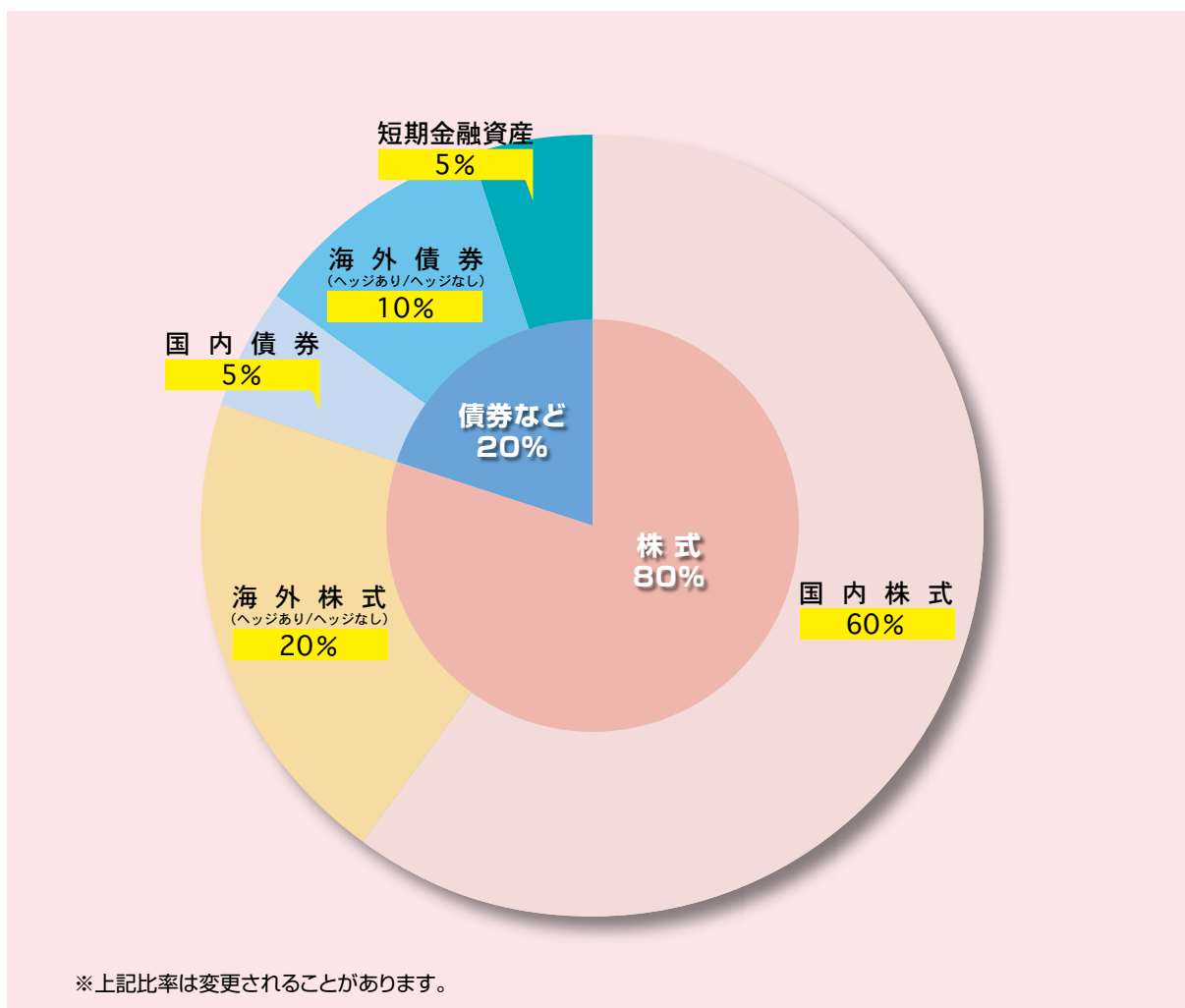


Aナビ80^(愛称)

アセット・ナビゲーション・ファンド (株式80)

追加型投信 / 内外 / 資産複合



●本書は金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第13条の規定に基づく目論見書です。ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みいただき、ご自身でご判断ください。

●ファンドに関する金融商品取引法第15条第3項に規定する目論見書(以下「請求目論見書」といいます。)は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。また、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。なお、請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようにしてください。

●本書には約款の主な内容が含まれていますが、約款の全文は請求目論見書に掲載しています。

●ファンドの基準価額、販売会社などについては、以下の委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社> [ファンドの運用の指図を行なう者]

日興アセットマネジメント株式会社 金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第368号

ホームページアドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404 (午前9時~午後5時。土、日、祝・休日は除きます。)

<受託会社> [ファンドの財産の保管および管理を行なう者]

野村信託銀行株式会社

設定・運用は

日興アセットマネジメント

- ファンドの内容に関して重大な変更を行なう場合には、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)に基づき事前に投資者(受益者)の意向を確認いたします。
- ファンドの財産は、信託法(平成18年法律第108号)に基づき受託会社において分別管理されています。
- この目論見書により行なう「アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2014年1月24日に関東財務局長に提出しており、2014年1月25日にその効力が発生しております。

商品分類			属性区分				
単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	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
追加型	内外	資産複合	その他資産 (投資信託証券 (資産複合 資産配分固定型 (株式、債券)))	年1回	グローバル (含む日本)	ファミリー ファンド	あり (部分ヘッジ)

商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<http://www.toushin.or.jp/>)をご参照ください。
 ※属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

<委託会社の情報>

委託会社名	日興アセットマネジメント株式会社
設立年月日	1959年12月1日
資本金	173億6,304万円
運用する投資信託財産の 合計純資産総額	9兆2,731億円

(2014年5月末現在)

ファンドの目的・特色

ファンドの目的

4つの異なる資産に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざします。

ファンドの特色

1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。
2. インデックスファンドで構成しています。
3. 株式に80%、債券などに20%投資します。

ファンドの仕組み

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



- (主な投資制限)
- ・ 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
 - ・ 外貨建資産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。
- (分配方針)
- ・ 毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。
- ※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。

- 主として、国内株式、海外株式、国内債券、海外債券の4つの資産に投資を行ないます。
- 国際分散投資によりリスク低減をはかりながら、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。

2. インデックスファンドで構成しています。

- 各資産の運用は資産全体の値動きを表す代表的な指数に連動することをめざすインデックス運用で行ないます。

<国内株式>

「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

主としてわが国の株式に投資し、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<海外株式>

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

主として日本を除く世界各国の株式(DR(預託証券)およびカントリーファンドなどを含みます。)に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス(円ヘッジなし・円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド」

主として日本を除く世界各国の株式(DR(預託証券)およびカントリーファンドなどを含みます。)に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス(円ヘッジあり・円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<国内債券>

「日本債券インデックスマザーファンド」

主としてわが国の公社債に投資し、日興債券パフォーマンスインデックス(総合)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<海外債券>

「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」

主として世界各国の債券に投資し、シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

「海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド」

主として世界各国の債券に投資し、シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジあり・円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

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

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

※日興債券パフォーマンスインデックス(総合)：同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はSMBC日興証券株式会社に帰属します。また、SMBC日興証券株式会社の同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

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

3. 株式に80%、債券などに20%投資します。

- 資産の標準実質組入比率は、株式80%、債券など20%とします。
- 組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンドへの投資比率を調整することで行ないます。
- 各マザーファンドおよび短期金融資産への投資比率は以下を基本とします。

投資対象	基本投資比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	60%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	10%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	10%
日本債券インデックスマザーファンド	5%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	5%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	5%
短期金融資産	5%

※基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。

※基本投資比率から乖離した場合は、一定のルールに従い基本投資比率のように調整を行ないます。

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

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

基準価額の変動要因

投資者の皆様は投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者(受益者)の皆様へ帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。

当ファンドは、主に株式および債券を実質的な投資対象としますので、株式および債券の価格の下落や、株式および債券の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

流動性リスク

- 市場規模や取引量が少ない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは、価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。

信用リスク

- 投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト(債務不履行)や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落(価格がゼロになることもあります。)し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。
- 公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト(債務不履行)が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落(価格がゼロになることもあります。)し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。

為替変動リスク

- 外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。
- 「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド」および「海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド」は原則として為替ヘッジを行ないませんが、為替ヘッジを行なうにあたっては、円の金利が為替ヘッジを行なう通貨の金利より低い場合、この金利差に相当するヘッジコストが発生します。為替および金利の動向によっては、為替ヘッジに伴うヘッジコストが予想以上に発生する場合があります。

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

- 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。
- 当ファンドは、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはなりません。
- 分配金は、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。分配金は、計算期間中に発生した運用収益を超えて支払われる場合があります。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。

リスクの管理体制

- リスク・パフォーマンスの評価・分析とリスク管理および法令などの遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理/コンプライアンス業務担当部門が担当しています。
- 上記部門はリスク管理/コンプライアンス関連の委員会へ報告/提案を行なうと共に、必要に応じて運用部門に改善案策定の指示などを行ない、適切な運用体制を維持できるように努めています。

※上記体制は2014年5月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

運用実績

2014年5月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額..... 11,328円

純資産総額..... 1.55億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金込基準価額は、2004年5月末の基準価額を起点として指数化しています。

※分配金込基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2009年10月	2010年10月	2011年10月	2012年10月	2013年10月	設定来累計
0円	0円	0円	0円	10円	30円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	60.42%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	9.97%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	9.97%
日本債券インデックスマザーファンド	4.93%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	4.94%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	4.95%
現金その他	4.83%

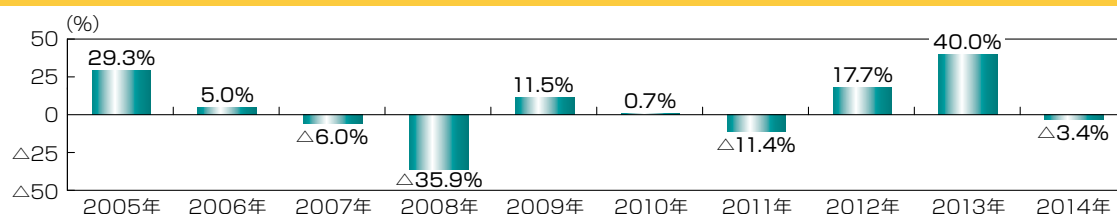
※当ファンドの対純資産総額比です。

<組入上位銘柄>

組入資産	銘柄	通貨	業種・種類	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	1 トヨタ自動車	日本円	輸送用機器	4.62%
	2 三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本円	銀行業	2.47%
	3 ソフトバンク	日本円	情報・通信業	2.05%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	1 APPLE COMPUTER INC	アメリカドル	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.85%
	2 EXXON MOBIL CORP	アメリカドル	エネルギー	1.43%
	3 MICROSOFT CORP	アメリカドル	ソフトウェア・サービス	1.03%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	1 APPLE COMPUTER INC	アメリカドル	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.76%
	2 EXXON MOBIL CORP	アメリカドル	エネルギー	1.36%
	3 MICROSOFT CORP	アメリカドル	ソフトウェア・サービス	0.98%
日本債券インデックスマザーファンド	1 第299回利付国債(10年)	日本円	国債証券	2.34%
	2 第305回利付国債(10年)	日本円	国債証券	2.11%
	3 第303回利付国債(10年)	日本円	国債証券	1.83%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	1 US TREASURY N/B(クーポン2.500%)	アメリカドル	国債証券	1.31%
	2 US TREASURY N/B(クーポン4.125%)	アメリカドル	国債証券	1.18%
	3 US TREASURY N/B(クーポン4.500%)	アメリカドル	国債証券	1.16%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	1 US TREASURY N/B(クーポン1.500%)	アメリカドル	国債証券	1.05%
	2 US TREASURY N/B(クーポン2.125%)	アメリカドル	国債証券	1.03%
	3 BUONI POLIENNALI DEL TES(クーポン3.750%)	ユーロ	国債証券	0.86%

※各マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



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

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2014年は、2014年5月末までの騰落率です。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

お申込みメモ

購入単位	販売会社が定める単位 ※販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。
購入価額	購入申込受付日の翌営業日の基準価額
購入代金	販売会社が指定する日までにお支払いください。
換金単位	1口単位 ※販売会社によって異なる場合があります。
換金価額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を控除した価額
換金代金	原則として、換金申込受付日から起算して5営業日目からお支払いします。
申込締切時間	原則として、販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。
購入の申込期間	2014年1月25日から2015年1月27日までとします。 ※上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。
換金制限	ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の換金には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。
購入・換金申込受付の中止及び取消し	委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、購入および換金の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた購入および換金の申込みの受付を取り消すことができます。
信託期間	無期限(1999年10月29日設定)
繰上償還	次のいずれかの場合等には、繰上償還することがあります。 ・ファンドの受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合 ・繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき ・やむを得ない事情が発生したとき
決算日	毎年10月26日(休業日の場合は翌営業日)
収益分配	年1回、分配方針に基づいて分配を行ないます。 ※原則として、分配金は再投資されます。
信託金の限度額	1兆円
公告	日本経済新聞に掲載します。
運用報告書	毎期決算後および償還後に運用報告書は作成され、知れている受益者に対して交付されます。
課税関係	課税上は、株式投資信託として取り扱われます。 ・公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。 ・配当控除の適用があります。 ・原則として、益金不算入制度が適用されます。

ファンドの費用・税金

ファンドの費用

投資者が直接的に負担する費用

購入時手数料	購入時の基準価額に対し1.08%(税抜1%)以内 ※購入時手数料は販売会社が定めます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
信託財産留保額	換金時の基準価額に対し0.3%

投資者が信託財産で間接的に負担する費用

運用管理費用 (信託報酬)	<p>ファンドの日々の純資産総額に対し年率0.8208%(税抜0.76%) 運用管理費用は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日(当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。)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。</p> <p style="text-align: center;"><運用管理費用の配分(税抜)></p> <table border="1" style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <thead> <tr> <th colspan="4">運用管理費用(年率)</th> </tr> <tr> <th>合計</th> <th>委託会社</th> <th>販売会社</th> <th>受託会社</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>0.76%</td> <td>0.26%</td> <td>0.45%</td> <td>0.05%</td> </tr> </tbody> </table> <p>※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。</p>	運用管理費用(年率)				合計	委託会社	販売会社	受託会社	0.76%	0.26%	0.45%	0.05%
運用管理費用(年率)													
合計	委託会社	販売会社	受託会社										
0.76%	0.26%	0.45%	0.05%										
その他の費用・手数料	<p>監査費用、組入有価証券の売買委託手数料、借入金の利息および立替金の利息などがその都度、信託財産から支払われます。 ※運用状況などにより変動するものであり、事前に料率、上限額などを表示することはできません。</p>												

投資者の皆様にご負担いただくファンドの費用などの合計額については、保有期間や運用の状況などに応じて異なりますので、表示することができません。

税金

- ・税金は表に記載の時期に適用されます。
- ・以下の表は、個人投資者の源泉徴収時の税率であり、課税方法等により異なる場合があります。

時 期	項 目	税 金
分配時	所得税および地方税	配当所得として課税 普通分配金に対して20.315%
換金(解約)時および償還時	所得税および地方税	譲渡所得として課税 換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対して20.315%

※少額投資非課税制度「愛称:NISA(ニーサ)」をご利用の場合

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

※法人の場合は上記とは異なります。

※上記は2014年7月28日現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。



A series of horizontal dashed lines for writing, spaced evenly down the page.

nikko am

アセット・ナビゲーション・ファンド(株式 80)

愛称 「Aナビ 80」

追加型投信／内外／資産複合

◆この目論見書により行なう「アセット・ナビゲーション・ファンド(株式 80)」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を平成 26 年 1 月 24 日に関東財務局長に提出しており、平成 26 年 1 月 25 日にその効力が発生しております。

有価証券届出書提出日	: 平成 26 年 1 月 24 日
発行者名	: 日興アセットマネジメント株式会社
代表者の役職氏名	: 代表取締役 村上 雅彦
本店の所在の場所	: 東京都港区赤坂九丁目7番1号
有価証券届出書(訂正届出書を含みます。)の写しを縦覧に供する場所	: 該当事項はありません。

設定・運用は

日興アセットマネジメント

投資信託は、金融機関の預金や保険契約とは商品性が異なります。

- 投資信託は、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。
また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはなりません。
- 投資信託は、元金および利回り保証のいずれもありません。
- 投資信託をご購入されたお客様は、投資した資産の価値の減少を含むリスクを負います。

－ 目 次 －

	頁
第一部【証券情報】	1
第二部【ファンド情報】	3
第1【ファンドの状況】	3
第2【管理及び運営】	59
第3【ファンドの経理状況】	64
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	276
第三部【委託会社等の情報】	277
約款	316

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

アセット・ナビゲーション・ファンド(株)80(以下「ファンド」といいます。)

- ・愛称として「Aナビ80」、「ステージ1」、「アセット・ナビゲーション・ファンド」、「Aナビ」という名称を用いることがあります。

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

- ・追加型証券投資信託受益権です。(以下「受益権」といいます。)
- ・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の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(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(社債、株式等の振替に関する法律第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「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(以下、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。)。委託会社は、やむを得ない事情などがある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。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】

5兆円を上限とします。

(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。

- ・基準価額につきましては、販売会社または「(8)申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

(5)【申込手数料】

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社または「(8)申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

- ・販売会社における申込手数料率は1.08%(税抜1%)が上限となっております。

(6)【申込単位】

販売会社または「(8)申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

(7)【申込期間】

平成26年1月25日から平成27年1月27日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(8)【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(9)【払込期日】

- ・取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する期日までに販売会社に支払うものとします。
- ・申込期間における各取得申込受付日の発行価額の総額（設定総額）は、販売会社によって、追加設定が行なわれる日に委託会社の指定する口座を経由して、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】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(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】

- ① ファンドの目的
4つの異なる資産に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざします。
- ② ファンドの基本的性格
 - 1) 商品分類

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式 債券
	海外	不動産投信
追加型投信	内外	その他資産 ()
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

◇追加型投信

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

◇内外

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

◇資産複合

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

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

◇その他資産 (投資信託証券 (資産複合 資産配分固定型 (株式、債券)))

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

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

◇年1回

目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。

◇グローバル (含む日本)

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

◇ファミリーファンド

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

◇為替ヘッジあり (部分ヘッジ)

目論見書または投資信託約款において、一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるものをいいます。

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

上記以外の商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

ファンドの特色

1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。
2. インデックスファンドで構成しています。
3. 株式に80%、債券などに20%投資します。

ファンドの仕組み

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



- (主な投資制限)
- ・株式への実質投資割合には、制限を設けません。
 - ・外貨建資産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。
- (分配方針)
- ・毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。
 - ※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。

- 主として、国内株式、海外株式、国内債券、海外債券の4つの資産に投資を行ないます。
- 国際分散投資によりリスク低減をはかりながら、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。

2. インデックスファンドで構成しています。

- 各資産の運用は資産全体の値動きを表す代表的な指数に連動することをめざすインデックス運用で行ないます。

<国内株式>

「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

主としてわが国の株式に投資し、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<海外株式>

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

主として日本を除く世界各国の株式(DR(預託証券)およびカントリーファンドなどを含みます。)に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス(円ヘッジなし・円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド」

主として日本を除く世界各国の株式(DR(預託証券)およびカントリーファンドなどを含みます。)に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス(円ヘッジあり・円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<国内債券>

「日本債券インデックスマザーファンド」

主としてわが国の公社債に投資し、日興債券パフォーマンスインデックス(総合)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<海外債券>

「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」

主として世界各国の債券に投資し、シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

「海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド」

主として世界各国の債券に投資し、シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジあり・円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

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

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

※日興債券パフォーマンスインデックス(総合)：同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はSMBC日興証券株式会社に帰属します。また、SMBC日興証券株式会社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

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

3. 株式に80%、債券などに20%投資します。

- 資産の標準実質組入比率は、株式80%、債券など20%とします。
- 組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンドへの投資比率を調整することで行ないます。
- 各マザーファンドおよび短期金融資産への投資比率は以下を基本とします。

投資対象	基本投資比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	60%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	10%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	10%
日本債券インデックスマザーファンド	5%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	5%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	5%
短期金融資産	5%

※基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。

※基本投資比率から乖離した場合は、一定のルールに従い基本投資比率になるように調整を行ないます。

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

④ 信託金限度額

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

(2) 【ファンドの沿革】

平成11年10月29日

- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

平成13年6月1日

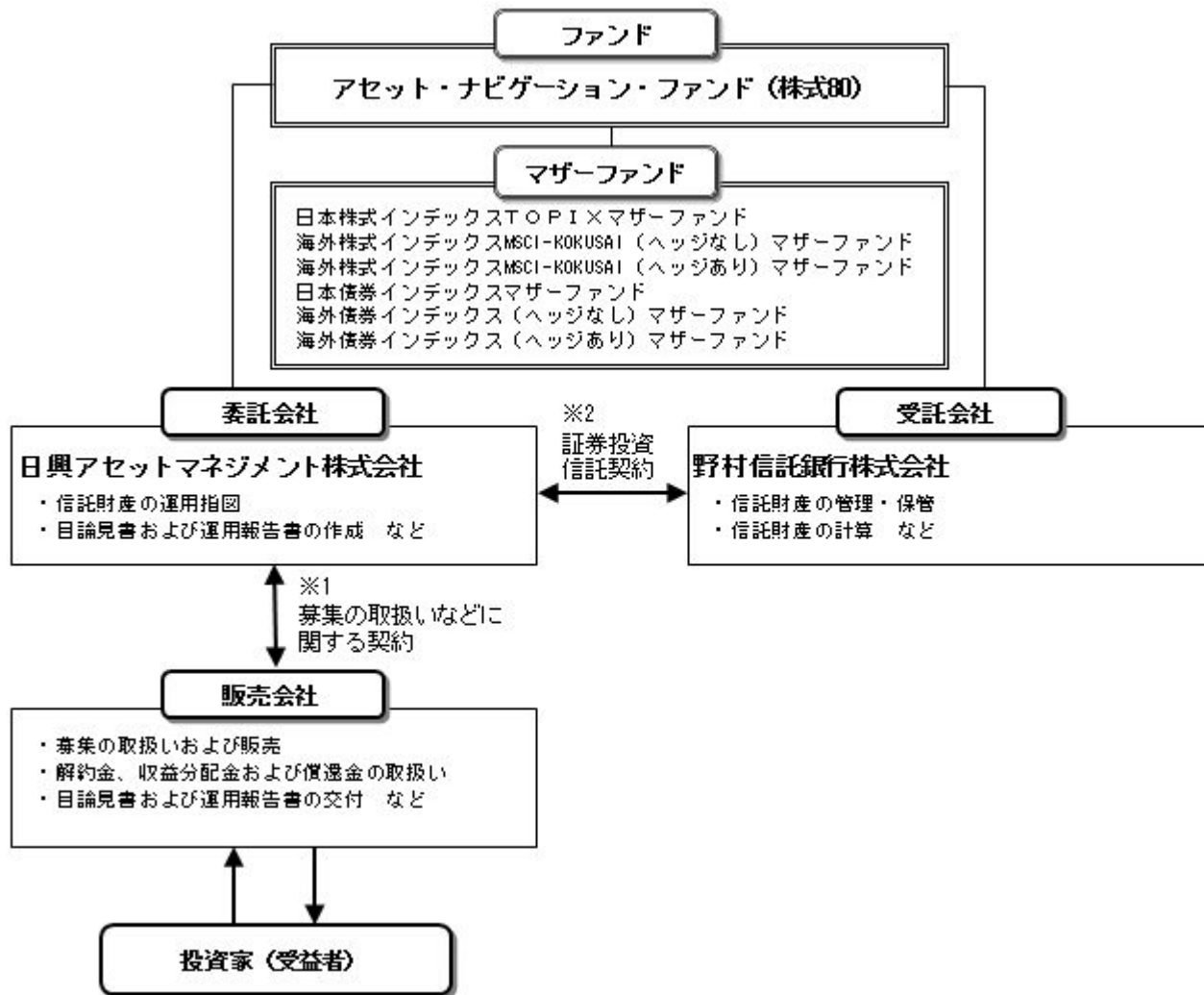
- ・ファンド名称変更

新名称：アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）

旧名称：アセット・ナビゲーション・ファンド（ステージ1）

(3) 【ファンドの仕組み】

① ファンドの仕組み



※1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したもの。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。

※2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したもの。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

② 委託会社の概況（平成26年5月末現在）

1) 資本金

17,363百万円

2) 沿革

昭和34年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

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

3) 大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

- ・主として、以下に掲げる各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長をめざします。
 - 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
 - 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」
 - 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」
 - 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
 - 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」
 - 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」
- ・純資産総額に対する株式ならびに公社債および短期金融資産の実質組入比率については、次の標準実質組入比率を目処として投資を行ないます。
 - 株式の標準実質組入比率……………80%
 - 公社債および短期金融資産の標準実質組入比率……………20%
- ・組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンド受益証券への投資比率を調整することで行ないますが、市況動向などによっては内外の有価証券などへの直接投資を行なうことがあります。
- ・また、資金動向などによっては組入比率を引き下げることがあります。
- ・株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【投資対象】

<アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）>

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

- 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
- 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」
- 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」
- 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
- 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」
- 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」

- ① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条、第21条および第22条に定めるものに限りません。）
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- ② 主として次のマザーファンドの受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
- 1) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」受益証券
 - 2) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券
 - 3) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」受益証券
 - 4) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券
 - 5) 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券
 - 6) 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」受益証券
 - 7) 株券または新株引受権証書

- 8) 国債証券
 - 9) 地方債証券
 - 10) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 11) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - 12) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 13) コマーシャル・ペーパー
 - 14) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 - 15) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)～14)の証券または証書の性質を有するもの
 - 16) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
 - 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) 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
 - 23) 外国の者に対する権利で22)の有価証券の性質を有するもの
- ③ 次に掲げる有価証券（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含みます。）により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
- ④ 次の取引ができます。
- 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引
 - 10) 資金の借入
- <日本株式インデックストップIXマザーファンド>
わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
- ① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限ります。）
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- ② 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
- 1) 株券または新株引受権証書
 - 2) 国債証券
 - 3) 地方債証券

- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 7) コマーシャル・ペーパー
 - 8) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 - 9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)～8)の証券の性質を有するもの
 - 10) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
 - 11) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 - 12) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 13) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 - 14) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- ③ 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- ④ 次の取引ができます。
- 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 有価証券の貸付
 - 6) 公社債の空売
 - 7) 公社債の借入
- <海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド>
日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
- ① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限ります。）
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- ② 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
 - 2) 国債証券
 - 3) 地方債証券
 - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 7) コマーシャル・ペーパー
 - 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 - 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)～7)の証券の性質を有するもの
 - 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

す。)

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

④ 次の取引ができます。

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

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

- 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 - 11) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で12)に定めるもの以外のもの
 - 12) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 - 13) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 - 14) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 - 15) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 17) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
- ③ 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
- ④ 次の取引ができます。
- 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引

<日本債券インデックスマザーファンド>

わが国の公社債を主要投資対象とします。

- ① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）
 - 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限ります。）
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- ② 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
- 1) 国債証券
 - 2) 地方債証券
 - 3) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限ります。）
 - 5) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 6) コマーシャル・ペーパー

- 7) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの
- 8) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
- 9) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 10) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

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

④ 次の取引ができます。

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

<海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

内外の公社債を主要投資対象とします。

① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

- 1) 預金

- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
- ④ 次の取引ができます。
- 1) 先物取引等
 - 2) スワップ取引
 - 3) 金利先渡取引
 - 4) 為替先渡取引
 - 5) 有価証券の貸付
 - 6) 公社債の空売
 - 7) 公社債の借入
 - 8) 外国為替予約取引
- <海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド>
内外の公社債を主要投資対象とします。
- ① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします
- 1) 有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）
 - 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限ります。）
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- ② 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
- 1) 国債証券
 - 2) 地方債証券
 - 3) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限ります。）
 - 5) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 6) コマーシャル・ペーパー
 - 7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの
 - 8) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
 - 9) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 - 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 11) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 - 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの
- ③ 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
- ④ 次の取引ができます。
- 1) 先物取引等

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

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

運用の基本方針	
基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、T O P I X（東証株価指数）*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主としてわが国の株式に投資し、T O P I X（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成11年10月29日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

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

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジなし・円ベース）*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカントリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成12年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

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

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジあり・円ベース）*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカントリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えること、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額の合計額が外貨建資産の組入総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないます。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成12年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、日興債券パフォーマンスインデックス（総合）*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主としてわが国の公社債に投資し、日興債券パフォーマンスインデックス（総合）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 運用の効率化をはかるため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式への投資は行ないません。 外貨建資産への投資は行ないません。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.1%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成10年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

*日興債券パフォーマンスインデックス（総合）は、日興フィナンシャル・インテリジェンス株式会社が発表している、日本の債券市場の動きを表す指数です。国債、地方債、政府保証債、財投機関債、金融債、事業債などの円建て公募利付債で構成されています。対象となる債券は残存年数1年以上、残存額面10億円以上で、格付会社からBBB格相当以上の格付を取得している発行体に限られます。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はSMB C日興証券株式会社に帰属します。また、SMB C日興証券株式会社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

<海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として世界各国の債券に投資し、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成10年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

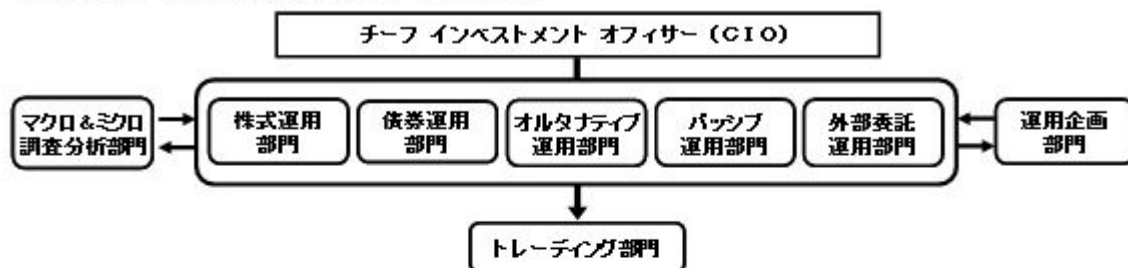
<海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として世界各国の債券に投資し、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えること、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額が外貨建資産の組入総額を超えることがあります。 外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないます。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式への投資は行ないません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成10年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

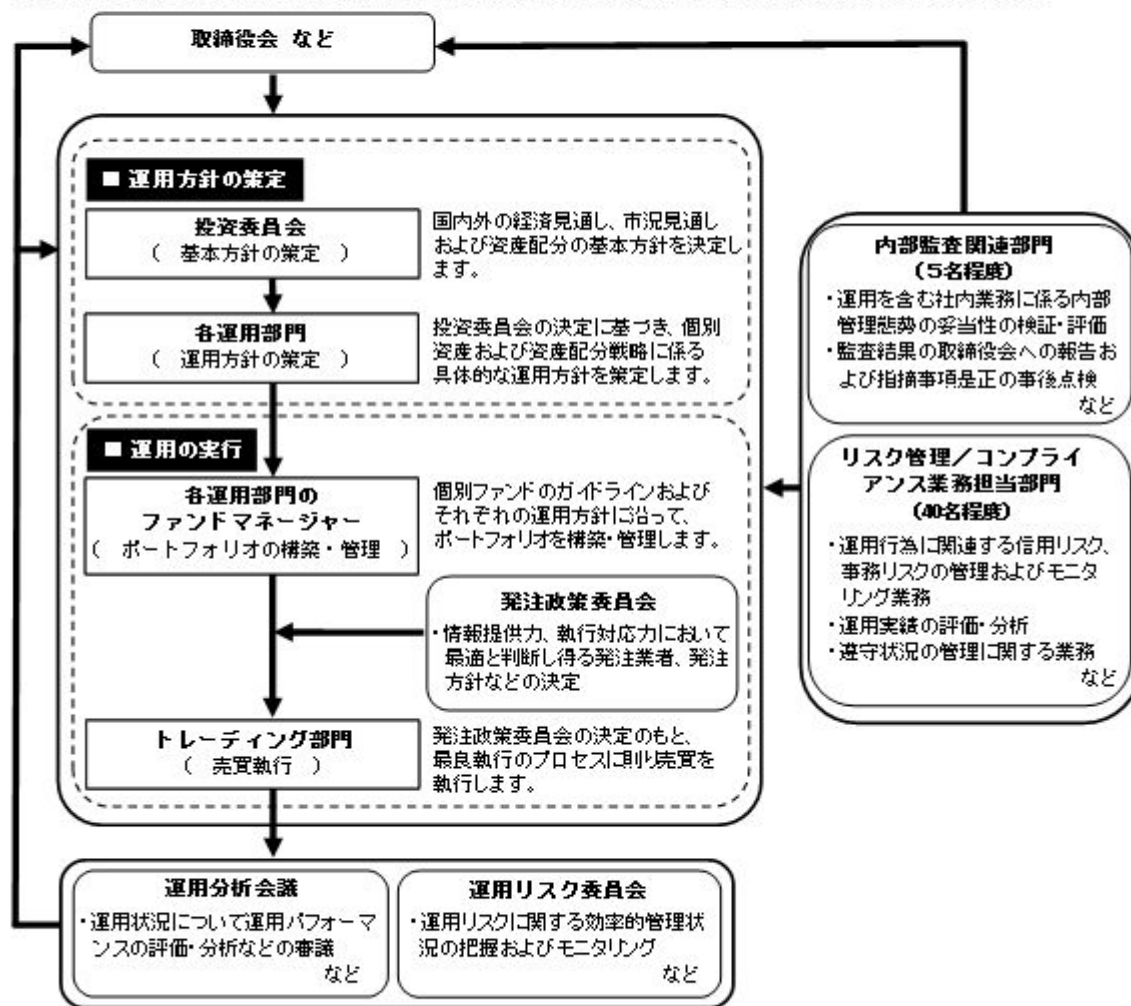
*シティ世界国債インデックス（除く日本）は、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが開発した、日本を除く世界の主要国の国債市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（ヘッジあり・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数を対円でヘッジし、円換算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

(3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

※上記体制は平成26年5月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

① 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

1) 分配対象額の範囲

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

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

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

② 収益分配金の支払い

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

(5) 【投資制限】

① 約款に定める投資制限

＜アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 80）＞

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

- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 14) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
 - イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
 - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
 - ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
- 二) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
- ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

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

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

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

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

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

る先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

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

<海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

<海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド>

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

図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

② 法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

① 価格変動リスク

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

② 流動性リスク

市場規模や取引量が少ない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは、価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。

③ 信用リスク

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

④ 為替変動リスク

- ・外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。
- ・「海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」および「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」は原則として為替ヘッジを行ないませんが、為替ヘッジを行なうにあたっては、円の金利が為替ヘッジを行なう通貨の金利より低い場合、この金利差に相当するヘッジコストが発生します。為替および金利の動向によっては、為替ヘッジに伴うヘッジコストが予想以上に発生する場

合があります。

<その他の留意事項>

・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

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

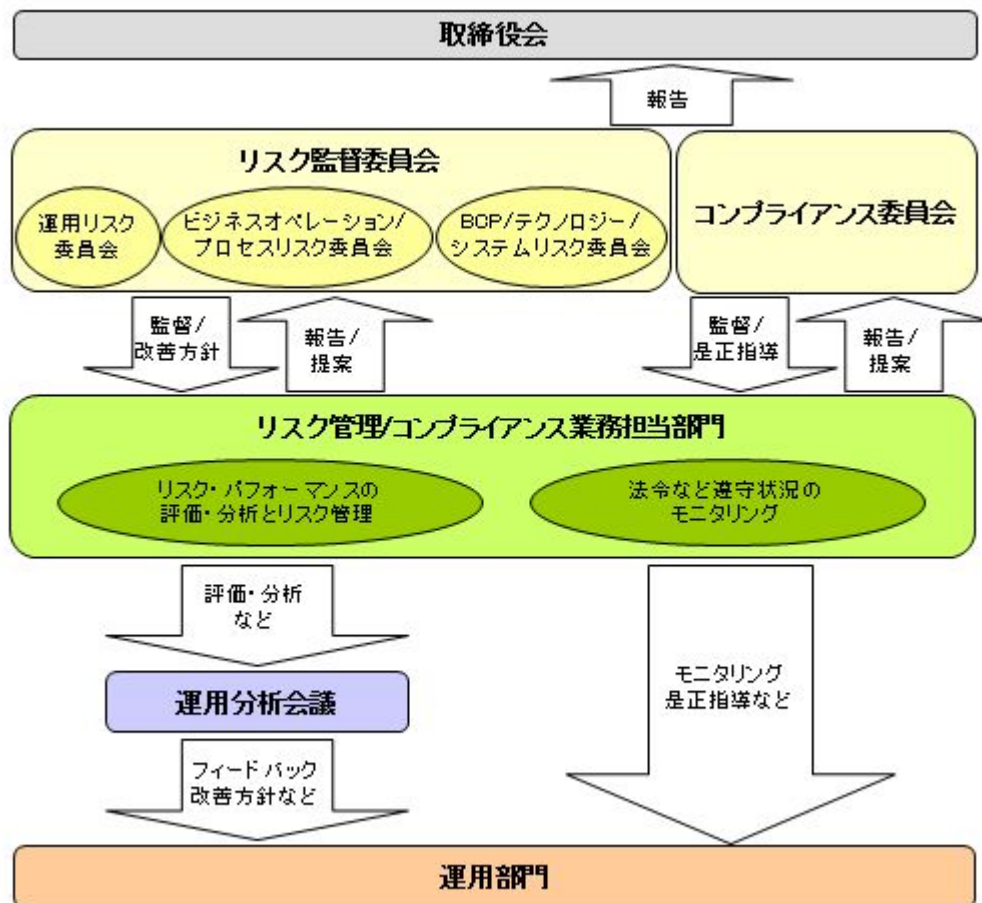
・運用制限や規制上の制限に関する事項

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

・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

(2) リスク管理体制



■全社的リスク管理

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

■リスク・パフォーマンスの評価・分析とリスク管理

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

■法令など遵守状況のモニタリング

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

※上記体制は平成26年5月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

- ・販売会社における申込手数料率は1.08%（税抜1%）が上限となっております。
- ・申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
- ・収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
- ・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(2) 【換金（解約）手数料】

① 換金手数料

ありません。

② 信託財産留保額

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

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

(3) 【信託報酬等】

① 信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.8208%（税抜0.76%）の率を乗じて得た額とします。

② 信託報酬の配分

信託報酬の配分は、以下の通りとします。

信託報酬率（年率）			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.76%	0.26%	0.45%	0.05%

※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

③ 支払時期

信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

(4) 【その他の手数料等】

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

- ① 組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および先物・オプション取引などに要する費用。
- ② 信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。
- ③ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外貨建資産の保管などに要する費用、解約に伴う支払資金の手当てなどを目的とした借入金の利息および受託会社の立て替えた立替金の利息。

<投資対象とするマザーファンドに係る費用>

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

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

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

① 個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税 15.315%および地方税 5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります。）のいずれかを選択することもできます。

2) 解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益（譲渡益）*については譲渡所得として、20.315%（所得税 15.315%および地方税 5%）の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座（源泉徴収選択口座）を選択している場合は、20.315%（所得税 15.315%および地方税 5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。

*解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益

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

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

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

② 法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、15.315%（所得税のみ）の税率による源泉徴収が行なわれます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。

2) 益金不算入制度の適用

原則として、益金不算入制度が適用されます。

※買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③ 個別元本

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

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

④ 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

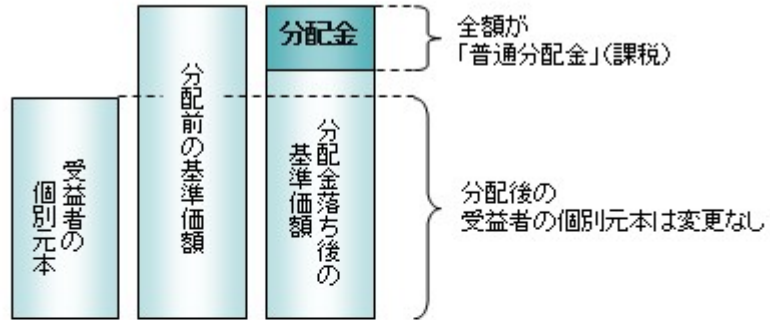
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の 1 口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

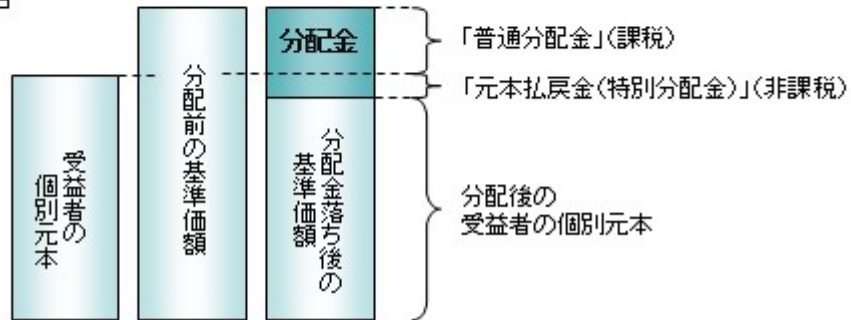
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



※上記は平成 26 年 7 月 28 日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

【アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）】

以下の運用状況は2014年5月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	148,048,697	95.17
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	7,518,252	4.83
合計（純資産総額）		155,566,949	100.00

(2) 【投資資産】

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	95,063,475	0.9743	92,620,344	0.9887	93,989,257	60.42
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド	13,197,662	1.0742	14,177,452	1.1751	15,508,572	9.97
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	9,297,956	1.4693	13,661,859	1.6676	15,505,271	9.97
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	5,539,167	1.3437	7,443,312	1.3895	7,696,672	4.95
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	3,717,352	1.9251	7,156,321	2.0674	7,685,253	4.94
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	5,918,808	1.2833	7,595,868	1.2948	7,663,672	4.93

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	95.17
合計	95.17

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

期別	純資産総額 (百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第5計算期間末 (2004年10月26日)	903	903	0.8243	0.8243
第6計算期間末 (2005年10月26日)	273	273	1.0116	1.0116
第7計算期間末 (2006年10月26日)	331	331	1.1687	1.1697
第8計算期間末 (2007年10月26日)	311	311	1.1636	1.1646
第9計算期間末 (2008年10月27日)	164	164	0.6505	0.6505
第10計算期間末 (2009年10月26日)	222	222	0.7943	0.7943
第11計算期間末 (2010年10月26日)	212	212	0.7548	0.7548
第12計算期間末 (2011年10月26日)	184	184	0.7191	0.7191
第13計算期間末 (2012年10月26日)	185	185	0.7518	0.7518
第14計算期間末 (2013年10月28日)	198	198	1.0963	1.0973
2013年5月末日	205	—	1.0468	—
6月末日	196	—	1.0328	—
7月末日	196	—	1.0418	—
8月末日	192	—	1.0239	—
9月末日	201	—	1.0855	—
10月末日	199	—	1.0960	—
11月末日	188	—	1.1406	—
12月末日	171	—	1.1721	—
2014年1月末日	157	—	1.1191	—
2月末日	156	—	1.1230	—
3月末日	156	—	1.1259	—
4月末日	153	—	1.1065	—
5月末日	155	—	1.1328	—

② 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金 (円)
第5期	2003年10月28日～2004年10月26日	0.0000
第6期	2004年10月27日～2005年10月26日	0.0000
第7期	2005年10月27日～2006年10月26日	0.0010
第8期	2006年10月27日～2007年10月26日	0.0010
第9期	2007年10月27日～2008年10月27日	0.0000
第10期	2008年10月28日～2009年10月26日	0.0000

第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	0.0000
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	0.0000
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	0.0000
第14期	2012年10月27日～2013年10月28日	0.0010
当中間期	2013年10月29日～2014年4月28日	—

③【収益率の推移】

期	期間	収益率 (%)
第5期	2003年10月28日～2004年10月26日	5.40
第6期	2004年10月27日～2005年10月26日	22.72
第7期	2005年10月27日～2006年10月26日	15.63
第8期	2006年10月27日～2007年10月26日	△0.35
第9期	2007年10月27日～2008年10月27日	△44.10
第10期	2008年10月28日～2009年10月26日	22.11
第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	△4.97
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	△4.73
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	4.55
第14期	2012年10月27日～2013年10月28日	45.96
当中間期	2013年10月29日～2014年4月28日	0.60

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

(4)【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数 (口)	解約口数 (口)
第5期	2003年10月28日～2004年10月26日	109,219,759	83,867,439
第6期	2004年10月27日～2005年10月26日	79,716,243	905,414,249
第7期	2005年10月27日～2006年10月26日	105,184,984	91,974,687
第8期	2006年10月27日～2007年10月26日	54,775,405	70,648,230
第9期	2007年10月27日～2008年10月27日	39,696,045	54,456,013
第10期	2008年10月28日～2009年10月26日	40,558,097	13,000,445
第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	31,178,453	29,716,908
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	26,532,382	51,181,847
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	20,084,711	30,295,119
第14期	2012年10月27日～2013年10月28日	14,612,172	80,167,991
当中間期	2013年10月29日～2014年4月28日	3,970,485	46,189,759

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2014年5月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	26,587,663,360	98.76
コール・ローン等、その他資産 (負債控除後)	—	334,013,046	1.24
合計 (純資産総額)		26,921,676,406	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	336,420,000	1.25

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	215,800	6,302.37	1,360,051,680	5,761.00	1,243,223,800	4.62
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,159,000	627.98	727,837,544	573.00	664,107,000	2.47
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	75,100	7,478.23	561,615,692	7,345.00	551,609,500	2.05
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	139,500	3,901.54	544,266,184	3,563.00	497,038,500	1.85
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	115,700	4,719.66	546,064,724	4,105.00	474,948,500	1.76
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,985,400	208.91	414,778,688	198.00	393,109,200	1.46
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	60,100	5,144.56	309,188,106	6,042.00	363,124,200	1.35
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	96,300	3,391.65	326,616,272	3,444.00	331,657,200	1.23
日本	株式	キヤノン	電気機器	89,900	3,148.42	283,043,170	3,338.00	300,086,200	1.11
日本	株式	ファナック	電気機器	17,300	16,439.26	284,399,364	17,320.00	299,636,000	1.11
日本	株式	KDDI	情報・通信業	47,500	5,134.71	243,899,166	6,053.00	287,517,500	1.07
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	60,800	4,650.77	282,767,345	4,607.00	280,105,600	1.04
日本	株式	三菱地所	不動産業	107,000	2,827.38	302,530,140	2,471.00	264,397,000	0.98
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	64,000	3,620.09	231,686,092	4,068.00	260,352,000	0.97
日本	株式	日立製作所	電気機器	373,000	674.86	251,723,180	684.00	255,132,000	0.95
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	187,000	1,081.08	202,162,080	1,304.00	243,848,000	0.91

日本	株式	三菱商事	卸売業	119,400	1,986.28	237,162,614	2,009.00	239,874,600	0.89
日本	株式	三井不動産	不動産業	72,000	3,283.51	236,413,000	3,221.00	231,912,000	0.86
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	28,500	8,743.09	249,178,276	7,765.00	221,302,500	0.82
日本	株式	N T T ドコモ	情報・通信業	126,100	1,536.08	193,700,894	1,690.00	213,109,000	0.79
日本	株式	三井物産	卸売業	138,200	1,418.51	196,038,082	1,542.00	213,104,400	0.79
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	312,800	740.24	231,549,336	669.00	209,263,200	0.78
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	217,600	1,006.96	219,116,595	919.00	199,974,400	0.74
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	686,000	337.10	231,255,030	287.00	196,882,000	0.73
日本	株式	パナソニック	電気機器	177,100	950.70	168,370,670	1,093.00	193,570,300	0.72
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	59,300	3,151.56	186,887,820	3,216.00	190,708,800	0.71
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	13,900	12,689.13	176,379,036	13,480.00	187,372,000	0.70
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	50,900	3,409.14	173,525,596	3,676.00	187,108,400	0.70
日本	株式	三菱電機	電気機器	155,000	1,065.97	165,225,360	1,181.00	183,055,000	0.68
日本	株式	デンソー	輸送用機器	38,300	4,744.65	181,720,234	4,663.00	178,592,900	0.66

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.52
		建設業	2.63
		食料品	4.06
		繊維製品	0.69
		パルプ・紙	0.28
		化学	5.44
		医薬品	4.45
		石油・石炭製品	0.62
		ゴム製品	0.92
		ガラス・土石製品	1.00
		鉄鋼	1.57
		非鉄金属	1.00
		金属製品	0.66
		機械	5.16
		電気機器	12.16
		輸送用機器	11.44
		精密機器	1.38
		その他製品	1.44
		電気・ガス業	2.09
陸運業	3.96		
海運業	0.34		
空運業	0.52		

		倉庫・運輸関連業	0.22
		情報・通信業	7.17
		卸売業	4.59
		小売業	4.25
		銀行業	8.99
		証券、商品先物取引業	1.55
		保険業	2.26
		その他金融業	1.35
		不動産業	3.34
		サービス業	2.60
合 計			98.76

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2014年 06月	買建	28	日本円	326,035,197	336,420,000	1.25

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

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2014年5月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	43,100,274,580	55.00
	カナダ	3,464,826,909	4.42
	モーリシャス	10,438,857	0.01
	ドイツ	3,166,783,637	4.04
	イタリア	819,968,483	1.05
	フランス	3,251,748,110	4.15
	オランダ	1,229,782,078	1.57
	スペイン	1,229,416,129	1.57
	ベルギー	416,147,228	0.53
	オーストリア	94,223,911	0.12
	ルクセンブルク	122,191,219	0.16
	フィンランド	310,323,100	0.40
	アイルランド	690,181,895	0.88
	ポルトガル	62,240,808	0.08
	イギリス	6,979,853,174	8.91
	スイス	3,485,238,859	4.45
	スウェーデン	1,073,809,981	1.37
	ノルウェー	300,137,473	0.38
	デンマーク	438,283,914	0.56
	ケイマン	88,736,933	0.11
	オーストラリア	2,480,570,626	3.17
	バミューダ	109,342,439	0.14
	ニュージーランド	42,032,109	0.05
	香港	844,592,450	1.08
	シンガポール	522,514,259	0.67
	イスラエル	166,623,666	0.21
	ジャージー	406,399,246	0.52
	ガーンジー	19,959,946	0.03
	英ヴァージン諸島	47,844,042	0.06
		小計	74,974,486,061
投資証券	アメリカ	1,194,491,229	1.52
	カナダ	17,495,361	0.02
	フランス	101,629,923	0.13
	オランダ	10,105,957	0.01

	イギリス	99,180,995	0.13
	オーストラリア	211,850,836	0.27
	香港	32,137,854	0.04
	シンガポール	29,884,817	0.04
	小計	1,696,776,972	2.17
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	1,687,925,971	2.15
合計（純資産総額）		78,359,189,004	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,121,098,855	1.43
	買建	ドイツ	482,647,203	0.62

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	995,508,620	1.27

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
アメリカ	株式	APPLE COMPUTER INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	22,426	53,493.49	1,199,645,052	64,592.73	1,448,556,581	1.85
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	108,901	8,943.03	973,904,932	10,295.10	1,121,147,578	1.43
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	197,474	3,632.31	717,287,140	4,100.96	809,833,844	1.03
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	70,201	9,361.86	657,212,594	10,243.26	719,087,208	0.92
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	252,103	2,630.96	663,273,111	2,718.38	685,313,871	0.87
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	80,523	7,424.84	597,871,076	7,923.23	638,002,773	0.81
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	124,700	4,357.14	543,336,306	5,110.44	637,272,891	0.81
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	47,911	12,259.17	587,349,544	12,435.05	595,775,738	0.76
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	67,719	8,132.80	550,745,084	8,173.46	553,498,809	0.71
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	93,650	5,364.59	502,394,621	5,664.49	530,479,975	0.68
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテ	17,498	28,170.24	492,923,017	30,050.53	525,824,191	0.67

			クノロジ ー・ライ フサイエ ンス						
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・ バイオテ クノロジ ー・ライ フサイエ ンス	57,423	7,968.54	457,577,730	9,152.21	525,547,699	0.67
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信 サービス	102,917	5,130.78	528,044,506	5,054.53	520,197,599	0.66
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	465,741	1,156.47	538,618,288	1,067.86	497,350,621	0.63
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・ バイオテ クノロジ ー・ライ フサイエ ンス	161,250	3,111.81	501,779,782	3,009.13	485,223,180	0.62
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウ ェア・サ ービス	25,692	17,978.57	461,905,446	18,681.04	479,953,321	0.61
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信 サービス	131,186	3,577.41	469,306,816	3,597.74	471,974,090	0.60
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・ バイオテ クノロジ ー・ライ フサイエ ンス	72,783	4,731.25	344,355,034	5,865.78	426,929,211	0.54
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	265,629	1,449.67	385,074,818	1,540.14	409,108,239	0.52
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲 料・タバ コ	98,952	3,967.78	392,620,737	4,133.49	409,017,657	0.52
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウ ェア・サ ービス	6,900	51,768.74	357,204,312	58,003.12	400,221,594	0.51
イギリス	株式	BP PLC	エネルギ ー	464,358	767.01	356,169,876	859.87	399,289,332	0.51
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウ ェア・サ ービス	6,900	51,609.31	356,104,260	56,937.73	392,870,356	0.50
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウ ェア・サ ービス	90,413	3,397.47	307,176,106	4,290.05	387,876,471	0.49
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギ ー	95,648	3,620.79	346,321,350	4,012.80	383,816,452	0.49
フランス	株式	TOTAL SA	エネルギ ー	53,147	6,165.36	327,670,819	7,154.42	380,236,364	0.49
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	75,507	5,089.09	384,262,644	4,806.48	362,923,248	0.46
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	27,790	11,897.26	330,625,128	13,023.66	361,927,584	0.46
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲 料・タバ コ	39,878	9,007.07	359,184,176	8,983.69	358,251,757	0.46
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	41,553	7,040.97	292,573,493	8,542.48	354,966,079	0.45

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	10.42
		素材	5.58
		資本財	7.43

		商業・専門サービス	0.90
		運輸	1.95
		自動車・自動車部品	1.80
		耐久消費財・アパレル	1.55
		消費者サービス	1.68
		メディア	2.95
		小売	2.85
		食品・生活必需品小売り	2.12
		食品・飲料・タバコ	6.12
		家庭用品・パーソナル用品	1.75
		ヘルスケア機器・サービス	2.95
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.87
		銀行	9.58
		各種金融	3.87
		保険	4.08
		不動産	0.57
		ソフトウェア・サービス	6.50
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.11
		電気通信サービス	3.28
		公益事業	3.28
		半導体・半導体製造装置	1.50
投資証券	—	—	2.17
合計			97.85

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等 (円)	評価額 (各通貨)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500 1406	買建	23	米ドル	10,637,650	1,081,423,498	11,027,925	1,121,098,855	1.43
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1406	買建	115	ユーロ	3,310,910	457,998,180	3,489,100	482,647,203	0.62

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	7,650,000.00	779,646,675	777,337,000	0.99
	ユーロ	買建	1,578,000.00	222,780,478	218,171,620	0.28

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド

以下の運用状況は2014年5月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	928,143,706	52.36
	カナダ	70,611,761	3.98
	ドイツ	67,184,406	3.79
	イタリア	16,643,849	0.94
	フランス	70,173,862	3.96
	オランダ	22,438,723	1.27
	スペイン	24,716,829	1.39
	ベルギー	8,329,050	0.47
	オーストリア	1,153,641	0.07
	ルクセンブルク	3,040,198	0.17
	フィンランド	7,492,448	0.42
	アイルランド	15,888,935	0.90
	イギリス	147,134,286	8.30
	スイス	80,459,729	4.54
	スウェーデン	20,823,224	1.17
	ノルウェー	8,145,631	0.46
	デンマーク	8,842,112	0.50
	ケイマン	1,465,698	0.08
	オーストラリア	55,513,523	3.13
	バミューダ	2,025,083	0.11
	香港	18,198,571	1.03
	シンガポール	9,551,953	0.54
イスラエル	2,805,926	0.16	
ジャージー	9,814,146	0.55	
	小計	1,600,597,290	90.30
投資証券	アメリカ	25,970,833	1.47
	フランス	1,713,784	0.10
	イギリス	3,126,821	0.18
	オーストラリア	3,401,849	0.19
	香港	1,350,330	0.08
	小計	35,563,617	2.01
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	136,447,373	7.70
合計（純資産総額）		1,772,608,280	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	87,738,171	4.95
	買建	ドイツ	37,772,389	2.13

