株式 77銘柄	97.68%		20.60%
	投資証券 1銘柄		2.32%	0.49%
香港ドル	株式 119銘柄	100.00%		17.67%
マレーシアリングgit	株式 33銘柄	100.00%		3.28%
タイバーツ	株式 15銘柄	100.00%		1.79%
フィリピンペソ	株式 9銘柄	100.00%		0.69%
インドネシアルピア	株式 23銘柄	100.00%		2.84%
メキシコペソ	株式 23銘柄	100.00%		4.47%
ブラジルリアル	株式 75銘柄	100.00%		10.99%
韓国ウォン	株式 93銘柄	100.00%		14.39%
ニュー台湾ドル	株式 79銘柄	100.00%		8.97%
インドルピー	株式 26銘柄	100.00%		2.93%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.00%		0.29%
ハンガリーフォリント	株式 4銘柄	100.00%		0.29%
ポーランドズロチ	株式 17銘柄	100.00%		1.40%
南アフリカランド	株式 46銘柄	100.00%		7.32%
トルコリラ	株式 16銘柄	100.00%		1.11%
ユーロ	投資証券 1銘柄		100.00%	0.49%

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関係に関する注記）」に記載しております。

[前へ](#)   [次へ](#)

「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。

(1) 貸借対照表

		[ 平成24年1月26日現在 ]
		金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		562,278,274
国債証券		147,150,201,470
地方債証券		12,880,354,661
特殊債券		18,845,185,595
社債券		14,729,096,240
未収入金		41,827,200
未収利息		723,289,608
前払費用		39,680,716
流動資産合計		194,971,913,764
資産合計		194,971,913,764
負債の部		
流動負債		
未払金		492,705,080
未払解約金		1,088,245
流動負債合計		493,793,325
負債合計		493,793,325
純資産の部		
元本等		
元本	1	165,752,517,161
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		28,725,603,278
元本等合計		194,478,120,439
純資産合計		194,478,120,439
負債純資産合計		194,971,913,764

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年5月13日から翌年5月12日までであります。

(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	<p>有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合また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、委託会社が忠実義務に基づいて合理的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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
-------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	[平成24年1月26日現在]
1 期首	平成23年10月31日
期首元本額	166,666,593,489円
期首からの追加設定元本額	7,162,432,122円
期首からの一部解約元本額	8,076,508,450円
元本の内訳*	
ファンド・マネジャー（国内債券）	333,287,751円
eMAXIS 国内債券インデックス	1,138,280,497円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	10,721,718円
eMAXIS バランス（波乗り型）	5,619,996円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	49,821,510,227円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	18,551,251,016円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	3,596,945,069円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	8,645,315,695円
MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	23,966,278,594円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	19,953,801,860円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型（適格機関投資家限定）	6,152,577,920円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	4,371,960,448円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型（適格機関投資家限定）	1,017,916,468円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	487,416,262円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	7,610,913,891円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	3,573,639,303円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	9,553,005円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	318,163,539円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	398,280,189円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	327,691,684円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	282,582,294円
三菱UFJ 日本債券インデックスファンドVA	199,240,964円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	1,311,724,842円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	2,937,850,064円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	1,334,409,347円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	1,886,423,918円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	1,405,800,511円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	1,602,197,949円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	2,762,611,045円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	1,181,579,869円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	556,971,226円
（合計）	165,752,517,161円
2 受益権の総数	165,752,517,161口
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1733円 （11,733円）

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

## 1 金融商品の状況に関する事項

区分	(自平成23年10月31日 至平成24年1月26日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資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。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債を実質的な主要投資対象としております。公社債の投資に係る価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成24年1月26日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2 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）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 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	[ 平成24年1月26日現在 ]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	983,168,280
地方債証券	69,353,220
特殊債証券	108,268,880
社債証券	181,388,960
合計	979,401,420

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

[前へ](#)   [次へ](#)

## (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71回利付国債(5年)	6,005,000,000	6,085,046,650	
	第72回利付国債(5年)	6,460,000,000	6,583,127,600	
	第1回利付国債(40年)	235,000,000	254,982,050	
	第2回利付国債(40年)	350,000,000	360,685,500	
	第3回利付国債(40年)	333,000,000	341,494,830	
	第4回利付国債(40年)	282,000,000	287,747,160	
	第253回利付国債(10年)	6,828,000,000	6,992,896,200	
	第256回利付国債(10年)	4,440,000,000	4,546,426,800	
	第259回利付国債(10年)	3,135,000,000	3,225,946,350	
	第262回利付国債(10年)	2,720,000,000	2,833,043,200	
	第263回利付国債(10年)	3,353,000,000	3,479,240,450	
	第265回利付国債(10年)	2,968,000,000	3,079,537,440	
	第268回利付国債(10年)	3,802,000,000	3,955,182,580	
	第270回利付国債(10年)	3,389,000,000	3,510,732,880	
	第273回利付国債(10年)	2,368,000,000	2,474,631,040	
	第276回利付国債(10年)	3,435,000,000	3,611,318,550	
	第279回利付国債(10年)	3,235,000,000	3,462,226,400	
	第281回利付国債(10年)	3,538,000,000	3,799,033,640	
	第283回利付国債(10年)	4,117,000,000	4,396,297,280	
	第284回利付国債(10年)	2,561,000,000	2,729,667,460	
	第285回利付国債(10年)	1,978,000,000	2,113,136,960	
	第287回利付国債(10年)	1,735,000,000	1,875,101,250	
	第288回利付国債(10年)	1,326,000,000	1,420,994,640	
	第289回利付国債(10年)	1,203,000,000	1,277,237,130	
	第292回利付国債(10年)	2,094,000,000	2,250,170,520	
	第293回利付国債(10年)	1,516,000,000	1,640,448,440	
	第296回利付国債(10年)	1,275,000,000	1,356,013,500	
	第297回利付国債(10年)	1,633,000,000	1,726,783,190	
	第300回利付国債(10年)	1,425,000,000	1,517,368,500	
	第301回利付国債(10年)	1,477,000,000	1,572,089,260	
	第303回利付国債(10年)	1,890,000,000	1,996,010,100	
	第305回利付国債(10年)	1,509,000,000	1,579,606,110	
	第306回利付国債(10年)	1,570,000,000	1,653,272,800	
	第308回利付国債(10年)	2,134,000,000	2,225,697,980	
	第310回利付国債(10年)	2,528,000,000	2,567,790,720	
	第312回利付国債(10年)	1,320,000,000	1,359,850,800	
	第313回利付国債(10年)	1,647,000,000	1,706,901,390	
	第315回利付国債(10年)	2,014,000,000	2,064,490,980	
	第317回利付国債(10年)	2,218,000,000	2,248,342,240	
	第319回利付国債(10年)	765,000,000	773,613,900	
	第1回利付国債(30年)	76,000,000	89,157,120	
	第2回利付国債(30年)	98,000,000	108,905,440	
	第3回利付国債(30年)	117,000,000	128,048,310	
	第4回利付国債(30年)	127,000,000	151,190,960	
	第5回利付国債(30年)	108,000,000	116,268,480	
	第6回利付国債(30年)	169,000,000	187,637,320	
	第7回利付国債(30年)	142,000,000	155,090,980	
	第8回利付国債(30年)	117,000,000	117,622,440	
	第9回利付国債(30年)	116,000,000	108,462,320	
	第10回利付国債(30年)	185,000,000	162,807,400	
	第11回利付国債(30年)	137,000,000	134,883,350	
	第12回利付国債(30年)	170,000,000	179,197,000	
	第13回利付国債(30年)	160,000,000	165,673,600	
	第14回利付国債(30年)	233,000,000	258,397,000	
	第15回利付国債(30年)	246,000,000	277,232,160	
	第16回利付国債(30年)	207,000,000	233,305,560	
	第17回利付国債(30年)	177,000,000	196,280,610	
	第18回利付国債(30年)	257,000,000	280,042,620	
	第19回利付国債(30年)	203,000,000	221,158,350	
	第20回利付国債(30年)	197,000,000	221,888,980	

第21回利付国債(30年)	189,000,000	205,643,340
第22回利付国債(30年)	220,000,000	247,783,800
第23回利付国債(30年)	149,000,000	167,954,290
第24回利付国債(30年)	196,000,000	220,923,360
第25回利付国債(30年)	237,000,000	257,585,820
第26回利付国債(30年)	454,000,000	502,437,260
第27回利付国債(30年)	431,000,000	485,624,940
第28回利付国債(30年)	501,000,000	565,333,410
第29回利付国債(30年)	465,000,000	515,229,300
第30回利付国債(30年)	656,000,000	712,540,640
第31回利付国債(30年)	631,000,000	671,384,000
第32回利付国債(30年)	695,000,000	753,560,700
第33回利付国債(30年)	721,000,000	733,689,600
第34回利付国債(30年)	759,000,000	804,714,570
第35回利付国債(30年)	604,000,000	612,546,600
第30回利付国債(20年)	876,000,000	985,316,040
第32回利付国債(20年)	77,000,000	87,780,000
第33回利付国債(20年)	36,000,000	41,760,720
第35回利付国債(20年)	117,000,000	134,601,480
第36回利付国債(20年)	201,000,000	229,992,240
第38回利付国債(20年)	400,000,000	453,836,000
第40回利付国債(20年)	601,000,000	670,259,240
第42回利付国債(20年)	869,000,000	992,267,650
第43回利付国債(20年)	94,000,000	109,784,480
第44回利付国債(20年)	480,000,000	546,681,600
第47回利付国債(20年)	114,000,000	127,152,180
第48回利付国債(20年)	209,000,000	238,481,540
第49回利付国債(20年)	515,000,000	570,058,650
第51回利付国債(20年)	200,000,000	219,420,000
第52回利付国債(20年)	214,000,000	236,669,020
第54回利付国債(20年)	480,000,000	535,425,600
第55回利付国債(20年)	291,000,000	319,096,050
第56回利付国債(20年)	444,000,000	486,681,720
第58回利付国債(20年)	162,000,000	175,761,900
第59回利付国債(20年)	589,000,000	626,395,610
第61回利付国債(20年)	289,000,000	285,849,900
第63回利付国債(20年)	442,000,000	473,536,700
第64回利付国債(20年)	441,000,000	476,407,890
第65回利付国債(20年)	333,000,000	359,486,820
第68回利付国債(20年)	686,000,000	761,871,600
第70回利付国債(20年)	522,000,000	591,123,240
第72回利付国債(20年)	404,000,000	443,406,160
第74回利付国債(20年)	528,000,000	578,767,200
第75回利付国債(20年)	705,000,000	771,721,200
第80回利付国債(20年)	545,000,000	595,717,700
第82回利付国債(20年)	645,000,000	703,946,550
第83回利付国債(20年)	791,000,000	861,873,600
第86回利付国債(20年)	735,000,000	818,349,000
第88回利付国債(20年)	556,000,000	618,127,440
第91回利付国債(20年)	839,000,000	931,843,740
第92回利付国債(20年)	711,000,000	769,934,790
第94回利付国債(20年)	775,000,000	837,503,750
第95回利付国債(20年)	677,000,000	748,904,170
第97回利付国債(20年)	798,000,000	870,953,160
第99回利付国債(20年)	775,000,000	834,109,250
第101回利付国債(20年)	743,000,000	830,391,660
第102回利付国債(20年)	897,000,000	1,001,850,330
第106回利付国債(20年)	781,000,000	848,134,760
第107回利付国債(20年)	822,000,000	879,556,440
第110回利付国債(20年)	831,000,000	888,056,460
第111回利付国債(20年)	949,000,000	1,027,140,660
第113回利付国債(20年)	807,000,000	860,132,880
第115回利付国債(20年)	849,000,000	916,648,320
第116回利付国債(20年)	1,047,000,000	1,129,723,470
第118回利付国債(20年)	971,000,000	1,016,064,110
第121回利付国債(20年)	984,000,000	1,013,283,840
第123回利付国債(20年)	873,000,000	925,563,330
第125回利付国債(20年)	774,000,000	833,474,160
第128回利付国債(20年)	619,000,000	635,657,290

	第130回利付国債(20年)	985,000,000	995,096,250
	第132回利付国債(20年)	347,000,000	344,185,830
	国債証券 小計	139,406,000,000	147,150,201,470
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	20,000,000	20,681,200
	第8回東京都公募公債(30年)	80,000,000	82,844,800
	第20回東京都公募公債(20年)	80,000,000	84,123,200
	第21回東京都公募公債(20年)	80,000,000	85,204,000
	第22回東京都公募公債(20年)	120,000,000	122,588,400
	第24回東京都公募公債(20年)	70,000,000	71,864,800
	第26回東京都公募公債(5年)	100,000,000	100,235,000
	第604回東京都公募公債	100,000,000	102,505,000
	第611回東京都公募公債	100,000,000	103,876,000
	第615回東京都公募公債	100,000,000	103,433,000
	第618回東京都公募公債	115,000,000	118,966,350
	第619回東京都公募公債	100,000,000	103,947,000
	第624回東京都公募公債	100,000,000	104,084,000
	第626回東京都公募公債	100,000,000	104,666,000
	第630回東京都公募公債	100,000,000	105,057,000
	第632回東京都公募公債	100,000,000	106,797,000
	第636回東京都公募公債	20,000,000	21,463,800
	第651回東京都公募公債	115,000,000	122,376,100
	第666回東京都公募公債	100,000,000	105,785,000
	第669回東京都公募公債	50,000,000	53,495,000
	第678回東京都公募公債	100,000,000	104,816,000
	第680回東京都公募公債	100,000,000	104,752,000
	第684回東京都公募公債	100,000,000	103,496,000
	第685回東京都公募公債	100,000,000	102,435,000
	第691回東京都公募公債	100,000,000	102,889,000
	平成15年度第8回北海道公募公債	120,700,000	123,280,566
	平成16年度第3回北海道公募公債	100,000,000	103,141,000
	平成17年度第1回北海道公募公債	110,000,000	113,685,000
	平成18年度第6回北海道公募公債	100,000,000	107,428,000
	平成19年度第4回北海道公募公債	20,000,000	21,550,600
	平成20年度第6回北海道公募公債	40,000,000	42,730,800
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	113,895,000
	第2回神奈川県公募公債(20年)	80,000,000	88,127,200
	第2回神奈川県公募公債(30年)	80,000,000	92,861,600
	第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	108,256,000
	第139回神奈川県公募公債	115,700,000	123,229,756
	第152回神奈川県公募公債	10,000,000	10,601,400
	第162回神奈川県公募公債	140,450,000	150,062,398
	第170回神奈川県公募公債	100,000,000	104,597,000
	第46回大阪府公募公債	100,000,000	101,959,000
	第256回大阪府公募公債	100,000,000	101,276,000
	第258回大阪府公募公債	100,000,000	102,234,000
	第270回大阪府公募公債	100,000,000	103,184,000
	第271回大阪府公募公債	70,200,000	72,675,954
	第281回大阪府公募公債	100,000,000	103,626,000
	第285回大阪府公募公債	50,000,000	52,139,000
	第300回大阪府公募公債	120,000,000	128,020,800
	第306回大阪府公募公債	30,000,000	32,145,600
	第313回大阪府公募公債	100,000,000	106,449,000
	第314回大阪府公募公債	30,000,000	32,197,500
	第326回大阪府公募公債	10,000,000	10,665,900
	第331回大阪府公募公債	100,000,000	104,595,000
	第332回大阪府公募公債	71,600,000	75,753,516
	平成15年度第3回京都府公募公債	100,000,000	102,492,000
	平成21年度第5回京都府公募公債	20,000,000	20,896,200
	平成22年度第5回京都府公募公債	110,000,000	113,269,200
	平成23年度第1回京都府公募公債	130,680,000	131,362,149
	平成15年度第6回兵庫県公募公債	100,000,000	102,293,000
	平成16年度第1回兵庫県公募公債	140,000,000	143,869,600
	平成17年度第8回兵庫県公募公債	100,000,000	103,713,000
	平成17年度第9回兵庫県公募公債	100,000,000	104,637,000
	平成20年度第5回兵庫県公募公債	50,000,000	54,113,000
	平成21年度第3回兵庫県公募公債	70,000,000	74,508,700
	平成18年度第2回静岡県公募公債	41,300,000	44,244,690
	平成19年度第1回静岡県公募公債	66,900,000	71,577,648
	平成20年度第1回静岡県公募公債	14,500,000	15,561,545

平成20年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	106,888,000	
平成20年度第5回静岡県公募公債	11,000,000	11,716,540	
平成21年度第4回静岡県公募公債	52,920,000	56,270,894	
平成22年度第6回静岡県公募公債	50,000,000	51,338,500	
平成23年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	101,089,000	
平成23年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	101,560,000	
平成18年度第4回愛知県公募公債	98,500,000	104,965,540	
平成22年度第1回愛知県公募公債	100,000,000	104,779,000	
平成22年度第16回愛知県公募公債	100,000,000	102,705,000	
平成22年度第19回愛知県公募公債	100,000,000	103,862,000	
平成23年度第7回愛知県公募公債	100,000,000	101,025,000	
平成18年度第4回広島県公募公債	90,000,000	96,229,800	
平成16年度第2回埼玉県公募公債	43,150,000	44,537,704	
平成16年度第5回埼玉県公募公債	45,000,000	46,580,400	
平成18年度第3回埼玉県公募公債	53,600,000	57,705,760	
平成18年度第5回埼玉県公募公債	62,100,000	66,554,433	
平成18年度第7回埼玉県公募公債	12,600,000	13,506,570	
平成19年度第3回埼玉県公募公債	39,100,000	42,262,017	
平成19年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	106,548,000	
平成23年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	103,604,000	
平成17年度第5回福岡県公募公債	50,000,000	52,300,500	
平成20年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	101,599,000	
平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)	80,000,000	83,536,800	
平成21年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	105,099,000	
平成22年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	102,039,000	
第9回千葉県公募公債(20年)	80,000,000	80,438,400	
平成16年度第1回千葉県公募公債	80,500,000	83,163,745	
平成18年度第1回千葉県公募公債	109,490,000	117,163,059	
平成20年度第2回千葉県公募公債	90,000,000	96,965,100	
平成20年度第3回千葉県公募公債	80,000,000	86,140,800	
平成20年度第4回千葉県公募公債	50,000,000	50,859,500	
平成21年度第5回千葉県公募公債	22,300,000	22,637,176	
平成22年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	100,249,000	
第1回群馬県公募公債	100,000,000	103,465,000	
第10回共同発行市場公募地方債	50,000,000	51,092,500	
第12回共同発行市場公募地方債	129,000,000	132,326,910	
第21回共同発行市場公募地方債	120,100,000	124,057,295	
第22回共同発行市場公募地方債	113,000,000	116,806,970	
第25回共同発行市場公募地方債	140,000,000	145,021,800	
第27回共同発行市場公募地方債	110,000,000	113,732,300	
第28回共同発行市場公募地方債	150,000,000	155,154,000	
第35回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,072,000	
第38回共同発行市場公募地方債	12,000,000	12,840,960	
第45回共同発行市場公募地方債	18,500,000	19,661,245	
第47回共同発行市場公募地方債	107,000,000	114,419,380	
第50回共同発行市場公募地方債	29,100,000	31,023,510	
第52回共同発行市場公募地方債	88,900,000	95,833,311	
第53回共同発行市場公募地方債	300,000	321,942	
第54回共同発行市場公募地方債	112,100,000	119,703,743	
第58回共同発行市場公募地方債	21,000,000	22,329,300	
第59回共同発行市場公募地方債	67,800,000	72,030,720	
第63回共同発行市場公募地方債	100,000,000	108,302,000	
第74回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,505,000	
第81回共同発行市場公募地方債	109,500,000	114,163,605	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,931,000	
平成18年度第1回堺市公募公債	30,000,000	32,051,400	
平成19年度第1回堺市公募公債	100,000,000	106,925,000	
平成18年度第2回熊本県公募公債	84,540,000	90,057,925	
第5回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	110,102,000	
平成18年度第6回大阪市公募公債	75,000,000	80,366,250	
平成19年度第4回大阪市公募公債	30,000,000	32,190,600	
平成21年度第6回大阪市公募公債	100,000,000	105,647,000	
第5回京都市公募公債(20年)	50,000,000	55,102,500	
平成16年度第5回神戸市公募公債	100,000,000	103,232,000	
平成17年度第10回神戸市公募公債	50,000,000	52,367,500	
平成17年度第13回神戸市公募公債	100,000,000	104,960,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債	120,000,000	135,172,800	
平成22年度第9回神戸市公募公債	80,000,000	83,116,000	
平成15年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	102,499,000	

平成17年度第3回横浜市公募公債	130,600,000	136,662,452	
第17回横浜市公募公債(20年)	80,000,000	84,106,400	
平成17年度第4回横浜市公募公債	17,800,000	18,619,512	
第20回横浜市公募公債(20年)	80,000,000	84,075,200	
平成20年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	107,314,000	
平成21年度第5回札幌市公募公債	100,000,000	104,758,000	
平成22年度第8回札幌市公募公債(30年)	80,000,000	82,912,000	
第23回川崎市公募公債	126,310,000	127,886,348	
第77回川崎市公募公債	64,500,000	67,003,890	
第82回川崎市公募公債	100,000,000	105,918,000	
平成17年度第3回福岡市公募公債	60,000,000	62,877,600	
平成18年度第6回福岡市公募公債	70,000,000	74,687,900	
平成20年度第5回福岡市公募公債	91,000,000	96,731,180	
平成18年度第1回千葉市公募公債	50,000,000	53,259,500	
平成20年度第1回岡山県公募公債	48,700,000	51,753,003	
地方債証券 小計	12,289,040,000	12,880,354,661	
特殊債券			
第9回オーストリア共和国政府保証オーストリア輸出銀行	100,000,000	100,650,000	
第2回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	100,000,000	102,081,000	
第8回政府保証日本政策投資銀行債券	101,000,000	105,125,850	
第10回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,933,000	
第16回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	100,000,000	103,176,000	
第27回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	100,000,000	106,944,000	
第46回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	50,000,000	53,261,500	
第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	100,000,000	108,648,000	
第3回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	100,000,000	104,753,000	
第5回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,181,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	20,000,000	22,051,200	
第10回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)			
第11回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,271,000	
第11回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	57,000,000	60,508,350	
第13回道路債券(財投機関債)	100,000,000	110,409,000	
第14回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	111,000,000	118,538,010	
第17回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,461,000	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	10,000,000	10,561,100	
第21回道路債券(財投機関債)	20,000,000	22,129,400	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)			
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	100,000,000	100,914,000	
第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,402,000	
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)			
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	60,000,000	65,238,600	
第24回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,542,000	
第25回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)			
第25回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	100,000,000	107,015,000	
第37回道路債券(財投機関債)	120,000,000	124,279,200	
第40回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	112,000,000	120,957,760	
第41回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	12,000,000	12,832,800	
第41回道路債券(財投機関債)	100,000,000	103,641,000	
第42回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	79,000,000	84,965,290	
第42回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)			
第42回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	100,000,000	106,297,000	
第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,947,000	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	34,000,000	36,502,400	
第64回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	56,000,000	59,756,480	
第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,771,000	
第75回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	144,000,000	150,896,160	
第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,797,000	
第82回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,165,000	
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	44,000,000	45,990,120	
第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,530,000	
第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	129,000,000	133,540,800	
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	10,000,000	10,423,800	
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	50,000,000	52,071,500	
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,354,000	
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,904,000	
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,171,000	
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	50,000,000	51,347,000	
第127回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,432,000	
第129回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,519,000	
第135回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	152,104,500	

