

～お申込をされる前に～

## 目論見書補完書面(投資信託)

(この書面は、金融商品取引法第37条の3の規定により、目論見書と一体としてお渡しするものです。  
この書面は、株式会社新生銀行が作成したものであり、目論見書の一部を構成するものではありません。)

この目論見書補完書面、および目論見書の内容をよくお読みください。

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。

### 当ファンドにかかる金融商品取引契約の概要

当行は、当ファンドの販売会社として、募集の取扱いおよび販売等に関する事務を行います。

### 当行が行う登録金融機関業務の内容および方法の概要

当行が行う金融商品取引業務は、金融商品取引法第33条の2の規定に基づく登録金融機関業務であり、当行においてファンドのお取引や保護預りを行われる場合は、以下によります。

- ・お取引にあたっては、投資信託総合取引口座をあらかじめ開設されることが必要となります。
- ・お取引のご注文をいただいたときは、原則として、あらかじめ当該ご注文にかかる設定代金または設定代金概算額の全部(前受金)を預金決済口座から引き落としてお預りしたうえで、ご注文をお受けいたします。
- ・設定代金概算額と設定代金の確定額の差額は、設定日に精算していただきます。
- ・ご注文いただいたお取引が成立した場合(法令に定める場合を除きます。)には、取引報告書をお客さまのお届出住所宛に送付します。

当行は上記の他に金融商品取引業として、以下の業務を行っています。

- ①法令により登録金融機関が取り扱うことを認められた有価証券等の募集、売り出し、私募の取扱い等の業務
- ②証券仲介業務
- ③デリバティブ業務
- ④保護預り業務
- ⑤社債等の振替業務

### 当ファンドの販売会社の概要




|       |                                   |
|-------|-----------------------------------|
| 商号等   | 株式会社新生銀行 登録金融機関 関東財務局長(登金)第10号    |
| 本店所在地 | 〒100-8501 東京都千代田区内幸町2-1-8         |
| 加入協会  | 日本証券業協会、(社)金融先物取引業協会              |
| 資本金   | 476,296,960,638円(2008年2月4日現在)     |
| 主な事業  | 銀行業                               |
| 設立年月  | 1952年12月1日                        |
| 連絡先   | 0120-456-860またはお取引のある本支店にご連絡ください。 |



### 当行取扱いの公募追加型投資信託のお申込手数料一覧



















次ページ以降をご確認ください。









## 当行取扱いの公募追加型投資信託のお申込手数料一覧




























(※)約定金額とは、お申込金額からお申込手数料およびお申込手数料に対する消費税等の相当額を控除した金額(「約定日の基準価額×約定した口数」)をいいます。お申込手数料は、下記の手数料率を約定金額に乘じた金額とします。また、消費税等の相当額とは消費税および地方消費税相当額の合計金額を示し、各お申込手数料に対して5%がかかります。(「お申込金額=約定金額+お申込手数料+お申込手数料に対する消費税等の相当額」)

取扱窓口  店頭 /  電話 (新生パワーコール) /  インターネット (新生パワーダイレクト)










〔 電話 (新生パワーコール)、 インターネット (新生パワーダイレクト) は、パワーフレックス口座をお持ちの個人のお客さまのみのお取り扱いになります。〕












| ファンド名                                  | 運用会社               | 取扱コース             | 約定金額(※)に対するお申込手数料率     |                  | お申込単位         | 取扱窓口  |
|--|--------------------|-------------------|------------------------|------------------|---------------|---|
| 大同のMMF<br>(マネー・マネージメント・ファンド)           | T&Dアセット<br>マネジメント  | 累積投資<br>専用        | なし                     |                  | 1万円以上<br>1円単位 |          |
| 225インデックス<br>ファンド                      | T&Dアセット<br>マネジメント  | 自動継続<br>投資コース     | 5億円未満                  | 1.05% (税抜 1.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |       |
|  |                    |                   | 5億円以上                  | 0.525% (税抜 0.5%) |               |   |
| インデックス<br>ファンド225                      | 日興アセット<br>マネジメント   | 分配金<br>再投資<br>コース | 一律                     | 1.05% (税抜 1.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
| ダイワ・<br>バリュー株・<br>オープン<br>(愛称:底力)      | 大和証券<br>投資信託<br>委託 | 分配金<br>再投資<br>コース | 1,000万円未満              | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
|  |                    |                   | 1,000万円以上<br>5億円未満     | 2.1% (税抜 2.0%)   |               |   |
|  |                    |                   | 5億円以上<br>10億円未満        | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
|  |                    |                   | 10億円以上                 | 0.525% (税抜 0.5%) |               |   |
| フィデリティ・<br>日本成長株・<br>ファンド              | フィデリティ<br>投信       | 累積<br>投資コース       | 1,000万円未満              | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
|  |                    |                   | 1,000万円以上<br>5,000万円未満 | 2.1% (税抜 2.0%)   |               |   |
|  |                    |                   | 5,000万円以上<br>1億円未満     | 1.575% (税抜 1.5%) |               |   |
|  |                    |                   | 1億円以上                  | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
| フィデリティ・<br>日本配当<br>成長株・ファンド<br>(分配重視型) | フィデリティ<br>投信       | 累積<br>投資コース       | 一律                     | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
















| ファンド名                               | 運用会社                                | 取扱コース                      | 約定金額(※)に対するお申込手数料率  | お申込単位         | 取扱窓口  |
|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------|---|---------------|---|
| クレディ・スイス・<br>ジャパン・<br>グロース・<br>ファンド | クレディ・<br>スイス投信                      | 自動<br>けいぞく<br>投資専用         | 1,000万円未満 3.15% (税抜 3.0%)   | 1万円以上<br>1円単位 |    |
|                                     |                                     |                            | 1,000万円以上<br>5,000万円未満 2.1% (税抜 2.0%)                                 |               |   |
|                                     |                                     |                            | 5,000万円以上<br>1億円未満 1.575% (税抜 1.5%)                                   |               |   |
|                                     |                                     |                            | 1億円以上<br>5億円未満 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
|                                     |                                     |                            | 5億円以上 0.525% (税抜 0.5%)  |               |   |
| アメリカン・<br>ドリーム・ファンド                 | 新生インベス<br>トメント・<br>マネジメント           | 自動<br>けいぞく<br>投資コース        | 1億円未満 3.15% (税抜 3.0%)   | 1万円以上<br>1円単位 |    |
|                                     |                                     |                            | 1億円以上<br>3億円未満 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
|                                     |                                     |                            | 3億円以上 0.525% (税抜 0.5%)  |               |   |
| ガリレオ                                | ゴールドマン・<br>サックス・<br>アセット・<br>マネジメント | 自動<br>けいぞく<br>投資専用         | 1億円未満 2.1% (税抜 2.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |  |
|                                     |                                     |                            | 1億円以上<br>10億円未満 1.05% (税抜 1.0%)                                       |               |   |
|                                     |                                     |                            | 10億円以上 0.525% (税抜 0.5%)   |               |   |
| グローバル・<br>ソブリン・<br>オープン<br>(毎月決算型)  | 国際投信<br>投資顧問                        | 分配金<br>複利<br>けいぞく<br>投資コース | 1億口未満 1.575% (税抜 1.5%)  | 1万円以上<br>1円単位 |  |
|                                     |                                     |                            | 1億口以上<br>3億口未満 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
|                                     |                                     |                            | 3億口以上 0.525% (税抜 0.5%)  |               |   |
|                                     |                                     |                            | お申込手数料の段階区分が「口数」<br>であるため、当ファンドについては「約<br>定した口数」に応じた手数料率を記<br>載しています。 |               |   |
| 世界のサイフ                              | 日興アセット<br>マネジメント                    | 分配金<br>再投資<br>コース          | 一律 2.10% (税抜 2.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |  |
| LM・<br>オーストラリア<br>毎月分配型<br>ファンド     | レッグ・<br>メイソン・<br>アセット・<br>マネジメント    | 自動<br>けいぞく<br>投資コース        | 1,000万円未満 2.1% (税抜 2.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |  |
|                                     |                                     |                            | 1,000万円以上<br>1億円未満 1.575% (税抜 1.5%)                                   |               |   |
|                                     |                                     |                            | 1億円以上 1.05% (税抜 1.0%)   |               |   |
| ニッセイ/<br>パトナム・<br>インカムオープン          | ニッセイ<br>アセット<br>マネジメント              | 自動<br>けいぞく<br>投資コース        | 一律 1.575% (税抜 1.5%)   | 1万円以上<br>1円単位 |  |
| エマージング・<br>ソブリン・オープン<br>(毎月決算型)     | 国際投信<br>投資顧問                        | 自動<br>けいぞく<br>投資コース        | 5億円未満 2.1% (税抜 2.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |  |
|                                     |                                     |                            | 5億円以上 1.05% (税抜 1.0%)   |               |   |

| ファンド名                                  | 運用会社                       | 取扱コース               | 約定金額(※)に対するお申込手数料率     |                  | お申込単位         | 取扱窓口  |
|--|----------------------------|---------------------|------------------------|------------------|---------------|---|
| 高利回り社債オープン                             | 野村アセットマネジメント               | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 一律                     | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |          |
| 高利回り社債オープン・<br>為替ヘッジ                   | 野村アセットマネジメント               | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 一律                     | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |          |
| エマージング・<br>カレンシー・<br>債券ファンド<br>(毎月分配型) | 新生インベスト<br>メント・<br>マネジメント  | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 1億円未満                  | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |          |
|  |                            |                     | 1億円以上                  | 1.575% (税抜 1.5%) |               |   |
| JPMワールド・<br>CB・<br>オープン                | JPモルガン・<br>アセット・<br>マネジメント | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 一律                     | 2.1% (税抜 2.0%)   | 1万円以上<br>1円単位 |          |
| ドイツ・ライフ・<br>プラン<br>30                  | ドイツ・<br>アセット・<br>マネジメント    | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 5,000万円未満              | 2.1% (税抜 2.0%)   | 1万円以上<br>1円単位 |          |
|  |                            |                     | 5,000万円以上<br>1億円未満     | 1.575% (税抜 1.5%) |               |   |
|  |                            |                     | 1億円以上                  | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
| ドイツ・ライフ・<br>プラン<br>50                  | ドイツ・<br>アセット・<br>マネジメント    | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 5,000万円未満              | 2.1% (税抜 2.0%)   | 1万円以上<br>1円単位 |    |
|  |                            |                     | 5,000万円以上<br>1億円未満     | 1.575% (税抜 1.5%) |               |   |
|  |                            |                     | 1億円以上                  | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
| ドイツ・ライフ・<br>プラン<br>70                  | ドイツ・<br>アセット・<br>マネジメント    | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 5,000万円未満              | 2.1% (税抜 2.0%)   | 1万円以上<br>1円単位 |    |
|  |                            |                     | 5,000万円以上<br>1億円未満     | 1.575% (税抜 1.5%) |               |   |
|  |                            |                     | 1億円以上                  | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
| フィデリティ・<br>バランス・<br>ファンド               | フィデリティ<br>投信               | 累積投資<br>コース         | 1,000万円未満              | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
|  |                            |                     | 1,000万円以上<br>5,000万円未満 | 2.1% (税抜 2.0%)   |               |   |
|  |                            |                     | 5,000万円以上<br>1億円未満     | 1.575% (税抜 1.5%) |               |   |
|  |                            |                     | 1億円以上                  | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
| 新生・4分散<br>ファンド                         | 中央三井<br>アセット<br>マネジメント     | 分配金<br>再投資<br>コース   | 1億円未満                  | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
|  |                            |                     | 1億円以上<br>3億円未満         | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
|  |                            |                     | 3億円以上                  | 0.525% (税抜 0.5%) |               |   |



| ファンド名                                    | 運用会社                       | 取扱コース               | 約定金額(※)に対するお申込手数料率 |                  | お申込単位         | 取扱窓口  |
|--|----------------------------|---------------------|--------------------|------------------|---------------|---|
| 新生・世界分散ファンド<br>(複利効果重視型)                 | 新生インベストメント・マネジメント          | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 1億円未満              | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
|  |                            |                     | 1億円以上<br>3億円未満     | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
|  |                            |                     | 3億円以上              | 0.525% (税抜 0.5%) |               |   |
| 新生・世界分散ファンド<br>(分配重視型)                   | 新生インベストメント・マネジメント          | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 1億円未満              | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
|  |                            |                     | 1億円以上<br>3億円未満     | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
|  |                            |                     | 3億円以上              | 0.525% (税抜 0.5%) |               |   |
| 世界の財産<br>3分法ファンド<br>(不動産・債券・株式)<br>毎月分配型 | 日興アセット<br>マネジメント           | 分配金<br>再投資<br>コース   | 一律                 | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
| 新生・世界株式<br>ファンド<br>(複利効果重視型)             | 新生インベストメント・マネジメント          | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 1億円未満              | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |  |
|  |                            |                     | 1億円以上<br>3億円未満     | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
|  |                            |                     | 3億円以上              | 0.525% (税抜 0.5%) |               |   |
| 新生・世界株式<br>ファンド<br>(分配重視型)               | 新生インベストメント・マネジメント          | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 1億円未満              | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |  |
|  |                            |                     | 1億円以上<br>3億円未満     | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
|  |                            |                     | 3億円以上              | 0.525% (税抜 0.5%) |               |   |
| グローバル・<br>ハイインカム・<br>ストック・ファンド           | 野村アセット<br>マネジメント           | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 一律                 | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |  |
| 世界好配当<br>インフラ株<br>ファンド<br>(毎月分配型)        | 日興アセット<br>マネジメント           | 分配金<br>再投資<br>コース   | 1億円未満              | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |  |
|  |                            |                     | 1億円以上<br>3億円未満     | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
|  |                            |                     | 3億円以上              | 0.525% (税抜 0.5%) |               |   |
| JFアジア株・<br>アクティブ・<br>オープン                | JPモルガン・<br>アセット・<br>マネジメント | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 一律                 | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |  |
| JPM・BRICS5・<br>ファンド(愛称:<br>ブリックス・ファイブ)   | JPモルガン・<br>アセット・<br>マネジメント | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 一律                 | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |  |

| ファンド名                                    | 運用会社                            | 取扱コース               | 約定金額(※)に対するお申込手数料率 |                  | お申込単位         | 取扱窓口  |
|--|---------------------------------|---------------------|--------------------|------------------|---------------|---|
| 新生・フラトン<br>VPIC<br>ファンド                  | 新生インベスト<br>メント・<br>マネジメント       | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 1億円未満              | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
|  |                                 |                     | 1億円以上<br>3億円未満     | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
|  |                                 |                     | 3億円以上              | 0.525% (税抜 0.5%) |               |   |
| HSBCチャイナ<br>オープン                         | HSBC投信                          | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 一律                 | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
| HSBCインド<br>オープン                          | HSBC投信                          | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 一律                 | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
| 新生・UTI<br>インドファンド                        | 新生インベスト<br>メント・<br>マネジメント       | 分配金<br>再投資<br>コース   | 一律                 | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
| 新生・UTIインド<br>インフラ関連株式<br>ファンド            | 新生インベスト<br>メント・<br>マネジメント       | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 1億円未満              | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
|  |                                 |                     | 1億円以上<br>3億円未満     | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
|  |                                 |                     | 3億円以上              | 0.525% (税抜 0.5%) |               |   |
| HSBCブラジル<br>オープン                         | HSBC投信                          | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 一律                 | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |  |
| SGロシア<br>東欧株ファンド                         | ソシエテ<br>ジェネラル<br>アセット<br>マネジメント | 分配金<br>再投資<br>コース   | 一律                 | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |  |
| 新生・トロイカ<br>ロシアファンド                       | 新生インベスト<br>メント・<br>マネジメント       | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 1億円未満              | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |  |
|  |                                 |                     | 1億円以上<br>3億円未満     | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
|  |                                 |                     | 3億円以上              | 0.525% (税抜 0.5%) |               |   |
| フィデリティ・<br>USリート・<br>ファンド A<br>(為替ヘッジあり) | フィデリティ<br>投信                    | 累積投資<br>コース         | 一律                 | 2.1% (税抜 2.0%)   | 1万円以上<br>1円単位 |  |
| フィデリティ・<br>USリート・<br>ファンド B<br>(為替ヘッジなし) | フィデリティ<br>投信                    | 累積投資<br>コース         | 一律                 | 2.1% (税抜 2.0%)   | 1万円以上<br>1円単位 |  |
| ラサール・<br>グローバルREIT<br>ファンド<br>(毎月分配型)    | 日興アセット<br>マネジメント                | 分配金<br>再投資<br>コース   | 一律                 | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |  |

| ファンド名   | 運用会社                                     | 取扱コース               | 約定金額(※)に対するお申込手数料率                         | お申込単位          | 取扱窓口  |
|---|--|---------------------|--|----------------|---|
| ゴールドマン・サックス<br>日本株式マーケット・<br>ニュートラル・ファンド<br>(愛称:GS ジャパン・<br>ニュートラル)   | ゴールドマン・<br>サックス・<br>アセット・<br>マネジメント      | 自動<br>けいぞく<br>投資専用  | 5,000万円未満 2.1% (税抜 2.0%)                   | 1万円以上<br>1円単位  |    |
|   |  |                     | 5,000万円以上<br>1億円未満 1.575% (税抜 1.5%)        |                |   |
|   |  |                     | 1億円以上 1.05% (税抜 1.0%)                      |                |   |
| ゴールドマン・サックス<br>米国株式マーケット・<br>ニュートラル・ファンド<br>(愛称:GS US<br>ニュートラル)  | ゴールドマン・<br>サックス・<br>アセット・<br>マネジメント      | 自動<br>けいぞく<br>投資専用  | 5,000万円未満 2.1% (税抜 2.0%)                   | 1万円以上<br>1円単位  |    |
|   |  |                     | 5,000万円以上<br>1億円未満 1.575% (税抜 1.5%)        |                |   |
|   |  |                     | 1億円以上 1.05% (税抜 1.0%)                      |                |   |
| MHAM物価<br>連動国債ファンド<br>(愛称:未来予想)   | みずほ<br>投信投資<br>顧問                        | 分配金<br>再投資<br>コース   | 一律 1.05% (税抜 1.0%)                         | 1万円以上<br>1円単位  |    |
| インベスコ<br>店頭・成長株<br>オープン   | インベスコ<br>投信投資<br>顧問                      | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 一律 2.1% (税抜 2.0%)                          | 1万円以上<br>1円単位  |    |
| ドイチェ・ヨーロッパ<br>インカムオープン  | ドイチェ・<br>アセット・<br>マネジメント                 | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 一律 1.575% (税抜 1.5%)                        | 1万円以上<br>1円単位  |    |
| MSCIインデックス・<br>セレクト・ファンド<br>コクサイ・<br>ポートフォリオ  | モルガン・<br>スタンレー・<br>アセット・<br>マネジメント<br>投信 | 分配金<br>再投資<br>コース   | 一律 1.05% (税抜 1.0%)                         | 1万円以上<br>1円単位  |    |
| ダイワJ-REIT<br>オープン   | 大和証券<br>投資信託<br>委託                       | 分配金<br>再投資<br>コース   | 一律 1.05% (税抜 1.0%)                         | 1万円以上<br>1円単位  |    |
| 日本トレンド・セレクト<br>ハイパー・ウェイブ  | 日興アセット<br>マネジメント                         | 自動<br>けいぞく<br>投資専用  | 一律 1.05% (税抜 1.0%)                         | 1万円以上<br>1円単位  |    |
| 日本トレンド・セレクト<br>リバース・トレンド・<br>オープン   |  |                     | 一律 1.05% (税抜 1.0%)                         |                |   |
| 日本トレンド・セレクト<br>日本トレンド・<br>マネー・ポートフォリオ   |  |                     | 日本トレンド・セレクトの他のポートフォリオからのスイッチングでのみご購入いただけます |                |   |
| 日本トレンド・セレクトは手数料無しで3つのポートフォリオ間のスイッチングができます(信託財産留保額はかかる場合があります。詳しくは目論見書でご確認ください)。スイッチングによる購入申込単位は、1円以上1円単位です。 |  |                     |  |                |   |
| 日本債券ベア  | T&D<br>アセット<br>マネジメント                    | 自動継続<br>投資コース       | 一律 1.05% (税抜 1.0%)                         | 10万円以上<br>1円単位 |    |

### <償還乗換優遇制度について>

償還乗換優遇制度とは、投資信託の償還金をもって、その支払を受けた販売会社で一定期間内に新たに別の投資信託をご購入いただく場合に、お申込手数料が無料となるなどの優遇制度です。当行では、お客さまが、下記の優遇対象となる償還(予定)ファンドの償還金をもって、本お申込手数料一覧記載のいずれかの投資信託(「大同のMMF」は除く。)をお申し込みされる場合に、手数料を無料とさせていただきます。\*なお、償還乗換の際に償還金の支払を受けたことを証する書類を呈示していただくことがあります。

※以下の場合には優遇制度の対象外となります。

- ・「償還するファンド」「償還金をもってお申し込みされるファンド」のいずれかまたは両方が、外国籍投資信託である場合
- ・インターネット(新生パワーダイレクト)でお申し込みされる場合

| 優遇対象となる償還(予定)ファンド   | 償還(予定)日 | 優遇期限 |
|---------------------|---------|------|
| —                   | —       | —    |
| 優遇対象とならない償還(予定)ファンド | 償還(予定)日 |      |
| —                   | —       |      |

Color your life





# 世界の財産3分法ファンド

(不動産・債券・株式)

## 毎月分配型

ファンド・オブ・ファンズ / 自動けいぞく投資適用

本書は「交付目論見書」と「請求目論見書」を合冊しております。



設定・運用は

## 日興アセットマネジメント

# 世界の財産3分法ファンド

(不動産・債券・株式)

## 毎月分配型

ファンド・オブ・ファンズ / 自動けいぞく投資適用



設定・運用は

## 日興アセットマネジメント

本書は金融商品取引法第13条の規定に基づき、投資家に交付される目論見書です。

「世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型」(マザーファンドを含みます。)は、主に投資信託証券に投資を行ない、投資対象とする投資信託証券は、主に不動産、債券および株式など値動きのある資産(外貨建資産は為替変動リスクもあります。)を投資対象としているため、基準価額は変動します。したがって、元金を割り込むことがあります。

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。

この目論見書により行なう「世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型」の募集については、委託会社は、証券取引法(現金融商品取引法)(昭和23年法第25号)第5条の規定により有価証券届出書を平成19年9月14日に関東財務局長に提出しており、平成19年9月15日にその効力が発生しております。また、同法第7条の規定により有価証券届出書の訂正届出書を平成19年11月19日および平成20年3月14日に関東財務局長に提出しております。

当該有価証券届出書「第三部 ファンドの詳細情報」の内容を記載した投資信託説明書(請求目論見書)については、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、投資信託説明書(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。

基準価額、販売会社などにつきましては、以下の委託会社の照会先にお問い合わせください。

## 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。  
(半休日となる場合は午前9時～正午)



下記の事項は、この投資信託(以下「当ファンド」といいます。)をお申込みされる投資家の皆様にあらかじめ、ご確認いただきたい重要な事項としてお知らせするものです。

お申込みの際には、下記の事項および投資信託説明書(交付目論見書)の内容を十分にお読みください。

## 記

### 当ファンドのリスクについて

- ・当ファンドは、主に不動産、債券および株式を実質的な投資対象としますので、不動産、債券および株式の価格の下落や、不動産の市況の悪化、債券および株式の発行者の財務状況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。したがって、投資家の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金が割り込むことがあります。
- ・当ファンドの基準価額の変動要因としては、主に「価格変動リスク」、「流動性リスク」、「信用リスク」、「為替変動リスク」および「不動産投信への投資に伴なうリスク」などがあります。

詳しくは、投資信託説明書(交付目論見書)の「ファンドのリスク」をご覧ください。



## 当ファンドの手数料などについて

### お申込時、ご換金(解約)時にご負担いただく費用

|                    |   |
|--------------------|---|
| 申込手数料<br>(1口当たり)   | 基準価額に対し3.15%(税抜3%)以内<br>詳しくは、販売会社にお問い合わせください。 |
| 換金(解約)手数料          | ありません。  |
| 信託財産留保額<br>(1口当たり) | 基準価額に対し0.2%                                   |

### 信託財産で間接的にご負担いただく(ファンドから支払われる)費用

|            |  |
|------------|--|
| 信託報酬       | 純資産総額に対し年率0.9975%(税抜0.95%)<br>この他に、投資対象とする「日本リートインデックス」- REITマザーファンド」および「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」の主要投資対象である不動産投信には運用などに係る費用がかかりますが、投資する不動産投信の銘柄は固定されていないため、事前に料率、上限額などを表示することができません。 |
| その他諸費用     | 純資産総額に対し年率0.1%以内   |
| 売買委託手数料など* | ・組入有価証券の売買委託手数料<br>・外貨建資産の保管などに要する費用<br>・借入金の利息<br>・立替金の利息 など  |

詳しくは、投資信託説明書(交付目論見書)の「費用・税金」をご覧ください。

\*売買委託手数料などについては、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ができません。

当ファンドの手数料などの合計額については、投資家の皆様がファンドを保有される期間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。

# 目 次

## 基本情報について

|               |   |
|---------------|---|
| ファンドの概要 ..... | 1 |
|---------------|---|

## 運用の内容について

|                   |    |
|-------------------|----|
| ファンドの特色 .....     | 3  |
| 投資方針 .....        | 4  |
| 投資方針              |    |
| 投資対象              |    |
| 配分方針              |    |
| 投資制限              |    |
| ファンドのリスク .....    | 12 |
| ファンドの仕組み・体制 ..... | 14 |
| ファンドの仕組み          |    |
| 運用体制・リスク管理体制      |    |

## 手続きと費用について

|                |    |
|----------------|----|
| 取得申込み手続き ..... | 18 |
| 換金手続き .....    | 20 |
| 費用・税金 .....    | 21 |

## 運営方法について

|               |    |
|---------------|----|
| 管理および運営 ..... | 26 |
| 基準価額          |    |
| 償還            |    |
| 信託約款の変更       |    |
| 異議の申立て        |    |
| 公告            |    |
| その他           |    |

## 運用の状況について

|                 |    |
|-----------------|----|
| ファンドの運用状況 ..... | 32 |
| 財務ハイライト情報 ..... | 51 |

## その他

|           |    |
|-----------|----|
| 約款 .....  | 53 |
| 用語集 ..... | 66 |

## ファンドの概要

|          |   |
|----------|---|
| ファンドの名称  | 世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型<br>(以下「ファンド」といいます。)<br>・愛称として「世界の財産3分法ファンド」、「世界の財産3分法」という名称を用いることがあります。  |
| 商品分類     | ファンド・オブ・ファンズ / 自動けいぞく投資適用<br>「ファンド・オブ・ファンズ」とは、社団法人投資信託協会が定める分類方法において、「主として投資信託証券に投資するもの」として分類されるファンドをいいます。  |
| ファンドの目的  | 安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長を目標として運用を行ないます。   |
| 主な投資対象   | 投資信託証券を主要投資対象とします。<br>▶ 詳しくは、後述の『投資対象』をご覧ください。  |
| 主な投資制限   | ・投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。<br>・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。<br>▶ 詳しくは、後述の『投資制限』をご覧ください。   |
| 主なリスク    | ・価格変動リスク<br>・流動性リスク<br>・信用リスク<br>・為替変動リスク<br>・不動産投信への投資に伴なうリスク<br>▶ 詳しくは、後述の『ファンドのリスク』をご覧ください。  |
| 信託報酬     | 純資産総額に対し年率0.9975%(税抜0.95%)<br>この他に、投資対象とする「日本リートインデックス」- REITマザーファンド」および「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」の主要投資対象である不動産投信には運用などに係る費用がかかりますが、投資する不動産投信の銘柄は固定されていないため、事前に料率、上限額などを表示することができません。<br>▶ 詳しくは、後述の『費用・税金』をご覧ください。 |
| 信託期間     | 無期限(平成17年9月29日設定)<br>▶ 詳しくは、後述の『償還』をご覧ください。   |
| 決算日      | 毎月15日(休業日の場合は翌営業日)  |
| 収益分配     | 毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。<br>▶ 詳しくは、後述の『分配方針』をご覧ください。   |
| 運用報告書の作成 | 委託会社は、年2回(6月、12月)および償還後に運用報告書を作成し、あらかじめ届出を受けた住所に販売会社よりお届けします。   |

商品内容を充分にご理解のうえ、お申込みいただきますようお願い申し上げます。

# 基本情報について

## 取得・換金(解約)に関して

|                |  |
|----------------|--|
| 取得・解約<br>取扱時間  | 原則として、販売会社の営業日の午後3時(わが国の金融商品取引所が半<br>休日となる場合は午前11時)まで  |
| 取得・解約<br>申込不可日 | 販売会社の営業日であっても、取得申込日・解約請求日がニューヨーク証券<br>取引所の休業日またはニューヨークの銀行休業日に該当する場合は、取得<br>の申込み・解約請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせ<br>ください。 |
| 申込価額           | 取得申込受付日の翌営業日の基準価額  |
| 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<br>たは委託会社の照会先にお問い合わせください。<br>・販売会社における申込手数料率は3.15%(税抜3%)が上限となっております。                  |
| 申込単位           | 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。  |
| 申込代金の支払い       | 販売会社が指定する日までにお支払いください。   |
| 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を控除した価額  |
| 解約手数料          | 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)   |
| 解約単位           | 1口単位<br>販売会社によって異なる場合がありますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。   |
| 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。   |

## 主な用語の解説

- 信託報酬(しんたくほうしゅう)  
投資信託の運用や管理の対価として、委託会社、受託会社、販売会社が信託財産の中から受け取る報酬のことをいいます。
- 運用報告書(うんようほうこくしょ)  
投資家に対して、運用状況(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)に関する情報を報告  
する書類のことです。
- 信託財産留保額(しんたくざいさんりゅうほがく)  
投資信託を解約される投資家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。

➡ 本書で用いている専門的な用語については、後述の『用語集』をご覧ください。



## ファンドの特色

### 1 主として国内外の不動産、債券および株式に投資を行ないます。

- ・国内外の不動産、債券および株式の3つの異なる資産へ投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざします。
- ・各資産への投資は、各資産を主要投資対象とする投資信託証券への投資を通じて行ないます（ファンド・オブ・ファンズ）。

### 2 国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

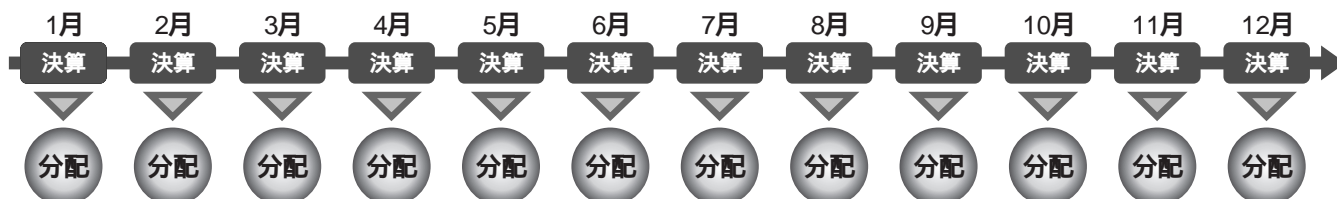
投資信託証券( マザーファンド )への投資を通じて、原則として、国内外の各3資産へそれぞれ純資産総額の6分の1を基本に国際分散投資を行ないます。

資金動向やその見通しなどによっては、5%～25%の範囲内で組入比率を変更する場合があります。

### 3 原則として、毎月、安定した収益分配を行なうことをめざします。

- ・インカム収益( 投資した資産から生じる利息・配当金・分配金収入など )に加え、キャピタル収益( 投資した資産自体の値上がり益 )を原資として、毎月の安定的な分配をめざします。
- ・したがって、基準価額が当初元本( 1万口当たり1万円 )を下回っている場合においても、分配を行なう場合があります
- ・毎月15日( 休業日の場合は翌営業日 )を決算日とします。

\*なお、分配金額は収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により分配を行なわない場合もあります。



上記の図はイメージであり、将来の分配金の支払いをお約束するものではありません。

< 分配金再投資コース > の場合、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。

# 運用の内容について

## 投資方針

### 投資方針

- ・主として、以下に掲げる各投資信託証券に投資を行ない、安定した収益の確保と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。
- ・各マザーファンドへの投資比率は、原則として、信託財産の純資産総額の6分の1を基本としますが、資金動向やその見通しなどによっては5%から25%の範囲内で組入比率を変更する場合があります。

証券投資信託「日本リートインデックスJ-REITマザーファンド」

証券投資信託「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」

証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」

証券投資信託「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-KOKUSA(ヘッジなし)マザーファンド」

- ・特に「日本リートインデックスJ-REITマザーファンド」や「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」においては、投資対象としている資産の流動性が他のマザーファンドと比べて相対的に低い場合、資金の流出入に備える場合や純資産規模が大きくなった場合などには両マザーファンドの組入比率をそれぞれ5%を下限として引き下げることがあります。両マザーファンドの組入比率を引き下げた場合には、現金の比率を高くする場合や他のマザーファンドの組入比率をそれぞれ25%を上限に引き上げる場合があります。
- また、組入比率はファンド全体として国内資産の実質組入比率と海外資産の実質組入比率が概ね50%程度ずつになるように決定します。
- ・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。

### 投資対象

投資信託証券(投資信託または外国投資信託の受益証券(振替投資信託受益権を含みます。))および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。)を主要投資対象とします。

その他の投資対象に関しましては「約款」をご覧ください。

## 投資対象とする投資信託証券の概要

## 日本リートインデックスJ - REITマザーファンド

## 運用の基本方針

|        |  |
|--------|--|
| 基本方針   | わが国の金融商品取引所に上場する不動産投信( 社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。)の投資信託証券( 以下「不動産投資信託証券」といいます。)に投資を行ない、東証REIT指数( 配当込み ) <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果を目標と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に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。  |
| 投資方針   | <ul style="list-style-type: none"> <li>・主として、東京証券取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、東証REIT指数( 配当込み )の動きに連動した投資成果をめざします。</li> <li>・不動産投資信託証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。</li> <li>・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。</li> </ul>   |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> <li>・投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。</li> <li>・有価証券先物取引等の派生商品取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。</li> <li>・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・同一銘柄の投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証REIT指数( 配当込み )における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、当該不動産投資信託証券への投資を東証REIT指数( 配当込み )における構成割合の範囲内で行なうことができるものとします。</li> <li>・外貨建資産への投資は行ないません。</li> </ul> |
| 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 | 組入る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。<br>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 | 日興シティ信託銀行株式会社          |
| 信託期間 | 無期限( 平成17年6月30日設定 )    |
| 決算日  | 毎年6月15日( 休業日の場合は翌営業日 ) |

<sup>\*</sup>東証REIT指数( 配当込み )は、株式会社東京証券取引所が発表している、東京証券取引所に上場しているJ - REIT全銘柄に投資した場合の投資成果( 市場における価格の変動と分配金の受取りを合わせた投資成果 )を表す指数です。東京証券取引所に上場しているJ - REIT全銘柄の時価総額加重平均を2003年3月31日を1,000として指数化したものです。  
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社東京証券取引所に帰属します。また、株式会社東京証券取引所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。

# 運用の内容について

## 海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド

### 運用の基本方針

|        |  |
|--------|--|
| 基本方針   | 世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投信( 社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。)の投資信託証券( 以下「不動産投資信託証券」といいます。)に投資を行ない、S&Pシティグループ・グローバル・リート・インデックス( 除く日本、ヘッジなし・円ベース ) <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果を目標と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に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。  |
| 投資方針   | <ul style="list-style-type: none"> <li>・主として、日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、S&amp;Pシティグループ・グローバル・リート・インデックス( 除く日本、ヘッジなし・円ベース )の動きに連動した投資成果をめざします。</li> <li>・不動産投資信託証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。</li> <li>・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は行ないません。</li> <li>・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。</li> </ul>  |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> <li>・投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。</li> <li>・有価証券先物取引等の派生商品取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。</li> <li>・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・同一銘柄の投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、S&amp;Pシティグループ・グローバル・リート・インデックス( 除く日本、ヘッジなし・円ベース )における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、当該不動産投資信託証券への投資をS&amp;Pシティグループ・グローバル・リート・インデックス( 除く日本、ヘッジなし・円ベース )における構成割合の範囲内で行なうことができるものとします。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> </ul> |
| 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。<br>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 | 日興シティ信託銀行株式会社          |
| 信託期間 | 無期限( 平成17年6月30日設定 )    |
| 決算日  | 毎年6月15日( 休業日の場合は翌営業日 ) |

<sup>\*</sup>S&Pシティグループ・グローバル・リート・インデックス( 除く日本 )は、スタンダード&プアーズ社( S&P社 )が発表している、日本を除く世界の主要国の不動産投信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S&P社に帰属します。また、S&P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。



## 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) <sup>*</sup> 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"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul> |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への投資は行ないません。</li> <li>・外貨建資産への投資は行ないません。</li> </ul>  |
| 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 | 組入の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。<br>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 | 日興シティ信託銀行株式会社         |
| 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、格付機関から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日興コーディアル証券株式会社に帰属します。また、日興コーディアル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。

# 運用の内容について

## 海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド

### 運用の基本方針

|        |  |
|--------|--|
| 基本方針   | 世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。  |
| 主な投資対象 | 内外の公社債を主要投資対象とします。   |
| 投資方針   | <ul style="list-style-type: none"> <li>・主として世界各国の債券に投資し、シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul> |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への投資は行ないません。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>  |
| 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。<br>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 | 日興シティ信託銀行株式会社         |
| 信託期間 | 無期限(平成10年10月30日設定)    |
| 決算日  | 毎年10月26日(休業日の場合は翌営業日) |

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

## 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

## 運用の基本方針

|        |  |
|--------|--|
| 基本方針   | わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX(東証株価指数)*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。  |
| 主な投資対象 | わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。  |
| 投資方針   | <ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul> |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・外貨建資産への投資は行ないません。</li> </ul>   |
| 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。<br>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 | 日興シティ信託銀行株式会社         |
| 信託期間 | 無期限(平成11年10月29日設定)    |
| 決算日  | 毎年10月26日(休業日の場合は翌営業日) |

\*TOPIX(東証株価指数)は、東京証券取引所第一部に上場されている普通株式全銘柄(算出対象除外後の整理ポスト割当銘柄および算出対象組入前の新規上場銘柄を除きます。)の浮動株調整後の時価総額を指数化したもので、市場全体の動向を反映するものです。TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

# 運用の内容について

## 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) <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。  |
| 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"> <li>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いません。</li> <li>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。</li> <li>外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行いません。</li> <li>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。</li> </ul> |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>  |
| 収益分配   | 収益分配は行いません。  |

### 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。<br>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 | 日興シティ信託銀行株式会社           |
| 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 ) |

<sup>\*</sup>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。



## 分配方針

### 収益分配方針

第1計算期から第3計算期までは、収益分配を行いません。第4計算期以降、毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

- 1) 分配対象額の範囲  
経費控除後の利子・配当等収益および売買益(評価益を含みます。)などの全額とします。
- 2) 分配対象額についての分配方針  
分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。
- 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(無分配期の利益を含みます。)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せん。

### 収益分配金の支払い

#### < 分配金再投資コース >

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

#### < 分配金受取りコース >

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

## 投資制限

### 約款に定める投資制限

- 1) 投資信託証券、短期社債等(社振法第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。)、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
- 2) 有価証券先物取引等の派生商品取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。
- 3) 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
- 4) 同一銘柄の投資信託証券への実質投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の50%以下とします。ただし、不動産投信(社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。)の投資信託証券については、同一銘柄への実質投資割合を、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- 5) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

その他の投資制限に関しましては「約款」をご覧ください。

# 運用の内容について

## ファンドのリスク

### ファンドのリスク

- ・当ファンド(マザーファンドを含みます。)は、主に投資信託証券に投資を行ない、投資対象とする投資信託証券は、主に不動産、債券および株式など値動きのある資産(外貨建資産は為替変動リスクもあります。)を投資対象としているため、基準価額は変動します。したがって、元金を割り込むことがあります。
- ・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。
- ・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。取得申込者は、ファンドの投資目的およびリスク要因を十分に認識することが求められます。

投資対象とする投資信託証券の主なリスクは以下の通りです。

### 価格変動リスク

- ・一般に株式や不動産の価格は、国内および国外の経済・政治情勢などの影響を受け変動します。ファンドにおいては、株式や不動産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、その価格変動は、残存期間・発行条件などによりばらつきがあります。

### 流動性リスク

市場規模や取引量が少ない場合、組入銘柄を売却する際に市場実勢から期待される価格で売却できず、不測の損失を被るリスクがあります。

### 信用リスク

- ・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・不動産投信が支払不能や債務超過の状態になった場合、またはそうなることが予想される場合、大きな損失を被る可能性があります。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。

**不動産投信への投資に伴うリスク**

不動産投信は、不動産を運用対象とする商品で、かつ、市場で取引されますので、不動産を取り巻く環境、不動産市況や金利動向、マクロ経済の変化など様々な要因で分配金や価格は影響を受けます。主なリスクは以下の通りです。

- ・不動産の価格は、不動産市況、社会情勢その他の要因を理由として変動します。さらに不動産の流動性は一般に低く、望ましい時期に売却することができない可能性、売却価格が下落する可能性があります。元本が保証された商品ではありません。
- ・不動産投信は、一般の法人と同様に倒産のリスクがあります。法的倒産手続きを開始した場合、本投資証券の価格が著しく下落し、無価値になることも予想されます。
- ・不動産について、火災、爆発、水災その他の事故について、火災保険などの保険契約で支払われる上限額を上回る損害が発生した場合には、著しい悪影響を受ける可能性があります。
- ・地震、噴火、津波などの災害により不動産が滅失、劣化または毀損し、その価格が影響を受ける可能性があります。
- ・不動産からの収入が減少する可能性や、不動産に関する費用は増大する可能性があり、分配金額が悪影響を受けることがあります。
- ・収益は、不動産の賃料収入に依存しています。賃料収入は、不動産の稼働率の低下、賃料水準の低下、テナントによる賃料の支払債務の不履行・遅延などにより減少する可能性があります。
- ・退去するテナントへの敷金・保証金の返還、多額の資本的支出、未稼働不動産の取得などは、分配金額に悪影響を及ぼす可能性があります。
- ・金融商品取引所が定める基準に抵触し、上場廃止になった場合には、取引が著しく困難になる可能性があります。

## その他の留意事項

## ● システムリスク・市場リスクなどに関する事項

証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により閉鎖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。また、一時的に取得・換金ができなくなることもあります。

## ● 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証券を大量に売却することがあります。その際に基準価額が大きく変動する可能性があります。

## ● 法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

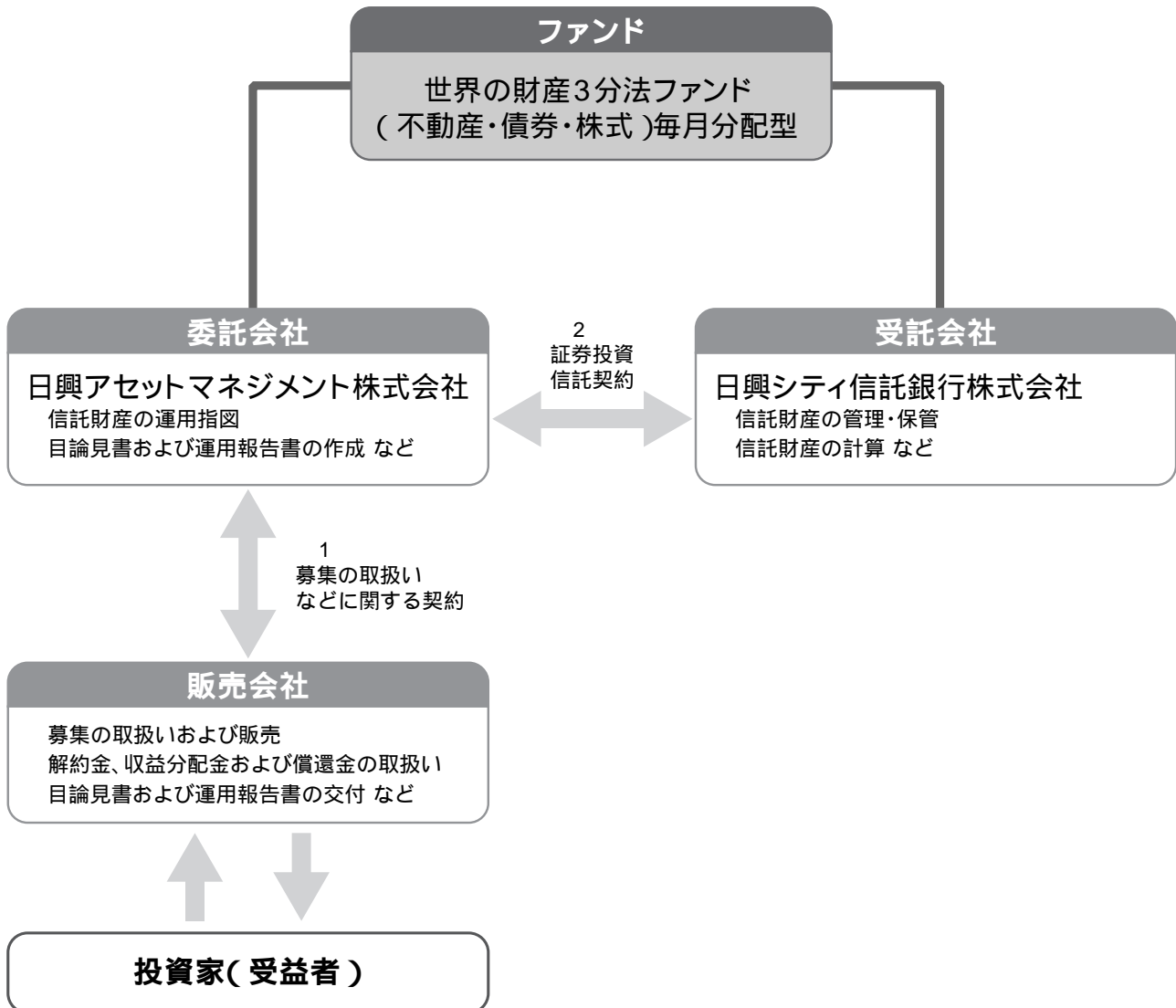
ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

ファンドが投資対象とする投資信託証券は、これらの影響を受けて価格が変動しますので、ファンド自身にもこれらのリスクがあります。

# 運用の内容について

## ファンドの仕組み・体制

### ファンドの仕組み



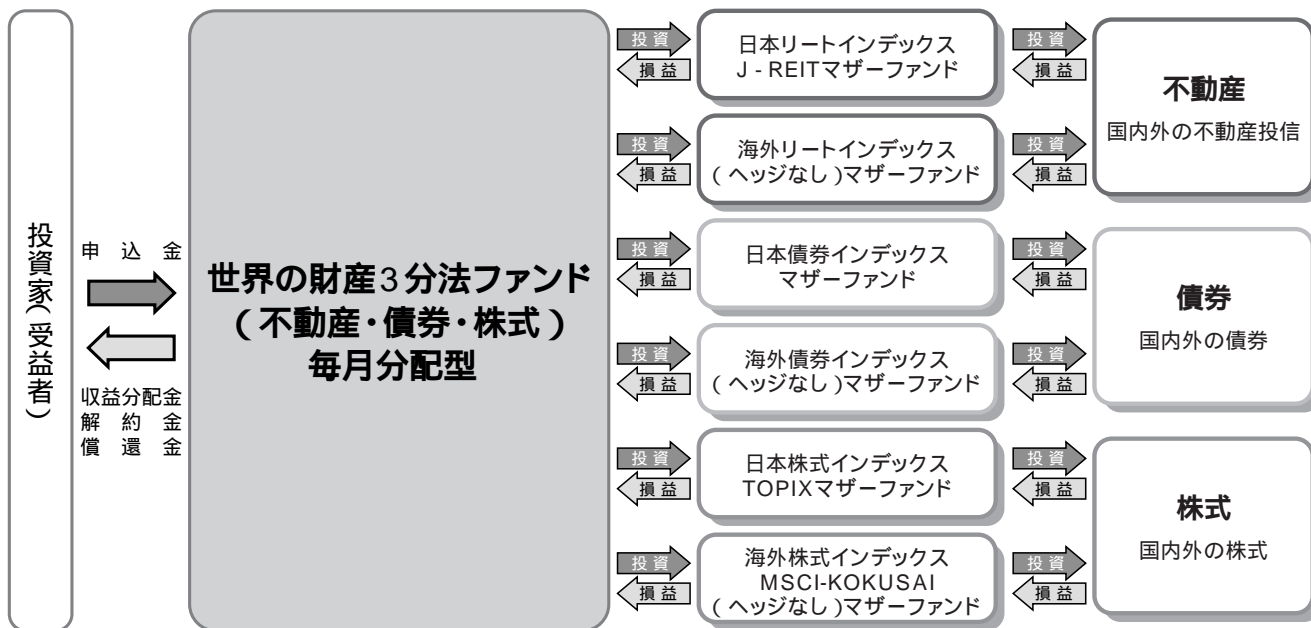
1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものです。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。

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です。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。



## ファンド・オブ・ファンズの仕組み

当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。

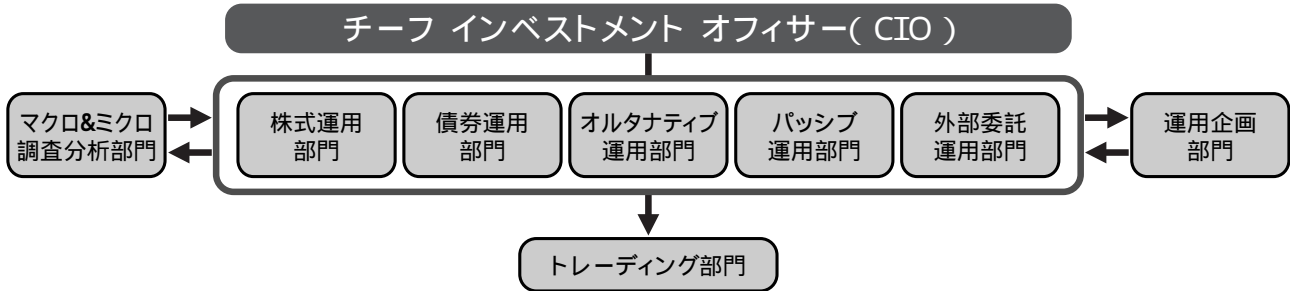


# 運用の内容について

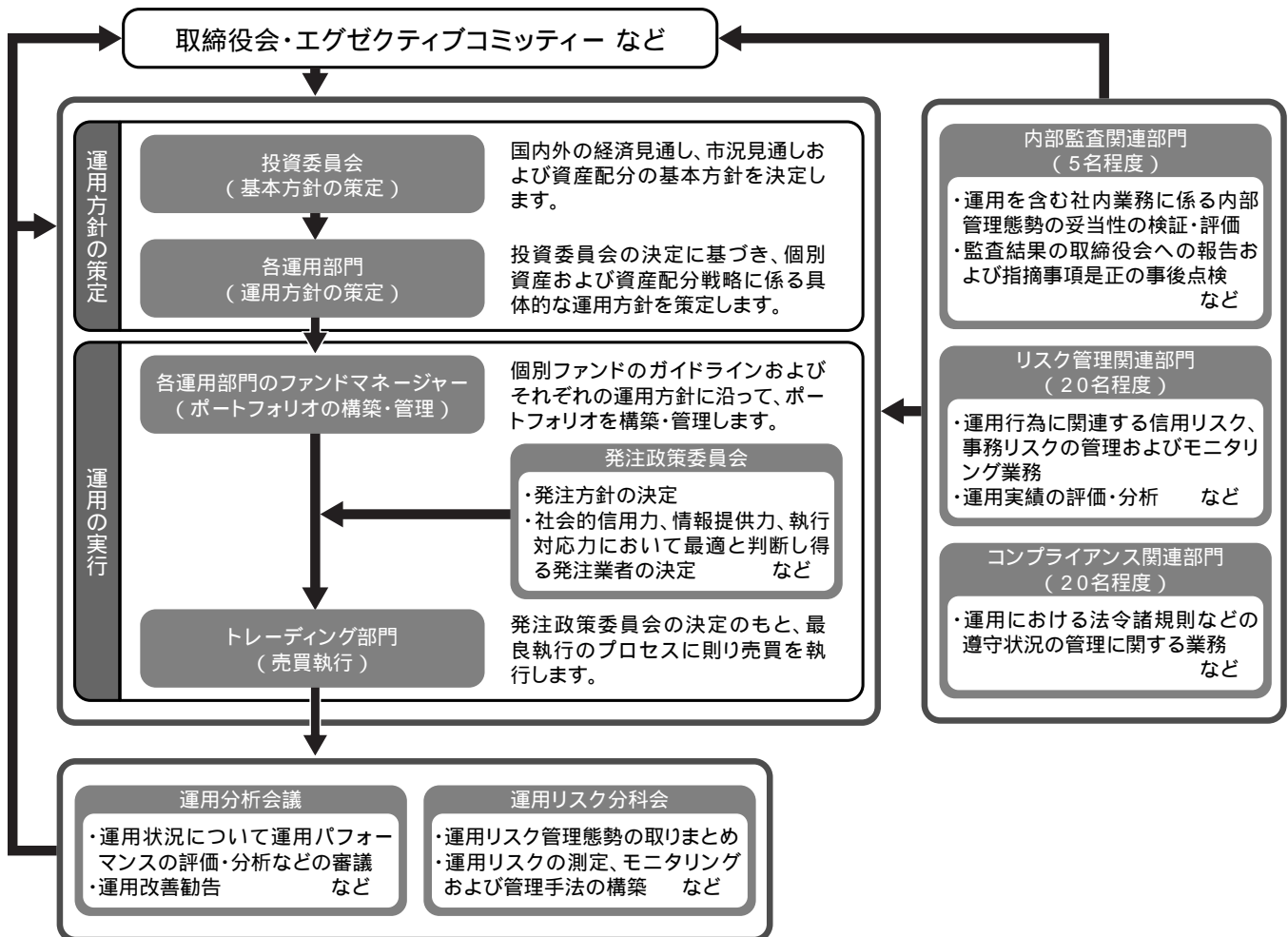
## 運用体制・リスク管理体制

### 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。



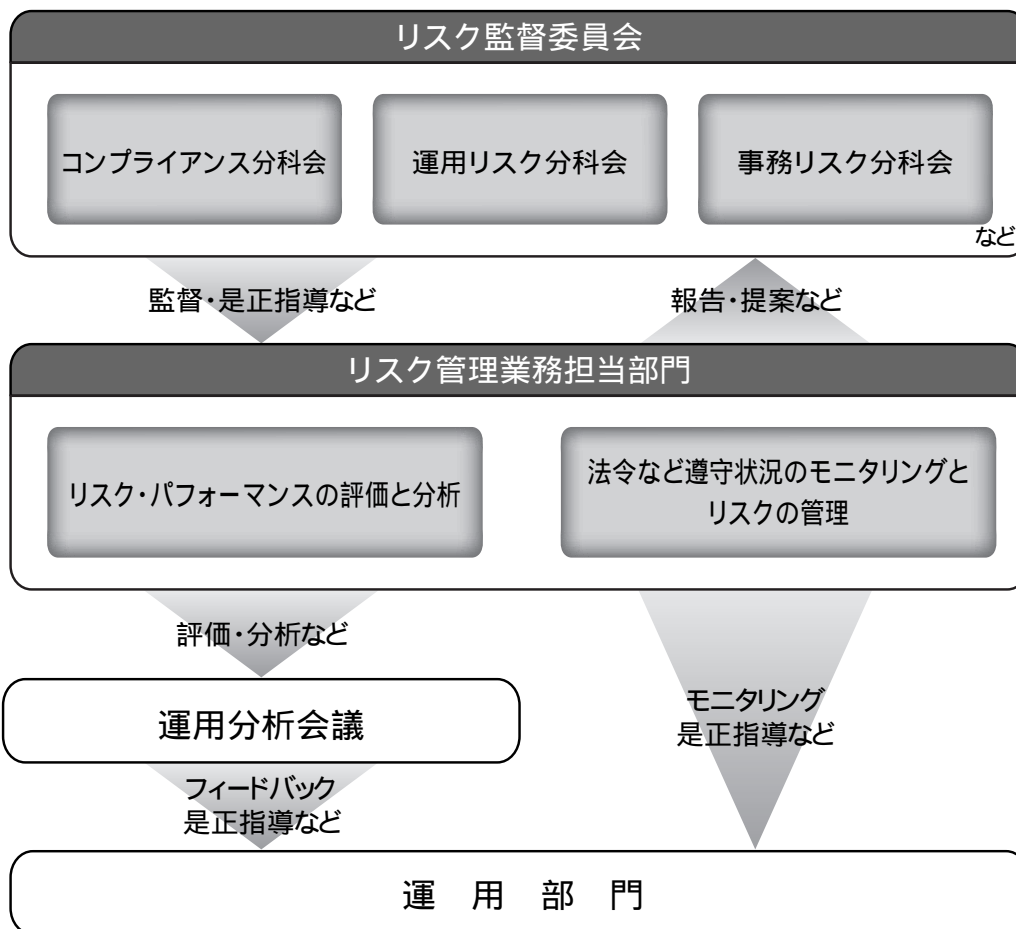
運用の内容

### 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、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっております。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なっており、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20年3月14日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 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マネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況およびリスク管理状況については、リスクマネジメント部が事務局を務めるリスク監督委員会、およびその分科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分科会においては、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と分析

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を運用分析会議に報告し、問題点については運用部門に原因の究明と是正指導を行ないます。

## 法令など遵守状況のモニタリングとリスクの管理

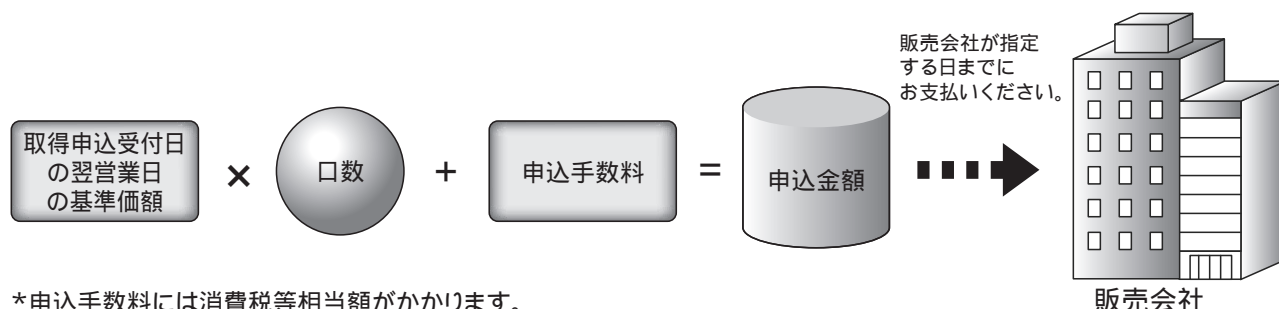
法令・諸規則、信託約款などの遵守状況とリスク管理状況のモニタリングを行ないます。その結果については運用リスク分科会などで報告し運用部門に是正指導を行なうなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は平成20年3月14日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

# 手続きと費用について

## 取得申込み手続き

< 申込みについて(イメージ図) >



\*申込手数料には消費税等相当額がかかります。

| 申込みの方法など |   |
|----------|---|
| 申込方法     | 販売会社所定の方法でお申し込みください。  |
| コースの選択   | 収益分配金の受取方法によって、< 分配金再投資コース > と < 分配金受取りコース > の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。<br>分配金再投資コース…収益分配金を自動的に再投資するコースです。なお、販売会社によっては、収益分配金を定期的に受け取るための「定期引出契約」を結ぶことができる場合があります。<br>分配金受取りコース…収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。 |
| 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。  |
| 申込みの時間など |   |
| 申込みの受付   | 販売会社の営業日に受け付けます。  |
| 取扱時間     | 原則として、午後3時(わが国の金融商品取引所が半休日となる場合は午前11時)までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。  |
| 取得申込不可日  | 販売会社の営業日であっても、取得申込日がニューヨーク証券取引所の休業日またはニューヨークの銀行休業日に該当する場合は、取得の申込みの受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。   |
| 申込期間     | 平成19年9月15日から平成20年9月12日までとします。<br>・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。   |



| 申込みの金額など   |  |
|------------|--|
| 申込価額       | <p>取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。</p> <p>・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。</p>  |
| 申込手数料      | <p>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。</p> <p>・販売会社における申込手数料率は3.15%(税抜3%)が上限となっております。</p> <p>・申込手数料の額(1口当たり)は、申込価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。</p> <p>・&lt;分配金再投資コース&gt;の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。</p> <p>・償還乗換、乗換優遇に関わる手数料の取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。</p> |
| 申込金額       | <p>申込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。</p>  |
| 申込単位       | <p>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。</p>   |
| 申込代金の支払い   | <p>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。</p>   |
| その他        |  |
| 受付の中止および取消 | <p>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。</p> <p>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号口に規定する外国金融商品市場をいいます。</p>   |

# 手続きと費用について

## 換金手続き

### 解約請求による換金

< 換金(解約)について(イメージ図) >



#### 換金(解約)の時間など

|         |  |
|---------|--|
| 解約の受付   | 販売会社の営業日に受け付けます。   |
| 取扱時間    | 原則として、午後3時(わが国の金融商品取引所が半休日となる場合は午前11時)までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。 |
| 解約請求不可日 | 販売会社の営業日であっても、解約請求日がニューヨーク証券取引所の休業日またはニューヨークの銀行休業日に該当する場合は、解約請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。        |
| 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。         |

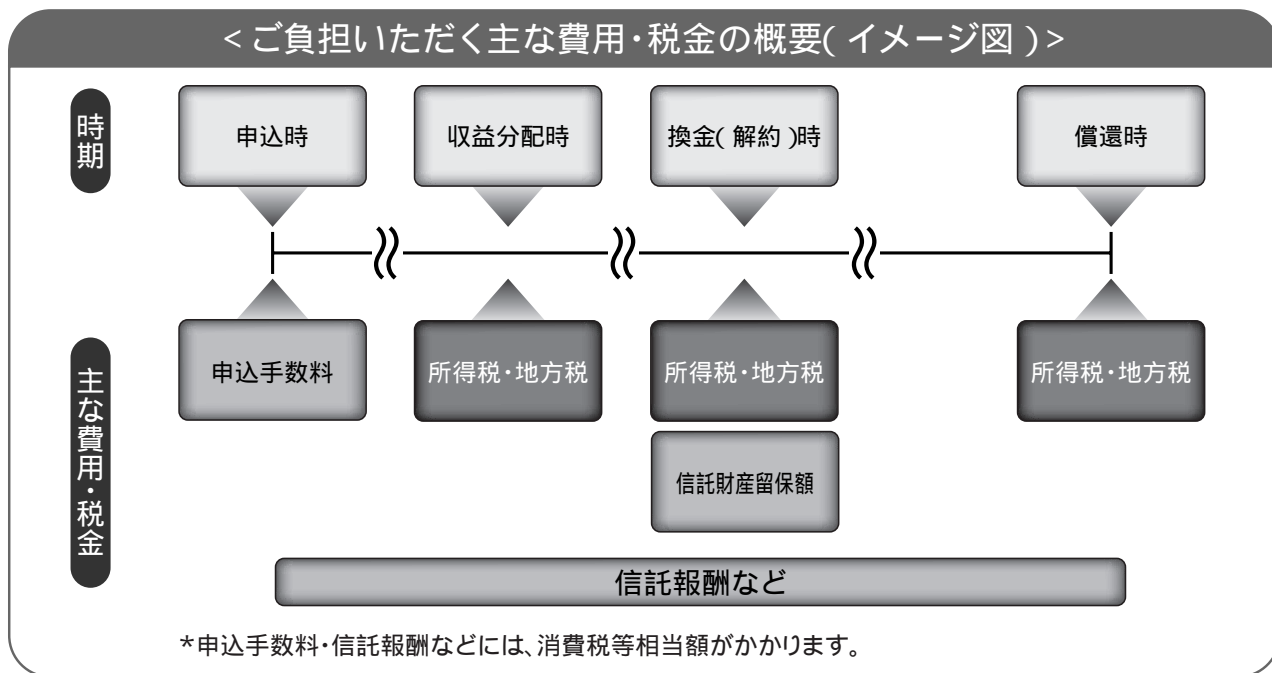
#### 換金(解約)の金額など

|          |   |
|----------|---|
| 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を控除した価額とします。<br>・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。  |
| 解約手数料    | ありません。  |
| 信託財産留保額  | 解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.2%の率を乗じて得た額(1口当たり)  |
| 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(当該解約価額が受益者毎の個別元本を超過した額に対し10%(内国法人は所得税のみの7%))を差し引いた金額となります。<br>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、後述の「費用・税金」をご覧ください。 |
| 解約単位     | 1口単位<br>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。   |
| 解約代金の支払い | 手取額は、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。   |

#### その他

|            |  |
|------------|--|
| 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。 |
|------------|--|

## 費用・税金



## 申込時、収益分配時、換金(解約)時などにご負担いただく費用・税金

| 時期                | 項目                 | 費用・税金                |
|-------------------|--------------------|----------------------|
| 申込時               | 申込手数料<br>(1口当たり)   | 基準価額に対し3.15%(税抜3%)以内 |
| 収益分配時             | 所得税・地方税            | 普通分配金に対し10%*         |
| 換金(解約)時<br>(解約請求) | 換金(解約)手数料          | ありません。               |
|                   | 信託財産留保額<br>(1口当たり) | 基準価額に対し0.2%          |
|                   | 所得税・地方税            | 個別元本超過額に対し10%*       |
| 償還時               | 所得税・地方税            | 個別元本超過額に対し10%*       |

\*上記の税率は個人の場合であり、法人の場合は7%の源泉徴収となります。

申込手数料は販売会社が定めます。上記は販売会社が定めた手数料率のうち上限の率を記載しております。

<分配金再投資コース>の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。

買取請求に係る課税上の取扱いについては、後述の「課税上の取扱い」をご覧ください。

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、後述の「課税上の取扱い」をご覧ください。

# 手続きと費用について

## 信託財産で間接的にご負担いただく(ファンドから支払われる)費用・税金

| 時期                 | 項目  | 費用・税金   |                    |  |  |  |    |      |      |      |                    |                    |                    |                    |
|--------------------|---|---|--------------------|--|--|--|----|------|------|------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| 毎日                 | 信託報酬  | <p>純資産総額に対し年率0.9975%(税抜0.95%)</p> <p>この他に、投資対象とする「日本リートインデックスJ-REITマザーファンド」および「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」の主要投資対象である不動産投信には運用などに係る費用がかかりますが、投資する不動産投信の銘柄は固定されていないため、事前に料率、上限額などを表示することができません。</p> <p>・信託報酬の配分は、以下の通りとします。</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th colspan="4">信託報酬率(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>0.9975%<br/>(0.95%)</td> <td>0.4200%<br/>(0.40%)</td> <td>0.5250%<br/>(0.50%)</td> <td>0.0525%<br/>(0.05%)</td> </tr> </tbody> </table> <p>括弧内は税抜です。</p> <p>・信託報酬(信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。)は、毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。</p> | 信託報酬率(年率)          |  |  |  | 合計 | 委託会社 | 販売会社 | 受託会社 | 0.9975%<br>(0.95%) | 0.4200%<br>(0.40%) | 0.5250%<br>(0.50%) | 0.0525%<br>(0.05%) |
|                    | 信託報酬率(年率)   |   |                    |  |  |  |    |      |      |      |                    |                    |                    |                    |
| 合計                 | 委託会社  | 販売会社  | 受託会社               |  |  |  |    |      |      |      |                    |                    |                    |                    |
| 0.9975%<br>(0.95%) | 0.4200%<br>(0.40%)  | 0.5250%<br>(0.50%)  | 0.0525%<br>(0.05%) |  |  |  |    |      |      |      |                    |                    |                    |                    |
| その他諸費用             | <p>純資産総額に対し年率0.1%以内</p> <p>・詳しくは、後述の「その他の費用などについて」をご覧ください。</p>                                  |   |                    |  |  |  |    |      |      |      |                    |                    |                    |                    |
| 随時                 | <p>売買委託手数料など</p> <p>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</p> <p>・詳しくは、後述の「その他の費用などについて」をご覧ください。</p> |   |                    |  |  |  |    |      |      |      |                    |                    |                    |                    |

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。



## その他の費用などについて

## &lt; その他諸費用 &gt;

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

- 1 ) やむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合における発行および管理事務に係る費用。
- 2 ) 有価証券届出書、有価証券報告書および臨時報告書(これらの訂正に係る書類を含みます。)の作成、印刷および提出に係る費用。
- 3 ) 目論見書および仮目論見書(これらの訂正事項分を含みます。)の作成、印刷および交付に係る費用(これらを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。)
- 4 ) 信託約款の作成、印刷および交付に係る費用(これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。)
- 5 ) 運用報告書の作成、印刷および交付に係る費用(これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。)
- 6 ) この信託の受益者に対して行なう公告に係る費用ならびに信託約款の変更または信託契約の解約に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用。
- 7 ) 格付の取得に要する費用。
- 8 ) ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。

## &lt; 売買委託手数料など &gt;

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

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。

# 手続きと費用について

## 課税上の取扱い

### 個人受益者の場合

#### 1) 収益分配金、解約金、償還金の取扱い

- ・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、軽減税率が適用され、10%(所得税7%および地方税3%)の税率による源泉徴収(申告不要)となります。なお、確定申告を行ない、総合課税(配当控除の適用なし)を選択することもできます。
- ・解約時および償還時に損失が生じた時には、確定申告を行なうことで、株式等の譲渡益との損益通算が可能です。なお、その年に控除しきれない金額は、翌年以降3年間にわたり繰越控除ができます。

上記の10%(所得税7%および地方税3%)の税率は、平成21年4月1日以降は20%(所得税15%および地方税5%)の税率となる予定です。

#### 2) 買取請求の取扱い

- ・買取請求した場合の譲渡益は、譲渡所得等とみなされ、譲渡益に対し10%(所得税7%および地方税3%)の申告分離課税の対象となり、確定申告を行なうことが必要です。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・譲渡損益は、確定申告を行なうことで、株式等の譲渡損益との損益通算が可能となります。なお、その年に控除しきれない譲渡損失は、翌年以降3年間にわたり繰越控除ができます。

上記の10%(所得税7%および地方税3%)の税率は、平成21年1月1日以降は20%(所得税15%および地方税5%)の税率となる予定です。

### 法人受益者の場合

#### 1) 収益分配金、解約金、償還金の取扱い

- ・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、軽減税率が適用され、7%(所得税のみ)の税率による源泉徴収となります。
- ・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。

上記の7%(所得税のみ)の税率は、平成21年4月1日以降は15%(所得税のみ)の税率となる予定です。

#### 2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

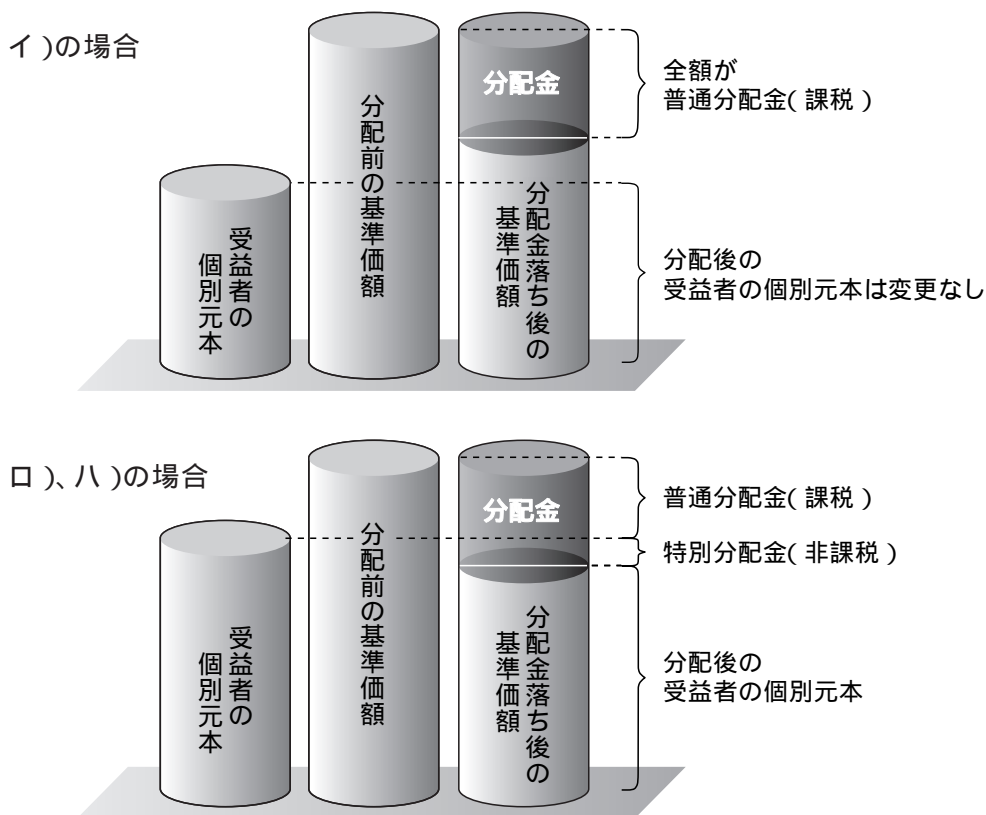
### 個別元本

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

## 普通分配金と特別分配金

- 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「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特別分配金となり、収益分配金から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、その個別元本から特別分配金を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

## &lt; 分配金に関するイメージ図 &gt;



税法が改正された場合などには、上記の内容が変更になる場合があります。

# 運営方法について

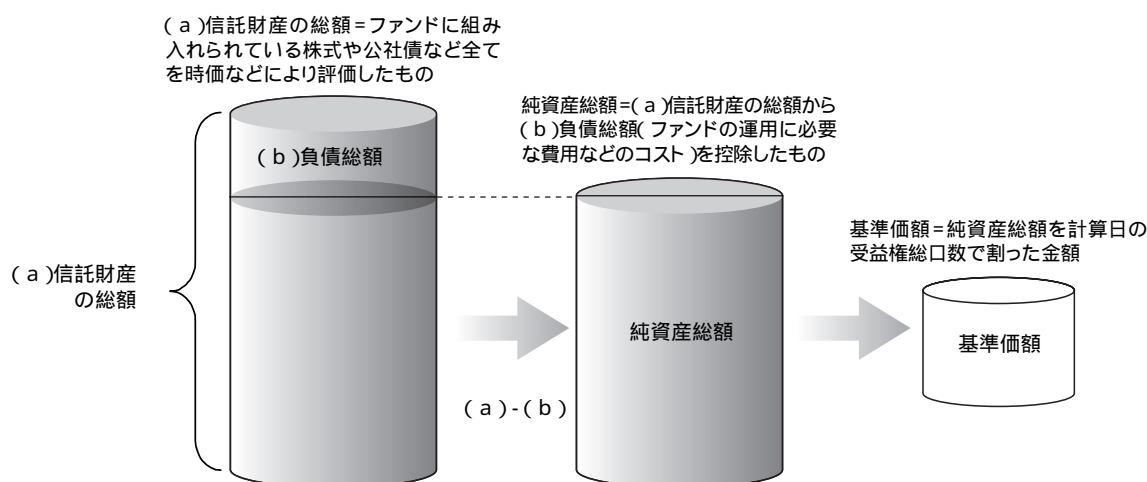
## 管理および運営

### 基準価額

#### 基準価額の算出

- ・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。
- ・基準価額とは、信託財産に属する資産を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額(純資産総額)を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは1万口当りに換算した価額で表示することがあります。

< 基準価額算出の流れ >



#### 有価証券などの評価基準

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

< 主な資産の評価方法 >

|             |                           |
|-------------|---------------------------|
| 投資信託証券(国内籍) | 原則として、基準価額計算日の基準価額で評価します。 |
|-------------|---------------------------|

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

### 償還

#### 信託期間

無期限とします(平成17年9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。

### 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10億口を下回る事となった場合
  - 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、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときなどには、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。
- 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。

### 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。

### 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いません。
- 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べるすることができます。( 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。

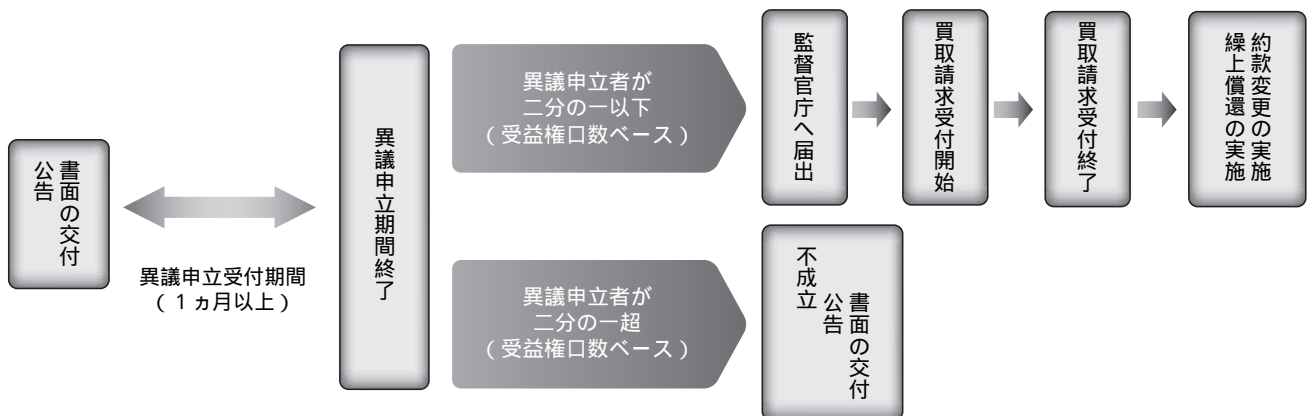


# 運営方法について

## 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きは、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 >



## 公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

## その他

### 国内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。
- ・格付は取得してありません。

ファンドの受益権は、社債等の振替に関する法律(政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。)の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「振替機関に関する事項」に記載の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります(振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。)。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。

## 発行(売出)価額の総額

5兆円を上限とします。

## 払込期日および払込取扱場所

- ・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經由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

## 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。

## 信託金限度額

- ・30兆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。

## 計算期間

毎月16日から翌月15日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とします。

## 委託会社の概況(平成20年1月末現在)

- 1)名称  
日興アセットマネジメント株式会社
- 2)代表者の役職氏名  
取締役社長 ビリー・ウェード・ワイルダー
- 3)本店の所在の場所  
東京都港区赤坂九丁目7番1号
- 4)資本金  
16,287百万円
- 5)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
- 6)大株主の状況

| 名称               | 住所                | 所有株数         | 所有比率   |
|------------------|-------------------|--------------|--------|
| 株式会社日興コーディアルグループ | 東京都中央区日本橋兜町6番5号   | 112,842,500株 | 61.31% |
| NAMホールディングス株式会社  | 東京都千代田区丸の内二丁目7番3号 | 69,170,000株  | 37.58% |

# 運営方法について

## 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。

- ・収益分配金・償還金受領権
- ・解約請求権
- ・帳簿閲覧権

## 内国投資信託受益証券事務の概要

### 名義書換

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

### 受益者に対する特典

該当事項はありません。

### 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

#### 受益権の譲渡

- ・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等(当該他の振替機関等の上位機関を含みます。)に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行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。

#### 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。

### 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。

### 受益権の再分割

委託会社は、受益権の再分割を行ないません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託会社と協議のうえ、同法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。

### 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。

### ファンドの詳細情報の項目

有価証券届出書「第三部 ファンドの詳細情報」(投資信託説明書(請求目論見書))の記載項目は以下の通りです。

#### 第1 ファンドの沿革

#### 第2 手続等

- 1 申込(販売)手続等
- 2 換金(解約)手続等

#### 第3 管理及び運営

- 1 資産管理等の概要
  - (1)資産の評価
  - (2)保管
  - (3)信託期間
  - (4)計算期間
  - (5)その他
- 2 受益者の権利等

#### 第4 ファンドの経理状況

- 1 財務諸表
  - (1)貸借対照表
  - (2)損益及び剰余金計算書
  - (3)注記表
  - (4)附属明細表
- 2 ファンドの現況
  - 純資産額計算書

#### 第5 設定及び解約の実績

上記の情報については、EDINET(エディネット)でもご覧いただくことができます。

Electronic Disclosure for Investors' NETworkの略で、「金融商品取引法に基づく有価証券報告書等の開示書類に関する電子開示システム」の愛称です。投資家はEDINETを利用することにより、インターネットを通じてファンドの有価証券届出書や有価証券報告書などを閲覧することができます。

# 運用の状況について

## ファンドの運用状況

以下の運用状況は平成 19 年 12 月 28 日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### (1) 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(千円)      | 投資比率(%) |
|-----------------------|-------------|---------|
| 親投資信託受益証券             | 163,002,782 | 98.72   |
| 日本                    | 163,002,782 | 98.72   |
| コール・ローン等、その他資産(負債控除後) | 2,115,832   | 1.28    |
| 純資産総額                 | 165,118,614 | 100.00  |

### (2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

#### イ 評価額上位銘柄明細

##### < 親投資信託受益証券 >

| 通貨<br>国・地域 | 種類<br>業種           | 銘柄名  | 利率(%)<br>償還期限 | 数量又は<br>券面総額   | 簿価単価(円)<br>評価単価(円) | 簿価額(円)<br>評価額(円)                 | 投資比率<br>(%) |
|------------|--------------------|--|---------------|----------------|--------------------|----------------------------------|-------------|
| 日本円<br>日本  | 親投資信託<br>受益証券<br>- | 日本債券インデックスマザー<br>ファンド                        | -<br>-        | 24,987,565,446 | 1.1225<br>1.1259   | 28,048,542,213<br>28,133,499,935 | 17.04       |
| 日本円<br>日本  | 親投資信託<br>受益証券<br>- | 海外債券インデックス(ヘッジ<br>なし)マザーファンド                 | -<br>-        | 15,732,343,312 | 1.7560<br>1.7845   | 27,625,994,855<br>28,074,366,640 | 17.00       |
| 日本円<br>日本  | 親投資信託<br>受益証券<br>- | 日本リートインデックスJ-R<br>EITマザーファンド                 | -<br>-        | 21,523,478,059 | 1.2324<br>1.2710   | 26,525,535,011<br>27,356,340,612 | 16.57       |
| 日本円<br>日本  | 親投資信託<br>受益証券<br>- | 海外株式インデックスMSCI-<br>KOKUSAI(ヘッジなし)マザー<br>ファンド | -<br>-        | 18,989,986,668 | 1.4151<br>1.4368   | 26,872,707,521<br>27,284,812,844 | 16.52       |
| 日本円<br>日本  | 親投資信託<br>受益証券<br>- | 日本株式インデックスTOP I<br>Xマザーファンド                  | -<br>-        | 24,862,535,521 | 1.0522<br>1.0553   | 26,161,240,985<br>26,237,433,735 | 15.89       |
| 日本円<br>日本  | 親投資信託<br>受益証券<br>- | 海外リートインデックス(ヘッ<br>ジなし)マザーファンド                | -<br>-        | 20,324,938,189 | 1.2737<br>1.2751   | 25,888,651,373<br>25,916,328,684 | 15.70       |

#### ロ 種類別及び業種別の投資比率

| 種類別及び業種別  | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 98.72   |
| 合計        | 98.72   |

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。



## (3) 運用実績

## 純資産の推移

| 期別                    | 1口当たりの純資産額(円) |        | 純資産総額(百万円) |         |
|-----------------------|---------------|--------|------------|---------|
|                       | 分配落ち          | 分配付き   | 分配落ち       | 分配付き    |
| 設 定 時 (2005年9月29日)    | 1.0000        | 1.0000 | 1          | 1       |
| 第1特定期間末 (2005年12月15日) | 1.0510        | 1.0510 | 1          | 1       |
| 第2特定期間末 (2006年6月15日)  | 1.0370        | 1.0550 | 1          | 1       |
| 第3特定期間末 (2006年12月15日) | 1.1544        | 1.1884 | 37,382     | 37,885  |
| 第4特定期間末 (2007年6月15日)  | 1.2070        | 1.2480 | 128,203    | 131,221 |
| 第5特定期間末 (2007年12月17日) | 1.0419        | 1.0839 | 162,250    | 168,241 |

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

|            | 1口当たりの純資産額(円) | 純資産総額(百万円) |
|------------|---------------|------------|
| 2006年12月末日 | 1.1682        | 46,251     |
| 2007年1月末日  | 1.2105        | 61,304     |
| 2007年2月末日  | 1.2057        | 74,415     |
| 2007年3月末日  | 1.2053        | 89,111     |
| 2007年4月末日  | 1.2268        | 103,967    |
| 2007年5月末日  | 1.2396        | 122,753    |
| 2007年6月末日  | 1.2021        | 137,193    |
| 2007年7月末日  | 1.1386        | 147,299    |
| 2007年8月末日  | 1.1073        | 156,316    |
| 2007年9月末日  | 1.1316        | 166,936    |
| 2007年10月末日 | 1.1234        | 170,367    |
| 2007年11月末日 | 1.0581        | 163,505    |
| 2007年12月末日 | 1.0536        | 165,118    |

## 分配の推移

|                                 | 1口当たり税込み分配金(円) |
|---------------------------------|----------------|
| 第1特定期間 (2005年9月29日～2005年12月15日) | 0              |
| 第2特定期間 (2005年12月16日～2006年6月15日) | 0.0180         |
| 第3特定期間 (2006年6月16日～2006年12月15日) | 0.0340         |
| 第4特定期間 (2006年12月16日～2007年6月15日) | 0.0410         |
| 第5特定期間 (2007年6月16日～2007年12月17日) | 0.0420         |

## 収益率の推移

|                                 | 収益率(%) |
|---------------------------------|--------|
| 第1特定期間 (2005年9月29日～2005年12月15日) | 5.10   |
| 第2特定期間 (2005年12月16日～2006年6月15日) | 0.38   |
| 第3特定期間 (2006年6月16日～2006年12月15日) | 14.60  |
| 第4特定期間 (2006年12月16日～2007年6月15日) | 8.11   |
| 第5特定期間 (2007年6月16日～2007年12月17日) | 10.20  |