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建	—	1,694,712,320	△95.61

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE COMPUTER INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	482	53,570.09	25,820,788	64,592.73	31,133,696	1.76
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	2,338	9,016.16	21,079,789	10,295.10	24,069,963	1.36
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4,227	3,636.72	15,372,447	4,100.96	17,334,777	0.98
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,509	9,374.84	14,146,645	10,243.26	15,457,082	0.87
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	5,444	2,639.13	14,367,467	2,718.38	14,798,906	0.83
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	2,708	4,370.99	11,836,662	5,110.44	13,839,094	0.78
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	1,730	7,431.74	12,856,922	7,923.23	13,707,199	0.77
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	1,036	12,285.79	12,728,080	12,435.05	12,882,713	0.73
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	1,471	8,141.67	11,976,411	8,173.46	12,023,166	0.68
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	2,022	5,394.95	10,908,591	5,664.49	11,453,609	0.65
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	379	28,208.43	10,690,998	30,050.53	11,389,151	0.64
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,242	7,981.31	9,912,789	9,152.21	11,367,052	0.64
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	2,245	5,128.65	11,513,827	5,054.53	11,347,432	0.64
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	10,045	1,156.49	11,616,991	1,067.86	10,726,749	0.61

アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3,564	3,112.77	11,093,922	3,009.13	10,724,561	0.61
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	561	18,053.37	10,127,943	18,681.04	10,480,064	0.59
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	2,866	3,576.23	10,249,497	3,597.74	10,311,144	0.58
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	5,805	1,463.32	8,494,614	1,540.14	8,940,565	0.50
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,488	4,731.25	7,040,110	5,865.78	8,728,284	0.49
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	2,029	3,967.79	8,050,646	4,133.49	8,386,863	0.47
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	2,083	3,626.65	7,554,317	4,012.80	8,358,665	0.47
フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	1,168	6,160.34	7,195,282	7,154.42	8,356,371	0.47
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	144	51,943.47	7,479,860	58,003.13	8,352,451	0.47
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	1,938	3,447.29	6,680,851	4,290.05	8,314,121	0.47
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	9,584	767.01	7,351,079	859.87	8,241,031	0.46
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	144	51,783.50	7,456,824	56,937.73	8,199,034	0.46
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	927	7,108.90	6,589,953	8,542.48	7,918,888	0.45
アメリカ	株式	SCHLUMBERGER LTD	エネルギー	725	9,391.70	6,808,983	10,558.40	7,654,845	0.43
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	843	8,474.93	7,144,374	8,918.63	7,518,407	0.42
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	2,721	2,475.81	6,736,705	2,740.75	7,457,591	0.42

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	9.91
		素材	5.27
		資本財	7.11
		商業・専門サービス	0.70
		運輸	1.81
		自動車・自動車部品	1.68
		耐久消費財・アパレル	1.20
		消費者サービス	1.71
		メディア	3.00
		小売	2.78

		食品・生活必需品小売り	1.90
		食品・飲料・タバコ	5.58
		家庭用品・パーソナル用品	1.57
		ヘルスケア機器・サービス	2.97
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.48
		銀行	9.06
		各種金融	3.60
		保険	3.86
		不動産	0.52
		ソフトウェア・サービス	6.28
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.89
		電気通信サービス	2.94
		公益事業	3.00
		半導体・半導体製造装置	1.48
投資証券	—	—	2.01
合計			92.30

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等 (円)	評価額 (各通貨)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI1406	買建	9	米ドル	825,277.5	83,897,710	863,055	87,738,171	4.95
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1406	買建	9	ユーロ	251,040	34,726,362	273,060	37,772,389	2.13

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	9,989,000.00	1,017,357,509	1,015,190,490	△57.27
	加ドル	売建	773,000.00	71,869,461	72,360,690	△4.08
	ユーロ	売建	1,740,000.00	244,426,701	240,557,210	△13.57
	英ポンド	売建	939,000.00	160,360,040	159,546,790	△9.00
	スイスフラン	売建	645,000.00	74,897,206	73,061,340	△4.12
	スウェーデンクローナ	売建	1,400,000.00	22,025,868	21,397,370	△1.21
	ノルウェークローネ	売建	507,000.00	8,675,346	8,622,520	△0.49
	デンマーククローネ	売建	506,000.00	9,534,136	9,376,180	△0.53
	豪ドル	売建	631,000.00	59,486,349	59,514,930	△3.36

	香港ドル	売建	1,684,000.00	22,292,700	22,077,010	△1.25
	シンガポールドル	売建	119,000.00	9,702,107	9,646,330	△0.54
	イスラエルシェケル	売建	115,000.00	3,379,671	3,361,460	△0.19

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2014年5月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	26,758,044,066	79.19
地方債証券	日本	2,316,705,000	6.86
特殊債券	日本	2,389,928,000	7.07
社債券	日本	1,978,037,720	5.85
	オーストラリア	203,737,000	0.60
	小計	2,181,774,720	6.46
コール・ローン等、その他資産 (負債控除後)	—	143,397,781	0.42
合計 (純資産総額)		33,789,849,567	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第299回利付国債 (10年)	750,000,000	105.80	793,537,500	105.39	790,492,500	1.300	2019/3/20	2.34
日本	国債証券	第305回利付国債 (10年)	673,000,000	106.22	714,860,600	106.03	713,615,550	1.300	2019/12/20	2.11
日本	国債証券	第303回利付国債 (10年)	581,000,000	106.70	619,961,860	106.34	617,876,070	1.400	2019/9/20	1.83
日本	国債証券	第60回利付国債 (20年)	545,000,000	107.49	585,820,500	107.81	587,613,550	1.400	2022/12/20	1.74
日本	国債証券	第284回利付国債 (10年)	462,000,000	104.90	484,679,580	104.09	480,905,040	1.700	2016/12/20	1.42
日本	国債証券	第93回利付国債 (5年)	445,000,000	100.84	448,751,350	100.64	447,888,050	0.500	2015/12/20	1.33
日本	国債証券	第290回利付国債 (10年)	406,000,000	105.30	427,554,540	104.81	425,548,900	1.400	2018/3/20	1.26
日本	国債証券	第313回利付国債 (10年)	380,000,000	106.41	404,358,000	106.72	405,570,200	1.300	2021/3/20	1.20
日本	国債証券	第330回利付国債 (2年)	380,000,000	100.15	380,577,600	100.13	380,505,400	0.200	2015/7/15	1.13
日本	国債証券	第88回利付国債 (20年)	300,000,000	117.82	353,475,000	117.77	353,325,000	2.300	2026/6/20	1.05
日本	国債証券	第97回利付国債 (5年)	350,000,000	100.73	352,576,000	100.64	352,250,500	0.400	2016/6/20	1.04
日本	国債証券	第292回利付国債 (10年)	331,000,000	106.52	352,606,140	105.94	350,687,880	1.700	2018/3/20	1.04
日本	国債証券	第106回利付国債 (5年)	340,000,000	100.13	340,459,000	100.29	341,003,000	0.200	2017/9/20	1.01
日本	国債証券	第36回利付国債 (30年)	310,000,000	108.44	336,173,300	107.59	333,535,200	2.000	2042/3/20	0.99

日本	国債証券	第29回利付国債 (30年)	276,000,000	116.41	321,308,160	115.82	319,663,200	2.400	2038/9/20	0.95
日本	国債証券	第91回利付国債 (20年)	260,000,000	117.80	306,287,800	117.85	306,412,600	2.300	2026/9/20	0.91
日本	国債証券	第291回利付国債 (10年)	287,000,000	104.87	300,988,380	104.43	299,734,190	1.300	2018/3/20	0.89
日本	国債証券	第140回利付国債 (20年)	280,000,000	104.17	291,676,000	106.22	297,432,800	1.700	2032/9/20	0.88
日本	国債証券	第99回利付国債 (5年)	290,000,000	100.78	292,263,600	100.71	292,061,900	0.400	2016/9/20	0.86
日本	国債証券	第102回利付国債 (5年)	280,000,000	100.51	281,442,000	100.52	281,458,800	0.300	2016/12/20	0.83
日本	国債証券	第325回利付国債 (10年)	270,000,000	102.16	275,837,400	102.88	277,781,400	0.800	2022/9/20	0.82
日本	国債証券	第328回利付国債 (10年)	275,000,000	100.13	275,365,750	100.92	277,549,250	0.600	2023/3/20	0.82
日本	国債証券	第285回利付国債 (10年)	261,000,000	105.25	274,720,770	104.47	272,674,530	1.700	2017/3/20	0.81
日本	国債証券	第50回利付国債 (20年)	237,000,000	110.80	262,617,330	110.77	262,532,010	1.900	2021/3/22	0.78
日本	国債証券	第330回利付国債 (10年)	240,000,000	101.87	244,496,400	102.43	245,851,200	0.800	2023/9/20	0.73
日本	国債証券	第14回利付国債 (30年)	208,000,000	115.40	240,036,160	116.49	242,303,360	2.400	2034/3/20	0.72
日本	国債証券	第301回利付国債 (10年)	223,000,000	107.09	238,828,540	106.60	237,720,230	1.500	2019/6/20	0.70
日本	国債証券	第298回利付国債 (10年)	221,000,000	105.59	233,367,160	105.14	232,374,870	1.300	2018/12/20	0.69
日本	国債証券	第321回利付国債 (10年)	215,000,000	104.02	223,651,600	104.57	224,834,100	1.000	2022/3/20	0.67
日本	国債証券	第95回利付国債 (5年)	220,000,000	101.16	222,565,200	100.93	222,048,200	0.600	2016/3/20	0.66

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	79.19
地方債証券	6.86
特殊債券	7.07
社債券	6.46
合計	99.58

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2014年5月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	78,680,804,155	38.04
	カナダ	4,807,618,769	2.32
	メキシコ	2,265,596,715	1.10
	ドイツ	17,685,724,212	8.55
	イタリア	21,359,057,389	10.33
	フランス	21,438,069,675	10.37
	オランダ	5,656,133,539	2.73
	スペイン	11,595,378,950	5.61
	ベルギー	5,704,746,572	2.76
	オーストリア	3,610,472,291	1.75
	フィンランド	1,424,782,761	0.69
	アイルランド	1,758,582,517	0.85
	イギリス	16,230,785,444	7.85
	スイス	827,438,808	0.40
	スウェーデン	1,166,176,973	0.56
	ノルウェー	757,482,128	0.37
	デンマーク	1,683,151,850	0.81
	ポーランド	1,368,988,725	0.66
	オーストラリア	3,356,828,520	1.62
	シンガポール	768,117,965	0.37
マレーシア	1,078,695,535	0.52	
南アフリカ	1,051,520,636	0.51	
	小計	204,276,154,129	98.77
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	2,546,404,844	1.23
合計（純資産総額）		206,822,558,973	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	26,000,000	10,512.27	2,733,192,638	10,390.76	2,701,598,616	2.500	2015/4/30	1.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	23,100,000	10,775.16	2,489,063,295	10,557.54	2,438,794,013	4.125	2015/5/15	1.18

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	22,200,000	11,034.08	2,449,566,002	10,804.55	2,398,610,516	4.500	2015/11/15	1.16
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	22,200,000	10,889.53	2,417,476,388	10,671.91	2,369,165,650	4.250	2015/8/15	1.15
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	18,200,000	11,373.72	2,070,017,186	11,115.88	2,023,091,184	5.125	2016/5/15	0.98
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	17,700,000	11,125.67	1,969,243,661	10,903.03	1,929,837,195	4.500	2016/2/15	0.93
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	16,300,000	11,367.65	1,852,927,433	11,243.75	1,832,732,039	3.625	2020/2/15	0.89
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	15,900,000	11,333.05	1,801,956,031	11,254.07	1,789,398,670	3.625	2021/2/15	0.87
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,000,000	14,625.53	1,755,064,593	14,361.06	1,723,327,612	8.000	2021/11/15	0.83
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	15,200,000	11,382.74	1,730,176,955	11,242.16	1,708,809,294	3.750	2018/11/15	0.83
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,800,000	11,219.92	1,548,350,103	11,104.76	1,532,457,786	3.375	2019/11/15	0.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	14,300,000	10,553.51	1,509,153,201	10,470.18	1,497,236,566	2.125	2015/12/31	0.72
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,600,000	11,501.81	1,449,228,363	11,328.73	1,427,420,768	4.000	2018/8/15	0.69
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,450,000	15,820.80	1,336,857,778	16,175.91	1,366,864,782	3.250	2021/7/4	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,000,000	10,872.53	1,304,704,440	10,793.43	1,295,211,937	2.750	2018/2/28	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,700,000	11,194.79	1,309,791,506	11,057.90	1,293,775,195	3.500	2018/2/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,500,000	10,896.93	1,253,147,571	10,753.72	1,236,678,016	3.250	2016/5/31	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	13,910.74	1,251,966,727	13,523.16	1,217,084,639	8.125	2019/8/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,500,000	10,181.71	1,170,896,877	10,211.27	1,174,296,103	1.500	2018/12/31	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,700,000	12,273.85	1,190,564,086	11,903.75	1,154,663,811	7.500	2016/11/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,950,000	14,724.02	1,170,559,702	14,332.47	1,139,431,489	8.750	2020/8/15	0.55
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,410,000	19,351.80	1,046,932,819	20,835.35	1,127,192,454	9.000	2023/11/1	0.55
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,200,000	15,169.26	1,092,187,282	15,568.95	1,120,964,614	5.250	2017/8/1	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,000,000	11,264.30	1,126,430,404	11,177.83	1,117,783,469	3.500	2020/5/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,800,000	11,476.39	1,124,686,946	11,300.93	1,107,491,982	4.250	2017/11/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,100,000	10,878.63	1,098,742,297	10,782.31	1,089,013,689	2.750	2017/12/31	0.53
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,400,000	14,481.76	1,071,650,810	14,680.34	1,086,345,600	3.750	2016/8/1	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,000,000	10,910.97	1,091,097,719	10,768.81	1,076,881,203	3.250	2016/6/30	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,000,000	10,820.22	1,082,022,276	10,747.36	1,074,736,812	3.000	2016/8/31	0.52
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	7,300,000	14,798.54	1,080,293,668	14,643.24	1,068,957,249	3.250	2016/4/25	0.52

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.77
合計	98.77

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

以下の運用状況は2014年5月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	11,087,759,361	37.20
	カナダ	692,636,992	2.32
	メキシコ	300,143,599	1.01
	ドイツ	2,461,507,486	8.26
	イタリア	2,969,003,276	9.96
	フランス	2,961,239,565	9.94
	オランダ	801,144,844	2.69
	スペイン	1,644,837,447	5.52
	ベルギー	794,461,876	2.67
	オーストリア	509,858,087	1.71
	フィンランド	187,871,489	0.63
	アイルランド	254,195,129	0.85
	イギリス	2,316,138,928	7.77
	スイス	137,594,034	0.46
	スウェーデン	167,331,408	0.56
	ノルウェー	112,144,076	0.38
	デンマーク	227,683,089	0.76
	ポーランド	221,794,645	0.74
	オーストラリア	469,283,647	1.57
	シンガポール	119,796,712	0.40
マレーシア	178,945,730	0.60	
南アフリカ	143,757,787	0.48	
	小計	28,759,129,207	96.49
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	1,045,496,795	3.51
合計（純資産総額）		29,804,626,002	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	—	29,157,217,770	△97.83

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,000,000	10,435.24	313,057,204	10,397.91	311,937,356	1.500	2016/6/30	1.05
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,950,000	10,466.21	308,753,332	10,370.90	305,941,798	2.125	2015/5/31	1.03
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,740,000	14,502.80	252,348,867	14,680.34	255,438,019	3.750	2016/8/1	0.86
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,500,000	10,155.59	253,889,891	10,171.55	254,288,988	0.375	2016/4/30	0.85
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,450,000	10,383.61	254,398,591	10,343.90	253,425,673	1.375	2015/11/30	0.85
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,580,000	14,050.52	221,998,343	15,067.71	238,069,972	3.750	2021/8/1	0.80
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,150,000	11,074.58	238,103,605	10,962.60	235,695,930	3.125	2019/5/15	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,150,000	10,913.51	234,640,559	10,920.50	234,790,918	3.125	2021/5/15	0.79
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,500,000	15,291.46	229,371,966	15,233.24	228,498,661	3.750	2017/4/25	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,200,000	10,075.52	221,661,497	10,087.37	221,922,191	1.000	2018/5/31	0.74
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,400,000	15,683.22	219,565,125	15,763.08	220,683,155	4.000	2018/4/25	0.74
イギリス	国債証券	UK TREASURY	1,110,000	19,669.83	218,335,133	19,251.50	213,691,674	5.000	2018/3/7	0.72
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,250,000	16,181.84	202,273,043	17,023.40	212,792,537	4.250	2023/10/25	0.71
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,340,000	15,664.63	209,906,045	15,432.79	206,799,431	5.000	2016/10/25	0.69
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,320,000	15,763.83	208,082,603	15,599.31	205,910,993	4.250	2017/7/4	0.69
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000	16,705.35	183,758,901	18,420.64	202,627,098	6.500	2027/11/1	0.68
イギリス	国債証券	UK TREASURY	1,110,000	18,587.83	206,324,965	18,225.32	202,301,129	4.000	2016/9/7	0.68
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,400,000	14,250.75	199,510,593	14,395.00	201,530,042	3.150	2016/1/31	0.68
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,340,000	15,212.09	203,842,032	14,966.53	200,551,538	4.000	2016/7/4	0.67
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,200,000	14,708.53	176,502,441	16,134.02	193,608,306	4.800	2024/1/31	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,800,000	10,865.70	195,582,720	10,747.36	193,452,626	3.000	2016/8/31	0.65
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,200,000	16,133.63	193,603,625	16,102.95	193,235,462	4.250	2018/7/4	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,850,000	10,165.47	188,061,247	10,180.29	188,335,474	0.250	2015/7/15	0.63
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,200,000	14,838.65	178,063,909	15,520.54	186,246,516	4.500	2018/8/1	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,750,000	10,525.78	184,201,168	10,482.89	183,450,632	1.875	2017/9/30	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	11,088.23	177,411,700	11,254.07	180,065,275	3.625	2021/2/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	10,426.50	177,250,563	10,358.20	176,089,415	1.750	2015/7/31	0.59
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,050,000	15,405.81	161,761,027	16,693.62	175,283,099	5.500	2022/9/1	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	10,243.26	174,135,447	10,248.59	174,226,179	1.000	2017/3/31	0.58
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,050,000	16,101.64	169,067,316	16,265.05	170,783,114	4.250	2019/4/25	0.57

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.49
合計	96.49

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	109,694,000.00	11,282,370,223	11,147,024,300	△37.40
	加ドル	売建	7,494,000.00	698,944,987	702,104,820	△2.36
	メキシコペソ	売建	39,130,000.00	305,608,783	308,303,920	△1.03
	ユーロ	売建	92,399,000.00	13,198,144,202	12,778,088,480	△42.87
	英ポンド	売建	13,811,000.00	2,359,565,992	2,347,215,810	△7.88
	スイスフラン	売建	1,283,000.00	149,053,762	145,326,230	△0.49
	スウェーデンクローナ	売建	11,124,000.00	175,588,097	170,016,340	△0.57
	ノルウェークローネ	売建	6,838,000.00	117,412,261	116,360,810	△0.39
	デンマーククローネ	売建	12,510,000.00	237,159,451	231,810,300	△0.78
	ポーランドズロチ	売建	6,853,000.00	230,526,289	228,449,650	△0.77
	豪ドル	売建	5,031,000.00	471,289,337	475,450,900	△1.60
	シンガポールドル	売建	1,500,000.00	122,492,010	121,594,430	△0.41
	マレーシアリングgit	売建	7,540,000.00	235,692,427	238,490,200	△0.80
	南アフリカランド	売建	15,171,000.00	146,187,153	146,981,580	△0.49

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

基準価額・純資産の推移



基準価額..... 11,328円

純資産総額..... 1.55億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金込基準価額は、2004年5月末の基準価額を起点として指数化しています。

※分配金込基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2009年10月	2010年10月	2011年10月	2012年10月	2013年10月	設定来累計
0円	0円	0円	0円	10円	30円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	60.42%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	9.97%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	9.97%
日本債券インデックスマザーファンド	4.93%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	4.94%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	4.95%
現金その他	4.83%

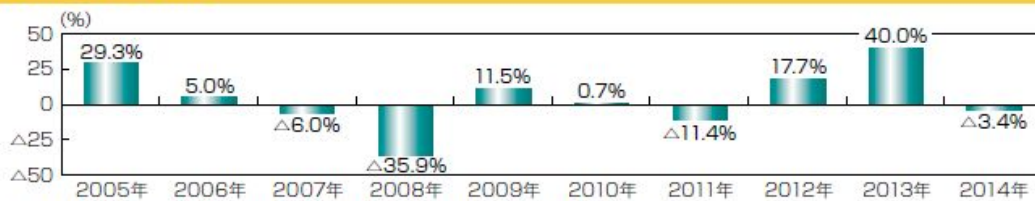
※当ファンドの対純資産総額比です。

<組入上位銘柄>

組入資産	銘柄	通貨	業種・種類	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	1 トヨタ自動車	日本円	輸送用機器	4.62%
	2 三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本円	銀行業	2.47%
	3 ソフトバンク	日本円	情報・通信業	2.05%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	1 APPLE COMPUTER INC	アメリカドル	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.85%
	2 EXXON MOBIL CORP	アメリカドル	エネルギー	1.43%
	3 MICROSOFT CORP	アメリカドル	ソフトウェア・サービス	1.03%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	1 APPLE COMPUTER INC	アメリカドル	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.76%
	2 EXXON MOBIL CORP	アメリカドル	エネルギー	1.36%
	3 MICROSOFT CORP	アメリカドル	ソフトウェア・サービス	0.98%
日本債券インデックスマザーファンド	1 第299回利付国債(10年)	日本円	国債証券	2.34%
	2 第305回利付国債(10年)	日本円	国債証券	2.11%
	3 第303回利付国債(10年)	日本円	国債証券	1.83%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	1 US TREASURY N/B(クーポン2.500%)	アメリカドル	国債証券	1.31%
	2 US TREASURY N/B(クーポン4.125%)	アメリカドル	国債証券	1.18%
	3 US TREASURY N/B(クーポン4.500%)	アメリカドル	国債証券	1.16%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	1 US TREASURY N/B(クーポン1.500%)	アメリカドル	国債証券	1.05%
	2 US TREASURY N/B(クーポン2.125%)	アメリカドル	国債証券	1.03%
	3 BUONI POLIENALI DEL TES(クーポン3.750%)	ユーロ	国債証券	0.86%

※各マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



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

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2014年は、2014年5月末までの騰落率です。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- (1) 申込方法
販売会社所定の方法でお申し込みください。
- (2) 申込みの受付
販売会社の営業日に受け付けます。
- (3) 取扱時間
原則として、午後3時まで、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
- (4) 申込金額
取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。
- (5) 申込単位
販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

＜委託会社の照会先＞

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

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

2【換金（解約）手続等】

＜解約請求による換金＞

- (1) 解約の受付
販売会社の営業日に受け付けます。
- (2) 取扱時間
原則として、午後3時まで、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
- (3) 解約制限
ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(4) 解約価額

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

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(5) 手取額

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

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

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(6) 解約単位

1口単位

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

(7) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(8) 受付の中止および取消

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

・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

3 【資産管理等の概要】

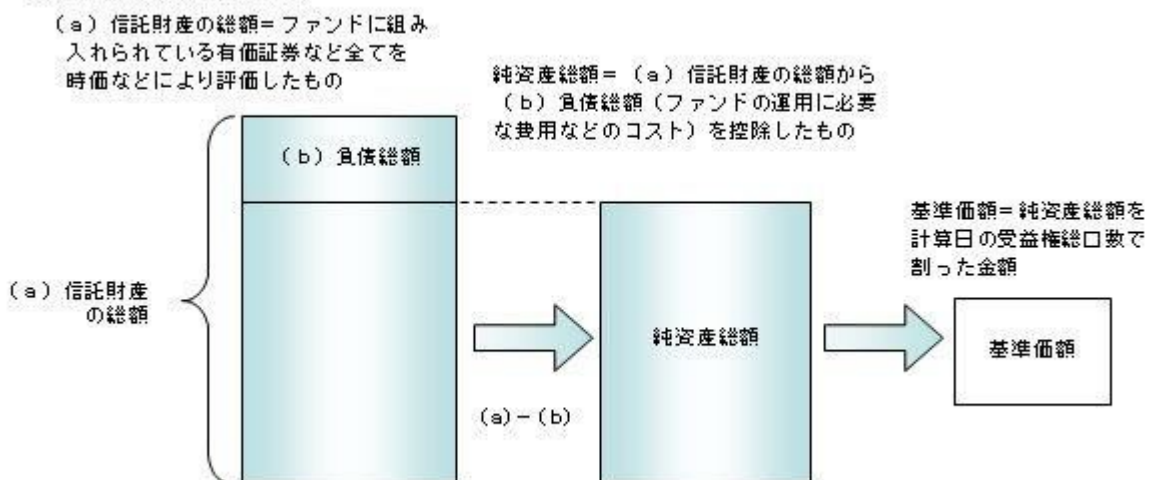
(1) 【資産の評価】

① 基準価額の算出

・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。

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

<基準価額算出の流れ>



② 有価証券などの評価基準

・信託財産に属する資産については、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価します。

<主な資産の評価方法>

◇マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

◇国内上場株式

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

◇外国株式

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

◇公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日*における以下のいずれかの価額で評価します。

- ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
- ・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）
- ・価格情報会社の提供する価額

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

*外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

③ 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします（平成11年10月29日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年10月27日から翌年10月26日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5) 【その他】

① 信託の終了（繰上償還）

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

イ) 受益者の解約により受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合

ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ハ) やむを得ない事情が発生したとき

- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。

- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内（1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。）に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）

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

イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合

ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託

約款の変更が成立の場合を除きます。)

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

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

② 償還金について

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

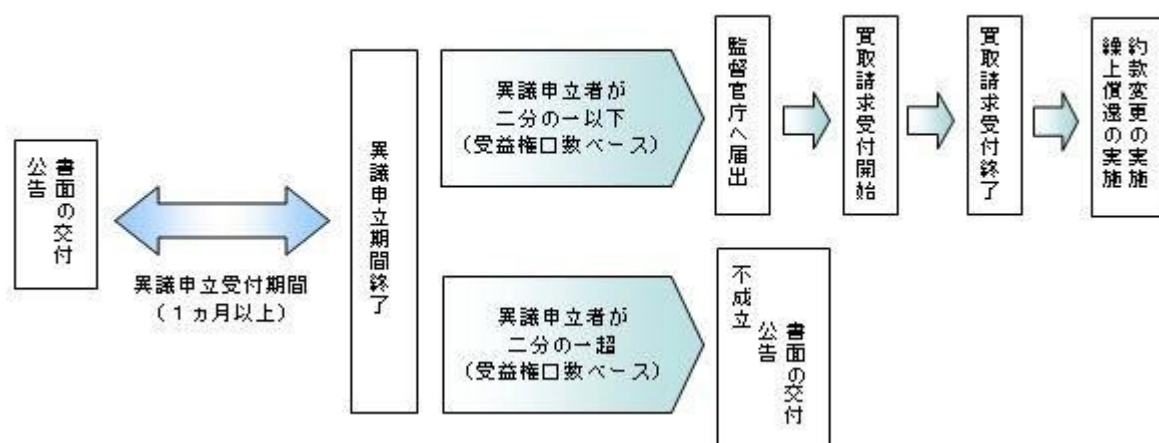
③ 信託約款の変更

- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。
- 3) この信託約款の変更に関する異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
- 4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

④ 異議の申立て

- 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えると、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。
- 2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行わない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。
- 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べ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できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



⑤ 公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

⑥ 運用報告書の作成

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

⑦ 関係法人との契約について

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

4 【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

- (1) 収益分配金・償還金受領権

- ・受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を、自己に帰属する受益権の口数に応じて受領する権利を有します。
 - ・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から5年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。
- (2) 解約請求権
受益者は、自己に帰属する受益権につき販売会社を通じて、委託会社に解約の請求をすることができます。
- (3) 帳簿閲覧権
受益者は、委託会社に対し、その営業時間内にファンドの信託財産に関する帳簿書類の閲覧を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 38 年大蔵省令第 59 号）並びに同規則第 2 条の 2 の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 14 期計算期間（平成 24 年 10 月 27 日から平成 25 年 10 月 28 日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成25年11月27日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指 定 社 員 公認会計士 佐々木 貴 司
業務執行社員

指 定 社 員 公認会計士 鶴 田 光 夫
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）の平成24年10月27日から平成25年10月28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、アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）の平成25年10月28日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

1 【財務諸表】

【アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第13期 平成24年10月26日現在	第14期 平成25年10月28日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	9,686,776	10,820,062
親投資信託受益証券	176,657,990	188,989,358
未収入金	-	4,306,774
未収利息	18	18
流動資産合計	186,344,784	204,116,212
資産合計	186,344,784	204,116,212
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	-	181,289
未払解約金	-	4,362,030
未払受託者報酬	49,756	53,959
未払委託者報酬	707,398	767,095
その他未払費用	4,826	5,237
流動負債合計	761,980	5,369,610
負債合計	761,980	5,369,610
純資産の部		
元本等		
元本	246,845,047	181,289,228
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△61,262,243	17,457,374
（分配準備積立金）	20,623,192	30,098,302
元本等合計	185,582,804	198,746,602
純資産合計	185,582,804	198,746,602
負債純資産合計	186,344,784	204,116,212

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第13期		第14期	
	自	平成23年10月27日 至 平成24年10月26日	自	平成24年10月27日 至 平成25年10月28日
営業収益				
受取利息		6,362		6,275
有価証券売買等損益		9,994,323		79,863,998
営業収益合計		10,000,685		79,870,273
営業費用				
受託者報酬		100,226		107,769
委託者報酬		1,424,868		1,532,040
その他費用		9,710		10,459
営業費用合計		1,534,804		1,650,268
営業利益又は営業損失(△)		8,465,881		78,220,005
経常利益又は経常損失(△)		8,465,881		78,220,005
当期純利益又は当期純損失(△)		8,465,881		78,220,005
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額(△)		918,206		18,364,007
期首剰余金又は期首欠損金(△)		△72,196,046		△61,262,243
剰余金増加額又は欠損金減少額		8,521,185		19,577,775
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		8,521,185		19,577,775
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		5,135,057		532,867
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		5,135,057		532,867
分配金		-		181,289
期末剰余金又は期末欠損金(△)		△61,262,243		17,457,374

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年10月27日から翌年10月26日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は平成24年10月27日から平成25年10月28日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第13期 平成24年10月26日現在	第14期 平成25年10月28日現在
1. 期首元本額	257,055,455円	246,845,047円
期中追加設定元本額	20,084,711円	14,612,172円
期中一部解約元本額	30,295,119円	80,167,991円
2. 受益権の総数	246,845,047口	181,289,228口
3. 元本の欠損		
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	61,262,243円	-円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第13期 自平成23年10月27日 至平成24年10月26日		第14期 自平成24年10月27日 至平成25年10月28日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 計算期末における費用控除後の配当等収益	5,288円	A 計算期末における費用控除後の配当等収益	5,170円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	16,087,056円
C 信託約款に定める収益調整金	32,198,924円	C 信託約款に定める収益調整金	24,660,636円
D 信託約款に定める分配準備積立金	20,617,904円	D 信託約款に定める分配準備積立金	14,187,365円
E 分配対象収益(A+B+C+D)	52,822,116円	E 分配対象収益(A+B+C+D)	54,940,227円
F 分配対象収益(1万口当たり)	2,139円	F 分配対象収益(1万口当たり)	3,030円
G 分配金額	0円	G 分配金額	181,289円
H 分配金額(1万口当たり)	0円	H 分配金額(1万口当たり)	10円

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

	第13期 自平成23年10月27日 至平成24年10月26日	第14期 自平成24年10月27日 至平成25年10月28日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

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

II 金融商品の時価等に関する事項

	第13期 平成24年10月26日現在	第14期 平成25年10月28日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第13期（平成24年10月26日現在）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	8,574,547
合計	8,574,547

第14期（平成25年10月28日現在）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	58,976,399
合計	58,976,399

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第13期 平成24年10月26日現在	第14期 平成25年10月28日現在
1口当たり純資産額	0.7518円	1.0963円
(1万口当たり純資産額)	(7,518円)	(10,963円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI (ヘッジなし) マザーファンド	13,478,586	19,778,477	
	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI (ヘッジあり) マザーファンド	18,538,040	19,908,001	
	日本債券インデックスマザーファンド	7,733,131	9,927,020	
	海外債券インデックス (ヘッジなし) マザーファンド	5,145,285	9,900,557	
	海外債券インデックス (ヘッジあり) マザーファンド	7,402,745	9,950,029	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	122,665,512	119,525,274	
合計		174,963,299	188,989,358	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

当ファンドは、「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI (ヘッジなし) マザーファンド」「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI (ヘッジあり) マザーファンド」「日本債券インデックスマザーファンド」「海外債券インデックス (ヘッジなし) マザーファンド」「海外債券インデックス (ヘッジあり) マザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	平成24年10月26日現在	平成25年10月28日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	69,564,544	82,932,319
株式	23,856,717,830	27,515,161,350
派生商品評価勘定	665,282	876,162
未収入金	39,525,306	22,182,500
未収配当金	247,545,320	203,445,922
未収利息	132	139
前払金	-	5,040,000
流動資産合計	24,214,018,414	27,829,638,392
資産合計	24,214,018,414	27,829,638,392
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,477,158	1,712,158
前受金	2,462,000	-
未払解約金	9,694,077	22,587,405
流動負債合計	15,633,235	24,299,563
負債合計	15,633,235	24,299,563
純資産の部		
元本等		
元本	40,986,230,601	28,535,557,496
剰余金		
剰余金又は欠損金(△)	△16,787,845,422	△730,218,667
元本等合計	24,198,385,179	27,805,338,829
純資産合計	24,198,385,179	27,805,338,829
負債純資産合計	24,214,018,414	27,829,638,392

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成 24 年 10 月 26 日現在	平成 25 年 10 月 28 日現在
1.	期首	平成 23 年 10 月 27 日	平成 24 年 10 月 27 日
	期首元本額	43,690,469,568 円	40,986,230,601 円
	期首からの追加設定元本額	2,790,629,343 円	1,271,459,203 円
	期首からの一部解約元本額	5,494,868,310 円	13,722,132,308 円
	元本の内訳 ※		
	DCインデックスバランス（株式20）	228,900,360 円	165,248,170 円
	DCインデックスバランス（株式40）	813,948,519 円	634,585,909 円
	DCインデックスバランス（株式60）	1,495,692,940 円	1,220,047,095 円
	DCインデックスバランス（株式80）	1,627,089,818 円	1,461,068,741 円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	965,266,890 円	1,058,995,323 円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	15,155,628,928 円	9,629,648,475 円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	17,437,461 円	10,879,626 円
	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産）	123,014,080 円	28,627,449 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	188,919,142 円	122,665,512 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	161,781,734 円	90,261,923 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	260,372,111 円	143,937,380 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	332,442,407 円	180,700,510 円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	14,763,797,749 円	9,907,936,510 円
	世界アセットバランスファンド40（適格機関投資家向け）	97,392,097 円	59,733,916 円
	世界アセットバランスファンド25（適格機関投資家向け）	119,169,389 円	74,653,904 円
	3資産バランスファンド（適格機関投資家向け）	44,505,368 円	—円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	76,809,009 円	55,661,438 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	432,717,850 円	310,402,328 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,154,734,144 円	895,072,288 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,483,461,174 円	1,226,663,814 円

0)	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式80)	1,443,149,431 円	1,258,767,185 円
	計	40,986,230,601 円	28,535,557,496 円
2.	受益権の総数	40,986,230,601 口	28,535,557,496 口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	16,787,845,422 円	730,218,667 円
4.	担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。 株式	215,798,500 円	362,072,000 円

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

	自 平成 23 年 10 月 27 日 至 平成 24 年 10 月 26 日	自 平成 24 年 10 月 27 日 至 平成 25 年 10 月 28 日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

	平成 24 年 10 月 26 日現在	平成 25 年 10 月 28 日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれておりま	同左

	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。	
--	---	--

(有価証券に関する注記)

(平成 24 年 10 月 26 日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	△145,603,844
合計	△145,603,844

(平成 25 年 10 月 28 日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	10,131,056,774
合計	10,131,056,774

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成 24 年 10 月 26 日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	336,385,000	—	333,675,000	△2,710,000
合計		336,385,000	—	333,675,000	△2,710,000

(平成 25 年 10 月 28 日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	300,120,000	—	299,375,000	△745,000
合計		300,120,000	—	299,375,000	△745,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成24年10月26日現在		平成25年10月28日現在	
1口当たり純資産額	0.5904円	1口当たり純資産額	0.9744円
(1万口当たり純資産額)	(5,904円)	(1万口当たり純資産額)	(9,744円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	8,000	272.00	2,176,000	
日本水産	20,300	202.00	4,100,600	
マルハニチロホールディングス	36,000	185.00	6,660,000	
サカタのタネ	2,700	1,339.00	3,615,300	
ホクト	1,900	1,873.00	3,558,700	
住石ホールディングス	5,600	149.00	834,400	
日鉄鉱業	5,000	583.00	2,915,000	
三井松島産業	13,000	154.00	2,002,000	
国際石油開発帝石	89,900	1,129.00	101,497,100	
日本海洋掘削	500	6,760.00	3,380,000	
関東天然瓦斯開発	2,000	730.00	1,460,000	
石油資源開発	2,600	4,040.00	10,504,000	
ショーボンドホールディングス	1,700	4,585.00	7,794,500	
ミライト・ホールディングス	5,300	854.00	4,526,200	
タマホーム	800	1,144.00	915,200	
ダイセキ環境ソリューション	200	1,984.00	396,800	
安藤・間	11,200	378.00	4,233,600	
東急建設	6,600	609.00	4,019,400	
コムシスホールディングス	9,000	1,352.00	12,168,000	
ミサワホーム	2,200	1,789.00	3,935,800	
高松コンストラクショングループ	1,400	1,958.00	2,741,200	
東建コーポレーション	690	5,240.00	3,615,600	
ヤマウラ	900	294.00	264,600	

大成建設	94,000	510.00	47,940,000	
大林組	55,000	629.00	34,595,000	
清水建設	57,000	503.00	28,671,000	
飛島建設	12,300	191.00	2,349,300	
長谷工コーポレーション	23,200	736.00	17,075,200	
松井建設	2,000	407.00	814,000	
銭高組	1,000	278.00	278,000	
鹿島建設	81,000	413.00	33,453,000	
不動テトラ	13,400	184.00	2,465,600	
大末建設	8,000	127.00	1,016,000	
鉄建建設	11,000	343.00	3,773,000	
日鉄住金テックスエンジ	3,000	400.00	1,200,000	
西松建設	23,000	347.00	7,981,000	
三井住友建設	38,500	126.00	4,851,000	
大豊建設	5,000	439.00	2,195,000	
前田建設工業	11,000	707.00	7,777,000	
ナカノフドー建設	1,500	244.00	366,000	
奥村組	16,000	454.00	7,264,000	
大和小田急建設	1,000	278.00	278,000	
東鉄工業	2,400	2,182.00	5,236,800	
イチケン	2,000	185.00	370,000	
浅沼組	6,000	150.00	900,000	
戸田建設	22,000	343.00	7,546,000	
熊谷組	14,000	352.00	4,928,000	
青木あすなろ建設	1,000	553.00	553,000	
北野建設	4,000	222.00	888,000	
植木組	3,000	212.00	636,000	
三井ホーム	2,000	484.00	968,000	
矢作建設工業	2,300	575.00	1,322,500	
ピーエス三菱	1,700	495.00	841,500	
大東建託	7,000	9,980.00	69,860,000	
新日本建設	2,300	328.00	754,400	
N I P P O	4,000	1,853.00	7,412,000	
東亜道路工業	3,000	479.00	1,437,000	
前田道路	5,000	1,742.00	8,710,000	

日本道路	5,000	597.00	2,985,000	
東亜建設工業	16,000	234.00	3,744,000	
若築建設	10,000	136.00	1,360,000	
東洋建設	5,900	332.00	1,958,800	
五洋建設	22,000	286.00	6,292,000	
大林道路	2,000	557.00	1,114,000	
福田組	3,000	375.00	1,125,000	
住友林業	12,700	1,147.00	14,566,900	
日本基礎技術	2,300	433.00	995,900	
日成ビルド工業	6,000	199.00	1,194,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	10,000	146.00	1,460,000	
巴コーポレーション	2,600	482.00	1,253,200	
パナホーム	7,000	659.00	4,613,000	
大和ハウス工業	50,000	1,931.00	96,550,000	
ライト工業	4,200	800.00	3,360,000	
積水ハウス	56,000	1,370.00	76,720,000	
日特建設	1,700	427.00	725,900	
北陸電気工事	1,000	405.00	405,000	
ユアテック	3,000	323.00	969,000	
西部電気工業	2,000	443.00	886,000	
四電工	2,000	344.00	688,000	
中電工	2,700	1,459.00	3,939,300	
関電工	8,000	601.00	4,808,000	
きんでん	10,000	1,044.00	10,440,000	
東京エネシス	2,000	531.00	1,062,000	
トーエネック	3,000	605.00	1,815,000	
住友電設	1,300	1,406.00	1,827,800	
日本電設工業	3,000	1,194.00	3,582,000	
協和エクシオ	6,600	1,162.00	7,669,200	
新日本空調	1,300	619.00	804,700	
NDS	3,000	284.00	852,000	
九電工	3,000	622.00	1,866,000	
三機工業	4,000	596.00	2,384,000	
日揮	19,000	3,770.00	71,630,000	
中外炉工業	6,000	256.00	1,536,000	

ヤマト	2,000	354.00	708,000
太平電業	2,000	699.00	1,398,000
高砂熱学工業	5,300	832.00	4,409,600
三晃金属工業	2,000	273.00	546,000
朝日工業社	2,000	354.00	708,000
明星工業	2,000	423.00	846,000
大氣社	2,600	2,426.00	6,307,600
ダイダン	2,000	523.00	1,046,000
日比谷総合設備	2,300	1,191.00	2,739,300
東芝プラントシステム	3,000	1,755.00	5,265,000
東洋エンジニアリング	10,000	429.00	4,290,000
千代田化工建設	13,000	1,230.00	15,990,000
新興プランテック	3,800	789.00	2,998,200
日本製粉	11,000	474.00	5,214,000
日清製粉グループ本社	18,400	1,043.00	19,191,200
日東富士製粉	1,000	308.00	308,000
昭和産業	8,000	299.00	2,392,000
鳥越製粉	1,400	656.00	918,400
協同飼料	7,000	111.00	777,000
中部飼料	1,700	579.00	984,300
日本配合飼料	6,000	123.00	738,000
東洋精糖	3,000	104.00	312,000
日本甜菜製糖	9,000	187.00	1,683,000
三井製糖	7,000	324.00	2,268,000
森永製菓	18,000	209.00	3,762,000
中村屋	4,000	402.00	1,608,000
江崎グリコ	7,000	1,059.00	7,413,000
名糖産業	800	1,049.00	839,200
不二家	10,000	196.00	1,960,000
山崎製パン	13,000	1,048.00	13,624,000
第一屋製パン	3,000	155.00	465,000
モロゾフ	3,000	311.00	933,000
亀田製菓	1,000	2,909.00	2,909,000
カルビー	6,800	2,517.00	17,115,600
森永乳業	16,000	302.00	4,832,000

六甲バター	500	854.00	427,000
ヤクルト本社	10,800	4,975.00	53,730,000
明治ホールディングス	5,500	5,400.00	29,700,000
雪印メグミルク	3,600	1,376.00	4,953,600
プリマハム	10,000	209.00	2,090,000
日本ハム	14,000	1,417.00	19,838,000
伊藤ハム	10,000	410.00	4,100,000
林兼産業	7,000	91.00	637,000
丸大食品	9,000	309.00	2,781,000
米久	800	775.00	620,000
S Foods	1,000	979.00	979,000
サッポロホールディングス	30,000	432.00	12,960,000
アサヒグループホールディングス	37,100	2,677.00	99,316,700
キリンホールディングス	79,000	1,443.00	113,997,000
宝ホールディングス	14,000	900.00	12,600,000
オエノンホールディングス	5,000	257.00	1,285,000
養命酒製造	1,000	810.00	810,000
コカ・コーラウエスト	5,700	1,993.00	11,360,100
コカ・コーライーストジャパン	3,900	1,705.00	6,649,500
サントリー食品インターナショナル	9,500	3,325.00	31,587,500
ダイドードリンコ	900	4,210.00	3,789,000
伊藤園	5,000	2,259.00	11,295,000
キーコーヒー	1,600	1,544.00	2,470,400
ユニカフェ	500	552.00	276,000
ジャパンフーズ	300	1,223.00	366,900
日清オイリオグループ	8,000	334.00	2,672,000
不二製油	4,500	1,747.00	7,861,500
かどや製油	200	2,740.00	548,000
J-オイルミルズ	8,000	307.00	2,456,000
キッコーマン	15,000	1,731.00	25,965,000
味の素	45,000	1,376.00	61,920,000
キュービー	9,400	1,460.00	13,724,000
ハウス食品グループ本社	6,500	1,545.00	10,042,500
カゴメ	6,600	1,719.00	11,345,400
焼津水産化学工業	900	878.00	790,200

アリアケジャパン	1,700	2,333.00	3,966,100
ニチレイ	20,000	512.00	10,240,000
東洋水産	9,000	3,015.00	27,135,000
日清食品ホールディングス	7,200	4,085.00	29,412,000
永谷園	2,000	896.00	1,792,000
フジッコ	2,000	1,198.00	2,396,000
ロック・フィールド	1,000	1,918.00	1,918,000
日本たばこ産業	102,800	3,395.00	349,006,000
ケンコーマヨネーズ	500	894.00	447,000
わらべや日洋	1,100	1,785.00	1,963,500
なとり	800	968.00	774,400
ミヨシ油脂	7,000	157.00	1,099,000
片倉工業	2,000	1,176.00	2,352,000
グンゼ	13,000	265.00	3,445,000
東洋紡	73,000	191.00	13,943,000
ユニチカ	49,000	62.00	3,038,000
富士紡ホールディングス	9,000	204.00	1,836,000
日清紡ホールディングス	11,000	858.00	9,438,000
倉敷紡績	18,000	169.00	3,042,000
シキボウ	11,000	131.00	1,441,000
日本毛織	6,000	762.00	4,572,000
大東紡織	3,000	79.00	237,000
トーア紡コーポレーション	8,000	80.00	640,000
ダイドーリミテッド	1,900	682.00	1,295,800
帝国繊維	2,000	894.00	1,788,000
帝人	66,000	222.00	14,652,000
東レ	134,000	618.00	82,812,000
サカイオーボックス	5,000	150.00	750,000
住江織物	5,000	278.00	1,390,000
日本フェルト	900	442.00	397,800
イチカワ	1,000	311.00	311,000
日本バイリーン	2,000	552.00	1,104,000
日東製網	2,000	132.00	264,000
芦森工業	4,000	135.00	540,000
アツギ	15,000	117.00	1,755,000

ダイニック	3,000	174.00	522,000
セーレン	4,600	635.00	2,921,000
東海染工	3,000	130.00	390,000
小松精練	3,000	510.00	1,530,000
ワコールホールディングス	10,000	1,024.00	10,240,000
ホギメディカル	1,100	5,590.00	6,149,000
レナウン	4,000	133.00	532,000
クラウドディア	200	1,086.00	217,200
T S I ホールディングス	8,900	714.00	6,354,600
三陽商会	9,000	265.00	2,385,000
ナイガイ	8,000	91.00	728,000
オンワードホールディングス	12,000	806.00	9,672,000
ルック	3,000	302.00	906,000
キムラタン	40,000	16.00	640,000
ゴールドウイン	4,000	477.00	1,908,000
デサント	4,000	717.00	2,868,000
キング	500	441.00	220,500
ヤマトインターナショナル	1,000	436.00	436,000
特種東海製紙	10,000	202.00	2,020,000
王子ホールディングス	76,000	455.00	34,580,000
日本製紙	8,400	1,600.00	13,440,000
三菱製紙	25,000	90.00	2,250,000
北越紀州製紙	11,000	460.00	5,060,000
中越パルプ工業	7,000	157.00	1,099,000
巴川製紙所	3,000	178.00	534,000
大王製紙	7,000	698.00	4,886,000
レンゴー	14,000	532.00	7,448,000
トーモク	5,000	316.00	1,580,000
ザ・パック	1,200	1,865.00	2,238,000
クラレ	29,400	1,158.00	34,045,200
旭化成	108,000	722.00	77,976,000
共和レザー	1,000	422.00	422,000
コープケミカル	3,000	142.00	426,000
昭和電工	115,000	135.00	15,525,000
住友化学	119,000	356.00	42,364,000

日本化成	3,000	145.00	435,000	
住友精化	3,000	666.00	1,998,000	
日産化学工業	11,800	1,491.00	17,593,800	
ラサ工業	6,000	221.00	1,326,000	
クレハ	12,000	356.00	4,272,000	
多木化学	1,000	809.00	809,000	
テイカ	3,000	302.00	906,000	
石原産業	32,000	93.00	2,976,000	
片倉チッカリン	1,000	281.00	281,000	
日本曹達	10,000	597.00	5,970,000	
東ソー	46,000	388.00	17,848,000	
トクヤマ	25,000	398.00	9,950,000	
セントラル硝子	15,000	343.00	5,145,000	
東亜合成	20,000	440.00	8,800,000	
ダイソー	7,000	297.00	2,079,000	
関東電化工業	4,000	213.00	852,000	
電気化学工業	35,000	399.00	13,965,000	
信越化学工業	31,000	5,520.00	171,120,000	
日本カーバイド工業	5,000	330.00	1,650,000	
堺化学工業	6,000	326.00	1,956,000	
エア・ウォーター	14,000	1,393.00	19,502,000	
大陽日酸	23,000	668.00	15,364,000	
日本化学工業	7,000	164.00	1,148,000	
日本パーカライジング	4,000	1,906.00	7,624,000	
高圧ガス工業	3,000	540.00	1,620,000	
四国化成工業	2,000	780.00	1,560,000	
戸田工業	2,000	305.00	610,000	
ステラ ケミファ	800	1,724.00	1,379,200	
保土谷化学工業	4,000	201.00	804,000	
日本触媒	13,000	1,197.00	15,561,000	
大日精化工業	6,000	410.00	2,460,000	
カネカ	22,000	624.00	13,728,000	
三菱瓦斯化学	27,000	795.00	21,465,000	
三井化学	74,000	262.00	19,388,000	
J S R	15,800	1,867.00	29,498,600	

東京応化工業	3,300	2,173.00	7,170,900	
大阪有機化学工業	1,100	454.00	499,400	
三菱ケミカルホールディングス	108,000	461.00	49,788,000	
日本合成化学工業	4,000	958.00	3,832,000	
ダイセル	21,000	832.00	17,472,000	
住友ベークライト	14,000	349.00	4,886,000	
積水化学工業	35,000	1,082.00	37,870,000	
日本ゼオン	15,000	1,190.00	17,850,000	
アイカ工業	4,800	1,973.00	9,470,400	
宇部興産	87,000	204.00	17,748,000	
積水樹脂	2,000	1,525.00	3,050,000	
タキロン	4,000	420.00	1,680,000	
旭有機材工業	6,000	220.00	1,320,000	
日立化成	7,500	1,504.00	11,280,000	
ニチバン	2,000	388.00	776,000	
リケンテクノス	3,000	465.00	1,395,000	
大倉工業	4,000	358.00	1,432,000	
積水化成品工業	4,000	276.00	1,104,000	
群栄化学工業	5,000	507.00	2,535,000	
タイガースポリマー	900	426.00	383,400	
ミライアル	400	1,557.00	622,800	
日本化薬	12,000	1,351.00	16,212,000	
カーリットホールディングス	1,400	503.00	704,200	
日本精化	1,500	651.00	976,500	
ADEKA	7,500	1,158.00	8,685,000	
日油	13,000	661.00	8,593,000	
新日本理化	1,500	295.00	442,500	
ハリマ化成グループ	1,500	483.00	724,500	
花王	44,900	3,145.00	141,210,500	
第一工業製薬	3,000	241.00	723,000	
三洋化成工業	5,000	696.00	3,480,000	
大日本塗料	10,000	166.00	1,660,000	
日本ペイント	15,000	1,641.00	24,615,000	
関西ペイント	19,000	1,272.00	24,168,000	
神東塗料	1,000	222.00	222,000	

中国塗料	5,000	596.00	2,980,000
日本特殊塗料	1,300	413.00	536,900
藤倉化成	2,000	528.00	1,056,000
太陽ホールディングス	1,400	2,986.00	4,180,400
D I C	62,000	284.00	17,608,000
サカタインクス	4,000	927.00	3,708,000
東洋インキ S Cホールディングス	16,000	495.00	7,920,000
T & K T O K A	600	2,073.00	1,243,800
富士フイルムホールディングス	36,900	2,298.00	84,796,200
資生堂	30,800	1,731.00	53,314,800
ライオン	20,000	588.00	11,760,000
高砂香料工業	6,000	548.00	3,288,000
マンダム	1,900	3,325.00	6,317,500
ミルボン	900	3,970.00	3,573,000
ファンケル	4,400	1,170.00	5,148,000
コーセー	3,100	2,880.00	8,928,000
ドクターシーラボ	12	316,500.00	3,798,000
シーボン	100	1,992.00	199,200
ポーラ・オルビスホールディングス	1,800	3,420.00	6,156,000
ノエビアホールディングス	1,200	1,613.00	1,935,600
エステー	1,000	1,000.00	1,000,000
コニシ	1,300	1,939.00	2,520,700
長谷川香料	2,200	1,404.00	3,088,800
星光PMC	800	471.00	376,800
小林製薬	2,600	5,400.00	14,040,000
荒川化学工業	1,300	947.00	1,231,100
メック	1,300	402.00	522,600
日本高純度化学	5	219,000.00	1,095,000
J C U	200	4,060.00	812,000
新田ゼラチン	1,100	1,168.00	1,284,800
アース製薬	1,200	3,630.00	4,356,000
イハラケミカル工業	3,000	736.00	2,208,000
北興化学工業	2,000	299.00	598,000
大成ラミック	500	2,443.00	1,221,500
クミアイ化学工業	4,000	726.00	2,904,000

日本農薬	4,000	1,122.00	4,488,000	
アキレス	14,000	169.00	2,366,000	
有沢製作所	2,700	664.00	1,792,800	
日東電工	14,300	5,180.00	74,074,000	
レック	500	1,277.00	638,500	
きもと	1,600	1,147.00	1,835,200	
藤森工業	1,500	2,905.00	4,357,500	
前澤化成工業	1,200	1,045.00	1,254,000	
J S P	1,200	1,556.00	1,867,200	
エフピコ	800	7,530.00	6,024,000	
天馬	1,400	1,289.00	1,804,600	
信越ポリマー	3,400	350.00	1,190,000	
東リ	4,000	208.00	832,000	
ニフコ	3,900	2,583.00	10,073,700	
日本バルカー工業	7,000	273.00	1,911,000	
ユニ・チャーム	9,500	6,430.00	61,085,000	
協和発酵キリン	21,000	1,042.00	21,882,000	
武田薬品工業	64,800	4,650.00	301,320,000	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	37,500	5,390.00	202,125,000	
大日本住友製薬	12,200	1,306.00	15,933,200	
塩野義製薬	25,200	2,090.00	52,668,000	
田辺三菱製薬	14,400	1,406.00	20,246,400	
わかもと製薬	2,000	271.00	542,000	
あすか製薬	2,000	744.00	1,488,000	
日本新薬	4,000	1,687.00	6,748,000	
バイオフェルミン製薬	200	2,647.00	529,400	
中外製薬	17,200	2,183.00	37,547,600	
科研製薬	7,000	1,525.00	10,675,000	
エーザイ	21,300	3,845.00	81,898,500	
ロート製薬	7,000	1,405.00	9,835,000	
小野薬品工業	8,400	6,230.00	52,332,000	
久光製薬	5,300	5,400.00	28,620,000	
有機合成薬品工業	2,000	297.00	594,000	
持田製薬	1,200	6,330.00	7,596,000	
参天製薬	5,900	4,920.00	29,028,000	

