

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年7月26日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 安倍 秀雄
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

半期報告書を提出しましたので2019年1月25日付をもって提出しました有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出します。

2【訂正の内容】

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

第一部【証券情報】

(5)【申込手数料】

<訂正前>

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、販売会社の照会先にお問い合わせください。

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

<訂正後>

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

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

*消費税率が10%になった場合は、1.1%となります。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<訂正前>

ファンドの基本的性格
(略)

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。
上記以外の商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

<訂正後>

ファンドの基本的性格
(略)

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。
上記以外の商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

(3)【ファンドの仕組み】

<更新後>

委託会社の概況（2019年4月末現在）

1) 資本金

17,363百万円

2) 沿革

1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更

3) 大株主の状況

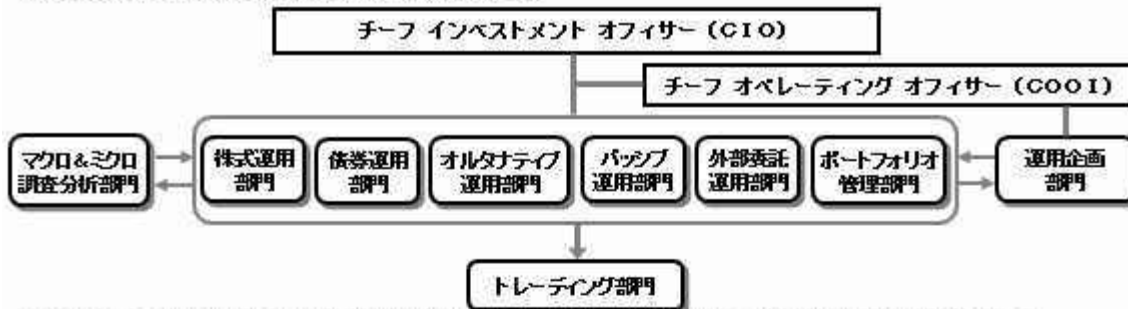
名 称	住 所	所有株数	所有比率
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	179,869,100株	91.29%
DBS Bank Ltd.	6 Shenton Way, #46-00, DBS Building Tower One, Singapore 068809	14,283,400株	7.24%

2【投資方針】

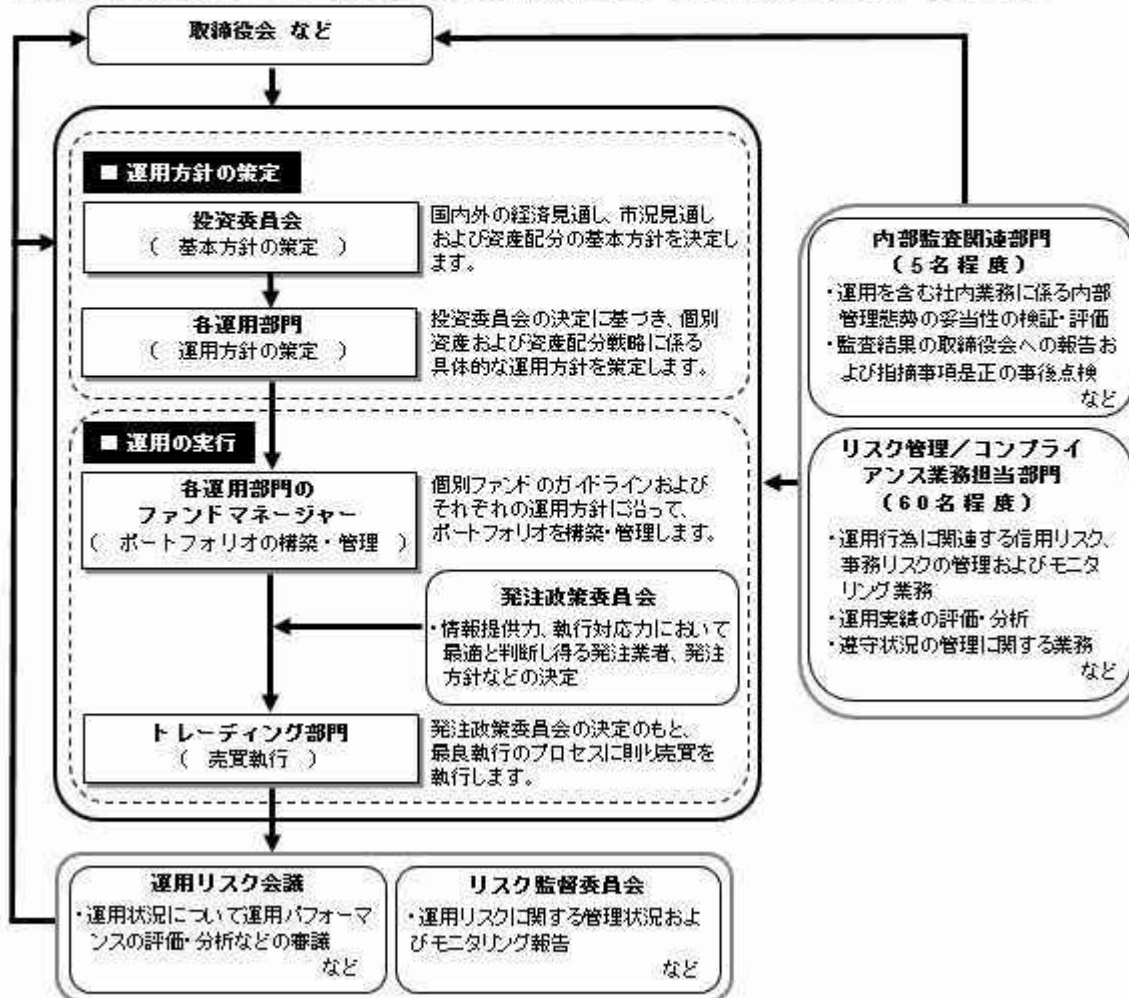
(3)【運用体制】

<更新後>

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

上記体制は2019年4月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

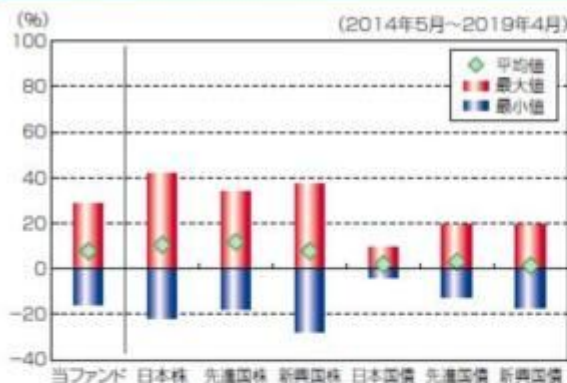
3【投資リスク】

< 更新後 >

(2) リスク管理体制

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



(当ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大騰落率および最小騰落率(%))

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	7.8%	10.4%	11.7%	7.8%	2.0%	3.1%	1.4%
最大値	28.8%	41.9%	34.1%	37.2%	9.3%	19.3%	19.3%
最小値	-15.9%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2014年5月から2019年4月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株 ……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株 ……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

新興国株 ……MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

東証株価指数(TOPIX、配当込)

当指数は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

当指数は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当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。

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

当指数は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当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。

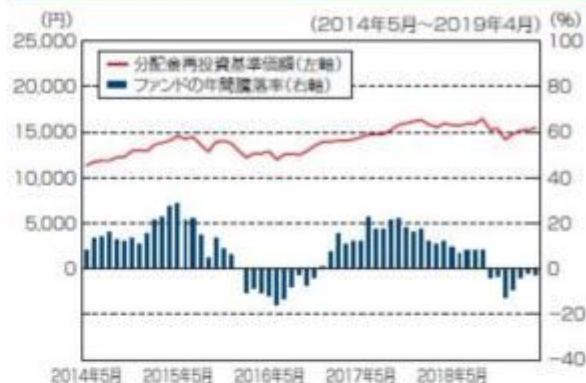
NOMURA-BPI国債

当指数は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

当指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。当指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2014年5月末の基準価額を起点として指数化しています。

※当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

日本国債 ……NOMURA-BPI国債

先進国債 ……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債 ……JPモルガンGBI-EMグローバルディバースファイド(円ヘッジなし、円ベース)

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド（円ヘッジなし、円ベース）

当指数は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

4【手数料等及び税金】**(1)【申込手数料】**

<訂正前>

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、販売会社の照会先にお問い合わせください。

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

申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

<訂正後>

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

- ・販売会社における申込手数料率は1.08%^{*}（税抜1%）が上限となっております。
*消費税率が10%になった場合は、1.1%となります。
- ・申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
- ・収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
- ・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができます場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

(3)【信託報酬等】

<訂正前>

信託報酬

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

<訂正後>

信託報酬

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

*消費税率が10%になった場合は、0.836%となります。

（５）【課税上の取扱い】

<更新後>

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

個人受益者の場合

１）収益分配金に対する課税

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

２）解約金および償還金に対する課税

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

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

確定申告等により、解約時および償還時の差損（譲渡損失）については、上場株式等の譲渡益、上場株式等の配当等および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限りません。）と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益（譲渡益）、普通分配金および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限りません。）については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、未成年者少額投資非課税制度（ジュニアNISA）をご利用の場合、20歳未満の居住者などを対象に、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人受益者の場合

１）収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

２）益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

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

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

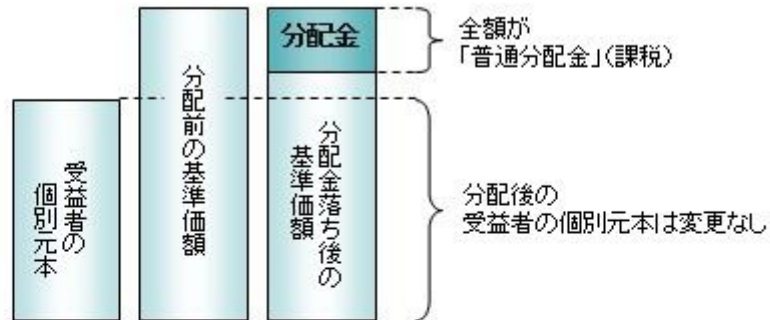
- 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 受益者が収益分配金を受け取る際
 - 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から

元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。

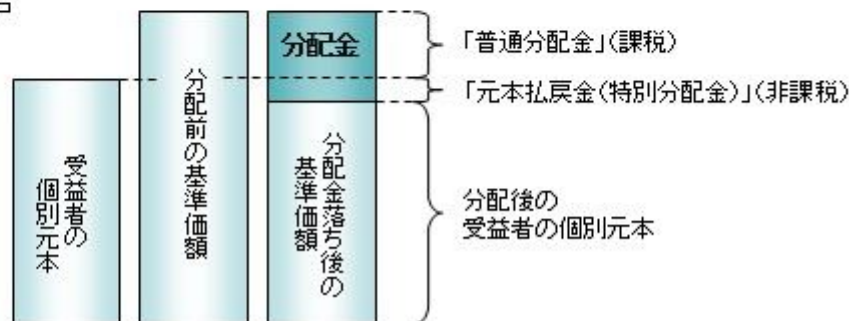
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は2019年7月26日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）】