第138回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,811,000
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	50,000,000	50,622,500
第142回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,246,000
第321回政府保証道路債券	116,000,000	118,488,200
第325回政府保証道路債券	115,000,000	117,679,500
第326回政府保証道路債券	130,000,000	133,415,100
第333回政府保証道路債券	100,000,000	103,768,000
第334回政府保証道路債券	100,000,000	103,592,000
第335回政府保証道路債券	100,000,000	103,366,000
第339回政府保証道路債券	116,000,000	120,273,440
第341回政府保証道路債券	100,000,000	103,419,000
第344回政府保証道路債券	100,000,000	106,339,000
第346回政府保証道路債券	100,000,000	103,951,000
第30回道路債券(財投機関債)	100,000,000	103,166,000
第1回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	50,000,000	53,586,500
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	25,000,000	26,352,250
第2回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	80,000,000	83,993,600
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,083,000
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)	20,000,000	19,559,800
第3回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	106,176,000
第5回政府保証公営企業債券(15年)	100,000,000	110,948,000
第5回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	104,713,000
第6回公営企業債券(20年)(財投機関債)	100,000,000	107,804,000
第6回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	105,579,000
第7回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,619,840
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,462,000
第8回政府保証地方公営企業等金融機構債券	48,000,000	50,958,720
第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)	50,000,000	55,416,000
第10回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,174,000
第12回公営企業債券(財投機関債)	50,000,000	51,664,000
第12回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,021,000
第14回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	80,000,000	84,197,600
第16回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	102,085,000
第16回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	80,000,000	79,916,800
第18回公営企業債券(財投機関債)	100,000,000	104,492,000
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,684,000
第19回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	50,000,000	51,377,000
第20回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	102,698,000
第21回政府保証地方公共団体金融機構債券	51,000,000	52,303,050
F24回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	70,000,000	73,193,400
第28回公営企業債券(財投機関債)	100,000,000	107,702,000
第831回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,383,000
第841回政府保証公営企業債券	101,000,000	105,008,690
第849回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,902,000
第851回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,407,000
第852回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,474,000
第856回政府保証公営企業債券	101,000,000	105,497,530
第860回政府保証公営企業債券	73,000,000	76,764,610
第864回政府保証公営企業債券	14,000,000	14,947,380
第866回政府保証公営企業債券	63,000,000	67,664,520
第870回政府保証公営企業債券	52,000,000	55,328,520
第879回政府保証公営企業債券	102,000,000	109,078,800
第883回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,395,000
第884回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,399,000
第885回政府保証公営企業債券	104,000,000	111,574,320
第2回政府保証公営企業債券(15年)	100,000,000	110,245,000
第2回政府保証首都高速道路債券	24,000,000	25,585,920
第3回政府保証首都高速道路債券	9,000,000	9,594,180
第4回政府保証首都高速道路債券	79,000,000	84,451,790
第9回首都高速道路債券(財投機関債)	100,000,000	103,337,000
第186回政府保証首都高速道路債券	115,000,000	116,334,000
第190回政府保証首都高速道路債券	81,000,000	83,095,470
第193回政府保証首都高速道路債券	55,000,000	56,873,300
第195回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	103,440,000
第197回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	103,896,000
第200回政府保証首都高速道路債券	8,000,000	8,289,840
第1回政府保証阪神高速道路債券	5,000,000	5,261,450
第6回阪神高速道路債券(財投機関債)	100,000,000	103,516,000

第135回政府保証阪神高速道路債券	23,000,000	23,494,500	
第136回政府保証阪神高速道路債券	50,000,000	51,163,000	
第137回政府保証阪神高速道路債券	50,000,000	51,301,500	
第1回水資源債券(財投機関債)	100,000,000	103,410,000	
第3回水資源開発債券(財投機関債)	50,000,000	50,195,000	
第10回日本政策金融公庫(財投機関債)	80,000,000	83,847,200	

[前](#) [次](#)

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
特殊債券	第14回日本政策金融公庫(財投機関債)	100,000,000	99,949,000	
	第15回日本政策金融公庫(財投機関債)	80,000,000	80,380,800	
	第26回中小企業債券(財投機関債)	50,000,000	51,215,000	
	第190回政府保証中小企業債券	13,000,000	13,902,460	
	第191回政府保証中小企業債券	9,000,000	9,620,730	
	第29回都市再生債券(財投機関債)	100,000,000	101,759,000	
	第27回政府保証本州四国連絡橋債券	100,000,000	103,929,000	
	第46回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	103,337,000	
	第50回政府保証関西国際空港債券	64,000,000	69,100,160	
	第52回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	103,224,000	
	第53回政府保証関西国際空港債券	47,000,000	49,771,120	
	第10回福祉医療機構債券(財投機関債)	100,000,000	107,397,000	
	第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,657,000	67,881,444	
	第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	48,242,000	50,792,072	
	第2回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,263,000	24,229,345	
	第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,140,000	68,630,852	
	第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	50,010,000	52,931,584	
	第2回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	100,000,000	106,615,000	
	第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	25,464,000	26,605,041	
	第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,644,000	68,485,146	
	第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	38,799,000	40,305,953	
	第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	41,546,000	44,116,035	
	第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,492,000	67,795,280	
	第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	56,890,000	59,165,031	
	第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	42,271,000	44,805,146	
	第8回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	70,000,000	74,565,400	
	第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	43,038,000	45,594,887	
	第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	62,439,000	65,876,891	
	第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	35,915,000	36,603,849	
	第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	44,516,000	47,089,915	
	第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,085,000	76,113,830	
	第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券	41,065,000	42,326,106	
	第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	72,281,000	75,380,409	
	第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	145,014,000	150,292,509	
	第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券	45,525,000	47,088,783	
	第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	47,163,000	49,577,745	
	第21回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	100,000,000	108,126,000	
	第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券	59,166,000	60,720,290	
	第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	62,133,000	63,800,028	
	第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	63,537,000	65,263,300	
	第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,839,000	91,287,559	
	第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,268,000	93,748,734	
	第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,814,000	93,993,398	
	第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	62,551,000	64,747,165	
	第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	64,067,000	67,263,943	
	第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	61,718,000	65,792,005	
	第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,095,000	96,933,186	
	第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,553,000	98,740,648	
	第45回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	100,000,000	104,151,000	
	第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,610,000	201,950,718	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,413,000	100,487,354		
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,933,000	100,301,019		
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	63,408,000	66,873,247		
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,223,000	100,428,106		
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,130,000	99,962,692		
第75回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	80,000,000	81,944,000		
第12回政府保証国民生活債券	102,000,000	104,655,060		
第15回政府保証国民生活債券	98,000,000	101,801,420		
第17回政府保証国民生活債券	41,000,000	43,133,230		
第21回政府保証国民生活債券	2,000,000	2,117,600		
第2回政府保証農林漁業金融公庫	10,000,000	10,244,000		
第2回政府保証成田国際空港債券	38,000,000	39,955,860		
第5回新東京国際空港債券(財投機関債)	140,000,000	143,760,400		
第2回沖縄振興開発金融公庫債券(財投機関債)	100,000,000	102,381,000		
第6回沖縄振興開発金融公庫債券(財投機関債)	50,000,000	53,252,500		
い第703号商工債券	100,000,000	102,300,000		
い第705号商工債券	100,000,000	102,377,000		

い第709号商工債券	100,000,000	102,220,000	
い第723号商工債券	100,000,000	100,459,000	
い第724号商工債券	50,000,000	50,217,000	
い第729号商工債券	100,000,000	101,185,000	
い第732号商工債券	100,000,000	100,767,000	
い第698号農林債券	50,000,000	50,920,000	
い第702号農林債券	50,000,000	51,164,000	
い第707号農林債券	100,000,000	102,363,000	
い第712号農林債券	50,000,000	50,760,000	
い第713号農林債券	100,000,000	101,286,000	
い第714号農林債券	100,000,000	101,583,000	
い第715号農林債券	130,000,000	131,331,200	
い第716号農林債券	50,000,000	50,594,500	
い第720号農林債券	100,000,000	100,884,000	
い第721号農林債券	100,000,000	100,724,000	
い第725号農林債券	80,000,000	79,961,600	
い第728号農林債券	100,000,000	100,493,000	
第231回信金中金債	60,000,000	61,351,200	
第234回信金中金債	50,000,000	51,007,500	
第237回信金中金債	150,000,000	152,710,500	
第240回信金中金債	100,000,000	101,640,000	
第244回信金中金債	50,000,000	50,478,500	
第249回信金中金債	100,000,000	100,424,000	
第255回信金中金債	150,000,000	152,019,000	
第257回信金中金債	50,000,000	50,574,000	
第8号商工債券(10年)	100,000,000	106,424,000	
第138号商工債券(3年)	100,000,000	100,173,000	
第7回国際協力機構債券(財投機関債)	70,000,000	71,310,400	
第1回オランダ開発金融公庫	100,000,000	100,494,000	
第4回政府保証東日本高速道路債券	75,000,000	80,073,750	
第6回政府保証東日本高速道路債券	37,000,000	39,508,970	
第7回政府保証東日本高速道路債券	34,000,000	36,710,140	
第10回政府保証東日本高速道路債券	89,000,000	94,240,320	
第13回政府保証東日本高速道路債券	28,000,000	29,881,320	
第3回政府保証中日本高速道路債券	27,000,000	28,385,640	
第20回政府保証中日本高速道路債券	10,000,000	10,535,600	
第23回政府保証中日本高速道路債券	46,000,000	48,780,240	
第5回政府保証西日本高速道路債券	41,000,000	43,847,860	
第6回政府保証西日本高速道路債券	51,000,000	54,596,520	
第8回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	106,701,000	
第10回西日本高速道路	100,000,000	100,251,000	
第11回政府保証西日本高速道路債券	31,000,000	33,167,210	
特殊債券 小計	18,119,917,000	18,845,185,595	
社債券			
第347回東京交通債券	100,000,000	107,462,000	
第11回関西国際空港	50,000,000	52,778,000	
第24回関西国際空港	100,000,000	100,320,000	
第1回成田国際空港	20,000,000	20,687,400	
第7回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	101,211,000	
第5回パークレイズ・バンク	100,000,000	96,462,000	
第4回ナショナル・オーストラリア銀行	100,000,000	99,881,000	
第5回ナショナル・オーストラリア銀行	100,000,000	99,216,000	
第5回オーストラリア・コモンウェルス銀行	100,000,000	98,471,000	
第5回ウエストバック・バンキング・コーポレーション	100,000,000	100,237,000	
第7回ウエストバック・バンキング・コーポレーション	100,000,000	99,612,000	
第1回オーストラリア連邦保証ANZ銀行	100,000,000	102,403,000	
第5回オーストラリア・ニュージーランド銀行	100,000,000	100,141,000	
第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行	100,000,000	99,035,000	
第3回ラポバンク・ネダーランド	100,000,000	98,976,000	
第9回ラポバンク・ネダーランド	100,000,000	95,473,000	
第4回ウォルマート・ストアーズ・インク	100,000,000	100,845,000	
第32回アサヒビール	100,000,000	100,815,000	
第4回サントリーホールディングス	100,000,000	100,949,000	
第1回コカ・コーラウエスト	100,000,000	100,980,000	
第1回セブン&アイ・ホールディングス	100,000,000	101,633,000	
第8回旭化成	100,000,000	104,433,000	
第31回三菱化学	100,000,000	104,319,000	
第39回三井化学	100,000,000	106,643,000	
第1回大日本住友製薬	100,000,000	100,470,000	
第1回第一三共	100,000,000	101,865,000	

第4回フジ・メディア・ホールディングス	100,000,000	102,597,000	
第2回コニカミノルタホールディングス	100,000,000	101,358,000	
第29回新日本石油	100,000,000	103,097,000	
第11回旭硝子	100,000,000	101,992,000	
第6回日本電気硝子	100,000,000	102,151,000	
第67回新日本製鐵	100,000,000	102,106,000	
第58回住友金属工業	100,000,000	102,273,000	
第11回ジェイエフイーホールディングス	100,000,000	101,634,000	
第16回ジェイエフイーホールディングス	100,000,000	101,617,000	
第11回YKK	100,000,000	101,094,000	
第18回豊田自動織機	100,000,000	109,401,000	
第8回小松製作所	100,000,000	100,529,000	
第11回クボタ	100,000,000	103,542,000	
第14回ダイキン工業	100,000,000	101,641,000	
第14回日立製作所	100,000,000	103,924,000	
第43回三菱電機	100,000,000	100,596,000	
第43回日本電気	100,000,000	99,452,000	
第26回富士通	100,000,000	100,037,000	
第10回パナソニック	100,000,000	101,000,000	
第25回ソニー	100,000,000	102,229,000	
第7回デンソー	100,000,000	100,490,000	
第1回日東電工	100,000,000	102,170,000	
第3回松下電工	100,000,000	104,103,000	
第1回日本生命2010基金	100,000,000	100,127,000	
第1回B号日本生命2011基金	100,000,000	100,393,000	
第1回明治安田生命2011基金	100,000,000	100,158,000	
第5回アイシン精機	100,000,000	102,977,000	
第7回リコー	100,000,000	102,326,000	
第5回凸版印刷	100,000,000	103,036,000	
第3回大日本印刷	100,000,000	102,750,000	
第48回伊藤忠商事	100,000,000	106,799,000	
第59回三井物産	100,000,000	109,038,000	
第30回住友商事	100,000,000	104,915,000	
第69回三菱商事	100,000,000	107,784,000	
第14回みずほコーポレート銀行	100,000,000	102,231,000	
第18回みずほコーポレート銀行	100,000,000	101,235,000	
第23回みずほコーポレート銀行	100,000,000	99,883,000	
第7回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	100,000,000	106,645,000	
第8回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	100,000,000	103,355,000	
第9回三菱東京UFJ銀行	200,000,000	228,092,000	
第28回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	100,000,000	101,406,000	
第30回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	100,000,000	101,264,000	
第87回三菱東京UFJ銀行	100,000,000	106,980,000	
第121回三菱東京UFJ銀行	100,000,000	100,589,000	
第2回三菱UFJ信託銀行(劣後特約付)	100,000,000	103,208,000	
第5回住友信託銀行(劣後特約付)	100,000,000	105,633,000	
第6回住友信託銀行(劣後特約付)	100,000,000	107,144,000	
第3回中央三井信託銀行(劣後特約付)	100,000,000	103,686,000	
第9回三井住友銀行(劣後特約付)	100,000,000	103,723,000	
第10回三井住友銀行(劣後特約付)	100,000,000	106,049,000	
第20回三井住友銀行(劣後特約付)	100,000,000	107,342,000	
第23回三井住友銀行(劣後特約付)	100,000,000	101,738,000	
第25回三井住友銀行(劣後特約付)	100,000,000	101,368,000	
第53回三井住友銀行	100,000,000	101,059,000	
第54回三井住友銀行	100,000,000	100,158,000	
第2回みずほ銀行(劣後特約付)	100,000,000	102,905,000	
第6回みずほ銀行(劣後特約付)	100,000,000	105,945,000	
第9回みずほ銀行(劣後特約付)	100,000,000	103,106,000	
第16回ホンダファイナンス	100,000,000	100,623,000	
第40回トヨタファイナンス	100,000,000	102,803,000	
第3回三井住友ファイナンス&リース	100,000,000	100,164,000	
第13回三菱UFJリース	100,000,000	100,998,000	
第15回野村ホールディングス	100,000,000	102,900,000	
第27回野村ホールディングス	100,000,000	97,134,000	
第2回財政融資マスタートラスト特定目的会社第1回	100,000,000	107,055,000	
第5回三井住友海上火災保険	100,000,000	100,368,000	
第31回三井不動産	100,000,000	103,445,000	
第98回三菱地所	100,000,000	101,746,000	
第1回イオンモール	100,000,000	101,349,000	

第7回エヌ・ティ・ティ都市開発	100,000,000	106,440,000	
第54回小田急電鉄	100,000,000	101,856,000	
第25回京王電鉄	100,000,000	106,182,000	
第56回東日本旅客鉄道	100,000,000	106,688,000	
第5回東海旅客鉄道	30,000,000	34,022,400	
第56回東海旅客鉄道	100,000,000	103,180,000	
第5回日本通運	100,000,000	107,350,000	
第11回商船三井	100,000,000	101,843,000	
第4回関西高速鉄道	100,000,000	105,772,000	
第5回関西高速鉄道	100,000,000	101,844,000	
第52回日本電信電話	100,000,000	106,464,000	
第53回日本電信電話	100,000,000	105,540,000	
第59回日本電信電話	100,000,000	106,811,000	
第19回KDDI	100,000,000	101,049,000	
第15回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	100,000,000	108,225,000	
第428回東京電力	100,000,000	91,681,000	
第519回東京電力	120,000,000	98,175,600	
第524回東京電力	100,000,000	78,790,000	
第532回東京電力	50,000,000	38,248,000	
第534回東京電力	100,000,000	71,926,000	
第536回東京電力	100,000,000	74,835,000	
第544回東京電力	100,000,000	75,277,000	
第546回東京電力	100,000,000	87,742,000	
第549回東京電力	140,000,000	102,373,600	
第560回東京電力	80,000,000	47,567,200	
第567回東京電力	80,000,000	46,652,000	
第407回中部電力	50,000,000	54,571,000	
第467回中部電力	100,000,000	102,514,000	
第473回中部電力	100,000,000	103,002,000	
第478回中部電力	100,000,000	104,802,000	
第481回中部電力	100,000,000	102,059,000	
第484回中部電力	100,000,000	102,016,000	
第489回中部電力	100,000,000	100,922,000	
第448回関西電力	100,000,000	106,944,000	
第456回関西電力	100,000,000	105,837,000	
第485回関西電力	100,000,000	99,496,000	
第350回中国電力	100,000,000	102,525,000	
第277回北陸電力	60,000,000	61,405,800	
第383回東北電力	100,000,000	110,611,000	
第431回東北電力	120,000,000	127,011,600	
第445回東北電力	100,000,000	104,221,000	
第448回東北電力	100,000,000	102,892,000	
第379回九州電力	100,000,000	103,106,000	
第408回九州電力	100,000,000	103,889,000	
第256回北海道電力	80,000,000	89,346,400	
第261回北海道電力	24,000,000	26,455,440	
第293回北海道電力	100,000,000	105,145,000	
第302回北海道電力	100,000,000	99,019,000	
第310回北海道電力	50,000,000	49,811,000	
第9回沖縄電力	31,000,000	31,192,200	
第19回沖縄電力	80,000,000	82,473,600	
第30回東京ガス	100,000,000	104,258,000	
第9回大阪ガス	100,000,000	113,588,000	
第10回西部瓦斯	100,000,000	101,021,000	
第25回エヌ・ティ・ティ・データ	100,000,000	104,446,000	
社債券 小計	14,565,000,000	14,729,096,240	
合計	184,379,957,000	193,604,837,966	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[前へ](#) [次へ](#)

「外国債券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。

(1) 貸借対照表

		[ 平成24年1月26日現在 ]
		金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金		388,537,206
コール・ローン		91,465,725
国債証券		152,054,999,729
派生商品評価勘定		114,405
未収利息		1,758,465,721
前払費用		109,915,659
流動資産合計		154,403,498,445
資産合計		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		6,300
未払金		135,818,208
未払解約金		5,502,819
流動負債合計		141,327,327
負債合計		
純資産の部		
元本等		
元本	1	120,750,418,705
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		33,511,752,413
元本等合計		154,262,171,118
純資産合計		
負債純資産合計		

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年5月13日から翌年5月12日までであります。

(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	<p>有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場（外貨建証券の場合は知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合また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、委託会社が忠実義務に基づいて合理的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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	[ 平成24年1月26日現在 ]
1 期首	平成23年10月31日
期首元本額	119,138,695,196円
期首からの追加設定元本額	4,308,218,526円
期首からの一部解約元本額	2,696,495,017円
元本の内訳*	
ファンド・マネジャー（海外債券）	119,275,809円
eMAXIS 先進国債券インデックス	1,415,956,829円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	10,864,308円
eMAXIS バランス（波乗り型）	4,143,647円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	3,810,912,138円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	38,453,881,735円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	5,737,706,145円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	4,019,382,534円
MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	2,920,365,302円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	37,702,945,515円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型（適格機関投資家限定）	8,735,468,208円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	2,024,976,409円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型（適格機関投資家限定）	539,254,562円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	302,050,616円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	3,334,179,822円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	15,878,580円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	52,553,035円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	88,473,418円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	95,155,536円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	48,571,347円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	2,633,496,894円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	491,477,910円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	917,080,096円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	935,103,534円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	1,060,058,461円
外国債券インデックスファンドi（適格機関投資家限定）	2,042,985,077円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	1,928,042,193円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	261,734,004円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	608,580,995円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	343,282,145円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	96,581,901円
（合計）	120,750,418,705円
2 受益権の総数	120,750,418,705口
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2775円 （12,775円）

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

## 1 金融商品の状況に関する事項

区分	(自平成23年10月31日 至平成24年1月26日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資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。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債を実質的な主要投資対象としております。公社債の投資に係る価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[ 平成24年1月26日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。
2 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）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関係に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。
---------------------------	--

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[平成24年1月26日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	5,847,847,844	
合計	5,847,847,844	

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

区分	種類	[平成24年1月26日現在]			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち1年超			
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカドル	24,892,340		24,886,400	5,940
	オーストラリアドル	2,472,960		2,472,600	360
	イギリスポンド	3,644,010		3,652,500	8,490
	ユーロ	23,317,285		23,423,200	105,915
	合計	54,326,595		54,434,700	108,105

(注) 時価の算定方法

1 対顧客先物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。

為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます。)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。