(注) 各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額(分配付の額)から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額(分配落ちの額。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。

# 運用の状況について

(参考) 日本リートインデックスJ - REITマザーファンド

以下の運用状況は平成 19 年 12 月 28 日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1) 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(千円)     | 投資比率(%) |
|-----------------------|------------|---------|
| 投資証券                  | 28,319,550 | 98.36   |
| 日本                    | 28,319,550 | 98.36   |
| コール・ローン等、その他資産(負債控除後) | 471,160    | 1.64    |
| 純資産総額                 | 28,790,710 | 100.00  |

## (2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

### イ 評価額上位銘柄明細

#### < 投資証券 >

| 通貨<br>国・地域 | 種類<br>業種  | 銘柄名                    | 利率(%)<br>償還期限 | 数量又は<br>券面総額 | 簿価単価(円)<br>評価単価(円)     | 簿価額(円)<br>評価額(円)               | 投資比率<br>(%) |
|------------|-----------|------------------------|---------------|--------------|------------------------|--------------------------------|-------------|
| 日本円<br>日本  | 投資証券<br>- | 日本ビルファンド投資法人 投資証券      | -             | 2,811        | 1,660,236<br>1,570,000 | 4,666,923,250<br>4,413,270,000 | 15.33       |
| 日本円<br>日本  | 投資証券<br>- | ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券  | -             | 2,269        | 1,412,850<br>1,400,000 | 3,205,757,530<br>3,176,600,000 | 11.03       |
| 日本円<br>日本  | 投資証券<br>- | 日本リテールファンド投資法人 投資証券    | -             | 2,139        | 1,042,061<br>797,000   | 2,228,968,703<br>1,704,783,000 | 5.92        |
| 日本円<br>日本  | 投資証券<br>- | 野村不動産オフィスファンド投資法人 投資証券 | -             | 1,471        | 1,239,367<br>1,060,000 | 1,823,108,435<br>1,559,260,000 | 5.42        |
| 日本円<br>日本  | 投資証券<br>- | 日本プライムリアルティ投資法人 投資証券   | -             | 3,458        | 484,428<br>450,000     | 1,675,151,356<br>1,556,100,000 | 5.40        |
| 日本円<br>日本  | 投資証券<br>- | 森トラスト総合リート投資法人 投資証券    | -             | 885          | 1,340,441<br>1,200,000 | 1,186,289,870<br>1,062,000,000 | 3.69        |
| 日本円<br>日本  | 投資証券<br>- | オリックス不動産投資法人 投資証券      | -             | 1,392        | 918,652<br>735,000     | 1,278,763,312<br>1,023,120,000 | 3.55        |
| 日本円<br>日本  | 投資証券<br>- | 東急リアル・エステート投資法人 投資証券   | -             | 937          | 1,171,302<br>1,050,000 | 1,097,509,760<br>983,850,000   | 3.42        |
| 日本円<br>日本  | 投資証券<br>- | ケネディクス不動産投資法人 投資証券     | -             | 1,107        | 920,598<br>746,000     | 1,019,102,252<br>825,822,000   | 2.87        |
| 日本円<br>日本  | 投資証券<br>- | DAオフィス投資法人 投資証券        | -             | 1,134        | 829,245<br>724,000     | 940,363,412<br>821,016,000     | 2.85        |
| 日本円<br>日本  | 投資証券<br>- | ジャパンエクセレント投資法人 投資証券    | -             | 855          | 1,105,930<br>898,000   | 945,570,414<br>767,790,000     | 2.67        |
| 日本円<br>日本  | 投資証券<br>- | グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券   | -             | 536          | 1,462,455<br>1,370,000 | 783,875,638<br>734,320,000     | 2.55        |
| 日本円<br>日本  | 投資証券<br>- | 日本コマースリアル投資法人 投資証券     | -             | 1,424        | 564,341<br>499,000     | 803,621,723<br>710,576,000     | 2.47        |
| 日本円<br>日本  | 投資証券<br>- | 日本レジデンシャル投資法人 投資証券     | -             | 1,368        | 706,964<br>504,000     | 967,126,474<br>689,472,000     | 2.39        |
| 日本円<br>日本  | 投資証券<br>- | ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券   | -             | 884          | 878,291<br>752,000     | 776,409,307<br>664,768,000     | 2.31        |
| 日本円<br>日本  | 投資証券<br>- | 森ヒルズリート投資法人 投資証券       | -             | 718          | 1,192,330<br>770,000   | 856,093,059<br>552,860,000     | 1.92        |
| 日本円<br>日本  | 投資証券<br>- | 日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券 | -             | 677          | 1,125,438<br>808,000   | 761,921,613<br>547,016,000     | 1.90        |
| 日本円<br>日本  | 投資証券<br>- | MIDリート投資法人 投資証券        | -             | 1,016        | 610,106<br>523,000     | 619,867,257<br>531,368,000     | 1.85        |
| 日本円<br>日本  | 投資証券<br>- | フロンティア不動産投資法人 投資証券     | -             | 611          | 1,116,874<br>817,000   | 682,409,895<br>499,187,000     | 1.73        |
| 日本円<br>日本  | 投資証券<br>- | プレミア投資法人 投資証券          | -             | 727          | 902,128<br>685,000     | 655,846,823<br>497,995,000     | 1.73        |
| 日本円<br>日本  | 投資証券<br>- | トップリート投資法人 投資証券        | -             | 858          | 768,040<br>530,000     | 658,978,166<br>454,740,000     | 1.58        |

|           |           |                         |   |     |                      |                            |      |
|-----------|-----------|-------------------------|---|-----|----------------------|----------------------------|------|
| 日本円<br>日本 | 投資証券<br>- | 福岡リート投資法人 投資証券          | - | 592 | 1,068,234<br>760,000 | 632,394,494<br>449,920,000 | 1.56 |
| 日本円<br>日本 | 投資証券<br>- | ニューシティ・レジデンス投資法人 投資証券   | - | 908 | 649,281<br>459,000   | 589,547,529<br>416,772,000 | 1.45 |
| 日本円<br>日本 | 投資証券<br>- | 日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券 | - | 628 | 856,399<br>583,000   | 537,818,616<br>366,124,000 | 1.27 |
| 日本円<br>日本 | 投資証券<br>- | 阪急リート投資法人 投資証券          | - | 473 | 1,222,946<br>774,000 | 578,453,494<br>366,102,000 | 1.27 |
| 日本円<br>日本 | 投資証券<br>- | クリード・オフィス投資法人 投資証券      | - | 738 | 586,246<br>480,000   | 432,649,313<br>354,240,000 | 1.23 |
| 日本円<br>日本 | 投資証券<br>- | クレッシェンド投資法人 投資証券        | - | 601 | 677,383<br>426,000   | 407,107,255<br>256,026,000 | 0.89 |
| 日本円<br>日本 | 投資証券<br>- | イーアセット投資法人 投資証券         | - | 667 | 550,555<br>369,000   | 367,220,283<br>246,123,000 | 0.85 |
| 日本円<br>日本 | 投資証券<br>- | 野村不動産レジデンシャル投資法人 投資証券   | - | 377 | 847,101<br>641,000   | 319,357,091<br>241,657,000 | 0.84 |
| 日本円<br>日本 | 投資証券<br>- | ジョイント・リート投資法人 投資証券      | - | 579 | 526,492<br>372,000   | 304,838,919<br>215,388,000 | 0.75 |

#### □ 種類別及び業種別の投資比率

| 種類別及び業種別 | 投資比率 (%) |
|----------|----------|
| 投資証券     | 98.36    |
| 合計       | 98.36    |

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。

# 運用の状況について

(参考) 海外リートインデックス(ヘッジなし) マザーファンド

以下の運用状況は平成 19 年 12 月 28 日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。
- ・為替予約取引の金額は、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。

## (1) 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(千円)     | 投資比率(%) |
|-----------------------|------------|---------|
| 投資証券                  | 27,031,455 | 98.86   |
| アメリカ                  | 14,614,546 | 53.45   |
| オーストラリア               | 5,461,738  | 19.97   |
| イギリス                  | 2,645,715  | 9.68    |
| フランス                  | 1,814,928  | 6.64    |
| オランダ                  | 622,584    | 2.28    |
| カナダ                   | 590,782    | 2.16    |
| シンガポール                | 557,905    | 2.04    |
| 香港                    | 356,184    | 1.30    |
| ベルギー                  | 219,672    | 0.80    |
| ニュージーランド              | 115,555    | 0.42    |
| ドイツ                   | 19,095     | 0.07    |
| ギリシャ                  | 12,746     | 0.05    |
| 為替予約取引(買建)            | (173,848)  | (0.64)  |
| コール・ローン等、その他資産(負債控除後) | 312,955    | 1.14    |
| 純資産総額                 | 27,344,411 | 100.00  |

## (2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

### イ 評価額上位銘柄明細

#### < 投資証券 >

| 通貨<br>国・地域      | 種類<br>業種 | 銘柄名                           | 利率(%)<br>償還期限 | 数量又は<br>券面総額 | 簿価単価(円)<br>評価単価(円) | 簿価額(円)<br>評価額(円) | 投資比率<br>(%) |
|-----------------|----------|-------------------------------|---------------|--------------|--------------------|------------------|-------------|
| オーストラリア<br>ドル   | 投資証券     | WESTFIELD GROUP               | -             | 929,932      | 2,070              | 1,924,733,497    | 7.20        |
| オーストラリア         | -        | -                             | -             | -            | 2,117              | 1,968,483,219    | -           |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 投資証券     | SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT | -             | 106,602      | 11,010             | 1,173,678,148    | 3.93        |
| アメリカ            | -        | -                             | -             | -            | 10,071             | 1,073,637,193    | -           |
| ユーロ<br>フランス     | 投資証券     | UNIBAIL-RODANCO               | -             | 39,142       | 31,486             | 1,232,425,188    | 3.50        |
| フランス            | -        | -                             | -             | -            | 24,434             | 956,396,513      | -           |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 投資証券     | PROLOGIS                      | -             | 123,434      | 6,981              | 861,750,823      | 3.18        |
| アメリカ            | -        | -                             | -             | -            | 7,041              | 869,070,651      | -           |
| イギリスポンド<br>イギリス | 投資証券     | LAND SECURITIES GROUP PLC     | -             | 222,393      | 4,062              | 903,327,711      | 2.75        |
| イギリス            | -        | -                             | -             | -            | 3,377              | 751,127,465      | -           |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 投資証券     | VORNADO REALTY TRUST          | -             | 63,849       | 12,712             | 811,648,660      | 2.32        |
| アメリカ            | -        | -                             | -             | -            | 9,937              | 634,452,030      | -           |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 投資証券     | BOSTON PROPERTIES INC         | -             | 57,110       | 12,004             | 685,574,600      | 2.22        |
| アメリカ            | -        | -                             | -             | -            | 10,624             | 606,733,242      | -           |
| オーストラリア<br>ドル   | 投資証券     | STOCKLAND                     | -             | 691,199      | 857                | 592,076,499      | 2.14        |
| オーストラリア         | -        | -                             | -             | -            | 847                | 585,114,469      | -           |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 投資証券     | GENERAL GROWTH PROPERTIES INC | -             | 116,179      | 6,138              | 713,145,669      | 2.01        |
| アメリカ            | -        | -                             | -             | -            | 4,722              | 548,642,025      | -           |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 投資証券     | EQUITY RESIDENTIAL-REIT       | -             | 129,163      | 5,149              | 665,085,183      | 1.97        |
| アメリカ            | -        | -                             | -             | -            | 4,179              | 539,776,246      | -           |
| イギリスポンド<br>イギリス | 投資証券     | BRITISH LAND COMPANY PLC      | -             | 245,102      | 3,055              | 748,875,150      | 1.91        |
| イギリス            | -        | -                             | -             | -            | 2,130              | 521,999,990      | -           |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 投資証券     | KIMCO REALTY CORPORATION      | -             | 121,644      | 4,740              | 576,605,734      | 1.87        |
| アメリカ            | -        | -                             | -             | -            | 4,212              | 512,380,950      | -           |

|                          |           |   |   |           |                  |                            |      |
|--------------------------|-----------|---|---|-----------|------------------|----------------------------|------|
| アメリカドル<br>アメリカ           | 投資証券<br>- | PUBLIC STORAGE                            | - | 59,339    | 9,120<br>8,558   | 541,151,260<br>507,812,807 | 1.86 |
| アメリカドル<br>アメリカ           | 投資証券<br>- | HOST HOTELS & RESORTS INC                 | - | 249,233   | 2,645<br>1,936   | 659,127,121<br>482,511,100 | 1.76 |
| オーストラリア<br>ドル<br>オーストラリア | 投資証券<br>- | GPT GROUP                                 | - | 1,000,488 | 482<br>410       | 481,804,482<br>409,936,151 | 1.50 |
| オーストラリア<br>ドル<br>オーストラリア | 投資証券<br>- | GOODMAN GROUP                             | - | 816,964   | 663<br>497       | 541,599,570<br>405,943,529 | 1.48 |
| アメリカドル<br>アメリカ           | 投資証券<br>- | HCP INC                                   | - | 103,052   | 3,376<br>3,904   | 347,877,257<br>402,307,794 | 1.47 |
| アメリカドル<br>アメリカ           | 投資証券<br>- | AVALONBAY COMMUNITIES INC                 | - | 37,526    | 13,983<br>10,720 | 524,729,058<br>402,272,209 | 1.47 |
| アメリカドル<br>アメリカ           | 投資証券<br>- | VENTAS INC                                | - | 63,227    | 4,286<br>5,083   | 271,010,074<br>321,389,132 | 1.18 |
| イギリスポンド<br>イギリス          | 投資証券<br>- | HAMMERSON PLC                             | - | 140,570   | 3,180<br>2,279   | 447,023,940<br>320,359,030 | 1.17 |
| イギリスポンド<br>イギリス          | 投資証券<br>- | LIBERTY INTERNATIONAL PLC                 | - | 126,734   | 2,647<br>2,475   | 335,489,110<br>313,665,890 | 1.15 |
| アメリカドル<br>アメリカ           | 投資証券<br>- | SL GREEN REALTY CORP                      | - | 28,774    | 14,663<br>10,788 | 421,905,676<br>310,423,019 | 1.14 |
| アメリカドル<br>アメリカ           | 投資証券<br>- | AMB PROPERTY CORPORATION                  | - | 47,191    | 6,388<br>6,447   | 301,443,845<br>304,249,438 | 1.11 |
| オーストラリア<br>ドル<br>オーストラリア | 投資証券<br>- | MIRVAC GROUP                              | - | 489,629   | 570<br>611       | 278,881,505<br>299,211,303 | 1.09 |
| アメリカドル<br>アメリカ           | 投資証券<br>- | THE MACERICH COMPANY                      | - | 34,862    | 9,557<br>8,320   | 333,163,874<br>290,065,558 | 1.06 |
| オーストラリア<br>ドル<br>オーストラリア | 投資証券<br>- | DB RREEF TRUST                            | - | 1,397,160 | 195<br>197       | 272,465,886<br>275,735,953 | 1.01 |
| アメリカドル<br>アメリカ           | 投資証券<br>- | DEVELOPERS DIVERSIFIED REALTY CORPORATION | - | 59,356    | 6,207<br>4,462   | 368,451,947<br>264,853,802 | 0.97 |
| アメリカドル<br>アメリカ           | 投資証券<br>- | FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT      | - | 27,312    | 9,304<br>9,490   | 254,123,062<br>259,202,651 | 0.95 |
| 香港ドル<br>香港               | 投資証券<br>- | LINK REIT                                 | - | 1,028,500 | 254<br>249       | 261,724,573<br>255,798,235 | 0.94 |
| アメリカドル<br>アメリカ           | 投資証券<br>- | REGENCY CENTERS CORPORATION               | - | 33,212    | 8,220<br>7,408   | 272,986,425<br>246,045,622 | 0.90 |

#### □ 種類別及び業種別の投資比率

| 種類別及び業種別 | 投資比率 (%) |
|----------|----------|
| 投資証券     | 98.86    |
| 合計       | 98.86    |

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

< 為替予約取引 >

| 名称         | 種類 | 契約額等 (円)    | 評価額 (円)     | 投資比率 (%) |
|------------|----|-------------|-------------|----------|
| オーストラリアドル  | 買建 | 68,967,040  | 69,022,600  | 0.25     |
| アメリカドル     | 買建 | 58,148,280  | 58,150,500  | 0.21     |
| カナダドル      | 買建 | 16,282,532  | 16,272,900  | 0.06     |
| ユーロ        | 買建 | 9,932,640   | 9,992,400   | 0.04     |
| イギリスポンド    | 買建 | 9,073,600   | 9,106,400   | 0.03     |
| シンガポールドル   | 買建 | 8,647,650   | 8,664,700   | 0.03     |
| ニュージーランドドル | 買建 | 2,635,755   | 2,638,800   | 0.01     |
| 合計         |    | 173,687,497 | 173,848,300 | 0.64     |



# 運用の状況について

(参考) 日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は平成 19 年 12 月 28 日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1) 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(千円)     | 投資比率(%) |
|-----------------------|------------|---------|
| 国債証券                  | 35,695,496 | 73.68   |
| 日本                    | 35,695,496 | 73.68   |
| 地方債証券                 | 2,914,304  | 6.02    |
| 日本                    | 2,914,304  | 6.02    |
| 特殊債券                  | 5,254,421  | 10.85   |
| 日本                    | 5,254,421  | 10.85   |
| 社債券                   | 4,443,471  | 9.17    |
| 日本                    | 4,443,471  | 9.17    |
| コール・ローン等、その他資産(負債控除後) | 136,018    | 0.28    |
| 純資産総額                 | 48,443,710 | 100.00  |

## (2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

### イ 評価額上位銘柄明細

< 国債証券・地方債証券・特殊債券・社債券 >

| 通貨<br>国・地域 | 種類<br>業種  | 銘柄名                  | 利率(%)<br>償還期限         | 数量又は<br>券面総額 | 簿価単価(円)<br>評価単価(円) | 簿価額(円)<br>評価額(円)           | 投資比率<br>(%) |
|------------|-----------|----------------------|-----------------------|--------------|--------------------|----------------------------|-------------|
| 日本円<br>日本  | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(10年)<br>第288回 | 1.70000<br>2017-09-20 | 880,000,000  | 101.01<br>102.00   | 888,858,340<br>897,556,000 | 1.85        |
| 日本円<br>日本  | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(10年)<br>第282回 | 1.70000<br>2016-09-20 | 823,000,000  | 101.61<br>102.92   | 836,233,840<br>847,064,520 | 1.75        |
| 日本円<br>日本  | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(20年)<br>第92回  | 2.10000<br>2026-12-20 | 766,000,000  | 98.99<br>100.68    | 758,232,760<br>771,224,120 | 1.59        |
| 日本円<br>日本  | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(10年)<br>第210回 | 1.90000<br>2009-03-20 | 754,000,000  | 101.61<br>101.50   | 766,131,860<br>765,302,460 | 1.58        |
| 日本円<br>日本  | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(10年)<br>第284回 | 1.70000<br>2016-12-20 | 702,000,000  | 101.36<br>102.67   | 711,561,240<br>720,750,420 | 1.49        |
| 日本円<br>日本  | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(10年)<br>第212回 | 1.50000<br>2009-06-22 | 708,000,000  | 101.21<br>101.19   | 716,545,560<br>716,446,440 | 1.48        |
| 日本円<br>日本  | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(10年)<br>第259回 | 1.50000<br>2014-03-20 | 699,000,000  | 101.60<br>102.35   | 710,170,020<br>715,419,510 | 1.48        |
| 日本円<br>日本  | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(10年)<br>第233回 | 1.40000<br>2011-06-20 | 700,000,000  | 101.56<br>102.00   | 710,941,000<br>713,965,000 | 1.47        |
| 日本円<br>日本  | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(5年)<br>第35回   | 0.60000<br>2009-03-20 | 700,000,000  | 99.84<br>99.95     | 698,879,320<br>699,664,000 | 1.44        |
| 日本円<br>日本  | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(10年)<br>第285回 | 1.70000<br>2017-03-20 | 680,000,000  | 101.15<br>102.49   | 687,786,000<br>696,898,000 | 1.44        |
| 日本円<br>日本  | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(5年)<br>第66回   | 1.10000<br>2012-09-20 | 680,000,000  | 100.13<br>100.54   | 680,910,750<br>683,665,200 | 1.41        |
| 日本円<br>日本  | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(10年)<br>第283回 | 1.80000<br>2016-09-20 | 642,000,000  | 102.43<br>103.75   | 657,613,440<br>666,042,900 | 1.37        |
| 日本円<br>日本  | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(10年)<br>第220回 | 1.70000<br>2010-03-22 | 652,000,000  | 102.07<br>102.13   | 665,520,120<br>665,907,160 | 1.37        |
| 日本円<br>日本  | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(10年)<br>第214回 | 1.80000<br>2009-09-21 | 649,000,000  | 101.91<br>101.88   | 661,387,340<br>661,220,670 | 1.36        |
| 日本円<br>日本  | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(10年)<br>第240回 | 1.30000<br>2012-06-20 | 610,000,000  | 100.99<br>101.49   | 616,057,300<br>619,107,300 | 1.28        |
| 日本円<br>日本  | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(2年)<br>第256回  | 0.90000<br>2009-05-15 | 600,000,000  | 100.25<br>100.32   | 601,524,500<br>601,920,000 | 1.24        |
| 日本円<br>日本  | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(10年)<br>第261回 | 1.80000<br>2014-06-20 | 562,000,000  | 103.43<br>104.12   | 581,293,760<br>585,148,780 | 1.21        |

|           |           |                      |                       |             |                  |                            |      |
|-----------|-----------|----------------------|-----------------------|-------------|------------------|----------------------------|------|
| 日本円<br>日本 | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(10年)<br>第264回 | 1.50000<br>2014-09-20 | 560,000,000 | 101.45<br>102.21 | 568,117,600<br>572,364,800 | 1.18 |
| 日本円<br>日本 | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(5年)<br>第57回   | 1.40000<br>2011-06-20 | 557,000,000 | 101.53<br>101.98 | 565,505,390<br>568,017,460 | 1.17 |
| 日本円<br>日本 | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(20年)<br>第90回  | 2.20000<br>2026-09-20 | 549,000,000 | 100.74<br>102.37 | 553,057,110<br>562,027,770 | 1.16 |
| 日本円<br>日本 | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(10年)<br>第229回 | 1.40000<br>2011-03-21 | 549,000,000 | 101.56<br>101.98 | 557,558,910<br>559,875,690 | 1.16 |
| 日本円<br>日本 | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(10年)<br>第218回 | 1.90000<br>2009-12-21 | 547,000,000 | 102.31<br>102.34 | 559,652,780<br>559,788,860 | 1.16 |
| 日本円<br>日本 | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(10年)<br>第236回 | 1.50000<br>2011-12-20 | 540,000,000 | 101.93<br>102.37 | 550,395,000<br>552,771,000 | 1.14 |
| 日本円<br>日本 | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(10年)<br>第239回 | 1.40000<br>2012-06-20 | 520,000,000 | 101.44<br>101.92 | 527,462,000<br>529,978,800 | 1.09 |
| 日本円<br>日本 | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(20年)<br>第42回  | 2.60000<br>2019-03-20 | 477,000,000 | 108.95<br>110.44 | 519,677,190<br>526,784,490 | 1.09 |
| 日本円<br>日本 | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(10年)<br>第227回 | 1.60000<br>2011-03-21 | 507,000,000 | 102.25<br>102.61 | 518,402,430<br>520,207,350 | 1.07 |
| 日本円<br>日本 | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(5年)<br>第41回   | 0.70000<br>2009-09-20 | 503,000,000 | 99.85<br>100.03  | 502,244,750<br>503,125,750 | 1.04 |
| 日本円<br>日本 | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(2年)<br>第252回  | 0.80000<br>2009-01-15 | 460,000,000 | 100.10<br>100.20 | 460,464,600<br>460,906,200 | 0.95 |
| 日本円<br>日本 | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(20年)<br>第91回  | 2.30000<br>2026-09-20 | 434,000,000 | 102.29<br>103.94 | 443,934,260<br>451,103,940 | 0.93 |
| 日本円<br>日本 | 国債証券<br>- | 利付国庫債券(10年)<br>第238回 | 1.40000<br>2012-03-20 | 442,000,000 | 101.49<br>101.96 | 448,576,960<br>450,658,780 | 0.93 |

#### □ 種類別及び業種別の投資比率

| 種類別及び業種別 | 投資比率(%) |
|----------|---------|
| 国債証券     | 73.68   |
| 地方債証券    | 6.02    |
| 特殊債券     | 10.85   |
| 社債券      | 9.17    |
| 合計       | 99.72   |

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。

# 運用の状況について

(参考) 海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は平成 19 年 12 月 28 日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。
- ・為替予約取引の金額は、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。

## (1) 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(千円)      | 投資比率(%) |
|-----------------------|-------------|---------|
| 国債証券                  | 897,091,843 | 98.29   |
| アメリカ                  | 244,359,301 | 26.77   |
| ドイツ                   | 121,914,759 | 13.36   |
| イタリア                  | 115,802,651 | 12.69   |
| フランス                  | 100,199,684 | 10.98   |
| イギリス                  | 74,055,515  | 8.11    |
| スペイン                  | 38,767,407  | 4.25    |
| ベルギー                  | 31,679,097  | 3.47    |
| オランダ                  | 27,847,797  | 3.05    |
| ギリシャ                  | 25,520,040  | 2.80    |
| カナダ                   | 24,183,794  | 2.65    |
| オーストリア                | 19,530,208  | 2.14    |
| ポルトガル                 | 11,199,452  | 1.23    |
| ポーランド                 | 10,499,231  | 1.15    |
| スウェーデン                | 8,232,347   | 0.90    |
| デンマーク                 | 8,111,884   | 0.89    |
| スイス                   | 7,241,304   | 0.79    |
| フィンランド                | 6,119,072   | 0.67    |
| アイルランド                | 4,933,608   | 0.54    |
| マレーシア                 | 4,740,738   | 0.52    |
| シンガポール                | 4,131,980   | 0.45    |
| オーストラリア               | 4,075,194   | 0.45    |
| ノルウェー                 | 3,946,768   | 0.43    |
| 為替予約取引(買建)            | (2,062,587) | (0.23)  |
| 為替予約取引(売建)            | (11,657)    | (0.00)  |
| コール・ローン等、その他資産(負債控除後) | 15,573,808  | 1.71    |
| 純資産総額                 | 912,665,651 | 100.00  |

## (2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

### イ 評価額上位銘柄明細

#### < 国債証券 >

| 通貨<br>国・地域   | 種類<br>業種  | 銘柄名    | 利率(%)<br>償還期限        | 数量又は<br>券面総額 | 簿価単価(円)<br>評価単価(円)     | 簿価額(円)<br>評価額(円)               | 投資比率<br>(%) |
|--------------|-----------|--------|----------------------|--------------|------------------------|--------------------------------|-------------|
| ユーロ<br>イタリア  | 国債証券<br>- | イタリア国債 | 6.0000<br>2031-05-01 | 29,500,000   | 19,615.26<br>19,056.79 | 5,786,502,491<br>5,621,752,371 | 0.62        |
| イギリス<br>イギリス | 国債証券<br>- | イギリス国債 | 8.0000<br>2021-06-07 | 17,360,000   | 29,938.58<br>30,267.29 | 5,197,336,701<br>5,254,400,685 | 0.58        |
| ユーロ<br>イタリア  | 国債証券<br>- | イタリア国債 | 6.5000<br>2027-11-01 | 25,850,000   | 20,555.74<br>20,042.45 | 5,313,659,928<br>5,180,972,878 | 0.57        |
| ユーロ<br>イタリア  | 国債証券<br>- | イタリア国債 | 5.0000<br>2012-02-01 | 28,430,000   | 17,244.76<br>17,112.13 | 4,902,685,320<br>4,864,979,171 | 0.53        |
| ユーロ<br>ドイツ   | 国債証券<br>- | ドイツ国債  | 5.0000<br>2012-07-04 | 26,910,000   | 17,343.97<br>17,196.31 | 4,667,263,102<br>4,627,527,591 | 0.51        |
| ユーロ<br>ドイツ   | 国債証券<br>- | ドイツ国債  | 4.5000<br>2009-07-04 | 26,740,000   | 16,802.68<br>16,752.03 | 4,493,037,438<br>4,479,492,793 | 0.49        |

|                 |           |        |                       |            |                        |                                |      |
|-----------------|-----------|--------|-----------------------|------------|------------------------|--------------------------------|------|
| ユーロ<br>ドイツ      | 国債証券<br>- | ドイツ国債  | 5.00000<br>2012-01-04 | 24,780,000 | 17,275.96<br>17,149.21 | 4,280,984,054<br>4,249,575,230 | 0.47 |
| ユーロ<br>ドイツ      | 国債証券<br>- | ドイツ国債  | 5.00000<br>2011-07-04 | 23,960,000 | 17,215.85<br>17,112.37 | 4,124,918,237<br>4,100,122,769 | 0.45 |
| ユーロ<br>ドイツ      | 国債証券<br>- | ドイツ国債  | 4.25000<br>2014-07-04 | 24,240,000 | 16,825.14<br>16,650.32 | 4,078,414,817<br>4,036,036,912 | 0.44 |
| ユーロ<br>ドイツ      | 国債証券<br>- | ドイツ国債  | 5.25000<br>2011-01-04 | 23,200,000 | 17,272.12<br>17,188.18 | 4,007,131,375<br>3,987,657,554 | 0.44 |
| ユーロ<br>イタリア     | 国債証券<br>- | イタリア国債 | 5.50000<br>2010-11-01 | 22,640,000 | 17,334.81<br>17,226.39 | 3,924,601,001<br>3,900,055,658 | 0.43 |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 国債証券<br>- | アメリカ国債 | 6.25000<br>2023-08-15 | 29,000,000 | 13,393.00<br>13,444.73 | 3,883,971,414<br>3,898,971,603 | 0.43 |
| ユーロ<br>イタリア     | 国債証券<br>- | イタリア国債 | 5.25000<br>2029-11-01 | 22,390,000 | 17,884.13<br>17,395.25 | 4,004,257,738<br>3,894,797,407 | 0.43 |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 国債証券<br>- | アメリカ国債 | 8.12500<br>2019-08-15 | 25,450,000 | 15,114.17<br>15,190.87 | 3,846,557,384<br>3,866,075,747 | 0.42 |
| ユーロ<br>ドイツ      | 国債証券<br>- | ドイツ国債  | 3.75000<br>2013-07-04 | 23,700,000 | 16,420.13<br>16,299.48 | 3,891,570,168<br>3,862,977,075 | 0.42 |
| ユーロ<br>ドイツ      | 国債証券<br>- | ドイツ国債  | 4.50000<br>2013-01-04 | 22,700,000 | 17,026.25<br>16,902.56 | 3,864,958,795<br>3,836,880,485 | 0.42 |
| イギリスポンド<br>イギリス | 国債証券<br>- | イギリス国債 | 5.00000<br>2025-03-07 | 15,970,000 | 23,548.74<br>23,879.54 | 3,760,733,394<br>3,813,563,228 | 0.42 |
| ユーロ<br>イタリア     | 国債証券<br>- | イタリア国債 | 3.75000<br>2015-08-01 | 23,870,000 | 16,121.32<br>15,934.88 | 3,848,160,097<br>3,803,655,676 | 0.42 |
| ユーロ<br>ドイツ      | 国債証券<br>- | ドイツ国債  | 3.75000<br>2015-01-04 | 23,550,000 | 16,298.73<br>16,122.46 | 3,838,350,976<br>3,796,838,170 | 0.42 |
| ユーロ<br>イタリア     | 国債証券<br>- | イタリア国債 | 3.75000<br>2016-08-01 | 24,000,000 | 15,982.56<br>15,770.39 | 3,835,815,370<br>3,784,892,598 | 0.41 |
| ユーロ<br>イタリア     | 国債証券<br>- | イタリア国債 | 4.50000<br>2009-05-01 | 22,600,000 | 16,776.88<br>16,738.40 | 3,791,574,631<br>3,782,877,746 | 0.41 |
| イギリスポンド<br>イギリス | 国債証券<br>- | イギリス国債 | 4.00000<br>2009-03-07 | 16,700,000 | 22,474.02<br>22,647.72 | 3,753,160,781<br>3,782,169,579 | 0.41 |
| ユーロ<br>フランス     | 国債証券<br>- | フランス国債 | 5.00000<br>2016-10-25 | 21,740,000 | 17,622.31<br>17,370.27 | 3,831,090,574<br>3,776,297,095 | 0.41 |
| イギリスポンド<br>イギリス | 国債証券<br>- | イギリス国債 | 4.25000<br>2032-06-07 | 17,100,000 | 21,759.55<br>21,973.84 | 3,720,883,076<br>3,757,527,413 | 0.41 |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 国債証券<br>- | アメリカ国債 | 8.00000<br>2021-11-15 | 24,350,000 | 15,360.37<br>15,397.76 | 3,740,250,352<br>3,749,355,597 | 0.41 |
| ユーロ<br>ドイツ      | 国債証券<br>- | ドイツ国債  | 4.25000<br>2014-01-04 | 22,420,000 | 16,827.86<br>16,669.10 | 3,772,806,255<br>3,737,212,192 | 0.41 |
| ユーロ<br>ドイツ      | 国債証券<br>- | ドイツ国債  | 4.00000<br>2016-07-04 | 22,750,000 | 16,510.29<br>16,265.08 | 3,756,090,875<br>3,700,306,315 | 0.41 |
| ユーロ<br>イタリア     | 国債証券<br>- | イタリア国債 | 4.25000<br>2015-02-01 | 22,150,000 | 16,692.52<br>16,513.34 | 3,697,393,398<br>3,657,704,686 | 0.40 |
| ユーロ<br>イタリア     | 国債証券<br>- | イタリア国債 | 4.25000<br>2014-08-01 | 22,000,000 | 16,741.56<br>16,582.39 | 3,683,142,902<br>3,648,125,069 | 0.40 |
| ユーロ<br>イタリア     | 国債証券<br>- | イタリア国債 | 4.25000<br>2009-11-01 | 21,560,000 | 16,759.68<br>16,695.63 | 3,613,388,069<br>3,599,578,291 | 0.39 |

#### □ 種類別及び業種別の投資比率

| 種類別及び業種別 | 投資比率 (%) |
|----------|----------|
| 国債証券     | 98.29    |
| 合計       | 98.29    |

投資不動産物件

該当事項はありません。

# 運用の状況について

## その他投資資産の主要なもの

< 為替予約取引 >

| 名称        | 種類 | 契約額等 (円)      | 評価額 (円)       | 投資比率 (%) |
|-----------|----|---------------|---------------|----------|
| ユーロ       | 買建 | 1,157,589,340 | 1,162,916,300 | 0.13     |
| アメリカドル    | 買建 | 582,456,550   | 581,042,550   | 0.06     |
| イギリスポンド   | 買建 | 137,899,542   | 137,901,360   | 0.02     |
| スイスフラン    | 買建 | 68,856,416    | 68,855,040    | 0.01     |
| デンマーククローネ | 買建 | 59,704,128    | 59,688,090    | 0.01     |
| ポーランドズロチ  | 買建 | 52,271,427    | 52,184,340    | 0.01     |
| 合計        |    | 2,058,777,403 | 2,062,587,680 | 0.23     |
| ユーロ       | 売建 | 11,589,445    | 11,657,800    | 0.00     |
| 合計        |    | 11,589,445    | 11,657,800    | 0.00     |



(参考) 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は平成19年12月28日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。
- ・有価証券指数等先物取引の金額は、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。

### (1) 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(千円)     | 投資比率(%) |
|-----------------------|------------|---------|
| 株式                    | 40,406,731 | 99.82   |
| 日本                    | 40,406,731 | 99.82   |
| 有価証券指数等先物取引(買建)       | (73,500)   | (0.18)  |
| 日本                    | (73,500)   | (0.18)  |
| コール・ローン等、その他資産(負債控除後) | 72,187     | 0.18    |
| 純資産総額                 | 40,478,919 | 100.00  |

### (2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

#### イ 評価額上位銘柄明細

<株式>

| 通貨<br>国・地域 | 種類<br>業種         | 銘柄名               | 利率(%)<br>償還期限 | 数量又は<br>券面総額 | 簿価単価(円)<br>評価単価(円) | 簿価額(円)<br>評価額(円)               | 投資比率<br>(%) |
|------------|------------------|-------------------|---------------|--------------|--------------------|--------------------------------|-------------|
| 日本円<br>日本  | 株式<br>輸送用機器      | トヨタ自動車            | -             | 285,300      | 6,234<br>6,040     | 1,778,649,454<br>1,723,212,000 | 4.26        |
| 日本円<br>日本  | 株式<br>銀行業        | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | -             | 1,216,000    | 1,042<br>1,047     | 1,266,721,460<br>1,273,152,000 | 3.15        |
| 日本円<br>日本  | 株式<br>その他製品      | 任天堂               | -             | 12,100       | 67,684<br>66,900   | 818,980,800<br>809,490,000     | 2.00        |
| 日本円<br>日本  | 株式<br>電気機器       | ソニー               | -             | 119,000      | 5,568<br>6,200     | 662,544,171<br>737,800,000     | 1.82        |
| 日本円<br>日本  | 株式<br>銀行業        | 三井住友フィナンシャルグループ   | -             | 865          | 838,415<br>837,000 | 725,229,220<br>724,005,000     | 1.79        |
| 日本円<br>日本  | 株式<br>電気機器       | キヤノン              | -             | 131,700      | 5,710<br>5,200     | 752,007,844<br>684,840,000     | 1.69        |
| 日本円<br>日本  | 株式<br>銀行業        | みずほフィナンシャルグループ    | -             | 1,276        | 602,056<br>534,000 | 768,223,061<br>681,384,000     | 1.68        |
| 日本円<br>日本  | 株式<br>輸送用機器      | ホンダ               | -             | 181,300      | 4,036<br>3,750     | 731,668,200<br>679,875,000     | 1.68        |
| 日本円<br>日本  | 株式<br>医薬品        | 武田薬品工業            | -             | 87,900       | 7,925<br>6,570     | 696,590,000<br>577,503,000     | 1.43        |
| 日本円<br>日本  | 株式<br>情報・通信業     | 日本電信電話            | -             | 962          | 519,735<br>559,000 | 499,984,902<br>537,758,000     | 1.33        |
| 日本円<br>日本  | 株式<br>電気機器       | 松下電器産業            | -             | 226,000      | 2,053<br>2,315     | 464,020,000<br>523,190,000     | 1.29        |
| 日本円<br>日本  | 株式<br>卸売業        | 三菱商事              | -             | 156,100      | 3,612<br>3,060     | 563,785,108<br>477,666,000     | 1.18        |
| 日本円<br>日本  | 株式<br>鉄鋼         | 新日本製鐵             | -             | 627,000      | 763<br>692         | 478,207,820<br>433,884,000     | 1.07        |
| 日本円<br>日本  | 株式<br>証券・商品先物取引業 | 野村ホールディングス        | -             | 220,200      | 1,914<br>1,895     | 421,518,300<br>417,279,000     | 1.03        |
| 日本円<br>日本  | 株式<br>卸売業        | 三井物産              | -             | 167,000      | 2,998<br>2,365     | 500,590,000<br>394,955,000     | 0.98        |
| 日本円<br>日本  | 株式<br>不動産業       | 三菱地所              | -             | 146,000      | 3,175<br>2,695     | 463,555,000<br>393,470,000     | 0.97        |
| 日本円<br>日本  | 株式<br>情報・通信業     | NTTドコモ            | -             | 2,115        | 155,265<br>186,000 | 328,385,830<br>393,390,000     | 0.97        |
| 日本円<br>日本  | 株式<br>電気・ガス業     | 東京電力              | -             | 133,600      | 2,802<br>2,890     | 374,290,440<br>386,104,000     | 0.95        |

# 運用の状況について

|           |              |                 |   |         |                    |                            |      |
|-----------|--------------|-----------------|---|---------|--------------------|----------------------------|------|
| 日本円<br>日本 | 株式<br>陸運業    | 東日本旅客鉄道         | - | 395     | 930,168<br>922,000 | 367,416,488<br>364,190,000 | 0.90 |
| 日本円<br>日本 | 株式<br>食料品    | J T             | - | 527     | 666,602<br>668,000 | 351,299,071<br>352,036,000 | 0.87 |
| 日本円<br>日本 | 株式<br>保険業    | ミレアホールディングス     | - | 92,300  | 4,292<br>3,770     | 396,131,968<br>347,971,000 | 0.86 |
| 日本円<br>日本 | 株式<br>鉄鋼     | J F E ホールディングス  | - | 56,600  | 7,023<br>5,660     | 397,481,871<br>320,356,000 | 0.79 |
| 日本円<br>日本 | 株式<br>機械     | コマツ             | - | 98,700  | 3,799<br>3,040     | 374,917,700<br>300,048,000 | 0.74 |
| 日本円<br>日本 | 株式<br>電気機器   | 日立製作所           | - | 355,000 | 745<br>833         | 264,582,910<br>295,715,000 | 0.73 |
| 日本円<br>日本 | 株式<br>輸送用機器  | 日産自動車           | - | 238,200 | 1,129<br>1,230     | 268,934,538<br>292,986,000 | 0.72 |
| 日本円<br>日本 | 株式<br>小売業    | セブン&アイ・ホールディングス | - | 89,300  | 2,859<br>3,260     | 255,341,984<br>291,118,000 | 0.72 |
| 日本円<br>日本 | 株式<br>情報・通信業 | K D D I         | - | 325     | 839,704<br>832,000 | 272,903,831<br>270,400,000 | 0.67 |
| 日本円<br>日本 | 株式<br>電気機器   | 東芝              | - | 320,000 | 961<br>837         | 307,494,700<br>267,840,000 | 0.66 |
| 日本円<br>日本 | 株式<br>化学     | 信越化学工業          | - | 36,900  | 7,335<br>7,020     | 270,675,000<br>259,038,000 | 0.64 |
| 日本円<br>日本 | 株式<br>化学     | 富士フィルムホールディングス  | - | 54,200  | 5,083<br>4,730     | 275,478,600<br>256,366,000 | 0.63 |

## □ 種類別及び業種別の投資比率

| 種類別及び業種別   | 投資比率 (%) |
|------------|----------|
| 株式         | 99.82    |
| 電気機器       | 14.49    |
| 銀行業        | 10.81    |
| 輸送用機器      | 9.88     |
| 化学         | 5.73     |
| 情報・通信業     | 5.31     |
| 卸売業        | 4.72     |
| 機械         | 4.47     |
| 電気・ガス業     | 4.16     |
| 医薬品        | 4.07     |
| 小売業        | 3.30     |
| 鉄鋼         | 3.27     |
| 陸運業        | 3.23     |
| その他製品      | 3.07     |
| 食料品        | 2.94     |
| 不動産業       | 2.69     |
| 保険業        | 2.36     |
| 証券、商品先物取引業 | 1.79     |
| 建設業        | 1.74     |
| 精密機器       | 1.57     |
| サービス業      | 1.40     |
| ガラス・土石製品   | 1.28     |
| その他金融業     | 1.27     |
| 非鉄金属       | 1.25     |
| 繊維製品       | 0.92     |
| 海運業        | 0.84     |
| 石油・石炭製品    | 0.79     |
| 金属製品       | 0.55     |
| ゴム製品       | 0.51     |
| 空運業        | 0.41     |
| 鉱業         | 0.40     |
| パルプ・紙      | 0.33     |
| 倉庫・運輸関連業   | 0.21     |
| 水産・農林業     | 0.08     |
| 合計         | 99.82    |

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

< 有価証券指数等先物取引 >

| 国・地域 | 銘柄名                 | 種類 | 数量 | 契約額等 (円)   | 評価額 (円)    | 投資比率 (%) |
|------|---------------------|----|----|------------|------------|----------|
| 日本   | 東証株価指数先物<br>2008-03 | 買建 | 5  | 75,675,418 | 73,500,000 | 0.18     |
| 合計   |                     |    | -  | 75,675,418 | 73,500,000 | 0.18     |

# 運用の状況について

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

以下の運用状況は平成 19 年 12 月 28 日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。
- ・有価証券指数等先物取引の金額は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。
- ・為替予約取引の金額は、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。

## (1) 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価 (千円)     | 投資比率 (%) |
|-----------------------|-------------|----------|
| 株式                    | 80,832,278  | 97.28    |
| アメリカ                  | 42,025,589  | 50.57    |
| イギリス                  | 9,826,920   | 11.83    |
| フランス                  | 4,456,773   | 5.36     |
| ドイツ                   | 4,125,517   | 4.96     |
| カナダ                   | 3,565,991   | 4.29     |
| スイス                   | 2,942,386   | 3.54     |
| オーストラリア               | 2,608,853   | 3.14     |
| スペイン                  | 1,924,271   | 2.32     |
| イタリア                  | 1,731,295   | 2.08     |
| オランダ                  | 1,226,620   | 1.48     |
| スウェーデン                | 998,145     | 1.20     |
| 香港                    | 982,167     | 1.18     |
| フィンランド                | 829,294     | 1.00     |
| ベルギー                  | 544,057     | 0.65     |
| シンガポール                | 504,101     | 0.61     |
| ノルウェー                 | 422,615     | 0.51     |
| デンマーク                 | 413,567     | 0.50     |
| ギリシャ                  | 339,971     | 0.41     |
| アイルランド                | 278,907     | 0.34     |
| パミューダ諸島               | 263,403     | 0.32     |
| ルクセンブルク               | 244,719     | 0.29     |
| オーストリア                | 240,947     | 0.29     |
| ポルトガル                 | 164,608     | 0.20     |
| ケイマン諸島                | 77,492      | 0.09     |
| ニュージーランド              | 61,482      | 0.07     |
| 中国                    | 20,072      | 0.02     |
| キプロス                  | 12,239      | 0.01     |
| ジブラルタル                | 266         | 0.00     |
| 投資証券                  | 1,226,430   | 1.48     |
| アメリカ                  | 575,531     | 0.69     |
| オーストラリア               | 237,876     | 0.29     |
| カナダ                   | 160,850     | 0.19     |
| イギリス                  | 122,865     | 0.15     |
| フランス                  | 76,915      | 0.09     |
| シンガポール                | 19,204      | 0.02     |
| 香港                    | 16,663      | 0.02     |
| オランダ                  | 16,523      | 0.02     |
| 有価証券指数等先物取引(買建)       | (1,087,266) | (1.31)   |
| アメリカ                  | (629,224)   | (0.76)   |
| ドイツ                   | (458,041)   | (0.55)   |
| 為替予約取引(買建)            | (642,992)   | (0.77)   |
| コール・ローン等、その他資産(負債控除後) | 1,037,690   | 1.25     |
| 純資産総額                 | 83,096,399  | 100.00   |

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ 評価額上位銘柄明細

## &lt; 株式 &gt;

| 通貨<br>国・地域      | 種類<br>業種          | 銘柄名                                  | 利率(%)<br>償還期限 | 数量又は<br>券面総額 | 簿価単価(円)<br>評価単価(円) | 簿価額(円)<br>評価額(円)               | 投資比率<br>(%) |
|-----------------|-------------------|--------------------------------------|---------------|--------------|--------------------|--------------------------------|-------------|
| アメリカドル<br>アメリカ  | 株式<br>石油・ガス       | EXXON MOBIL CORPORATION              | -             | 154,200      | 10,442<br>10,692   | 1,610,214,020<br>1,648,772,783 | 1.98        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 株式<br>その他製造       | GENERAL ELECTRIC COMPANY             | -             | 284,872      | 4,563<br>4,245     | 1,299,833,915<br>1,209,349,582 | 1.46        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 株式<br>ソフトウェア      | MICROSOFT CORP                       | -             | 234,594      | 3,667<br>4,106     | 860,191,212<br>963,237,216     | 1.16        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 株式<br>通信          | AT&T INC                             | -             | 169,566      | 4,669<br>4,797     | 791,772,151<br>813,337,393     | 0.98        |
| イギリスポンド<br>イギリス | 株式<br>石油・ガス       | BP PLC                               | -             | 529,978      | 1,395<br>1,416     | 739,059,870<br>750,660,044     | 0.90        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 株式<br>化粧品/パーソナルケア | PROCTER & GAMBLE COMPANY             | -             | 86,633       | 8,155<br>8,435     | 706,488,366<br>730,709,807     | 0.88        |
| イギリスポンド<br>イギリス | 株式<br>通信          | VODAFONE GROUP PLC                   | -             | 1,474,025    | 432<br>432         | 636,062,011<br>636,587,913     | 0.77        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 株式<br>石油・ガス       | CHEVRON CORPORATION                  | -             | 59,264       | 10,399<br>10,702   | 616,280,340<br>634,217,400     | 0.76        |
| イギリスポンド<br>イギリス | 株式<br>銀行          | HSBC HOLDINGS PLC                    | -             | 327,291      | 2,058<br>1,936     | 673,619,010<br>633,638,811     | 0.76        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 株式<br>ヘルスケア製品     | JOHNSON & JOHNSON                    | -             | 80,474       | 7,324<br>7,686     | 589,421,159<br>618,500,591     | 0.74        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 株式<br>銀行          | BANK OF AMERICA CORP                 | -             | 123,369      | 5,330<br>4,733     | 657,594,681<br>583,863,408     | 0.70        |
| スイスフラン<br>スイス   | 株式<br>食品          | NESTLE SA-REGISTERED                 | -             | 10,927       | 53,353<br>52,423   | 582,986,286<br>572,829,290     | 0.69        |
| ユーロ<br>フランス     | 株式<br>石油・ガス       | TOTAL SA                             | -             | 59,874       | 9,035<br>9,390     | 540,985,775<br>562,194,371     | 0.68        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 株式<br>コンピューター     | APPLE INC                            | -             | 24,176       | 20,854<br>22,667   | 504,162,456<br>547,991,723     | 0.66        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 株式<br>通信          | CISCO SYSTEMS INC                    | -             | 168,795      | 3,540<br>3,172     | 597,472,698<br>535,456,310     | 0.64        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 株式<br>インターネット     | GOOGLE INC-CL A                      | -             | 6,476        | 76,385<br>79,989   | 494,666,872<br>518,011,814     | 0.62        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 株式<br>農業          | ALTRIA GROUP INC                     | -             | 58,528       | 8,267<br>8,702     | 483,862,053<br>509,290,435     | 0.61        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 株式<br>医薬品         | PFIZER INC                           | -             | 192,592      | 2,763<br>2,616     | 532,223,625<br>503,881,916     | 0.61        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 株式<br>半導体         | INTEL CORP                           | -             | 162,912      | 2,953<br>3,063     | 481,145,334<br>498,941,541     | 0.60        |
| イギリスポンド<br>イギリス | 株式<br>石油・ガス       | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS          | -             | 101,343      | 4,706<br>4,852     | 476,908,041<br>491,715,324     | 0.59        |
| ユーロ<br>フィンランド   | 株式<br>通信          | NOKIA OYJ                            | -             | 109,331      | 4,535<br>4,458     | 495,807,885<br>487,414,544     | 0.59        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 株式<br>コンピューター     | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP | -             | 37,947       | 12,872<br>12,511   | 488,453,263<br>474,748,845     | 0.57        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 株式<br>その他金融       | JPMORGAN CHASE & CO                  | -             | 94,395       | 5,236<br>4,982     | 494,290,428<br>470,229,259     | 0.57        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 株式<br>その他金融       | CITIGROUP INC                        | -             | 138,298      | 4,637<br>3,374     | 641,228,507<br>466,655,346     | 0.56        |
| イギリスポンド<br>イギリス | 株式<br>医薬品         | GLAXOSMITHKLINE PLC                  | -             | 157,426      | 2,826<br>2,947     | 444,898,996<br>463,894,593     | 0.56        |
| ユーロ<br>スペイン     | 株式<br>通信          | TELEFONICA S.A.                      | -             | 119,843      | 3,716<br>3,752     | 445,382,137<br>449,593,004     | 0.54        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 株式<br>コンピューター     | HEWLETT-PACKARD CO                   | -             | 73,055       | 5,861<br>5,891     | 428,195,456<br>430,387,570     | 0.52        |
| ユーロ<br>ドイツ      | 株式<br>その他製造       | SIEMENS AG-REG                       | -             | 23,752       | 15,363<br>18,074   | 364,911,576<br>429,300,227     | 0.52        |



# 運用の状況について

|             |          |                    |   |         |                  |                            |      |
|-------------|----------|--------------------|---|---------|------------------|----------------------------|------|
| ユーロ<br>スペイン | 株式<br>銀行 | BANCO SANTANDER SA | - | 174,471 | 2,363<br>2,460   | 412,278,703<br>429,181,492 | 0.52 |
| ユーロ<br>ドイツ  | 株式<br>電力 | E.ON AG            | - | 17,373  | 22,630<br>24,166 | 393,149,098<br>419,830,706 | 0.51 |

## <投資証券>

| 通貨<br>国・地域      | 種類<br>業種 | 銘柄名                               | 利率(%)<br>償還期限 | 数量又は<br>券面総額 | 簿価単価(円)<br>評価単価(円) | 簿価額(円)<br>評価額(円)         | 投資比率<br>(%) |
|-----------------|----------|-----------------------------------|---------------|--------------|--------------------|--------------------------|-------------|
| オーストラリア<br>ドル   | 投資証券     | WESTFIELD GROUP                   | -             | 48,695       | 2,203              | 107,260,762              | 0.12        |
| オーストラリア         | -        | -                                 | -             | -            | 2,117              | 103,077,742              | -           |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 投資証券     | SIMON PROPERTY GROUP INC-<br>REIT | -             | 6,277        | 11,167<br>10,071   | 70,095,650<br>63,218,520 | 0.08        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 投資証券     | PROLOGIS                          | -             | 6,776        | 8,013<br>7,041     | 54,298,324<br>47,708,271 | 0.06        |
| ユーロ<br>フランス     | 投資証券     | UNIBAIL-RODAMCO                   | -             | 1,920        | 28,697<br>24,434   | 55,098,596<br>46,913,323 | 0.06        |
| イギリスポンド<br>イギリス | 投資証券     | LAND SECURITIES GROUP PLC         | -             | 12,014       | 3,532<br>3,377     | 42,438,854<br>40,577,021 | 0.05        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 投資証券     | VORNADO REALTY TRUST              | -             | 3,517        | 12,574<br>9,937    | 44,221,430<br>34,947,576 | 0.04        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 投資証券     | BOSTON PROPERTIES INC             | -             | 3,042        | 12,009<br>10,624   | 36,530,100<br>32,318,027 | 0.04        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 投資証券     | EQUITY RESIDENTIAL-REIT           | -             | 7,695        | 4,483<br>4,179     | 34,494,149<br>32,157,647 | 0.04        |
| オーストラリア<br>ドル   | 投資証券     | STOCKLAND                         | -             | 37,105       | 909                | 33,714,813               | 0.04        |
| オーストラリア         | -        | -                                 | -             | -            | 847                | 31,410,162               | -           |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 投資証券     | PUBLIC STORAGE                    | -             | 3,454        | 8,906<br>8,558     | 30,761,265<br>29,558,729 | 0.04        |
| イギリスポンド<br>イギリス | 投資証券     | BRITISH LAND COMPANY PLC          | -             | 13,451       | 2,347<br>2,130     | 31,574,474<br>28,646,937 | 0.03        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 投資証券     | HOST HOTELS & RESORTS INC         | -             | 14,223       | 2,512<br>1,936     | 35,734,455<br>27,535,500 | 0.03        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 投資証券     | GENERAL GROWTH PROPERTIES<br>INC  | -             | 5,760        | 6,073<br>4,722     | 34,979,213<br>27,200,940 | 0.03        |
| カナダドル<br>カナダ    | 投資証券     | CANADIAN OIL SANDS TRUST          | -             | 6,090        | 3,908<br>4,389     | 23,800,917<br>26,727,317 | 0.03        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 投資証券     | KIMCO REALTY CORPORATION          | -             | 6,245        | 4,797<br>4,212     | 29,959,840<br>26,304,783 | 0.03        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 投資証券     | PLUM CREEK TIMBER CO              | -             | 4,473        | 4,834<br>5,325     | 21,623,611<br>23,819,161 | 0.03        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 投資証券     | AVALONBAY COMMUNITIES INC         | -             | 2,190        | 13,204<br>10,720   | 28,916,170<br>23,476,420 | 0.03        |
| オーストラリア<br>ドル   | 投資証券     | GPT GROUP                         | -             | 56,530       | 477                | 26,956,715               | 0.03        |
| オーストラリア         | -        | -                                 | -             | -            | 410                | 23,162,387               | -           |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 投資証券     | HCP INC                           | -             | 5,525        | 3,850<br>3,904     | 21,272,794<br>21,569,213 | 0.03        |
| オーストラリア<br>ドル   | 投資証券     | GOODMAN GROUP                     | -             | 41,290       | 700                | 28,913,661               | 0.02        |
| オーストラリア         | -        | -                                 | -             | -            | 497                | 20,516,704               | -           |
| カナダドル<br>カナダ    | 投資証券     | PENN WEST ENERGY TRUST            | -             | 6,625        | 3,599<br>3,009     | 23,841,254<br>19,933,373 | 0.02        |
| オーストラリア<br>ドル   | 投資証券     | MIRVAC GROUP                      | -             | 31,010       | 577                | 17,893,911               | 0.02        |
| オーストラリア         | -        | -                                 | -             | -            | 611                | 18,950,149               | -           |
| オーストラリア<br>ドル   | 投資証券     | DB RREEF TRUST                    | -             | 94,150       | 207                | 19,524,130               | 0.02        |
| オーストラリア         | -        | -                                 | -             | -            | 197                | 18,580,936               | -           |
| イギリスポンド<br>イギリス | 投資証券     | HAMMERSON PLC                     | -             | 8,065        | 2,382<br>2,279     | 19,207,241<br>18,380,135 | 0.02        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 投資証券     | SL GREEN REALTY CORP              | -             | 1,672        | 13,327<br>10,788   | 22,282,765<br>18,038,065 | 0.02        |
| アメリカドル<br>アメリカ  | 投資証券     | VENTAS INC                        | -             | 3,505        | 4,978<br>5,083     | 17,446,791<br>17,816,264 | 0.02        |

|                |           |                             |   |        |                |                          |      |
|----------------|-----------|-----------------------------|---|--------|----------------|--------------------------|------|
| アメリカドル<br>アメリカ | 投資証券<br>- | THE MACERICH COMPANY        | - | 2,060  | 9,702<br>8,320 | 19,985,314<br>17,140,011 | 0.02 |
| アメリカドル<br>アメリカ | 投資証券<br>- | AMB PROPERTY CORPORATION    | - | 2,590  | 7,307<br>6,447 | 18,924,460<br>16,698,227 | 0.02 |
| 香港ドル<br>香港     | 投資証券<br>- | LINK REIT                   | - | 67,000 | 253<br>249     | 16,927,808<br>16,663,570 | 0.02 |
| カナダドル<br>カナダ   | 投資証券<br>- | FORDING CANADIAN COAL TRUST | - | 3,790  | 4,538<br>4,353 | 17,197,694<br>16,496,557 | 0.02 |

□ 種類別及び業種別の投資比率

| 種類別及び業種別   | 投資比率 (%) |
|------------|----------|
| 株式         | 97.28    |
| 銀行         | 10.62    |
| 石油・ガス      | 9.80     |
| 通信         | 7.03     |
| 保険         | 5.24     |
| 医薬品        | 5.15     |
| その他金融      | 4.50     |
| 電力         | 3.98     |
| 食品         | 3.39     |
| その他製造      | 3.36     |
| 小売り        | 3.34     |
| 鉱業         | 2.96     |
| コンピューター    | 2.87     |
| ソフトウェア     | 2.55     |
| メディア       | 2.53     |
| 化学         | 2.47     |
| ヘルスケア製品    | 2.02     |
| 飲料         | 1.89     |
| 半導体        | 1.56     |
| 航空宇宙・防衛    | 1.48     |
| 運輸関連       | 1.30     |
| 農業         | 1.29     |
| 石油・ガス サービス | 1.24     |
| 化粧品パーソナルケア | 1.22     |
| インターネット    | 1.20     |
| エンジニアリング建設 | 1.07     |
| 自動車 製造     | 1.07     |
| 商業サービス     | 0.98     |
| ヘルスケア・サービス | 0.90     |
| 不動産        | 0.72     |
| バイオテクノロジー  | 0.67     |
| 鉄鋼         | 0.65     |
| 電子機器       | 0.65     |
| 機械 その他     | 0.63     |
| 建築資材       | 0.62     |
| 多角産業       | 0.44     |
| 電気部品・電気機械  | 0.44     |
| 生活用品       | 0.42     |
| 繊維製品       | 0.40     |
| 宿泊施設       | 0.38     |
| パイプライン     | 0.37     |
| 自動車 部品・機器  | 0.34     |
| ガス         | 0.32     |

# 運用の状況について

|                |       |
|----------------|-------|
| 木材・紙           | 0.32  |
| 機械 建設・鉱業用      | 0.29  |
| 水道             | 0.26  |
| レジャー           | 0.22  |
| 流通・卸売業         | 0.19  |
| エンターテインメント     | 0.18  |
| 金属 加工・鉱業用      | 0.17  |
| 石炭             | 0.15  |
| その他資源          | 0.14  |
| 広告             | 0.14  |
| 航空             | 0.14  |
| 工具・工作機械        | 0.13  |
| 住宅建設           | 0.12  |
| 貯蓄貸付 ( S & L ) | 0.11  |
| OA機器           | 0.10  |
| 包装・容器          | 0.10  |
| 環境ビジネス         | 0.09  |
| 投資会社           | 0.09  |
| 家具・家電製品        | 0.08  |
| 食品サービス         | 0.07  |
| 玩具・娯楽          | 0.05  |
| 繊維             | 0.04  |
| ベンチャーキャピタル     | 0.03  |
| 家庭用品           | 0.02  |
| 造船             | 0.01  |
| 投資証券           | 1.48  |
| 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

< 有価証券指数等先物取引 >

| 国・地域 | 銘柄名                            | 種類 | 数量 | 契約額等 (円)      | 評価額 (円)       | 投資比率 (%) |
|------|--------------------------------|----|----|---------------|---------------|----------|
| アメリカ | S&P 500 FUTURES 2008-03        | 買建 | 13 | 551,906,689   | 552,697,178   | 0.67     |
| ドイツ  | DJ STOXX 50 FUTURES 2008-03    | 買建 | 74 | 458,591,656   | 458,041,678   | 0.55     |
| アメリカ | E-MINI S&P 500 FUTURES 2008-03 | 買建 | 9  | 76,078,692    | 76,527,302    | 0.09     |
| 合計   |                                |    | -  | 1,086,577,037 | 1,087,266,158 | 1.31     |

< 為替予約取引 >

| 名称     | 種類 | 契約額等 (円)    | 評価額 (円)     | 投資比率 (%) |
|--------|----|-------------|-------------|----------|
| アメリカドル | 買建 | 371,009,672 | 374,552,040 | 0.45     |
| ユーロ    | 買建 | 264,539,592 | 268,440,230 | 0.32     |
| 合計     |    | 635,549,264 | 642,992,270 | 0.77     |

## 財務ハイライト情報

- (1) 以下の情報は、有価証券届出書「第三部 ファンドの詳細情報 第4 ファンドの経理状況」に記載されている「財務諸表」から抜粋して記載したものです。
- (2) 「財務諸表」については、あらた監査法人による監査を受けております。また、当該監査法人による監査報告書は、有価証券届出書「第三部 ファンドの詳細情報 第4 ファンドの経理状況」に記載されている「財務諸表」に添付されています。

## 世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型

## &lt;貸借対照表&gt;

(単位:円)

| 科 目         | 期 別      | 前期                | 当期              |
|-------------|----------|-------------------|-----------------|
|             |          | 平成19年6月15日現在      | 平成19年12月17日現在   |
|             | 注記<br>番号 | 金 額               | 金 額             |
| 資産の部        |          |                   |                 |
| 流動資産        |          |                   |                 |
| コール・ローン     |          | 2,650,227,479     | 3,070,790,594   |
| 親投資信託受益証券   |          | 126,388,082,335   | 160,581,487,953 |
| 流動資産合計      |          | 129,038,309,814   | 163,652,278,547 |
| 資産合計        |          | 129,038,309,814   | 163,652,278,547 |
| 負債の部        |          |                   |                 |
| 流動負債        |          |                   |                 |
| 未払収益分配金     |          | 722,002,404       | 1,089,130,278   |
| 未払解約金       |          | 10,459,279        | 153,183,964     |
| 未払受託者報酬     |          | 5,368,566         | 7,512,727       |
| 未払委託者報酬     |          | 96,634,396        | 135,229,246     |
| その他未払費用     |          | 232,282           | 16,540,426      |
| 流動負債合計      |          | 834,696,927       | 1,401,596,641   |
| 負債合計        |          | 834,696,927       | 1,401,596,641   |
| 純資産の部       |          |                   |                 |
| 元本等         |          |                   |                 |
| 元本          |          | 106,218,996,782   | 155,728,854,096 |
| 剰余金         |          |                   |                 |
| 期末剰余金       |          | 21,984,616,105    | 6,521,827,810   |
| (うち分配準備積立金) |          | ( 4,850,521,336 ) | ( 233,360,629 ) |
| 剰余金合計       |          | 21,984,616,105    | 6,521,827,810   |
| 元本等合計       |          | 128,203,612,887   | 162,250,681,906 |
| 純資産合計       |          | 128,203,612,887   | 162,250,681,906 |
| 負債・純資産合計    |          | 129,038,309,814   | 163,652,278,547 |

# 運用の状況について

## < 損益及び剰余金計算書 >

(単位：円)

| 科目                  | 期別 | 注記<br>番号 | 前期                          | 当期                          |
|---------------------|----|----------|-----------------------------|-----------------------------|
|                     |    |          | 自平成18年12月16日<br>至平成19年6月15日 | 自平成19年6月16日<br>至平成19年12月17日 |
|                     |    |          | 金額                          | 金額                          |
| 営業収益                |    |          |                             |                             |
| 受取利息                |    |          | 3,753,448                   | 7,569,243                   |
| 有価証券売買等損益           |    |          | 5,148,596,094               | 16,001,204,182              |
| 営業収益合計              |    |          | 5,152,349,542               | 15,993,634,939              |
| 営業費用                |    |          |                             |                             |
| 受託者報酬               |    |          | 21,455,681                  | 41,461,635                  |
| 委託者報酬               |    |          | 386,203,357                 | 746,310,595                 |
| その他費用               |    |          | 1,116,354                   | 21,265,668                  |
| 営業費用合計              |    |          | 408,775,392                 | 809,037,898                 |
| 営業利益金額              |    |          | 4,743,574,150               | -                           |
| 営業損失金額              |    |          | -                           | 16,802,672,837              |
| 経常利益金額              |    |          | 4,743,574,150               | -                           |
| 経常損失金額              |    |          | -                           | 16,802,672,837              |
| 当期純利益金額             |    |          | 4,743,574,150               | -                           |
| 当期純損失金額             |    |          | -                           | 16,802,672,837              |
| 当期一部解約に伴う当期純損失金額分配額 |    |          | 4,386,350                   | 85,549,373                  |
| 期首剰余金               |    |          | 5,000,736,936               | 21,984,616,105              |
| 剰余金増加額              |    |          | 15,715,001,419              | 7,878,695,097               |
| (当期一部解約に伴う剰余金増加額)   |    |          | (-)                         | (-)                         |
| (当期追加信託に伴う剰余金増加額)   |    |          | (15,715,001,419)            | (7,878,695,097)             |
| 剰余金減少額              |    |          | 461,407,111                 | 633,157,452                 |
| (当期一部解約に伴う剰余金減少額)   |    |          | (461,407,111)               | (633,157,452)               |
| (当期追加信託に伴う剰余金減少額)   |    |          | (-)                         | (-)                         |
| 分配金                 |    |          | 3,017,675,639               | 5,991,202,476               |
| 期末剰余金               |    |          | 21,984,616,105              | 6,521,827,810               |

## < 重要な会計方針に係る事項に関する注記 >

| 項目                         | 期別 | 前期   | 当期   |
|----------------------------|----|--|--|
|                            |    | 自平成18年12月16日<br>至平成19年6月15日                      | 自平成19年6月16日<br>至平成19年12月17日  |
| 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<br>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。 | 親投資信託受益証券<br>同左  |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 |    | -  | 当ファンドの計算期間は原則として、毎月16日から翌月15日までとなり、毎月6ヶ月未満のため、財務諸表を6ヶ月毎に作成しております。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、当特定期間は平成19年6月16日から平成19年12月17日までとなっております。 |



## 約款

<追加型証券投資信託 世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型>

## 運用の基本方針

約款第21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、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長を目標として運用を行ないます。

## 運用方法

## (1)投資対象

投資信託証券(投資信託または外国投資信託の受益証券(振替投資信託受益権を含みます。))および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。)を主要投資対象とします。

## (2)投資態度

主として、以下に掲げる各証券投資信託の受益証券に投資を行ない、安定した収益の確保と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。

各マザーファンドの受益証券への投資比率は、原則として、信託財産の純資産総額の6分の1を基本としますが、資金動向やその見通し等によっては5%から25%の範囲内で組入率を変更する場合があります。

証券投資信託 日本リートインデックスJ-REITマザーファンド

証券投資信託 海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド

証券投資信託 日本債券インデックスマザーファンド

証券投資信託 海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド

証券投資信託 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-KOKUSA(ヘッジなし)マザーファンド

特に「日本リートインデックスJ-REITマザーファンド」や「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」においては、投資対象としている資産の流動性が他のマザーファンドと比べて相対的に低い場合、資金の流入に備える場合や純資産規模が大きくなった場合等には両マザーファンドの組入率をそれぞれ5%を下限として引き下げることがあります。両マザーファンドの組入率を引き下げた場合には、現金の比率を高くする場合や他のマザーファンドの組入率をそれぞれ25%を上限に引き上げる場合があります。

また、組入率はファンド全体として国内資産の実質組入率と海外資産の実質組入率が概ね50%程度ずつになるように決定します。

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)投資信託証券、短期社債等(社債等の振替に関する法律(政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。))第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。)、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。

(2)有価証券先物取引等の派生商品取引の指図ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れの指図は行ないません。

(3)投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。

(4)同一銘柄の投資信託証券への実質投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の50%以下とします。ただし、不動産投信(社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。)の投資信託証券については、同一銘柄への実質投資割合を、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

(5)外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

(6)外国為替の売買の予約取引の指図は、約款第24条の範囲で行ないません。

# そ の 他

## 収益分配方針

第1計算期から第3計算期までは、収益分配を行いません。第4計算期以降、毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行いません。

### 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。

### 分配対象額についての分配方針

分配金額は、委託者が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことを目指します。

### 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（無分配期の利益を含みます。）については、運用の基本方針に基づき運用を行いません。

## 追加型証券投資信託 世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型 約款

(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、日興シティ信託銀行株式会社を受託者とします。

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100万円を、受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者は、これを引き受けません。

委託者は、受託者と合意の上、金30兆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。

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44条、第45条第1項、第46条第1項および第48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 この信託にかか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100万口に、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。

委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議の上、同法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。

(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、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産を法令および社団法人投資信託協会規則に従って時価評価し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。

第24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、社債等の振替に関する法律(政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。)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。)

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



# そ の 他

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わないものとします。

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、社振法の規定にしたがい、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。

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日現在の全ての受益権（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、当該一部解約にかか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まず。）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。ただし、保護預かりではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行なうものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券（当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日にかかる収益分配金交付票を含みます。）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41条に規定する委託者の指定する口座管理機関、委託者の指定する証券会社（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応ずることができるものとします。なお、第40条第3項に規定する収益分配金の再投資にかか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応ずることができます。また、受益権の取得申込者がその申込をしようとする場合において、委託者に対し、当該取得の申込にかかる受益権について、第40条第3項に規定する収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込をしないことを申し出たときは、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応ずることができるものとします。

委託者の指定する証券会社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、その取得申込者に対し、委託者の指定する証券会社または委託者の指定する登録金融機関が定める単位をもって取得の申込に応ずることができます。ただし、委託者の指定する証券会社または委託者の指定する登録金融機関と別に定める自動けいぞく投資契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に限り、1口の整数倍をもって取得の申込に応ずることができます。

前2項の取得申込者は、委託者、委託者の指定する証券会社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予め、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41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。）、委託者の指定する証券会社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5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。

第1項および第2項の規定にかかわらず、取得申込日がニューヨーク証券取引所の休業日またはニューヨークの銀行休業日に該当する場合は、受益権の取得の申込に応じないものとします。

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かかる受益証券の価額は、1口につき1円に、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。

前項の手数は、委託者、委託者の指定する証券会社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。

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っては、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。）にあっては、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っては、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かか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っては、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、委託者の指定する証券会社または委託者の指定する登録金融機関でこの信託にかかる受益権の取得申込をする場合の1口当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っては、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に、取得申込を行なう委託者、委託者の指定する証券会社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。

なお、委託者、委託者の指定する証券会社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。

第5項の規定にかかわらず、受益者が第40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34条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

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、委託者の指定する証券会社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かか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、委託者の指定する証券会社または委託者の指定する登録金融機関でこの信託にかか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、委託者の指定する証券会社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。

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号口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12条 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。

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え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13条 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。

（無記名式の受益証券の再交付）

第14条 （削除）

（記名式の受益証券の再交付）



# そ の 他

第15条 (削 除)

( 毀損した場合等の再交付 )

第16条 (削 除)

( 受益証券の再交付の費用 )

第17条 (削 除)

( 投資の対象とする資産の種類 )

第18条 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. 金銭債権
3. 約束手形

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19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、日興シティ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 日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド 受益証券
2. 証券投資信託 海外リートインデックス ( ヘッジなし ) マザーファンド 受益証券
3. 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
4. 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
5. 証券投資信託 日本株式インデックスト O P I Xマザーファンド 受益証券
6. 証券投資信託 海外株式インデックスM S C I - K O K U S A I ( ヘッジなし ) マザーファンド 受益証券
7. 短期社債等 ( 社振法第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。 ) およびコマーシャル・ペーパー
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券の性質を有するもの
9. 投資信託または外国投資信託の受益証券 ( 金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。 )
10. 投資証券もしくは投資法人債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。 )
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。 )

なお、第9号および第10号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

( 受託者の自己または利害関係人等との取引 )

第20条 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25条において同じ。 ) 、第25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18条ならびに第19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。

前項の取扱いは、第22条、第24条、第29条および第30条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21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したがって、その指図を行いません。

(同一銘柄の投資信託証券への投資制限)

第22条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の投資信託証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。

前項の規定にかかわらず、不動産投信の投資信託証券については、同一銘柄の時価総額とマザーファンドに属する当該銘柄の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の30を超えることとなる投資の指図をしないこととします。

前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当該有価証券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23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)

第24条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額と投資信託証券の信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する投資信託証券の時価総額に当該投資信託証券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25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

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。

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26条 (削除)

(混蔵寄託)

第27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

# そ の 他

蔵寄託することができるものとします。

( 信託財産の登記等および記載等の留保等 )

第28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。

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ます。

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あります。

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あります。

( 一部解約の請求および有価証券の売却等の指図 )

第29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かかる信託契約の一部解約の請求および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30条 委託者は、前条の規定による一部解約金の代金および売却代金、有価証券に係る償還金等、有価証券等に係る利子等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31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ます。

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

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ます。

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。

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32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33条 信託財産に属する有価証券について、借替がある場合で、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。

信託財産に属する有価証券に係る償還金等、有価証券等に係る利子等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。

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34条 この信託の計算期間は、毎月16日から翌月15日までとすることを原則とします。

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ます。ただし、第1計算期間は平成17年9月29日から平成17年10月17日までとし、



最終計算期間の終了日は第3条に定める信託期間の終了日とします。

(信託財産に関する報告)

第35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。

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36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(第2項各号に掲げる諸費用を含め、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。

前項に定める諸費用のほか、以下の諸費用(消費税等相当額を含みます。)は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁することができます。

1. 受益証券の発行および管理事務に係る費用(券面の作成、印刷、発行および交付に係る費用ならびに印紙税を含みます。)
2. 有価証券届出書、有価証券報告書および臨時報告書(これらの訂正に係る書類を含みます。)の作成、印刷および提出に係る費用
3. 目論見書および仮目論見書(これらの訂正事項分を含みます。)の作成、印刷および交付に係る費用(これらを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。)
4. 信託約款の作成、印刷および交付に係る費用(これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。)
5. 運用報告書の作成、印刷および交付に係る費用(これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。)
6. この信託の受益者に対して行なう公告に係る費用ならびに信託約款の変更または信託契約の解約に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用
7. 格付の取得に要する費用
8. この信託の監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用

委託者は、前項に定める諸費用の支払いを信託財産のために行ない、支払金額の支弁を信託財産から受けることができ、また、現に信託財産のために支払った金額の支弁を受けることについて、あらかじめ受領する金額に上限を付することができます。この場合、委託者は、信託財産の規模等を考慮して、かかる上限額を定期的に見直すことができます。

前項に基づいて実際に支払った金額の支弁を受ける代わりに、委託者は、かかる諸費用の金額をあらかじめ合理的に見積もった上で、実際の費用額にかかわらず、合理的な見積率により計算した金額を諸費用とみなして、その支弁を信託財産から受けることもできます。この場合、委託者は、かかる見積率に上限を付することとし、その上限の範囲内で、かかる見積率を何時にても見直すことができるものとします。

前項の場合において、第2項に定める諸費用としてみなす額は、信託財産の純資産総額に見積率(前項に規定する見積率の上限は、年万分の10とします。)を乗じて得た額とし、第34条に規定する計算期間を通じて毎日計上され、委託者が定めた時期に信託財産中から支弁するものとします。

(信託報酬等の額)

第37条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第34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95の率を乗じて得た額とします。

前項の信託報酬は、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。

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38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。ただし、第1、第2および第3計算期末には、収益の分配は行ないません。

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。なお、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

# そ の 他

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。なお、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。

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。

(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39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(第1計算期から第3計算期までを除きます。)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40条第4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40条第5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。

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。

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第40条 収益分配金は、第1、第2および第3計算期を除く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、毎計算期間の末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(当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末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41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。)、委託者の指定する証券会社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、平成19年1月4日以降においても、第42条に規定する時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、当該収益分配金交付票と引き換えに受益者に支払います。

前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、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(第1計算期から第3計算期までを除きます。)の翌営業日に収益分配金が委託者の指定する証券会社および委託者の指定する登録金融機関に支払われます。この場合、委託者の指定する証券会社および委託者の指定する登録金融機関は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかか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項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。ただし、第43条第4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、第1項の規定に準じて受益者に支払います。

委託者は、第1項の規定にかかわらず、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する収益分配金(受益者が自己の有する受益権の全部もしくは一部の口数について、委託者に対し、この信託の収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込をしないことをあらかじめ申し出た場合において、委託者が、当該申し出を受け付けた受益権に帰属する収益分配金を除きます。)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かか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項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。ただし、第43条第4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、第1項の規定に準じて受益者に支払います。

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かか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41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。)、委託者の指定する証券会社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、社振法の規定にしたが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。

一部解約金は、第43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。

前各項に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する証券会社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、ただし、委託者の自ら



の募集にかかる受益権に帰属する収益分配金、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ます。

収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、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ます。

(委託者の自らの募集にかかる受益権の口座管理機関)

第41条 委託者は、委託者の自らの募集にかかる受益権について、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。

(収益分配金および償還金の時効)

第42条 受益者が、収益分配金については第40条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については第40条第4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43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。

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、委託者の指定する証券会社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ます。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、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとします。

前2項の規定にかかわらず、一部解約の実行の請求日がニューヨーク証券取引所の休業日またはニューヨークの銀行休業日に該当する場合は、受益権の一部解約の実行を受け付けないものとします。

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、社振法の規定にしたが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。

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0.2%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。

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。

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(この計算日が第3項に規定する一部解約の請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の一部解約の請求を受け付けることができる日とします。)を一部解約の実行の請求日として、第5項の規定に準じて算定した価額とします。

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44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43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かかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受け付け、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したがって取り扱われます。

(信託契約の解約)

第44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。

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全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。

# そ の 他

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。

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ないません。

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全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。

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45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、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

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49条の規定にしたがうものとします。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第46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。

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49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47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。

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48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49条の規定にしたがい新受託者を選任します。

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49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。

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全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。

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。

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。

委託者は、前項の規定により信託約款の変更を行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全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50条 第44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44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51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52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「自動けいぞく投資契約」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証券会社および委託者の指定する登録金融機関が締結する「自動けいぞく投資契約」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、「自動けいぞく投資契約」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条 第40条第7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。

第3条 平成18年12月29日現在の信託約款第9条、第10条および第12条から第17条まで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。

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17年9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

東京都品川区東品川二丁目3番14号  
受託者 日興シティ信託銀行株式会社



# そ の 他

## 用語集

投資信託の基本的な用語を簡潔にまとめたもので、特定のファンドの解説を目的としたものではありません。

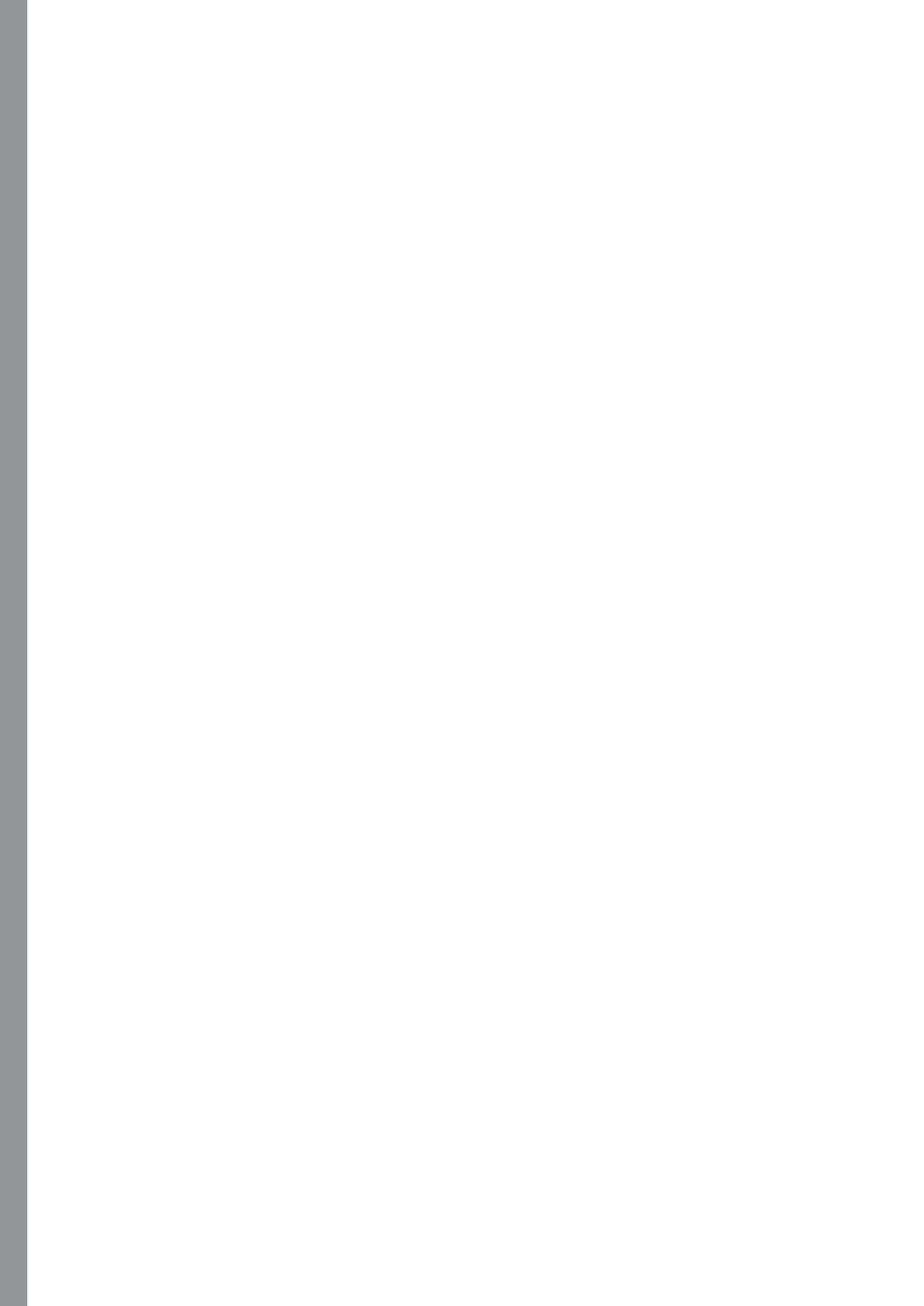
|   |   |
|---|---|
| <b>委託会社(委託者)</b><br>いたくがいしゃ(いたくしゃ)                | 投資信託の運用を行なう会社です。  |
| <b>解約価額</b><br>かいやくかがく                            | 投資信託を解約請求によって換金する時の価額で、基準価額から信託財産留保額を差し引いた価額のことです。  |
| <b>解約請求(解約)</b><br>かいやくせいきゅう(かいやく)                | 投資信託の換金方法の一つで、受益者が販売会社を通じて委託会社に解約を請求する方法のことです。(なお、受益者が販売会社に受益権の買取りを請求する換金方法を買取請求(買取)といいます。)   |
| <b>繰上償還</b><br>くりあげしょうかん                          | 信託期間を繰り上げて信託(運用)を終了させることです。   |
| <b>個別元本超過額</b><br>こべつがんばんちようかがく                   | 解約価額から各受益者の個別元本を差し引いた額のことです。償還金・解約金を受け取る場合、個別元本超過額が所得税および地方税の課税対象となります。   |
| <b>自動けいぞく投資</b><br>じどうけいぞくとうし                     | 販売会社と受益者との契約により、税引き後の収益分配金を無手数料で自動的に再投資することをいいます。なお、販売会社により取扱いできない場合や一部異なる場合があります。  |
| <b>収益分配</b><br>しゅうえきぶんぱい                          | 投資信託の決算期末に、運用によって得た収益などを保有口数に応じて受益者に分配することです。また、その分配される金額を収益分配金または分配金といいます。   |
| <b>受益者</b><br>じゆえきしゃ                              | 投資信託を購入した投資家のことです。  |
| <b>純資産総額</b><br>じゆんしさんそうがく                        | 信託財産の総額(信託財産に属する資産を時価などで評価して得た金額)から負債総額(運用に必要な費用などのコスト)を控除した金額のことです。  |
| <b>償還</b><br>しょうかん                                | 投資信託の信託契約を解約し、信託(運用)を終了することです。  |
| <b>信託期間</b><br>しんたくきかん                            | 信託財産を運用する期間のことで、運用開始日(設定日)から運用終了日(償還日)までのことです。  |
| <b>信託財産</b><br>しんたくざいさん                           | 投資信託が保有するすべての資産(組入る有価証券、現金など)のことです。   |
| <b>ファンドマネージャー</b>                                 | 投資信託の運用を行なう人(金融資産を運用する専門家)のことです。  |
| <b>ポートフォリオ</b>                                    | 株式や債券など、複数の資産や銘柄の組み合わせ、あるいはそうした資産構成のことです。   |
| <b>目論見書(投資信託説明書)</b><br>もくろみしょ<br>(とうししんたくせつめいしょ) | 投資家に交付することが義務づけられている投資信託の説明資料です。投資家が投資信託を購入するにあたって知っておくべき重要な情報(特色、運用方針、信託報酬、手数料など)が記載されています。目論見書には、お申込みの際にあらかじめまたは同時に投資家に交付される「交付目論見書」と、投資家から請求があった場合に交付される「請求目論見書」があります。 |
| <b>約款(信託約款)</b><br>やっかん(しんたくやっかん)                 | 投資信託の仕組みや運営、管理などの詳細について規定したものをいいます。委託会社と受託会社は、この信託約款に基づいて信託契約を締結しています。  |
| <b>リスクとリターン</b>                                   | 投資によって得られる収益をリターンといい、その収益を獲得するにあたっての不確実性をリスクといいます。一般的にリスクが高いとリターンは高く、その逆にリスクが低いとリターンは低くなります。  |