扶桑薬品工業	6,000	321.00	1,926,000
日本ケミファ	2,000	471.00	942,000
ツムラ	4,700	2,999.00	14,095,300
日医工	2,500	2,461.00	6,152,500
キッセイ薬品工業	3,200	2,244.00	7,180,800
生化学工業	3,300	1,251.00	4,128,300
栄研化学	1,200	1,810.00	2,172,000
日水製薬	700	1,103.00	772,100
鳥居薬品	1,000	2,560.00	2,560,000
東和薬品	900	4,975.00	4,477,500
富士製薬工業	500	1,731.00	865,500
沢井製薬	2,300	7,260.00	16,698,000
ゼリア新薬工業	2,200	2,295.00	5,049,000
第一三共	54,500	1,781.00	97,064,500
キョーリン製薬ホールディングス	4,600	2,092.00	9,623,200
大幸薬品	800	1,715.00	1,372,000
ダイト	600	1,419.00	851,400
大塚ホールディングス	34,300	2,720.00	93,296,000
大正製薬ホールディングス	4,100	6,780.00	27,798,000
日本コークス工業	14,600	126.00	1,839,600
昭和シェル石油	15,500	1,046.00	16,213,000
コスモ石油	48,000	176.00	8,448,000
ニチレキ	2,000	1,026.00	2,052,000
東燃ゼネラル石油	26,000	918.00	23,868,000
ユシロ化学工業	900	929.00	836,100
ビーピー・カストロール	600	465.00	279,000
富士石油	4,100	357.00	1,463,700
MORESCO	400	1,657.00	662,800
出光興産	2,000	8,230.00	16,460,000
JXホールディングス	191,700	490.00	93,933,000
横浜ゴム	19,000	973.00	18,487,000
東洋ゴム工業	14,000	603.00	8,442,000
ブリヂストン	54,200	3,405.00	184,551,000
住友ゴム工業	13,500	1,389.00	18,751,500
藤倉ゴム工業	1,000	436.00	436,000

オカモト	6,000	314.00	1,884,000
フコク	700	829.00	580,300
ニッタ	1,700	2,126.00	3,614,200
東海ゴム工業	3,200	930.00	2,976,000
三ツ星ベルト	4,000	508.00	2,032,000
バンドー化学	6,000	387.00	2,322,000
日東紡績	13,000	441.00	5,733,000
旭硝子	85,000	605.00	51,425,000
日本板硝子	79,000	127.00	10,033,000
石塚硝子	2,000	390.00	780,000
日本山村硝子	7,000	180.00	1,260,000
日本電気硝子	30,000	496.00	14,880,000
オハラ	600	630.00	378,000
住友大阪セメント	31,000	397.00	12,307,000
太平洋セメント	95,000	422.00	40,090,000
デイ・シイ	1,800	702.00	1,263,600
日本ヒューム	2,000	888.00	1,776,000
日本コンクリート工業	3,000	575.00	1,725,000
三谷セキサン	600	1,575.00	945,000
ジャパンパイル	1,300	1,044.00	1,357,200
東海カーボン	16,000	344.00	5,504,000
日本カーボン	9,000	200.00	1,800,000
東洋炭素	1,000	1,910.00	1,910,000
ノリタケカンパニーリミテド	9,000	271.00	2,439,000
TOTO	25,000	1,373.00	34,325,000
日本碍子	23,000	1,541.00	35,443,000
日本特殊陶業	15,000	2,161.00	32,415,000
ダントーホールディングス	2,000	119.00	238,000
MARUWA	400	3,525.00	1,410,000
品川リフラクトリーズ	4,000	217.00	868,000
黒崎播磨	4,000	252.00	1,008,000
ヨータイ	1,000	312.00	312,000
イソライト工業	400	196.00	78,400
東京窯業	2,000	258.00	516,000
ニッカトー	500	423.00	211,500

フジインコーポレーテッド	1,600	1,331.00	2,129,600	
エーアンドエーマテリアル	4,000	145.00	580,000	
ニチアス	8,000	668.00	5,344,000	
ニチハ	1,900	1,434.00	2,724,600	
新日鐵住金	735,000	338.00	248,430,000	
神戸製鋼所	240,000	179.00	42,960,000	
合同製鐵	10,000	196.00	1,960,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	44,100	2,320.00	102,312,000	
日新製鋼ホールディングス	7,400	1,361.00	10,071,400	
東京製鐵	9,700	557.00	5,402,900	
共英製鋼	1,600	2,000.00	3,200,000	
大和工業	3,600	3,655.00	13,158,000	
東京鐵鋼	3,000	468.00	1,404,000	
大阪製鐵	900	1,971.00	1,773,900	
淀川製鋼所	12,000	449.00	5,388,000	
東洋鋼鈹	4,000	474.00	1,896,000	
丸一鋼管	5,800	2,453.00	14,227,400	
モリ工業	3,000	430.00	1,290,000	
大同特殊鋼	27,000	593.00	16,011,000	
日本高周波鋼業	7,000	111.00	777,000	
日本冶金工業	13,000	347.00	4,511,000	
山陽特殊製鋼	8,000	538.00	4,304,000	
愛知製鋼	9,000	517.00	4,653,000	
日立金属	15,000	1,248.00	18,720,000	
日本金属	5,000	138.00	690,000	
大平洋金属	11,000	363.00	3,993,000	
日本電工	7,000	289.00	2,023,000	
栗本鐵工所	8,000	285.00	2,280,000	
虹技	1,000	201.00	201,000	
日本鑄鉄管	2,000	250.00	500,000	
三菱製鋼	11,000	306.00	3,366,000	
日亜鋼業	3,000	368.00	1,104,000	
日本精線	1,000	481.00	481,000	
シンニッタン	1,400	384.00	537,600	
新家工業	4,000	181.00	724,000	

大紀アルミニウム工業所	3,000	278.00	834,000
日本軽金属ホールディングス	36,600	152.00	5,563,200
三井金属鉱業	44,000	256.00	11,264,000
東邦亜鉛	10,000	296.00	2,960,000
三菱マテリアル	101,000	387.00	39,087,000
住友金属鉱山	45,000	1,371.00	61,695,000
DOWAホールディングス	19,000	914.00	17,366,000
古河機械金属	29,000	200.00	5,800,000
エス・サイエンス	4,500	63.00	283,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,700	2,071.00	3,520,700
東邦チタニウム	2,900	791.00	2,293,900
UACJ	20,000	334.00	6,680,000
古河電気工業	55,000	222.00	12,210,000
住友電気工業	61,000	1,485.00	90,585,000
フジクラ	28,000	387.00	10,836,000
昭和電線ホールディングス	23,000	113.00	2,599,000
タツタ電線	3,300	716.00	2,362,800
沖電線	2,000	175.00	350,000
カナレ電気	200	1,534.00	306,800
平河ヒューテック	400	762.00	304,800
リョービ	10,000	426.00	4,260,000
アサヒホールディングス	2,600	1,602.00	4,165,200
稲葉製作所	800	1,291.00	1,032,800
宮地エンジニアリンググループ	6,000	216.00	1,296,000
トーカロ	1,000	1,595.00	1,595,000
アルファC o	600	1,037.00	622,200
SUMCO	10,600	884.00	9,370,400
川田テクノロジーズ	400	2,849.00	1,139,600
東洋製罐グループホールディングス	12,300	2,008.00	24,698,400
ホッカンホールディングス	4,000	308.00	1,232,000
コロナ	800	1,106.00	884,800
横河ブリッジホールディングス	3,000	1,464.00	4,392,000
駒井ハルテック	4,000	280.00	1,120,000
高田機工	1,000	223.00	223,000
三和ホールディングス	16,000	636.00	10,176,000

文化シャッター	4,000	540.00	2,160,000
三協立山	2,300	2,099.00	4,827,700
東洋シャッター	500	602.00	301,000
LIXILグループ	24,000	2,228.00	53,472,000
日本ファイルコン	1,200	443.00	531,600
ノーリツ	3,400	2,210.00	7,514,000
長府製作所	1,800	2,214.00	3,985,200
リンナイ	2,700	7,550.00	20,385,000
ダイニチ工業	900	823.00	740,700
日東精工	3,000	361.00	1,083,000
三洋工業	2,000	187.00	374,000
岡部	3,400	1,304.00	4,433,600
中国工業	300	798.00	239,400
東プレ	3,300	1,354.00	4,468,200
高周波熱錬	2,300	889.00	2,044,700
東京製綱	12,000	172.00	2,064,000
サンコール	1,000	588.00	588,000
モリテック スチール	600	282.00	169,200
パイオラックス	700	3,495.00	2,446,500
日本発條	12,500	1,041.00	13,012,500
中央発條	2,000	327.00	654,000
アドバネクス	4,000	126.00	504,000
三益半導体工業	1,400	867.00	1,213,800
アタカ大機	1,000	484.00	484,000
日本製鋼所	27,000	556.00	15,012,000
三浦工業	2,600	2,574.00	6,692,400
タクマ	6,000	829.00	4,974,000
ツガミ	5,000	501.00	2,505,000
オークマ	11,000	868.00	9,548,000
東芝機械	9,000	531.00	4,779,000
アマダ	26,000	838.00	21,788,000
アイダエンジニアリング	4,100	955.00	3,915,500
滝澤鉄工所	5,000	152.00	760,000
富士機械製造	5,300	862.00	4,568,600
牧野フライス製作所	8,000	714.00	5,712,000

オーエスジー	7,100	1,572.00	11,161,200
ダイジェット工業	2,000	176.00	352,000
旭ダイヤモンド工業	4,200	973.00	4,086,600
DMG森精機	9,100	1,619.00	14,732,900
ディスコ	1,900	6,230.00	11,837,000
日東工器	1,000	1,863.00	1,863,000
豊和工業	1,000	880.00	880,000
大阪機工	7,000	143.00	1,001,000
東洋機械金属	1,400	382.00	534,800
津田駒工業	5,000	161.00	805,000
島精機製作所	2,300	2,193.00	5,043,900
日阪製作所	2,000	900.00	1,800,000
やまびこ	700	3,060.00	2,142,000
ペガサスミシン製造	1,700	401.00	681,700
ナブテスコ	8,600	2,480.00	21,328,000
三井海洋開発	1,400	3,070.00	4,298,000
レオン自動機	2,000	304.00	608,000
SMC	4,900	22,530.00	110,397,000
新川	1,500	647.00	970,500
ホソカワミクロン	3,000	693.00	2,079,000
ユニオンツール	800	2,289.00	1,831,200
オイレス工業	1,800	2,242.00	4,035,600
サトーホールディングス	1,800	1,978.00	3,560,400
日本エアータック	600	514.00	308,400
日精樹脂工業	1,300	643.00	835,900
ワイエイシイ	700	610.00	427,000
小松製作所	80,600	2,358.00	190,054,800
住友重機械工業	47,000	436.00	20,492,000
日立建機	8,800	2,222.00	19,553,600
日工	2,000	532.00	1,064,000
巴工業	600	1,732.00	1,039,200
井関農機	17,000	326.00	5,542,000
TOWA	1,600	574.00	918,400
丸山製作所	4,000	263.00	1,052,000
北川鉄工所	8,000	194.00	1,552,000

クボタ	90,000	1,466.00	131,940,000
荏原実業	400	1,339.00	535,600
三菱化工機	5,000	202.00	1,010,000
月島機械	3,000	1,041.00	3,123,000
帝国電機製作所	500	2,238.00	1,119,000
新東工業	3,500	728.00	2,548,000
澁谷工業	1,100	1,926.00	2,118,600
アイチ コーポレーション	2,900	520.00	1,508,000
小森コーポレーション	4,200	1,515.00	6,363,000
鶴見製作所	1,000	990.00	990,000
住友精密工業	3,000	426.00	1,278,000
酒井重工業	3,000	386.00	1,158,000
荏原製作所	36,000	530.00	19,080,000
石井鐵工所	3,000	297.00	891,000
西島製作所	2,000	873.00	1,746,000
ダイキン工業	22,500	5,640.00	126,900,000
オルガノ	3,000	470.00	1,410,000
トーヨーカネツ	9,000	292.00	2,628,000
栗田工業	8,500	2,152.00	18,292,000
椿本チエイン	9,000	651.00	5,859,000
大同工業	3,000	288.00	864,000
日本コンベヤ	5,000	150.00	750,000
木村化工機	1,600	549.00	878,400
アネスト岩田	3,000	471.00	1,413,000
ダイフク	7,500	1,260.00	9,450,000
加藤製作所	4,000	658.00	2,632,000
油研工業	4,000	222.00	888,000
タダノ	8,000	1,199.00	9,592,000
フジテック	5,000	1,199.00	5,995,000
CKD	4,700	915.00	4,300,500
キトー	1,000	1,556.00	1,556,000
平和	3,600	1,663.00	5,986,800
理想科学工業	1,100	2,275.00	2,502,500
SANKYO	5,000	4,610.00	23,050,000
日本金銭機械	1,500	2,191.00	3,286,500

マースエンジニアリング	900	1,926.00	1,733,400
福島工業	900	1,366.00	1,229,400
オーイズミ	600	1,238.00	742,800
ダイコク電機	700	2,142.00	1,499,400
アマノ	4,700	980.00	4,606,000
JUKI	11,000	192.00	2,112,000
サンデン	9,000	408.00	3,672,000
蛇の目マシン工業	17,000	83.00	1,411,000
マックス	2,000	1,100.00	2,200,000
グローリー	4,900	2,465.00	12,078,500
新晃工業	800	872.00	697,600
大和冷機工業	3,000	624.00	1,872,000
セガサミーホールディングス	17,800	2,613.00	46,511,400
日本ピストンリング	6,000	179.00	1,074,000
リケン	6,000	434.00	2,604,000
T P R	1,800	1,860.00	3,348,000
ホシザキ電機	3,600	3,545.00	12,762,000
大豊工業	1,200	1,299.00	1,558,800
日本精工	37,000	1,083.00	40,071,000
NTN	36,000	482.00	17,352,000
ジェイテクト	17,500	1,301.00	22,767,500
不二越	15,000	500.00	7,500,000
日本トムソン	6,000	551.00	3,306,000
THK	11,000	2,134.00	23,474,000
ユーション精機	800	1,896.00	1,516,800
前澤給装工業	600	1,277.00	766,200
イーグル工業	2,000	1,597.00	3,194,000
前澤工業	1,300	376.00	488,800
日本ピラー工業	2,000	699.00	1,398,000
キッツ	6,800	437.00	2,971,600
日立工機	4,500	741.00	3,334,500
マキタ	10,000	5,450.00	54,500,000
日立造船	13,100	772.00	10,113,200
三菱重工業	277,000	632.00	175,064,000
I H I	113,000	405.00	45,765,000

イビデン	10,100	1,678.00	16,947,800
コニカミノルタ	43,500	843.00	36,670,500
ブラザー工業	21,300	1,139.00	24,260,700
ミネベア	22,000	534.00	11,748,000
日立製作所	396,000	673.00	266,508,000
東芝	326,000	430.00	140,180,000
三菱電機	165,000	1,063.00	175,395,000
富士電機	50,000	435.00	21,750,000
東洋電機製造	3,000	317.00	951,000
安川電機	18,000	1,273.00	22,914,000
シンフォニアテクノロジー	10,000	177.00	1,770,000
明電舎	16,000	365.00	5,840,000
オリジン電気	3,000	325.00	975,000
山洋電気	2,000	715.00	1,430,000
デンヨー	1,600	1,244.00	1,990,400
東芝テック	10,000	582.00	5,820,000
芝浦メカトロニクス	3,000	232.00	696,000
マブチモーター	2,300	5,210.00	11,983,000
日本電産	9,200	9,260.00	85,192,000
東光高岳ホールディングス	800	1,900.00	1,520,000
宮越ホールディングス	600	298.00	178,800
ダイヘン	9,000	393.00	3,537,000
ヤーマン	200	1,293.00	258,600
JVCケンウッド	10,300	199.00	2,049,700
第一精工	700	1,450.00	1,015,000
日新電機	3,000	572.00	1,716,000
大崎電気工業	2,000	611.00	1,222,000
オムロン	17,500	3,610.00	63,175,000
日東工業	2,400	1,575.00	3,780,000
I D E C	2,200	886.00	1,949,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	32,000	630.00	20,160,000
サクサホールディングス	4,000	162.00	648,000
メルコホールディングス	1,000	1,363.00	1,363,000
テクノメディカ	300	2,181.00	654,300
日本電気	214,000	231.00	49,434,000

富士通	159,000	417.00	66,303,000	
沖電気工業	60,000	219.00	13,140,000	
岩崎通信機	8,000	100.00	800,000	
電気興業	4,000	657.00	2,628,000	
サンケン電気	8,000	552.00	4,416,000	
ナカヨ通信機	2,000	321.00	642,000	
アイホン	900	1,585.00	1,426,500	
ルネサスエレクトロニクス	4,300	565.00	2,429,500	
セイコーエプソン	11,300	1,650.00	18,645,000	
ワコム	12,100	775.00	9,377,500	
アルバック	2,800	978.00	2,738,400	
アクセル	800	1,829.00	1,463,200	
E I Z O	1,400	2,427.00	3,397,800	
日本信号	4,200	753.00	3,162,600	
京三製作所	4,000	327.00	1,308,000	
能美防災	2,000	892.00	1,784,000	
ホーチキ	2,000	477.00	954,000	
エレコム	500	1,358.00	679,000	
日本無線	4,000	371.00	1,484,000	
パナソニック	188,600	946.00	178,415,600	
シャープ	115,000	295.00	33,925,000	
アンリツ	8,900	1,191.00	10,599,900	
富士通ゼネラル	4,000	1,183.00	4,732,000	
日立国際電気	4,000	1,239.00	4,956,000	
ソニー	103,800	1,910.00	198,258,000	
TDK	9,300	4,145.00	38,548,500	
帝国通信工業	4,000	178.00	712,000	
ミツミ電機	6,400	685.00	4,384,000	
タムラ製作所	6,000	261.00	1,566,000	
アルプス電気	12,100	799.00	9,667,900	
池上通信機	6,000	108.00	648,000	
パイオニア	20,300	186.00	3,775,800	
日本電波工業	1,400	929.00	1,300,600	
日本トリム	400	6,710.00	2,684,000	
ローランド ディー. ジー.	700	2,911.00	2,037,700	

フォスター電機	1,700	1,972.00	3,352,400
クラリオン	9,000	137.00	1,233,000
SMK	5,000	490.00	2,450,000
ヨコオ	1,300	549.00	713,700
東光	8,000	343.00	2,744,000
ティアック	10,000	71.00	710,000
ホシデン	4,500	534.00	2,403,000
ヒロセ電機	2,900	14,890.00	43,181,000
日本航空電子工業	4,000	1,018.00	4,072,000
TOA	1,800	802.00	1,443,600
古野電気	1,100	684.00	752,400
ユニデン	5,000	242.00	1,210,000
アルパイン	3,200	1,126.00	3,603,200
スミダコーポレーション	1,400	460.00	644,000
アイコム	900	2,238.00	2,014,200
リオン	400	1,527.00	610,800
船井電機	1,700	1,041.00	1,769,700
横河電機	16,500	1,286.00	21,219,000
新電元工業	5,000	638.00	3,190,000
アズビル	4,600	2,416.00	11,113,600
日本光電工業	3,300	3,925.00	12,952,500
チノー	3,000	229.00	687,000
共和電業	2,000	427.00	854,000
日本電子材料	700	360.00	252,000
堀場製作所	3,000	3,610.00	10,830,000
アドバンテスト	11,300	1,287.00	14,543,100
小野測器	2,000	437.00	874,000
エスベック	1,700	772.00	1,312,400
パナソニック デバイス SUNX	1,400	455.00	637,000
キーエンス	4,100	35,850.00	146,985,000
日置電機	800	1,406.00	1,124,800
シスメックス	5,800	6,480.00	37,584,000
メガチップス	1,300	1,645.00	2,138,500
OBARA GROUP	1,100	2,578.00	2,835,800
日本電産コパル電子	1,600	612.00	979,200

澤藤電機	1,000	240.00	240,000	
コーセル	2,400	1,208.00	2,899,200	
日立メディコ	1,000	1,330.00	1,330,000	
新日本無線	1,000	419.00	419,000	
オプテックス	1,100	1,617.00	1,778,700	
千代田インテグレ	700	1,665.00	1,165,500	
レーザーテック	1,200	1,079.00	1,294,800	
スタンレー電気	12,800	2,216.00	28,364,800	
岩崎電気	6,000	215.00	1,290,000	
ウシオ電機	10,000	1,237.00	12,370,000	
岡谷電機産業	800	339.00	271,200	
ヘリオス テクノ ホールディング	1,500	281.00	421,500	
日本セラミック	1,000	1,436.00	1,436,000	
遠藤照明	500	2,259.00	1,129,500	
日本デジタル研究所	1,400	1,201.00	1,681,400	
古河電池	1,000	566.00	566,000	
双信電機	800	387.00	309,600	
山一電機	1,900	250.00	475,000	
図研	1,000	827.00	827,000	
日本電子	6,000	443.00	2,658,000	
カシオ計算機	15,700	935.00	14,679,500	
ファナック	17,200	16,450.00	282,940,000	
日本シイエムケイ	3,600	282.00	1,015,200	
エンプラス	700	6,400.00	4,480,000	
大真空	2,000	385.00	770,000	
ローム	8,700	4,005.00	34,843,500	
浜松ホトニクス	6,400	3,640.00	23,296,000	
三井ハイテック	2,400	705.00	1,692,000	
新光電気工業	5,600	891.00	4,989,600	
京セラ	27,400	4,940.00	135,356,000	
太陽誘電	8,100	1,267.00	10,262,700	
村田製作所	17,400	7,900.00	137,460,000	
ユースン	2,300	745.00	1,713,500	
双葉電子工業	3,100	1,330.00	4,123,000	
北陸電気工業	7,000	141.00	987,000	

ニチコン	5,200	1,030.00	5,356,000	
日本ケミコン	9,000	443.00	3,987,000	
KOA	2,100	967.00	2,030,700	
市光工業	4,000	194.00	776,000	
小糸製作所	8,000	1,904.00	15,232,000	
ミツバ	3,000	1,524.00	4,572,000	
スター精密	2,900	1,039.00	3,013,100	
大日本スクリーン製造	17,000	558.00	9,486,000	
キヤノン電子	1,500	1,854.00	2,781,000	
キヤノン	95,700	3,150.00	301,455,000	代用有価証券 10,000株
リコー	50,000	1,062.00	53,100,000	
MUTOHホールディングス	2,000	448.00	896,000	
東京エレクトロン	13,900	5,430.00	75,477,000	
トヨタ紡織	5,800	1,347.00	7,812,600	
鬼怒川ゴム工業	3,000	550.00	1,650,000	
ユニプレス	2,900	2,059.00	5,971,100	
豊田自動織機	15,000	4,275.00	64,125,000	
モリタホールディングス	3,000	802.00	2,406,000	
三櫻工業	2,100	709.00	1,488,900	
デンソー	40,800	4,740.00	193,392,000	
東海理化電機製作所	3,900	2,051.00	7,998,900	
三井造船	64,000	202.00	12,928,000	
佐世保重工業	11,000	105.00	1,155,000	
川崎重工業	129,000	415.00	53,535,000	
名村造船所	1,600	1,452.00	2,323,200	
サノヤスホールディングス	1,000	190.00	190,000	
日本車輛製造	6,000	547.00	3,282,000	
ニチュ三菱フォークリフト	2,000	484.00	968,000	
近畿車輛	3,000	313.00	939,000	
日産自動車	208,500	1,009.00	210,376,500	
いすゞ自動車	96,000	623.00	59,808,000	
トヨタ自動車	212,100	6,310.00	1,338,351,000	代用有価証券 35,000株
日野自動車	21,000	1,417.00	29,757,000	
三菱自動車工業	41,500	1,079.00	44,778,500	

エフテック	600	1,694.00	1,016,400
GMB	100	1,200.00	120,000
武蔵精密工業	1,800	2,534.00	4,561,200
日産車体	6,000	1,772.00	10,632,000
新明和工業	7,000	738.00	5,166,000
極東開発工業	3,100	1,218.00	3,775,800
日信工業	3,400	1,782.00	6,058,800
トピー工業	12,000	226.00	2,712,000
ティラド	6,000	322.00	1,932,000
曙ブレーキ工業	7,700	478.00	3,680,600
タチエス	2,200	1,550.00	3,410,000
NOK	8,000	1,506.00	12,048,000
フタバ産業	5,100	390.00	1,989,000
カヤバ工業	13,000	601.00	7,813,000
シロキ工業	4,000	218.00	872,000
大同メタル工業	2,000	1,109.00	2,218,000
プレス工業	7,000	444.00	3,108,000
カルソニックカンセイ	11,000	484.00	5,324,000
太平洋工業	3,400	718.00	2,441,200
ケーヒン	3,400	1,628.00	5,535,200
河西工業	2,000	602.00	1,204,000
アイシン精機	15,100	4,165.00	62,891,500
富士機工	2,000	315.00	630,000
マツダ	261,000	445.00	116,145,000
ダイハツ工業	17,500	1,876.00	32,830,000
今仙電機製作所	1,200	1,392.00	1,670,400
本田技研工業	139,300	3,905.00	543,966,500
スズキ	34,500	2,412.00	83,214,000
富士重工業	52,200	2,725.00	142,245,000
ヤマハ発動機	25,100	1,527.00	38,327,700
ショーワ	3,900	1,356.00	5,288,400
T B K	2,000	544.00	1,088,000
エクセディ	2,200	2,557.00	5,625,400
豊田合成	4,700	2,490.00	11,703,000
愛三工業	1,700	967.00	1,643,900

ヨロズ	1,200	1,943.00	2,331,600
エフ・シー・シー	2,700	2,261.00	6,104,700
シマノ	7,100	8,490.00	60,279,000
タカタ	3,000	2,491.00	7,473,000
テイ・エス テック	3,500	3,795.00	13,282,500
テルモ	12,600	4,705.00	59,283,000
クリエートメディック	500	940.00	470,000
日機装	6,000	1,177.00	7,062,000
島津製作所	20,000	967.00	19,340,000
JMS	3,000	319.00	957,000
ショットモリテックス	400	290.00	116,000
長野計器	1,100	686.00	754,600
ブイ・テクノロジー	3	269,300.00	807,900
東京計器	5,000	316.00	1,580,000
愛知時計電機	2,000	286.00	572,000
東京精密	3,000	1,918.00	5,754,000
マニー	500	3,795.00	1,897,500
ニコン	30,800	1,838.00	56,610,400
トプコン	3,800	1,519.00	5,772,200
オリンパス	21,800	3,130.00	68,234,000
理研計器	1,300	745.00	968,500
タムロン	1,300	2,208.00	2,870,400
HOYA	40,100	2,318.00	92,951,800
ノーリツ鋼機	1,600	666.00	1,065,600
エー・アンド・デイ	1,500	672.00	1,008,000
シチズンホールディングス	18,700	708.00	13,239,600
リズム時計工業	8,000	145.00	1,160,000
大研医器	400	2,019.00	807,600
松風	800	874.00	699,200
セイコーホールディングス	11,000	448.00	4,928,000
ニプロ	8,900	904.00	8,045,600
パラマウントベッドホールディングス	1,400	3,350.00	4,690,000
SHO-BI	500	418.00	209,000
前田工織	1,200	1,249.00	1,498,800
永大産業	2,000	527.00	1,054,000

ダンロップスポーツ	900	1,222.00	1,099,800
バンダイナムコホールディングス	17,100	1,863.00	31,857,300
共立印刷	2,600	269.00	699,400
フランスベッドホールディングス	10,000	202.00	2,020,000
パイロットコーポレーション	1,500	3,685.00	5,527,500
トッパン・フォームズ	3,000	931.00	2,793,000
フジシールインターナショナル	2,000	3,010.00	6,020,000
タカラトミー	5,600	520.00	2,912,000
廣済堂	1,500	570.00	855,000
アーク	5,800	255.00	1,479,000
タカノ	800	473.00	378,400
プロネクサス	1,900	601.00	1,141,900
ホクシン	1,300	178.00	231,400
ウッドワン	3,000	280.00	840,000
大建工業	7,000	266.00	1,862,000
凸版印刷	47,000	788.00	37,036,000
大日本印刷	50,000	1,033.00	51,650,000
図書印刷	3,000	283.00	849,000
共同印刷	5,000	276.00	1,380,000
日本写真印刷	2,600	1,651.00	4,292,600
光村印刷	2,000	264.00	528,000
宝印刷	1,000	678.00	678,000
アシックス	15,400	1,703.00	26,226,200
ツツミ	800	2,367.00	1,893,600
ローランド	1,500	1,178.00	1,767,000
小松ウオール工業	600	2,069.00	1,241,400
ヤマハ	12,200	1,452.00	17,714,400
河合楽器製作所	6,000	189.00	1,134,000
クリナップ	1,700	867.00	1,473,900
ピジョン	2,500	5,060.00	12,650,000
兼松日産農林	3,000	170.00	510,000
キングジム	1,300	691.00	898,300
リンテック	3,500	2,025.00	7,087,500
TASAKI	400	517.00	206,800
イトーキ	3,600	508.00	1,828,800

任天堂	9,500	11,510.00	109,345,000	
三菱鉛筆	1,400	2,553.00	3,574,200	
タカラスタンド	7,000	792.00	5,544,000	
コクヨ	8,600	754.00	6,484,400	
ナカバヤシ	4,000	215.00	860,000	
岡村製作所	6,000	676.00	4,056,000	
美津濃	8,000	555.00	4,440,000	
アデランス	2,100	1,157.00	2,429,700	
東京電力	140,100	514.00	72,011,400	
中部電力	50,500	1,432.00	72,316,000	
関西電力	67,400	1,255.00	84,587,000	
中国電力	22,800	1,493.00	34,040,400	
北陸電力	16,200	1,370.00	22,194,000	
東北電力	41,300	1,184.00	48,899,200	
四国電力	14,900	1,693.00	25,225,700	
九州電力	36,500	1,373.00	50,114,500	
北海道電力	15,500	1,261.00	19,545,500	
沖縄電力	1,000	3,365.00	3,365,000	
電源開発	10,200	3,150.00	32,130,000	
東京瓦斯	193,000	517.00	99,781,000	
大阪瓦斯	160,000	413.00	66,080,000	
東邦瓦斯	42,000	512.00	21,504,000	
北海道瓦斯	3,000	261.00	783,000	
西部瓦斯	19,000	245.00	4,655,000	
静岡瓦斯	4,200	643.00	2,700,600	
東武鉄道	94,000	506.00	47,564,000	
相鉄ホールディングス	26,000	367.00	9,542,000	
東京急行電鉄	97,000	677.00	65,669,000	
京浜急行電鉄	42,000	931.00	39,102,000	
小田急電鉄	53,000	959.00	50,827,000	
京王電鉄	46,000	683.00	31,418,000	
京成電鉄	25,000	1,004.00	25,100,000	
富士急行	4,000	822.00	3,288,000	
東日本旅客鉄道	30,400	8,760.00	266,304,000	
西日本旅客鉄道	14,200	4,305.00	61,131,000	

東海旅客鉄道	13,700	12,700.00	173,990,000
鴻池運輸	700	1,619.00	1,133,300
西日本鉄道	21,000	377.00	7,917,000
ハマキョウレックス	500	2,767.00	1,383,500
サカイ引越センター	300	3,040.00	912,000
近畿日本鉄道	164,000	363.00	59,532,000
阪急阪神ホールディングス	104,000	545.00	56,680,000
南海電気鉄道	34,000	367.00	12,478,000
京阪電気鉄道	37,000	405.00	14,985,000
神戸電鉄	3,000	381.00	1,143,000
名糖運輸	700	646.00	452,200
名古屋鉄道	58,000	285.00	16,530,000
山陽電気鉄道	4,000	429.00	1,716,000
日本通運	65,000	486.00	31,590,000
ヤマトホールディングス	30,700	2,125.00	65,237,500
山九	20,000	347.00	6,940,000
丸運	1,100	248.00	272,800
丸全昭和運輸	6,000	360.00	2,160,000
センコー	7,000	518.00	3,626,000
トナミホールディングス	4,000	216.00	864,000
日本梱包運輸倉庫	5,100	1,704.00	8,690,400
日本石油輸送	2,000	227.00	454,000
福山通運	10,000	638.00	6,380,000
セイノーホールディングス	13,000	976.00	12,688,000
神奈川中央交通	2,000	511.00	1,022,000
日立物流	2,900	1,482.00	4,297,800
日本郵船	131,000	325.00	42,575,000
商船三井	81,000	443.00	35,883,000
川崎汽船	73,000	230.00	16,790,000
N S ユナイテッド海運	7,000	306.00	2,142,000
乾汽船	2,200	399.00	877,800
明治海運	1,600	419.00	670,400
飯野海運	6,900	637.00	4,395,300
共栄タンカー	2,000	242.00	484,000
日本航空	18,600	5,810.00	108,066,000

ANAホールディングス	325,000	218.00	70,850,000	
パスコ	2,000	408.00	816,000	
トランコム	400	3,095.00	1,238,000	
日新	6,000	288.00	1,728,000	
三菱倉庫	12,000	1,399.00	16,788,000	
三井倉庫	8,000	515.00	4,120,000	
住友倉庫	11,000	595.00	6,545,000	
澁澤倉庫	4,000	443.00	1,772,000	
東陽倉庫	3,000	262.00	786,000	
日本トランスシティ	4,000	325.00	1,300,000	
ケイヒン	3,000	193.00	579,000	
中央倉庫	700	954.00	667,800	
安田倉庫	1,300	1,211.00	1,574,300	
東洋埠頭	5,000	278.00	1,390,000	
宇徳	1,400	323.00	452,200	
上組	18,000	855.00	15,390,000	
サンリツ	500	524.00	262,000	
キムラユニティー	400	1,010.00	404,000	
キューソー流通システム	500	1,052.00	526,000	
郵船ロジスティクス	1,300	1,160.00	1,508,000	
近鉄エクスプレス	1,500	3,805.00	5,707,500	
東海運	1,000	288.00	288,000	
エーアイテイー	300	1,570.00	471,000	
NEC ネットエスアイ	1,500	2,427.00	3,640,500	
システナ	1,700	715.00	1,215,500	
デジタルアーツ	600	993.00	595,800	
新日鉄住金ソリューションズ	1,100	2,133.00	2,346,300	
コア	600	741.00	444,600	
ソフトクリエイトホールディングス	500	943.00	471,500	
ITホールディングス	5,400	1,357.00	7,327,800	
ネオス	400	1,722.00	688,800	
電算システム	400	1,483.00	593,200	
グリー	8,500	817.00	6,944,500	
コーエーテクモホールディングス	3,200	1,072.00	3,430,400	
三菱総合研究所	600	2,128.00	1,276,800	

ボルテージ	300	1,222.00	366,600	
電算	100	1,968.00	196,800	
ヒト・コミュニケーションズ	200	1,501.00	300,200	
ブレインパッド	100	1,270.00	127,000	
K L a b	1,100	841.00	925,100	
ポータルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	400	3,135.00	1,254,000	
ネクソン	13,500	1,160.00	15,660,000	
アイスタイル	500	790.00	395,000	
エイチーム	100	2,685.00	268,500	
ブロードリーフ	1,600	2,209.00	3,534,400	
ハーツユナイテッドグループ	300	1,990.00	597,000	
ダウンゴ	1,400	1,900.00	2,660,000	
ベリサーブ	100	1,870.00	187,000	
マクロミル	2,600	651.00	1,692,600	
ティーガイア	2,000	979.00	1,958,000	
テクマトリックス	500	600.00	300,000	
GMOペイメントゲートウェイ	600	3,395.00	2,037,000	
ザッパラス	9	70,700.00	636,300	
インターネットイニシアティブ	2,100	2,860.00	6,006,000	
ビットアイル	1,300	864.00	1,123,200	
S R Aホールディングス	800	1,088.00	870,400	
朝日ネット	1,000	489.00	489,000	
パナソニック インフォメーションシステムズ	400	2,470.00	988,000	
フェイス	500	1,050.00	525,000	
野村総合研究所	9,200	3,350.00	30,820,000	
サイバネットシステム	1,400	354.00	495,600	
インテージホールディングス	1,000	1,286.00	1,286,000	
ソースネクスト	900	902.00	811,800	
クレスコ	400	768.00	307,200	
フジ・メディア・ホールディングス	15,800	1,966.00	31,062,800	
オービック	5,600	3,060.00	17,136,000	
TDCソフトウェアエンジニアリング	300	811.00	243,300	
ヤフー	117,900	490.00	57,771,000	
トレンドマイクロ	7,200	3,640.00	26,208,000	

日本オラクル	3,200	3,805.00	12,176,000	
アルファシステムズ	500	1,358.00	679,000	
フューチャーアーキテクト	2,000	589.00	1,178,000	
シーエーシー	1,000	891.00	891,000	
ソフトバンク・テクノロジー	400	1,772.00	708,800	
トーセ	400	667.00	266,800	
オービックビジネスコンサルタント	1,000	3,460.00	3,460,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	1,900	3,945.00	7,495,500	
アイティフォー	1,900	423.00	803,700	
東計電算	200	1,444.00	288,800	
エクスネット	100	1,341.00	134,100	
大塚商会	1,400	13,190.00	18,466,000	
サイボウズ	25	29,450.00	736,250	
ソフトブレーン	2,500	140.00	350,000	
アグレックス	400	865.00	346,000	
電通国際情報サービス	1,000	1,122.00	1,122,000	
EMシステムズ	200	1,992.00	398,400	
ウェザーニューズ	400	2,195.00	878,000	
C I J	1,500	419.00	628,500	
WOWOW	500	3,780.00	1,890,000	
日本コロムビア	800	659.00	527,200	
ネットワンシステムズ	5,900	695.00	4,100,500	
アルゴグラフィックス	600	1,637.00	982,200	
マーベラスAQL	2,500	640.00	1,600,000	
エイベックス・グループ・ホールディングス	3,000	2,665.00	7,995,000	
日本ユニシス	4,500	898.00	4,041,000	
兼松エレクトロニクス	1,000	1,289.00	1,289,000	
東京放送ホールディングス	8,800	1,306.00	11,492,800	
日本テレビホールディングス	14,900	1,804.00	26,879,600	
テレビ朝日	4,100	2,279.00	9,343,900	
スカパーJ S A Tホールディングス	14,200	514.00	7,298,800	
テレビ東京ホールディングス	1,200	1,709.00	2,050,800	
コネクシオ	1,500	850.00	1,275,000	
日本電信電話	68,600	5,140.00	352,604,000	代用有価証券 12,300株
KDDI	46,000	5,110.00	235,060,000	

光通信	1,400	7,520.00	10,528,000
NTTドコモ	134,200	1,535.00	205,997,000
GMOインターネット	5,500	1,234.00	6,787,000
学研ホールディングス	5,000	302.00	1,510,000
ゼンリン	2,200	1,050.00	2,310,000
昭文社	1,000	618.00	618,000
KADOKAWA	1,400	3,350.00	4,690,000
インプレスホールディングス	1,500	145.00	217,500
アイネット	800	731.00	584,800
松竹	11,000	981.00	10,791,000
東宝	11,600	2,095.00	24,302,000
東映	7,000	577.00	4,039,000
AOI Pro.	800	640.00	512,000
エヌ・ティ・ティ・データ	10,100	3,275.00	33,077,500
DTS	1,600	1,627.00	2,603,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,900	1,582.00	9,333,800
シーイーシー	1,100	617.00	678,700
カプコン	3,100	1,905.00	5,905,500
ジャステック	1,100	826.00	908,600
SCSK	3,900	2,440.00	9,516,000
日本システムウエア	600	418.00	250,800
アイネス	2,200	637.00	1,401,400
TKC	1,400	1,625.00	2,275,000
富士ソフト	2,300	1,948.00	4,480,400
NSD	3,200	1,200.00	3,840,000
コナミ	7,400	2,398.00	17,745,200
福井コンピュータホールディングス	200	816.00	163,200
JBCCHホールディングス	1,400	935.00	1,309,000
ミロク情報サービス	1,000	402.00	402,000
ソフトバンク	78,900	7,480.00	590,172,000
ハウスイ	2,000	135.00	270,000
高千穂交易	600	957.00	574,200
伊藤忠食品	400	3,225.00	1,290,000
エレマテック	700	1,368.00	957,600
JALUX	500	1,145.00	572,500

あらた	4,000	346.00	1,384,000
トーメンデバイス	200	1,699.00	339,800
東京エレクトロン デバイス	300	1,567.00	470,100
双日	102,900	192.00	19,756,800
アルフレッサ ホールディングス	4,200	5,390.00	22,638,000
横浜冷凍	4,100	778.00	3,189,800
神栄	2,000	284.00	568,000
山下医科器械	200	1,831.00	366,200
ラサ商事	700	451.00	315,700
アルコニックス	500	2,060.00	1,030,000
神戸物産	100	2,360.00	236,000
あい ホールディングス	2,900	1,319.00	3,825,100
ダイワボウホールディングス	15,000	185.00	2,775,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,100	696.00	2,157,600
八洲電機	1,200	424.00	508,800
UKCホールディングス	1,000	1,944.00	1,944,000
TOKAIホールディングス	6,300	355.00	2,236,500
ミタチ産業	400	426.00	170,400
シップヘルスケアホールディングス	2,300	4,065.00	9,349,500
富士興産	600	617.00	370,200
協栄産業	2,000	203.00	406,000
小野建	1,400	1,165.00	1,631,000
佐島電機	1,200	587.00	704,400
エコートレーディング	400	728.00	291,200
伯東	1,000	939.00	939,000
コンドーテック	1,300	720.00	936,000
中山福	900	770.00	693,000
ナガイレーベン	2,100	1,584.00	3,326,400
三菱食品	1,800	2,722.00	4,899,600
松田産業	1,200	1,409.00	1,690,800
メディパルホールディングス	16,300	1,274.00	20,766,200
アドヴァン	800	1,226.00	980,800
S P K	400	1,785.00	714,000
アズワン	1,100	2,210.00	2,431,000
スズデン	500	530.00	265,000

シモジマ	1,000	969.00	969,000
ドウシシャ	1,700	1,419.00	2,412,300
高速	900	933.00	839,700
黒田電気	2,100	1,420.00	2,982,000
丸文	1,400	455.00	637,000
ハピネット	1,000	736.00	736,000
トーメンエレクトロニクス	800	1,124.00	899,200
エクセル	700	1,154.00	807,800
マルカキカイ	500	1,486.00	743,000
ガリバーインターナショナル	5,500	600.00	3,300,000
日本エム・ディ・エム	1,600	296.00	473,600
進和	1,000	1,143.00	1,143,000
エスケイジャパン	500	279.00	139,500
ダイトエレクトロン	800	410.00	328,000
シークス	1,000	1,196.00	1,196,000
田中商事	600	579.00	347,400
オーハシテクニカ	900	860.00	774,000
マクニカ	800	2,694.00	2,155,200
白銅	500	805.00	402,500
伊藤忠商事	129,900	1,174.00	152,502,600
丸紅	134,000	768.00	102,912,000
高島	3,000	278.00	834,000
長瀬産業	9,200	1,204.00	11,076,800
蝶理	1,000	1,189.00	1,189,000
豊田通商	18,200	2,753.00	50,104,600
三共生興	2,700	332.00	896,400
兼松	35,000	134.00	4,690,000
ツカモトコーポレーション	3,000	156.00	468,000
三井物産	140,600	1,418.00	199,370,800
日本紙パルプ商事	8,000	320.00	2,560,000
日立ハイテクノロジーズ	5,000	2,231.00	11,155,000
カメイ	1,900	750.00	1,425,000
東都水産	3,000	210.00	630,000
OUGホールディングス	2,000	185.00	370,000
スターゼン	5,000	268.00	1,340,000

山善	6,200	632.00	3,918,400
椿本興業	2,000	265.00	530,000
住友商事	96,100	1,306.00	125,506,600
内田洋行	4,000	288.00	1,152,000
三菱商事	127,100	1,989.00	252,801,900
第一実業	4,000	425.00	1,700,000
キヤノンマーケティングジャパン	4,600	1,352.00	6,219,200
西華産業	6,000	239.00	1,434,000
佐藤商事	1,400	603.00	844,200
菱洋エレクトロ	1,900	902.00	1,713,800
東京産業	1,500	335.00	502,500
ユアサ商事	17,000	202.00	3,434,000
神鋼商事	4,000	204.00	816,000
小林産業	800	355.00	284,000
阪和興業	16,000	450.00	7,200,000
カナデン	2,000	650.00	1,300,000
菱電商事	2,000	675.00	1,350,000
フルサト工業	900	1,043.00	938,700
岩谷産業	18,000	458.00	8,244,000
すてきナイスグループ	7,000	255.00	1,785,000
昭光通商	6,000	157.00	942,000
ニチモウ	3,000	202.00	606,000
極東貿易	2,000	208.00	416,000
イワキ	2,000	218.00	436,000
三愛石油	4,000	430.00	1,720,000
稲畑産業	4,000	968.00	3,872,000
G S I クレオス	4,000	147.00	588,000
明和産業	1,400	330.00	462,000
ワキタ	2,000	1,300.00	2,600,000
東邦ホールディングス	5,200	1,883.00	9,791,600
サンゲツ	2,900	2,587.00	7,502,300
ミツウロコグループホールディングス	2,500	476.00	1,190,000
シナネン	3,000	384.00	1,152,000
伊藤忠エネクス	3,600	522.00	1,879,200
サンリオ	4,100	5,540.00	22,714,000

サンワテクノス	800	952.00	761,600
リョーサン	2,600	1,837.00	4,776,200
新光商事	1,800	849.00	1,528,200
トーホー	3,000	353.00	1,059,000
三信電気	2,300	643.00	1,478,900
東陽テクニカ	2,300	1,125.00	2,587,500
モスフードサービス	2,100	1,890.00	3,969,000
加賀電子	1,500	1,039.00	1,558,500
ソーダニッカ	1,000	413.00	413,000
立花エレテック	1,000	1,138.00	1,138,000
P a l t a c	1,900	1,331.00	2,528,900
太平洋興発	6,000	110.00	660,000
ヤマタネ	8,000	189.00	1,512,000
丸紅建材リース	2,000	217.00	434,000
日鉄住金物産	10,000	305.00	3,050,000
トラスコ中山	1,800	2,099.00	3,778,200
オートボックスセブン	5,700	1,444.00	8,230,800
加藤産業	2,300	1,982.00	4,558,600
イノテック	1,400	454.00	635,600
イエローハット	1,500	1,725.00	2,587,500
富士エレクトロニクス	800	1,327.00	1,061,600
J Kホールディングス	1,400	609.00	852,600
日伝	700	2,282.00	1,597,400
北沢産業	1,500	181.00	271,500
杉本商事	900	899.00	809,100
因幡電機産業	2,200	3,015.00	6,633,000
バイテック	400	811.00	324,400
ミスミグループ本社	6,100	2,880.00	17,568,000
江守商事	400	1,528.00	611,200
アルテック	900	277.00	249,300
タキヒヨー	2,000	416.00	832,000
スズケン	6,300	3,500.00	22,050,000
ジェコス	1,100	742.00	816,200
ローソン	6,200	7,850.00	48,670,000
サンエー	1,200	2,749.00	3,298,800

麒麟堂	600	655.00	393,000
ダイユーエイト	300	655.00	196,500
カワチ薬品	1,200	1,913.00	2,295,600
エービーシー・マート	1,900	4,930.00	9,367,000
ハードオフコーポレーション	800	749.00	599,200
アスクル	1,400	2,809.00	3,932,600
ゲオホールディングス	2,800	941.00	2,634,800
アダストリアホールディングス	1,500	4,410.00	6,615,000
シー・ヴィ・エス・バイエリア	2,000	248.00	496,000
くらコーポレーション	1,000	1,651.00	1,651,000
キャンドゥ	800	1,623.00	1,298,400
パル	900	2,713.00	2,441,700
エディオン	7,200	485.00	3,492,000
サーラコーポレーション	1,400	528.00	739,200
あみやき亭	300	3,505.00	1,051,500
ひらまつ	1,700	666.00	1,132,200
ゲンキー	200	2,131.00	426,200
大黒天物産	300	2,969.00	890,700
ハニーズ	1,300	1,074.00	1,396,200
アルペン	1,300	2,054.00	2,670,200
クオール	900	624.00	561,600
ジェイアイエヌ	800	4,020.00	3,216,000
ビックカメラ	62	48,050.00	2,979,100
DCMホールディングス	8,100	725.00	5,872,500
MonotaRO	2,500	2,775.00	6,937,500
J. フロント リテイリング	38,000	745.00	28,310,000
ドトール・日レスホールディングス	2,900	1,779.00	5,159,100
マツモトキヨシホールディングス	2,800	3,265.00	9,142,000
ブロンコビリー	300	1,914.00	574,200
スタートトゥデイ	4,500	2,800.00	12,600,000
物語コーポレーション	200	4,165.00	833,000
ココカラファイン	1,700	2,798.00	4,756,600
三越伊勢丹ホールディングス	32,400	1,441.00	46,688,400
ウエルシアホールディングス	600	6,030.00	3,618,000
クリエイトSDホールディングス	700	3,490.00	2,443,000

丸善C H I ホールディングス	1,000	294.00	294,000
ブックオフコーポレーション	900	662.00	595,800
あさひ	900	1,691.00	1,521,900
日本調剤	210	2,784.00	584,640
コスモス薬品	800	12,000.00	9,600,000
一六堂	200	484.00	96,800
セブン&アイ・ホールディングス	68,100	3,615.00	246,181,500
ツルハホールディングス	1,600	8,640.00	13,824,000
サンマルクホールディングス	500	5,000.00	2,500,000
フェリシモ	500	982.00	491,000
トリドール	1,400	932.00	1,304,800
クスリのアオキ	200	6,170.00	1,234,000
メディカルシステムネットワーク	1,200	445.00	534,000
総合メディカル	400	3,790.00	1,516,000
はるやま商事	700	672.00	470,400
カップ・クリエイトホールディングス	1,200	1,836.00	2,203,200
ライトオン	1,200	852.00	1,022,400
ジーンズメイト	700	259.00	181,300
良品計画	1,700	9,770.00	16,609,000
三城ホールディングス	2,000	464.00	928,000
コナカ	2,100	935.00	1,963,500
ハウス オブ ローゼ	200	1,327.00	265,400
G-7ホールディングス	500	778.00	389,000
イオン北海道	1,100	612.00	673,200
コジマ	2,400	277.00	664,800
ヒマラヤ	400	1,400.00	560,000
コーナン商事	2,100	1,038.00	2,179,800
エコス	600	611.00	366,600
ワタミ	1,900	1,514.00	2,876,600
マルシェ	400	827.00	330,800
ドン・キホーテ	4,800	6,610.00	31,728,000
西松屋チェーン	3,200	738.00	2,361,600
ゼンショーホールディングス	6,200	1,133.00	7,024,600
幸楽苑	1,000	1,218.00	1,218,000
ハークスレイ	500	758.00	379,000

サイゼリヤ	2,400	1,231.00	2,954,400
ポプラ	500	534.00	267,000
ユナイテッドアローズ	1,800	4,280.00	7,704,000
ハイデイ日高	900	2,133.00	1,919,700
京都きもの友禅	1,100	1,034.00	1,137,400
コロワイド	5,500	1,008.00	5,544,000
壱番屋	700	4,155.00	2,908,500
トップカルチャー	700	484.00	338,800
P L A N T	300	939.00	281,700
スギホールディングス	2,600	4,100.00	10,660,000
スクロール	2,200	295.00	649,000
ヨンドシーホールディングス	1,300	1,241.00	1,613,300
ファミリーマート	5,000	4,315.00	21,575,000
木曾路	2,000	1,844.00	3,688,000
サトレストランシステムズ	1,000	664.00	664,000
千趣会	2,900	853.00	2,473,700
タカキュー	1,500	322.00	483,000
ケーヨー	2,700	463.00	1,250,100
上新電機	3,000	785.00	2,355,000
日本瓦斯	2,300	1,119.00	2,573,700
ベスト電器	5,400	149.00	804,600
マルエツ	3,000	321.00	963,000
ロイヤルホールディングス	2,700	1,548.00	4,179,600
東天紅	1,000	190.00	190,000
いなげや	1,700	1,002.00	1,703,400
島忠	3,700	2,442.00	9,035,400
チョダ	1,900	2,148.00	4,081,200
ライフコーポレーション	1,000	1,623.00	1,623,000
カスミ	3,300	600.00	1,980,000
リンガーハット	1,500	1,417.00	2,125,500
さが美	2,000	106.00	212,000
M r M a x	1,700	330.00	561,000
テンアライド	1,300	322.00	418,600
A O K Iホールディングス	1,400	3,195.00	4,473,000
オークワ	2,000	894.00	1,788,000

コメリ	2,500	2,606.00	6,515,000
青山商事	4,500	2,504.00	11,268,000
しまむら	1,900	10,790.00	20,501,000
C F S コーポレーション	1,100	391.00	430,100
はせがわ	500	658.00	329,000
高島屋	22,000	921.00	20,262,000
松屋	3,300	1,228.00	4,052,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	11,000	772.00	8,492,000
近鉄百貨店	4,000	363.00	1,452,000
丸栄	3,000	220.00	660,000
ニッセンホールディングス	3,200	316.00	1,011,200
パルコ	3,200	952.00	3,046,400
丸井グループ	21,300	925.00	19,702,500
アクシアル リテイリング	900	1,601.00	1,440,900
ダイエー	9,650	313.00	3,020,450
イズミヤ	6,000	456.00	2,736,000
イオン	59,500	1,326.00	78,897,000
ユニーグループ・ホールディングス	15,700	615.00	9,655,500
イズミ	4,000	3,160.00	12,640,000
東武ストア	2,000	257.00	514,000
平和堂	3,300	1,505.00	4,966,500
フジ	1,800	1,766.00	3,178,800
ヤオコー	800	3,590.00	2,872,000
ゼビオ	2,200	2,119.00	4,661,800
ケーズホールディングス	4,100	2,850.00	11,685,000
O l y m p i c グループ	1,000	716.00	716,000
日産東京販売ホールディングス	3,000	292.00	876,000
アインファーマシーズ	1,000	4,215.00	4,215,000
元気寿司	500	1,251.00	625,500
ヤマダ電機	74,600	291.00	21,708,600
アークランドサカモト	1,100	1,537.00	1,690,700
ニトリホールディングス	3,200	9,100.00	29,120,000
愛眼	1,400	278.00	389,200
吉野家ホールディングス	4,400	1,123.00	4,941,200
松屋フーズ	800	1,560.00	1,248,000

サガミチェーン	2,000	874.00	1,748,000	
関西スーパーマーケット	800	905.00	724,000	
王将フードサービス	500	3,240.00	1,620,000	
プレナス	1,800	2,277.00	4,098,600	
ミニストップ	1,200	1,546.00	1,855,200	
アークス	2,800	1,846.00	5,168,800	
バロー	3,500	1,416.00	4,956,000	
藤久	100	1,652.00	165,200	
ベルク	800	1,785.00	1,428,000	
大庄	800	1,294.00	1,035,200	
ファーストリテイリング	3,800	33,200.00	126,160,000	
サンドラッグ	3,100	4,900.00	15,190,000	
東京デリカ	700	1,465.00	1,025,500	
ヤマザワ	400	1,499.00	599,600	
やまや	300	1,433.00	429,900	
ベルーナ	4,100	522.00	2,140,200	
島根銀行	400	1,275.00	510,000	
じもとホールディングス	11,800	213.00	2,513,400	
新生銀行	141,000	235.00	33,135,000	
あおぞら銀行	59,000	286.00	16,874,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,234,100	629.00	776,248,900	
りそなホールディングス	154,800	519.00	80,341,200	
三井住友トラスト・ホールディングス	322,000	493.00	158,746,000	
三井住友フィナンシャルグループ	123,200	4,725.00	582,120,000	
第四銀行	21,000	335.00	7,035,000	
北越銀行	17,000	212.00	3,604,000	
西日本シティ銀行	57,000	270.00	15,390,000	
千葉銀行	63,000	702.00	44,226,000	
横浜銀行	101,000	541.00	54,641,000	
常陽銀行	61,000	512.00	31,232,000	
群馬銀行	36,000	575.00	20,700,000	
武蔵野銀行	2,600	3,455.00	8,983,000	
千葉興業銀行	3,200	763.00	2,441,600	
筑波銀行	6,800	344.00	2,339,200	
東京都民銀行	3,100	1,064.00	3,298,400	