当該日の対顧客先物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。

(イ) 当該日を超える対顧客先物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相場の仲値をもとに計算したレートをを用いております。

(ロ) 当該日を超える対顧客先物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相場の仲値を用いております。

2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

(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。

[前へ](#) [次へ](#)

## (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)

通貨		銘柄	券面総額	評価額	備考
種類					
アメリカドル					
国債証券	0.125 T-NOTE	130831	4,900,000.00	4,895,023.46	
	0.125 T-NOTE	130930	4,800,000.00	4,793,625.02	
	0.25 T-NOTE	131031	5,000,000.00	5,003,125.00	
	0.25 T-NOTE	131130	4,500,000.00	4,502,460.96	
	0.25 T-NOTE	140915	5,400,000.00	5,393,250.00	
	0.25 T-NOTE	141215	5,000,000.00	4,989,843.75	
	0.375 T-NOTE	130630	3,000,000.00	3,007,968.75	
	0.375 T-NOTE	130731	6,300,000.00	6,316,242.20	
	0.375 T-NOTE	141115	5,000,000.00	5,008,984.40	
	0.5 T-NOTE	130531	3,300,000.00	3,314,179.70	
	0.5 T-NOTE	131015	4,800,000.00	4,824,000.00	
	0.5 T-NOTE	131115	3,200,000.00	3,216,250.01	
	0.5 T-NOTE	140815	4,300,000.00	4,323,851.57	
	0.5 T-NOTE	141015	4,000,000.00	4,021,250.00	
	0.625 T-NOTE	121231	4,900,000.00	4,922,203.12	
	0.625 T-NOTE	130131	4,200,000.00	4,219,031.25	
	0.625 T-NOTE	130228	3,500,000.00	3,516,132.83	
	0.625 T-NOTE	130430	3,200,000.00	3,218,250.01	
	0.625 T-NOTE	140715	5,000,000.00	5,043,359.40	
	0.75 T-NOTE	130331	2,700,000.00	2,717,929.70	
	0.75 T-NOTE	130815	4,600,000.00	4,639,531.25	
	0.75 T-NOTE	130915	3,000,000.00	3,026,718.75	
	0.75 T-NOTE	131215	2,900,000.00	2,928,320.32	
	0.75 T-NOTE	140615	3,900,000.00	3,945,703.12	
	0.875 T-NOTE	161130	6,000,000.00	6,026,718.78	
	1 T-NOTE	130715	5,200,000.00	5,260,937.50	
	1 T-NOTE	140115	2,000,000.00	2,030,000.00	
	1 T-NOTE	140515	4,600,000.00	4,679,421.89	
	1 T-NOTE	160831	4,500,000.00	4,558,710.96	
	1 T-NOTE	160930	5,000,000.00	5,060,937.50	
	1 T-NOTE	161031	3,700,000.00	3,741,335.95	
	1.125 T-NOTE	130615	4,700,000.00	4,760,585.96	
	1.25 T-NOTE	140215	4,000,000.00	4,082,500.00	
	1.25 T-NOTE	140315	3,700,000.00	3,779,781.25	
	1.25 T-NOTE	140415	3,500,000.00	3,578,476.58	
	1.25 T-NOTE	150831	4,300,000.00	4,426,984.37	
	1.25 T-NOTE	150930	5,000,000.00	5,144,921.90	
	1.25 T-NOTE	151031	4,600,000.00	4,729,734.39	
	1.375 T-NOTE	130115	6,300,000.00	6,373,335.96	
	1.375 T-NOTE	130215	6,200,000.00	6,274,109.40	
	1.375 T-NOTE	130315	6,000,000.00	6,080,156.28	
	1.375 T-NOTE	130515	5,200,000.00	5,280,843.77	
	1.375 T-NOTE	151130	4,300,000.00	4,440,757.83	
	1.375 T-NOTE	180930	3,000,000.00	3,007,500.00	
	1.375 T-NOTE	181130	2,000,000.00	1,999,375.00	
	1.5 T-NOTE	131231	3,700,000.00	3,791,054.70	
	1.5 T-NOTE	160630	5,000,000.00	5,181,640.65	
	1.5 T-NOTE	160731	4,300,000.00	4,455,203.12	
	1.5 T-NOTE	180831	2,200,000.00	2,225,437.50	
	1.75 T-NOTE	130415	5,300,000.00	5,401,859.37	
	1.75 T-NOTE	140131	3,100,000.00	3,193,726.57	
	1.75 T-NOTE	140331	4,300,000.00	4,441,093.75	
	1.75 T-NOTE	150731	3,700,000.00	3,871,992.20	
	1.75 T-NOTE	160531	2,700,000.00	2,829,093.75	
	1.75 T-NOTE	181031	4,500,000.00	4,616,718.75	
	1.875 T-NOTE	140228	2,800,000.00	2,894,500.00	
	1.875 T-NOTE	140430	3,900,000.00	4,042,593.75	
	1.875 T-NOTE	150630	3,800,000.00	3,986,437.50	

1.875 T-NOTE 170831	3,000,000.00	3,140,156.25
1.875 T-NOTE 170930	2,700,000.00	2,821,921.87
1.875 T-NOTE 171031	2,500,000.00	2,610,937.50
11.25 T-BOND 150215	940,000.00	1,251,521.87
2 T-NOTE 131130	4,500,000.00	4,647,304.71
2 T-NOTE 160131	3,100,000.00	3,277,765.62
2 T-NOTE 160430	2,500,000.00	2,644,921.87
2 T-NOTE 211115	4,000,000.00	3,996,875.00
2.125 T-NOTE 141130	5,800,000.00	6,094,984.40
2.125 T-NOTE 150531	5,100,000.00	5,394,445.33
2.125 T-NOTE 151231	2,300,000.00	2,443,210.94
2.125 T-NOTE 160229	1,000,000.00	1,062,812.50
2.125 T-NOTE 210815	5,800,000.00	5,881,562.50
2.25 T-NOTE 140531	4,800,000.00	5,023,125.02
2.25 T-NOTE 150131	5,100,000.00	5,390,062.50
2.25 T-NOTE 160331	2,500,000.00	2,671,093.75
2.25 T-NOTE 171130	3,000,000.00	3,196,875.00
2.25 T-NOTE 180731	5,000,000.00	5,303,125.00
2.375 T-NOTE 140831	4,500,000.00	4,741,875.00
2.375 T-NOTE 140930	5,200,000.00	5,486,812.50
2.375 T-NOTE 141031	4,700,000.00	4,966,578.12
2.375 T-NOTE 150228	5,300,000.00	5,628,351.58
2.375 T-NOTE 160331	3,600,000.00	3,864,375.00
2.375 T-NOTE 170731	3,200,000.00	3,437,500.00
2.375 T-NOTE 180531	2,500,000.00	2,675,000.00
2.375 T-NOTE 180630	4,000,000.00	4,277,500.00
2.5 T-NOTE 130331	3,200,000.00	3,288,250.01
2.5 T-NOTE 150331	6,300,000.00	6,723,773.46
2.5 T-NOTE 150430	5,400,000.00	5,767,875.00
2.5 T-NOTE 170630	1,000,000.00	1,081,250.00
2.625 T-NOTE 140630	5,100,000.00	5,391,656.25
2.625 T-NOTE 140731	4,700,000.00	4,977,593.75
2.625 T-NOTE 141231	5,200,000.00	5,546,937.50
2.625 T-NOTE 160229	2,300,000.00	2,491,187.50
2.625 T-NOTE 160430	3,000,000.00	3,252,656.25
2.625 T-NOTE 180131	1,000,000.00	1,086,718.75
2.625 T-NOTE 180430	1,600,000.00	1,737,500.00
2.625 T-NOTE 200815	8,500,000.00	9,095,000.00
2.625 T-NOTE 201115	6,300,000.00	6,723,281.25
2.75 T-NOTE 130228	2,300,000.00	2,364,687.50
2.75 T-NOTE 131031	4,100,000.00	4,282,898.45
2.75 T-NOTE 161130	3,700,000.00	4,043,406.25
2.75 T-NOTE 170531	4,700,000.00	5,143,562.50
2.75 T-NOTE 171231	1,700,000.00	1,861,234.37
2.75 T-NOTE 180228	1,000,000.00	1,094,687.50
2.75 T-NOTE 190215	5,900,000.00	6,430,078.12
2.875 T-NOTE 130131	2,300,000.00	2,363,250.00
2.875 T-NOTE 180331	3,000,000.00	3,307,031.25
3 T-NOTE 160831	4,000,000.00	4,414,375.00
3 T-NOTE 160930	3,500,000.00	3,865,312.50
3 T-NOTE 170228	3,400,000.00	3,760,718.75
3.125 T-BOND 411115	1,500,000.00	1,492,031.25
3.125 T-NOTE 130430	2,900,000.00	3,010,335.95
3.125 T-NOTE 130831	3,700,000.00	3,873,726.58
3.125 T-NOTE 130930	3,500,000.00	3,671,171.87
3.125 T-NOTE 161031	4,500,000.00	4,997,109.37
3.125 T-NOTE 170131	3,800,000.00	4,226,906.25
3.125 T-NOTE 170430	2,100,000.00	2,338,546.87
3.125 T-NOTE 190515	7,700,000.00	8,587,906.25
3.125 T-NOTE 210515	7,100,000.00	7,845,500.00
3.25 T-NOTE 160531	2,900,000.00	3,224,890.62
3.25 T-NOTE 160630	3,100,000.00	3,450,203.12
3.25 T-NOTE 160731	4,000,000.00	4,458,750.00
3.25 T-NOTE 161231	3,800,000.00	4,247,093.75
3.25 T-NOTE 170331	3,400,000.00	3,804,812.50
3.375 T-NOTE 130630	2,500,000.00	2,614,062.50
3.375 T-NOTE 130731	900,000.00	943,312.50
3.375 T-NOTE 191115	10,000,000.00	11,326,562.50
3.5 T-BOND 390215	3,600,000.00	3,871,687.50

3.5 T-NOTE 130531	2,900,000.00	3,030,726.57
3.5 T-NOTE 180215	5,000,000.00	5,689,062.50
3.5 T-NOTE 200515	7,200,000.00	8,224,875.00
3.625 T-NOTE 121231	2,400,000.00	2,477,625.00
3.625 T-NOTE 130515	3,500,000.00	3,657,500.00
3.625 T-NOTE 190815	6,200,000.00	7,140,656.25
3.625 T-NOTE 200215	9,700,000.00	11,174,703.12
3.625 T-NOTE 210215	6,800,000.00	7,820,000.00
3.75 T-BOND 410815	3,700,000.00	4,145,156.25
3.75 T-NOTE 181115	4,900,000.00	5,674,046.87
3.875 T-BOND 400815	6,400,000.00	7,325,000.00
3.875 T-NOTE 130215	3,100,000.00	3,220,125.00
3.875 T-NOTE 180515	3,000,000.00	3,489,843.75
4 T-NOTE 140215	5,000,000.00	5,385,937.50
4 T-NOTE 150215	4,200,000.00	4,663,312.50
4 T-NOTE 180815	3,000,000.00	3,521,718.75
4.125 T-NOTE 150515	3,400,000.00	3,816,500.00
4.25 T-BOND 390515	4,500,000.00	5,480,859.37
4.25 T-BOND 401115	6,300,000.00	7,675,171.87
4.25 T-NOTE 130815	4,000,000.00	4,251,875.00
4.25 T-NOTE 131115	5,200,000.00	5,576,187.50
4.25 T-NOTE 140815	3,600,000.00	3,963,375.00
4.25 T-NOTE 141115	3,000,000.00	3,329,531.25
4.25 T-NOTE 150815	3,500,000.00	3,966,484.37
4.25 T-NOTE 171115	3,100,000.00	3,656,062.50
4.375 T-BOND 380215	2,000,000.00	2,480,312.50
4.375 T-BOND 391115	6,100,000.00	7,576,390.62
4.375 T-BOND 400515	6,000,000.00	7,454,062.50
4.375 T-BOND 410515	5,700,000.00	7,090,265.62
4.5 T-BOND 360215	3,500,000.00	4,403,984.37
4.5 T-BOND 380515	2,600,000.00	3,287,781.25
4.5 T-BOND 390815	4,900,000.00	6,202,328.12
4.5 T-NOTE 151115	3,200,000.00	3,679,500.00
4.5 T-NOTE 160215	3,500,000.00	4,048,515.62
4.5 T-NOTE 170515	1,900,000.00	2,251,796.87
4.625 T-BOND 400215	5,800,000.00	7,484,718.75
4.625 T-NOTE 161115	3,300,000.00	3,897,093.75
4.625 T-NOTE 170215	2,700,000.00	3,204,140.62
4.75 T-BOND 370215	1,700,000.00	2,218,765.62
4.75 T-BOND 410215	5,500,000.00	7,247,109.37
4.75 T-NOTE 140515	4,200,000.00	4,631,156.25
4.75 T-NOTE 170815	2,900,000.00	3,490,875.00
4.875 T-NOTE 160815	2,900,000.00	3,445,109.37
5 T-BOND 370515	2,100,000.00	2,838,609.37
5.125 T-NOTE 160515	3,300,000.00	3,928,031.25
5.25 T-BOND 281115	1,400,000.00	1,880,156.25
5.25 T-BOND 290215	1,400,000.00	1,882,781.25
5.375 T-BOND 310215	2,200,000.00	3,043,218.75
5.5 T-BOND 280815	1,000,000.00	1,375,781.25
6 T-BOND 260215	1,700,000.00	2,401,515.62
6.125 T-BOND 271115	2,400,000.00	3,482,625.00
6.125 T-BOND 290815	1,000,000.00	1,474,843.75
6.25 T-BOND 230815	2,500,000.00	3,532,812.50
6.25 T-BOND 300515	1,700,000.00	2,556,109.37
6.375 T-BOND 270815	900,000.00	1,334,109.37
6.5 T-BOND 261115	1,100,000.00	1,633,328.12
6.625 T-BOND 270215	1,000,000.00	1,504,843.75
6.875 T-BOND 250815	1,300,000.00	1,967,265.62
7.125 T-BOND 230215	1,300,000.00	1,943,093.75
7.25 T-BOND 160515	2,600,000.00	3,334,906.25
7.25 T-BOND 220815	1,200,000.00	1,796,812.50
7.5 T-BOND 161115	2,100,000.00	2,768,718.75
7.5 T-BOND 241115	1,000,000.00	1,571,562.50
7.625 T-BOND 250215	1,100,000.00	1,750,375.00
8 T-BOND 211115	1,700,000.00	2,630,218.75
8.125 T-BOND 190815	2,100,000.00	3,108,328.12
8.75 T-BOND 170515	2,000,000.00	2,818,750.00
8.75 T-BOND 200815	1,700,000.00	2,661,828.12
8.875 T-BOND 170815	1,400,000.00	2,004,406.25

	8.875 T-BOND 190215	2,300,000.00	3,473,359.37
	国債証券 小計	732,840,000.00	805,194,569.27 (62,628,033,597)
	アメリカドル 小計	732,840,000.00	805,194,569.27 (62,628,033,597)
	カナダドル		
国債証券	1 CAN GOVT 140201	1,000,000.00	999,450.00
	1.5 CAN GOVT 131101	1,600,000.00	1,613,152.00
	1.5 CAN GOVT 170301	700,000.00	702,079.00
	1.75 CAN GOVT 130301	2,900,000.00	2,923,084.00
	2 CAN GOVT 130801	1,600,000.00	1,623,056.00
	2 CAN GOVT 140301	1,500,000.00	1,529,775.00
	2 CAN GOVT 141201	2,100,000.00	2,151,429.00
	2 CAN GOVT 160601	1,100,000.00	1,131,163.00
	2.25 CAN GOVT 140801	1,300,000.00	1,337,622.00
	2.5 CAN GOVT 130901	1,200,000.00	1,227,852.00
	2.5 CAN GOVT 150601	1,400,000.00	1,459,906.00
	2.75 CAN GOVT 160901	1,100,000.00	1,167,320.00
	3 CAN GOVT 140601	2,300,000.00	2,402,925.00
	3 CAN GOVT 151201	1,700,000.00	1,810,993.00
	3.25 CAN GOVT 210601	1,500,000.00	1,653,000.00
	3.5 CAN GOVT 130601	2,100,000.00	2,169,174.00
	3.5 CAN GOVT 200601	2,000,000.00	2,240,000.00
	3.5 CAN GOVT 451201	500,000.00	593,305.00
	3.75 CAN GOVT 190601	2,800,000.00	3,177,160.00
	4 CAN GOVT 160601	1,800,000.00	2,002,194.00
	4 CAN GOVT 170601	1,750,000.00	1,977,342.50
	4 CAN GOVT 410601	2,000,000.00	2,551,000.00
	4.25 CAN GOVT 180601	1,800,000.00	2,088,270.00
	4.5 CAN GOVT 150601	1,800,000.00	1,994,418.00
	5 CAN GOVT 140601	1,800,000.00	1,963,764.00
	5 CAN GOVT 370601	2,300,000.00	3,275,085.00
	5.25 CAN GOVT 130601	1,400,000.00	1,478,736.00
	5.75 CAN GOVT 290601	1,700,000.00	2,465,816.00
	5.75 CAN GOVT 330601	2,200,000.00	3,310,098.00
	8 CAN GOVT 230601	700,000.00	1,107,008.00
	8 CAN GOVT 270601	900,000.00	1,539,828.00
	9 CAN GOVT 250601	650,000.00	1,147,458.00
	国債証券 小計	51,200,000.00	58,813,462.50 (4,553,338,266)
	カナダドル 小計	51,200,000.00	58,813,462.50 (4,553,338,266)
	オーストラリアドル		
国債証券	4.25 AUST GOVT 170721	700,000.00	720,629.00
	4.5 AUST GOVT 141021	1,600,000.00	1,645,364.80
	4.5 AUST GOVT 200415	2,300,000.00	2,392,855.60
	4.75 AUST GOVT 151021	400,000.00	417,602.40
	4.75 AUST GOVT 160615	2,000,000.00	2,100,588.00
	4.75 AUST GOVT 270421	600,000.00	623,434.80
	5.25 AUST GOVT 190315	2,300,000.00	2,505,530.30
	5.5 AUST GOVT 131215	1,400,000.00	1,450,204.00
	5.5 AUST GOVT 180121	1,200,000.00	1,315,081.20
	5.5 AUST GOVT 230421	700,000.00	780,470.60
	5.75 AUST GOVT 210515	2,200,000.00	2,498,366.20
	5.75 AUST GOVT 220715	1,300,000.00	1,475,630.00
	6 AUST GOVT 170215	2,200,000.00	2,446,637.60
	6.25 AUST GOVT 140615	1,800,000.00	1,916,415.00
	6.25 AUST GOVT 150415	2,200,000.00	2,389,281.40
	6.5 AUST GOVT 130515	2,600,000.00	2,698,641.40
	国債証券 小計	25,500,000.00	27,376,732.30 (2,257,759,112)
	オーストラリアドル 小計	25,500,000.00	27,376,732.30 (2,257,759,112)
	イギリスポンド		
国債証券	1.75 GILT 170122	2,300,000.00	2,369,805.00
	2 GILT 160122	4,300,000.00	4,493,285.00
	2.25 GILT 140307	3,900,000.00	4,049,760.00
	2.75 GILT 150122	3,900,000.00	4,151,745.00
	3.75 GILT 190907	3,700,000.00	4,227,250.00
	3.75 GILT 200907	3,000,000.00	3,423,300.00

	3.75 GILT 210907	3,400,000.00	3,867,840.00	
	3.75 GILT 520722	300,000.00	338,910.00	
	4 GILT 160907	3,300,000.00	3,750,285.00	
	4 GILT 220307	2,200,000.00	2,552,990.00	
	4 GILT 600122	2,100,000.00	2,539,950.00	
	4.25 GILT 271207	2,500,000.00	3,000,375.00	
	4.25 GILT 320607	2,500,000.00	2,999,750.00	
	4.25 GILT 360307	3,035,000.00	3,657,326.75	
	4.25 GILT 390907	2,400,000.00	2,899,320.00	
	4.25 GILT 401207	2,900,000.00	3,508,420.00	
	4.25 GILT 461207	2,700,000.00	3,323,970.00	
	4.25 GILT 491207	2,300,000.00	2,850,850.00	
	4.25 GILT 551207	2,400,000.00	3,017,400.00	
	4.5 GILT 130307	4,000,000.00	4,180,600.00	
	4.5 GILT 190307	2,700,000.00	3,225,825.00	
	4.5 GILT 340907	2,300,000.00	2,854,990.00	
	4.5 GILT 421207	2,500,000.00	3,169,125.00	
	4.75 GILT 150907	3,150,000.00	3,608,797.50	
	4.75 GILT 200307	3,100,000.00	3,776,265.00	
	4.75 GILT 301207	2,400,000.00	3,058,920.00	
	4.75 GILT 381207	2,700,000.00	3,517,695.00	
	5 GILT 140907	3,800,000.00	4,247,640.00	
	5 GILT 180307	2,500,000.00	3,033,500.00	
	5 GILT 250307	2,500,000.00	3,197,875.00	
	6 GILT 281207	1,700,000.00	2,463,470.00	
	8 GILT 130927	1,000,000.00	1,125,550.00	
	8 GILT 151207	1,000,000.00	1,277,050.00	
	8 GILT 210607	1,800,000.00	2,716,560.00	
	8.75 GILT 170825	1,050,000.00	1,479,292.50	
	国債証券 小計	91,335,000.00	107,955,686.75 (13,144,684,418)	
	イギリスポンド 小計	91,335,000.00	107,955,686.75 (13,144,684,418)	
	スイスフラン			
国債証券	2.5 SWISS GOVT 160312	1,000,000.00	1,092,570.00	
	3 SWISS GOVT 180108	1,000,000.00	1,150,840.00	
	3 SWISS GOVT 190512	900,000.00	1,056,690.00	
	4 SWISS GOVT 130211	1,000,000.00	1,040,140.00	
	4 SWISS GOVT 230211	700,000.00	928,529.00	
	4 SWISS GOVT 280408	800,000.00	1,141,640.00	
	4.25 SWISS GOVT 140106	700,000.00	756,070.00	
	4.25 SWISS GOVT 170605	800,000.00	965,472.00	
	国債証券 小計	6,900,000.00	8,131,951.00 (685,604,788)	
	スイスフラン 小計	6,900,000.00	8,131,951.00 (685,604,788)	
	シンガポールドル			
国債証券	1.125SINGAPORGOVT 160401	200,000.00	204,974.20	
	1.375SINGAPORGOVT 141001	300,000.00	307,835.10	
	1.625SINGAPORGOVT 130401	600,000.00	609,437.40	
	2.25 SINGAPORGOVT 130701	900,000.00	925,441.20	
	2.25 SINGAPORGOVT 210601	400,000.00	420,263.60	
	2.375 SINGAPORGOV 170401	300,000.00	325,659.00	
	2.5 SINGAPORGOVT 190601	400,000.00	432,830.00	
	2.875SINGAPORGOVT 150701	600,000.00	649,186.80	
	2.875SINGAPORGOVT 300901	400,000.00	430,106.80	
	3 SINGAPORGOVT 240901	500,000.00	549,147.00	
	3.125SINGAPORGOVT 220901	500,000.00	560,201.50	
	3.25 SINGAPORGOVT 200901	700,000.00	793,188.20	
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	600,000.00	689,296.80	
	3.625SINGAPORGOVT 140701	800,000.00	862,948.00	
	3.75 SINGAPORGOVT 160901	750,000.00	855,686.25	
	4 SINGAPORGOVT 180901	700,000.00	828,773.40	
	国債証券 小計	8,650,000.00	9,444,975.25 (583,793,920)	
	シンガポールドル 小計	8,650,000.00	9,444,975.25 (583,793,920)	
	マレーシアリンギット			
国債証券	3.21 MALAYSIAGOV 130531	200,000.00	200,826.40	
	3.434 MALAYSIAGOV 140815	2,700,000.00	2,728,193.40	