**日興アセットマネジメントの照会先**  
ホームページアドレス <http://www.nikkoam.com/>  
**☎ 0120-25-1404**  
午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。(半休日となる場合は午前9時～正午)









# 世界の財産3分法ファンド

(不動産・債券・株式)

毎月分配型

ファンド・オブ・ファンズ／自動けいぞく投資適用

設定・運用は

**日興アセットマネジメント**

本書は金融商品取引法第13条の規定に基づき、投資家の請求により交付される目論見書です。

「世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型」（マザーファンドを含みます。）は、主に投資信託証券に投資を行ない、投資対象とする投資信託証券は、主に不動産、債券および株式など値動きのある資産（外貨建資産は為替変動リスクもあります。）を投資対象としているため、基準価額は変動します。したがって、元金を割り込むことがあります。

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。

この目論見書により行なう「世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型」の募集については、委託会社は、証券取引法（現 金融商品取引法）（昭和23年法第25号）第5条の規定により有価証券届出書を平成19年9月14日に関東財務局長に提出しており、平成19年9月15日にその効力が発生しております。また、同法第7条の規定により有価証券届出書の訂正届出書を平成19年11月19日および平成20年3月14日に関東財務局長に提出しております。

## - 目 次 -

|                  | 頁  |
|------------------|----|
| 第1 【ファンドの沿革】     | 1  |
| 第2 【手続等】         | 1  |
| 1 【申込（販売）手続等】    |    |
| 2 【換金（解約）手続等】    |    |
| 第3 【管理及び運営】      | 3  |
| 1 【資産管理等の概要】     |    |
| (1) 【資産の評価】      |    |
| (2) 【保管】         |    |
| (3) 【信託期間】       |    |
| (4) 【計算期間】       |    |
| (5) 【その他】        |    |
| 2 【受益者の権利等】      |    |
| 第4 【ファンドの経理状況】   | 5  |
| 1 【財務諸表】         |    |
| (1) 【貸借対照表】      |    |
| (2) 【損益及び剰余金計算書】 |    |
| (3) 【注記表】        |    |
| (4) 【附属明細表】      |    |
| 2 【ファンドの現況】      |    |
| 【純資産額計算書】        |    |
| 第5 【設定及び解約の実績】   | 66 |

## 第1【ファンドの沿革】

平成 17 年 9 月 29 日 ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

平成 18 年 3 月 9 日 ファンド名称変更

新名称：世界の財産 3 分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型

旧名称：世界の財産 3 分法ファンド（バランス重視）毎月分配型

## 第2【手続等】

### 1【申込（販売）手続等】

#### （1）申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

#### （2）コースの選択

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

##### ＜分配金再投資コース＞

・収益分配金を自動的に再投資するコースです。

・なお、販売会社によっては、収益分配金を定期的に受け取るための「定期引出契約」を結ぶことができる場合があります。

##### ＜分配金受取りコース＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

#### （3）申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

#### （4）取扱時間

原則として、午後 3 時（わが国の金融商品取引所が半休日となる場合は午前 11 時）までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

#### （5）取得申込不可日

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

#### （6）申込金額

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

#### （7）申込単位

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

##### ＜委託会社の照会先＞

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前 9 時～午後 5 時 土、日、祝・休日は除きます。

（半休日となる場合は午前 9 時～正午）

#### （8）申込代金の支払い

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

#### （9）受付の中止および取消

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

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



(10) 償還乗換

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

(11) 乗換優遇

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

## 2【換金（解約）手続等】

### < 解約請求による換金 >

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

原則として、午後3時（わが国の金融商品取引所が半休日となる場合は午前11時）までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

(3) 解約請求不可日

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

(4) 解約制限

ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(5) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額（当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た額）を控除した価額とします。

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

### < 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

（半休日となる場合は午前9時～正午）

(6) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額から所得税および地方税（当該解約価額が受益者毎の個別元本を超過した額に対し10%（内国法人は所得税のみの7%））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。

(7) 解約単位

1口単位

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

( 8 ) 解約代金の支払い

手取額は、原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

( 9 ) 受付の中止および取消

- ・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
- ・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

第3【管理及び運営】

1【資産管理等の概要】

( 1 )【資産の評価】

基準価額の算出

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

有価証券などの評価基準

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

< 主な資産の評価方法 >

投資信託証券（国内籍）

原則として、基準価額計算日の基準価額で評価します。

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

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。

（半休日となる場合は午前9時～正午）

( 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17年9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】

毎月16日から翌月15日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とします。

## (5)【その他】

### 信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
  - イ) 受益者の解約により受益権の口数が10億口を下回る事となった場合
  - 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ないません。
- 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。）
  - ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 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。

### 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。

### 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。

### 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することができます。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きは、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なわない場合は、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。

## 公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

## 運用報告書の作成

委託会社は、年2回（6月、12月）および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成し、あらかじめ届出を受けた住所に販売会社よりお届けします。

## 関係法人との契約について

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

## 2【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4【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、改正前の「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- （2） 当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。
- （3） 当ファンドは、平成18年12月16日から平成19年6月15日までの特定期間の財務諸表については、旧証券取引法第193条の2の規定に、また、平成19年6月16日から平成19年12月17日までの特定期間の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、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19年7月24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

代表社員 公認会計士  
業務執行社員

業務執行社員 公認会計士

松 裕一  
鳥飼 裕一



当監査法人は、証券取引法第193条の2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」に掲げられている世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の平成18年12月16日から平成19年6月15日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の平成19年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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



# 独立監査人の監査報告書

平成20年1月22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  
業務執行社員

蔡 秋

指定社員 公認会計士  
業務執行社員

鳥飼裕一

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」に掲げられている世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の平成19年6月16日から平成19年12月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の平成19年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

1【財務諸表】

世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型

(1)【貸借対照表】

| 科目          | 期別 | (単位：円)             |                     |
|-------------|----|--------------------|---------------------|
|             |    | 前期<br>平成19年6月15日現在 | 当期<br>平成19年12月17日現在 |
| 資産の部        |    |                    |                     |
| 流動資産        |    |                    |                     |
| コール・ローン     |    | 2,650,227,479      | 3,070,790,594       |
| 親投資信託受益証券   |    | 126,388,082,335    | 160,581,487,953     |
| 流動資産合計      |    | 129,038,309,814    | 163,652,278,547     |
| 資産合計        |    | 129,038,309,814    | 163,652,278,547     |
| 負債の部        |    |                    |                     |
| 流動負債        |    |                    |                     |
| 未払収益分配金     |    | 722,002,404        | 1,089,130,278       |
| 未払解約金       |    | 10,459,279         | 153,183,964         |
| 未払受託者報酬     |    | 5,368,566          | 7,512,727           |
| 未払委託者報酬     |    | 96,634,396         | 135,229,246         |
| その他未払費用     |    | 232,282            | 16,540,426          |
| 流動負債合計      |    | 834,696,927        | 1,401,596,641       |
| 負債合計        |    | 834,696,927        | 1,401,596,641       |
| 純資産の部       |    |                    |                     |
| 元本等         |    |                    |                     |
| 元本          |    | 106,218,996,782    | 155,728,854,096     |
| 剰余金         |    |                    |                     |
| 期末剰余金       |    | 21,984,616,105     | 6,521,827,810       |
| (うち分配準備積立金) |    | (4,850,521,336)    | (233,360,629)       |
| 剰余金合計       |    | 21,984,616,105     | 6,521,827,810       |
| 元本等合計       |    | 128,203,612,887    | 162,250,681,906     |
| 純資産合計       |    | 128,203,612,887    | 162,250,681,906     |
| 負債・純資産合計    |    | 129,038,309,814    | 163,652,278,547     |

(2)【損益及び剰余金計算書】

| 科目                  | 期別 | (単位：円)                            |                                   |
|---------------------|----|-----------------------------------|-----------------------------------|
|                     |    | 前期<br>自平成18年12月16日<br>至平成19年6月15日 | 当期<br>自平成19年6月16日<br>至平成19年12月17日 |
| 営業収益                |    |                                   |                                   |
| 受取利息                |    | 3,753,448                         | 7,569,243                         |
| 有価証券売買等損益           |    | 5,148,596,094                     | 16,001,204,182                    |
| 営業収益合計              |    | 5,152,349,542                     | 15,993,634,939                    |
| 営業費用                |    |                                   |                                   |
| 受託者報酬               |    | 21,455,681                        | 41,461,635                        |
| 委託者報酬               |    | 386,203,357                       | 746,310,595                       |
| その他費用               |    | 1,116,354                         | 21,265,688                        |
| 営業費用合計              |    | 408,775,392                       | 809,037,898                       |
| 営業利益金額              |    | 4,743,574,150                     | -                                 |
| 営業損失金額              |    | -                                 | 16,802,672,837                    |
| 経常利益金額              |    | 4,743,574,150                     | -                                 |
| 経常損失金額              |    | -                                 | 16,802,672,837                    |
| 当期純利益金額             |    | 4,743,574,150                     | -                                 |
| 当期純損失金額             |    | -                                 | 16,802,672,837                    |
| 当期一部解約に伴う当期純損失金額分配額 |    | 4,386,350                         | 85,549,373                        |
| 期首剰余金               |    | 5,000,736,936                     | 21,984,616,105                    |
| 剰余金増加額              |    | 15,715,001,419                    | 7,878,685,097                     |
| (当期一部解約に伴う剰余金増加額)   |    | (-)                               | (-)                               |
| (当期追加信託に伴う剰余金増加額)   |    | (15,715,001,419)                  | (7,878,685,097)                   |
| 剰余金減少額              |    | 461,407,111                       | 633,157,452                       |
| (当期一部解約に伴う剰余金減少額)   |    | (461,407,111)                     | (633,157,452)                     |
| (当期追加信託に伴う剰余金減少額)   |    | (-)                               | (-)                               |
| 分配金                 |    | 3,017,675,639                     | 5,991,202,476                     |
| 期末剰余金               |    | 21,984,616,105                    | 6,521,827,810                     |

( 3 ) 【注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

| 項目                         | 期別                            | 前期   | 当期   |
|----------------------------|-------------------------------|--|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 自 平成18年12月16日<br>至 平成19年6月15日 | 精投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき当該期投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 | 精投資信託受益証券<br>同左  |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 |                               |  | 当ファンドの計算期間は原則として、毎月16日から翌月15日までとなっており6ヶ月未満のため、財務諸表を6ヶ月毎に作成しております。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したしますのて、当特定期間は平成19年6月16日から平成19年12月17日までとなっております。 |

( 貸借対照表に関する注記 )

|                      | 前期                | 当期                |
|----------------------|-------------------|-------------------|
|                      | 平成19年6月15日現在      | 平成19年12月17日現在     |
| 1. 期首元本額             | 32,381,426,324 円  | 106,218,996,782 円 |
| 期中追加設定元本額            | 76,066,618,738 円  | 54,714,957,440 円  |
| 期中解約元本額              | 2,229,048,280 円   | 5,205,100,126 円   |
| 2. 当特定期間末日における受益権の総数 | 106,218,996,782 口 | 155,728,854,096 口 |

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

|                            | 前期                            | 当期                            |
|----------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
|                            | 自 平成18年12月16日<br>至 平成19年6月15日 | 自 平成19年6月16日<br>至 平成19年12月17日 |
| 分配金の計算過程                   | 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      | 115,585,417 円                 | 262,478,387 円                 |
| B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等増益 | 815,614,792 円                 | 0 円                           |
| C 信託約款に定める収益調整金            | 5,528,722,048 円               | 22,892,337,706 円              |
| D 信託約款に定める分配準備積立金          | 1,473,865,405 円               | 4,829,557,385 円               |
| E 分配対象収益 ( A + B + C + D ) | 7,933,787,662 円               | 27,984,373,478 円              |
| F 分配対象収益 ( 1口当たり )         | 0.1830 円                      | 0.2290 円                      |
| G 分配金額                     | 258,032,327 円                 | 2,290 円                       |
| H 分配金額 ( 1口当たり )           | 0.0060 円                      | 0.0070 円                      |
| 分配金に加算した外国支払税              | 2,050,626 円                   | 9,931,855 円                   |

|                              | 自 平成19年1月16日<br>至 平成19年2月15日 | 自 平成19年3月16日<br>至 平成19年4月15日 | 自 平成19年4月16日<br>至 平成19年5月15日 | 自 平成19年5月16日<br>至 平成19年6月15日 | 自 平成19年6月16日<br>至 平成19年7月15日 | 自 平成19年7月16日<br>至 平成19年8月15日 |
|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|
| A 計算期末における費用控除後の配当等収益        | 106,800,576 円                | 79,874,899 円                 | 262,214,176 円                | 262,214,176 円                | 262,214,176 円                | 458,531,921 円                |
| B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等増益   | 3,015,225,638 円              | 0 円                          | 0 円                          | 0 円                          | 0 円                          | 0 円                          |
| C 信託約款に定める収益調整金              | 7,978,645,909 円              | 10,584,239,113 円             | 13,113,387,252 円             | 13,113,387,252 円             | 13,113,387,252 円             | 28,981,161,030 円             |
| D 信託約款に定める分配準備積立金            | 2,134,918,013 円              | 4,812,984,999 円              | 4,405,716,137 円              | 4,405,716,137 円              | 4,405,716,137 円              | 2,627,172,490 円              |
| E 分配対象収益 ( A + B + C + D )   | 13,235,690,136 円             | 15,477,159,011 円             | 17,781,317,565 円             | 17,781,317,565 円             | 17,781,317,565 円             | 32,066,865,441 円             |
| F 分配対象収益 ( 1口当たり )           | 0.2352 円                     | 0.2272 円                     | 0.2238 円                     | 0.2238 円                     | 0.2238 円                     | 0.2143 円                     |
| G 分配金額                       | 389,547,644 円                | 2,272 円                      | 2,238 円                      | 2,238 円                      | 2,238 円                      | 2,143 円                      |
| H 分配金額 ( 1口当たり )             | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     |
| 分配金に加算した外国支払税                | 70 円                         | 70 円                         | 70 円                         | 70 円                         | 70 円                         | 70 円                         |
| 分配金に加算した外国支払税                | 4,259,681 円                  | 2,855,587 円                  | 2,855,587 円                  | 2,855,587 円                  | 2,855,587 円                  | 3,492,854 円                  |
| 自 平成19年2月16日<br>至 平成19年3月15日 |                              |                              |                              |                              |                              |                              |
| A 計算期末における費用控除後の配当等収益        | 79,874,899 円                 | 0 円                          | 0 円                          | 0 円                          | 0 円                          | 0 円                          |
| B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等増益   | 0 円                          | 0 円                          | 0 円                          | 0 円                          | 0 円                          | 0 円                          |
| C 信託約款に定める収益調整金              | 10,584,239,113 円             | 4,812,984,999 円              | 4,405,716,137 円              | 4,405,716,137 円              | 4,405,716,137 円              | 27,983,088,004 円             |
| D 信託約款に定める分配準備積立金            | 4,812,984,999 円              | 15,477,159,011 円             | 15,477,159,011 円             | 15,477,159,011 円             | 15,477,159,011 円             | 31,632,464,924 円             |
| E 分配対象収益 ( A + B + C + D )   | 15,477,159,011 円             | 20,272 円                     | 2,272 円                      | 2,272 円                      | 2,272 円                      | 0.2182 円                     |
| F 分配対象収益 ( 1口当たり )           | 0.2272 円                     | 2,272 円                      | 2,272 円                      | 2,272 円                      | 2,272 円                      | 2,182 円                      |
| G 分配金額                       | 473,904,085 円                | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 1,011,165,226 円              |
| H 分配金額 ( 1口当たり )             | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     |
| 分配金に加算した外国支払税                | 70 円                         | 70 円                         | 70 円                         | 70 円                         | 70 円                         | 70 円                         |
| 分配金に加算した外国支払税                | 4,259,681 円                  | 2,855,587 円                  | 2,855,587 円                  | 2,855,587 円                  | 2,855,587 円                  | 3,492,854 円                  |
| 自 平成19年3月16日<br>至 平成19年4月15日 |                              |                              |                              |                              |                              |                              |
| A 計算期末における費用控除後の配当等収益        | 79,874,899 円                 | 0 円                          | 0 円                          | 0 円                          | 0 円                          | 0 円                          |
| B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等増益   | 0 円                          | 0 円                          | 0 円                          | 0 円                          | 0 円                          | 0 円                          |
| C 信託約款に定める収益調整金              | 10,584,239,113 円             | 4,812,984,999 円              | 4,405,716,137 円              | 4,405,716,137 円              | 4,405,716,137 円              | 27,983,088,004 円             |
| D 信託約款に定める分配準備積立金            | 4,812,984,999 円              | 15,477,159,011 円             | 15,477,159,011 円             | 15,477,159,011 円             | 15,477,159,011 円             | 31,632,464,924 円             |
| E 分配対象収益 ( A + B + C + D )   | 15,477,159,011 円             | 20,272 円                     | 2,272 円                      | 2,272 円                      | 2,272 円                      | 0.2182 円                     |
| F 分配対象収益 ( 1口当たり )           | 0.2272 円                     | 2,272 円                      | 2,272 円                      | 2,272 円                      | 2,272 円                      | 2,182 円                      |
| G 分配金額                       | 473,904,085 円                | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 1,011,165,226 円              |
| H 分配金額 ( 1口当たり )             | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     |
| 分配金に加算した外国支払税                | 70 円                         | 70 円                         | 70 円                         | 70 円                         | 70 円                         | 70 円                         |
| 分配金に加算した外国支払税                | 4,259,681 円                  | 2,855,587 円                  | 2,855,587 円                  | 2,855,587 円                  | 2,855,587 円                  | 3,492,854 円                  |
| 自 平成19年4月16日<br>至 平成19年5月15日 |                              |                              |                              |                              |                              |                              |
| A 計算期末における費用控除後の配当等収益        | 262,214,176 円                | 262,214,176 円                | 262,214,176 円                | 262,214,176 円                | 262,214,176 円                | 458,531,921 円                |
| B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等増益   | 0 円                          | 0 円                          | 0 円                          | 0 円                          | 0 円                          | 0 円                          |
| C 信託約款に定める収益調整金              | 13,113,387,252 円             | 13,113,387,252 円             | 13,113,387,252 円             | 13,113,387,252 円             | 13,113,387,252 円             | 28,981,161,030 円             |
| D 信託約款に定める分配準備積立金            | 4,405,716,137 円              | 4,405,716,137 円              | 4,405,716,137 円              | 4,405,716,137 円              | 4,405,716,137 円              | 2,627,172,490 円              |
| E 分配対象収益 ( A + B + C + D )   | 17,781,317,565 円             | 17,781,317,565 円             | 17,781,317,565 円             | 17,781,317,565 円             | 17,781,317,565 円             | 32,066,865,441 円             |
| F 分配対象収益 ( 1口当たり )           | 0.2238 円                     | 0.2238 円                     | 0.2238 円                     | 0.2238 円                     | 0.2238 円                     | 0.2143 円                     |
| G 分配金額                       | 546,623,546 円                | 2,238 円                      | 2,238 円                      | 2,238 円                      | 2,238 円                      | 2,143 円                      |
| H 分配金額 ( 1口当たり )             | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     |
| 分配金に加算した外国支払税                | 70 円                         | 70 円                         | 70 円                         | 70 円                         | 70 円                         | 70 円                         |
| 分配金に加算した外国支払税                | 9,460,218 円                  | 2,855,587 円                  | 2,855,587 円                  | 2,855,587 円                  | 2,855,587 円                  | 3,492,854 円                  |
| 自 平成19年5月16日<br>至 平成19年6月15日 |                              |                              |                              |                              |                              |                              |
| A 計算期末における費用控除後の配当等収益        | 226,846,719 円                | 226,846,719 円                | 226,846,719 円                | 226,846,719 円                | 226,846,719 円                | 203,221,422 円                |
| B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等増益   | 1,760,836,213 円              | 1,760,836,213 円              | 1,760,836,213 円              | 1,760,836,213 円              | 1,760,836,213 円              | 0 円                          |
| C 信託約款に定める収益調整金              | 15,624,981,637 円             | 15,624,981,637 円             | 15,624,981,637 円             | 15,624,981,637 円             | 15,624,981,637 円             | 29,787,517,554 円             |
| D 信託約款に定める分配準備積立金            | 4,103,839,237 円              | 4,103,839,237 円              | 4,103,839,237 円              | 4,103,839,237 円              | 4,103,839,237 円              | 2,043,147,606 円              |
| E 分配対象収益 ( A + B + C + D )   | 21,716,503,806 円             | 21,716,503,806 円             | 21,716,503,806 円             | 21,716,503,806 円             | 21,716,503,806 円             | 32,033,886,582 円             |
| F 分配対象収益 ( 1口当たり )           | 0.2389 円                     | 0.2389 円                     | 0.2389 円                     | 0.2389 円                     | 0.2389 円                     | 0.2088 円                     |
| G 分配金額                       | 627,565,633 円                | 2,389 円                      | 2,389 円                      | 2,389 円                      | 2,389 円                      | 2,088 円                      |
| H 分配金額 ( 1口当たり )             | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     | 0.0070 円                     |
| 分配金に加算した外国支払税                | 8,490,493 円                  | 8,490,493 円                  | 8,490,493 円                  | 8,490,493 円                  | 8,490,493 円                  | 1,071,615,027 円              |
| 分配金に加算した外国支払税                | 70 円                         | 70 円                         | 70 円                         | 70 円                         | 70 円                         | 70 円                         |
| 分配金に加算した外国支払税                | 2,015,704 円                  | 2,015,704 円                  | 2,015,704 円                  | 2,015,704 円                  | 2,015,704 円                  | 2,015,704 円                  |

|                            | 自 平成18年5月16日<br>至 平成18年6月15日 | 自 平成19年11月16日<br>至 平成19年12月17日 |
|----------------------------|------------------------------|--------------------------------|
| A 計算期末における費用控除後の配当等収益      | 134,905,912 円                | 156,558,138 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                          | 0 円                            |
| C 信託約款に定める収益調整金            | 19,232,320,905 円             | 30,274,412,343 円               |
| D 信託約款に定める分配準備積立金          | 5,437,617,828 円              | 1,166,932,769 円                |
| E 分配対象収益 (A + B + C + D)   | 24,804,844,645 円             | 31,596,903,250 円               |
| F 分配対象収益 (1口当たり)           | 0.2335 円                     | 0.2028 円                       |
| G 分配金額 (1万口当たり)            | 2,335 円                      | 2,028 円                        |
| H 分配金額 (1口当たり)             | 722,002,404 円                | 1,089,130,278 円                |
| 分配金額 (1万口当たり)              | 0.0070 円                     | 0.0070 円                       |
| 分配金額 (1口当たり)               | 70 円                         | 70 円                           |
| 分配金に加算した外国支払税              | 21,530,573 円                 | 971,700 円                      |

(有価証券に関する注記)

前期 (自 平成 18 年 12 月 16 日 至 平成 19 年 6 月 15 日)

売買目的有価証券

| 種 類       | 貸借対照表計上額        | 最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|-----------------|---------------------|
| 親投資信託受益証券 | 126,388,082,335 | 1,523,584,749       |
| 合計        | 126,388,082,335 | 1,523,584,749       |

当期 (自 平成 19 年 6 月 16 日 至 平成 19 年 12 月 17 日)

売買目的有価証券

| 種 類       | 貸借対照表計上額        | 最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|-----------------|---------------------|
| 親投資信託受益証券 | 160,581,487,953 | 2,200,657,534       |
| 合計        | 160,581,487,953 | 2,200,657,534       |

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

|              | 前期         | 当期         |
|--------------|------------|------------|
| 1口当たり純資産額    | 1,2070 円   | 1,0419 円   |
| (1万口当たり純資産額) | (12,070 円) | (10,419 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

(親投資信託受益証券)

| 種 類       | 銘柄   | 券面総額            | 評価額             | 備 考 |
|-----------|--|-----------------|-----------------|-----|
| 親投資信託受益証券 | 海外株式会社インデックスMSCI-KOJUSA1<br>(ヘッジなし)マザーファンド | 18,985,419,470  | 26,866,267,091  |     |
|           | 日本債券インデックスマザーファンド                          | 24,987,565,446  | 28,048,542,213  |     |
|           | 海外債券インデックス(ヘッジなし)<br>マザーファンド               | 15,732,343,312  | 27,625,994,855  |     |
|           | 日本株式会社インデックスTOPIXマザー<br>ファンド               | 24,709,024,200  | 25,998,835,263  |     |
|           | 日本リートインデックスJ-REIT<br>マザーファンド               | 21,523,406,341  | 26,525,445,974  |     |
|           | 海外リートインデックス(ヘッジな<br>し)マザーファンド              | 20,030,145,661  | 25,516,402,557  |     |
|           | 合計   | 125,967,904,430 | 160,581,487,953 |     |

(注) 親投資信託受益証券における券面総額の数値は、口数を表示しております。

第2 有価証券先物取引等及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目                 | 対象期間   | 自 平成18年12月16日<br>至 平成19年6月16日  | 自 平成19年6月16日<br>至 平成19年12月17日 |
|--------------------|--|--|-------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 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。<br>(1) 証券取引所に上場されている有価証券<br>証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所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）又は証券取引所の発表する基準価額で評価しております。<br>(2) 証券取引所に上場されていない有価証券<br>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、金融機関の提示する価値（ただし、売買相場は使用しない）又は価格提供会社の提示する価値のいずれかから入手した価額で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>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、投資信託委託業者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。 | 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。<br>(1) 証券取引所に上場されている有価証券<br>証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所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）又は証券取引所の発表する基準価額で評価しております。<br>(2) 証券取引所に上場されていない有価証券<br>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、金融機関の提示する価値（ただし、売買相場は使用しない）又は価格提供会社の提示する価値のいずれかから入手した価額で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>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、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |                               |
| 2. 収益及び費用の計上基準     | 受取配当金の計上基準<br>受取配当金は原則として、株式の配当落ち日に、当該金額を計上しております。ただし、平成19年6月30日以前については、原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定していない場合には、予想配当金額の90%を計上し、残額については入金時に計上しております。  | 受取配当金の計上基準<br>受取配当金は原則として、株式の配当落ち日に、当該金額を計上しております。ただし、平成19年6月30日以前については、原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定していない場合には、予想配当金額の90%を計上し、残額については入金時に計上しております。  |                               |

(参考)  
当ファンドは「日本リートインデックスJ - REITマザーファンド」「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」「日本債券インデックスマザーファンド」「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」「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-KOKUSA1（ヘッジなし）マザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。

1. 「日本リートインデックスJ - REITマザーファンド」の状況  
なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

日本リートインデックスJ - REITマザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

| 対象年月日    | 注記番号 | 平成19年6月15日現在   | 平成19年12月17日現在  |
|----------|------|----------------|----------------|
| 資産の部     |      |                |                |
| 流動資産     |      |                |                |
| コール・ローン  |      | 866,109,135    | 189,864,237    |
| 投資証券     |      | 22,187,893,000 | 27,567,030,000 |
| 未収配当金    |      | 69,577,673     | 169,625,564    |
| 流動資産合計   |      | 23,123,579,808 | 27,926,519,791 |
| 資産合計     |      | 23,123,579,808 | 27,926,519,791 |
| 負債の部     |      |                |                |
| 流動負債     |      |                |                |
| 未払金      |      | 766,122,000    | -              |
| 未払解約金    |      | 4,884,875      | 11,900,000     |
| 流動負債合計   |      | 771,006,875    | 11,900,000     |
| 負債合計     |      | 771,006,875    | 11,900,000     |
| 純資産の部    |      |                |                |
| 元本等      |      |                |                |
| 元本       |      | 14,371,734,316 | 22,650,423,609 |
| 剰余金      |      |                |                |
| 剰余金      |      | 7,980,838,617  | 5,264,196,182  |
| 剰余金合計    |      | 7,980,838,617  | 5,264,196,182  |
| 元本等合計    |      | 22,352,572,933 | 27,914,619,791 |
| 純資産合計    |      | 22,352,572,933 | 27,914,619,791 |
| 負債・純資産合計 |      | 23,123,579,808 | 27,926,519,791 |



(貸借対照表に関する注記)

|   | 平成19年6月15日現在     | 平成18年12月16日現在    | 1. 期首                                    | 平成19年12月17日現在    | 平成19年6月16日現在     |
|---|------------------|------------------|--|------------------|------------------|
| 1. 期首                                       |                  |                  |  |                  |                  |
| 期首元本額                                       | 5,241,153,359 円  | 5,241,153,359 円  | 期首元本額                                    | 14,371,734,316 円 | 14,371,734,316 円 |
| 期首からの追加取得元本額                                | 9,145,590,941 円  | 9,145,590,941 円  | 期首からの追加取得元本額                             | 8,601,254,251 円  | 8,601,254,251 円  |
| 期首からの解約元本額                                  | 15,009,984 円     | 15,009,984 円     | 期首からの解約元本額                               | 322,564,958 円    | 322,564,958 円    |
| 平成19年6月15日現在の元本の内訳                          |                  |                  | 平成19年12月17日現在の元本の内訳                      |                  |                  |
| J - R E I Tインデックスファンド (適格機関投資家向け)           | 465,212,236 円    | 465,212,236 円    | J - R E I Tインデックスファンド (適格機関投資家向け)        | 540,225,383 円    | 540,225,383 円    |
| 世界の財産3分法ファンド (不動産・債券・株式) 毎月分配型              | 13,324,570,283 円 | 13,324,570,283 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           | 21,523,406,341 円 | 21,523,406,341 円 |
| 全世界全資産ファンド (債券/株式・不動産・資源・食料等) 毎月分配型         | 9,945,957 円      | 9,945,957 円      | グローバルコレクション (債券/株式・不動産・資源・食料等) 毎月分配型     | 12,202,756 円     | 12,202,756 円     |
| 3資産バランズファンド (適格機関投資家向け)                     | 572,005,840 円    | 572,005,840 円    | 日興ストラテジック・アロケーション・ファンド (代管資産)            | 3,420,324 円      | 3,420,324 円      |
| (合計)  | 14,371,734,316 円 | 14,371,734,316 円 | 3資産バランズファンド (適格機関投資家向け)                  | 571,168,805 円    | 571,168,805 円    |
| 2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期末日における当該親投資信託の受益権の総数 | 14,371,734,316 口 | 14,371,734,316 口 | (合計)                                     | 22,650,423,609 円 | 22,650,423,609 円 |
| 2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期末日における当該親投資信託の受益権の総数 |                  |                  | 本報告書における開示対象ファンドの特定期末日における当該親投資信託の受益権の総数 | 22,650,423,609 口 | 22,650,423,609 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

(有価証券に関する注記)

対象期間 (自 平成 18 年 12 月 16 日 至 平成 19 年 6 月 15 日)

売買目的有価証券

| 種 類  | 貸借対照表計上額       | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 | (単位: 円) |
|------|----------------|-------------------|---------|
| 投資証券 | 22,187,893,000 | 2,136,740,320     |         |
| 合計   | 22,187,893,000 | 2,136,740,320     |         |

対象期間 (自 平成 19 年 6 月 16 日 至 平成 19 年 12 月 17 日)

売買目的有価証券

| 種 類  | 貸借対照表計上額       | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 | (単位: 円) |
|------|----------------|-------------------|---------|
| 投資証券 | 27,567,030,000 | 6,360,932,071     |         |
| 合計   | 27,567,030,000 | 6,360,932,071     |         |

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

|              | 平成19年6月15日現在 | 平成19年12月17日現在 |
|--------------|--------------|---------------|
| 1口当たり純資産額    | 1,5553 円     | 1,2324 円      |
| (1万口当たり純資産額) | (15,553 円)   | (12,324 円)    |

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(国内投資証券)

| コード  | 銘柄                         | 券面総額   | 評価額            | 備 考 |
|------|----------------------------|--------|----------------|-----|
| 3226 | 日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券    | 628    | 378,056,000    |     |
| 3227 | MI Dリード投資法人 投資証券           | 1,016  | 515,112,000    |     |
| 3229 | 日本コマニヤル投資法人 投資証券           | 1,424  | 666,432,000    |     |
| 3234 | 森ビルリード投資法人 投資証券            | 718    | 548,552,000    |     |
| 3240 | 野村不動産レジデンシャル投資法人 投資証券      | 377    | 238,264,000    |     |
| 3249 | 産業ファンド投資法人 投資証券            | 437    | 202,331,000    |     |
| 8951 | 日本ビルファンド投資法人 投資証券          | 2,811  | 4,300,830,000  |     |
| 8952 | ジャパソリアルエステイト投資法人 投資証券      | 2,269  | 3,085,840,000  |     |
| 8953 | 日本リサーチファンド投資法人 投資証券        | 2,139  | 1,582,960,000  |     |
| 8954 | オリックス不動産投資法人 投資証券          | 1,392  | 1,010,592,000  |     |
| 8955 | 日本ブライトリアルエステイト投資法人 投資証券    | 3,458  | 1,493,856,000  |     |
| 8956 | プレミア投資法人 投資証券              | 727    | 462,372,000    |     |
| 8957 | 東急リアル・エステイト投資法人 投資証券       | 937    | 936,063,000    |     |
| 8958 | グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券       | 536    | 718,240,000    |     |
| 8959 | 野村不動産オフィスファンド投資法人 投資証券     | 1,471  | 1,559,260,000  |     |
| 8960 | コナトラッド・アール・ワン投資法人 投資証券     | 884    | 647,872,000    |     |
| 8961 | 森トラスト総合リート投資法人 投資証券        | 885    | 1,008,900,000  |     |
| 8962 | 日本レジデンシャル投資法人 投資証券         | 1,368  | 692,208,000    |     |
| 8963 | 東京グローリーリート投資法人 投資証券        | 298    | 95,956,000     |     |
| 8964 | フロンティア不動産投資法人 投資証券         | 611    | 504,686,000    |     |
| 8965 | ニューシティ・レジデンス投資法人 投資証券      | 908    | 425,852,000    |     |
| 8966 | クレシエント投資法人 投資証券            | 601    | 257,228,000    |     |
| 8967 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券     | 677    | 518,582,000    |     |
| 8968 | 福岡リート投資法人 投資証券             | 592    | 441,040,000    |     |
| 8969 | アロスベクト・レジデンシャル投資法人 投資証券    | 416    | 136,864,000    |     |
| 8970 | ジャパン・シングルレジデンス投資法人 投資証券    | 310    | 108,500,000    |     |
| 8972 | ケネディクス不動産投資法人 投資証券         | 1,107  | 809,217,000    |     |
| 8973 | ジョイント・リート投資法人 投資証券         | 579    | 206,124,000    |     |
| 8974 | イーアセット投資法人 投資証券            | 667    | 258,796,000    |     |
| 8975 | F Cレジデンシャル投資法人 投資証券        | 84     | 34,272,000     |     |
| 8976 | D Aオフィス投資法人 投資証券           | 1,134  | 811,944,000    |     |
| 8977 | 阪急リート投資法人 投資証券             | 473    | 386,441,000    |     |
| 8978 | アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券       | 421    | 195,765,000    |     |
| 8980 | エルシービー投資法人 投資証券            | 508    | 193,548,000    |     |
| 8981 | ジャパン・ホテル・アンド・リゾート投資法人 投資証券 | 507    | 194,181,000    |     |
| 8982 | トップリート投資法人 投資証券            | 858    | 420,420,000    |     |
| 8983 | クリード・オフィス投資法人 投資証券         | 738    | 338,742,000    |     |
| 8984 | ピ・ライフ投資法人 投資証券             | 273    | 120,393,000    |     |
| 8985 | 日本ホテルファンド投資法人 投資証券         | 233    | 104,151,000    |     |
| 8986 | リブラス・レジデンシャル投資法人 投資証券      | 539    | 205,898,000    |     |
| 8987 | ジャパンエクスプレスリート投資法人 投資証券     | 855    | 750,880,000    |     |
|      | 合計                         | 36,866 | 27,567,030,000 |     |

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 有価証券先物取引等及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(2) 注記表

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

海外リポートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

(1) 貸借対照表

| 科目       | 対象年月日 | 平成19年6月15日現在 |                | 平成19年12月17日現在  |                |
|----------|-------|--------------|----------------|----------------|----------------|
|          |       | 注記<br>番号     | 金額             | 金額             | 金額             |
| 資産の部     |       |              |                |                |                |
| 流動資産     |       |              |                |                |                |
| 預金       |       |              | 401,213,829    |                | 78,578,502     |
| コール・ローン  |       |              | 271,305,959    |                | 75,456,946     |
| 投資証券     |       |              | 23,018,313,278 | 26,889,832,997 |                |
| 派生商品評価勘定 |       |              | 845,929        |                | 311,740        |
| 未収入金     |       |              | 7,267,694      |                | -              |
| 未収配当金    |       |              | 22,609,640     |                | 34,306,835     |
| 流動資産合計   |       |              | 23,721,556,329 | 27,078,487,020 | 27,078,487,020 |
| 資産合計     |       |              | 23,721,556,329 | 27,078,487,020 | 27,078,487,020 |
| 負債の部     |       |              |                |                |                |
| 流動負債     |       |              |                |                |                |
| 派生商品評価勘定 |       |              | 54,280         |                | 185,940        |
| 未払金      |       |              | 602,402,146    |                | 133,216,093    |
| 未払解約金    |       |              | 1,421,000      |                | -              |
| 流動負債合計   |       |              | 603,877,426    |                | 133,402,033    |
| 負債合計     |       |              | 603,877,426    |                | 133,402,033    |
| 純資産の部    |       |              |                |                |                |
| 元本等      |       |              |                |                |                |
| 元本       |       |              | 14,588,165,476 |                | 21,151,810,778 |
| 剰余金      |       |              |                |                |                |
| 剰余金      |       |              | 8,529,513,427  |                | 5,793,274,209  |
| 剰余金合計    |       |              | 8,529,513,427  |                | 5,793,274,209  |
| 元本等合計    |       |              | 23,117,678,903 |                | 26,945,084,987 |
| 純資産合計    |       |              | 23,117,678,903 |                | 26,945,084,987 |
| 負債・純資産合計 |       |              | 23,721,556,329 |                | 27,078,487,020 |

(単位：円)

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目                                    | 対象期間  | 自 平成18年12月16日<br>至 平成19年6月15日  | 自 平成19年6月16日<br>至 平成19年12月17日  |
|---------------------------------------|---|--|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法                    | 対象期間<br>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。<br>(1) 証券取引所に上場されている有価証券<br>証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所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）又は証券取引所が発表する基準値で評価しております。<br>(2) 証券取引所に上場されていない有価証券<br>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、金融機関の提示する価値（ただし、売買配相場は使用しない）又は価格提供会社の提示する価値のいずれかから入手した価値で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>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、投資信託委託業者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られた価値もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的理由をもって時価と認められた価値で評価しております。 | 自 平成19年6月16日<br>至 平成19年12月17日<br>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。<br>(1) 証券取引所に上場されている有価証券<br>証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所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）又は証券取引所が発表する基準値で評価しております。<br>(2) 証券取引所に上場されていない有価証券<br>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、金融機関の提示する価値（ただし、売買配相場は使用しない）又は価格提供会社の提示する価値のいずれかから入手した価値で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>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、投資信託委託業者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られた価値もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的理由をもって時価と認められた価値で評価しております。 |  |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価為替予約取引<br>評価方法     |   | 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価値で評価しております。   | 受取配当金の計上基準<br>受取配当金は原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 |
| 3. 収益及び費用の計上基準                        |   | 受取配当金の計上基準<br>受取配当金は原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。   | 外貨建取引等の処理基準<br>「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。                    |
| 4. その他財務諸表作成のための基本外貨建取引等の処理基準となる重要な事項 |   |  |  |

(貸借対照表に関する注記)

|   | 平成19年6月15日現在     | 平成18年12月16日現在    | 平成19年12月17日現在                            | 平成19年6月16日現在     |
|---|------------------|------------------|--|------------------|
| 1. 期首元本額                                    | 4,415,857,418 円  | 4,415,857,418 円  | 期首元本額                                    | 14,588,165,476 円 |
| 期首からの追加取得元本額                                | 10,265,409,627 円 | 10,265,409,627 円 | 期首からの追加取得元本額                             | 6,327,046,243 円  |
| 期首からの解約元本額                                  | 93,101,569 円     | 93,101,569 円     | 期首からの解約元本額                               | 363,399,941 円    |
| 平成19年6月15日現在の元本の内訳                          |                  |                  | 平成19年12月17日現在の元本の内訳                      |                  |
| 海外REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)                 | 177,971,983 円    | 177,971,983 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             | 20,030,145,661 円 |
| 世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型                | 13,384,824,390 円 | 13,384,824,390 円 | グローバルコレクション(債券/株式/不動産・資源・食料等)隔月分配型       | 19,571,564 円     |
| 全世界資産ファンド(債券/株式/不動産・資源・食料等)毎月分配型            | 18,491,736 円     | 18,491,736 円     | 日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(代替資産)             | 7,549,195 円      |
| 海外先進国REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)              | 428,722,284 円    | 428,722,284 円    | 海外先進国REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)           | 537,903,632 円    |
| 3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)                      | 578,155,103 円    | 578,155,103 円    | 3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)                   | 556,640,726 円    |
| (合計)  | 14,588,165,476 円 | 14,588,165,476 円 | (合計)                                     | 21,151,810,778 円 |
| 2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期末日における当該親投資信託の受益権の総額 | 14,588,165,476 円 | 14,588,165,476 円 | 本報告書における開示対象ファンドの特定期末日における当該親投資信託の受益権の総額 | 21,151,810,778 円 |

当該親投資信託は受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(有価証券に関する注記)

対象期間(自 平成18年12月16日 至 平成19年6月15日)

売買目的有価証券

| 種 類  | 貸借対照表計上額       | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 | (単位:円) |
|------|----------------|-------------------|--------|
| 投資証券 | 23,018,313,278 | 535,092,222       |        |
| 合計   | 23,018,313,278 | 535,092,222       |        |

対象期間(自 平成19年6月16日 至 平成19年12月17日)

売買目的有価証券

| 種 類  | 貸借対照表計上額       | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 | (単位:円) |
|------|----------------|-------------------|--------|
| 投資証券 | 26,889,832,997 | 4,312,455,101     |        |
| 合計   | 26,889,832,997 | 4,312,455,101     |        |

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の状況に関する事項

| 取引の内容               | 自 平成18年12月16日<br>至 平成19年6月15日  | 自 平成19年6月16日<br>至 平成19年12月17日 |
|---------------------|--|-------------------------------|
| 取引の内容               | 当投資信託が利用することができるデリバティブ取引等は、内外の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨先物取引、通貨オプション取引、金利先物取引、金利オプショントラック取引、スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引、および為替予約取引であります。 | 同左                            |
| 取引の利用目的及び取引に対する取組方針 | 市場動向を勘案し、デリバティブ取引を行う方針であります。また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。   | 同左                            |
| 取引に係るリスクの内容         | デリバティブ取引には、有価証券、為替、金利等の市場価格が変動することによって発生するリスクがあります。  | 同左                            |
| 取引に係るリスク管理体制        | デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門が執行し、リスク管理業務担当部門が日常的にこれを監視しております。  | 同左                            |

取引の時価等に関する事項

| 区分    |  | 種 類         | 平成19年6月15日現在 |     | 時 価         | 評価損益    |
|-------|--|-------------|--------------|-----|-------------|---------|
|       |  |             | 契 約 額        | 等 価 |             |         |
| 市場    |  | 為替予約取引      | -            | -   | -           | 791,649 |
| 取 引   |  | 買 建         | 281,610,781  | -   | 282,402,430 | 583,240 |
| 以 外   |  | アメリカドル      | 157,476,280  | -   | 158,059,520 | 24,255  |
| の 取 引 |  | カナダドル       | 6,321,095    | -   | 6,345,350   | 53,736  |
| 引     |  | オーストラリアドル   | 49,160,546   | -   | 49,106,810  | 48,250  |
| 取 引   |  | イギリスポンド     | 27,829,900   | -   | 27,878,150  | 56,780  |
| 引     |  | シンガポールドル    | 13,527,920   | -   | 13,584,700  | 51,225  |
| 引     |  | ニューゼalandドル | 6,893,025    | -   | 6,944,250   | 81,635  |
| 引     |  | ユーロ         | 20,402,015   | -   | 20,483,650  | 791,649 |
| 引     |  | 合計          | 281,610,781  | -   | 282,402,430 | 791,649 |

(単位：円)

| 区分    |  | 種 類       | 平成19年12月17日現在 |     | 時 価         | 評価損益    |
|-------|--|-----------|---------------|-----|-------------|---------|
|       |  |           | 契 約 額         | 等 価 |             |         |
| 市場    |  | 為替予約取引    | -             | -   | -           | 125,800 |
| 取 引   |  | 買 建       | 119,028,100   | -   | 119,153,900 | 309,400 |
| 以 外   |  | アメリカドル    | 64,278,400    | -   | 64,587,800  | 106,600 |
| の 取 引 |  | オーストラリアドル | 24,602,100    | -   | 24,495,500  | 29,400  |
| 引     |  | イギリスポンド   | 13,744,800    | -   | 13,715,400  | 47,600  |
| 引     |  | ユーロ       | 16,402,800    | -   | 16,355,200  | 125,800 |
| 引     |  | 合計        | 119,028,100   | -   | 119,153,900 | 125,800 |

(単位：円)

(注) 時価の算定方法

1. 計算期間末日に對顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。  
 計算期間末日において為替予約の受渡日の對顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。  
 計算期間末日において当該日の對顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっています。  
 ・計算期間末日に当該日を超える對顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しています。  
 ・計算期間末日に当該日を超える對顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている對顧客先物相場の仲値を用います。
2. 計算期間末日に對顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の對顧客相場の仲値で評価しています。

(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19年6月15日現在 |            | 平成19年12月17日現在 |            |
|--------------|------------|---------------|------------|
| 1口当たり純資産額    | 1,5847 円   | 1口当たり純資産額     | 1,2739 円   |
| (1万口当たり純資産額) | (15,847 円) | (1万口当たり純資産額)  | (12,739 円) |

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

外国投資証券(アメリカドル) (単位：アメリカドル)

| 銘柄   | 評価額          | 券面総額   | 備考 |
|--|--------------|--------|----|
| 00163T10 AIB PROPERTY CORPORATION                  | 2,812,174.81 | 48,967 |    |
| 00423910 ACADIA REALTY TRUST                       | 436,374.06   | 17,106 |    |
| 00849210 AGREE REALTY CORPORATION                  | 115,088.75   | 3,935  |    |
| 01475210 ALEXANDER'S INC                           | 361,168.94   | 974    |    |
| 01527110 ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC       | 1,547,455.32 | 15,282 |    |
| 02483510 AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES               | 330,594.24   | 12,784 |    |
| 02607P30 AMERICAN FINANCIAL REALTY TRUST           | 499,841.76   | 60,808 |    |
| 02711810 AMERICAN LAND LEASE INC                   | 77,820.96    | 3,657  |    |
| 03748R10 APARTMENT INV&MGT CO - A                  | 1,660,863.30 | 47,010 |    |
| 04410310 ASHFORD HOSPITALITY TRUST                 | 376,077.15   | 50,345 |    |
| 04560410 ASSOCIATED ESTATES REALTY COPORATION      | 52,252.88    | 5,143  |    |
| 05348410 AVALONBAY COMMUNITIES INC                 | 3,570,484.50 | 38,187 |    |
| 05564E10 BRE PROPERTIES-CL A                       | 964,214.16   | 23,324 |    |
| 09063H10 BIOMED REALTY TRUST INC                   | 797,303.83   | 32,663 |    |
| 10112110 BOSTON PROPERTIES INC                     | 5,214,387.36 | 56,238 |    |
| 10536820 BRANDYVINE REALTY TRUST                   | 760,238.05   | 40,895 |    |
| 12483010 CBL&ASSOCIATES PROPERTIES                 | 800,066.98   | 30,607 |    |
| 13313110 CAMDEN PROPERTY TRUST                     | 1,256,254.74 | 26,403 |    |
| 14028810 CAPLEASE INC                              | 193,277.64   | 22,422 |    |
| 15060220 CEDAR SHOPPING CENTERS INC                | 204,857.80   | 18,340 |    |
| 19238U10 COGDELL SPENCER INC                       | 69,219.28    | 4,294  |    |
| 20221810 NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC            | 803,212.32   | 34,296 |    |
| 22002T10 CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST         | 721,997.52   | 22,188 |    |
| 22279510 COUSINS PROPERTIES INC                    | 418,222.81   | 18,679 |    |
| 23316310 DCT INDUSTRIAL TRUST INC                  | 768,840.54   | 83,298 |    |
| 25159110 DEVELOPERS DIVERSIFIED REALTY CORPORATION | 2,399,763.08 | 59,356 |    |
| 25278430 DIAMONDRICK HOSPITALITY CO                | 673,655.60   | 42,908 |    |
| 25386810 DIGITAL REALTY TRUST INC                  | 1,122,452.54 | 29,546 |    |
| 25960P10 DOUGLAS EMMETT INC                        | 1,105,316.65 | 47,953 |    |
| 26441150 DUKE REALTY CORPORATION                   | 1,709,733.62 | 68,362 |    |
| 27272610 EASTGROUP PROPERTIES INC                  | 510,583.75   | 12,125 |    |
| 28140H10 EDUCATION REALTY TRUST INC                | 160,755.40   | 14,548 |    |
| 29380T10 ENTERTAINMENT PROPERTIES TRUST            | 652,735.02   | 13,503 |    |
| 29472R10 EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC           | 502,105.20   | 11,084 |    |
| 29475Z10 EQUITY ONE INC                            | 375,859.83   | 16,923 |    |

|          |   |         |              |
|----------|---|---------|--------------|
| 2947610  | EQUITY RESIDENTIAL-REIT                     | 137,631 | 4,764,785.22 |
| 29717810 | ESSEX PROPERTY TRUST INC                    | 12,410  | 1,222,385.00 |
| 3022510  | EXTRA SPACE STORAGE INC                     | 28,335  | 378,272.25   |
| 31374720 | FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT        | 27,312  | 2,214,456.96 |
| 31430810 | FELDMAN WALL PROPERTIES INC                 | 3,946   | 11,877.46    |
| 31430F10 | FELCOR LODGING TRUST INC                    | 30,615  | 512,801.25   |
| 32054K10 | FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC           | 21,541  | 777,414.69   |
| 33610F10 | FIRST POTOMAC REALTY TRUST                  | 11,280  | 210,146.40   |
| 33740010 | FIRST UNION REAL ESTATE                     | 26,344  | 134,090.96   |
| 35474R10 | FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP             | 30,310  | 446,466.30   |
| 36188610 | GHF COMMUNITIES TRUST                       | 16,383  | 93,710.76    |
| 37002110 | GENERAL GROWTH PROPERTIES INC               | 115,870 | 5,150,421.50 |
| 37429710 | GETTY REALTY CORPORATION                    | 8,988   | 233,238.60   |
| 37653610 | GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION            | 1,925   | 32,147.50    |
| 37930210 | GLITCHER REALTY TRUST                       | 18,407  | 293,039.44   |
| 40426W10 | HRPT PROPERTIES TRUST                       | 101,718 | 773,056.80   |
| 42191510 | HCP INC                                     | 97,383  | 3,069,512.16 |
| 42194610 | HEALTHCARE REALTY TRUST INC                 | 22,614  | 537,760.92   |
| 42217K10 | HEALTH CARE REIT INC                        | 39,036  | 1,654,736.04 |
| 42782510 | HERSHA HOSPITALITY TRUST                    | 18,392  | 176,747.12   |
| 43128410 | HIGHWOODS PROPERTIES INC                    | 26,926  | 819,896.70   |
| 43730610 | HOME PROPERTIES INC                         | 15,138  | 642,608.10   |
| 44106W10 | HOSPITALITY PROPERTIES TRUST                | 44,810  | 1,553,114.60 |
| 44107P10 | HOST HOTELS & RESORTS INC                   | 249,233 | 4,331,669.54 |
| 45746110 | INLAND REAL ESTATE CORPORATION              | 28,738  | 425,035.02   |
| 46173010 | INVESTORS REAL ESTATE TRUST                 | 30,963  | 284,240.34   |
| 49427F10 | KILROY REALTY CORPORATION                   | 15,962  | 875,675.32   |
| 49446R10 | KIMCO REALTY CORPORATION                    | 119,479 | 4,457,761.49 |
| 49803T10 | KITE REALTY GROUP TRUST                     | 14,181  | 211,864.14   |
| 50217510 | LTC PROPERTIES INC                          | 10,326  | 245,449.02   |
| 51794210 | LASALLE HOTEL PROPERTIES                    | 18,217  | 612,819.88   |
| 52904310 | LEXINGTON REALTY TRUST                      | 32,004  | 524,545.56   |
| 53117210 | LIBERTY PROPERTY TRUST                      | 42,755  | 1,219,372.60 |
| 55438210 | THE MACERICH COMPANY                        | 33,754  | 2,518,385.94 |
| 55448910 | MACK-CALL REALTY CORPORATION                | 32,486  | 1,063,591.64 |
| 55977510 | MAGUIRE PROPERTIES INC                      | 20,256  | 572,029.44   |
| 58463J30 | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC                | 22,481  | 242,345.18   |
| 59522J10 | MID AMERICA APARTMENT COMMUNITIES           | 11,835  | 524,172.15   |
| 60520310 | MISSION WEST PROPERTIES INC                 | 10,154  | 99,306.12    |
| 60972010 | MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT CORPORATION | 4,025   | 32,924.50    |
| 63633D10 | NATIONAL HEALTH INVESTORS INC               | 10,781  | 317,500.45   |
| 63862010 | NATIONWIDE HEALTH PROPERTIES INC            | 41,604  | 1,285,147.56 |
| 68193610 | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS                  | 33,126  | 527,697.18   |
| 68240610 | ONE LIBERTY PROPERTIES INC                  | 4,234   | 83,621.50    |
| 69360J10 | PS BUSINESS PARKS INC                       | 7,384   | 388,250.72   |
| 70159010 | PARKWAY PROPERTIES INC                      | 7,289   | 288,978.17   |
| 70910210 | PENNSYLVANIA REAL ESTATE INVESTMENT TRUST   | 18,035  | 548,805.05   |
| 73746410 | POST PROPERTIES INC                         | 19,689  | 716,482.71   |
| 74341010 | PROLOGIS                                    | 122,139 | 7,871,858.55 |
| 74460010 | PUBLIC STORAGE                              | 59,339  | 4,332,340.39 |
| 75145220 | RANCO-GERSHENSON PROPERTIES TRSUT           | 9,534   | 217,947.24   |
| 75610910 | REALTY INCOME CORP                          | 49,663  | 1,360,766.20 |
| 75884910 | REGENCY CENTERS CORPORATION                 | 33,212  | 2,107,633.52 |
| 78440X10 | SL GREEN REALTY CORP                        | 28,774  | 2,740,723.50 |
| 80439510 | SAUL CENTERS INC                            | 5,149   | 271,455.28   |
| 81721M10 | SENIOR HOUSING PROPERTIES TRUST             | 39,331  | 860,168.97   |
| 82880610 | SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT               | 106,602 | 9,826,572.36 |

|          |   |           |                  |
|----------|---|-----------|------------------|
| 84610H10 | SOVRAN SELF STORAGE INC                 | 10,364    | 427,307.72       |
| 86272110 | STRATEGIC HOTELS & RESORTS INC          | 37,289    | 661,133.97       |
| 86667410 | SUN COMMUNITIES INC                     | 9,211     | 205,497.41       |
| 86789210 | SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC            | 30,212    | 630,524.44       |
| 86852610 | SUPERTEL HOSPITALITY INC                | 5,000     | 31,650.00        |
| 87546510 | TANGER FACTORY OUTLET CENTERS INC       | 15,017    | 587,314.87       |
| 87666410 | TAUBMAN CENTERS INC                     | 24,646    | 1,232,300.00     |
| 91019710 | UDR INC                                 | 64,593    | 1,288,606.52     |
| 91102410 | UHI PROPERTIES INC                      | 985       | 11,110.80        |
| 91274F10 | U-STORE-IT TRUST                        | 21,562    | 212,816.94       |
| 91359E10 | UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST    | 4,938     | 169,126.50       |
| 91728620 | URSTADT BIDDLE PROPERTIES-CL A          | 10,707    | 174,524.10       |
| 92276F10 | VENTAS INC                              | 63,227    | 2,761,755.36     |
| 92904210 | VORNADO REALTY TRUST                    | 63,534    | 5,475,360.12     |
| 93965310 | WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 22,084    | 671,574.44       |
| 94874110 | WEINGARTEN REALTY INVESTORS             | 36,626    | 1,248,580.34     |
| アメリカドル 計 |   | 3,627,226 | 127,989,485.08   |
| (邦貨換算額)  |   |           | (14,506,328,239) |

外国投資証券(カナダドル)

(単位:カナダドル)

| 銘柄      | 券面総額   | 評価額     | 備考            |
|---------|--|---------|---------------|
| AP-U    | ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST             | 6,811   | 143,916.43    |
| AX-U    | ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST                         | 9,065   | 137,334.75    |
| BEI-U   | BOARDWALK EQUITIES INC                                     | 13,037  | 586,665.00    |
| BRE-U   | PRIMARIS RETAIL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST               | 16,746  | 295,231.98    |
| CAR-U   | CANADIAN APARTMENT PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 14,279  | 234,889.55    |
| CRR-U   | CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST                       | 2,000   | 24,280.00     |
| CSH-U   | CHARTWELL SENIORS HOUSING REAL ESTATE INVESTMENT TRUST     | 23,029  | 241,804.50    |
| CUF-U   | COMINAR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST                       | 11,064  | 226,812.00    |
| CIIT-U  | CALLOWAY REAL ESTATE INVESTMENT TRUST                      | 16,544  | 396,228.80    |
| D-U     | DUNDEE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST                        | 5,662   | 204,454.82    |
| EXE-U   | EXTENDICARE REIT   | 13,129  | 158,204.45    |
| HR-U    | H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST                           | 30,636  | 632,020.68    |
| INN-U   | INVEST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST                        | 14,812  | 148,712.48    |
| MRT-U   | MORGUARD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST                      | 11,915  | 154,895.00    |
| NPR-U   | NORTHERN PROPERTY REAL ESTATE INVESTMENT TRUST             | 6,793   | 156,374.86    |
| REF-U   | CANADIAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST                      | 12,838  | 361,261.32    |
| REI-U   | RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST                        | 47,294  | 1,074,046.74  |
| カナダドル 計 |  | 255,654 | 5,177,133.36  |
| (邦貨換算額) |  |         | (576,059,629) |





外国投資証券(ユーロ) (単位:ユーロ)

| 銘柄  | 券面総額    | 評価額             | 備考 |
|---|---------|-----------------|----|
| ACAN  | 11,815  | 29,301.20       |    |
| ACANTHE DEVELOPPEMENT SA                      |         |                 |    |
| AED   | 800     | 32,280.00       |    |
| AEDIFICA                                      |         |                 |    |
| ANF   | 1,300   | 65,000.00       |    |
| ANF SA  |         |                 |    |
| AOX   | 11,200  | 116,368.00      |    |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG                        |         |                 |    |
| BEFB  | 6,646   | 497,918.32      |    |
| BEFIMO S.C.A.                                 |         |                 |    |
| COFIT   | 4,490   | 561,384.70      |    |
| COFINIMO                                      |         |                 |    |
| CORA  | 23,962  | 1,359,124.64    |    |
| CORIO NV                                      |         |                 |    |
| DREG  | 10,649  | 986,929.20      |    |
| FONCIERE DES REGIONS                          |         |                 |    |
| EIFF  | 2,626   | 239,885.10      |    |
| SOCIETE DE LA TOUR EIFFEL                     |         |                 |    |
| ENGP  | 8,522   | 903,843.32      |    |
| ICADE   |         |                 |    |
| EUROBANK PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT CO |         |                 |    |
| EUPRO   | 8,498   | 80,561.04       |    |
| GFCA  |         |                 |    |
| CECINA SA                                     | 9,417   | 1,087,663.50    |    |
| GFC   |         |                 |    |
| AFFINE  | 1,485   | 53,059.05       |    |
| INIL  |         |                 |    |
| INTERVEST OFFICES                             | 1,951   | 54,530.45       |    |
| INTO  |         |                 |    |
| LEAS  | 700     | 44,660.00       |    |
| LEASINVEST REAL ESTATE SCA                    |         |                 |    |
| LI  | 32,632  | 1,142,120.00    |    |
| KLEPIERRE                                     |         |                 |    |
| MERY  | 8,528   | 221,728.00      |    |
| MERCIALYS                                     |         |                 |    |
| NSI   | 19,947  | 357,250.77      |    |
| NIEUWE STEEN INVESTMENTS NV                   |         |                 |    |
| SCHIP   | 15,737  | 559,292.98      |    |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV                  |         |                 |    |
| SIL   | 5,493   | 546,718.29      |    |
| SILIC   |         |                 |    |
| UL  | 38,766  | 5,758,689.30    |    |
| UNIBAIL-RODAMCO                               |         |                 |    |
| VASTN   | 8,185   | 536,035.65      |    |
| VASTNED RETAIL NV                             |         |                 |    |
| VIN   | 12,106  | 289,068.40      |    |
| VASTNED OFFICES/INDUSTRIAL NV                 |         |                 |    |
| WDP   | 2,473   | 113,065.56      |    |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA                        |         |                 |    |
| WEHA  | 9,773   | 753,009.65      |    |
| WERELDHAVE NV                                 |         |                 |    |
| WEHB  | 771     | 38,442.06       |    |
| WERELDHAVE BELGIUM                            |         |                 |    |
| ユーロ 計   | 268,472 | 16,377,929.18   |    |
| (邦貨換算額)                                       |         | (2,679,101,655) |    |

|     |                  |                |
|-----|------------------|----------------|
| 総合計 | (26,889,832,997) | 26,889,832,997 |
|-----|------------------|----------------|

(注1) 総合計の( )内の金額は外国投資証券の邦貨換算額合計であります。

(注2) 投資証券における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

| 通貨         | 銘柄数        | 組入投資証券時価比率 (%) | 合計額に対する比率 (%) |
|------------|------------|----------------|---------------|
| アメリカドル     | 投資証券 109銘柄 | 100.0          | 54.0          |
| カナダドル      | 投資証券 17銘柄  | 100.0          | 2.1           |
| オーストラリアドル  | 投資証券 41銘柄  | 100.0          | 20.6          |
| イギリスポンド    | 投資証券 16銘柄  | 100.0          | 9.6           |
| 香港ドル       | 投資証券 8銘柄   | 100.0          | 1.4           |
| シンガポールドル   | 投資証券 13銘柄  | 100.0          | 1.9           |
| ニュージーランドドル | 投資証券 5銘柄   | 100.0          | 0.4           |
| ユーロ        | 投資証券 26銘柄  | 100.0          | 10.0          |

第2 有価証券先物取引等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)に記載しております。

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

日本債券インデックスマザーファンド

(1) 貸借対照表

| 科目       | 対象年月日 | 平成19年6月15日現在   | 平成19年12月17日現在  |
|----------|-------|----------------|----------------|
|          | 注記番号  | 金額             | 金額             |
| 資産の部     |       |                |                |
| 流動資産     |       |                |                |
| コール・ローン  |       | 450,080,783    | 171,608,977    |
| 国債証券     |       | 26,249,922,660 | 35,229,577,300 |
| 地方債証券    |       | 2,145,578,000  | 2,908,468,000  |
| 特殊債券     |       | 3,957,112,000  | 5,245,305,000  |
| 社債券      |       | 3,267,356,000  | 4,430,971,000  |
| 未収利息     |       | 123,298,801    | 212,901,571    |
| 前払費用     |       | 46,569,107     | 18,896,803     |
| 流動資産合計   |       | 36,238,917,351 | 48,217,728,651 |
| 資産合計     |       | 36,238,917,351 | 48,217,728,651 |
| 負債の部     |       |                |                |
| 流動負債     |       |                |                |
| 未払金      |       | 427,411,390    | 154,425,030    |
| 未払解約金    |       | 15,741,421     | 11,838,205     |
| 流動負債合計   |       | 443,152,811    | 166,263,235    |
| 負債合計     |       | 443,152,811    | 166,263,235    |
| 純資産の部    |       |                |                |
| 元本等      |       |                |                |
| 元本       |       | 32,838,406,592 | 42,808,712,950 |
| 剰余金      |       |                |                |
| 剰余金      |       | 2,957,357,948  | 5,242,752,466  |
| 剰余金合計    |       | 2,957,357,948  | 5,242,752,466  |
| 元本等合計    |       | 35,795,764,540 | 48,051,465,416 |
| 純資産合計    |       | 35,795,764,540 | 48,051,465,416 |
| 負債・純資産合計 |       | 36,238,917,351 | 48,217,728,651 |

( 2 ) 注記表

( 貸借対照表に関する注記 )

| ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ) |   | 平成19年6月15日現在   |  | 平成19年12月17日現在  |                        |                     |                    |                     |                    |                     |                    |                    |                     |                       |                       |                       |                     |                     |                    |                     |                     |                     |                    |                       |                    |                        |
|------------------------|---|--|--|--|------------------------|---------------------|--------------------|---------------------|--------------------|---------------------|--------------------|--------------------|---------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|---------------------|---------------------|--------------------|---------------------|---------------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|------------------------|
| 対象期間                   | 自 平成18年12月16日<br>至 平成19年6月15日   | 期首<br>13,567,715,722 円   | 期首<br>19,603,301,679 円   | 期首<br>32,838,406,592 円                               | 期首<br>32,838,406,592 円 |                     |                    |                     |                    |                     |                    |                    |                     |                       |                       |                       |                     |                     |                    |                     |                     |                     |                    |                       |                    |                        |
| 有価証券の評価基準及び評価方法        | 国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債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。<br>(1) 証券取引所に上場されている有価証券<br>証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所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）又は証券取引所が発表する基準値で評価しております。<br>(2) 証券取引所に上場されていない有価証券<br>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、金融機関の提示する価値（ただし、売買相場は使用しない）又は価格提供会社の提示する価値のいずれかから入手した価値で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>適正な評価額を入手できなかった場合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、投資信託委託業者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られた価値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値で評価してあります。 | 期首<br>332,610,809 円  | 期首<br>309,467,694 円  | 期首<br>1,279,774,532 円                                | 期首<br>1,279,774,532 円  |                     |                    |                     |                    |                     |                    |                    |                     |                       |                       |                       |                     |                     |                    |                     |                     |                     |                    |                       |                    |                        |
| 項目                     |   | 平成19年6月16日現在の内訳<br>D C インデックスバランス<br>(株式20)<br>D C インデックスバランス<br>(株式40)<br>D C インデックスバランス<br>(株式60)<br>D C インデックスバランス<br>(株式80)<br>インデックスファンド日本債<br>券 ( D C 専用 )<br>世界の財産3分法ファンド ( 不<br>動産・債券・株式 ) 毎月分配型<br>全世界資産ファンド ( 債券<br>/ 株式 / 不動産・資源・食<br>料 ) 毎月分配型<br>アセット・ナビゲーション・<br>ファンド ( 株式80 )<br>アセット・ナビゲーション・<br>ファンド ( 株式60 )<br>アセット・ナビゲーション・<br>ファンド ( 株式40 )<br>アセット・ナビゲーション・<br>ファンド ( 株式20 )<br>国際分散型ファンド40 ( 適格<br>機関投資家向け )<br>世界アセットバランスフアン<br>ド40 ( 適格機関投資家向け )<br>世界アセットバランスフアン<br>ド25 ( 適格機関投資家向け )<br>3 資産バランスファンド ( 適<br>格機関投資家向け )<br>日本債券インデックス<br>年金積立アセット・ナビゲ<br>ーション・ファンド ( 株式20 )<br>年金積立アセット・ナビゲ<br>ーション・ファンド ( 株式40 )<br>年金積立アセット・ナビゲ<br>ーション・ファンド ( 株式60 )<br>年金積立アセット・ナビゲ<br>ーション・ファンド ( 株式80 )<br>年金積立 インデックスフ<br>ァンド日本債券<br>日本債券インデックスフ<br>ァンド ( 個人型年金向け )<br>( 合計 )<br>32,838,406,592 円 | 平成19年12月17日現在の内訳<br>D C インデックスバランス<br>(株式20)<br>D C インデックスバランス<br>(株式40)<br>D C インデックスバランス<br>(株式60)<br>D C インデックスバランス<br>(株式80)<br>インデックスファンド日本債<br>券 ( D C 専用 )<br>世界の財産3分法ファンド ( 不<br>動産・債券・株式 ) 毎月分配型<br>全世界資産ファンド ( 債券<br>/ 株式 / 不動産・資源・食<br>料 ) 毎月分配型<br>日興ストラテジック・アロケ<br>ーション・ファンド ( 債券資産 )<br>アセット・ナビゲーション・<br>ファンド ( 株式80 )<br>アセット・ナビゲーション・<br>ファンド ( 株式60 )<br>アセット・ナビゲーション・<br>ファンド ( 株式40 )<br>アセット・ナビゲーション・<br>ファンド ( 株式20 )<br>国際分散型ファンド40 ( 適格<br>機関投資家向け )<br>世界アセットバランスフアン<br>ド40 ( 適格機関投資家向け )<br>世界アセットバランスフアン<br>ド25 ( 適格機関投資家向け )<br>3 資産バランスファンド ( 適<br>格機関投資家向け )<br>日本債券インデックス<br>年金積立アセット・ナビゲ<br>ーション・ファンド ( 株式20 )<br>年金積立アセット・ナビゲ<br>ーション・ファンド ( 株式40 )<br>年金積立アセット・ナビゲ<br>ーション・ファンド ( 株式60 )<br>年金積立アセット・ナビゲ<br>ーション・ファンド ( 株式80 )<br>年金積立 インデックスフ<br>ァンド日本債券<br>日本債券インデックスフ<br>ァンド ( 個人型年金向け )<br>( 合計 )<br>42,808,712,950 円 | 期首<br>335,925,692 円                                  | 期首<br>432,261,315 円    | 期首<br>329,137,111 円 | 期首<br>60,473,309 円 | 期首<br>675,290,357 円 | 期首<br>24,266,287 円 | 期首<br>121,626,901 円 | 期首<br>13,499,954 円 | 期首<br>65,130,223 円 | 期首<br>316,101,834 円 | 期首<br>1,365,251,448 円 | 期首<br>5,740,781,325 円 | 期首<br>3,021,018,789 円 | 期首<br>219,495,741 円 | 期首<br>626,583,360 円 | 期首<br>37,812,419 円 | 期首<br>718,562,438 円 | 期首<br>682,408,092 円 | 期首<br>361,044,992 円 | 期首<br>58,962,729 円 | 期首<br>2,557,281,685 円 | 期首<br>58,231,503 円 | 期首<br>42,808,712,950 円 |
|                        |   | 1. 本報告書における開示対象フ<br>ァンドの特定期間末日における当<br>該親投資信託の受益権の総額   |  | 2. 本報告書における開示対象フ<br>ァンドの特定期間末日における当<br>該親投資信託の受益権の総額 |                        |                     |                    |                     |                    |                     |                    |                    |                     |                       |                       |                       |                     |                     |                    |                     |                     |                     |                    |                       |                    |                        |

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

| 対象期間            | 自 平成18年12月16日<br>至 平成19年6月15日   | 自 平成19年6月16日<br>至 平成19年12月17日  |
|-----------------|---|--|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債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。<br>(1) 証券取引所に上場されている有価証券<br>証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所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）又は証券取引所が発表する基準値で評価しております。<br>(2) 証券取引所に上場されていない有価証券<br>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、金融機関の提示する価値（ただし、売買相場は使用しない）又は価格提供会社の提示する価値のいずれかから入手した価値で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>適正な評価額を入手できなかった場合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、投資信託委託業者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られた価値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値で評価してあります。 | 国債証券、地方債証券、特殊債券及び社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。<br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>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）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>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値（ただし、売買相場は使用しない）又は価格提供会社の提示する価値のいずれかから入手した価値で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>適正な評価額を入手できなかった場合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られた価値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値で評価してあります。 |

(有価証券に関する注記)

対象期間(自 平成 18 年 12 月 16 日 至 平成 19 年 6 月 15 日)

売買目的有価証券

| 種 類   | 貸借対照表計上額       | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 | (単位:円) |
|-------|----------------|-------------------|--------|
| 国債証券  | 26,249,922,660 | 345,340,250       |        |
| 地方債証券 | 2,145,578,000  | 27,312,000        |        |
| 特殊債券  | 3,957,112,000  | 37,843,000        |        |
| 社債券   | 3,267,356,000  | 36,526,000        |        |
| 合計    | 35,619,968,660 | 447,021,250       |        |

対象期間(自 平成 19 年 6 月 16 日 至 平成 19 年 12 月 17 日)

売買目的有価証券

| 種 類   | 貸借対照表計上額       | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 | (単位:円) |
|-------|----------------|-------------------|--------|
| 国債証券  | 35,229,577,300 | 149,790,060       |        |
| 地方債証券 | 2,908,468,000  | 15,711,000        |        |
| 特殊債券  | 5,245,305,000  | 16,288,000        |        |
| 社債券   | 4,430,971,000  | 6,630,000         |        |
| 合計    | 47,814,321,300 | 188,419,060       |        |

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

|              | 平成19年6月15日現在 | 平成19年12月17日現在 |
|--------------|--------------|---------------|
| 1口当たり純資産額    | 1,0901円      | 1口当たり純資産額     |
| (1万口当たり純資産額) | (10,901円)    | (1万口当たり純資産額)  |
|              |              | 1,1225円       |
|              |              | (11,225円)     |