七十七銀行	26,000	494.00	12,844,000	
青森銀行	12,000	257.00	3,084,000	
秋田銀行	11,000	250.00	2,750,000	
山形銀行	10,000	410.00	4,100,000	
岩手銀行	1,200	4,470.00	5,364,000	
東邦銀行	13,000	309.00	4,017,000	
東北銀行	9,000	146.00	1,314,000	
みちのく銀行	8,000	208.00	1,664,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	66,000	451.00	29,766,000	
静岡銀行	48,000	1,091.00	52,368,000	
十六銀行	20,000	393.00	7,860,000	
スルガ銀行	16,000	1,551.00	24,816,000	
八十二銀行	30,000	608.00	18,240,000	
山梨中央銀行	10,000	424.00	4,240,000	
大垣共立銀行	22,000	277.00	6,094,000	
福井銀行	14,000	216.00	3,024,000	
北國銀行	18,000	355.00	6,390,000	
清水銀行	600	2,743.00	1,645,800	
滋賀銀行	15,000	536.00	8,040,000	
南都銀行	16,000	390.00	6,240,000	
百五銀行	15,000	403.00	6,045,000	
京都銀行	29,000	872.00	25,288,000	
紀陽銀行	6,500	1,300.00	8,450,000	
三重銀行	7,000	201.00	1,407,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	111,000	203.00	22,533,000	
広島銀行	48,000	419.00	20,112,000	
山陰合同銀行	10,000	723.00	7,230,000	
中国銀行	12,000	1,389.00	16,668,000	
鳥取銀行	5,000	188.00	940,000	
伊予銀行	17,000	1,021.00	17,357,000	
百十四銀行	18,000	361.00	6,498,000	
四国銀行	12,000	231.00	2,772,000	
阿波銀行	13,000	517.00	6,721,000	
鹿児島銀行	11,000	661.00	7,271,000	
大分銀行	10,000	360.00	3,600,000	

宮崎銀行	11,000	287.00	3,157,000	
肥後銀行	13,000	564.00	7,332,000	
佐賀銀行	10,000	212.00	2,120,000	
十八銀行	10,000	230.00	2,300,000	
沖縄銀行	1,200	3,855.00	4,626,000	
琉球銀行	3,400	1,117.00	3,797,800	
八千代銀行	900	2,716.00	2,444,400	
セブン銀行	55,000	346.00	19,030,000	
みずほフィナンシャルグループ	2,108,300	209.00	440,634,700	
山口フィナンシャルグループ	16,000	938.00	15,008,000	
長野銀行	6,000	174.00	1,044,000	
名古屋銀行	15,000	345.00	5,175,000	
北洋銀行	24,600	434.00	10,676,400	
愛知銀行	600	4,480.00	2,688,000	
第三銀行	9,000	165.00	1,485,000	
中京銀行	7,000	176.00	1,232,000	
東日本銀行	7,000	221.00	1,547,000	
大光銀行	6,000	219.00	1,314,000	
愛媛銀行	9,000	239.00	2,151,000	
トマト銀行	6,000	173.00	1,038,000	
みなと銀行	15,000	170.00	2,550,000	
京葉銀行	13,000	500.00	6,500,000	
関西アーバン銀行	23,000	115.00	2,645,000	
栃木銀行	8,000	373.00	2,984,000	
北日本銀行	500	2,398.00	1,199,000	
東和銀行	19,000	91.00	1,729,000	
福島銀行	21,000	85.00	1,785,000	
大東銀行	11,000	101.00	1,111,000	
トモニホールディングス	12,500	372.00	4,650,000	
フィデアホールディングス	9,300	196.00	1,822,800	
池田泉州ホールディングス	13,400	487.00	6,525,800	
F P G	1,100	1,175.00	1,292,500	
S B I ホールディングス	20,800	1,238.00	25,750,400	
ジャフコ	2,200	4,940.00	10,868,000	
大和証券グループ本社	161,000	883.00	142,163,000	

野村ホールディングス	333,000	742.00	247,086,000	
岡三証券グループ	14,000	891.00	12,474,000	
丸三証券	5,000	816.00	4,080,000	
東洋証券	6,000	343.00	2,058,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	18,700	840.00	15,708,000	
光世証券	4,000	263.00	1,052,000	
水戸証券	5,000	485.00	2,425,000	
いちよし証券	3,700	1,434.00	5,305,800	
松井証券	9,700	1,052.00	10,204,400	
だいこう証券ビジネス	1,000	702.00	702,000	
マネックスグループ	17,800	376.00	6,692,800	
カブドットコム証券	6,400	527.00	3,372,800	
極東証券	2,200	1,749.00	3,847,800	
岩井コスモホールディングス	1,600	1,305.00	2,088,000	
マネーパートナーズグループ	1,300	295.00	383,500	
NKS Jホールディングス	36,200	2,497.00	90,391,400	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	48,700	2,519.00	122,675,300	
ソニーフィナンシャルホールディングス	15,600	1,804.00	28,142,400	
第一生命保険	87,200	1,376.00	119,987,200	
東京海上ホールディングス	63,100	3,155.00	199,080,500	
T&Dホールディングス	55,900	1,174.00	65,626,600	
全国保証	1,700	4,260.00	7,242,000	
クレディセゾン	14,300	2,649.00	37,880,700	
芙蓉総合リース	1,600	4,070.00	6,512,000	
興銀リース	2,800	2,790.00	7,812,000	
東京センチュリーリース	3,800	3,145.00	11,951,000	
日本証券金融	7,200	742.00	5,342,400	
アイフル	27,300	494.00	13,486,200	
ポケットカード	1,700	894.00	1,519,800	
リコーリース	1,100	2,759.00	3,034,900	
イオンフィナンシャルサービス	6,100	3,020.00	18,422,000	
アコム	32,900	386.00	12,699,400	
ジャックス	9,000	502.00	4,518,000	
オリエントコーポレーション	36,700	256.00	9,395,200	
日立キャピタル	3,200	2,569.00	8,220,800	

アプラスフィナンシャル	4,100	164.00	672,400
オリックス	97,800	1,673.00	163,619,400
三菱UFJリース	41,400	547.00	22,645,800
日本取引所グループ	20,600	2,240.00	46,144,000
イー・ギャランティ	500	2,618.00	1,309,000
アサックス	300	1,465.00	439,500
NECキャピタルソリューション	700	2,420.00	1,694,000
日本駐車場開発	177	7,630.00	1,350,510
ヒューリック	27,400	1,641.00	44,963,400
東京建物不動産販売	900	472.00	424,800
三栄建築設計	500	866.00	433,000
野村不動産ホールディングス	7,800	2,503.00	19,523,400
常和ホールディングス	400	2,933.00	1,173,200
フージャースホールディングス	2,200	795.00	1,749,000
東急不動産ホールディングス	41,300	1,004.00	41,465,200
パーク24	8,500	1,953.00	16,600,500
三井不動産	77,000	3,285.00	252,945,000
三菱地所	114,000	2,835.00	323,190,000
平和不動産	3,100	1,800.00	5,580,000
東京建物	33,000	935.00	30,855,000
ダイビル	4,200	1,274.00	5,350,800
京阪神ビルディング	2,500	560.00	1,400,000
住友不動産	39,000	4,765.00	185,835,000
大京	25,000	307.00	7,675,000
テーオーシー	5,600	828.00	4,636,800
東京楽天地	3,000	495.00	1,485,000
レオパレス21	15,700	686.00	10,770,200
フジ住宅	2,100	681.00	1,430,100
空港施設	2,000	879.00	1,758,000
明和地所	900	431.00	387,900
住友不動産販売	1,100	3,365.00	3,701,500
ゴールドクレスト	1,300	2,688.00	3,494,400
東栄住宅	1,100	2,551.00	2,806,100
日本エスリード	700	1,123.00	786,100
飯田産業	1,800	2,272.00	4,089,600

日神不動産	1,000	804.00	804,000
アーネストワン	2,700	2,700.00	7,290,000
タカラレーベン	6,800	363.00	2,468,400
サンヨーハウジング名古屋	800	1,187.00	949,600
イオンモール	9,200	2,802.00	25,778,400
タクトホーム	8	238,000.00	1,904,000
ファースト住建	300	1,639.00	491,700
トーセイ	2,300	827.00	1,902,100
穴吹興産	1,000	328.00	328,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	10,200	1,291.00	13,168,200
サンフロンティア不動産	1,600	1,241.00	1,985,600
ランドビジネス	1,100	446.00	490,600
グランディハウス	1,000	349.00	349,000
日本空港ビルデング	5,600	2,446.00	13,697,600
日本工営	6,000	467.00	2,802,000
ネクスト	800	2,860.00	2,288,000
日本M&Aセンター	900	7,930.00	7,137,000
ノバレーゼ	500	711.00	355,500
アコーディア・ゴルフ	7,600	1,095.00	8,322,000
タケエイ	800	1,569.00	1,255,200
パソナグループ	18	82,100.00	1,477,800
リンクアンドモチベーション	12	31,200.00	374,400
GCAサヴィアン	1,100	1,120.00	1,232,000
エス・エム・エス	1,000	2,278.00	2,278,000
テンプホールディングス	2,600	2,774.00	7,212,400
リニカル	400	1,299.00	519,600
クックパッド	1,000	3,385.00	3,385,000
エスクリ	500	926.00	463,000
アイ・ケイ・ケイ	400	838.00	335,200
学情	600	975.00	585,000
スタジオアリス	700	1,283.00	898,100
シミックホールディングス	700	1,370.00	959,000
NECフィールドディング	1,400	1,133.00	1,586,200
総合警備保障	6,300	1,957.00	12,329,100
カカコム	9,300	1,938.00	18,023,400

ルネサンス	800	744.00	595,200
ツクイ	2,000	1,096.00	2,192,000
総合臨床ホールディングス	500	614.00	307,000
キャリアデザインセンター	4	118,200.00	472,800
エムスリー	41	264,000.00	10,824,000
ベストプライダル	1,000	694.00	694,000
日本E R I	400	1,271.00	508,400
アウトソーシング	600	1,077.00	646,200
ディー・エヌ・エー	8,500	2,073.00	17,620,500
博報堂DYホールディングス	23,900	764.00	18,259,600
ぐるなび	1,200	2,176.00	2,611,200
一休	11	159,500.00	1,754,500
ジャパンベストレスキューシステム	10	77,100.00	771,000
ジェイコムホールディングス	400	819.00	327,600
P G Mホールディングス	2,500	954.00	2,385,000
バリューコマース	1,000	1,446.00	1,446,000
J Pホールディングス	2,600	463.00	1,203,800
イーピーエス	19	100,800.00	1,915,200
アミューズ	500	1,894.00	947,000
ドリームインキュベータ	6	188,500.00	1,131,000
T A C	1,100	234.00	257,400
ケネディクス	20,500	526.00	10,783,000
電通	16,100	3,730.00	60,053,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	1,925.00	1,155,000
ぴあ	500	1,708.00	854,000
イオンファンタジー	600	1,499.00	899,400
みらかホールディングス	4,500	4,360.00	19,620,000
アルプス技研	800	1,050.00	840,000
サニックス	2,500	1,119.00	2,797,500
ダイオーズ	300	715.00	214,500
日本空調サービス	500	907.00	453,500
オリエンタルランド	5,100	15,260.00	77,826,000
ダスキン	4,700	2,003.00	9,414,100
明光ネットワークジャパン	1,700	1,231.00	2,092,700
ファルコSDホールディングス	900	1,296.00	1,166,400

秀英予備校	400	350.00	140,000
田谷	300	762.00	228,600
ラウンドワン	5,500	537.00	2,953,500
リゾートトラスト	2,900	3,730.00	10,817,000
ビー・エム・エル	1,000	3,310.00	3,310,000
ワタベウェディング	500	736.00	368,000
もしもしホットライン	2,900	1,221.00	3,540,900
リソー教育	1,900	670.00	1,273,000
早稲田アカデミー	100	754.00	75,400
ユー・エス・エス	19,300	1,445.00	27,888,500
東京個別指導学院	1,000	246.00	246,000
テー・オー・ダブリュー	700	566.00	396,200
セントラルスポーツ	500	1,528.00	764,000
リゾートソリューション	2,000	233.00	466,000
リブセンス	400	5,190.00	2,076,000
リロ・ホールディング	600	4,665.00	2,799,000
エイチ・アイ・エス	1,400	5,430.00	7,602,000
共立メンテナンス	900	3,715.00	3,343,500
イチネンホールディングス	1,900	688.00	1,307,200
建設技術研究所	1,100	909.00	999,900
スペース	900	906.00	815,400
燦ホールディングス	400	1,382.00	552,800
スバル興業	1,000	380.00	380,000
東京テアトル	7,000	166.00	1,162,000
よみうりランド	3,000	758.00	2,274,000
東京都競馬	13,000	415.00	5,395,000
常磐興産	6,000	167.00	1,002,000
カナモト	2,000	2,716.00	5,432,000
東京ドーム	13,000	704.00	9,152,000
西尾レントオール	600	2,769.00	1,661,400
トランス・コスモス	2,200	1,735.00	3,817,000
乃村工藝社	4,000	871.00	3,484,000
藤田観光	4,000	431.00	1,724,000
KNT-CTホールディングス	6,000	160.00	960,000
日本管財	700	1,822.00	1,275,400

トーカイ	700	2,678.00	1,874,600	
白洋舎	2,000	242.00	484,000	
セコム	17,900	5,920.00	105,968,000	
セントラル警備保障	800	927.00	741,600	
丹青社	2,000	623.00	1,246,000	
メイテック	2,600	2,635.00	6,851,000	
アサツー ディ・ケイ	3,100	2,725.00	8,447,500	
応用地質	1,700	1,686.00	2,866,200	
船井総合研究所	1,800	797.00	1,434,600	
進学会	800	399.00	319,200	
ベネッセホールディングス	5,200	3,645.00	18,954,000	
イオンディライト	1,700	1,909.00	3,245,300	
ナック	800	1,848.00	1,478,400	
ニチイ学館	3,400	991.00	3,369,400	
ダイセキ	2,600	1,969.00	5,119,400	
ステップ	500	851.00	425,500	
合 計	26,065,172		27,515,161,350	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	平成 24 年 10 月 26 日現在	平成 25 年 10 月 28 日現在
資産の部		
流動資産		
預金	879,491,192	130,877,687
コール・ローン	827,338,500	738,559,756
株式	60,333,037,109	75,381,119,201
投資証券	1,409,155,471	1,627,991,309
派生商品評価勘定	11,509,244	18,347,447
未収入金	6,599,811	587,146
未収配当金	72,072,802	66,368,075
未収利息	1,580	1,245
差入委託証拠金	213,634,415	285,711,080
流動資産合計	63,752,840,124	78,249,562,946
資産合計	63,752,840,124	78,249,562,946
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	37,113,942	3,479,375
未払金	-	7,426,210
未払解約金	157,285,011	288,691,891
流動負債合計	194,398,953	299,597,476
負債合計	194,398,953	299,597,476
純資産の部		
元本等		
元本	66,445,318,652	53,121,420,340
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	△2,886,877,481	24,828,545,130
元本等合計	63,558,441,171	77,949,965,470
純資産合計	63,558,441,171	77,949,965,470
負債純資産合計	63,752,840,124	78,249,562,946

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成 24 年 10 月 26 日現在	平成 25 年 10 月 28 日現在
1.	期首	平成 23 年 10 月 27 日	平成 24 年 10 月 27 日
	期首元本額	76,714,471,608 円	66,445,318,652 円
	期首からの追加設定元本額	4,062,313,228 円	2,064,048,909 円
	期首からの一部解約元本額	14,331,466,184 円	15,387,947,221 円
	元本の内訳 ※		
	インデックスファンド海外株式ヘッジなし（DC専用）	14,253,130,726 円	13,892,180,524 円
	DCインデックスバランス（株式20）	47,303,478 円	37,234,680 円
	DCインデックスバランス（株式40）	167,155,442 円	143,469,943 円
	DCインデックスバランス（株式60）	307,882,116 円	275,922,594 円
	DCインデックスバランス（株式80）	337,085,275 円	327,852,003 円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	9,406,652,401 円	6,484,482,909 円
	日興五大陸株式ファンド	17,740,467,598 円	13,462,485,251 円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	73,474,807 円	56,923,858 円
	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産）	99,295,104 円	24,231,305 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	19,537,370 円	13,478,586 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	16,656,680 円	9,964,615 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	26,841,375 円	15,992,156 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	34,142,879 円	19,891,518 円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	15,479,415,845 円	11,190,881,578 円
	3資産バランスファンド（適格機関投資家向け）	27,422,152 円	—円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	18,895,482 円	15,230,756 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	44,806,587 円	35,107,086 円

年金積立	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	120,074,635 円	100,461,569 円
年金積立	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	153,893,994 円	136,553,155 円
年金積立	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	151,053,747 円	141,468,831 円
年金積立	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	7,920,130,959 円	6,737,607,423 円
	計	66,445,318,652 円	53,121,420,340 円
2.	受益権の総数	66,445,318,652 口	53,121,420,340 口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	2,886,877,481 円	－円

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

	自 平成 23 年 10 月 27 日 至 平成 24 年 10 月 26 日	自 平成 24 年 10 月 27 日 至 平成 25 年 10 月 28 日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

	平成 24 年 10 月 26 日現在	平成 25 年 10 月 28 日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前	同左

	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。	
--	---	--

(有価証券に関する注記)

(平成 24 年 10 月 26 日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	6,257,309,721
投資証券	203,569,304
合計	6,460,879,025

(平成 25 年 10 月 28 日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	13,846,367,644
投資証券	107,821,874
合計	13,954,189,518

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成 24 年 10 月 26 日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,853,203,691	—	1,819,098,732	△34,104,959
合計		1,853,203,691	—	1,819,098,732	△34,104,959

(平成 25 年 10 月 28 日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	849,067,883	—	867,415,330	18,347,447
合計		849,067,883	—	867,415,330	18,347,447

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(平成 24 年 10 月 26 日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,110,932,489	—	1,121,179,880	10,247,391
	米ドル	692,454,988	—	702,104,780	9,649,792
	ユーロ	418,477,501	—	419,075,100	597,599
	売建	276,157,870	—	277,905,000	△1,747,130
	加ドル	72,450,450	—	72,621,000	△170,550
	英ポンド	127,983,900	—	129,410,000	△1,426,100
	スイスフラン	34,488,520	—	34,344,000	144,520
	豪ドル	41,235,000	—	41,530,000	△295,000
合計		1,387,090,359	—	1,399,084,880	8,500,261

(平成 25 年 10 月 28 日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	495,936,395	—	492,457,020	△3,479,375
	米ドル	393,478,530	—	390,159,000	△3,319,530
	ユーロ	102,457,865	—	102,298,020	△159,845
合計		495,936,395	—	492,457,020	△3,479,375

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成 24 年 10 月 26 日現在		平成 25 年 10 月 28 日現在	
1口当たり純資産額	0.9566円	1口当たり純資産額	1.4674円
(1万口当たり純資産額)	(9,566円)	(1万口当たり純資産額)	(14,674円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	13,973	96.15	1,343,503.95	
	APACHE CORP	10,994	90.45	994,407.30	
	BAKER HUGHES INC	12,265	58.23	714,190.95	
	CABOT OIL & GAS CORP	11,240	36.98	415,655.20	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	7,511	53.25	399,960.75	
	CHENIERE ENERGY INC	5,580	39.00	217,620.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	13,880	28.47	395,163.60	
	CHEVRON CORP	54,241	120.59	6,540,922.19	
	CIMAREX ENERGY CO	2,535	105.82	268,253.70	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	8,000	22.73	181,840.00	
	CONCHO RESOURCES INC	2,935	112.54	330,304.90	
	CONOCOPHILLIPS	32,430	74.06	2,401,765.80	
	CONSOL ENERGY INC	6,858	38.14	261,564.12	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	980	117.52	115,169.60	
	CORE LABORATORIES N.V.	1,470	188.75	277,462.50	
	DENBURY RESOURCES INC	10,745	19.22	206,518.90	
	DEVON ENERGY CORPORATION	11,221	64.54	724,203.34	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	1,525	61.27	93,436.75	
	ENERGEN CORP	2,310	84.29	194,709.90	
	ENSCO PLC-CL A	7,000	57.02	399,140.00	
	EOG RESOURCES INC	7,576	183.44	1,389,741.44	
	EQT CORP	4,345	87.80	381,491.00	
EXXON MOBIL CORP	124,471	87.97	10,949,713.87		
FMC TECHNOLOGIES INC	6,925	51.13	354,075.25		

HALLIBURTON CO	23,537	51.69	1,216,627.53
HELMERICH & PAYNE	2,800	76.57	214,396.00
HESS CORP	8,810	83.20	732,992.00
HOLLYFRONTIER CORP	5,590	44.06	246,295.40
KINDER MORGAN INC	19,460	36.49	710,095.40
MARATHON OIL CORP	20,667	35.59	735,538.53
MARATHON PETROLEUM CORP	9,216	69.89	644,106.24
MURPHY OIL CORP	5,325	61.75	328,818.75
NABORS INDUSTRIES LTD	7,671	16.76	128,565.96
NATIONAL OILWELL VARCO INC	12,151	82.72	1,005,130.72
NOBLE CORP	7,632	38.08	290,626.56
NOBLE ENERGY INC	9,962	76.51	762,192.62
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	22,481	96.88	2,177,959.28
OCEANEERING INTL INC	3,070	83.69	256,928.30
PEABODY ENERGY CORP	9,290	19.16	177,996.40
PHILLIPS 66	16,105	63.40	1,021,057.00
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,600	210.77	758,772.00
QEP RESOURCES INC	4,290	33.14	142,170.60
RANGE RESOURCES CORP	4,920	74.73	367,671.60
ROWAN COMPANIES PLC	3,300	36.55	120,615.00
SCHLUMBERGER LTD	37,099	92.90	3,446,497.10
SOUTHWESTERN ENERGY CO	10,635	37.13	394,877.55
SPECTRA ENERGY CORP	19,574	35.95	703,685.30
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	5,500	25.98	142,890.00
TESORO CORP	3,820	46.96	179,387.20
VALERO ENERGY CORP	15,232	39.44	600,750.08
WEATHERFORD INTL LTD	21,119	16.26	343,394.94
WHITING PETROLEUM CORP	3,275	68.90	225,647.50
WILLIAMS COS INC	19,974	37.30	745,030.20
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	5,675	111.73	634,067.75
AIRGAS INC	2,080	109.14	227,011.20
ALBEMARLE CORP	2,650	67.60	179,140.00
ALCOA INC	30,889	9.24	285,414.36
ASHLAND INC	2,050	91.50	187,575.00
AVERY DENNISON CORP	2,260	47.74	107,892.40

BALL CORP	4, 113	48. 60	199, 891. 80
CELANESE CORP-SERIES A	4, 510	57. 58	259, 685. 80
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1, 470	209. 62	308, 141. 40
CROWN HOLDINGS INC	4, 035	41. 40	167, 049. 00
DOW CHEMICAL	34, 243	39. 52	1, 353, 283. 36
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	25, 658	61. 90	1, 588, 230. 20
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4, 675	77. 94	364, 369. 50
ECOLAB INC	7, 790	105. 18	819, 352. 20
FMC CORP	3, 270	74. 34	243, 091. 80
FREEPORT-MCMORAN COPPER	28, 478	37. 44	1, 066, 216. 32
INTERNATIONAL PAPER CO	11, 830	45. 57	539, 093. 10
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2, 494	81. 82	204, 059. 08
LYONDELLBASELL INDU-CL A	12, 380	77. 10	954, 498. 00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1, 445	99. 75	144, 138. 75
MEADWESTVACO CORP	4, 879	39. 31	191, 793. 49
MONSANTO CO	14, 881	108. 00	1, 607, 148. 00
MOSAIC CO/THE	9, 040	45. 94	415, 297. 60
NEWMONT MINING CORP	13, 420	27. 83	373, 478. 60
NUCOR CORP	9, 649	51. 40	495, 958. 60
OWENS-ILLINOIS INC	4, 955	30. 35	150, 384. 25
PPG INDUSTRIES INC	3, 927	181. 92	714, 399. 84
PRAXAIR INC	8, 520	125. 24	1, 067, 044. 80
ROCK-TENN COMPANY-CL A	1, 830	107. 60	196, 908. 00
SEALED AIR CORP	4, 356	28. 33	123, 405. 48
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2, 587	195. 07	504, 646. 09
SIGMA-ALDRICH	3, 575	87. 06	311, 239. 50
VULCAN MATERIALS CO	3, 643	54. 84	199, 782. 12
3M CO	18, 296	124. 42	2, 276, 388. 32
AGCO CORP	2, 710	63. 33	171, 624. 30
AMETEK INC	6, 343	47. 09	298, 691. 87
BOEING CO	20, 202	131. 19	2, 650, 300. 38
CATERPILLAR INC	18, 256	84. 77	1, 547, 561. 12
CUMMINS INC	5, 045	135. 59	684, 051. 55
DANAHER CORP	16, 219	72. 11	1, 169, 552. 09
DEERE & CO	10, 540	83. 55	880, 617. 00

DOVER CORP	4,520	90.95	411,094.00
EATON CORP PLC	13,206	71.64	946,077.84
EMERSON ELECTRIC CO	20,020	67.22	1,345,744.40
FASTENAL CO	8,533	50.63	432,025.79
FLOWSERVE CORP	4,335	71.22	308,738.70
FLUOR CORP	4,903	76.31	374,147.93
GENERAL DYNAMICS CORP	8,292	88.26	731,851.92
GENERAL ELECTRIC CO.	291,203	25.88	7,536,333.64
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	21,216	87.50	1,856,400.00
ILLINOIS TOOL WORKS	12,390	78.55	973,234.50
INGERSOLL-RAND PLC	8,006	67.85	543,207.10
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3,330	60.56	201,664.80
JOY GLOBAL INC	3,005	58.09	174,560.45
KBR INC	4,120	33.75	139,050.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	2,591	97.53	252,700.23
LOCKHEED MARTIN CORP	7,531	134.00	1,009,154.00
MASCO CORP	10,699	20.99	224,572.01
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,124	108.37	663,657.88
PACCAR INC	9,454	58.55	553,531.70
PALL CORP	2,596	80.27	208,380.92
PARKER HANNIFIN CORP	4,410	116.42	513,412.20
PENTAIR LTD-REGISTERED	5,858	66.67	390,552.86
PRECISION CASTPARTS CORP	3,930	254.81	1,001,403.30
QUANTA SERVICES INC	6,025	29.15	175,628.75
RAYTHEON COMPANY	8,972	79.96	717,401.12
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,273	110.60	472,593.80
ROCKWELL COLLINS INC.	3,995	70.69	282,406.55
ROPER INDUSTRIES INC	2,710	133.04	360,538.40
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,100	40.62	125,922.00
SPX CORP	887	86.05	76,326.35
STANLEY BLACK & DECKER INC	4,456	78.46	349,617.76
TEXTRON INC	8,346	29.07	242,618.22
TRANSDIGM GROUP INC	1,460	146.22	213,481.20
UNITED TECHNOLOGIES CORP	24,535	107.52	2,638,003.20
WW GRAINGER INC	1,767	267.40	472,495.80

XYLEM INC	4,368	28.99	126,628.32
ADT CORP/THE	4,917	42.17	207,349.89
CINTAS CORP	3,387	53.91	182,593.17
DUN & BRADSTREET CORP	1,162	108.45	126,018.90
EQUIFAX INC	3,584	65.52	234,823.68
IHS INC-CLASS A	1,710	110.65	189,211.50
IRON MOUNTAIN INC	4,684	27.12	127,030.08
MANPOWERGROUP INC	2,657	79.00	209,903.00
NIELSEN HOLDINGS NV	5,645	39.04	220,380.80
REPUBLIC SERVICES INC	7,000	33.74	236,180.00
ROBERT HALF INTL INC	3,425	39.25	134,431.25
STERICYCLE INC	2,285	116.85	267,002.25
TYCO INTERNATIONAL LTD	12,505	36.49	456,307.45
VERISK ANALYTICS INC	4,000	68.39	273,560.00
WASTE MANAGEMENT INC	12,204	43.65	532,704.60
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,410	60.76	267,951.60
CSX CORP	27,163	26.61	722,807.43
DELTA AIR LINES INC	6,905	26.31	181,670.55
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,227	45.88	285,694.76
FEDEX CORP	8,728	132.06	1,152,619.68
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	9,780	23.84	233,155.20
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,080	74.77	230,291.60
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	158,000	0.76	120,080.00
KANSAS CITY SOUTHERN	2,910	123.49	359,355.90
NORFOLK SOUTHERN CORP	8,930	87.65	782,714.50
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,190	17.17	71,942.30
UNION PACIFIC CORP	13,068	152.36	1,991,040.48
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	2,495	31.17	77,769.15
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	20,217	95.61	1,932,947.37
AUTOLIV INC	2,610	91.89	239,832.90
BORGWARNER INC	3,215	106.27	341,658.05
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	7,980	58.03	463,079.40
FORD MOTOR COMPANY	102,875	17.60	1,810,600.00
GENERAL MOTORS CORP	20,745	35.59	738,314.55
HARLEY-DAVIDSON INC	6,549	64.98	425,554.02

JOHNSON CONTROLS INC	18,988	43.01	816,673.88
TESLA MOTORS INC	2,200	169.66	373,252.00
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	2,955	79.13	233,829.15
COACH INC	8,476	49.89	422,867.64
DR HORTON INC	6,906	19.77	136,531.62
FOSSIL GROUP INC	1,545	126.25	195,056.25
GARMIN LTD	3,575	48.90	174,817.50
HASBRO INC	3,368	52.05	175,304.40
LEGETT & PLATT INC	4,468	30.35	135,603.80
LENNAR CORP-CL A	5,360	36.99	198,266.40
LULULEMON ATHLETICA INC	2,790	72.66	202,721.40
MATTEL INC	10,019	44.06	441,437.14
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	5,100	76.24	388,824.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,738	131.78	229,033.64
NEWELL RUBBERMAID INC	9,310	29.40	273,714.00
NIKE INC -CL B	19,934	75.70	1,509,003.80
POLARIS INDUSTRIES INC	1,580	133.01	210,155.80
PULTE GROUP INC	11,600	18.04	209,264.00
PVH CORP	2,030	118.55	240,656.50
RALPH LAUREN CORP	1,715	164.54	282,186.10
TOLL BROTHERS INC	4,501	33.81	152,178.81
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	2,640	80.18	211,675.20
VF CORP	2,585	212.23	548,614.55
WHIRLPOOL CORP	2,394	146.18	349,954.92
CARNIVAL CORP	10,117	34.63	350,351.71
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	825	527.50	435,187.50
DARDEN RESTAURANTS INC	2,853	51.70	147,500.10
H&R BLOCK INC	8,610	28.48	245,212.80
INTL GAME TECHNOLOGY	7,626	18.68	142,453.68
LAS VEGAS SANDS CORP	11,800	71.90	848,420.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	6,406	44.49	285,002.94
MCDONALD'S CORP	28,011	94.78	2,654,882.58
MGM RESORTS INTERNATIONAL	9,790	20.31	198,834.90
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,908	43.47	213,350.76
STARBUCKS CORP	20,872	79.96	1,668,925.12

STARWOOD HOTELS & RESORTS	5,687	74.56	424,022.72
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	3,950	67.35	266,032.50
WYNN RESORTS LTD	2,370	168.18	398,586.60
YUM! BRANDS INC	12,914	66.57	859,684.98
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	5,725	15.81	90,512.25
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	16,548	59.80	989,570.40
CHARTER COMMUNICATION-A	1,400	138.58	194,012.00
COMCAST CORP-CLASS A	59,476	48.18	2,865,553.68
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	13,871	46.82	649,440.22
DIRECTV	14,244	62.82	894,808.08
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,930	85.66	336,643.80
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	2,635	79.38	209,166.30
DISH NETWORK CORP-A	6,029	48.67	293,431.43
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	11,796	16.15	190,505.40
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,355	80.16	429,256.80
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	4,673	76.50	357,484.50
LIBERTY MEDIA CORP	2,465	151.38	373,151.70
NEWS CORP - CLASS A	11,240	17.15	192,766.00
OMNICOM GROUP	7,317	67.46	493,604.82
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	2,320	80.23	186,133.60
SIRIUS XM RADIO INC	92,570	3.75	347,137.50
THE WALT DISNEY CO.	48,173	69.26	3,336,461.98
TIME WARNER CABLE	8,267	119.44	987,410.48
TIME WARNER INC	26,318	70.26	1,849,102.68
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	12,569	34.64	435,390.16
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	42,242	34.86	1,472,556.12
VIACOM INC-CLASS B	11,998	84.94	1,019,110.12
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,088	102.67	214,374.96
AMAZON.COM INC	10,145	363.39	3,686,591.55
AUTOZONE INC	972	429.47	417,444.84
BED BATH & BEYOND INC	6,062	76.75	465,258.50
BEST BUY CO INC	6,504	42.77	278,176.08
CARMAX INC	5,869	47.76	280,303.44
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,770	52.46	145,314.20
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	9,040	59.50	537,880.00

DOLLAR TREE INC	6,214	59.70	370,975.80
EXPEDIA INC	2,232	50.45	112,604.40
FAMILY DOLLAR STORES	3,343	69.58	232,605.94
GAMESTOP CORP-CLASS A	3,440	54.88	188,787.20
GAP INC/THE	8,356	36.66	306,330.96
GENUINE PARTS CO	4,731	79.09	374,174.79
HOME DEPOT INC	41,020	76.25	3,127,775.00
J. C. PENNEY CO INC	4,661	6.79	31,648.19
KOHL'S CORP	5,202	54.74	284,757.48
L BRANDS INC	6,408	61.54	394,348.32
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	13,920	26.72	371,942.40
LKQ CORP	8,560	33.23	284,448.80
LOWE'S COS INC	30,942	50.59	1,565,355.78
MACY'S INC	10,109	44.89	453,793.01
NETFLIX INC	1,390	328.17	456,156.30
NORDSTROM INC	4,740	59.27	280,939.80
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,905	125.86	365,623.30
PETSMART INC	2,240	73.00	163,520.00
PRICELINE.COM INC	1,437	1,070.85	1,538,811.45
ROSS STORES INC	6,276	75.87	476,160.12
STAPLES INC	17,384	16.02	278,491.68
TARGET CORP	17,430	64.07	1,116,740.10
TIFFANY & CO	3,360	79.32	266,515.20
TJX COMPANIES INC	20,463	59.10	1,209,363.30
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,440	73.22	325,096.80
TRIPADVISOR INC	3,220	76.98	247,875.60
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	1,770	127.52	225,710.40
URBAN OUTFITTERS INC	3,320	37.88	125,761.60
COSTCO WHOLESALE CORP	12,139	116.44	1,413,465.16
CVS CAREMARK CORP	34,177	61.41	2,098,809.57
KROGER CO	13,275	43.42	576,400.50
SAFEWAY INC	7,013	36.54	256,255.02
SYSCO CORP	17,146	32.99	565,646.54
WAL-MART STORES INC	46,172	76.08	3,512,765.76
WALGREEN CO	25,062	59.19	1,483,419.78

WHOLE FOODS MARKET INC	9,570	65.24	624,346.80
ALTRIA GROUP INC	56,058	36.25	2,032,102.50
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	18,473	39.93	737,626.89
BEAM INC	4,336	68.65	297,666.40
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,517	72.80	256,037.60
BUNGE LTD	3,647	82.39	300,476.33
CAMPBELL SOUP CO	5,715	42.56	243,230.40
COCA-COLA CO/THE	112,092	39.03	4,374,950.76
COCA-COLA ENTERPRISES	6,670	41.18	274,670.60
CONAGRA FOODS INC	11,730	31.72	372,075.60
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,990	63.91	255,000.90
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	5,129	46.67	239,370.43
GENERAL MILLS INC	18,449	50.06	923,556.94
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	3,865	61.78	238,779.70
HERSHEY CO/THE	4,165	97.11	404,463.15
HORMEL FOODS CORP	3,770	43.62	164,447.40
JM SMUCKER CO/THE	2,680	110.36	295,764.80
KELLOGG CO	6,618	62.43	413,161.74
KRAFT FOODS GROUP INC	16,931	54.96	930,527.76
LORILLARD INC	10,690	49.59	530,117.10
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,365	69.15	232,689.75
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	5,811	81.09	471,213.99
MOLSON COORS BREWING CO -B	4,240	53.89	228,493.60
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	47,095	33.48	1,576,740.60
MONSTER BEVERAGE CORP	4,550	58.15	264,582.50
PEPSICO INC	43,271	83.35	3,606,637.85
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	45,728	88.60	4,051,500.80
REYNOLDS AMERICAN INC	9,080	50.62	459,629.60
TYSON FOODS INC-CL A	7,806	28.14	219,660.84
AVON PRODUCTS	12,793	21.99	281,318.07
CHURCH & DWIGHT CO INC	4,225	64.44	272,259.00
CLOROX COMPANY	3,246	88.64	287,725.44
COLGATE-PALMOLIVE CO	26,090	63.60	1,659,324.00
ENERGIZER HOLDINGS INC	2,061	98.54	203,090.94
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	6,630	71.51	474,111.30

HERBALIFE LTD	2,430	66.37	161,279.10
KIMBERLY-CLARK CORP	11,123	105.51	1,173,587.73
PROCTER & GAMBLE CO	76,869	80.00	6,149,520.00
ABBOTT LABORATORIES	43,447	37.25	1,618,400.75
AETNA INC	10,619	61.82	656,466.58
AMERISOURCEBERGEN CORP	6,954	65.24	453,678.96
BAXTER INTERNATIONAL INC	15,039	65.49	984,904.11
BECTON DICKINSON AND CO	5,486	105.55	579,047.30
BOSTON SCIENTIFIC CORP	41,028	11.62	476,745.36
CARDINAL HEALTH INC	9,165	54.95	503,616.75
CAREFUSION CORP	6,075	38.94	236,560.50
CERNER CORP	9,210	56.13	516,957.30
CIGNA CORP	7,940	73.90	586,766.00
COVIDIEN PLC	13,205	64.10	846,440.50
CR BARD INC	2,344	134.55	315,385.20
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	4,638	55.44	257,130.72
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	4,562	45.00	205,290.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	3,660	77.06	282,039.60
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	22,854	60.88	1,391,351.52
HCA HOLDINGS INC	6,715	46.92	315,067.80
HENRY SCHEIN INC	2,170	111.03	240,935.10
HOLOGIC INC	8,758	22.16	194,077.28
HUMANA INC	4,105	91.54	375,771.70
INTUITIVE SURGICAL INC	1,200	369.13	442,956.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,875	100.22	288,132.50
MCKESSON CORP	6,244	154.99	967,757.56
MEDTRONIC INC	28,482	57.36	1,633,727.52
OMNICARE INC	2,710	54.81	148,535.10
PATTERSON COS INC	2,042	41.58	84,906.36
QUEST DIAGNOSTICS	4,826	58.59	282,755.34
RESMED INC	3,370	49.55	166,983.50
ST JUDE MEDICAL INC	7,400	57.27	423,798.00
STRYKER CORP	8,493	74.61	633,662.73
UNITEDHEALTH GROUP INC	28,670	67.62	1,938,665.40
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	3,164	73.20	231,604.80

WELLPOINT INC	8,356	84.10	702,739.60
ZIMMER HOLDINGS INC	5,002	86.91	434,723.82
ABBVIE INC	44,577	49.30	2,197,646.10
ACTAVIS PLC	4,655	148.15	689,638.25
AGILENT TECHNOLOGIES INC	9,110	51.87	472,535.70
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	5,580	125.17	698,448.60
ALLERGAN INC	8,405	92.82	780,152.10
AMGEN INC	21,141	116.32	2,459,121.12
BIOGEN IDEC INC	6,687	252.36	1,687,531.32
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,500	66.24	231,840.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	46,011	48.77	2,243,956.47
CELGENE CORP	11,782	155.74	1,834,928.68
ELI LILLY & CO	28,453	50.66	1,441,428.98
FOREST LABORATORIES INC	6,145	47.34	290,904.30
GILEAD SCIENCES INC	42,844	69.68	2,985,369.92
HOSPIRA INC	3,921	41.37	162,211.77
ILLUMINA INC	3,745	93.29	349,371.05
JOHNSON & JOHNSON	78,771	92.09	7,254,021.39
LIFE TECHNOLOGIES CORP	4,476	75.23	336,729.48
MERCK & CO. INC.	84,833	46.54	3,948,127.82
MYLAN INC	9,655	38.43	371,041.65
PERRIGO CO	2,650	130.61	346,116.50
PFIZER INC	183,660	30.61	5,621,832.60
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,210	302.24	667,950.40
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	10,354	97.81	1,012,724.74
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	6,430	76.87	494,274.10
WATERS CORP	2,276	101.99	232,129.24
ZOETIS INC	12,480	32.47	405,225.60
BB&T CORP	20,378	34.81	709,358.18
CIT GROUP INC	5,695	49.25	280,478.75
COMERICA INC	5,130	42.72	219,153.60
FIFTH THIRD BANCORP	23,509	19.08	448,551.72
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,330	50.97	118,760.10
HUDSON CITY BANCORP INC	14,060	8.99	126,399.40
KEYCORP	26,168	12.69	332,071.92

M & T BANK CORP	3,463	112.55	389,760.65
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	13,774	16.08	221,485.92
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	10,750	14.71	158,132.50
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	15,130	75.36	1,140,196.80
REGIONS FINANCIAL CORP	37,184	9.49	352,876.16
SUNTRUST BANKS INC	15,547	33.71	524,089.37
US BANCORP	51,611	37.83	1,952,444.13
WELLS FARGO & CO	141,120	42.86	6,048,403.20
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,540	202.54	311,911.60
AMERICAN EXPRESS CO	28,124	82.61	2,323,323.64
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,650	99.56	562,514.00
BANK OF AMERICA CORPORATION	302,679	14.26	4,316,202.54
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	33,532	31.83	1,067,323.56
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	29,960	117.03	3,506,218.80
BLACKROCK INC	3,845	307.61	1,182,760.45
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	16,075	70.38	1,131,358.50
CITIGROUP INC	85,387	50.06	4,274,473.22
CME GROUP INC	9,000	76.50	688,500.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,220	51.00	725,220.00
EATON VANCE CORP	3,790	42.35	160,506.50
FRANKLIN RESOURCES INC	11,455	54.50	624,297.50
GOLDMAN SACHS GROUP INC	12,438	162.09	2,016,075.42
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	2,160	196.00	423,360.00
INVESCO LTD	11,767	32.87	386,781.29
JPMORGAN CHASE & CO	106,020	52.77	5,594,675.40
LEGG MASON INC	3,635	37.91	137,802.85
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	29.15	212,940.75
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	7,782	71.35	555,245.70
MOODY'S CORP	5,927	71.56	424,136.12
MORGAN STANLEY	42,585	29.23	1,244,759.55
NASDAQ OMX GROUP/THE	3,055	35.70	109,063.50
NORTHERN TRUST CORP	6,410	56.40	361,524.00
NYSE EURONEXT	6,790	44.59	302,766.10
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,380	45.85	154,973.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	33,014	23.56	777,809.84

SEI INVESTMENTS COMPANY	4,325	33.87	146,487.75
SLM CORP	12,552	25.73	322,962.96
STATE STREET CORP	13,247	68.74	910,598.78
T ROWE PRICE GROUP INC	6,755	75.77	511,826.35
TD AMERITRADE HOLDING CORP	5,050	27.92	140,996.00
ACE LTD	9,463	96.14	909,772.82
AFLAC INC	12,482	66.30	827,556.60
ALLEGHANY CORP	400	402.69	161,076.00
ALLSTATE CORP	13,493	53.35	719,851.55
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	39,135	51.85	2,029,149.75
AON PLC	8,427	77.54	653,429.58
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,985	57.56	229,376.60
ASSURANT INC	2,500	57.75	144,375.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,995	46.83	140,255.85
CHUBB CORP	7,373	92.20	679,790.60
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,030	50.18	252,405.40
EVEREST RE GROUP LTD	1,434	150.94	216,447.96
FIDELITY NATIONAL FINL-A	5,881	27.58	162,197.98
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	11,832	33.57	397,200.24
LINCOLN NATIONAL CORP	7,733	44.66	345,355.78
LOEWS CORP	9,315	48.81	454,665.15
MARSH & MCLENNAN COS	16,163	46.56	752,549.28
METLIFE INC	26,395	48.63	1,283,588.85
PARTNERRE LTD	1,742	93.60	163,051.20
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	7,970	46.85	373,394.50
PROGRESSIVE CORP	15,290	26.45	404,420.50
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	13,092	81.41	1,065,819.72
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,497	92.11	137,888.67
TORCHMARK CORP	2,071	73.36	151,928.56
TRAVELERS COS INC/THE	10,594	86.63	917,758.22
UNUM GROUP	7,828	31.35	245,407.80
WILLIS GROUP HOLDING	4,510	46.02	207,550.20
WR BERKLEY CORP	2,573	43.64	112,285.72
XL GROUP PLC	8,070	31.68	255,657.60
CBRE GROUP INC	8,880	23.72	210,633.60

REALOGY HOLDINGS CORP	3,160	44.16	139,545.60
ACCENTURE PLC-CL A	18,328	73.61	1,349,124.08
ACTIVISION BLIZZARD INC	13,350	17.34	231,489.00
ADOBE SYSTEMS INC	13,049	53.81	702,166.69
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	5,140	45.88	235,823.20
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,275	234.47	298,949.25
ANSYS INC	2,800	87.41	244,748.00
AUTODESK INC	6,280	39.87	250,383.60
AUTOMATIC DATA PROCESSING	13,856	75.51	1,046,266.56
CA INC	8,520	31.40	267,528.00
CITRIX SYSTEMS INC	5,648	57.98	327,471.04
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	8,369	86.68	725,424.92
COMPUTER SCIENCES CORP	4,363	51.82	226,090.66
EBAY INC	32,577	51.66	1,682,927.82
ELECTRONIC ARTS INC	9,244	24.75	228,789.00
EQUINIX INC	1,450	171.54	248,733.00
FACEBOOK INC-A	45,560	51.96	2,367,297.60
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	7,595	47.44	360,306.80
FISERV INC	4,069	106.30	432,534.70
GOOGLE INC-CL A	7,566	1,015.19	7,680,927.54
INTL BUSINESS MACHINES CORP	29,472	176.85	5,212,123.20
INTUIT INC	7,736	70.44	544,923.84
LEIDOS HOLDINGS INC	2,056	47.33	97,310.48
LINKEDIN CORP - A	2,580	240.70	621,006.00
MASTERCARD INC-CLASS A	2,960	723.78	2,142,388.80
MICROSOFT CORP	222,144	35.73	7,937,205.12
NUANCE COMMUNICATIONS INC	6,980	16.30	113,774.00
ORACLE CORP	105,343	33.15	3,492,120.45
PAYCHEX INC	9,402	43.00	404,286.00
RACKSPACE HOSTING INC	3,210	52.69	169,134.90
RED HAT INC	5,810	43.40	252,154.00
SALESFORCE.COM INC	15,720	54.56	857,683.20
SYMANTEC CORP	18,825	22.03	414,714.75
SYNOPSYS INC	4,627	36.25	167,728.75
TERADATA CORP	4,175	44.47	185,662.25

TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,506	30.04	135,360.24
VERISIGN INC	4,810	53.76	258,585.60
VISA INC-CLASS A SHARES	14,465	203.06	2,937,262.90
VMWARE INC	2,405	83.39	200,552.95
WESTERN UNION CO	15,831	19.29	305,379.99
YAHOO! INC	26,955	32.25	869,298.75
AMPHENOL CORP-CL A	4,790	81.27	389,283.30
APPLE COMPUTER INC	26,276	526.20	13,826,431.20
ARROW ELECTRONICS INC	3,110	47.43	147,507.30
AVNET INC	4,620	38.77	179,117.40
CISCO SYSTEMS INC	149,830	22.46	3,365,181.80
CORNING INC	41,608	17.35	721,898.80
DELL INC	39,196	13.84	542,472.64
EMC CORP/MASS	58,569	23.80	1,393,942.20
F5 NETWORKS INC	2,365	82.73	195,656.45
FLEXTRONICS INTL LTD	14,686	8.88	130,411.68
FLIR SYSTEMS INC	3,195	28.54	91,185.30
HARRIS CORP	3,080	59.61	183,598.80
HEWLETT-PACKARD CO	54,335	24.00	1,304,040.00
JUNIPER NETWORKS INC	13,013	18.70	243,343.10
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,605	62.99	416,048.95
NETAPP INC	9,936	39.39	391,379.04
QUALCOMM INC	47,642	68.27	3,252,519.34
SANDISK CORP	7,303	69.02	504,053.06
SEAGATE TECHNOLOGY	8,564	49.81	426,572.84
TE CONNECTIVITY LTD	11,655	53.60	624,708.00
TRIMBLE NAVIGATION LTD	7,540	29.34	221,223.60
WESTERN DIGITAL CORP	5,865	72.63	425,974.95
XEROX CORP	36,254	9.71	352,026.34
AT&T INC	150,916	35.19	5,310,734.04
CENTURYLINK INC	16,326	33.27	543,166.02
CROWN CASTLE INTL CORP	8,910	76.11	678,140.10
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	30,694	4.48	137,509.12
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	3,980	87.29	347,414.20
SPRINT CORP	28,000	6.45	180,600.00

T-MOBILE US INC	4,362	27.56	120,216.72
VERIZON COMMUNICATIONS INC	80,293	50.71	4,071,658.03
WINDSTREAM HOLDINGS INC	20,465	8.57	175,385.05
AES CORP	17,438	14.31	249,537.78
ALLIANT ENERGY CORP	3,610	52.76	190,463.60
AMEREN CORPORATION	6,522	36.48	237,922.56
AMERICAN ELECTRIC POWER	14,168	47.28	669,863.04
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,095	42.56	174,283.20
CALPINE CORP	9,640	20.92	201,668.80
CENTERPOINT ENERGY INC	11,092	24.87	275,858.04
CMS ENERGY CORP	7,820	28.03	219,194.60
CONSOLIDATED EDISON INC	8,536	58.59	500,124.24
DOMINION RESOURCES INC/VA	16,647	64.66	1,076,395.02
DTE ENERGY COMPANY	4,478	69.44	310,952.32
DUKE ENERGY CORP	19,636	72.37	1,421,057.32
EDISON INTERNATIONAL	9,159	49.41	452,546.19
ENTERGY CORP	5,187	68.27	354,116.49
EXELON CORP	24,586	27.96	687,424.56
FIRSTENERGY CORP	11,925	37.88	451,719.00
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	2,420	59.13	143,094.60
MDU RESOURCES GROUP INC	5,280	30.26	159,772.80
NEXTERA ENERGY INC	12,085	85.95	1,038,705.75
NISOURCE INC	8,025	32.32	259,368.00
NORTHEAST UTILITIES	9,690	43.41	420,642.90
NRG ENERGY INC	9,360	30.11	281,829.60
OGE ENERGY CORP	5,180	37.09	192,126.20
ONEOK INC	5,160	56.39	290,972.40
P G & E CORP	12,901	42.12	543,390.12
PEPCO HOLDINGS INC	7,192	19.50	140,244.00
PINNACLE WEST CAPITAL	3,569	58.43	208,536.67
PPL CORPORATION	17,338	30.79	533,837.02
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	15,188	34.32	521,252.16
SCANA CORP	3,443	47.62	163,955.66
SEMPRA ENERGY	6,547	91.21	597,151.87
SOUTHERN CO	24,655	42.46	1,046,851.30

	WISCONSIN ENERGY CORP	5,774	42.74	246,780.76	
	XCEL ENERGY INC	14,404	29.10	419,156.40	
	ALTERA CORPORATION	9,206	33.13	304,994.78	
	ANALOG DEVICES INC	8,741	46.75	408,641.75	
	APPLIED MATERIALS INC	32,603	17.70	577,073.10	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	6,260	45.63	285,643.80	
	BROADCOM CORP-CL A	15,346	26.41	405,287.86	
	CREE INC	3,840	60.84	233,625.60	
	INTEL CORP	138,262	24.24	3,351,470.88	
	KLA-TENCOR CORPORATION	4,819	63.88	307,837.72	
	LAM RESEARCH CORP	5,127	54.77	280,805.79	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	5,594	39.07	218,557.58	
	LSI CORP	11,795	7.79	91,883.05	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	12,624	11.96	150,983.04	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	7,570	30.10	227,857.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6,334	38.87	246,202.58	
	MICRON TECHNOLOGY INC	28,947	16.58	479,941.26	
	NVIDIA CORP	18,575	15.24	283,083.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	30,772	40.23	1,237,957.56	
	XILINX INC	7,715	44.64	344,397.60	
	米ドル小計	8,644,212		452,584,038.39 (44,154,098,785)	
加ドル	ALTAGAS LTD	3,050	38.32	116,876.00	
	ARC RESOURCES LTD	7,925	28.32	224,436.00	
	ATHABASCA OIL CORP	11,180	6.50	72,670.00	
	BAYTEX ENERGY CORP	3,375	42.65	143,943.75	
	BONAVISTA ENERGY CORP	4,985	12.71	63,359.35	
	CAMECO CORP	10,492	19.27	202,180.84	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	31,284	33.32	1,042,382.88	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	14,490	20.70	299,943.00	
	CENOVUS ENERGY INC	22,063	30.98	683,511.74	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	11,225	40.90	459,102.50	
	ENBRIDGE INC	22,405	44.33	993,213.65	
	ENCANA CORP	20,718	19.16	396,956.88	
	ENERPLUS CORP	6,630	18.12	120,135.60	

HUSKY ENERGY INC	10,659	29.82	317,851.38
IMPERIAL OIL LTD	8,212	45.96	377,423.52
KEYERA CORP	2,060	60.21	124,032.60
MEG ENERGY CORP	4,510	33.74	152,167.40
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	9,390	22.48	211,087.20
PEMBINA PIPELINE CORP	8,085	34.53	279,175.05
PENGROWTH ENERGY CORP	12,780	6.66	85,114.80
PENN WEST PETROLEUM LTD	15,493	11.77	182,352.61
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	3,680	30.80	113,344.00
SUNCOR ENERGY INC	42,055	37.66	1,583,791.30
TALISMAN ENERGY INC	30,152	12.91	389,262.32
TOURMALINE OIL CORP	4,005	41.02	164,285.10
TRANSCANADA CORP	18,973	46.96	890,972.08
VERMILION ENERGY INC	3,000	57.33	171,990.00
AGNICO EAGLE MINES LTD	5,325	32.24	171,678.00
AGRIUM INC	3,765	89.90	338,473.50
BARRICK GOLD CORP	27,474	21.07	578,877.18
ELDORADO GOLD CORP	20,510	7.27	149,107.70
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	17,260	19.25	332,255.00
FRANCO-NEVADA CORP	4,495	47.75	214,636.25
GOLDCORP INC	23,257	27.98	650,730.86
KINROSS GOLD CORP	34,515	5.44	187,761.60
NEW GOLD INC	16,160	6.58	106,332.80
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	23,017	32.61	750,584.37
SILVER WHEATON CORP	10,485	25.70	269,464.50
TECK RESOURCES LTD-CLS B	16,345	30.27	494,763.15
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	13,419	5.10	68,436.90
YAMANA GOLD INC	19,626	10.74	210,783.24
BOMBARDIER INC ' B'	34,746	5.37	186,586.02
CAE INC	6,315	11.83	74,706.45
FINNING INTERNATIONAL INC	4,625	23.88	110,445.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	4,385	43.84	192,238.40
CANADIAN NATL RAILWAY CO	11,644	115.18	1,341,155.92
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	4,925	150.04	738,947.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	6,089	88.48	538,754.72

GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,920	50.28	197,097.60
TIM HORTONS INC	4,585	63.81	292,568.85
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	10,695	24.67	263,845.65
THOMSON REUTERS CORP	11,524	36.97	426,042.28
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,040	97.86	199,634.40
DOLLARAMA INC	2,360	88.95	209,922.00
ALIMENTATION COUCHE SUB VTG	3,810	70.15	267,271.50
EMPIRE CO LTD 'A'	1,000	76.98	76,980.00
LOBLAW COMPANIES LTD	3,849	47.77	183,866.73
METRO INC	3,090	65.80	203,322.00
SHOPPERS DRUG MART INC	5,365	61.09	327,747.85
WESTON (GEORGE) LTD	1,572	85.16	133,871.52
SAPUTO INC	3,520	51.82	182,406.40
CATAMARAN CORP	5,730	51.35	294,235.50
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	8,534	117.60	1,003,598.40
BANK OF MONTREAL	18,041	72.93	1,315,730.13
BANK OF NOVA SCOTIA	33,629	62.39	2,098,113.31
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	11,005	86.79	955,123.95
NATIONAL BANK OF CANADA	4,550	89.39	406,724.50
ROYAL BANK OF CANADA	40,339	69.45	2,801,543.55
TORONTO-DOMINION BANK	25,650	94.10	2,413,665.00
CI FINANCIAL CORP	3,410	33.36	113,757.60
IGM FINANCIAL INC	2,535	49.37	125,152.95
ONEX CORPORATION	1,905	54.50	103,822.50
GREAT-WEST LIFE CO INC	9,334	30.98	289,167.32
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	2,905	45.25	131,451.25
INTACT FINANCIAL CORP	4,025	65.32	262,913.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	52,821	18.07	954,475.47
POWER CORP OF CANADA	10,160	29.35	298,196.00
POWER FINANCIAL CORP	7,645	33.13	253,278.85
SUN LIFE FINANCIAL INC	15,704	34.66	544,300.64
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	15,782	42.54	671,366.28
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES CORP	8,664	19.67	170,420.88
CGI GROUP INC - CL A	5,870	35.59	208,913.30
OPEN TEXT CORPORATION	1,535	81.38	124,918.30

	BLACKBERRY LTD	13,928	8.60	119,780.80	
	BCE INC	7,900	45.23	357,317.00	
	BELL ALIANT INC	1,680	27.01	45,376.80	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	10,405	46.78	486,745.90	
	TELUS CORP	5,976	36.84	220,155.84	
	ATCO LTD -CLASS I	1,920	48.47	93,062.40	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,590	38.08	98,627.20	
	FORTIS INC	4,785	32.71	156,517.35	
	TRANSALTA CORP	7,950	14.31	113,764.50	
加ドル小計		1,055,495		37,765,073.36 (3,528,768,454)	
ユーロ	CGG	4,720	16.65	78,588.00	
	ENI SPA	70,946	17.90	1,269,933.40	
	FUGRO NV-CVA	1,660	45.41	75,388.90	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	9,315	12.50	116,437.50	
	NESTE OIL OYJ	3,590	15.26	54,783.40	
	OMV AG	3,490	34.84	121,591.60	
	REPSOL SA	25,171	19.15	482,150.50	
	SAIPEM SPA	8,980	15.48	139,010.40	
	TECHNIP SA	3,008	89.68	269,757.44	
	TENARIS SA	14,025	17.34	243,193.50	
	TOTAL SA	59,787	44.57	2,665,005.52	
	VOPAK	2,440	45.95	112,118.00	
	AIR LIQUIDE	8,676	101.80	883,216.80	
	AKZO NOBEL NV	7,208	51.31	369,842.48	
	ARCELORMITTAL	30,061	11.67	350,962.17	
	ARKEMA	2,005	83.90	168,219.50	
	BASF SE	25,645	75.17	1,927,734.65	
	CRH PLC	20,670	17.73	366,479.10	
	FUCHS PETROLUB SE-PRF	860	62.05	53,363.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	3,965	57.35	227,392.75	
	IMERYS SA	910	55.80	50,778.00	
	K+S AG	5,420	18.64	101,028.80	
	KONINKLIJKE DSM NV	4,382	55.64	243,814.48	
	LAFARGE SA	5,258	50.26	264,267.08	

LANXESS AG	2,765	51.63	142,756.95
LINDE AG	5,265	145.45	765,794.25
SOLVAY ET CIE SA -A	1,711	116.10	198,647.10
STORA ENSO OYJ-R SHS	12,085	6.68	80,727.80
THYSSENKRUPP AG	9,395	19.00	178,505.00
UMICORE	3,460	36.21	125,303.90
UPM-KYMMENE OYJ	12,618	11.28	142,331.04
VOESTALPINE AG	2,509	34.92	87,614.28
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	5,146	24.00	123,504.00
ALSTOM	5,800	27.29	158,282.00
ANDRITZ AG	1,980	43.40	85,932.00
BOSKALIS WESTMINSTER	1,695	34.70	58,816.50
BOUYGUES SA	4,210	29.30	123,353.00
BRENTAG AG	1,465	122.75	179,828.75
CNH INDUSTRIAL NV	24,730	8.93	220,838.90
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	10,846	39.68	430,423.51
EADS NV	15,928	49.04	781,109.12
FERROVIAL SA	13,715	13.93	191,049.95
FINMECCANICA SPA	9,630	5.54	53,398.35
GEA GROUP AG	5,040	31.85	160,549.20
HOCHTIEF AG	1,045	65.39	68,332.55
KONE OYJ-B	4,497	63.75	286,683.75
KONINKLIJKE PHILIPS NV	25,861	25.74	665,662.14
LEGRAND SA	7,428	41.29	306,739.26
MAN SE	1,054	88.75	93,542.50
METSO OYJ	3,260	28.12	91,671.20
OCI NV	2,300	28.11	64,664.50
OSRAM LICHT AG	2,332	37.75	88,033.00
PRYSMIAN SPA	5,635	18.04	101,655.40
REXEL SA	4,200	18.20	76,461.00
SAFRAN SA	6,190	46.86	290,094.35
SCHNEIDER ELECTRIC SA	14,718	62.58	921,052.44
SIEMENS AG-REG	22,146	93.85	2,078,402.10
THALES SA	2,345	44.26	103,789.70
VALLOUREC	3,345	42.90	143,517.22

VINCI SA	13,550	48.11	651,890.50
WARTSILA OYJ	4,810	32.80	157,768.00
ZARDOYA OTIS SA	5,219	12.55	65,498.45
ZODIAC AEROSPACE	910	119.50	108,745.00
BUREAU VERITAS SA	7,080	21.91	155,122.80
EDENRED	6,096	24.47	149,169.12
RANDSTAD HOLDING NV	2,865	43.74	125,329.42
SOCIETE BIC SA	735	90.92	66,826.20
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	10,531	15.90	167,495.55
ADP	970	79.20	76,824.00
ATLANTIA SPA	12,070	16.39	197,827.30
DEUTCHE LUFTHANSA	7,870	14.47	113,878.90
DEUTSCHE POST AG	25,023	25.04	626,575.92
FRAPORT AG	980	56.95	55,811.00
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	17,530	7.11	124,796.07
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	31,722	4.10	130,060.20
RYANAIR HOLDINGS PLC	2,835	6.16	17,463.60
TNT EXPRESS NV	9,060	6.80	61,608.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	9,285	83.66	776,783.10
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,650	62.61	103,306.50
CONTINENTAL AG	3,055	136.20	416,091.00
DAIMLER AG	27,052	59.99	1,622,849.48
FIAT SPA	26,775	5.93	158,775.75
MICHELIN (CGDE)-B	4,749	80.42	381,914.58
NOKIAN RENKAAT OYJ	2,915	35.90	104,648.50
PIRELLI & C.	5,506	10.48	57,702.88
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	4,500	65.25	293,625.00
RENAULT SA	5,577	66.11	368,695.47
VOLKSWAGEN AG	771	170.40	131,378.40
VOLKSWAGEN AG-PFD	4,133	176.50	729,474.50
ADIDAS AG	5,881	84.20	495,180.20
CHRISTIAN DIOR	1,420	140.15	199,013.00
HUGO BOSS AG -ORD	900	93.45	84,105.00
KERING	2,037	167.40	340,993.80
LUXOTTICA GROUP SPA	3,976	36.90	146,714.40

LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	7,069	139.15	983,651.35
ACCOR SA	3,686	33.61	123,904.89
SODEXO	2,850	71.81	204,658.50
AXEL SPRINGER AG	995	44.57	44,347.15
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	21.97	83,395.12
JC DECAUX SA .	1,910	29.30	55,963.00
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	870	91.92	79,970.40
LAGARDERE S. C. A.	2,980	26.66	79,461.70
PROSIEBEN SAT. 1 MEDIA AG-REG	2,855	35.22	100,553.10
PUBLICIS GROUPE	4,725	60.65	286,571.25
REED ELSEVIER NV	20,248	14.76	298,860.48
SES	9,570	21.15	202,453.35
TELENET GROUP HOLDING NV	1,440	40.00	57,600.00
WOLTERS KLUWER	7,557	20.22	152,840.32
INDITEX	6,475	118.35	766,316.25
CARREFOUR SA	16,343	27.20	444,529.60
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,344	83.04	111,605.76
COLRUYT SA	2,035	41.80	85,073.17
DELHAIZE GROUP	2,426	45.94	111,450.44
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	16,598	6.74	111,920.31
JERONIMO MARTINS	7,685	14.33	110,126.05
KESKO OYJ-B SHS	2,230	23.93	53,363.90
KONINKLIJKE AHOLD NV	29,474	13.84	408,067.53
METRO AG	3,260	34.95	113,937.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	22,591	75.70	1,710,138.70
DANONE	15,914	55.30	880,044.20
HEINEKEN HOLDING NV	2,595	46.60	120,927.00
HEINEKEN NV	6,333	50.63	320,639.79
KERRY GROUP PLC-A	4,610	45.58	210,123.80
PERNOD-RICARD SA	6,076	86.48	525,452.48
REMY COINTREAU	780	72.60	56,628.00
SUEDZUCKER AG	2,400	23.89	57,336.00
UNILEVER NV-CVA	45,435	28.75	1,306,256.25
BEIERSDORF AG	3,205	69.52	222,811.60
HENKEL AG & CO KGAA	3,880	66.71	258,834.80

HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	4,983	77.00	383,691.00	
L' OREAL	6,816	127.65	870,062.40	
CELESIO AG	2,150	22.90	49,235.00	
ESSILOR INTERNATIONAL	5,685	77.16	438,654.60	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	6,463	49.10	317,333.30	
FRESENIUS SE & CO KGAA	3,495	94.04	328,669.80	
BAYER AG	23,240	91.20	2,119,488.00	
ELAN CORP PLC	11,000	11.62	127,875.00	
GRIFOLS SA	4,680	29.04	135,907.20	
MERCK KGAA	1,985	121.50	241,177.50	
ORION OYJ-CLASS B	2,590	19.40	50,246.00	
QIAGEN N. V.	7,635	15.85	121,052.92	
SANOFI	33,406	75.21	2,512,465.26	
UCB SA	2,798	46.94	131,338.12	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	153,605	0.21	32,625.70	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	154,213	8.85	1,364,785.05	
BANCO DE SABADELL SA	84,048	1.85	155,572.84	
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	21,145	0.90	19,199.66	
BANCO POPULAR ESPANOL	29,339	4.04	118,646.91	
BANCO SANTANDER SA	309,437	6.53	2,020,623.61	
BANK OF IRELAND	558,550	0.26	146,898.65	
BANKIA SA	65,000	1.13	73,645.00	
BNP PARIBAS	28,052	53.35	1,496,574.20	
CAIXABANK S. A	26,440	3.74	99,070.68	
COMMERZBANK AG	26,244	9.54	250,525.22	
CREDIT AGRICOLE SA	29,942	8.84	264,926.81	
ERSTE GROUP BANK AG	7,118	24.35	173,323.30	
INTESA SANPAOLO	338,003	1.80	608,405.40	
KBC GROEP NV	6,119	38.11	233,225.68	
NATIXIS	32,490	3.92	127,555.74	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	1,470	25.81	37,940.70	
SOCIETE GENERALE	20,319	40.90	831,047.10	
UBI BANCA SCPA	28,684	4.86	139,576.34	
UNICREDIT SPA	120,043	5.30	636,227.90	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	28,395	36.08	1,024,633.57	

DEUTSCHE BOERSE AG	5,790	58.09	336,341.10
EURAZEO	1,159	54.85	63,571.15
EXOR SPA	1,714	29.37	50,340.18
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,882	65.20	122,706.40
ING GROEP NV-CVA	107,445	9.35	1,005,147.97
MEDIOBANCA SPA	16,140	6.33	102,166.20
POHJOLA BANK PLC	3,875	12.74	49,367.50
WENDEL	1,050	101.70	106,785.00
AEGON NV	53,099	5.81	308,876.88
AGEAS	7,014	31.48	220,835.79
ALLIANZ SE-REG	12,758	123.60	1,576,888.80
ASSICURAZIONI GENERALI	34,528	16.96	585,594.88
AXA	50,422	18.27	921,209.94
CNP ASSURANCES	3,530	13.21	46,631.30
DELTA LLOYD NV	3,600	15.50	55,800.00
HANNOVER RUECK SE-REG	1,845	58.93	108,725.85
MAPFRE SA	26,034	2.94	76,539.96
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,086	151.85	772,309.10
SAMPO OYJ-A SHS	11,829	34.89	412,713.81
SCOR SE	5,322	25.69	136,722.18
VIENNA INSURANCE GROUP	1,410	39.10	55,138.05
IMMOEAST AG-TEMPORARY	16,150	—	—
IMMOFINANZ AG	25,580	3.24	82,955.94
IMMOFINANZ AG-TEMPORARY	13,000	—	—
AMADEUS IT HOLDING SA	10,060	27.21	273,732.60
ATOS	1,650	59.82	98,703.00
CAP GEMINI SA	4,079	46.91	191,366.28
DASSAULT SYSTEMES SA	1,765	86.69	153,007.85
SAP AG-COMMON	25,892	57.62	1,491,897.04
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,570	29.64	105,832.65
GEMALTO	2,370	82.96	196,615.20
NOKIA OYJ	110,656	5.09	563,792.32
BELGACOM SA	3,780	21.00	79,380.00
DEUTSCHE TELEKOM AG	80,466	11.35	913,691.43
ELISA OYJ	4,205	18.10	76,110.50

	ILIAD SA	730	173.40	126,582.00	
	KONINKLIJKE KPN NV	80,906	2.30	186,083.80	
	ORANGE S. A.	54,164	10.14	549,493.78	
	PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	15,833	3.34	52,961.38	
	TELECOM ITALIA SPA	277,303	0.67	186,347.61	
	TELECOM ITALIA-RSP	189,867	0.53	100,629.51	
	TELEFONICA SA	114,208	12.71	1,451,583.68	
	TELEKOM AUSTRIA AG	6,570	5.91	38,854.98	
	VIVENDI	34,590	18.77	649,254.30	
	ZIGGO NV	4,030	31.05	125,151.65	
	ACCIONA SA	566	46.18	26,140.71	
	E.ON SE	48,869	13.42	655,821.98	
	EDF	6,885	25.47	175,395.37	
	ENAGAS	4,190	19.34	81,055.55	
	ENEL GREEN POWER SPA	43,650	1.71	74,641.50	
	ENEL SPA	193,554	3.19	618,211.47	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	49,221	2.67	131,420.07	
	FORTUM OYJ	14,195	16.28	231,094.60	
	GAS NATURAL SDG SA	10,732	17.32	185,878.24	
	GDF SUEZ	37,654	18.43	694,151.49	
	IBERDROLA SA	129,702	4.48	581,194.66	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	3,040	45.70	138,928.00	
	RWE AG	14,235	26.94	383,562.07	
	RWE AG-NON VTG PFD	1,060	24.92	26,420.50	
	SNAM SPA	47,520	3.77	179,150.40	
	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	8,549	12.78	109,256.22	
	TERNA SPA	43,127	3.54	152,669.58	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	9,184	12.98	119,208.32	
	VERBUND AG	2,370	16.99	40,266.30	
	ASML HOLDING NV	10,312	67.93	700,494.16	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	29,335	6.93	203,496.89	
	STMICROELECTRONICS NV	16,783	5.56	93,347.04	
ユーロ小計		5,468,089		78,600,349.33 (10,594,541,086)	
英ポンド	AMEC PLC	8,850	11.64	103,014.00	

BG GROUP PLC	94,934	12.54	1,190,947.03
BP PLC	530,838	4.51	2,394,875.63
PETROFAC LTD	6,995	14.71	102,896.45
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	105,298	21.29	2,242,320.91
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	71,474	22.37	1,599,230.75
TULLOW OIL PLC	25,600	9.78	250,496.00
ANGLO AMERICAN PLC	40,424	15.08	609,593.92
ANTOFAGASTA PLC	11,360	8.75	99,456.80
BHP BILLITON PLC	58,921	19.53	1,150,727.13
CRODA INTERNATIONAL PLC	3,900	25.97	101,283.00
FRESNILLO PLC	5,160	10.37	53,509.20
GLENCORE XSTRATA PLC	290,583	3.42	995,246.77
JOHNSON MATTHEY PLC	5,517	29.58	163,192.86
RANDGOLD RESOURCES LTD	2,250	46.39	104,377.50
REXAM PLC	22,222	5.11	113,554.42
RIO TINTO PLC	35,445	32.22	1,142,215.12
VEDANTA RESOURCES PLC	2,850	10.68	30,438.00
BAE SYSTEMS PLC ORD	88,785	4.51	401,041.84
BUNZL PLC	10,376	13.57	140,802.32
COBHAM PLC	34,695	2.82	98,152.15
IMI PLC	9,210	15.09	138,978.90
INVENSYS PLC	21,664	5.04	109,294.88
MEGGITT PLC	20,865	5.61	117,156.97
MELROSE INDUSTRIES PLC	40,000	3.15	126,160.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS -PRF C(N)	4,548,970	0.00	4,548.97
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	52,895	11.71	619,400.45
SMITHS GROUP PLC	11,363	14.15	160,786.45
TRAVIS PERKINS PLC	6,600	18.04	119,064.00
WEIR GROUP PLC/THE	6,800	23.18	157,624.00
WOLSELEY PLC	7,414	33.01	244,736.14
AGGREKO PLC	8,361	15.17	126,836.37
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	9,775	12.48	121,992.00
CAPITA PLC	18,349	9.66	177,343.08
EXPERIAN PLC	29,558	12.21	360,903.18
G4S PLC	42,539	2.58	109,963.31

INTERTEK GROUP PLC	4,815	33.09	159,328.35
SERCO GROUP PLC	14,965	5.57	83,429.87
EASYJET PLC	3,840	13.29	51,033.60
GKN PLC	44,825	3.72	166,838.65
BURBERRY GROUP PLC	13,234	15.32	202,744.88
PERSIMMON PLC	8,190	12.43	101,801.70
CARNIVAL PLC	5,300	22.07	116,971.00
COMPASS GROUP PLC	50,618	9.07	459,105.26
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	8,369	18.65	156,081.85
TUI TRAVEL PLC	14,295	3.85	55,064.34
WHITBREAD PLC	5,510	33.72	185,797.20
WILLIAM HILL PLC	23,300	3.91	91,196.20
BRITISH SKY BROADCASTING GRO	28,404	9.28	263,731.14
ITV PLC	119,005	1.91	228,251.59
PEARSON PLC	23,069	13.64	314,661.16
REED ELSEVIER PLC	32,106	8.66	278,198.49
WPP PLC	34,754	13.44	467,093.76
KINGFISHER PLC	62,157	3.70	230,043.05
MARKS & SPENCER GROUP PLC	47,910	4.75	227,955.78
NEXT PLC	4,477	52.05	233,027.85
SAINSBURY (J) PLC	34,011	3.96	134,955.64
TESCO PLC	225,054	3.70	833,037.38
WM MORRISON SUPERMARKETS	59,995	2.82	169,185.90
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	10,125	21.33	215,966.25
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	53,587	34.15	1,829,996.05
COCA-COLA HBC AG-CDI	5,000	18.13	90,650.00
DIAGEO PLC	70,122	20.17	1,414,711.35
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	27,812	23.41	651,078.92
SABMILLER PLC	27,261	32.50	885,982.50
TATE & LYLE PLC	12,180	7.91	96,343.80
UNILEVER PLC	35,767	24.93	891,671.31
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	18,065	47.80	863,507.00
SMITH & NEPHEW PLC	26,646	7.98	212,635.08
ASTRAZENECA PLC	34,923	32.48	1,134,473.65
GLAXOSMITHKLINE PLC	138,271	16.04	2,218,558.19

	SHIRE PLC	15,145	27.76	420,425.20	
	BARCLAYS PLC	425,121	2.67	1,138,899.15	
	HSBC HOLDINGS PLC	522,441	6.80	3,552,598.80	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,301,366	0.80	1,045,907.85	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	57,230	3.68	210,835.32	
	STANDARD CHARTERED PLC	67,489	15.25	1,029,544.69	
	3I GROUP PLC	29,809	3.63	108,355.71	
	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	22,730	4.59	104,353.43	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,720	11.55	66,066.00	
	ICAP PLC	18,640	3.75	70,049.12	
	INVESTEC PLC	13,185	4.41	58,145.85	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	4,068	16.82	68,423.76	
	SCHRODERS PLC	2,231	26.88	59,969.28	
	ADMIRAL GROUP PLC	4,925	12.40	61,070.00	
	AVIVA PLC	87,890	4.38	385,485.54	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	19,560	2.24	43,912.20	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	168,571	2.12	358,887.65	
	OLD MUTUAL PLC	143,879	2.04	294,376.43	
	PRUDENTIAL PLC	72,802	12.70	924,585.40	
	RESOLUTION LTD	37,353	3.48	130,100.49	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	89,957	1.26	114,065.47	
	STANDARD LIFE PLC	70,055	3.66	256,821.63	
	SAGE GROUP PLC/THE	27,620	3.31	91,670.78	
	BT GROUP PLC	226,482	3.59	813,296.86	
	INMARSAT PLC	10,010	7.25	72,572.50	
	VODAFONE GROUP PLC	1,371,665	2.26	3,110,250.38	
	CENTRICA PLC	149,625	3.56	532,814.62	
	NATIONAL GRID PLC	102,105	7.82	798,461.10	
	SEVERN TRENT PLC	6,283	18.81	118,183.23	
	SSE PLC	27,917	14.40	402,004.80	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	21,925	7.18	157,531.12	
	ARM HOLDINGS PLC	37,080	9.83	364,496.40	
英ボンド小計		12,779,681		48,461,430.00 (7,651,090,568)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	10,745	43.84	471,060.80	

EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	240	328.50	78,840.00
GIVAUDAN-REG	258	1,282.00	330,756.00
HOLCIM LTD-REG	6,583	66.60	438,427.80
SIKA AG-BR	67	2,701.00	180,967.00
SYNGENTA AG-REG	2,598	367.70	955,284.60
ABB LTD-REG	61,265	23.10	1,415,221.50
GEBERIT AG-REG	1,125	251.80	283,275.00
SCHINDLER HOLDING AG-REG	780	127.40	99,372.00
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,490	127.10	189,379.00
SULZER AG-REG	520	137.20	71,344.00
ADECCO SA-REG	3,557	65.75	233,872.75
SGS SA-REG	168	2,138.00	359,184.00
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,550	114.50	177,475.00
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	14,849	92.45	1,372,790.05
SWATCH GROUP AG/THE-BR	830	579.50	480,985.00
SWATCH GROUP AG/THE-REG	930	100.30	93,279.00
ARYZTA AG	2,630	67.30	176,999.00
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	25	3,845.00	96,125.00
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	3	45,630.00	136,890.00
NESTLE SA-REG	90,223	65.55	5,914,117.65
SONOVA HOLDING AG-REG	1,510	117.10	176,821.00
ACTELION LTD-REG	2,560	69.15	177,024.00
LONZA GROUP AG-REG	1,650	78.70	129,855.00
NOVARTIS AG-REG	64,333	70.35	4,525,826.55
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	19,718	248.70	4,903,866.60
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	41,718	28.77	1,200,226.86
JULIUS BAER GROUP LTD	6,780	44.40	301,032.00
PARGESA HOLDING SA-BR	975	71.25	69,468.75
PARTNERS GROUP HOLDIING AG	500	230.10	115,050.00
UBS AG-REG	102,062	18.92	1,931,013.04
BALOISE HOLDING AG - REG	1,390	106.20	147,618.00
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	850	183.50	155,975.00
SWISS RE AG	9,779	79.50	777,430.50
ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,011	247.20	991,519.20
SWISS PRIME SITE-REG	1,370	70.30	96,311.00

	SWISSCOM AG-REG	634	460.50	291,957.00	
スイスフラン小計		460,276		29,546,639.65 (3,230,038,646)	
スウェーデン ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	6,180	138.50	855,930.00	
	BOLIDEN AB	7,620	96.10	732,282.00	
	ALFA LAVAL AB	7,470	156.90	1,172,043.00	
	ASSA ABLOY AB-B	9,660	300.30	2,900,898.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	17,995	184.70	3,323,676.50	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	11,280	166.80	1,881,504.00	
	SANDVIK AB	30,250	89.55	2,708,887.50	
	SCANIA AB-B SHS	8,560	133.90	1,146,184.00	
	SKANSKA AB-B SHS	10,520	124.90	1,313,948.00	
	SKF AB-B SHS	10,209	173.40	1,770,240.60	
	VOLVO AB-B SHARES	44,630	88.10	3,931,903.00	
	SECURITAS AB-B SHS	7,249	74.75	541,862.75	
	ELECTROLUX AB - B	6,765	162.80	1,101,342.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	8,480	38.70	328,176.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	26,248	279.20	7,328,441.60	
	SWEDISH MATCH AB	6,530	229.70	1,499,941.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	17,395	181.30	3,153,713.50	
	ELEKTA AB-B SHS	10,440	97.30	1,015,812.00	
	GETINGE AB-B SHS	5,730	207.00	1,186,110.00	
	NORDEA BANK AB	76,178	83.00	6,322,774.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	44,630	78.70	3,512,381.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	13,930	288.90	4,024,377.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	24,570	170.10	4,179,357.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,630	118.90	312,707.00	
	INVESTOR AB-B SHS	11,795	211.90	2,499,360.50	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	6,715	241.60	1,622,344.00	
	RATOS AB-B SHS	4,110	58.90	242,079.00	
	ERICSSON LM-B SHS	87,385	78.00	6,816,030.00	
HEXAGON AB-B SHS	6,960	198.60	1,382,256.00		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,370	612.50	839,125.00		
TELE2 AB-B SHS	8,705	78.55	683,777.75		
TELIASONERA AB	65,210	53.50	3,488,735.00		

スウェーデンクローナ小計		607,399		73,818,198.70 (1,141,229,351)
ノルウェークローネ	AKER SOLUTIONS ASA	4,430	81.75	362,152.50
	SEADRILL LTD	9,735	276.20	2,688,807.00
	STATOIL ASA	32,894	142.80	4,697,263.20
	SUBSEA 7 SA	7,505	130.80	981,654.00
	NORSK HYDRO A S	20,410	26.81	547,192.10
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,560	254.30	1,159,608.00
	ORKLA ASA	19,380	46.72	905,433.60
	DNB ASA	28,595	105.80	3,025,351.00
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,200	111.40	467,880.00
	TELENOR ASA	19,875	150.60	2,993,175.00
ノルウェークローネ小計		151,584		17,828,516.40 (295,418,516)
デンマーククローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	13	50,450.00	655,850.00
	A P MOLLER - MAERSK A/S - B	33	53,950.00	1,780,350.00
	DSV A/S	5,060	158.90	804,034.00
	CARLSBERG AS-B	3,360	566.00	1,901,760.00
	COLOPLAST-B	3,385	321.60	1,088,616.00
	WILLIAM DEMANT HOLDING	600	532.00	319,200.00
	NOVO NORDISK A/S-B	11,125	980.50	10,908,062.50
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,645	216.30	1,221,013.50
	DANSKE BANK A/S	20,135	127.40	2,565,199.00
	TRYG A/S	615	523.00	321,645.00
	TDC A/S	14,545	49.92	726,086.40
デンマーククローネ小計		64,516		22,291,816.40 (402,813,122)
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	4,575	18.96	86,742.00
	ORIGIN ENERGY LTD	30,980	14.65	453,857.00
	SANTOS LTD	28,415	14.76	419,405.40
	WHITEHAVEN COAL LTD	15,000	1.77	26,550.00
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	18,488	38.45	710,863.60
	WORLEYPARSONS LTD	4,340	22.50	97,650.00
	ALUMINA LTD	68,742	1.03	70,804.26
	AMCOR LIMITED	35,520	10.67	378,998.40

BHP BILLITON LTD	89,736	37.41	3,357,023.76
BORAL LTD	17,115	4.92	84,205.80
FORTESCUE METALS GROUP LTD	46,275	5.21	241,092.75
ILUKA RESOURCES LTD	12,115	9.98	120,907.70
INCITEC PIVOT LTD	53,090	2.64	140,157.60
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	13,935	10.62	147,989.70
NEWCREST MINING LTD	20,969	10.99	230,449.31
ORICA LIMITED	10,785	21.04	226,916.40
RIO TINTO LTD	12,648	63.77	806,562.96
LEIGHTON HOLDINGS LTD	3,517	17.73	62,356.41
ALS LTD	8,301	10.09	83,757.09
BRAMBLES LTD	45,708	9.46	432,397.68
SEEK LTD	8,040	12.81	102,992.40
ASCIANO LTD	24,833	5.90	146,514.70
AURIZON HOLDINGS LTD	59,950	4.77	285,961.50
QANTAS AIRWAYS LTD	34,245	1.29	44,347.27
SYDNEY AIRPORT	5,340	4.09	21,840.60
TOLL HOLDINGS LTD	16,805	5.80	97,469.00
TRANSURBAN GROUP	35,045	7.14	250,221.30
CROWN LTD	10,705	16.79	179,736.95
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	17,212	2.65	45,611.80
FLIGHT CENTRE LTD	1,640	50.99	83,623.60
TABCORP HOLDINGS LTD	23,977	3.54	84,878.58
TATTS GROUP LTD	42,460	3.09	131,201.40
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	15,840	3.21	50,846.40
METCASH LTD	18,890	3.21	60,636.90
WESFARMERS LTD	27,930	42.02	1,173,618.60
WOOLWORTHS LTD	34,062	34.49	1,174,798.38
COCA-COLA AMATIL LTD	15,150	12.90	195,435.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	21,730	4.53	98,436.90
COCHLEAR LTD	1,277	58.55	74,768.35
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,935	38.80	113,878.00
SONIC HEALTHCARE LTD	9,830	15.91	156,395.30
CSL LTD	14,332	66.47	952,648.04
AUST AND NZ BANKING GROUP	76,589	32.66	2,501,396.74

	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	10,478	11.08	116,096.24	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	45,047	76.28	3,436,185.16	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	65,383	36.08	2,359,018.64	
	WESTPAC BANKING CORP	86,681	34.36	2,978,359.16	
	ASX LTD	4,995	36.51	182,367.45	
	MACQUARIE GROUP LTD	8,026	51.20	410,931.20	
	AMP LTD	86,217	4.80	413,841.60	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	59,878	5.82	348,489.96	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	36,130	14.32	517,381.60	
	SUNCORP GROUP LTD	38,450	13.13	504,848.50	
	COMPUTERSHARE LTD	11,490	10.45	120,070.50	
	TELSTRA CORPORATION LTD	122,744	5.07	622,312.08	
	AGL ENERGY LTD	16,671	15.40	256,733.40	
	SP AUSNET	49,750	1.21	60,446.25	
豪ドル小計		1,701,011		28,533,027.27 (2,673,829,985)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	23,390	9.60	224,544.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	30,950	3.43	106,313.25	
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	19,990	3.86	77,161.40	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	55,837	2.31	129,262.65	
	CONTACT ENERGY LIMITED	9,430	5.20	49,036.00	
ニュージーランドドル小計		139,597		586,317.30 (47,479,974)	
香港ドル	HOPEWELL HOLDINGS	16,000	25.70	411,200.00	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	61,823	95.10	5,879,367.30	
	NWS HOLDINGS LTD	48,500	11.68	566,480.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	37,000	15.12	559,440.00	
	MTR CORP	39,500	29.50	1,165,250.00	
	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	6,000	39.70	238,200.00	
	LI & FUNG LTD	182,000	10.64	1,936,480.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	24,500	20.90	512,050.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	57,000	59.75	3,405,750.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	28,000	27.80	778,400.00	
	SANDS CHINA LTD	68,600	57.35	3,934,210.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	48,000	13.94	669,120.00	

	SJM HOLDINGS LTD	57,000	25.45	1,450,650.00	
	WYNN MACAU LTD	44,600	29.35	1,309,010.00	
	BANK OF EAST ASIA	36,440	32.35	1,178,834.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	109,000	24.75	2,697,750.00	
	HANG SENG BANK LTD	23,500	127.20	2,989,200.00	
	FIRST PACIFIC CO	74,250	8.70	645,975.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	31,400	123.80	3,887,320.00	
	AIA GROUP LTD	335,800	38.75	13,012,250.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	39,682	119.70	4,749,935.40	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	57,000	24.90	1,419,300.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	30,168	45.80	1,381,694.40	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	22,000	35.95	790,900.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	16,950	33.20	562,740.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	131,000	10.72	1,404,320.00	
	SINO LAND CO	63,050	10.64	670,852.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	45,480	100.50	4,570,740.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	18,017	89.65	1,615,224.05	
	SWIRE PROPERTIES LTD	39,400	20.85	821,490.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	43,800	66.65	2,919,270.00	
	WHEELOCK & CO LTD	29,600	39.15	1,158,840.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	19,000	33.55	637,450.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	67,000	7.20	482,400.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	15,000	53.15	797,250.00	
	CLP HOLDINGS LTD	53,000	61.45	3,256,850.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	173,438	18.00	3,121,884.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS	37,500	65.15	2,443,125.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	75.00	487,500.00	
	香港ドル小計	2,236,498		80,518,701.15 (1,012,925,260)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	43,660	10.87	474,584.20	
	NOBLE GROUP LTD	141,854	1.05	148,946.70	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	32,000	5.33	170,560.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	27,000	4.57	123,390.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,000	4.16	137,280.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	42,010	1.18	49,571.80	

	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,000	1.91	88,090.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	15,800	10.48	165,584.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	172,000	1.49	257,140.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	55,050	4.25	233,962.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,000	36.08	72,160.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	47,000	1.55	72,850.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	220,000	0.55	122,100.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	53,000	3.45	182,850.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	47,215	16.60	783,769.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	67,240	10.40	699,296.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	37,700	20.79	783,783.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	28,000	7.41	207,480.00	
	CAPITALAND LTD	71,000	3.13	222,230.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	29,880	2.06	61,552.80	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	13,000	10.45	135,850.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	60,000	3.09	185,400.00	
	KEPPEL LAND LTD	18,000	3.67	66,060.00	
	UOL GROUP LTD	12,250	6.39	78,277.50	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	220,280	3.73	821,644.40	
シンガポールドル小計		1,534,939		6,344,411.90 (500,954,763)	
イスラエルシ ケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	9,770	28.37	277,174.90	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	78	1,726.00	134,628.00	
	TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	22,840	146.30	3,341,492.00	
	BANK HAPOALIM BM	27,725	18.40	510,140.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	29,355	13.34	391,595.70	
	NICE SYSTEMS LTD	1,825	147.10	268,457.50	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	68,880	6.25	430,500.00	
イスラエルシケル小計		160,473		5,353,988.10 (147,930,691)	
合 計		35,003,770		75,381,119,201 (75,381,119,201)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	11,760	282,828.00	
		AMERICAN TOWER CORP	11,209	905,911.38	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	24,910	302,905.60	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,475	456,858.25	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,117	451,387.88	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,200	143,154.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,735	216,293.85	
		DUKE REALTY CORPORATION	6,875	118,181.25	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	8,890	488,149.90	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,825	195,603.50	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	11,315	241,462.10	
		HCP INC	12,455	536,187.75	
		HEALTH CARE REIT INC	8,180	543,724.60	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	21,749	408,446.22	
		KIMCO REALTY CORPORATION	11,985	258,995.85	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	118,667.56	
		PLUM CREEK TIMBER CO	4,548	226,990.68	
		PROLOGIS INC	13,432	549,637.44	
		PUBLIC STORAGE	4,239	738,688.14	
		RAYONIER INC	3,507	164,758.86	
		REALTY INCOME CORP	5,400	232,092.00	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	2,805	149,478.45	
		SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	8,734	1,394,819.80	
		SL GREEN REALTY CORP	2,650	259,938.50	
THE MACERICH COMPANY	4,370	261,151.20			
UDR INC	7,800	195,702.00			
VENTAS INC	8,095	545,036.35			
VORNADO REALTY TRUST	5,091	463,841.01			
WEYERHAEUSER CO	16,116	505,881.24			
米ドル合計			234,580	11,356,773.36 (1,107,966,809)	
加ドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	4,000	87,600.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,380	86,798.40	
加ドル合計			7,380	174,398.40	

				(16,295,786)
ユーロ	投資証券	CORIO NV	1,998	64,954.98
		FONCIERE DES REGIONS	595	38,270.40
		GECINA SA	740	73,755.80
		ICADE	685	46,847.15
		KLEPIERRE	2,445	81,883.05
		UNIBAIL-RODAMCO SE-NA	2,680	521,662.00
ユーロ合計			9,143	827,373.38 (111,521,657)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	27,311	171,513.08
		HAMMERSON PLC	15,295	82,057.67
		INTU PROPERTIES PLC	19,860	68,437.56
		LAND SECURITIES GROUP PLC	22,899	226,929.09
		SEGRO PLC	20,223	67,403.25
英ポンド合計			105,588	616,340.65 (97,307,861)
豪ドル	投資証券	APA GROUP	19,805	116,651.45
		CFS RETAIL PROPERTY TRUST GR	67,010	135,360.20
		DEXUS PROPERTY GROUP	163,705	172,708.77
		FEDERATION CENTRES	45,000	106,650.00
		GOODMAN GROUP	54,772	273,860.00
		GPT GROUP	47,615	177,127.80
		LEND LEASE GROUP	17,037	192,688.47
		MIRVAC GROUP	108,455	189,253.97
		STOCKLAND	55,310	220,133.80
		WESTFIELD GROUP	60,415	660,940.10
		WESTFIELD RETAIL TRUST	86,505	267,300.45
豪ドル合計			725,629	2,512,675.01 (235,462,775)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	59,500	2,302,650.00
香港ドル合計			59,500	2,302,650.00 (28,967,337)
シンガポ ールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	62,000	144,460.00
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	67,000	97,820.00
		CAPITAMALL TRUST	71,800	143,600.00

シンガポールドル合計	200,800	385,880.00 (30,469,084)	
合計		1,627,991,309 (1,627,991,309)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 569 銘柄	97.6%	—	57.4%
	投資証券 29 銘柄	—	2.4%	1.4%
加ドル	株式 92 銘柄	99.5%	—	4.6%
	投資証券 2 銘柄	—	0.5%	0.0%
ユーロ	株式 231 銘柄	99.0%	—	13.8%
	投資証券 6 銘柄	—	1.0%	0.1%
英ポンド	株式 103 銘柄	98.7%	—	9.9%
	投資証券 5 銘柄	—	1.3%	0.1%
スイスフラン	株式 37 銘柄	100.0%	—	4.2%
スウェーデンクローナ	株式 32 銘柄	100.0%	—	1.5%
ノルウェークローネ	株式 10 銘柄	100.0%	—	0.4%
デンマーククローネ	株式 11 銘柄	100.0%	—	0.5%
豪ドル	株式 57 銘柄	91.9%	—	3.5%
	投資証券 11 銘柄	—	8.1%	0.3%
ニュージーランドドル	株式 5 銘柄	100.0%	—	0.1%
香港ドル	株式 39 銘柄	97.2%	—	1.3%
	投資証券 1 銘柄	—	2.8%	0.0%
シンガポールドル	株式 25 銘柄	94.3%	—	0.7%
	投資証券 3 銘柄	—	5.7%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 7 銘柄	100.0%	—	0.2%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	平成 24 年 10 月 26 日現在	平成 25 年 10 月 28 日現在
資産の部		
流動資産		
預金	56,358,489	3,092,296
コール・ローン	22,210,993	46,198,669
株式	1,136,537,137	1,479,373,496
投資証券	25,347,234	32,576,567
派生商品評価勘定	28,808	17,006,577
未収入金	102,399	12,445
未収配当金	1,427,275	1,338,300
未収利息	42	77
差入委託証拠金	20,487,294	20,342,641
流動資産合計	1,262,499,671	1,599,941,068
資産合計	1,262,499,671	1,599,941,068
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	34,629,133	13,857,989
未払金	59,069	-
未払解約金	426,766	7,859,187
流動負債合計	35,114,968	21,717,176
負債合計	35,114,968	21,717,176
純資産の部		
元本等		
元本	1,423,095,784	1,469,650,974
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	△195,711,081	108,572,918
元本等合計	1,227,384,703	1,578,223,892
純資産合計	1,227,384,703	1,578,223,892
負債純資産合計	1,262,499,671	1,599,941,068

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成 24 年 10 月 26 日現在	平成 25 年 10 月 28 日現在
1.	期首	平成 23 年 10 月 27 日	平成 24 年 10 月 27 日
	期首元本額	1,537,000,695 円	1,423,095,784 円
	期首からの追加設定元本額	156,925,408 円	334,092,349 円
	期首からの一部解約元本額	270,830,319 円	287,537,159 円
	元本の内訳 ※		
	インデックスファンド海外株式ヘッジあり (DC 専用)	99,354,693 円	160,724,977 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 8 0)	21,263,305 円	18,538,040 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 6 0)	18,234,104 円	13,685,300 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 4 0)	29,459,396 円	21,949,046 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 2 0)	37,353,755 円	27,353,237 円
	世界アセットバランスファンド 4 0 (適格機関投資家向け)	196,735,372 円	168,133,801 円
	世界アセットバランスファンド 2 5 (適格機関投資家向け)	120,363,635 円	105,013,841 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 2 0)	48,411,996 円	48,064,250 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 4 0)	130,071,267 円	137,038,067 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 6 0)	165,886,923 円	187,531,493 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 8 0)	163,956,468 円	193,522,968 円
	年金積立 インデックスファンド海外株式 (ヘッジあり)	392,004,870 円	388,095,954 円
	計	1,423,095,784 円	1,469,650,974 円
2.	受益権の総数	1,423,095,784 口	1,469,650,974 口
3.	元本の欠損		

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

	自 平成 23 年 10 月 27 日 至 平成 24 年 10 月 26 日	自 平成 24 年 10 月 27 日 至 平成 25 年 10 月 28 日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

	平成 24 年 10 月 26 日現在	平成 25 年 10 月 28 日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成 24 年 10 月 26 日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

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

株式	115,743,397
投資証券	3,691,182
合計	119,434,579

(平成 25 年 10 月 28 日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	256,748,934
投資証券	2,490,172
合計	259,239,106

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成 24 年 10 月 26 日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	75,761,733	—	74,417,674	△1,344,059
合計		75,761,733	—	74,417,674	△1,344,059

(平成 25 年 10 月 28 日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	59,426,027	—	61,958,237	2,532,210
合計		59,426,027	—	61,958,237	2,532,210

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(平成 24 年 10 月 26 日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超		時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引					
	売建	1,211,175,694	—	1,244,431,960	△33,256,266	
	米ドル	709,302,893	—	724,716,940	△15,414,047	
	加ドル	64,773,059	—	66,011,380	△1,238,321	
	ユーロ	155,619,096	—	162,540,900	△6,921,804	
	英ポンド	125,240,821	—	130,367,310	△5,126,489	
	スイスフラン	48,151,822	—	49,805,410	△1,653,588	
	スウェーデンクローナ	16,230,620	—	16,493,570	△262,950	
	ノルウェークローネ	5,651,325	—	5,748,430	△97,105	
	デンマーククローネ	6,987,239	—	7,269,880	△282,641	
	豪ドル	49,792,447	—	51,198,920	△1,406,473	
	香港ドル	16,888,492	—	17,294,570	△406,078	
	シンガポールドル	10,694,284	—	11,038,060	△343,776	
イスラエルシェケル	1,843,596	—	1,946,590	△102,994		
合計		1,211,175,694	—	1,244,431,960	△33,256,266	

(平成25年10月28日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超		時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引					
	売建	1,526,784,858	—	1,526,168,480	616,378	
	米ドル	911,852,281	—	899,117,780	12,734,501	
	加ドル	69,045,274	—	68,221,210	824,064	
	ユーロ	208,698,184	—	214,411,910	△5,713,726	
	英ポンド	149,076,781	—	152,085,810	△3,009,029	
	スイスフラン	62,680,082	—	64,068,950	△1,388,868	
	スウェーデンクローナ	20,320,996	—	20,810,040	△489,044	
	ノルウェークローネ	7,210,407	—	7,317,820	△107,413	
	デンマーククローネ	7,472,594	—	7,679,750	△207,156	
	豪ドル	55,433,102	—	57,420,970	△1,987,868	
	香港ドル	21,463,543	—	21,323,100	140,443	
	シンガポールドル	11,186,644	—	11,365,200	△178,556	

	イスラエルシュケル	2,344,970	—	2,345,940	△970
合計		1,526,784,858	—	1,526,168,480	616,378

(注) 1. 時価の算定方法

- (1) 本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
- ① 同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
- ② 同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
- ・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
 - ・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
- (2) 本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成24年10月26日現在		平成25年10月28日現在	
1口当たり純資産額	0.8625円	1口当たり純資産額	1.0739円
(1万口当たり純資産額)	(8,625円)	(1万口当たり純資産額)	(10,739円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	280	96.15	26,922.00	
	APACHE CORP	219	90.45	19,808.55	
	BAKER HUGHES INC	290	58.23	16,886.70	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	229	53.25	12,194.25	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	438	28.47	12,469.86	
	CHEVRON CORP	1,069	120.59	128,910.71	
	CONOCOPHILLIPS	644	74.06	47,694.64	
	CONSOL ENERGY INC	243	38.14	9,268.02	
	DEVON ENERGY CORPORATION	254	64.54	16,393.16	
	ENSCO PLC-CL A	227	57.02	12,943.54	
	EOG RESOURCES INC	153	183.44	28,066.32	
	EQT CORP	143	87.80	12,555.40	

EXXON MOBIL CORP	2,465	87.97	216,846.05
FMC TECHNOLOGIES INC	229	51.13	11,708.77
HALLIBURTON CO	520	51.69	26,878.80
HESS CORP	203	83.20	16,889.60
KINDER MORGAN INC	416	36.49	15,179.84
MARATHON OIL CORP	467	35.59	16,620.53
MARATHON PETROLEUM CORP	212	69.89	14,816.68
MURPHY OIL CORP	174	61.75	10,744.50
NABORS INDUSTRIES LTD	405	16.76	6,787.80
NATIONAL OILWELL VARCO INC	239	82.72	19,770.08
NOBLE CORP	245	38.08	9,329.60
NOBLE ENERGY INC	236	76.51	18,056.36
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	452	96.88	43,789.76
PEABODY ENERGY CORP	253	19.16	4,847.48
PHILLIPS 66	359	63.40	22,760.60
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	113	210.77	23,817.01
QEP RESOURCES INC	262	33.14	8,682.68
RANGE RESOURCES CORP	181	74.73	13,526.13
SCHLUMBERGER LTD	728	92.90	67,631.20
SOUTHWESTERN ENERGY CO	328	37.13	12,178.64
SPECTRA ENERGY CORP	432	35.95	15,530.40
VALERO ENERGY CORP	313	39.44	12,344.72
WEATHERFORD INTL LTD	710	16.26	11,544.60
WILLIAMS COS INC	438	37.30	16,337.40
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	119	111.73	13,295.87
ALCOA INC	1,100	9.24	10,164.00
DOW CHEMICAL	672	39.52	26,557.44
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	522	61.90	32,311.80
ECOLAB INC	163	105.18	17,144.34
FMC CORP	145	74.34	10,779.30
FREEMPORT-MCMORAN COPPER	532	37.44	19,918.08
INTERNATIONAL PAPER CO	327	45.57	14,901.39
LYONDELLBASELL INDU-CL A	238	77.10	18,349.80
MONSANTO CO	297	108.00	32,076.00
MOSAIC CO/THE	216	45.94	9,923.04

NEWMONT MINING CORP	272	27.83	7,569.76
NUCOR CORP	268	51.40	13,775.20
PPG INDUSTRIES INC	92	181.92	16,736.64
PRAXAIR INC	167	125.24	20,915.08
SIGMA-ALDRICH	164	87.06	14,277.84
VULCAN MATERIALS CO	174	54.84	9,542.16
3M CO	366	124.42	45,537.72
BOEING CO	398	131.19	52,213.62
CATERPILLAR INC	364	84.77	30,856.28
CUMMINS INC	121	135.59	16,406.39
DANAHER CORP	331	72.11	23,868.41
DEERE & CO	208	83.55	17,378.40
DOVER CORP	206	90.95	18,735.70
EATON CORP PLC	262	71.64	18,769.68
EMERSON ELECTRIC CO	408	67.22	27,425.76
FASTENAL CO	242	50.63	12,252.46
FLUOR CORP	183	76.31	13,964.73
GENERAL DYNAMICS CORP	197	88.26	17,387.22
GENERAL ELECTRIC CO.	5,705	25.88	147,645.40
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	416	87.50	36,400.00
ILLINOIS TOOL WORKS	236	78.55	18,537.80
INGERSOLL-RAND PLC	272	67.85	18,455.20
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	130	60.56	7,872.80
JOY GLOBAL INC	127	58.09	7,377.43
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	94	97.53	9,167.82
LOCKHEED MARTIN CORP	152	134.00	20,368.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	144	108.37	15,605.28
PACCAR INC	224	58.55	13,115.20
PARKER HANNIFIN CORP	153	116.42	17,812.26
PENTAIR LTD-REGISTERED	195	66.67	13,000.65
PRECISION CASTPARTS CORP	80	254.81	20,384.80
RAYTHEON COMPANY	230	79.96	18,390.80
ROCKWELL COLLINS INC.	158	70.69	11,169.02
ROPER INDUSTRIES INC	85	133.04	11,308.40
STANLEY BLACK & DECKER INC	139	78.46	10,905.94

TEXTRON INC	317	29.07	9,215.19
UNITED TECHNOLOGIES CORP	483	107.52	51,932.16
XYLEM INC	293	28.99	8,494.07
ADT CORP/THE	183	42.17	7,717.11
IRON MOUNTAIN INC	256	27.12	6,942.72
TYCO INTERNATIONAL LTD	447	36.49	16,311.03
WASTE MANAGEMENT INC	329	43.65	14,360.85
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	155	60.76	9,417.80
CSX CORP	575	26.61	15,300.75
EXPEDITORS INTL WASH INC	230	45.88	10,552.40
FEDEX CORP	167	132.06	22,054.02
NORFOLK SOUTHERN CORP	175	87.65	15,338.75
UNION PACIFIC CORP	264	152.36	40,223.04
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	405	95.61	38,722.05
AUTOLIV INC	134	91.89	12,313.26
BORGWARNER INC	139	106.27	14,771.53
FORD MOTOR COMPANY	1,996	17.60	35,129.60
GENERAL MOTORS CORP	381	35.59	13,559.79
HARLEY-DAVIDSON INC	281	64.98	18,259.38
JOHNSON CONTROLS INC	450	43.01	19,354.50
COACH INC	190	49.89	9,479.10
MATTEL INC	345	44.06	15,200.70
NEWELL RUBBERMAID INC	396	29.40	11,642.40
NIKE INC -CL B	408	75.70	30,885.60
VF CORP	77	212.23	16,341.71
WHIRLPOOL CORP	73	146.18	10,671.14
CARNIVAL CORP	296	34.63	10,250.48
LAS VEGAS SANDS CORP	266	71.90	19,125.40
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	321	44.49	14,281.29
MCDONALD'S CORP	533	94.78	50,517.74
STARBUCKS CORP	453	79.96	36,221.88
STARWOOD HOTELS & RESORTS	229	74.56	17,074.24
YUM! BRANDS INC	248	66.57	16,509.36
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	456	59.80	27,268.80
COMCAST CORP-CLASS A	1,162	48.18	55,985.16

COMCAST CORP-SPECIAL CL A	328	46.82	15,356.96
DIRECTV	324	62.82	20,353.68
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	89	79.38	7,064.82
DISH NETWORK CORP-A	298	48.67	14,503.66
NEWS CORP - CLASS A	271	17.15	4,647.65
OMNICOM GROUP	252	67.46	16,999.92
THE WALT DISNEY CO.	972	69.26	67,320.72
TIME WARNER CABLE	170	119.44	20,304.80
TIME WARNER INC	636	70.26	44,685.36
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	1,085	34.86	37,823.10
VIACOM INC-CLASS B	287	84.94	24,377.78
AMAZON.COM INC	198	363.39	71,951.22
AUTOZONE INC	29	429.47	12,454.63
BED BATH & BEYOND INC	154	76.75	11,819.50
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	198	59.50	11,781.00
GAP INC/THE	227	36.66	8,321.82
GENUINE PARTS CO	189	79.09	14,948.01
HOME DEPOT INC	836	76.25	63,745.00
KOHL'S CORP	178	54.74	9,743.72
L BRANDS INC	296	61.54	18,215.84
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	566	26.72	15,123.52
LOWE'S COS INC	619	50.59	31,315.21
MACY'S INC	324	44.89	14,544.36
NORDSTROM INC	194	59.27	11,498.38
PRICELINE.COM INC	29	1,070.85	31,054.65
ROSS STORES INC	190	75.87	14,415.30
STAPLES INC	489	16.02	7,833.78
TARGET CORP	349	64.07	22,360.43
TIFFANY & CO	125	79.32	9,915.00
TJX COMPANIES INC	439	59.10	25,944.90
COSTCO WHOLESALE CORP	242	116.44	28,178.48
CVS CAREMARK CORP	655	61.41	40,223.55
KROGER CO	460	43.42	19,973.20
SAFEWAY INC	328	36.54	11,985.12
SYSCO CORP	388	32.99	12,800.12

WAL-MART STORES INC	917	76.08	69,765.36
WALGREEN CO	495	59.19	29,299.05
WHOLE FOODS MARKET INC	230	65.24	15,005.20
ALTRIA GROUP INC	1,135	36.25	41,143.75
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	372	39.93	14,853.96
BEAM INC	127	68.65	8,718.55
BUNGE LTD	139	82.39	11,452.21
COCA-COLA CO/THE	2,207	39.03	86,139.21
COCA-COLA ENTERPRISES	235	41.18	9,677.30
CONAGRA FOODS INC	463	31.72	14,686.36
CONSTELLATION BRANDS INC-A	154	63.91	9,842.14
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	242	46.67	11,294.14
GENERAL MILLS INC	409	50.06	20,474.54
KELLOGG CO	224	62.43	13,984.32
KRAFT FOODS GROUP INC	359	54.96	19,730.64
LORILLARD INC	258	49.59	12,794.22
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	135	81.09	10,947.15
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	946	33.48	31,672.08
MONSTER BEVERAGE CORP	126	58.15	7,326.90
PEPSICO INC	848	83.35	70,680.80
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	906	88.60	80,271.60
TYSON FOODS INC-CL A	392	28.14	11,030.88
AVON PRODUCTS	330	21.99	7,256.70
COLGATE-PALMOLIVE CO	520	63.60	33,072.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	157	71.51	11,227.07
KIMBERLY-CLARK CORP	243	105.51	25,638.93
PROCTER & GAMBLE CO	1,503	80.00	120,240.00
ABBOTT LABORATORIES	876	37.25	32,631.00
AETNA INC	230	61.82	14,218.60
AMERISOURCEBERGEN CORP	267	65.24	17,419.08
BAXTER INTERNATIONAL INC	302	65.49	19,777.98
BECTON DICKINSON AND CO	134	105.55	14,143.70
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,188	11.62	13,804.56
CARDINAL HEALTH INC	229	54.95	12,583.55
CAREFUSION CORP	265	38.94	10,319.10

CIGNA CORP	263	73.90	19,435.70
COVIDIEN PLC	267	64.10	17,114.70
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	226	55.44	12,529.44
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	455	60.88	27,700.40
HUMANA INC	122	91.54	11,167.88
INTUITIVE SURGICAL INC	22	369.13	8,120.86
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	108	100.22	10,823.76
MCKESSON CORP	131	154.99	20,303.69
MEDTRONIC INC	562	57.36	32,236.32
QUEST DIAGNOSTICS	187	58.59	10,956.33
ST JUDE MEDICAL INC	263	57.27	15,062.01
STRYKER CORP	229	74.61	17,085.69
UNITEDHEALTH GROUP INC	576	67.62	38,949.12
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	141	73.20	10,321.20
WELLPOINT INC	171	84.10	14,381.10
ZIMMER HOLDINGS INC	157	86.91	13,644.87
ABBVIE INC	876	49.30	43,186.80
AGILENT TECHNOLOGIES INC	179	51.87	9,284.73
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	123	125.17	15,395.91
ALLERGAN INC	186	92.82	17,264.52
AMGEN INC	398	116.32	46,295.36
BIOGEN IDEC INC	154	252.36	38,863.44
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	937	48.77	45,697.49
CELGENE CORP	268	155.74	41,738.32
ELI LILLY & CO	575	50.66	29,129.50
FOREST LABORATORIES INC	235	47.34	11,124.90
GILEAD SCIENCES INC	911	69.68	63,478.48
HOSPIRA INC	149	41.37	6,164.13
JOHNSON & JOHNSON	1,519	92.09	139,884.71
MERCK & CO. INC.	1,663	46.54	77,396.02
PFIZER INC	3,619	30.61	110,777.59
REGENERON PHARMACEUTICALS	54	302.24	16,320.96
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	240	97.81	23,474.40
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	145	76.87	11,146.15
WATERS CORP	120	101.99	12,238.80