	3.502MALAYSIAGOV 270531	1,000,000.00	956,844.00	
	3.58 MALAYSIAGOV 180928	400,000.00	405,054.40	
	3.741 MALAYSIAGOV 150227	500,000.00	509,599.50	
	3.814MALAYSIAGOV 170215	5,300,000.00	5,429,987.80	
	3.835MALAYSIAGOV 150812	2,300,000.00	2,354,289.20	
	4.012 MALAYSIAGOV 170915	2,300,000.00	2,381,767.30	
	4.16 MALAYSIAGOV 210715	1,400,000.00	1,468,912.20	
	4.24 MALAYSIAGOV 180207	1,000,000.00	1,049,037.00	
	4.262MALAYSIAGOV 160915	4,000,000.00	4,174,488.00	
	4.378MALAYSIAGOV 191129	4,200,000.00	4,472,004.60	
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	700,000.00	743,759.80	
	5.094MALAYSIAGOV 140430	5,000,000.00	5,231,425.00	
	5.734MALAYSIAGOV 190730	1,000,000.00	1,152,846.00	
	国債証券 小計	32,000,000.00	33,259,034.60 (848,437,972)	
	マレーシアリングギット 小計	32,000,000.00	33,259,034.60 (848,437,972)	
	スウェーデンクローネ			
国債証券	3 SWD GOVT 160712	7,000,000.00	7,533,330.00	
	3.5 SWD GOVT 220601	6,700,000.00	7,733,676.00	
	3.5 SWD GOVT 390330	6,400,000.00	7,919,360.00	
	3.75 SWD GOVT 170812	7,500,000.00	8,428,725.00	
	4.25 SWD GOVT 190312	10,400,000.00	12,236,848.00	
	4.5 SWD GOVT 150812	8,700,000.00	9,718,770.00	
	5 SWD GOVT 201201	10,500,000.00	13,275,675.00	
	6.75 SWD GOVT 140505	12,700,000.00	14,338,173.00	
	国債証券 小計	69,900,000.00	81,184,557.00 (936,869,787)	
	スウェーデンクローネ 小計	69,900,000.00	81,184,557.00 (936,869,787)	
	ノルウェークローネ			
国債証券	3.75 NORWE GOVT 210525	4,500,000.00	4,986,000.00	
	4.25 NORWE GOVT 170519	6,100,000.00	6,793,570.00	
	4.5 NORWE GOVT 190522	4,000,000.00	4,594,000.00	
	5 NORWE GOVT 150515	7,800,000.00	8,613,540.00	
	6.5 NORWE GOVT 130515	8,500,000.00	9,035,500.00	
	国債証券 小計	30,900,000.00	34,022,610.00 (452,500,713)	
	ノルウェークローネ 小計	30,900,000.00	34,022,610.00 (452,500,713)	
	デンマーククローネ			
国債証券	2 DMK GOVT 141115	7,500,000.00	7,834,500.00	
	3 DMK GOVT 211115	7,500,000.00	8,220,375.00	
	4 DMK GOVT 151115	12,900,000.00	14,535,075.00	
	4 DMK GOVT 171115	8,300,000.00	9,635,885.00	
	4 DMK GOVT 191115	13,100,000.00	15,432,455.00	
	4.5 DMK GOVT 391115	15,300,000.00	21,550,050.00	
	5 DMK GOVT 131115	10,600,000.00	11,499,940.00	
	7 DMK GOVT 241110	3,800,000.00	5,831,100.00	
	国債証券 小計	79,000,000.00	94,539,380.00 (1,295,189,506)	
	デンマーククローネ 小計	79,000,000.00	94,539,380.00 (1,295,189,506)	
	メキシコペソ			
国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	12,600,000.00	16,654,831.20	
	10 MEXICAN BONOS 361120	9,600,000.00	12,351,004.80	
	6 MEXICAN BONOS 150618	10,200,000.00	10,510,212.60	
	6.25 MEXICAN BONO 160616	7,300,000.00	7,600,103.00	
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	14,200,000.00	14,649,941.20	
	7 MEXICAN BONOS 140619	10,700,000.00	11,265,805.30	
	7.25 MEXICAN BONO 161215	8,200,000.00	8,909,759.20	
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	13,400,000.00	14,416,269.40	
	7.75 MEXICAN BONO 171214	10,400,000.00	11,624,880.80	
	7.75 MEXICAN BONO 310529	4,000,000.00	4,273,100.00	

（単位：円）

通貨種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
メキシコペソ				
国債証券	8 MEXICAN BONOS 131219	16,200,000.00	17,169,553.80	
	8 MEXICAN BONOS 151217	6,600,000.00	7,255,518.60	
	8 MEXICAN BONOS 200611	12,300,000.00	14,046,587.70	
	8 MEXICAN BONOS 231207	3,600,000.00	4,112,542.80	
	8.5 MEXICAN BONOS 181213	6,100,000.00	7,110,251.50	
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	13,300,000.00	15,463,750.40	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	14,200,000.00	15,952,095.40	
	9 MEXICAN BONOS 130620	14,300,000.00	15,137,665.40	
	9.5 MEXICAN BONOS 141218	15,200,000.00	17,063,216.00	
	国債証券 小計	202,400,000.00	225,567,089.10 (1,344,379,851)	
メキシコペソ 小計		202,400,000.00	225,567,089.10 (1,344,379,851)	
ポーランドズロチ				
国債証券	5 POLAND 131024	6,200,000.00	6,233,170.00	
	5 POLAND 160425	2,800,000.00	2,795,380.00	
	5.25 POLAND 130425	5,200,000.00	5,241,340.00	
	5.25 POLAND 171025	3,900,000.00	3,894,735.00	
	5.25 POLAND 201025	4,000,000.00	3,889,400.00	
	5.5 POLAND 150425	5,100,000.00	5,191,035.00	
	5.5 POLAND 191025	4,200,000.00	4,192,440.00	
	5.75 POLAND 140425	4,900,000.00	5,003,635.00	
	5.75 POLAND 211025	1,000,000.00	1,002,300.00	
	5.75 POLAND 220923	4,200,000.00	4,202,100.00	
	5.75 POLAND 290425	500,000.00	492,225.00	
	6.25 POLAND 151024	4,600,000.00	4,802,170.00	
	POLAND 130125	400,000.00	382,840.00	
	国債証券 小計	47,000,000.00	47,322,770.00 (1,129,121,292)	
ポーランドズロチ 小計		47,000,000.00	47,322,770.00 (1,129,121,292)	
ユーロ				
国債証券	0.25 SCHATS 131213	1,800,000.00	1,801,890.00	
	0.75 SCHATS 130913	2,600,000.00	2,624,180.00	
	1 NETH GOVT 140115	2,300,000.00	2,327,025.00	
	1.25 OBL 161014	2,700,000.00	2,751,435.00	
	1.5 SCHATS 130315	2,800,000.00	2,843,120.00	
	1.75 FINNISH GOVT 160415	1,100,000.00	1,127,445.00	
	1.75 NETH GOVT 130115	2,200,000.00	2,233,550.00	
	1.75 OBL 151009	2,400,000.00	2,504,160.00	
	1.75 SCHATS 130614	2,500,000.00	2,554,750.00	
	2 BTAN 130925	2,100,000.00	2,142,420.00	
	2 BTAN 150712	3,600,000.00	3,660,120.00	
	2 BUND 220104	900,000.00	904,410.00	
	2 ITALY GOVT 130601	2,500,000.00	2,458,375.00	
	2 OBL 160226	2,500,000.00	2,634,625.00	
	2.25 BTAN 160225	3,100,000.00	3,160,140.00	
	2.25 BUND 200904	2,500,000.00	2,602,625.00	
	2.25 BUND 210904	2,300,000.00	2,371,070.00	
	2.25 ITALY GOVT 131101	2,700,000.00	2,634,525.00	
	2.25 OBL 140411	2,900,000.00	3,032,385.00	
	2.25 OBL 150410	2,800,000.00	2,959,600.00	
	2.3 SPAIN GOVT 130430	2,300,000.00	2,299,655.00	
	2.5 BTAN 140112	4,300,000.00	4,436,955.00	
	2.5 BTAN 150115	3,100,000.00	3,208,345.00	
	2.5 BTAN 160725	2,800,000.00	2,872,520.00	
	2.5 BUND 210104	2,800,000.00	2,964,220.00	
	2.5 NETH GOVT 170115	1,300,000.00	1,370,408.00	
	2.5 O.A.T 201025	4,400,000.00	4,231,040.00	
	2.5 OBL 141010	2,500,000.00	2,646,875.00	
	2.5 OBL 150227	4,400,000.00	4,679,180.00	
	2.5 SPAIN GOVT 131031	2,500,000.00	2,494,250.00	
	2.75 BEL GOVT 160328	1,500,000.00	1,505,025.00	
	2.75 NETH GOVT 150115	2,300,000.00	2,438,115.00	
	2.75 OBL 160408	2,700,000.00	2,928,555.00	

3 BTAN 140712	3,800,000.00	3,977,650.00	
3 BUND 200704	3,300,000.00	3,636,105.00	
3 ITALY GOVT 140401	2,200,000.00	2,157,760.00	
3 ITALY GOVT 150415	3,100,000.00	2,975,690.00	
3 ITALY GOVT 150615	2,700,000.00	2,578,635.00	
3 ITALY GOVT 151101	2,500,000.00	2,369,125.00	
3 O.A.T 151025	4,900,000.00	5,144,265.00	
3 SPAIN GOVT 150430	2,700,000.00	2,689,875.00	
3.125 FINNISHGOVT 140915	1,000,000.00	1,067,000.00	
3.15 SPAIN GOVT 160131	3,100,000.00	3,061,250.00	
3.2 AUSTRIA GOVT 170220	1,200,000.00	1,254,480.00	
3.25 BEL GOVT 160928	1,850,000.00	1,883,670.00	
3.25 BUND 150704	3,100,000.00	3,389,540.00	
3.25 BUND 200104	3,200,000.00	3,591,200.00	
3.25 BUND 210704	2,800,000.00	3,133,340.00	
3.25 BUND 420704	1,800,000.00	2,049,840.00	
3.25 NETH GOVT 150715	2,300,000.00	2,487,335.00	
3.25 NETH GOVT 210715	2,300,000.00	2,494,465.00	
3.25 O.A.T 160425	4,300,000.00	4,553,055.00	
3.25 O.A.T 211025	3,600,000.00	3,629,520.00	
3.25 SPAIN GOVT 160430	2,100,000.00	2,062,935.00	
3.3 SPAIN GOVT 141031	2,600,000.00	2,621,840.00	
3.375 FINNISH GOV 200415	1,000,000.00	1,084,400.00	
3.4 AUSTRIA GOVT 141020	1,700,000.00	1,806,335.00	
3.4 SPAIN GOVT 140430	1,500,000.00	1,516,425.00	
3.5 AUSTRIA GOVT 150715	2,000,000.00	2,130,700.00	
3.5 AUSTRIA GOVT 210915	2,000,000.00	2,062,400.00	
3.5 BEL GOVT 150328	1,300,000.00	1,347,385.00	
3.5 BEL GOVT 170628	900,000.00	913,050.00	
3.5 BUND 160104	3,600,000.00	4,000,320.00	
3.5 BUND 190704	3,500,000.00	3,988,775.00	
3.5 FINNISH GOVT 210415	800,000.00	875,120.00	
3.5 ITALY GOVT 140601	3,200,000.00	3,164,320.00	
3.5 NETH GOVT 200715	2,300,000.00	2,542,880.00	
3.5 O.A.T 150425	3,400,000.00	3,625,590.00	
3.5 O.A.T 200425	4,500,000.00	4,689,675.00	
3.5 O.A.T 260425	3,600,000.00	3,558,420.00	
3.5 OBL 130412	2,600,000.00	2,705,170.00	
3.65 AUSTRIA GOVT 220420	1,000,000.00	1,033,650.00	
3.75 BEL GOVT 150928	1,750,000.00	1,828,487.50	
3.75 BEL GOVT 200928	2,800,000.00	2,797,200.00	
3.75 BTAN 130112	3,300,000.00	3,402,795.00	
3.75 BUND 130704	3,400,000.00	3,573,230.00	
3.75 BUND 150104	3,500,000.00	3,842,300.00	
3.75 BUND 170104	3,000,000.00	3,411,300.00	
3.75 BUND 190104	5,500,000.00	6,357,725.00	
3.75 ITALY GOVT 131215	2,900,000.00	2,900,725.00	
3.75 ITALY GOVT 150801	3,800,000.00	3,709,370.00	
3.75 ITALY GOVT 160415	2,300,000.00	2,220,420.00	
3.75 ITALY GOVT 160801	4,600,000.00	4,405,650.00	
3.75 ITALY GOVT 210301	3,500,000.00	3,020,325.00	
3.75 ITALY GOVT 210801	4,100,000.00	3,471,675.00	
3.75 NETH GOVT 140715	2,200,000.00	2,375,120.00	
3.75 NETH GOVT 230115	2,200,000.00	2,476,650.00	
3.75 NETH GOVT 420115	1,600,000.00	1,952,160.00	
3.75 O.A.T 170425	4,400,000.00	4,749,800.00	
3.75 O.A.T 191025	3,600,000.00	3,831,480.00	
3.75 O.A.T 210425	4,700,000.00	4,942,050.00	
3.8 AUSTRIA GOVT 131020	1,900,000.00	1,998,420.00	
3.8 SPAIN GOVT 170131	2,400,000.00	2,374,560.00	
3.875 FINNISH GOVT170915	1,300,000.00	1,450,540.00	
3.9 AUSTRIA GOVT 200715	2,100,000.00	2,231,880.00	
4 AUSTRIA GOVT 160915	1,800,000.00	1,957,050.00	
4 BEL GOVT 130328	1,900,000.00	1,958,995.00	
4 BEL GOVT 140328	2,000,000.00	2,086,300.00	
4 BEL GOVT 170328	1,700,000.00	1,772,080.00	
4 BEL GOVT 180328	1,700,000.00	1,764,515.00	
4 BEL GOVT 190328	1,500,000.00	1,547,325.00	
4 BEL GOVT 220328	2,500,000.00	2,506,375.00	

4 BUND 160704	3,500,000.00	3,992,275.00	
4 BUND 180104	3,900,000.00	4,535,310.00	
4 BUND 370104	3,300,000.00	4,121,370.00	
4 FINNISH GOVT 250704	900,000.00	1,022,355.00	
4 IRISH GOVT 140115	1,600,000.00	1,559,600.00	
4 ITALY GOVT 170201	3,600,000.00	3,443,040.00	
4 ITALY GOVT 200901	3,900,000.00	3,438,825.00	
4 ITALY GOVT 370201	3,500,000.00	2,475,900.00	
4 NETH GOVT 160715	2,000,000.00	2,247,000.00	
4 NETH GOVT 180715	2,300,000.00	2,614,525.00	
4 NETH GOVT 190715	2,000,000.00	2,280,700.00	
4 NETH GOVT 370115	1,800,000.00	2,218,500.00	
4 O.A.T 130425	3,500,000.00	3,648,750.00	
4 O.A.T 131025	3,800,000.00	4,009,570.00	
4 O.A.T 140425	3,350,000.00	3,573,612.50	
4 O.A.T 141025	3,000,000.00	3,229,950.00	
4 O.A.T 180425	3,700,000.00	4,036,885.00	
4 O.A.T 381025	3,450,000.00	3,522,105.00	
4 O.A.T 550425	2,150,000.00	2,169,995.00	
4 O.A.T 600425	1,200,000.00	1,209,960.00	
4 OBL 131011	2,400,000.00	2,555,160.00	
4 SPAIN GOVT 200430	2,900,000.00	2,759,205.00	
4.1 SPAIN GOVT 180730	2,400,000.00	2,364,840.00	
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	1,650,000.00	1,764,015.00	
4.2 SPAIN GOVT 130730	2,200,000.00	2,254,780.00	
4.2 SPAIN GOVT 370131	2,400,000.00	1,811,760.00	
4.25 BEL GOVT 130928	2,300,000.00	2,393,725.00	
4.25 BEL GOVT 140928	1,900,000.00	2,004,310.00	
4.25 BEL GOVT 210928	1,900,000.00	1,945,315.00	
4.25 BEL GOVT 410328	1,300,000.00	1,266,005.00	
4.25 BUND 140104	5,500,000.00	5,930,650.00	
4.25 BUND 140704	5,600,000.00	6,138,720.00	
4.25 BUND 170704	2,900,000.00	3,391,985.00	
4.25 BUND 180704	3,000,000.00	3,552,450.00	
4.25 BUND 390704	2,000,000.00	2,635,500.00	
4.25 FINNISH GOVT 150704	600,000.00	666,480.00	
4.25 ITALY GOVT 130415	2,500,000.00	2,532,375.00	
4.25 ITALY GOVT 130801	3,700,000.00	3,736,260.00	
4.25 ITALY GOVT 140701	2,100,000.00	2,106,405.00	
4.25 ITALY GOVT 140801	4,500,000.00	4,523,850.00	
4.25 ITALY GOVT 150201	2,800,000.00	2,800,700.00	
4.25 ITALY GOVT 190201	3,400,000.00	3,155,710.00	
4.25 ITALY GOVT 190901	3,500,000.00	3,198,650.00	
4.25 ITALY GOVT 200301	3,500,000.00	3,174,675.00	
4.25 NETH GOVT 130715	2,300,000.00	2,434,090.00	
4.25 O.A.T 171025	3,300,000.00	3,645,840.00	
4.25 O.A.T 181025	3,300,000.00	3,642,705.00	
4.25 O.A.T 190425	4,100,000.00	4,513,075.00	
4.25 O.A.T 231025	4,600,000.00	4,988,010.00	
4.25 SPAIN GOVT 140131	2,100,000.00	2,158,275.00	
4.25 SPAIN GOVT 161031	1,000,000.00	1,014,350.00	
4.3 AUSTRIA GOVT 140715	1,300,000.00	1,403,480.00	
4.3 AUSTRIA GOVT 170915	1,000,000.00	1,098,350.00	
4.3 SPAIN GOVT 191031	2,400,000.00	2,349,000.00	
4.35 AUSTRIA GOVT 190315	1,700,000.00	1,860,905.00	
4.375 FINNISH GOV 190704	800,000.00	922,880.00	
4.4 IRISH GOVT 190618	1,100,000.00	935,715.00	
4.4 SPAIN GOVT 150131	2,600,000.00	2,698,410.00	
4.5 BEL GOVT 260328	300,000.00	306,885.00	
4.5 BTAN 130712	3,600,000.00	3,799,260.00	
4.5 BUND 130104	3,500,000.00	3,642,975.00	
4.5 IRISH GOVT 181018	1,350,000.00	1,173,622.50	
4.5 IRISH GOVT 200418	1,700,000.00	1,430,550.00	
4.5 ITALY GOVT 180201	3,800,000.00	3,642,110.00	
4.5 ITALY GOVT 180801	3,600,000.00	3,430,080.00	
4.5 ITALY GOVT 190301	3,500,000.00	3,276,000.00	
4.5 ITALY GOVT 200201	3,200,000.00	2,953,120.00	
4.5 ITALY GOVT 260301	2,400,000.00	1,973,160.00	
4.5 NETH GOVT 170715	2,100,000.00	2,426,865.00	