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(邦貨建債券)

| 種 類       | 種 別               | 期 満              | 券 面 総 額     | 評 価 額       | 備 考 |
|-----------|-------------------|------------------|-------------|-------------|-----|
| 国債証券      | 0042 0252         | 利付国庫債券(2年) 第252回 | 460,000,000 | 460,878,600 |     |
|           | 0042 0255         | 利付国庫債券(2年) 第255回 | 250,000,000 | 250,455,000 |     |
|           | 0042 0256         | 利付国庫債券(2年) 第256回 | 551,000,000 | 552,757,690 |     |
|           | 0042 0258         | 利付国庫債券(2年) 第258回 | 162,000,000 | 162,777,600 |     |
|           | 0042 0260         | 利付国庫債券(2年) 第260回 | 379,000,000 | 380,265,860 |     |
|           | 0042 0261         | 利付国庫債券(2年) 第261回 | 125,000,000 | 125,426,250 |     |
|           | 0045 0033         | 利付国庫債券(5年) 第33回  | 153,000,000 | 152,969,400 |     |
|           | 0045 0034         | 利付国庫債券(5年) 第34回  | 280,000,000 | 279,664,000 |     |
|           | 0045 0035         | 利付国庫債券(5年) 第35回  | 700,000,000 | 699,517,000 |     |
|           | 0045 0037         | 利付国庫債券(5年) 第37回  | 437,000,000 | 437,742,900 |     |
|           | 0045 0039         | 利付国庫債券(5年) 第39回  | 52,000,000  | 52,080,600  |     |
|           | 0045 0040         | 利付国庫債券(5年) 第40回  | 60,000,000  | 59,885,400  |     |
|           | 0045 0041         | 利付国庫債券(5年) 第41回  | 475,000,000 | 474,914,500 |     |
|           | 0045 0042         | 利付国庫債券(5年) 第42回  | 131,000,000 | 130,663,330 |     |
|           | 0045 0044         | 利付国庫債券(5年) 第44回  | 23,000,000  | 22,974,470  |     |
|           | 0045 0045         | 利付国庫債券(5年) 第45回  | 100,000,000 | 99,679,000  |     |
|           | 0045 0046         | 利付国庫債券(5年) 第46回  | 241,000,000 | 239,667,270 |     |
|           | 0045 0048         | 利付国庫債券(5年) 第48回  | 46,000,000  | 45,931,920  |     |
|           | 0045 0049         | 利付国庫債券(5年) 第49回  | 70,000,000  | 69,660,500  |     |
|           | 0045 0052         | 利付国庫債券(5年) 第52回  | 277,000,000 | 277,000,000 |     |
|           | 0045 0053         | 利付国庫債券(5年) 第53回  | 294,000,000 | 295,764,000 |     |
|           | 0045 0054         | 利付国庫債券(5年) 第54回  | 220,000,000 | 221,911,800 |     |
| 0045 0057 | 利付国庫債券(5年) 第57回   | 557,000,000      | 567,020,430 |             |     |
| 0045 0058 | 利付国庫債券(5年) 第58回   | 333,000,000      | 340,122,870 |             |     |
| 0045 0060 | 利付国庫債券(5年) 第60回   | 172,000,000      | 173,807,720 |             |     |
| 0045 0062 | 利付国庫債券(5年) 第62回   | 137,000,000      | 138,874,160 |             |     |
| 0045 0063 | 利付国庫債券(5年) 第63回   | 159,000,000      | 160,458,030 |             |     |
| 0045 0064 | 利付国庫債券(5年) 第64回   | 300,000,000      | 306,522,000 |             |     |
| 0045 0066 | 利付国庫債券(5年) 第66回   | 643,000,000      | 644,890,420 |             |     |
| 0067 0207 | 利付国庫債券(10年) 第207回 | 294,000,000      | 294,849,660 |             |     |
| 0067 0208 | 利付国庫債券(10年) 第208回 | 55,000,000       | 55,268,950  |             |     |
| 0067 0209 | 利付国庫債券(10年) 第209回 | 351,000,000      | 356,812,560 |             |     |
| 0067 0210 | 利付国庫債券(10年) 第210回 | 754,000,000      | 765,649,300 |             |     |
| 0067 0212 | 利付国庫債券(10年) 第212回 | 708,000,000      | 716,531,400 |             |     |
| 0067 0214 | 利付国庫債券(10年) 第214回 | 649,000,000      | 661,305,040 |             |     |
| 0067 0215 | 利付国庫債券(10年) 第215回 | 88,000,000       | 89,820,720  |             |     |
| 0067 0216 | 利付国庫債券(10年) 第216回 | 155,000,000      | 157,997,700 |             |     |
| 0067 0217 | 利付国庫債券(10年) 第217回 | 40,000,000       | 40,848,800  |             |     |
| 0067 0218 | 利付国庫債券(10年) 第218回 | 532,000,000      | 544,337,080 |             |     |
| 0067 0219 | 利付国庫債券(10年) 第219回 | 161,000,000      | 164,760,960 |             |     |
| 0067 0220 | 利付国庫債券(10年) 第220回 | 644,000,000      | 657,620,600 |             |     |
| 0067 0221 | 利付国庫債券(10年) 第221回 | 323,000,000      | 331,995,550 |             |     |
| 0067 0222 | 利付国庫債券(10年) 第222回 | 250,000,000      | 266,604,000 |             |     |

|           |             |         |             |             |
|-----------|-------------|---------|-------------|-------------|
| 0067 0223 | 利付国庫債券(10年) | 第2.2.3回 | 115,000,000 | 117,848,550 |
| 0067 0224 | 利付国庫債券(10年) | 第2.2.4回 | 263,000,000 | 270,258,800 |
| 0067 0225 | 利付国庫債券(10年) | 第2.2.5回 | 278,000,000 | 287,040,560 |
| 0067 0226 | 利付国庫債券(10年) | 第2.2.6回 | 109,000,000 | 112,241,660 |
| 0067 0227 | 利付国庫債券(10年) | 第2.2.7回 | 507,000,000 | 519,512,760 |
| 0067 0229 | 利付国庫債券(10年) | 第2.2.9回 | 549,000,000 | 558,986,310 |
| 0067 0231 | 利付国庫債券(10年) | 第2.3.1回 | 79,000,000  | 80,180,260  |
| 0067 0232 | 利付国庫債券(10年) | 第2.3.2回 | 55,000,000  | 55,634,700  |
| 0067 0233 | 利付国庫債券(10年) | 第2.3.3回 | 700,000,000 | 712,957,000 |
| 0067 0234 | 利付国庫債券(10年) | 第2.3.4回 | 70,000,000  | 71,282,400  |
| 0067 0235 | 利付国庫債券(10年) | 第2.3.5回 | 218,000,000 | 221,950,160 |
| 0067 0236 | 利付国庫債券(10年) | 第2.3.6回 | 540,000,000 | 551,971,800 |
| 0067 0237 | 利付国庫債券(10年) | 第2.3.7回 | 193,000,000 | 197,211,260 |
| 0067 0238 | 利付国庫債券(10年) | 第2.3.8回 | 442,000,000 | 449,841,080 |
| 0067 0239 | 利付国庫債券(10年) | 第2.3.9回 | 520,000,000 | 529,063,600 |
| 0067 0240 | 利付国庫債券(10年) | 第2.4.0回 | 618,000,000 | 618,009,300 |
| 0067 0241 | 利付国庫債券(10年) | 第2.4.1回 | 84,000,000  | 85,045,800  |
| 0067 0245 | 利付国庫債券(10年) | 第2.4.5回 | 64,000,000  | 63,528,320  |
| 0067 0250 | 利付国庫債券(10年) | 第2.5.0回 | 433,000,000 | 419,416,790 |
| 0067 0252 | 利付国庫債券(10年) | 第2.5.2回 | 19,000,000  | 18,911,270  |
| 0067 0253 | 利付国庫債券(10年) | 第2.5.3回 | 300,000,000 | 308,277,000 |
| 0067 0254 | 利付国庫債券(10年) | 第2.5.4回 | 25,000,000  | 25,412,500  |
| 0067 0256 | 利付国庫債券(10年) | 第2.5.6回 | 360,000,000 | 365,767,200 |
| 0067 0258 | 利付国庫債券(10年) | 第2.5.8回 | 69,000,000  | 69,643,770  |
| 0067 0259 | 利付国庫債券(10年) | 第2.5.9回 | 699,000,000 | 713,881,710 |
| 0067 0261 | 利付国庫債券(10年) | 第2.6.1回 | 562,000,000 | 584,260,820 |
| 0067 0264 | 利付国庫債券(10年) | 第2.6.4回 | 560,000,000 | 571,558,400 |
| 0067 0265 | 利付国庫債券(10年) | 第2.6.5回 | 295,000,000 | 300,908,850 |
| 0067 0266 | 利付国庫債券(10年) | 第2.6.6回 | 312,000,000 | 316,130,880 |
| 0067 0268 | 利付国庫債券(10年) | 第2.6.8回 | 125,000,000 | 127,542,500 |
| 0067 0269 | 利付国庫債券(10年) | 第2.6.9回 | 76,000,000  | 76,455,240  |
| 0067 0270 | 利付国庫債券(10年) | 第2.7.0回 | 316,000,000 | 317,516,800 |
| 0067 0271 | 利付国庫債券(10年) | 第2.7.1回 | 56,000,000  | 55,884,640  |
| 0067 0272 | 利付国庫債券(10年) | 第2.7.2回 | 28,000,000  | 28,286,720  |
| 0067 0273 | 利付国庫債券(10年) | 第2.7.3回 | 409,000,000 | 416,222,940 |
| 0067 0274 | 利付国庫債券(10年) | 第2.7.4回 | 50,000,000  | 50,835,000  |
| 0067 0275 | 利付国庫債券(10年) | 第2.7.5回 | 97,000,000  | 97,879,790  |
| 0067 0279 | 利付国庫債券(10年) | 第2.7.9回 | 60,000,000  | 63,198,600  |
| 0067 0280 | 利付国庫債券(10年) | 第2.8.0回 | 59,000,000  | 61,544,080  |
| 0067 0281 | 利付国庫債券(10年) | 第2.8.1回 | 112,000,000 | 117,773,600 |
| 0067 0282 | 利付国庫債券(10年) | 第2.8.2回 | 823,000,000 | 843,229,340 |
| 0067 0283 | 利付国庫債券(10年) | 第2.8.3回 | 642,000,000 | 663,307,980 |
| 0067 0284 | 利付国庫債券(10年) | 第2.8.4回 | 702,000,000 | 717,682,680 |
| 0067 0285 | 利付国庫債券(10年) | 第2.8.5回 | 680,000,000 | 699,572,800 |
| 0067 0286 | 利付国庫債券(10年) | 第2.8.6回 | 150,000,000 | 153,996,000 |
| 0067 0287 | 利付国庫債券(10年) | 第2.8.7回 | 370,000,000 | 383,098,000 |
| 0067 0288 | 利付国庫債券(10年) | 第2.8.8回 | 849,000,000 | 862,337,790 |
| 0068 0014 | 利付国庫債券(30年) | 第1.4回   | 118,000,000 | 119,150,500 |
| 0068 0015 | 利付国庫債券(30年) | 第1.5回   | 162,000,000 | 166,647,780 |
| 0068 0023 | 利付国庫債券(30年) | 第2.3回   | 185,000,000 | 189,573,200 |
| 0068 0024 | 利付国庫債券(30年) | 第2.4回   | 278,000,000 | 284,421,800 |
| 0068 0026 | 利付国庫債券(30年) | 第2.6回   | 270,000,000 | 270,464,400 |
| 0068 0027 | 利付国庫債券(30年) | 第2.7回   | 80,000,000  | 81,743,200  |
| 0069 0023 | 利付国庫債券(20年) | 第2.3回   | 100,000,000 | 124,606,000 |
| 0069 0026 | 利付国庫債券(20年) | 第2.6回   | 37,000,000  | 44,982,010  |
| 0069 0029 | 利付国庫債券(20年) | 第2.9回   | 100,000,000 | 121,798,000 |
| 0069 0031 | 利付国庫債券(20年) | 第3.1回   | 140,000,000 | 163,984,800 |
| 0069 0033 | 利付国庫債券(20年) | 第3.3回   | 200,000,000 | 239,848,000 |

|           |             |           |                |                |
|-----------|-------------|-----------|----------------|----------------|
| 0069 0034 | 利付国庫債券(20年) | 第3.4回     | 85,000,000     | 100,228,600    |
| 0069 0039 | 利付国庫債券(20年) | 第3.9回     | 347,000,000    | 381,068,460    |
| 0069 0041 | 利付国庫債券(20年) | 第4.1回     | 27,000,000     | 26,577,720     |
| 0069 0042 | 利付国庫債券(20年) | 第4.2回     | 477,000,000    | 523,459,800    |
| 0069 0043 | 利付国庫債券(20年) | 第4.3回     | 40,000,000     | 46,165,600     |
| 0069 0044 | 利付国庫債券(20年) | 第4.4回     | 51,000,000     | 55,416,090     |
| 0069 0047 | 利付国庫債券(20年) | 第4.7回     | 21,000,000     | 22,065,750     |
| 0069 0049 | 利付国庫債券(20年) | 第4.9回     | 57,000,000     | 59,082,210     |
| 0069 0050 | 利付国庫債券(20年) | 第5.0回     | 92,000,000     | 93,133,440     |
| 0069 0054 | 利付国庫債券(20年) | 第5.4回     | 15,000,000     | 15,662,100     |
| 0069 0055 | 利付国庫債券(20年) | 第5.5回     | 66,000,000     | 67,191,960     |
| 0069 0057 | 利付国庫債券(20年) | 第5.7回     | 214,000,000    | 214,731,880    |
| 0069 0058 | 利付国庫債券(20年) | 第5.8回     | 135,000,000    | 136,233,550    |
| 0069 0059 | 利付国庫債券(20年) | 第5.9回     | 33,000,000     | 32,098,110     |
| 0069 0060 | 利付国庫債券(20年) | 第6.0回     | 121,000,000    | 112,752,640    |
| 0069 0063 | 利付国庫債券(20年) | 第6.3回     | 31,000,000     | 30,446,340     |
| 0069 0064 | 利付国庫債券(20年) | 第6.4回     | 54,000,000     | 53,641,980     |
| 0069 0065 | 利付国庫債券(20年) | 第6.5回     | 231,000,000    | 229,170,480    |
| 0069 0066 | 利付国庫債券(20年) | 第6.6回     | 34,000,000     | 33,256,080     |
| 0069 0067 | 利付国庫債券(20年) | 第6.7回     | 54,000,000     | 53,468,640     |
| 0069 0068 | 利付国庫債券(20年) | 第6.8回     | 38,000,000     | 39,220,180     |
| 0069 0070 | 利付国庫債券(20年) | 第7.0回     | 49,000,000     | 51,849,350     |
| 0069 0072 | 利付国庫債券(20年) | 第7.2回     | 42,000,000     | 42,606,900     |
| 0069 0073 | 利付国庫債券(20年) | 第7.3回     | 13,000,000     | 12,975,300     |
| 0069 0074 | 利付国庫債券(20年) | 第7.4回     | 78,000,000     | 78,989,040     |
| 0069 0076 | 利付国庫債券(20年) | 第7.6回     | 310,000,000    | 304,268,100    |
| 0069 0078 | 利付国庫債券(20年) | 第7.8回     | 300,000,000    | 309,642,000    |
| 0069 0090 | 利付国庫債券(20年) | 第9.0回     | 549,000,000    | 557,509,500    |
| 0069 0091 | 利付国庫債券(20年) | 第9.1回     | 434,000,000    | 447,480,040    |
| 0069 0092 | 利付国庫債券(20年) | 第9.2回     | 766,000,000    | 764,958,240    |
| 0069 0094 | 利付国庫債券(20年) | 第9.4回     | 100,000,000    | 99,658,000     |
| 0069 0095 | 利付国庫債券(20年) | 第9.5回     | 215,000,000    | 220,794,250    |
| 0069 0096 | 利付国庫債券(20年) | 第9.6回     | 86,000,000     | 85,585,480     |
| 0069 0097 | 利付国庫債券(20年) | 第9.7回     | 245,000,000    | 247,212,350    |
| 国債証券計     |             |           | 34,551,000,000 | 35,229,577,900 |
| 地方債証券     |             |           |                |                |
| 0100 0570 | 東京都公債       | 570回      | 100,000,000    | 101,902,000    |
| 0100 0592 | 東京都公債       | 592回      | 100,000,000    | 99,910,000     |
| 0100 0596 | 東京都公債       | 596回      | 100,000,000    | 97,167,000     |
| 0100 0597 | 東京都公債       | 597回      | 100,000,000    | 96,585,000     |
| 0100 0598 | 東京都公債       | 598回      | 100,000,000    | 95,962,000     |
| 0100 0636 | 東京都公債       | 636回      | 100,000,000    | 104,084,000    |
| 0101 1404 | 北海道公債       | 平成14年度4回  | 100,000,000    | 100,130,000    |
| 0102 2801 | 宮城県公債       | 28回1号     | 100,000,000    | 97,815,000     |
| 0103 0123 | 神奈川県公債      | 123回      | 100,000,000    | 101,147,000    |
| 0104 0261 | 大阪府公債       | 261回      | 100,000,000    | 100,845,000    |
| 0104 8001 | 大阪府公債(7年)   | 1回        | 100,000,000    | 102,572,000    |
| 0106 1904 | 兵庫県公債       | 平成19年度4回  | 100,000,000    | 101,798,000    |
| 0107 1503 | 静岡県公債       | 平成15年度3回  | 100,000,000    | 100,611,000    |
| 0108 1401 | 愛知県公債       | 平成14年度1回  | 100,000,000    | 100,986,000    |
| 0109 1801 | 広島県公債       | 平成18年度1回  | 100,000,000    | 104,305,000    |
| 0110 1601 | 埼玉県公債       | 平成16年度1回  | 100,000,000    | 101,009,000    |
| 0120 1603 | 千葉県公債       | 平成16年度3回  | 100,000,000    | 103,473,000    |
| 0121 1701 | 新潟県公債       | 平成17年度1回  | 100,000,000    | 99,118,000     |
| 0122 1401 | 長野県公債       | 平成14年度1回  | 100,000,000    | 99,387,000     |
| 0123 1201 | 茨城県公債       | 平成12年度1回  | 100,000,000    | 101,237,000    |
| 0150 1605 | 大阪府公債       | 平成16年度第5回 | 100,000,000    | 101,184,000    |
| 0151 1240 | 名古屋市公債      | 12回抄号     | 100,000,000    | 102,827,000    |
| 0152 1402 | 京都市公債       | 平成14年度2回  | 100,000,000    | 99,988,000     |
| 0154 1401 | 横浜市公債       | 平成14年度1回  | 100,000,000    | 100,928,000    |

|       |      |                                |               |               |
|-------|------|--------------------------------|---------------|---------------|
| 0154  | 1502 | 横浜市公安局 平成15年度2回                | 100,000,000   | 96,519,000    |
| 0155  | 1407 | 札幌市公安局 平成14年度7回                | 100,000,000   | 97,121,000    |
| 0158  | 1404 | 福岡市公安局 平成14年度4回                | 100,000,000   | 97,761,000    |
| 0160  | 1301 | 仙台市公安局 平成13年度1回                | 100,000,000   | 101,169,000   |
| 0183  | 0005 | 鹿児島県平公債 平成18年度第1回              | 100,000,000   | 102,528,000   |
| 計     |      |                                | 2,900,000,000 | 2,908,468,000 |
| 地方債証券 |      |                                |               |               |
| 特殊債券  |      |                                |               |               |
| 0903  | 0001 | 政府保証日本政策投資銀行債券 政府保証第1回         | 100,000,000   | 102,387,000   |
| 0903  | 0004 | 政府保証日本政策投資銀行債券 政府保証第4回         | 100,000,000   | 102,062,000   |
| 0903  | 9029 | 日本政策投資銀行債券 29回                 | 100,000,000   | 101,713,000   |
| 0905  | 0328 | 政府保証道路債券 政府保証第328回             | 100,000,000   | 101,299,000   |
| 0905  | 0329 | 政府保証道路債券 政府保証第329回             | 100,000,000   | 101,912,000   |
| 0905  | 0332 | 政府保証道路債券 政府保証第332回             | 100,000,000   | 101,226,000   |
| 0905  | 0335 | 政府保証道路債券 政府保証第335回             | 100,000,000   | 100,453,000   |
| 0905  | 0336 | 政府保証道路債券 政府保証第336回             | 100,000,000   | 100,426,000   |
| 0905  | 0338 | 政府保証道路債券 政府保証第338回             | 100,000,000   | 101,131,000   |
| 0905  | 0343 | 政府保証道路債券 政府保証第343回             | 100,000,000   | 99,441,000    |
| 0905  | 8005 | 政府保証 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証第5回 | 100,000,000   | 101,183,000   |
| 0906  | 0788 | 政府保証公営企業債券 政府保証第788回           | 200,000,000   | 204,406,000   |
| 0906  | 0789 | 政府保証公営企業債券 政府保証第789回           | 100,000,000   | 102,258,000   |
| 0906  | 0794 | 政府保証公営企業債券 政府保証第794回           | 100,000,000   | 102,842,000   |
| 0906  | 0807 | 政府保証公営企業債券 政府保証第807回           | 100,000,000   | 101,452,000   |
| 0906  | 0809 | 政府保証公営企業債券 政府保証第809回           | 100,000,000   | 101,422,000   |
| 0906  | 0812 | 政府保証公営企業債券 政府保証第812回           | 100,000,000   | 101,780,000   |
| 0906  | 0820 | 政府保証公営企業債券 政府保証第820回           | 100,000,000   | 100,695,000   |
| 0906  | 0832 | 政府保証公営企業債券 政府保証第832回           | 100,000,000   | 100,954,000   |
| 0906  | 0858 | 政府保証公営企業債券 政府保証第858回           | 100,000,000   | 100,721,000   |
| 0906  | 9012 | 公営企業債券(財投機関債) 第12回             | 100,000,000   | 100,895,000   |
| 0906  | 9020 | 公営企業債券(財投機関債) 第20回             | 100,000,000   | 103,840,000   |
| 0907  | 0199 | 政府保証首都高速道路債券 第199回             | 100,000,000   | 100,007,000   |
| 0910  | 0176 | 政府保証中小企業債券 政府保証第176回           | 100,000,000   | 102,028,000   |
| 0910  | 9020 | 中小企業債券(財投機関債) 第20回             | 100,000,000   | 98,726,000    |
| 0916  | 9025 | 国際協力銀行債券(財投機関債) 第25回           | 100,000,000   | 104,000,000   |
| 0917  | 7007 | 政府保証都市再生債券 第7回                 | 100,000,000   | 100,870,000   |
| 0942  | 0075 | 政府保証預金保険機構債券 政府保証第75回          | 100,000,000   | 98,972,000    |
| 0942  | 0108 | 政府保証預金保険機構債券 政府保証第108回         | 100,000,000   | 101,814,000   |
| 0943  | 0001 | 政府保証住宅金融公債債券 政府保証第1回           | 100,000,000   | 102,452,000   |
| 0943  | 0002 | 政府保証住宅金融公債債券 政府保証第2回           | 100,000,000   | 102,784,000   |
| 0944  | 0014 | 政府保証国民生活債券 政府保証第14回            | 100,000,000   | 101,217,000   |
| 0945  | 9008 | 農林漁業金融公債債券(財投機関債) 第8回          | 200,000,000   | 200,366,000   |

|        |      |  |               |               |
|--------|------|--|---------------|---------------|
| 0949   | 0003 | 沖縄振興開発金融公債債券(財投機関債) 第3回                    | 100,000,000   | 101,399,000   |
| 0949   | 0005 | 沖縄振興開発金融公債債券(財投機関債) 第5回                    | 200,000,000   | 198,992,000   |
| 0953   | 1660 | 利附農林債券(5年) 利附第1660号                        | 100,000,000   | 98,937,000    |
| 0953   | 1665 | 利附農林債券(5年) 利附第1665号                        | 100,000,000   | 99,529,000    |
| 0953   | 1667 | 利附農林債券(5年) 利附第1667号                        | 100,000,000   | 99,619,000    |
| 0954   | 1626 | 利附長期信用債券(5年) 利付第1626回                      | 100,000,000   | 98,787,000    |
| 0956   | 1559 | 利附あおぞら債券(5年) 利附第1559回                      | 100,000,000   | 99,463,000    |
| 0958   | 0185 | 利附しんきん中金債券(5年) 利附第185回                     | 100,000,000   | 99,101,000    |
| 0958   | 0198 | 利附しんきん中金債券(5年) 利附第198回                     | 100,000,000   | 101,575,000   |
| 0958   | 0201 | 利附しんきん中金債券(5年) 利附第201回                     | 100,000,000   | 101,537,000   |
| 0959   | 1662 | みずほコーポレート銀行債券(5年) 利附第1662号                 | 100,000,000   | 99,643,000    |
| 0959   | 1669 | みずほコーポレート銀行債券(5年) 利附第1669号                 | 100,000,000   | 99,055,000    |
| 0972   | 3076 | 利附商工債券(3年) 利附第3076号                        | 100,000,000   | 100,348,000   |
| 0972   | 3083 | 利附商工債券(3年) 利附第3083号                        | 100,000,000   | 100,396,000   |
| 0972   | 3065 | 利附商工債券(3年) 利附第3065号                        | 100,000,000   | 100,170,000   |
| 1094   | 1005 | 第5回 韓国ガス公社円貨債券(2005)                       | 100,000,000   | 99,020,000    |
| 計      |      |  | 5,200,000,000 | 5,245,305,000 |
| 特殊債券 計 |      |  |               |               |
| 社債券    |      |  |               |               |
| 0931   | 0324 | 東京都交通債券 324回                               | 100,000,000   | 114,520,000   |
| 1210   | 1011 | ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーション 第11回円貨社債(2005) | 100,000,000   | 97,665,000    |
| 1212   | 1004 | ジェン・ビル・モルガン・チェース・アシエ・カンパニー 第2回(2004)       | 100,000,000   | 98,138,000    |
| 1218   | 1011 | エイエスビシー・ファイナンス・コーポレーション 第11回円貨社債(2006)     | 100,000,000   | 95,820,000    |
| 1236   | 1003 | ドイツ銀行AGロンドン支店 第3回円貨社債(2007)                | 100,000,000   | 98,460,000    |
| 2801   | 0401 | キッコーマン(社債間限定同順位特約付) 4回                     | 100,000,000   | 98,872,000    |
| 4010   | 3201 | 三菱化学(社債間限定同順位特約付) 32回                      | 100,000,000   | 100,869,000   |
| 4043   | 1901 | トクヤマ 19回                                   | 100,000,000   | 100,460,000   |
| 4631   | 3001 | 大日本インキ化学工業(社債間限定同順位特約付) 30回                | 100,000,000   | 99,475,000    |
| 5001   | 1901 | 新日本石油(社債間限定同順位特約付) 19回                     | 100,000,000   | 101,860,000   |
| 5108   | 0201 | プリヂストン(社債間限定同順位特約付) 2回                     | 100,000,000   | 102,197,000   |
| 5233   | 1605 | 太平洋セメント(社債間限定同順位特約付) 16回                   | 100,000,000   | 101,416,000   |
| 5401   | 4901 | 新日本製鉄(社債間限定同順位特約付) 49回                     | 100,000,000   | 97,152,000    |
| 5411   | 0801 | ジェイエフイーホールディングス(JFEスチール(株)保証付) 8回          | 100,000,000   | 100,270,000   |
| 5711   | 2001 | 三菱マテリアル(社債間限定同順位特約付) 20回                   | 100,000,000   | 101,515,000   |

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

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

(1) 貸借対照表

| 科目       | 対象年月日           |                 | 注記<br>番号 | (単位：円) |    |
|----------|-----------------|-----------------|----------|--------|----|
|          | 平成19年6月15日現在    | 平成19年12月17日現在   |          | 金額     | 金額 |
| 資産の部     |                 |                 |          |        |    |
| 流動資産     |                 |                 |          |        |    |
| 預金       | 1,249,983,444   | 758,253,553     |          |        |    |
| コール・ローン  | 772,423,879     | 880,495,689     |          |        |    |
| 国債証券     | 880,917,341,698 | 878,013,170,180 |          |        |    |
| 派生商品評価勘定 | 5,746,415       | 3,852,221       |          |        |    |
| 未収入金     | 6,728,570       | 1,836,696,237   |          |        |    |
| 未収利息     | 13,073,796,632  | 13,555,684,917  |          |        |    |
| 前払費用     | 2,406,227,130   | 1,357,985,393   |          |        |    |
| 流動資産合計   | 898,432,247,768 | 896,406,138,200 |          |        |    |
| 資産合計     | 898,432,247,768 | 896,406,138,200 |          |        |    |
| 負債の部     |                 |                 |          |        |    |
| 流動負債     |                 |                 |          |        |    |
| 派生商品評価勘定 | 36,740          | 2,707,442       |          |        |    |
| 未払金      | 2,385,928,922   | 4,168,712,297   |          |        |    |
| 未払解約金    | 6,224,304       | 6,215,002       |          |        |    |
| 流動負債合計   | 2,392,189,966   | 4,177,634,741   |          |        |    |
| 負債合計     | 2,392,189,966   | 4,177,634,741   |          |        |    |
| 純資産の部    |                 |                 |          |        |    |
| 元本等      |                 |                 |          |        |    |
| 元本       | 520,406,143,348 | 508,098,126,010 |          |        |    |
| 剰余金      |                 |                 |          |        |    |
| 剰余金      | 375,633,914,454 | 384,130,377,449 |          |        |    |
| 剰余金合計    | 375,633,914,454 | 384,130,377,449 |          |        |    |
| 元本等合計    | 896,040,057,802 | 892,228,503,459 |          |        |    |
| 純資産合計    | 896,040,057,802 | 892,228,503,459 |          |        |    |
| 負債・純資産合計 | 898,432,247,768 | 896,406,138,200 |          |        |    |

|           |                                |                |                |
|-----------|--------------------------------|----------------|----------------|
| 6201 1501 | 豊田自動織機（社債間限定同順位特約付） 1 5 回      | 100,000,000    | 101,534,000    |
| 6473 0305 | ジェイテクト（社債間限定同順位特約付）（旧豊田工業） 3 回 | 100,000,000    | 98,728,000     |
| 7011 1701 | 三菱重工（社債間限定同順位特約付） 1 7 回        | 100,000,000    | 96,244,000     |
| 8002 6601 | 丸紅（社債間限定同順位特約付） 6 6 回          | 100,000,000    | 101,006,000    |
| 8063 2301 | 住友商事（社債間限定同順位特約付） 2 3 回        | 100,000,000    | 100,412,000    |
| 8068 3101 | 三菱商事（担保提供制限等財務上特約無） 3 1 回      | 100,000,000    | 102,398,000    |
| 8310 0301 | みずほコーポレート銀行（劣後特約付） 3 回         | 100,000,000    | 100,958,000    |
| 8315 0085 | 三菱東京UFJ銀行（特定社債間限定同順位特約付） 8 5 回 | 100,000,000    | 100,898,000    |
| 8604 0501 | 野村ホールディングス 5 回                 | 100,000,000    | 100,113,000    |
| 8801 2601 | 三井不動産（社債間限定同順位特約付） 2 6 回       | 100,000,000    | 102,349,000    |
| 8830 5001 | 住友不動産（社債間限定同順位特約付） 5 0 回       | 100,000,000    | 100,681,000    |
| 9005 5701 | 東京急行電鉄（社債間限定同順位特約付） 5 7 回      | 100,000,000    | 99,877,000     |
| 9020 3101 | 東日本旅客鉄道（社債間限定同順位特約付） 3 1 回     | 100,000,000    | 101,357,000    |
| 9022 1601 | 東海旅客鉄道（社債間限定同順位特約付） 1 6 回      | 100,000,000    | 99,696,000     |
| 9075 0601 | 福山通運（社債間限定同順位特約付） 2 6 回        | 100,000,000    | 99,900,000     |
| 9101 2601 | 日本郵船（社債間限定同順位特約付） 2 6 回        | 100,000,000    | 101,854,000    |
| 9432 0043 | 日本電信電話 4 3 回                   | 100,000,000    | 101,890,000    |
| 9501 0496 | 東京電力 4 9 6 回                   | 200,000,000    | 202,480,000    |
| 9501 0510 | 東京電力 5 1 0 回                   | 100,000,000    | 100,493,000    |
| 9501 0523 | 東京電力 5 2 3 回                   | 100,000,000    | 102,209,000    |
| 9502 0430 | 中部電力 4 3 0 回                   | 100,000,000    | 101,204,000    |
| 9502 0461 | 中部電力 4 6 1 回                   | 100,000,000    | 98,671,000     |
| 9503 0433 | 関西電力 4 3 3 回                   | 100,000,000    | 99,305,000     |
| 9503 0435 | 関西電力 4 3 5 回                   | 100,000,000    | 101,290,000    |
| 9503 0451 | 関西電力 4 5 1 回                   | 100,000,000    | 101,988,000    |
| 9504 0316 | 中国電力 3 1 6 回                   | 100,000,000    | 102,377,000    |
| 9506 0434 | 東北電力 4 3 4 回                   | 100,000,000    | 102,551,000    |
| 9507 0257 | 四国電力 2 5 7 回                   | 100,000,000    | 99,819,000     |
| 社債券計      |                                | 4,400,000,000  | 4,430,971,000  |
| 合計        |                                | 47,031,000,000 | 47,814,321,300 |

第2 有価証券先物取引等及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
 該当事項はありません。



(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 対象期間                      | 自 平成18年12月16日<br>至 平成19年6月15日   | 自 平成19年6月16日<br>至 平成19年12月17日  |
|---------------------------|---|--|
| 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) 証券取引所に上場されている有価証券</p> <p>証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所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）又は証券取引所が発表する基準値で評価しております。</p> <p>(2) 証券取引所に上場されていない有価証券</p> <p>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、金融機関の提示する価値（ただし、売買配相場は使用しない）又は価格提供会社の提示する価値のいずれかから入手した価値で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p> <p>適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的な事由をもつて時価と認められた価値もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもつて時価と認められた価値で評価しております。</p> | <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</p> <p>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）又は金融商品取引所等が発表する基準値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</p> <p>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、金融機関の提示する価値（ただし、売買配相場は使用しない）又は価格提供会社の提示する価値のいずれかから入手した価値で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p> <p>適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもつて時価と認められた価値もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもつて時価と認められた価値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</p> <p>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>   | <p>為替予約取引</p> <p>同左</p>  |
| 3. その他財務諸表作成のための基となる重要な事項 | <p>「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>   | <p>同左</p>  |

(貸借対照表に関する注記)

|    | 平成19年6月15日現在  | 平成18年12月16日  | 平成19年12月17日現在  |
|----|---|--|--|
| 1. | <p>期首 418,346,648,743 円</p> <p>期首元本額 112,993,893,114 円</p> <p>期首からの追加設定元本額 10,934,398,509 円</p> <p>期首からの繰上元本額</p> <p>平成18年6月15日現在の元本の内訳<br/>インデックスファンド海外債<br/>券ヘッジなし(D/C専用)<br/>D C インデックスバラン<br/>ス(株式20)<br/>D C インデックスバラン<br/>ス(株式40)<br/>D C インデックスバラン<br/>ス(株式60)<br/>D C インデックスバラン<br/>ス(株式80)<br/>財産3分法ファンド(不動産・<br/>債券・株式)毎月分配型<br/>世界の財産3分法ファンド(不<br/>動産・債券・株式)毎月分配型<br/>日興五大陸債券ファンド(毎<br/>月分配型)<br/>世界全資産ファンド(債券<br/>/株式/不動産・資源・食<br/>料)毎月分配型<br/>アセット・ナビゲーション・<br/>ファンド(株式80)<br/>アセット・ナビゲーション・<br/>ファンド(株式60)<br/>アセット・ナビゲーション・<br/>ファンド(株式40)<br/>アセット・ナビゲーション・<br/>ファンド(株式20)<br/>世界国債インデックスファン<br/>ド(適格機関投資家向け)<br/>国際分散型ファンド40(適格<br/>機関投資家向け)<br/>世界アセットバランスマ<br/>ンD40(適格機関投資家向け)<br/>世界アセットバランスマ<br/>ンD25(適格機関投資家向け)<br/>3資産バランスマンD(適<br/>格機関投資家向け)<br/>海外債券インデックス(ヘッ<br/>ジなし)<br/>年金積立アセット・ナビゲ<br/>ーション・ファンド(株式20)<br/>年金積立アセット・ナビゲ<br/>ーション・ファンド(株式40)<br/>年金積立アセット・ナビゲ<br/>ーション・ファンド(株式60)<br/>年金積立アセット・ナビゲ<br/>ーション・ファンド(株式80)<br/>年金積立インデックスフ<br/>ァンド海外債券(ヘッジなし)<br/>海外債券インデックスフ<br/>ァンド(個人型年金向け)<br/>(合計) 520,406,143,348 円</p> <p>本報告書における開示対象フ<br/>ァンドの特定期間末日における当<br/>該親投資信託の受益権の総数</p> | <p>期首 418,346,648,743 円</p> <p>期首元本額 112,993,893,114 円</p> <p>期首からの追加設定元本額 10,934,398,509 円</p> <p>期首からの繰上元本額</p> <p>平成18年12月16日現在の元本の内訳<br/>インデックスファンド海外債<br/>券ヘッジなし(D/C専用)<br/>D C インデックスバラン<br/>ス(株式20)<br/>D C インデックスバラン<br/>ス(株式40)<br/>D C インデックスバラン<br/>ス(株式60)<br/>D C インデックスバラン<br/>ス(株式80)<br/>財産3分法ファンド(不動産・<br/>債券・株式)毎月分配型<br/>世界の財産3分法ファンド(不<br/>動産・債券・株式)毎月分配型<br/>日興五大陸債券ファンド(毎<br/>月分配型)<br/>世界全資産ファンド(債券<br/>/株式/不動産・資源・食<br/>料)毎月分配型<br/>アセット・ナビゲーション・<br/>ファンド(株式80)<br/>アセット・ナビゲーション・<br/>ファンド(株式60)<br/>アセット・ナビゲーション・<br/>ファンド(株式40)<br/>アセット・ナビゲーション・<br/>ファンド(株式20)<br/>世界国債インデックスファン<br/>ド(適格機関投資家向け)<br/>国際分散型ファンド40(適格<br/>機関投資家向け)<br/>世界アセットバランスマ<br/>ンD40(適格機関投資家向け)<br/>世界アセットバランスマ<br/>ンD25(適格機関投資家向け)<br/>3資産バランスマンD(適<br/>格機関投資家向け)<br/>海外債券インデックス(ヘッ<br/>ジなし)<br/>年金積立アセット・ナビゲ<br/>ーション・ファンド(株式20)<br/>年金積立アセット・ナビゲ<br/>ーション・ファンド(株式40)<br/>年金積立アセット・ナビゲ<br/>ーション・ファンド(株式60)<br/>年金積立アセット・ナビゲ<br/>ーション・ファンド(株式80)<br/>年金積立インデックスフ<br/>ァンド海外債券(ヘッジなし)<br/>海外債券インデックスフ<br/>ァンド(個人型年金向け)<br/>(合計) 520,406,143,348 円</p> <p>本報告書における開示対象フ<br/>ァンドの特定期間末日における当<br/>該親投資信託の受益権の総数</p> | <p>期首 520,406,143,348 円</p> <p>期首元本額 112,993,893,114 円</p> <p>期首からの追加設定元本額 10,934,398,509 円</p> <p>期首からの繰上元本額</p> <p>平成19年12月17日現在の元本の内訳<br/>インデックスファンド海外債<br/>券ヘッジなし(D/C専用)<br/>D C インデックスバラン<br/>ス(株式20)<br/>D C インデックスバラン<br/>ス(株式40)<br/>D C インデックスバラン<br/>ス(株式60)<br/>D C インデックスバラン<br/>ス(株式80)<br/>財産3分法ファンド(不動産・<br/>債券・株式)毎月分配型<br/>世界の財産3分法ファンド(不<br/>動産・債券・株式)毎月分配型<br/>日興五大陸債券ファンド(毎<br/>月分配型)<br/>世界全資産ファンド(債券<br/>/株式/不動産・資源・食<br/>料)毎月分配型<br/>アセット・ナビゲーション・<br/>ファンド(株式80)<br/>アセット・ナビゲーション・<br/>ファンド(株式60)<br/>アセット・ナビゲーション・<br/>ファンド(株式40)<br/>アセット・ナビゲーション・<br/>ファンド(株式20)<br/>世界国債インデックスファン<br/>ド(適格機関投資家向け)<br/>国際分散型ファンド40(適格<br/>機関投資家向け)<br/>世界アセットバランスマ<br/>ンD40(適格機関投資家向け)<br/>世界アセットバランスマ<br/>ンD25(適格機関投資家向け)<br/>3資産バランスマンD(適<br/>格機関投資家向け)<br/>海外債券インデックス(ヘッ<br/>ジなし)<br/>年金積立アセット・ナビゲ<br/>ーション・ファンド(株式20)<br/>年金積立アセット・ナビゲ<br/>ーション・ファンド(株式40)<br/>年金積立アセット・ナビゲ<br/>ーション・ファンド(株式60)<br/>年金積立アセット・ナビゲ<br/>ーション・ファンド(株式80)<br/>年金積立インデックスフ<br/>ァンド海外債券(ヘッジなし)<br/>海外債券インデックスフ<br/>ァンド(個人型年金向け)<br/>(合計) 508,098,126,010 円</p> <p>本報告書における開示対象フ<br/>ァンドの特定期間末日における当<br/>該親投資信託の受益権の総数</p> |
| 2. | <p>本報告書における開示対象フ<br/>ァンドの特定期間末日における当<br/>該親投資信託の受益権の総数</p>  | <p>本報告書における開示対象フ<br/>ァンドの特定期間末日における当<br/>該親投資信託の受益権の総数</p>   | <p>本報告書における開示対象フ<br/>ァンドの特定期間末日における当<br/>該親投資信託の受益権の総数</p>   |

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

(有価証券に関する注記)

対象期間 (自 平成 18 年 12 月 16 日 至 平成 19 年 6 月 15 日)

売買目的有価証券

| 種 類  | 貸借対照表計上額        | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|------|-----------------|-------------------|
| 国債証券 | 880,917,341,698 | 34,959,489,413    |
| 合計   | 880,917,341,698 | 34,959,489,413    |

対象期間 (自 平成 19 年 6 月 16 日 至 平成 19 年 12 月 17 日)

売買目的有価証券

| 種 類  | 貸借対照表計上額        | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|------|-----------------|-------------------|
| 国債証券 | 878,013,170,180 | 3,563,393,775     |
| 合計   | 878,013,170,180 | 3,563,393,775     |

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の状況に関する事項

| 取引の内容               | 自 平成18年12月16日<br>至 平成19年6月15日   | 自 平成19年12月16日<br>至 平成19年12月17日 |
|---------------------|---|--------------------------------|
| 取引の内容               | 当投資信託が利用することができるデリバティブ取引等は、内外の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨先物取引、通貨オプション取引、金利先物取引、金利先渡取引、スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引、および為替予約取引であります。 | 同左                             |
| 取引の利用目的及び取引に対する取組方針 | 市場動向を勘案し、デリバティブ取引を行う方針であります。また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。  | 同左                             |
| 取引に係るリスクの内容         | デリバティブ取引には、有価証券、為替、金利等の市場価格が変動することによって発生するリスクがあります。   | 同左                             |
| 取引に係るリスク管理体制        | デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門が執行し、リスク管理業務担当部門が日常的にこれを監視しております。   | 同左                             |

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

| 区分         | 種 類           | 平成19年6月15日現在  |               | 評価損益      |
|------------|---------------|---------------|---------------|-----------|
|            |               | 契 約 額         | 時 価           |           |
| 市場取引以外での取引 | 為替予約取引        | -             | -             | -         |
|            | 買建            | 1,179,406,825 | 1,185,116,500 | 5,709,675 |
|            | アメリカドル        | 592,343,681   | 597,111,880   | 4,768,199 |
|            | デนมマーククローネ    | 66,717,144    | 66,954,420    | 237,276   |
| 合計         | 520,346,000   | 521,050,200   | 704,200       |           |
| 合計         | 1,179,406,825 | 1,185,116,500 | 5,709,675     |           |

| 区分         | 種 類           | 平成19年12月17日現在 |               | 評価損益      |
|------------|---------------|---------------|---------------|-----------|
|            |               | 契 約 額         | 時 価           |           |
| 市場取引以外での取引 | 為替予約取引        | -             | -             | -         |
|            | 売建            | 35,539,619    | 35,482,690    | 56,929    |
|            | スイスフラン        | 35,539,619    | 35,482,690    | 56,929    |
|            | 買建            | 1,635,637,020 | 1,636,724,870 | 1,087,850 |
|            | アメリカドル        | 608,052,228   | 611,834,400   | 3,782,172 |
|            | イギリスポンド       | 52,571,100    | 52,571,100    | -         |
| 合計         | 921,508,050   | 919,143,800   | 2,364,250     |           |
| 合計         | 1,671,176,639 | 1,672,207,560 | 1,144,779     |           |

(注) 時価の算定方法

- 計算期間末日に對顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。  
計算期間末日において為替予約の受渡日の對顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。  
計算期間末日において当該日の對顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっています。  
・計算期間末日に当該日を超える對顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しています。  
・計算期間末日に当該日を超える對顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている對顧客先物相場の仲値を用います。
- 計算期間末日に對顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の對顧客相場の仲値で評価しています。

(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19年6月15日現在 | 平成19年12月17日現在 |
|--------------|--------------|---------------|
| 1口当たり純資産額    | 1,7218 円     | 1,7560 円      |
| (1万口当たり純資産額) | (17,218 円)   | (17,560 円)    |

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(外貨建債券) アメリカドル

| 種 類                           | 銘柄                            | 券面総額          | 評価額           | 備 考 |
|-------------------------------|-------------------------------|---------------|---------------|-----|
| 国債証券                          | 108K03 アメリカ国債 4.625% 20081130 | 16,900,000.00 | 17,103,327.28 |     |
|                               | 108L00 アメリカ国債 3.375% 20081215 | 17,650,000.00 | 17,661,031.25 |     |
|                               | 108L02 アメリカ国債 4.75% 20081231  | 19,400,000.00 | 19,666,750.00 |     |
|                               | 109A00 アメリカ国債 3.25% 20090115  | 13,450,000.00 | 13,446,847.32 |     |
|                               | 109A01 アメリカ国債 4.875% 20090131 | 19,000,000.00 | 19,319,139.20 |     |
|                               | 109B00 アメリカ国債 3% 20090215     | 15,350,000.00 | 15,294,835.16 |     |
|                               | 109B01 アメリカ国債 4.5% 20090215   | 20,100,000.00 | 20,362,240.67 |     |
|                               | 109B02 アメリカ国債 4.75% 20090228  | 19,000,000.00 | 19,314,687.49 |     |
|                               | 109C00 アメリカ国債 2.625% 20090315 | 14,400,000.00 | 14,278,500.00 |     |
|                               | 109C01 アメリカ国債 4.5% 20090331   | 18,500,000.00 | 18,773,163.60 |     |
|                               | 109D00 アメリカ国債 3.125% 20090415 | 13,750,000.00 | 13,718,846.62 |     |
|                               | 109D01 アメリカ国債 4.5% 20090430   | 17,100,000.00 | 17,367,187.50 |     |
|                               | 109E00 アメリカ国債 5.5% 20090515   | 11,340,000.00 | 11,686,400.69 |     |
|                               | 109E01 アメリカ国債 3.875% 20090515 | 17,850,000.00 | 17,989,453.11 |     |
|                               | 109E02 アメリカ国債 4.875% 20090515 | 23,160,000.00 | 23,659,387.50 |     |
|                               | 109E03 アメリカ国債 4.875% 20090531 | 16,550,000.00 | 16,919,788.23 |     |
|                               | 109F00 アメリカ国債 4% 20090615     | 13,800,000.00 | 13,944,468.06 |     |
|                               | 109F01 アメリカ国債 4.875% 20090630 | 19,000,000.00 | 19,437,889.20 |     |
|                               | 109G00 アメリカ国債 3.625% 20090715 | 11,690,000.00 | 11,744,796.86 |     |
|                               | 109G01 アメリカ国債 4.625% 20090731 | 18,000,000.00 | 18,368,436.60 |     |
|                               | 109H00 アメリカ国債 6% 20090815     | 30,000,000.00 | 31,293,750.00 |     |
|                               | 109H01 アメリカ国債 3.5% 20090815   | 13,210,000.00 | 13,249,216.49 |     |
|                               | 109H02 アメリカ国債 4.875% 20090815 | 18,400,000.00 | 18,852,811.11 |     |
|                               | 109H03 アメリカ国債 4% 20090831     | 15,340,000.00 | 15,510,177.35 |     |
|                               | 109I00 アメリカ国債 3.375% 20090915 | 11,700,000.00 | 11,712,796.27 |     |
|                               | 109I01 アメリカ国債 4% 20090930     | 15,850,000.00 | 16,036,979.28 |     |
|                               | 109J00 アメリカ国債 3.375% 20091015 | 20,430,000.00 | 20,474,690.59 |     |
|                               | 109J01 アメリカ国債 3.625% 20091031 | 16,800,000.00 | 16,893,186.24 |     |
|                               | 109K00 アメリカ国債 3.5% 20091115   | 17,970,000.00 | 18,048,618.75 |     |
|                               | 109K01 アメリカ国債 4.625% 20091115 | 16,300,000.00 | 16,704,952.31 |     |
| 109L00 アメリカ国債 3.5% 20091215   | 11,800,000.00                 | 11,846,093.16 |               |     |
| 110A00 アメリカ国債 3.625% 20100115 | 15,300,000.00                 | 15,408,772.28 |               |     |
| 110B00 アメリカ国債 6.5% 20100215   | 25,680,000.00                 | 27,365,250.00 |               |     |
| 110B01 アメリカ国債 3.5% 20100215   | 10,900,000.00                 | 10,944,281.25 |               |     |
| 110B02 アメリカ国債 4.75% 20100215  | 13,000,000.00                 | 13,392,030.60 |               |     |
| 110C00 アメリカ国債 4% 20100315     | 13,650,000.00                 | 13,861,147.75 |               |     |
| 110D00 アメリカ国債 4% 20100415     | 10,550,000.00                 | 10,720,612.49 |               |     |
| 110E00 アメリカ国債 3.875% 20100515 | 9,360,000.00                  | 9,489,431.01  |               |     |
| 110E01 アメリカ国債 4.5% 20100515   | 12,050,000.00                 | 12,395,495.19 |               |     |
| 110F00 アメリカ国債 3.625% 20100615 | 12,070,000.00                 | 12,172,783.25 |               |     |
| 110H00 アメリカ国債 5.75% 20100815  | 28,550,000.00                 | 30,305,376.69 |               |     |
| 110H01 アメリカ国債 4.125% 20100815 | 10,030,000.00                 | 10,236,868.75 |               |     |
| 110I00 アメリカ国債 3.875% 20100915 | 17,730,000.00                 | 18,000,104.10 |               |     |
| 110J00 アメリカ国債 4.25% 20101015  | 11,850,000.00                 | 12,151,804.09 |               |     |

(単位: アメリカドル)

|                               |               |               |
|-------------------------------|---------------|---------------|
| 110J01 アメリカ国債 3.875% 20100715 | 7,960,000.00  | 8,078,155.85  |
| 110K00 アメリカ国債 4.5% 20101115   | 11,400,000.00 | 11,774,952.84 |
| 110L00 アメリカ国債 4.375% 20101215 | 11,000,000.00 | 11,328,280.70 |
| 111A00 アメリカ国債 4.25% 20110115  | 13,830,000.00 | 14,208,163.34 |
| 111B00 アメリカ国債 5% 20110215     | 19,200,000.00 | 20,179,499.52 |
| 111B01 アメリカ国債 4.5% 20110228   | 13,000,000.00 | 13,457,030.60 |
| 111C00 アメリカ国債 4.75% 20110331  | 14,250,000.00 | 14,873,437.50 |
| 111D00 アメリカ国債 4.875% 20110430 | 12,750,000.00 | 13,348,652.02 |
| 111E00 アメリカ国債 4.875% 20110531 | 14,580,000.00 | 15,272,550.00 |
| 111F00 アメリカ国債 5.125% 20110630 | 13,770,000.00 | 14,540,259.37 |
| 111G00 アメリカ国債 4.875% 20110731 | 13,000,000.00 | 13,631,718.09 |
| 111H00 アメリカ国債 5% 20110815     | 23,000,000.00 | 24,257,812.45 |
| 111H01 アメリカ国債 4.625% 20110831 | 14,000,000.00 | 14,564,375.00 |
| 111I00 アメリカ国債 4.5% 20110930   | 13,500,000.00 | 13,995,702.45 |
| 111J00 アメリカ国債 4.625% 20111031 | 13,600,000.00 | 14,163,124.32 |
| 111K00 アメリカ国債 4.5% 20111130   | 13,580,000.00 | 14,078,639.94 |
| 111L00 アメリカ国債 4.625% 20111231 | 12,070,000.00 | 12,579,203.11 |
| 112A00 アメリカ国債 4.75% 20120131  | 12,000,000.00 | 12,563,124.39 |
| 112B00 アメリカ国債 4.875% 20120215 | 20,050,000.00 | 21,105,756.76 |
| 112B01 アメリカ国債 4.625% 20120229 | 12,720,000.00 | 13,246,686.86 |
| 112C00 アメリカ国債 4.5% 20120331   | 12,500,000.00 | 12,954,101.25 |
| 112D00 アメリカ国債 4.5% 20120430   | 11,900,000.00 | 12,324,866.89 |
| 112E00 アメリカ国債 4.75% 20120531  | 14,200,000.00 | 14,856,750.00 |
| 112F00 アメリカ国債 4.875% 20120630 | 13,380,000.00 | 14,064,678.68 |
| 112G00 アメリカ国債 4.625% 20120731 | 12,000,000.00 | 12,494,061.60 |
| 112H00 アメリカ国債 4.375% 20120815 | 17,650,000.00 | 18,262,234.35 |
| 112H01 アメリカ国債 4.125% 20120831 | 12,050,000.00 | 12,297,588.94 |
| 112I00 アメリカ国債 4.25% 20120930  | 12,000,000.00 | 12,311,250.00 |
| 112J00 アメリカ国債 3.875% 20121031 | 12,000,000.00 | 12,112,500.00 |
| 112K00 アメリカ国債 4% 20121115     | 19,870,000.00 | 20,236,353.09 |
| 113B00 アメリカ国債 3.875% 20130215 | 16,750,000.00 | 16,938,437.50 |
| 113E00 アメリカ国債 3.625% 20130515 | 16,900,000.00 | 16,863,031.24 |
| 113H00 アメリカ国債 4.25% 20130815  | 30,350,000.00 | 31,198,850.01 |
| 113K00 アメリカ国債 4.25% 20131115  | 27,470,000.00 | 28,229,715.80 |
| 114B00 アメリカ国債 4% 20140215     | 25,530,000.00 | 25,865,081.25 |
| 114E00 アメリカ国債 4.75% 20140515  | 23,800,000.00 | 25,079,250.00 |
| 114H00 アメリカ国債 4.25% 20140815  | 22,500,000.00 | 23,016,795.74 |
| 114K01 アメリカ国債 4.25% 20141115  | 22,320,000.00 | 22,786,400.00 |
| 115B00 アメリカ国債 4% 20150215     | 22,600,000.00 | 22,645,905.05 |
| 115E00 アメリカ国債 4.125% 20150515 | 22,000,000.00 | 22,144,374.99 |
| 115H00 アメリカ国債 4.25% 20150815  | 18,350,000.00 | 18,570,772.51 |
| 115K01 アメリカ国債 4.5% 20151115   | 21,100,000.00 | 21,673,656.22 |
| 116B00 アメリカ国債 4.5% 20160215   | 21,410,000.00 | 21,951,940.61 |
| 116E00 アメリカ国債 5.125% 20160515 | 18,000,000.00 | 19,200,936.57 |
| 116H00 アメリカ国債 4.875% 20160815 | 17,410,000.00 | 18,261,456.94 |
| 116K00 アメリカ国債 4.625% 20161115 | 19,000,000.00 | 19,581,875.00 |
| 117B00 アメリカ国債 4.625% 20170215 | 22,800,000.00 | 23,469,750.00 |
| 117E00 アメリカ国債 4.5% 20170515   | 20,030,000.00 | 20,424,340.61 |
| 117H00 アメリカ国債 4.75% 20170815  | 19,500,000.00 | 20,267,812.50 |
| 117K00 アメリカ国債 4.25% 20171115  | 13,000,000.00 | 13,018,280.60 |
| 118K00 アメリカ国債 4.75% 20181115  | 5,400,000.00  | 7,522,875.00  |
| 215020 アメリカ国債 11.25% 20150215 | 8,600,000.00  | 12,441,780.80 |
| 216110 アメリカ国債 9% 20161115     | 13,900,000.00 | 17,216,452.39 |
| 216E00 アメリカ国債 7.25% 20160515  | 21,500,000.00 | 26,102,343.72 |
| 217050 アメリカ国債 8.75% 20170515  | 11,050,000.00 | 14,825,991.63 |
| 217080 アメリカ国債 8.875% 20170815 | 6,150,000.00  | 8,344,781.25  |
| 218E00 アメリカ国債 9.125% 20180515 | 4,520,000.00  | 6,299,750.00  |
| 219020 アメリカ国債 8.875% 20190215 | 8,650,000.00  | 11,981,601.13 |
| 219022 アメリカ国債 8.125% 20190815 | 25,450,000.00 | 33,761,015.58 |

(外貨建債券) オーストラリアドル (単位: オーストラリアドル)

| 種 類  | 銘 柄         | 券面総額                     | 評 価 額           | 備 考             |  |
|------|-------------|--------------------------|-----------------|-----------------|--|
| 国債証券 | 309100      | オーストラリア国債 7.5% 20090915  | 5,600,000.00    | 5,664,248.80    |  |
|      | 310H00      | オーストラリア国債 5.25% 20100815 | 4,990,000.00    | 4,939,312.10    |  |
|      | 311F00      | オーストラリア国債 5.75% 20110615 | 5,700,000.00    | 5,539,413.90    |  |
|      | 312000      | オーストラリア国債 5.75% 20120415 | 4,200,000.00    | 4,065,297.60    |  |
|      | 313E00      | オーストラリア国債 6.5% 20130515  | 4,700,000.00    | 4,700,728.50    |  |
|      | 315000      | オーストラリア国債 6.25% 20150415 | 4,990,000.00    | 4,973,537.99    |  |
|      | 317B00      | オーストラリア国債 6% 20170215    | 4,800,000.00    | 4,715,049.60    |  |
|      | 319C00      | オーストラリア国債 5.25% 20190315 | 5,050,000.00    | 4,659,175.45    |  |
|      | 321E00      | オーストラリア国債 5.75% 20210515 | 1,740,000.00    | 1,668,498.18    |  |
|      | 国債証券 計      |                          | 41,770,000.00   | 40,795,262.12   |  |
|      | オーストラリアドル 計 |                          | 41,770,000.00   | 40,795,262.12   |  |
|      | (邦貨換算額)     |                          | (4,093,877,700) | (3,998,343,640) |  |

(外貨建債券) イギリスポンド (単位: イギリスポンド)

| 種 類       | 銘 柄                   | 券面総額                  | 評 価 額            | 備 考           |
|-----------|-----------------------|-----------------------|------------------|---------------|
| 国債証券      | 309120                | イギリス国債 5.75% 20091207 | 11,800,000.00    | 12,046,419.40 |
|           | 309C00                | イギリス国債 4% 20090307    | 16,700,000.00    | 16,554,008.60 |
|           | 310F00                | イギリス国債 4.75% 20100607 | 12,500,000.00    | 12,532,325.00 |
|           | 310K00                | イギリス国債 6.25% 20101125 | 5,130,000.00     | 5,355,617.40  |
|           | 311C00                | イギリス国債 4.25% 20110307 | 13,470,000.00    | 13,269,256.59 |
|           | 311G00                | イギリス国債 9% 20110712    | 5,530,000.00     | 6,290,850.58  |
|           | 312C00                | イギリス国債 5% 20120307    | 13,800,000.00    | 13,946,914.80 |
|           | 312F00                | イギリス国債 5.25% 20120607 | 7,580,000.00     | 7,726,081.76  |
|           | 313100                | イギリス国債 8% 20130927    | 6,320,000.00     | 7,321,302.88  |
|           | 314100                | イギリス国債 5% 20140907    | 13,530,000.00    | 13,687,935.69 |
|           | 315100                | イギリス国債 4.75% 20150907 | 13,300,000.00    | 13,272,588.70 |
|           | 315L00                | イギリス国債 8% 20151207    | 7,520,000.00     | 9,064,886.24  |
|           | 316100                | イギリス国債 4% 20160907    | 13,460,000.00    | 12,709,887.66 |
|           | 317H00                | イギリス国債 8.75% 20170825 | 7,930,000.00     | 10,296,795.73 |
|           | 318C00                | イギリス国債 5% 20180307    | 7,400,000.00     | 7,519,880.00  |
|           | 320C00                | イギリス国債 4.75% 20200307 | 10,600,000.00    | 10,552,374.20 |
|           | 321F00                | イギリス国債 8% 20210607    | 17,360,000.00    | 22,719,639.60 |
|           | 325C00                | イギリス国債 5% 20250307    | 15,970,000.00    | 16,498,559.09 |
|           | 327L00                | イギリス国債 4.25% 20271207 | 13,300,000.00    | 12,538,162.70 |
|           | 328L00                | イギリス国債 6% 20281207    | 12,210,000.00    | 14,317,555.89 |
| 330L00    | イギリス国債 4.75% 20301207 | 4,500,000.00          | 4,557,793.50     |               |
| 332F00    | イギリス国債 4.25% 20320607 | 17,100,000.00         | 16,248,967.20    |               |
| 336C00    | イギリス国債 4.25% 20360307 | 15,200,000.00         | 14,554,288.80    |               |
| 338L00    | イギリス国債 4.75% 20381207 | 14,670,000.00         | 15,287,695.02    |               |
| 342L00    | イギリス国債 4.5% 20421207  | 6,350,000.00          | 6,382,277.05     |               |
| 346L00    | イギリス国債 4.25% 20461207 | 13,400,000.00         | 12,897,419.60    |               |
| 355L00    | イギリス国債 4.25% 20551207 | 11,400,000.00         | 11,095,346.40    |               |
| 国債証券 計    |                       | 308,030,000.00        | 319,244,830.08   |               |
| イギリスポンド 計 |                       | 308,030,000.00        | 319,244,830.08   |               |
| (邦貨換算額)   |                       | (70,434,139,800)      | (72,988,522,846) |               |

(外貨建債券) スイスフラン (単位: スイスフラン)

| 種 類  | 銘 柄    | 券面総額                 | 評 価 額         | 備 考           |
|------|--------|----------------------|---------------|---------------|
| 国債証券 | 306F00 | スイス国債 4% 20110610    | 10,000,000.00 | 10,393,650.00 |
|      | 309B00 | スイス国債 3.25% 20090211 | 12,000,000.00 | 12,083,436.00 |
|      | 310H00 | スイス国債 3.5% 20100807  | 2,200,000.00  | 2,242,741.60  |
|      | 312F00 | スイス国債 2.75% 20120610 | 10,450,000.00 | 10,440,250.15 |
|      | 313B00 | スイス国債 4% 20130211    | 11,200,000.00 | 11,808,529.60 |
|      | 316C00 | スイス国債 2.5% 20160312  | 5,000,000.00  | 4,841,945.00  |
|      | 317F00 | スイス国債 4.25% 20170605 | 2,500,000.00  | 2,743,177.50  |

(外貨建債券) カナダドル (単位: カナダドル)

| 種 類      | 銘 柄    | 券面総額                   | 評 価 額             | 備 考           |
|----------|--------|------------------------|-------------------|---------------|
| 国債証券     | 220080 | アメリカ国債 8.75% 20200815  | 19,500,000.00     | 27,309,139.58 |
|          | 220800 | アメリカ国債 8.5% 20200215   | 6,500,000.00      | 8,896,875.00  |
|          | 220E01 | アメリカ国債 8.75% 20200515  | 5,000,000.00      | 6,985,937.50  |
|          | 221020 | アメリカ国債 7.875% 20210215 | 6,860,000.00      | 9,068,062.50  |
|          | 221050 | アメリカ国債 8.125% 20210515 | 6,600,000.00      | 8,908,968.42  |
|          | 221080 | アメリカ国債 8.125% 20210815 | 5,340,000.00      | 7,225,687.50  |
|          | 221110 | アメリカ国債 8% 20211115     | 24,350,000.00     | 32,727,921.83 |
|          | 222080 | アメリカ国債 7.25% 20220815  | 7,200,000.00      | 9,167,624.64  |
|          | 222110 | アメリカ国債 7.625% 20221115 | 4,100,000.00      | 5,399,827.92  |
|          | 223020 | アメリカ国債 7.125% 20230215 | 11,620,000.00     | 14,685,668.69 |
|          | 223080 | アメリカ国債 6.25% 20230815  | 29,000,000.00     | 34,007,029.74 |
|          | 224K01 | アメリカ国債 7.5% 20241115   | 7,350,000.00      | 9,747,937.50  |
|          | 225020 | アメリカ国債 7.625% 20250215 | 5,900,000.00      | 7,920,750.00  |
|          | 225080 | アメリカ国債 8.875% 20250815 | 16,090,000.00     | 20,240,716.30 |
|          | 226020 | アメリカ国債 6% 20260215     | 9,850,000.00      | 11,389,062.50 |
|          | 226080 | アメリカ国債 6.75% 20260815  | 6,810,000.00      | 8,517,819.96  |
|          | 226110 | アメリカ国債 6.5% 20261115   | 11,800,000.00     | 14,423,655.64 |
|          | 227080 | アメリカ国債 6.375% 20270815 | 5,500,000.00      | 6,663,593.75  |
|          | 227110 | アメリカ国債 6.125% 20271115 | 16,050,000.00     | 18,969,093.75 |
|          | 228H00 | アメリカ国債 5.5% 20280815   | 7,300,000.00      | 8,059,656.25  |
|          | 228K00 | アメリカ国債 5.25% 20281115  | 6,400,000.00      | 6,864,000.00  |
|          | 229800 | アメリカ国債 5.25% 20290215  | 7,200,000.00      | 7,718,624.64  |
|          | 229H00 | アメリカ国債 6.125% 20290815 | 14,760,000.00     | 17,625,150.00 |
|          | 230B00 | アメリカ国債 6.25% 20300515  | 12,840,000.00     | 15,616,650.00 |
|          | 231B00 | アメリカ国債 5.375% 20310215 | 14,500,000.00     | 15,895,625.00 |
|          | 236B00 | アメリカ国債 4.5% 20360215   | 23,500,000.00     | 22,863,125.00 |
|          | 237B00 | アメリカ国債 4.75% 20370215  | 11,850,000.00     | 12,014,788.47 |
|          | 237E00 | アメリカ国債 5% 20370515     | 14,600,000.00     | 15,393,875.00 |
|          | N00106 | アメリカ国債 6.625% 20270215 | 6,280,000.00      | 7,785,237.50  |
| 国債証券 計   |        | 1,982,030,000.00       | 2,122,063,274.47  |               |
| アメリカドル 計 |        | 1,982,030,000.00       | 2,122,063,274.47  |               |
| (邦貨換算額)  |        | (224,643,280,200)      | (240,514,651,528) |               |

(外貨建債券) カナダドル (単位: カナダドル)

| 種 類     | 銘 柄                  | 券面総額                 | 評 価 額            | 備 考           |
|---------|----------------------|----------------------|------------------|---------------|
| 国債証券    | 308L01               | カナダ国債 4.25% 20081201 | 7,300,000.00     | 7,306,570.00  |
|         | 309F00               | カナダ国債 5.5% 20090601  | 6,400,000.00     | 6,534,336.00  |
|         | 309F01               | カナダ国債 3.75% 20090601 | 3,270,000.00     | 3,258,685.80  |
|         | 309L01               | カナダ国債 4.25% 20090901 | 8,800,000.00     | 8,834,232.00  |
|         | 309L00               | カナダ国債 4.25% 20091201 | 7,100,000.00     | 7,138,695.00  |
|         | 310F00               | カナダ国債 5.5% 20100601  | 4,900,000.00     | 5,070,667.00  |
|         | 310L00               | カナダ国債 4% 20100901    | 8,320,000.00     | 8,314,009.60  |
|         | 311F00               | カナダ国債 6% 20110601    | 9,900,000.00     | 10,528,947.00 |
|         | 311L00               | カナダ国債 3.75% 20110901 | 9,150,000.00     | 9,084,630.50  |
|         | 312F00               | カナダ国債 5.25% 20120601 | 10,000,000.00    | 10,490,100.00 |
|         | 312F01               | カナダ国債 3.75% 20120601 | 6,800,000.00     | 6,721,800.00  |
|         | 313F00               | カナダ国債 5.25% 20130601 | 8,900,000.00     | 9,413,708.00  |
|         | 314F00               | カナダ国債 5% 20140601    | 9,500,000.00     | 9,992,575.00  |
|         | 315F00               | カナダ国債 4.5% 20150601  | 10,150,000.00    | 10,414,610.50 |
|         | 316F00               | カナダ国債 4% 20160601    | 10,000,000.00    | 9,921,100.00  |
|         | 317F00               | カナダ国債 4% 20170601    | 10,200,000.00    | 10,085,760.00 |
|         | 323F00               | カナダ国債 8% 20230601    | 5,600,000.00     | 7,974,904.00  |
|         | 325F00               | カナダ国債 9% 20250601    | 5,300,000.00     | 8,373,205.00  |
|         | 327F00               | カナダ国債 8% 20270601    | 7,350,000.00     | 10,947,016.50 |
| 329F00  | カナダ国債 5.75% 20290601 | 13,000,000.00        | 15,682,160.00    |               |
| 333F00  | カナダ国債 5.75% 20330601 | 13,300,000.00        | 16,385,600.00    |               |
| 337F00  | カナダ国債 5% 20370601    | 11,600,000.00        | 13,099,184.00    |               |
| 国債証券 計  |                      | 186,840,000.00       | 205,552,495.90   |               |
| カナダドル 計 |                      | 186,840,000.00       | 205,552,495.90   |               |
| (邦貨換算額) |                      | (20,769,686,800)     | (22,871,826,219) |               |

|        |                   |                 |                 |  |  |
|--------|-------------------|-----------------|-----------------|--|--|
| 319E00 | スイス国債 3% 20190512 | 10,800,000.00   | 10,679,806.80   |  |  |
| 328B00 | スイス国債 4% 20280408 | 5,800,000.00    | 6,395,062.60    |  |  |
|        | 国債証券 計            | 69,950,000.00   | 71,628,599.25   |  |  |
|        | スイスフラン            | 69,950,000.00   | 71,628,599.25   |  |  |
|        | (邦貨換算額)           | (6,876,784,500) | (7,041,807,592) |  |  |

(外貨建債券) スウェーデンクローナ (単位: スウェーデンクローナ)

| 種 類  | 銘柄                             | 券面総額            | 評価額             | 備 考 |
|------|--------------------------------|-----------------|-----------------|-----|
| 国債証券 | 309A00 スウェーデン国債 5% 20090128    | 75,850,000.00   | 76,434,045.00   |     |
|      | 309L00 スウェーデン国債 4% 20091201    | 50,000,000.00   | 49,789,150.00   |     |
|      | 311000 スウェーデン国債 5.25% 20110315 | 59,000,000.00   | 60,740,500.00   |     |
|      | 312J00 スウェーデン国債 5.5% 20121008  | 52,500,000.00   | 55,224,750.00   |     |
|      | 314E00 スウェーデン国債 6.75% 20140505 | 55,000,000.00   | 56,595,000.00   |     |
|      | 315H00 スウェーデン国債 4.5% 20150812  | 30,500,000.00   | 35,837,250.00   |     |
|      | 316G00 スウェーデン国債 3% 20160712    | 36,500,000.00   | 32,998,226.50   |     |
|      | 317H01 スウェーデン国債 3.75% 20170812 | 45,400,000.00   | 43,150,384.60   |     |
|      | 320L00 スウェーデン国債 5% 20201201    | 50,200,000.00   | 52,996,290.60   |     |
|      | 国債証券 計                         | 454,950,000.00  | 463,765,596.70  |     |
|      | スウェーデンクローナ 計                   | 454,950,000.00  | 463,765,596.70  |     |
|      | (邦貨換算額)                        | (7,911,580,500) | (8,064,883,727) |     |

(外貨建債券) シンガポールドル (単位: シンガポールドル)

| 種 類  | 銘柄                              | 券面総額            | 評価額             | 備 考 |
|------|---------------------------------|-----------------|-----------------|-----|
| 国債証券 | 309A00 シンガポール国債 4.375% 20090115 | 5,570,000.00    | 5,724,127.47    |     |
|      | 309J00 シンガポール国債 2.375% 20091001 | 3,700,000.00    | 3,739,072.00    |     |
|      | 310D00 シンガポール国債 2.625% 20100401 | 1,900,000.00    | 1,934,625.60    |     |
|      | 310G00 シンガポール国債 4.625% 20100701 | 4,000,000.00    | 4,275,400.00    |     |
|      | 310J00 シンガポール国債 2.5% 20121001   | 1,700,000.00    | 1,716,763.70    |     |
|      | 311B00 シンガポール国債 3.125% 20110201 | 2,400,000.00    | 2,486,966.40    |     |
|      | 311G00 シンガポール国債 3.625% 20110701 | 3,800,000.00    | 4,007,882.80    |     |
|      | 312D00 シンガポール国債 2.625% 20120401 | 2,400,000.00    | 2,443,579.20    |     |
|      | 312G00 シンガポール国債 3.5% 20120701   | 3,200,000.00    | 3,374,595.20    |     |
|      | 313G04 シンガポール国債 2.25% 20130701  | 3,200,000.00    | 3,172,131.20    |     |
|      | 314G00 シンガポール国債 3.625% 20140701 | 4,400,000.00    | 4,669,623.20    |     |
|      | 316I00 シンガポール国債 3.75% 20160901  | 4,870,000.00    | 5,241,571.26    |     |
|      | 318I00 シンガポール国債 4% 20180901     | 1,900,000.00    | 2,089,825.20    |     |
|      | 320I00 シンガポール国債 3.25% 20200901  | 3,100,000.00    | 3,167,192.50    |     |
|      | 322I00 シンガポール国債 3.125% 20220901 | 2,150,000.00    | 2,152,483.25    |     |
|      | 327G00 シンガポール国債 3.5% 20270301   | 2,150,000.00    | 2,223,110.75    |     |
|      | 国債証券 計                          | 50,440,000.00   | 52,418,949.73   |     |
|      | シンガポールドル 計                      | 50,440,000.00   | 52,418,949.73   |     |
|      | (邦貨換算額)                         | (3,944,408,000) | (4,099,161,869) |     |

(外貨建債券) マレーシアリンギット (単位: マレーシアリンギット)

| 種 類  | 銘柄                             | 券面総額          | 評価額           | 備 考 |
|------|--------------------------------|---------------|---------------|-----|
| 国債証券 | 309B00 マレーシア国債 4.305% 20090227 | 9,600,000.00  | 9,690,124.80  |     |
|      | 309C00 マレーシア国債 7% 20090315     | 7,500,000.00  | 7,817,212.50  |     |
|      | 309I01 マレーシア国債 4.032% 20090915 | 7,500,000.00  | 7,567,417.50  |     |
|      | 309J00 マレーシア国債 6.844% 20091001 | 7,700,000.00  | 8,143,058.00  |     |
|      | 310D00 マレーシア国債 3.869% 20100413 | 8,300,000.00  | 8,365,005.60  |     |
|      | 310H00 マレーシア国債 3.644% 20100825 | 7,400,000.00  | 7,420,549.80  |     |
|      | 311D00 マレーシア国債 3.756% 20110428 | 12,000,000.00 | 12,064,716.00 |     |
|      | 311I00 マレーシア国債 3.833% 20110928 | 3,800,000.00  | 3,828,063.00  |     |
|      | 312F00 マレーシア国債 3.718% 20120615 | 9,700,000.00  | 9,710,379.00  |     |
|      | 313B00 マレーシア国債 3.702% 20130225 | 19,700,000.00 | 19,669,543.80 |     |
|      | 314D00 マレーシア国債 5.094% 20140430 | 5,700,000.00  | 6,071,674.20  |     |
|      | 315I00 マレーシア国債 4.72% 20150930  | 4,500,000.00  | 4,707,832.50  |     |

|        |                         |                 |                 |  |
|--------|-------------------------|-----------------|-----------------|--|
| 316I00 | マレーシア国債 4.262% 20160915 | 9,100,000.00    | 9,207,980.60    |  |
| 317B00 | マレーシア国債 3.814% 20170215 | 5,800,000.00    | 5,662,499.40    |  |
| 318B00 | マレーシア国債 4.24% 20180207  | 9,600,000.00    | 9,647,155.20    |  |
| 319G00 | マレーシア国債 5.734% 20190730 | 3,500,000.00    | 3,975,653.50    |  |
| 327E00 | マレーシア国債 3.502% 20270531 | 5,600,000.00    | 4,870,538.40    |  |
|        | 国債証券 計                  | 137,000,000.00  | 138,419,403.80  |  |
|        | マレーシアリンギット 計            | 137,000,000.00  | 138,419,403.80  |  |
|        | (邦貨換算額)                 | (4,663,480,000) | (4,711,796,505) |  |

(外貨建債券) デンマーククローネ (単位: デンマーククローネ)

| 種 類  | 銘柄                         | 券面総額            | 評価額             | 備 考 |
|------|----------------------------|-----------------|-----------------|-----|
| 国債証券 | 309K00 デンマーク国債 6% 20091115 | 61,000,000.00   | 62,861,354.00   |     |
|      | 310K00 デンマーク国債 4% 20101115 | 34,000,000.00   | 33,782,306.00   |     |
|      | 311K00 デンマーク国債 6% 20111115 | 59,000,000.00   | 62,629,208.00   |     |
|      | 313K00 デンマーク国債 5% 20131115 | 73,000,000.00   | 75,747,136.00   |     |
|      | 315K00 デンマーク国債 4% 20151115 | 57,000,000.00   | 55,681,077.00   |     |
|      | 317K00 デンマーク国債 4% 20171115 | 40,500,000.00   | 39,118,828.50   |     |
|      | 324K00 デンマーク国債 7% 20241110 | 24,200,000.00   | 30,875,691.00   |     |
|      | 国債証券 計                     | 348,700,000.00  | 360,675,600.50  |     |
|      | デンマーククローネ 計                | 348,700,000.00  | 360,675,600.50  |     |
|      | (邦貨換算額)                    | (7,643,504,000) | (7,906,009,163) |     |

(外貨建債券) ノルウェークローネ (単位: ノルウェークローネ)

| 種 類  | 銘柄                            | 券面総額            | 評価額             | 備 考 |
|------|-------------------------------|-----------------|-----------------|-----|
| 国債証券 | 309E00 ノルウェー国債 5.5% 20090515  | 44,400,000.00   | 44,764,302.00   |     |
|      | 311E01 ノルウェー国債 6% 20110516    | 37,200,000.00   | 38,621,560.80   |     |
|      | 313E00 ノルウェー国債 6.5% 20130515  | 45,000,000.00   | 48,780,315.00   |     |
|      | 315E00 ノルウェー国債 5% 20150515    | 33,500,000.00   | 34,107,053.50   |     |
|      | 317E00 ノルウェー国債 4.25% 20170519 | 23,200,000.00   | 22,397,813.60   |     |
|      | 国債証券 計                        | 183,300,000.00  | 188,671,044.90  |     |
|      | ノルウェークローネ 計                   | 183,300,000.00  | 188,671,044.90  |     |
|      | (邦貨換算額)                       | (3,755,817,000) | (3,885,869,710) |     |

(外貨建債券) ポーランドズロチ (単位: ポーランドズロチ)

| 種 類  | 銘柄                            | 券面総額             | 評価額              | 備 考 |
|------|-------------------------------|------------------|------------------|-----|
| 国債証券 | 309E00 ポーランド国債 6% 20090524    | 44,700,000.00    | 44,602,643.40    |     |
|      | 310C00 ポーランド国債 5.75% 20100324 | 29,600,000.00    | 29,359,381.60    |     |
|      | 310K00 ポーランド国債 6% 20101124    | 27,800,000.00    | 27,675,622.80    |     |
|      | 311E00 ポーランド国債 4.25% 20110524 | 23,500,000.00    | 22,161,863.00    |     |
|      | 312D00 ポーランド国債 4.75% 20120425 | 25,650,000.00    | 24,356,316.60    |     |
|      | 313J00 ポーランド国債 5% 20131024    | 23,250,000.00    | 22,150,600.50    |     |
|      | 315J00 ポーランド国債 6.25% 20151024 | 24,000,000.00    | 24,414,720.00    |     |
|      | 317J00 ポーランド国債 5.25% 20171025 | 15,000,000.00    | 14,323,365.00    |     |
|      | 322I00 ポーランド国債 5.75% 20220923 | 17,300,000.00    | 17,248,151.90    |     |
|      | 国債証券 計                        | 230,800,000.00   | 226,292,664.80   |     |
|      | ポーランドズロチ 計                    | 230,800,000.00   | 226,292,664.80   |     |
|      | (邦貨換算額)                       | (10,471,396,000) | (10,266,898,202) |     |

(外貨建債券) ユーロ (単位: ユーロ)

| 種 類  | 銘柄                           | 券面総額          | 評価額           | 備 考 |
|------|------------------------------|---------------|---------------|-----|
| 国債証券 | 304D00 フランス国債 5.5% 20290425  | 15,250,000.00 | 16,910,496.25 |     |
|      | 308L00 ドイツ国債 3.75% 20081212  | 9,950,000.00  | 9,909,971.15  |     |
|      | 309O40 フランス国債 4% 20090425    | 17,550,000.00 | 17,514,268.20 |     |
|      | 309A00 ドイツ国債 3.75% 20090104  | 17,700,000.00 | 17,634,156.00 |     |
|      | 309A01 ギリシャ国債 6.3% 20090129  | 6,700,000.00  | 6,844,746.80  |     |
|      | 309A02 オランダ国債 2.75% 20090115 | 10,000,000.00 | 9,858,510.00  |     |

|        |                |          |               |               |  |
|--------|----------------|----------|---------------|---------------|--|
| 309A03 | スペイン国債 3.6%    | 20090131 | 12,730,000.00 | 12,642,201.19 |  |
| 309A04 | フランス国債 3.5%    | 20090112 | 16,100,000.00 | 15,988,121.10 |  |
| 309B00 | スペイン国債 8.2%    | 20090228 | 4,230,000.00  | 4,424,466.79  |  |
| 309B01 | イタリア国債 3%      | 20090201 | 14,950,000.00 | 14,759,895.80 |  |
| 309C00 | ベルギー国債 3.75%   | 20090328 | 18,400,000.00 | 18,295,782.40 |  |
| 309C01 | ドイツ国債 3.75%    | 20090313 | 13,500,000.00 | 13,433,296.50 |  |
| 309D00 | ギリシャ国債 3.5%    | 20090420 | 9,080,000.00  | 8,988,001.44  |  |
| 309D01 | フィンランド国債 5%    | 20090425 | 5,500,000.00  | 5,558,602.50  |  |
| 309D02 | イタリア国債 4%      | 20090415 | 15,820,000.00 | 15,591,132.06 |  |
| 309D03 | オランダ国債 2.75%   | 20090415 | 10,400,000.00 | 10,226,091.20 |  |
| 309D04 | ドイツ国債 3.25%    | 20090417 | 17,100,000.00 | 16,900,323.30 |  |
| 309E00 | イタリア国債 4.5%    | 20090501 | 22,600,000.00 | 22,697,767.60 |  |
| 309F00 | イタリア国債 3.75%   | 20090615 | 17,000,000.00 | 16,898,697.00 |  |
| 309F01 | ギリシャ国債 3.4%    | 20090621 | 6,500,000.00  | 6,420,778.00  |  |
| 309F02 | ドイツ国債 4.5%     | 20090612 | 12,630,000.00 | 12,694,665.60 |  |
| 309G00 | スペイン国債 5.15%   | 20090730 | 11,580,000.00 | 11,765,708.46 |  |
| 309G01 | ドイツ国債 4.5%     | 20090704 | 26,740,000.00 | 26,883,700.76 |  |
| 309G02 | ドイツ国債 4%       | 20090704 | 10,070,000.00 | 10,052,417.78 |  |
| 309G03 | オーストリア国債 4%    | 20090715 | 8,550,000.00  | 8,535,336.75  |  |
| 309G04 | オランダ国債 3.75%   | 20090715 | 10,880,000.00 | 10,821,193.60 |  |
| 309G05 | ポルトガル国債 3.95%  | 20090715 | 5,900,000.00  | 5,877,639.00  |  |
| 309G06 | フランス国債 3.5%    | 20090712 | 16,870,000.00 | 16,705,247.58 |  |
| 309I00 | アイルランド国債 3.25% | 20090418 | 4,950,000.00  | 4,888,832.85  |  |
| 309I01 | フランス国債 4%      | 20090912 | 11,000,000.00 | 10,976,372.00 |  |
| 309I02 | ドイツ国債 4%       | 20090911 | 11,750,000.00 | 11,744,125.00 |  |
| 309J00 | フランス国債 4.5%    | 20091025 | 19,800,000.00 | 19,762,716.60 |  |
| 309J01 | ドイツ国債 3.5%     | 20091009 | 16,400,000.00 | 16,234,934.00 |  |
| 309K00 | イタリア国債 4.25%   | 20091101 | 21,560,000.00 | 21,598,786.44 |  |
| 310A00 | ドイツ国債 5.375%   | 20100104 | 19,000,000.00 | 19,483,911.00 |  |
| 310A01 | スペイン国債 4%      | 20100131 | 12,300,000.00 | 12,271,956.00 |  |
| 310A03 | イタリア国債 3%      | 20100115 | 15,880,000.00 | 15,523,446.36 |  |
| 310A04 | フランス国債 3%      | 20100112 | 17,080,000.00 | 16,715,102.88 |  |
| 310A05 | オーストリア国債 5.5%  | 20100115 | 8,900,000.00  | 9,143,148.00  |  |
| 310A06 | フランス国債 3%      | 20100115 | 12,000,000.00 | 11,750,712.00 |  |
| 310C01 | ベルギー国債 3%      | 20100328 | 8,700,000.00  | 8,486,997.90  |  |
| 310C02 | イタリア国債 4%      | 20100301 | 15,000,000.00 | 14,945,760.00 |  |
| 310D00 | フランス国債 5.5%    | 20100425 | 14,700,000.00 | 15,150,599.10 |  |
| 310D01 | ドイツ国債 3.25%    | 20100409 | 17,100,000.00 | 16,809,522.30 |  |
| 310D02 | ギリシャ国債 3.1%    | 20100420 | 8,300,000.00  | 8,089,146.80  |  |
| 310E00 | ギリシャ国債 6%      | 20100519 | 8,330,000.00  | 8,653,728.79  |  |
| 310E01 | ポルトガル国債 5.85%  | 20100520 | 6,000,000.00  | 6,221,760.00  |  |
| 310F00 | イタリア国債 2.75%   | 20100615 | 18,650,000.00 | 18,024,945.25 |  |
| 310G00 | ドイツ国債 5.25%    | 20100704 | 19,700,000.00 | 20,259,499.70 |  |
| 310G01 | オランダ国債 5.5%    | 20100715 | 9,980,000.00  | 10,318,152.34 |  |
| 310G02 | スペイン国債 3.25%   | 20100730 | 13,400,000.00 | 13,110,426.00 |  |
| 310H00 | イタリア国債 4.5%    | 20100801 | 11,400,000.00 | 11,479,378.20 |  |
| 310I00 | ベルギー国債 5.75%   | 20100928 | 15,400,000.00 | 16,028,581.80 |  |
| 310I02 | フィンランド国債 2.75% | 20100915 | 4,900,000.00  | 4,731,361.60  |  |
| 310J00 | フランス国債 5.5%    | 20101025 | 15,280,000.00 | 15,841,158.00 |  |
| 310J01 | ドイツ国債 2.5%     | 20101008 | 16,950,000.00 | 16,269,237.15 |  |
| 310J02 | フランス国債 2.5%    | 20100712 | 14,950,000.00 | 14,380,345.20 |  |
| 310K00 | イタリア国債 5.5%    | 20101101 | 22,640,000.00 | 23,428,256.88 |  |
| 311A00 | ドイツ国債 5.25%    | 20110104 | 22,600,000.00 | 23,342,274.40 |  |
| 311A01 | オーストリア国債 5.25% | 20110104 | 8,000,000.00  | 8,250,104.00  |  |
| 311A02 | フランス国債 3%      | 20110112 | 17,300,000.00 | 16,756,399.40 |  |
| 311B00 | フィンランド国債 5.75% | 20110223 | 5,500,000.00  | 5,759,220.50  |  |
| 311C00 | イタリア国債 3.5%    | 20110315 | 17,800,000.00 | 17,416,908.40 |  |
| 311D00 | フランス国債 6.5%    | 20110425 | 19,380,000.00 | 20,781,988.58 |  |
| 311D01 | ポルトガル国債 3.2%   | 20110415 | 5,800,000.00  | 5,622,398.20  |  |

|        |                 |          |               |               |  |
|--------|-----------------|----------|---------------|---------------|--|
| 311D02 | ドイツ国債 3.5%      | 20110408 | 18,470,000.00 | 18,151,392.50 |  |
| 311E00 | ギリシャ国債 5.35%    | 20110518 | 6,600,000.00  | 6,809,794.20  |  |
| 311F01 | ポルトガル国債 5.15%   | 20110615 | 5,180,000.00  | 5,331,256.00  |  |
| 311G00 | ドイツ国債 5%        | 20110704 | 23,200,000.00 | 23,926,747.90 |  |
| 311G01 | スペイン国債 5.4%     | 20110730 | 12,260,000.00 | 12,689,976.40 |  |
| 311G02 | オランダ国債 5%       | 20110715 | 12,300,000.00 | 12,649,885.80 |  |
| 311G03 | フランス国債 3.5%     | 20110712 | 14,050,000.00 | 13,758,757.55 |  |
| 311H00 | イタリア国債 5.25%    | 20110801 | 20,600,000.00 | 21,299,576.00 |  |
| 311H01 | ギリシャ国債 3.9%     | 20110820 | 6,600,000.00  | 6,503,607.00  |  |
| 311I00 | ベルギー国債 5%       | 20110928 | 11,380,000.00 | 11,718,873.64 |  |
| 311I01 | イタリア国債 3.75%    | 20110915 | 15,830,000.00 | 15,588,974.57 |  |
| 311J00 | スペイン国債 5.35%    | 20111031 | 12,180,000.00 | 12,671,146.32 |  |
| 311J01 | ドイツ国債 3.5%      | 20111014 | 16,550,000.00 | 16,201,308.05 |  |
| 312A00 | ドイツ国債 5%        | 20120104 | 24,780,000.00 | 25,550,806.68 |  |
| 312A01 | フランス国債 3.75%    | 20120112 | 17,000,000.00 | 17,547,910.00 |  |
| 312A02 | ドイツ国債 4%        | 20120413 | 15,720,000.00 | 15,633,760.08 |  |
| 312A03 | イタリア国債 4%       | 20120415 | 15,000,000.00 | 14,838,210.00 |  |
| 312E00 | ギリシャ国債 5.25%    | 20120518 | 8,080,000.00  | 8,360,222.48  |  |
| 312F00 | ポルトガル国債 5%      | 20120615 | 5,700,000.00  | 5,872,903.80  |  |
| 312G00 | オーストリア国債 5%     | 20120715 | 10,000,000.00 | 10,323,590.00 |  |
| 312G01 | スペイン国債 5%       | 20120730 | 12,580,000.00 | 13,002,323.18 |  |
| 312G02 | ドイツ国債 5%        | 20120704 | 26,910,000.00 | 27,830,591.10 |  |
| 312G03 | オランダ国債 5%       | 20120715 | 12,200,000.00 | 12,605,393.80 |  |
| 312G04 | フランス国債 4.5%     | 20120712 | 11,380,000.00 | 11,518,107.68 |  |
| 312H00 | ギリシャ国債 4.1%     | 20120820 | 5,900,000.00  | 5,828,610.00  |  |
| 312I00 | ベルギー国債 5%       | 20120928 | 11,660,000.00 | 12,038,915.02 |  |
| 312I01 | フィンランド国債 4.25%  | 20120915 | 3,850,000.00  | 3,850,970.20  |  |
| 312J00 | フランス国債 4.75%    | 20121025 | 18,350,000.00 | 18,790,932.15 |  |
| 312J01 | スペイン国債 3.9%     | 20121031 | 9,000,000.00  | 8,879,796.00  |  |
| 312J02 | ドイツ国債 4.25%     | 20121012 | 10,660,000.00 | 10,732,488.00 |  |
| 312J03 | イタリア国債 4.25%    | 20121015 | 5,880,000.00  | 5,869,392.48  |  |
| 312L00 | フランス国債 8.5%     | 20121226 | 6,460,000.00  | 7,706,172.76  |  |
| 312L01 | ベルギー国債 8%       | 20121224 | 7,700,000.00  | 8,965,217.80  |  |
| 313A00 | スペイン国債 6.15%    | 20130131 | 11,780,000.00 | 12,814,225.10 |  |
| 313A01 | ドイツ国債 4.5%      | 20130104 | 22,700,000.00 | 23,071,508.20 |  |
| 313B00 | イタリア国債 4.75%    | 20130201 | 17,750,000.00 | 18,155,427.75 |  |
| 313C00 | ベルギー国債 4%       | 20130328 | 8,500,000.00  | 8,392,900.00  |  |
| 313D00 | フランス国債 4%       | 20130425 | 18,950,000.00 | 18,761,333.80 |  |
| 313E00 | ギリシャ国債 4.6%     | 20130520 | 8,300,000.00  | 8,393,333.50  |  |
| 313G00 | スペイン国債 4.2%     | 20130730 | 9,980,000.00  | 9,966,107.84  |  |
| 313G01 | オランダ国債 4.25%    | 20130715 | 12,180,000.00 | 12,212,469.70 |  |
| 313G02 | ドイツ国債 3.75%     | 20130704 | 23,700,000.00 | 23,231,214.00 |  |
| 313G03 | フィンランド国債 5.375% | 20130704 | 6,000,000.00  | 6,333,786.00  |  |
| 313H00 | イタリア国債 4.25%    | 20130801 | 20,800,000.00 | 20,800,000.00 |  |
| 313I00 | ベルギー国債 4.25%    | 20130928 | 12,750,000.00 | 12,759,715.50 |  |
| 313I01 | ポルトガル国債 5.45%   | 20130923 | 5,900,000.00  | 6,248,595.60  |  |
| 313J00 | オーストリア国債 3.8%   | 20131020 | 12,100,000.00 | 11,838,289.10 |  |
| 313J01 | フランス国債 4%       | 20131025 | 17,290,000.00 | 17,103,146.97 |  |
| 314A00 | ドイツ国債 4.25%     | 20140104 | 22,420,000.00 | 22,420,000.00 |  |
| 314D00 | フランス国債 4%       | 20140425 | 17,850,000.00 | 17,627,981.70 |  |
| 314E01 | ギリシャ国債 4.5%     | 20140520 | 8,400,000.00  | 8,453,726.40  |  |
| 314F00 | ポルトガル国債 4.375%  | 20140616 | 5,000,000.00  | 5,019,785.00  |  |
| 314G00 | スペイン国債 4.75%    | 20140730 | 11,000,000.00 | 11,323,565.00 |  |
| 314G01 | ドイツ国債 4.25%     | 20140704 | 24,240,000.00 | 24,279,535.44 |  |
| 314G02 | オーストリア国債 4.3%   | 20140715 | 8,680,000.00  | 8,692,516.56  |  |
| 314G03 | オランダ国債 3.75%    | 20140715 | 11,600,000.00 | 11,284,097.20 |  |



|        |                 |          |               |               |
|--------|-----------------|----------|---------------|---------------|
| 314H00 | イタリア国債 4.25%    | 20140801 | 22,000,000.00 | 21,955,670.00 |
| 314I00 | ベルギー国債 4.25%    | 20140928 | 11,400,000.00 | 11,372,161.20 |
| 314J00 | フランス国債 4%       | 20141025 | 14,350,000.00 | 14,140,332.15 |
| 315A00 | スペイン国債 4.4%     | 20150131 | 14,180,000.00 | 14,245,383.98 |
| 315A01 | ドイツ国債 3.75%     | 20150104 | 22,600,000.00 | 21,913,796.20 |
| 315B00 | イタリア国債 4.25%    | 20150201 | 22,150,000.00 | 22,024,653.15 |
| 315C00 | ベルギー国債 8%       | 20150328 | 6,070,000.00  | 7,422,335.30  |
| 315D00 | フランス国債 3.5%     | 20150425 | 17,920,000.00 | 17,028,838.40 |
| 315E00 | フィンランド国債 4.25%  | 20150704 | 5,000,000.00  | 4,978,430.00  |
| 315F01 | ギリシャ国債 3.7%     | 20150720 | 8,970,000.00  | 8,548,616.31  |
| 315G02 | ドイツ国債 3.25%     | 20150704 | 21,100,000.00 | 19,732,171.40 |
| 315H00 | オランダ国債 3.25%    | 20150715 | 10,000,000.00 | 9,321,720.00  |
| 315G04 | オーストリア国債 3.5%   | 20150715 | 8,000,000.00  | 7,575,016.00  |
| 315H00 | イタリア国債 3.75%    | 20150801 | 23,870,000.00 | 22,896,414.31 |
| 315I00 | ベルギー国債 3.75%    | 20150928 | 11,000,000.00 | 10,544,545.00 |
| 315J00 | フランス国債 3%       | 20151025 | 17,000,000.00 | 15,536,640.00 |
| 315J01 | ポルトガル国債 3.35%   | 20151015 | 5,900,000.00  | 5,503,844.50  |
| 316A00 | ドイツ国債 3.5%      | 20160104 | 22,780,000.00 | 21,582,751.54 |
| 316A01 | スペイン国債 3.15%    | 20160131 | 11,300,000.00 | 10,379,377.70 |
| 316B00 | 아일랜드国債 4.6%     | 20160418 | 5,788,555.20  | 5,788,555.20  |
| 316D01 | フランス国債 3.25%    | 20160425 | 19,850,000.00 | 18,333,876.85 |
| 316F00 | ドイツ国債 6%        | 20160620 | 3,850,000.00  | 4,301,277.75  |
| 316G00 | ギリシャ国債 3.6%     | 20160720 | 7,950,000.00  | 7,423,829.25  |
| 316G01 | ドイツ国債 4%        | 20160704 | 22,750,000.00 | 22,261,261.75 |
| 316G02 | オランダ国債 4%       | 20160715 | 10,000,000.00 | 9,742,560.00  |
| 316H00 | イタリア国債 3.75%    | 20160801 | 23,450,000.00 | 22,276,421.30 |
| 316I00 | ベルギー国債 3.25%    | 20160928 | 11,980,000.00 | 10,944,424.84 |
| 316I01 | オーストリア国債 4%     | 20160915 | 10,000,000.00 | 9,726,010.00  |
| 316J00 | フランス国債 5%       | 20161025 | 21,740,000.00 | 22,719,408.74 |
| 316J01 | ポルトガル国債 4.2%    | 20161015 | 4,780,000.00  | 4,687,898.96  |
| 317A00 | スペイン国債 3.8%     | 20170131 | 12,000,000.00 | 11,434,776.00 |
| 317A01 | ドイツ国債 3.75%     | 20170104 | 19,780,000.00 | 18,979,285.82 |
| 317B00 | イタリア国債 4%       | 20170201 | 21,820,000.00 | 20,986,556.84 |
| 317C00 | ベルギー国債 4%       | 20170328 | 10,500,000.00 | 10,113,684.00 |
| 317D00 | フランス国債 3.75%    | 20170425 | 19,740,000.00 | 18,777,990.84 |
| 317E00 | スペイン国債 5.5%     | 20170730 | 14,900,000.00 | 16,089,166.90 |
| 317G01 | ギリシャ国債 4.3%     | 20170720 | 11,200,000.00 | 10,921,960.00 |
| 317G02 | ドイツ国債 4.25%     | 20170704 | 18,500,000.00 | 18,444,500.00 |
| 317G03 | オランダ国債 4.5%     | 20170715 | 12,000,000.00 | 12,064,608.00 |
| 317H00 | イタリア国債 5.25%    | 20170801 | 19,500,000.00 | 20,588,860.50 |
| 317I02 | オーストリア国債 3.875% | 20170915 | 8,300,000.00  | 8,962,995.70  |
| 317I01 | フィンランド国債 3.875% | 20170915 | 5,800,000.00  | 5,559,178.20  |
| 317J00 | ポルトガル国債 4.35%   | 20171016 | 5,000,000.00  | 4,950,540.00  |
| 317J01 | フランス国債 4.25%    | 20171025 | 6,000,000.00  | 5,911,134.00  |
| 318A00 | オーストリア国債 4.65%  | 20180115 | 9,400,000.00  | 8,868,663.00  |
| 318A01 | ドイツ国債 4%        | 20180104 | 6,600,000.00  | 9,569,707.60  |
| 318B00 | イタリア国債 4.5%     | 20180201 | 10,000,000.00 | 6,433,020.00  |
| 318J00 | 아일랜드国債 4.5%     | 20181018 | 5,800,000.00  | 9,969,000.00  |
| 319B00 | イタリア国債 4.25%    | 20190201 | 20,550,000.00 | 5,788,632.00  |
| 319D00 | フランス国債 4.25%    | 20190425 | 17,350,000.00 | 19,961,119.20 |
| 319J00 | フランス国債 8.5%     | 20191025 | 17,500,000.00 | 17,034,108.50 |
| 319J01 | ギリシャ国債 6.5%     | 20191022 | 8,700,000.00  | 11,876,074.20 |
| 320B00 | イタリア国債 4.5%     | 20200201 | 8,000,000.00  | 9,278,248.00  |
| 320D00 | 아일랜드国債 4.5%     | 20200418 | 7,030,000.00  | 20,874,360.95 |
| 320G00 | オーストリア国債 3.9%   | 20200715 | 7,000,000.00  | 7,006,407.32  |
| 321D00 | ポルトガル国債 3.85%   | 20210415 | 6,100,000.00  | 6,595,225.00  |
| 321D01 | フランス国債 3.75%    | 20210425 | 19,500,000.00 | 5,634,972.60  |
| 321H00 | イタリア国債 3.75%    | 20210801 | 19,170,000.00 | 17,986,234.50 |
| 321H01 |                 |          |               | 17,346,338.73 |

|           |                |          |                   |                   |
|-----------|----------------|----------|-------------------|-------------------|
| 321I00    | オーストリア国債 3.5%  | 20210915 | 9,400,000.00      | 8,390,421.20      |
| 322C00    | ベルギー国債 4%      | 20220328 | 8,200,000.00      | 7,649,870.20      |
| 322J00    | ギリシャ国債 5.9%    | 20221022 | 8,200,000.00      | 9,152,143.00      |
| 323A00    | オランダ国債 7.5%    | 20230115 | 5,680,000.00      | 7,478,606.08      |
| 323A01    | オランダ国債 3.75%   | 20230115 | 6,000,000.00      | 5,469,636.00      |
| 323D00    | フランス国債 8.5%    | 20230425 | 10,300,000.00     | 14,683,597.60     |
| 323I00    | フランス国債 4.25%   | 20231025 | 6,560,000.00      | 6,308,561.76      |
| 323K00    | イタリア国債 9%      | 20231101 | 12,010,000.00     | 17,618,862.16     |
| 324A00    | ドイツ国債 6.25%    | 20240104 | 10,160,000.00     | 12,088,332.48     |
| 324C00    | ギリシャ国債 4.7%    | 20240320 | 7,000,000.00      | 6,852,188.00      |
| 325J00    | フランス国債 6%      | 20251025 | 9,400,000.00      | 10,953,387.60     |
| 326K00    | イタリア国債 7.25%   | 20261101 | 9,500,000.00      | 12,315,135.00     |
| 327D00    | ドイツ国債 6.5%     | 20270704 | 11,110,000.00     | 13,720,105.63     |
| 327G00    | オーストリア国債 6.25% | 20270715 | 6,500,000.00      | 7,777,607.50      |
| 327K00    | イタリア国債 6.5%    | 20271101 | 25,850,000.00     | 31,178,434.65     |
| 328H01    | ドイツ国債 5.625%   | 20280104 | 14,200,000.00     | 15,966,309.60     |
| 328D00    | ドイツ国債 4.75%    | 20280704 | 11,000,000.00     | 11,133,078.00     |
| 328A00    | オランダ国債 5.5%    | 20280115 | 8,710,000.00      | 9,628,094.97      |
| 328C00    | ベルギー国債 5.5%    | 20280328 | 11,580,000.00     | 12,710,381.70     |
| 329A00    | スペイン国債 6%      | 20290131 | 12,300,000.00     | 14,408,343.00     |
| 329K00    | イタリア国債 5.25%   | 20291101 | 22,390,000.00     | 23,435,389.10     |
| 330A00    | ドイツ国債 6.25%    | 20300104 | 9,140,000.00      | 11,090,302.34     |
| 331A00    | ドイツ国債 5.5%     | 20310104 | 16,600,000.00     | 18,513,332.60     |
| 331E00    | イタリア国債 6%      | 20310501 | 28,810,000.00     | 33,021,301.75     |
| 332G00    | スペイン国債 5.75%   | 20320730 | 11,380,000.00     | 13,065,901.48     |
| 332J00    | フランス国債 5.75%   | 20321025 | 18,450,000.00     | 21,258,846.45     |
| 333B00    | イタリア国債 5.75%   | 20330201 | 14,950,000.00     | 16,676,246.60     |
| 334G00    | ドイツ国債 4.75%    | 20340704 | 19,600,000.00     | 19,864,404.00     |
| 334H00    | イタリア国債 5%      | 20340801 | 18,450,000.00     | 18,597,083.40     |
| 335C00    | ベルギー国債 5%      | 20350328 | 12,000,000.00     | 12,359,616.00     |
| 335D00    | フランス国債 4.75%   | 20350425 | 15,250,000.00     | 15,379,411.50     |
| 337A00    | スペイン国債 4.2%    | 20370131 | 12,300,000.00     | 11,247,033.90     |
| 337A01    | オランダ国債 4%      | 20370115 | 11,780,000.00     | 10,511,458.92     |
| 337A02    | ドイツ国債 4%       | 20370104 | 22,300,000.00     | 20,072,051.60     |
| 337B00    | イタリア国債 4%      | 20370201 | 19,900,000.00     | 17,011,037.40     |
| 337C00    | オーストリア国債 4.15% | 20370315 | 5,650,000.00      | 5,148,133.10      |
| 337D00    | ポルトガル国債 4.1%   | 20370415 | 5,730,000.00      | 5,090,434.59      |
| 337I00    | ギリシャ国債 4.5%    | 20370920 | 8,680,000.00      | 7,999,140.80      |
| 338J00    | フランス国債 4%      | 20381025 | 8,400,000.00      | 7,471,732.80      |
| 339G00    | ドイツ国債 4.25%    | 20390704 | 9,800,000.00      | 9,192,841.00      |
| 340G00    | スペイン国債 4.9%    | 20400730 | 4,750,000.00      | 4,783,763.00      |
| 340I00    | フランス国債 4.6%    | 20400920 | 3,900,000.00      | 4,885,030.94      |
| 355D00    | フランス国債 4%      | 20550425 | 12,900,000.00     | 3,631,426.50      |
| N00184    | ギリシャ国債 6.5%    | 20140111 | 4,600,000.00      | 11,343,731.10     |
| N00238    | フランス国債 5%      | 20111025 | 13,600,000.00     | 5,109,689.20      |
| 国債証券 計    |                |          | 2,970,750,000.00  | 13,998,316.80     |
| 一口 計      |                |          | 2,970,750,000.00  | 3,005,706,071.52  |
| ( 邦貨換算額 ) |                |          | (485,965,285,000) | (491,673,399,179) |

|     |                   |                   |
|-----|-------------------|-------------------|
| 総合計 | (851,183,239,500) | (878,013,170,180) |
|     | 851,183,239,500   | 878,013,170,180   |