BB&T CORP	462	34.81	16,082.22
COMERICA INC	211	42.72	9,013.92
FIFTH THIRD BANCORP	609	19.08	11,619.72
KEYCORP	1,033	12.69	13,108.77
M & T BANK CORP	105	112.55	11,817.75
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	537	16.08	8,634.96
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	297	75.36	22,381.92
SUNTRUST BANKS INC	356	33.71	12,000.76
US BANCORP	1,058	37.83	40,024.14
WELLS FARGO & CO	2,755	42.86	118,079.30
AMERICAN EXPRESS CO	569	82.61	47,005.09
AMERIPRISE FINANCIAL INC	172	99.56	17,124.32
BANK OF AMERICA CORPORATION	5,915	14.26	84,347.90
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	663	31.83	21,103.29
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	588	117.03	68,813.64
BLACKROCK INC	87	307.61	26,762.07
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	326	70.38	22,943.88
CITIGROUP INC	1,639	50.06	82,048.34
CME GROUP INC	220	76.50	16,830.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	285	51.00	14,535.00
FRANKLIN RESOURCES INC	252	54.50	13,734.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	254	162.09	41,170.86
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	85	196.00	16,660.00
INVESCO LTD	383	32.87	12,589.21
JPMORGAN CHASE & CO	2,086	52.77	110,078.22
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	298	71.35	21,262.30
MOODY'S CORP	165	71.56	11,807.40
MORGAN STANLEY	831	29.23	24,290.13
NORTHERN TRUST CORP	161	56.40	9,080.40
SCHWAB (CHARLES) CORP	716	23.56	16,868.96
STATE STREET CORP	273	68.74	18,766.02
T ROWE PRICE GROUP INC	227	75.77	17,199.79
ACE LTD	181	96.14	17,401.34
AFLAC INC	247	66.30	16,376.10
ALLSTATE CORP	272	53.35	14,511.20

AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	783	51.85	40,598.55
AON PLC	204	77.54	15,818.16
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	189	46.83	8,850.87
CHUBB CORP	146	92.20	13,461.20
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	341	33.57	11,447.37
MARSH & MCLENNAN COS	361	46.56	16,808.16
METLIFE INC	519	48.63	25,238.97
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	325	46.85	15,226.25
PROGRESSIVE CORP	476	26.45	12,590.20
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	247	81.41	20,108.27
TRAVELERS COS INC/THE	216	86.63	18,712.08
UNUM GROUP	310	31.35	9,718.50
WR BERKLEY CORP	152	43.64	6,633.28
ACCENTURE PLC-CL A	356	73.61	26,205.16
ADOBE SYSTEMS INC	369	53.81	19,855.89
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	196	45.88	8,992.48
AUTODESK INC	212	39.87	8,452.44
AUTOMATIC DATA PROCESSING	274	75.51	20,689.74
CA INC	302	31.40	9,482.80
CITRIX SYSTEMS INC	145	57.98	8,407.10
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	180	86.68	15,602.40
COMPUTER SCIENCES CORP	169	51.82	8,757.58
EBAY INC	717	51.66	37,040.22
FACEBOOK INC-A	932	51.96	48,426.72
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	306	47.44	14,516.64
FISERV INC	144	106.30	15,307.20
GOOGLE INC-CL A	148	1,015.19	150,248.12
INTL BUSINESS MACHINES CORP	582	176.85	102,926.70
INTUIT INC	244	70.44	17,187.36
LINKEDIN CORP - A	50	240.70	12,035.00
MASTERCARD INC-CLASS A	63	723.78	45,598.14
MICROSOFT CORP	4,378	35.73	156,425.94
ORACLE CORP	2,084	33.15	69,084.60
PAYCHEX INC	388	43.00	16,684.00
SALESFORCE.COM INC	344	54.56	18,768.64

SYMANTEC CORP	676	22.03	14,892.28
VISA INC-CLASS A SHARES	305	203.06	61,933.30
WESTERN UNION CO	725	19.29	13,985.25
YAHOO! INC	809	32.25	26,090.25
AMPHENOL CORP-CL A	191	81.27	15,522.57
APPLE COMPUTER INC	517	526.20	272,045.40
CISCO SYSTEMS INC	2,913	22.46	65,425.98
CORNING INC	1,086	17.35	18,842.10
EMC CORP/MASS	1,178	23.80	28,036.40
F5 NETWORKS INC	66	82.73	5,460.18
HARRIS CORP	63	59.61	3,755.43
HEWLETT-PACKARD CO	1,107	24.00	26,568.00
JUNIPER NETWORKS INC	445	18.70	8,321.50
MOTOROLA SOLUTIONS INC	281	62.99	17,700.19
NETAPP INC	302	39.39	11,895.78
QUALCOMM INC	935	68.27	63,832.45
SEAGATE TECHNOLOGY	338	49.81	16,835.78
TE CONNECTIVITY LTD	283	53.60	15,168.80
XEROX CORP	1,249	9.71	12,127.79
AT&T INC	3,021	35.19	106,308.99
CENTURYLINK INC	408	33.27	13,574.16
CROWN CASTLE INTL CORP	315	76.11	23,974.65
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,602	50.71	81,237.42
AES CORP	993	14.31	14,209.83
AMERICAN ELECTRIC POWER	298	47.28	14,089.44
CENTERPOINT ENERGY INC	442	24.87	10,992.54
CONSOLIDATED EDISON INC	194	58.59	11,366.46
DOMINION RESOURCES INC/VA	321	64.66	20,755.86
DUKE ENERGY CORP	395	72.37	28,586.15
EDISON INTERNATIONAL	295	49.41	14,575.95
ENTERGY CORP	134	68.27	9,148.18
EXELON CORP	474	27.96	13,253.04
FIRSTENERGY CORP	277	37.88	10,492.76
NEXTERA ENERGY INC	259	85.95	22,261.05
P G & E CORP	280	42.12	11,793.60

	PINNACLE WEST CAPITAL	209	58.43	12,211.87
	PPL CORPORATION	384	30.79	11,823.36
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	336	34.32	11,531.52
	SEMPRA ENERGY	229	91.21	20,887.09
	SOUTHERN CO	491	42.46	20,847.86
	WISCONSIN ENERGY CORP	312	42.74	13,334.88
	XCEL ENERGY INC	322	29.10	9,370.20
	ALTERA CORPORATION	339	33.13	11,231.07
	ANALOG DEVICES INC	191	46.75	8,929.25
	APPLIED MATERIALS INC	848	17.70	15,009.60
	BROADCOM CORP-CL A	364	26.41	9,613.24
	INTEL CORP	2,731	24.24	66,199.44
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	304	39.07	11,877.28
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	279	38.87	10,844.73
	TEXAS INSTRUMENTS INC	638	40.23	25,666.74
	XILINX INC	216	44.64	9,642.24
米ドル小計		163,724		8,894,170.92 (867,715,314)
加ドル	CAMECO CORP	350	19.27	6,744.50
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	614	33.32	20,458.48
	CANADIAN OIL SANDS LTD	466	20.70	9,646.20
	CENOVUS ENERGY INC	419	30.98	12,980.62
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	210	40.90	8,589.00
	ENBRIDGE INC	538	44.33	23,849.54
	ENCANA CORP	487	19.16	9,330.92
	ENERPLUS CORP	346	18.12	6,269.52
	HUSKY ENERGY INC	279	29.82	8,319.78
	IMPERIAL OIL LTD	196	45.96	9,008.16
	PENN WEST PETROLEUM LTD	679	11.77	7,991.83
	SUNCOR ENERGY INC	862	37.66	32,462.92
	TALISMAN ENERGY INC	920	12.91	11,877.20
	TRANSCANADA CORP	398	46.96	18,690.08
	AGNICO EAGLE MINES LTD	152	32.24	4,900.48
	AGRIUM INC	83	89.90	7,461.70
	BARRICK GOLD CORP	561	21.07	11,820.27

	ELDORADO GOLD CORP	598	7.27	4,347.46
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	496	19.25	9,548.00
	GOLDCORP INC	452	27.98	12,646.96
	KINROSS GOLD CORP	888	5.44	4,830.72
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	482	32.61	15,718.02
	SILVER WHEATON CORP	234	25.70	6,013.80
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	382	30.27	11,563.14
	YAMANA GOLD INC	367	10.74	3,941.58
	BOMBARDIER INC 'B'	1,631	5.37	8,758.47
	SNC-LAVALIN GROUP INC	229	43.84	10,039.36
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	244	115.18	28,103.92
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	165	150.04	24,756.60
	MAGNA INTERNATIONAL INC	219	88.48	19,377.12
	TIM HORTONS INC	158	63.81	10,081.98
	THOMSON REUTERS CORP	422	36.97	15,601.34
	SHOPPERS DRUG MART INC	141	61.09	8,613.69
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	193	117.60	22,696.80
	BANK OF MONTREAL	363	72.93	26,473.59
	BANK OF NOVA SCOTIA	639	62.39	39,867.21
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	227	86.79	19,701.33
	NATIONAL BANK OF CANADA	186	89.39	16,626.54
	ROYAL BANK OF CANADA	796	69.45	55,282.20
	TORONTO-DOMINION BANK	510	94.10	47,991.00
	MANULIFE FINANCIAL CORP	1,030	18.07	18,612.10
	POWER CORP OF CANADA	445	29.35	13,060.75
	SUN LIFE FINANCIAL INC	391	34.66	13,552.06
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	395	42.54	16,803.30
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES CORP	397	19.67	7,808.99
	BLACKBERRY LTD	345	8.60	2,967.00
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	353	46.78	16,513.34
	TELUS CORP	200	36.84	7,368.00
	TRANSALTA CORP	508	14.31	7,269.48
加ドル小計		21,646		736,937.05 (68,859,397)
ユーロ	ENI SPA	1,420	17.90	25,418.00

OMV AG	232	34.84	8,082.88
REPSOL SA	540	19.15	10,343.70
SAIPEM SPA	337	15.48	5,216.76
TECHNIP SA	63	89.68	5,649.84
TENARIS SA	298	17.34	5,167.32
TOTAL SA	1,168	44.57	52,063.60
AIR LIQUIDE	175	101.80	17,815.00
AKZO NOBEL NV	155	51.31	7,953.05
ARCELORMITTAL	647	11.67	7,553.72
BASF SE	506	75.17	38,036.02
CRH PLC	556	17.73	9,857.88
K+S AG	190	18.64	3,541.60
KONINKLIJKE DSM NV	215	55.64	11,962.60
LAFARGE SA	188	50.26	9,448.88
LANXESS AG	140	51.63	7,228.20
LINDE AG	107	145.45	15,563.15
SOLVAY ET CIE SA -A	88	116.10	10,216.80
THYSSENKRUPP AG	421	19.00	7,999.00
UMICORE	187	36.21	6,772.20
UPM-KYMMENE OYJ	507	11.28	5,718.96
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	161	24.00	3,864.00
ALSTOM	186	27.29	5,075.94
CNH INDUSTRIAL NV	875	8.93	7,813.75
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	261	39.68	10,357.78
EADS NV	376	49.04	18,439.04
KONE OYJ-B	132	63.75	8,415.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	583	25.74	15,006.42
MAN SE	48	88.75	4,260.00
OSRAM LICHT AG	42	37.75	1,585.50
SCHNEIDER ELECTRIC SA	295	62.58	18,461.10
SIEMENS AG-REG	422	93.85	39,604.70
VALLOUREC	105	42.90	4,505.02
VINCI SA	305	48.11	14,673.55
WARTSILA OYJ	177	32.80	5,805.60
EDENRED	307	24.47	7,512.29

ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	676	15.90	10,751.78
ATLANTIA SPA	492	16.39	8,063.88
DEUTSCHE POST AG	761	25.04	19,055.44
TNT EXPRESS NV	390	6.80	2,652.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	187	83.66	15,644.42
CONTINENTAL AG	101	136.20	13,756.20
DAIMLER AG	509	59.99	30,534.91
MICHELIN (CGDE)-B	119	80.42	9,569.98
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	87	65.25	5,676.75
RENAULT SA	154	66.11	10,180.94
VOLKSWAGEN AG-PFD	81	176.50	14,296.50
ADIDAS AG	188	84.20	15,829.60
KERING	70	167.40	11,718.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	142	139.15	19,759.30
ACCOR SA	197	33.61	6,622.15
SODEXO	131	71.81	9,407.11
LAGARDERE S. C. A.	186	26.66	4,959.69
SES	443	21.15	9,371.66
WOLTERS KLUWER	443	20.22	8,959.67
INDITEX	147	118.35	17,397.45
CARREFOUR SA	401	27.20	10,907.20
KONINKLIJKE AHOLD NV	825	13.84	11,422.12
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	454	75.70	34,367.80
DANONE	325	55.30	17,972.50
HEINEKEN NV	152	50.63	7,695.76
PERNOD-RICARD SA	131	86.48	11,328.88
UNILEVER NV-CVA	909	28.75	26,133.75
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	210	77.00	16,170.00
L'OREAL	152	127.65	19,402.80
ESSILOR INTERNATIONAL	132	77.16	10,185.12
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	160	49.10	7,856.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	134	94.04	12,601.36
BAYER AG	456	91.20	41,587.20
SANOFI	653	75.21	49,112.13
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	3,002	8.85	26,567.70

BANCO SANTANDER SA	5,763	6.53	37,632.39
BNP PARIBAS	560	53.35	29,876.00
CREDIT AGRICOLE SA	708	8.84	6,264.38
ERSTE GROUP BANK AG	241	24.35	5,868.35
INTESA SANPAOLO	6,669	1.80	12,004.20
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	2,782	—	—
SOCIETE GENERALE	433	40.90	17,709.70
UNICREDIT SPA	2,144	5.30	11,363.20
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	521	36.08	18,800.28
ING GROEP NV-CVA	2,150	9.35	20,113.25
MEDIOBANCA SPA	857	6.33	5,424.81
AGEAS	266	31.48	8,375.01
ALLIANZ SE-REG	251	123.60	31,023.60
ASSICURAZIONI GENERALI	773	16.96	13,110.08
AXA	992	18.27	18,123.84
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	122	151.85	18,525.70
SAMPO OYJ-A SHS	317	34.89	11,060.13
AMADEUS IT HOLDING SA	412	27.21	11,210.52
CAP GEMINI SA	173	46.91	8,116.29
SAP AG-COMMON	545	57.62	31,402.90
NOKIA OYJ	2,577	5.09	13,129.81
BELGACOM SA	334	21.00	7,014.00
DEUTSCHE TELEKOM AG	1,678	11.35	19,053.69
ORANGE S. A.	1,247	10.14	12,650.81
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	1,896	3.34	6,342.12
TELECOM ITALIA SPA	11,938	0.67	8,022.33
TELEFONICA SA	2,287	12.71	29,067.77
VIVENDI	695	18.77	13,045.15
ACCIONA SA	76	46.18	3,510.06
E.ON SE	1,011	13.42	13,567.62
ENEL SPA	3,724	3.19	11,894.45
FORTUM OYJ	342	16.28	5,567.76
GDF SUEZ	805	18.43	14,840.17
IBERDROLA SA	2,570	4.48	11,516.17
RWE AG	324	26.94	8,730.18

	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	362	12.78	4,626.36
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	338	12.98	4,387.24
	ASML HOLDING NV	246	67.93	16,710.78
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	968	6.93	6,715.01
	STMICROELECTRONICS NV	664	5.56	3,693.16
ユーロ小計		86,776		1,514,595.87 (204,152,377)
英ポンド	BG GROUP PLC	1,897	12.54	23,797.86
	BP PLC	10,463	4.51	47,203.82
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,051	21.29	43,676.04
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,391	22.37	31,123.62
	TULLOW OIL PLC	596	9.78	5,831.86
	ANGLO AMERICAN PLC	780	15.08	11,762.40
	ANTOFAGASTA PLC	612	8.75	5,358.06
	BHP BILLITON PLC	1,179	19.53	23,025.87
	GLENORE XSTRATA PLC	5,598	3.42	19,173.15
	RANDGOLD RESOURCES LTD	93	46.39	4,314.27
	RIO TINTO PLC	674	32.22	21,719.65
	BAE SYSTEMS PLC ORD	1,945	4.51	8,785.56
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS -PRF C(N)	100,964	0.00	100.96
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,174	11.71	13,747.54
	SMITHS GROUP PLC	404	14.15	5,716.60
	WOLSELEY PLC	270	33.01	8,912.70
	CAPITA PLC	748	9.66	7,229.42
	EXPERIAN PLC	658	12.21	8,034.18
	CARNIVAL PLC	202	22.07	4,458.14
	COMPASS GROUP PLC	1,236	9.07	11,210.52
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	412	18.65	7,683.80
	WHITBREAD PLC	261	33.72	8,800.92
	BRITISH SKY BROADCASTING GRO	1,034	9.28	9,600.69
	PEARSON PLC	514	13.64	7,010.96
	REED ELSEVIER PLC	1,234	8.66	10,692.61
	WPP PLC	1,041	13.44	13,991.04
	KINGFISHER PLC	2,100	3.70	7,772.10
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,326	4.75	6,309.10

	NEXT PLC	193	52.05	10,045.65
	TESCO PLC	4,514	3.70	16,708.57
	WM MORRISON SUPERMARKETS	1,579	2.82	4,452.78
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,060	34.15	36,199.00
	DIAGEO PLC	1,380	20.17	27,841.50
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	556	23.41	13,015.96
	SABMILLER PLC	541	32.50	17,582.50
	UNILEVER PLC	720	24.93	17,949.60
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	356	47.80	17,016.80
	SMITH & NEPHEW PLC	824	7.98	6,575.52
	ASTRAZENECA PLC	696	32.48	22,609.56
	GLAXOSMITHKLINE PLC	2,692	16.04	43,193.14
	SHIRE PLC	454	27.76	12,603.04
	BARCLAYS PLC	8,391	2.67	22,479.48
	HSBC HOLDINGS PLC	10,101	6.80	68,686.80
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	25,060	0.80	20,140.72
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	1,630	3.68	6,004.92
	STANDARD CHARTERED PLC	1,335	15.25	20,365.42
	AVIVA PLC	2,180	4.38	9,561.48
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	6,338	2.12	13,493.60
	OLD MUTUAL PLC	3,107	2.04	6,356.92
	PRUDENTIAL PLC	1,446	12.70	18,364.20
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	5,863	1.26	7,434.28
	STANDARD LIFE PLC	2,126	3.66	7,793.91
	BT GROUP PLC	5,005	3.59	17,972.95
	VODAFONE GROUP PLC	26,918	2.26	61,036.56
	CENTRICA PLC	2,783	3.56	9,910.26
	NATIONAL GRID PLC	2,042	7.82	15,968.44
	SEVERN TRENT PLC	309	18.81	5,812.29
	SSE PLC	625	14.40	9,000.00
	ARM HOLDINGS PLC	1,157	9.83	11,373.31
英ボンド小計		262,838		954,592.60 (150,711,079)
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	232	43.84	10,170.88
	GIVAUDAN-REG	5	1,282.00	6,410.00

	HOLCIM LTD-REG	222	66.60	14,785.20	
	SYNGENTA AG-REG	52	367.70	19,120.40	
	ABB LTD-REG	1,234	23.10	28,505.40	
	GEBERIT AG-REG	61	251.80	15,359.80	
	ADECCO SA-REG	199	65.75	13,084.25	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	29	114.50	3,320.50	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	329	92.45	30,416.05	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	30	579.50	17,385.00	
	NESTLE SA-REG	1,774	65.55	116,285.70	
	ACTELION LTD-REG	171	69.15	11,824.65	
	NOVARTIS AG-REG	1,262	70.35	88,781.70	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	386	248.70	95,998.20	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	901	28.77	25,921.77	
	JULIUS BAER GROUP LTD	290	44.40	12,876.00	
	UBS AG-REG	2,163	18.92	40,923.96	
	SWISS RE AG	194	79.50	15,423.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	82	247.20	20,270.40	
スイスフラン小計		9,616		586,862.86	(64,155,847)
スウェーデンク ローナ	ASSA ABLOY AB-B	322	300.30	96,696.60	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	679	184.70	125,411.30	
	SANDVIK AB	664	89.55	59,461.20	
	SKANSKA AB-B SHS	355	124.90	44,339.50	
	SKF AB-B SHS	482	173.40	83,578.80	
	VOLVO AB-B SHARES	865	88.10	76,206.50	
	SECURITAS AB-B SHS	836	74.75	62,491.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	552	279.20	154,118.40	
	NORDEA BANK AB	1,468	83.00	121,844.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,545	78.70	121,591.50	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	325	288.90	93,892.50	
	SWEDBANK AB - A SHARES	544	170.10	92,534.40	
	ERICSSON LM-B SHS	1,708	78.00	133,224.00	
	TELIASONERA AB	1,433	53.50	76,665.50	
スウェーデンクローナ小計		11,778		1,342,055.20	(20,748,173)

ノルウェークローネ	STATOIL ASA	600	142.80	85,680.00	
	NORSK HYDRO A S	1,642	26.81	44,022.02	
	YARA INTERNATIONAL ASA	199	254.30	50,605.70	
	ORKLA ASA	1,079	46.72	50,410.88	
	DNB ASA	960	105.80	101,568.00	
	TELENOR ASA	666	150.60	100,299.60	
ノルウェークローネ小計		5,146		432,586.20	(7,167,953)
デンマーククローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S - B	1	53,950.00	53,950.00	
	CARLSBERG AS-B	110	566.00	62,260.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	238	980.50	233,359.00	
	DANSKE BANK A/S	622	127.40	79,242.80	
デンマーククローネ小計		971		428,811.80	(7,748,629)
豪ドル	ORIGIN ENERGY LTD	944	14.65	13,829.60	
	SANTOS LTD	807	14.76	11,911.32	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	347	38.45	13,342.15	
	WORLEYPARSONS LTD	285	22.50	6,412.50	
	BHP BILLITON LTD	1,762	37.41	65,916.42	
	NEWCREST MINING LTD	538	10.99	5,912.62	
	ORICA LIMITED	480	21.04	10,099.20	
	RIO TINTO LTD	244	63.77	15,559.88	
	LEIGHTON HOLDINGS LTD	219	17.73	3,882.87	
	BRAMBLES LTD	1,733	9.46	16,394.18	
	CROWN LTD	629	16.79	10,560.91	
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	1,652	2.65	4,377.80	
	TABCORP HOLDINGS LTD	1,303	3.54	4,612.62	
	WESFARMERS LTD	565	42.02	23,741.30	
	WOOLWORTHS LTD	691	34.49	23,832.59	
	COCA-COLA AMATIL LTD	768	12.90	9,907.20	
	CSL LTD	312	66.47	20,738.64	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	1,516	32.66	49,512.56	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	883	76.28	67,355.24	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,269	36.08	45,785.52	
WESTPAC BANKING CORP	1,691	34.36	58,102.76		

	MACQUARIE GROUP LTD	306	51.20	15,667.20	
	AMP LTD	1,916	4.80	9,196.80	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	1,863	5.82	10,842.66	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	853	14.32	12,214.96	
	SUNCORP GROUP LTD	1,427	13.13	18,736.51	
	COMPUTERSHARE LTD	820	10.45	8,569.00	
	TELSTRA CORPORATION LTD	3,293	5.07	16,695.51	
	AGL ENERGY LTD	726	15.40	11,180.40	
豪ドル小計		29,842		584,890.92	(54,810,128)
香港ドル	HUTCHISON WHAMPOA LTD	1,411	95.10	134,186.10	
	LI & FUNG LTD	4,000	10.64	42,560.00	
	SANDS CHINA LTD	2,000	57.35	114,700.00	
	BANK OF EAST ASIA	1,880	32.35	60,818.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,000	24.75	49,500.00	
	HANG SENG BANK LTD	550	127.20	69,960.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	880	123.80	108,944.00	
	AIA GROUP LTD	6,600	38.75	255,750.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	920	119.70	110,124.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	3,000	24.90	74,700.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,100	45.80	50,380.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	933	100.50	93,766.50	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	754	89.65	67,596.10	
	WHARF HOLDINGS LTD	2,100	66.65	139,965.00	
	CLP HOLDINGS LTD	1,194	61.45	73,371.30	
	HONG KONG & CHINA GAS	6,619	18.00	119,142.00	
香港ドル小計		35,941		1,565,463.00	(19,693,524)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	1,100	10.87	11,957.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	1,000	10.48	10,480.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	9,000	1.49	13,455.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,202	16.60	19,953.20	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,708	10.40	17,763.20	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	842	20.79	17,505.18	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	2,000	7.41	14,820.00	

	CAPITALAND LTD	4,000	3.13	12,520.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	500	10.45	5,225.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	5,000	3.73	18,650.00	
シンガポールドル小計		26,352		142,328.58 (11,238,264)	
イスラエルシュケル	TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	587	146.30	85,878.10	
イスラエルシュケル小計		587		85,878.10 (2,372,811)	
合 計		655,217		1,479,373,496 (1,479,373,496)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	AMERICAN TOWER CORP	314	25,377.48	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	104	13,672.88	
		BOSTON PROPERTIES INC	143	15,678.52	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	200	10,982.00	
		HCP INC	315	13,560.75	
		HEALTH CARE REIT INC	271	18,013.37	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	634	11,906.52	
		KIMCO REALTY CORPORATION	540	11,669.40	
		PROLOGIS INC	405	16,572.60	
		PUBLIC STORAGE	113	19,691.38	
		SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	185	29,544.50	
		THE MACERICH COMPANY	214	12,788.64	
		VENTAS INC	245	16,495.85	
		VORNADO REALTY TRUST	146	13,302.06	
		WEYERHAEUSER CO	527	16,542.53	
米ドル合計			4,356	245,798.48 (23,980,099)	
ユーロ	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE-NA	61	11,873.65	
ユーロ合計			61	11,873.65 (1,600,449)	
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	1,166	7,322.48	

		LAND SECURITIES GROUP PLC	944	9,355.04	
英債券合計			2,110	16,677.52 (2,633,046)	
豪ドル	投資証券	LEND LEASE GROUP	919	10,393.89	
		WESTFIELD GROUP	1,209	13,226.46	
		WESTFIELD RETAIL TRUST	3,220	9,949.80	
豪ドル合計			5,348	33,570.15 (3,145,858)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	2,500	96,750.00	
香港ドル合計			2,500	96,750.00 (1,217,115)	
合計				32,576,567 (32,576,567)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 343 銘柄	97.3%	—	57.3%
	投資証券 15 銘柄	—	2.7%	1.6%
加ドル	株式 49 銘柄	100.0%	—	4.6%
ユーロ	株式 111 銘柄	99.2%	—	13.5%
	投資証券 1 銘柄	—	0.8%	0.1%
英債券	株式 59 銘柄	98.3%	—	10.0%
	投資証券 2 銘柄	—	1.7%	0.2%
スイスフラン	株式 19 銘柄	100.0%	—	4.2%
スウェーデンクローナ	株式 14 銘柄	100.0%	—	1.4%
ノルウェークローネ	株式 6 銘柄	100.0%	—	0.5%
デンマーククローネ	株式 4 銘柄	100.0%	—	0.5%
豪ドル	株式 29 銘柄	94.6%	—	3.6%
	投資証券 3 銘柄	—	5.4%	0.2%
香港ドル	株式 16 銘柄	94.2%	—	1.3%
	投資証券 1 銘柄	—	5.8%	0.1%
シンガポールドル	株式 10 銘柄	100.0%	—	0.7%
イスラエルシェケル	株式 1 銘柄	100.0%	—	0.2%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

平成 24 年 10 月 26 日現在 平成 25 年 10 月 28 日現在

	平成 24 年 10 月 26 日現在	平成 25 年 10 月 28 日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	23,445,690	30,393,211
国債証券	24,348,578,740	27,135,308,660
地方債証券	1,998,839,000	2,312,856,000
特殊債券	2,903,682,603	2,476,924,000
社債券	2,182,644,000	2,279,816,000
未収利息	89,004,354	95,326,764
前払費用	1,021,799	1,834,425
流動資産合計	31,547,216,186	34,332,459,060
資産合計	31,547,216,186	34,332,459,060
負債の部		
流動負債		
未払解約金	6,252,210	18,951,655
流動負債合計	6,252,210	18,951,655
負債合計	6,252,210	18,951,655
純資産の部		
元本等		
元本	25,106,160,065	26,729,401,948
剰余金		
剰余金又は欠損金 (△)	6,434,803,911	7,584,105,457
元本等合計	31,540,963,976	34,313,507,405
純資産合計	31,540,963,976	34,313,507,405
負債純資産合計	31,547,216,186	34,332,459,060

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成 24 年 10 月 26 日現在	平成 25 年 10 月 28 日現在
1.	期首	平成 23 年 10 月 27 日	平成 24 年 10 月 27 日
	期首元本額	25,987,788,436 円	25,106,160,065 円
	期首からの追加設定元本額	1,802,086,670 円	4,332,159,284 円
	期首からの一部解約元本額	2,683,715,041 円	2,708,917,401 円
	元本の内訳 ※		
	DCインデックスバランス（株式20）	464,923,776 円	546,869,516 円
	DCインデックスバランス（株式40）	569,838,246 円	720,630,370 円
	DCインデックスバランス（株式60）	386,310,060 円	507,234,166 円
	DCインデックスバランス（株式80）	63,246,822 円	91,941,013 円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	1,105,071,789 円	1,167,452,017 円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	7,126,691,792 円	7,327,590,304 円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	8,126,582 円	8,143,932 円
	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（債券資産）	99,397,477 円	62,711,113 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	7,420,263 円	7,733,131 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	42,502,040 円	37,831,248 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	185,939,603 円	163,675,666 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	677,839,851 円	592,869,206 円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	6,942,590,807 円	7,401,918,468 円
	世界アセットバランスファンド40（適格機関投資家向け）	113,893,062 円	113,652,101 円
	世界アセットバランスファンド25（適格機関投資家向け）	195,112,931 円	198,662,714 円
	3資産バランスファンド（適格機関投資家向け）	21,261,988 円	— 円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	28,156,286 円	33,295,646 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	874,366,945 円	1,015,097,125 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	808,826,593 円	988,707,628 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	382,806,853 円	518,126,902 円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式80)	56,241,735 円	78,440,524 円
年金積立 インデックスファンド日本債券 日本債券インデックスファンド (個人型年金向け)	4,800,769,855 円 144,824,709 円	4,983,358,152 円 163,461,006 円
計	25,106,160,065 円	26,729,401,948 円
2. 受益権の総数	25,106,160,065 口	26,729,401,948 口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

	自 平成 23 年 10 月 27 日 至 平成 24 年 10 月 26 日	自 平成 24 年 10 月 27 日 至 平成 25 年 10 月 28 日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

	平成 24 年 10 月 26 日現在	平成 25 年 10 月 28 日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成 24 年 10 月 26 日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	214,690,300
地方債証券	△3,633,000
特殊債券	△10,119,000
社債券	24,949,000
合計	225,887,300

(平成 25 年 10 月 28 日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	294,126,790
地方債証券	△1,740,000
特殊債券	△19,596,000
社債券	△2,874,000
合計	269,916,790

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成 24 年 10 月 26 日現在		平成 25 年 10 月 28 日現在	
1口当たり純資産額	1.2563円	1口当たり純資産額	1.2837円
(1万口当たり純資産額)	(12,563円)	(1万口当たり純資産額)	(12,837円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第3 2 3 回利付国債 (2年)	210,000,000	210,046,200	
	第3 2 4 回利付国債 (2年)	100,000,000	100,024,000	
	第3 2 9 回利付国債 (2年)	100,000,000	100,178,000	
	第3 3 2 回利付国債 (2年)	150,000,000	150,000,000	
	第8 7 回利付国債 (5年)	460,000,000	462,198,800	
	第8 8 回利付国債 (5年)	140,000,000	140,813,400	
	第8 9 回利付国債 (5年)	330,000,000	331,699,500	

第90回利付国債（5年）	50,000,000	50,175,500	
第91回利付国債（5年）	50,000,000	50,287,500	
第92回利付国債（5年）	15,000,000	15,057,900	
第93回利付国債（5年）	445,000,000	448,751,350	
第94回利付国債（5年）	70,000,000	70,739,200	
第95回利付国債（5年）	220,000,000	222,565,200	
第96回利付国債（5年）	150,000,000	151,392,000	
第97回利付国債（5年）	350,000,000	352,576,000	
第98回利付国債（5年）	55,000,000	55,260,150	
第99回利付国債（5年）	200,000,000	201,554,000	
第100回利付国債（5年）	50,000,000	50,244,500	
第101回利付国債（5年）	170,000,000	171,407,600	
第102回利付国債（5年）	280,000,000	281,442,000	
第104回利付国債（5年）	50,000,000	50,092,500	
第105回利付国債（5年）	100,000,000	100,162,000	
第106回利付国債（5年）	340,000,000	340,459,000	
第107回利付国債（5年）	210,000,000	210,214,200	
第109回利付国債（5年）	100,000,000	99,630,000	
第111回利付国債（5年）	40,000,000	40,374,000	
第112回利付国債（5年）	160,000,000	161,507,200	
第114回利付国債（5年）	90,000,000	90,413,100	
第1回利付国債（40年）	25,000,000	29,833,250	
第2回利付国債（40年）	165,000,000	188,217,150	
第3回利付国債（40年）	20,000,000	22,812,000	
第4回利付国債（40年）	75,000,000	85,526,250	
第5回利付国債（40年）	20,000,000	21,670,400	
第6回利付国債（40年）	50,000,000	52,607,000	
第265回利付国債（10年）	50,000,000	50,808,000	
第266回利付国債（10年）	118,000,000	119,773,540	
第268回利付国債（10年）	361,000,000	368,097,260	
第269回利付国債（10年）	90,000,000	91,520,100	
第270回利付国債（10年）	88,000,000	89,741,520	
第271回利付国債（10年）	146,000,000	148,649,900	
第272回利付国債（10年）	178,000,000	182,382,360	
第273回利付国債（10年）	111,000,000	113,942,610	

第274回利付国債（10年）	73,000,000	75,181,970	
第276回利付国債（10年）	35,000,000	36,120,700	
第278回利付国債（10年）	80,000,000	83,217,600	
第279回利付国債（10年）	30,000,000	31,349,400	
第280回利付国債（10年）	156,000,000	163,302,360	
第281回利付国債（10年）	182,000,000	190,998,080	
第282回利付国債（10年）	24,000,000	25,088,640	
第283回利付国債（10年）	25,000,000	26,206,000	
第284回利付国債（10年）	462,000,000	484,679,580	
第285回利付国債（10年）	261,000,000	274,720,770	
第286回利付国債（10年）	186,000,000	197,068,860	
第287回利付国債（10年）	35,000,000	37,209,550	
第288回利付国債（10年）	18,000,000	19,071,720	
第289回利付国債（10年）	199,000,000	209,879,330	
第290回利付国債（10年）	406,000,000	427,554,540	
第291回利付国債（10年）	287,000,000	300,988,380	
第292回利付国債（10年）	241,000,000	256,939,740	
第293回利付国債（10年）	96,000,000	103,105,920	
第294回利付国債（10年）	32,000,000	34,221,440	
第295回利付国債（10年）	13,000,000	13,782,990	
第296回利付国債（10年）	126,000,000	133,964,460	
第297回利付国債（10年）	148,000,000	157,033,920	
第298回利付国債（10年）	221,000,000	233,367,160	
第299回利付国債（10年）	750,000,000	793,537,500	
第300回利付国債（10年）	86,000,000	91,908,200	
第301回利付国債（10年）	223,000,000	238,828,540	
第302回利付国債（10年）	14,000,000	14,915,880	
第303回利付国債（10年）	581,000,000	619,961,860	
第305回利付国債（10年）	673,000,000	714,860,600	
第306回利付国債（10年）	233,000,000	249,214,470	
第308回利付国債（10年）	140,000,000	148,965,600	
第309回利付国債（10年）	34,000,000	35,723,800	
第310回利付国債（10年）	88,000,000	91,879,040	
第311回利付国債（10年）	93,000,000	95,847,660	
第312回利付国債（10年）	205,000,000	216,758,800	

第3 1 3 回利付国債（10年）	420,000,000	446,955,600	
第3 1 5 回利付国債（10年）	85,000,000	89,806,750	
第3 1 6 回利付国債（10年）	35,000,000	36,720,600	
第3 1 7 回利付国債（10年）	165,000,000	173,104,800	
第3 1 8 回利付国債（10年）	205,000,000	213,509,550	
第3 1 9 回利付国債（10年）	180,000,000	188,814,600	
第3 2 0 回利付国債（10年）	100,000,000	104,114,000	
第3 2 1 回利付国債（10年）	215,000,000	223,651,600	
第3 2 2 回利付国債（10年）	200,000,000	206,438,000	
第3 2 3 回利付国債（10年）	45,000,000	46,413,450	
第3 2 4 回利付国債（10年）	75,000,000	76,704,000	
第3 2 5 回利付国債（10年）	270,000,000	275,837,400	
第3 2 6 回利付国債（10年）	30,000,000	30,351,900	
第3 2 7 回利付国債（10年）	140,000,000	142,858,800	
第3 2 8 回利付国債（10年）	275,000,000	275,365,750	
第3 2 9 回利付国債（10年）	210,000,000	213,922,800	
第3 3 0 回利付国債（10年）	60,000,000	61,063,200	
第1 4 回利付国債（30年）	208,000,000	240,036,160	
第1 5 回利付国債（30年）	162,000,000	189,773,280	
第1 8 回利付国債（30年）	50,000,000	56,798,500	
第2 3 回利付国債（30年）	55,000,000	64,677,250	
第2 4 回利付国債（30年）	158,000,000	185,872,780	
第2 6 回利付国債（30年）	30,000,000	34,734,600	
第2 7 回利付国債（30年）	59,000,000	69,621,180	
第2 8 回利付国債（30年）	14,000,000	16,558,780	
第2 9 回利付国債（30年）	276,000,000	321,308,160	
第3 0 回利付国債（30年）	127,000,000	145,411,190	
第3 1 回利付国債（30年）	60,000,000	67,517,400	
第3 2 回利付国債（30年）	40,000,000	45,918,800	
第3 3 回利付国債（30年）	50,000,000	54,218,500	
第3 4 回利付国債（30年）	165,000,000	186,154,650	
第3 5 回利付国債（30年）	120,000,000	130,134,000	
第3 6 回利付国債（30年）	310,000,000	336,173,300	
第3 7 回利付国債（30年）	70,000,000	74,295,200	
第3 8 回利付国債（30年）	50,000,000	51,843,000	

第39回利付国債（30年）	75,000,000	79,523,250	
第40回利付国債（30年）	40,000,000	41,449,600	
第29回利付国債（20年）	110,000,000	118,543,700	
第31回利付国債（20年）	40,000,000	43,236,000	
第33回利付国債（20年）	200,000,000	221,198,000	
第34回利付国債（20年）	85,000,000	94,609,250	
第37回利付国債（20年）	63,000,000	70,174,440	
第39回利付国債（20年）	86,000,000	95,097,940	
第41回利付国債（20年）	27,000,000	28,862,730	
第42回利付国債（20年）	178,000,000	200,764,420	
第43回利付国債（20年）	73,000,000	84,302,590	
第44回利付国債（20年）	51,000,000	58,140,000	
第47回利付国債（20年）	21,000,000	23,646,630	
第48回利付国債（20年）	99,000,000	113,751,990	
第49回利付国債（20年）	57,000,000	63,979,650	
第50回利付国債（20年）	237,000,000	262,617,330	
第51回利付国債（20年）	39,000,000	43,529,460	
第54回利付国債（20年）	15,000,000	17,054,400	
第55回利付国債（20年）	66,000,000	74,089,620	
第57回利付国債（20年）	137,000,000	152,818,020	
第58回利付国債（20年）	135,000,000	150,894,900	
第59回利付国債（20年）	33,000,000	36,349,830	
第60回利付国債（20年）	545,000,000	585,820,500	
第61回利付国債（20年）	27,000,000	28,021,680	
第63回利付国債（20年）	31,000,000	34,483,470	
第64回利付国債（20年）	54,000,000	60,638,760	
第65回利付国債（20年）	140,000,000	157,470,600	
第66回利付国債（20年）	34,000,000	37,899,460	
第67回利付国債（20年）	84,000,000	94,584,000	
第68回利付国債（20年）	38,000,000	43,944,340	
第70回利付国債（20年）	49,000,000	57,762,180	
第72回利付国債（20年）	42,000,000	48,292,020	
第73回利付国債（20年）	13,000,000	14,830,660	
第74回利付国債（20年）	78,000,000	89,841,180	
第76回利付国債（20年）	151,000,000	170,648,120	

第 8 8 回利付国債（20年）	300,000,000	353,475,000	
第 9 0 回利付国債（20年）	156,000,000	181,838,280	
第 9 1 回利付国債（20年）	260,000,000	306,287,800	
第 9 2 回利付国債（20年）	110,000,000	126,776,100	
第 9 4 回利付国債（20年）	50,000,000	57,580,500	
第 9 5 回利付国債（20年）	32,000,000	37,624,640	
第 9 6 回利付国債（20年）	98,000,000	112,695,100	
第 9 7 回利付国債（20年）	45,000,000	52,287,300	
第 9 8 回利付国債（20年）	44,000,000	50,550,280	
第 9 9 回利付国債（20年）	117,000,000	134,273,880	
第 1 0 0 回利付国債（20年）	30,000,000	34,790,100	
第 1 0 1 回利付国債（20年）	66,000,000	78,310,320	
第 1 0 2 回利付国債（20年）	106,000,000	125,589,860	
第 1 0 3 回利付国債（20年）	11,000,000	12,883,530	
第 1 0 4 回利付国債（20年）	33,000,000	37,755,630	
第 1 0 5 回利付国債（20年）	112,000,000	128,049,600	
第 1 0 6 回利付国債（20年）	122,000,000	141,156,440	
第 1 0 7 回利付国債（20年）	80,000,000	91,330,400	
第 1 0 8 回利付国債（20年）	134,000,000	149,170,140	
第 1 0 9 回利付国債（20年）	107,000,000	118,889,840	
第 1 1 0 回利付国債（20年）	148,000,000	168,583,840	
第 1 1 1 回利付国債（20年）	90,000,000	103,624,200	
第 1 1 3 回利付国債（20年）	170,000,000	192,863,300	
第 1 1 4 回利付国債（20年）	52,000,000	58,844,760	
第 1 1 6 回利付国債（20年）	185,000,000	211,782,450	
第 1 1 7 回利付国債（20年）	30,000,000	33,882,600	
第 1 1 8 回利付国債（20年）	70,000,000	77,874,300	
第 1 1 9 回利付国債（20年）	50,000,000	54,123,000	
第 1 2 0 回利付国債（20年）	70,000,000	73,678,500	
第 1 2 1 回利付国債（20年）	22,000,000	24,078,120	
第 1 2 2 回利付国債（20年）	80,000,000	86,316,800	
第 1 2 3 回利付国債（20年）	55,000,000	61,685,800	
第 1 2 4 回利付国債（20年）	50,000,000	55,332,000	
第 1 2 5 回利付国債（20年）	50,000,000	56,743,500	
第 1 2 6 回利付国債（20年）	25,000,000	27,599,000	

第128回利付国債(20年)	35,000,000	38,012,800	
第129回利付国債(20年)	115,000,000	123,073,000	
第130回利付国債(20年)	80,000,000	85,433,600	
第131回利付国債(20年)	25,000,000	26,298,750	
第132回利付国債(20年)	90,000,000	94,452,300	
第133回利付国債(20年)	30,000,000	31,967,100	
第134回利付国債(20年)	30,000,000	31,894,500	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	31,407,600	
第136回利付国債(20年)	210,000,000	216,457,500	
第137回利付国債(20年)	140,000,000	146,207,600	
第138回利付国債(20年)	50,000,000	50,589,500	
第140回利付国債(20年)	280,000,000	291,676,000	
第141回利付国債(20年)	250,000,000	259,947,500	
第142回利付国債(20年)	25,000,000	26,409,750	
第143回利付国債(20年)	115,000,000	117,432,250	
第144回利付国債(20年)	40,000,000	40,180,800	
第145回利付国債(20年)	125,000,000	129,478,750	
第146回利付国債(20年)	95,000,000	98,211,000	
国債証券 合計	25,430,000,000	27,135,308,660	
地方債証券			
第636回東京都公募公債	100,000,000	104,935,000	
第682回東京都公募公債	100,000,000	106,161,000	
第708回東京都公募公債	100,000,000	102,593,000	
第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	118,560,000	
平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	205,432,000	
平成19年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	106,111,000	
平成19年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	105,591,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	106,129,000	
平成18年度第1回広島県公募公債	100,000,000	105,381,000	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	103,930,000	
平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	101,629,000	
平成23年度第4回福岡県公募公債	100,000,000	100,493,000	
平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	100,736,000	
平成17年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	101,989,000	
第55回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,471,000	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,056,000	

	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	101,733,000	
	平成16年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	101,422,000	
	第4回京都市公募公債(20年)	100,000,000	118,871,000	
	平成18年度第1回鹿児島県公募公債(10年)	100,000,000	105,099,000	
	平成23年度第2回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	103,534,000	
地方債証券 合計		2,200,000,000	2,312,856,000	
特殊債券	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	105,913,000	
	第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	106,197,000	
	第6回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	105,389,000	
	第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,884,000	
	第21回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,917,000	
	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,024,000	
	第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,636,000	
	第335回政府保証道路債券	100,000,000	101,477,000	
	第336回政府保証道路債券	100,000,000	101,600,000	
	第338回政府保証道路債券	100,000,000	101,943,000	
	第343回政府保証道路債券	100,000,000	101,960,000	
	第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,508,000	
	第20回公営企業債券	100,000,000	104,865,000	
	第858回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,938,000	
	第199回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	102,311,000	
	第25回国際協力銀行債券	100,000,000	104,296,000	
	第8回農林漁業金融公庫債券	200,000,000	203,482,000	
	第5回沖縄振興開発金融公庫債券	200,000,000	203,204,000	
	い第714号農林債	100,000,000	100,755,000	
	い第722号農林債	100,000,000	100,590,000	
い第745号農林債	100,000,000	100,291,000		
第267回信金中金債(5年)	100,000,000	100,744,000		
特殊債券 合計		2,400,000,000	2,476,924,000	
社債券	第324回東京交通債券	100,000,000	110,246,000	
	第5回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債(2010)	100,000,000	101,225,000	
	第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債(2011)	100,000,000	101,545,000	
	第8回帝人株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,463,000	

第28回東レ株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	102,060,000	
第32回住友化学株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	102,779,000	
第12回武田薬品工業株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,570,000	
第2回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,668,000	
第6回株式会社資生堂無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,530,000	
第15回株式会社豊田自動織機無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	102,728,000	
第15回ダイキン工業株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	103,030,000	
第11回パナソニック株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	102,503,000	
第18回株式会社ニコン無担保社債（特定社債間限定同順位特約付）	100,000,000	102,516,000	
第26回三井不動産株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	105,020,000	
第65回三菱地所株式会社無担保社債（担保提供制限等財務上特約無）	100,000,000	105,380,000	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	108,809,000	
第25回日本郵船株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	112,366,000	
第7回KDDI株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	102,420,000	
第523回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	96,271,000	
第306回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	109,444,000	
第257回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,328,000	
第19回沖縄電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,915,000	
社債券 合計	2,200,000,000	2,279,816,000	
合計	32,230,000,000	34,204,904,660	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成 24 年 10 月 26 日現在	平成 25 年 10 月 28 日現在
資産の部		
流動資産		
預金	526,591,699	413,589,377
コール・ローン	50,403,359	31,073,541
国債証券	223,980,927,942	221,170,500,757
派生商品評価勘定	-	88,095
未収入金	545,928,863	529,441,791
未収利息	2,884,023,543	2,942,971,134
前払費用	72,225,632	74,741,747
流動資産合計	228,060,101,038	225,162,406,442
資産合計	228,060,101,038	225,162,406,442
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,768,417	1,554,025
未払解約金	456,857,911	507,270,024
流動負債合計	458,626,328	508,824,049
負債合計	458,626,328	508,824,049
純資産の部		
元本等		
元本	149,884,558,127	116,750,317,478
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	77,716,916,583	107,903,264,915
元本等合計	227,601,474,710	224,653,582,393
純資産合計	227,601,474,710	224,653,582,393
負債純資産合計	228,060,101,038	225,162,406,442

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成 24 年 10 月 26 日現在	平成 25 年 10 月 28 日現在
1.	期首	平成 23 年 10 月 27 日	平成 24 年 10 月 27 日
	期首元本額	328,307,863,758 円	149,884,558,127 円
	期首からの追加設定元本額	1,581,095,536 円	2,793,364,547 円
	期首からの一部解約元本額	180,004,401,167 円	35,927,605,196 円
	元本の内訳 ※		
	インデックスファンド海外債券ヘッジなし（DC 専用）	10,178,641,504 円	10,169,985,285 円
	DC インデックスバランス（株式 20）	60,404,469 円	56,363,037 円
	DC インデックスバランス（株式 40）	106,385,397 円	107,811,741 円
	DC インデックスバランス（株式 60）	130,847,111 円	137,491,394 円
	DC インデックスバランス（株式 80）	107,250,758 円	124,032,093 円
	財産 3 分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	41,302,697,103 円	35,943,492,442 円
	世界の財産 3 分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	5,998,185,805 円	4,917,898,995 円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	74,934,401,067 円	50,820,572,036 円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	46,557,824 円	42,551,474 円
	日興外国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,358,030,930 円	1,255,049,496 円
	財産 3 分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	9,899,741 円	21,935,607 円
	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（債券資産）	70,323,881 円	34,967,614 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 80）	6,232,597 円	5,145,285 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 60）	7,103,388 円	5,055,566 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 40）	17,186,845 円	12,146,020 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 20）	43,517,521 円	30,358,393 円
	世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	1,091,712,429 円	903,649,566 円
	国際分散型ファンド 40（適格機関投資家向け）	1,963,563,094 円	1,672,000,815 円
	世界アセットバランスファンド 40（適格機関投資家向	136,015,513 円	107,506,058 円

け) 世界アセットバランスファンド25 (適格機関投資家向け)	190,213,809 円	153,413,933 円
3資産バランスファンド (適格機関投資家向け)	17,680,881 円	—円
グローバルバランスファンド35 (適格機関投資家向け)	53,500,276 円	50,784,130 円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式20)	56,775,136 円	52,525,183 円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式40)	75,813,671 円	74,099,521 円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式60)	64,963,568 円	69,148,967 円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式80)	47,690,463 円	52,863,303 円
年金積立 インデックスファンド海外債券 (ヘッジなし)	11,584,994,196 円	9,709,002,469 円
海外債券インデックスファンド (個人型年金向け)	223,969,150 円	220,467,055 円
計	149,884,558,127 円	116,750,317,478 円
2. 受益権の総数	149,884,558,127 円	116,750,317,478 円

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

	自 平成 23 年 10 月 27 日 至 平成 24 年 10 月 26 日	自 平成 24 年 10 月 27 日 至 平成 25 年 10 月 28 日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

	平成 24 年 10 月 26 日現在	平成 25 年 10 月 28 日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品

	短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成 24 年 10 月 26 日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	5,098,832,565
合計	5,098,832,565

(平成 25 年 10 月 28 日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	△4,425,422,160
合計	△4,425,422,160

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(平成 24 年 10 月 26 日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
				うち1年超	
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	629,842,363	—	631,610,780	△1,768,417
	米ドル	267,530,520	—	268,837,500	△1,306,980
	ユーロ	259,298,000	—	259,650,000	△352,000
	英ポンド	67,258,152	—	67,293,200	△35,048
	デンマーククローネ	35,755,691	—	35,830,080	△74,389
合計		629,842,363	—	631,610,780	△1,768,417

(平成 25 年 10 月 28 日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
				うち1年超	
市場取引以外の	為替予約取引				

取引	売建	668,015,300	—	669,481,230	△1,465,930
	米ドル	177,196,448	—	177,541,000	△344,552
	加ドル	22,387,200	—	22,423,200	△36,000
	ユーロ	376,353,500	—	377,384,000	△1,030,500
	英ポンド	28,026,100	—	28,100,860	△74,760
	ポーランドズロチ	21,527,357	—	21,586,070	△58,713
	豪ドル	42,524,695	—	42,446,100	78,595
	合計	668,015,300	—	669,481,230	△1,465,930

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成24年10月26日現在		平成25年10月28日現在	
1口当たり純資産額	1.5185円	1口当たり純資産額	1.9242円
(1万口当たり純資産額)	(15,185円)	(1万口当たり純資産額)	(19,242円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-2.375%-14/09/30	3,700,000.00	3,776,312.50	
		US TREASURY N/B-2.375%-14/10/31	8,500,000.00	8,690,585.93	
		US TREASURY N/B-4.25%-14/11/15	32,700,000.00	34,099,968.75	
		US TREASURY N/B-2.125%-14/11/30	10,700,000.00	10,928,210.93	
		US TREASURY N/B-2.625%-14/12/31	25,500,000.00	26,231,132.81	

US TREASURY N/B-2.25%-15/01/31	14,700,000.00	15,081,281.25	
US TREASURY N/B-11.25%-15/02/15	3,000,000.00	3,428,906.25	
US TREASURY N/B-4.0%-15/02/15	32,700,000.00	34,306,898.43	
US TREASURY N/B-2.375%-15/02/28	2,300,000.00	2,366,125.00	
US TREASURY N/B-2.5%-15/03/31	13,000,000.00	13,418,437.50	
US TREASURY N/B-2.5%-15/04/30	26,000,000.00	26,885,625.00	
US TREASURY N/B-4.125%-15/05/15	23,100,000.00	24,484,195.31	
US TREASURY N/B-2.125%-15/05/31	9,500,000.00	9,780,546.87	
US TREASURY N/B-4.25%-15/08/15	22,200,000.00	23,780,015.62	
US TREASURY N/B-4.5%-15/11/15	22,200,000.00	24,095,671.87	
US TREASURY N/B-2.125%-15/12/31	4,300,000.00	4,463,937.50	
US TREASURY N/B-4.5%-16/02/15	22,500,000.00	24,625,195.31	
US TREASURY N/B-5.125%-16/05/15	23,700,000.00	26,516,226.56	
US TREASURY N/B-7.25%-16/05/15	9,000,000.00	10,557,421.87	
US TREASURY N/B-3.25%-16/05/31	16,500,000.00	17,687,226.56	
US TREASURY N/B-3.25%-16/06/30	10,000,000.00	10,732,812.50	
US TREASURY N/B-3.25%-16/07/31	4,200,000.00	4,513,687.50	
US TREASURY N/B-4.875%-16/08/15	8,000,000.00	8,965,000.00	
US TREASURY N/B-3.0%-16/08/31	4,000,000.00	4,275,312.50	
US TREASURY N/B-3.0%-16/09/30	5,200,000.00	5,561,968.75	
US TREASURY N/B-3.125%-16/10/31	6,900,000.00	7,413,726.56	
US TREASURY N/B-4.625%-16/11/15	6,000,000.00	6,719,531.25	
US TREASURY N/B-7.5%-16/11/15	9,700,000.00	11,711,234.37	
US TREASURY N/B-2.75%-16/11/30	1,000,000.00	1,063,828.12	
US TREASURY N/B-3.25%-16/12/31	8,700,000.00	9,396,679.68	
US TREASURY N/B-3.125%-17/01/31	9,000,000.00	9,693,984.37	
US TREASURY N/B-4.625%-17/02/15	9,250,000.00	10,419,980.46	
US TREASURY N/B-3.0%-17/02/28	5,400,000.00	5,799,515.62	
US TREASURY N/B-3.25%-17/03/31	8,800,000.00	9,537,687.50	
US TREASURY N/B-3.125%-17/04/30	7,000,000.00	7,561,093.75	
US TREASURY N/B-4.5%-17/05/15	12,500,000.00	14,102,539.06	
US TREASURY N/B-8.75%-17/05/15	8,000,000.00	10,221,250.00	
US TREASURY N/B-2.75%-17/05/31	8,800,000.00	9,398,812.50	
US TREASURY N/B-2.5%-17/06/30	4,000,000.00	4,235,000.00	
US TREASURY N/B-4.75%-17/08/15	18,700,000.00	21,388,125.00	