4.5 O.A.T 410425	2,700,000.00	2,985,660.00	
4.6 IRISH GOVT 160418	1,500,000.00	1,419,525.00	
4.6 SPAIN GOVT 190730	2,000,000.00	2,004,100.00	
4.65 AUSTRIA GOVT 180115	1,700,000.00	1,895,415.00	
4.65 SPAIN GOVT 250730	2,200,000.00	1,943,590.00	
4.7 SPAIN GOVT 410730	1,600,000.00	1,283,920.00	
4.75 BUND 280704	1,700,000.00	2,182,035.00	
4.75 BUND 340704	3,200,000.00	4,316,480.00	
4.75 BUND 400704	2,400,000.00	3,421,680.00	
4.75 ITALY GOVT 130201	3,100,000.00	3,157,660.00	
4.75 ITALY GOVT 160915	2,200,000.00	2,179,540.00	
4.75 ITALY GOVT 210901	3,600,000.00	3,289,680.00	
4.75 ITALY GOVT 230801	3,700,000.00	3,243,790.00	
4.75 O.A.T 350425	2,700,000.00	3,064,365.00	
4.75 SPAIN GOVT 140730	2,200,000.00	2,292,730.00	
4.8 SPAIN GOVT 240131	2,700,000.00	2,485,755.00	
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	1,500,000.00	1,704,375.00	
4.85 SPAIN GOVT 201031	2,600,000.00	2,586,870.00	
4.9 SPAIN GOVT 400730	1,750,000.00	1,442,700.00	
5 BEL GOVT 350328	2,300,000.00	2,489,750.00	
5 IRISH GOVT 130418	900,000.00	894,420.00	
5 IRISH GOVT 201018	1,000,000.00	850,500.00	
5 ITALY GOVT 220301	1,500,000.00	1,373,025.00	
5 ITALY GOVT 250301	3,000,000.00	2,613,000.00	
5 ITALY GOVT 340801	3,300,000.00	2,642,145.00	
5 ITALY GOVT 390801	2,700,000.00	2,143,665.00	
5 ITALY GOVT 400901	3,100,000.00	2,452,565.00	
5 O.A.T 161025	4,200,000.00	4,775,820.00	
5.25 ITALY GOVT 170801	3,300,000.00	3,297,525.00	
5.25 ITALY GOVT 291101	3,900,000.00	3,317,340.00	
5.375 FINNISH GOVT130704	900,000.00	964,710.00	
5.4 IRISH GOVT 250313	1,300,000.00	1,103,700.00	
5.5 BEL GOVT 170928	1,300,000.00	1,450,150.00	
5.5 BEL GOVT 280328	2,300,000.00	2,610,960.00	
5.5 BUND 310104	2,700,000.00	3,831,705.00	
5.5 NETH GOVT 280115	1,900,000.00	2,583,145.00	
5.5 O.A.T 290425	3,500,000.00	4,253,550.00	
5.5 SPAIN GOVT 170730	2,300,000.00	2,446,510.00	
5.5 SPAIN GOVT 210430	3,200,000.00	3,286,400.00	
5.625 BUND 280104	2,200,000.00	3,069,550.00	
5.75 ITALY GOVT 330201	2,250,000.00	1,977,637.50	
5.75 O.A.T 321025	3,450,000.00	4,387,020.00	
5.75 SPAIN GOVT 320730	2,200,000.00	2,090,770.00	
5.9 IRISH GOVT 191018	1,000,000.00	921,850.00	
5.9 SPAIN GOVT 260730	1,000,000.00	986,000.00	
6 BUND 160620	140,000.00	170,786.00	
6 ITALY GOVT 310501	4,500,000.00	4,094,775.00	
6 O.A.T 251025	2,300,000.00	2,905,015.00	
6 SPAIN GOVT 290131	2,500,000.00	2,456,375.00	
6.15 SPAIN GOVT 130131	2,200,000.00	2,285,140.00	
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	1,100,000.00	1,433,960.00	
6.25 BUND 240104	1,600,000.00	2,273,360.00	
6.25 BUND 300104	1,400,000.00	2,113,370.00	
6.5 BUND 270704	1,700,000.00	2,559,520.00	
6.5 ITALY GOVT 271101	3,900,000.00	3,792,360.00	
7.25 ITALY GOVT 261101	1,400,000.00	1,477,280.00	
8 BEL GOVT 150328	900,000.00	1,052,190.00	
8.5 O.A.T 191025	1,400,000.00	1,950,830.00	
8.5 O.A.T 230425	1,700,000.00	2,509,285.00	
9 ITALY GOVT 231101	1,700,000.00	1,962,055.00	
国債証券 小計	586,740,000.00	610,655,734.00 (62,195,286,507)	
ユーロ 小計	586,740,000.00	610,655,734.00 (62,195,286,507)	
合 計		152,054,999,729 (152,054,999,729)	

(注1) 通貨の種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

## 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 197銘柄	100.00%	41.19%
カナダドル	国債証券 32銘柄	100.00%	2.99%
オーストラリアドル	国債証券 16銘柄	100.00%	1.48%
イギリスポンド	国債証券 35銘柄	100.00%	8.64%
スイスフラン	国債証券 8銘柄	100.00%	0.45%
シンガポールドル	国債証券 16銘柄	100.00%	0.38%
マレーシアリングgit	国債証券 15銘柄	100.00%	0.56%
スウェーデンクローネ	国債証券 8銘柄	100.00%	0.62%
ノルウェークローネ	国債証券 5銘柄	100.00%	0.30%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.00%	0.85%
メキシコペソ	国債証券 19銘柄	100.00%	0.88%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	100.00%	0.74%
ユーロ	国債証券 231銘柄	100.00%	40.90%

## 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関係に関する注記）」に記載しております。

[前へ](#)   [次へ](#)

「新興国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。

(1) 貸借対照表

		[ 平成24年1月26日現在 ]
		金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金		7,183,675
コール・ローン		8,942,440
国債証券		1,563,948,285
特殊債券		139,044,130
未収利息		25,996,780
前払費用		5,741,801
流動資産合計		1,750,857,111
資産合計		1,750,857,111
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		11,400
未払解約金		6,685,191
流動負債合計		6,696,591
負債合計		6,696,591
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,754,755,192
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	2	10,594,672
元本等合計		1,744,160,520
純資産合計		1,744,160,520
負債純資産合計		1,750,857,111

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年1月27日から翌年1月26日までであります。

(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	<p>有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場（外貨建証券の場合は知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合また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、委託会社が忠実義務に基づいて合理的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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	[ 平成24年1月26日現在 ]
1 期首	平成23年10月31日
期首元本額	1,636,208,683円
期首からの追加設定元本額	223,028,870円
期首からの一部解約元本額	104,482,361円
元本の内訳*	
eMAXIS バランス（8資産均等型）	14,106,559円
eMAXIS バランス（波乗り型）	5,371,521円
eMAXIS 新興国債券インデックス	590,946,234円
三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド	62,791,817円
新興国債券インデックスファンド	907,525,400円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	8,237,971円
三菱UFJ 新興国債券ファンドVA（適格機関投資家限定）	165,775,690円
（合計）	1,754,755,192円
2 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	10,594,672円
3 受益権の総数	1,754,755,192口
4 1口当たり純資産額	0.9940円
（1万口当たり純資産額）	（9,940円）

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 1 金融商品の状況に関する事項

区分	（自平成23年10月31日 至平成24年1月26日）
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資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。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債を実質的な主要投資対象としております。公社債の投資に係る価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスクおよびカントリーリスクに晒されております。 デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[ 平成24年1月26日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2 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）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関係に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。

## （有価証券関係に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	[ 平成24年1月26日現在 ]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	43,155,269
特殊債券	3,332,962
合計	39,822,307

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

区分	種類	[平成24年1月26日現在]		
		契約額等(円)	時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超	
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建			
	マレーシアリングット	2,554,700		3,700
	メキシコペソ	1,673,700		7,700
	合計	4,228,400		11,400
			4,217,000	

(注)時価の算定方法

1 対顧客先物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。

為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。

当該日の対顧客先物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。

(イ) 当該日を超える対顧客先物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相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(ロ) 当該日を超える対顧客先物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相場の仲値を用いております。

2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

(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。

(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)

通貨		券面総額	評価額	備考
種類	銘柄			
マレーシアリングット				
国債証券	3.21 MALAYSIAGOV 130531	300,000.00	301,239.60	
	3.434 MALAYSIAGOV 140815	100,000.00	101,044.20	
	3.461 MALAYSIAGOV 130731	200,000.00	201,650.60	
	3.702 MALAYSIAGOV 130225	200,000.00	201,731.40	
	3.741 MALAYSIAGOV 150227	500,000.00	509,599.50	
	3.835MALAYSIAGOV 150812	1,100,000.00	1,125,964.40	
	4.012 MALAYSIAGOV 170915	900,000.00	931,995.90	
	4.16 MALAYSIAGOV 210715	400,000.00	419,689.20	
	4.24 MALAYSIAGOV 180207	200,000.00	209,807.40	
	4.262MALAYSIAGOV 160915	300,000.00	313,086.60	
	4.378MALAYSIAGOV 191129	1,100,000.00	1,171,239.30	
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	400,000.00	425,005.60	
	5.094MALAYSIAGOV 140430	700,000.00	732,399.50	
	国債証券 小計	6,400,000.00	6,644,453.20 (169,500,001)	
	マレーシアリングット 小計	6,400,000.00	6,644,453.20 (169,500,001)	
タイバーツ				
国債証券	3.125 THAILAND 151211	1,000,000.00	1,001,557.00	
	3.625 THAILAND 150522	6,000,000.00	6,104,868.00	
	3.625 THAILAND 230616	2,000,000.00	2,064,920.00	
	3.65 THAILAND 211217	1,400,000.00	1,467,022.20	
	3.85 THAILAND 251212	2,000,000.00	2,103,278.00	
	3.875 THAILAND 190613	15,500,000.00	16,345,618.00	
	4.125 THAILAND 161118	7,000,000.00	7,311,794.00	
	4.25 THAILAND 130313	4,500,000.00	4,558,216.50	
	4.75 THAILAND 241220	1,400,000.00	1,605,158.80	
	5.125 THAILAND 180313	4,000,000.00	4,436,908.00	
	5.25 THAILAND 130713	1,200,000.00	1,237,035.60	
	5.25 THAILAND 140512	4,000,000.00	4,191,268.00	
	5.85 THAILAND 210331	2,000,000.00	2,416,906.00	
	6.15 THAILAND 260707	1,900,000.00	2,491,392.10	
	国債証券 小計	53,900,000.00	57,335,942.20 (142,193,136)	

タイバーツ 小計		53,900,000.00	57,335,942.20 (142,193,136)
インドネシアルピア			
国債証券	10 INDONESIA 170715	1,000,000,000.00	1,237,539,000.00
	10 INDONESIA 240915	700,000,000.00	938,018,200.00
	10 INDONESIA 280215	700,000,000.00	945,791,000.00
	10.25 INDONESIA 220715	400,000,000.00	539,452,800.00
	10.25 INDONESIA 270715	280,000,000.00	382,049,920.00
	10.5 INDONESIA 300815	1,950,000,000.00	2,741,167,650.00
	10.5 INDONESIA 380715	550,000,000.00	782,560,350.00
	10.75 INDONESIA 160515	1,200,000,000.00	1,471,069,200.00
	11 INDONESIA 201115	1,000,000,000.00	1,374,554,000.00
	11 INDONESIA 250915	1,000,000,000.00	1,437,368,000.00
	11.5 INDONESIA 190915	1,030,000,000.00	1,415,138,630.00
	12.8 INDONESIA 210615	100,000,000.00	151,598,700.00
	7.375 INDONESIA 160915	400,000,000.00	442,946,400.00
	8.25 INDONESIA 210715	500,000,000.00	596,410,500.00
	8.25 INDONESIA 320615	400,000,000.00	467,114,400.00
	8.375 INDONESIA 260915	400,000,000.00	481,450,800.00
	9.5 INDONESIA 150615	1,220,000,000.00	1,399,819,460.00
	9.5 INDONESIA 230715	600,000,000.00	775,439,400.00
	9.5 INDONESIA 310715	1,050,000,000.00	1,372,726,950.00
	9.5 INDONESIA 410515	550,000,000.00	720,308,600.00
国債証券 小計		15,030,000,000.00	19,672,523,960.00 (173,118,210)
インドネシアルピア 小計		15,030,000,000.00	19,672,523,960.00 (173,118,210)
メキシコペソ			
国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	1,600,000.00	2,114,899.20
	10 MEXICAN BONOS 361120	1,100,000.00	1,415,219.30
	6 MEXICAN BONOS 150618	900,000.00	927,371.70
	6.25 MEXICAN BONO 160616	700,000.00	728,777.00
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	2,600,000.00	2,682,383.60
	7 MEXICAN BONOS 140619	400,000.00	421,151.60
	7.25 MEXICAN BONO 161215	3,000,000.00	3,259,668.00
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	3,000,000.00	3,227,523.00
	7.75 MEXICAN BONO 171214	400,000.00	447,110.80
	7.75 MEXICAN BONO 310529	1,100,000.00	1,175,102.50
	8 MEXICAN BONOS 131219	2,700,000.00	2,861,592.30
	8 MEXICAN BONOS 151217	400,000.00	439,728.40
	8 MEXICAN BONOS 200611	1,200,000.00	1,370,398.80
	8 MEXICAN BONOS 231207	200,000.00	228,474.60
	8.5 MEXICAN BONOS 181213	600,000.00	699,369.00
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	800,000.00	930,150.40
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	1,700,000.00	1,909,757.90
	9 MEXICAN BONOS 130620	1,500,000.00	1,587,867.00
	9.5 MEXICAN BONOS 141218	3,000,000.00	3,367,740.00
国債証券 小計		26,900,000.00	29,794,285.10 (177,573,939)
メキシコペソ 小計		26,900,000.00	29,794,285.10 (177,573,939)
ブラジルリアル			
国債証券	10(IN)BRAZIL NTN-F140101	300,000.00	299,467.20
	10(IN)BRAZIL NTN-F150101	100,000.00	98,426.80
	10(IN)BRAZIL NTN-F170101	1,000,000.00	962,223.00
	10(IN)BRAZIL NTN-F210101	500,000.00	462,372.50
	BRAZIL-LTN 130701	1,200,000.00	1,045,803.60
	BRAZIL-LTN 140101	800,000.00	659,458.40
	BRAZIL-LTN 150101	500,000.00	368,321.00
国債証券 小計		4,400,000.00	3,896,072.50 (171,894,718)
ブラジルリアル 小計		4,400,000.00	3,896,072.50 (171,894,718)
コロンビアペソ			
国債証券	12 COLOMBIA (GL) 151022	1,020,000,000.00	1,291,116,000.00
	7.75 COLOMBI (GL) 210414	360,000,000.00	427,410,000.00
	9.85 COLOMBI (GL) 270628	120,000,000.00	171,666,000.00
国債証券 小計		1,500,000,000.00	1,890,192,000.00 (81,089,236)

コロンビアペソ 小計		1,500,000,000.00	1,890,192,000.00 (81,089,236)
ハンガリーフォリント			
国債証券	5.5 HUNGARY 140212	51,000,000.00	47,993,040.00
	5.5 HUNGARY 160212	86,000,000.00	76,663,840.00
	6 HUNGARY 231124	8,000,000.00	6,319,520.00
	6.5 HUNGARY 190624	26,000,000.00	22,610,900.00
	6.75 HUNGARY 130212	10,000,000.00	9,854,200.00
	6.75 HUNGARY 140822	30,000,000.00	28,636,200.00
	6.75 HUNGARY 170224	28,000,000.00	25,652,200.00
	6.75 HUNGARY 171124	20,000,000.00	18,094,000.00
	7.5 HUNGARY 131024	10,000,000.00	9,853,900.00
	7.5 HUNGARY 201112	20,000,000.00	18,243,000.00
	8 HUNGARY 150212	27,000,000.00	26,428,680.00
国債証券 小計		316,000,000.00	290,349,480.00 (99,444,696)
ハンガリーフォリント 小計		316,000,000.00	290,349,480.00 (99,444,696)
ペルーヌエボソル			
国債証券	6.9 PERU 370812	300,000.00	306,990.00
	7.84 PERU 200812	650,000.00	741,715.00
	8.2 PERU 260812	200,000.00	236,420.00
国債証券 小計		1,150,000.00	1,285,125.00 (37,114,410)
ペルーヌエボソル 小計		1,150,000.00	1,285,125.00 (37,114,410)
ポーランドズロチ			
国債証券	4.75 POLAND 161025	200,000.00	196,710.00
	5 POLAND 131024	600,000.00	603,210.00
	5 POLAND 160425	500,000.00	499,175.00
	5.25 POLAND 130425	500,000.00	503,975.00
	5.25 POLAND 171025	700,000.00	699,055.00
	5.25 POLAND 201025	600,000.00	583,410.00
	5.5 POLAND 150425	700,000.00	712,495.00
	5.5 POLAND 191025	700,000.00	698,740.00
	5.75 POLAND 140425	700,000.00	714,805.00
	5.75 POLAND 211025	200,000.00	200,460.00
	5.75 POLAND 220923	600,000.00	600,300.00
	6.25 POLAND 151024	600,000.00	626,370.00
	POLAND 130725	300,000.00	280,635.00
	POLAND 140125	200,000.00	182,500.00
	国債証券 小計		7,100,000.00
ポーランドズロチ 小計		7,100,000.00	7,101,840.00 (169,449,902)
南アフリカランド			
国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	3,000,000.00	3,533,970.00
	13.5 SOUTH AFRICA 150915	1,700,000.00	2,068,067.00
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	1,400,000.00	1,046,892.00
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	300,000.00	227,574.00
	6.75 SOUTH AFRICA 210331	2,000,000.00	1,850,180.00
	7 SOUTH AFRICA 310228	300,000.00	251,367.00
	7.25 SOUTH AFRICA 200115	2,300,000.00	2,218,787.00
	7.5 SOUTH AFRICA 140115	700,000.00	718,249.00
	8 SOUTH AFRICA 181221	2,000,000.00	2,037,220.00
	8.25 SOUTH AFRICA 170915	1,900,000.00	1,977,748.00
	8.75 SOUTH AFRICA 141221	1,100,000.00	1,172,182.00
国債証券 小計		16,700,000.00	17,102,236.00 (168,970,091)
南アフリカランド 小計		16,700,000.00	17,102,236.00 (168,970,091)
ロシアルーブル			
特殊債券	4.875 INTL BK(GL) 130916	20,300,000.00	19,887,910.00
	7.5 INTL BK(GL) 170302	34,000,000.00	34,639,200.00
特殊債券 小計		54,300,000.00	54,527,110.00 (139,044,130)
ロシアルーブル 小計		54,300,000.00	54,527,110.00 (139,044,130)
トルコリラ			

国債証券	10 TURKEY GOVT 130410	700,000.00	701,050.00	
	10 TURKEY GOVT 150617	300,000.00	300,000.00	
	10.5 TURKEY GOVT 200115	400,000.00	423,000.00	
	11 TURKEY GOVT 140806	800,000.00	818,000.00	
	8 TURKEY GOVT 131009	400,000.00	387,000.00	
	8 TURKEY GOVT 140129	300,000.00	289,950.00	
	8 TURKEY GOVT 140604	400,000.00	385,000.00	
	9 TURKEY GOVT 160127	200,000.00	193,350.00	
	TURKEY GOVT 130220	400,000.00	359,692.00	
	TURKEY GOVT 130515	200,000.00	176,414.00	
国債証券 小計		4,100,000.00	4,033,456.00 (173,599,946)	
トルコリラ 小計		4,100,000.00	4,033,456.00 (173,599,946)	
合 計			1,702,992,415 (1,702,992,415)	

(注1) 通貨の種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

通貨	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git	国債証券 13銘柄	100.00%	9.95%
タイバーツ	国債証券 14銘柄	100.00%	8.35%
インドネシアルピア	国債証券 20銘柄	100.00%	10.17%
メキシコペソ	国債証券 19銘柄	100.00%	10.43%
ブラジルリアル	国債証券 7銘柄	100.00%	10.09%
コロンビアペソ	国債証券 3銘柄	100.00%	4.76%
ハンガリーフォリント	国債証券 11銘柄	100.00%	5.84%
ペルーヌエボソル	国債証券 3銘柄	100.00%	2.18%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.00%	9.95%
南アフリカランド	国債証券 11銘柄	100.00%	9.92%
ロシアルーブル	特殊債券 2銘柄	100.00%	8.16%
トルコリラ	国債証券 10銘柄	100.00%	10.19%

#### 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関係に関する注記)」に記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「東証REIT指数マザーファンド」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。

(1) 貸借対照表

		[ 平成24年1月26日現在 ]
		金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		27,410,414
投資証券		991,018,460
未収配当金		9,897,408
未収利息		63
流動資産合計		1,028,326,345
資産合計		1,028,326,345
負債の部		
流動負債		
未払金		17,274,290
未払解約金		2,092,870
流動負債合計		19,367,160
負債合計		19,367,160
純資産の部		
元本等		
元本	1	976,937,045
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		32,022,140
元本等合計		1,008,959,185
純資産合計		1,008,959,185
負債純資産合計		1,028,326,345

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年1月27日から翌年1月26日までであります。

(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	<p>投資証券は移動平均法、投資証券以外の有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合また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、委託会社が忠実義務に基づいて合理的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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
-------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

		[ 平成24年1月26日現在 ]
1 期首		平成23年10月31日
期首元本額		859,668,732円
期首からの追加設定元本額		186,869,305円
期首からの一部解約元本額		69,600,992円
元本の内訳*		
eMAXIS 国内リートインデックス		957,604,809円
eMAXIS バランス(8資産均等型)		13,310,941円
eMAXIS バランス(波乗り型)		5,056,211円
三菱UFJ <DC> J - REITインデックスファンド		965,084円
(合計)		976,937,045円
2 受益権の総数		976,937,045口
3 1口当たり純資産額		1.0328円
(1万口当たり純資産額)		(10,328円)

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 1 金融商品の状況に関する事項

区分	（自平成23年10月31日 至平成24年1月26日）
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資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。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、投資証券を実質的な主要投資対象としております。投資証券の投資に係る価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成24年1月26日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。
2 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）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 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。

## （有価証券関係に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	[平成24年1月26日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	228,445,922	
合計	228,445,922	

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

## （デリバティブ取引等関係に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （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	口数(口)	評価額	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	64.00	32,064,000	
	MIDリート投資法人	61.00	11,175,200	
	森ヒルズリート投資法人	77.00	19,727,400	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	50.00	17,250,000	
	産業ファンド投資法人	31.00	12,214,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	319.00	44,596,200	
	日本ビルファンド投資法人	201.00	132,459,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	162.00	107,568,000	
	日本リテールファンド投資法人	622.00	68,357,800	
	オリックス不動産投資法人	94.00	30,785,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	237.00	43,134,000	
	プレミアム投資法人	65.00	16,445,000	
	東急リアル・エステート投資法人	56.00	21,672,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	32.00	16,224,000	
	野村不動産オフィスファンド投資法人	101.00	41,208,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	696.00	56,167,200	
	森トラスト総合リート投資法人	80.00	51,200,000	
	インヴィンシブル投資法人	446.00	2,836,560	
	フロンティア不動産投資法人	64.00	39,104,000	
	平和不動産リート投資法人	230.00	9,016,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	49.00	31,360,000	
	福岡リート投資法人	41.00	20,705,000	
	ケネディクス不動産投資法人	95.00	21,289,500	

積水ハウス・S I 投資法人	38.00	11,058,000	
いちご不動産投資法人	279.00	8,621,100	
大和証券オフィス投資法人	131.00	22,414,100	
阪急リート投資法人	28.00	9,254,000	
スタートプロシード投資法人	36.00	3,614,400	
ジャパン・ホテル・アンド・リゾート投資法人	35.00	6,156,500	
トップリート投資法人	51.00	17,926,500	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	53.00	25,625,500	
日本ホテルファンド投資法人	19.00	3,779,100	
日本賃貸住宅投資法人	440.00	15,554,000	
ジャパンエクセレント投資法人	62.00	19,375,000	
アドバンス・レジデンス投資法人(新)	8.00	1,082,400	
投資証券 小計	5,053.00	991,018,460	
合計	5,053.00	991,018,460	

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

[前へ](#)   [次へ](#)