( 単位：円 )

( 注 ) 総合計の ( ) 内の金額は外貨建債券の邦貨換算額合計であります。

外貨建価値証券の内訳

| 通貨         | 銘柄数        | 組入債券時価比率 (%) | 合計額に対する比率 (%) |
|------------|------------|--------------|---------------|
| アメリカドル     | 国債証券 132銘柄 | 100.0        | 27.4          |
| カナダドル      | 国債証券 22銘柄  | 100.0        | 2.6           |
| オーストラリアドル  | 国債証券 9銘柄   | 100.0        | 0.5           |
| イギリスポンド    | 国債証券 27銘柄  | 100.0        | 8.3           |
| スイスフラン     | 国債証券 9銘柄   | 100.0        | 0.8           |
| スウェーデンクローナ | 国債証券 9銘柄   | 100.0        | 0.9           |
| シンガポールドル   | 国債証券 16銘柄  | 100.0        | 0.5           |
| マレーシアリンギット | 国債証券 17銘柄  | 100.0        | 0.5           |
| デンマーククローネ  | 国債証券 7銘柄   | 100.0        | 0.9           |
| ノルウェークローネ  | 国債証券 5銘柄   | 100.0        | 0.4           |
| ポーランドズロチ   | 国債証券 9銘柄   | 100.0        | 1.2           |
| ユーロ        | 国債証券 229銘柄 | 100.0        | 56.0          |

第2 有価証券先物取引等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。

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

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

| 科目       | 対象年月日 |  | 注記<br>番号 | 平成19年6月15日現在   |    | 平成19年12月17日現在  |    |
|----------|-------|--|----------|----------------|----|----------------|----|
|          |       |  |          | 金額             | 金額 | 金額             | 金額 |
| 資産の部     |       |  |          |                |    |                |    |
| 流動資産     |       |  |          |                |    |                |    |
| コール・ローン  |       |  |          | 543,609,946    |    | 176,247,986    |    |
| 株式       |       |  |          | 32,546,853,890 |    | 39,837,926,500 |    |
| 派生商品評価勘定 |       |  |          | 259,128        |    | -              |    |
| 未収配当金    |       |  |          | 96,417,937     |    | 3,530,290      |    |
| 前払金      |       |  |          | 1,040,000      |    | 1,140,000      |    |
| 流動資産合計   |       |  |          | 33,188,180,901 |    | 40,018,844,776 |    |
| 資産合計     |       |  |          | 33,188,180,901 |    | 40,018,844,776 |    |
| 負債の部     |       |  |          |                |    |                |    |
| 流動負債     |       |  |          |                |    |                |    |
| 派生商品評価勘定 |       |  |          | 140,809        |    | 2,085,523      |    |
| 未払金      |       |  |          | 477,325,381    |    | 130,923,470    |    |
| 未払解約金    |       |  |          | 21,862,215     |    | 3,713,563      |    |
| 流動負債合計   |       |  |          | 499,328,405    |    | 136,722,556    |    |
| 負債合計     |       |  |          | 499,328,405    |    | 136,722,556    |    |
| 純資産の部    |       |  |          |                |    |                |    |
| 元本等      |       |  |          |                |    |                |    |
| 元本       |       |  |          | 25,987,304,337 |    | 37,904,286,208 |    |
| 剰余金      |       |  |          |                |    |                |    |
| 剰余金      |       |  |          | 6,701,548,159  |    | 1,977,836,012  |    |
| 剰余金合計    |       |  |          | 6,701,548,159  |    | 1,977,836,012  |    |
| 元本等合計    |       |  |          | 32,688,852,496 |    | 39,882,122,220 |    |
| 純資産合計    |       |  |          | 32,688,852,496 |    | 39,882,122,220 |    |
| 負債・純資産合計 |       |  |          | 33,188,180,901 |    | 40,018,844,776 |    |

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目                    | 自 平成18年12月16日<br>至 平成19年6月15日  | 自 平成19年6月16日<br>至 平成19年12月17日  |
|-----------------------|--|--|
| 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) 証券取引所に上場されている有価証券</p> <p>証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所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）又は証券取引所の発表する基準値で評価しております。</p> <p>(2) 証券取引所に上場されていない有価証券</p> <p>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、金融機関の提示する価値（ただし、売買相場の使用は提供する価値のいずれから入手した価値で評価しております。）</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p> <p>適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的な事由をもつて時価と認められた価値もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもつて時価と認められた価値で評価しております。</p> | <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</p> <p>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）又は金融商品取引所等が発表する基準値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</p> <p>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、金融機関の提示する価値（ただし、売買相場の使用は提供する価値のいずれから入手した価値で評価しております。）</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p> <p>適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的な事由をもつて時価と認められた価値もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもつて時価と認められた価値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>デリバティブ等の評価基準及び評価方法は、同左</p>  | <p>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3. 担保資産</p>  |
| 3. 収益及び費用の計上基準        | <p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、株式の配当落ち日に、当該金額を計上しております。ただし、平成19年6月30日以前については、原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未確定していない場合には予想配当金額の90%を計上しております。</p>  | <p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、株式の配当落ち日に、当該金額を計上しております。ただし、平成19年6月30日以前については、原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未確定していない場合には予想配当金額の90%を計上しております。</p>  |

(貸借対照表に関する注記)

|    | 平成18年12月16日現在   | 平成19年12月17日現在   |
|----|---|---|
| 1. | <p>期首 10,489,557,888 円</p> <p>期首からの追加設定元本額 15,830,244,335 円</p> <p>期首からの解約元本額 332,497,886 円</p> <p>平成18年12月16日現在の元本の内訳</p> <p>D Cインデックスバランズ(株式20) 62,726,170 円</p> <p>D Cインデックスバランズ(株式40) 241,479,516 円</p> <p>D Cインデックスバランズ(株式60) 504,043,095 円</p> <p>D Cインデックスバランズ(株式80) 601,354,940 円</p> <p>インデックスファンド日本株式(D C専用) 878,267,877 円</p> <p>世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型 16,795,337,286 円</p> <p>全世界全資産ファンド(債券/株式/不動産・資源・食料等)毎月分配型 23,366,590 円</p> <p>アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80) 158,721,326 円</p> <p>アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60) 116,903,121 円</p> <p>アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) 197,106,322 円</p> <p>アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) 294,094,480 円</p> <p>国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け) 3,126,880,583 円</p> <p>格別アセットバランズファンド40(適格機関投資家向け) 490,549,664 円</p> <p>世界アセットバランズファンド25(適格機関投資家向け) 14,703,991 円</p> <p>3資産/バランズファンド(適格機関投資家向け) 730,936,195 円</p> <p>年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) 135,610,484 円</p> <p>年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) 393,193,808 円</p> <p>年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60) 579,771,711 円</p> <p>年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80) 642,257,278 円</p> <p>(合計) 25,987,304,337 円</p> <p>本報告書における開示対象ファンドの特定期末日における当該親投資信託の受益権の総数 25,987,304,337 口</p> <p>担保資産</p> | <p>期首 25,987,304,337 円</p> <p>期首からの追加設定元本額 12,682,474,386 円</p> <p>期首からの解約元本額 746,492,525 円</p> <p>平成19年12月17日現在の元本の内訳</p> <p>D Cインデックスバランズ(株式20) 80,155,190 円</p> <p>D Cインデックスバランズ(株式40) 303,847,560 円</p> <p>D Cインデックスバランズ(株式60) 616,742,544 円</p> <p>D Cインデックスバランズ(株式80) 747,630,682 円</p> <p>インデックスファンド日本株式(D C専用) 600,866,831 円</p> <p>世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型 24,709,024,200 円</p> <p>グローバルコレクション(債券/株式/不動産・資源・食料等)毎月分配型 25,234,466 円</p> <p>日興ストラテジック・アロケージョ 46,368,787 円</p> <p>アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80) 166,072,373 円</p> <p>アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60) 122,366,416 円</p> <p>アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) 222,788,399 円</p> <p>アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) 320,348,205 円</p> <p>国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け) 5,901,056,877 円</p> <p>格別アセットバランズファンド40(適格機関投資家向け) 1,240,532,676 円</p> <p>世界アセットバランズファンド25(適格機関投資家向け) 64,384,341 円</p> <p>3資産/バランズファンド(適格機関投資家向け) 671,333,022 円</p> <p>年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) 176,114,287 円</p> <p>年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) 475,178,398 円</p> <p>年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60) 676,362,911 円</p> <p>年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80) 737,858,063 円</p> <p>(合計) 37,904,286,208 円</p> <p>本報告書における開示対象ファンドの特定期末日における当該親投資信託の受益権の総数 37,904,286,208 口</p> <p>担保資産</p> |
| 2. | <p>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3. 担保資産</p> <p>8,246,000 円</p>  | <p>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3. 担保資産</p> <p>6,576,000 円</p>  |
| 3. | <p>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</p>  | <p>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</p>  |

(有価証券に関する注記)

対象期間(自 平成 18 年 12 月 16 日 至 平成 19 年 6 月 15 日)

売買目的有価証券

| 種 類 | 貸借対照表計上額       | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----|----------------|-------------------|
| 株式  | 32,546,853,890 | 1,563,192,976     |
| 合計  | 32,546,853,890 | 1,563,192,976     |

(単位：円)

対象期間(自 平成 19 年 6 月 16 日 至 平成 19 年 12 月 17 日)

売買目的有価証券

| 種 類 | 貸借対照表計上額       | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----|----------------|-------------------|
| 株式  | 39,837,926,500 | 2,661,405,425     |
| 合計  | 39,837,926,500 | 2,661,405,425     |

(単位：円)

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の状況に関する事項

| 取引の内容               | 自 平成18年12月16日<br>至 平成19年6月15日   | 自 平成19年6月16日<br>至 平成19年12月17日 |
|---------------------|---|-------------------------------|
| 取引の内容               | 当投資信託が利用することができるデリバティブ取引等は、内外の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利先物取引、金利オブション取引、スワップ取引、および金利先渡取引であります。 | 同左                            |
| 取引の利用目的及び取引に対する取組方針 | 市場動向を勘案し、デリバティブ取引を行う方針であります。また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。  | 同左                            |
| 取引に係るリスクの内容         | デリバティブ取引には、有価証券、為替、金利等の市場価格が変動することによって発生するリスクがあります。   | 同左                            |
| 取引に係るリスク管理体制        | デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門が執行し、リスク管理業務担当部門が日常的にこれを監視しております。                             | 同左                            |

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(単位：円)

| 区分   | 種 類            | 平成19年6月15日現在 |         | 時 価         | 評価損益    |
|------|----------------|--------------|---------|-------------|---------|
|      |                | 契 約 額        | 等 うち1年超 |             |         |
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>買建 | 124,055,000  | -       | 124,215,000 | 160,000 |
|      | 合計             | 124,055,000  | -       | 124,215,000 | 160,000 |

(単位：円)

| 区分   | 種 類            | 平成19年12月17日現在 |         | 時 価        | 評価損益      |
|------|----------------|---------------|---------|------------|-----------|
|      |                | 契 約 額         | 等 うち1年超 |            |           |
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>買建 | 46,200,000    | -       | 44,130,000 | 2,070,000 |
|      | 合計             | 46,200,000    | -       | 44,130,000 | 2,070,000 |

(注) 時価の算定方法

1. 計算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を評価しています。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定します。
2. 先物取引の残高表示は契約額ベースです。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

|              | 平成19年6月15日現在 | 平成19年12月17日現在 |
|--------------|--------------|---------------|
| 1口当たり純資産額    | 1,2579 円     | 1口当たり純資産額     |
| (1万口当たり純資産額) | (12,579 円)   | (1万口当たり純資産額)  |
|              |              | 1,0522 円      |
|              |              | (10,522 円)    |

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

| 銘柄                    | 株数      | 評価額       |             | 備考 |
|-----------------------|---------|-----------|-------------|----|
|                       |         | 単価        | 金額          |    |
| 1301 樟洋               | 10,000  | 192       | 1,920,000   |    |
| 1332 日本水産             | 25,200  | 578       | 14,565,600  |    |
| 1334 マルハニチロホールディングス   | 43,000  | 131       | 5,633,000   |    |
| 1352 ホウスイ             | 2,000   | 156       | 312,000     |    |
| 1377 サカタのタネ           | 4,300   | 1,494     | 6,424,200   |    |
| 1379 ホクト              | 1,900   | 1,843     | 3,501,700   |    |
| 1503 住友炭鉱業            | 26,500  | 102       | 2,703,000   |    |
| 1515 日鉄鉱業             | 6,000   | 774       | 4,644,000   |    |
| 1518 三井松島産業           | 11,000  | 281       | 3,091,000   |    |
| 1605 国際石油開発帝石ホールディングス | 107     | 1,150,000 | 123,050,000 |    |
| 1661 関東天然瓦斯開発         | 3,000   | 667       | 2,001,000   |    |
| 1662 石油資源開発           | 2,200   | 8,190     | 18,018,000  |    |
| 1719 石ガム              | 7,800   | 110       | 858,000     |    |
| 1720 東急建設             | 8,320   | 451       | 3,752,320   |    |
| 1721 コムリスホールディングス     | 12,000  | 862       | 10,344,000  |    |
| 1722 ミサワホーム           | 2,800   | 522       | 1,461,600   |    |
| 1762 高松建設             | 2,000   | 1,571     | 3,142,000   |    |
| 1766 東建コーポレーション       | 790     | 3,620     | 2,859,800   |    |
| 1780 ヤマウラ             | 1,000   | 273       | 273,000     |    |
| 1786 オリエンタル日石         | 1,500   | 292       | 438,000     |    |
| 1801 大成建設             | 104,000 | 306       | 31,824,000  |    |
| 1802 大林組              | 66,000  | 531       | 35,046,000  |    |
| 1803 清水建設             | 67,000  | 459       | 30,753,000  |    |
| 1805 飛鳥建設             | 35,000  | 42        | 1,470,000   |    |
| 1808 長谷工コーポレーション      | 102,500 | 195       | 19,987,500  |    |
| 1810 松井建設             | 3,000   | 478       | 1,434,000   |    |
| 1812 鹿島               | 96,000  | 342       | 32,832,000  |    |
| 1813 不動テトラ            | 16,500  | 114       | 1,881,000   |    |
| 1814 大末建設             | 8,000   | 69        | 552,000     |    |
| 1815 鉄建               | 11,000  | 123       | 1,353,000   |    |
| 1816 安藤建設             | 7,000   | 155       | 1,085,000   |    |
| 1819 太平工業             | 4,000   | 545       | 2,180,000   |    |
| 1820 西松建設             | 25,000  | 315       | 7,875,000   |    |
| 1821 三井住友建設           | 11,900  | 141       | 1,677,900   |    |
| 1822 大豊建設             | 6,000   | 136       | 816,000     |    |
| 1824 前田建設工業           | 14,000  | 371       | 5,194,000   |    |
| 1826 佐田建設             | 9,000   | 104       | 936,000     |    |
| 1827 ナカノフードー建設        | 2,000   | 309       | 618,000     |    |
| 1833 興村組              | 21,000  | 540       | 11,340,000  |    |
| 1834 小田急建設            | 1,500   | 248       | 372,000     |    |
| 1835 東鉄工業             | 3,000   | 632       | 1,896,000   |    |
| 1839 真柄建設             | 5,000   | 115       | 575,000     |    |
| 1852 淺沼組              | 7,000   | 157       | 1,099,000   |    |
| 1854 新井組              | 1,600   | 71        | 113,600     |    |
| 1860 戸田建設             | 23,000  | 544       | 12,512,000  |    |
| 1861 熊谷組              | 14,000  | 133       | 1,862,000   |    |
| 1865 青木あすなろ建設         | 1,500   | 688       | 1,032,000   |    |
| 1866 北野建設             | 6,000   | 208       | 1,248,000   |    |
| 1867 植木組              | 3,000   | 163       | 489,000     |    |

(単位：株、円)

|                   |        |       |            |
|-------------------|--------|-------|------------|
| 1868 三井ホーム        | 3,000  | 479   | 1,437,000  |
| 1870 矢作建設工業       | 3,000  | 407   | 1,221,000  |
| 1871 ビーエス三菱       | 1,500  | 270   | 405,000    |
| 1872 アゼル          | 5,000  | 265   | 1,325,000  |
| 1878 大東建託         | 9,600  | 5,670 | 54,432,000 |
| 1879 新日本建設        | 2,800  | 348   | 974,400    |
| 1881 NIPOコーポレーション | 5,000  | 800   | 4,000,000  |
| 1882 東亜道路工業       | 5,000  | 173   | 865,000    |
| 1883 前田道路         | 7,000  | 908   | 6,356,000  |
| 1884 日本道路         | 8,000  | 165   | 1,320,000  |
| 1885 東亜建設工業       | 20,000 | 101   | 2,020,000  |
| 1888 若築建設         | 13,000 | 85    | 1,105,000  |
| 1889 佐伯建設工業       | 9,000  | 72    | 648,000    |
| 1890 東洋建設         | 28,000 | 83    | 2,324,000  |
| 1893 五洋建設         | 25,500 | 170   | 4,335,000  |
| 1895 大成口テック       | 4,000  | 161   | 644,000    |
| 1896 大林道路         | 3,000  | 175   | 525,000    |
| 1899 福田組          | 3,000  | 387   | 1,161,000  |
| 1907 東北ミサワホーム     | 1,300  | 370   | 481,000    |
| 1911 住友林業         | 16,000 | 787   | 12,592,000 |
| 1914 日本基礎技術       | 3,000  | 288   | 864,000    |
| 1916 日成ビルド工業      | 7,000  | 107   | 749,000    |
| 1919 エス・バイ・エル     | 12,000 | 62    | 744,000    |
| 1921 バコーポレーション    | 3,200  | 317   | 1,014,400  |
| 1924 パナホーム        | 8,000  | 735   | 5,880,000  |
| 1925 大和ハウス工業      | 58,000 | 1,477 | 85,666,000 |
| 1926 ライト工業        | 4,900  | 282   | 1,381,800  |
| 1928 積水ハウス        | 69,000 | 1,245 | 85,905,000 |
| 1929 日特建設         | 6,000  | 74    | 444,000    |
| 1930 北陸電気工事       | 1,000  | 311   | 311,000    |
| 1932 コミュニテュア      | 2,000  | 562   | 1,124,000  |
| 1934 コアテック        | 4,000  | 613   | 2,452,000  |
| 1937 西部電気工業       | 2,000  | 491   | 982,000    |
| 1939 四電工          | 2,000  | 542   | 1,084,000  |
| 1941 中電工          | 3,400  | 1,969 | 6,694,600  |
| 1942 関電工          | 11,000 | 645   | 7,095,000  |
| 1943 大明           | 4,000  | 792   | 3,168,000  |
| 1944 きんでん         | 14,000 | 850   | 11,900,000 |
| 1945 東京エネシス       | 3,000  | 656   | 1,968,000  |
| 1946 トーエネック       | 3,000  | 590   | 1,770,000  |
| 1949 住友電設         | 1,900  | 572   | 1,086,800  |
| 1950 日本電設工業       | 4,000  | 772   | 3,088,000  |
| 1951 協和エクスオ       | 8,000  | 835   | 6,680,000  |
| 1952 新日本空調        | 1,800  | 592   | 1,065,600  |
| 1954 日本工営         | 8,000  | 289   | 2,312,000  |
| 1955 東電通          | 4,000  | 254   | 1,016,000  |
| 1956 日本電話施設       | 4,000  | 302   | 1,208,000  |
| 1959 九電工          | 5,000  | 577   | 2,885,000  |
| 1961 三機工業         | 6,000  | 658   | 3,948,000  |
| 1963 日揮           | 24,000 | 1,941 | 46,584,000 |
| 1964 中外炉工業        | 9,000  | 393   | 3,537,000  |
| 1967 ヤマト          | 3,000  | 287   | 861,000    |
| 1968 太平電業         | 4,000  | 993   | 3,972,000  |
| 1969 高砂熱学工業       | 7,000  | 920   | 6,440,000  |
| 1970 日立プラントテクノロジ- | 6,000  | 457   | 2,742,000  |
| 1972 三晃金属工業       | 3,000  | 177   | 531,000    |
| 1973 NECネットスエア    | 1,900  | 1,313 | 2,494,700  |
| 1975 朝日工業社        | 3,000  | 386   | 1,158,000  |
| 1978 アタカ大機        | 2,000  | 279   | 558,000    |

|      |                                |        |         |            |
|------|--------------------------------|--------|---------|------------|
| 1979 | 大気社                            | 3,500  | 1,148   | 4,018,000  |
| 1980 | ダイダ                            | 3,000  | 539     | 1,617,000  |
| 1982 | 日比谷総合設備                        | 3,000  | 850     | 2,550,000  |
| 1983 | 東芝ブランドシステム                     | 4,000  | 1,032   | 4,128,000  |
| 1988 | シヨ-ポ-ランド建設                     | 2,300  | 1,362   | 3,132,800  |
| 2001 | 日本製粉                           | 15,000 | 424     | 6,360,000  |
| 2002 | 日清製粉グループ本社                     | 21,500 | 1,142   | 24,553,000 |
| 2003 | 日東富士製粉                         | 2,000  | 343     | 686,000    |
| 2004 | 昭和産業                           | 10,000 | 265     | 2,650,000  |
| 2009 | 鳥越製粉                           | 1,900  | 772     | 1,466,800  |
| 2051 | 日本農産工業                         | 8,000  | 293     | 2,344,000  |
| 2052 | 協同飼料                           | 8,000  | 136     | 1,088,000  |
| 2053 | 中部飼料                           | 2,000  | 1,081   | 2,162,000  |
| 2056 | 日本配合飼料                         | 7,000  | 152     | 1,064,000  |
| 2059 | ユニ-チャ-ム ベットケア                  | 700    | 5,780   | 4,046,000  |
| 2107 | 東洋精糖                           | 4,000  | 119     | 476,000    |
| 2108 | 日本甜菜製糖                         | 13,000 | 241     | 3,133,000  |
| 2109 | 三井製糖                           | 10,000 | 427     | 4,270,000  |
| 2131 | アコ-ディ-ア・ゴルフ                    | 68     | 117,000 | 7,956,000  |
| 2168 | ハンナグループ                        | 20     | 122,000 | 2,440,000  |
| 2201 | 森永製菓                           | 25,000 | 242     | 6,050,000  |
| 2202 | 明治製菓                           | 35,000 | 504     | 17,640,000 |
| 2204 | 中村屋                            | 5,000  | 511     | 2,555,000  |
| 2206 | 江崎グリコ                          | 9,000  | 1,155   | 10,395,000 |
| 2207 | 名糖産業                           | 1,200  | 2,075   | 2,490,000  |
| 2211 | 不二家                            | 13,000 | 177     | 2,301,000  |
| 2212 | 山崎製パン                          | 17,000 | 1,150   | 19,550,000 |
| 2215 | 第一屋製パン                         | 3,000  | 130     | 390,000    |
| 2217 | モロソフ                           | 4,000  | 342     | 1,368,000  |
| 2261 | 明治乳業                           | 30,000 | 588     | 17,640,000 |
| 2262 | 雪印乳業                           | 25,500 | 363     | 9,256,500  |
| 2264 | 森永乳業                           | 20,000 | 329     | 6,580,000  |
| 2267 | ヤクルト本社                         | 12,600 | 2,625   | 33,075,000 |
| 2281 | プリマハム                          | 13,000 | 110     | 1,430,000  |
| 2282 | 日本ハム                           | 18,000 | 1,093   | 19,674,000 |
| 2284 | 伊藤ハム                           | 15,000 | 480     | 7,200,000  |
| 2286 | 林兼産業                           | 8,000  | 101     | 808,000    |
| 2288 | 丸大食品                           | 10,000 | 251     | 2,510,000  |
| 2290 | 米久                             | 2,000  | 1,060   | 2,120,000  |
| 2292 | S FOODS                        | 1,500  | 938     | 1,407,000  |
| 2301 | 学糖                             | 800    | 411     | 328,800    |
| 2305 | スタジオアリス                        | 900    | 1,303   | 1,172,700  |
| 2309 | シミック                           | 40     | 31,700  | 1,268,000  |
| 2317 | システムプロ                         | 15     | 85,400  | 1,281,000  |
| 2322 | NECフィールドینگ                    | 1,800  | 1,322   | 2,379,600  |
| 2327 | 新日鉄ソリューションズ                    | 1,400  | 3,400   | 4,760,000  |
| 2331 | 総合警備保障                         | 7,300  | 1,853   | 13,526,900 |
| 2353 | 日本駐車場開発                        | 201    | 6,400   | 1,286,400  |
| 2359 | コア                             | 800    | 675     | 540,000    |
| 2371 | カカコム                           | 8      | 432,000 | 3,456,000  |
| 2372 | アイロムホールディングス                   | 49     | 9,710   | 475,790    |
| 2378 | ルネサンス                          | 900    | 555     | 499,500    |
| 2413 | ソネット・エムスリー                     | 6      | 357,000 | 2,142,000  |
| 2433 | 博報堂DYホールディングス                  | 3,030  | 6,140   | 18,604,200 |
| 2450 | 一休                             | 12     | 88,700  | 1,064,400  |
| 2453 | ジャパンベストシステム                    | 2      | 101,000 | 202,000    |
| 2462 | ジェイコム                          | 1      | 221,000 | 221,000    |
| 2466 | パシフィックゴルフグループインターナショナルホールディングス | 46     | 93,800  | 4,314,800  |

|      |                    |         |         |             |
|------|--------------------|---------|---------|-------------|
| 2476 | テンプスタッフ            | 24      | 113,000 | 2,712,000   |
| 2501 | サッポロホールディングス       | 31,000  | 910     | 28,210,000  |
| 2502 | アサヒビール             | 47,100  | 1,932   | 90,997,200  |
| 2503 | キリンホールディングス        | 102,000 | 1,700   | 173,400,000 |
| 2531 | 宝ホールディングス          | 21,000  | 687     | 14,427,000  |
| 2533 | オエノンホールディングス       | 6,000   | 275     | 1,650,000   |
| 2536 | メルシャン              | 7,000   | 239     | 1,673,000   |
| 2540 | 養命酒製造              | 2,000   | 1,169   | 2,338,000   |
| 2572 | 三國コカ・コーラボトリング      | 3,500   | 1,243   | 4,350,500   |
| 2578 | 四国コカ・コーラボトリング      | 1,100   | 1,354   | 1,489,400   |
| 2579 | コカ・コーラウエストホールディングス | 7,200   | 2,680   | 19,296,000  |
| 2680 | コカ・コーラ セントラル ジャパン  | 5       | 873,000 | 4,365,000   |
| 2690 | ダイドードリンコ           | 1,100   | 4,180   | 4,598,000   |
| 2693 | 伊藤園                | 6,500   | 2,240   | 14,560,000  |
| 2694 | キ-コーヒー             | 1,900   | 1,517   | 2,882,300   |
| 2697 | ユニカフエ              | 600     | 1,542   | 925,200     |
| 2698 | アサヒ飲料              | 2,000   | 2,095   | 4,190,000   |
| 2699 | ジャパンフーズ            | 400     | 1,211   | 484,400     |
| 2602 | 日清オイリオグループ         | 10,000  | 426     | 4,260,000   |
| 2607 | 不二戦油               | 6,200   | 858     | 5,319,600   |
| 2613 | J-オイルミルズ           | 9,000   | 326     | 2,934,000   |
| 2651 | ローソン               | 6,800   | 4,000   | 27,200,000  |
| 2657 | インターニックス           | 900     | 617     | 555,300     |
| 2659 | サンエー               | 700     | 3,540   | 2,478,000   |
| 2660 | キリン堂               | 600     | 780     | 468,000     |
| 2664 | カワチ薬品              | 1,400   | 3,000   | 4,200,000   |
| 2670 | エービーシー・マート         | 2,200   | 2,500   | 5,500,000   |
| 2674 | ハードオフコーポレーション      | 800     | 449     | 359,200     |
| 2676 | 高千穂交野              | 800     | 1,372   | 1,097,600   |
| 2678 | アスクル               | 2,300   | 2,660   | 6,118,000   |
| 2681 | ゲオ                 | 38      | 205,000 | 7,790,000   |
| 2685 | ポイント               | 1,860   | 5,280   | 9,820,800   |
| 2687 | シー・グイ・エス・ペイエリア     | 2,000   | 183     | 366,000     |
| 2692 | 伊藤忠食品              | 600     | 3,150   | 1,890,000   |
| 2695 | くらこーポレーション         | 6       | 263,000 | 1,578,000   |
| 2698 | キャンドウ              | 9       | 88,300  | 794,700     |
| 2715 | 高千穂電気              | 1,300   | 1,340   | 1,742,000   |
| 2726 | ハル                 | 600     | 2,340   | 1,404,000   |
| 2729 | JALUX              | 600     | 1,915   | 1,149,000   |
| 2730 | エディオン              | 8,900   | 1,251   | 11,133,900  |
| 2734 | サ-ラコーポレーション        | 2,000   | 476     | 952,000     |
| 2737 | ト-メンデバイス           | 300     | 1,742   | 522,600     |
| 2738 | ハルズ                | 11      | 80,000  | 880,000     |
| 2753 | あみやき亭              | 4       | 264,000 | 1,066,000   |
| 2768 | 双日                 | 96,200  | 404     | 38,864,800  |
| 2779 | 三越                 | 50,000  | 524     | 26,200,000  |
| 2784 | アルフレッサ ホールディングス    | 4,100   | 6,320   | 25,912,000  |
| 2792 | ハニ-ズ               | 1,450   | 2,750   | 3,987,500   |
| 2794 | クリエイトエス・ディー        | 600     | 2,475   | 1,485,000   |
| 2801 | キッコーマン             | 18,000  | 1,557   | 28,026,000  |
| 2802 | 味の素                | 64,000  | 1,325   | 84,800,000  |
| 2809 | キユーピー              | 12,100  | 1,132   | 13,697,200  |
| 2810 | ハウス食品              | 8,600   | 1,935   | 16,641,000  |
| 2811 | カゴメ                | 9,100   | 1,723   | 15,679,300  |
| 2812 | 焼津水産化学工業           | 1,200   | 1,161   | 1,393,200   |
| 2815 | アリアケジャパン           | 1,900   | 2,105   | 3,999,500   |
| 2871 | ニチレイ               | 28,000  | 469     | 13,132,000  |
| 2873 | 加ト吉                | 11,600  | 707     | 8,201,200   |
| 2874 | ヨコレイ               | 5,000   | 843     | 4,215,000   |



|      |                     |         |         |             |
|------|---------------------|---------|---------|-------------|
| 2875 | 東洋水産                | 10,000  | 1,996   | 19,960,000  |
| 2897 | 白清食品                | 9,100   | 3,910   | 36,581,000  |
| 2899 | 永谷園                 | 2,000   | 860     | 1,720,000   |
| 2908 | フジッコ                | 3,000   | 1,170   | 3,510,000   |
| 2910 | ロジック・フィールド          | 1,200   | 1,622   | 1,946,400   |
| 2914 | J T                 | 520     | 672,000 | 349,440,000 |
| 2918 | わらべや日洋              | 1,200   | 1,585   | 1,902,000   |
| 2922 | なとり                 | 1,000   | 888     | 888,000     |
| 3001 | 片倉工業                | 2,700   | 1,998   | 5,394,600   |
| 3002 | グンゼ                 | 18,000  | 490     | 8,820,000   |
| 3003 | 昭栄                  | 3,700   | 1,569   | 5,805,300   |
| 3004 | 神栄                  | 3,000   | 212     | 636,000     |
| 3009 | 川島織物セルコン            | 8,000   | 119     | 952,000     |
| 3022 | 山下医科器械              | 100     | 1,700   | 170,000     |
| 3023 | ラサ商事                | 700     | 463     | 324,100     |
| 3028 | アルペン                | 1,600   | 1,758   | 2,812,800   |
| 3050 | D C M Japanホールディングス | 10,400  | 796     | 8,278,400   |
| 3076 | あい ホールディングス         | 4,400   | 758     | 3,335,200   |
| 3086 | J・フロント リテイリング       | 49,000  | 1,066   | 52,234,000  |
| 3087 | トール・日レスホールディングス     | 3,300   | 1,805   | 5,956,500   |
| 3088 | マツモトキヨシホールディングス     | 3,500   | 2,580   | 9,030,000   |
| 3101 | 東洋紡                 | 73,000  | 232     | 16,936,000  |
| 3103 | ユニチカ                | 52,000  | 129     | 6,708,000   |
| 3104 | 富士紡ホールディングス         | 11,000  | 166     | 1,826,000   |
| 3105 | 日清紡                 | 17,000  | 1,377   | 23,409,000  |
| 3106 | クラボウ                | 22,000  | 255     | 5,610,000   |
| 3107 | タイワボウ               | 15,000  | 290     | 4,350,000   |
| 3109 | シキボウ                | 14,000  | 126     | 1,764,000   |
| 3110 | 日東紡                 | 21,000  | 279     | 5,859,000   |
| 3116 | トヨタ紡織               | 7,300   | 3,800   | 27,740,000  |
| 3201 | 日本毛織                | 7,000   | 838     | 5,866,000   |
| 3202 | 大東紡織                | 4,000   | 101     | 404,000     |
| 3204 | トーア紡コーポレーション        | 8,000   | 99      | 792,000     |
| 3205 | タイドリーミテッド           | 2,700   | 1,422   | 3,839,400   |
| 3216 | 御幸ホールディングス          | 2,000   | 301     | 602,000     |
| 3231 | 野村不動産ホールディングス       | 5,800   | 2,780   | 16,124,000  |
| 3302 | 帝國繊維                | 2,000   | 410     | 820,000     |
| 3313 | フックオフコーポレーション       | 1,300   | 664     | 863,200     |
| 3315 | 三井鉱山                | 13,500  | 361     | 4,873,500   |
| 3321 | ミタチ産業               | 400     | 815     | 326,000     |
| 3332 | J F E 商事ホールディングス    | 12,000  | 663     | 7,956,000   |
| 3333 | あさひ                 | 300     | 1,445   | 433,500     |
| 3337 | サークルKサンクス           | 3,900   | 1,672   | 6,520,800   |
| 3341 | 日本調剤                | 370     | 1,889   | 699,930     |
| 3349 | コスモス薬品              | 800     | 1,629   | 1,303,200   |
| 3360 | グリーンホスピタルサブライ       | 15      | 127,000 | 1,905,000   |
| 3382 | セブン&アイ・ホールディングス     | 88,000  | 2,955   | 260,040,000 |
| 3391 | ソルバルホールディングス        | 1,500   | 4,120   | 6,180,000   |
| 3395 | サンマルクホールディングス       | 600     | 4,660   | 2,796,000   |
| 3396 | フェリスモ               | 400     | 2,065   | 826,000     |
| 3401 | 帝人                  | 96,000  | 492     | 47,232,000  |
| 3402 | 東レ                  | 137,000 | 851     | 116,587,000 |
| 3404 | 三菱レイヨン              | 51,000  | 547     | 27,897,000  |
| 3405 | クラレ                 | 35,000  | 1,279   | 44,765,000  |
| 3407 | 旭化成                 | 137,000 | 743     | 101,791,000 |
| 3408 | サカイオーベックス           | 6,000   | 161     | 966,000     |
| 3421 | 稲葉製作所               | 1,000   | 1,654   | 1,654,000   |
| 3431 | 宮地エンジニアリンググループ      | 6,000   | 107     | 642,000     |
| 3432 | 三協・立山ホールディングス       | 27,000  | 149     | 4,023,000   |

|      |                 |         |         |             |
|------|-----------------|---------|---------|-------------|
| 3433 | トーカコ            | 1,300   | 1,701   | 2,211,300   |
| 3434 | アルファ Co         | 700     | 2,000   | 1,400,000   |
| 3436 | SUMCO           | 11,600  | 3,140   | 36,424,000  |
| 3501 | 住江織物            | 6,000   | 266     | 1,596,000   |
| 3512 | 日本フェルト          | 1,200   | 586     | 703,200     |
| 3513 | イチカワ            | 2,000   | 395     | 790,000     |
| 3514 | 日本バイリオン         | 3,000   | 498     | 1,494,000   |
| 3524 | 日東製鋼            | 3,000   | 116     | 348,000     |
| 3526 | 芦森工業            | 5,000   | 206     | 1,030,000   |
| 3529 | アソギ             | 19,000  | 144     | 2,736,000   |
| 3551 | ダイニック           | 4,000   | 231     | 924,000     |
| 3553 | 共和レザー           | 1,300   | 628     | 816,400     |
| 3569 | ゼーレン            | 4,600   | 889     | 4,089,400   |
| 3577 | 東海染工            | 3,000   | 134     | 402,000     |
| 3580 | 小松精練            | 4,000   | 508     | 2,032,000   |
| 3591 | ワコールホールディングス    | 13,000  | 1,489   | 19,357,000  |
| 3593 | ホギメディカル         | 1,100   | 4,790   | 5,269,000   |
| 3605 | サンエー・インターナショナル  | 1,000   | 2,085   | 2,085,000   |
| 3606 | レナウン            | 3,700   | 803     | 2,971,100   |
| 3607 | クラウディア          | 200     | 993     | 199,600     |
| 3708 | 特種東海ホールディングス    | 13,000  | 234     | 3,042,000   |
| 3715 | ドウゴ             | 11      | 351,000 | 3,861,000   |
| 3730 | マクミル            | 8       | 151,000 | 1,208,000   |
| 3738 | テレパーク           | 19      | 128,000 | 2,432,000   |
| 3774 | インターネットイニシアティブ  | 13      | 406,000 | 5,278,000   |
| 3817 | S R Aホールディングス   | 900     | 1,780   | 1,602,000   |
| 3819 | インテックホールディングス   | 4,400   | 1,648   | 7,251,200   |
| 3820 | J B I Sホールディングス | 2,100   | 405     | 850,500     |
| 3861 | 王子製紙            | 90,000  | 515     | 46,350,000  |
| 3864 | 三泰製紙            | 31,000  | 231     | 7,161,000   |
| 3865 | 北越製紙            | 12,500  | 522     | 6,525,000   |
| 3877 | 中越パルプ工業         | 8,000   | 224     | 1,792,000   |
| 3878 | 巴川製紙所           | 3,000   | 267     | 801,000     |
| 3880 | 大王製紙            | 9,000   | 911     | 8,199,000   |
| 3882 | 紀州製紙            | 7,000   | 148     | 1,036,000   |
| 3893 | 日本製紙グループ本社      | 100     | 327,000 | 32,700,000  |
| 3941 | レノゴ             | 20,000  | 740     | 14,800,000  |
| 3946 | トーモク            | 7,000   | 220     | 1,540,000   |
| 3950 | ザ・バック           | 1,400   | 1,780   | 2,492,000   |
| 4003 | コーベケミカル         | 3,000   | 134     | 402,000     |
| 4004 | 昭和電工            | 113,000 | 378     | 42,714,000  |
| 4005 | 住友化学            | 151,000 | 938     | 141,638,000 |
| 4007 | 日本化成            | 4,000   | 214     | 856,000     |
| 4008 | 住友精化            | 5,000   | 457     | 2,285,000   |
| 4021 | 日産化学工業          | 17,000  | 1,422   | 24,174,000  |
| 4022 | ラサ工業            | 8,000   | 220     | 1,760,000   |
| 4023 | クレハ             | 15,000  | 540     | 8,100,000   |
| 4027 | テイカ             | 4,000   | 332     | 1,328,000   |
| 4028 | 石原産業            | 35,000  | 206     | 7,210,000   |
| 4031 | 片倉チツカリン         | 2,000   | 277     | 554,000     |
| 4041 | 日本曹達            | 14,000  | 448     | 6,272,000   |
| 4042 | 東ソー             | 55,000  | 488     | 26,840,000  |
| 4043 | トクヤマ            | 27,000  | 1,105   | 29,835,000  |
| 4044 | セントラル硝子         | 22,000  | 421     | 9,262,000   |
| 4045 | 東亜合成            | 24,000  | 367     | 8,808,000   |
| 4046 | ダイソー            | 9,000   | 377     | 3,393,000   |
| 4047 | 関東電化工業          | 5,000   | 640     | 3,200,000   |
| 4061 | 電気化学工業          | 41,000  | 512     | 20,992,000  |
| 4062 | イビデン            | 14,700  | 7,980   | 117,306,000 |

|      |                    |         |         |             |  |
|------|--------------------|---------|---------|-------------|--|
| 4063 | 信越化学工業             | 36,500  | 6,840   | 249,660,000 |  |
| 4064 | 日本カーバイド工業          | 5,000   | 213     | 1,065,000   |  |
| 4065 | 紀文フードケミフア          | 1,500   | 980     | 1,470,000   |  |
| 4078 | 堺化学工業              | 7,000   | 489     | 3,423,000   |  |
| 4088 | エア・ウオーター           | 16,000  | 1,141   | 18,256,000  |  |
| 4091 | 太陽日酸               | 34,000  | 1,025   | 34,850,000  |  |
| 4092 | 日本化学工業             | 8,000   | 273     | 2,184,000   |  |
| 4095 | 日本カーバイド工業          | 5,000   | 1,610   | 8,050,000   |  |
| 4097 | 高圧ガス工業             | 4,000   | 661     | 2,644,000   |  |
| 4099 | 四国化成工業             | 3,000   | 471     | 1,413,000   |  |
| 4100 | 戸田工業               | 4,000   | 450     | 1,800,000   |  |
| 4109 | スチラ ケミフア           | 1,000   | 2,405   | 2,405,000   |  |
| 4112 | 保土谷化学工業            | 5,000   | 265     | 1,325,000   |  |
| 4114 | 日本触媒               | 14,000  | 1,090   | 15,260,000  |  |
| 4116 | 大日精化工業             | 8,000   | 484     | 3,872,000   |  |
| 4118 | カネカ                | 26,000  | 933     | 24,258,000  |  |
| 4151 | 協和発酵工業             | 36,000  | 1,250   | 45,000,000  |  |
| 4182 | 三菱ケミカル化学           | 38,000  | 1,103   | 41,914,000  |  |
| 4183 | 三井化学               | 67,000  | 720     | 48,240,000  |  |
| 4185 | J S R              | 21,600  | 2,760   | 59,616,000  |  |
| 4186 | 東京応化工業             | 4,300   | 2,410   | 10,363,000  |  |
| 4188 | 三菱ケミカルホールディングス     | 117,500 | 882     | 103,635,000 |  |
| 4201 | 日本合成化学工業           | 6,000   | 571     | 3,426,000   |  |
| 4202 | ダイセル化学工業           | 31,000  | 668     | 20,708,000  |  |
| 4203 | 住友ベークライト           | 21,000  | 702     | 14,742,000  |  |
| 4204 | 積水化学工業             | 53,000  | 740     | 39,220,000  |  |
| 4205 | 日本ゼオン              | 19,000  | 670     | 12,730,000  |  |
| 4206 | アイカ工業              | 6,300   | 1,072   | 6,753,600   |  |
| 4208 | 宇部興産               | 92,000  | 380     | 34,960,000  |  |
| 4212 | 積水樹脂               | 3,000   | 912     | 2,736,000   |  |
| 4215 | タキロン               | 5,000   | 288     | 1,440,000   |  |
| 4216 | 旭有機材工業             | 7,000   | 322     | 2,254,000   |  |
| 4217 | 日立化成工業             | 10,800  | 2,480   | 26,784,000  |  |
| 4218 | ニチバン               | 2,000   | 321     | 642,000     |  |
| 4220 | リケンテクノス            | 4,000   | 290     | 1,160,000   |  |
| 4221 | 大倉工業               | 5,000   | 271     | 1,355,000   |  |
| 4228 | 積水化成工業             | 6,000   | 339     | 2,034,000   |  |
| 4229 | 群衆化学工業             | 6,000   | 237     | 1,422,000   |  |
| 4231 | タイカースポリマー          | 1,100   | 617     | 678,700     |  |
| 4271 | 日本カーリット            | 1,500   | 521     | 781,500     |  |
| 4272 | 日本化薬               | 15,000  | 889     | 13,335,000  |  |
| 4282 | イービーエス             | 6       | 375,000 | 2,250,000   |  |
| 4283 | 松下電工インフォメーションシステムズ | 400     | 3,290   | 1,316,000   |  |
| 4295 | フエイズ               | 78      | 13,100  | 1,021,800   |  |
| 4301 | アモユース              | 500     | 2,085   | 1,042,500   |  |
| 4307 | 野村総合研究所            | 10,200  | 3,730   | 38,046,000  |  |
| 4310 | トリウムインキュベータ        | 7       | 153,000 | 1,071,000   |  |
| 4312 | サイバネットシステム         | 17      | 65,000  | 1,105,000   |  |
| 4319 | T A C              | 1,000   | 464     | 464,000     |  |
| 4321 | ケネテイクス             | 66      | 183,000 | 12,078,000  |  |
| 4324 | 電通                 | 217     | 290,000 | 62,930,000  |  |
| 4325 | バンダイビジュアル          | 6       | 281,000 | 1,686,000   |  |
| 4331 | テイクアンドグヴ・ニース       | 56      | 13,530  | 757,680     |  |
| 4337 | びあ                 | 500     | 1,763   | 881,500     |  |
| 4340 | シンプレクス・テクノロジ       | 38      | 47,350  | 1,799,300   |  |
| 4343 | イオンファンタジー          | 600     | 2,390   | 1,434,000   |  |
| 4362 | 日本精化               | 2,100   | 831     | 1,745,100   |  |
| 4401 | A D E K A          | 8,700   | 1,136   | 9,883,200   |  |
| 4403 | 白油                 | 20,000  | 447     | 8,940,000   |  |

|      |              |        |       |             |  |
|------|--------------|--------|-------|-------------|--|
| 4404 | ミヨシ油脂        | 8,000  | 169   | 1,352,000   |  |
| 4410 | ハリマ化成        | 2,000  | 531   | 1,062,000   |  |
| 4452 | 花王           | 61,000 | 3,430 | 209,230,000 |  |
| 4461 | 第一工業製薬       | 4,000  | 278   | 1,112,000   |  |
| 4471 | 三洋化成工業       | 6,000  | 631   | 3,786,000   |  |
| 4502 | 武田薬品工業       | 86,700 | 6,610 | 573,087,000 |  |
| 4503 | アステラス製薬      | 47,200 | 4,890 | 230,808,000 |  |
| 4506 | 大日本住友製薬      | 16,000 | 846   | 13,536,000  |  |
| 4507 | 塩野義製薬        | 37,000 | 2,030 | 75,110,000  |  |
| 4508 | 田辺三菱製薬       | 25,000 | 1,066 | 26,650,000  |  |
| 4512 | わかもと製薬       | 3,000  | 397   | 1,191,000   |  |
| 4514 | あすか製薬        | 2,000  | 964   | 1,928,000   |  |
| 4516 | 日本新薬         | 6,000  | 1,058 | 6,348,000   |  |
| 4518 | 富山化学工業       | 17,000 | 715   | 12,155,000  |  |
| 4519 | 中央製薬         | 29,100 | 1,805 | 52,525,500  |  |
| 4521 | 科研製薬         | 10,000 | 803   | 8,030,000   |  |
| 4523 | エーザイ         | 27,000 | 4,580 | 123,660,000 |  |
| 4527 | ロート製薬        | 9,000  | 1,341 | 12,069,000  |  |
| 4528 | 小野薬品工業       | 11,000 | 5,330 | 58,630,000  |  |
| 4530 | 久光製薬         | 6,200  | 3,370 | 20,894,000  |  |
| 4531 | 有機合成薬品工業     | 2,000  | 310   | 620,000     |  |
| 4534 | 持田製薬         | 9,000  | 1,088 | 9,792,000   |  |
| 4535 | 大正製薬         | 21,000 | 2,185 | 45,885,000  |  |
| 4536 | 参天製薬         | 7,900  | 2,825 | 22,317,500  |  |
| 4537 | エスエス製薬       | 6,000  | 586   | 3,516,000   |  |
| 4538 | 扶桑薬品工業       | 7,000  | 293   | 2,051,000   |  |
| 4539 | 日本ケミフア       | 4,000  | 591   | 2,364,000   |  |
| 4540 | ツムラ          | 6,900  | 2,105 | 14,524,500  |  |
| 4543 | テルモ          | 15,100 | 5,960 | 89,996,000  |  |
| 4544 | みらかホールディングス  | 4,700  | 2,720 | 12,784,000  |  |
| 4547 | キッセイ薬品工業     | 5,000  | 2,280 | 11,400,000  |  |
| 4548 | 生化学工業        | 4,200  | 1,251 | 5,254,200   |  |
| 4549 | 栄研化学         | 1,400  | 956   | 1,338,400   |  |
| 4550 | 白水製薬         | 900    | 782   | 703,800     |  |
| 4551 | 鳥居薬品         | 1,300  | 1,831 | 2,380,300   |  |
| 4553 | 東和薬品         | 900    | 4,700 | 4,230,000   |  |
| 4555 | 沢井製薬         | 1,500  | 4,570 | 6,855,000   |  |
| 4559 | ゼリア新薬工業      | 3,000  | 986   | 2,958,000   |  |
| 4568 | 第一三共         | 71,700 | 3,480 | 249,516,000 |  |
| 4569 | キョーリン        | 6,000  | 1,245 | 7,470,000   |  |
| 4611 | 大日本塗料        | 12,000 | 150   | 1,800,000   |  |
| 4612 | 日本ペイント       | 22,000 | 556   | 12,232,000  |  |
| 4613 | 関西ペイント       | 25,000 | 801   | 20,025,000  |  |
| 4614 | トウベ          | 2,000  | 115   | 230,000     |  |
| 4617 | 中国塗料         | 5,000  | 1,028 | 5,140,000   |  |
| 4619 | 日本特殊塗料       | 2,000  | 542   | 1,084,000   |  |
| 4620 | 藤倉化成         | 2,200  | 912   | 2,006,400   |  |
| 4626 | 太陽インキ製造      | 1,700  | 3,170 | 5,389,000   |  |
| 4631 | 大日本インキ化学工業   | 72,000 | 518   | 37,296,000  |  |
| 4633 | サカタインクス      | 5,000  | 567   | 2,835,000   |  |
| 4634 | 東洋インキ製造      | 22,000 | 384   | 8,448,000   |  |
| 4641 | アルプス技研       | 900    | 1,476 | 1,328,400   |  |
| 4651 | サニックス        | 3,500  | 306   | 1,071,000   |  |
| 4653 | タイオース        | 400    | 541   | 216,400     |  |
| 4658 | 日本空調サービス     | 500    | 1,016 | 508,000     |  |
| 4661 | オリエンタルランド    | 6,200  | 6,810 | 42,222,000  |  |
| 4665 | ダスキン         | 6,600  | 1,927 | 12,718,200  |  |
| 4666 | パーク 2 4      | 10,600 | 945   | 10,017,000  |  |
| 4668 | 明光ネットワークジャパン | 2,300  | 610   | 1,403,000   |  |

|      |                       |        |         |             |
|------|-----------------------|--------|---------|-------------|
| 4671 | ファルコバイオシステムズ          | 1,200  | 755     | 906,000     |
| 4674 | クレスコ                  | 400    | 905     | 362,000     |
| 4676 | フジテレビジョン              | 215    | 178,000 | 38,270,000  |
| 4678 | 秀英予備校                 | 400    | 580     | 232,000     |
| 4679 | 田谷                    | 400    | 826     | 330,400     |
| 4680 | ラウンドワン                | 33     | 234,000 | 7,722,000   |
| 4681 | リゾートトラスト              | 3,700  | 2,240   | 8,288,000   |
| 4684 | オービック                 | 650    | 20,670  | 13,435,500  |
| 4687 | ティーチャーズフットウェアエンジニアリング | 500    | 787     | 393,500     |
| 4689 | ヤフー                   | 1,965  | 47,300  | 92,944,600  |
| 4694 | ビー・エム・エル              | 1,000  | 1,778   | 1,778,000   |
| 4696 | ワタエエディング              | 700    | 1,483   | 1,038,100   |
| 4704 | トレンドマイクロ              | 9,000  | 4,140   | 37,260,000  |
| 4708 | もしもしホットライン            | 900    | 5,630   | 5,067,000   |
| 4711 | 東急コミュニケーション           | 600    | 2,680   | 1,608,000   |
| 4714 | リソー教育                 | 249    | 3,500   | 871,500     |
| 4716 | 日本オラル                 | 3,300  | 4,800   | 15,840,000  |
| 4719 | アルファシステムズ             | 600    | 2,435   | 1,461,000   |
| 4722 | フューチャーアーキテクト          | 22     | 60,900  | 1,339,800   |
| 4723 | グッドウィル・グループ           | 180    | 23,800  | 4,284,000   |
| 4724 | シチエ                   | 500    | 975     | 487,500     |
| 4725 | シーエーシー                | 1,300  | 790     | 1,027,000   |
| 4726 | ソフトバンク・テクノロジー         | 500    | 952     | 476,000     |
| 4728 | トーセ                   | 500    | 1,084   | 542,000     |
| 4732 | ユー・エス・エス              | 2,760  | 6,950   | 19,182,000  |
| 4733 | オービックビジネスコンサルティング     | 650    | 6,890   | 4,478,500   |
| 4738 | 日立ビジネスソリューション         | 700    | 645     | 451,500     |
| 4739 | 伊藤忠テクノソリューションズ        | 2,600  | 3,870   | 10,062,000  |
| 4743 | アイティフォー               | 2,300  | 443     | 1,018,900   |
| 4745 | 東京個別指導学院              | 3,400  | 300     | 1,020,000   |
| 4746 | 東計電算                  | 400    | 1,608   | 643,200     |
| 4756 | カルチャ・コンピニエンス・クラブ      | 10,000 | 594     | 5,940,000   |
| 4762 | エックスネット               | 2      | 139,000 | 278,000     |
| 4768 | 大塚商会                  | 1,600  | 9,970   | 15,952,000  |
| 4775 | 総合メディアカル              | 500    | 2,815   | 1,407,500   |
| 4776 | サイボウズ                 | 30     | 42,000  | 1,260,000   |
| 4779 | ソフトブレイン               | 30     | 12,560  | 376,800     |
| 4799 | アグレックス                | 400    | 1,261   | 504,400     |
| 4801 | セントラルスポーツ             | 700    | 1,106   | 774,200     |
| 4812 | ISID                  | 1,500  | 1,101   | 1,651,500   |
| 4825 | ウェザーニューズ              | 600    | 480     | 288,000     |
| 4826 | C I J                 | 2,200  | 429     | 943,800     |
| 4848 | フルキャスト                | 16     | 69,300  | 1,108,800   |
| 4901 | 富士フイルムホールディングス        | 53,500 | 4,770   | 255,195,000 |
| 4902 | コニカミノルタホールディングス       | 52,000 | 2,045   | 106,340,000 |
| 4911 | 資生堂                   | 41,000 | 2,710   | 111,110,000 |
| 4912 | ライオン                  | 27,000 | 569     | 15,363,000  |
| 4914 | 高砂香料工業                | 8,000  | 754     | 6,032,000   |
| 4917 | マンダム                  | 2,200  | 2,970   | 6,534,000   |
| 4919 | ミルボン                  | 900    | 2,920   | 2,628,000   |
| 4921 | アファンケル                | 4,600  | 1,391   | 6,398,600   |
| 4922 | コーセー                  | 3,900  | 3,020   | 11,778,000  |
| 4924 | ドクターシーラボ              | 14     | 175,000 | 2,450,000   |
| 4951 | エスター化学                | 1,500  | 1,376   | 2,064,000   |
| 4956 | コニシ                   | 1,800  | 945     | 1,701,000   |
| 4958 | 長谷川香料                 | 2,500  | 1,752   | 4,380,000   |
| 4967 | 小林製薬                  | 3,000  | 4,160   | 12,480,000  |
| 4968 | 荒川化学工業                | 1,700  | 1,203   | 2,045,100   |
| 4971 | メック                   | 900    | 1,225   | 1,102,500   |

|      |              |         |         |             |
|------|--------------|---------|---------|-------------|
| 4973 | 日本高純度化学      | 6       | 411,000 | 2,466,000   |
| 4975 | 荏原エーシライト     | 200     | 2,000   | 400,000     |
| 4985 | アース製薬        | 1,700   | 2,800   | 4,760,000   |
| 4989 | イハラケミカル工業    | 4,000   | 227     | 908,000     |
| 4992 | 北興化学工業       | 2,000   | 384     | 768,000     |
| 4994 | 大成ラミック       | 600     | 2,430   | 1,458,000   |
| 4996 | クミアイ化学工業     | 5,000   | 193     | 965,000     |
| 4997 | 日本興業         | 5,000   | 608     | 3,040,000   |
| 5001 | 新日本石油        | 143,000 | 900     | 128,700,000 |
| 5002 | 昭和シェル石油      | 17,100  | 1,251   | 21,392,100  |
| 5007 | コスモ石油        | 60,000  | 437     | 26,220,000  |
| 5009 | 富士興産         | 8,000   | 136     | 1,088,000   |
| 5011 | ニチレキ         | 3,000   | 354     | 1,062,000   |
| 5012 | 東燃ゼネラル石油     | 30,000  | 1,157   | 34,710,000  |
| 5013 | エシロ化学工業      | 1,100   | 1,950   | 2,145,000   |
| 5015 | ピービー・カストロール  | 800     | 377     | 301,600     |
| 5016 | 新日鉱ホールディングス  | 90,500  | 728     | 65,884,000  |
| 5017 | AOCホールディングス  | 5,100   | 1,735   | 8,848,500   |
| 5019 | 出光興産         | 2,300   | 12,420  | 28,566,000  |
| 5101 | 横浜ゴム         | 27,000  | 661     | 17,847,000  |
| 5105 | 東洋ゴム工業       | 19,000  | 432     | 8,208,000   |
| 5108 | ブリヂストン       | 68,700  | 1,976   | 135,751,200 |
| 5110 | 住友ゴム工業       | 17,100  | 1,003   | 17,151,300  |
| 5121 | 藤倉ゴム工業       | 1,400   | 609     | 852,600     |
| 5122 | オカモト         | 9,000   | 357     | 3,213,000   |
| 5142 | アキレス         | 18,000  | 150     | 2,700,000   |
| 5185 | フコク          | 900     | 916     | 824,400     |
| 5186 | ニッタ          | 2,200   | 2,330   | 5,126,000   |
| 5187 | クリエーメディック    | 600     | 1,036   | 621,600     |
| 5191 | 東海ゴム工業       | 4,000   | 1,856   | 7,424,000   |
| 5192 | 三ツ星ベルト       | 7,000   | 551     | 3,857,000   |
| 5195 | バンダー化学       | 9,000   | 474     | 4,266,000   |
| 5196 | 鬼怒川ゴム工業      | 5,000   | 139     | 695,000     |
| 5201 | 旭硝子          | 108,000 | 1,485   | 160,380,000 |
| 5202 | 日本板硝子        | 70,000  | 563     | 39,410,000  |
| 5204 | 石塚硝子         | 3,000   | 235     | 705,000     |
| 5208 | 有沢製作所        | 3,600   | 1,322   | 4,759,200   |
| 5210 | 日本山村硝子       | 10,000  | 241     | 2,410,000   |
| 5214 | 日本電気硝子       | 37,000  | 1,790   | 66,230,000  |
| 5218 | オハラ          | 800     | 1,805   | 1,444,000   |
| 5232 | 住友大阪セメント     | 44,000  | 216     | 9,504,000   |
| 5233 | 太平洋セメント      | 86,000  | 262     | 22,532,000  |
| 5234 | デイ・シー        | 2,000   | 353     | 706,000     |
| 5261 | リゾートソリューション  | 2,000   | 408     | 816,000     |
| 5262 | 日本ヒューム       | 2,000   | 362     | 724,000     |
| 5269 | 日本コンクリート工業   | 3,000   | 211     | 633,000     |
| 5301 | 東海カーボン       | 17,000  | 961     | 16,337,000  |
| 5302 | 日本カーボン       | 10,000  | 455     | 4,550,000   |
| 5310 | 東洋炭素         | 900     | 8,770   | 7,893,000   |
| 5331 | リタケカンパニーリミテド | 12,000  | 454     | 5,448,000   |
| 5332 | TOTO         | 34,000  | 864     | 29,376,000  |
| 5333 | 日本ガイシ        | 28,000  | 2,980   | 83,440,000  |
| 5334 | 日本特殊陶業       | 16,000  | 1,950   | 31,200,000  |
| 5337 | ダントーホールディングス | 3,000   | 244     | 732,000     |
| 5344 | MARUWA       | 600     | 1,696   | 1,017,600   |
| 5345 | 日本セラテック      | 4       | 135,000 | 540,000     |
| 5351 | 品川白煉瓦        | 6,000   | 346     | 2,076,000   |
| 5362 | 黒崎播磨         | 5,000   | 300     | 1,500,000   |
| 5363 | T Y K        | 3,000   | 209     | 627,000     |

|      |                |         |       |             |
|------|----------------|---------|-------|-------------|
| 5384 | フジミインコンロープレーター | 1,600   | 1,604 | 2,566,400   |
| 5391 | エーアンドエーマテリアル   | 5,000   | 123   | 615,000     |
| 5393 | ニチアス           | 10,000  | 500   | 5,000,000   |
| 5401 | 新日本製鐵          | 619,000 | 605   | 374,495,000 |
| 5405 | 住友金屬工業         | 406,000 | 448   | 181,888,000 |
| 5406 | 神戸製鋼所          | 304,000 | 341   | 103,664,000 |
| 5407 | 日新製鋼           | 77,000  | 369   | 28,413,000  |
| 5408 | 中山製鋼所          | 12,000  | 232   | 2,784,000   |
| 5410 | 合同製鐵           | 13,000  | 311   | 4,043,000   |
| 5411 | JFE ホールディングス   | 55,900  | 5,180 | 289,562,000 |
| 5423 | 東京製鐵           | 12,100  | 1,225 | 14,822,500  |
| 5440 | 共成製鐵           | 2,100   | 2,060 | 4,326,000   |
| 5444 | 大和工業           | 5,200   | 4,390 | 22,828,000  |
| 5445 | 東京製鐵           | 4,000   | 466   | 1,864,000   |
| 5449 | 大阪製鐵           | 1,700   | 1,528 | 2,597,600   |
| 5451 | 淀川製鋼所          | 17,000  | 567   | 9,639,000   |
| 5453 | 東洋鋼板           | 5,000   | 523   | 2,615,000   |
| 5457 | 住友鋼管           | 2,000   | 767   | 1,534,000   |
| 5463 | 丸一鋼管           | 7,000   | 2,960 | 20,720,000  |
| 5464 | モリ工業           | 4,000   | 342   | 1,368,000   |
| 5471 | 大同特殊鋼          | 34,000  | 784   | 26,656,000  |
| 5476 | 日本高周波鋼業        | 9,000   | 209   | 1,881,000   |
| 5479 | 日本金屬工業         | 16,000  | 331   | 5,296,000   |
| 5480 | 日本冶金工業         | 10,500  | 815   | 8,557,500   |
| 5481 | 山陽特殊製鋼         | 12,000  | 729   | 8,748,000   |
| 5482 | 愛知製鋼           | 13,000  | 546   | 7,088,000   |
| 5486 | 日立金属           | 17,000  | 1,485 | 25,245,000  |
| 5491 | 日本金属           | 6,000   | 282   | 1,692,000   |
| 5541 | 大平洋金属          | 14,000  | 1,062 | 14,868,000  |
| 5563 | 日本電工           | 10,000  | 690   | 6,900,000   |
| 5602 | 栗本鐵工所          | 10,000  | 230   | 2,300,000   |
| 5606 | 旭テック           | 5,000   | 108   | 540,000     |
| 5612 | 日本鉄管           | 3,000   | 173   | 519,000     |
| 5631 | 日本製鋼所          | 34,000  | 1,603 | 54,502,000  |
| 5632 | 三菱製鋼           | 14,000  | 427   | 5,978,000   |
| 5658 | 日亜製鋼           | 3,000   | 383   | 1,149,000   |
| 5659 | 日本精線           | 2,000   | 480   | 960,000     |
| 5701 | 日本製鋼           | 53,000  | 194   | 10,282,000  |
| 5702 | 大紀アルミニウム工業所    | 3,000   | 376   | 1,128,000   |
| 5706 | 三井金属           | 63,000  | 457   | 28,791,000  |
| 5707 | 東邦造船           | 10,000  | 606   | 6,060,000   |
| 5711 | 三菱マテリアル        | 122,000 | 484   | 59,048,000  |
| 5713 | 住友金属鉱山         | 57,000  | 1,957 | 111,549,000 |
| 5714 | DOWAホールディングス   | 28,000  | 718   | 20,104,000  |
| 5715 | 古河機械金属         | 39,000  | 225   | 8,775,000   |
| 5721 | エス・サイエンス       | 106,000 | 16    | 1,696,000   |
| 5726 | 大阪チタニウムテクノロジーズ | 1,900   | 8,320 | 15,808,000  |
| 5727 | 東邦チタニウム        | 3,500   | 3,320 | 11,620,000  |
| 5738 | 住友製鋼工業         | 33,000  | 161   | 5,313,000   |
| 5741 | 古河スカイ          | 9,000   | 302   | 2,718,000   |
| 5771 | 三菱伸銅           | 4,000   | 269   | 1,076,000   |
| 5801 | 古河電気工業         | 73,000  | 447   | 32,631,000  |
| 5802 | 住友電気工業         | 71,800  | 1,723 | 123,711,400 |
| 5803 | フシクラ           | 36,000  | 600   | 21,600,000  |
| 5804 | 三菱電線工業         | 13,000  | 151   | 1,963,000   |
| 5805 | 昭和電線ホールディングス   | 26,000  | 145   | 3,770,000   |
| 5809 | タツタ電線          | 5,000   | 267   | 1,335,000   |
| 5812 | 日立電線           | 17,000  | 676   | 11,492,000  |
| 5815 | 沖電線            | 2,000   | 190   | 380,000     |

|      |                |        |       |            |
|------|----------------|--------|-------|------------|
| 5821 | 平河ビューテック       | 600    | 1,490 | 894,000    |
| 5851 | リョービ           | 13,000 | 610   | 7,930,000  |
| 5855 | アサヒプリテック       | 3,300  | 2,865 | 9,454,500  |
| 5901 | 東洋製鐵           | 16,900 | 1,958 | 33,090,200 |
| 5902 | ホックンホールディングス   | 5,000  | 354   | 1,770,000  |
| 5909 | コロナ            | 1,000  | 1,456 | 1,456,000  |
| 5911 | 横河ブリッジホールディングス | 4,000  | 564   | 2,256,000  |
| 5913 | 松尾橋梁           | 4,000  | 115   | 460,000    |
| 5915 | 駒井鉄工           | 3,000  | 191   | 573,000    |
| 5929 | 三和ホールディングス     | 19,000 | 552   | 10,488,000 |
| 5930 | 文化シヤッター        | 6,000  | 455   | 2,730,000  |
| 5931 | 川田工業           | 5,000  | 205   | 1,025,000  |
| 5936 | 東洋シヤッター        | 500    | 1,190 | 595,000    |
| 5938 | 住生活グループ        | 28,500 | 1,782 | 50,787,000 |
| 5942 | 日本フイルコン        | 1,600  | 651   | 1,041,600  |
| 5943 | ノーリツ           | 4,000  | 1,486 | 5,944,000  |
| 5944 | 日立粉末冶金         | 2,000  | 508   | 1,016,000  |
| 5946 | 長府製作所          | 2,300  | 1,747 | 4,018,100  |
| 5947 | リンナイ           | 4,600  | 3,610 | 16,606,000 |
| 5949 | ユニプレス          | 3,200  | 1,083 | 3,465,600  |
| 5951 | ダイニチ工業         | 1,200  | 874   | 1,048,800  |
| 5957 | 日東精工           | 3,000  | 748   | 2,244,000  |
| 5958 | 三洋工業           | 3,000  | 210   | 630,000    |
| 5959 | 岡部             | 4,300  | 492   | 2,115,600  |
| 5963 | 日立ツール          | 1,300  | 1,340 | 1,742,000  |
| 5974 | 中国工業           | 3,000  | 124   | 372,000    |
| 5975 | 東プレ            | 4,200  | 1,089 | 4,573,800  |
| 5976 | ネツレン           | 3,500  | 1,377 | 4,819,500  |
| 5981 | 東京製鋼           | 16,000 | 209   | 3,344,000  |
| 5988 | バイオラックス        | 900    | 2,440 | 2,196,000  |
| 5991 | ニッパツ           | 16,000 | 1,045 | 16,720,000 |
| 5992 | 中央鉄條           | 3,000  | 405   | 1,215,000  |
| 5998 | アドパネクス         | 4,000  | 142   | 568,000    |
| 6005 | 三浦工業           | 3,200  | 2,605 | 8,336,000  |
| 6013 | タクマ            | 9,000  | 459   | 4,131,000  |
| 6041 | ボッシュ           | 20,000 | 533   | 10,660,000 |
| 6101 | ツガミ            | 6,000  | 350   | 2,100,000  |
| 6103 | オークマ           | 14,000 | 1,182 | 16,548,000 |
| 6104 | 東芝機械           | 11,000 | 907   | 9,977,000  |
| 6113 | アマダ            | 34,000 | 976   | 33,184,000 |
| 6118 | アイダエンジニアリング    | 6,000  | 612   | 3,672,000  |
| 6135 | 牧野フライス製作所      | 9,000  | 812   | 7,308,000  |
| 6136 | O S G          | 8,400  | 1,228 | 10,315,200 |
| 6138 | ダイジェット工業       | 3,000  | 221   | 663,000    |
| 6140 | 旭ダイヤモンド工業      | 6,000  | 816   | 4,896,000  |
| 6141 | 森精機製作所         | 8,600  | 2,235 | 19,221,000 |
| 6146 | テイスコ           | 2,000  | 6,580 | 13,160,000 |
| 6151 | 日東工業           | 1,100  | 2,195 | 2,414,500  |
| 6201 | 豊田自動織機         | 19,100 | 4,640 | 88,624,000 |
| 6203 | 豊和工業           | 12,000 | 94    | 1,128,000  |
| 6205 | O K K          | 7,000  | 240   | 1,680,000  |
| 6208 | 石川製作所          | 5,000  | 87    | 435,000    |
| 6210 | 東洋機械金属         | 1,100  | 500   | 550,000    |
| 6213 | オーエム製作所        | 2,000  | 945   | 1,890,000  |
| 6217 | 津田駒工業          | 5,000  | 341   | 1,705,000  |
| 6218 | エンシュウ          | 6,000  | 160   | 960,000    |
| 6222 | 鳥精機製作所         | 2,700  | 5,080 | 13,716,000 |
| 6242 | 日本スピンドル製造      | 3,000  | 291   | 873,000    |
| 6247 | 日阪製作所          | 2,000  | 2,005 | 4,010,000  |

|      |             |         |        |             |
|------|-------------|---------|--------|-------------|
| 6262 | ベガサスミシン製造   | 1,300   | 671    | 872,300     |
| 6268 | ナブテスコ       | 9,000   | 1,733  | 15,597,000  |
| 6269 | 三井海運船務      | 1,400   | 3,260  | 4,564,000   |
| 6272 | レオン自動車      | 2,000   | 330    | 660,000     |
| 6273 | S M C       | 6,500   | 12,480 | 81,120,000  |
| 6274 | 新川          | 1,800   | 1,749  | 3,148,200   |
| 6277 | ホンカワミクロン    | 4,000   | 884    | 3,536,000   |
| 6278 | ユニオンツール     | 1,200   | 3,580  | 4,296,000   |
| 6282 | オイレス工業      | 2,100   | 2,025  | 4,252,500   |
| 6287 | サトー         | 2,300   | 1,756  | 4,038,800   |
| 6291 | 日本エアーターテック  | 500     | 778    | 389,000     |
| 6293 | 日精樹脂工業      | 1,800   | 465    | 837,000     |
| 6301 | コマツ         | 97,300  | 3,060  | 297,738,000 |
| 6302 | 住友重機械工業     | 63,000  | 1,061  | 66,843,000  |
| 6305 | 日立建機        | 11,200  | 3,530  | 39,536,000  |
| 6306 | 日工          | 3,000   | 255    | 765,000     |
| 6309 | 巴工業         | 800     | 1,283  | 1,026,400   |
| 6310 | 井関農機        | 21,000  | 164    | 3,444,000   |
| 6313 | 共立          | 5,000   | 253    | 1,265,000   |
| 6315 | T O W A     | 2,000   | 1,045  | 2,090,000   |
| 6316 | 丸山製作所       | 5,000   | 277    | 1,385,000   |
| 6317 | 北川鉄工所       | 10,000  | 207    | 2,070,000   |
| 6319 | シンニッタ       | 2,300   | 720    | 1,656,000   |
| 6326 | クボタ         | 101,000 | 755    | 76,255,000  |
| 6328 | 荏原実業        | 500     | 1,519  | 759,500     |
| 6330 | 東洋エンジニアリング  | 14,000  | 594    | 8,316,000   |
| 6331 | 三菱化工機       | 7,000   | 352    | 2,464,000   |
| 6332 | 月島機械        | 3,000   | 1,064  | 3,192,000   |
| 6333 | 帝國電機製作所     | 800     | 2,000  | 1,600,000   |
| 6335 | 東京電機製作所     | 6,000   | 257    | 1,542,000   |
| 6339 | 新東工業        | 4,400   | 1,149  | 5,055,600   |
| 6340 | 造谷工業        | 1,200   | 859    | 1,030,800   |
| 6345 | アイチコーポレーション | 3,600   | 1,106  | 3,981,600   |
| 6349 | 小森コーポレーション  | 6,400   | 2,465  | 15,776,000  |
| 6351 | 鶴見製作所       | 2,000   | 895    | 1,790,000   |
| 6355 | 住友精密工業      | 4,000   | 361    | 1,444,000   |
| 6358 | 酒井重工業       | 4,000   | 202    | 808,000     |
| 6361 | 荏原          | 47,000  | 375    | 17,625,000  |
| 6362 | 石井建機        | 4,000   | 206    | 824,000     |
| 6363 | 西島製作所       | 2,000   | 1,495  | 2,990,000   |
| 6366 | 千代田化工建設     | 18,000  | 1,302  | 23,436,000  |
| 6367 | ダイキン工業      | 24,800  | 5,980  | 148,304,000 |
| 6368 | オルガノ        | 3,000   | 1,034  | 3,102,000   |
| 6369 | トーヨーカネツ     | 15,000  | 304    | 4,560,000   |
| 6370 | 栗田工業        | 12,900  | 3,120  | 40,248,000  |
| 6371 | 椿本チエイン      | 12,000  | 647    | 7,764,000   |
| 6373 | 大同工業        | 4,000   | 285    | 1,140,000   |
| 6374 | T C M       | 6,000   | 309    | 1,854,000   |
| 6375 | 日本コンベヤ      | 8,000   | 91     | 728,000     |
| 6376 | 日機装         | 6,000   | 876    | 5,256,000   |
| 6378 | 木村化工機       | 2,000   | 1,000  | 2,000,000   |
| 6379 | 新興フランテック    | 3,200   | 1,598  | 5,113,600   |
| 6381 | アネスト岩田      | 4,000   | 458    | 1,832,000   |
| 6383 | タイフク        | 9,000   | 1,534  | 13,806,000  |
| 6390 | 加藤製作所       | 5,000   | 437    | 2,185,000   |
| 6393 | 油研工業        | 4,000   | 368    | 1,472,000   |
| 6395 | タグノ         | 10,000  | 1,169  | 11,690,000  |
| 6406 | フジテック       | 7,000   | 622    | 4,354,000   |
| 6407 | C K D       | 5,900   | 796    | 4,696,400   |