US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	17,900,000.00	20,208,820.31	
US TREASURY N/B-2.75%-17/12/31	18,000,000.00	19,262,812.50	
US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	15,700,000.00	17,289,625.00	
US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	7,550,000.00	8,464,847.65	
US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	17,400,000.00	19,687,828.12	
US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	15,200,000.00	17,019,250.00	
US TREASURY N/B-8.875%-19/02/15	5,000,000.00	6,926,953.12	
US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	5,600,000.00	5,988,937.50	
US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	4,400,000.00	4,793,250.00	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	3,000,000.00	3,348,281.25	
US TREASURY N/B-8.125%-19/08/15	9,000,000.00	12,315,234.37	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	13,800,000.00	15,230,671.87	
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	16,300,000.00	18,226,710.93	
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	8,000,000.00	8,879,375.00	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	7,950,000.00	11,514,457.03	
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	2,000,000.00	2,102,656.25	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	17,800,000.00	19,844,218.75	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	12,000,000.00	17,264,062.50	
US TREASURY N/B-7.25%-22/08/15	4,000,000.00	5,605,625.00	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	9,300,000.00	8,958,515.62	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	8,500,000.00	7,964,765.62	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,500,000.00	5,496,562.50	
US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,700,000.00	3,774,304.68	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	3,100,000.00	4,227,625.00	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	3,800,000.00	5,336,031.25	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	3,500,000.00	4,518,828.12	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	2,900,000.00	3,639,726.56	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	3,500,000.00	4,028,554.68	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	3,900,000.00	4,573,054.68	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	6,300,000.00	7,114,078.12	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	8,000,000.00	9,389,375.00	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	7,000,000.00	8,058,203.12	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	8,800,000.00	10,521,500.00	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	9,600,000.00	11,049,000.00	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	4,900,000.00	5,197,445.31	

		US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	8,200,000.00	9,250,625.00	
		US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,600,000.00	1,949,750.00	
		US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	7,200,000.00	8,283,375.00	
		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	5,600,000.00	5,794,687.50	
		US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	1,823,593.75	
		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	9,000,000.00	7,775,859.36	
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	3,000,000.00	3,017,109.37	
米ドル合計			809,450,000.00	893,631,878.70 (87,182,726,085)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-14/12/01	2,200,000.00	2,223,760.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-15/02/01	3,900,000.00	3,899,415.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-15/06/01	2,100,000.00	2,148,237.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.5%-15/06/01	4,650,000.00	4,903,099.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-15/11/01	500,000.00	499,070.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-15/12/01	2,350,000.00	2,442,237.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-16/06/01	4,900,000.00	5,253,878.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-16/06/01	1,200,000.00	1,225,608.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-17/06/01	5,100,000.00	5,561,295.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/03/01	2,500,000.00	2,460,125.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	2,220,000.00	2,473,635.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/09/01	650,000.00	636,220.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	2,600,000.00	2,862,730.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	2,070,000.00	2,261,350.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	1,650,000.00	1,779,987.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	1,850,000.00	1,914,491.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	2,000,000.00	1,844,000.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	220,000.00	219,384.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	700,000.00	1,124,284.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	1,700,000.00	2,331,771.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	1,950,000.00	2,764,788.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	2,300,000.00	3,078,412.00	
CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	2,460,000.00	2,910,180.00			
CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	2,150,000.00	2,356,486.00			
加ドル合計			53,920,000.00	59,174,443.80 (5,529,260,028)	

メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-9.5%-14/12/18	30,300,000.00	32,297,146.32	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-15/12/17	32,100,000.00	34,920,104.73	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.25%-16/06/16	3,700,000.00	3,904,420.15	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%-16/12/15	27,400,000.00	29,881,411.13	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-17/12/14	18,500,000.00	20,721,103.89	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	34,800,000.00	40,457,678.20	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	4,000,000.00	4,704,340.28	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	37,300,000.00	50,626,372.79	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	4,000,000.00	4,533,156.04	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	28,700,000.00	34,580,405.27	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	4,800,000.00	5,383,843.48	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	11,900,000.00	16,215,253.08	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	21,300,000.00	25,282,540.23	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	5,200,000.00	5,721,359.07	
メキシコペソ合計			264,000,000.00	309,229,134.66	(2,350,141,423)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-3.5%-15/03/28	1,150,000.00	1,202,027.03	
		BELGIUM KINGDOM-8.0%-15/03/28	1,800,000.00	1,995,117.30	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-15/09/28	1,720,000.00	1,831,833.36	
		BELGIUM KINGDOM-2.75%-16/03/28	1,500,000.00	1,580,770.05	
		BELGIUM KINGDOM-3.25%-16/09/28	2,840,000.00	3,053,875.00	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-17/03/28	2,430,000.00	2,689,042.86	
		BELGIUM KINGDOM-3.5%-17/06/28	250,000.00	273,055.60	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-17/09/28	2,400,000.00	2,815,960.56	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-18/03/28	3,130,000.00	3,518,852.42	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	2,050,000.00	2,324,078.03	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	2,900,000.00	3,254,869.81	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	2,270,000.00	2,625,911.48	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	2,050,000.00	2,326,951.31	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,500,000.00	1,728,196.95	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	1,450,000.00	1,693,943.50	
BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	2,940,000.00	3,780,288.45			

BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	850,000.00	929,355.32	
BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	3,420,000.00	4,251,997.76	
BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	2,230,000.00	2,523,222.25	
BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	850,000.00	871,998.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.3%-14/10/31	4,800,000.00	4,913,270.88	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%-15/01/31	5,200,000.00	5,417,865.96	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.0%-15/04/30	1,300,000.00	1,331,488.86	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%-15/07/30	4,620,000.00	4,815,846.88	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%-16/01/31	6,000,000.00	6,181,582.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.25%-16/04/30	4,700,000.00	4,861,135.27	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.25%-16/10/31	4,700,000.00	4,993,684.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%-17/01/31	2,550,000.00	2,678,768.11	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-17/07/30	3,750,000.00	4,163,031.37	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.5%-18/01/31	1,900,000.00	2,043,132.32	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%-18/07/30	3,700,000.00	3,928,567.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%-19/07/30	3,200,000.00	3,445,531.52	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%-19/10/31	3,000,000.00	3,174,077.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%-20/04/30	3,000,000.00	3,098,850.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%-20/10/31	2,800,000.00	3,022,330.08	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-21/04/30	3,800,000.00	4,259,312.46	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%-22/01/31	1,100,000.00	1,250,740.26	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%-23/01/31	1,200,000.00	1,320,093.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%-23/10/31	1,250,000.00	1,274,947.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%-24/01/31	3,100,000.00	3,253,832.23	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%-25/07/30	1,500,000.00	1,536,157.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%-26/07/30	1,700,000.00	1,926,546.25	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	3,550,000.00	4,041,711.21	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	3,070,000.00	3,429,408.27	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	2,900,000.00	2,589,153.35	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	2,300,000.00	2,268,148.91	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	2,100,000.00	2,005,899.84	
BUNDESobligation-2.5%-14/10/10	1,500,000.00	1,533,770.85	
BUNDESobligation-2.5%-15/02/27	4,500,000.00	4,641,007.05	
BUNDESobligation-2.25%-15/04/10	8,000,000.00	8,241,617.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 15/01/04	4,700,000.00	4,901,995.19	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 15/07/04	5,000,000.00	5,257,180.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%- 16/01/04	3,850,000.00	4,127,107.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.0%- 16/06/20	8,200,000.00	9,425,608.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 16/07/04	5,760,000.00	6,334,247.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 17/01/04	5,750,000.00	6,374,537.97	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 17/07/04	6,650,000.00	7,578,218.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 18/01/04	6,900,000.00	7,893,677.28	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 18/07/04	5,600,000.00	6,531,364.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 19/01/04	2,300,000.00	2,648,642.28	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%- 19/07/04	4,200,000.00	4,811,620.38	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 20/01/04	4,300,000.00	4,882,368.78	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%- 20/07/04	5,900,000.00	6,630,595.82	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	9,050,000.00	10,351,169.18	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 21/09/04	200,000.00	213,734.76	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	2,000,000.00	2,091,964.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	500,000.00	493,527.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-	1,000,000.00	981,710.80	

23/05/15			
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	1,950,000.00	2,768,237.35	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,800,000.00	2,720,912.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	2,200,000.00	3,099,429.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	2,130,000.00	2,779,265.53	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	1,840,000.00	2,786,821.12	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	2,650,000.00	3,772,148.33	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	4,900,000.00	6,606,102.09	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	3,900,000.00	4,828,668.39	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	3,550,000.00	4,625,323.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	3,600,000.00	5,060,800.44	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	1,500,000.00	1,689,625.65	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	850,000.00	825,682.43	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 15/02/01	8,100,000.00	8,417,168.46	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 15/04/15	1,000,000.00	1,024,946.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 15/06/15	1,600,000.00	1,640,950.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 15/07/15	2,450,000.00	2,574,006.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 15/08/01	11,100,000.00	11,527,166.85	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 16/04/15	4,000,000.00	4,185,372.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 16/08/01	9,000,000.00	9,422,653.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 17/02/01	8,600,000.00	9,063,673.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 17/08/01	8,000,000.00	8,772,923.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/02/01	4,200,000.00	4,502,904.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/06/01	1,000,000.00	1,029,294.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/08/01	4,200,000.00	4,505,365.20	

BUONI POLIENNALI DEL TES-4. 25%- 19/02/01	4, 300, 000. 00	4, 553, 756. 76	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4. 5%- 19/03/01	4, 350, 000. 00	4, 653, 822. 27	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4. 25%- 19/09/01	4, 790, 000. 00	5, 066, 075. 48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4. 5%- 20/02/01	4, 100, 000. 00	4, 365, 962. 49	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4. 25%- 20/03/01	3, 300, 000. 00	3, 468, 940. 53	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4. 0%- 20/09/01	4, 650, 000. 00	4, 830, 665. 05	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3. 75%- 21/08/01	5, 100, 000. 00	5, 180, 199. 03	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4. 75%- 21/09/01	5, 400, 000. 00	5, 802, 405. 84	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5. 0%- 22/03/01	2, 400, 000. 00	2, 604, 868. 32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5. 5%- 22/09/01	1, 000, 000. 00	1, 113, 742. 00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5. 5%- 22/11/01	500, 000. 00	556, 478. 40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4. 5%- 23/05/01	500, 000. 00	519, 106. 60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4. 75%- 23/08/01	1, 000, 000. 00	1, 064, 423. 80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9. 0%- 23/11/01	5, 410, 000. 00	7, 568, 371. 43	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5. 0%- 25/03/01	3, 400, 000. 00	3, 627, 689. 16	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7. 25%- 26/11/01	3, 800, 000. 00	4, 870, 203. 50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6. 5%- 27/11/01	5, 600, 000. 00	6, 762, 812. 56	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5. 25%- 29/11/01	4, 700, 000. 00	5, 049, 185. 56	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6. 0%- 31/05/01	5, 700, 000. 00	6, 598, 149. 00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5. 75%- 33/02/01	4, 650, 000. 00	5, 251, 670. 01	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5. 0%- 34/08/01	2, 300, 000. 00	2, 385, 579. 78	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4. 0%- 37/02/01	3, 200, 000. 00	2, 909, 666. 56	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5. 0%- 39/08/01	4, 500, 000. 00	4, 613, 238. 00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5. 0%- 40/09/01	3, 200, 000. 00	3, 262, 378. 56	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4. 75%-	1, 000, 000. 00	977, 148. 00	

44/09/01		
FINNISH GOVERNMENT-4.25%-15/07/04	860,000.00	918,483.95
FINNISH GOVERNMENT-1.75%-16/04/15	1,080,000.00	1,118,626.84
FINNISH GOVERNMENT-3.875%-17/09/15	1,420,000.00	1,591,547.07
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	1,150,000.00	1,353,327.59
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	1,470,000.00	1,652,864.91
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	1,050,000.00	1,188,130.02
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	100,000.00	95,914.11
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	1,780,000.00	2,093,630.30
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	400,000.00	409,749.76
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	440,000.00	427,911.44
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-14/10/25	5,850,000.00	6,069,255.66
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-15/04/25	6,150,000.00	6,444,647.11
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-15/10/25	6,760,000.00	7,117,473.53
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-16/04/25	10,300,000.00	11,019,749.58
FRANCE (GOVT OF)-5.0%-16/10/25	6,710,000.00	7,598,472.44
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-17/04/25	8,900,000.00	9,838,359.93
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-17/10/25	6,250,000.00	7,090,198.12
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-18/04/25	5,650,000.00	6,405,711.79
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-18/10/25	2,300,000.00	2,652,558.26
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25	7,700,000.00	8,930,856.55
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-19/10/25	1,050,000.00	1,480,016.68
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	4,700,000.00	5,341,610.16
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	6,400,000.00	7,197,307.52
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	2,300,000.00	2,434,650.74
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	8,070,000.00	9,209,604.24
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	5,500,000.00	6,066,744.20
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	4,350,000.00	4,689,383.95
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	4,000,000.00	6,161,168.40
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	1,400,000.00	1,339,862.58
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	4,150,000.00	4,855,020.67
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	3,800,000.00	5,133,760.86
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	4,600,000.00	4,999,810.84
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	1,000,000.00	991,664.40
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	3,070,000.00	4,059,897.86

FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	4,200,000.00	5,830,185.06	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	3,650,000.00	4,556,328.21	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	3,250,000.00	3,662,254.70	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	5,090,000.00	6,194,488.77	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	2,500,000.00	2,814,505.75	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	1,950,000.00	2,203,159.72	
FRENCH TREASURY NOTE-2.5%-15/01/15	1,200,000.00	1,233,141.12	
FRENCH TREASURY NOTE-2.0%-15/07/12	2,100,000.00	2,160,971.19	
FRENCH TREASURY NOTE-2.25%-16/02/25	2,100,000.00	2,189,507.04	
IRISH TREASURY-4.5%-15/02/18	520,000.00	547,383.20	
IRISH TREASURY-4.6%-16/04/18	1,570,000.00	1,695,230.89	
IRISH TREASURY-5.5%-17/10/18	950,000.00	1,070,205.40	
IRISH TREASURY-4.5%-18/10/18	1,500,000.00	1,641,261.00	
IRISH TREASURY-4.4%-19/06/18	1,150,000.00	1,245,720.25	
IRISH TREASURY-5.9%-19/10/18	1,000,000.00	1,157,525.00	
IRISH TREASURY-4.5%-20/04/18	1,900,000.00	2,044,156.23	
IRISH TREASURY-5.0%-20/10/18	1,300,000.00	1,436,405.10	
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	780,000.00	801,916.05	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	1,770,000.00	1,996,882.49	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-15/01/15	4,400,000.00	4,537,307.72	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-15/07/15	3,600,000.00	3,783,754.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-16/07/15	4,100,000.00	4,491,620.52	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.5%-17/07/15	4,750,000.00	5,405,675.75	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-18/01/15	220,000.00	223,540.41	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	3,420,000.00	3,894,282.52	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	2,600,000.00	2,996,401.46	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	2,550,000.00	2,881,890.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	2,100,000.00	2,336,009.76	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	500,000.00	513,666.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	2,400,000.00	2,758,062.96	
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	1,500,000.00	2,196,142.65	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	2,070,000.00	2,800,369.07	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	500,000.00	482,338.25	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	2,930,000.00	3,547,067.96	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	2,780,000.00	3,300,454.64	

		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-14/10/20	1,770,000.00	1,825,517.11	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-15/07/15	2,250,000.00	2,375,725.95	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.0%-16/09/15	1,870,000.00	2,059,807.24	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.2%-17/02/20	1,650,000.00	1,790,511.85	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-17/09/15	1,550,000.00	1,759,681.36	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	1,520,000.00	1,758,028.65	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	2,400,000.00	2,797,149.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.95%-19/06/18	220,000.00	228,741.10	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	1,980,000.00	2,280,665.17	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	2,210,000.00	2,494,362.91	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	1,100,000.00	1,251,233.94	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	1,400,000.00	1,564,172.68	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	280,000.00	270,201.82	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	1,200,000.00	1,512,548.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	1,200,000.00	1,718,538.48	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,910,000.00	2,321,870.10	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	650,000.00	678,787.46	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	580,000.00	704,232.46	
			636,700,000.00	712,327,668.57	
				(96,014,646,446)	
	ユーロ合計				
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-2.75%-15/01/22	1,200,000.00	1,234,378.92	
		UK TREASURY-4.75%-15/09/07	2,730,000.00	2,947,669.99	
		UK TREASURY-8.0%-15/12/07	4,900,000.00	5,676,006.63	
		UK TREASURY-2.0%-16/01/22	400,000.00	412,560.00	
		UK TREASURY-4.0%-16/09/07	6,740,000.00	7,366,496.48	
		UK TREASURY-1.75%-17/01/22	2,200,000.00	2,259,306.06	
		UK TREASURY-8.75%-17/08/25	4,100,000.00	5,270,238.81	
		UK TREASURY-1.0%-17/09/07	1,000,000.00	994,600.00	
		UK TREASURY-5.0%-18/03/07	3,250,000.00	3,758,861.27	
		UK TREASURY-1.25%-18/07/22	2,000,000.00	1,980,589.20	
		UK TREASURY-4.5%-19/03/07	3,650,000.00	4,192,491.10	
		UK TREASURY-3.75%-19/09/07	2,150,000.00	2,391,249.13	
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	4,750,000.00	5,579,128.17	
		UK TREASURY-3.75%-20/09/07	1,600,000.00	1,782,731.20	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	3,450,000.00	4,870,667.91	

		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	2,300,000.00	2,557,881.52	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	3,000,000.00	3,391,740.00	
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	900,000.00	872,057.07	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	2,590,000.00	3,161,179.69	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	1,950,000.00	2,230,981.54	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	1,710,000.00	2,329,873.97	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	2,500,000.00	3,020,994.50	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	3,150,000.00	3,598,133.17	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	4,050,000.00	4,780,729.35	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,050,000.00	1,201,246.62	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,550,000.00	1,917,685.57	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	2,100,000.00	2,411,827.32	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	3,650,000.00	4,193,978.48	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	3,150,000.00	3,782,112.70	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,220,000.00	1,169,171.01	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	3,450,000.00	4,002,199.41	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	3,100,000.00	3,627,804.14	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	500,000.00	533,123.00	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	4,920,000.00	5,844,518.18	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,700,000.00	1,936,141.56	
英債券合計			92,660,000.00	107,280,353.67 (16,937,422,237)	
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-2.5%-16/03/12	1,610,000.00	1,707,244.00	
		SWITZERLAND-4.25%-17/06/05	1,780,000.00	2,047,000.00	
		SWITZERLAND-2.25%-20/07/06	400,000.00	443,160.00	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	2,740,000.00	3,468,566.00	
スイスフラン合計			6,530,000.00	7,665,970.00 (838,043,840)	
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-4.5%-15/08/12	10,180,000.00	10,795,533.70	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.0%-16/07/12	8,500,000.00	8,885,815.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.75%-17/08/12	10,700,000.00	11,581,091.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	13,000,000.00	14,644,643.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	8,300,000.00	9,924,210.40	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	11,000,000.00	12,116,720.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	3,150,000.00	2,914,931.25	

		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	9,200,000.00	9,974,676.80	
スウェーデンクローナ合計			74,030,000.00	80,837,621.65	(1,249,749,630)
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-5.0%-15/05/15	11,750,000.00	12,339,861.75	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.25%-17/05/19	8,950,000.00	9,643,633.95	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	8,250,000.00	9,165,741.75	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	8,950,000.00	9,620,363.95	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	4,550,000.00	4,235,140.00	
ノルウェークローネ合計			42,450,000.00	45,004,741.40	(745,728,564)
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-4.0%-15/11/15	16,500,000.00	17,774,625.00	
		KINGDOM OF DENMARK-2.5%-16/11/15	600,000.00	638,145.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-17/11/15	15,500,000.00	17,612,061.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	27,000,000.00	31,578,687.00	
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	4,900,000.00	4,743,930.10	
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	5,350,000.00	8,105,785.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	18,050,000.00	24,500,167.50	
デンマーククローネ合計			87,900,000.00	104,953,400.60	(1,896,507,948)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-15/04/25	5,750,000.00	5,977,700.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.25%-15/10/24	4,500,000.00	4,790,025.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-16/04/25	6,000,000.00	6,280,800.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-16/10/25	2,800,000.00	2,931,320.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-17/04/25	2,100,000.00	2,205,420.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	9,200,000.00	9,852,740.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-18/07/25	1,900,000.00	1,823,525.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	5,000,000.00	5,487,750.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	4,000,000.00	4,346,800.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	3,200,000.00	3,580,640.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	4,300,000.00	4,831,695.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	1,450,000.00	1,433,977.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	1,950,000.00	2,235,870.00	
ポーランドズロチ合計			52,150,000.00	55,778,262.50	(1,794,944,487)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-14/10/21	1,850,000.00	1,885,553.30	

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.25%-15/04/15	3,080,000.00	3,245,020.24	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-15/10/21	1,240,000.00	1,289,635.96	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-16/06/15	2,950,000.00	3,092,207.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.0%-17/02/15	3,720,000.00	4,068,671.88	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-17/07/21	1,400,000.00	1,456,373.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-18/01/21	2,100,000.00	2,290,810.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	2,670,000.00	2,915,405.04	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	2,850,000.00	3,003,626.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	2,630,000.00	2,980,694.72	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	2,550,000.00	2,912,018.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	2,810,000.00	3,168,480.13	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	1,400,000.00	1,255,742.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	1,000,000.00	926,210.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,420,000.00	1,493,426.78	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,050,000.00	918,649.20	
豪ドル合計			34,720,000.00	36,902,526.35 (3,458,135,744)	
シンガポ ールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-1.375%-14/10/01	600,000.00	605,959.99	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-15/07/01	1,570,000.00	1,637,928.66	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.125%-16/04/01	500,000.00	509,600.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.75%-16/09/01	900,000.00	986,190.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-17/04/01	670,000.00	713,036.33	
		SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	770,000.00	881,239.33	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01	700,000.00	747,226.66	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	1,150,000.00	1,267,606.67	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	580,000.00	634,094.66	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	800,000.00	853,226.66	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	760,000.00	835,594.66	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	500,000.00	507,466.66	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	130,000.00	139,555.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	580,000.00	561,227.33	
シンガポールドル合計			10,210,000.00	10,879,952.61 (859,081,058)	
マレーシ アリンギ ット	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT-3.741%-15/02/27	2,200,000.00	2,221,050.89	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.835%-15/08/12	1,650,000.00	1,675,451.25	

		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.72%-15/09/30	850,000.00	877,055.77	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.197%-15/10/15	1,000,000.00	1,004,144.34	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.172%-16/07/15	1,400,000.00	1,402,660.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.262%-16/09/15	3,400,000.00	3,506,250.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.814%-17/02/15	1,900,000.00	1,929,450.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.012%-17/09/15	3,400,000.00	3,481,770.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	4,100,000.00	4,233,237.70	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	2,300,000.00	2,563,173.86	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	3,800,000.00	3,982,554.54	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	3,000,000.00	3,107,900.01	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,150,000.00	1,138,317.15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	2,500,000.00	2,604,583.32	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	445,868.86	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	1,300,000.00	1,241,133.80	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000.00	850,174.89	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	950,000.00	955,225.00	
マレーシアリングット合計			36,100,000.00	37,220,001.38 (1,160,147,443)	
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 14/12/21	2,600,000.00	2,684,491.16	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 17/09/15	14,500,000.00	15,382,020.50	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 18/12/21	10,000,000.00	10,568,887.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	15,000,000.00	15,173,869.50	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	10,000,000.00	9,760,938.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	28,300,000.00	34,424,538.84	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	6,850,000.00	5,940,169.30	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	8,600,000.00	6,563,820.14	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	12,700,000.00	9,684,673.29	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	6,000,000.00	5,909,733.60	
南アフリカランド合計			114,550,000.00	116,093,141.33 (1,153,965,824)	
合計				221,170,500,757	

(221, 170, 500, 757)

(注1) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 82 銘柄	100.0%	39.4%
加ドル	国債証券 24 銘柄	100.0%	2.5%
メキシコペソ	国債証券 14 銘柄	100.0%	1.1%
ユーロ	国債証券 204 銘柄	100.0%	43.3%
英ポンド	国債証券 35 銘柄	100.0%	7.7%
スイスフラン	国債証券 4 銘柄	100.0%	0.4%
スウェーデンクローナ	国債証券 8 銘柄	100.0%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券 5 銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 7 銘柄	100.0%	0.9%
ポーランドズロチ	国債証券 13 銘柄	100.0%	0.8%
豪ドル	国債証券 16 銘柄	100.0%	1.6%
シンガポールドル	国債証券 14 銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングギット	国債証券 18 銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 10 銘柄	100.0%	0.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	平成 24 年 10 月 26 日現在	平成 25 年 10 月 28 日現在
資産の部		
流動資産		
預金	129,235,946	114,350,875
コール・ローン	53,843,740	262,698,970
国債証券	27,812,499,897	29,769,919,451
派生商品評価勘定	2,294,420	12,760,582
未収利息	286,621,739	324,939,556
前払費用	14,648,832	18,274,464
流動資産合計	28,299,144,574	30,502,943,898
資産合計	28,299,144,574	30,502,943,898
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	997,052,890	516,618,773
未払解約金	2,320,490	6,389,181
流動負債合計	999,373,380	523,007,954
負債合計	999,373,380	523,007,954
純資産の部		
元本等		
元本	20,550,735,931	22,305,266,953
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	6,749,035,263	7,674,668,991
元本等合計	27,299,771,194	29,979,935,944
純資産合計	27,299,771,194	29,979,935,944
負債純資産合計	28,299,144,574	30,502,943,898

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成 24 年 10 月 26 日現在	平成 25 年 10 月 28 日現在
1.	期首	平成 23 年 10 月 27 日	平成 24 年 10 月 27 日
	期首元本額	21,844,897,199 円	20,550,735,931 円
	期首からの追加設定元本額	1,154,740,736 円	2,831,997,112 円
	期首からの一部解約元本額	2,448,902,004 円	1,077,466,090 円
	元本の内訳 ※		
	インデックスファンド海外債券ヘッジあり (DC 専用)	630,254,056 円	659,086,940 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 8 0)	7,004,522 円	7,402,745 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 6 0)	8,008,779 円	7,252,243 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 4 0)	19,454,343 円	17,409,276 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 2 0)	49,145,308 円	43,664,419 円
	国際分散型ファンド 4 0 (適格機関投資家向け)	17,515,781,536 円	18,889,991,185 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 2 0)	63,372,276 円	74,943,158 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 4 0)	84,712,607 円	105,203,040 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 6 0)	72,124,344 円	99,282,206 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 8 0)	53,077,042 円	75,260,610 円
	年金積立 インデックスファンド海外債券 (ヘッジあり)	2,047,801,118 円	2,325,771,131 円
	計	20,550,735,931 円	22,305,266,953 円
2.	受益権の総数	20,550,735,931 口	22,305,266,953 口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

	自 平成 23 年 10 月 27 日 至 平成 24 年 10 月 26 日	自 平成 24 年 10 月 27 日 至 平成 25 年 10 月 28 日
--	--	--

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

II 金融商品の時価等に関する事項

	平成 24 年 10 月 26 日現在	平成 25 年 10 月 28 日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成 24 年 10 月 26 日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	608,918,075
合計	608,918,075

(平成 25 年 10 月 28 日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	△444,705,265
合計	△444,705,265

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

(デリバティブ取引等に関する注記)
取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(平成24年10月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	27,361,253,810	—	28,356,012,280	△994,758,470
	米ドル	11,553,656,584	—	11,786,676,550	△233,019,966
	加ドル	813,436,499	—	833,230,620	△19,794,121
	メキシコペソ	221,328,120	—	225,238,780	△3,910,660
	ユーロ	10,936,545,712	—	11,509,349,760	△572,804,048
	英ポンド	2,145,914,072	—	2,251,273,940	△105,359,868
	スイスフラン	105,868,463	—	112,223,800	△6,355,337
	スウェーデンクローナ	158,577,407	—	163,114,080	△4,536,673
	ノルウェークローネ	75,152,023	—	77,985,210	△2,833,187
	デンマーククローネ	244,274,824	—	259,020,750	△14,745,926
	ポーランドズロチ	208,726,380	—	215,207,340	△6,480,960
	豪ドル	449,206,344	—	463,136,800	△13,930,456
	シンガポールドル	99,622,687	—	103,426,730	△3,804,043
	マレーシアリンギット	184,848,275	—	194,325,920	△9,477,645
	南アフリカランド	164,096,420	—	161,802,000	2,294,420
合計		27,361,253,810	—	28,356,012,280	△994,758,470

(平成25年10月28日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	29,632,969,789	—	30,136,827,980	△503,858,191
	米ドル	11,735,659,359	—	11,820,558,830	△84,899,471
	加ドル	737,785,775	—	730,149,100	7,636,675

メキシコペソ	329,155,258	—	337,426,800	△8,271,542
ユーロ	12,743,805,368	—	13,076,076,740	△332,271,372
英ポンド	2,239,969,571	—	2,274,214,590	△34,245,019
スイスフラン	136,155,863	—	139,296,000	△3,140,137
スウェーデンクローナ	172,284,425	—	176,821,750	△4,537,325
ノルウェークローネ	107,855,188	—	109,726,710	△1,871,522
デンマーククローネ	252,258,425	—	258,906,960	△6,648,535
ポーランドズロチ	236,452,602	—	244,632,410	△8,179,808
豪ドル	449,324,773	—	463,246,420	△13,921,647
シンガポールドル	116,002,632	—	118,066,220	△2,063,588
マレーシアリングット	226,738,533	—	234,117,870	△7,379,337
南アフリカランド	149,522,017	—	153,587,580	△4,065,563
合計	29,632,969,789	—	30,136,827,980	△503,858,191

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成 24 年 10 月 26 日現在		平成 25 年 10 月 28 日現在	
1口当たり純資産額	1.3284円	1口当たり純資産額	1.3441円
(1万口当たり純資産額)	(13,284円)	(1万口当たり純資産額)	(13,441円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-2.375%-14/09/30	2,450,000.00	2,500,531.25	
		US TREASURY N/B-0.25%-14/09/30	1,500,000.00	1,501,640.62	
		US TREASURY N/B-2.375%-14/10/31	900,000.00	920,179.68	
		US TREASURY N/B-4.25%-14/11/15	700,000.00	729,968.75	
		US TREASURY N/B-2.125%-14/11/30	1,850,000.00	1,889,457.03	
		US TREASURY N/B-0.25%-14/12/15	300,000.00	300,304.68	
		US TREASURY N/B-2.625%-14/12/31	1,000,000.00	1,028,671.87	
		US TREASURY N/B-0.25%-15/01/15	700,000.00	700,601.56	
		US TREASURY N/B-0.25%-15/01/31	150,000.00	150,128.90	
		US TREASURY N/B-11.25%-15/02/15	550,000.00	628,632.81	
		US TREASURY N/B-4.0%-15/02/15	1,300,000.00	1,363,882.81	
		US TREASURY N/B-2.375%-15/02/28	670,000.00	689,262.50	
		US TREASURY N/B-0.25%-15/02/28	1,500,000.00	1,500,820.31	
		US TREASURY N/B-0.375%-15/03/15	600,000.00	601,125.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-15/03/31	500,000.00	516,093.75	
		US TREASURY N/B-0.375%-15/04/15	1,900,000.00	1,904,007.81	
		US TREASURY N/B-4.125%-15/05/15	1,580,000.00	1,674,676.56	
		US TREASURY N/B-0.25%-15/05/15	2,000,000.00	2,000,156.25	
		US TREASURY N/B-2.125%-15/05/31	2,950,000.00	3,037,117.18	
		US TREASURY N/B-0.25%-15/07/15	1,500,000.00	1,499,414.06	
		US TREASURY N/B-1.75%-15/07/31	1,700,000.00	1,743,562.50	
		US TREASURY N/B-0.25%-15/07/31	1,500,000.00	1,498,945.31	
		US TREASURY N/B-0.25%-15/08/15	1,000,000.00	999,218.75	
		US TREASURY N/B-1.25%-15/08/31	600,000.00	610,500.00	
		US TREASURY N/B-0.25%-15/10/15	700,000.00	699,125.00	
		US TREASURY N/B-1.25%-15/10/31	1,650,000.00	1,680,550.78	
		US TREASURY N/B-4.5%-15/11/15	1,250,000.00	1,356,738.28	
		US TREASURY N/B-1.375%-15/11/30	2,450,000.00	2,502,445.31	
		US TREASURY N/B-2.125%-15/12/31	1,100,000.00	1,141,937.50	
		US TREASURY N/B-0.375%-16/01/15	1,000,000.00	1,000,000.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-16/01/31	650,000.00	673,714.84	
		US TREASURY N/B-4.5%-16/02/15	430,000.00	470,614.84	
		US TREASURY N/B-2.0%-16/04/30	1,300,000.00	1,350,070.31	

US TREASURY N/B-5.125%-16/05/15	220,000.00	246,142.18	
US TREASURY N/B-1.5%-16/06/30	3,000,000.00	3,079,453.12	
US TREASURY N/B-0.625%-16/07/15	1,000,000.00	1,002,734.37	
US TREASURY N/B-4.875%-16/08/15	1,460,000.00	1,636,112.50	
US TREASURY N/B-3.0%-16/08/31	1,800,000.00	1,923,890.62	
US TREASURY N/B-3.125%-16/10/31	1,000,000.00	1,074,453.12	
US TREASURY N/B-4.625%-16/11/15	1,160,000.00	1,299,109.37	
US TREASURY N/B-2.75%-16/11/30	1,000,000.00	1,063,828.12	
US TREASURY N/B-0.875%-16/11/30	900,000.00	906,187.50	
US TREASURY N/B-3.25%-16/12/31	1,250,000.00	1,350,097.65	
US TREASURY N/B-0.875%-16/12/31	1,000,000.00	1,005,937.50	
US TREASURY N/B-3.125%-17/01/31	1,430,000.00	1,540,266.40	
US TREASURY N/B-3.25%-17/03/31	1,170,000.00	1,268,078.90	
US TREASURY N/B-1.0%-17/03/31	2,000,000.00	2,015,312.50	
US TREASURY N/B-3.125%-17/04/30	1,050,000.00	1,134,164.06	
US TREASURY N/B-4.5%-17/05/15	820,000.00	925,126.56	
US TREASURY N/B-2.75%-17/05/31	1,000,000.00	1,068,046.87	
US TREASURY N/B-0.625%-17/05/31	1,500,000.00	1,488,867.18	
US TREASURY N/B-0.75%-17/06/30	1,200,000.00	1,194,937.50	
US TREASURY N/B-2.375%-17/07/31	1,100,000.00	1,159,984.37	
US TREASURY N/B-1.875%-17/09/30	1,750,000.00	1,811,933.59	
US TREASURY N/B-0.75%-17/10/31	1,500,000.00	1,486,171.87	
US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	480,000.00	541,912.50	
US TREASURY N/B-0.625%-17/11/30	1,700,000.00	1,673,437.50	
US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	250,000.00	275,312.50	
US TREASURY N/B-0.75%-18/02/28	1,200,000.00	1,182,562.50	
US TREASURY N/B-0.75%-18/03/31	300,000.00	295,101.56	
US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	200,000.00	224,234.37	
US TREASURY N/B-2.375%-18/06/30	700,000.00	737,789.06	
US TREASURY N/B-1.375%-18/07/31	350,000.00	352,351.56	
US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	770,000.00	871,242.96	
US TREASURY N/B-1.5%-18/08/31	2,050,000.00	2,074,023.43	
US TREASURY N/B-1.75%-18/10/31	700,000.00	715,585.93	
US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	200,000.00	223,937.50	
US TREASURY N/B-1.375%-18/11/30	600,000.00	601,687.50	

US TREASURY N/B-1.375%-18/12/31	700,000.00	701,039.06	
US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	860,000.00	919,729.68	
US TREASURY N/B-1.5%-19/03/31	1,000,000.00	1,002,734.37	
US TREASURY N/B-1.25%-19/04/30	1,200,000.00	1,185,937.50	
US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	2,150,000.00	2,342,156.25	
US TREASURY N/B-0.875%-19/07/31	1,050,000.00	1,010,625.00	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	1,400,000.00	1,562,531.25	
US TREASURY N/B-1.25%-19/10/31	600,000.00	587,296.87	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	1,300,000.00	1,434,773.43	
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	1,050,000.00	1,174,113.28	
US TREASURY N/B-1.25%-20/02/29	650,000.00	631,007.81	
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	800,000.00	887,937.50	
US TREASURY N/B-2.0%-20/07/31	1,200,000.00	1,212,750.00	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	390,000.00	564,860.15	
US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	310,000.00	325,039.84	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	400,000.00	445,937.50	
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	1,500,000.00	1,616,132.81	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	750,000.00	750,351.56	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	970,000.00	1,395,511.71	
US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	1,350,000.00	1,332,070.31	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	850,000.00	834,527.34	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	1,300,000.00	1,224,945.31	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	1,700,000.00	1,637,578.12	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	950,000.00	890,179.68	
US TREASURY N/B-6.25%-23/08/15	1,480,000.00	1,974,296.87	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	880,000.00	1,200,100.00	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	210,000.00	265,600.78	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	130,000.00	182,548.43	
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	390,000.00	457,549.21	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	350,000.00	402,855.46	
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	640,000.00	638,500.00	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	620,000.00	727,676.56	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	100,000.00	115,117.18	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	300,000.00	358,687.50	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,430,000.00	1,645,840.62	

		US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	770,000.00	816,741.40	
		US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	550,000.00	620,468.75	
		US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	650,000.00	747,804.68	
		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	200,000.00	206,953.12	
		US TREASURY N/B-3.125%-41/11/15	700,000.00	643,125.00	
		US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	2,850,000.00	2,613,093.75	
		US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	1,070,000.00	975,622.65	
米ドル合計			115,490,000.00	120,576,459.81 (11,763,439,419)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-14/12/01	480,000.00	485,184.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-15/06/01	650,000.00	664,930.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-15/08/01	700,000.00	705,334.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-16/06/01	500,000.00	536,110.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-16/09/01	400,000.00	416,932.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-17/06/01	300,000.00	327,135.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	500,000.00	557,125.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	350,000.00	385,367.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	750,000.00	819,330.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	300,000.00	323,634.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	750,000.00	776,145.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	150,000.00	240,918.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	280,000.00	384,056.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	710,000.00	950,292.40	
CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	200,000.00	236,600.00			
加ドル合計			7,020,000.00	7,809,093.80 (729,681,724)	
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-9.5%-14/12/18	9,000,000.00	9,593,211.78	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-15/12/17	4,500,000.00	4,895,341.78	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	6,000,000.00	6,975,461.76	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	5,000,000.00	6,786,377.05	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	6,000,000.00	7,229,353.02	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	2,500,000.00	2,804,085.15	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	4,500,000.00	5,341,381.74	
メキシコペソ合計			37,500,000.00	43,625,212.28	

				(331, 551, 613)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-3. 75%-15/09/28	1, 000, 000. 00	1, 065, 019. 40
		BELGIUM KINGDOM-3. 25%-16/09/28	300, 000. 00	322, 592. 43
		BELGIUM KINGDOM-5. 5%-17/09/28	720, 000. 00	844, 788. 16
		BELGIUM KINGDOM-4. 0%-19/03/28	100, 000. 00	113, 369. 66
		BELGIUM KINGDOM-3. 75%-20/09/28	950, 000. 00	1, 066, 250. 45
		BELGIUM KINGDOM-4. 0%-22/03/28	500, 000. 00	567, 549. 10
		BELGIUM KINGDOM-2. 25%-23/06/22	220, 000. 00	215, 000. 72
		BELGIUM KINGDOM-5. 5%-28/03/28	380, 000. 00	488, 608. 71
		BELGIUM KINGDOM-5. 0%-35/03/28	910, 000. 00	1, 131, 379. 52
		BELGIUM KINGDOM-4. 25%-41/03/28	150, 000. 00	169, 723. 47
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4. 4%-15/01/31	1, 300, 000. 00	1, 354, 466. 49
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4. 0%-15/07/30	600, 000. 00	625, 434. 66
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3. 15%-16/01/31	1, 900, 000. 00	1, 957, 501. 22
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5. 5%-17/07/30	1, 080, 000. 00	1, 198, 953. 03
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4. 1%-18/07/30	550, 000. 00	583, 976. 25
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4. 6%-19/07/30	560, 000. 00	602, 968. 01
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4. 85%-20/10/31	1, 620, 000. 00	1, 748, 633. 83
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5. 5%-21/04/30	500, 000. 00	560, 435. 85
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4. 8%-24/01/31	950, 000. 00	997, 142. 13
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6. 0%-29/01/31	830, 000. 00	944, 963. 46
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4. 2%-37/01/31	930, 000. 00	830, 314. 69
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4. 7%-41/07/30	200, 000. 00	191, 038. 08
		BUNDESobligation-1. 75%-15/10/09	350, 000. 00	360, 680. 98
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3. 75%-15/01/04	1, 440, 000. 00	1, 501, 887. 88
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3. 25%-15/07/04	1, 100, 000. 00	1, 156, 579. 71
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3. 5%-16/01/04	530, 000. 00	568, 147. 28		
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4. 0%-16/07/04	1, 340, 000. 00	1, 473, 592. 37		

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3. 75%- 17/01/04	430,000.00	476,704.57	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4. 25%- 17/07/04	1,320,000.00	1,504,247.83	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4. 0%- 18/01/04	250,000.00	286,002.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4. 25%- 18/07/04	1,200,000.00	1,399,578.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3. 75%- 19/01/04	360,000.00	414,570.09	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3. 25%- 20/01/04	450,000.00	510,945.57	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3. 0%- 20/07/04	1,350,000.00	1,517,170.23	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2. 25%- 20/09/04	350,000.00	375,848.13	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2. 5%- 21/01/04	350,000.00	381,221.85	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3. 25%- 21/07/04	250,000.00	285,943.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1. 5%- 22/09/04	800,000.00	796,863.44	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1. 5%- 23/05/15	600,000.00	589,026.48	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6. 25%- 24/01/04	620,000.00	880,157.51	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5. 625%- 28/01/04	960,000.00	1,352,478.23	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5. 5%- 31/01/04	770,000.00	1,096,058.19	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4. 0%- 37/01/04	560,000.00	693,347.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4. 25%- 39/07/04	400,000.00	521,163.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4. 75%- 40/07/04	400,000.00	562,311.16	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3. 25%- 42/07/04	150,000.00	168,962.56	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2. 5%- 44/07/04	300,000.00	291,417.33	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0. 25%- 15/03/13	650,000.00	650,910.65	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6. 0%- 14/11/15	620,000.00	652,532.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4. 25%- 15/02/01	430,000.00	446,837.33	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2. 5%- 15/03/01	300,000.00	305,285.04	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3. 75%-	1,790,000.00	1,858,885.46	

15/08/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 16/08/01	1,490,000.00	1,559,972.63	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 17/02/01	900,000.00	948,523.95	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 17/08/01	1,000,000.00	1,096,615.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/02/01	730,000.00	782,647.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/08/01	1,500,000.00	1,609,059.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/02/01	510,000.00	540,096.73	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/09/01	600,000.00	634,581.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 20/02/01	650,000.00	692,164.78	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 20/03/01	550,000.00	578,156.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	450,000.00	467,483.71	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	1,580,000.00	1,604,845.97	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,200,000.00	1,336,490.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,200,000.00	1,277,308.56	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	430,000.00	601,552.62	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	1,100,000.00	1,328,409.61	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	900,000.00	966,865.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	350,000.00	405,149.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	250,000.00	282,347.85	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	500,000.00	518,604.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	510,000.00	463,728.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	1,050,000.00	1,070,467.96	
FINNISH GOVERNMENT-1.875%-17/04/15	300,000.00	313,413.39	
FINNISH GOVERNMENT-3.875%-17/09/15	200,000.00	224,161.56	
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	160,000.00	188,289.05	
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	350,000.00	393,539.26	

FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	100,000.00	95,914.11	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	300,000.00	352,859.04	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-14/10/25	600,000.00	622,487.76	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-15/04/25	410,000.00	429,643.14	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-15/10/25	1,170,000.00	1,231,870.41	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-16/04/25	960,000.00	1,027,083.45	
FRANCE (GOVT OF)-5.0%-16/10/25	1,340,000.00	1,517,429.66	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-17/04/25	1,500,000.00	1,658,150.55	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-18/04/25	1,400,000.00	1,587,256.02	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25	550,000.00	637,918.32	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-19/10/25	590,000.00	831,628.42	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	770,000.00	875,114.85	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	700,000.00	787,205.51	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	250,000.00	264,635.95	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	1,480,000.00	1,688,998.05	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	500,000.00	551,522.20	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	450,000.00	485,108.68	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	1,900,000.00	2,222,780.55	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	700,000.00	945,692.79	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	600,000.00	652,149.24	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	660,000.00	872,811.91	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	580,000.00	724,019.27	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	760,000.00	856,404.17	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	450,000.00	547,646.35	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	320,000.00	360,256.73	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	200,000.00	225,965.10	
FRENCH TREASURY NOTE-2.0%-15/07/12	850,000.00	874,678.81	
IRISH TREASURY-4.6%-16/04/18	500,000.00	539,882.45	
IRISH TREASURY-4.5%-20/04/18	800,000.00	860,697.36	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	300,000.00	338,454.66	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-15/04/15	600,000.00	604,555.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-15/07/15	620,000.00	651,646.66	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-16/07/15	860,000.00	942,144.79	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	620,000.00	705,981.04	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	1,150,000.00	1,299,676.06	

		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	270,000.00	310,282.08	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	150,000.00	145,303.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	420,000.00	568,190.82	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	650,000.00	786,892.21	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	150,000.00	178,082.08	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-15/07/15	450,000.00	475,145.19	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	670,000.00	774,920.52	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	800,000.00	932,383.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	250,000.00	282,167.75	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	200,000.00	227,497.08	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	350,000.00	441,159.95	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	200,000.00	286,423.08	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	300,000.00	364,691.64	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	150,000.00	156,643.26	
			85,680,000.00	95,343,994.24	
				(12,851,416,983)	
	ユーロ合計				
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-2.75%-15/01/22	220,000.00	226,302.80	
		UK TREASURY-4.75%-15/09/07	950,000.00	1,025,745.97	
		UK TREASURY-4.0%-16/09/07	1,110,000.00	1,213,176.72	
		UK TREASURY-5.0%-18/03/07	1,110,000.00	1,283,795.69	
		UK TREASURY-4.5%-19/03/07	830,000.00	953,360.99	
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	690,000.00	810,441.77	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	720,000.00	1,016,487.21	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	450,000.00	500,455.08	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	400,000.00	378,068.00	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,090,000.00	1,330,380.64	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	420,000.00	572,249.74	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	930,000.00	1,062,305.98	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	360,000.00	411,855.98	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	370,000.00	457,770.10	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	870,000.00	1,044,583.50	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	800,000.00	928,046.24	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	560,000.00	665,229.71	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	250,000.00	284,726.70	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	200,000.00	203,962.36	

英ポンド合計			12,330,000.00	14,368,945.18 (2,268,569,065)
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-4.25%-17/06/05	450,000.00	517,500.00
		SWITZERLAND-3.0%-18/01/08	350,000.00	391,650.00
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	140,000.00	177,226.00
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	100,000.00	133,920.00
スイスフラン合計			1,040,000.00	1,220,296.00 (133,402,758)
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-3.0%-16/07/12	3,460,000.00	3,617,049.40
		SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	1,500,000.00	1,689,766.50
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	3,100,000.00	3,706,632.80
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	1,200,000.00	1,110,450.00
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	1,100,000.00	1,192,624.40
スウェーデンクローナ合計			10,360,000.00	11,316,523.10 (174,953,447)
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-5.0%-15/05/15	1,900,000.00	1,995,381.90
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.25%-17/05/19	1,600,000.00	1,724,001.60
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	1,000,000.00	1,110,999.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	400,000.00	429,960.40
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	1,400,000.00	1,303,120.00
ノルウェークローネ合計			6,300,000.00	6,563,462.90 (108,756,580)
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-2.0%-14/11/15	3,000,000.00	3,059,955.00
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-15/11/15	750,000.00	807,937.50
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-17/11/15	1,000,000.00	1,136,262.00
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	1,800,000.00	2,105,245.80
		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	1,950,000.00	2,172,105.00
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	650,000.00	984,815.00
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	2,750,000.00	3,732,712.50
デンマーククローネ合計			11,900,000.00	13,999,032.80 (252,962,522)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-6.25%-15/10/24	1,300,000.00	1,383,785.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	2,800,000.00	2,998,660.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	1,000,000.00	1,086,700.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	1,700,000.00	1,910,205.00

ポーランドズロチ合計			6,800,000.00	7,379,350.00 (237,467,483)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.25%-15/04/15	520,000.00	547,860.56
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.0%-17/02/15	780,000.00	853,108.62
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-18/01/21	500,000.00	545,431.00
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	1,000,000.00	1,091,912.00
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	970,000.00	1,099,343.68
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	300,000.00	342,590.40
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	400,000.00	420,683.60
豪ドル合計			4,470,000.00	4,900,929.86 (459,266,137)
シンガポ ールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.75%-16/09/01	450,000.00	493,095.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	400,000.00	457,786.66
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	100,000.00	103,146.66
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	400,000.00	439,786.66
シンガポールドル合計			1,350,000.00	1,493,814.98 (117,951,630)
マレーシ アリンギ ット	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT-3.741%-15/02/27	300,000.00	302,870.57
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.262%-16/09/15	1,700,000.00	1,753,125.00
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	2,150,000.00	2,219,868.55
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	600,000.00	628,824.40
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	550,000.00	573,008.33
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	600,000.00	603,300.00
マレーシアリンギット合計			5,900,000.00	6,080,996.85 (189,544,671)
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 18/12/21	1,500,000.00	1,585,333.05
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	4,500,000.00	4,552,160.85
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	7,000,000.00	8,514,903.60
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	700,000.00	534,264.43
南アフリカランド合計			13,700,000.00	15,186,661.93 (150,955,419)
合計				29,769,919,451 (29,769,919,451)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 110 銘柄	100.0%	39.5%
加ドル	国債証券 15 銘柄	100.0%	2.5%
メキシコペソ	国債証券 7 銘柄	100.0%	1.1%
ユーロ	国債証券 126 銘柄	100.0%	43.3%
英ポンド	国債証券 19 銘柄	100.0%	7.6%
スイスフラン	国債証券 4 銘柄	100.0%	0.4%
スウェーデンクローナ	国債証券 5 銘柄	100.0%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券 5 銘柄	100.0%	0.4%
デンマーククローネ	国債証券 7 銘柄	100.0%	0.8%
ポーランドズロチ	国債証券 4 銘柄	100.0%	0.8%
豪ドル	国債証券 7 銘柄	100.0%	1.5%
シンガポールドル	国債証券 4 銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 6 銘柄	100.0%	0.6%
南アフリカランド	国債証券 4 銘柄	100.0%	0.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表 (デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

【中間財務諸表】

- (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)並びに同規則第 38 条の 3 及び第 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)に基づき作成しております。
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、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、当中間計算期間(平成 25 年 10 月 29 日から平成 26 年 4 月 28 日まで)の中間財務諸表について、あらた監査法人による中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

平成 26 年 6 月 4 日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

あらた監査法人

指 定 社 員 公認会計士 佐々木 貴 司
業務執行社員

指 定 社 員 公認会計士 鶴 田 光 夫
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセット・ナビゲーション・ファンド（株式 80）の平成 25 年 10 月 29 日から平成 26 年 4 月 28 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、アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 80）の平成 26 年 4 月 28 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 25 年 10 月 29 日から平成 26 年 4 月 28 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

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

以 上

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

【アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

当中間計算期間末
平成26年4月28日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,993,763
親投資信託受益証券	146,066,490
未収利息	12
流動資産合計	154,060,265
資産合計	154,060,265
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	44,176
未払委託者報酬	628,160
その他未払費用	4,259
流動負債合計	676,595
負債合計	676,595
純資産の部	
元本等	
元本	139,069,954
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金(△)	14,313,716
(分配準備積立金)	22,596,309
元本等合計	153,383,670
純資産合計	153,383,670
負債純資産合計	154,060,265

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

当中間計算期間
自 平成 25 年 10 月 29 日
至 平成 26 年 4 月 28 日

営業収益	
受取利息	2,521
有価証券売買等損益	2,777,642
営業収益合計	2,780,163
営業費用	
受託者報酬	44,176
委託者報酬	628,160
その他費用	4,259
営業費用合計	676,595
営業利益又は営業損失 (△)	2,103,568
経常利益又は経常損失 (△)	2,103,568
中間純利益又は中間純損失 (△)	2,103,568
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額 (△)	1,397,726
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	17,457,374
剰余金増加額又は欠損金減少額	495,788
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	495,788
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,345,288
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,345,288
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	14,313,716

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

		当中間計算期間末 平成 26 年 4 月 28 日現在
1.	期首元本額	181,289,228 円
	期中追加設定元本額	3,970,485 円
	期中一部解約元本額	46,189,759 円
2.	受益権の総数	139,069,954 口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

当中間計算期間 自 平成 25 年 10 月 29 日 至 平成 26 年 4 月 28 日	
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

当中間計算期間末 平成 26 年 4 月 28 日現在	
中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表計上額は中間計算期間末日の時価で計上しているため、その差額は ありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載 しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品 の時価を帳簿価額としております。
金融商品の時価等に関する事項について の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的 に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件 等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なること もあります。

(1口当たり情報)

当中間計算期間末 平成 26 年 4 月 28 日現在	
1口当たり純資産額	1.1029 円
(1万口当たり純資産額)	(11,029 円)

当ファンドは、「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」「海外株式インデックスMSCI-KOKUSA I (ヘッジなし) マザーファンド」「海外株式インデックスMSCI-KOKUSA I (ヘッジあり) マザーファンド」「日本債券インデックスマザーファンド」「海外債券インデックス (ヘッジなし) マザーファンド」「海外債券インデックス (ヘッジあり) マザーファンド」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」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

平成26年4月28日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	102,870,961
株式	25,408,573,710
派生商品評価勘定	293,297
未収入金	119,661,400
未収配当金	257,358,931
未収利息	160
流動資産合計	25,888,758,459
資産合計	25,888,758,459
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,366,771
前受金	2,800,000
流動負債合計	4,166,771
負債合計	4,166,771
純資産の部	
元本等	
元本	27,112,575,754
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	△1,227,984,066
元本等合計	25,884,591,688
純資産合計	25,884,591,688
負債純資産合計	25,888,758,459

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成 26 年 4 月 28 日現在
1.	期首	平成 25 年 10 月 29 日
	期首元本額	28,535,557,496 円
	期首からの追加設定元本額	763,269,662 円
	期首からの一部解約元本額	2,186,251,404 円
	元本の内訳 ※	
	DCインデックスバランス（株式20）	176,071,310 円
	DCインデックスバランス（株式40）	661,288,736 円
	DCインデックスバランス（株式60）	1,257,145,040 円
	DCインデックスバランス（株式80）	1,498,661,156 円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,090,396,793 円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	8,599,821,730 円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	8,382,719 円
	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産）	36,268,504 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	95,398,885 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	73,399,778 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	121,397,834 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	159,408,797 円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	9,396,625,995 円
	世界アセットバランスファンド40（適格機関投資家向け）	47,113,250 円
	世界アセットバランスファンド25（適格機関投資家向け）	65,633,684 円
グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	54,322,555 円	
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	323,784,387 円	
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	906,380,044 円	
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,268,816,890 円	
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,272,257,667 円	
計	27,112,575,754 円	
2.	受益権の総数	27,112,575,754 口
3.	元本の欠損	
	純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	1,227,984,066 円
4.	担保資産	

デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。	
株式	337,503,500円

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	平成26年4月28日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成26年4月28日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	360,720,000	—	359,755,000	△965,000
	合計	360,720,000	—	359,755,000	△965,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

平成26年4月28日現在	
1口当たり純資産額	0.9547円
(1万口当たり純資産額)	(9,547円)