以下の運用状況は2019年4月26日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	120,999,581	95.36
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		5,882,121	4.64
合計(純資産総額)		126,881,702	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	51,433,195	1.4396	74,043,228	1.4818	76,213,708	60.07
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	4,980,021	2.3817	11,860,917	2.6046	12,970,962	10.22
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	7,539,145	1.5719	11,850,783	1.7192	12,961,298	10.22
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	2,755,044	2.2225	6,123,086	2.2849	6,295,000	4.96
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	4,157,059	1.4648	6,089,328	1.5119	6,285,057	4.95
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	4,429,539	1.3927	6,169,219	1.4163	6,273,556	4.94

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.36
合計	95.36

【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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第10計算期間末 (2009年10月26日)	222	222	0.7943	0.7943
第11計算期間末 (2010年10月26日)	212	212	0.7548	0.7548
第12計算期間末 (2011年10月26日)	184	184	0.7191	0.7191
第13計算期間末 (2012年10月26日)	185	185	0.7518	0.7518
第14計算期間末 (2013年10月28日)	198	198	1.0963	1.0973
第15計算期間末 (2014年10月27日)	149	149	1.1748	1.1758
第16計算期間末 (2015年10月26日)	142	142	1.3877	1.3887
第17計算期間末 (2016年10月26日)	127	127	1.2858	1.2868
第18計算期間末 (2017年10月26日)	136	136	1.5660	1.5670
第19計算期間末 (2018年10月26日)	124	124	1.4887	1.4897
2018年4月末日	133		1.5879	

5月末日	131		1.5730
6月末日	132		1.5662
7月末日	133		1.5884
8月末日	133		1.5843
9月末日	137		1.6412
10月末日	127		1.5163
11月末日	128		1.5349
12月末日	116		1.4125
2019年 1月末日	122		1.4733
2月末日	125		1.5118
3月末日	125		1.5170
4月末日	126		1.5431

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第10期	2008年10月28日～2009年10月26日	0.0000
第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	0.0000
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	0.0000
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	0.0000
第14期	2012年10月27日～2013年10月28日	0.0010
第15期	2013年10月29日～2014年10月27日	0.0010
第16期	2014年10月28日～2015年10月26日	0.0010
第17期	2015年10月27日～2016年10月26日	0.0010
第18期	2016年10月27日～2017年10月26日	0.0010
第19期	2017年10月27日～2018年10月26日	0.0010
当中間期	2018年10月27日～2019年 4月26日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第10期	2008年10月28日～2009年10月26日	22.11
第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	4.97
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	4.73
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	4.55
第14期	2012年10月27日～2013年10月28日	45.96
第15期	2013年10月29日～2014年10月27日	7.25
第16期	2014年10月28日～2015年10月26日	18.21
第17期	2015年10月27日～2016年10月26日	7.27
第18期	2016年10月27日～2017年10月26日	21.87
第19期	2017年10月27日～2018年10月26日	4.87

当中間期	2018年10月27日～2019年 4月26日	3.65
------	-------------------------	------

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第10期	2008年10月28日～2009年10月26日	40,558,097	13,000,445
第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	31,178,453	29,716,908
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	26,532,382	51,181,847
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	20,084,711	30,295,119
第14期	2012年10月27日～2013年10月28日	14,612,172	80,167,991
第15期	2013年10月29日～2014年10月27日	7,347,662	61,141,524
第16期	2014年10月28日～2015年10月26日	8,195,630	33,100,687
第17期	2015年10月27日～2016年10月26日	5,609,382	9,391,307
第18期	2016年10月27日～2017年10月26日	6,990,650	18,477,769
第19期	2017年10月27日～2018年10月26日	8,745,652	12,479,935
当中間期	2018年10月27日～2019年 4月26日	2,649,213	4,013,442

（参考）

日本株式インデックストップIXマザーファンド

以下の運用状況は2019年 4月26日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	30,544,666,800	98.72
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		396,374,035	1.28
合計（純資産総額）		30,941,040,835	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	403,750,000	1.30

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	146,600	6,530.16	957,321,456	6,905.00	1,012,273,000	3.27
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	53,900	8,593.76	463,203,664	11,555.00	622,814,500	2.01
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	893,000	644.54	575,574,220	549.90	491,060,700	1.59
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	114,800	4,433.17	508,927,916	4,112.00	472,057,600	1.53
日本	株式	ソニー	電気機器	88,200	5,789.16	510,603,912	5,212.00	459,698,400	1.49
日本	株式	キーエンス	電気機器	6,500	51,994.95	337,967,175	69,120.00	449,280,000	1.45
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	88,300	4,849.05	428,171,115	4,616.00	407,592,800	1.32
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	91,400	4,207.78	384,591,092	4,021.00	367,519,400	1.19
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	110,900	2,978.80	330,348,920	3,101.00	343,900,900	1.11
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,762,600	187.24	330,029,224	173.50	305,811,100	0.99
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	90,000	2,846.56	256,190,400	3,329.00	299,610,000	0.97
日本	株式	KDDI	情報・通信業	113,800	2,807.90	319,539,020	2,540.50	289,108,900	0.93
日本	株式	任天堂	その他製品	7,500	34,331.79	257,488,425	38,000.00	285,000,000	0.92
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	11,800	21,220.28	250,399,347	23,895.00	281,961,000	0.91
日本	株式	三菱商事	卸売業	90,900	3,143.92	285,782,328	3,056.00	277,790,400	0.90
日本	株式	花王	化学	31,900	7,340.36	234,157,484	8,557.00	272,968,300	0.88
日本	株式	ファナック	電気機器	12,500	17,652.39	220,654,875	20,775.00	259,687,500	0.84
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	46,300	5,166.45	239,206,635	5,602.00	259,372,600	0.84
日本	株式	ダイキン工業	機械	17,900	12,577.29	225,133,491	14,100.00	252,390,000	0.82
日本	株式	日本電産	電気機器	15,800	13,654.25	215,737,150	15,785.00	249,403,000	0.81
日本	株式	村田製作所	電気機器	41,400	5,195.78	215,105,292	5,960.00	246,744,000	0.80
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	23,400	9,561.66	223,742,844	10,465.00	244,881,000	0.79
日本	株式	信越化学工業	化学	22,700	8,525.63	193,531,801	10,430.00	236,761,000	0.77
日本	株式	資生堂	化学	26,100	6,793.74	177,316,614	8,718.00	227,539,800	0.74
日本	株式	キヤノン	電気機器	70,800	3,193.09	226,070,772	3,089.00	218,701,200	0.71
日本	株式	日立製作所	電気機器	59,200	3,245.23	192,117,616	3,689.00	218,388,800	0.71
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	54,300	4,766.58	258,825,294	3,859.00	209,543,700	0.68
日本	株式	三菱電機	電気機器	131,500	1,308.81	172,108,515	1,582.00	208,033,000	0.67
日本	株式	HOYA	精密機器	26,500	6,130.78	162,465,670	7,815.00	207,097,500	0.67
日本	株式	第一三共	医薬品	37,600	4,325.63	162,643,688	5,481.00	206,085,600	0.67

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.12
		鉱業	0.29
		建設業	2.83
		食料品	4.12

繊維製品	0.64
パルプ・紙	0.29
化学	7.40
医薬品	5.47
石油・石炭製品	0.61
ゴム製品	0.77
ガラス・土石製品	0.88
鉄鋼	0.95
非鉄金属	0.77
金属製品	0.56
機械	5.16
電気機器	13.47
輸送用機器	7.94
精密機器	2.05
その他製品	2.09
電気・ガス業	1.72
陸運業	4.60
海運業	0.17
空運業	0.56
倉庫・運輸関連業	0.20
情報・通信業	8.44
卸売業	4.87
小売業	4.50
銀行業	5.96
証券、商品先物取引業	0.77
保険業	2.18
その他金融業	1.08
不動産業	2.28
サービス業	4.98
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

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2019年06月	買建	25	日本円	400,683,500	403,750,000	1.30

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

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

以下の運用状況は2019年 4月26日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
出資金	アメリカ	8,882,623	0.01
株式	アメリカ	72,121,759,218	61.21
	カナダ	4,256,140,991	3.61
	モーリシャス	3,092,908	0.00
	ドイツ	3,698,515,373	3.14
	イタリア	784,529,123	0.67
	フランス	4,252,968,488	3.61
	オランダ	1,974,778,111	1.68
	スペイン	1,250,501,106	1.06
	ベルギー	418,699,608	0.36
	オーストリア	104,309,491	0.09
	ルクセンブルク	123,501,231	0.10
	フィンランド	488,635,008	0.41
	アイルランド	1,938,615,616	1.65
	ポルトガル	65,960,104	0.06
	イギリス	6,793,948,521	5.77
	スイス	4,040,963,604	3.43
	スウェーデン	1,049,420,986	0.89
	ノルウェー	290,178,868	0.25
	デンマーク	716,872,215	0.61
	ケイマン	308,851,817	0.26
	オーストラリア	2,627,842,335	2.23
	バミューダ	239,679,228	0.20
	ニュージーランド	94,506,884	0.08
	香港	1,263,095,913	1.07
	シンガポール	521,960,383	0.44
	イスラエル	214,221,602	0.18
	ジャージー	305,972,983	0.26
	英ヴァージン諸島	17,378,671	0.01
	アラブ首長国連邦	8,273,112	0.01
	マン島	15,332,122	0.01
	小計	109,990,505,620	93.35
投資証券	アメリカ	2,306,863,735	1.96
	カナダ	19,474,868	0.02
	フランス	133,220,828	0.11
	イギリス	93,022,634	0.08
	オーストラリア	238,918,348	0.20

	香港	77,507,734	0.07
	シンガポール	55,139,149	0.05
	小計	2,924,147,296	2.48
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		4,907,455,588	4.16
合計(純資産総額)		117,830,991,127	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	4,582,293,170	3.89
	買建	ドイツ	1,094,245,488	0.93

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		4,032,976,000	3.42

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	127,272	24,033.62	3,058,808,047	22,960.56	2,922,237,410	2.48
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	195,564	12,128.42	2,371,882,699	14,445.42	2,825,005,584	2.40
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	11,145	197,776.40	2,204,218,070	212,766.66	2,371,284,454	2.01
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	64,520	17,009.38	1,097,445,572	21,616.13	1,394,672,772	1.18
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	8,452	122,994.88	1,039,552,732	141,316.88	1,194,410,291	1.01
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	8,030	123,921.93	995,093,123	141,751.97	1,138,268,391	0.97
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	89,120	11,739.44	1,046,219,418	12,707.27	1,132,472,660	0.96
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	71,871	15,454.18	1,110,707,391	15,619.85	1,122,614,419	0.95
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	113,471	8,746.38	992,460,543	9,196.30	1,043,514,152	0.89
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	82,073	9,252.23	759,358,518	10,657.75	874,713,581	0.74
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	47,152	15,784.97	744,293,011	18,010.08	849,211,622	0.72
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	249,579	2,994.32	747,321,515	3,364.44	839,695,567	0.71

アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	34,620	22,707.00	786,116,672	23,706.60	820,722,752	0.70
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	122,262	5,045.42	616,864,131	6,443.67	787,817,021	0.67
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	66,499	10,067.43	669,474,063	11,551.86	768,187,670	0.65
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	120,460	5,113.27	615,945,453	6,300.51	758,959,495	0.64
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	48,152	12,414.05	597,761,610	15,350.29	739,147,357	0.63
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	30,320	20,131.31	610,381,367	23,097.02	700,301,798	0.59
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	110,597	6,321.34	699,122,231	6,246.82	690,879,828	0.59
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	154,850	4,853.75	751,604,183	4,430.37	686,044,111	0.58
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェア・サービス	24,610	22,990.31	565,791,633	27,471.47	676,073,086	0.57
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	51,111	12,597.59	643,875,811	13,187.11	674,006,635	0.57
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	25,800	29,386.56	758,173,486	25,813.86	665,997,627	0.57
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	195,047	3,365.23	656,378,322	3,393.52	661,897,651	0.56
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	119,770	5,762.66	690,194,646	5,313.99	636,457,001	0.54
アメリカ	株式	BOEING CO/THE	資本財	14,452	40,812.23	589,818,394	42,816.17	618,779,433	0.53
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	69,643	7,911.70	550,995,106	8,538.62	594,655,739	0.50
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	121,564	4,043.01	491,484,679	4,801.72	583,716,351	0.50
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	108,352	5,224.93	566,132,641	5,350.90	579,781,150	0.49
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	18,848	26,094.25	491,824,584	28,983.91	546,288,736	0.46

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
出資金			0.01
株式	国外	エネルギー	6.13
		素材	4.21
		資本財	6.78
		商業・専門サービス	1.15
		運輸	1.93
		自動車・自動車部品	1.15
		耐久消費財・アパレル	1.85
		消費者サービス	1.84
		メディア・娯楽	5.93

	小売	4.72
	食品・生活必需品小売り	1.38
	食品・飲料・タバコ	4.65
	家庭用品・パーソナル用品	1.97
	ヘルスケア機器・サービス	4.29
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.52
	銀行	7.83
	各種金融	4.14
	保険	3.72
	不動産	0.57
	ソフトウェア・サービス	8.88
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.24
	電気通信サービス	2.20
	公益事業	3.21
	半導体・半導体製造装置	3.08
投資証券		2.48
合計		95.84

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI 1906	買建	280	米ドル	40,845,975	4,568,622,304	40,968,200	4,582,293,170	3.89
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1906	買建	280	ユーロ	8,755,920	1,089,061,330	8,797,600	1,094,245,488	0.93

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	28,250,000.00	3,144,807,595	3,149,867,000	2.67
	ユーロ	買建	7,100,000.00	890,693,605	883,109,000	0.75

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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

以下の運用状況は2019年 4月26日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	4,992,428,772	61.93
	カナダ	296,541,944	3.68
	ドイツ	254,701,618	3.16
	イタリア	52,611,471	0.65
	フランス	296,935,370	3.68
	オランダ	136,867,883	1.70
	スペイン	85,626,312	1.06
	ベルギー	31,473,167	0.39
	オーストリア	5,813,255	0.07
	ルクセンブルク	3,001,454	0.04
	フィンランド	35,186,375	0.44
	アイルランド	130,020,365	1.61
	ポルトガル	5,724,645	0.07
	イギリス	483,454,249	6.00
	スイス	277,131,982	3.44
	スウェーデン	69,819,838	0.87
	ノルウェー	20,664,955	0.26
	デンマーク	52,044,196	0.65
	ケイマン	18,357,921	0.23
	オーストラリア	179,551,021	2.23
	バミューダ	16,111,427	0.20
	ニュージーランド	3,781,638	0.05
	香港	87,697,805	1.09
	シンガポール	38,219,630	0.47
	イスラエル	10,674,608	0.13
	ジャージー	22,241,775	0.28
英ヴァージン諸島	1,583,501	0.02	
	小計	7,608,267,177	94.38
投資証券	アメリカ	167,651,203	2.08
	フランス	7,594,265	0.09
	イギリス	2,278,938	0.03
	オーストラリア	21,227,210	0.26
	香港	5,949,207	0.07
		小計	204,700,823
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		248,483,542	3.08
合計（純資産総額）		8,061,451,542	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	196,383,993	2.44

	買建	ドイツ	46,896,235	0.58
--	----	-----	------------	------

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		7,942,133,610	98.52

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8,802	23,974.44	211,023,069	22,960.56	202,098,920	2.51
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	13,521	12,102.13	163,633,028	14,445.42	195,316,625	2.42
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	772	197,621.01	152,563,421	212,766.66	164,255,863	2.04
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	4,459	16,886.89	75,298,671	21,616.13	96,386,328	1.20
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	584	122,553.30	71,571,130	141,316.88	82,529,059	1.02
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	554	123,451.80	68,392,299	141,751.97	78,530,596	0.97
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	6,166	11,698.79	72,134,768	12,707.27	78,353,079	0.97
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,941	15,441.54	76,296,687	15,619.85	77,177,691	0.96
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	7,737	8,732.03	67,559,792	9,196.30	71,151,827	0.88
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	5,625	9,234.70	51,945,226	10,657.75	59,949,848	0.74
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	3,263	15,738.38	51,354,353	18,010.08	58,766,914	0.73
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	17,189	2,978.19	51,192,233	3,364.44	57,831,497	0.72
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	2,375	22,617.56	53,716,705	23,706.60	56,303,193	0.70
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	8,428	5,020.26	42,310,754	6,443.67	54,307,322	0.67
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	4,585	10,042.85	46,046,500	11,551.86	52,965,315	0.66
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8,173	5,077.60	41,499,262	6,300.51	51,494,072	0.64
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	3,341	12,375.08	41,345,155	15,350.29	51,285,332	0.64
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	2,085	20,059.11	41,823,264	23,097.02	48,157,297	0.60

アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	7,664	6,335.91	48,558,441	6,246.82	47,875,648	0.59
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10,679	4,861.15	51,912,315	4,430.37	47,312,012	0.59
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	3,495	12,545.20	43,845,503	13,187.11	46,088,967	0.57
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェア・サービス	1,676	22,857.70	38,309,513	27,471.47	46,042,198	0.57
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	13,510	3,371.46	45,548,526	3,393.52	45,846,577	0.57
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	1,775	29,342.48	52,082,912	25,813.86	45,819,604	0.57
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	8,203	5,769.79	47,329,663	5,313.99	43,590,689	0.54
アメリカ	株式	BOEING CO/THE	資本財	1,001	40,991.35	41,032,346	42,816.17	42,858,996	0.53
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,799	7,899.80	37,911,166	8,538.62	40,976,881	0.51
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	8,420	4,023.56	33,878,389	4,801.72	40,430,487	0.50
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	7,361	5,213.05	38,373,277	5,350.90	39,388,004	0.49
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,297	25,981.23	33,697,663	28,983.90	37,592,131	0.47

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	6.27
		素材	4.27
		資本財	6.88
		商業・専門サービス	1.23
		運輸	1.91
		自動車・自動車部品	1.19
		耐久消費財・アパレル	1.79
		消費者サービス	1.88
		メディア・娯楽	5.95
		小売	4.79
		食品・生活必需品小売り	1.40
		食品・飲料・タバコ	4.63
		家庭用品・パーソナル用品	2.00
		ヘルスケア機器・サービス	4.37
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.58
		銀行	7.95
		各種金融	4.16
		保険	3.78
不動産	0.55		

		ソフトウェア・サービス	9.05
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.27
		電気通信サービス	2.16
		公益事業	3.16
		半導体・半導体製造装置	3.15
投資証券			2.54
合 計			96.92

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI1906	買建	12	米ドル	1,681,947.5	188,125,828	1,755,780	196,383,993	2.44
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1906	買建	12	ユーロ	360,140	44,794,213	377,040	46,896,235	0.58

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	49,002,000.00	5,411,418,464	5,454,576,700	67.66
	加ドル	売建	3,535,000.00	293,430,346	292,217,630	3.62
	ユーロ	売建	7,577,000.00	950,843,478	942,484,110	11.69
	英ポンド	売建	3,443,000.00	501,042,479	495,390,250	6.15
	スイスフラン	売建	2,346,000.00	259,793,557	257,293,140	3.19
	スウェーデンクローナ	売建	6,549,000.00	78,283,158	76,687,570	0.95
	ノルウェークローネ	売建	1,613,000.00	20,801,142	20,719,990	0.26
	デンマーククローネ	売建	3,181,000.00	53,630,877	52,995,460	0.66
	豪ドル	売建	2,598,000.00	203,933,095	202,964,500	2.52
	ニュージーランドドル	売建	53,000.00	3,953,747	3,909,810	0.05
	香港ドル	売建	7,366,000.00	104,024,011	104,532,030	1.30
	シンガポールドル	売建	423,000.00	34,537,349	34,546,260	0.43
	イスラエルシェケル	売建	124,000.00	3,775,404	3,816,160	0.05

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2019年 4月26日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	30,783,590,412	77.32
地方債証券	日本	3,096,397,000	7.78
特殊債券	日本	2,866,520,730	7.20
社債券	日本	2,868,168,186	7.20
	オーストラリア	100,197,000	0.25
	小計	2,968,365,186	7.46
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		99,302,630	0.25
合計（純資産総額）		39,814,175,958	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	利率 （％）	償還期限	投資 比率 （％）
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	700,000,000	102.32	716,240,000	103.11	721,791,000	0.300	2025/12/20	1.81
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	610,000,000	100.65	613,965,000	101.88	621,516,800	0.100	2026/12/20	1.56
日本	国債証券	第124回利付国債（5年）	560,000,000	100.38	562,161,600	100.29	561,629,600	0.100	2020/6/20	1.41
日本	国債証券	第140回利付国債（20年）	458,000,000	119.01	545,070,500	121.19	555,063,940	1.700	2032/9/20	1.39
日本	国債証券	第335回利付国債（10年）	490,000,000	103.28	506,076,900	103.63	507,796,800	0.500	2024/9/20	1.28
日本	国債証券	第123回利付国債（5年）	505,000,000	100.24	506,245,875	100.24	506,245,875	0.100	2020/3/20	1.27
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	490,000,000	100.54	492,660,700	101.90	499,354,100	0.100	2027/3/20	1.25
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	490,000,000	100.27	491,332,800	101.82	498,952,300	0.100	2027/12/20	1.25
日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	480,000,000	100.13	480,667,200	101.78	488,587,200	0.100	2028/3/20	1.23
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	435,000,000	100.04	435,204,450	101.74	442,599,450	0.100	2028/6/20	1.11
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	420,000,000	102.97	432,474,000	103.63	435,279,600	0.400	2025/9/20	1.09
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	390,000,000	102.85	401,118,900	103.37	403,174,200	0.400	2025/3/20	1.01
日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	390,000,000	99.97	389,885,200	101.65	396,438,900	0.100	2028/9/20	1.00
日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	370,000,000	102.89	380,711,500	103.52	383,042,500	0.400	2025/6/20	0.96
日本	国債証券	第29回利付国債（30年）	276,000,000	132.93	366,897,840	138.32	381,765,960	2.400	2038/9/20	0.96
日本	国債証券	第313回利付国債（10年）	370,000,000	103.42	382,676,200	102.72	380,086,200	1.300	2021/3/20	0.95