|      |              |         |         |             |
|------|--------------|---------|---------|-------------|
| 6409 | キトー          | 5       | 281,000 | 1,405,000   |
| 6412 | 平和           | 5,600   | 947     | 5,303,200   |
| 6413 | 理想科学工業       | 1,800   | 1,981   | 3,565,800   |
| 6417 | S A N K Y O  | 5,700   | 5,040   | 28,728,000  |
| 6418 | 日本金銭機械       | 2,300   | 820     | 1,886,000   |
| 6419 | マースエンジニアリング  | 1,300   | 1,306   | 1,697,800   |
| 6420 | 福島工業         | 700     | 1,011   | 707,700     |
| 6421 | キヤノンファインテック  | 1,900   | 1,627   | 3,091,300   |
| 6423 | アピリット        | 3,200   | 232     | 742,400     |
| 6428 | オーイズミ        | 800     | 382     | 305,600     |
| 6430 | タイコク電機       | 800     | 1,224   | 979,200     |
| 6436 | アマノ          | 5,800   | 1,348   | 7,818,400   |
| 6440 | J U K I      | 11,000  | 658     | 7,238,000   |
| 6444 | サンデン         | 12,000  | 577     | 6,924,000   |
| 6445 | 蛇の目ミシン工業     | 20,000  | 107     | 2,140,000   |
| 6448 | ブラザー工業       | 27,000  | 1,537   | 41,499,000  |
| 6454 | マックス         | 3,000   | 1,262   | 3,786,000   |
| 6455 | モリタ          | 3,000   | 547     | 1,641,000   |
| 6457 | グローバル        | 6,300   | 2,530   | 15,939,000  |
| 6459 | 大和冷機工業       | 3,000   | 640     | 1,920,000   |
| 6460 | セガサミホールディングス | 23,900  | 1,393   | 33,292,700  |
| 6461 | 日本ビストンリング    | 8,000   | 185     | 1,480,000   |
| 6462 | リケン          | 9,000   | 585     | 5,265,000   |
| 6463 | T P R        | 2,500   | 1,104   | 2,760,000   |
| 6470 | 大豊工業         | 1,500   | 1,720   | 2,580,000   |
| 6471 | 日本精工         | 46,000  | 1,091   | 50,186,000  |
| 6472 | N T N        | 37,000  | 920     | 34,040,000  |
| 6473 | ジェイテクト       | 20,800  | 1,945   | 40,456,000  |
| 6474 | 不二越          | 21,000  | 448     | 9,408,000   |
| 6479 | ミネア          | 34,000  | 725     | 24,650,000  |
| 6480 | 日本トムソン       | 6,000   | 817     | 4,902,000   |
| 6481 | T H K        | 13,000  | 1,996   | 25,948,000  |
| 6482 | ユーション精機      | 900     | 1,974   | 1,776,600   |
| 6485 | 前澤給装工業       | 900     | 1,905   | 1,714,500   |
| 6486 | イーグル工業       | 3,000   | 1,326   | 3,978,000   |
| 6489 | 前澤工業         | 1,600   | 312     | 499,200     |
| 6490 | 日本ピラー工業      | 3,000   | 663     | 1,989,000   |
| 6498 | キッツ          | 11,000  | 568     | 6,248,000   |
| 6501 | 日立製作所        | 350,000 | 784     | 274,400,000 |
| 6502 | 東芝           | 315,000 | 840     | 264,600,000 |
| 6504 | 三菱電機         | 195,000 | 1,191   | 232,245,000 |
| 6504 | 富士電機ホールディングス | 53,000  | 384     | 20,352,000  |
| 6505 | 東洋電機製造       | 4,000   | 357     | 1,428,000   |
| 6506 | 安川電機         | 23,000  | 1,406   | 32,338,000  |
| 6507 | 神鋼電機         | 13,000  | 277     | 3,601,000   |
| 6508 | 明電舎          | 18,000  | 286     | 5,148,000   |
| 6513 | オリシン電気       | 3,000   | 608     | 1,824,000   |
| 6517 | デンヨー         | 2,300   | 1,038   | 2,387,400   |
| 6581 | 日立工機         | 5,600   | 1,783   | 9,984,800   |
| 6584 | 三協工業         | 2,700   | 816     | 2,203,200   |
| 6586 | マキタ          | 14,000  | 4,670   | 65,380,000  |
| 6588 | 東芝テック        | 13,000  | 771     | 10,023,000  |
| 6590 | 芝浦メカトロニクス    | 4,000   | 547     | 2,188,000   |
| 6592 | マフチモーター      | 3,700   | 6,950   | 25,715,000  |
| 6594 | 日本電産         | 11,300  | 7,840   | 88,592,000  |
| 6621 | 高岳製作所        | 8,000   | 142     | 1,136,000   |
| 6622 | ダイヘン         | 11,000  | 585     | 6,435,000   |
| 6641 | 日新電機         | 6,000   | 561     | 3,366,000   |
| 6644 | 大崎電気工業       | 3,000   | 559     | 1,677,000   |

|      |                     |         |         |             |
|------|---------------------|---------|---------|-------------|
| 6645 | オムロン                | 24,300  | 2,610   | 63,423,000  |
| 6651 | 日東工業                | 3,200   | 1,187   | 3,798,400   |
| 6652 | I D E C             | 2,500   | 1,308   | 3,270,000   |
| 6665 | エルピーダメモリ            | 10,100  | 3,780   | 38,178,000  |
| 6674 | ジーエス・ユアサ コーポレーション   | 36,000  | 258     | 9,288,000   |
| 6675 | サクサホールディングス         | 5,000   | 185     | 925,000     |
| 6676 | メルコホールディングス         | 1,200   | 1,804   | 2,164,800   |
| 6701 | N E C               | 224,000 | 504     | 112,896,000 |
| 6702 | 富士通                 | 215,000 | 772     | 165,980,000 |
| 6703 | 沖電気工業               | 71,000  | 188     | 13,348,000  |
| 6704 | 岩崎通信機               | 9,000   | 128     | 1,152,000   |
| 6706 | 電気興業                | 5,000   | 626     | 3,130,000   |
| 6707 | サンケン電気              | 12,000  | 595     | 7,140,000   |
| 6708 | エプソントヨコム            | 4,000   | 503     | 2,012,000   |
| 6715 | ナカヨ通信機              | 2,000   | 243     | 486,000     |
| 6718 | アイホン                | 1,600   | 1,763   | 2,820,800   |
| 6723 | N E C エレクトロニクス      | 4,000   | 2,680   | 10,720,000  |
| 6724 | セイコーエプソン            | 16,600  | 2,495   | 41,417,000  |
| 6727 | ワコム                 | 41      | 245,000 | 10,045,000  |
| 6728 | アルバック               | 3,300   | 4,560   | 15,048,000  |
| 6731 | ピクセラ                | 800     | 369     | 295,200     |
| 6735 | ティアーアンドエムホールディングス   | 4,000   | 431     | 1,724,000   |
| 6737 | ナナオ                 | 1,800   | 2,880   | 5,184,000   |
| 6741 | 日本信号                | 5,700   | 579     | 3,300,300   |
| 6742 | 京三製作所               | 5,000   | 415     | 2,075,000   |
| 6744 | 能美防災                | 3,000   | 682     | 2,046,000   |
| 6745 | ホーチキ                | 2,000   | 634     | 1,268,000   |
| 6749 | マスプロ電工              | 1,500   | 916     | 1,374,000   |
| 6751 | 日本無線                | 11,000  | 385     | 4,235,000   |
| 6752 | 松下電器産業              | 223,000 | 2,315   | 516,245,000 |
| 6753 | シャープ                | 101,000 | 1,947   | 196,647,000 |
| 6754 | アンリツ                | 9,000   | 475     | 4,275,000   |
| 6755 | 富士通ゼネラル             | 6,000   | 595     | 3,570,000   |
| 6756 | 日立国際電気              | 5,000   | 1,392   | 6,960,000   |
| 6758 | ソニー                 | 117,400 | 6,150   | 722,010,000 |
| 6759 | N E C トーキン          | 7,000   | 476     | 3,332,000   |
| 6762 | T D K               | 10,900  | 8,350   | 91,015,000  |
| 6763 | 帝國通信工業              | 5,000   | 410     | 2,050,000   |
| 6764 | 三洋電機                | 195,000 | 203     | 39,585,000  |
| 6765 | ケンウッド               | 43,000  | 142     | 6,106,000   |
| 6767 | ミツミ電機               | 7,900   | 3,820   | 30,178,000  |
| 6768 | タムラ製作所              | 6,000   | 552     | 3,312,000   |
| 6770 | アルプス電気              | 17,700  | 1,469   | 26,001,300  |
| 6771 | 池上通信機               | 6,000   | 183     | 1,089,000   |
| 6773 | パイオニア               | 17,500  | 1,071   | 18,742,500  |
| 6779 | 日本電波工業              | 1,600   | 5,280   | 8,448,000   |
| 6788 | 日本トリム               | 300     | 3,280   | 984,000     |
| 6789 | ローランド               | 700     | 5,750   | 4,025,000   |
| 6791 | ロムビアミュージックエンタテインメント | 14,000  | 76      | 1,064,000   |
| 6792 | 日本ビクター              | 12,000  | 229     | 2,748,000   |
| 6794 | フォスター電機             | 2,200   | 3,220   | 7,084,000   |
| 6796 | クラリオン               | 11,000  | 263     | 2,893,000   |
| 6798 | S M K               | 7,000   | 960     | 6,720,000   |
| 6800 | ヨコオ                 | 1,600   | 738     | 1,180,800   |
| 6801 | 東光                  | 9,000   | 212     | 1,908,000   |
| 6803 | ティアック               | 9,000   | 104     | 936,000     |
| 6804 | ホシデン                | 5,700   | 1,720   | 9,804,000   |
| 6806 | ヒロセ電機               | 3,900   | 12,940  | 50,466,000  |
| 6807 | 日本航空電子工業            | 5,000   | 1,732   | 8,660,000   |

|      |              |        |        |             |
|------|--------------|--------|--------|-------------|
| 6809 | T O A        | 3,000  | 870    | 2,610,000   |
| 6810 | 日立マクセル       | 3,900  | 1,369  | 5,339,100   |
| 6815 | ユニデン         | 6,000  | 659    | 3,954,000   |
| 6816 | エルパイン        | 4,500  | 1,913  | 8,608,500   |
| 6817 | スミダ コーポレーション | 1,200  | 1,584  | 1,900,800   |
| 6818 | 島田理化学工業      | 1,300  | 202    | 262,600     |
| 6820 | アイコム         | 1,100  | 2,840  | 3,124,000   |
| 6825 | パトライト        | 1,700  | 1,220  | 2,074,000   |
| 6839 | 船井電機         | 2,100  | 4,780  | 10,038,000  |
| 6841 | 横河電機         | 21,000 | 1,218  | 25,578,000  |
| 6844 | 新電元工業        | 7,000  | 337    | 2,359,000   |
| 6845 | 山武           | 6,200  | 2,875  | 17,825,000  |
| 6849 | 日本光電         | 4,200  | 2,570  | 10,794,000  |
| 6850 | チノソー         | 4,000  | 289    | 1,156,000   |
| 6853 | 共和電業         | 2,000  | 404    | 808,000     |
| 6855 | 日本電子材料       | 800    | 1,171  | 936,800     |
| 6856 | 堀場製作所        | 2,800  | 4,200  | 11,760,000  |
| 6857 | アドバンテクト      | 15,600 | 3,150  | 49,140,000  |
| 6858 | 小野測器         | 2,000  | 678    | 1,356,000   |
| 6859 | エスベック        | 2,200  | 803    | 1,766,600   |
| 6860 | S U N X      | 1,800  | 699    | 1,258,200   |
| 6861 | キーエンス        | 3,900  | 27,360 | 106,704,000 |
| 6866 | H I O K I    | 900    | 1,995  | 1,795,500   |
| 6869 | シズメックス       | 3,300  | 4,780  | 15,774,000  |
| 6875 | メガチップス       | 1,700  | 1,748  | 2,971,600   |
| 6877 | O B A R A    | 800    | 2,095  | 1,676,000   |
| 6883 | 日本電産コバル電子    | 2,600  | 637    | 1,656,200   |
| 6885 | ミヤチテクノス      | 900    | 1,675  | 1,507,500   |
| 6900 | 東京電波         | 600    | 1,406  | 843,600     |
| 6901 | 渡脈電機         | 1,000  | 343    | 343,000     |
| 6902 | デンソー         | 51,700 | 4,550  | 235,235,000 |
| 6905 | コーセル         | 2,900  | 1,450  | 4,205,000   |
| 6910 | 日立メデイク       | 2,000  | 931    | 1,862,000   |
| 6911 | 新日本無線        | 2,000  | 462    | 924,000     |
| 6914 | オプテックス       | 1,400  | 1,652  | 2,312,800   |
| 6915 | 千代田インテグレ     | 1,200  | 2,000  | 2,400,000   |
| 6921 | 東光電気         | 2,000  | 285    | 570,000     |
| 6923 | スタンレー電気      | 14,700 | 2,810  | 41,307,000  |
| 6924 | 岩崎電気         | 8,000  | 235    | 1,880,000   |
| 6925 | フジオ電機        | 12,700 | 2,350  | 29,845,000  |
| 6926 | 阿谷電機産業       | 1,100  | 740    | 814,000     |
| 6927 | フェニックス電機     | 1,900  | 508    | 965,200     |
| 6929 | 日本セラミック      | 1,400  | 1,404  | 1,965,600   |
| 6934 | 新神戸電機        | 2,000  | 438    | 876,000     |
| 6935 | 日本デジタル研究所    | 1,800  | 1,479  | 2,662,200   |
| 6937 | 古河電池         | 2,000  | 179    | 358,000     |
| 6938 | 双信電機         | 900    | 713    | 641,700     |
| 6941 | 山一電機         | 1,600  | 489    | 782,400     |
| 6947 | 図研           | 1,600  | 1,170  | 1,872,000   |
| 6951 | 日本電子         | 8,000  | 488    | 3,904,000   |
| 6952 | カシオ計算機       | 21,700 | 1,274  | 27,645,800  |
| 6954 | フアナック        | 20,200 | 10,560 | 213,312,000 |
| 6955 | F D K        | 9,000  | 130    | 1,170,000   |
| 6958 | 日本 C M K     | 4,500  | 858    | 3,861,000   |
| 6961 | エンプラス        | 1,600  | 1,269  | 2,030,400   |
| 6963 | ローム          | 11,600 | 10,000 | 116,000,000 |
| 6965 | 浜松ホトニクス      | 7,100  | 3,890  | 27,619,000  |
| 6966 | 三井ハイテック      | 2,500  | 1,149  | 2,872,500   |
| 6967 | 新光電気工業       | 6,100  | 2,250  | 13,725,000  |



|      |            |         |       |               |  |  |                  |
|------|------------|---------|-------|---------------|--|--|------------------|
| 6971 | 京セラ        | 17,400  | 9,770 | 169,998,000   |  |  |                  |
| 6973 | 協栄産業       | 3,000   | 360   | 1,080,000     |  |  |                  |
| 6974 | 日本インター     | 2,100   | 294   | 617,400       |  |  |                  |
| 6976 | 太陽誘電       | 11,000  | 1,737 | 19,107,000    |  |  |                  |
| 6981 | 村田製作所      | 22,000  | 6,650 | 146,300,000   |  |  |                  |
| 6985 | エーシン       | 2,300   | 544   | 1,251,200     |  |  |                  |
| 6986 | 双葉電子工業     | 3,700   | 2,200 | 8,140,000     |  |  |                  |
| 6988 | 日東電工       | 18,100  | 5,790 | 104,799,000   |  |  |                  |
| 6989 | 北陸電気工業     | 10,000  | 227   | 2,270,000     |  |  |                  |
| 6991 | 松下電工       | 39,000  | 1,210 | 47,190,000    |  |  |                  |
| 6995 | 東海理化       | 4,900   | 3,400 | 16,660,000    |  |  |                  |
| 6996 | ニチコン       | 7,600   | 1,159 | 8,808,400     |  |  |                  |
| 6997 | 日本ケミコン     | 11,000  | 675   | 7,425,000     |  |  |                  |
| 6999 | KOA        | 3,400   | 945   | 3,213,000     |  |  |                  |
| 7003 | 三井造船       | 70,000  | 420   | 29,400,000    |  |  |                  |
| 7004 | 日立造船       | 93,000  | 150   | 13,950,000    |  |  |                  |
| 7007 | 佐世保重工業     | 14,000  | 511   | 7,154,000     |  |  |                  |
| 7011 | 三菱重工       | 351,000 | 482   | 169,182,000   |  |  |                  |
| 7012 | 川崎重工       | 152,000 | 324   | 49,248,000    |  |  |                  |
| 7013 | IHI        | 143,000 | 222   | 31,746,000    |  |  |                  |
| 7102 | 日本車輜製造     | 13,000  | 192   | 2,496,000     |  |  |                  |
| 7105 | ニチユ        | 3,000   | 390   | 1,170,000     |  |  |                  |
| 7122 | 近畿車輛       | 4,000   | 330   | 1,320,000     |  |  |                  |
| 7201 | 日産自動車      | 235,000 | 1,182 | 277,770,000   |  |  |                  |
| 7202 | いすゞ自動車     | 110,000 | 521   | 57,310,000    |  |  | 代用有価証券<br>1,000株 |
| 7203 | トヨタ自動車     | 281,500 | 6,040 | 1,700,260,000 |  |  |                  |
| 7205 | 日野自動車      | 30,000  | 712   | 21,360,000    |  |  |                  |
| 7211 | 三菱自動車      | 464,000 | 190   | 88,160,000    |  |  |                  |
| 7212 | エフテック      | 700     | 2,440 | 1,708,000     |  |  |                  |
| 7220 | 武蔵精密工業     | 1,800   | 3,150 | 5,670,000     |  |  |                  |
| 7221 | トヨタ車体      | 3,800   | 1,803 | 6,851,400     |  |  |                  |
| 7222 | 日産車体       | 8,000   | 817   | 6,536,000     |  |  |                  |
| 7223 | 関東自動車工業    | 3,600   | 1,466 | 5,277,600     |  |  |                  |
| 7224 | 新明和工業      | 9,000   | 432   | 3,888,000     |  |  |                  |
| 7226 | 極東開発工業     | 3,900   | 822   | 3,205,800     |  |  |                  |
| 7230 | 日信工業       | 4,200   | 2,630 | 11,046,000    |  |  |                  |
| 7231 | トビー工業      | 19,000  | 295   | 5,605,000     |  |  |                  |
| 7236 | テイラド       | 6,000   | 732   | 4,392,000     |  |  |                  |
| 7238 | 曙ブレーキ工業    | 5,800   | 735   | 4,263,000     |  |  |                  |
| 7239 | タチエス       | 2,900   | 962   | 2,789,800     |  |  |                  |
| 7240 | NOK        | 11,200  | 2,280 | 25,536,000    |  |  |                  |
| 7241 | フタバ産業      | 4,600   | 3,130 | 14,398,000    |  |  |                  |
| 7242 | カヤハ工業      | 17,000  | 644   | 10,948,000    |  |  |                  |
| 7243 | シロキ工業      | 4,000   | 351   | 1,404,000     |  |  |                  |
| 7244 | 市光工業       | 6,000   | 275   | 1,650,000     |  |  |                  |
| 7245 | 大同メタル工業    | 4,000   | 575   | 2,300,000     |  |  |                  |
| 7246 | フレス工業      | 9,000   | 531   | 4,779,000     |  |  |                  |
| 7248 | カルソニックカンセイ | 14,000  | 541   | 7,574,000     |  |  |                  |
| 7250 | 大冢洋工業      | 4,000   | 554   | 2,216,000     |  |  |                  |
| 7251 | ケーヒン       | 4,300   | 2,090 | 8,987,000     |  |  |                  |
| 7256 | 河西工業       | 2,000   | 348   | 696,000       |  |  |                  |
| 7259 | アイシン精機     | 19,200  | 4,580 | 87,936,000    |  |  |                  |
| 7260 | 富士機工       | 3,000   | 235   | 705,000       |  |  |                  |
| 7261 | マツダ        | 83,000  | 554   | 45,982,000    |  |  |                  |
| 7262 | タイハツ工業     | 22,000  | 1,041 | 22,902,000    |  |  |                  |
| 7263 | 愛知機械工業     | 5,000   | 230   | 1,150,000     |  |  |                  |
| 7266 | 今仙電機製作所    | 1,000   | 1,819 | 1,819,000     |  |  |                  |
| 7267 | ホンダ        | 178,800 | 3,690 | 659,772,000   |  |  |                  |

|      |                     |        |         |             |  |  |  |
|------|---------------------|--------|---------|-------------|--|--|--|
| 7269 | スズキ                 | 42,300 | 3,420   | 144,666,000 |  |  |  |
| 7270 | 富士重工                | 71,000 | 523     | 37,133,000  |  |  |  |
| 7272 | ヤマハ発動機              | 20,500 | 2,775   | 56,887,500  |  |  |  |
| 7274 | ショーワ                | 4,900  | 996     | 4,880,400   |  |  |  |
| 7276 | 小糸製作所               | 9,000  | 1,522   | 13,698,000  |  |  |  |
| 7277 | TBK                 | 2,000  | 630     | 1,260,000   |  |  |  |
| 7278 | エウゼディ               | 2,500  | 3,770   | 9,425,000   |  |  |  |
| 7280 | ミツバ                 | 4,000  | 652     | 2,608,000   |  |  |  |
| 7282 | 豊田合成                | 5,900  | 4,070   | 24,013,000  |  |  |  |
| 7283 | 愛三工業                | 2,200  | 1,342   | 2,952,400   |  |  |  |
| 7294 | ヨロス                 | 1,300  | 1,605   | 2,086,500   |  |  |  |
| 7296 | エフ・シー・シー            | 3,100  | 2,025   | 6,277,500   |  |  |  |
| 7305 | 新家工業                | 5,000  | 264     | 1,320,000   |  |  |  |
| 7309 | シマノ                 | 8,200  | 4,080   | 33,456,000  |  |  |  |
| 7312 | タカタ                 | 3,700  | 3,200   | 11,840,000  |  |  |  |
| 7313 | ティ・エス テック           | 1,500  | 4,930   | 7,395,000   |  |  |  |
| 7414 | 小野建                 | 1,900  | 1,203   | 2,285,700   |  |  |  |
| 7416 | はるやま商事              | 900    | 728     | 655,200     |  |  |  |
| 7420 | 佐島電機                | 1,600  | 1,279   | 2,046,400   |  |  |  |
| 7421 | カッパ・クリエイト           | 1,200  | 2,295   | 2,754,000   |  |  |  |
| 7427 | エコーレーディング           | 500    | 1,015   | 507,500     |  |  |  |
| 7429 | セイジョー               | 800    | 2,305   | 1,844,000   |  |  |  |
| 7433 | 伯東                  | 1,200  | 1,472   | 1,766,400   |  |  |  |
| 7445 | ライトオン               | 1,500  | 1,265   | 1,897,500   |  |  |  |
| 7447 | ナガイレベント             | 1,200  | 1,980   | 2,376,000   |  |  |  |
| 7448 | ジーンズメイト             | 800    | 951     | 760,800     |  |  |  |
| 7451 | 養食                  | 2,000  | 2,235   | 4,470,000   |  |  |  |
| 7453 | 良品計画                | 2,200  | 6,630   | 14,586,000  |  |  |  |
| 7455 | 三城                  | 2,900  | 1,551   | 4,497,900   |  |  |  |
| 7456 | 松田産業                | 1,400  | 2,640   | 3,696,000   |  |  |  |
| 7459 | メディセオ・バルタックホールディングス | 22,100 | 1,712   | 37,835,200  |  |  |  |
| 7463 | アドヴァン               | 1,600  | 956     | 1,529,600   |  |  |  |
| 7466 | S P K               | 500    | 1,397   | 698,500     |  |  |  |
| 7476 | アズワン                | 1,300  | 3,334   | 3,334,500   |  |  |  |
| 7480 | スズデン                | 600    | 839     | 503,400     |  |  |  |
| 7482 | シモジマ                | 1,400  | 1,102   | 1,542,800   |  |  |  |
| 7483 | ドウシヤ                | 1,000  | 2,015   | 2,015,000   |  |  |  |
| 7494 | コナカ                 | 2,200  | 1,101   | 2,422,200   |  |  |  |
| 7504 | 高速                  | 1,200  | 630     | 756,000     |  |  |  |
| 7508 | G-7ホールディングス         | 600    | 536     | 321,600     |  |  |  |
| 7512 | イオン北海道              | 1,300  | 322     | 418,600     |  |  |  |
| 7513 | コジマ                 | 2,800  | 544     | 1,523,200   |  |  |  |
| 7516 | コーナン商事              | 2,000  | 1,851   | 3,702,000   |  |  |  |
| 7517 | 黒田電気                | 3,000  | 1,595   | 4,785,000   |  |  |  |
| 7518 | ネットワシシステムズ          | 54     | 126,000 | 6,804,000   |  |  |  |
| 7520 | エコス                 | 700    | 773     | 541,100     |  |  |  |
| 7522 | ワタシ                 | 2,700  | 1,760   | 4,752,000   |  |  |  |
| 7524 | マルシエ                | 600    | 899     | 539,400     |  |  |  |
| 7532 | ドン・キホーテ             | 4,700  | 2,295   | 10,786,500  |  |  |  |
| 7537 | 丸文                  | 1,800  | 887     | 1,596,600   |  |  |  |
| 7541 | メガネット               | 1,400  | 938     | 1,313,200   |  |  |  |
| 7545 | 西松屋チェーン             | 4,500  | 1,281   | 5,764,500   |  |  |  |
| 7550 | ゼンショー               | 6,900  | 1,123   | 7,748,700   |  |  |  |
| 7552 | ハピネット               | 700    | 1,605   | 1,123,500   |  |  |  |
| 7554 | 華楽苑                 | 1,300  | 1,142   | 1,484,600   |  |  |  |
| 7558 | トーマンエレクトロニクス        | 500    | 1,369   | 684,500     |  |  |  |
| 7560 | ユニマツトライフ            | 800    | 1,331   | 1,064,800   |  |  |  |
| 7561 | ハークスレイ              | 600    | 1,427   | 856,200     |  |  |  |
| 7581 | サイゼリヤ               | 2,000  | 1,690   | 3,380,000   |  |  |  |

|      |                      |         |           |             |
|------|----------------------|---------|-----------|-------------|
| 7591 | エクセル                 | 900     | 1,295     | 1,165,500   |
| 7594 | マルカキカイ               | 600     | 921       | 552,600     |
| 7595 | アルゴグラフィックス           | 900     | 1,420     | 1,278,000   |
| 7599 | ガリバーインターナショナル        | 480     | 7,490     | 3,670,100   |
| 7600 | 日本エム・ティ・エム           | 1,600   | 309       | 494,400     |
| 7601 | ボブラ                  | 700     | 741       | 518,700     |
| 7606 | ユナイテッドアローズ           | 3,100   | 1,135     | 3,518,500   |
| 7607 | 進和                   | 1,100   | 1,891     | 2,080,100   |
| 7608 | エスケイジャパン             | 900     | 378       | 189,000     |
| 7609 | ダイトエレクトロン            | 900     | 1,027     | 924,300     |
| 7611 | ハイデイ日高               | 800     | 1,126     | 900,800     |
| 7613 | シークス                 | 700     | 2,460     | 1,722,000   |
| 7615 | 京都きもの友禅              | 11      | 90,700    | 997,700     |
| 7616 | コロワイド                | 4,500   | 520       | 2,340,000   |
| 7619 | 田中商事                 | 700     | 749       | 524,300     |
| 7628 | オーハシテクニカ             | 1,500   | 953       | 1,429,500   |
| 7630 | 巻巻屋                  | 700     | 2,220     | 1,554,000   |
| 7631 | マクニカ                 | 900     | 2,280     | 2,052,000   |
| 7637 | 白鋼                   | 600     | 1,600     | 960,000     |
| 7640 | トップカルチャー             | 700     | 457       | 319,900     |
| 7649 | スギ薬局                 | 3,300   | 3,220     | 10,626,000  |
| 7701 | 鳥津製作所                | 25,000  | 1,029     | 25,725,000  |
| 7702 | JMS                  | 3,000   | 258       | 774,000     |
| 7704 | アロカ                  | 1,400   | 1,443     | 2,020,200   |
| 7714 | モリテックス               | 1,300   | 512       | 665,600     |
| 7715 | 長野計器                 | 1,000   | 1,211     | 1,211,000   |
| 7718 | スター精密                | 4,200   | 2,475     | 10,395,000  |
| 7720 | ソキア                  | 3,000   | 635       | 1,905,000   |
| 7721 | トキメック                | 8,000   | 314       | 2,512,000   |
| 7723 | 愛知時計電機               | 3,000   | 310       | 930,000     |
| 7724 | 金門製作所                | 4,000   | 128       | 512,000     |
| 7728 | 日本電産トーンク             | 600     | 798       | 478,800     |
| 7729 | 東京精密                 | 3,900   | 2,710     | 10,569,000  |
| 7731 | ニコン                  | 36,000  | 4,060     | 146,160,000 |
| 7732 | トプコン                 | 4,200   | 1,413     | 5,934,600   |
| 7733 | オリンパス                | 25,000  | 4,590     | 114,750,000 |
| 7734 | 理研計器                 | 1,900   | 815       | 1,548,500   |
| 7735 | 大日本スクリーン製造           | 22,000  | 610       | 13,420,000  |
| 7739 | キヤノン電子               | 1,900   | 2,550     | 4,845,000   |
| 7740 | タムロン                 | 1,500   | 2,935     | 4,402,500   |
| 7741 | HOYA                 | 45,200  | 3,570     | 161,364,000 |
| 7744 | ノーリツ鋼機               | 1,600   | 2,225     | 3,560,000   |
| 7745 | エー・アンド・ティ            | 1,600   | 1,153     | 1,844,800   |
| 7751 | キヤノン                 | 130,000 | 5,530     | 718,900,000 |
| 7752 | リコー                  | 68,000  | 2,110     | 143,480,000 |
| 7756 | 日本電産コバル              | 2,100   | 1,475     | 3,097,500   |
| 7757 | 日本電産サンキョー            | 8,000   | 937       | 7,496,000   |
| 7762 | シチズンホールディングス         | 32,100  | 1,102     | 35,374,200  |
| 7769 | リズミ時計工業              | 11,000  | 151       | 1,661,000   |
| 7825 | SRIエスボーツ             | 13      | 145,000   | 1,885,000   |
| 7832 | バンダイナムコホールディングス      | 23,300  | 1,843     | 42,941,900  |
| 7838 | 共立印刷                 | 1,800   | 339       | 610,200     |
| 7840 | フランスベッドホールディングス      | 14,000  | 161       | 2,254,000   |
| 7846 | パイロットコーポレーション        | 4       | 1,240,000 | 4,960,000   |
| 7860 | エイベックス・グループ・ホールディングス | 3,300   | 1,377     | 4,544,100   |
| 7862 | トッパン・フォームズ           | 4,500   | 1,088     | 4,896,000   |
| 7864 | フジシールインターナショナル       | 2,400   | 2,085     | 5,004,000   |
| 7867 | タカラトミー               | 6,300   | 841       | 5,298,300   |
| 7868 | 廣済堂                  | 1,600   | 827       | 1,323,200   |

|      |                    |         |        |             |
|------|--------------------|---------|--------|-------------|
| 7873 | アーク                | 5,300   | 333    | 1,764,900   |
| 7874 | スルガ                | 600     | 1,597  | 958,200     |
| 7882 | アロン化成              | 2,000   | 442    | 884,000     |
| 7885 | タカノ                | 800     | 939    | 751,200     |
| 7893 | プロネクサス             | 2,800   | 899    | 2,517,200   |
| 7897 | ホクシン               | 1,900   | 284    | 539,600     |
| 7898 | ウッドワン              | 4,000   | 630    | 2,520,000   |
| 7905 | 大建工業               | 9,000   | 284    | 2,556,000   |
| 7908 | KI MOTO            | 2,000   | 818    | 1,636,000   |
| 7909 | シーアイ化成             | 2,000   | 285    | 570,000     |
| 7911 | 凸版印刷               | 64,000  | 1,120  | 71,680,000  |
| 7912 | 大日本印刷              | 66,000  | 1,648  | 108,768,000 |
| 7913 | 図書印刷               | 5,000   | 254    | 1,270,000   |
| 7914 | 共同印刷               | 7,000   | 315    | 2,205,000   |
| 7915 | 日本写真印刷             | 3,800   | 4,130  | 15,694,000  |
| 7916 | 光村印刷               | 2,000   | 430    | 860,000     |
| 7917 | 藤森工業               | 1,500   | 990    | 1,485,000   |
| 7921 | 宝印刷                | 900     | 965    | 868,500     |
| 7925 | 前澤化成工業             | 1,400   | 1,272  | 1,780,800   |
| 7935 | コンビ                | 1,500   | 691    | 1,036,500   |
| 7936 | アシックス              | 20,000  | 1,595  | 31,900,000  |
| 7937 | ツツミ                | 800     | 2,075  | 1,660,000   |
| 7942 | J S P              | 1,400   | 1,233  | 1,726,200   |
| 7943 | ニチハ                | 2,400   | 869    | 2,085,600   |
| 7944 | ローランド              | 1,600   | 3,200  | 5,120,000   |
| 7947 | エフビコ               | 1,100   | 3,370  | 3,707,000   |
| 7949 | 小松ウオール工業           | 700     | 1,594  | 1,115,800   |
| 7951 | ヤマハ                | 18,800  | 2,570  | 48,316,000  |
| 7952 | 河合楽器製作所            | 8,000   | 176    | 1,408,000   |
| 7955 | クリナップ              | 2,500   | 744    | 1,860,000   |
| 7956 | ビジョン               | 1,300   | 1,934  | 2,514,200   |
| 7958 | 天馬                 | 2,000   | 1,843  | 3,686,000   |
| 7960 | パラマウントベッド          | 1,800   | 1,500  | 2,700,000   |
| 7961 | 兼松日産農林             | 3,000   | 107    | 321,000     |
| 7962 | キングジム              | 1,700   | 795    | 1,351,500   |
| 7966 | リンテック              | 4,000   | 1,781  | 7,124,000   |
| 7968 | 田崎真珠               | 4,000   | 429    | 1,716,000   |
| 7970 | 信越ポリマー             | 4,300   | 807    | 3,470,100   |
| 7971 | 東リ                 | 6,000   | 209    | 1,254,000   |
| 7972 | イトーキ               | 4,700   | 751    | 3,529,700   |
| 7974 | 任天堂                | 12,000  | 64,200 | 770,400,000 |
| 7976 | 三菱鉛筆               | 2,000   | 1,667  | 3,334,000   |
| 7981 | タカラスタンダード          | 11,000  | 558    | 6,138,000   |
| 7984 | コクヨ                | 10,900  | 1,025  | 11,172,500  |
| 7987 | ナカバヤシ              | 5,000   | 191    | 955,000     |
| 7988 | ニフコ                | 4,900   | 2,640  | 12,936,000  |
| 7990 | ダイワ精工              | 10,000  | 205    | 2,050,000   |
| 7993 | サンエーブ工業            | 3,000   | 162    | 486,000     |
| 7994 | 阿村製作所              | 8,000   | 978    | 7,824,000   |
| 7995 | 日本バルカール工業          | 9,000   | 353    | 3,177,000   |
| 7999 | MUTOHホールディングス      | 3,000   | 461    | 1,383,000   |
| 8001 | 伊藤忠商事              | 155,000 | 1,068  | 165,540,000 |
| 8002 | 丸紅                 | 169,000 | 786    | 132,834,000 |
| 8005 | ムトウ                | 2,400   | 481    | 1,154,400   |
| 8007 | 高島                 | 4,000   | 158    | 632,000     |
| 8008 | F & A アークアホールディングス | 1,800   | 775    | 1,395,000   |
| 8011 | 三陽商会               | 10,000  | 687    | 6,870,000   |
| 8012 | 長瀬産業               | 10,000  | 1,181  | 11,810,000  |
| 8013 | ナイガイ               | 7,000   | 87     | 609,000     |

|      |                 |         |       |             |  |  |  |
|------|-----------------|---------|-------|-------------|--|--|--|
| 8014 | 蝶理              | 12,000  | 112   | 1,344,000   |  |  |  |
| 8015 | 豊田通商            | 20,700  | 3,090 | 63,963,000  |  |  |  |
| 8016 | オンワードホールディングス   | 15,000  | 1,146 | 17,190,000  |  |  |  |
| 8018 | 三共生興            | 3,100   | 289   | 895,900     |  |  |  |
| 8019 | 市田              | 2,000   | 99    | 198,000     |  |  |  |
| 8020 | 兼松              | 44,000  | 169   | 7,436,000   |  |  |  |
| 8022 | ミスノ             | 10,000  | 728   | 7,280,000   |  |  |  |
| 8024 | シルバーオックス        | 2,000   | 162   | 324,000     |  |  |  |
| 8025 | ツカモトコーポレーション    | 3,000   | 161   | 483,000     |  |  |  |
| 8028 | ファミリア           | 6,300   | 3,310 | 20,853,000  |  |  |  |
| 8029 | リック             | 4,000   | 171   | 684,000     |  |  |  |
| 8031 | 三井物産            | 165,000 | 2,280 | 376,200,000 |  |  |  |
| 8032 | 日本紙ハルプロ商事       | 11,000  | 409   | 4,499,000   |  |  |  |
| 8035 | 東京エレクトロン        | 15,300  | 6,750 | 103,275,000 |  |  |  |
| 8036 | 日立ハイテクノロジーズ     | 7,200   | 2,465 | 17,748,000  |  |  |  |
| 8037 | カメイ             | 3,000   | 525   | 1,575,000   |  |  |  |
| 8038 | 東都水産            | 4,000   | 200   | 800,000     |  |  |  |
| 8042 | 日本マタイ           | 3,000   | 167   | 501,000     |  |  |  |
| 8043 | スターゼン           | 7,000   | 258   | 1,806,000   |  |  |  |
| 8050 | セイコーホールディングス    | 8,000   | 499   | 3,992,000   |  |  |  |
| 8051 | 山藤              | 7,300   | 494   | 3,606,200   |  |  |  |
| 8052 | 榎本興業            | 2,000   | 374   | 748,000     |  |  |  |
| 8053 | 住友商事            | 113,800 | 1,538 | 175,024,400 |  |  |  |
| 8056 | 日本ユニシス          | 5,000   | 1,494 | 7,470,000   |  |  |  |
| 8057 | 内田洋行            | 4,000   | 424   | 1,696,000   |  |  |  |
| 8058 | 三菱商事            | 154,000 | 3,020 | 465,080,000 |  |  |  |
| 8059 | 第一興業            | 5,000   | 488   | 2,440,000   |  |  |  |
| 8060 | キヤノンマーケティングジャパン | 8,800   | 2,165 | 19,052,000  |  |  |  |
| 8061 | 西華産業            | 9,000   | 259   | 2,331,000   |  |  |  |
| 8064 | 金商              | 1,500   | 438   | 657,000     |  |  |  |
| 8065 | 佐藤商事            | 1,900   | 811   | 1,540,900   |  |  |  |
| 8068 | 菱洋エレクトロ         | 2,300   | 1,520 | 3,496,000   |  |  |  |
| 8070 | 東京産業            | 2,000   | 369   | 738,000     |  |  |  |
| 8074 | コアサ商事           | 24,000  | 147   | 3,528,000   |  |  |  |
| 8075 | 神綱商事            | 6,000   | 359   | 2,154,000   |  |  |  |
| 8078 | 阪和興業            | 21,000  | 476   | 9,996,000   |  |  |  |
| 8081 | カナデン            | 2,000   | 679   | 1,358,000   |  |  |  |
| 8084 | 菱電商事            | 3,000   | 810   | 2,430,000   |  |  |  |
| 8086 | ニプロ             | 5,000   | 2,260 | 11,300,000  |  |  |  |
| 8087 | フルサト工業          | 1,300   | 1,166 | 1,515,800   |  |  |  |
| 8088 | 岩谷産業            | 23,000  | 328   | 7,544,000   |  |  |  |
| 8089 | すてきなイスグループ      | 9,000   | 361   | 3,249,000   |  |  |  |
| 8090 | 昭光通商            | 7,000   | 156   | 1,092,000   |  |  |  |
| 8091 | ニチモウ            | 3,000   | 172   | 516,000     |  |  |  |
| 8092 | 富士通ビジネスシステム     | 1,400   | 1,402 | 1,962,800   |  |  |  |
| 8093 | 極東貿易            | 3,000   | 382   | 1,146,000   |  |  |  |
| 8095 | イワキ             | 2,000   | 223   | 446,000     |  |  |  |
| 8096 | 兼松エレクトロニクス      | 1,100   | 845   | 929,500     |  |  |  |
| 8097 | 三菱石油            | 5,000   | 416   | 2,080,000   |  |  |  |
| 8098 | 稲畑産業            | 5,100   | 601   | 3,065,100   |  |  |  |
| 8101 | G S I クレオス      | 6,000   | 115   | 690,000     |  |  |  |
| 8103 | 明和産業            | 1,900   | 276   | 524,400     |  |  |  |
| 8111 | ゴールドウイン         | 5,000   | 185   | 925,000     |  |  |  |
| 8112 | 東京スタイル          | 9,000   | 1,146 | 10,314,000  |  |  |  |
| 8113 | ユニ・チャーム         | 4,500   | 7,400 | 33,300,000  |  |  |  |
| 8114 | チサン             | 7,000   | 582   | 4,074,000   |  |  |  |
| 8129 | 東邦薬品            | 5,000   | 2,195 | 10,975,000  |  |  |  |
| 8130 | サンゲツ            | 3,300   | 2,425 | 8,002,500   |  |  |  |
| 8131 | ミツウロコ           | 3,400   | 769   | 2,614,600   |  |  |  |

|      |                  |        |       |             |  |  |  |
|------|------------------|--------|-------|-------------|--|--|--|
| 8132 | シナノン             | 5,000  | 496   | 2,480,000   |  |  |  |
| 8133 | 伊藤忠エネクス          | 5,600  | 738   | 4,132,800   |  |  |  |
| 8134 | T O K A I        | 5,000  | 438   | 2,190,000   |  |  |  |
| 8136 | サンリオ             | 5,100  | 1,001 | 5,105,100   |  |  |  |
| 8137 | サンワテクノス          | 1,100  | 782   | 860,200     |  |  |  |
| 8140 | リョーサン            | 3,300  | 2,835 | 9,355,500   |  |  |  |
| 8141 | 新光商事             | 1,900  | 1,300 | 2,470,000   |  |  |  |
| 8142 | トーホー             | 4,000  | 363   | 1,452,000   |  |  |  |
| 8150 | 三信電気             | 2,700  | 1,523 | 4,112,100   |  |  |  |
| 8151 | 東陽テクニカ           | 2,300  | 1,362 | 3,132,600   |  |  |  |
| 8153 | モスフードサービス        | 2,900  | 1,494 | 4,332,600   |  |  |  |
| 8154 | 加賀電子             | 2,600  | 1,616 | 4,201,600   |  |  |  |
| 8155 | 三益半導体工業          | 1,600  | 2,080 | 3,328,000   |  |  |  |
| 8158 | ソーダニッカ           | 2,000  | 441   | 882,000     |  |  |  |
| 8159 | 立花エレテック          | 1,400  | 966   | 1,352,400   |  |  |  |
| 8160 | 木曽路              | 2,300  | 2,155 | 4,956,500   |  |  |  |
| 8165 | 千趣会              | 4,000  | 1,146 | 4,584,000   |  |  |  |
| 8166 | タカキユー            | 1,500  | 255   | 382,500     |  |  |  |
| 8168 | ケーヨー             | 4,600  | 642   | 2,953,200   |  |  |  |
| 8170 | アデランスホールディングス    | 2,700  | 1,818 | 4,908,600   |  |  |  |
| 8173 | 上新電機             | 5,000  | 949   | 4,745,000   |  |  |  |
| 8174 | 日本瓦斯             | 2,400  | 817   | 1,960,800   |  |  |  |
| 8175 | ベスト電器            | 7,000  | 794   | 5,558,000   |  |  |  |
| 8178 | マルエツ             | 4,000  | 720   | 2,880,000   |  |  |  |
| 8179 | ロイヤルホールディングス     | 3,300  | 1,219 | 4,022,700   |  |  |  |
| 8181 | 東天紅              | 2,000  | 225   | 450,000     |  |  |  |
| 8182 | いりなげや            | 2,000  | 903   | 1,806,000   |  |  |  |
| 8184 | 島忠               | 5,000  | 3,220 | 16,100,000  |  |  |  |
| 8185 | チヨダ              | 3,200  | 1,975 | 6,320,000   |  |  |  |
| 8193 | 鈴丹               | 500    | 305   | 152,500     |  |  |  |
| 8194 | ライフコーポレーション      | 1,300  | 1,533 | 1,992,900   |  |  |  |
| 8196 | カスミ              | 5,000  | 596   | 2,980,000   |  |  |  |
| 8197 | 東急ストア            | 4,000  | 507   | 2,028,000   |  |  |  |
| 8200 | リンガーハット          | 1,600  | 1,457 | 2,331,200   |  |  |  |
| 8201 | さが美              | 2,000  | 152   | 304,000     |  |  |  |
| 8203 | Mr M a x         | 2,300  | 481   | 1,106,300   |  |  |  |
| 8207 | テンアライド           | 1,400  | 363   | 508,200     |  |  |  |
| 8214 | A O K I ホールディングス | 2,200  | 1,976 | 4,347,200   |  |  |  |
| 8217 | オークワ             | 3,000  | 1,478 | 4,434,000   |  |  |  |
| 8218 | コメリ              | 2,800  | 2,980 | 8,344,000   |  |  |  |
| 8219 | 青山商事             | 5,700  | 2,910 | 16,587,000  |  |  |  |
| 8227 | しまむら             | 2,100  | 9,920 | 20,832,000  |  |  |  |
| 8229 | C F S コーポレーション   | 2,500  | 516   | 1,290,000   |  |  |  |
| 8233 | 高島屋              | 30,000 | 1,405 | 42,150,000  |  |  |  |
| 8236 | 丸善               | 10,000 | 137   | 1,370,000   |  |  |  |
| 8237 | 松屋               | 3,500  | 2,130 | 7,455,000   |  |  |  |
| 8238 | 伊勢丹              | 20,500 | 1,553 | 31,836,500  |  |  |  |
| 8242 | エイチ・ツー・オー リテイリング | 16,000 | 909   | 14,544,000  |  |  |  |
| 8245 | 丸米               | 4,000  | 307   | 1,228,000   |  |  |  |
| 8248 | ニッセンホールディングス     | 4,900  | 679   | 3,327,100   |  |  |  |
| 8251 | ハルコ              | 5,300  | 1,498 | 7,939,400   |  |  |  |
| 8252 | 丸井グループ           | 32,000 | 1,121 | 35,872,000  |  |  |  |
| 8253 | クレディセゾン          | 17,700 | 3,010 | 53,277,000  |  |  |  |
| 8255 | 原信ナリスホールディングス    | 1,200  | 1,039 | 1,246,800   |  |  |  |
| 8258 | オーエムシーカード        | 6,900  | 399   | 2,753,100   |  |  |  |
| 8260 | 井筒屋              | 12,000 | 108   | 1,296,000   |  |  |  |
| 8263 | ダイエー             | 9,550  | 614   | 5,863,700   |  |  |  |
| 8266 | イズミヤ             | 7,000  | 634   | 4,438,000   |  |  |  |
| 8267 | イオン              | 78,000 | 1,674 | 130,572,000 |  |  |  |

|      |                   |           |           |               |  |  |  |
|------|-------------------|-----------|-----------|---------------|--|--|--|
| 8268 | 西友                | 40,000    | 136       | 5,440,000     |  |  |  |
| 8270 | ユニエー              | 16,000    | 1,024     | 16,384,000    |  |  |  |
| 8273 | イズミ               | 6,400     | 1,717     | 10,988,800    |  |  |  |
| 8274 | 東武ストア             | 3,000     | 406       | 1,218,000     |  |  |  |
| 8276 | 平和堂               | 3,800     | 1,934     | 7,349,200     |  |  |  |
| 8278 | アジ                | 2,300     | 1,746     | 4,015,800     |  |  |  |
| 8279 | ヤオコー              | 1,000     | 2,980     | 2,980,000     |  |  |  |
| 8281 | ゼビオ               | 2,200     | 3,340     | 7,348,000     |  |  |  |
| 8282 | ケーズホールディングス       | 3,900     | 3,010     | 11,739,000    |  |  |  |
| 8289 | オリエンティック          | 1,500     | 710       | 1,065,000     |  |  |  |
| 8291 | 東日カーライヴグループ       | 3,000     | 387,000   | 387,000       |  |  |  |
| 8303 | 新生銀行              | 141,000   | 405       | 57,105,000    |  |  |  |
| 8304 | あおぞら銀行            | 86,000    | 341       | 29,326,000    |  |  |  |
| 8306 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 1,199,800 | 1,028     | 1,233,394,400 |  |  |  |
| 8308 | りそなホールディングス       | 630       | 195,000   | 122,850,000   |  |  |  |
| 8309 | 中央三井トラスト・ホールディングス | 109,000   | 879       | 95,811,000    |  |  |  |
| 8316 | 三井住友フィナンシャルグループ   | 854       | 825,000   | 704,550,000   |  |  |  |
| 8324 | 第四銀行              | 29,000    | 459       | 13,311,000    |  |  |  |
| 8325 | 北越銀行              | 22,000    | 264       | 5,808,000     |  |  |  |
| 8327 | 西日本シティ銀行          | 72,000    | 282       | 20,304,000    |  |  |  |
| 8328 | 札幌北洋ホールディングス      | 31        | 1,030,000 | 31,930,000    |  |  |  |
| 8331 | 千葉銀行              | 81,000    | 934       | 75,654,000    |  |  |  |
| 8332 | 横浜銀行              | 145,000   | 798       | 115,710,000   |  |  |  |
| 8333 | 常陽銀行              | 80,000    | 654       | 52,320,000    |  |  |  |
| 8334 | 群馬銀行              | 49,000    | 764       | 37,436,000    |  |  |  |
| 8336 | 武蔵野銀行             | 3,100     | 5,430     | 16,833,000    |  |  |  |
| 8337 | 千葉興業銀行            | 4,300     | 1,427     | 6,136,100     |  |  |  |
| 8338 | 関東つくば銀行           | 5,500     | 683       | 3,756,500     |  |  |  |
| 8339 | 東京都民銀行            | 3,900     | 3,360     | 13,104,000    |  |  |  |
| 8341 | 七十七銀行             | 35,000    | 708       | 24,780,000    |  |  |  |
| 8342 | 青森銀行              | 13,000    | 430       | 5,590,000     |  |  |  |
| 8343 | 秋田銀行              | 14,000    | 533       | 7,462,000     |  |  |  |
| 8344 | 山形銀行              | 13,000    | 613       | 7,969,000     |  |  |  |
| 8345 | 岩手銀行              | 1,400     | 6,850     | 9,590,000     |  |  |  |
| 8346 | 東邦銀行              | 16,000    | 461       | 7,376,000     |  |  |  |
| 8347 | 荘内銀行              | 10,000    | 270       | 2,700,000     |  |  |  |
| 8349 | 東北銀行              | 11,000    | 193       | 2,123,000     |  |  |  |
| 8350 | みちのく銀行            | 11,000    | 352       | 3,872,000     |  |  |  |
| 8354 | ふくおかフィナンシャルグループ   | 84,000    | 661       | 55,524,000    |  |  |  |
| 8355 | 静岡銀行              | 65,000    | 1,215     | 78,975,000    |  |  |  |
| 8356 | 十六銀行              | 27,000    | 635       | 17,145,000    |  |  |  |
| 8358 | スルガ銀行             | 24,000    | 1,206     | 28,944,000    |  |  |  |
| 8359 | 八十二銀行             | 39,000    | 792       | 30,888,000    |  |  |  |
| 8360 | 山梨中央銀行            | 14,000    | 663       | 9,282,000     |  |  |  |
| 8361 | 大垣共立銀行            | 24,000    | 643       | 15,432,000    |  |  |  |
| 8362 | 福井銀行              | 18,000    | 344       | 6,192,000     |  |  |  |
| 8363 | 北國銀行              | 24,000    | 529       | 12,696,000    |  |  |  |
| 8364 | 清水銀行              | 700       | 4,910     | 3,437,000     |  |  |  |
| 8366 | 滋賀銀行              | 19,000    | 781       | 14,839,000    |  |  |  |
| 8367 | 南都銀行              | 21,000    | 583       | 12,243,000    |  |  |  |
| 8368 | 百五銀行              | 20,000    | 640       | 12,800,000    |  |  |  |
| 8369 | 京都銀行              | 35,000    | 1,317     | 46,095,000    |  |  |  |
| 8374 | 三重銀行              | 9,000     | 575       | 5,175,000     |  |  |  |
| 8375 | 池田銀行              | 1,900     | 4,040     | 7,676,000     |  |  |  |
| 8377 | ほくほくフィナンシャルグループ   | 145,000   | 383       | 55,535,000    |  |  |  |
| 8379 | 広島銀行              | 61,000    | 621       | 37,881,000    |  |  |  |
| 8381 | 山陰合同銀行            | 12,000    | 933       | 11,196,000    |  |  |  |
| 8382 | 中国銀行              | 17,000    | 1,615     | 27,455,000    |  |  |  |
| 8383 | 鳥取銀行              | 7,000     | 301       | 2,107,000     |  |  |  |

|      |                    |  |         |         |  |             |  |
|------|--------------------|--|---------|---------|--|-------------|--|
| 8384 | 東京スター銀行            |  | 27      | 345,000 |  | 9,315,000   |  |
| 8385 | 伊予銀行               |  | 23,000  | 1,137   |  | 26,151,000  |  |
| 8386 | 百十四銀行              |  | 24,000  | 573     |  | 13,752,000  |  |
| 8387 | 四国銀行               |  | 15,000  | 431     |  | 6,465,000   |  |
| 8388 | 阿波銀行               |  | 18,000  | 640     |  | 11,520,000  |  |
| 8390 | 鹿児島銀行              |  | 13,000  | 774     |  | 10,062,000  |  |
| 8392 | 大分銀行               |  | 11,000  | 701     |  | 7,711,000   |  |
| 8393 | 宮崎銀行               |  | 11,000  | 475     |  | 5,225,000   |  |
| 8394 | 肥後銀行               |  | 17,000  | 749     |  | 12,733,000  |  |
| 8395 | 佐賀銀行               |  | 13,000  | 379     |  | 4,927,000   |  |
| 8396 | 十八銀行               |  | 14,000  | 414     |  | 5,796,000   |  |
| 8397 | 沖縄銀行               |  | 1,600   | 4,110   |  | 6,576,000   |  |
| 8399 | 琉球銀行               |  | 4,100   | 1,441   |  | 5,908,100   |  |
| 8403 | 住友信託銀行             |  | 185,000 | 765     |  | 141,525,000 |  |
| 8404 | みずほ信託銀行            |  | 196,000 | 204     |  | 39,984,000  |  |
| 8409 | 八千代銀行              |  | 11      | 451,000 |  | 4,961,000   |  |
| 8411 | みずほフィナンシャルグループ     |  | 1,259   | 533,000 |  | 671,047,000 |  |
| 8415 | 紀陽ホールディングス         |  | 77,000  | 175     |  | 13,475,000  |  |
| 8418 | 山口フィナンシャルグループ      |  | 21,000  | 1,362   |  | 28,602,000  |  |
| 8423 | フィデック              |  | 6       | 123,000 |  | 738,000     |  |
| 8424 | 芙蓉総合リース            |  | 2,200   | 3,060   |  | 6,732,000   |  |
| 8425 | 興銀リース              |  | 3,100   | 1,844   |  | 5,716,400   |  |
| 8439 | センチュリー・リーディング・システム |  | 3,400   | 987     |  | 3,355,800   |  |
| 8473 | SBIホールディングス        |  | 1,210   | 30,450  |  | 36,844,500  |  |
| 8511 | 日本証券金融             |  | 9,100   | 1,072   |  | 9,755,200   |  |
| 8512 | 大証金                |  | 2,500   | 310     |  | 775,000     |  |
| 8515 | アイフル               |  | 9,200   | 2,075   |  | 19,090,000  |  |
| 8519 | ポケットカード            |  | 2,000   | 386     |  | 772,000     |  |
| 8521 | 長野銀行               |  | 8,000   | 281     |  | 2,248,000   |  |
| 8522 | 名古屋銀行              |  | 19,000  | 682     |  | 12,958,000  |  |
| 8527 | 愛知銀行               |  | 800     | 9,420   |  | 7,536,000   |  |
| 8529 | 第三銀行               |  | 13,000  | 380     |  | 4,940,000   |  |
| 8530 | 中京銀行               |  | 9,000   | 341     |  | 3,069,000   |  |
| 8536 | 東日本銀行              |  | 11,000  | 405     |  | 4,455,000   |  |
| 8541 | 愛媛銀行               |  | 13,000  | 410     |  | 5,330,000   |  |
| 8542 | トマト銀行              |  | 8,000   | 249     |  | 1,992,000   |  |
| 8543 | みなと銀行              |  | 21,000  | 242     |  | 5,082,000   |  |
| 8544 | 京葉銀行               |  | 19,000  | 661     |  | 12,559,000  |  |
| 8545 | 関西アーバン銀行           |  | 22,000  | 362     |  | 7,964,000   |  |
| 8550 | 栃木銀行               |  | 11,000  | 670     |  | 7,370,000   |  |
| 8551 | 北日本銀行              |  | 600     | 4,100   |  | 2,460,000   |  |
| 8556 | 香川銀行               |  | 7,000   | 630     |  | 4,410,000   |  |
| 8558 | 東和銀行               |  | 18,000  | 131     |  | 2,358,000   |  |
| 8561 | 徳島銀行               |  | 6,000   | 656     |  | 3,936,000   |  |
| 8562 | 福島銀行               |  | 26,000  | 107     |  | 2,782,000   |  |
| 8563 | 大東銀行               |  | 14,000  | 111     |  | 1,554,000   |  |
| 8564 | 武富士                |  | 14,360  | 2,785   |  | 39,992,600  |  |
| 8566 | リコーリース             |  | 1,400   | 2,415   |  | 3,381,000   |  |
| 8568 | シンキ                |  | 2,200   | 160     |  | 352,000     |  |
| 8570 | イオンクレジットサービス       |  | 9,200   | 1,765   |  | 16,238,000  |  |
| 8571 | NI Sグループ           |  | 11,400  | 273     |  | 3,112,200   |  |
| 8572 | アコム                |  | 9,330   | 2,375   |  | 22,158,750  |  |
| 8574 | プロミス               |  | 9,650   | 2,840   |  | 27,406,000  |  |
| 8579 | 東京リース              |  | 2,900   | 999     |  | 2,897,100   |  |
| 8583 | 三菱UFJニコス           |  | 46,000  | 260     |  | 11,960,000  |  |
| 8584 | ジャックス              |  | 12,000  | 264     |  | 3,168,000   |  |
| 8586 | 日立キャピタル            |  | 4,900   | 1,470   |  | 7,203,000   |  |
| 8588 | セントラルファイナンス        |  | 8,000   | 221     |  | 1,768,000   |  |
| 8591 | オリックス              |  | 10,150  | 20,090  |  | 203,913,500 |  |

|      |                     |         |         |             |
|------|---------------------|---------|---------|-------------|
| 8593 | 三菱UFJリース            | 5,220   | 3,840   | 20,044,800  |
| 8595 | シャフコ                | 3,500   | 3,770   | 13,195,000  |
| 8597 | SFCG                | 480     | 15,130  | 7,262,400   |
| 8601 | 大和証券グループ本社          | 146,000 | 1,029   | 150,234,000 |
| 8603 | 日興コーディアルグループ        | 51,000  | 1,656   | 84,456,000  |
| 8604 | 野村ホールディングス          | 217,200 | 1,868   | 405,729,600 |
| 8606 | 新光証券                | 53,000  | 461     | 24,433,000  |
| 8607 | みずほインバスタース証券        | 48,000  | 168     | 8,064,000   |
| 8609 | 同三ホールディングス          | 18,000  | 648     | 11,664,000  |
| 8611 | コスモ証券               | 22,000  | 131     | 2,882,000   |
| 8613 | 丸三証券                | 6,300   | 1,034   | 6,514,200   |
| 8614 | 東洋証券                | 9,000   | 478     | 4,302,000   |
| 8616 | 東海東京証券              | 24,000  | 511     | 12,264,000  |
| 8617 | 光世証券                | 5,000   | 148     | 740,000     |
| 8622 | 水戸証券                | 7,000   | 436     | 3,052,000   |
| 8624 | いちよし証券              | 4,700   | 1,058   | 4,972,600   |
| 8628 | 松井証券                | 14,000  | 843     | 11,802,000  |
| 8692 | たいこう証券ビジネス          | 800     | 741     | 592,800     |
| 8698 | マネックス・ビーンズ・ホールディングス | 107     | 77,400  | 8,281,800   |
| 8703 | カブドットコム証券           | 57      | 161,000 | 9,177,000   |
| 8706 | 樟華証券                | 2,800   | 1,013   | 2,836,400   |
| 8707 | 岩井証券                | 2,100   | 1,465   | 3,076,500   |
| 8729 | ソニーファイナンス・ホールディングス  | 85      | 416,000 | 35,360,000  |
| 8742 | 小林洋行                | 700     | 678     | 474,600     |
| 8752 | 三井住友海上火災保険          | 157,000 | 1,129   | 177,253,000 |
| 8754 | 日本興亜損害保険            | 81,000  | 1,013   | 82,063,000  |
| 8755 | 損保ジャパン              | 103,000 | 1,015   | 104,545,000 |
| 8759 | ニッセイ同和損害保険          | 23,000  | 531     | 12,213,000  |
| 8761 | あいおい損害保険            | 49,000  | 542     | 26,558,000  |
| 8763 | 富士火災海上保険            | 22,000  | 310     | 6,820,000   |
| 8766 | ミレアホールディングス         | 91,100  | 3,630   | 330,693,000 |
| 8793 | NECリース              | 800     | 1,596   | 1,276,800   |
| 8795 | T&Dホールディングス         | 27,200  | 5,640   | 153,408,000 |
| 8801 | 三井不動産               | 86,000  | 2,445   | 210,270,000 |
| 8802 | 三菱地所                | 144,000 | 2,530   | 364,320,000 |
| 8803 | 平和不動産               | 14,500  | 694     | 10,063,000  |
| 8804 | 東京建物                | 29,000  | 1,113   | 32,277,000  |
| 8806 | タイビル                | 5,300   | 1,276   | 6,762,800   |
| 8809 | サンケイビル              | 3,500   | 947     | 3,314,500   |
| 8815 | 東急不動産               | 38,000  | 940     | 35,720,000  |
| 8818 | 京阪神不動産              | 3,000   | 505     | 1,515,000   |
| 8830 | 住友不動産               | 49,000  | 2,830   | 138,670,000 |
| 8833 | 東宝不動産               | 2,200   | 717     | 1,577,400   |
| 8834 | 藤和不動産               | 6,500   | 232     | 1,508,000   |
| 8835 | 太平洋興業               | 7,000   | 86      | 602,000     |
| 8840 | 大京                  | 20,000  | 305     | 6,100,000   |
| 8841 | テオーシー               | 8,000   | 911     | 7,288,000   |
| 8842 | 東京栄天地               | 3,000   | 403     | 1,209,000   |
| 8848 | レオパレス21             | 14,500  | 2,945   | 42,702,500  |
| 8860 | フジ住宅                | 2,200   | 390     | 858,000     |
| 8864 | 空港施設                | 2,100   | 691     | 1,451,100   |
| 8868 | アーバンコーポレーション        | 16,200  | 1,461   | 23,668,200  |
| 8869 | 明和地所                | 1,000   | 1,092   | 1,092,000   |
| 8870 | 住友不動産販売             | 740     | 5,400   | 3,996,000   |
| 8871 | ゴードルクレスト            | 1,630   | 3,430   | 5,590,900   |
| 8874 | ジョイント・コーポレーション      | 3,100   | 2,200   | 6,820,000   |
| 8875 | 東栄住宅                | 1,200   | 895     | 1,074,000   |
| 8877 | 日本エスリード             | 800     | 1,428   | 1,142,400   |
| 8878 | 日本総合地所              | 3,600   | 1,530   | 5,508,000   |

|      |                |         |           |             |
|------|----------------|---------|-----------|-------------|
| 8879 | 東急リハビリ         | 1,900   | 1,338     | 2,542,200   |
| 8880 | 飯田産業           | 1,000   | 773       | 773,000     |
| 8881 | 日神不動産          | 1,200   | 775       | 930,000     |
| 8882 | ゼファール          | 19      | 86,900    | 1,651,100   |
| 8888 | クリード           | 14      | 234,000   | 3,276,000   |
| 8895 | アーネストワン        | 3,800   | 454       | 1,725,200   |
| 8897 | タカラレーベン        | 1,000   | 770       | 770,000     |
| 8902 | バシフィックマネジメント   | 54      | 112,000   | 6,048,000   |
| 8904 | サンヨーハウジング名古屋   | 8       | 129,000   | 1,032,000   |
| 8905 | イオンモール         | 9,400   | 2,945     | 27,683,000  |
| 8907 | フージャースコーポレーション | 19      | 35,600    | 676,400     |
| 8910 | サンシティ          | 35      | 39,000    | 1,365,000   |
| 8911 | 創建ホームズ         | 11      | 54,300    | 597,300     |
| 8913 | ゼクス            | 12      | 80,000    | 960,000     |
| 8915 | タクトホーム         | 10      | 49,550    | 495,500     |
| 8921 | シーズクリエイト       | 18      | 19,990    | 359,820     |
| 8924 | リサ・パートナーズ      | 25      | 244,000   | 6,100,000   |
| 8933 | NTT都市開発        | 150     | 190,000   | 28,500,000  |
| 8934 | サンフロントティア不動産   | 13      | 180,000   | 2,340,000   |
| 8939 | 大和システム         | 800     | 2,110     | 1,688,000   |
| 8944 | ランドビジネス        | 9       | 74,300    | 668,700     |
| 8993 | アトリウム          | 2,000   | 2,145     | 4,290,000   |
| 9001 | 東武鉄道           | 89,000  | 541       | 48,149,000  |
| 9003 | 相模鉄道           | 27,000  | 395       | 10,665,000  |
| 9005 | 東京急行電鉄         | 111,000 | 718       | 79,698,000  |
| 9006 | 京浜急行電鉄         | 49,000  | 709       | 34,741,000  |
| 9007 | 小田急電鉄          | 72,000  | 743       | 53,496,000  |
| 9008 | 京王電鉄           | 54,000  | 685       | 36,990,000  |
| 9009 | 京成電鉄           | 29,000  | 607       | 17,603,000  |
| 9010 | 富士急行           | 6,000   | 392       | 2,352,000   |
| 9020 | 東日本旅客鉄道        | 390     | 937,000   | 365,430,000 |
| 9021 | 西日本旅客鉄道        | 195     | 576,000   | 112,320,000 |
| 9022 | 東海旅客鉄道         | 189     | 1,190,000 | 224,910,000 |
| 9030 | アートコーポレーション    | 400     | 2,675     | 1,070,000   |
| 9031 | 西日本鉄道          | 27,000  | 383       | 10,341,000  |
| 9037 | ハマキョウレックス      | 700     | 2,625     | 1,837,500   |
| 9039 | サカイ引越センター      | 400     | 3,520     | 1,408,000   |
| 9041 | 近畿日本鉄道         | 178,000 | 358       | 63,724,000  |
| 9042 | 阪急阪神ホールディングス   | 132,000 | 487       | 64,284,000  |
| 9045 | 名鉄運輸           | 47,000  | 445       | 20,915,000  |
| 9047 | 名鉄運輸           | 900     | 864       | 777,600     |
| 9048 | 名古屋鉄道          | 73,000  | 327       | 23,871,000  |
| 9062 | 日本通運           | 90,000  | 582       | 52,380,000  |
| 9064 | ヤマトホールディングス    | 42,000  | 1,536     | 64,512,000  |
| 9065 | 山九             | 27,000  | 660       | 17,820,000  |
| 9066 | 日新             | 8,000   | 347       | 2,776,000   |
| 9067 | 丸運             | 1,500   | 301       | 451,500     |
| 9068 | 丸全昭和運輸         | 6,000   | 365       | 2,190,000   |
| 9069 | センコー           | 8,000   | 312       | 2,496,000   |
| 9070 | トナミ運輸          | 5,000   | 290       | 1,450,000   |
| 9072 | 日本梱包運輸倉庫       | 5,000   | 1,463     | 7,315,000   |
| 9074 | 日本石油輸送         | 3,000   | 237       | 711,000     |
| 9075 | 福山通運           | 15,000  | 464       | 6,960,000   |
| 9076 | セイノーホールディングス   | 16,000  | 794       | 12,704,000  |
| 9081 | 神奈川中央交通        | 3,000   | 543       | 1,629,000   |
| 9086 | 日立物流           | 4,300   | 1,268     | 5,452,400   |
| 9101 | 日本郵船           | 112,000 | 900       | 100,800,000 |
| 9104 | 商船三井           | 110,000 | 1,436     | 157,960,000 |
| 9107 | 川崎汽船           | 46,000  | 1,114     | 51,244,000  |

|      |                     |         |         |             |
|------|---------------------|---------|---------|-------------|
| 9110 | 新和海运                | 8,000   | 683     | 5,464,000   |
| 9113 | 乾汽船                 | 2,100   | 1,811   | 3,803,100   |
| 9115 | 明治海运                | 1,900   | 576     | 1,094,400   |
| 9119 | 飯野海运                | 9,400   | 1,071   | 10,067,400  |
| 9123 | 大平洋海运               | 4,000   | 267     | 1,068,000   |
| 9130 | 共栄タンカー              | 2,000   | 340     | 680,000     |
| 9132 | 第一中央汽船              | 14,000  | 610     | 8,540,000   |
| 9202 | 全日本空輸               | 203,000 | 422     | 85,666,000  |
| 9205 | 日本航空                | 302,000 | 262     | 79,124,000  |
| 9232 | バスコ                 | 3,000   | 179     | 537,000     |
| 9234 | 国際航空ホールディングス        | 2,000   | 382     | 764,000     |
| 9301 | 三養倉庫                | 15,000  | 1,228   | 18,420,000  |
| 9302 | 三井倉庫                | 9,000   | 617     | 5,553,000   |
| 9303 | 住友倉庫                | 17,000  | 616     | 10,472,000  |
| 9304 | 滋澤倉庫                | 7,000   | 636     | 4,452,000   |
| 9305 | ヤマタネ                | 11,000  | 120     | 1,320,000   |
| 9306 | 東陽倉庫                | 3,000   | 284     | 852,000     |
| 9310 | 日本トランスシテイ           | 5,000   | 496     | 2,480,000   |
| 9312 | ケイビン                | 4,000   | 187     | 748,000     |
| 9324 | 安田倉庫                | 1,500   | 990     | 1,485,000   |
| 9351 | 東洋埠頭                | 7,000   | 196     | 1,372,000   |
| 9358 | 宇徳                  | 1,500   | 440     | 660,000     |
| 9364 | 上総                  | 23,000  | 825     | 18,975,000  |
| 9366 | サンリツ                | 500     | 917     | 458,500     |
| 9368 | キムラユニティ             | 500     | 998     | 499,000     |
| 9369 | キユーソー流通システム         | 600     | 1,047   | 628,200     |
| 9370 | 郵船航空サービス            | 1,700   | 2,500   | 4,250,000   |
| 9375 | 近鉄エクスプレス            | 1,900   | 3,950   | 7,505,000   |
| 9380 | 東海運                 | 900     | 345     | 310,500     |
| 9382 | パンテック・グループ・ホールディングス | 9       | 181,000 | 1,629,000   |
| 9401 | TBS                 | 11,100  | 2,490   | 27,639,000  |
| 9404 | 日本テレビ放送網            | 1,810   | 14,930  | 27,023,300  |
| 9409 | テレビ朝日               | 52      | 177,000 | 9,204,000   |
| 9411 | テレビ東京               | 800     | 4,210   | 3,368,000   |
| 9412 | スカパー-JSAT           | 168     | 46,450  | 7,803,600   |
| 9427 | イー・アクセス             | 114     | 68,600  | 7,820,400   |
| 9430 | NECモバイルリング          | 800     | 1,715   | 1,372,000   |
| 9432 | 日本電信電話              | 949     | 536,000 | 508,664,000 |
| 9433 | KDDI                | 320     | 779,000 | 249,280,000 |
| 9435 | 光通信                 | 3,000   | 3,770   | 11,310,000  |
| 9437 | NTTドコモ              | 2,087   | 177,000 | 369,399,000 |
| 9448 | インボイス               | 1,138   | 3,430   | 3,903,340   |
| 9449 | GMOインターネット          | 4,100   | 334     | 1,369,400   |
| 9470 | 学習研究社               | 8,000   | 235     | 1,880,000   |
| 9474 | ゼンリン                | 3,000   | 3,210   | 9,630,000   |
| 9475 | 昭文社                 | 1,100   | 948     | 1,042,800   |
| 9477 | 角川グループホールディングス      | 1,900   | 3,250   | 6,175,000   |
| 9479 | インプレスホールディングス       | 17      | 17,310  | 294,270     |
| 9501 | 東京電力                | 131,900 | 3,040   | 400,976,000 |
| 9502 | 中部電力                | 70,900  | 2,965   | 210,218,500 |
| 9503 | 関西電力                | 87,600  | 2,780   | 243,528,000 |
| 9504 | 中国電力                | 28,900  | 2,300   | 66,470,000  |
| 9505 | 北陸電力                | 21,500  | 2,480   | 53,320,000  |
| 9506 | 東北電力                | 52,300  | 2,640   | 138,072,000 |
| 9507 | 四国電力                | 24,200  | 3,100   | 75,020,000  |
| 9508 | 九州電力                | 46,200  | 2,885   | 133,287,000 |
| 9509 | 北海道電力               | 19,600  | 2,520   | 49,392,000  |
| 9511 | 沖縄電力                | 1,400   | 5,680   | 7,952,000   |

|      |                  |         |         |             |
|------|------------------|---------|---------|-------------|
| 9513 | J-POWER          | 15,100  | 4,160   | 62,816,000  |
| 9531 | 東京ガス             | 287,000 | 540     | 144,180,000 |
| 9532 | 大阪ガス             | 233,000 | 460     | 107,180,000 |
| 9533 | 東邦ガス             | 55,000  | 589     | 32,395,000  |
| 9534 | 北海道ガス            | 4,000   | 290     | 1,160,000   |
| 9536 | 西部ガス             | 24,000  | 262     | 6,288,000   |
| 9543 | 静岡ガス             | 6,000   | 524     | 3,144,000   |
| 9600 | アイネット            | 1,000   | 795     | 795,000     |
| 9601 | 松竹               | 12,000  | 821     | 9,852,000   |
| 9602 | 東宝               | 14,700  | 2,455   | 36,088,500  |
| 9603 | エイチ・アイ・エス        | 1,800   | 2,010   | 3,618,000   |
| 9605 | 東映               | 10,000  | 686     | 6,860,000   |
| 9607 | 森プロモーション         | 1,000   | 661     | 661,000     |
| 9609 | ベンチャー・リンク        | 10,800  | 179     | 1,933,200   |
| 9613 | NTTデータ           | 146     | 514,000 | 75,044,000  |
| 9616 | 日立メンテナンス         | 1,000   | 2,105   | 2,105,000   |
| 9619 | イチネン             | 2,000   | 488     | 976,000     |
| 9621 | 建設技術研究所          | 1,200   | 781     | 937,200     |
| 9628 | 燦ホールディングス        | 500     | 1,956   | 978,000     |
| 9632 | スバル興業            | 2,000   | 369     | 738,000     |
| 9633 | 東京アトル            | 8,000   | 214     | 1,712,000   |
| 9650 | テクモ              | 1,600   | 1,385   | 2,216,000   |
| 9654 | コーエー             | 1,800   | 2,160   | 3,888,000   |
| 9665 | 吉本興業             | 3,100   | 1,503   | 4,659,300   |
| 9667 | ホリプロ             | 900     | 1,302   | 1,171,800   |
| 9669 | オークネット           | 700     | 2,030   | 1,421,000   |
| 9671 | よみうりランド          | 5,000   | 389     | 1,945,000   |
| 9672 | 東京都競馬            | 15,000  | 252     | 3,780,000   |
| 9675 | 常盤興産             | 7,000   | 178     | 1,246,000   |
| 9678 | カナモト             | 3,000   | 743     | 2,229,000   |
| 9681 | 東京ドーム            | 15,000  | 587     | 8,805,000   |
| 9682 | DTS              | 2,100   | 1,852   | 3,889,200   |
| 9684 | スクウェア・エニックス      | 6,600   | 3,440   | 22,704,000  |
| 9682 | シーエーシー           | 1,400   | 1,032   | 1,444,800   |
| 9694 | 日立ソフトウェアエンジニアリング | 3,300   | 2,245   | 7,408,500   |
| 9697 | カブコン             | 5,200   | 2,905   | 15,106,000  |
| 9706 | 日本空港ビルデング        | 6,400   | 1,965   | 12,576,000  |
| 9715 | トランスコスモス         | 2,900   | 1,324   | 3,839,600   |
| 9716 | 乃村工藝社            | 4,000   | 643     | 2,572,000   |
| 9717 | シャステック           | 1,100   | 897     | 986,700     |
| 9719 | 住商情報システム         | 2,100   | 1,833   | 3,849,300   |
| 9722 | 藤田観光             | 5,000   | 882     | 4,410,000   |
| 9726 | 近畿日本ツーリスト        | 6,000   | 206     | 1,236,000   |
| 9728 | 日本管財             | 900     | 3,190   | 2,871,000   |
| 9731 | 白洋舎              | 2,000   | 331     | 662,000     |
| 9735 | セコム              | 22,700  | 5,860   | 133,022,000 |
| 9737 | CSKホールディングス      | 6,100   | 3,640   | 22,204,000  |
| 9739 | NSW              | 800     | 606     | 484,800     |
| 9740 | CSP              | 1,000   | 977     | 977,000     |
| 9741 | 日立情報システムズ        | 1,700   | 2,510   | 4,267,000   |
| 9742 | アイネス             | 2,600   | 594     | 1,544,400   |
| 9743 | 丹青社              | 2,000   | 383     | 766,000     |
| 9744 | メイテック            | 3,500   | 3,470   | 12,145,000  |
| 9746 | TKC              | 2,100   | 1,980   | 4,158,000   |
| 9747 | アサツー ディ・ケイ       | 4,400   | 3,080   | 13,552,000  |
| 9749 | 富士ソフト            | 2,700   | 1,816   | 4,903,200   |
| 9750 | ソラン              | 2,100   | 607     | 1,274,700   |
| 9751 | TIS              | 4,400   | 2,160   | 9,504,000   |
| 9755 | 応用地産             | 2,500   | 1,262   | 3,155,000   |
| 9757 | 船井総合研究所          | 2,300   | 739     | 1,699,700   |
| 9759 | 日本システムデベロップメント   | 4,000   | 1,512   | 6,048,000   |

6. 「海外株式インデックス MSCI-KOKUSA1 (ヘッジなし) マザーファンド」の状況  
 なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

海外株式インデックス MSCI-KOKUSA1 (ヘッジなし) マザーファンド

(1) 貸借対照表

| 科目       | 対象年月日 | 平成19年6月15日現在 |                | 平成19年12月17日現在 |                |
|----------|-------|--------------|----------------|---------------|----------------|
|          |       | 注記<br>番号     | 金額             | 金額            | 金額             |
| 資産の部     |       |              |                |               |                |
| 流動資産     |       |              |                |               |                |
| 預金       |       |              | 215,769,891    |               | 516,236,737    |
| コール・ローン  |       |              | 904,479,808    |               | 1,625,571,087  |
| 株式       |       |              | 62,532,416,587 |               | 79,602,905,573 |
| 投資証券     |       |              | 1,122,588,733  |               | 1,223,132,040  |
| 派生商品評価勘定 |       |              | 24,537,869     |               | 25,152,919     |
| 未収入金     |       |              | 4,692,339      |               | 46,150,935     |
| 未収配当金    |       |              | 88,366,281     |               | 93,184,528     |
| その他未収収益  |       |              | 223,751        |               | -              |
| 差入委託証拠金  |       |              | 257,370,906    |               | 370,522,402    |
| 流動資産合計   |       |              | 65,150,446,165 |               | 83,502,856,221 |
| 資産合計     |       |              | 65,150,446,165 |               | 83,502,856,221 |
| 負債の部     |       |              |                |               |                |
| 流動負債     |       |              |                |               |                |
| 派生商品評価勘定 |       |              | 222,766        |               | 10,476,102     |
| 未払金      |       |              | 186,313,581    |               | 2,057,339,309  |
| 未払解約金    |       |              | 9,774,914      |               | 799,233        |
| 流動負債合計   |       |              | 196,311,261    |               | 2,068,614,644  |
| 負債合計     |       |              | 196,311,261    |               | 2,068,614,644  |
| 純資産の部    |       |              |                |               |                |
| 元本等      |       |              | 42,320,019,413 |               | 57,545,815,474 |
| 剰余金      |       |              |                |               |                |
| 剰余金      |       |              | 22,634,115,491 |               | 23,888,426,103 |
| 剰余金合計    |       |              | 22,634,115,491 |               | 23,888,426,103 |
| 元本等合計    |       |              | 64,954,134,904 |               | 81,434,241,577 |
| 純資産合計    |       |              | 64,954,134,904 |               | 81,434,241,577 |
| 負債・純資産合計 |       |              | 65,150,446,165 |               | 83,502,856,221 |

(単位：円)

|      |               |            |         |                |
|------|---------------|------------|---------|----------------|
| 9760 | 進学会           | 1,100      | 724     | 796,400        |
| 9763 | 丸紅建材リース       | 2,000      | 194     | 388,000        |
| 9766 | コナミ           | 10,300     | 3,670   | 37,801,000     |
| 9783 | ベネッセコーポレーション  | 7,600      | 4,500   | 34,200,000     |
| 9787 | イオンデパート       | 1,400      | 2,265   | 3,171,000      |
| 9788 | ナック           | 600        | 882     | 529,200        |
| 9790 | 福井コンピュータ      | 500        | 744     | 372,000        |
| 9792 | ニチイ学館         | 2,400      | 1,504   | 3,609,600      |
| 9793 | ダイセイ          | 3,200      | 3,330   | 10,656,000     |
| 9828 | 元気寿司          | 600        | 1,288   | 772,800        |
| 9830 | トラスコ中山        | 2,100      | 1,678   | 3,523,800      |
| 9831 | ヤマダ電機         | 10,020     | 13,130  | 131,562,600    |
| 9832 | オートバックスセブン    | 3,300      | 2,300   | 7,590,000      |
| 9842 | アークランドサカモト    | 1,300      | 1,462   | 1,900,600      |
| 9843 | ニトリ           | 4,450      | 5,210   | 23,184,500     |
| 9844 | ユーエスシー        | 700        | 1,474   | 1,031,800      |
| 9854 | 養眼            | 1,700      | 711     | 1,208,700      |
| 9861 | 吉野家ホールディングス   | 56         | 189,000 | 10,584,000     |
| 9865 | 日商エレクトロニクス    | 1,100      | 711     | 782,100        |
| 9869 | 加藤産業          | 3,200      | 1,291   | 4,131,200      |
| 9882 | イエローハット       | 2,100      | 730     | 1,533,000      |
| 9883 | 富士エレクトロニクス    | 1,200      | 1,033   | 1,239,600      |
| 9887 | 松屋フーズ         | 1,000      | 1,379   | 1,379,000      |
| 9889 | JBCホールディングス   | 2,000      | 937     | 1,874,000      |
| 9896 | JKホールディングス    | 1,800      | 600     | 1,080,000      |
| 9897 | ユニタックス        | 1,500      | 532     | 798,000        |
| 9900 | サガミチェーン       | 2,000      | 1,157   | 2,314,000      |
| 9902 | 日伝            | 900        | 2,790   | 2,511,000      |
| 9912 | ダイワボウ情報システム   | 1,500      | 1,491   | 2,236,500      |
| 9916 | バイタルネット       | 2,700      | 690     | 1,863,000      |
| 9930 | 北沢産業          | 2,000      | 338     | 676,000        |
| 9932 | 杉本商事          | 1,100      | 1,393   | 1,532,300      |
| 9934 | 因幡電機産業        | 2,100      | 4,060   | 8,526,000      |
| 9937 | セシール          | 1,900      | 293     | 556,700        |
| 9938 | 住金物産          | 8,000      | 403     | 3,224,000      |
| 9945 | ブレナス          | 2,300      | 1,643   | 3,778,900      |
| 9946 | ミニストップ        | 1,500      | 1,974   | 2,961,000      |
| 9947 | イマージュホールディングス | 700        | 441     | 308,700        |
| 9948 | アークス          | 2,700      | 1,417   | 3,825,900      |
| 9956 | パロー           | 4,100      | 1,416   | 5,805,600      |
| 9962 | ミスミグループ本社     | 6,400      | 1,860   | 11,904,000     |
| 9963 | 江守商事          | 400        | 1,012   | 404,800        |
| 9972 | アルテック         | 900        | 326     | 293,400        |
| 9979 | 大庄            | 1,200      | 1,535   | 1,842,000      |
| 9982 | タキヒヨー         | 4,000      | 411     | 1,644,000      |
| 9983 | ファーストリテイリング   | 4,800      | 7,670   | 36,816,000     |
| 9984 | ソフトバンク        | 84,200     | 2,285   | 192,397,000    |
| 9987 | スズケン          | 8,500      | 4,040   | 34,340,000     |
| 9989 | サンドラッグ        | 3,500      | 3,010   | 10,535,000     |
| 9991 | ジェコス          | 1,400      | 559     | 782,600        |
| 9993 | ヤマザワ          | 600        | 1,570   | 942,000        |
| 9994 | やまや           | 400        | 659     | 263,600        |
| 9997 | ヘルナー          | 2,200      | 790     | 1,738,000      |
|      | 合計            | 28,633,607 |         | 39,837,926,500 |