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

平成26年4月28日現在

資産の部	
流動資産	
預金	273,027,855
コール・ローン	1,078,408,005
株式	73,538,518,068
新株予約権証券	233,217
投資証券	1,649,836,778
派生商品評価勘定	22,026,879
未収入金	1,900,693
未収配当金	115,251,583
未収利息	1,681
差入委託証拠金	311,906,212
流動資産合計	76,991,110,971
資産合計	76,991,110,971
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,221,178
未払金	620,020
未払解約金	122,323,165
流動負債合計	131,164,363
負債合計	131,164,363
純資産の部	
元本等	
元本	47,258,202,325
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	29,601,744,283
元本等合計	76,859,946,608
純資産合計	76,859,946,608
負債純資産合計	76,991,110,971

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成 26 年 4 月 28 日現在
1.	期首	平成 25 年 10 月 29 日
	期首元本額	53,121,420,340 円
	期首からの追加設定元本額	882,897,837 円
	期首からの一部解約元本額	6,746,115,852 円
	元本の内訳 ※	
	インデックスファンド海外株式ヘッジなし (DC 専用)	14,090,320,651 円
	DC インデックスバランス (株式 20)	34,795,673 円
	DC インデックスバランス (株式 40)	132,750,455 円
	DC インデックスバランス (株式 60)	253,803,557 円
	DC インデックスバランス (株式 80)	301,288,275 円
	世界の財産 3 分法ファンド (不動産・債券・株式) 毎月分配型	5,260,038,440 円
	日興五大陸株式ファンド	10,982,689,919 円
	全世界株式債券ファンド (日本・先進国・新興国) 毎月分配型	39,135,198 円
	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド (株式資産)	17,429,577 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 80)	9,644,126 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 60)	7,249,136 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 40)	12,115,497 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 20)	15,776,769 円
	国際分散型ファンド 40 (適格機関投資家向け)	9,633,999,873 円
	グローバルバランスファンド 35 (適格機関投資家向け)	13,002,264 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 20)	32,185,286 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 40)	91,011,455 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 60)	127,032,849 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 80)	128,532,097 円
	年金積立 インデックスファンド海外株式 (ヘッジなし)	6,075,401,228 円

	計	47,258,202,325 円
2.	受益権の総数	47,258,202,325 口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	平成 26 年 4 月 28 日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成 26 年 4 月 28 日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,609,724,397	—	1,630,613,940	20,889,543
合計		1,609,724,397	—	1,630,613,940	20,889,543

(注) 1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(平成 26 年 4 月 28 日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の	為替予約取引				

取引	買建	1,092,208,862	—	1,085,125,020	△7,083,842
	米ドル	872,704,847	—	865,903,020	△6,801,827
	ユーロ	219,504,015	—	219,222,000	△282,015
	合計	1,092,208,862	—	1,085,125,020	△7,083,842

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

平成 26 年 4 月 28 日現在	
1口当たり純資産額	1.6264 円
(1万口当たり純資産額)	(16,264 円)

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

平成26年4月28日現在

資産の部	
流動資産	
預金	16,832,274
コール・ローン	69,793,680
株式	1,568,700,045
新株予約権証券	5,323
投資証券	34,554,402
派生商品評価勘定	8,133,468
未収入金	69,930
未収配当金	2,515,380
未収利息	108
差入委託証拠金	29,922,821
流動資産合計	1,730,527,431
資産合計	1,730,527,431
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,665,538
未払金	719
未払解約金	1,215,166
流動負債合計	7,881,423
負債合計	7,881,423
純資産の部	
元本等	
元本	1,513,660,472
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	208,985,536
元本等合計	1,722,646,008
純資産合計	1,722,646,008
負債純資産合計	1,730,527,431

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成 26 年 4 月 28 日現在
1.	期首	平成 25 年 10 月 29 日
	期首元本額	1,469,650,974 円
	期首からの追加設定元本額	187,229,799 円
	期首からの一部解約元本額	143,220,301 円
	元本の内訳 ※	
	インデックスファンド海外株式ヘッジあり (DC 専用)	307,596,614 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 80)	13,810,034 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 60)	10,440,352 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 40)	17,539,188 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 20)	22,698,406 円
	世界アセットバランスファンド 40 (適格機関投資家向け)	123,736,821 円
	世界アセットバランスファンド 25 (適格機関投資家向け)	86,188,961 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 20)	46,038,711 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 40)	130,271,234 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 60)	182,278,737 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 80)	184,724,622 円
	年金積立 インデックスファンド海外株式 (ヘッジあり)	388,336,792 円
	計	1,513,660,472 円
2.	受益権の総数	1,513,660,472 口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	平成 26 年 4 月 28 日現在
--	--------------------

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成 26 年 4 月 28 日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	119,701,592	—	122,296,045	2,594,453
合計		119,701,592	—	122,296,045	2,594,453

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(平成 26 年 4 月 28 日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	1,650,991,957	—	1,652,118,480	△1,126,523
	米ドル	986,344,357	—	987,900,320	△1,555,963
	加ドル	70,998,251	—	70,574,810	423,441
	ユーロ	235,805,154	—	235,944,930	△139,776
	英ポンド	153,896,497	—	154,285,650	△389,153
	スイスフラン	71,955,129	—	71,627,780	327,349

スウェーデンクローナ	21,484,996	—	21,002,100	482,896
ノルウェークローネ	7,912,848	—	7,817,580	95,268
デンマーククローネ	9,514,208	—	9,525,600	△11,392
豪ドル	58,567,740	—	59,078,140	△510,400
香港ドル	21,662,930	—	21,532,950	129,980
シンガポールドル	9,536,945	—	9,509,040	27,905
イスラエルシェケル	3,312,902	—	3,319,580	△6,678
合計	1,650,991,957	—	1,652,118,480	△1,126,523

(注) 1. 時価の算定方法

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

- ① 同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
- ② 同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
 - ・ 同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

平成 26 年 4 月 28 日現在	
1口当たり純資産額	1.1381円
(1万口当たり純資産額)	(11,381円)

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

平成 26 年 4 月 28 日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,461,296
国債証券	26,753,442,690
地方債証券	2,313,375,000
特殊債券	2,388,937,000
社債券	2,179,973,000
未収利息	92,176,702
前払費用	1,614,524
流動資産合計	33,740,980,212
資産合計	33,740,980,212
負債の部	
流動負債	
未払解約金	4,274,231
流動負債合計	4,274,231
負債合計	4,274,231
純資産の部	
元本等	
元本	26,123,456,077
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	7,613,249,904
元本等合計	33,736,705,981
純資産合計	33,736,705,981
負債純資産合計	33,740,980,212

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成 26 年 4 月 28 日現在
1.	期首	平成 25 年 10 月 29 日
	期首元本額	26,729,401,948 円
	期首からの追加設定元本額	814,658,664 円
	期首からの一部解約元本額	1,420,604,535 円
	元本の内訳 ※	
	DCインデックスバランス（株式20）	570,115,048 円
	DCインデックスバランス（株式40）	758,694,787 円
	DCインデックスバランス（株式60）	528,532,684 円
	DCインデックスバランス（株式80）	94,681,244 円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	1,242,854,763 円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	6,641,234,841 円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	6,338,013 円
	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（債券資産）	56,963,727 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	6,053,024 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	30,420,153 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	139,978,306 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	521,469,196 円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	7,255,166,442 円
	世界アセットバランスファンド40（適格機関投資家向け）	90,373,950 円
	世界アセットバランスファンド25（適格機関投資家向け）	176,259,999 円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	32,935,994 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	1,043,268,657 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,025,554,123 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	531,532,948 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	80,843,738 円
	年金積立 インデックスファンド日本債券	5,125,163,125 円
	日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	165,021,315 円
	計	26,123,456,077 円
2.	受益権の総数	26,123,456,077 円

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

平成 26 年 4 月 28 日現在	
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
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「有価証券の評価基準及び評価方法」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 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(1口当たり情報)

平成 26 年 4 月 28 日現在	
1口当たり純資産額	1.2914円
(1万口当たり純資産額)	(12,914円)

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

平成 26 年 4 月 28 日現在

資産の部	
流動資産	
預金	508,714,206
コール・ローン	219,342,063
国債証券	206,344,033,774
派生商品評価勘定	301,800
未収入金	119,438,747
未収利息	2,631,867,596
前払費用	55,391,450
流動資産合計	209,879,089,636
資産合計	209,879,089,636
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	28,820
未払解約金	276,797,563
流動負債合計	276,826,383
負債合計	276,826,383
純資産の部	
元本等	
元本	101,398,829,504
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	108,203,433,749
元本等合計	209,602,263,253
純資産合計	209,602,263,253
負債純資産合計	209,879,089,636

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成 26 年 4 月 28 日現在
1.	期首	平成 25 年 10 月 29 日
	期首元本額	116,750,317,478 円
	期首からの追加設定元本額	549,776,211 円
	期首からの一部解約元本額	15,901,264,185 円
	元本の内訳 ※	
	インデックスファンド海外債券ヘッジなし（DC専用）	10,283,969,019 円
	DCインデックスバランス（株式20）	54,709,216 円
	DCインデックスバランス（株式40）	104,952,599 円
	DCインデックスバランス（株式60）	132,759,070 円
	DCインデックスバランス（株式80）	118,790,170 円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	31,791,609,308 円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	4,153,946,308 円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	41,765,849,995 円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	30,816,126 円
	日興外国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,138,201,716 円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	22,411,423 円
	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（債券資産）	28,787,619 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	3,812,696 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	3,794,083 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	9,667,217 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	24,973,199 円
	世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	893,008,551 円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,514,308,066 円
	世界アセットバランスファンド40（適格機関投資家向け）	78,991,697 円
	世界アセットバランスファンド25（適格機関投資家向け）	125,764,024 円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	46,342,615 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	50,211,807 円

年金積立	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	71,590,502 円
年金積立	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	66,861,331 円
年金積立	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	50,630,288 円
年金積立	インデックスファンド海外債券（ヘッジなし）	8,597,397,156 円
	海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	234,673,703 円
	計	101,398,829,504 円
2.	受益権の総数	101,398,829,504 口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成 26 年 4 月 28 日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（平成 26 年 4 月 28 日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1 年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	214,708,980	—	214,436,000	272,980
	米ドル	113,386,600	—	113,342,100	44,500
	ユーロ	72,200,700	—	71,961,000	239,700
	英ポンド	29,121,680	—	29,132,900	△11,220
	合計	214,708,980	—	214,436,000	272,980

（注）1. 時価の算定方法

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

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

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

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

- ・ 同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に

最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

平成 26 年 4 月 28 日現在	
1 口当たり純資産額	2.0671 円
(1 万口当たり純資産額)	(20,671 円)

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

平成 26 年 4 月 28 日現在

資産の部	
流動資産	
預金	128,151,130
コール・ローン	91,786,066
国債証券	28,937,978,416
派生商品評価勘定	283,886,745
未収利息	301,097,320
前払費用	22,214,770
流動資産合計	29,765,114,447
資産合計	29,765,114,447
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,681,442
未払解約金	10,275,984
流動負債合計	24,957,426
負債合計	24,957,426
純資産の部	
元本等	
元本	21,628,232,788
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	8,111,924,233
元本等合計	29,740,157,021
純資産合計	29,740,157,021
負債純資産合計	29,765,114,447

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成 26 年 4 月 28 日現在
1.	期首	平成 25 年 10 月 29 日
	期首元本額	22,305,266,953 円
	期首からの追加設定元本額	230,069,297 円
	期首からの一部解約元本額	907,103,462 円
	元本の内訳 ※	
	インデックスファンド海外債券ヘッジあり (DC 専用)	721,596,857 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 80)	5,736,799 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 60)	5,732,234 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 40)	14,712,219 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 20)	37,851,084 円
	国際分散型ファンド 40 (適格機関投資家向け)	18,241,259,044 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 20)	75,501,643 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 40)	107,842,824 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 60)	100,749,749 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 80)	76,405,330 円
	年金積立 インデックスファンド海外債券 (ヘッジあり)	2,240,845,005 円
	計	21,628,232,788 円
2.	受益権の総数	21,628,232,788 口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

		平成 26 年 4 月 28 日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券	

	<p>重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引等に関する注記)
取引の時価等に関する事項
(通貨関連)

(平成 26 年 4 月 28 日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	29,577,441,713	—	29,308,236,410	269,205,303
	米ドル	11,179,047,217	—	11,090,860,200	88,187,017
	加ドル	690,254,105	—	683,178,140	7,075,965
	メキシコペソ	295,426,066	—	293,395,770	2,030,296
	ユーロ	13,217,118,187	—	13,048,559,200	168,558,987
	英ポンド	2,312,509,688	—	2,317,184,250	△4,674,562
	スイスフラン	148,743,667	—	148,119,020	624,647
	スウェーデンクローナ	173,505,845	—	169,896,180	3,609,665
	ノルウェークローネ	116,544,707	—	114,634,860	1,909,847
	デンマーククローネ	234,893,928	—	234,000,900	893,028
	ポーランドズロチ	226,194,688	—	224,083,190	2,111,498
	豪ドル	483,711,521	—	488,012,120	△4,300,599
	シンガポールドル	120,710,206	—	120,118,400	591,806
	マレーシアリングット	235,692,427	—	235,474,200	218,227
	南アフリカランド	143,089,461	—	140,719,980	2,369,481
合計		29,577,441,713	—	29,308,236,410	269,205,303

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

② 同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の

方法によっております。

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

平成 26 年 4 月 28 日現在	
1口当たり純資産額	1.3751円
(1万口当たり純資産額)	(13,751円)

2 【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2014年5月30日現在です。

【アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）】

【純資産額計算書】

I 資産総額	155,678,882円
II 負債総額	111,933円
III 純資産総額（I－II）	155,566,949円
IV 発行済口数	137,329,805口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.1328円

（参考）

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	26,968,953,644円
II 負債総額	47,277,238円
III 純資産総額（I－II）	26,921,676,406円
IV 発行済口数	27,229,604,600口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	0.9887円

海外株式インデックスMSCI－KOKUSA I（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	78,505,397,918円
II 負債総額	146,208,914円
III 純資産総額（I－II）	78,359,189,004円
IV 発行済口数	46,990,130,370口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.6676円

海外株式インデックスMSCI－KOKUSA I（ヘッジあり）マザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	1,782,139,996円
II 負債総額	9,531,716円
III 純資産総額（I－II）	1,772,608,280円
IV 発行済口数	1,508,479,542口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.1751円

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	33,863,914,870円
II 負債総額	74,065,303円
III 純資産総額 (I - II)	33,789,849,567円
IV 発行済口数	26,095,677,321口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.2948円

海外債券インデックス (ヘッジなし) マザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	206,996,334,108円
II 負債総額	173,775,135円
III 純資産総額 (I - II)	206,822,558,973円
IV 発行済口数	100,042,052,706口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	2.0674円

海外債券インデックス (ヘッジあり) マザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	29,924,206,791円
II 負債総額	119,580,789円
III 純資産総額 (I - II)	29,804,626,002円
IV 発行済口数	21,449,426,810口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.3895円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

① 譲渡制限はありません。

② 受益権の譲渡

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

③ 受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【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

平成26年5月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

●過去5年間における主な資本金の増減

年月日	変更後（変更前）
平成21年10月1日	17,363,045,900円（16,403,045,900円）

(2) 会社の意思決定機関（平成26年5月末現在）

・株主総会

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

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

・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。

当社の取締役会は10名以内の取締役で構成され、取締役の任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。取締役会はその決議をもって、代表取締役若干名を選定します。

・監査役会

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

(3) 運用の意思決定プロセス（平成26年5月末現在）

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

2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、平成 26 年 5 月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	500	92,731
株式投資信託	442	72,355
単位型	59	1,556
追加型	383	70,799
公社債投資信託	58	20,376
単位型	42	338
追加型	16	20,038
投資法人合計	1	41

3 【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 38 年大蔵省令第 59 号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第 2 条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成 19 年 8 月 6 日内閣府令第 52 号）に基づいて作成しております。

なお、当事業年度（平成 25 年 4 月 1 日から平成 26 年 3 月 31 日まで）の財務諸表に含まれる比較情報については、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」（平成 24 年 9 月 21 日内閣府令第 61 号）附則第 2 条第 2 項により、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2. 当社は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 55 期事業年度（平成 25 年 4 月 1 日から平成 26 年 3 月 31 日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成 26 年 6 月 13 日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 秋 宗 勝 彦
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成 25 年 4 月 1 日から平成 26 年 3 月 31 日までの第 55 期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成 26 年 3 月 31 日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

		第 54 期 (平成 25 年 3 月 31 日)		第 55 期 (平成 26 年 3 月 31 日)
資産の部				
流動資産				
現金・預金	※3	15,820	※3	17,805
有価証券		—		234
前払費用	※3	380	※3	419
未収入金		4		37
未収委託者報酬		7,472		7,162
未収収益	※3	342	※3	608
関係会社短期貸付金		606		240
立替金		335		303
繰延税金資産		869		984
その他	※2	30	※2	30
流動資産合計		25,862		27,826
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	48	※1	47
器具備品	※1	124	※1	134
有形固定資産合計		172		181
無形固定資産				
ソフトウェア		70		91
無形固定資産合計		70		91
投資その他の資産				
投資有価証券		7,170		7,290
関係会社株式		22,935		21,702
関係会社長期貸付金		60		60
長期差入保証金		706		692
繰延税金資産		500		525
投資その他の資産合計		31,373		30,271
固定資産合計		31,616		30,544
資産合計		57,478		58,371

(単位：百万円)

	第 54 期 (平成 25 年 3 月 31 日)	第 55 期 (平成 26 年 3 月 31 日)
負債の部		
流動負債		
預り金	305	329
未払金	3,862	3,404
未払収益分配金	6	6
未払償還金	115	112
未払手数料	※3 3,195	※3 2,743
その他未払金	545	542
未払費用	※3 3,282	※3 3,239
未払法人税等	589	2,286
未払消費税等	※4 123	※4 356
賞与引当金	1,770	1,935
役員賞与引当金	80	150
流動負債合計	10,012	11,702
固定負債		
退職給付引当金	1,001	1,081
その他	55	55
固定負債合計	1,057	1,137
負債合計	11,070	12,840
純資産の部		
株主資本		
資本金	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金	5,220	5,220
資本剰余金合計	5,220	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	23,530	22,694
利益剰余金合計	23,530	22,694
自己株式	△68	△68
株主資本合計	46,045	45,209
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	362	321
評価・換算差額等合計	362	321
純資産合計	46,408	45,531
負債純資産合計	57,478	58,371

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第54期		第55期	
	(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)		(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		52,848		63,120
その他営業収益		1,922		2,557
営業収益合計		<u>54,771</u>		<u>65,678</u>
営業費用				
支払手数料		26,955		31,207
広告宣伝費		649		1,081
公告費		7		2
調査費		10,797		13,405
調査費		691		712
委託調査費		10,089		12,669
図書費		17		23
委託計算費		406		465
営業雑経費		530		558
通信費		188		186
印刷費		214		252
協会費		46		43
諸会費		16		11
その他		64		65
営業費用計		<u>39,347</u>		<u>46,721</u>
一般管理費				
給料		6,759		7,171
役員報酬		256		316
役員賞与引当金繰入額		80		150
給料・手当		4,565		4,719
賞与		87		50
賞与引当金繰入額		1,770		1,935
交際費		100		108
寄付金		66		54
旅費交通費		313		448
租税公課		188		209
不動産賃借料		753		755
退職給付費用		312		313
退職金		83		32
固定資産減価償却費		124		109
諸経費		3,061		3,364
一般管理費計		<u>11,764</u>		<u>12,568</u>
営業利益		<u>3,659</u>		<u>6,388</u>

(単位：百万円)

	第54期		第55期	
	(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)		(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		12		17
受取配当金	※1	601	※1	1,774
時効成立分配金・償還金		4		4
為替差益		64		26
その他		16		19
営業外収益合計		699		1,842
営業外費用				
支払利息		19		19
有価証券償還損		1		—
時効成立後支払分配金・償還金		15		22
支払源泉所得税		55		57
その他		2		13
営業外費用合計		93		114
経常利益		4,265		8,116
特別利益				
投資有価証券売却益		226		135
関係会社株式売却益		239		—
特別利益合計		465		135
特別損失				
投資有価証券売却損		84		12
関係会社株式評価損		—		4,500
固定資産処分損		3		0
割増退職金		—		59
役員退職一時金		75		235
特別損失合計		163		4,807
税引前当期純利益		4,568		3,445
法人税、住民税及び事業税		1,480		3,020
法人税等調整額		260		△119
法人税等合計		1,740		2,900
当期純利益		2,827		544

(3) 【株主資本等変動計算書】

第54期（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利 益剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余 金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	22,172	22,172	△68	44,687
当期変動額							
剰余金の配当				△1,468	△1,468		△1,468
当期純利益				2,827	2,827		2,827
株主資本以外の項目の当 期変動額（純額）							
当期変動額合計	—	—	—	1,358	1,358	—	1,358
当期末残高	17,363	5,220	5,220	23,530	23,530	△68	46,045

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券評 価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	42	42	44,729
当期変動額			
剰余金の配当			△1,468
当期純利益			2,827
株主資本以外の項目の当 期変動額（純額）	320	320	320
当期変動額合計	320	320	1,678
当期末残高	362	362	46,408

（単位：百万円）

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利 益剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余 金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	23,530	23,530	△68	46,045
当期変動額							
剰余金の配当				△1,380	△1,380		△1,380
当期純利益				544	544		544
株主資本以外の項目の当 期変動額（純額）							
当期変動額合計	—	—	—	△836	△836	—	△836
当期末残高	17,363	5,220	5,220	22,694	22,694	△68	45,209

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券評 価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	362	362	46,408
当期変動額			
剰余金の配当			△1,380
当期純利益			544
株主資本以外の項目の当 期変動額（純額）	△40	△40	△40
当期変動額合計	△40	△40	△876
当期末残高	321	321	45,531

注記事項

(重要な会計方針)

項目	第 55 期 (自 平成 25 年 4 月 1 日 至 平成 26 年 3 月 31 日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>① 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法</p> <p>② その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 3年～5年 器具備品 4年～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>① 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。</p> <p>② 数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。</p>

(表示方法の変更)

第 55 期

(自 平成 25 年 4 月 1 日

至 平成 26 年 3 月 31 日)

「退職給付に関する会計基準」(企業会計基準第 26 号 平成 24 年 5 月 17 日。以下「退職給付会計基準」という。)及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第 25 号 平成 24 年 5 月 17 日。以下「退職給付適用指針」という。)を当事業年度より適用し(ただし、退職給付会計基準第 35 項本文及び退職給付適用指針第 67 項本文に掲げられた定めを除く。)、(退職給付関係)注記の表示方法を変更しております。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第 37 項に定める経過的な取扱いに従っており、(退職給付関係)の注記の組替えは行っておりません。

(貸借対照表関係)

第 54 期 (平成 25 年 3 月 31 日)	第 55 期 (平成 26 年 3 月 31 日)
※ 1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,054 百万円 器具備品 618 百万円	※ 1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,091 百万円 器具備品 625 百万円
※ 2 信託資産 その他流動資産の 30 百万円は、「直販顧客分別金 信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託し ております。	※ 2 信託資産 その他流動資産の 30 百万円は、「直販顧客分別金 信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託し ております。
※ 3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであ ります。 (流動資産) 現金・預金 3,818 百万円 前払費用 2 百万円 未収収益 58 百万円 (流動負債) 未払手数料 143 百万円 未払費用 297 百万円	※ 3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであ ります。 (流動資産) 現金・預金 6,249 百万円 前払費用 2 百万円 未収収益 74 百万円 (流動負債) 未払手数料 98 百万円 未払費用 274 百万円
※ 4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、 「未払消費税等」として表示しております。	※ 4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、 「未払消費税等」として表示しております。
※ 5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd が ロンドン ウォール リミテッド パートナーシップ に支払うオフィス賃借料等の債務 87 百万円に対し て保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワー アソシエイツ リミテッド パートナーシッ プに支払うオフィス賃借料等の債務 243 百万円に対 して保証を行っております。	※ 5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd が ロンドン ウォール リミテッド パートナーシップ に支払うオフィス賃借料等の債務 65 百万円に対し て保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タ ワー アソシエイツ リミテッド パートナーシッ プに支払うオフィス賃借料等の債務 159 百万円に対 して保証を行っております。

(損益計算書関係)

第 54 期 (自 平成 24 年 4 月 1 日 至 平成 25 年 3 月 31 日)	第 55 期 (自 平成 25 年 4 月 1 日 至 平成 26 年 3 月 31 日)
※ 1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、 次のとおりであります。 受取配当金 552 百万円	※ 1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、 次のとおりであります。 受取配当金 1,290 百万円

(株主資本等変動計算書関係)

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

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
平成 21 年度ストックオプション (1)	普通株式	19,215,900	—	2,237,400	16,978,500	—
平成 21 年度ストックオプション (2)	普通株式	1,676,400	—	49,500	1,626,900	—
平成 22 年度ストックオプション (1)	普通株式	2,310,000	—	—	2,310,000	—
第 1 回新株予約権	普通株式	2,955,200	—	—	2,955,200	—
平成 23 年度ストックオプション (1)	普通株式	6,091,800	—	161,700	5,930,100	—
合計		32,249,300	—	2,448,600	29,800,700	—

(注) 1 平成 21 年度ストックオプション(1)、平成 21 年度ストックオプション(2)及び平成 23 年度ストックオプション (1) の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

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

3 平成 21 年度ストックオプション(1)13,625,700 株、平成 21 年度ストックオプション(2)1,287,000 株、平成 22 年度ストックオプション(1)1,732,500 株及び第 1 回新株予約権 2,955,200 株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成 23 年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来していません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

決議	株式の種類	配当の 原資	配当金の 総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成25年5月27日 取締役会	普通株式	利益剰 余金	1,380	7.01	平成25年3月31日	平成25年6月18日

第 55 期（自 平成 25 年 4 月 1 日 至 平成 26 年 3 月 31 日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年 度末残高 (百万円)
		当事業年度 期首	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
平成 21 年度 ストックオプション (1)	普通株式	16,978,500	—	1,075,800	15,902,700	—
平成 21 年度 ストックオプション (2)	普通株式	1,626,900	—	59,400	1,567,500	—
平成 22 年度 ストックオプション (1)	普通株式	2,310,000	—	—	2,310,000	—
第 1 回新株予約権	普通株式	2,955,200	—	—	2,955,200	—
平成 23 年度 ストックオプション (1)	普通株式	5,930,100	—	541,200	5,388,900	—
合計		29,800,700	—	1,676,400	28,124,300	—

- (注) 1 平成 21 年度ストックオプション(1)、平成 21 年度ストックオプション(2)及び平成 23 年度ストックオプション (1) の減少は、新株予約権の失効によるものであります。
- 2 第 1 回新株予約権の新株予約権の目的となる株式の数は、新株予約権の行使に関する通知が当社に提出された日における、当社の発行済株式数×0.25%に 6 を乗じた数で算出され、当事業年度末の発行済株式に基づき算出しております。
- 3 平成 21 年度ストックオプション(1)15,902,700 株、平成 21 年度ストックオプション(2)1,567,500 株、平成 22 年度ストックオプション(1)2,310,000 株、第 1 回新株予約権 2,955,200 株及び平成 23 年度ストックオプション(1)2,887,500 株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成25年5月27日 取締役会	普通株式	1,380	7.01	平成25年3月31日	平成25年6月18日

(2) 基準日が当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
該当事項はありません。

(リース取引関係)

第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)		第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料		オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	750百万円	1年内	751百万円
1年超	807百万円	1年超	77百万円
合計	1,558百万円	合計	828百万円

(金融商品関係)

第54期(自平成24年4月1日至平成25年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

②市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

③流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

平成 25 年 3 月 31 日（当事業年度の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額(※)	時価(※)	差額
(1) 現金・預金	15,820	15,820	—
(2) 未収委託者報酬	7,472	7,472	—
(3) 未収収益	342	342	—
(4) 投資有価証券 その他有価証券	7,091	7,091	—
(5) 未払金	(3,862)	(3,862)	—
(6) 未払費用	(3,282)	(3,282)	—

(※)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(5) 未払金及び(6) 未払費用

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

2 非上場株式等（貸借対照表計上額 79 百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式（貸借対照表計上額 20,042 百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額 2,892 百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	15,820	—	—	—
未収委託者報酬	7,472	—	—	—
未収収益	342	—	—	—
投資有価証券 投資信託	—	385	1,299	920
合計	23,635	385	1,299	920

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

②市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

③流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

平成 26 年 3 月 31 日（当事業年度の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額(※)	時価(※)	差額
(1) 現金・預金	17,805	17,805	—
(2) 未収委託者報酬	7,162	7,162	—
(3) 未収収益	608	608	—
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	7,457	7,457	—
(5) 未払金	(3,404)	(3,404)	—
(6) 未払費用	(3,239)	(3,239)	—

(※)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(5) 未払金及び(6) 未払費用

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

2 非上場株式等（貸借対照表計上額 66 百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式（貸借対照表計上額 18,809 百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額 2,892 百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	17,805	—	—	—
未収委託者報酬	7,162	—	—	—
未収収益	608	—	—	—
有価証券及び投資有価証券 投資信託	234	315	1,166	973
合計	25,811	315	1,166	973

(有価証券関係)

第54期(自平成24年4月1日至平成25年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	20,042
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	6,366	5,708	658
	小計	6,366	5,708	658
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	724	821	△96
	小計	724	821	△96
合計		7,091	6,529	561

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

2 非上場株式等(貸借対照表計上額79百万円)については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
株式	43	35	67
投資信託	1,099	190	17
合計	1,143	226	84

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	18,809
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	3,819	3,188	631
	小計	3,819	3,188	631
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	3,637	3,768	△130
	小計	3,637	3,768	△130
合計		7,457	6,957	500

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

2 非上場株式等(貸借対照表計上額 66百万円)については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
株式	23	11	—
投資信託	1,734	124	12
合計	1,758	135	12

(持分法損益等)

第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額 3,069	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,065
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 6,280	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 7,660
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,159	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,379

(退職給付関係)

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバランスプラン型退職金制度を設けております。

2 退職給付債務に関する事項

(単位：百万円)

イ 退職給付債務	△1,101
ロ 未積立退職給付債務	△1,101
ハ 未認識数理計算上の差異	99
ニ 退職給付引当金残高	△1,001

3 退職給付費用に関する事項

(単位：百万円)

イ 勤務費用	102
ロ 利息費用	13
ハ 数理計算上の差異の費用処理額	24
ニ 確定拠出型企業年金への掛金	171
ホ 退職給付費用合計	312

4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例
ロ 割引率	0.9%
ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年

第 55 期(自 平成 25 年 4 月 1 日 至 平成 26 年 3 月 31 日)

1 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバランスプラン型退職金制度を設けております。

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	1,101	百万円
勤務費用	110	〃
利息費用	9	〃
数理計算上の差異の発生額	9	〃
退職給付の支払額	△56	〃
退職給付債務の期末残高	1,174	〃

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

退職給付債務	1,174	百万円
未積立退職給付債務	1,174	〃
未認識数理計算上の差異	△92	〃
貸借対照表に計上された負債の額	1,081	〃

退職給付引当金	1,081	百万円
貸借対照表に計上された負債の額	1,081	〃

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	110	百万円
利息費用	9	〃
数理計算上の差異の費用処理額	16	〃
確定給付制度に係る退職給付費用	137	〃

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.8%
-----	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、176 百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

① ストックオプション(新株予約権)の数

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

	平成 22 年度ストックオプション(1)	平成 23 年度ストックオプション(1)
付与日	平成 22 年 8 月 20 日	平成 23 年 10 月 7 日
権利確定前(株)		
期首	2,310,000	6,091,800
付与	0	0
失効	0	161,700
権利確定	0	0
権利未確定残	2,310,000	5,930,100
権利確定後(株)		
期首	—	—
権利確定	—	—
権利行使	—	—
失効	—	—
権利未行使残	—	—

(注) 株式数に換算して記載しております。

② 単価情報

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

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

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

- 2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 — 百万円
- 3 株式公開価格が 737 円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するよう調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第 55 期(自 平成 25 年 4 月 1 日 至 平成 26 年 3 月 31 日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

① ストックオプション(新株予約権)の数

	平成 21 年度ストックオプション(1)	平成 21 年度ストックオプション(2)
付与日	平成 22 年 2 月 8 日	平成 22 年 8 月 20 日
権利確定前(株)		
期首	16,978,500	1,626,900
付与	0	0
失効	1,075,800	59,400
権利確定	0	0
権利未確定残	15,902,700	1,567,500
権利確定後(株)		
期首	—	—
権利確定	—	—
権利行使	—	—
失効	—	—
権利未行使残	—	—

	平成 22 年度ストックオプション(1)	平成 23 年度ストックオプション(1)
付与日	平成 22 年 8 月 20 日	平成 23 年 10 月 7 日
権利確定前(株)		
期首	2,310,000	5,930,100
付与	0	0
失効	0	541,200
権利確定	0	0
権利未確定残	2,310,000	5,388,900
権利確定後(株)		
期首	—	—
権利確定	—	—
権利行使	—	—
失効	—	—
権利未行使残	—	—

(注) 株式数に換算して記載しております。

② 単価情報

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

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

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

- 2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 ー 百万円
- 3 株式公開価格が 737 円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するよう調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

(税効果会計関係)

第 54 期 (平成 25 年 3 月 31 日)		第 55 期 (平成 26 年 3 月 31 日)	
1	繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：百万円)	1	繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：百万円)
	繰延税金資産(流動)		繰延税金資産(流動)
	賞与引当金繰入超過額		賞与引当金繰入超過額
	672		689
	その他		その他
	196		294
	小計		小計
	869		984
	繰延税金資産(固定)		繰延税金資産(固定)
	投資有価証券評価損		投資有価証券評価損
	149		148
	退職給付引当金超過額		関係会社株式評価損
	361		1,665
	固定資産減価償却超過額		退職給付引当金超過額
	174		385
	その他		固定資産減価償却超過額
	75		158
	小計		その他
	760		34
	繰延税金資産小計		小計
	1,630		2,391
	評価性引当金		繰延税金資産小計
	△61		3,375
	繰延税金資産合計		評価性引当金
	1,568		△1,665
			繰延税金資産合計
			1,710
	繰延税金負債(固定)		繰延税金負債(固定)
	その他有価証券評価差額金		その他有価証券評価差額金
	199		200
	繰延税金負債合計		繰延税金負債合計
	199		200
	繰延税金資産の純額		繰延税金資産の純額
	1,369		1,510
2	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の 100 分の 5 以下であるため注記を省略しております。	2	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳 法定実効税率 (調整)
			38.0%
			評価性引当金の増減
			46.6%
			交際費等永久に損金に算入されない項目
			3.7%
			受取配当金等永久に益金に算入されない項目
			△12.9%
			税率変更による期末繰延税金資産の減額修正
			1.9%
			海外子会社の留保利益の影響額等
			6.9%
			税効果会計適用後の法人税等の負担率
			84.2%

第54期 (平成25年3月31日)	第55期 (平成26年3月31日)
—	<p>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</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」(平成26年法律第10号)の施行に伴い、「復興特別法人税に関する政令の一部を改正する政令」(平成26年政令第151号)が平成26年3月31日に公布されたことにより、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、平成26年4月1日に開始する事業年度において解消が見込まれる一時差異について、当社が使用した法定実効税率は38.0%から35.6%に変更されております。この結果、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65百万円減少し、その他有価証券評価差額金の金額が1百万円、法人税等調整額の金額が63百万円、それぞれ増加しております。</p>

(関連当事者情報)

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の 名称又は 氏名	所在地	資本金 又は 出資金 (千SGD)	事業 の 内容	議決権等の 所有 (被所有) 割合(%)	関連 当事者 との 関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガ ポール 国	252,000	アセット マネジメ ント業	直接 100.00	資金の 貸付	資金の貸付 (シンガポー ルドル貸建) (注1)	525 (千SGD 8,000)	関係会社 短期貸付金	606 (千SGD 8,000)
							貸付金利息 (シンガポー ルドル貸建) (注1)	5 (千SGD 76)	未収収益	5 (千SGD 76)

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社 (東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社 (非上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成24年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場
で円貨に換算したものであります。

資産合計 10,930 百万円

負債合計 1,103 百万円

純資産合計 9,826 百万円

営業収益 7,917 百万円

税引前当期純利益 2,801 百万円

当期純利益 2,091 百万円

第 55 期(自 平成 25 年 4 月 1 日 至 平成 26 年 3 月 31 日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の 名称又は 氏名	所在地	資本金 又は 出資金 (千 SGD)	事業 の 内容	議決権等の 所有 (被所有) 割合(%)	関連 当事者 との 関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガ ポール 国	292,000	アセット マネジメ ント業	直接 100.00	資金の 貸付	資金の貸付 (シンガポー ルドル貸建) (注 1)	△398 (千 SGD) △5,059 (注 2)	関係会社 短期貸付金	240 (千 SGD) 2,940)
							貸付金利息 (シンガポー ルドル貸建) (注 1)	15 (千 SGD) 192)	未収収益	5 (千 SGD) 64)
						—	増資の引受 (注 3)	3,266 (千 SGD) 40,000)	—	—

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 融資枠 SGD11 百万、返済期間 1 年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 2 資金の貸付に係る取引金額△398 百万円(△5,059 千 SGD)の内訳は、貸付 240 百万円(2,940 千 SGD)及び返済△638 百万円(△8,000 千 SGD)であります。
- 3 Nikko Asset Management International Limited の行った 40,000,000 株の新株発行増資を、1 株につき 1 シンガポールドルで当社が引受けたものであります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社 (東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社 (非上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成 25 年 12 月 31 日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場
で円貨に換算したものであります。

資産合計	15,790 百万円
負債合計	1,713 百万円
純資産合計	14,076 百万円
営業収益	11,350 百万円
税引前当期純利益	4,212 百万円
当期純利益	3,096 百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

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

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

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

関連情報

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
該当事項はありません。

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
該当事項はありません。

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
該当事項はありません。

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
1株当たり純資産額	235円69銭	231円23銭
1株当たり当期純利益金額	14円35銭	2円76銭

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
当期純利益(百万円)	2,827	544
普通株主に帰属しない金額(百万円)	—	—
普通株式に係る当期純利益(百万円)	2,827	544
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,903	196,903
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1)16,978,500株、平成21年度ストックオプション(2)1,626,900株、平成22年度ストックオプション(1)2,310,000株、第1回新株予約権2,955,200株、平成23年度ストックオプション(1)5,930,100株	平成21年度ストックオプション(1)15,902,700株、平成21年度ストックオプション(2)1,567,500株、平成22年度ストックオプション(1)2,310,000株、第1回新株予約権2,955,200株、平成23年度ストックオプション(1)5,388,900株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第54期 (平成25年3月31日)	第55期 (平成26年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	46,408	45,531
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	—	—
普通株式に係る期末の純資産額(百万円)	46,408	45,531
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数(千株)	196,903	196,903

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

5 【その他】

- (1) 定款の変更
委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

<約款>

＜追加型証券投資信託 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）＞

運用の基本方針

約款第16条の規定に基づき、委託者が別に定める運用の基本方針は次のものとします。

基本方針

この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。

運用方法

(1)投資対象

以下に掲げる各証券投資信託（その受益権を他の証券投資信託の信託財産に取得させることを目的とした証券投資信託であり、以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

証券投資信託 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

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

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

証券投資信託 日本債券インデックスマザーファンド

証券投資信託 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

証券投資信託 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

(2)投資態度

主として、上に掲げる各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長を目指します。

純資産総額に対する株式ならびに公社債および短期金融資産の実質組入率については、下記の標準実質組入率を目処として投資を行ないます。

組入率の調整にあたっては、原則としてマザーファンド受益証券への投資比率を調整することで行ないませんが、市況動向等によっては内外の有価証券等への直接投資を行なうことがあります。

株式の標準実質組入率 80%

公社債および短期金融資産の標準実質組入率 20%

また、資金動向等によっては組入率を引き下げることもあります。

株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。

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

運用制限

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

(2)外貨建資産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。

(3)外国為替の売買の予約取引の指図は、約款第28条の範囲で行ないます。

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

①分配対象額の範囲

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

②分配対象額についての分配方針

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

③留保益の運用方針

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

（信託の種類、委託者および受託者）

第1条 この信託は証券投資信託であり、日興アセットマネジメント株式会社を委託者とし、野村信託銀行株式会社を受託者とします。

② この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。

（信託の目的、金額および追加信託の限度額）

第2条 委託者は、金7億7,000万円を受受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者は、これを引き受けます。

② 委託者は、受託者と合意の上、金1兆円を限度として信託金を追加できるものとし、追加信託を行なったときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

③ 委託者は、受託者と合意の上、前項の限度額を変更することができます。

（信託期間）

第3条 この信託の期間は、信託契約締結日から第50条第7項、第51条、第52条第1項、第53条第1項および第55条第2項の規定による解約の日までとします。

（受益権の取得申込の勧誘の種類）

第4条 この信託に係る受益権の取得申込の勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行なわれます。

（当初の受益者）

第5条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第6条により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

（受益権の分割および再分割）

第6条 委託者は、第2条第1項による受益権については7億7,000万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第7条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受託者と協議の上、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）に定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとし、

（追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法）

第7条 追加信託金は、追加信託を行なう日の前営業日の基準価額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第25条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価し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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。））、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における当日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

③ 第28条に規定する予約為替の評価は、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るものとします。

（追加日時の異なる受益権の内容）

第8条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

（受益権の帰属と受益証券の不発行）

第9条 この信託の受益権は、平成19年1月4日より、社振法の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）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、以下「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（以下、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。）。

② 委託者は、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、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託者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なわないものとします。

- ③ 委託者は、第6条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。
- ④ 委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在のすべての受益権（受益権につき、既に信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約に係る一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。振替受入簿に記載または記録された受益権に係る受益証券は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、保護預り会社または第46条に規定する委託者の指定する口座管理機関、委託者の指定する第一種金融商品取引業者（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者をいいます。以下同じ。）および委託者の指定する登録金融機関（委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）に当該申請の手続きを委任することができます。

（受益権の設定に係る受託者の通知）

第10条 受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

（受益権の申込単位および価額）

第11条 委託者は、第6条第1項の規定により分割される受益権を、取得申込者に対し、委託者が定める単位をもって、当該受益権の取得の申込に应ずるものとします。ただし、第45条第3項に規定する収益分配金の再投資に係る受益権の取得の申込に限り、1口の整数倍をもって当該取得の申込に应ずることができます。

- ② 委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関は、第6条第1項の規定により分割される受益権を、別に定めるアセット・ナビゲーション・ファンド自動けいぞく投資約款（以下「自動けいぞく投資約款」といいます。）に従って契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に対し、1口の整数倍をもって取得の申込に应ずるものとします。
- ③ 前2項の取得申込者は、委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、委託者（第46条に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。）、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関は、当該取得申込の代金（第4項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。
- ④ 第1項および第2項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、手数料および当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込に係る受益証券の価額は、1口につき1円とします。
- ⑤ 前項の手料は、委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関がそれぞれ独自に定めるものとします。
- ⑥ 第4項の規定にかかわらず、証券投資信託の受益証券または受益権を信託終了時まで保有した受益者（信託期間を延長した証券投資信託（追加型証券投資信託にあつては、延長前の信託終了日（以下「当初の信託終了日」といいます。）以降、収益分配金の再投資以外の追加信託を行なわないものをいいます。以下本項において同じ。）にあつては、当初の信託終了日まで当該信託の受益証券または受益権を保有した受益者をいいます。以下本項において同じ。）が、その償還金（信託期間を延長した証券投資信託にあつては、当初の信託終了日以降における当該信託の受益証券または受益権の買取請求に係る売却代金または一部解約金を含みます。以下本項において同じ。）をもって、当該信託終了日（信託期間を延長した証券投資信託にあつては、当初の信託終了日以降における当該信託の受益証券または受益権の買取約定日または一部解約請求日を含みます。）の属する月の翌月の初日から起算して3ヵ月以内に、当該償還金の支払いを受けた委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関でこの信託に係る受益権の取得申込をする場合の1口当たり

の受益権の価額は、当該償還金額の範囲内（単位型証券投資信託にあつては、当該償還金額とその元本額とのいずれか大きい額）で取得する口数について取得申込日の翌営業日の基準価額とすることができます。ただし、取得日がこの信託契約締結の日である時は、当該受益証券の価額は1口につき1円とします。

なお、委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関は、当該受益者に対し、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求めることができます。

- ⑦ 第4項の規定にかかわらず、受益者が第45条第3項の規定または別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第39条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑧ 第4項の規定にかかわらず、自動けいぞく投資約款に規定するこの信託以外の信託の受益者が別に定める契約に基づいて当該信託の受益権の一部解約金の手取金をもって委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関に対して取得申込をする場合の受益権の価額および委託者の自らの募集に関して別に定める各信託（この信託を除きます。）の受益者が当該信託の受益権の一部解約金の手取金をもって委託者に対して取得申込をする場合の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ⑨ 前項の手数は、第5項で定める手数料とは別に、委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関がそれぞれ独自に定めるものとします。
- ⑩ 追加型証券投資信託の受益証券または受益権を保有する者が、当該信託の信託終了日の1年前の日以降に開始する委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関が別に定める期間内に、当該信託の受益証券または受益権の買取請求に係る売却代金または一部解約金をもって、当該売却代金または一部解約金の支払いを受けた委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関でこの信託に係る受益権の取得申込をする場合の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、取得申込を行なう委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ⑪ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込の受付を中止することおよび既に受け付けた取得申込の受付を取消することができます。

（受益権の譲渡に係る記載または記録）

第11条の2 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。

- ② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項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。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
- ③ 委託者は、第1項に規定する振替について、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、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（受益権の譲渡の対抗要件）

第11条の3 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

（受益証券の再交付）

第12条 （削 除）

（毀損した場合等の再交付）

第13条 （削 除）

（受益証券の再交付の費用）

第14条 （削 除）

(投資の対象とする資産の種類)

第14条の2 この信託において投資の対象とする資産の種類(投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条各号で定める特定資産の種類をいいます。)は、次に掲げるものとします。

1. 有価証券
 2. デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、第20条、第21条および第22条に定めるものに限ります。)
 3. 金銭債権
 4. 約束手形
- ② この信託においては、前項各号に掲げる資産のほか、次に掲げる資産を投資の対象とします。
1. 為替手形

(運用の指図範囲)

第15条 委託者は、信託金を、主として日興アセットマネジメント株式会社を委託者とし、野村信託銀行株式会社を受託者として締結された次の証券投資信託(その受益権を他の証券投資信託の信託財産に取得させることを目的とした証券投資信託であり、以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券ならびに次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 証券投資信託 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド 受益証券
2. 証券投資信託 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド 受益証券
3. 証券投資信託 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド 受益証券
4. 証券投資信託 日本債券インデックスマザーファンド 受益証券
5. 証券投資信託 海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド 受益証券
6. 証券投資信託 海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド 受益証券
7. 株券または新株引受権証券
8. 国債証券
9. 地方債証券
10. 特別の法律により法人の発行する債券
11. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)
12. 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
13. コマーシャル・ペーパー
14. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
15. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第7号から第14号までの証券または証書の性質を有するもの
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。以下本号において同じ。)または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)で投資法人債券に類する証券
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. 貸付債権信託受益権であつ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
23. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第7号の証券または証書ならびに第15号および第19号の証券または証書のうち第7号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、第8号から第12号までの証券ならびに第16号の証券ならびに第15号および第19号の証券または証書のうち第8号から第12号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。

- ② 前項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2

項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することの指図ができます。

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

（受託者の自己または利害関係人等との取引）

第15条の2 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本条および第29条において同じ。）、第29条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第14条の2ならびに第15条第1項および第2項に定める資産への投資を行なうことができます。

- ② 前項の取扱いは、第17条、第19条から第26条まで、第28条および第34条から第36条までにおける委託者の指図による取引についても同様とします。

（運用の基本方針）

第16条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行いません。

（投資する株式等の範囲）

第17条 委託者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、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

（同一銘柄の株式への投資制限等）

第18条 （削除）

（信用取引の指図範囲）

第19条 委託者は、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、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行なうことの指図をすることができるものとします。

- ② 前項の信用取引の指図は、当該売り付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売り付けに係る建玉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、委託者は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

（先物取引等の運用指図）

第20条 委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

- ② 委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- ③ 委託者は、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

（スワップ取引の運用指図）

第21条 委託者は、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、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

- ② 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、原則として第3条に定める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。
- ③ 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定した価額で評価するものとします。
- ④ 委託者は、スワップ取引を行な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なうものとします。

(金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図)

第22条 委託者は、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なうことの指図をすることができます。

- ② 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、第3条に定める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。
- ③ 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。
- ④ 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行な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なうものとします。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第23条 委託者は、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各号の範囲内で貸付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の50%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の50%を超えないものとします。
- ② 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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。
- ③ 委託者は、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なうものとします。

(公社債の空売りの指図範囲)

第24条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債(信託財産により借入れた公社債を含みます。)の引き渡しまたは買い戻しにより行なうことの指図をすることができるものとします。

- ② 前項の売り付けの指図は、当該売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売り付けに係る公社債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、委託者は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

(公社債の借入れ)

第25条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行なうにあたり担保の提供が必要と認められた時は、担保の提供の指図を行なうものとします。

- ② 前項の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る公社債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、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ④ 第1項の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

(外貨建資産への投資制限)

第26条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、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。ただし、有価証券の値上り等により100分の50を超えることとなる場合には、速やかにこれを調整します。

- ② 前項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をいいます。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第27条 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、制約されることがあります。

(外国為替予約の指図および範囲)

第28条 委託者は、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。

- ② 前項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。
- ③ 前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者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。
- ④ 第2項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をいいます。

(信託業務の委託等)

第29条 受託者は、委託者と協議の上、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みません。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
 2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
 3. 信託財産の保管等を委託する場合においては、当該財産の分別管理を行なう体制が整備されていること
 4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
 - ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務（裁量性のないものに限りません。）を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
 1. 信託財産の保存に係る業務
 2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
 4. 受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

(有価証券の保管)

第30条 (削除)

(混蔵寄託)

第31条 金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託することができるものとします。

(一括登録)

第32条 (削除)

(信託財産の登記等および記載等の留保等)

第33条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速

やかに登記または登録をするものとしします。

- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとしします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することができます。

- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することができます。

（一部解約の請求および有価証券の売却等の指図）

第34条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求ならびに信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

（再投資の指図）

第35条 委託者は、前条の規定による一部解約の代金および売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金ならびにその他の収入金を再投資することの指図ができます。

（資金の借入れ）

第36条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、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入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとしします。

- ② 前項の資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額としします。

1. 一部解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、一部解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
2. 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
3. 借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内

- ③ 一部解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間としします。

- ④ 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとしします。

- ⑤ 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

（損益の帰属）

第37条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

（受託者による資金の立替え）

第38条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は、資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

（信託の計算期間）

第39条 この信託の計算期間は、毎年10月27日から翌年10月26日までとすることを原則としします。ただし、第1計算期間は平成11年10月29日から平成12年10月26日までとしします。

- ② 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとしします。

（信託財産に関する報告）

第40条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

(信託事務等の諸費用)

第41条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託者の立替えた立替金の利息、信託財産の財務諸表の監査に要する費用ならびに当該費用に係る消費税等相当額（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

(信託報酬等の額)

第42条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第39条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の76の率を乗じて得た額とします。

- ② 前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。）および毎計算期末、または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

- ③ 第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁の時に信託財産中から支弁します。

(収益分配)

第43条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。ただし、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。ただし、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

- ② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。

(追加信託金および一部解約金の計算処理)

第44条 (削除)

(収益分配金の再投資等)

第45条 受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関に交付されます。

- ② 委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関は、別に定める契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の取得の申込に応じたものとし、当該取得により増加した受益権は、第9条第3項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。

- ③ 委託者は、自らの募集に係る受益権に帰属する収益分配金をこの信託の受益権の取得申込金として、各受益者ごとに当該収益分配金の再投資に係る受益権の取得の申込に応じたものとし、当該取得により増加した受益権は、第9条第3項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。

- ④ 第50条第3項により信託の一部解約が行なわれた場合に、当該受益権に帰属する収益分配金があるときは、前2項の規定にかかわらず、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から受益者に支払います。

- ⑤ 収益分配金に係る収益調整金は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとし、

(委託者の自らの募集に係る受益権の口座管理機関)

第46条 委託者は、委託者の自らの募集に係る受益権について、口座管理機関を指定し、振替口座簿への記載または記録等に関する業務を委任することができます。

(収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責)

第47条 受託者は、収益分配金については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第48条第1項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第48条第2項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- ② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

(償還金および一部解約金の支払い)

第48条 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権に係る受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者(第46条に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。)、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。

- ② 一部解約金は、第50条第1項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として5営業日目から当該受益者に支払います。
- ③ 前2項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関の営業所等において行なうものとし、委託者の自らの募集に係る受益権に帰属する償還金および一部解約金の支払いは、委託者において行なうものとし、
- ④ 第45条第4項に規定する信託の一部解約に係る受益権に帰属する収益分配金は、原則として、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関の営業所等において受益者に支払います。ただし、信託の一部解約に係る受益権が委託者の自らの募集に係る受益権である場合には、当該受益権に帰属する収益分配金は、委託者において支払います。
- ⑤ 償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとし、

(償還金の時効)

第49条 受益者が、信託終了による償還金について第48条第1項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

(一部解約)

第50条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

- ② 平成19年1月4日以降の信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関に対し、振替受益権をもって行なうものとし、ただし、平成19年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成19年1月4日以前に行なわれる当該請求については、振替受益権となるのが確実な受益証券をもって行なうものとし、
- ③ 委託者は、第1項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、第1項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。
- ④ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額から当該基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額とします。
- ⑤ 委託者は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受付を中止することおよび既に受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取消することができます。
- ⑥ 前項により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日の一部解約の実行の請求日として、第4項の規定に準じて算定した価額とします。
- ⑦ 委託者は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下ることとなった場合には、第51条の規定に従ってこの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

(質権口記載または記録の受益権の取り扱い)

第50条の2 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、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

(信託契約の解約)

第51条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約す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は、受託者と合意の上、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出るものとします。

- ② 委託者は、前項の規定に基づいてこの信託契約を解約する場合は、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるとときは、第1項の信託契約の解約を行いません。
- ⑤ 委託者は、この信託契約の解約を行わないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ⑥ 前3項の規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第3項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合は、適用しないものとします。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第52条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第56条の規定に従うものとします。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第53条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第56条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第54条 委託者は、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。

- ② 委託者は、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。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第55条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第56条の規定に従い新受託者を選任します。

- ② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更)

第56条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、この信託約款を変更することができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出るものとします。

- ② 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

- ③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるとときは、第1項の信託約款の変更を行ないません。
- ⑤ 委託者は、前項の規定により信託約款の変更を行なわないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

(反対者の買取請求権)

第56条の2 第51条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行なう場合において、第51条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

(公告)

第57条 委託者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。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第58条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

附 則

第1条 この約款において、「アセット・ナビゲーション・ファンド自動けいぞく投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関が締結する「アセット・ナビゲーション・ファンド自動けいぞく投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合、「アセット・ナビゲーション・ファンド自動けいぞく投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条 変更後の第7条第1項の規定は、平成12年4月4日以降行なわれる追加信託について適用するものとします。

第3条 変更後の第11条の規定は、平成18年7月27日以降の取得申込について適用します。

第4条 第45条第5項および第48条第5項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額を言い、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。なお、平成12年3月30日以前を取得申込日とする取得申込に係る受益権の信託時の受益証券の価額は、委託者が計算する平成12年3月31日の平均信託金（信託金総額を受益権総口数で除して得た額）とみなすものとします。

第5条 平成18年12月29日現在の信託約款第9条、第10条、第12条から第14条までおよび第46条の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。

第6条 第22条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

- ② 第22条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割

り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

信託契約締結日 平成11年10月29日

東京都港区赤坂九丁目7番1号
委託者 日興アセットマネジメント株式会社

東京都千代田区大手町二丁目2番2号
受託者 野村信託銀行株式会社

(1) 委託者の自らの募集に関して別に定める各信託

約款第11条の「委託者の自らの募集に関して別に定める各信託」とは次のものをいいます。

追加型証券投資信託	アセット・ナビゲーション・ファンド (株式80)
追加型証券投資信託	アセット・ナビゲーション・ファンド (株式60)
追加型証券投資信託	アセット・ナビゲーション・ファンド (株式40)
追加型証券投資信託	アセット・ナビゲーション・ファンド (株式20)