日本	国債証券	第117回利付国債(20年)	293,000,000	122.23	358,147,590	122.89	360,067,700	2.100	2030/3/20	0.90
日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	290,000,000	120.96	350,795,600	122.09	354,087,100	2.100	2029/9/20	0.89
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	300,000,000	117.57	352,722,000	117.63	352,899,000	2.300	2026/6/20	0.89
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	325,000,000	100.44	326,449,500	100.35	326,160,250	0.100	2020/9/20	0.82
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	295,000,000	106.23	313,405,050	105.72	311,876,950	1.400	2022/12/20	0.78
日本	国債証券	第43回利付国債(30年)	235,000,000	121.08	284,540,350	129.08	303,349,750	1.700	2044/6/20	0.76
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	250,000,000	118.06	295,152,500	118.17	295,440,000	2.300	2026/9/20	0.74
日本	国債証券	第164回利付国債(20年)	285,000,000	97.92	279,077,700	103.01	293,604,150	0.500	2038/3/20	0.74
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	208,000,000	129.84	270,067,200	132.72	276,065,920	2.400	2034/3/20	0.69
日本	国債証券	第34回利付国債(30年)	200,000,000	130.67	261,354,000	137.30	274,602,000	2.200	2041/3/20	0.69
日本	国債証券	第149回利付国債(20年)	215,000,000	116.44	250,365,350	119.69	257,342,100	1.500	2034/6/20	0.65
日本	国債証券	第145回利付国債(20年)	205,000,000	119.13	244,222,650	121.85	249,800,700	1.700	2033/6/20	0.63
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	245,000,000	100.80	246,964,900	101.87	249,586,400	0.100	2026/6/20	0.63
日本	国債証券	第50回利付国債(20年)	237,000,000	104.87	248,556,120	103.86	246,152,940	1.900	2021/3/22	0.62

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	77.32
地方債証券	7.78
特殊債券	7.20
社債券	7.46
合計	99.75

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2019年4月26日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
-------	------	---------	---------

国債証券	アメリカ	69,878,982,743	46.40
	カナダ	2,857,413,765	1.90
	メキシコ	1,227,184,836	0.81
	ドイツ	9,875,131,540	6.56
	イタリア	12,853,304,805	8.53
	フランス	14,954,579,162	9.93
	オランダ	2,926,410,186	1.94
	スペイン	8,555,271,564	5.68
	ベルギー	3,675,439,155	2.44
	オーストリア	2,173,039,134	1.44
	フィンランド	940,301,383	0.62
	アイルランド	1,165,136,064	0.77
	イギリス	9,804,857,948	6.51
	スウェーデン	530,219,602	0.35
	ノルウェー	368,020,945	0.24
	デンマーク	765,615,510	0.51
	ポーランド	955,075,454	0.63
	オーストラリア	3,146,821,941	2.09
	シンガポール	607,592,888	0.40
	マレーシア	713,667,490	0.47
南アフリカ	844,029,192	0.56	
	小計	148,818,095,307	98.82
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,780,144,763	1.18
合計（純資産総額）		150,598,240,070	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		61,451,500	0.04

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（％）	償還期限	投資比率（％）
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,250,000	12,841.77	1,187,864,476	12,746.96	1,179,094,480	8.000	2021/11/15	0.78
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,000,000	10,331.92	1,136,511,205	10,702.64	1,177,291,156	1.250	2023/7/31	0.78
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,860,000	10,948.54	1,079,526,718	11,137.59	1,098,166,850	2.125	2021/8/15	0.73
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,700,000	10,758.57	1,043,581,472	11,035.57	1,070,450,807	1.875	2022/7/31	0.71
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,840,000	10,861.36	960,144,986	10,945.57	967,588,484	1.500	2022/1/31	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,150,000	10,605.65	864,360,520	10,939.89	891,601,136	1.750	2023/5/15	0.59

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,830,000	11,302.09	884,954,098	11,310.61	885,620,921	3.500	2020/5/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,050,000	10,961.07	663,145,116	11,139.34	673,930,220	2.125	2021/6/30	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,100,000	10,415.59	635,351,298	10,970.03	669,172,335	2.250	2027/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	11,004.92	660,295,290	11,126.23	667,574,101	2.000	2020/9/30	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,940,000	10,606.52	630,027,465	11,072.49	657,706,183	2.250	2025/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	11,179.40	648,405,635	11,273.69	653,874,169	2.500	2024/1/31	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	10,894.44	631,877,941	11,272.16	653,785,488	2.500	2024/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,120,000	11,718.25	599,974,711	12,577.44	643,965,140	3.625	2043/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,450,000	10,700.68	583,187,577	11,115.09	605,772,609	2.250	2024/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	10,154.48	578,805,630	10,625.75	605,667,750	1.625	2026/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,370,000	11,024.21	592,000,379	11,132.57	597,819,025	2.000	2020/7/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	10,948.41	580,265,989	11,267.13	597,158,382	2.500	2023/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	10,989.03	582,419,057	11,169.05	591,959,790	2.250	2021/7/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	10,365.30	570,091,770	10,739.78	590,688,420	1.375	2023/9/30	0.39
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,930,000	15,097.28	593,323,171	15,026.40	590,537,814	4.250	2023/10/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	10,254.58	543,493,109	11,067.03	586,552,756	2.875	2045/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	10,749.90	569,744,886	11,059.60	586,159,098	2.000	2023/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,810,000	12,336.48	593,384,908	12,090.28	581,542,753	8.750	2020/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,180,000	11,141.31	577,119,930	11,219.73	581,182,216	2.625	2020/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,133.37	556,668,922	11,574.28	578,714,473	3.000	2025/9/30	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,500,000	11,955.50	537,997,549	12,828.67	577,290,169	3.750	2043/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,250,000	10,699.38	561,717,886	10,941.20	574,413,100	1.625	2022/8/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,220,000	10,457.10	545,860,754	10,919.35	569,990,396	2.000	2025/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	10,955.40	558,725,681	11,075.55	564,853,202	1.500	2020/5/31	0.38

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.82
合計	98.82

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	買建	550,000.00	61,451,500	61,451,500	0.04

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド

以下の運用状況は2019年4月26日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	11,045,855,365	45.89
	カナダ	441,569,924	1.83
	メキシコ	188,745,356	0.78
	ドイツ	1,520,762,142	6.32
	イタリア	2,006,916,407	8.34
	フランス	2,389,770,624	9.93
	オランダ	460,213,739	1.91
	スペイン	1,332,805,950	5.54
	ベルギー	574,181,536	2.39
	オーストリア	353,284,846	1.47
	フィンランド	130,309,028	0.54
	アイルランド	199,370,174	0.83
	イギリス	1,517,243,589	6.30
	スウェーデン	140,418,602	0.58
	ノルウェー	69,416,263	0.29
	デンマーク	123,242,623	0.51
	ポーランド	110,438,433	0.46
	オーストラリア	494,805,776	2.06
	シンガポール	57,204,441	0.24
マレーシア	202,428,483	0.84	
南アフリカ	136,883,104	0.57	
	小計	23,495,866,405	97.61
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		576,530,126	2.39
合計（純資産総額）		24,072,396,531	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		23,746,261,430	98.65

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	利率 （％）	償還期限	投資 比率 （％）
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,600,000	10,907.97	501,766,990	11,029.24	507,345,047	1.375	2020/9/30	2.11

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,800,000	10,313.68	391,920,163	10,835.68	411,756,113	2.000	2026/11/15	1.71
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	10,415.59	333,299,041	10,970.03	351,041,225	2.250	2027/11/15	1.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,830,000	10,799.20	305,617,557	11,198.98	316,931,169	2.375	2024/8/15	1.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,130,000	13,954.58	297,232,738	14,291.89	304,417,374	6.125	2027/11/15	1.26
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,700,000	10,754.42	290,369,401	11,013.29	297,358,905	1.750	2022/3/31	1.24
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,600,000	11,171.18	290,450,786	11,212.52	291,525,654	2.500	2021/1/31	1.21
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,550,000	10,652.84	271,647,422	10,945.13	279,100,921	1.625	2022/8/15	1.16
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,450,000	11,248.35	275,584,620	11,362.16	278,373,120	3.125	2021/5/15	1.16
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,420,000	10,948.62	264,956,783	11,137.59	269,529,795	2.125	2021/8/15	1.12
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,400,000	10,955.40	262,929,732	11,075.55	265,813,271	1.500	2020/5/31	1.10
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,400,000	10,844.19	260,260,634	10,845.51	260,292,427	1.500	2023/3/31	1.08
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,350,000	10,735.63	252,287,339	11,003.68	258,586,495	1.750	2022/5/15	1.07
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,300,000	10,700.68	246,115,858	11,115.09	255,647,156	2.250	2024/11/15	1.06
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,400,000	10,091.40	242,193,816	10,598.87	254,373,115	1.625	2026/5/15	1.06
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,400,000	9,530.19	228,724,571	10,307.23	247,373,752	2.500	2045/2/15	1.03
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,080,000	11,061.29	230,074,859	11,396.68	237,051,026	2.750	2024/2/15	0.98
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,050,000	10,858.84	222,606,330	11,097.39	227,496,673	2.000	2022/2/15	0.95
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,050,000	10,605.65	217,415,837	10,939.89	224,267,770	1.750	2023/5/15	0.93
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,000,000	10,999.75	219,995,080	11,140.87	222,817,434	2.125	2021/1/31	0.93
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,900,000	10,933.77	207,741,721	11,037.32	209,709,138	1.375	2020/8/31	0.87
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,580,000	12,980.03	205,084,562	13,260.46	209,515,311	3.750	2021/8/1	0.87
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,500,000	13,649.98	204,749,735	13,606.17	204,092,654	2.250	2022/10/25	0.85
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,010,000	18,351.51	185,350,316	19,133.42	193,247,594	4.000	2038/10/25	0.80
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,100,000	16,755.49	184,310,439	17,082.34	187,905,842	5.900	2026/7/30	0.78
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	10,727.33	182,364,647	11,022.90	187,389,382	1.875	2022/10/31	0.78
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	11,366.09	181,857,542	11,434.91	182,958,629	3.625	2021/2/15	0.76
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,200,000	15,062.48	180,749,763	15,192.95	182,315,458	4.800	2024/1/31	0.76
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,850,000	9,191.60	170,044,717	9,727.01	179,949,828	2.250	2046/8/15	0.75
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	10,641.69	170,267,197	10,960.86	175,373,809	1.750	2023/1/31	0.73

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.61
合計	97.61

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	売建	99,556,000.00	11,008,587,794	11,088,666,510	46.06