「MUAM G - REIT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。

(1) 貸借対照表

		[ 平成24年1月26日現在 ]
		金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金		18,771,186
コール・ローン		10,957,128
投資証券		3,417,940,324
未収入金		6,373
未収配当金		6,641,465
未収利息		25
流動資産合計		3,454,316,501
資産合計		
負債の部		
流動負債		
未払解約金		5,374,209
流動負債合計		5,374,209
負債合計		
純資産の部		
元本等		
元本	1	5,067,809,441
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	2	1,618,867,149
元本等合計		3,448,942,292
純資産合計		
負債純資産合計		
		3,454,316,501

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年1月6日から翌年1月5日までであります。

(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	<p>投資証券および新株予約権証券は移動平均法、投資証券および新株予約権証券以外の有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場（外貨建証券の場合は知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合また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、委託会社が忠実義務に基づいて合理的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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

		[ 平成24年1月26日現在 ]
1 期首		平成23年10月31日
期首元本額		5,138,115,055円
期首からの追加設定元本額		252,229,172円
期首からの一部解約元本額		322,534,786円
元本の内訳*		
三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）		742,391,377円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）		474,590,106円
三菱UFJ 資産設計ファンド（分配型）		143,673,770円
三菱UFJ 資産設計ファンド（バランス型）		242,279,965円
三菱UFJ 資産設計ファンド（株式重視型）		99,425,029円
ファンド・マネジャー（海外リート）		69,994,218円
F Pバランスファンド（安定型）		17,789,643円
F Pバランスファンド（安定成長型）		39,248,551円
eMAXIS 先進国リートインデックス		3,208,079,395円
eMAXIS バランス（8資産均等型）		20,844,807円
eMAXIS バランス（波乗り型）		7,926,136円
三菱UFJ <DC>先進国REITインデックスファンド		1,566,444円
（合計）		5,067,809,441円
2 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	1,618,867,149円
3 受益権の総数		5,067,809,441口
4 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）		0.6806円 (6,806円)

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 1 金融商品の状況に関する事項

区分	( 自 平成23年10月31日 至 平成24年 1月26日 )
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資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。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、投資証券および新株予約権証券を実質的な主要投資対象としております。投資証券および新株予約権証券の投資に係る価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[ 平成24年1月26日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2 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）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 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	

## （有価証券関係に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	[ 平成24年1月26日現在 ]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	182,242,716
合計	182,242,716

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

## （デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項  
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)  
該当事項はありません。

## (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)

通貨		口数(口)	評価額	備考
種類	銘柄			
アメリカドル				
投資証券	ACADIA REALTY TRUST	2,866.00	59,727.44	
	AGREE REALTY CORP	700.00	17,416.00	
	ALEXANDER'S INC	165.00	63,030.00	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4,570.00	327,120.60	
	AMERICAN ASSETS TRUST INC	2,500.00	53,425.00	
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	5,200.00	217,880.00	
	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	9,265.00	226,158.65	
	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	5,640.00	51,324.00	
	ASSOCIATED ESTATES REALTY CP	2,510.00	40,511.40	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,207.00	964,368.67	
	BIOMED REALTY TRUST INC	11,870.00	217,102.30	
	BOSTON PROPERTIES INC	11,110.00	1,152,662.50	
	BRANDYWINE REALTY TRUST	9,390.00	97,937.70	
	BRE PROPERTIES INC	5,630.00	290,057.60	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	5,530.00	350,270.20	
	CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	2,700.00	28,026.00	
	CAPLEASE INC	4,510.00	19,393.00	
	CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	10,703.00	182,486.15	
	CEDAR REALTY TRUST INC	4,060.00	20,827.80	
	CHESAPEAKE LODGING TRUST	2,800.00	47,796.00	
	COGDELL SPENCER INC	3,150.00	13,356.00	
	COLONIAL PROPERTIES TRUST	6,210.00	131,341.50	
	COMMONWEALTH REIT	6,265.00	123,357.85	
	CORESITE REALTY CORP	1,600.00	31,968.00	
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	5,540.00	131,242.60	
	COUSINS PROPERTIES INC	7,254.00	53,244.36	
	CUBESMART	9,900.00	112,464.00	
	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	18,580.00	106,091.80	
	DDR CORP	15,818.00	226,671.94	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	13,666.00	146,909.50	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	7,990.00	550,031.60	
	DOUGLAS EMMETT INC	9,630.00	199,148.40	
	DUKE REALTY CORP	19,180.00	259,505.40	
	DUPONT FABROS TECHNOLOGY	4,310.00	107,879.30	
	EASTGROUP PROPERTIES INC	1,870.00	88,675.40	
	EDUCATION REALTY TRUST INC	6,320.00	67,434.40	
	ENTERTAINMENT PROPERTIES TR	3,500.00	153,930.00	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	3,180.00	216,621.60	
	EQUITY ONE INC	4,200.00	80,010.00	
	EQUITY RESIDENTIAL	22,090.00	1,284,091.70	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,520.00	363,384.00	
	EXCEL TRUST INC	1,900.00	24,016.00	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	7,000.00	179,550.00	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,717.00	444,199.89	
	FELCOR LODGING TRUST INC	9,950.00	39,203.00	
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	5,580.00	63,946.80	
	FIRST POTOMAC REALTY TRUST	3,760.00	55,911.20	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	4,770.00	48,749.40	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	44,548.00	704,303.88	
	GETTY REALTY CORP	2,570.00	42,122.30	
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	970.00	17,479.40	
	GLIMCHER REALTY TRUST	7,880.00	75,254.00	
	GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	3,000.00	71,850.00	
	HCP INC	30,360.00	1,255,386.00	
	HEALTH CARE REIT INC	13,870.00	785,596.80	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	5,390.00	111,195.70	

HERSHA HOSPITALITY TRUST	11,190.00	60,426.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	5,530.00	183,208.90	
HOME PROPERTIES INC	3,590.00	207,861.00	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	9,030.00	220,332.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	53,632.00	891,900.16	
INLAND REAL ESTATE CORP	4,780.00	39,913.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	6,560.00	48,544.00	
KILROY REALTY CORP	4,210.00	173,494.10	
KIMCO REALTY CORP	30,590.00	575,092.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	4,550.00	21,976.50	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	6,101.00	163,994.88	
LEXINGTON REALTY TRUST	10,698.00	91,574.88	
LIBERTY PROPERTY TRUST	8,570.00	294,208.10	
LTC PROPERTIES INC	2,410.00	76,131.90	
MACERICH CO/THE	10,096.00	553,765.60	
MACK-CALI REALTY CORP	6,320.00	181,573.60	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	8,920.00	93,481.60	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,700.00	169,182.00	
MISSION WEST PROPERTIES	1,500.00	13,920.00	
MONMOUTH REIT-CLASS A	4,000.00	37,200.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	8,070.00	219,423.30	
NATL HEALTH INVESTORS INC	1,890.00	89,245.80	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	8,029.00	165,798.85	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,300.00	22,620.00	
PARKWAY PROPERTIES INC	2,010.00	19,316.10	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	3,700.00	81,400.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	4,500.00	57,330.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	12,700.00	231,775.00	
POST PROPERTIES INC	3,940.00	173,557.00	
PROLOGIS INC	34,143.00	1,105,208.91	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	1,320.00	80,797.20	
PUBLIC STORAGE	10,564.00	1,435,753.24	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	2,560.00	29,312.00	
REALTY INCOME CORP	9,720.00	352,836.00	
REGENCY CENTERS CORP	6,620.00	270,559.40	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	4,400.00	52,272.00	
RLJ LODGING TRUST	2,400.00	43,392.00	
ROUSE PROPERTIES INC	1,670.00	18,670.60	
SAUL CENTERS INC	730.00	25,104.70	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	12,070.00	268,557.50	
SIMON PROPERTY GROUP INC	21,893.00	2,973,069.40	
SL GREEN REALTY CORP	6,500.00	485,355.00	
SOVRAN SELF STORAGE INC	2,020.00	91,667.60	
STRATEGIC HOTELS & RESORTS I	13,000.00	81,380.00	
SUN COMMUNITIES INC	1,750.00	69,492.50	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	8,549.00	80,446.09	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	6,440.00	189,271.60	
TAUBMAN CENTERS INC	4,450.00	293,255.00	
UDR INC	16,096.00	411,735.68	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	790.00	31,607.90	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	1,540.00	29,460.20	
VENTAS INC	21,716.00	1,257,790.72	
VORNADO REALTY TRUST	13,708.00	1,124,604.32	
WASHINGTON REIT	4,640.00	137,622.40	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	9,100.00	225,316.00	
WINTHROP REALTY TRUST	2,490.00	27,863.10	
投資証券 小計	889,959.00	29,144,292.06	(2,266,843,036)
アメリカドル 小計	889,959.00	29,144,292.06	(2,266,843,036)
カナダドル			
投資証券			
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	1,600.00	41,040.00	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	3,590.00	54,711.60	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	1,760.00	91,308.80	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTI-U	1,100.00	27,555.00	
CALLOWAY REAL ESTATE INVESTM	3,550.00	96,595.50	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,180.00	72,154.20	
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	2,370.00	89,586.00	
CANMARC REAL ESTATE INVESTME	2,000.00	33,020.00	
CHARTWELL SENIORS HOUSING RE	4,600.00	40,250.00	

	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	2,220.00	48,396.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	2,030.00	28,947.80	
	DUNDEE INTERNATIONAL REAL ES	2,700.00	28,485.00	
	DUNDEE REAL ESTATE INVESTMEN	2,360.00	79,720.80	
	EXTENDICARE REAL ESTATE INVE	2,780.00	23,157.40	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	6,060.00	140,895.00	
	INNVEST REAL ESTATE INVESTME	3,480.00	18,026.40	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	2,000.00	33,160.00	
	NORTHERN PROPERTY REAL ESTAT	1,250.00	38,887.50	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	2,000.00	24,200.00	
	PRIMARIS RETAIL REAL ESTATE	3,130.00	68,390.50	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	10,270.00	268,047.00	
	TRANSGLOBE APARTMENT REAL ES	2,500.00	29,250.00	
	投資証券 小計	66,530.00	1,375,784.50 (106,513,235)	
	カナダドル 小計	66,530.00	1,375,784.50 (106,513,235)	
	オーストラリアドル			
投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	20,672.00	37,933.12	
	ALE PROPERTY GROUP	10,000.00	19,400.00	
	ASPEN GROUP	34,000.00	15,640.00	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	3,000.00	6,180.00	
	AUSTRALAND PROPERTY GROUP	19,000.00	49,590.00	
	BWP TRUST	33,420.00	58,819.20	
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	173,100.00	298,597.50	
	CHALLENGER DIVERSIFIED PROPE	26,280.00	12,877.20	
	CHARTER HALL GROUP	17,172.00	35,374.32	
	CHARTER HALL OFFICE REIT	30,630.00	109,042.80	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	20,616.00	67,414.32	
	COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	176,050.00	172,529.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	61,930.00	42,731.70	
	DEXUS PROPERTY GROUP	371,720.00	328,972.20	
	GOODMAN GROUP	489,780.00	320,805.90	
	GPT GROUP	130,500.00	403,245.00	
	INVESTA OFFICE FUND	192,140.00	122,969.60	
	MIRVAC GROUP	253,770.00	315,943.65	
	STOCKLAND	181,200.00	614,268.00	
	WESTFIELD GROUP	157,700.00	1,338,873.00	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	215,300.00	538,250.00	
	投資証券 小計	2,617,980.00	4,909,456.51 (404,882,878)	
	オーストラリアドル 小計	2,617,980.00	4,909,456.51 (404,882,878)	
	イギリスポンド			
投資証券	BIG YELLOW GROUP PLC	7,200.00	19,612.80	
	BRITISH LAND CO PLC	67,815.00	333,581.98	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GRO	45,430.00	148,101.80	
	DERWENT LONDON PLC	6,110.00	101,792.60	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	23,850.00	83,785.05	
	HAMMERSON PLC	52,220.00	201,360.32	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	57,990.00	398,391.30	
	LONDON & STAMFORD PROPERTY P	42,000.00	44,814.00	
	METRIC PROPERTY INVESTMENT P	15,000.00	12,618.75	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	4,200.00	13,503.00	
	SEGRO PLC	56,341.00	123,893.85	
	SHAFTESBURY PLC	18,400.00	92,920.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	5,979.00	13,960.96	
	投資証券 小計	402,535.00	1,588,336.41 (193,395,841)	
	イギリスポンド 小計	402,535.00	1,588,336.41 (193,395,841)	
	香港ドル			
投資証券	CHAMPION REIT	215,000.00	651,450.00	
	FORTUNE REIT	75,000.00	293,250.00	
	LINK REIT	168,500.00	4,852,800.00	
	PROSPERITY REIT	112,000.00	176,960.00	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	75,000.00	141,000.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	64,000.00	149,760.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	48,000.00	171,360.00	

	投資証券 小計	757,500.00	6,436,580.00 (64,494,531)
	香港ドル 小計	757,500.00	6,436,580.00 (64,494,531)
	シンガポールドル		
投資証券	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	34,000.00	34,170.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	132,000.00	252,780.00
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	51,000.00	52,785.00
	CACHE LOGISTICS TRUST	45,000.00	44,550.00
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	99,000.00	49,005.00
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	154,900.00	174,262.50
	CAPITAMALL TRUST	200,000.00	344,000.00
	CAPITARETAIL CHINA TRUST	43,000.00	49,020.00
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	44,000.00	72,380.00
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	40,000.00	30,600.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	32,000.00	48,160.00
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	27,200.00	20,672.00
	K-REIT ASIA	53,000.00	46,905.00
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	108,000.00	41,580.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	80,000.00	69,200.00
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	75,000.00	79,125.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	101,000.00	90,395.00
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	26,000.00	46,020.00
	STARHILL GLOBAL REIT	94,000.00	55,460.00
	SUNTEC REIT	170,000.00	197,200.00
	投資証券 小計	1,609,100.00	1,798,269.50 (111,151,037)
	シンガポールドル 小計	1,609,100.00	1,798,269.50 (111,151,037)
	ニュージーランドドル		
投資証券	ARGOSY PROPERTY TRUST	35,000.00	29,050.00
	GOODMAN PROPERTY TRUST	68,690.00	69,376.90
	KIWI INCOME PROPERTY TRUST	83,000.00	86,320.00
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	28,000.00	31,920.00
	投資証券 小計	214,690.00	216,666.90 (13,780,014)
	ニュージーランドドル 小計	214,690.00	216,666.90 (13,780,014)
	ユーロ		
投資証券	AEDIFICA	550.00	24,601.50
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	4,200.00	37,674.00
	ALTAREA	110.00	13,090.00
	ANF IMMOBILIER	800.00	22,224.00
	BEFIMMO S.C.A.	1,000.00	51,410.00
	BENI STABILI SPA	65,000.00	24,076.00
	COFINIMMO	1,120.00	99,680.00
	CORIO NV	7,050.00	252,954.00
	EUROBANK PROPERTIES REAL EST	1,050.00	3,738.00
	EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	2,500.00	65,750.00
	FONCIERE DES REGIONS	2,923.00	142,145.49
	GECINA SA	2,040.00	146,737.20
	HAMBORNER REIT AG	2,800.00	19,513.20
	ICADE	1,690.00	103,174.50
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,890.00	5,443.10
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	500.00	9,180.00
	KLEPIERRE	6,800.00	159,698.00
	MERCIALYS	3,191.00	84,609.36
	NIEUWE STEEN INVESTMENTS NV	3,746.00	34,463.20
	SILIC	650.00	49,621.00
	STE DE LA TOUR EIFFEL	482.00	18,417.22
	UNIBAIL-RODAMCO SE	6,800.00	987,020.00
	VASTNED RETAIL NV	1,440.00	48,636.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	570.00	21,945.00
	WERELDHAVE NV	1,720.00	96,337.20
	投資証券 小計	125,622.00	2,522,137.97 (256,879,752)
	ユーロ 小計	125,622.00	2,522,137.97 (256,879,752)
	合計		3,417,940,324 (3,417,940,324)

（注1）通貨の種類ごとの小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。

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

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 112銘柄	100.00%	66.32%
カナダドル	投資証券 22銘柄	100.00%	3.12%
オーストラリアドル	投資証券 21銘柄	100.00%	11.85%
イギリスポンド	投資証券 13銘柄	100.00%	5.66%
香港ドル	投資証券 7銘柄	100.00%	1.89%
シンガポールドル	投資証券 20銘柄	100.00%	3.25%
ニュージーランドドル	投資証券 4銘柄	100.00%	0.40%
ユーロ	投資証券 25銘柄	100.00%	7.52%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[前へ](#)   [次へ](#)

- 1 当ファンドの中間財務諸表は、「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)ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、中間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 当ファンドは、当中間計算期間より中間財務諸表を作成しているため、中間損益及び剰余金計算書に係る比較情報は記載しておりません。
- 3 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期中間計算期間(平成24年1月27日から平成24年7月26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。

[前へ](#)

【eMAXIS バランス(8資産均等型)】  
(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

第2期中間計算期間末  
[平成24年7月26日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,701,096
親投資信託受益証券	281,410,195
未収利息	8
流動資産合計	285,111,299
資産合計	285,111,299
負債の部	
流動負債	
未払解約金	301,168
未払受託者報酬	64,614
未払委託者報酬	473,797
その他未払費用	3,813
流動負債合計	843,392
負債合計	843,392
純資産の部	
元本等	
元本	277,896,496
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	6,371,411
(分配準備積立金)	3,295,847
元本等合計	284,267,907
純資産合計	284,267,907
負債純資産合計	285,111,299

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期中間計算期間 自平成24年1月27日 至平成24年7月26日
営業収益	
受取利息	1,119
有価証券売買等損益	4,550,317
営業収益合計	4,549,198
営業費用	
受託者報酬	64,614
委託者報酬	473,797
その他費用	3,813
営業費用合計	542,224
営業利益	5,091,422
経常利益	5,091,422
中間純利益	5,091,422
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	804,097
期首剰余金又は期首欠損金( )	1,022,326
剰余金増加額又は欠損金減少額	12,702,352
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	12,702,352
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,457,748
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,457,748
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	6,371,411

## (3) 【中間注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 親投資信託受益証券以外の有価証券 個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 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最終相場で評価しております。 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、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）また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。 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また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、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
-------------------	---

## (中間貸借対照表に関する注記)

	第 2 期中間計算期間末 [ 平成24年7月26日現在 ]
1 期首元本額	110,359,349円
期中追加設定元本額	203,457,408円
期中一部解約元本額	35,920,261円
2 受益権の総数	277,896,496口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0229円 (10,229円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 2 期中間計算期間末 [ 平成24年7月26日現在 ]
1 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2 時価の算定方法	<p>(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)に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	

## (有価証券関係に関する注記)

該当事項はありません。

## (デリバティブ取引等関係に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## &lt; 参考 &gt;

当ファンドは「TOPIXマザーファンド」、「外国株式インデックスマザーファンド」、「新興国株式インデックスマザーファンド」、「日本債券インデックスマザーファンド」、「外国債券インデックスマザーファンド」、「新興国債券インデックスマザーファンド」、「東証REIT指数マザーファンド」および「MUAMG-REITマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間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、これら親投資信託の受益証券です。

なお、これら親投資信託の状況は次の通りです。

[次へ](#)

## 「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。

## (1) 貸借対照表

		[ 平成24年7月26日現在 ]
		金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		
		57,088,034,987
株式	2,3	164,964,331,816
派生商品評価勘定		5,479,640
未収配当金		157,043,825
未収利息		129,394
前払金		58,885,000
その他未収収益		28,580,038
流動資産合計		222,302,484,700
資産合計		222,302,484,700
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		
		38,854,120
未払金		150,714,690
未払解約金		40,170,171
未払利息		1,962,843
受入担保金		54,806,083,784
流動負債合計		55,037,785,608
負債合計		55,037,785,608
純資産の部		
元本等		
元本	1	249,641,012,341
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	4	82,376,313,249
元本等合計		167,264,699,092
純資産合計		167,264,699,092
負債純資産合計		222,302,484,700

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年3月26日から翌年3月25日までであります。

## (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	<p>株式は移動平均法、株式以外の有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合また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、委託会社が忠実義務に基づいて合理的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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	[ 平成24年7月26日現在 ]
1 期首	平成24年1月27日
期首元本額	250,369,277,064円
期首からの追加設定元本額	24,967,676,779円
期首からの一部解約元本額	25,695,941,502円
元本の内訳*	
ファンド・マネジャー（国内株式）	332,884,752円
eMAXIS TOPIXインデックス	5,379,143,536円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	53,100,975円
eMAXIS バランス（波乗り型）	41,345,927円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	54,848,820,441円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	30,211,638,268円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	1,469,674,355円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	9,711,450,617円
MUAM 日本株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	9,571,512,776円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	33,937,794,375円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型（適格機関投資家限定）	10,667,833,787円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	2,371,249,245円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型（適格機関投資家限定）	973,641,005円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	811,213,102円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,386,643,929円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	3,037,478,663円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	7,339,029円
MUAMトピックスリスクコントロール（5%）インデックス ファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）	252,156,738円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	18,656,439,226円
三菱UFJ TOPIX・ライト	1,267,118,756円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	189,944,652円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	448,751,522円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	591,216,762円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	626,101,566円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	7,835,366,601円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	5,154,615,589円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	872,741,684円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	6,598,703,596円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	838,976,283円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	3,839,553,396円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	2,054,497,919円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド （安定型）	971,976,028円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド （安定成長型）	3,511,681,365円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド （成長型）	2,291,503,990円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド （積極型）	1,471,553,329円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド （合計）	27,355,348,557円 249,641,012,341円
2 貸付有価証券	
株券貸借取引契約により、以下の通り有価証券の貸付を行っております。	
株式	51,934,820,626円
3 差入委託証拠金代用有価証券	
先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の通り 差入れを行っております。	
株式	922,410,000円
4 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	82,376,313,249円
5 受益権の総数	249,641,012,341口
6 1口当たり純資産額	0.6700円
（1万口当たり純資産額）	（6,700円）

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	[ 平成24年7月26日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2 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)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関係に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。

## （有価証券関係に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等関係に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

## 株式関連

区分	種類	[ 平成24年7月26日現在 ]			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,048,210,000		3,015,190,000	33,020,000
	合計	3,048,210,000		3,015,190,000	33,020,000

## （注）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、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、最も近い最終相場値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 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。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

[次へ](#)