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 有価証券先物取引等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)に記載しております。



(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目                         | 対象期間  | 自 平成18年12月16日<br>至 平成19年6月15日   | 自 平成19年6月16日<br>至 平成19年12月17日   |
|----------------------------|---|---|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。<br>(1) 証券取引所に上場されている有価証券<br>証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所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）又は証券取引所の発表する基準値で評価しております。<br>(2) 証券取引所に上場されていない有価証券<br>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、金融機関の提示する価値（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提示する価値のいずれから入手した価値で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>適正な評価額を入手できなかった場合は、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、投資信託委託業者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値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値で評価しております。 | 株式、投資証券及び新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。<br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>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）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>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、金融機関の提示する価値（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提示する価値のいずれから入手した価値で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>適正な評価額を入手できなかった場合は、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、投資信託委託業者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値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値で評価しております。 |   |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法      | (1) デリバティブ取引<br>個別法に基づき原則として時価で評価しております。<br>(2) 為替予約取引<br>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。<br>受取配当金の計上基準<br>受取配当金は原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。  | (1) デリバティブ取引<br>同左<br>(2) 為替予約取引<br>同左<br>受取配当金の計上基準<br>同左<br>外貨建取引等の処理基準<br>同左   | (1) デリバティブ取引<br>同左<br>(2) 為替予約取引<br>同左<br>受取配当金の計上基準<br>同左<br>外貨建取引等の処理基準<br>同左 |
| 3. 収益及び費用の計上基準             | 受取配当金の計上基準  | 受取配当金の計上基準  | 受取配当金の計上基準  |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総務府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。  |   |   |

(貸借対照表に関する注記)

|   | 平成18年12月16日現在    | 平成19年6月15日現在     | 平成19年12月17日現在    |
|---|------------------|------------------|------------------|
| 1. 期首                                       | 19,270,338,898 円 | 19,270,338,898 円 | 42,320,019,413 円 |
| 期首元本額                                       | 23,860,376,333 円 | 23,860,376,333 円 | 16,636,510,400 円 |
| 期首からの追加設定元本額                                | 810,686,518 円    | 810,686,518 円    | 1,410,514,339 円  |
| 期首からの解除元本額                                  |                  |                  |                  |
| 平成19年6月15日現在の元本の内訳                          |                  |                  |                  |
| インデックスファンド海外株                               | 5,515,370,093 円  | 5,515,370,093 円  | 6,186,560,308 円  |
| 式ヘッジなし(D,C専用)                               | 17,244,316 円     | 17,244,316 円     | 21,095,361 円     |
| D Cインデックスバランス(株式20)                         | 66,895,263 円     | 66,895,263 円     | 80,115,236 円     |
| D Cインデックスバランス(株式40)                         | 138,886,752 円    | 138,886,752 円    | 162,233,615 円    |
| D Cインデックスバランス(株式60)                         | 166,973,642 円    | 166,973,642 円    | 195,674,877 円    |
| D Cインデックスバランス(株式80)                         | 13,990,363,329 円 | 13,990,363,329 円 | 18,985,419,470 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                | 14,222,138,391 円 | 14,222,138,391 円 | 19,849,801,975 円 |
| 日興五大陸株式ファンド                                 | 19,471,835 円     | 19,471,835 円     | 19,395,814 円     |
| 全世界不動産ファンド(債券/株式/不動産・資源・食料等)毎月分配型           | 21,896,543 円     | 21,896,543 円     | 59,556,396 円     |
| アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)                     | 16,101,423 円     | 16,101,423 円     | 21,577,876 円     |
| アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)                     | 27,261,407 円     | 27,261,407 円     | 15,969,200 円     |
| アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)                     | 40,496,314 円     | 40,496,314 円     | 28,655,616 円     |
| アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)                     | 4,332,630,843 円  | 4,332,630,843 円  | 41,316,891 円     |
| 国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)                      | 612,415,703 円    | 612,415,703 円    | 7,758,577,433 円  |
| 3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)                      | 18,531,503 円     | 18,531,503 円     | 522,455,483 円    |
| 年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)                 | 53,347,535 円     | 53,347,535 円     | 23,067,195 円     |
| 年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)                 | 79,383,114 円     | 79,383,114 円     | 61,512,213 円     |
| 年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)                 | 89,195,267 円     | 89,195,267 円     | 86,901,872 円     |
| 年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)                 | 2,901,416,140 円  | 2,901,416,140 円  | 95,165,632 円     |
| 海外株   | 42,320,019,413 円 | 42,320,019,413 円 | 3,330,912,011 円  |
| (合計)  |                  |                  |                  |
| 2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該投資信託の受益権の総数 | 42,320,019,413 口 | 42,320,019,413 口 | 57,546,815,474 口 |
| 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該投資信託の受益権の総数    |                  |                  |                  |
| (合計)  |                  |                  | 57,546,815,474 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

当該親投資信託の受益権の総数

(有価証券に関する注記)

対象期間(自 平成 18 年 12 月 16 日 至 平成 19 年 6 月 15 日)

売買目的有価証券

| 種 類  | 貸借対照表計上額       | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|------|----------------|-------------------|
| 株式   | 62,532,416,587 | 4,311,260,545     |
| 投資証券 | 1,122,588,733  | 26,206,868        |
| 合計   | 63,655,005,320 | 4,285,053,677     |

対象期間(自 平成 19 年 6 月 16 日 至 平成 19 年 12 月 17 日)

売買目的有価証券

| 種 類  | 貸借対照表計上額       | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|------|----------------|-------------------|
| 株式   | 79,602,905,573 | 2,061,821,945     |
| 投資証券 | 1,223,132,040  | 128,068,812       |
| 合計   | 80,826,037,613 | 2,189,890,757     |

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

| 区 分     | 種 類            | 平成19年6月15日現在  |         | 時 価           | 評価損益       |
|---------|----------------|---------------|---------|---------------|------------|
|         |                | 契 約 額         | 等 うち1年超 |               |            |
| 市 場 取 引 | 株価指数先物取引<br>買建 | 1,419,749,261 | -       | 1,436,773,181 | 17,023,920 |
|         | 合計             | 1,419,749,261 | -       | 1,436,773,181 | 17,023,920 |

| 区 分     | 種 類            | 平成19年12月17日現在 |         | 時 価         | 評価損益       |
|---------|----------------|---------------|---------|-------------|------------|
|         |                | 契 約 額         | 等 うち1年超 |             |            |
| 市 場 取 引 | 株価指数先物取引<br>買建 | 530,113,322   | -       | 519,839,043 | 10,274,279 |
|         | 合計             | 530,113,322   | -       | 519,839,043 | 10,274,279 |

取引の状況に関する事項

| 取引の内容               | 自 平成18年12月16日<br>至 平成19年6月15日   | 自 平成19年6月16日<br>至 平成19年12月17日                                    |
|---------------------|---|--|
| 取引の利用目的及び取引に対する取組方針 | 当投資信託が利用することができるデリバティブ取引等は、内外の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨先物取引、通貨オプション取引、金利先物取引、金利先渡取引、為替先渡取引、および為替予約取引であります。 | 市場動向を勘案し、デリバティブ取引を行う方針であります。また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。 |
| 取引に係るリスクの内容         | デリバティブ取引には、有価証券、為替、金利等の市場価格が変動することによって発生するリスクがあります。   | 同左   |
| 取引に係るリスク管理体制        | デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門が執行し、リスク管理業務担当部門が日常的にこれを監視しております。   | 同左   |

(注) 時価の算定方法

1. 計算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います。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定します。
2. 先物取引の残高表示は契約額ベースです。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。



|          |  |         |           |              |  |  |  |
|----------|--|---------|-----------|--------------|--|--|--|
| 03836W10 | AQUA AMERICA INC                         | 5,165   | 21,51000  | 111,089.15   |  |  |  |
| 03938010 | ARCH COAL INC                            | 4,300   | 40,01000  | 172,043.00   |  |  |  |
| 03948310 | ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO                | 16,118  | 39,07000  | 629,730.26   |  |  |  |
| 04273510 | ARROW ELECTRONICS INC                    | 3,550   | 38,07000  | 135,148.50   |  |  |  |
| 04548710 | ASSOCIATED BANC-CORP                     | 4,659   | 26,70000  | 124,395.30   |  |  |  |
| 04621X10 | ASSURANT INC                             | 1,330   | 65,86000  | 87,593.80    |  |  |  |
| 05276910 | AUTODESK INC                             | 6,220   | 49,56000  | 308,263.20   |  |  |  |
| 05301510 | AUTOMATIC DATA PROCESSING INC            | 14,201  | 44,94000  | 638,192.94   |  |  |  |
| 05329W10 | AUTOMATION INC                           | 5,130   | 15,20000  | 77,976.00    |  |  |  |
| 05333Z10 | AUTOZONE INC                             | 1,342   | 120,07000 | 161,133.94   |  |  |  |
| 05361110 | AVERY DENNISON CORP                      | 2,860   | 50,73000  | 145,087.80   |  |  |  |
| 05380710 | AVNET INC                                | 3,995   | 35,00000  | 139,825.00   |  |  |  |
| 05430310 | AVON PRODUCTS INC                        | 11,598  | 39,31000  | 455,917.38   |  |  |  |
| 05493710 | BB&T CORPORATION                         | 14,498  | 32,67000  | 473,649.66   |  |  |  |
| 05548210 | BJ SERVICES CO                           | 8,293   | 23,45000  | 194,470.85   |  |  |  |
| 05592110 | BMC SOFTWARE INC                         | 5,919   | 35,78000  | 211,781.82   |  |  |  |
| 05722410 | BAKER HUGHES INC                         | 8,996   | 82,75000  | 744,419.00   |  |  |  |
| 05849810 | BALL CORP                                | 3,439   | 45,87000  | 157,746.93   |  |  |  |
| 06405710 | BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE         | 31,742  | 48,11000  | 1,527,107.62 |  |  |  |
| 06605F10 | BANK OF AMERICA CORP                     | 123,369 | 42,16000  | 5,201,237.04 |  |  |  |
| 06738310 | C. R. BARD INC                           | 2,874   | 83,50000  | 239,979.00   |  |  |  |
| 06830610 | BARR PHARMACEUTICALS INC                 | 2,680   | 53,67000  | 143,835.60   |  |  |  |
| 07181310 | BAXTER INTERNATIONAL INC                 | 18,239  | 58,09000  | 1,059,503.51 |  |  |  |
| 07332510 | BEA SYSTEMS INC                          | 11,180  | 15,58000  | 174,184.40   |  |  |  |
| 07390210 | BEAR STEARNS COMPANIES INC               | 1,450   | 95,29000  | 138,170.50   |  |  |  |
| 07581110 | BECKMAN COULTER INC                      | 2,128   | 71,54000  | 152,237.12   |  |  |  |
| 07588710 | BECTON DICKINSON & CO                    | 6,841   | 82,46000  | 564,108.86   |  |  |  |
| 07589610 | BED BATH & BEYOND INC                    | 7,497   | 29,51000  | 221,236.47   |  |  |  |
| 07785310 | VERIZON COMMUNICATIONS INC               | 80,968  | 44,37000  | 3,592,540.16 |  |  |  |
| 08442310 | W. R. BERKLEY CORPORATION                | 5,088   | 30,04000  | 152,843.52   |  |  |  |
| 08651610 | BEST BUY CO INC                          | 11,309  | 50,34000  | 589,295.06   |  |  |  |
| 09062X10 | BIODEN IDEC INC                          | 7,842   | 58,79000  | 461,031.18   |  |  |  |
| 09179710 | BLACK & DECKER CORP                      | 1,705   | 73,31000  | 124,993.55   |  |  |  |
| 09367110 | H&R BLOCK INC                            | 9,590   | 18,32000  | 175,688.80   |  |  |  |
| 09702310 | BOEING CO                                | 20,767  | 88,42000  | 1,836,218.14 |  |  |  |
| 10113710 | BOSTON SCIENTIFIC CORP                   | 36,273  | 11,95000  | 433,462.35   |  |  |  |
| 11012210 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO                  | 55,174  | 28,08000  | 1,549,285.92 |  |  |  |
| 11132010 | BROADCOM CORP-CL A                       | 12,431  | 27,50000  | 341,852.50   |  |  |  |
| 11133710 | BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC       | 2,051   | 23,72000  | 48,649.72    |  |  |  |
| 11506111 | ACCENTURE LTD-CL A                       | 15,633  | 34,00000  | 531,522.00   |  |  |  |
| 11523610 | BROWN & BROWN INC                        | 4,665   | 23,91000  | 111,540.15   |  |  |  |
| 11583720 | BROWN-FORMAN CORP -CL B                  | 1,420   | 71,70000  | 101,814.00   |  |  |  |
| 11704310 | BRUNSWICK CORP                           | 1,956   | 18,20000  | 35,599.20    |  |  |  |
| 12189T10 | BURLINGTON NORTHERN SANTA FE CORPORATION | 9,851   | 83,93000  | 826,794.43   |  |  |  |
| 12485720 | CBS CORP                                 | 17,433  | 26,15000  | 455,872.95   |  |  |  |
| 12497110 | CB RICHARD ELLIS GROUP INC               | 6,460   | 21,66000  | 139,923.60   |  |  |  |
| 12541W20 | C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC             | 2,155   | 51,52000  | 111,025.60   |  |  |  |
| 12550910 | CIGNA CORP                               | 8,750   | 53,72000  | 470,050.00   |  |  |  |
| 12568110 | CIT GROUP INC                            | 5,887   | 24,75000  | 145,703.25   |  |  |  |
| 12640810 | CVS CORP                                 | 12,176  | 43,49000  | 529,534.24   |  |  |  |
| 12665010 | CVS CAREMARK CORP                        | 42,012  | 39,20000  | 1,646,870.40 |  |  |  |
| 12686C10 | CABLEVISION SYSTEM CORPORATION           | 6,070   | 24,51000  | 148,775.70   |  |  |  |
| 12738710 | CADENCE DESIGN SYS INC                   | 8,885   | 17,12000  | 152,111.20   |  |  |  |
| 13442310 | CAMPBELL SOUP CO                         | 6,160   | 36,39000  | 224,162.40   |  |  |  |
| 14040H10 | CAPITAL ONE FINANCIAL CORP               | 11,745  | 47,20000  | 554,364.00   |  |  |  |
| 14149Y10 | CARDINAL HEALTH INC                      | 10,480  | 58,48000  | 612,870.40   |  |  |  |
| 14166510 | CAREER EDUCATION CORPORATION             | 2,045   | 29,37000  | 60,061.65    |  |  |  |
| 14313010 | CARMAX INC                               | 6,149   | 21,43000  | 131,773.07   |  |  |  |

|          |  |         |           |              |  |  |  |
|----------|--|---------|-----------|--------------|--|--|--|
| 14365810 | CARNIVAL CORP                                | 11,482  | 45,02000  | 516,919.64   |  |  |  |
| 14912310 | CATERPILLAR INC                              | 17,831  | 73,39000  | 1,308,617.09 |  |  |  |
| 15087010 | CELANESE CORP                                | 3,530   | 44,33000  | 156,484.90   |  |  |  |
| 15102010 | CELGENE CORPORATION                          | 10,852  | 50,41000  | 547,049.32   |  |  |  |
| 15231210 | CENTEX CORP                                  | 4,586   | 23,90000  | 109,605.40   |  |  |  |
| 15670810 | CEPHALON INC                                 | 2,000   | 75,46000  | 150,920.00   |  |  |  |
| 15688010 | FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC   | 5,195   | 43,51000  | 226,084.45   |  |  |  |
| 15986410 | CHARLES RIVER LABORATORIES INTERNATIONAL INC | 2,325   | 65,60000  | 152,520.00   |  |  |  |
| 16161A10 | JPMORGAN CHASE & CO                          | 94,395  | 45,20000  | 4,286,654.00 |  |  |  |
| 16516710 | CHESAPEAKE ENERGY CORPORATION                | 12,780  | 38,21000  | 488,323.80   |  |  |  |
| 16675110 | CHEVRON CORPORATION                          | 59,264  | 92,02000  | 5,453,473.28 |  |  |  |
| 16776010 | CME GROUP INC                                | 1,336   | 699,05000 | 933,930.80   |  |  |  |
| 17038810 | CHOICEPOINT INC                              | 2,644   | 35,85000  | 94,787.40    |  |  |  |
| 17123210 | CHUBB CORP                                   | 10,968  | 52,68000  | 577,794.24   |  |  |  |
| 17179810 | CIMAREX ENERGY CO                            | 2,815   | 40,90000  | 115,133.50   |  |  |  |
| 17206210 | CINCINNATI FINANCIAL CORPORATION             | 3,920   | 39,32000  | 154,134.40   |  |  |  |
| 17275810 | CISCO SYSTEMS INC                            | 168,795 | 28,60000  | 4,827,537.00 |  |  |  |
| 17290810 | CINTAS CORP                                  | 4,777   | 33,59000  | 158,444.03   |  |  |  |
| 17296710 | CITIGROUP INC                                | 138,298 | 30,70000  | 4,245,748.60 |  |  |  |
| 17737610 | CITRIX SYSTEMS INC                           | 5,158   | 38,15000  | 196,777.70   |  |  |  |
| 18450210 | CLEAR CHANNEL COMMUNICATIONS                 | 13,071  | 34,75000  | 454,217.25   |  |  |  |
| 18905410 | CLOROX COMPANY                               | 4,471   | 65,74000  | 293,923.54   |  |  |  |
| 18975410 | COACH INC                                    | 10,156  | 34,20000  | 374,335.20   |  |  |  |
| 19121610 | COCA-COLA COMPANY                            | 58,086  | 63,81000  | 3,706,467.66 |  |  |  |
| 19121910 | COCA-COLA ENTERPRISES CORPORATION            | 3,495   | 26,50000  | 92,617.50    |  |  |  |
| 19244610 | COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION   | 8,004   | 32,72000  | 261,890.88   |  |  |  |
| 19416210 | COLGATE-PALMOLIVE CO                         | 7,200   | 80,64000  | 580,608.00   |  |  |  |
| 19549330 | COLONIAL BANCORP INC/THE                     | 6,290   | 13,34000  | 83,908.60    |  |  |  |
| 20030010 | COMCAST CORP-CL A                            | 54,951  | 18,14000  | 996,811.14   |  |  |  |
| 20030020 | COMCAST CORP-SPECIAL CL A                    | 26,786  | 18,08000  | 484,290.88   |  |  |  |
| 20034010 | COMERICA INC                                 | 4,530   | 41,17000  | 186,500.10   |  |  |  |
| 20051910 | COMMERCE BANCORP INC                         | 5,260   | 38,45000  | 202,247.00   |  |  |  |
| 20491210 | CA INC                                       | 11,110  | 26,46000  | 293,970.60   |  |  |  |
| 20536310 | COMPUTER SCIENCES CORP                       | 4,548   | 51,53000  | 234,358.44   |  |  |  |
| 20588710 | CONAGRA FOODS INC                            | 14,175  | 25,16000  | 356,643.00   |  |  |  |
| 20854P10 | CONSOL ENERGY INC                            | 5,173   | 66,02000  | 341,521.46   |  |  |  |
| 20911110 | CONSOLIDATED EDISON INC                      | 7,126   | 49,26000  | 351,026.76   |  |  |  |
| 21036P10 | CONSTELLATION BRANDS INC-A                   | 6,165   | 24,40000  | 150,426.00   |  |  |  |
| 21037110 | CONSTELLATION ENERGY GROUP INC               | 5,075   | 100,93000 | 512,219.75   |  |  |  |
| 21664010 | CAMERON INTERNATIONAL CORP                   | 2,963   | 95,71000  | 283,588.73   |  |  |  |
| 21664840 | THE COOPER COMPANIES INC                     | 982     | 38,70000  | 37,229.40    |  |  |  |
| 21666910 | COOPER INDUSTRIES LTD-CL A                   | 5,103   | 52,47000  | 287,754.41   |  |  |  |
| 21935010 | CORNING INC                                  | 44,588  | 24,19000  | 1,078,583.72 |  |  |  |
| 22160010 | COSTCO WHOLESALE CORP                        | 11,939  | 68,49000  | 817,702.11   |  |  |  |
| 22237210 | COUNTRYWIDE FINANCIAL CORP                   | 14,455  | 9,80000   | 141,659.00   |  |  |  |
| 22281610 | COVANCE INC                                  | 1,935   | 88,90000  | 172,021.50   |  |  |  |
| 22286210 | COVENTRY HEALTH CARE INC                     | 4,405   | 59,21000  | 260,820.05   |  |  |  |
| 22822710 | CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP              | 7,395   | 38,82000  | 287,073.90   |  |  |  |
| 23102110 | CUMMINS INC                                  | 2,605   | 121,92000 | 317,601.60   |  |  |  |
| 23331A10 | DR HORTON INC                                | 8,046   | 13,31000  | 107,082.26   |  |  |  |
| 23332610 | DTE SYSTEMS INC                              | 1,724   | 83,93000  | 144,695.32   |  |  |  |
| 23333110 | DTE ENERGY COMPANY                           | 4,703   | 46,79000  | 220,053.37   |  |  |  |
| 23585110 | DANAHER CORP                                 | 6,482   | 86,03000  | 557,646.46   |  |  |  |
| 23716210 | FIRST HORIZON NATIONAL CORPORATION           | 4,129   | 19,37000  | 79,978.73    |  |  |  |
| 23719410 | DARDEN RESTAURANTS INC                       | 3,988   | 35,79000  | 142,014.72   |  |  |  |
| 23918K10 | DAVITA INC                                   | 3,044   | 55,63000  | 169,337.72   |  |  |  |

|          |  |         |           |               |  |  |  |
|----------|--|---------|-----------|---------------|--|--|--|
| 23975310 | TARGET CORP                                | 22,465  | 51,56000  | 1,158,295.40  |  |  |  |
| 24237010 | DEAN FOODS CO                              | 4,312   | 26,29000  | 113,362.48    |  |  |  |
| 24419910 | DEERE & CO                                 | 12,680  | 87,16000  | 1,105,188.80  |  |  |  |
| 24702510 | DELL INC                                   | 60,201  | 23,57000  | 1,418,937.57  |  |  |  |
| 24791620 | DENBURY RESOURCES INC                      | 3,545   | 54,58000  | 193,486.10    |  |  |  |
| 24903010 | DENTSPLY INTERNATIONAL INC                 | 4,332   | 45,52000  | 197,192.64    |  |  |  |
| 25179M10 | DEVON ENERGY CORPORATION                   | 11,996  | 88,73000  | 1,064,405.08  |  |  |  |
| 25271C10 | DIAMOND OFFSHORE DRILLING, INC             | 1,885   | 128,58000 | 242,373.30    |  |  |  |
| 25468710 | THE WALT DISNEY CO.                        | 51,438  | 33,01000  | 1,697,968.38  |  |  |  |
| 25468Y10 | DISCOVERY HOLDING CO-A                     | 7,745   | 26,61000  | 206,094.45    |  |  |  |
| 25470910 | DISCOVER FINANCIAL SERVICES                | 12,590  | 15,64000  | 196,907.60    |  |  |  |
| 25747010 | DOMINION RESOURCES INC/VA                  | 16,452  | 47,82000  | 786,734.64    |  |  |  |
| 25755910 | DOMITAR CORP                               | 16,170  | 7,39000   | 119,496.30    |  |  |  |
| 25786710 | RR DONNELLEY & SONS CO                     | 6,035   | 37,96000  | 229,088.60    |  |  |  |
| 26000310 | DOVER CORP                                 | 5,270   | 45,59000  | 240,259.30    |  |  |  |
| 26054310 | DOW CHEMICAL COMPANY                       | 26,503  | 43,11000  | 1,142,544.33  |  |  |  |
| 26353410 | E. I. DU PONT DE NEMOURS AND COMPANY       | 25,678  | 44,73000  | 1,148,576.94  |  |  |  |
| 26439910 | DUKE ENERGY CORP                           | 35,253  | 20,46000  | 721,276.38    |  |  |  |
| 26483E10 | DUN & BRADSTREET CORPORATION               | 1,662   | 91,40000  | 151,906.80    |  |  |  |
| 26817G10 | DYNEGY INC                                 | 14,080  | 7,54000   | 106,163.20    |  |  |  |
| 26864810 | EMC CORP                                   | 58,504  | 18,98000  | 1,110,405.92  |  |  |  |
| 26874Q10 | ENSCO INTERNATIONAL INC                    | 4,190   | 55,72000  | 230,123.60    |  |  |  |
| 26924610 | E*TRADE FINANCIAL CORPORATION              | 10,965  | 3,87000   | 42,434.55     |  |  |  |
| 27743210 | EASTMAN CHEMICAL COMPANY                   | 2,210   | 62,74000  | 138,655.40    |  |  |  |
| 27746110 | EASTMAN KODAK CO                           | 7,857   | 22,10000  | 173,639.70    |  |  |  |
| 27806910 | EATON CORP                                 | 3,743   | 89,62000  | 335,447.66    |  |  |  |
| 27864210 | EBAY INC                                   | 30,612  | 32,70000  | 1,001,012.40  |  |  |  |
| 27876210 | ECHOSTAR COMMUNICATIONS CORP -A            | 5,824   | 37,82000  | 220,263.68    |  |  |  |
| 27886510 | ECOLAB INC                                 | 4,685   | 51,39000  | 240,762.15    |  |  |  |
| 28102010 | EDISON INTERNATIONAL                       | 8,624   | 55,14000  | 475,527.36    |  |  |  |
| 28390510 | EL PASO CORP                               | 19,135  | 16,17000  | 309,412.95    |  |  |  |
| 28551210 | ELECTRONIC ARTS INC                        | 8,549   | 58,08000  | 496,525.92    |  |  |  |
| 28566110 | ELECTRONIC DATA SYSTEMS CORP               | 12,855  | 21,59000  | 277,539.45    |  |  |  |
| 29078E10 | EMBARQ CORP                                | 4,012   | 49,37000  | 198,072.44    |  |  |  |
| 29101110 | EMERSON ELECTRIC CO                        | 22,095  | 56,21000  | 1,241,959.95  |  |  |  |
| 29266M10 | ENERGY EAST CORPORATION                    | 5,026   | 26,83000  | 134,847.58    |  |  |  |
| 29266R10 | ENERGIZER HOLDINGS INC                     | 1,716   | 115,00000 | 197,340.00    |  |  |  |
| 29356210 | EOG RESOURCES INC                          | 6,681   | 88,35000  | 590,266.35    |  |  |  |
| 29364G10 | ENTERGY CORP                               | 5,437   | 116,87000 | 635,422.19    |  |  |  |
| 29442910 | EQUIFAX INC                                | 4,369   | 37,68000  | 164,623.92    |  |  |  |
| 29454910 | EQUITABLE RESOURCES INC                    | 3,300   | 52,69000  | 173,877.00    |  |  |  |
| 30161N10 | EXLON CORPORATION                          | 18,804  | 83,93000  | 1,578,219.72  |  |  |  |
| 30212P10 | EXPEDIA INC                                | 4,955   | 33,25000  | 164,753.75    |  |  |  |
| 30213010 | EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON INC | 5,842   | 45,85000  | 267,855.70    |  |  |  |
| 30218210 | EXPRESS SCRIPTS INC                        | 6,326   | 70,65000  | 446,931.90    |  |  |  |
| 30225X10 | EXTRERRAN HOLDINGS INC                     | 1,780   | 78,30000  | 139,374.00    |  |  |  |
| 30231G10 | EXXON MOBIL CORPORATION                    | 154,200 | 91,18000  | 14,059,956.00 |  |  |  |
| 30249U10 | FMIC TECHNOLOGIES INC                      | 3,590   | 57,74000  | 207,286.60    |  |  |  |
| 30257110 | FPL GROUP INC                              | 10,780  | 69,39000  | 748,024.20    |  |  |  |
| 30700010 | FAMILY DOLLAR STORES                       | 4,448   | 18,53000  | 82,421.44     |  |  |  |
| 31190010 | FASTENAL COMPANY                           | 3,924   | 42,57000  | 167,044.68    |  |  |  |
| 31304N10 | FEDEX CORP                                 | 8,133   | 95,92000  | 780,117.36    |  |  |  |
| 31340030 | FREDDIE MAC                                | 18,714  | 31,85000  | 596,040.90    |  |  |  |
| 31358610 | FANNIE MAE                                 | 27,498  | 34,68000  | 953,630.64    |  |  |  |
| 31410H10 | MACY'S INC                                 | 13,374  | 27,77000  | 371,395.98    |  |  |  |
| 31620R10 | FIDELITY NATIONAL FINANCIAL, INC.          | 7,616   | 15,25000  | 116,144.00    |  |  |  |
| 31677310 | FIFTH THIRD BANCORP                        | 12,714  | 26,60000  | 338,192.40    |  |  |  |
| 31852230 | FIRST AMERICAN CORP                        | 3,035   | 33,40000  | 101,369.00    |  |  |  |

|          |                                   |         |            |               |  |  |  |
|----------|-----------------------------------|---------|------------|---------------|--|--|--|
| 33643310 | FIRST SOLAR INC                   | 1,100   | 251,69000  | 276,859.00    |  |  |  |
| 33735810 | WACHOVIA CORP                     | 55,166  | 39,03000   | 2,153,128.98  |  |  |  |
| 33773810 | FISERV INC                        | 4,209   | 54,02000   | 227,370.18    |  |  |  |
| 33793210 | FIRSTENERGY CORP                  | 8,483   | 72,43000   | 614,423.69    |  |  |  |
| 34386110 | FLUOR CORP                        | 2,339   | 144,03000  | 336,886.17    |  |  |  |
| 34537010 | FORD MOTOR CO                     | 48,963  | 6,89000    | 337,355.07    |  |  |  |
| 34555010 | FOREST CITY ENTERPRISES INC       | 1,995   | 45,53000   | 90,832.35     |  |  |  |
| 34583810 | FOREST LABORATORIES INC           | 4,155   | 36,06000   | 149,829.30    |  |  |  |
| 34963110 | FORTUNE BRANDS INC                | 4,026   | 74,81000   | 301,185.06    |  |  |  |
| 35461310 | FRANKLIN RESOURCES INC            | 4,865   | 111,04000  | 540,209.60    |  |  |  |
| 35671D85 | FREEPORT-MCMORAN COPPER-B         | 10,744  | 102,11000  | 1,097,069.84  |  |  |  |
| 36467110 | GAMESTOP CORP                     | 3,760   | 58,21000   | 218,869.60    |  |  |  |
| 36473010 | GANNETT CO                        | 5,835   | 35,30000   | 205,975.50    |  |  |  |
| 36476010 | GAP INC                           | 14,751  | 21,18000   | 312,426.18    |  |  |  |
| 36871010 | GENENTECH INC                     | 13,394  | 68,43000   | 916,551.42    |  |  |  |
| 36955010 | GENERAL DYNAMICS CORP             | 9,597   | 877,549.68 | 877,549.68    |  |  |  |
| 36960410 | GENERAL ELECTRIC COMPANY          | 284,872 | 36,91000   | 10,514,625.52 |  |  |  |
| 37033410 | GENERAL MILLS INC                 | 6,577   | 59,00000   | 506,043.00    |  |  |  |
| 37044210 | GENERAL MOTORS CORP               | 11,955  | 26,52000   | 317,046.60    |  |  |  |
| 37246010 | GENUINE PARTS CO                  | 4,996   | 47,56000   | 218,585.76    |  |  |  |
| 37247D10 | GENWORTH FINANCIAL INC-CL A       | 11,555  | 24,59000   | 284,137.45    |  |  |  |
| 37291710 | GENZYME CORP - GENL DIVISION      | 7,294   | 74,87000   | 546,101.78    |  |  |  |
| 37555810 | GILEAD SCIENCES INC               | 25,842  | 45,85000   | 1,184,855.70  |  |  |  |
| 38141G10 | GOLDMAN SACHS GROUP INC           | 10,183  | 210,67000  | 2,145,252.61  |  |  |  |
| 38238810 | GOODRICH CORP                     | 1,565   | 73,53000   | 115,074.45    |  |  |  |
| 38255010 | GOODYEAR TIRE & RUBBER CO         | 4,980   | 26,46000   | 131,770.80    |  |  |  |
| 38259F50 | GOOGLE INC-CL A                   | 6,476   | 689,96000  | 4,468,180.96  |  |  |  |
| 38480210 | WW GRAINGER INC                   | 2,117   | 90,48000   | 191,546.16    |  |  |  |
| 38821G10 | GRANT PRIDECO INC                 | 3,460   | 47,46000   | 164,211.60    |  |  |  |
| 40621610 | HALLIBURTON CO                    | 24,612  | 37,60000   | 925,411.20    |  |  |  |
| 41034510 | HAINESBRANDS INC                  | 2,079   | 28,73000   | 59,729.67     |  |  |  |
| 41131010 | HANSEN NATURAL CORP               | 1,800   | 47,70000   | 85,860.00     |  |  |  |
| 41282210 | HARLEY-DAVIDSON INC               | 6,714   | 44,96000   | 301,861.44    |  |  |  |
| 41308610 | HARMAN INTERNATIONAL              | 1,833   | 73,35000   | 134,450.55    |  |  |  |
| 41361910 | HARRAH'S ENTERTAINMENT INC        | 4,896   | 88,25000   | 432,072.00    |  |  |  |
| 41387510 | HARRIS CORP                       | 1,805   | 60,67000   | 109,509.35    |  |  |  |
| 41586410 | HARSCO CORP                       | 2,535   | 62,95000   | 159,578.25    |  |  |  |
| 41651510 | HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP | 8,962   | 88,55000   | 793,585.10    |  |  |  |
| 41805610 | HASBRO INC                        | 4,903   | 25,71000   | 126,066.13    |  |  |  |
| 42222G10 | HEALTH NET INC                    | 3,426   | 48,92000   | 167,599.92    |  |  |  |
| 42786610 | HERSHEY COMPANY                   | 4,765   | 38,45000   | 183,214.25    |  |  |  |
| 42805T10 | HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC         | 4,450   | 15,52000   | 69,064.00     |  |  |  |
| 42823610 | HEILETT-PACKARD CO                | 73,065  | 52,14000   | 3,809,087.70  |  |  |  |
| 43157310 | HILLENBRAND INDUSTRIES            | 2,014   | 54,17000   | 109,098.38    |  |  |  |
| 43644010 | HOLOGIC INC                       | 3,359   | 65,20000   | 219,006.80    |  |  |  |
| 43707610 | HOMER DEPOT INC                   | 47,020  | 26,63000   | 1,252,142.60  |  |  |  |
| 43850610 | HONEYWELL INTERNATIONAL INC       | 19,856  | 59,98000   | 1,190,962.88  |  |  |  |
| 44106010 | HOSPIRA INC                       | 4,491   | 44,06000   | 197,873.46    |  |  |  |
| 44368310 | HUDSON CITY BANCORP INC           | 14,825  | 14,48000   | 214,666.00    |  |  |  |
| 44441810 | THE DIRECTV GROUP INC             | 19,376  | 23,70000   | 459,211.20    |  |  |  |
| 44485910 | HUMANA INC                        | 2,215   | 75,50000   | 167,232.50    |  |  |  |
| 44615010 | HUNTINGTON BANCSHARES INC         | 9,245   | 14,17000   | 131,001.65    |  |  |  |
| 44701110 | HUNTSMAN CORP                     | 4,085   | 24,88000   | 101,634.80    |  |  |  |
| 44993410 | IMS HEALTH INC                    | 5,935   | 22,35000   | 132,647.25    |  |  |  |
| 45091110 | ITT CORPORATION                   | 4,338   | 62,16000   | 289,650.08    |  |  |  |
| 45166310 | IDEARC INC                        | 4,095   | 17,02000   | 69,686.90     |  |  |  |
| 45230810 | ILLINOIS TOOL WORKS               | 12,905  | 55,90000   | 721,389.50    |  |  |  |
| 45686610 | INGERSOLL-RAND CO-CL A            | 7,885   | 49,18000   | 387,784.30    |  |  |  |

|          |   |         |           |              |  |  |  |  |
|----------|---|---------|-----------|--------------|--|--|--|--|
| 45814010 | INTEL CORP                                  | 162,912 | 26,31000  | 4,286,214.72 |  |  |  |  |
| 45865110 | INTERCONTINENTALEXCHANGE INC                | 1,630   | 185,73000 | 302,739.90   |  |  |  |  |
| 45920010 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP        | 37,947  | 105,77000 | 4,013,654.19 |  |  |  |  |
| 45950610 | INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC      | 2,574   | 44,43000  | 124,658.82   |  |  |  |  |
| 45950210 | INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY               | 8,861   | 44,14000  | 391,124.54   |  |  |  |  |
| 46014610 | INTERNATIONAL PAPER CO                      | 11,070  | 32,36000  | 358,225.20   |  |  |  |  |
| 46069010 | INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES INC          | 16,061  | 8,15000   | 130,897.15   |  |  |  |  |
| 46069510 | INTERFIL CORP -CL A                         | 3,515   | 24,00000  | 84,360.00    |  |  |  |  |
| 46120210 | INTUIT INC                                  | 8,986   | 29,78000  | 267,603.08   |  |  |  |  |
| 46120E60 | INTUITIVE SURGICAL INC                      | 995     | 324,89000 | 323,265.55   |  |  |  |  |
| 46284610 | IRON MOUNTAIN INC                           | 5,402   | 36,70000  | 198,253.40   |  |  |  |  |
| 46631310 | JABIL CIRCUIT INC                           | 5,602   | 16,99000  | 95,177.98    |  |  |  |  |
| 46881410 | JACOBS ENGINEERING GROUP INC                | 3,245   | 95,31000  | 309,280.95   |  |  |  |  |
| 47816010 | JOHNSON & JOHNSON                           | 80,474  | 67,59000  | 5,439,237.66 |  |  |  |  |
| 47836610 | JOHNSON CONTROLS INC                        | 16,808  | 36,32000  | 610,466.56   |  |  |  |  |
| 48116510 | JOY GLOBAL INC                              | 3,020   | 58,21000  | 175,794.20   |  |  |  |  |
| 48203810 | JUNIPER NETWORKS INC                        | 14,988  | 33,11000  | 495,590.48   |  |  |  |  |
| 48242110 | KBR INC                                     | 4,445   | 38,92000  | 172,999.40   |  |  |  |  |
| 48248010 | KLA-TENCOR CORPORATION                      | 5,219   | 47,90000  | 249,990.10   |  |  |  |  |
| 48783610 | KELLOGG CO                                  | 7,613   | 53,62000  | 408,209.06   |  |  |  |  |
| 49326710 | KEYCORP                                     | 9,823   | 22,67000  | 222,687.41   |  |  |  |  |
| 49436810 | KIMBERLY-CLARK CORP                         | 11,473  | 68,11000  | 781,426.03   |  |  |  |  |
| 50025510 | KOHL'S CORP                                 | 8,077   | 46,69000  | 377,115.13   |  |  |  |  |
| 50075N10 | KRAFT FOODS INC-A                           | 43,985  | 33,31000  | 1,465,140.35 |  |  |  |  |
| 50104410 | KROGER CO                                   | 18,260  | 26,21000  | 478,594.60   |  |  |  |  |
| 50216110 | LSI CORP                                    | 21,485  | 5,60000   | 120,372.00   |  |  |  |  |
| 50242410 | L-3 COMMUNICATIONS                          | 3,301   | 108,62000 | 358,554.62   |  |  |  |  |
| 50540R40 | LABORATORY CORPORATION OF AMERICAN HOLDINGS | 3,405   | 74,60000  | 254,013.00   |  |  |  |  |
| 51280710 | LAM RESEARCH CORPORATION                    | 3,872   | 44,25000  | 171,336.00   |  |  |  |  |
| 51281510 | LAMAR ADVERTISING COMPANY-CL A              | 2,705   | 48,28000  | 130,597.40   |  |  |  |  |
| 51783410 | LAS VEGAS SANDS CORP                        | 2,855   | 117,70000 | 336,033.50   |  |  |  |  |
| 51843910 | ESTE E LAUDER COMPANIES-CL A                | 3,040   | 43,30000  | 131,632.00   |  |  |  |  |
| 52186510 | LEAR CORPORATION                            | 1,483   | 28,52000  | 42,295.16    |  |  |  |  |
| 52466010 | LEGGETT & PLATT INC                         | 5,413   | 18,72000  | 101,331.36   |  |  |  |  |
| 52490110 | LEGG MASON INC                              | 3,625   | 73,28000  | 285,640.00   |  |  |  |  |
| 52490810 | LEHMAN BROTHERS HOLDINGS INC                | 12,674  | 62,24000  | 788,829.76   |  |  |  |  |
| 52605710 | LENNAR CORP-CL A                            | 4,416   | 17,14000  | 75,690.24    |  |  |  |  |
| 52728810 | LEUCADIA NATIONAL CORP                      | 4,430   | 48,14000  | 213,260.20   |  |  |  |  |
| 52977110 | LEXMARK INTERNATIONAL INC                   | 2,780   | 33,38000  | 92,796.40    |  |  |  |  |
| 53055530 | LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C                 | 4,863   | 37,31000  | 181,438.53   |  |  |  |  |
| 53071910 | LIBERTY GLOBAL INC-A                        | 5,113   | 39,82000  | 203,599.66   |  |  |  |  |
| 53071M10 | LIBERTY MEDIA HOLDING CORP-INTERACTIVE A    | 17,110  | 20,51000  | 350,926.10   |  |  |  |  |
| 53071N30 | LIBERTY MEDIA HOLDING CORP-CAPITAL A        | 3,239   | 116,60000 | 377,667.40   |  |  |  |  |
| 53245710 | ELI LILLY & CO                              | 28,478  | 53,71000  | 1,529,553.38 |  |  |  |  |
| 53271610 | LIMITED BRANDS                              | 9,203   | 18,69000  | 172,004.07   |  |  |  |  |
| 53279110 | LINCARE HOLDINGS INC                        | 2,715   | 37,26000  | 101,160.90   |  |  |  |  |
| 53418710 | LINCOLN NATIONAL CORP                       | 7,583   | 57,23000  | 433,975.09   |  |  |  |  |
| 53567810 | L INEAR TECHNOLOGY CORP                     | 7,159   | 30,91000  | 221,284.69   |  |  |  |  |
| 53992010 | LIZ CLAIBORNE INC                           | 4,060   | 22,10000  | 89,726.00    |  |  |  |  |
| 53983010 | LOCKHEED MARTIN CORP                        | 9,801   | 110,48000 | 1,082,814.48 |  |  |  |  |
| 54042410 | LOEWS CORP                                  | 5,630   | 46,80000  | 263,484.00   |  |  |  |  |
| 54042420 | LOEWS CORP - CAROLINA GROUP                 | 1,425   | 27,30000  | 124,402.00   |  |  |  |  |
| 54866110 | LOWE'S COS INC                              | 41,314  | 22,72000  | 938,654.08   |  |  |  |  |
| 55207810 | LYONDELL CHEMICAL COMPANY                   | 6,355   | 47,76000  | 303,514.80   |  |  |  |  |
| 55261F10 | M & T BANK CORP                             | 1,638   | 83,31000  | 136,461.78   |  |  |  |  |
| 55282C10 | MBIA INC                                    | 4,109   | 27,60000  | 113,408.40   |  |  |  |  |
| 55271510 | MENC ELECTRONIC MATERIALS INC               | 6,045   | 86,57000  | 523,315.65   |  |  |  |  |

|          |                                |         |           |              |  |  |  |  |
|----------|--------------------------------|---------|-----------|--------------|--|--|--|--|
| 55295310 | MGM MIRAGE                     | 3,645   | 87,37000  | 318,463.65   |  |  |  |  |
| 56357110 | MANTONIC CO INC/THE            | 3,300   | 48,11000  | 158,763.00   |  |  |  |  |
| 56418H10 | MANPOWER INC                   | 2,612   | 59,45000  | 155,283.40   |  |  |  |  |
| 57174810 | MARSH & MCLENNAN COMPANIES INC | 15,443  | 24,76000  | 382,368.68   |  |  |  |  |
| 57183410 | MARSHALL & ILSLEY CORP         | 6,177   | 28,27000  | 174,623.79   |  |  |  |  |
| 57190310 | MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A    | 8,691   | 31,49000  | 273,679.59   |  |  |  |  |
| 57328410 | MARTIN MARIETTA MATERIALS INC  | 1,240   | 130,14000 | 161,373.60   |  |  |  |  |
| 57459910 | MASCO CORP                     | 10,034  | 21,97000  | 220,446.98   |  |  |  |  |
| 57620610 | MASSEY ENERGY COMPANY          | 1,733   | 35,70000  | 61,868.10    |  |  |  |  |
| 57636010 | MASTERCARD INC-A               | 1,875   | 216,56000 | 406,050.00   |  |  |  |  |
| 57708110 | MATTEL INC                     | 10,189  | 19,77000  | 201,436.53   |  |  |  |  |
| 57948910 | MCGLATCHY CO                   | 558     | 12,78000  | 7,131.24     |  |  |  |  |
| 57978020 | MCCORMIK & CO-NON VTS SHRS     | 4,730   | 37,06000  | 175,293.80   |  |  |  |  |
| 58003710 | MCDERMOTT INTERNATIONAL INC    | 6,035   | 57,54000  | 347,253.90   |  |  |  |  |
| 58013510 | MCDONALD'S CORPORATION         | 33,246  | 61,16000  | 2,033,325.36 |  |  |  |  |
| 58064510 | MCGRAW-HILL COMPANIES INC      | 9,062   | 46,42000  | 411,596.04   |  |  |  |  |
| 58155010 | MCKESSON CORPORATION           | 8,374   | 63,21000  | 529,320.54   |  |  |  |  |
| 58333410 | MEADWESTVACO CORP              | 5,859   | 31,95000  | 187,195.05   |  |  |  |  |
| 58405U10 | MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC     | 7,551   | 101,17000 | 763,934.67   |  |  |  |  |
| 58505510 | MEDTRONIC INC                  | 31,797  | 49,40000  | 1,570,771.80 |  |  |  |  |
| 58933110 | MERCK & CO, INC.               | 60,508  | 59,57000  | 3,604,461.56 |  |  |  |  |
| 59018810 | MERRILL LYNCH & CO INC         | 23,089  | 56,84000  | 1,311,241.96 |  |  |  |  |
| 59156R10 | METLIFE INC                    | 20,720  | 61,94000  | 1,283,396.80 |  |  |  |  |
| 59170810 | METROPCS COMMUNICATIONS INC    | 4,560   | 18,02000  | 82,171.20    |  |  |  |  |
| 59491810 | MICROSOFT CORP                 | 234,594 | 35,31000  | 8,283,514.14 |  |  |  |  |
| 59601710 | MICROCHIP TECHNOLOGY INC       | 5,869   | 31,59000  | 185,401.71   |  |  |  |  |
| 59511210 | MICRON TECHNOLOGY INC          | 21,507  | 8,37000   | 180,013.59   |  |  |  |  |
| 60107310 | MILLIPORE CORP                 | 1,950   | 75,67000  | 147,566.50   |  |  |  |  |
| 60405910 | 3M CO                          | 18,971  | 85,93000  | 1,630,178.03 |  |  |  |  |
| 60467510 | MIRANT CORP                    | 6,750   | 38,44000  | 259,470.00   |  |  |  |  |
| 60819010 | MOHAWK INDUSTRIES INC          | 1,543   | 75,51000  | 116,511.93   |  |  |  |  |
| 60871R20 | MOLSON COORS BREWING COMPANY-B | 1,710   | 52,05000  | 89,005.50    |  |  |  |  |
| 61166H10 | MONSANTO CO                    | 15,216  | 104,50000 | 1,590,072.00 |  |  |  |  |
| 61536910 | MOODY'S CORPORATION            | 6,367   | 38,48000  | 245,002.16   |  |  |  |  |
| 61744644 | MORGAN STANLEY                 | 26,425  | 50,30000  | 1,329,177.50 |  |  |  |  |
| 61945A10 | MOSAIC CO/THE                  | 4,250   | 82,81000  | 351,942.50   |  |  |  |  |
| 62007610 | MOTOROLA INC                   | 63,580  | 16,00000  | 1,017,280.00 |  |  |  |  |
| 62671710 | MURPHY OIL CORPORATION         | 2,355   | 76,45000  | 180,039.75   |  |  |  |  |
| 62913F20 | NI HOLDINGS INC                | 4,492   | 43,10000  | 193,605.20   |  |  |  |  |
| 62937750 | NRG ENERGY INC                 | 2,995   | 41,87000  | 125,400.65   |  |  |  |  |
| 62940M10 | NRG MEDIA INC                  | 7,300   | 18,05000  | 131,765.00   |  |  |  |  |
| 62948N10 | NYMEX HOLDINGS INC             | 2,380   | 127,85000 | 304,283.00   |  |  |  |  |
| 62949I10 | NYSE EURONEXT                  | 3,870   | 86,02000  | 332,897.40   |  |  |  |  |
| 62956810 | NABORS INDUSTRIES LTD          | 7,236   | 27,81000  | 201,233.16   |  |  |  |  |
| 63540S10 | NATIONAL CITY CORP             | 15,245  | 16,62000  | 253,371.90   |  |  |  |  |
| 63707110 | NATIONAL-OILWELL VARCO INC     | 10,082  | 77,37000  | 780,044.34   |  |  |  |  |
| 63764010 | NATIONAL SEMICONDUCTOR CORP    | 8,530   | 23,75000  | 202,587.50   |  |  |  |  |
| 63861210 | NATIONWIDE FINANCIAL           | 675     | 42,12000  | 28,431.00    |  |  |  |  |
| 63936L10 | NAVTEQ CORP                    | 2,780   | 74,50000  | 207,110.00   |  |  |  |  |
| 64093810 | MCAFEE INC                     | 4,195   | 38,96000  | 163,437.20   |  |  |  |  |
| 64120L10 | NETWORK APPLIANCE INC          | 10,116  | 15,57000  | 258,666.12   |  |  |  |  |
| 64944510 | NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC | 7,984   | 17,23000  | 137,564.32   |  |  |  |  |
| 65119210 | NEWELL RUBBERMAID INC          | 6,925   | 25,04000  | 173,402.00   |  |  |  |  |
| 65129010 | NEWFIELD EXPLORATION COMPANY   | 3,685   | 52,02000  | 191,693.70   |  |  |  |  |
| 65163910 | NEWMONT MINING CORP            | 12,650  | 47,81000  | 604,796.50   |  |  |  |  |
| 65248770 | NEWS CORP INC-CL B WHEN ISS    | 12,694  | 21,14000  | 288,351.16   |  |  |  |  |
| 65248780 | NEWS CORP-CL A                 | 51,177  | 20,28000  | 1,037,869.56 |  |  |  |  |
| 65410610 | NIKE INC -CL B                 | 10,177  | 64,32000  | 654,584.64   |  |  |  |  |
| 65473P10 | NI SOURCE INC                  | 7,560   | 18,90000  | 142,884.00   |  |  |  |  |

|          |   |         |           |              |
|----------|---|---------|-----------|--------------|
| 74834L10 | QUEST DIAGNOSTICS INC                   | 4,246   | 53,54000  | 227,330.84   |
| 74835610 | QUESTAR CORPORATION                     | 4,620   | 54,63000  | 252,390.60   |
| 74912110 | QUEST COMMUNICATIONS INTERNATIONAL INC  | 43,128  | 7,01000   | 302,327.28   |
| 75281A10 | RANGE RESOURCES CORP                    | 4,270   | 45,71000  | 195,181.70   |
| 75511140 | RAYTHEON COMPANY                        | 12,062  | 61,66000  | 743,742.92   |
| 75894010 | REGIONS FINANCIAL CORP                  | 18,044  | 24,00000  | 433,056.00   |
| 75952B10 | RELJANT ENERGY INC                      | 9,020   | 26,63000  | 240,202.60   |
| 75952J10 | CENTERPOINT ENERGY INC                  | 9,227   | 18,33000  | 169,130.91   |
| 76182K10 | REYNOLDS AMERICAN INC                   | 2,325   | 66,94000  | 155,635.50   |
| 77032310 | ROBERT HALF INTERNATIONAL INC           | 4,705   | 25,39000  | 119,459.95   |
| 77390310 | ROCKWELL AUTOMATION INC                 | 0,288   | 70,55000  | 302,518.40   |
| 77434110 | ROCKWELL COLLINS INC                    | 4,415   | 73,39000  | 324,016.85   |
| 77537110 | ROHM AND HAAS CO                        | 3,900   | 55,11000  | 214,929.00   |
| 77669610 | ROPER INDUSTRIES INC                    | 2,350   | 64,25000  | 150,987.50   |
| 77829610 | ROSS STORES INC                         | 4,398   | 25,01000  | 109,993.98   |
| 77938210 | ROWAN COMPANIES INC                     | 3,385   | 37,96000  | 128,494.60   |
| 78387G10 | AT&T INC                                | 169,566 | 41,14000  | 6,975,945.24 |
| 78411710 | SEI INVESTMENTS CO                      | 3,860   | 32,09000  | 123,867.40   |
| 78463510 | SPX CORP                                | 1,667   | 104,44000 | 174,101.48   |
| 78642910 | SAFECO CORP                             | 2,874   | 54,76000  | 157,380.24   |
| 78651420 | SAFEWAY INC                             | 11,533  | 35,06000  | 404,346.98   |
| 79084910 | ST JUDE MEDICAL INC                     | 9,395   | 42,11000  | 395,623.45   |
| 79286010 | TRAVELERS COS INC/THE                   | 18,229  | 52,69000  | 980,486.01   |
| 79466L30 | SALESFORCE.COM INC                      | 2,455   | 59,55000  | 146,195.25   |
| 80004C10 | SANDISK CORPORATION                     | 5,913   | 36,34000  | 214,878.42   |
| 80090710 | SANMINA-SCT CORPORATION                 | 11,439  | 1,65000   | 18,874.35    |
| 80311110 | SARA LEE CORP                           | 21,033  | 16,40000  | 344,941.20   |
| 80589M10 | SCANA CORP                              | 3,183   | 42,65000  | 135,754.95   |
| 80680510 | SCHERING-PLOUGH CORP                    | 21,270  | 27,70000  | 590,667.90   |
| 80685710 | SCHLUMBERGER LTD                        | 33,252  | 94,57000  | 3,144,641.64 |
| 80851310 | CHARLES SCHWAB CORP                     | 26,739  | 24,25000  | 648,420.75   |
| 81105420 | EI SCRIPPS CO-CL A                      | 1,165   | 43,66000  | 50,863.90    |
| 81211K10 | SEALED AIR CORP                         | 4,716   | 23,45000  | 110,590.20   |
| 81235010 | SEARS HOLDINGS CORPORATION              | 2,271   | 105,24000 | 239,000.04   |
| 81685110 | SEMPRA ENERGY                           | 6,847   | 61,18000  | 418,899.46   |
| 82434810 | SHERWIN-WILLIAMS CO                     | 2,922   | 59,79000  | 174,706.38   |
| 82655210 | SIGMA ALDRICH CORP                      | 3,790   | 53,00000  | 200,870.00   |
| 83211010 | SMITH INTERNATIONAL INC                 | 5,351   | 67,84000  | 363,011.84   |
| 84258710 | SOUTHERN CO                             | 19,890  | 38,49000  | 765,566.10   |
| 84474110 | SOUTHWEST AIRLINES COMPANY              | 4,510   | 13,24000  | 59,712.40    |
| 84546710 | SOUTHWESTERN ENERGY CO                  | 4,780   | 52,28000  | 249,898.40   |
| 84590510 | SOVEREIGN BANCORP INC                   | 10,985  | 12,05000  | 132,369.25   |
| 84756010 | SPECTRA ENERGY CORP                     | 16,789  | 24,65000  | 413,848.85   |
| 85206110 | SPRINT NEXTEL CORPORATION               | 77,322  | 14,17000  | 1,095,652.74 |
| 85461610 | STANLEY WORKS                           | 2,182   | 48,93000  | 106,765.26   |
| 85503010 | STAPLES INC                             | 18,374  | 22,64000  | 415,987.36   |
| 85524410 | STARBUCKS CORP                          | 20,757  | 21,25000  | 441,086.25   |
| 85590620 | STARWOOD HOTELS & RESORTS WORLDWIDE INC | 5,507   | 46,62000  | 256,736.34   |
| 85747710 | STATE STREET CORP                       | 11,062  | 77,65000  | 858,187.80   |
| 86083110 | JANUS CAPITAL GROUP INC                 | 5,715   | 34,18000  | 195,338.70   |
| 86366710 | STRYKER CORP                            | 8,163   | 74,27000  | 606,266.01   |
| 86676210 | SUNOCO INC                              | 3,268   | 67,80000  | 221,570.40   |
| 86681010 | SUN MICROSYSTEMS INC                    | 25,821  | 19,73000  | 509,448.33   |
| 86765210 | SUNPOWER CORP-CLASS A                   | 970     | 128,19000 | 124,344.30   |
| 86791410 | SUNTRUST BANKS INC                      | 8,727   | 63,05000  | 550,237.35   |
| 86853610 | SUPERVALU INC                           | 5,700   | 36,90000  | 210,330.00   |
| 87150310 | SYNANTEC CORP                           | 11,600  | 16,94000  | 196,504.00   |

|          |  |         |              |              |
|----------|--|---------|--------------|--------------|
| 65489410 | NOBLE ENERGY INC                             | 4,926   | 76,19000     | 375,311.94   |
| 65504210 | NOBLE CORP                                   | 7,082   | 51,85000     | 367,201.70   |
| 65566410 | NORDSTROM INC                                | 2,605   | 34,62000     | 90,185.10    |
| 65584410 | NORFOLK SOUTHERN CORP                        | 11,005  | 50,64000     | 557,293.20   |
| 66577210 | XCEL ENERGY INC                              | 10,294  | 22,94000     | 236,144.36   |
| 66585910 | NORTHERN TRUST CORP                          | 5,665   | 75,41000     | 427,197.65   |
| 66680710 | NORTHROP GRUMMAN CORP                        | 8,639   | 80,00000     | 691,120.00   |
| 67000810 | NOVELLUS SYSTEMS INC                         | 3,959   | 26,01000     | 102,973.59   |
| 67034610 | NUCOR CORP                                   | 6,269   | 59,93000     | 495,561.17   |
| 67066610 | NVIDIA CORP                                  | 14,125  | 35,07000     | 495,363.75   |
| 67459910 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP                    | 23,176  | 1,645,496.00 |              |
| 67622010 | OFFICE DEPOT INC                             | 8,290   | 14,44000     | 119,707.60   |
| 68022310 | OLD REPUBLIC INTERNATIONAL CORP              | 8,198   | 14,70000     | 120,510.60   |
| 68190410 | OMNICARE INC                                 | 3,968   | 24,53000     | 97,335.04    |
| 68191910 | OMNICOM GROUP INC                            | 9,022   | 47,81000     | 431,341.82   |
| 68389X10 | ORACLE CORP                                  | 114,105 | 2,419,026.00 |              |
| 68823920 | OSHKOSH TRUCK CORP                           | 1,955   | 46,32000     | 90,555.60    |
| 69331C10 | P G & E CORP                                 | 9,966   | 45,96000     | 458,037.36   |
| 69347510 | PNC FINANCIAL SERVICES GROUP                 | 9,730   | 64,81000     | 630,601.30   |
| 69349910 | PPL CORPORATION                              | 10,648  | 53,50000     | 569,668.00   |
| 69350610 | PPG INDUSTRIES INC                           | 4,187   | 69,40000     | 290,577.80   |
| 69371810 | PACCAR INTERNATIONAL INC                     | 9,829   | 53,15000     | 522,411.35   |
| 69525710 | PACTIV CORPORATION                           | 5,139   | 25,74000     | 132,277.86   |
| 69642930 | PALL CORP                                    | 3,551   | 40,65000     | 144,348.15   |
| 70109410 | PARKER HANNIFIN CORP                         | 4,850   | 76,68000     | 371,898.00   |
| 70341210 | PATTERSON COS INC                            | 3,057   | 32,06000     | 98,007.42    |
| 70348110 | PATTERSON-UTI ENERGY INC                     | 4,547   | 19,86000     | 90,303.42    |
| 70432610 | PAYCHEX INC                                  | 9,017   | 38,36000     | 345,892.12   |
| 70454910 | PEABODY ENERGY CORPORATION                   | 7,610   | 60,00000     | 456,600.00   |
| 70816010 | J C PENNEY CO INC (HOLDING CO)               | 5,491   | 42,52000     | 233,477.32   |
| 70963110 | PENTAIR INC                                  | 2,859   | 34,48000     | 98,578.32    |
| 71019810 | PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC                | 9,890   | 16,70000     | 165,163.00   |
| 71340910 | PEPSI BOTTLING GROUP INC                     | 1,780   | 39,27000     | 69,900.60    |
| 71344810 | PEPSICO INC                                  | 45,072  | 78,46000     | 3,536,349.12 |
| 71404110 | APPLERA CORPORATION-APPLIED BIOSYSTEMS GROUP | 5,535   | 33,35000     | 184,592.25   |
| 71676810 | BETSMART INC                                 | 4,270   | 25,51000     | 108,927.70   |
| 71708110 | Pfizer Inc                                   | 192,592 | 23,10000     | 4,448,875.20 |
| 71815410 | ALTRIA GROUP INC                             | 58,528  | 76,82000     | 4,496,120.96 |
| 71850710 | CONOCOPHILLIPS                               | 21,560  | 83,29000     | 1,795,732.40 |
| 72348410 | Pinnacle West Capital Corp                   | 3,399   | 42,69000     | 145,103.31   |
| 72378710 | PIONEER NATURAL RESOURCES COMPANY            | 3,500   | 46,74000     | 163,590.00   |
| 72447910 | PITNEY BOWES INC                             | 5,678   | 37,14000     | 210,880.92   |
| 73157210 | POLO RALPH LAUREN CORP                       | 2,045   | 64,59000     | 132,086.55   |
| 73767910 | PEFCO HOLDINGS INC                           | 5,887   | 28,85000     | 169,839.95   |
| 74005P10 | PRAXAIR INC                                  | 8,990   | 88,04000     | 791,479.60   |
| 74018910 | PRECISION CASTPARTS CORP                     | 1,810   | 145,66000    | 263,644.60   |
| 74147710 | T.ROWE PRICE GROUP INC                       | 7,300   | 62,50000     | 456,250.00   |
| 74153010 | PRIDE INTERNATIONAL INC                      | 4,475   | 32,16000     | 143,916.00   |
| 74251V10 | PRINCIPAL FINANCIAL GROUP                    | 6,985   | 67,41000     | 470,858.85   |
| 74271810 | PROCTER & GAMBLE COMPANY                     | 86,633  | 73,90000     | 6,402,178.70 |
| 74326310 | PROGRESS ENERGY INC                          | 6,468   | 48,96000     | 316,673.28   |
| 74331510 | PROGRESSIVE CORP                             | 18,555  | 17,99000     | 333,804.45   |
| 74369L10 | PDL BIOPHARMA INC                            | 2,485   | 17,83000     | 44,307.55    |
| 74432010 | PRUDENTIAL FINANCIAL INC                     | 12,917  | 93,76000     | 1,211,097.92 |
| 74457310 | PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC          | 7,144   | 96,41000     | 688,753.04   |
| 74586710 | PULTE HOMES INC                              | 7,409   | 10,37000     | 76,831.33    |
| 74727710 | QLOGIC CORP                                  | 3,433   | 13,64000     | 46,826.12    |
| 74752510 | QUALCOMM INC                                 | 46,702  | 39,38000     | 1,839,124.76 |



|           |   |        |           |              |  |
|-----------|---|--------|-----------|--------------|--|
| 87160710  | SYNOPLYS INC                            | 4,727  | 26,03000  | 123,043.81   |  |
| 87161C10  | SYNOVUS FINANCIAL CORP                  | 7,328  | 23,62000  | 173,087.36   |  |
| 87182910  | SYSCO CORP                              | 16,511 | 31,56000  | 521,087.16   |  |
| 87227510  | TCF FINANCIAL CORPORATION               | 4,853  | 18,07000  | 87,693.71    |  |
| 87236110  | TD AMERITRADE HOLDING CORP              | 3,525  | 19,58000  | 69,019.50    |  |
| 87254010  | TJX COMPANIES INC                       | 11,484 | 28,90000  | 331,887.60   |  |
| 87294110  | MONSTER WORLDWIDE INC                   | 3,580  | 33,46000  | 119,786.80   |  |
| 87538210  | RADIOSHACK CORP                         | 3,697  | 17,47000  | 64,586.59    |  |
| 875943310 | TELEPHONE AND DATA SYSTEMS              | 2,240  | 66,15000  | 148,176.00   |  |
| 875943386 | TELEPHONE & DATA SYSTEM INC-SPECIAL SHS | 684    | 61,00000  | 41,724.00    |  |
| 87596410  | TELLABS INC                             | 12,722 | 6,74000   | 85,746.28    |  |
| 87596810  | TEMPLE-INLAND INC                       | 3,125  | 32,52000  | 101,625.00   |  |
| 88077910  | TEREX CORP                              | 2,820  | 63,49000  | 179,041.80   |  |
| 88160910  | TESORO CORP                             | 3,810  | 47,87000  | 182,384.70   |  |
| 88250810  | TEXAS INSTRUMENTS INC                   | 39,867 | 33,29000  | 1,327,172.43 |  |
| 88320310  | TEXTRON INC                             | 6,716  | 71,15000  | 477,843.40   |  |
| 88355610  | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC            | 12,144 | 57,28000  | 695,608.32   |  |
| 88654710  | TIFFANY & CO                            | 3,655  | 44,93000  | 164,219.15   |  |
| 88706110  | TIH HORTONS INC                         | 5,114  | 38,38000  | 196,275.32   |  |
| 88732110  | TIME WARNER CABLE INC                   | 4,780  | 26,23000  | 125,379.40   |  |
| 88947810  | TOLL BROTHERS INC                       | 4,516  | 20,80000  | 93,932.80    |  |
| 89102710  | TORCHMARK CORP                          | 2,581  | 60,30000  | 155,634.30   |  |
| 89595310  | YUM! BRANDS INC                         | 14,374 | 38,39000  | 551,817.86   |  |
| 90212410  | TYCO INTERNATIONAL LTD                  | 13,875 | 41,64000  | 577,755.00   |  |
| 90249410  | TYSON FOODS INC                         | 8,021  | 14,41000  | 115,582.61   |  |
| 90290582  | MARATHON OIL CORPORATION                | 19,942 | 58,32000  | 1,163,017.44 |  |
| 90291110  | UST INC                                 | 2,090  | 57,93000  | 121,073.70   |  |
| 90297310  | US BANCORP                              | 48,161 | 32,68000  | 1,573,901.48 |  |
| 90298410  | IAC/INTERACTIVECORP                     | 5,337  | 26,87000  | 143,405.19   |  |
| 90319210  | UNUM GROUP                              | 9,803  | 23,38000  | 229,194.14   |  |
| 90337110  | UNITED STATES STEEL CORP                | 3,197  | 108,73000 | 347,609.81   |  |
| 90390010  | SLM CORP                                | 11,167 | 26,69000  | 288,047.23   |  |
| 90391410  | ULTRA PETROLEUM CORP                    | 4,214  | 69,44000  | 292,620.16   |  |
| 90781810  | UNION PACIFIC CORP                      | 7,069  | 130,56000 | 922,928.64   |  |
| 90890610  | UNIONBANCAL CORPORATION                 | 1,641  | 50,38000  | 82,673.58    |  |
| 91058110  | UNITEDHEALTH GROUP INC                  | 36,960 | 56,73000  | 2,096,740.80 |  |
| 91131210  | UNITED PARCEL SERVICE INC-CL B          | 19,022 | 72,61000  | 1,381,187.42 |  |
| 91301710  | UNITED TECHNOLOGIES CORP                | 26,285 | 76,69000  | 2,015,796.65 |  |
| 91820410  | VF CORP                                 | 2,255  | 70,22000  | 158,346.10   |  |
| 91913110  | VALERO ENERGY CORPORATION               | 15,347 | 66,65000  | 1,022,877.55 |  |
| 92220P10  | VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC              | 3,929  | 51,29000  | 201,518.41   |  |
| 92343E10  | VERISIGN INC                            | 6,720  | 36,31000  | 244,003.20   |  |
| 92552430  | VIACOM INC-CLASS B                      | 16,828 | 42,77000  | 719,733.56   |  |
| 92916010  | VULCAN MATERIALS CO                     | 2,843  | 81,43000  | 231,505.49   |  |
| 93114210  | WAL-MART STORES INC                     | 68,772 | 47,63000  | 3,275,610.36 |  |
| 93142210  | WALSHINGTON MUTUAL INC                  | 27,717 | 36,59000  | 1,014,165.03 |  |
| 93922110  | THE WASHINGTON POST COMPANY             | 23,962 | 15,15000  | 363,024.30   |  |
| 93984010  | WASTE MANAGEMENT INC                    | 177    | 776,30000 | 137,405.10   |  |
| 94106110  | WATERS CORP                             | 13,609 | 33,27000  | 452,771.43   |  |
| 94184810  | WEATHERFORD INTERNATIONAL LTD           | 2,911  | 80,07000  | 233,083.77   |  |
| 94707410  | WELLS FARGO & COMPANY                   | 9,517  | 65,12000  | 619,747.04   |  |
| 94974610  | WENDY'S INTERNATIONAL INC               | 90,169 | 30,07000  | 2,711,381.83 |  |
| 95059010  | WESTERN DIGITAL CORP                    | 3,206  | 26,86000  | 86,113.16    |  |
| 95810210  | WESTERN UNION CO/THE                    | 6,275  | 29,75000  | 186,681.25   |  |
| 95980210  | WEYERHAEUSER CO                         | 20,876 | 23,66000  | 493,926.16   |  |
| 96216610  | WHIRLPOOL CORP                          | 5,915  | 72,49000  | 428,778.35   |  |
| 9632010   | WHOLE FOODS MARKET INC                  | 1,954  | 81,29000  | 158,840.66   |  |
| 96683710  |   | 3,930  | 40,58000  | 159,479.40   |  |

|            |                               |           |           |                  |  |
|------------|-------------------------------|-----------|-----------|------------------|--|
| 96945710   | THE WILLIAMS COMPANIES INC    | 16,454    | 35,01000  | 576,064.54       |  |
| 96990410   | WILLIAMS-SONOMA INC           | 2,647     | 26,28000  | 69,563.16        |  |
| 97428010   | WINDSTREAM CORPORATION        | 6,275     | 13,27000  | 83,269.25        |  |
| 97665710   | WISCONSIN ENERGY CORP         | 3,537     | 48,86000  | 172,817.82       |  |
| 98252610   | WM WRIGLEY JR COMPANY         | 5,476     | 60,64000  | 332,064.64       |  |
| 98310H10   | WYNDHAM WORLDWIDE CORP        | 4,839     | 25,20000  | 121,942.80       |  |
| 98313410   | WYNN RESORTS LIMITED          | 1,560     | 117,87000 | 183,877.20       |  |
| 98385X10   | XTO ENERGY INC                | 11,171    | 52,49000  | 586,365.79       |  |
| 98385X10-1 | XTO ENERGY INC (新)            | 2,536     | 52,49000  | 133,114.64       |  |
| 98391910   | XILLINX INC                   | 8,830     | 22,11000  | 195,231.30       |  |
| 98412110   | XEROX CORP                    | 24,236    | 16,17000  | 391,896.12       |  |
| 98433210   | YAHOO! INC                    | 33,935    | 24,06000  | 816,476.10       |  |
| 98956P10   | ZIMMER HOLDINGS INC           | 6,277     | 67,48000  | 423,571.96       |  |
| 98970110   | ZIONS BANCORPORATION          | 2,877     | 49,87000  | 143,475.99       |  |
| 99900000   | FLEXTRONICS INTERNATIONAL LTD | 22,876    | 11,55000  | 284,217.80       |  |
| G0070K10   | ACE LTD                       | 9,188     | 59,51000  | 546,777.88       |  |
| G0892U10   | AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD     | 3,895     | 39,50000  | 153,862.50       |  |
| G1696210   | BUNGE LIMITED                 | 3,452     | 115,59000 | 399,016.68       |  |
| G2552X10   | COVIDIEN LTD                  | 13,970    | 43,90000  | 613,283.00       |  |
| G3223R10   | EVEREST RE GROUP LTD          | 1,739     | 101,67000 | 176,804.13       |  |
| G3653513   | FOSTER WHEELER LTD            | 1,905     | 159,80000 | 304,419.00       |  |
| G3726010   | GARMIN LTD                    | 3,195     | 104,04000 | 332,407.80       |  |
| G4918T10   | INVESCO LTD                   | 11,207    | 28,27000  | 316,821.89       |  |
| G5876H10   | MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD  | 13,269    | 14,39000  | 190,940.91       |  |
| G6852T10   | PARTNERRE LTD                 | 1,617     | 80,26000  | 129,780.42       |  |
| G7496G10   | RENAISSANCE HOLDINGS LTD      | 1,982     | 61,15000  | 119,976.30       |  |
| G7945J10   | SEAGATE TECHNOLOGY            | 14,384    | 27,52000  | 395,847.68       |  |
| G9007810   | TRANSOCEAN INC                | 8,700     | 136,00000 | 1,183,200.00     |  |
| G9144P10   | TYCO ELECTRONICS LTD          | 13,780    | 36,54000  | 503,521.20       |  |
| G9665610   | WILLIS TOWERS WATSON LTD      | 3,960     | 37,41000  | 148,143.60       |  |
| G9825510   | XL CAPITAL LTD -CLASS A       | 4,471     | 52,46000  | 234,548.66       |  |
| V7780T10   | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD   | 4,098     | 41,24000  | 169,001.52       |  |
| アメリカドル 計   |                               | 8,475,963 |           | 388,663,275.99   |  |
| (邦貨換算額)    |                               |           |           | (41,784,295,701) |  |

外国株式(カナダドル)

| 銘柄    | 株数     | 評価額      |              | 備考 |
|-------|--------|----------|--------------|----|
|       |        | 単価       | 金額           |    |
| ABX   | 24,024 | 38,56000 | 926,365.44   |    |
| ABZ   | 2,045  | 34,39000 | 70,327.55    |    |
| ACE/A | 2,445  | 28,10000 | 68,704.50    |    |
| ACM/A | 2,140  | 44,55000 | 95,337.00    |    |
| AGE   | 3,565  | 48,48000 | 172,831.20   |    |
| AGU   | 3,720  | 58,97000 | 219,368.40   |    |
| ATD/B | 4,805  | 18,04000 | 86,682.20    |    |
| AXC   | 615    | 42,75000 | 26,291.25    |    |
| BBD/B | 39,486 | 5,90000  | 232,967.40   |    |
| BCE   | 7,640  | 38,60000 | 294,904.00   |    |
| BMO   | 13,996 | 58,11000 | 813,307.56   |    |
| BNS   | 13,617 | 37,30000 | 507,914.10   |    |
| BNS   | 27,404 | 51,41000 | 1,408,839.64 |    |
| BPO   | 6,254  | 20,58000 | 128,707.32   |    |
| BVF   | 3,909  | 14,67000 | 57,345.03    |    |
| CAE   | 7,695  | 12,94000 | 99,573.30    |    |
| COO   | 9,997  | 36,82000 | 368,089.54   |    |
| CLS   | 4,350  | 5,82000  | 25,317.00    |    |
| CN    | 9,415  | 73,60000 | 692,944.00   |    |
| CNO   | 15,147 | 69,70000 | 1,055,745.90 |    |
| CNR   | 13,749 | 49,20000 | 676,450.80   |    |

|        |  |        |           |              |
|--------|--|--------|-----------|--------------|
| CPZ    | CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD             | 4,040  | 65,32000  | 263,892.80   |
| CSN    | COGNOS INC                               | 2,300  | 58,44000  | 134,412.00   |
| CTR/A  | CANADIAN TIRE CORPORATION LIMITED - CL A | 1,975  | 71,00000  | 140,225.00   |
| CU     | CANADIAN UTILITIES LTD-A                 | 1,425  | 47,50000  | 67,687.50    |
| ECA    | ENCANA CORP                              | 21,013 | 68,86000  | 1,446,955.18 |
| ELD    | ELDORADO GOLD CORP                       | 7,795  | 5,48000   | 42,716.60    |
| ENB    | ENBRIDGE INC                             | 9,190  | 38,42000  | 353,079.80   |
| ESI    | ENERSIS ENERGY SERVICES INC              | 3,695  | 15,10000  | 55,794.50    |
| FFH    | FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD           | 492    | 303,49000 | 149,317.08   |
| FM     | FIRST QUANTUM MINERALS LTD               | 1,825  | 85,98000  | 156,913.50   |
| FTS    | FORTIS INC                               | 4,800  | 27,84000  | 133,632.00   |
| FTT    | FINNING INTERNATIONAL INC                | 5,075  | 29,20000  | 148,190.00   |
| G      | GOLDCORP INC                             | 19,622 | 32,76000  | 642,816.72   |
| GIB/A  | GCI GROUP INC                            | 9,350  | 11,59000  | 108,366.50   |
| GIL    | GILDAN ACTIVEWEAR INC                    | 3,445  | 41,48000  | 142,898.60   |
| GNO    | GREAT WEST LIFE CO INC                   | 7,039  | 35,79000  | 251,925.81   |
| HSE    | HUSKY ENERGY INC                         | 7,214  | 43,09000  | 310,851.26   |
| IGI    | IGM FINANCIAL INC                        | 3,100  | 51,10000  | 158,410.00   |
| IWN    | INMET MINING CORP                        | 1,140  | 81,50000  | 92,910.00    |
| IWO    | IMPERIAL OIL LTD                         | 8,567  | 53,19000  | 455,678.73   |
| IWN    | IVANHOE MINES LTD                        | 6,975  | 10,30000  | 71,842.50    |
| K      | KINROSS GOLD CORP                        | 15,718 | 17,50000  | 275,065.00   |
| L      | LOBLAW COMPANIES LTD                     | 3,564  | 31,42000  | 111,980.88   |
| LUN    | LUNDIN MINING CORP                       | 7,620  | 9,26000   | 70,561.20    |
| MDS    | MDS INC                                  | 4,622  | 19,49000  | 90,082.78    |
| MFC    | MANULIFE FINANCIAL CORP                  | 43,191 | 41,01000  | 1,771,262.91 |
| MGA    | MAGNA INTERNATIONAL INC-CL A             | 2,917  | 80,03000  | 233,447.51   |
| MIM    | MIR DEBLOPMENTS INC-W/I CL A             | 1,305  | 29,82000  | 38,915.10    |
| MNG    | MERIDIAN GOLD INC                        | 2,526  | 35,48000  | 89,622.48    |
| MRU/A  | METRO INC-A                              | 1,280  | 26,76000  | 34,252.80    |
| MX     | METHANEX CORPORATION                     | 3,335  | 28,17000  | 93,946.95    |
| NA     | NATIONAL BANK OF CANADA                  | 4,340  | 53,29000  | 231,278.60   |
| NCX    | NOVA CHEMICALS CORPORATION               | 2,830  | 33,40000  | 94,522.00    |
| NKO    | NIKO RESOURCES LTD                       | 1,295  | 87,99000  | 113,947.05   |
| NT     | NORTEL NETWORKS CORP                     | 11,775 | 16,37000  | 192,756.75   |
| NYX    | NEXEN INC                                | 12,260 | 29,36000  | 359,953.60   |
| OCX    | ONEX CORPORATION                         | 3,280  | 35,36000  | 115,980.80   |
| OPC    | OPTI CANADA INC                          | 5,710  | 17,03000  | 97,241.30    |
| PAA    | PAN AMERICAN SILVER CORP                 | 2,360  | 31,98000  | 75,472.80    |
| PCA    | PETRO-CANADA                             | 13,185 | 51,68000  | 681,400.80   |
| PD     | PRECISION DRILLING TRUST                 | 1,780  | 15,75000  | 28,035.00    |
| POT    | POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC          | 8,924  | 127,88000 | 1,141,201.12 |
| POW    | POWIER CORP OF CANADA                    | 9,450  | 40,80000  | 385,560.00   |
| PIWF   | POWER FINANCIAL CORPORATION              | 6,485  | 41,50000  | 269,127.50   |
| RBA    | RITICHE BROS AUCTIONEERS INC             | 1,185  | 78,73000  | 93,295.05    |
| RCT/B  | ROGERS COMMUNICATIONS INC-CL B           | 13,505 | 43,74000  | 590,708.70   |
| RIM    | RESEARCH IN MOTION                       | 14,023 | 107,76000 | 1,511,118.48 |
| RON    | RONA INC                                 | 2,965  | 16,97000  | 50,316.05    |
| RY     | ROYAL BANK OF CANADA                     | 35,689 | 51,57000  | 1,840,481.73 |
| SAP    | SAPUTO INC                               | 2,240  | 29,00000  | 64,960.00    |
| SAP -1 | SAPUTO INC(新)                            | 2,240  | 29,00000  | 64,960.00    |
| SC     | SHOPPERS DRUG MART CORP                  | 5,015  | 53,70000  | 269,305.50   |
| SHER   | SHERRITT INTERNATIONAL CORP              | 6,315  | 14,25000  | 89,988.75    |
| SJRB   | SHAW COMMUNICATIONS INC-B                | 9,785  | 24,68000  | 241,493.80   |
| SLC    | SUN LIFE FINANCIAL INC                   | 15,854 | 55,45000  | 879,104.30   |
| SNC    | SNC-LAVALIN GROUP INC                    | 4,065  | 48,31000  | 196,380.15   |
| SU     | SUNCOR ENERGY INC                        | 12,874 | 105,34000 | 1,356,147.16 |
| T      | TELLUS CORP                              | 1,440  | 44,90000  | 64,656.00    |

|         |                              |         |          |                 |
|---------|------------------------------|---------|----------|-----------------|
| T/A     | TELLUS CORPORATION -NON VOTE | 4,348   | 43,71000 | 190,051.08      |
| TA      | TRANSALTA CORP               | 5,855   | 33,45000 | 195,849.75      |
| TCW     | TRICAN WELL SERVICE LTD      | 3,155   | 17,47000 | 55,117.85       |
| TD      | TORONTO-DOMINION BANK        | 10,200  | 72,50000 | 739,500.00      |
| TEK/B   | TECK COMINCO LIMITED-CL B    | 11,345  | 35,90000 | 407,285.50      |
| TLM     | TALISMAN ENERGY INC          | 27,342  | 18,20000 | 487,624.40      |
| TOC     | THOMSON CORP                 | 6,019   | 39,06000 | 235,102.14      |
| TRE     | SINO-FOREST CORP             | 4,035   | 19,28000 | 77,794.80       |
| TRP     | TRANSCANADA CORP             | 14,138  | 39,41000 | 557,178.58      |
| UUU     | URANIUM ONE INC              | 6,125   | 8,65000  | 52,981.25       |
| VN      | GEORGE WESTON LTD            | 1,522   | 50,50000 | 76,861.00       |
| X       | TSX GROUP INC                | 2,040   | 52,08000 | 106,243.20      |
| YRI     | YAMANA GOLD INC              | 11,605  | 12,80000 | 148,544.00      |
| カナダドル 計 |                              | 750,771 |          | 30,605,193.36   |
|         | (邦貨換算額)                      |         |          | (3,405,439,865) |