加ドル	売建	5,394,000.00	449,420,417	446,158,480	1.85
メキシコペソ	売建	33,116,000.00	186,774,699	191,877,120	0.80
ユーロ	売建	73,154,000.00	9,180,768,607	9,098,929,530	37.80
英ポンド	売建	10,620,000.00	1,557,579,647	1,528,436,780	6.35
スウェーデンクローナ	売建	12,191,000.00	145,379,652	142,756,470	0.59
ノルウェークローネ	売建	5,524,000.00	71,063,817	70,966,000	0.29
デンマーククローネ	売建	7,486,000.00	125,844,973	124,716,760	0.52
ポーランドズロチ	売建	3,888,000.00	112,933,039	112,280,740	0.47
豪ドル	売建	6,440,000.00	503,589,731	503,476,990	2.09
シンガポールドollar	売建	713,000.00	58,396,443	58,252,890	0.24
マレーシアリングgit	売建	8,889,000.00	240,985,527	238,847,430	0.99
南アフリカランド	売建	18,457,000.00	141,469,451	140,895,730	0.59

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

参考情報

運用実績

2019年4月26日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 15,431円
純資産総額…………… 1.26億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2009年4月末の基準価額を起点として指数化しています。
※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2014年10月	2015年10月	2016年10月	2017年10月	2018年10月	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	80円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	60.07%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	10.22%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	10.22%
日本債券インデックスマザーファンド	4.94%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	4.96%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	4.95%
現金その他	4.64%

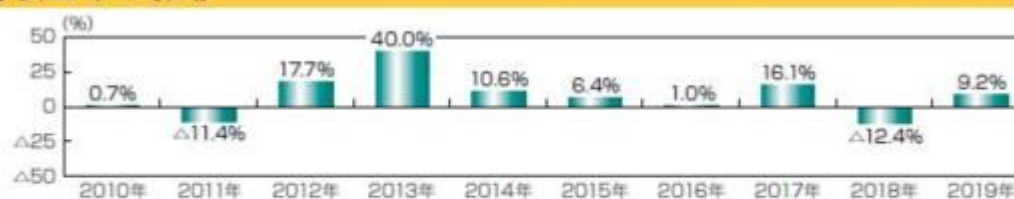
※当ファンドの対純資産総額比です。

<組入上位銘柄>

組入資産	銘柄	業種・種類	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.27%
	2 ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.01%
	3 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.59%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.48%
	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	2.40%
	3 AMAZON.COM INC	小売	2.01%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.51%
	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	2.42%
	3 AMAZON.COM INC	小売	2.04%
日本債券インデックスマザーファンド	1 第341回利付国債(10年)	国債証券	1.81%
	2 第345回利付国債(10年)	国債証券	1.56%
	3 第124回利付国債(5年)	国債証券	1.41%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	1 US TREASURY N/B(クーポン8.000%)	国債証券	0.78%
	2 US TREASURY N/B(クーポン1.250%)	国債証券	0.78%
	3 US TREASURY N/B(クーポン2.125%)	国債証券	0.73%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	1 US TREASURY N/B(クーポン1.375%)	国債証券	2.11%
	2 US TREASURY N/B(クーポン2.000%)	国債証券	1.71%
	3 US TREASURY N/B(クーポン2.250%)	国債証券	1.46%

※各マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



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

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2019年は、2019年4月末までの騰落率です。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第3【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2018年10月27日から2019年4月26日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前計算期間末 2018年10月26日現在	当中間計算期間末 2019年4月26日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,356,019	-
コール・ローン	5,569,277	6,393,182
親投資信託受益証券	118,142,930	120,999,581
流動資産合計	125,068,226	127,392,763
資産合計		
	125,068,226	127,392,763
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	83,586	-
未払受託者報酬	35,916	33,403
未払委託者報酬	510,888	475,039
未払利息	8	8
その他未払費用	3,464	2,611
流動負債合計	633,862	511,061
負債合計		
	633,862	511,061
純資産の部		
元本等		
元本	83,586,982	82,222,753
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	40,847,382	44,658,949
（分配準備積立金）	41,003,274	39,084,922
元本等合計	124,434,364	126,881,702
純資産合計		
	124,434,364	126,881,702
負債純資産合計		
	125,068,226	127,392,763

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自 2017年10月27日 至 2018年4月26日	当中間計算期間 自 2018年10月27日 至 2019年4月26日
営業収益		
受取利息	1	3
有価証券売買等損益	1,958,132	4,919,133
営業収益合計	1,958,133	4,919,136
営業費用		

	前中間計算期間 自 2017年10月27日 至 2018年 4月26日	当中間計算期間 自 2018年10月27日 至 2019年 4月26日
支払利息	1,559	1,147
受託者報酬	36,593	33,403
委託者報酬	520,413	475,039
その他費用	3,534	2,780
営業費用合計	562,099	512,369
営業利益又は営業損失()	1,396,034	4,406,767
経常利益又は経常損失()	1,396,034	4,406,767
中間純利益又は中間純損失()	1,396,034	4,406,767
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	73,494	87,572
期首剰余金又は期首欠損金()	49,426,600	40,847,382
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,282,285	1,261,176
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,282,285	1,261,176
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,910,957	1,943,948
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,910,957	1,943,948
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	49,120,468	44,658,949

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

	前計算期間末 2018年10月26日現在	当中間計算期間末 2019年 4月26日現在
1. 期首元本額	87,321,265円	83,586,982円
期中追加設定元本額	8,745,652円	2,649,213円
期中一部解約元本額	12,479,935円	4,013,442円
2. 受益権の総数	83,586,982口	82,222,753口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間 自 2017年10月27日 至 2018年 4月26日	当中間計算期間 自 2018年10月27日 至 2019年 4月26日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	前計算期間末 2018年10月26日現在	当中間計算期間末 2019年 4月26日現在
中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	中間貸借対照表計上額は中間計算期間末日の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(1口当たり情報)

前計算期間末 2018年10月26日現在	当中間計算期間末 2019年 4月26日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)
1.4887円 (14,887円)	1.5431円 (15,431円)

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

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2018年10月26日現在	2019年 4月26日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	40,005,132	-
コール・ローン	164,304,178	111,972,755
株式	27,555,913,710	30,544,666,800
派生商品評価勘定	-	3,488,660
未収入金	-	84,080,860
未収配当金	255,425,884	342,629,159
前払金	33,700,000	-
流動資産合計	28,049,348,904	31,086,838,234
資産合計		
28,049,348,904		
31,086,838,234		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	34,185,260	422,160
前受金	-	5,580,000
未払金	149,211,710	97,323,700
未払解約金	428,164	42,471,386
未払利息	258	153
流動負債合計	183,825,392	145,797,399
負債合計		
183,825,392		
145,797,399		
純資産の部		
元本等		
元本	19,319,878,842	20,880,089,581
剰余金		
剰余金又は欠損金()	8,545,644,670	10,060,951,254
元本等合計	27,865,523,512	30,941,040,835
純資産合計		
27,865,523,512		
30,941,040,835		
負債純資産合計		
28,049,348,904		
31,086,838,234		

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

（貸借対照表に関する注記）

		2018年10月26日現在	2019年 4月26日現在
1.	期首	2017年10月27日	2018年10月27日
	期首元本額	18,714,990,799円	19,319,878,842円
	期首からの追加設定元本額	2,763,601,529円	2,366,602,846円
	期首からの一部解約元本額	2,158,713,486円	806,392,107円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	391,285,298円	487,773,107円
	DCインデックスバランス（株式40）	1,131,807,591円	1,342,649,083円
	DCインデックスバランス（株式60）	2,170,432,401円	2,595,796,510円
	DCインデックスバランス（株式80）	2,306,839,231円	2,730,940,753円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,494,214,984円	1,379,471,901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	3,335,407,317円	3,582,656,930円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	3,366,097円	- 円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	685,436,046円	736,772,435円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	50,736,936円	51,433,195円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	41,072,726円	43,260,042円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	69,780,983円	78,459,536円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	60,878,867円	63,138,822円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	4,374,639,542円	4,377,295,747円
	世界アセットバランスファンド40（適格機関投資家向け）	1,164,137円	- 円
	世界アセットバランスファンド25（適格機関投資家向け）	1,959,662円	- 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	259,173,263円	280,024,865円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	743,842,894円	807,958,867円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,101,842,051円	1,164,345,418円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,095,998,816円	1,158,112,370円
	計	19,319,878,842円	20,880,089,581円
2.	受益権の総数	19,319,878,842口	20,880,089,581口
3.	担保資産		
	デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。		
	株式	412,220,000円	408,885,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2018年10月26日現在	2019年 4月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(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)

(2018年10月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	338,270,000	-	304,095,000	34,175,000
合計		338,270,000	-	304,095,000	34,175,000

(2019年 4月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				

	買建	400,670,000	-	403,750,000	3,080,000
	合計	400,670,000	-	403,750,000	3,080,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

2018年10月26日現在		2019年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	1.4423円	1口当たり純資産額	1.4818円
(1万口当たり純資産額)	(14,423円)	(1万口当たり純資産額)	(14,818円)

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

貸借対照表

(単位:円)

	2018年10月26日現在	2019年 4月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	161,793,334	1,012,410,109
金銭信託	231,905,007	-
コール・ローン	952,451,846	3,390,157,974
出資金	8,217,162	8,882,623
株式	86,957,039,121	109,990,505,620
投資証券	2,218,921,193	2,924,147,296
派生商品評価勘定	4,602,675	30,644,956
未収入金	107,998,029	4,111,027
未収配当金	77,429,302	139,245,800
差入委託証拠金	241,069,971	624,923,023
流動資産合計	90,961,427,640	118,125,028,428
資産合計	90,961,427,640	118,125,028,428
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	101,384,053	14,315,132
未払金	119,398,847	-
未払解約金	22,580,739	279,717,525
未払利息	1,498	4,644
流動負債合計	243,365,137	294,037,301
負債合計	243,365,137	294,037,301
純資産の部		
元本等		
元本	37,961,659,533	45,240,385,650
剰余金		
剰余金又は欠損金()	52,756,402,970	72,590,605,477

	2018年10月26日現在	2019年 4月26日現在
元本等合計	90,718,062,503	117,830,991,127
純資産合計	90,718,062,503	117,830,991,127
負債純資産合計	90,961,427,640	118,125,028,428