「外国株式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。

(1) 貸借対照表

		[ 平成24年7月26日現在 ]
		金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金		1,163,419,883
コール・ローン		154,256,949
株式		132,919,292,598
投資証券		3,172,795,277
派生商品評価勘定		16,112,820
未収入金		741,209
未収配当金		181,268,814
未収利息		349
差入委託証拠金		1,153,999,253
流動資産合計		138,761,887,152
資産合計		138,761,887,152
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		25,878,830
未払解約金		70,691,318
流動負債合計		96,570,148
負債合計		96,570,148
純資産の部		
元本等		
元本	1	147,021,435,697
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	2	8,356,118,693
元本等合計		138,665,317,004
純資産合計		138,665,317,004
負債純資産合計		138,761,887,152

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年5月13日から翌年5月12日までであります。

(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	<p>株式および投資証券は移動平均法、株式および投資証券以外の有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場（外貨建証券の場合は知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合また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、委託会社が忠実義務に基づいて合理的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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	[ 平成24年7月26日現在 ]
1 期首	平成24年1月27日
期首元本額	152,966,217,901円
期首からの追加設定元本額	11,347,736,915円
期首からの一部解約元本額	17,292,519,119円
元本の内訳*	
ファンド・マネジャー（海外株式）	286,937,239円
eMAXIS 先進国株式インデックス	7,475,117,213円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	37,179,444円
eMAXIS バランス（波乗り型）	18,579,964円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	1,464,438,959円
eMAXIS 全世界株式インデックス	1,007,781,696円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	52,046,844,553円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	36,676,612,356円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	1,069,467,150円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	6,938,514,019円
MUAM 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	7,273,112,202円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型（適格機関投資家限定）	867,117,129円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	585,169,177円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	5,082,176,178円
MSCIコクサイインデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）	1,956,680,395円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	15,901,409円
MUAM 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	6,019,272,100円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,452,003,132円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	68,233,426円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	162,682,023円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	239,679,239円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	277,580,437円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	2,680,735,560円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	318,931,032円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	2,396,409,231円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	610,943,926円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	2,799,522,007円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	2,994,117,172円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	354,058,528円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	1,223,421,090円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	955,572,201円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	666,645,510円
（合計）	147,021,435,697円
2 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	8,356,118,693円
3 受益権の総数	147,021,435,697口
4 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9432円 (9,432円)

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	[ 平成24年7月26日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2 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)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関係に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。

3 金融商品の時価等に関する事項につ  
いての補足説明

当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載してお  
ります。

（有価証券関係に関する注記）  
該当事項はありません。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）  
取引の時価等に関する事項  
株式関連

区分	種類	[平成24年7月26日現在]			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,482,119,804		2,472,428,999	9,690,805
	合計	2,482,119,804		2,472,428,999	9,690,805

（注）時価の算定方法

- 1 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、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、最も近い最終相場値や気配値等、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。

通貨関連

区分	種類	[平成24年7月26日現在]			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 ノルウェークローネ デンマーククローネ 買建 アメリカドル オーストラリアドル	10,222,960 10,136,160 11,707,125 12,062,700		10,248,000 10,184,000 11,706,000 12,061,500	25,040 47,840 1,125 1,200
	合計	44,128,945		44,199,500	75,205

（注）時価の算定方法

- 1 対顧客先物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。  
為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。  
当該日の対顧客先物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。  
（イ）当該日を超える対顧客先物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相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。  
（ロ）当該日を超える対顧客先物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相場の仲値を用いております。
- 2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「新興国株式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。

(1) 貸借対照表

		[ 平成24年7月26日現在 ]
		金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金		399,846,373
コール・ローン		160,138,959
株式		14,087,677,762
投資証券		30,557,329
派生商品評価勘定		460,437
未収入金		68,109,311
未収配当金		49,628,929
未収利息		362
差入委託証拠金		52,835,212
流動資産合計		14,849,254,674
資産合計		14,849,254,674
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		11,470,944
未払金		289,151,625
未払解約金		5,334,805
流動負債合計		305,957,374
負債合計		305,957,374
純資産の部		
元本等		
元本	1	11,225,326,022
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		3,317,971,278
元本等合計		14,543,297,300
純資産合計		14,543,297,300
負債純資産合計		14,849,254,674

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年5月13日から翌年5月12日までであります。

(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	<p>株式および投資証券は移動平均法、株式および投資証券以外の有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場（外貨建証券の場合は知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合また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、委託会社が忠実義務に基づいて合理的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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	[ 平成24年7月26日現在 ]
1 期首	平成24年1月27日
期首元本額	9,361,956,272円
期首からの追加設定元本額	2,164,711,906円
期首からの一部解約元本額	301,342,156円
元本の内訳*	
F P バランスファンド（安定型）	5,784,651円
F P バランスファンド（安定成長型）	38,062,207円
e M A X I S 新興国株式インデックス	9,431,471,506円
e M A X I S バランス（8資産均等型）	26,991,184円
e M A X I S バランス（波乗り型）	8,294,282円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	30,472円
三菱UFJ DC 新興国株式インデックスファンド	824,463,951円
新興国株式インデックスオープン	92,618,792円
e M A X I S 全世界株式インデックス	114,342,187円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	3,803,101円
M U A M 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	679,463,689円
（合計）	11,225,326,022円
2 受益権の総数	11,225,326,022口
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2956円 (12,956円)

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	[ 平成24年7月26日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2 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）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関係に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	

## （有価証券関係に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等関係に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

## 株式関連

区分	種類	[ 平成24年7月26日現在 ]		
		契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	453,509,915	442,494,718	11,015,197
	合計	453,509,915	442,494,718	11,015,197

## （注）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、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、最も近い最終相場値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 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。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

## 通貨関連

区分	種類	[平成24年7月26日現在]			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	マレーシアリングット	17,284,330		17,255,000	29,330
	タイバーツ	11,118,600		11,025,000	93,600
	インドネシアルピア	5,680,080		5,727,000	46,920
	韓国ウォン	27,174,000		27,280,000	106,000
	ニュー台湾ドル	20,740,800		20,720,000	20,800
	南アフリカランド	9,284,500		9,280,000	4,500
	合計	91,282,310		91,287,000	4,690

## (注) 時価の算定方法

- 対顧客先物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。  
為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます。)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。  
当該日の対顧客先物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。  
(イ) 当該日を超える対顧客先物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相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。  
(ロ) 当該日を超える対顧客先物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相場の仲値を用いております。
- 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

[前へ](#)   [次へ](#)

「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。

(1) 貸借対照表

		[ 平成24年7月26日現在 ]
		金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		617,785,215
国債証券		151,338,782,400
地方債証券		13,162,655,892
特殊債券		19,050,599,110
社債券		14,376,906,010
未収入金		578,343,350
未収利息		723,803,137
前払費用		38,277,540
差入委託証拠金		540,000
流動資産合計		199,887,692,654
資産合計		199,887,692,654
負債の部		
流動負債		
前受金		1,230,000
未払金		49,228,940
未払解約金		463,228,677
流動負債合計		513,687,617
負債合計		513,687,617
純資産の部		
元本等		
元本	1	166,598,779,161
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		32,775,225,876
元本等合計		199,374,005,037
純資産合計		199,374,005,037
負債純資産合計		199,887,692,654

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年5月13日から翌年5月12日までであります。

(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	<p>有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合また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、委託会社が忠実義務に基づいて合理的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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	[ 平成24年7月26日現在 ]
1 期首	平成24年1月27日
期首元本額	165,752,517,161円
期首からの追加設定元本額	14,289,714,281円
期首からの一部解約元本額	13,443,452,281円
元本の内訳*	
ファンド・マネジャー（国内債券）	229,013,240円
eMAXIS 国内債券インデックス	1,426,272,898円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	27,770,374円
eMAXIS バランス（波乗り型）	5,705,110円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	49,939,477,590円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	17,861,125,636円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	3,467,077,237円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	8,459,648,239円
MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	23,984,891,420円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	19,843,143,903円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型（適格機関投資家限定）	6,156,242,778円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	4,317,998,952円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型（適格機関投資家限定）	991,206,126円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	474,529,589円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	7,434,055,052円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	5,372,220,080円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	6,074,300円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	314,102,091円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	370,124,599円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	313,225,482円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	244,862,647円
三菱UFJ 日本債券インデックスファンドVA	179,511,066円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	1,300,339,662円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	2,902,479,450円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	1,323,155,177円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	1,875,513,239円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	1,529,120,113円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	1,625,284,142円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	2,821,868,789円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	1,222,675,294円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	580,064,886円
（合計）	166,598,779,161円
2 受益権の総数	166,598,779,161口
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1967円 （11,967円）

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	[ 平成24年7月26日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2 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）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 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。

## （有価証券関係に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

[前へ](#)   [次へ](#)

「外国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。

(1) 貸借対照表

		[ 平成24年7月26日現在 ]
		金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金		335,684,736
コール・ローン		237,624,504
国債証券		151,137,600,934
派生商品評価勘定		348,035
未収利息		1,611,990,572
前払費用		50,223,680
流動資産合計		153,373,472,461
資産合計		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		114,345
未払金		70,723,164
未払解約金		49,236,903
流動負債合計		120,074,412
負債合計		
純資産の部		
元本等		
元本	1	119,388,222,934
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		33,865,175,115
元本等合計		153,253,398,049
純資産合計		
負債純資産合計		

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年5月13日から翌年5月12日までであります。

(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	<p>有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場（外貨建証券の場合は知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合また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、委託会社が忠実義務に基づいて合理的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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	[平成24年7月26日現在]
1 期首	平成24年1月27日
期首元本額	120,750,418,705円
期首からの追加設定元本額	4,552,567,332円
期首からの一部解約元本額	5,914,763,103円
元本の内訳*	
ファンド・マネジャー（海外債券）	81,520,416円
eMAXIS 先進国債券インデックス	1,588,157,412円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	27,732,069円
eMAXIS バランス（波乗り型）	13,541,090円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	4,008,616,731円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	37,965,488,736円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	5,456,310,344円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	3,864,358,544円
MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	2,880,678,391円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	36,142,726,788円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型（適格機関投資家限定）	8,415,095,516円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	1,969,339,983円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型（適格機関投資家限定）	519,412,250円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	286,911,291円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	4,902,122,548円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	9,953,235円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	49,606,734円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	79,764,002円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	89,085,628円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	41,264,253円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	2,420,837,894円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	472,946,364円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	889,126,523円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	902,831,691円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	1,026,969,589円
外国債券インデックスファンドi（適格機関投資家限定）	2,006,720,847円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	1,959,660,870円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	258,680,212円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	614,868,505円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	346,414,037円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	97,480,441円
（合計）	119,388,222,934円
2 受益権の総数	119,388,222,934口
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2837円 (12,837円)

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成24年7月26日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2 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)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関係に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。

(有価証券関係に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

区分	種類	[平成24年7月26日現在]			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカドル	69,543,265		69,455,600	87,665
	カナダドル	3,820,290		3,840,000	19,710
	オーストラリアドル	3,187,340		3,217,600	30,260
	イギリスポンド	12,107,780		12,083,000	24,780
	スウェーデンクローネ	1,118,900		1,117,000	1,900
	デンマーククローネ	1,267,020		1,273,000	5,980
	メキシコペソ	1,139,720		1,146,000	6,280
	ユーロ	61,256,195		61,542,000	285,805
	合計	153,440,510		153,674,200	233,690

(注)時価の算定方法

1 対顧客先物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。

為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。

当該日の対顧客先物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。

(イ) 当該日を超える対顧客先物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相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(ロ) 当該日を超える対顧客先物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相場の仲値を用いております。

2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「新興国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。

(1) 貸借対照表

		[ 平成24年7月26日現在 ]
		金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金		24,527,881
コール・ローン		4,351,845
国債証券		1,809,364,933
特殊債券		99,687,569
派生商品評価勘定		4,060
未収利息		29,655,673
前払費用		4,872,250
流動資産合計		1,972,464,211
資産合計		1,972,464,211
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		1,410
未払金		4,270,181
未払解約金		989,309
流動負債合計		5,260,900
負債合計		5,260,900
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,945,221,377
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		21,981,934
元本等合計		1,967,203,311
純資産合計		1,967,203,311
負債純資産合計		1,972,464,211

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年1月27日から翌年1月26日までであります。

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

## （貸借対照表に関する注記）

		[ 平成24年7月26日現在 ]
1 期首		平成24年1月27日
期首元本額		1,754,755,192円
期首からの追加設定元本額		679,728,927円
期首からの一部解約元本額		489,262,742円
元本の内訳*		
eMAXIS バランス（8資産均等型）		35,017,523円
eMAXIS バランス（波乗り型）		17,105,070円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）		39,829円
eMAXIS 新興国債券インデックス		808,499,603円
三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド		131,312,941円
新興国債券インデックスオープン		967,428円
新興国債券インデックスファンド		651,292,263円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）		5,077,373円
三菱UFJ 新興国債券ファンドVA（適格機関投資家限定）		295,909,347円
（合計）		1,945,221,377円
2 受益権の総数		1,945,221,377口
3 1口当たり純資産額		1.0113円
（1万口当たり純資産額）		（10,113円）

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	[ 平成24年7月26日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2 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）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関係に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	

## （有価証券関係に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等関係に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

## 通貨関連

区分	種類	[ 平成24年7月26日現在 ]		
		契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超	
市場取引以外の取引	為替予約取引			
	売建			
	アメリカドル	234,142	234,120	22
	買建			
	メキシコペソ	2,119,212	2,120,100	888
	ハンガリーフォリント	329,800	329,100	700
	ポーランドズロチ	676,920	679,900	2,980
	南アフリカランド	1,114,140	1,113,600	540
	合計	4,474,214	4,476,820	2,650

## （注）時価の算定方法

- 対顧客先物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。  
為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。  
当該日の対顧客先物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。  
（イ）当該日を超える対顧客先物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相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。  
（ロ）当該日を超える対顧客先物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相場の仲値を用いております。
- 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

前へ 次へ

「東証REIT指数マザーファンド」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。

(1) 貸借対照表

		[ 平成24年7月26日現在 ]
		金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		30,902,639
投資証券		1,418,928,620
未収配当金		13,716,124
未収利息		70
流動資産合計		1,463,547,453
資産合計		1,463,547,453
負債の部		
流動負債		
未払金		11,895,980
未払解約金		8,972,054
流動負債合計		20,868,034
負債合計		20,868,034
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,221,330,122
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		221,349,297
元本等合計		1,442,679,419
純資産合計		1,442,679,419
負債純資産合計		1,463,547,453

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年1月27日から翌年1月26日までであります。

(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	<p>投資証券は移動平均法、投資証券以外の有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合また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、委託会社が忠実義務に基づいて合理的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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
-------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

		[ 平成24年7月26日現在 ]
1 期首		平成24年1月27日
期首元本額		976,937,045円
期首からの追加設定元本額		417,648,482円
期首からの一部解約元本額		173,255,405円
元本の内訳*		
eMAXIS 国内リートインデックス		1,174,936,313円
eMAXIS バランス(8資産均等型)		30,523,883円
eMAXIS バランス(波乗り型)		14,882,698円
三菱UFJ <DC>J-REITインデックスファンド		962,288円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)		24,940円
(合計)		1,221,330,122円
2 受益権の総数		1,221,330,122口
3 1口当たり純資産額		1.1812円
(1万口当たり純資産額)		(11,812円)

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	[ 平成24年7月26日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2 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）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 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。

（有価証券関係に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

[前へ](#)   [次へ](#)

「MUAM G - REIT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。

(1) 貸借対照表

		[ 平成24年7月26日現在 ]
		金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金		8,148,233
コール・ローン		6,885,972
投資証券		3,730,211,976
派生商品評価勘定		243
未収入金		30,416
未収配当金		9,088,213
未収利息		15
流動資産合計		3,754,365,068
資産合計		3,754,365,068
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		829
未払金		2,087,075
未払解約金		1,557,182
流動負債合計		3,645,086
負債合計		3,645,086
純資産の部		
元本等		
元本	1	5,065,462,176
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	2	1,314,742,194
元本等合計		3,750,719,982
純資産合計		3,750,719,982
負債純資産合計		3,754,365,068

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年1月6日から翌年1月5日までであります。

(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	<p>投資証券および株式は移動平均法、投資証券および株式以外の有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場（外貨建証券の場合は知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合また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、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

		[ 平成24年7月26日現在 ]
1	期首	平成24年1月27日
	期首元本額	5,067,809,441円
	期首からの追加設定元本額	550,390,163円
	期首からの一部解約元本額	552,737,428円
	元本の内訳*	
	三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）	603,924,244円
	三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）	394,704,739円
	三菱UFJ 資産設計ファンド（分配型）	122,805,267円
	三菱UFJ 資産設計ファンド（バランス型）	215,832,543円
	三菱UFJ 資産設計ファンド（株式重視型）	86,924,906円
	ファンド・マネジャー（海外リート）	48,901,729円
	F Pバランスファンド（安定型）	17,789,643円
	F Pバランスファンド（安定成長型）	32,633,044円
	eMAXIS 先進国リートインデックス	3,467,815,079円
	eMAXIS バランス（8資産均等型）	47,939,791円
	eMAXIS バランス（波乗り型）	23,437,526円
	三菱UFJ <DC>先進国REITインデックスファンド	2,712,021円
	三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	41,644円
	（合計）	5,065,462,176円
2	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	1,314,742,194円
3	受益権の総数	5,065,462,176口
4	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.7404円 (7,404円)

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	[ 平成24年7月26日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2 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）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関係に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	

## （有価証券関係に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等関係に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

## 通貨関連

区分	種類	[ 平成24年7月26日現在 ]		
		契約額等(円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建			
	アメリカドル 買建	1,894,429	1,894,186	243
	ユーロ 買建	1,894,429	1,893,600	829
合計		3,788,858	3,787,786	586

（注）時価の算定方法

- 1 対顧客先物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。  
為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。  
当該日の対顧客先物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。  
（イ）当該日を超える対顧客先物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相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。  
（ロ）当該日を超える対顧客先物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相場の仲値を用いております。
- 2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

[前へ](#)

2【ファンドの現況】  
【純資産額計算書】

平成24年8月31日現在  
(単位：円)

資産総額	341,342,846
負債総額	785,221
純資産総額( - )	340,557,625
発行済口数	322,626,614 口
1口当たり純資産価額( / )	1.0556 ( 1万口当たり 10,556 )

<参考>

「TOPIXマザーファンド」の現況  
純資産額計算書

平成24年8月31日現在  
(単位：円)

資産総額	211,768,277,168
負債総額	38,746,777,889
純資産総額( - )	173,021,499,279
発行済口数	252,248,606,518 口
1口当たり純資産価額( / )	0.6859 ( 1万口当たり 6,859 )

<参考>

「外国株式インデックスマザーファンド」の現況  
純資産額計算書

平成24年8月31日現在  
(単位：円)

資産総額	144,267,197,353
負債総額	205,747,918
純資産総額( - )	144,061,449,435
発行済口数	142,846,565,577 口
1口当たり純資産価額( / )	1.0085 ( 1万口当たり 10,085 )

<参考>

「新興国株式インデックスマザーファンド」の現況  
純資産額計算書

平成24年8月31日現在  
(単位：円)

資産総額	15,919,097,677
負債総額	271,814,128
純資産総額( - )	15,647,283,549
発行済口数	11,491,965,011 口
1口当たり純資産価額( / )	1.3616 ( 1万口当たり 13,616 )

<参考>

「日本債券インデックスマザーファンド」の現況  
純資産額計算書

平成24年8月31日現在  
(単位：円)

資産総額	204,328,616,139
負債総額	4,973,162,034
純資産総額( - )	199,355,454,105
発行済口数	167,239,656,254 口
1口当たり純資産価額( / )	1.1920 ( 1万口当たり 11,920 )

<参考>

「外国債券インデックスマザーファンド」の現況  
純資産額計算書

平成24年8月31日現在  
(単位：円)

資産総額	158,350,568,342
負債総額	115,477,920
純資産総額( - )	158,235,090,422
発行済口数	119,869,977,879 口
1口当たり純資産価額( / )	1.3201 ( 1万口当たり 13,201 )

## &lt;参考&gt;

「新興国債券インデックスマザーファンド」の現況  
純資産額計算書平成24年8月31日現在  
(単位:円)

資産総額	2,037,616,013
負債総額	17,608,145
純資産総額( - )	2,020,007,868
発行済口数	1,969,920,051 口
1口当たり純資産価額( / )	1.0254 ( 1万口当たり 10,254 )

## &lt;参考&gt;

「東証REIT指数マザーファンド」の現況  
純資産額計算書平成24年8月31日現在  
(単位:円)

資産総額	1,501,785,390
負債総額	3,976,455
純資産総額( - )	1,497,808,935
発行済口数	1,215,132,119 口
1口当たり純資産価額( / )	1.2326 ( 1万口当たり 12,326 )

## &lt;参考&gt;

「MUAMG-REITマザーファンド」の現況  
純資産額計算書平成24年8月31日現在  
(単位:円)

資産総額	3,834,037,091
負債総額	377,862
純資産総額( - )	3,833,659,229
発行済口数	5,014,651,774 口
1口当たり純資産価額( / )	0.7645 ( 1万口当たり 7,645 )

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### （1）名義書換

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

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

### （2）受益者等に対する特典

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。

### （4）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。

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

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたと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。

### （5）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。

### （6）受益権の再分割

委託会社は、受託会社と合意のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

### （7）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係る収益分配金の支払い、解約請求の受付け、解約代金および償還金の支払い等については、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額等

平成24年8月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、124,098株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

##### (2) 委託会社の機構

###### ・会社の意思決定機構

業務執行の基本方針を決定し、取締役の職務の執行を監督する機関として、取締役会を設置します。取締役の選任は、総株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席する株主総会にてその議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。また、取締役会で決定した基本方針に基づき、経営管理全般に関する執行方針その他重要な事項を協議・決定する機関として、経営会議を設置します。

###### ・投資運用の意思決定機構

###### 投資環境見通しの策定

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

###### 運用戦略の決定

運用戦略委員会において、で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

###### 運用計画の決定

で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

###### ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部門から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

###### 投資行動のモニタリング1

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

###### 投資行動のモニタリング2

運用部門から独立した管理担当部署は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

###### ファンドに係る法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に係る法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

###### 運用・管理に関する監督

内部監査担当部署（5名程度）は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

さらに、委託会社は、三菱UFJ信託銀行からの投資環境および全資産に関する助言を活用して、質の高い運用サービスの提供に努めています。

ファンドの運用体制等は平成24年8月末現在のものであり、今後変更される可能性があります。

#### 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）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成24年8月31日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。(親投資信託を除きます。)

商品分類	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	395	5,612,198
追加型公社債投資信託	18	463,426
単位型株式投資信託	8	27,748
単位型公社債投資信託	6	102,357
合計	427	6,205,729