外国株式（オーストラリアドル） (単位：株、オーストラリアドル)

| 銘柄    | 株数  | 評価額    |          | 備考           |  |
|-------|---|--------|----------|--------------|--|
|       |   | 単価     | 金額       |              |  |
| ABS   | ABC LEARNING CENTRES LTD                    | 15,430 | 5,15000  | 79,464.50    |  |
| AGK   | AGL ENERGY LTD                              | 13,450 | 13,13000 | 176,598.50   |  |
| AIO   | ASCIANO GROUP                               | 16,165 | 7,68000  | 124,147.20   |  |
| ALL   | ARISTOCRAT LEISURE LTD                      | 8,975  | 11,15000 | 100,071.25   |  |
| AMC   | AMCOR LTD                                   | 28,660 | 6,95000  | 199,187.00   |  |
| AMP   | AMP LIMITED                                 | 50,607 | 10,10000 | 511,130.70   |  |
| ANZ   | AUSTRALIA AND NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD | 48,837 | 27,60000 | 1,347,901.20 |  |
| ASX   | ASX LTD                                     | 4,875  | 58,80000 | 286,650.00   |  |
| BBS   | BILLABONG INTERNATIONAL LTD                 | 5,030  | 14,57000 | 73,287.10    |  |
| BHP   | BHP BILLITON LTD                            | 90,186 | 42,05000 | 3,792,321.30 |  |
| BLY   | BOART LONGYEAR GROUP                        | 35,145 | 2,21000  | 77,670.45    |  |
| BNB   | BARCOCK & BROWN LTD                         | 6,655  | 27,42000 | 182,480.10   |  |
| BOR   | BORAL LIMITED                               | 18,930 | 6,24000  | 118,123.20   |  |
| BSL   | BLUESCOPE STEEL LIMITED                     | 20,396 | 9,48000  | 193,354.08   |  |
| BXBAU | BRAMBLES LTD                                | 37,983 | 11,70000 | 444,401.10   |  |
| CBA   | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA              | 34,947 | 60,74000 | 2,122,680.78 |  |
| CCL   | COCA-COLA AMATIL LIMITED                    | 18,620 | 9,99000  | 186,013.80   |  |
| CGF   | CHALLENGER FINANCIAL SERVICE GROUP LIMITED  | 11,110 | 5,64000  | 62,660.40    |  |
| COH   | COCHLEAR LIMITED                            | 1,742  | 73,78000 | 128,524.76   |  |
| CPU   | COMPUTERSHARE LIMITED                       | 14,690 | 10,34000 | 151,894.60   |  |
| CSL   | CSL LIMITED                                 | 14,727 | 35,87000 | 528,257.49   |  |
| CSR   | CSR LIMITED                                 | 31,278 | 2,99000  | 93,521.22    |  |
| CTX   | CALTEX AUSTRALIA LIMITED                    | 4,880  | 20,10000 | 98,088.00    |  |
| CWN   | CROWN LTD                                   | 13,100 | 13,67000 | 179,077.00   |  |
| DOW   | DOWNER EDI LIMITED                          | 3,460  | 5,42000  | 18,753.20    |  |
| FBG   | FOSTER'S GROUP LTD                          | 54,775 | 6,25000  | 342,343.75   |  |
| FIG   | FORTESCUE METALS GROUP LTD                  | 3,355  | 62,50000 | 209,687.50   |  |
| FAJ   | FAIRFAX MEDIA LTD                           | 38,370 | 4,75000  | 182,257.50   |  |
| GFF   | GOODMAN FIELDER LTD                         | 33,675 | 1,87000  | 62,972.25    |  |
| HVN   | HARVEY NORIAN HOLDINGS LTD                  | 16,110 | 6,94000  | 111,803.40   |  |
| JHX   | JAMES HARDIE INDUSTRIES NW                  | 16,765 | 6,52000  | 109,307.80   |  |
| LEI   | LEIGHTON HOLDINGS LIMITED                   | 3,917  | 63,40000 | 248,337.80   |  |
| LLC   | LEND LEASE CORP LIMITED                     | 10,322 | 18,90000 | 195,085.80   |  |
| LNN   | LION NATHAN LIMITED                         | 12,460 | 9,08000  | 113,136.80   |  |
| MAP   | MACQUARIE AIRPORTS                          | 22,500 | 4,16000  | 93,600.00    |  |
| IMAY  | SYMBION HEALTH LTD                          | 7,255  | 4,04000  | 29,310.20    |  |
| MBL   | MACQUARIE GROUP LIMITED                     | 6,936  | 80,08000 | 555,434.88   |  |
| MIG   | MACQUARIE INFRASTRUCTURE GROUP              | 71,247 | 3,28000  | 233,690.16   |  |

| 銘柄                               | 株数        | 単価        | 金額              | 備考 |
|----------------------------------|-----------|-----------|-----------------|----|
| NAB NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD  | 43,833    | 38.45000  | 1,685,378.85    |    |
| NCM NENECREST MINING LIMITED     | 12,084    | 33.25000  | 401,793.00      |    |
| NMH AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS    | 25,900    | 7.71000   | 199,689.00      |    |
| NRM INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT | 48,783    | 4.33000   | 211,230.39      |    |
| ORG ORIGIN ENERGY LIMITED        | 26,195    | 8.85000   | 231,825.75      |    |
| ORI ORICA LTD                    | 8,290     | 31.98000  | 265,114.20      |    |
| OST ONESTEEL LIMITED             | 21,050    | 6.16000   | 129,668.00      |    |
| OKR OXIANA LTD                   | 36,405    | 3.80000   | 138,339.00      |    |
| PON PALADIN ENERGY LTD           | 15,115    | 6.67000   | 100,817.05      |    |
| PPT PERPETUAL LTD                | 1,530     | 66.00000  | 100,980.00      |    |
| QAN QANTAS AIRWAYS LIMITED       | 25,080    | 5.82000   | 145,965.60      |    |
| QBE QBE INSURANCE GROUP LIMITED  | 22,360    | 32.35000  | 723,346.00      |    |
| RIO RIO TINTO LIMITED            | 7,355     | 137.24000 | 1,009,400.20    |    |
| SGB ST GEORGE BANK LTD           | 7,000     | 35.16000  | 246,120.00      |    |
| SHL SONIC HEALTHCARE LTD         | 11,115    | 16.54000  | 183,842.10      |    |
| STO SANTOS LTD                   | 16,800    | 14.17000  | 238,056.00      |    |
| SUN SUNCORP-METWAY LIMITED       | 24,195    | 18.48000  | 447,123.60      |    |
| TAH TABCORP HOLDINGS LIMITED     | 13,025    | 14.99000  | 195,244.75      |    |
| TLS TELSTRA CORP LTD             | 95,574    | 4.71000   | 450,153.54      |    |
| TOL TOLL HOLDINGS LIMITED        | 15,455    | 13.06000  | 201,842.30      |    |
| TTS TATS GROUP LTD               | 33,415    | 3.96000   | 132,323.40      |    |
| WBC WESTPAC BANKING CORPORATION  | 48,499    | 29.00000  | 1,406,471.00    |    |
| WES WESFARMERS LIMITED           | 14,798    | 41.54000  | 614,708.92      |    |
| WESN WESFARMERS LTD-PPS          | 4,307     | 41.70000  | 179,601.90      |    |
| WMC WMC ALUMINA LIMITED          | 31,650    | 6.21000   | 196,546.50      |    |
| WOR WORLEYPARSONS LTD            | 4,315     | 50.91000  | 219,676.65      |    |
| WOW WOOLWORTHS LIMITED           | 31,582    | 34.66000  | 1,094,632.12    |    |
| WPL WOODSIDE PETROLEUM LTD       | 12,658    | 47.61000  | 602,647.38      |    |
| ZFX ZINIFEX LTD                  | 14,505    | 14.05000  | 203,795.25      |    |
| オーストラリアドル 計                      | 1,520,438 |           | 25,719,559.22   |    |
| (邦貨換算額)                          |           |           | (2,520,773,989) |    |

外国株式 (イギリスポンド)

| 銘柄                                | 株数      | 評価額      |              | 備考 |
|-----------------------------------|---------|----------|--------------|----|
|                                   |         | 単価       | 金額           |    |
| AAL ANGLo AMERICAN PLC            | 36,979  | 30.72000 | 1,135,994.88 |    |
| ABF ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC  | 4,685   | 8.72000  | 40,853.20    |    |
| AGK AGGREGO PLC                   | 5,525   | 4.59750  | 25,401.18    |    |
| AL/ ALLIANCE & LEICESTER          | 5,090   | 6.95000  | 35,375.50    |    |
| AMEC AMEC PLC                     | 9,640   | 8.10000  | 78,084.00    |    |
| ANITo ANTOFAGASTA PLC             | 5,185   | 7.02500  | 36,424.62    |    |
| ARI ARRIVA PLC                    | 4,275   | 7.61500  | 32,554.12    |    |
| ARM ARM HOLDINGS PLC              | 35,935  | 1.27250  | 45,727.28    |    |
| AZN AZRATENACA PLC                | 41,333  | 22.69000 | 937,845.77   |    |
| BA BAE SYSTEMS PLC                | 98,035  | 4.55000  | 446,059.25   |    |
| BATS BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 42,508  | 19.02000 | 808,502.16   |    |
| BAW BRITISH AIRWAYS PLC           | 16,785  | 3.20250  | 53,753.96    |    |
| BBA BBA AVIATION PLC              | 8,888   | 1.97000  | 17,509.36    |    |
| BGS BARCLAYS PLC                  | 190,526 | 5.31500  | 1,012,645.69 |    |
| BOEV BARRATT DEVELOPMENTS PLC     | 7,539   | 4.72250  | 35,602.92    |    |
| BG BG GROUP PLC                   | 93,919  | 10.91000 | 1,024,656.29 |    |
| BGY BRITISH ENERGY GROUP PLC      | 28,380  | 5.41000  | 153,535.80   |    |
| BICC BALFOUR BEATTY PLC           | 11,380  | 4.99750  | 56,871.55    |    |
| BIFF BIFFA PLC                    | 7,548   | 3.23250  | 24,396.91    |    |
| BKG BERKELEY GROUP HOLDINGS PLC   | 2,781   | 12.66000 | 35,207.46    |    |
| BLT BHP BILLITON PLC              | 64,256  | 15.45000 | 992,755.20   |    |
| BNZL BNZL PLC                     | 10,316  | 6.87500  | 70,922.50    |    |
| BP BP PLC                         | 529,978 | 6.17500  | 3,272,614.15 |    |
| BRBY BURBERRY GROUP PLC           | 11,944  | 5.79500  | 69,215.48    |    |

| 銘柄                                     | 株数      | 単価       | 金額           | 備考 |
|--|---------|----------|--------------|----|
| BRT RESOLUTION PLC                     | 19,263  | 7.10000  | 136,767.30   |    |
| BSY BRITISH SKY BROADCASTING GROUP PLC | 30,989  | 6.08500  | 188,588.06   |    |
| BT BT GROUP PLC                        | 225,887 | 2.85000  | 643,777.95   |    |
| BVS BOVIS HOMES GROUP PLC              | 2,602   | 6.43000  | 16,730.86    |    |
| CBG CLOSE BROTHERS GROUP PLC           | 2,858   | 9.50500  | 27,165.29    |    |
| CBRY CADBURY SCHWEPES PLC              | 56,978  | 6.09500  | 347,280.91   |    |
| CGU AVIVA PLC                          | 72,435  | 6.73500  | 487,849.72   |    |
| CHTR CHARTER PLC                       | 3,595   | 7.92500  | 28,490.37    |    |
| CKSN COOKSON GROUP PLC                 | 4,175   | 6.88000  | 28,724.00    |    |
| CNA CENTRICA PLC                       | 97,660  | 3.71000  | 362,318.60   |    |
| COB COBHAM PLC                         | 30,950  | 1.93000  | 67,453.50    |    |
| CPG COMPASS GROUP PLC                  | 52,978  | 3.18500  | 168,734.93   |    |
| CPI CAPITA GROUP PLC                   | 17,084  | 6.67000  | 113,950.28   |    |
| CPW CARPHONE WAREHOUSE GROUP           | 10,140  | 3.29750  | 33,436.65    |    |
| CSR CSR PLC                            | 2,810   | 6.12500  | 17,211.25    |    |
| CTT CATTLES PLC                        | 7,830   | 2.90500  | 22,746.15    |    |
| CW CABLE & WIRELESS PLC                | 67,226  | 1.88500  | 126,721.01   |    |
| DGE DIAGEO PLC                         | 73,257  | 10.58000 | 775,059.06   |    |
| DLAR DE LA RUE PLC                     | 3,234   | 9.25000  | 29,914.50    |    |
| DNGT DAILY MAIL&GENERAL TRUST-A NV     | 11,040  | 5.04500  | 55,696.80    |    |
| DVSG DAVIS SERVICE GROUP PLC           | 3,667   | 5.12000  | 18,775.04    |    |
| DXN DSG INTERNATIONAL PLC              | 55,480  | 1.03900  | 57,643.72    |    |
| ECM ELECTROCOMPONENTS PLC              | 9,395   | 2.10250  | 19,752.98    |    |
| EMA EMAP PLC                           | 7,640   | 7.58500  | 57,949.40    |    |
| ENG MAN GROUP PLC                      | 43,116  | 5.74500  | 247,701.42   |    |
| ETI ENTERPRISE INNS PLC                | 14,723  | 4.96500  | 73,089.69    |    |
| EXPN EXPERIAN GROUP LTD                | 26,863  | 3.87500  | 104,055.37   |    |
| FGP FIRSTGROUP PLC                     | 12,250  | 7.28000  | 89,180.00    |    |
| FPLN FRIENDS PROVIDENT PLC             | 55,899  | 1.60500  | 89,717.89    |    |
| GFS G4S PLC                            | 34,554  | 2.13750  | 73,859.17    |    |
| GKN GKN PLC                            | 21,280  | 2.94500  | 62,669.60    |    |
| GLXO GLAXOSMITHKLINE PLC               | 157,426 | 13.23000 | 2,082,745.98 |    |
| HAS HAYS PLC                           | 45,162  | 1.09250  | 49,339.48    |    |
| HBOS HBOS PLC                          | 104,186 | 7.56000  | 787,646.16   |    |
| HG LADBROKES PLC                       | 18,322  | 3.11000  | 56,981.42    |    |
| HOME HOME RETAIL GROUP                 | 23,703  | 3.30000  | 78,219.90    |    |
| HSBA HSBC HOLDINGS PLC                 | 327,291 | 8.39000  | 2,745,971.49 |    |
| IAP ICAP PLC                           | 15,680  | 6.94500  | 108,897.60   |    |
| ICI IMPERIAL CHEMICAL INDUSTRIES PLC   | 32,571  | 6.70500  | 218,388.55   |    |
| IHG INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP      | 8,487   | 9.31000  | 79,013.97    |    |
| III 3I GROUP PLC                       | 10,621  | 10.18000 | 108,121.78   |    |
| IMI IMI PLC                            | 8,500   | 4.28250  | 36,401.25    |    |
| IMT IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC         | 18,372  | 25.77000 | 473,446.44   |    |
| INCH INCHCAPE PLC                      | 13,700  | 3.75000  | 51,375.00    |    |
| INVP INVESTEC PLC                      | 11,815  | 4.81000  | 56,830.15    |    |
| ITRK INTERTEK GROUP PLC                | 3,378   | 9.64000  | 32,563.92    |    |
| ITV ITV PLC                            | 117,458 | 0.85200  | 100,074.21   |    |
| JMAT JOHNSON MATTHEY PLC               | 5,944   | 16.97000 | 100,869.68   |    |
| KAZ KAZAKHIMS PLC                      | 2,765   | 13.10000 | 36,221.50    |    |
| KEL Kelda GROUP PLC                    | 7,960   | 10.71000 | 85,251.60    |    |
| KESA KESA ELECTRICALS PLC              | 16,418  | 2.34500  | 38,500.21    |    |
| KGF KINGFISHER PLC                     | 58,727  | 1.54600  | 90,791.94    |    |
| LGEN LEGAL & GENERAL GROUP PLC         | 167,531 | 1.30200  | 218,125.36   |    |
| LLOY LLOYDS TSB GROUP PLC              | 157,450 | 4.76500  | 750,249.25   |    |
| LMI LOWMIN PLC                         | 2,050   | 30.29000 | 62,094.50    |    |
| LOG LOGICA PLC                         | 44,442  | 1.17750  | 52,330.45    |    |
| LSE LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC    | 4,588   | 18.36000 | 84,235.68    |    |
| MAB MITCHELLS&BUTLERS PLC              | 11,367  | 4.78750  | 54,419.51    |    |
| MGGT MEGGITT PLC                       | 19,555  | 3.09500  | 60,522.72    |    |

|      |  |           |          |              |
|------|--|-----------|----------|--------------|
| MKS  | MARKS & SPENCER GROUP PLC                | 45,005    | 5,69500  | 256,303.47   |
| MNDI | MONDI PLC                                | 10,278    | 4,10000  | 42,139.80    |
| MRW  | WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC        | 31,756    | 3,18250  | 101,060.28   |
| NEX  | NATIONAL EXPRESS GROUP PLC               | 4,085     | 10,94000 | 44,799.30    |
| NGG  | NATIONAL GRID PLC                        | 71,715    | 8,42000  | 603,840.30   |
| NPW  | INTERNATIONAL POWER PLC                  | 41,310    | 4,56500  | 188,580.15   |
| NXT  | NEXT PLC                                 | 5,842     | 16,77000 | 97,970.34    |
| OML  | OLD MUTUAL PLC                           | 145,755   | 1,71200  | 249,532.56   |
| POC  | CARNIVAL PLC                             | 4,505     | 21,86000 | 98,479.30    |
| PRTY | PARTYGAMING PLC                          | 4,245     | 0,30250  | 1,284.11     |
| PRU  | PRUDENTIAL PLC                           | 69,237    | 6,88000  | 476,350.56   |
| PSN  | PERSONAL FINANCIAL SERVICES PLC          | 7,494     | 7,80000  | 58,453.20    |
| PSON | PEARSON PLC                              | 22,314    | 7,08500  | 158,094.69   |
| PUB  | PUNCH TAVERNS PLC                        | 6,995     | 7,86500  | 55,015.67    |
| RE/  | RECKITT BENCKISER GROUP PLC              | 16,835    | 29,44000 | 495,622.40   |
| REBS | ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC         | 280,293   | 4,39000  | 1,230,486.27 |
| RDSA | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS              | 101,343   | 20,18000 | 2,045,101.74 |
| RDSB | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS              | 76,974    | 19,96000 | 1,536,401.04 |
| REED | REED ELSEVIER PLC                        | 33,906    | 6,40500  | 217,167.93   |
| REX  | REXAM PLC                                | 21,370    | 4,24000  | 90,608.80    |
| RIO  | RIO TINTO PLC                            | 27,803    | 51,76000 | 1,439,083.28 |
| RNK  | RANK GROUP PLC                           | 3,391     | 0,98000  | 3,323.18     |
| RR   | ROLLS-ROYCE GROUP PLC                    | 49,845    | 5,16000  | 257,200.20   |
| RBBB | ROLLS-ROYCE GROUP-B SHR ENT              | 1,924,454 | 0,00100  | 1,924.45     |
| RSA  | ROYAL & SUN ALLIANCE INSURANCE GROUP PLC | 88,967    | 1,46800  | 130,603.55   |
| RTOL | RENTOKIL INITIAL PLC                     | 54,528    | 1,18200  | 64,452.09    |
| RTRS | REUTERS GROUP PLC                        | 25,900    | 6,10500  | 158,119.50   |
| SAB  | SAB MILLER PLC                           | 24,006    | 3,04000  | 313,038.24   |
| SBRY | J SAINSBURY PLC                          | 42,241    | 4,38000  | 185,015.58   |
| SCTN | SCOTTISH & NEWCASTLE PLC                 | 22,060    | 7,26500  | 160,265.90   |
| SDR  | SCHROEDERS PLC                           | 3,621     | 13,47000 | 48,774.87    |
| SGC  | STAGECOACH GROUP PLC                     | 16,421    | 2,75750  | 45,280.90    |
| SGL  | SAGE GROUP PLC                           | 38,745    | 2,22000  | 86,013.90    |
| SHR  | SHIRE PLC                                | 7,330     | 11,26000 | 82,535.80    |
| SIG  | SIGNET GROUP PLC                         | 43,348    | 0,66250  | 28,718.05    |
| SL/  | STANDARD LIFE PLC                        | 55,710    | 2,58000  | 143,731.80   |
| SMIN | SMITHS GROUP PLC                         | 10,558    | 10,40000 | 109,803.20   |
| SMU  | SMITH & NEPHEW PLC                       | 26,336    | 5,91000  | 155,645.76   |
| SRP  | SERC GROUP PLC                           | 15,890    | 4,49250  | 71,385.82    |
| SSE  | SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY PLC           | 22,757    | 16,27000 | 370,256.39   |
| STAN | STANDARD CHARTERED PLC                   | 18,790    | 18,96000 | 356,258.40   |
| SVT  | SEVERN TRENT PLC                         | 6,683     | 15,28000 | 102,116.24   |
| TATL | TATE & LYLE PLC                          | 16,201    | 4,24250  | 68,732.74    |
| TCG  | THOMAS COOK GROUP PLC                    | 15,475    | 2,85500  | 44,181.12    |
| TPLR | TULLETT PREBON PLC                       | 1,890     | 4,64500  | 8,779.05     |
| TLW  | TULLOW OIL PLC                           | 18,905    | 6,82500  | 129,026.62   |
| TNI  | TRINITY MIRROK PLC                       | 6,324     | 3,45000  | 21,817.80    |
| TOMK | TOMKINS PLC                              | 29,479    | 1,79750  | 52,988.50    |
| TPK  | TRAVIS PERKINS PLC                       | 3,636     | 12,69000 | 46,140.84    |
| TSCO | TESCO PLC                                | 219,534   | 4,64750  | 1,020,284.26 |
| TT   | TUI TRAVEL PLC                           | 14,700    | 2,70250  | 39,726.75    |
| THOD | TAYLOR WIMPEY PLC                        | 30,757    | 2,07000  | 63,666.99    |
| UBM  | UNITED BUSINESS MEDIA PLC                | 8,998     | 5,89500  | 53,043.21    |
| ULVR | UNILEVER PLC                             | 36,547    | 17,55000 | 641,399.85   |
| UU   | UNITED UTILITIES PLC                     | 23,144    | 7,64500  | 176,936.88   |
| VED  | VEDANTA RESOURCES PLC                    | 1,890     | 21,09000 | 39,860.10    |
| VOD  | VODAFONE GROUP PLC                       | 1,474,025 | 1,83200  | 2,700,413.80 |
| WVH  | WILLIAN HILL PLC                         | 10,670    | 5,11500  | 54,577.05    |

|           |                |           |          |                 |
|-----------|----------------|-----------|----------|-----------------|
| IWS       | WOLSELEY PLC   | 18,496    | 7,30000  | 135,020.80      |
| WPP       | WPP GROUP PLC  | 30,954    | 6,09000  | 188,509.86      |
| WTB       | WHITBREAD PLC  | 5,445     | 13,55000 | 73,779.75       |
| XTA       | XSTRATA PLC    | 17,620    | 35,97000 | 633,791.40      |
| YELL      | YELL GROUP PLC | 23,940    | 3,90500  | 93,485.70       |
| イギリスボンド 計 |                | 9,310,027 |          | 42,362,143.48   |
| (邦貨換算額)   |                |           |          | (9,686,527,728) |

外国株式 (スイスフラン) (単位: 株、スイスフラン)

| 銘柄       | 株数   | 評価額     |             | 備考              |
|----------|--|---------|-------------|-----------------|
|          |  | 単価      | 金額          |                 |
| ABBN     | ABB LTD  | 60,665  | 32,18000    | 1,952,199.70    |
| ADEN     | ADECCO SA-REG  | 3,842   | 61,90000    | 237,819.80      |
| ADLN     | ACTELION LTD   | 2,520   | 52,30000    | 131,796.00      |
| BAER     | JULIUS BAER HOLDING AG   | 2,790   | 96,35000    | 268,816.50      |
| CIBN     | CIBA SPECIALTY CHEMICALS-REG                                       | 2,743   | 54,10000    | 148,396.30      |
| CS       | CREDIT SUISSE GROUP  | 29,390  | 69,95000    | 2,055,830.50    |
| EFNG     | EFG INTERNATIONAL  | 1,155   | 45,50000    | 52,552.50       |
| GEBN     | GEBERT AG-REG  | 1,120   | 158,50000   | 177,520.00      |
| GIVN     | GIVAUDAN-REG   | 209     | 1,069,00000 | 223,421.00      |
| HOL      | HOLCIM LTD-REG   | 5,508   | 124,00000   | 682,992.00      |
| KWI      | KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL AG                                    | 1,635   | 115,00000   | 188,025.00      |
| KUNZ     | KUONI REISEN HLDG-REG(CAT B)                                       | 63      | 610,00000   | 38,430.00       |
| LISP     | LINDT & SPRUENGLI AG   | 20      | 3,940,00000 | 78,800.00       |
| LOGN     | LOGITECH INTERNATIONAL-REG   | 4,730   | 40,30000    | 190,619.00      |
| LONN     | LONZA GROUP AG-REG   | 1,365   | 134,50000   | 183,592.50      |
| NEZS     | NESTLE SA-REGISTERED   | 10,927  | 536,00000   | 5,845,945.00    |
| NOBE     | NOBEL BIOCARE HOLDING AG   | 769     | 314,25000   | 241,658.25      |
| NOVN     | NOVARTIS AG-REG SHS  | 64,705  | 63,60000    | 4,115,238.00    |
| PARG     | PARGESA HOLDING SA-BEARER  | 355     | 127,70000   | 45,333.50       |
| PBHN     | SONOVA HOLDING AG  | 1,405   | 127,60000   | 179,278.00      |
| PSPN     | PSP SWISS PROPERTY AG  | 642     | 58,55000    | 37,589.10       |
| RAN      | SCHWEIZERISCHE LEBENSVERSICHERUNGS-UND REITENANSTALT/SWISS LIFE-RE | 915     | 295,75000   | 270,611.25      |
| RIFZ     | COMPAGNIE FINANCIERE RICHEMONT AG                                  | 14,524  | 76,55000    | 1,111,812.20    |
| RITZ     | RIETER HOLDING AG  | 55      | 531,00000   | 29,205.00       |
| ROCZ     | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN                                       | 19,598  | 201,00000   | 3,939,198.00    |
| RUKZ     | SWISS RE-REG   | 9,449   | 83,25000    | 786,629.25      |
| SCHP     | SCHINDLER HOLDING-PART CERT  | 1,365   | 74,00000    | 101,010.00      |
| SCMZ     | SWISSCOM AG-REG  | 624     | 440,75000   | 275,028.00      |
| SGSN     | SGS SOCIETE GENERALE DE SURVEILLANCE HOLDINGS SA                   | 146     | 1,375,00000 | 200,750.00      |
| STMN     | STRAUMANN HOLDING AG-REG   | 291     | 323,75000   | 94,211.25       |
| SUN      | SULZER AG-REG  | 90      | 1,619,00000 | 145,710.00      |
| SYNN     | SYNGENTA AG  | 2,841   | 280,25000   | 796,190.25      |
| SYST     | SYNTHES INC  | 1,794   | 144,50000   | 259,233.00      |
| UBSZ     | UBS AG-REGISTERED  | 57,807  | 55,25000    | 3,193,836.75    |
| UHR      | SWATCH GROUP AG-B  | 1,015   | 336,25000   | 341,293.75      |
| UHRN     | SWATCH GROUP AG-REG  | 1,345   | 65,90000    | 88,635.50       |
| UNAX     | OC OERLIKON CORP AG  | 155     | 506,50000   | 78,507.50       |
| ZURN     | ZURICH FINANCIAL SERVICES  | 4,056   | 337,75000   | 1,369,914.00    |
| スイスフラン 計 |  | 312,628 |             | 30,157,628.35   |
| (邦貨換算額)  |  |         |             | (2,984,796,443) |

外国株式（スウェーデン・クロナ）

| 銘柄           | 株数      | 評価額       |                 | 備考 |
|--------------|---------|-----------|-----------------|----|
|              |         | 単価        | 金額              |    |
| ALFA         | 2,770   | 382.50000 | 1,059,525.00    |    |
| ASSA         | 9,350   | 133.00000 | 1,243,550.00    |    |
| ATCOA        | 16,745  | 98.00000  | 1,641,010.00    |    |
| ATCOB        | 13,605  | 90.25000  | 1,227,851.25    |    |
| BOL          | 8,425   | 87.75000  | 739,293.75      |    |
| CAST         | 1,590   | 69.25000  | 110,107.50      |    |
| EKTAB        | 860     | 106.50000 | 91,590.00       |    |
| ELUX         | 7,790   | 108.00000 | 841,320.00      |    |
| ENRO         | 3,930   | 64.00000  | 251,520.00      |    |
| GETIB        | 6,510   | 175.00000 | 1,139,250.00    |    |
| HIB          | 12,479  | 387.00000 | 4,829,373.00    |    |
| HUSOB        | 7,145   | 73.25000  | 523,371.25      |    |
| INVEB        | 5,990   | 147.00000 | 880,530.00      |    |
| KLED         | 1,370   | 73.75000  | 101,037.50      |    |
| KLEDIL       | 1,370   | 11.45000  | 15,686.50       |    |
| LNEB         | 403,852 | 16.08000  | 6,493,940.16    |    |
| LUPE         | 7,005   | 71.00000  | 497,355.00      |    |
| MIC          | 860     | 742.00000 | 638,120.00      |    |
| MODO         | 2,005   | 246.50000 | 494,232.50      |    |
| MTGB         | 1,870   | 428.50000 | 801,295.00      |    |
| NBH          | 58,023  | 107.00000 | 6,208,461.00    |    |
| NCOMB        | 9,375   | 130.00000 | 1,218,750.00    |    |
| NOBI         | 3,185   | 57.75000  | 183,933.75      |    |
| ORI          | 865     | 415.50000 | 359,407.50      |    |
| SAND         | 24,525  | 114.50000 | 2,808,112.50    |    |
| SCAB         | 14,895  | 112.50000 | 1,675,687.50    |    |
| SCVIB        | 9,415   | 164.00000 | 1,544,060.00    |    |
| SEBA         | 13,085  | 174.00000 | 2,276,790.00    |    |
| SECB         | 10,389  | 90.50000  | 940,204.50      |    |
| SIBA         | 13,575  | 205.00000 | 2,782,875.00    |    |
| SKAB         | 10,305  | 125.00000 | 1,288,125.00    |    |
| SKFB         | 11,479  | 112.75000 | 1,294,257.25    |    |
| SSABA        | 5,690   | 181.00000 | 1,029,890.00    |    |
| SSABB        | 2,045   | 163.50000 | 334,357.50      |    |
| SWEDA        | 4,745   | 188.50000 | 894,432.50      |    |
| SIMA         | 8,660   | 153.00000 | 1,324,980.00    |    |
| TLIA         | 62,870  | 59.50000  | 3,740,765.00    |    |
| TREB         | 1,745   | 142.00000 | 247,790.00      |    |
| VOLV         | 28,610  | 112.50000 | 3,218,625.00    |    |
| VOLVA        | 14,325  | 112.50000 | 1,611,562.50    |    |
| WHL          | 1,740   | 69.25000  | 120,495.00      |    |
| スウェーデン・クロナ 計 | 825,067 |           | 58,723,519.91   |    |
| (邦貨換算額)      |         |           | (1,021,202,011) |    |

外国株式（シンガポール・ドル）

| 銘柄   | 株数     | 評価額      |            | 備考 |
|------|--------|----------|------------|----|
|      |        | 単価       | 金額         |    |
| AGRN | 28,000 | 1.56000  | 43,680.00  |    |
| CAPL | 43,000 | 6.60000  | 283,800.00 |    |
| CD   | 77,000 | 1.77000  | 136,290.00 |    |
| COS  | 27,000 | 5.95000  | 160,650.00 |    |
| CYCM | 5,000  | 20.70000 | 103,500.00 |    |
| CYDM | 16,000 | 13.70000 | 219,200.00 |    |
| DBS  | 29,150 | 20.40000 | 594,660.00 |    |
| FN   | 32,000 | 5.80000  | 185,600.00 |    |

外国株式（香港・ドル）

| 銘柄      | 株数        | 評価額       |                 | 備考 |
|---------|-----------|-----------|-----------------|----|
|         |           | 単価        | 金額              |    |
| AP      | 56,000    | 34.55000  | 1,934,800.00    |    |
| ASMP    | 6,500     | 340.92500 | 2,218,106.25    |    |
| BELL    | 46,000    | 11.72000  | 539,120.00      |    |
| BKEA    | 43,000    | 50.50000  | 2,171,500.00    |    |
| BOC     | 105,000   | 21.55000  | 2,262,750.00    |    |
| CATH    | 39,000    | 20.25000  | 789,750.00      |    |
| CCL     | 26,000    | 12.20000  | 317,200.00      |    |
| CGK     | 40,682    | 139.90000 | 5,691,411.80    |    |
| CHES    | 15,000    | 14.26000  | 213,900.00      |    |
| CHL     | 32,000    | 53.85000  | 1,723,200.00    |    |
| CKIZ    | 17,000    | 30.00000  | 510,000.00      |    |
| EPA     | 27,600    | 105.50000 | 2,911,800.00    |    |
| FOSN    | 42,500    | 8.74000   | 371,450.00      |    |
| FOXCON  | 65,000    | 17.92000  | 1,164,800.00    |    |
| HAC     | 2,000     | 214.00000 | 428,000.00      |    |
| HCG     | 107,710   | 22.35000  | 2,407,318.50    |    |
| HEL     | 38,000    | 40.95000  | 1,556,100.00    |    |
| HKEX    | 30,500    | 225.40000 | 6,874,700.00    |    |
| HL      | 12,000    | 42.00000  | 504,000.00      |    |
| HNDH    | 23,500    | 73.25000  | 1,721,375.00    |    |
| HNDH -1 | 2,926     | 73.25000  | 214,329.50      |    |
| HPWH    | 18,000    | 34.50000  | 621,000.00      |    |
| HSHG    | 22,100    | 152.90000 | 3,379,980.00    |    |
| HTEL    | 49,000    | 11.32000  | 554,680.00      |    |
| HTW     | 55,823    | 89.20000  | 4,979,411.60    |    |
| HID     | 69,000    | 27.50000  | 1,897,500.00    |    |
| HYS     | 22,000    | 20.85000  | 458,700.00      |    |
| KERP    | 16,950    | 61.10000  | 1,035,645.00    |    |
| KING    | 14,500    | 45.10000  | 653,950.00      |    |
| LEE     | 10,400    | 34.35000  | 357,240.00      |    |
| LIFE    | 18,000    | 19.40000  | 349,200.00      |    |
| LIFU    | 64,000    | 31.80000  | 2,035,200.00    |    |
| MELC    | 17,000    | 11.32000  | 192,440.00      |    |
| MTRC    | 37,500    | 27.35000  | 1,025,625.00    |    |
| ORLO    | 6,000     | 59.00000  | 354,000.00      |    |
| PACBS   | 33,000    | 12.42000  | 409,860.00      |    |
| PAP     | 11,000    | 23.50000  | 258,500.00      |    |
| PARK    | 2,500     | 81.85000  | 204,625.00      |    |
| SHGH    | 38,000    | 23.45000  | 891,100.00      |    |
| SHK     | 38,480    | 159.30000 | 6,129,864.00    |    |
| SHUL    | 54,500    | 8.86000   | 482,870.00      |    |
| SINO    | 43,500    | 26.25000  | 1,141,875.00    |    |
| STE     | 46,000    | 11.76000  | 540,960.00      |    |
| SIPA    | 22,017    | 104.50000 | 2,300,776.50    |    |
| TENC    | 25,000    | 56.40000  | 1,410,000.00    |    |
| TING    | 46,000    | 11.90000  | 547,400.00      |    |
| TVB     | 12,000    | 46.50000  | 558,000.00      |    |
| WHB     | 7,500     | 116.50000 | 873,750.00      |    |
| WHEL    | 12,000    | 24.85000  | 298,200.00      |    |
| WHH     | 34,800    | 43.20000  | 1,503,360.00    |    |
| YYN     | 19,000    | 27.15000  | 515,850.00      |    |
| 香港ドル 計  | 1,643,488 |           | 70,609,701.90   |    |
| (邦貨換算額) |           |           | (1,025,958,969) |    |

| 銘柄                   | 株数      | 評価額      |                               | 備考 |
|----------------------|---------|----------|-------------------------------|----|
|                      |         | 単価       | 金額                            |    |
| GIL                  | 64,000  | 0.68000  | 43,520.00                     |    |
| JRSS                 | 28,000  | 4.20000  | 117,600.00                    |    |
| KPL                  | 31,600  | 12.80000 | 404,480.00                    |    |
| LNDH                 | 5,000   | 7.60000  | 38,000.00                     |    |
| NEPS                 | 13,000  | 4.10000  | 53,300.00                     |    |
| NOBL                 | 31,000  | 2.41000  | 74,710.00                     |    |
| OCBM                 | 66,240  | 8.65000  | 572,976.00                    |    |
| SAL                  | 13,800  | 17.80000 | 245,640.00                    |    |
| SCIL                 | 29,000  | 5.60000  | 162,400.00                    |    |
| SOX                  | 22,000  | 13.30000 | 292,600.00                    |    |
| SPR                  | 62,050  | 4.50000  | 279,225.00                    |    |
| SSTM                 | 13,000  | 7.40000  | 96,200.00                     |    |
| STEG                 | 45,000  | 3.82000  | 171,900.00                    |    |
| TELE                 | 223,810 | 3.96000  | 886,287.60                    |    |
| TELE                 | 31,300  | 19.70000 | 616,610.00                    |    |
| UBOH                 | 21,250  | 4.62000  | 98,175.00                     |    |
| UTOS                 | 7,000   | 12.70000 | 88,900.00                     |    |
| VENM                 | 11,000  | 4.88000  | 53,680.00                     |    |
| YLLG                 | 12,000  | 3.14000  | 37,680.00                     |    |
| シンガポールドル計<br>(邦貨換算額) | 987,200 |          | 6,061,263.60<br>(473,990,814) |    |

外国株式(ニュージーランドドル)

(単位:株、ニュージーランドドル)

| 銘柄                     | 株数      | 評価額      |                            | 備考 |
|------------------------|---------|----------|----------------------------|----|
|                        |         | 単価       | 金額                         |    |
| AIA                    | 42,170  | 2.80000  | 118,076.00                 |    |
| CEN                    | 9,955   | 8.38000  | 83,422.90                  |    |
| FBU                    | 14,570  | 11.30000 | 164,641.00                 |    |
| SKC                    | 19,990  | 4.61000  | 92,153.90                  |    |
| TEL                    | 52,342  | 4.38000  | 229,257.96                 |    |
| ニュージーランドドル計<br>(邦貨換算額) | 139,027 |          | 687,551.76<br>(59,865,132) |    |

外国株式(デンマーククローネ)

(単位:株、デンマーククローネ)

| 銘柄                    | 株数     | 評価額          |                                | 備考 |
|-----------------------|--------|--------------|--------------------------------|----|
|                       |        | 単価           | 金額                             |    |
| BRYB                  | 820    | 634.00000    | 519,880.00                     |    |
| CPLCB                 | 1,041  | 472.50000    | 491,872.50                     |    |
| DANS                  | 11,945 | 208.00000    | 2,484,560.00                   |    |
| DSAC                  | 28     | 55,900.00000 | 1,565,200.00                   |    |
| DSC                   | 1,868  | 368.50000    | 688,358.00                     |    |
| DSVB                  | 6,095  | 118.00000    | 719,210.00                     |    |
| FLSB                  | 1,490  | 527.00000    | 785,230.00                     |    |
| GNTC                  | 4,380  | 41.10000     | 180,018.00                     |    |
| JYSK                  | 1,780  | 409.50000    | 728,910.00                     |    |
| LUN                   | 915    | 151.00000    | 138,165.00                     |    |
| MAERSKA               | 7      | 56,000.00000 | 392,000.00                     |    |
| NKT                   | 505    | 478.00000    | 241,300.00                     |    |
| NOVO                  | 13,790 | 328.50000    | 4,530,015.00                   |    |
| NZYM                  | 1,280  | 588.00000    | 752,640.00                     |    |
| ROCKB                 | 200    | 1,331.00000  | 266,200.00                     |    |
| SYDB                  | 2,275  | 216.75000    | 493,106.25                     |    |
| TDP                   | 520    | 775.00000    | 403,000.00                     |    |
| TRYG                  | 670    | 401.00000    | 268,670.00                     |    |
| VMS                   | 5,015  | 509.00000    | 2,552,635.00                   |    |
| WDH                   | 1,000  | 484.00000    | 484,000.00                     |    |
| デンマーククローネ計<br>(邦貨換算額) | 55,624 |              | 18,685,069.75<br>(409,576,510) |    |

外国株式(ノルウェークローネ)

(単位:株、ノルウェークローネ)

| 銘柄                    | 株数      | 評価額       |                                | 備考 |
|-----------------------|---------|-----------|--------------------------------|----|
|                       |         | 単価        | 金額                             |    |
| AKVER                 | 4,795   | 149.75000 | 718,051.25                     |    |
| DNBOR                 | 19,560  | 84.90000  | 1,660,644.00                   |    |
| DNO                   | 7,965   | 10.53000  | 83,871.45                      |    |
| FRO                   | 1,130   | 265.50000 | 300,015.00                     |    |
| LIGH                  | 669     | 9.50000   | 6,355.50                       |    |
| NHY                   | 17,850  | 74.30000  | 1,326,255.00                   |    |
| ORK                   | 21,895  | 99.30000  | 2,174,173.50                   |    |
| PAN                   | 66,910  | 3.87000   | 258,941.70                     |    |
| PGSO                  | 4,880   | 157.00000 | 766,160.00                     |    |
| PRS                   | 6,300   | 92.90000  | 585,270.00                     |    |
| REC                   | 4,720   | 266.00000 | 1,255,520.00                   |    |
| SCH                   | 560     | 255.00000 | 142,800.00                     |    |
| SDRL                  | 7,330   | 126.50000 | 927,245.00                     |    |
| STB                   | 12,415  | 59.70000  | 741,175.50                     |    |
| STL                   | 35,805  | 164.70000 | 5,897,083.50                   |    |
| STO                   | 5,380   | 118.75000 | 638,875.00                     |    |
| TAA                   | 2,480   | 114.50000 | 283,960.00                     |    |
| TEL                   | 22,860  | 126.25000 | 2,886,075.00                   |    |
| TGS                   | 2,295   | 76.20000  | 174,879.00                     |    |
| YAR                   | 5,185   | 222.50000 | 1,153,662.50                   |    |
| ノルウェークローネ計<br>(邦貨換算額) | 250,984 |           | 21,981,012.90<br>(450,390,954) |    |

外国株式(ユーロ)

(単位:株、ユーロ)

| 銘柄    | 株数     | 評価額       |              | 備考 |
|-------|--------|-----------|--------------|----|
|       |        | 単価        | 金額           |    |
| AC    | 5,326  | 56.27000  | 299,694.02   |    |
| ACA   | 17,322 | 23.76000  | 411,570.72   |    |
| ACRX  | 4,452  | 17.51000  | 77,954.52    |    |
| ACS   | 5,401  | 43.02000  | 232,351.02   |    |
| ACSA  | 6,713  | 23.40000  | 157,084.20   |    |
| ACUM  | 770    | 157.00000 | 120,890.00   |    |
| ADP   | 965    | 72.22000  | 69,692.30    |    |
| ADS   | 5,081  | 47.55000  | 241,601.55   |    |
| AEGO  | 39,619 | 12.19000  | 482,955.61   |    |
| AEM   | 11,830 | 3.08500   | 36,495.55    |    |
| AGFB  | 2,782  | 9.94000   | 27,653.08    |    |
| AGL   | 4,025  | 12.03000  | 48,420.75    |    |
| AGS   | 2,590  | 27.51000  | 71,250.90    |    |
| AHLN  | 34,024 | 9.57000   | 325,609.68   |    |
| AI    | 6,708  | 99.87000  | 669,927.96   |    |
| AIB   | 9,930  | 10.95000  | 108,733.50   |    |
| AIRF  | 3,180  | 24.08000  | 76,574.40    |    |
| AKZO  | 7,498  | 52.90000  | 396,644.20   |    |
| AL    | 11,130 | 9.06500   | 100,893.45   |    |
| ALBI  | 22,843 | 15.68400  | 358,269.61   |    |
| ALOM  | 2,820  | 151.56000 | 427,389.20   |    |
| ALPHA | 10,848 | 24.44000  | 265,125.12   |    |
| ALTN  | 2,430  | 16.73000  | 40,653.90    |    |
| ALLI  | 12,528 | 144.30000 | 1,807,790.40 |    |
| ANDR  | 1,115  | 40.33000  | 44,967.95    |    |
| ANT3  | 2,783  | 11.30000  | 31,447.90    |    |
| ARR   | 590    | 67.43000  | 39,783.70    |    |
| ASML  | 10,927 | 23.90000  | 261,155.30   |    |

|       |   |         |           |              |  |  |
|-------|---|---------|-----------|--------------|--|--|
| AUTO  | ATLANTIA SPA  | 6.889   | 26.10000  | 179.802.90   |  |  |
| BAK   | BANKINTER   | 3.650   | 13.54000  | 49.421.00    |  |  |
| BASF  | BASF AG   | 13.680  | 98.23000  | 1.343.786.40 |  |  |
| BAYE  | BAYER AG  | 20.255  | 59.49000  | 1.204.989.95 |  |  |
| BBV   | BANCO BILLBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA                     | 104.553 | 17.20000  | 1.798.311.60 |  |  |
| BCP   | BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R                             | 58.777  | 2.84000   | 166.926.68   |  |  |
| BCSA  | BANCO SANTANDER SA                                      | 174.471 | 14.69000  | 2.562.978.99 |  |  |
| BEI   | BEIERSDORF AG   | 2.435   | 52.97000  | 128.981.95   |  |  |
| BELG  | BELGACOM SA   | 5.155   | 33.91000  | 174.806.05   |  |  |
| BESNW | BANCO ESPIRITO SANTO-REG                                | 6.550   | 15.60000  | 102.180.00   |  |  |
| BI    | INTESA SANPAOLO SPA                                     | 214.863 | 5.43500   | 1.167.726.05 |  |  |
| BICP  | SOCIETE BIC SA  | 1.175   | 50.21000  | 58.996.75    |  |  |
| BINR  | INTESA SANPAOLO SPA                                     | 23.345  | 4.98750   | 116.433.18   |  |  |
| BKIR  | BANK OF IRELAND   | 26.945  | 10.33000  | 278.341.85   |  |  |
| BNPS  | BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA S PA                    | 29.830  | 3.84750   | 114.770.92   |  |  |
| BWV   | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG                             | 4.355   | 41.32000  | 179.948.60   |  |  |
| BWV3  | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG-PFD                         | 480     | 34.69000  | 16.651.20    |  |  |
| BNP   | BNP PARIBAS SA  | 23.517  | 74.64000  | 1.755.308.88 |  |  |
| BOB   | BUSINESS OBJECTS SA                                     | 2.922   | 41.64000  | 121.672.08   |  |  |
| BOUY  | BOUYGUES SA   | 6.360   | 60.78000  | 386.560.80   |  |  |
| BP    | BANCO POPOLARE SPA                                      | 17.899  | 15.71000  | 281.193.29   |  |  |
| BPE   | BANCO POPOLARE SPANOL SA                                | 22.369  | 12.05000  | 289.546.45   |  |  |
| BFIN  | BPI-SGPS S.A.-REG SHS                                   | 8.850   | 5.38000   | 47.613.00    |  |  |
| BPM   | BANCA POPOLARE DI MILANO SCRL                           | 11.812  | 9.57000   | 113.040.84   |  |  |
| BPU   | UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA                          | 17.224  | 19.00000  | 327.256.00   |  |  |
| BRISA | BRISA AUTO-ESTRADAS DE PORTUGAL SA-PRIV SHR             | 8.065   | 10.09000  | 81.375.85    |  |  |
| BSN   | GROUPE DANONE   | 12.181  | 58.67000  | 714.659.27   |  |  |
| BULG  | BULGARI SPA   | 5.960   | 9.68000   | 57.692.80    |  |  |
| CAP   | CAP GEMINI SA   | 3.774   | 38.64000  | 145.827.36   |  |  |
| CAR   | CARREFOUR SA  | 16.713  | 51.81000  | 865.900.53   |  |  |
| CCB   | COCA-COLA HELLENIC BOTTLING COMPANY SA                  | 4.958   | 29.48000  | 146.161.84   |  |  |
| CCGBV | CARGOTEC CORPORATON-B SHARE                             | 1.243   | 34.30000  | 42.634.90    |  |  |
| CCE   | ALCATEL LUCENT  | 64.694  | 5.44000   | 351.935.36   |  |  |
| CIMP  | CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL                             | 5.410   | 6.12000   | 33.109.20    |  |  |
| CIN   | CINTRA CONCESSIONES DE INFRAESTRUTURAS DE TRANSPORTE SA | 7.985   | 11.20000  | 89.432.00    |  |  |
| CNPP  | CNP ASSURANCES  | 1.155   | 86.39000  | 99.780.45    |  |  |
| CO    | CASINO GUICHARD - PERRACHON SA                          | 1.114   | 74.07000  | 82.513.98    |  |  |
| COLR  | COLRUYT NV  | 672     | 159.58000 | 107.237.76   |  |  |
| COM   | COMMERZBANK AG  | 17.098  | 26.72000  | 456.858.56   |  |  |
| CON   | CONTINENTAL AG  | 4.165   | 88.06000  | 366.769.90   |  |  |
| CRDI  | UNICREDITO ITALIANO SPA                                 | 260.287 | 5.72000   | 1.488.841.64 |  |  |
| CRG   | BANCA CARIAGE SPA                                       | 6.385   | 3.53500   | 22.570.97    |  |  |
| CRH   | CRH PLC   | 14.770  | 25.55000  | 377.373.50   |  |  |
| CTG   | GAS NATURAL SDG SA                                      | 3.930   | 42.00000  | 165.060.00   |  |  |
| CUBE  | ACCIONA S.A.  | 716     | 229.30000 | 164.178.80   |  |  |
| DAST  | DASSAULT SYSTEMES SA                                    | 1.895   | 38.43000  | 72.824.85    |  |  |
| DB1   | DEUTSCHE BOERSE AG                                      | 5.669   | 127.32000 | 721.777.08   |  |  |
| DBK   | DEUTSCHE BANK AG -REG                                   | 14.150  | 89.15000  | 1.261.472.50 |  |  |
| DCC   | DCC PLC   | 1.740   | 18.46000  | 32.120.40    |  |  |
| DCXG  | DAIMLER AG-REG  | 26.502  | 65.96000  | 1.748.601.96 |  |  |
| DECX  | JC DECAUX S.A.  | 1.750   | 27.19000  | 47.582.50    |  |  |
| DELB  | DELHAIZE GROUP  | 2.631   | 59.21000  | 155.781.51   |  |  |
| DESC  | ERSTE BANK DER OESTERREICHISCHEN SPARKASSEN AG          | 4.988   | 47.35000  | 236.181.80   |  |  |
| DEX   | DEXIA   | 14.529  | 17.27000  | 250.915.83   |  |  |
| DG    | VINCI S.A.  | 11.305  | 34.83000  | 619.853.15   |  |  |
| DOU   | DOUGLAS HOLDING AG                                      | 676     | 59.55000  | 26.735.80    |  |  |

|       |   |         |           |              |  |  |
|-------|---|---------|-----------|--------------|--|--|
| DPB   | DEUTSCHE POSTBANK AG                        | 2.195   | 58.65000  | 128.736.75   |  |  |
| DPW   | DEUTSCHE POST AG-REG                        | 21.688  | 23.62000  | 512.270.56   |  |  |
| DSIN  | KONINKLIJKE DSM NV                          | 4.207   | 34.38000  | 144.636.66   |  |  |
| DTEG  | DEUTSCHE TELEKOM AG-REG                     | 79.076  | 15.09000  | 1.193.266.84 |  |  |
| EAD   | EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE AND SPACE CO    | 8.948   | 22.31000  | 199.629.88   |  |  |
| EDF   | ELECTRICITE DE FRANCE                       | 2.890   | 81.97000  | 236.893.30   |  |  |
| EDPP  | ENERGIAS DE PORTUGAL, S.A.                  | 52.876  | 4.60000   | 243.229.60   |  |  |
| ELIAY | ELISA CORP-A SHARES                         | 4.765   | 20.12000  | 95.871.80    |  |  |
| ELN   | ELAN CORPORATION PLC                        | 10.000  | 15.84500  | 158.450.00   |  |  |
| ELSN  | REED ELSEVIER NV                            | 20.994  | 13.30000  | 279.220.20   |  |  |
| ENEL  | ENEL SPA                                    | 120.729 | 8.23500   | 994.203.31   |  |  |
| ENI   | ENI SPA                                     | 72.628  | 24.60000  | 1.786.599.60 |  |  |
| ERCK  | MERCK KGAA                                  | 1.770   | 88.97000  | 157.476.90   |  |  |
| ESSI  | ESSILOR INTERNATIONAL SA                    | 5.425   | 42.67000  | 231.484.75   |  |  |
| ETE   | NATIONAL BANK OF GREECE SA                  | 11.544  | 46.00000  | 519.480.00   |  |  |
| EURB  | EFG EUROBANK ERGASIAS                       | 9.015   | 23.36000  | 210.590.40   |  |  |
| EX    | VIVENDI SA                                  | 32.462  | 31.54000  | 1.023.851.48 |  |  |
| EXHO  | SODEXHO ALLIANCE SA                         | 2.670   | 42.50000  | 113.475.00   |  |  |
| FOC   | FONTEO DE CONSTRUCCIONES Y CONTRATAS SA-FCC | 1.150   | 56.15000  | 64.572.50    |  |  |
| FER   | GRUPO FERROVIAL SA                          | 1.610   | 53.15000  | 85.571.50    |  |  |
| FGR   | EIFFAGE SA                                  | 490     | 75.49000  | 36.990.10    |  |  |
| FIA   | FIAT SPA                                    | 20.000  | 17.51000  | 350.200.00   |  |  |
| FIE   | FRENSIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA          | 5.163   | 36.73000  | 189.636.99   |  |  |
| FIS   | UNION FENOSA, S.A.                          | 2.986   | 46.19000  | 138.385.24   |  |  |
| FORB  | FORTIS                                      | 57.639  | 18.47000  | 1.084.592.33 |  |  |
| FODA  | CHRISTIAN DIOR                              | 715     | 87.35000  | 62.455.25    |  |  |
| FRA   | FRAPORT AG                                  | 420     | 54.50000  | 22.890.00    |  |  |
| FRE   | FRENSIUS SE-PRF                             | 1.015   | 56.00000  | 56.840.00    |  |  |
| FSA   | FONDIARIA-SAI SPA                           | 2.115   | 29.43000  | 62.244.45    |  |  |
| FTE   | FRANCE TELECOM SA                           | 50.899  | 24.66000  | 1.255.169.34 |  |  |
| FUGR  | FUGRO NV                                    | 1.580   | 53.34000  | 84.277.20    |  |  |
| FUMIV | FORTUM OYJ                                  | 11.940  | 30.00000  | 358.200.00   |  |  |
| G1A   | GEA GROUP AG                                | 4.205   | 24.20000  | 101.761.00   |  |  |
| GA    | CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITAS         | 685     | 198.34000 | 135.862.90   |  |  |
| GAM   | GAMESA CORPORACION TECNOLOGICA S.A.         | 5.040   | 31.43000  | 158.407.20   |  |  |
| GASI  | ASSICURAZIONI GENERALI                      | 29.425  | 31.68000  | 932.184.00   |  |  |
| GAZ   | GAZ DE FRANCE                               | 5.440   | 39.26000  | 213.574.40   |  |  |
| GBF   | BILFINGER BERGER AG                         | 1.245   | 53.90000  | 67.105.50    |  |  |
| GBL   | GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA                 | 2.037   | 87.14000  | 177.504.18   |  |  |
| GEHG  | CELESIO AG                                  | 2.370   | 41.44000  | 98.212.80    |  |  |
| HAGN  | HAGEMEYER NV                                | 11.140  | 4.41000   | 49.127.40    |  |  |
| HDD   | HEIDELBERGER DRUCKMASCHINEN AG              | 2.045   | 21.82000  | 44.621.90    |  |  |
| HEI   | HEIDELBERGEMONT AG                          | 315     | 108.04000 | 34.032.60    |  |  |
| HEIN  | HEINKEN NV                                  | 6.403   | 45.54000  | 291.592.62   |  |  |
| HEIO  | HEINKEN HOLDING NV                          | 1.450   | 39.43000  | 57.173.50    |  |  |
| HEN   | HEINKE KGAA-VORZUG                          | 6.188   | 39.40000  | 244.054.72   |  |  |
| HNSY  | LVHM MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA         | 6.439   | 82.89000  | 533.728.71   |  |  |
| HO    | THALES SA                                   | 2.160   | 40.10000  | 86.616.00    |  |  |
| HOC   | HOCHTIEF AG                                 | 1.180   | 91.33000  | 107.769.40   |  |  |
| HRX   | HYPO REAL ESTATE HLDG                       | 5.762   | 38.11000  | 219.589.82   |  |  |
| HTO   | HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA                | 10.545  | 23.76000  | 250.549.20   |  |  |
| IANS  | IANS GROUP PLC                              | 2.680   | 14.40000  | 38.592.00    |  |  |
| IBER  | IBEROROLA SA                                | 104.475 | 10.63000  | 1.110.569.25 |  |  |
| IBLA  | IBERIA LINEAS AEREAS DE ESPANA SA           | 19.515  | 3.15000   | 61.472.25    |  |  |
| IDR   | INDRA SISTEMAS SA                           | 3.854   | 18.55000  | 71.491.70    |  |  |
| IEA   | IMMOENST AG                                 | 9.535   | 7.29000   | 69.510.15    |  |  |
| IFL   | IFIL - INVESTMENTS SPA                      | 4.780   | 6.72500   | 32.145.50    |  |  |



|       |   |         |           |              |  |
|-------|---|---------|-----------|--------------|--|
| IFP   | ISTITUTO FINANZIARIO INDUSTRIALE SPA            | 1,515   | 23,80000  | 36,057.00    |  |
| IFXG  | INFINEON TECHNOLOGIES AG                        | 20,379  | 8,55000   | 174,240.45   |  |
| IHC   | SBM OFFSHORE NV                                 | 4,134   | 21,71000  | 89,749.14    |  |
| IHA   | IMMOFINANZ AG                                   | 12,067  | 6,90000   | 83,262.30    |  |
| ING   | ING GROEP NV-C/OA                               | 52,415  | 27,06000  | 1,418,349.90 |  |
| INTB  | INBEV   | 4,928   | 55,05000  | 271,176.30   |  |
| IPW   | IRISH LIFE & PERMANENT PLC                      | 9,795   | 12,37000  | 121,164.15   |  |
| ITAI  | ITALCEMENTI SPA                                 | 1,930   | 15,09000  | 29,123.70    |  |
| ITR   | ITALCEMENTI SPA-RNC                             | 1,385   | 10,96000  | 15,179.60    |  |
| ITX   | INDITEX   | 5,680   | 45,31000  | 257,360.80   |  |
| IVG   | IVG IMMOBILILIEN AG                             | 2,990   | 24,56000  | 73,434.40    |  |
| KARG  | ARCANDOR AG                                     | 1,965   | 18,07000  | 35,507.55    |  |
| KBC   | KBC GROUP                                       | 5,119   | 96,57000  | 494,341.83   |  |
| KBCA  | KBC ANCOBA                                      | 410     | 75,89000  | 31,114.90    |  |
| KCI1V | KONECRANES OYJ                                  | 1,300   | 26,20000  | 34,060.00    |  |
| KESBV | KESKO OYJ-B SHS                                 | 2,305   | 38,80000  | 89,434.00    |  |
| KN    | NATTIXIS  | 4,815   | 14,10000  | 67,891.50    |  |
| KONBS | KONE OYJ  | 2,011   | 48,00000  | 96,528.00    |  |
| KPN   | KONINKLIJKE KPN NV                              | 52,031  | 12,13000  | 631,136.03   |  |
| KSP   | KINGSPAN GROUP PLC                              | 4,855   | 14,25000  | 69,183.75    |  |
| KSZ   | KALI & SALZ                                     | 975     | 148,47000 | 144,758.25   |  |
| KYGA  | KERRY GROUP PLC-A                               | 5,430   | 22,12000  | 120,111.60   |  |
| LAF   | LAFARGE SA                                      | 3,998   | 124,68000 | 498,470.64   |  |
| LEGP  | LEGRAND S.A.                                    | 1,240   | 23,31000  | 28,904.40    |  |
| LHA   | DEUTSCHE LUFTHANSA-REG                          | 5,850   | 18,30000  | 107,055.00   |  |
| LIN   | LINDE AG  | 3,195   | 88,41000  | 282,469.95   |  |
| LTO   | LOTTOMATICA SPA                                 | 2,425   | 23,28000  | 56,454.00    |  |
| LUX   | LUXOTTICA GROUP SPA                             | 3,446   | 21,87000  | 75,364.02    |  |
| LYOE  | SUEZ SA   | 28,938  | 46,12000  | 1,334,620.56 |  |
| MAN   | MAN AG  | 3,009   | 110,80000 | 333,397.20   |  |
| MAP   | MAPFRE SA                                       | 20,265  | 3,03000   | 61,402.95    |  |
| MB    | MEDIOBANCA SPA                                  | 12,280  | 14,88000  | 182,726.40   |  |
| MCNB  | MICHELIN (CODE)-B                               | 4,069   | 75,89000  | 308,796.41   |  |
| MED   | MEDOLANUM SPA                                   | 8,725   | 5,17000   | 45,108.25    |  |
| MEL   | MELN EUROPEAN LAND LTD                          | 10,210  | 9,80000   | 100,058.00   |  |
| MEOG  | METRO AG  | 4,500   | 58,69000  | 264,105.00   |  |
| MF    | WENDEL  | 430     | 103,40000 | 44,462.00    |  |
| MIDI  | AXA   | 43,907  | 27,45000  | 1,205,247.15 |  |
| MIBP  | LAGARDERE S.C.A.                                | 3,490   | 53,81000  | 187,796.90   |  |
| MIT   | M6-METROPOLE TELEVISION                         | 2,845   | 17,95000  | 51,067.75    |  |
| MOBB  | MOBISTAR SA                                     | 1,259   | 62,00000  | 78,058.00    |  |
| MS    | MEDIASET SPA                                    | 21,406  | 6,84500   | 146,524.07   |  |
| MTP   | ARCELOR MITTAL                                  | 25,245  | 49,64000  | 1,253,161.80 |  |
| MUVG  | MUENCHENER RUECKVER AG-REG                      | 5,706   | 129,73000 | 740,239.38   |  |
| NAT   | NATIONALE A PORTEFEUILLE                        | 520     | 50,78000  | 26,405.60    |  |
| NEO   | NEOPOST SA                                      | 992     | 70,72000  | 70,154.24    |  |
| NEST  | NESTE OIL OYJ                                   | 3,665   | 23,31000  | 85,431.15    |  |
| NEUF  | NEUF CEGETEL                                    | 820     | 35,80000  | 29,356.00    |  |
| NK    | NIERYS SA                                       | 985     | 57,56000  | 56,696.60    |  |
| NOKS  | NOKIA OYJ                                       | 109,331 | 26,40000  | 2,886,338.40 |  |
| NORIV | NOKIAN RENKAAT OYJ                              | 3,265   | 24,90000  | 81,298.50    |  |
| OEW   | OESTERREICHISCHE ELEKTRIZITAETSWIRTSCHAFTS AG-A | 2,155   | 49,95000  | 107,642.25   |  |
| OKOAS | OKO BANK PLC -A                                 | 3,935   | 13,90000  | 54,696.50    |  |
| OMV   | OMV AG  | 4,290   | 50,80000  | 217,932.00   |  |
| OPAP  | OPAP SA   | 6,130   | 27,40000  | 167,962.00   |  |
| ORL   | L'OREAL SA                                      | 6,891   | 95,92000  | 660,984.72   |  |
| ORNBV | ORION OYJ                                       | 3,595   | 16,17000  | 58,131.15    |  |
| OUTO  | OUTOKUMPU OYJ                                   | 3,515   | 21,39000  | 75,185.85    |  |

|       |  |        |             |              |  |
|-------|--|--------|-------------|--------------|--|
| PAJ   | PAGESJAUNES GROUPE SA  | 4,850  | 14,25000    | 69,112.50    |  |
| PC    | PIRELLI&C.   | 94,890 | 0,77650     | 73,682.08    |  |
| PERP  | PERNOD-RICARD SA   | 2,406  | 150,33000   | 361,693.98   |  |
| PHG   | PHILIPS ELECTRONICS NV   | 31,881 | 30,19000    | 142,487.39   |  |
| PLT   | PARMALAT SPA   | 55,250 | 2,57750     | 92,406.87    |  |
| POR   | PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PFD                                     | 233    | 1,417,12000 | 330,188.96   |  |
| PPC   | PUBLIC POWER CORP  | 3,466  | 36,90000    | 127,895.40   |  |
| PRE   | TUI AG   | 6,165  | 19,50000    | 120,217.50   |  |
| PRS   | PROMOTORA DE INFORMACIONES SA-PRI SA                                 | 2,230  | 12,23000    | 27,272.90    |  |
| PRTP  | PPR  | 1,962  | 111,01000   | 217,801.62   |  |
| PRYS  | PRYSMIAN SPA   | 3,550  | 18,38000    | 65,249.00    |  |
| PSAF  | PELIGOT SA   | 3,817  | 54,86000    | 209,400.62   |  |
| PSM   | PROSTEBEN SAT.1 MEDI AG-PFD  | 3,065  | 17,88000    | 54,802.20    |  |
| PTCO  | PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG   | 22,068 | 9,25000     | 204,129.00   |  |
| PTM   | PT MULTIMEDIA SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES E MULTIMEDIA, SGPS, SA | 6,188  | 9,68000     | 59,899.84    |  |
| PUB   | PUBLICIS GROUPE  | 4,030  | 26,09000    | 105,142.70   |  |
| PUM   | PUMA AG  | 296    | 281,50000   | 83,324.00    |  |
| QCE   | Q-CELLS AG   | 1,250  | 97,14000    | 121,425.00   |  |
| QGEN  | QIAGEN N.V.  | 3,065  | 15,17000    | 46,496.05    |  |
| REE   | RED ELECTRICA DE ESPANA  | 2,845  | 44,85000    | 127,598.25   |  |
| REVA  | RENAULT SA   | 5,102  | 97,94000    | 499,689.88   |  |
| RF    | EURAZEO  | 320    | 91,76000    | 29,363.20    |  |
| RHE   | RHEINMETALL AG   | 1,295  | 54,10000    | 70,059.50    |  |
| RIBH  | RAIFFEISEN INTERNATIONAL BANK HOLDING AG                             | 1,060  | 105,14000   | 111,448.40   |  |
| RIS   | HERMES INTERNATIONAL   | 1,904  | 87,85000    | 167,266.40   |  |
| RPSL  | REFSOL YPF SA  | 22,091 | 25,15000    | 555,588.65   |  |
| RSTD  | RANDSTAD HOLDING N.V.  | 1,860  | 27,81000    | 51,726.60    |  |
| RTRKS | RAUTARUUKKI OYJ  | 2,130  | 30,65000    | 65,284.50    |  |
| RVE   | RVE AG   | 12,410 | 95,36000    | 1,183,417.60 |  |
| RVEP  | RVE AG-NON VTG PFD   | 1,025  | 81,90000    | 83,947.50    |  |
| RYA   | RYANAIR HOLDINGS PLC   | 9,890  | 4,67000     | 46,186.30    |  |
| SAB   | BANCO DE SABADELL SA   | 12,875 | 7,83000     | 100,811.25   |  |
| SAG   | SAGRAN SA  | 5,070  | 14,01000    | 71,090.70    |  |
| SAMAS | SAMPO OYJ-A SHS  | 11,274 | 19,07000    | 214,995.18   |  |
| SAP   | SAP AG   | 24,742 | 35,81000    | 886,011.02   |  |
| SC3   | SOCIETE GENERALE-A   | 10,403 | 100,67000   | 1,047,270.01 |  |
| SOHN  | SCHNEIDER ELECTRIC SA  | 6,119  | 91,78000    | 561,601.82   |  |
| SCOR  | SCOR SE  | 5,397  | 17,74000    | 95,742.78    |  |
| SEGN  | ATOS ORIGIN  | 2,220  | 37,66000    | 83,605.20    |  |
| SESF  | SES GROBAL-FDR   | 3,975  | 17,08000    | 67,893.00    |  |
| SIF   | FINMECCANICA SPA   | 7,295  | 21,68000    | 158,155.60   |  |
| SKG   | SMURFIT KAPPA GROUP PLC  | 3,150  | 11,45200    | 36,073.80    |  |
| SM    | SIEMENS AG-REG   | 23,752 | 105,41000   | 2,503,698.32 |  |
| SNAM  | SNAM RETE GAS SPA  | 21,510 | 4,45250     | 95,773.27    |  |
| SOFF  | SANOFI-AVENTIS SA  | 28,491 | 63,85000    | 1,819,150.35 |  |
| SOLV  | SOLVAY SA  | 1,741  | 96,36000    | 167,762.76   |  |
| SON   | SONAE SGPS, SA   | 32,160 | 2,00000     | 64,320.00    |  |
| SPM   | SALPEN   | 3,480  | 27,48000    | 95,630.40    |  |
| STER  | STORA ENSO OYJ-R SHS   | 15,750 | 10,42000    | 164,115.00   |  |
| STGO  | COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN  | 8,651  | 67,48000    | 583,769.48   |  |
| STM   | STMI MICROELECTRONICS NV   | 17,993 | 10,40000    | 187,127.20   |  |
| SMSIV | SANOVA-VISDY OYJ   | 2,175  | 19,42000    | 42,238.50    |  |
| SNV   | SOLARWORLD AG  | 2,305  | 41,62000    | 95,934.10    |  |
| SZG   | SALZGITTER AG  | 1,070  | 101,31000   | 108,401.70   |  |
| TBCE  | ALTADIS SA   | 6,694  | 49,63000    | 332,223.22   |  |
| TECF  | TECHNIP S.A.   | 2,793  | 52,37000    | 146,269.41   |  |

(2) 株式以外の有価証券

(単位：アメリカドル)

外国投資証券（アメリカドル）

| 銘柄   | 評価額     | 備考            |
|--|---------|---------------|
| 00163T10 AMB PROPERTY CORPORATION                  | 2,590   | 148,743.70    |
| 03748R10 APARTMENT INVESTMENT CO -A                | 2,974   | 105,071.42    |
| 05348A10 AVALONBAY COMMUNITIES INC                 | 2,190   | 204,765.00    |
| 10112110 BOSTON PROPERTIES INC                     | 3,042   | 282,064.24    |
| 13313110 CAMDEN PROPERTY TRUST                     | 2,110   | 100,393.80    |
| 25159110 DEVELOPERS DIVERSIFIED REALTY CORPORATION | 3,491   | 141,141.13    |
| 26441150 DUKE REALTY CORPORATION                   | 4,465   | 111,669.65    |
| 29476L10 EQUITY RESIDENTIAL-REIT                   | 7,695   | 266,400.90    |
| 31374720 FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT      | 1,565   | 126,890.20    |
| 37002110 GENERAL GROWTH PROPERTIES INC             | 5,760   | 256,032.00    |
| 42191510 HCP INC                                   | 5,525   | 174,148.00    |
| 44107P10 HOST HOTELS & RESORTS INC                 | 14,223  | 247,195.74    |
| 45031U10 ISTAR FINANCIAL INC                       | 3,908   | 109,424.00    |
| 49446R10 KIMCO REALTY CORPORATION                  | 6,245   | 233,000.95    |
| 53117210 LIBERTY PROPERTY TRUST                    | 2,798   | 79,798.96     |
| 55438210 THE MACERICH COMPANY                      | 2,060   | 153,696.60    |
| 72925110 PLUM CREEK TIMBER CO                      | 4,473   | 198,467.01    |
| 74341010 PROLOGIS                                  | 6,776   | 436,713.20    |
| 74460D10 PUBLIC STORAGE                            | 3,454   | 252,176.54    |
| 75884910 REGENCY CENTERS CORPORATION               | 2,135   | 135,487.10    |
| 78440X10 SL GREEN REALTY CORP                      | 1,672   | 159,268.00    |
| 82880610 SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT             | 6,277   | 578,613.86    |
| 91019710 UDR INC                                   | 5,265   | 103,404.60    |
| 92276F10 VENTAS INC                                | 3,505   | 153,098.40    |
| 92904210 VORNADO REALTY TRUST                      | 3,517   | 303,095.06    |
| アメリカドル 計   | 107,715 | 5,060,740.06  |
| (邦貨換算額)  |         | (573,584,278) |

(単位：カナダドル)

外国投資証券（カナダドル）

| 銘柄  | 評価額    | 備考            |
|---|--------|---------------|
| AER-U AEROPLAN INCOME FUND                | 2,630  | 58,438.60     |
| AET-U ARC ENERGY TRUST                    | 3,285  | 62,743.50     |
| CIX CI FINANCIAL INCOME FUND              | 1,805  | 50,919.05     |
| CNE-U CANETIC RESOURCES TRUST             | 6,365  | 89,110.00     |
| CCS-U CANADIAN OIL SANDS TRUST            | 6,090  | 223,929.30    |
| ERF-U ENERPLUS RESOURCES FUND             | 3,375  | 133,582.50    |
| FDG-U FORDING CANADIAN COAL TRUST         | 3,790  | 146,635.10    |
| HTE-U HARVEST ENERGY TRUST                | 4,105  | 85,968.70     |
| PVE-U PROVIDENT ENERGY TRUST              | 7,475  | 77,366.25     |
| PWI-U PRIMEWEST ENERGY TRUST              | 4,155  | 110,689.20    |
| PWT-U PENN WEST ENERGY TRUST              | 6,625  | 177,351.25    |
| REI-U RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 3,085  | 70,060.35     |
| YLO-U YELLOW PAGES INCOME FUND            | 7,750  | 105,167.50    |
| カナダドル 計                                   | 60,535 | 1,391,951.30  |
| (邦貨換算額)                                   |        | (154,882,421) |

|  |           |           |                  |
|--|-----------|-----------|------------------|
| TFPP TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)      | 4,790     | 18,70000  | 89,573.00        |
| TLETV TIETENATOR OYJ                   | 910       | 15,80000  | 14,378.00        |
| TITI TELECOM ITALIA SPA                | 302,808   | 2,18250   | 660,878.46       |
| TITR TELECOM ITALIA RNC                | 150,922   | 1,69500   | 255,812.79       |
| TKA THYSENKRUPP AG                     | 10,065    | 37,09000  | 373,310.85       |
| TKAV TELEKOM AUSTRIA AG                | 9,410     | 19,08000  | 179,542.80       |
| TL5 GESTEVISION TELECOM SA             | 3,035     | 18,11000  | 54,963.85        |
| THM THOMSON (EX-TMM)                   | 7,645     | 9,98000   | 76,297.10        |
| TNE TELEFONICA S.A.                    | 119,843   | 22,60000  | 2,708,451.80     |
| TOL TOTAL SA                           | 59,874    | 55,47000  | 3,321,210.78     |
| TOM2 TOMCOM NV                         | 1,345     | 53,15000  | 71,486.75        |
| TP TNT NV                              | 11,375    | 28,45000  | 323,618.75       |
| TPEI BANK OF PIREAUS                   | 9,540     | 26,20000  | 249,948.00       |
| TRN TERNA SPA                          | 30,912    | 2,77750   | 85,858.08        |
| TNR TITAN CEMENT CO. S.A.              | 2,075     | 31,20000  | 64,740.00        |
| UCB UCB SA                             | 3,588     | 32,00000  | 114,816.00       |
| UNI1 UNIPOL GRUPPO FINANZIARIO SPA     | 7,680     | 2,35750   | 18,105.60        |
| UNI2 UNIPOL GRUPPO FINANZIARIO SPA-PFD | 32,420    | 2,18750   | 70,918.75        |
| UNL UNILEVER NV-CVA                    | 47,835    | 23,85000  | 1,140,864.75     |
| UNR1V UPONOR OYJ                       | 1,185     | 17,09000  | 20,251.65        |
| UPM1 UPM-KYVAME OYJ                    | 13,828    | 14,03000  | 194,006.84       |
| VALH SACRY VALLEHERMOSO SA             | 2,665     | 28,87000  | 76,938.55        |
| VAST VOESTALPINE AG                    | 2,889     | 47,80000  | 138,094.20       |
| VEB E.ON AG                            | 17,373    | 148,06000 | 2,537,500.38     |
| VEDR VEDOR NV-CVA                      | 5,795     | 17,32000  | 100,369.40       |
| VIE VEOLIA ENVIRONNEMENT               | 9,989     | 61,50000  | 614,323.50       |
| VK VALLOUREC                           | 1,280     | 189,80000 | 242,944.00       |
| VLMT METSO OYJ                         | 3,520     | 36,99000  | 130,204.80       |
| VLOF VALEO                             | 2,472     | 31,00000  | 76,632.00        |
| VOW VOLKSWAGEN AG                      | 4,471     | 155,00000 | 693,005.00       |
| VOWG VOLKSWAGEN AG PFD                 | 2,765     | 98,32000  | 271,854.80       |
| WBG WIENERBERGER AG                    | 2,170     | 39,79000  | 86,344.30        |
| WCH WACKER CHEMIE AG                   | 205       | 183,21000 | 37,558.05        |
| WIN WINCOR NIXDORF AG                  | 680       | 62,63000  | 42,588.40        |
| WILSN WOLTERS KLUWER-CVA               | 8,497     | 22,72000  | 193,051.84       |
| WRTBV WARTSILA OYJ-B SHARES            | 1,875     | 52,01000  | 97,518.75        |
| WST WIENER STAEDTISCHE VERSICHERUNG AG | 915       | 57,70000  | 52,795.50        |
| YIT YIT OYJ                            | 4,220     | 16,28000  | 68,701.60        |
| ZDDC ZODIAC SA                         | 1,267     | 43,36000  | 54,937.12        |
| ZRDY ZARDOYA OTIS SA                   | 3,395     | 21,23000  | 72,075.85        |
| コーロ 計                                  | 4,498,382 |           | 96,589,359.62    |
| (邦貨換算額)                                |           |           | (15,800,087,447) |

(単位：円)

|     |  |  |                  |
|-----|--|--|------------------|
| 総合計 |  |  | (79,602,905,573) |
|     |  |  | 79,602,905,573   |

(注) 総合計の( )内の金額は外国株式の邦貨換算額合計であります。

外国投資証券（オーストラリアドル）

| 銘柄                            | 券面総額    | 評価額           | 備考 |
|-------------------------------|---------|---------------|----|
| DRT DB RREEF TRUST            | 94,150  | 195,832.00    |    |
| GAN GFS RETAIL PROPERTY TRUST | 46,800  | 112,788.00    |    |
| GPT GPT GROUP                 | 56,530  | 245,905.50    |    |
| MGQ GOODMAN GROUP             | 41,290  | 229,572.40    |    |
| MGR MIRVAC GROUP              | 31,010  | 189,161.00    |    |
| MOF MACQUARIE OFFICE TRUST    | 77,680  | 117,296.80    |    |
| PRXDB CENTRO PROPERTIES GROUP | 26,390  | 150,423.00    |    |
| SGP STOCKLAND                 | 37,105  | 329,121.35    |    |
| WDC WESTFIELD GROUP           | 45,260  | 940,050.20    |    |
| オーストラリアドル 計                   | 456,215 | 2,510,150.25  |    |
| (邦貨換算額)                       |         | (246,019,826) |    |

(単位：オーストラリアドル)

外国投資証券（イギリスポンド）

| 銘柄                              | 券面総額   | 評価額           | 備考 |
|---------------------------------|--------|---------------|----|
| BLND BRITISH LAND COMPANY PLC   | 13,451 | 120,251.94    |    |
| BXTN BRIXTON PLC                | 3,125  | 8,609.37      |    |
| GPOR GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 3,568  | 16,234.40     |    |
| HMSO HAMMERSON PLC              | 8,065  | 78,069.20     |    |
| LAND LAND SECURITIES GROUP PLC  | 12,014 | 173,482.16    |    |
| LIH LIBERTY INTERNATIONAL PLC   | 6,635  | 71,259.90     |    |
| SLOU SEGRO PLC                  | 12,450 | 54,001.87     |    |
| イギリスポンド 計                       | 59,308 | 521,908.84    |    |
| (邦貨換算額)                         |        | (119,339,675) |    |

(単位：イギリスポンド)

外国投資証券（香港ドル）

| 銘柄             | 券面総額   | 評価額          | 備考 |
|----------------|--------|--------------|----|
| LINK LINK REIT | 67,000 | 1,165,800.00 |    |
| 香港ドル 計         | 67,000 | 1,165,800.00 |    |
| (邦貨換算額)        |        | (16,939,074) |    |

(単位：香港ドル)

外国投資証券（シンガポールドル）

| 銘柄                         | 券面総額   | 評価額          | 備考 |
|----------------------------|--------|--------------|----|
| CCT CAPITACOMMERCIAL TRUST | 41,000 | 99,630.00    |    |
| CT CAPITAMALL TRUST        | 42,000 | 138,600.00   |    |
| シンガポールドル 計                 | 83,000 | 238,230.00   |    |
| (邦貨換算額)                    |        | (18,629,586) |    |

(単位：シンガポールドル)

外国投資証券（ユーロ）

| 銘柄                 | 券面総額  | 評価額          | 備考 |
|--------------------|-------|--------------|----|
| CORA CORIO NV      | 1,205 | 68,347.60    |    |
| EMGP ICADÉ         | 660   | 69,999.60    |    |
| GFC GECINA SA      | 300   | 34,650.00    |    |
| LI KLEPIERRE       | 2,290 | 80,150.00    |    |
| UL UNIBAIL-RODANCO | 1,920 | 285,216.00   |    |
| WEHA WERELDHAVE NV | 450   | 34,672.50    |    |
| ユーロ 計              | 6,825 | 573,035.70   |    |
| (邦貨換算額)            |       | (93,737,180) |    |

(単位：ユーロ)

|     |  |                 |  |
|-----|--|-----------------|--|
| 総合計 |  | (1,223,132,040) |  |
|     |  | 1,223,132,040   |  |

(単位：円)

(注1) 総合計の( )内の金額は外国投資証券の邦貨換算額合計であります。

(注2) 投資証券における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

| 通貨         | 銘柄数       | 組入株式時価比率 (%) | 組入投資証券時価比率 (%) | 合計額に対する比率 (%) |
|------------|-----------|--------------|----------------|---------------|
| アメリカドル     | 株式 602銘柄  | 98.6         | -              | 51.7          |
| アメリカドル     | 投資証券 25銘柄 | -            | 1.4            | 0.7           |
| カナダドル      | 株式 92銘柄   | 95.6         | -              | 4.2           |
| カナダドル      | 投資証券 13銘柄 | -            | 4.4            | 0.2           |
| オーストラリアドル  | 株式 67銘柄   | 91.1         | -              | 3.1           |
| オーストラリアドル  | 投資証券 9銘柄  | -            | 8.9            | 0.3           |
| イギリスポンド    | 株式 146銘柄  | 98.8         | -              | 12.0          |
| イギリスポンド    | 投資証券 7銘柄  | -            | 1.2            | 0.1           |
| スイスフラン     | 株式 38銘柄   | 100.0        | -              | 3.7           |
| 香港ドル       | 株式 51銘柄   | 98.4         | -              | 1.3           |
| 香港ドル       | 投資証券 1銘柄  | -            | 1.6            | 0.0           |
| スウェーデンクローナ | 株式 41銘柄   | 100.0        | -              | 1.3           |
| シンガポールドル   | 株式 27銘柄   | 96.2         | -              | 0.6           |
| シンガポールドル   | 投資証券 2銘柄  | -            | 3.8            | 0.0           |
| ニュージーランドドル | 株式 5銘柄    | 100.0        | -              | 0.1           |
| デンマーククローナ  | 株式 20銘柄   | 100.0        | -              | 0.5           |
| ノルウェークローナ  | 株式 20銘柄   | 100.0        | -              | 0.6           |
| ユーロ        | 株式 295銘柄  | 99.4         | -              | 19.5          |
| ユーロ        | 投資証券 6銘柄  | -            | 0.6            | 0.1           |

第2 有価証券先物取引等及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は平成19年12月28日現在です。

### 【純資産額計算書】

|                 |                 |   |
|-----------------|-----------------|---|
| 資産総額            | 165,240,298,845 | 円 |
| 負債総額            | 121,684,004     | 円 |
| 純資産総額( - )      | 165,118,614,841 | 円 |
| 発行済数量           | 156,719,317,035 | 口 |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 1.0536          | 円 |

### (参考)日本リートインデックスJ-REITマザーファンド

#### 純資産額計算書

|                 |                |   |
|-----------------|----------------|---|
| 資産総額            | 28,790,710,438 | 円 |
| 負債総額            | 0              | 円 |
| 純資産総額( - )      | 28,790,710,438 | 円 |
| 発行済数量           | 22,651,192,095 | 口 |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 1.2710         | 円 |

### (参考)海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド

#### 純資産額計算書

|                 |                |   |
|-----------------|----------------|---|
| 資産総額            | 27,499,829,394 | 円 |
| 負債総額            | 155,417,916    | 円 |
| 純資産総額( - )      | 27,344,411,478 | 円 |
| 発行済数量           | 21,444,108,972 | 口 |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 1.2751         | 円 |

### (参考)日本債券インデックスマザーファンド

#### 純資産額計算書

|                 |                |   |
|-----------------|----------------|---|
| 資産総額            | 48,651,367,772 | 円 |
| 負債総額            | 207,656,781    | 円 |
| 純資産総額( - )      | 48,443,710,991 | 円 |
| 発行済数量           | 43,026,279,529 | 口 |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 1.1259         | 円 |

### (参考)海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド

#### 純資産額計算書

|                 |                 |   |
|-----------------|-----------------|---|
| 資産総額            | 916,606,596,761 | 円 |
| 負債総額            | 3,940,945,309   | 円 |
| 純資産総額( - )      | 912,665,651,452 | 円 |
| 発行済数量           | 511,430,659,985 | 口 |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 1.7845          | 円 |

(参考) 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

|                  |                |   |
|------------------|----------------|---|
| 資産総額             | 40,720,999,744 | 円 |
| 負債総額             | 242,080,385    | 円 |
| 純資産総額 ( - )      | 40,478,919,359 | 円 |
| 発行済数量            | 38,355,942,960 | 口 |
| 1単位当たり純資産額 ( / ) | 1.0553         | 円 |

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

純資産額計算書

|                  |                |   |
|------------------|----------------|---|
| 資産総額             | 83,105,008,235 | 円 |
| 負債総額             | 8,608,327      | 円 |
| 純資産総額 ( - )      | 83,096,399,908 | 円 |
| 発行済数量            | 57,834,539,051 | 口 |
| 1単位当たり純資産額 ( / ) | 1.4368         | 円 |

第5【設定及び解約の実績】

|                                | 設定数量(口)        | 解約数量(口)       |
|--------------------------------|----------------|---------------|
| 第1特定期間(2005年9月29日~2005年12月15日) | 1,000,000      | 0             |
| 第2特定期間(2005年12月16日~2006年6月15日) | 11,260         | 0             |
| 第3特定期間(2006年6月16日~2006年12月15日) | 33,010,586,394 | 630,171,330   |
| 第4特定期間(2006年12月16日~2007年6月15日) | 76,066,618,738 | 2,229,048,280 |
| 第5特定期間(2007年6月16日~2007年12月17日) | 54,714,957,440 | 5,205,100,126 |

(注) 第1特定期間の設定数量には、当初設定数量を含みます。

日興アセットマネジメントの照会先

ホームページアドレス <http://www.nikkoam.com/>

☎ 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。(半休日となる場合は午前9時～正午)



携帯サイトQRコード

日興アセットマネジメントの照会先

ホームページアドレス <http://www.nikkoam.com/>

☎ 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。(半休日となる場合は午前9時～正午)



携帯サイトQRコード