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	2018年10月26日現在	2019年 4月26日現在
1. 期首	2017年10月27日	2018年10月27日
期首元本額	34,878,791,197円	37,961,659,533円
期首からの追加設定元本額	6,427,442,010円	9,251,219,890円
期首からの一部解約元本額	3,344,573,674円	1,972,493,773円
元本の内訳		
インデックスファンド海外株式ヘッジなし(DC専用)	17,203,096,280円	17,590,102,399円
DCインデックスバランス(株式20)	80,398,407円	94,187,556円
DCインデックスバランス(株式40)	233,573,191円	260,049,343円
DCインデックスバランス(株式60)	447,780,159円	503,091,242円
DCインデックスバランス(株式80)	476,526,520円	520,689,662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	2,074,639,698円	2,088,427,556円
日興五大陸株式ファンド	5,375,436,468円	5,314,739,797円
全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	18,815,844円	- 円
インデックスファンド海外先進国株式(適格機関投資家向け)	93,227,038円	80,845,044円
インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	147,464,472円	149,883,088円
インデックスファンド先進国株式(適格機関投資家向け)	2,627,937,561円	6,977,490,455円
グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	25,916,934円	2,926,872,265円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	5,282,446円	4,980,021円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	4,311,945円	4,242,782円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	7,218,871円	7,603,217円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	6,309,667円	6,017,259円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	4,512,298,631円	4,120,343,469円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	26,918,914円	26,756,132円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	76,175,076円	78,032,012円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	112,997,773円	112,278,190円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	113,413,192円	111,142,254円
インデックスファンド海外株式(ヘッジなし)	4,291,920,446円	4,262,611,907円
計	37,961,659,533円	45,240,385,650円
2. 受益権の総数	37,961,659,533口	45,240,385,650口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2018年10月26日現在	2019年 4月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品

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

(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)

(2018年10月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,601,502,112	-	1,504,603,584	96,898,528
	合計	1,601,502,112	-	1,504,603,584	96,898,528

(2019年 4月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,657,683,634	-	5,676,538,658	18,855,024
	合計	5,657,683,634	-	5,676,538,658	18,855,024

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(2018年10月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,305,740,850	-	1,305,858,000	117,150
	米ドル	1,168,581,175	-	1,171,604,500	3,023,325
	ユーロ	137,159,675	-	134,253,500	2,906,175
合計		1,305,740,850	-	1,305,858,000	117,150

(2019年 4月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	4,035,501,200	-	4,032,976,000	2,525,200
	米ドル	3,144,807,595	-	3,149,867,000	5,059,405
	ユーロ	890,693,605	-	883,109,000	7,584,605
合計		4,035,501,200	-	4,032,976,000	2,525,200

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

2018年10月26日現在		2019年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	2.3897円	1口当たり純資産額	2.6046円
(1万口当たり純資産額)	(23,897円)	(1万口当たり純資産額)	(26,046円)

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

貸借対照表

（単位：円）

	2018年10月26日現在	2019年 4月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	51,897,794	44,394,380
金銭信託	41,634,297	-
コール・ローン	170,995,284	107,645,339
株式	6,327,724,845	7,608,267,177
投資証券	162,570,443	204,700,823
派生商品評価勘定	39,065,779	33,330,136
未収入金	9,232,010	280,657
未収配当金	5,787,810	9,707,497
差入委託証拠金	55,461,137	104,879,412
流動資産合計	6,864,369,399	8,113,205,421
資産合計	6,864,369,399	8,113,205,421
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	58,701,960	45,636,452
未払金	10,068,734	59,657
未払解約金	2,580,812	6,057,623
未払利息	269	147
流動負債合計	71,351,775	51,753,879
負債合計	71,351,775	51,753,879
純資産の部		
元本等		
元本	4,317,838,768	4,689,087,108
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,475,178,856	3,372,364,434
元本等合計	6,793,017,624	8,061,451,542
純資産合計	6,793,017,624	8,061,451,542
負債純資産合計	6,864,369,399	8,113,205,421

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券
--------------------	--

	<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)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、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p> <p>適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>(1) デリバティブ取引</p> <p>個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p> <p>(2) 為替予約取引</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>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <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>

(貸借対照表に関する注記)

		2018年10月26日現在	2019年 4月26日現在
1.	期首	2017年10月27日	2018年10月27日
	期首元本額	3,576,957,718円	4,317,838,768円
	期首からの追加設定元本額	1,161,111,188円	577,967,607円
	期首からの一部解約元本額	420,230,138円	206,719,267円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外株式ヘッジあり(DC専用)	2,802,212,323円	3,054,856,128円
	インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	437,588,598円	450,971,128円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	8,034,788円	7,539,145円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	6,520,047円	6,409,671円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	11,040,978円	11,500,395円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	9,640,630円	9,149,946円
	世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け)	3,367,988円	-円
	世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け)	2,839,097円	-円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	41,001,984円	40,532,345円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	115,922,313円	118,049,342円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	171,685,569円	169,921,624円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	172,791,072円	168,145,116円

	インデックスファンド海外株式(ヘッジあり)	535,193,381円	652,012,268円
	計	4,317,838,768円	4,689,087,108円
2.	受益権の総数	4,317,838,768口	4,689,087,108口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2018年10月26日現在	2019年 4月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(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)

(2018年10月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	334,619,385	-	319,728,260	14,891,125
	合計	334,619,385	-	319,728,260	14,891,125

(2019年 4月26日現在)

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	232,920,041	-	243,280,228	10,360,187
	合計	232,920,041	-	243,280,228	10,360,187

（注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（通貨関連）

（2018年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	6,525,498,274	-	6,530,243,330	4,745,056
	米ドル	4,435,028,415	-	4,464,638,200	29,609,785
	加ドル	240,820,469	-	241,121,700	301,231
	ユーロ	790,879,581	-	781,360,180	9,519,401
	英ポンド	433,835,312	-	426,204,020	7,631,292
	スイスフラン	215,230,861	-	211,274,060	3,956,801
	スウェーデンクローナ	63,799,572	-	62,785,920	1,013,652
	ノルウェークローネ	18,447,317	-	18,274,320	172,997
	デンマーククローネ	40,275,263	-	39,539,340	735,923
	豪ドル	171,391,847	-	168,984,000	2,407,847

	ニュージーランド ドル	2,206,651	-	2,186,740	19,911
	香港ドル	77,832,421	-	78,099,700	267,279
	シンガポールドル	30,147,186	-	30,183,710	36,524
	イスラエルシケ ル	5,603,379	-	5,591,440	11,939
	合計	6,525,498,274	-	6,530,243,330	4,745,056

(2019年 4月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	7,919,467,107	-	7,942,133,610	22,666,503
	米ドル	5,411,418,464	-	5,454,576,700	43,158,236
	加ドル	293,430,346	-	292,217,630	1,212,716
	ユーロ	950,843,478	-	942,484,110	8,359,368
	英ポンド	501,042,479	-	495,390,250	5,652,229
	スイスフラン	259,793,557	-	257,293,140	2,500,417
	スウェーデンク ローナ	78,283,158	-	76,687,570	1,595,588
	ノルウェークロー ネ	20,801,142	-	20,719,990	81,152
	デンマーククロー ネ	53,630,877	-	52,995,460	635,417
	豪ドル	203,933,095	-	202,964,500	968,595
	ニュージーランド ドル	3,953,747	-	3,909,810	43,937
	香港ドル	104,024,011	-	104,532,030	508,019
	シンガポールドル	34,537,349	-	34,546,260	8,911
	イスラエルシケ ル	3,775,404	-	3,816,160	40,756
	合計	7,919,467,107	-	7,942,133,610	22,666,503

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

2018年10月26日現在		2019年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	1.5732円	1口当たり純資産額	1.7192円
(1万口当たり純資産額)	(15,732円)	(1万口当たり純資産額)	(17,192円)

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2018年10月26日現在	2019年 4月26日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	23,033,935	-
コール・ローン	94,602,155	129,406,788
国債証券	30,067,973,850	30,783,590,412
地方債証券	2,792,055,000	3,096,397,000
特殊債券	3,106,375,000	2,866,520,730
社債券	2,356,368,000	2,968,365,186
未収利息	80,137,461	77,332,910
前払費用	719,683	2,028,993
流動資産合計	38,521,265,084	39,923,642,019
資産合計	38,521,265,084	39,923,642,019
負債の部		
流動負債		
未払金	-	103,131,000
未払解約金	54,418,138	6,334,884
未払利息	148	177
流動負債合計	54,418,286	109,466,061
負債合計	54,418,286	109,466,061
純資産の部		
元本等		
元本	27,733,551,245	28,111,498,609
剰余金		
剰余金又は欠損金()	10,733,295,553	11,702,677,349
元本等合計	38,466,846,798	39,814,175,958
純資産合計	38,466,846,798	39,814,175,958
負債純資産合計	38,521,265,084	39,923,642,019

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2018年10月26日現在	2019年 4月26日現在
1.	期首	2017年10月27日	2018年10月27日
	期首元本額	26,501,934,817円	27,733,551,245円
	期首からの追加設定元本額	3,531,441,697円	1,787,020,676円
	期首からの一部解約元本額	2,299,825,269円	1,409,073,312円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	1,832,450,054円	2,211,830,019円
	DCインデックスバランス（株式40）	1,862,268,494円	2,094,897,879円
	DCインデックスバランス（株式60）	1,342,863,165円	1,501,854,977円
	DCインデックスバランス（株式80）	221,368,003円	237,752,530円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	1,798,701,774円	1,904,858,468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	3,834,626,257円	3,594,443,311円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	3,933,014円	- 円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	1,514,625,168円	1,482,831,594円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	4,753,159円	4,429,539円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	26,123,505円	24,970,402円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	119,991,693円	121,405,204円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	300,427,344円	285,528,346円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	4,991,215,999円	4,562,167,681円
	世界アセットバランスファンド40（適格機関投資家向け）	3,454,881円	- 円
	世界アセットバランスファンド25（適格機関投資家向け）	8,181,717円	- 円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	1,241,071,680円	1,262,654,750円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,252,645,847円	1,253,146,064円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	685,795,510円	667,781,876円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	102,644,008円	100,275,987円
インデックスファンド日本債券（1年決算型）	6,322,149,282円	6,513,587,390円
日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	264,260,691円	287,082,592円
計	27,733,551,245円	28,111,498,609円
2. 受益権の総数	27,733,551,245口	28,111,498,609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

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2018年10月26日現在	2019年 4月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（1口当たり情報）

	2018年10月26日現在	2019年 4月26日現在
1口当たり純資産額	1.3870円	1.4163円

(1万口当たり純資産額)	(13,870円)	(1万口当たり純資産額)	(14,163円)
--------------	-----------	--------------	-----------

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2018年10月26日現在	2019年 4月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	346,171,535	430,700,360
金銭信託	7,521,161	-
コール・ローン	30,889,993	75,163,145
国債証券	145,412,931,383	148,818,140,244
派生商品評価勘定	165	-
未収利息	1,305,504,312	1,284,250,228
前払費用	25,047,200	28,419,071
流動資産合計	147,128,065,749	150,636,673,048
資産合計	147,128,065,749	150,636,673,048
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	288,000	-
未払解約金	94,343,279	38,432,876
未払利息	48	102
流動負債合計	94,631,327	38,432,978
負債合計	94,631,327	38,432,978
純資産の部		
元本等		
元本	66,172,631,391	65,911,636,828
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	80,860,803,031	84,686,603,242
元本等合計	147,033,434,422	150,598,240,070
純資産合計	147,033,434,422	150,598,240,070
負債純資産合計	147,128,065,749	150,636,673,048

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

	適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び第61条にしたがって処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