なお、純資産総額の金額については、百万円未満の端数を四捨五入して記載しておりますので、表中の個々の数字の合計と合計欄の数字とは一致しないことがあります。

### 3【委託会社等の経理状況】

#### (1) 財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱UFJ投信株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」（以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「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）」に基づき作成しております。

なお、財務諸表に掲載している金額については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

#### (2) 監査証明について

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27期事業年度（自平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第26期 (平成23年3月31日現在)		第27期 (平成24年3月31日現在)	
<b>(資産の部)</b>				
<b>流動資産</b>				
現金及び預金	2	17,056,128	2	14,298,590
有価証券	2	10,000,000	2	8,000,000
前払費用		156,230		154,925
未収入金	2	19,641		13,813
未収委託者報酬		4,517,987		3,977,324
未収収益	2	63,656	2	42,563
繰延税金資産		429,080		339,052
金銭の信託	2	30,000	2	30,000
その他		28,070		27,621
流動資産合計		32,300,796		26,883,891
<b>固定資産</b>				
<b>有形固定資産</b>				
建物	1	306,543	1	281,399
器具備品	1	184,985	1	177,757
土地		1,205,031		1,205,031
有形固定資産合計		1,696,560		1,664,188
<b>無形固定資産</b>				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		909,905		881,368
ソフトウェア仮勘定		146,761		402,721
その他		68		24
無形固定資産合計		1,072,557		1,299,937
<b>投資その他の資産</b>				
投資有価証券		9,405,012		14,456,313
関係会社株式		431,812		320,136
長期性預金	2	7,000,000	2	8,500,000
長期差入保証金	2	797,041	2	837,456
長期前払費用		52		
繰延税金資産		442,254		139,650
その他		15,035		15,035
投資その他の資産合計		18,091,208		24,268,591
固定資産合計		20,860,326		27,232,718
資産合計		53,161,123		54,116,609

(単位：千円)

	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
<b>(負債の部)</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	47,528	79,079
未払金		
未払収益分配金	245,085	185,817
未払償還金	1,328,820	1,159,445
未払手数料	2 1,768,519	2 1,557,726
その他未払金	104,042	50,899
未払費用	2 1,240,586	2 1,174,572
未払消費税等	184,873	63,602
未払法人税等	2,228,870	1,532,874
賞与引当金	550,000	520,000
その他	227,518	278,521
流動負債合計	7,925,844	6,602,539
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	105,461	119,902
役員退職慰労引当金	76,024	49,735
時効後支払損引当金	196,123	195,228
固定負債合計	377,609	364,866
負債合計	8,303,454	6,967,405
<b>(純資産の部)</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000,131	2,000,131
資本剰余金		
資本準備金	222,096	222,096
資本剰余金合計	222,096	222,096
利益剰余金		
利益準備金	342,589	342,589
その他利益剰余金		
別途積立金	6,998,000	6,998,000
繰越利益剰余金	34,903,313	36,863,331
利益剰余金合計	42,243,903	44,203,921
株主資本合計	44,466,131	46,426,148
評価・換算差額等		
その他有価証券	391,537	723,054
評価差額金		
評価・換算差額等合計	391,537	723,054
純資産合計	44,857,668	47,149,203
負債純資産合計	53,161,123	54,116,609

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)		第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		48,411,622		47,476,170
投資顧問料		16,400		15,335
その他営業収益		236,596		153,305
営業収益合計		48,664,618		47,644,812
営業費用				
支払手数料	2	19,778,797	2	19,292,904
広告宣伝費		696,640		516,886
公告費		7,795		7,961
調査費				
調査費		895,558		909,999
委託調査費		8,991,373		9,975,300
事務委託費		243,109		306,137
営業雑経費				
通信費		98,144		90,066
印刷費		569,763		400,552
協会費		37,616		40,636
諸会費		6,248		7,593
事務機器関連費		880,509		958,507
その他営業雑経費				16,396
営業費用合計		32,205,558		32,522,943
一般管理費				
給料				
役員報酬		199,168		202,812
給料・手当		3,576,037		3,623,556
賞与引当金繰入		550,000		520,000
福利厚生費		492,032		520,897
交際費		23,412		26,743
旅費交通費		156,920		153,892
租税公課		108,850		102,255
不動産賃借料		655,939		698,539
退職給付費用		163,440		142,883
役員退職慰労引当金繰入		18,106		22,805
固定資産減価償却費		406,176		481,601
諸経費		369,603		247,162
一般管理費合計		6,719,689		6,743,148
営業利益		9,739,370		8,378,719

(単位：千円)

	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)		第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金		29,543		153,215
有価証券利息	2	11,040	2	8,160
受取利息	2	20,465	2	25,661
投資有価証券償還益		371,171		1,876
収益分配金等時効完成分		438,693		318,285
その他		8,257		7,856
営業外収益合計		879,170		515,056
営業外費用				
投資有価証券償還損		192,004		
時効後支払損引当金繰入		666		15,288
事務過誤費		32,187		7,845
その他		7,757		82
営業外費用合計		232,615		23,216
経常利益		10,385,925		8,870,559
特別利益				
投資有価証券売却益		351,930		150,103
特別利益合計		351,930		150,103
特別損失				
投資有価証券売却損		127,114		153,276
関係会社株式売却損				13,563
投資有価証券評価損				1,925
過年度時効後支払損引当金繰入		204,138		
固定資産除却損	1	3,431	1	17,034
資産除去債務会計基準の適用に伴う 影響額		37,264		
その他		2,429		412
特別損失合計		374,378		186,212
税引前当期純利益		10,363,477		8,834,449
法人税、住民税及び事業税		4,027,373		3,510,046
法人税等調整額		25,800		175,067
法人税等合計		4,001,573		3,685,113
当期純利益		6,361,903		5,149,336

## (3)【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	2,000,131	2,000,131
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	2,000,131	2,000,131
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	222,096	222,096
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	222,096	222,096
資本剰余金合計		
当期首残高	222,096	222,096
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	222,096	222,096
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	342,589	342,589
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	342,589	342,589
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	6,998,000	6,998,000
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	6,998,000	6,998,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	31,383,254	34,903,313
当期変動額		
剰余金の配当	2,841,844	3,189,318
当期純利益	6,361,903	5,149,336
当期変動額合計	3,520,059	1,960,017
当期末残高	34,903,313	36,863,331
利益剰余金合計		
当期首残高	38,723,843	42,243,903
当期変動額		
剰余金の配当	2,841,844	3,189,318
当期純利益	6,361,903	5,149,336
当期変動額合計	3,520,059	1,960,017
当期末残高	42,243,903	44,203,921
株主資本合計		
当期首残高	40,946,071	44,466,131
当期変動額		
剰余金の配当	2,841,844	3,189,318
当期純利益	6,361,903	5,149,336
当期変動額合計	3,520,059	1,960,017
当期末残高	44,466,131	46,426,148
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	1,277,237	391,537
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	885,699	331,516
当期変動額合計	885,699	331,516
当期末残高	391,537	723,054
繰延ヘッジ損益		
当期首残高	62,258	

当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	62,258	
当期変動額合計	62,258	
当期末残高		
評価・換算差額等合計		
当期首残高	1,214,979	391,537
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	823,441	331,516
当期変動額合計	823,441	331,516
当期末残高	391,537	723,054
純資産合計		
当期首残高	42,161,050	44,857,668
当期変動額		
剰余金の配当	2,841,844	3,189,318
当期純利益	6,361,903	5,149,336
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	823,441	331,516
当期変動額合計	2,696,617	2,291,534
当期末残高	44,857,668	47,149,203

## [重要な会計方針]

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法によっております。

## (2) その他有価証券

## 時価のあるもの

決算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、売却原価は移動平均法により算定)によっております。

## 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は、建物38年であります。

## (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。

## 3. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

## 4. 引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

## (2) 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、その発生年度の従業員の平均支払期間以内の一定の年数(8年)による定額法により、翌事業年度より費用処理することとしております。

## (3) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。

## (4) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

## 5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## (1) 消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。

## [追加情報]

## (会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用)

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

## 注記事項

(貸借対照表関係)

## 1.有形固定資産の減価償却累計額

	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
建物	181,085千円	208,976千円
器具備品	227,109千円	294,294千円

## 2.関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
預金	13,335,700千円	11,773,728千円
有価証券	10,000,000千円	8,000,000千円
未収入金	1,500千円	-
未収収益	63,656千円	42,563千円
金銭の信託	30,000千円	30,000千円
長期性預金	7,000,000千円	8,500,000千円
長期差入保証金	788,590千円	828,908千円
未払手数料	986,786千円	851,491千円
未払費用	134,713千円	135,926千円

(損益計算書関係)

## 1.固定資産除却損の内訳

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
器具備品	3,431千円	1,144千円
ソフトウェア	-	15,890千円
計	3,431千円	17,034千円

## 2.関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
支払手数料	11,685,424千円	10,760,427千円
有価証券利息	8,718千円	6,532千円
受取利息	20,465千円	25,661千円

(株主資本等変動計算書関係)

第26期(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

## 1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 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)
発行済株式				
普通株式	124,098	-	-	124,098
合計	124,098	-	-	124,098

## 2.配当に関する事項

## (1)配当金支払額

平成22年6月30日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	2,841,844千円
1株当たり配当額	22,900円
基準日	平成22年3月31日
効力発生日	平成22年7月1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翌事業年度となるもの

平成23年6月30日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	3,189,318千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	25,700円
基準日	平成23年3月31日
効力発生日	平成23年6月30日

第27期(自平成23年4月1日至平成24年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 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)
発行済株式				
普通株式	124,098	-	-	124,098
合計	124,098	-	-	124,098

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

平成23年6月30日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	3,189,318千円
1株当たり配当額	25,700円
基準日	平成23年3月31日
効力発生日	平成23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翌事業年度となるもの

平成24年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	2,581,238千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	20,800円
基準日	平成24年3月31日
効力発生日	平成24年6月27日

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については銀行預金、譲渡性預金または投資信託に限定しており、金融機関からの資金調達は行っておりません。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません(注2)参照)。

第26期(平成23年3月31日現在)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	17,056,128	17,056,128	-
(2) 有価証券	10,000,000	10,000,000	-
(3) 未収委託者報酬	4,517,987	4,517,987	-
(4) 長期性預金	7,000,000	7,010,576	10,576
(5) 投資有価証券	9,140,755	9,140,755	-
資産計	47,714,871	47,725,447	10,576
(1) 未払手数料	1,768,519	1,768,519	-
(2) 未払法人税等	2,228,870	2,228,870	-
負債計	3,997,389	3,997,389	-

第27期(平成24年3月31日現在)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	14,298,590	14,298,590	-
(2) 有価証券	8,000,000	8,000,000	-
(3) 未収委託者報酬	3,977,324	3,977,324	-
(4) 長期性預金	8,500,000	8,509,886	9,886
(5) 投資有価証券	14,417,413	14,417,413	-
資産計	49,193,328	49,203,214	9,886
(1) 未払手数料	1,557,726	1,557,726	-
(2) 未払法人税等	1,532,874	1,532,874	-
負債計	3,090,600	3,090,600	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

## 資産

## (1) 現金及び預金、(2) 有価証券、(3) 未収委託者報酬

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。なお、有価証券はすべて短期決済される譲渡性預金であります。

## (4) 長期性預金

契約期間に基づく区分ごとに、新規に預金を行った場合に想定される預金金利で割り引いた現在価値を算定しております。

## (5) 投資有価証券

上記の表中における投資有価証券はすべて投資信託であり、基準価額によっております。

負債

## (1)未払手数料、(2)未払法人税等

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

## (注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
非上場株式	264,257	38,900
子会社株式	431,812	160,600
関連会社株式	-	159,536

非上場株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式及び関連会社株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

## (注3)金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第26期（平成23年3月31日現在）

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	17,056,128	-	-	-
未収委託者報酬	4,517,987	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
譲渡性預金	10,000,000	-	-	-
投資信託	-	2,032,211	1,152,101	-
長期性預金	-	7,000,000	-	-
合計	31,574,115	9,032,211	1,152,101	-

第27期（平成24年3月31日現在）

(単位：千円)

	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	14,298,590	-	-	-
未収委託者報酬	3,977,324	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
譲渡性預金	8,000,000	-	-	-
投資信託	-	3,168,056	4,412,092	2,183,060
長期性預金	-	8,500,000	-	-
合計	26,275,914	11,668,056	4,412,092	2,183,060

## (有価証券関係)

## 1.子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円、前事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式431,812千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

第26期（平成23年3月31日現在）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	4,026,733	3,476,499	550,234
	小計	4,026,733	3,476,499	550,234
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	5,114,022	5,236,164	122,142
	小計	5,114,022	5,236,164	122,142
	合計	9,140,755	8,712,663	428,091

第27期（平成24年3月31日現在）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	11,092,127	9,993,766	1,098,361
	小計	11,092,127	9,993,766	1,098,361
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	3,325,285	3,446,474	121,188
	小計	3,325,285	3,446,474	121,188
	合計	14,417,413	13,440,240	977,173

## 3. 売却したその他有価証券

第26期（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）

種類	売却額(千円)	売却益の合計額(千円)	売却損の合計額(千円)
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他	4,283,999	392,809	127,114
合計	4,283,999	392,809	127,114

第27期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

種類	売却額(千円)	売却益の合計額(千円)	売却損の合計額(千円)
株式	158,639	-	64,792
債券	-	-	-
その他	3,036,630	150,103	88,484
合計	3,195,269	150,103	153,276

(デリバティブ取引関係)  
重要な取引はありません。

## （退職給付関係）

## 1.採用している退職給付制度の概要

当社は、従業員に対して確定拠出年金制度、退職一時金制度及び確定給付年金制度を設けております。なお、平成23年10月に適格退職年金制度を廃止し、確定給付年金制度へ移行しました。

## 2.退職給付債務に関する事項

(単位：千円)

	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
(1)退職給付債務	567,377	475,564
(2)年金資産	309,065	198,994
(3)未積立退職給付債務 (1)+(2)	258,311	276,569
(4)未認識数理計算上の差異	152,850	156,666
(5)貸借対照表計上額純額 (3)+(4)	105,461	119,902
(6)退職給付引当金	105,461	119,902

## 3.退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
(1)勤務費用	28,585	27,806
(2)利息費用	9,774	8,420
(3)期待運用収益	6,248	4,635
(4)数理計算上の差異の費用処理額	37,969	13,599
(5)退職給付費用	70,080	45,191
(6)その他	93,360	97,692
(7)合計	163,440	142,883

(注)「(6)その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

## 4.退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

(1)退職給付見込額の期間配分方法  
期間定額基準

(2)割引率

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

(3)期待運用収益率

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

(4)数理計算上の差異の処理年数

8年（各事業年度の発生時における従業員の平均支払期間以内の一定の年数による定額法により、翌事業年度より費用処理しております。）

## （税効果会計関係）

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	651,260 千円	557,868 千円
投資有価証券評価損	408,754	362,665
ゴルフ会員権評価損	9,710	8,505
未払事業税	172,269	109,608
賞与引当金	223,795	197,652
役員退職慰労引当金	30,934	17,725
退職給付引当金	42,912	42,783
減価償却超過額	39,127	19,890
委託者報酬	92,577	99,265
長期差入保証金	20,080	21,895
時効後支払損引当金	79,802	69,579
その他	34,708	39,304
繰延税金資産 小計	1,805,934	1,546,744
評価性引当額	898,045	813,923
繰延税金資産 合計	907,888	732,821
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	36,553	254,118
繰延税金負債 合計	36,553	254,118
繰延税金資産(負債)の純額	871,334	478,702

## 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

	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
法定実効税率 (調整)	40.7 %	法定実効税率と税効果会計 適用後の法人税等の負担税率 との間の差異が法定実効税率 の100分の5以下であるため注 記を省略しております。
投資有価証券評価損認容	2.9	
その他	0.8	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	38.6	

## 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引き下げ及び復興特別法人税の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、従来の40.7%から、平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については38.0%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、35.6%となります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は39,177千円減少し、法人税等調整額が75,184千円、その他有価証券評価差額金が36,007千円、それぞれ増加しております。

## （セグメント情報等）

## [セグメント情報]

第26期（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）及び第27期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）  
当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## [関連情報]

第26期（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）及び第27期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

## [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。

## [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。

## [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。

## (関連当事者情報)

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第26期（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	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	科目	期末残高	
主要株主	三菱UFJ信託銀行(株)	東京都千代田区	324,279 百万円	信託業 銀行業	被所有 直接 30.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	4,481,369 千円	未払手数料	294,093 千円	
							事務所の賃借	事務所賃借料	631,409 千円	長期差入保証金	783,794 千円
							投資の助言	投資助言料	189,915 千円	未払費用	88,454 千円
主要株主	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 15.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	7,204,055 千円	未払手数料	692,693 千円	
							取引銀行	譲渡性預金の預入	41,000,000 千円	有価証券	10,000,000 千円
								譲渡性預金に係る受取利息	8,718 千円	未収利息	675 千円
								マルチコーラブル預金の預入	9,000,000 千円	現金及び預金	6,000,000 千円
								マルチコーラブル預金に係る受取利息	18,499 千円	未収利息	3,069 千円
								長期性預金	7,000,000 千円		

第27期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	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	科目	期末残高
----	--------	-----	-----	-------	----------------	-----------	-------	------	----	------

親会社	三菱UFJ 信託銀行(株)	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 50.0%	当社投資信託の募 集の取扱及び投資 信託に係る事務代 行の委託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払	4,404,897 千円	未払手数料	285,119 千円
						事務所の賃借	事務所賃借 料	667,780 千円	長期差入保 証金	812,027 千円
						投資の助言	投資助言料	168,292 千円	未払費用	81,330 千円
							株式の売却	98,112 千円		
主要株主	(株)三菱東京 UFJ銀行	東京都 千代田 区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 25.0%	当社投資信託の募 集の取扱及び投資 信託に係る事務代 行の委託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払	6,371,303 千円	未払手数料	566,371 千円
						取引銀行	譲渡性預金 の預入	36,000,000 千円	有価証券	8,000,000 千円
							譲渡性預金 に係る受取 利息	6,532 千円	未収利息	544 千円
							マルチコー ラブル預金 の預入	7,000,000 千円	現金及び 預金	5,500,000 千円
							マルチコー ラブル預金 に係る受取 利息	24,415 千円	長期性預金	8,500,000 千円
			未収利息	2,886 千円						

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

事務所敷金及び賃借料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

投資助言料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

売却価額については、第三者機関による企業価値評価をもとに決定しております。

預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。なお、預入期間は3ヶ月～3年であります。

上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等  
第26期（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	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	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	3,000百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	4,447,569千円	未払手数料	408,084千円

## 第27期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	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	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	3,914,481千円	未払手数料	285,874千円

(注)取引条件及び取引条件の決定方針等

投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

## 2.親会社に関する注記

株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ（東京証券取引所、大阪証券取引所、名古屋証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場）

三菱UFJ信託銀行株式会社（非上場）

## (1株当たり情報)

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
1株当たり純資産額	361,469.71円	379,935.23円
1株当たり当期純利益金額	51,265.16円	41,494.11円

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
当期純利益金額(千円)	6,361,903	5,149,336
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額(千円)	6,361,903	5,149,336
期中平均株式数(株)	124,098	124,098

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

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

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店頭デリバティブ取引を行うこと。

委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記 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】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の特別決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円（平成24年3月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

名称	資本金の額 (平成24年3月末現在)	事業の内容
株式会社三菱東京UFJ銀行	1,711,958 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社ジャパンネット銀行	37,250 百万円	銀行業務を営んでいます。
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
カブドットコム証券株式会社	7,196 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	47,937 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	7,425 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
野村證券株式会社	10,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

### 2【関係業務の概要】

(1) 受託会社：ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。

(2) 販売会社：ファンドの募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。

### 3【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（平成24年8月末現在）

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の50.0%（62,050株）、株式会社三菱東京UFJ銀行は25.0%（31,023株）を所有しています。

(注) 関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が3%以上のものを記載しています。

### 第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙にロゴマーク、図案およびキャッチ・コピー（「自分だけの投資スタイル、探せる、見つかる。ネットで賢く、インデックスファンド・シリーズ。」）を採用すること、またファンドの形態、申込みに係る事項、ファンド専用サイトのアドレスなどを記載することがあります。
- (2) 投資信託説明書（請求目論見書）に信託約款を掲載します。
- (3) 目論見書に以下の内容を記載することがあります。
- ・当ファンドの受益権の価額は、株式や公社債、不動産投資信託証券等の有価証券市場の相場変動、組入有価証券の発行者の信用状況の変化、為替市場の相場変動等の影響により変動し、下落する場合があります。したがって、投資家のみなさまの投資元金が保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被ることがあります。
  - ・当ファンドは、一定の運用成果を保証するものではありません。
  - ・運用により信託財産に生じた損益はすべて投資家のみなさまに帰属します。
  - ・投資信託は、預金等や保険契約とは異なり、預金保険機構、貯金保険機構、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。
  - ・金融商品取引業者以外の金融機関は、投資者保護基金に加入しておりません。
  - ・当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
- (4) 目論見書は電磁的方法により提供されるほか、インターネット、電子媒体等に掲載されることがあります。
- (5) 投信評価機関、投信評価会社等からファンドに対するレーティングを取得し、当該レーティングを使用することがあります。
- (6) 目論見書は「投資信託説明書」を別称として使用します。
- (7) 目論見書に委託会社のホームページアドレスのほか、モバイルサイトのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等を含みます。）等を掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨のご案内を記載することがあります。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成24年9月5日

三菱UFJ投信株式会社  
取締役会御中

### あらた監査法人

指定社員 公認会計士 荒川 進 印  
業務執行社員

指定社員 公認会計士 鶴田光夫 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているeMAXIS バランス（8資産均等型）の平成24年1月27日から平成24年7月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、eMAXIS バランス（8資産均等型）の平成24年7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中間計算期間（平成24年1月27日から平成24年7月26日まで）の損益の状況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

三菱UFJ投信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）上記は、委託会社が、独立監査人の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、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

平成24年6月26日

三菱UFJ投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	長島 拓也	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山田 信之	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ投信株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第27期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ投信株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

---

(注) 上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会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24年3月7日

三菱UFJ投信株式会社  
取締役会御中

### あらた監査法人

指定社員 公認会計士 荒川 進 印  
業務執行社員

指定社員 公認会計士 鶴田光夫 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているeMAXISバランス（8資産均等型）の平成23年10月31日から平成24年1月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、eMAXISバランス（8資産均等型）の平成24年1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計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

三菱UFJ投信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）上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。