		2018年10月26日現在	2019年 4月26日現在
1.	期首	2017年10月27日	2018年10月27日
	期首元本額	68,830,787,765円	66,172,631,391円
	期首からの追加設定元本額	3,405,417,219円	1,321,653,756円
	期首からの一部解約元本額	6,063,573,593円	1,582,648,319円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外債券ヘッジなし(DC専用)	11,964,377,999円	12,245,376,078円
	DCインデックスバランス(株式20)	174,920,013円	209,990,342円
	DCインデックスバランス(株式40)	255,247,492円	287,035,211円
	DCインデックスバランス(株式60)	331,015,030円	370,248,705円
	DCインデックスバランス(株式80)	268,750,988円	292,789,973円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	23,997,016,330円	24,400,524,993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	2,370,288,668円	2,247,700,741円
	日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	19,440,325,696円	18,487,436,389円
	全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	21,654,534円	- 円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	543,560,785円	696,891,044円
	インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	158,267,081円	152,697,699円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	2,942,188円	2,755,044円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	3,217,087円	3,089,388円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	8,154,550円	8,367,730円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	14,261,162円	13,536,609円
	世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	878,532,138円	868,259,206円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	1,029,476,088円	940,339,095円
	世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け)	2,937,316円	- 円
	世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け)	5,673,700円	- 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	59,228,746円	59,850,018円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	85,787,859円	86,205,331円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	84,822,845円	82,752,272円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	63,482,009円	61,877,713円
インデックスファンド海外債券（ヘッジなし）1年決算型	4,156,011,407円	4,135,733,323円
海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	252,679,680円	258,179,924円
計	66,172,631,391円	65,911,636,828円
2. 受益権の総数	66,172,631,391口	65,911,636,828口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2018年10月26日現在	2019年 4月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（2018年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	74,206,815	-	74,494,650	287,835
	米ドル	67,176,000	-	67,464,000	288,000
	ユーロ	7,030,815	-	7,030,650	165
合計		74,206,815	-	74,494,650	287,835

(2019年 4月26日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	61,451,500	-	61,451,500	-
	米ドル	61,451,500	-	61,451,500	-
合計		61,451,500	-	61,451,500	-

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

2018年10月26日現在		2019年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	2,222円	1口当たり純資産額	2,284円
(1万口当たり純資産額)	(22,220円)	(1万口当たり純資産額)	(22,849円)

海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2018年10月26日現在	2019年 4月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	97,169,128	90,452,338
金銭信託	15,003,438	-
コール・ローン	61,620,281	230,490,154
国債証券	24,012,612,135	23,495,866,405
派生商品評価勘定	264,684,285	124,479,186
未収入金	-	170,559
未収利息	239,886,562	214,744,640
前払費用	5,213,463	6,487,473
流動資産合計	24,696,189,292	24,162,690,755
資産合計	24,696,189,292	24,162,690,755
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	35,464,965	87,946,819
未払金	-	210,913
未払解約金	52,361,625	2,136,177
未払利息	96	315
流動負債合計	87,826,686	90,294,224
負債合計	87,826,686	90,294,224
純資産の部		
元本等		
元本	16,823,343,930	15,922,004,937
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	7,785,018,676	8,150,391,594
元本等合計	24,608,362,606	24,072,396,531
純資産合計	24,608,362,606	24,072,396,531
負債純資産合計	24,696,189,292	24,162,690,755

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2018年10月26日現在	2019年 4月26日現在
1.	期首	2017年10月27日	2018年10月27日
	期首元本額	17,017,756,688円	16,823,343,930円
	期首からの追加設定元本額	1,122,522,227円	387,024,472円
	期首からの一部解約元本額	1,316,934,985円	1,288,363,465円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外債券ヘッジあり（DC専用）	2,098,854,047円	2,304,875,576円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	1,183,255,079円	1,162,377,141円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	4,492,130円	4,157,059円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	4,928,627円	4,683,987円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	12,564,634円	12,655,220円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	21,827,881円	20,576,581円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	12,532,569,503円	11,408,889,394円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	90,510,867円	90,981,071円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	131,366,819円	130,337,587円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	129,222,482円	125,049,180円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	97,118,078円	93,883,308円
	インデックスファンド海外債券（ヘッジあり）1年決算型	516,633,783円	563,538,833円
	計	16,823,343,930円	15,922,004,937円
2.	受益権の総数	16,823,343,930口	15,922,004,937口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2018年10月26日現在	2019年 4月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(2018年10月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	24,558,872,960	-	24,329,653,640	229,219,320
	米ドル	10,966,235,039	-	10,965,771,870	463,169
	加ドル	459,678,639	-	467,942,660	8,264,021
	メキシコペソ	205,498,855	-	204,640,020	858,835
	ユーロ	9,811,796,484	-	9,603,928,590	207,867,894
	英ポンド	1,640,076,901	-	1,632,914,200	7,162,701
	スウェーデンクローナ	151,195,334	-	149,079,540	2,115,794
	ノルウェークローネ	73,886,258	-	73,140,870	745,388
	デンマーククローネ	161,826,504	-	159,759,390	2,067,114
	ポーランドズロチ	119,597,310	-	115,427,450	4,169,860
	豪ドル	520,463,981	-	511,688,540	8,775,441
シンガポールドル	81,104,893	-	80,668,020	436,873	

	マレーシアリン ギット	232,876,513	-	232,294,470	582,043
	南アフリカランド	134,636,249	-	132,398,020	2,238,229
	合計	24,558,872,960	-	24,329,653,640	229,219,320

(2019年 4月26日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の 取引	為替予約取引				
	売建	23,782,793,797	-	23,746,261,430	36,532,367
	米ドル	11,008,587,794	-	11,088,666,510	80,078,716
	加ドル	449,420,417	-	446,158,480	3,261,937
	メキシコペソ	186,774,699	-	191,877,120	5,102,421
	ユーロ	9,180,768,607	-	9,098,929,530	81,839,077
	英ポンド	1,557,579,647	-	1,528,436,780	29,142,867
	スウェーデンク ローナ	145,379,652	-	142,756,470	2,623,182
	ノルウェークロー ネ	71,063,817	-	70,966,000	97,817
	デンマーククロー ネ	125,844,973	-	124,716,760	1,128,213
	ポーランドズロチ	112,933,039	-	112,280,740	652,299
	豪ドル	503,589,731	-	503,476,990	112,741
	シンガポールドル	58,396,443	-	58,252,890	143,553
	マレーシアリン ギット	240,985,527	-	238,847,430	2,138,097
	南アフリカランド	141,469,451	-	140,895,730	573,721
	合計	23,782,793,797	-	23,746,261,430	36,532,367

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

2018年10月26日現在		2019年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	1.4628円	1口当たり純資産額	1.5119円
(1万口当たり純資産額)	(14,628円)	(1万口当たり純資産額)	(15,119円)

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2019年 4月26日現在です。

【アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）】

【純資産額計算書】

資産総額	127,392,763円
負債総額	511,061円
純資産総額（ - ）	126,881,702円
発行済口数	82,222,753口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5431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	31,081,258,234円
負債総額	140,217,399円
純資産総額（ - ）	30,941,040,835円
発行済口数	20,880,089,581口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4818円

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	118,125,028,428円
負債総額	294,037,301円
純資産総額（ - ）	117,830,991,127円
発行済口数	45,240,385,650口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6046円

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

純資産額計算書

資産総額	8,113,205,421円
負債総額	51,753,879円
純資産総額（ - ）	8,061,451,542円
発行済口数	4,689,087,108口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7192円

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	39,923,642,019円
負債総額	109,466,061円
純資産総額（ - ）	39,814,175,958円
発行済口数	28,111,498,609口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4163円

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	150,636,673,048円
負債総額	38,432,978円
純資産総額（ - ）	150,598,240,070円
発行済口数	65,911,636,828口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2849円

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	24,162,690,755円
負債総額	90,294,224円
純資産総額（ - ）	24,072,396,531円
発行済口数	15,922,004,937口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5119円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

<更新後>

(1) 資本金の額

2019年4月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（2019年4月末現在）

・株主総会

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

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

・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。

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

・監査役会

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

(3) 運用の意思決定プロセス（2019年4月末現在）

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

2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。

・委託会社の運用する、2019年4月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	812	179,725
株式投資信託	768	153,435
単位型	246	8,741
追加型	522	144,693
公社債投資信託	44	26,290
単位型	30	657
追加型	14	25,632

3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第60期事業年度（2018年4月1日から2019年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第59期 (2018年3月31日)		第60期 (2019年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	14,024	3	20,680
有価証券		19		1
前払費用		551		495
未収入金		73		38
未収委託者報酬		15,873		16,867
未収収益	3	3,174	3	618
関係会社短期貸付金		1,128		2,408
立替金		2,776		791
その他	2,3	4,179	2	869
流動資産合計		41,800		42,769
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	68	1	136
器具備品	1	122	1	137
有形固定資産合計		191		274
無形固定資産				
ソフトウェア		99		107
無形固定資産合計		99		107
投資その他の資産				
投資有価証券		14,103		16,755

関係会社株式	25,769	25,769
長期差入保証金	490	447
長期前払費用	0	-
繰延税金資産	1,504	1,913
投資その他の資産合計	41,868	44,886
固定資産合計	42,159	45,268
資産合計	83,959	88,038

(単位：百万円)

	第59期 (2018年3月31日)	第60期 (2019年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	3	354
未払金	5,874	6,112
未払収益分配金	7	7
未払償還金	91	71
未払手数料	3	5,299
その他未払金	651	734
未払費用	3	3,897
未払法人税等	2,185	2,382
未払消費税等	4	621
賞与引当金	2,286	2,680
役員賞与引当金	198	210
その他	41	172
流動負債合計	19,813	16,431
固定負債		
退職給付引当金	1,316	1,405
その他	318	629
固定負債合計	1,634	2,035
負債合計	21,448	18,466
純資産の部		
株主資本		
資本金	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金	5,220	5,220
資本剰余金合計	5,220	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	39,959	47,142
利益剰余金合計	39,959	47,142
自己株式	786	833
株主資本合計	61,756	68,891
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	408	493
繰延ヘッジ損益	346	185
評価・換算差額等合計	754	679

純資産合計	62,511	69,571
負債純資産合計	83,959	88,038

(2) 【損益計算書】

	(単位：百万円)	
	第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	70,609	77,264
その他営業収益	5,398	3,063
営業収益合計	76,008	80,328
営業費用		
支払手数料	30,448	32,834
広告宣伝費	973	960
公告費	2	2
調査費	18,132	18,251
調査費	862	890
委託調査費	17,241	17,333
図書費	28	27
委託計算費	520	541
営業雑経費	740	794
通信費	173	128
印刷費	348	334
協会費	68	69
諸会費	24	19
その他	125	243
営業費用計	50,817	53,385
一般管理費		
給料	9,096	9,783
役員報酬	507	241
役員賞与引当金繰入額	198	210
給料・手当	6,083	6,589
賞与	20	61
賞与引当金繰入額	2,286	2,680
交際費	99	92
寄付金	16	13
旅費交通費	455	476
租税公課	424	428
不動産賃借料	890	888
退職給付費用	355	378
退職金	24	52
固定資産減価償却費	152	108
福利費	974	1,071
諸経費	3,175	3,106
一般管理費計	15,664	16,401
営業利益	9,526	10,540

	(単位：百万円)	
	第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業外収益		

受取利息		26		37
受取配当金	1	1,120	1	1,865
有価証券償還益		1		1
デリバティブ収益		-	1	142
時効成立分配金・償還金		1		21
為替差益		79		58
その他		41		48
営業外収益合計		1,272		2,176
営業外費用				
支払利息	1	223	1	286
デリバティブ費用	1	295		-
時効成立後支払分配金・償還金		0		78
長期差入保証金償却額		212		-
その他		34		24
営業外費用合計		767		388
経常利益		10,030		12,328
特別利益				
投資有価証券売却益		199		218
特別利益合計		199		218
特別損失				
投資有価証券売却損		133		176
固定資産処分損		7		0
役員退職一時金		117		180
損害賠償損失		81		-
特別損失合計		340		357
税引前当期純利益		9,890		12,189
法人税、住民税及び事業税		3,217		3,741
法人税等調整額		307		375
法人税等合計		2,910		3,366
当期純利益		6,979		8,823

(3) 【株主資本等変動計算書】

第59期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	34,015	34,015	672	55,926
当期変動額							
剰余金の配当				1,036	1,036		1,036
当期純利益				6,979	6,979		6,979
自己株式の取得						113	113
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	5,943	5,943	113	5,830

当期末残高	17,363	5,220	5,220	39,959	39,959	786	61,756
-------	--------	-------	-------	--------	--------	-----	--------

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額等 合計	
当期首残高	282	266	548	56,475
当期変動額				
剰余金の配当				1,036
当期純利益				6,979
自己株式の取得				113
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	125	80	206	206
当期変動額合計	125	80	206	6,036
当期末残高	408	346	754	62,511

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計		
				繰越利益 剰余金			
当期首残高	17,363	5,220	5,220	39,959	39,959	786	61,756
当期変動額							
剰余金の配当				1,640	1,640		1,640
当期純利益				8,823	8,823		8,823
自己株式の取得						47	47
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)							
当期変動額合計	-	-	-	7,182	7,182	47	7,135
当期末残高	17,363	5,220	5,220	47,142	47,142	833	68,891

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額 等合計	
当期首残高	408	346	754	62,511
当期変動額				
剰余金の配当				1,640
当期純利益				8,823
自己株式の取得				47
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	85	160	75	75
当期変動額合計	85	160	75	7,060
当期末残高	493	185	679	69,571

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)				
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(2) デリバティブ 時価法</p>				
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産</p> <p>定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <table border="0" data-bbox="528 965 1031 1043"> <tr> <td>建物</td> <td>3年～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4年～20年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	3年～15年	器具備品	4年～20年
建物	3年～15年				
器具備品	4年～20年				
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>				

4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジして おります。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ 手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価して おります。</p>
5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消 費税等は、当事業年度の費用として処理しております。</p>

(未適用の会計基準等)

- 「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日）
- 「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日）

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

- ステップ1：顧客との契約を識別する。
ステップ2：契約における履行義務を識別する。
ステップ3：取引価格を算定する。
ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。
ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

(表示方法の変更)

第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
<p>(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)</p> <p>「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示しております。</p> <p>この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」1,014百万円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,504百万円に含めて表示しております。</p>	

(貸借対照表関係)

第59期 (2018年3月31日)		第60期 (2019年3月31日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額	1	有形固定資産の減価償却累計額
	建物 1,260百万円		建物 1,281百万円
	器具備品 612百万円		器具備品 655百万円

<p>2 信託資産 流動資産のその他のうち3,030百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 現金・預金 3,189百万円 未収収益 592百万円 その他 345百万円 (流動負債) 預り金 419百万円 未払手数料 376百万円 未払費用 677百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務553百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソンタワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務103百万円に対して保証を行っております。</p>	<p>2 信託資産 流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 現金・預金 1,347百万円 未収収益 127百万円 (流動負債) 未払手数料 350百万円 未払費用 767百万円 その他 162百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務468百万円に対して保証を行っております。</p>
---	---

(損益計算書関係)

第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)												
<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">受取配当金</td> <td style="text-align: right;">979百万円</td> </tr> <tr> <td>デリバティブ収益</td> <td style="text-align: right;">407百万円</td> </tr> <tr> <td>支払利息</td> <td style="text-align: right;">213百万円</td> </tr> </table>	受取配当金	979百万円	デリバティブ収益	407百万円	支払利息	213百万円	<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">受取配当金</td> <td style="text-align: right;">1,831百万円</td> </tr> <tr> <td>デリバティブ収益</td> <td style="text-align: right;">54百万円</td> </tr> <tr> <td>支払利息</td> <td style="text-align: right;">75百万円</td> </tr> </table>	受取配当金	1,831百万円	デリバティブ収益	54百万円	支払利息	75百万円
受取配当金	979百万円												
デリバティブ収益	407百万円												
支払利息	213百万円												
受取配当金	1,831百万円												
デリバティブ収益	54百万円												
支払利息	75百万円												

(株主資本等変動計算書関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,119,100	182,600	-	1,301,700

3 新株予約権等に関する事項

	新株予約権の目的となる株式の数(株)
--	--------------------

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	当事業年度 期首	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	当事業年 度末残高 (百万円)
2009年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,689,600	-	194,700	1,494,900	-
2009年度 ストックオプション(2)	普通株式	174,900	-	66,000	108,900	-
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,890,800	-	204,600	2,686,200	-
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,404,000	-	786,000	3,618,000	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	-	4,409,000	532,000	3,877,000	-
合計		9,159,300	4,409,000	1,783,300	11,785,000	-

- (注) 1 2016年度ストックオプション(2)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。
2 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。
3 2009年度ストックオプション(1)1,494,900株、2009年度ストックオプション(2)108,900株及び2011年度ス
tockオプション(1)2,686,200株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の
条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション
(1)及び2016年度ストックオプション(2)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2017年5月25日 取締役会	普通株式	1,036	5.29	2017年3月31日	2017年6月22日

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年5月31日 取締役会	普通株式	利益剰余金	1,640	8.38	2018年3月31日	2018年6月23日

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,301,700	64,000	-	1,365,700

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年 度末残高 (百万円)
		当事業年度 期首	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
2009年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,494,900	-	323,400	1,171,500	-
2009年度 ストックオプション(2)	普通株式	108,900	-	33,000	75,900	-
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,686,200	-	630,300	2,055,900	-
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	3,618,000	-	-	3,618,000	-

2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	3,877,000	-	66,000	3,811,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	-	4,422,000	66,000	4,356,000	-
合計		11,785,000	4,422,000	1,118,700	15,088,300	-

- (注) 1 2017年度ストックオプション(1)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。
 2 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。
 3 2009年度ストックオプション(1)1,171,500株、2009年度ストックオプション(2)75,900株、2011年度ストックオプション(1)2,055,900株及び2016年度ストックオプション(1)1,206,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(1)2,412,000株、2016年度ストックオプション(2)及び2017年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年5月31日 取締役会	普通株式	1,640	8.38	2018年3月31日	2018年6月23日

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年5月28日 取締役会	普通株式	利益剰余金	3,212	16.42	2019年3月31日	2019年6月24日

(リース取引関係)

第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料		オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	866百万円	1年内	853百万円
1年超	923百万円	1年超	6,704百万円
合計	1,790百万円	合計	7,558百万円

(金融商品関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しております。当社が行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、有価証券及び投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主

に自己で設定した投資信託へのシ - ドマネ - の投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計(繰延ヘッジ)を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「4 ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

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

外貨建ての関係会社短期借入金に関しましては、為替変動リスクに晒されておりますが、為替予約によりリスクをヘッジしております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

当社は、預金の預入れやデリバティブ取引を行う金融機関の選定に関しては、相手方の財政状態及び経営成績、又は必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関しても、定期的に継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。

市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

当社は、原則、有価証券及び投資有価証券以外の為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また、有価証券及び投資有価証券に関しては、一部について、為替変動リスクや価格変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益(ヘッジ対象の有価証券及び投資有価証券は、ヘッジ損益考慮後の評価損益)を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュ - ・アット - リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。さらに、外貨建ての関係会社短期借入金に関しては、為替変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。

流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

2018年3月31日(当事業年度の決算日)における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません。

(単位:百万円)

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	14,024	14,024	-
(2) 未収委託者報酬	15,873	15,873	-
(3) 未収収益	3,174	3,174	-
(4) 関係会社短期貸付金	1,128	1,128	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	14,106	14,106	-

(6) 未払金	(5,874)	(5,874)	-
(7) 未払費用	(4,634)	(4,634)	-
(8) デリバティブ取引(2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(14)	(14)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	336	336	-
デリバティブ取引計	321	321	-

(1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(2)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益並びに(4) 関係会社短期貸付金

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないもののうち8百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、23百万円は流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されているものは貸借対照表上流動資産のその他に含まれております。

2 非上場株式等(貸借対照表計上額16百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式(貸借対照表計上額22,876百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額2,892百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	14,024	-	-	-
未収委託者報酬	15,873	-	-	-
未収収益	3,174	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	19	616	1,743	545
合計	33,090	616	1,743	545

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しております。当社が行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、有価証券及び投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシ・ドマネ・の投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「4 ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

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

上記以外の外貨建ての債権及び債務に関しては、為替変動リスクに晒されておりますが、一部為替予約によりリスクをヘッジしております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

当社は、預金の預入れやデリバティブ取引を行う金融機関の選定に関しては、相手方の財政状態及び経営成績、又は必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関しても、定期的に継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

当社は、原則、有価証券及び投資有価証券以外の為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また、有価証券及び投資有価証券に関しては、一部について、為替変動リスクや価格変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益（ヘッジ対象の有価証券及び投資有価証券は、ヘッジ損益考慮後の評価損益）を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュ・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。さらに、外貨建ての貸付金及び借入金に関しては、為替変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

2019年3月31日（当事業年度の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額

(1) 現金・預金	20,680	20,680	-
(2) 未収委託者報酬	16,867	16,867	-
(3) 未収収益	618	618	-
(4) 関係会社短期貸付金	2,408	2,408	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	16,740	16,740	-
(6) 未払金	(6,112)	(6,112)	-
(7) 未払費用	(3,897)	(3,897)	-
(8) デリバティブ取引(2) ヘッジ会計が適用されていないもの	(31)	(31)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(127)	(127)	-
デリバティブ取引計	(158)	(158)	-

(1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(2)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益並びに(4) 関係会社短期貸付金

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないもののうち3百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、35百万円は流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されているもののうち0百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、127百万円は流動負債のその他に含まれております。

2 非上場株式等(貸借対照表計上額16百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式(貸借対照表計上額22,876百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額2,892百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	20,680	-	-	-
未収委託者報酬	16,867	-	-	-
未収収益	618	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	1	163	6,929	1,363
合計	38,167	163	6,929	1,363

(有価証券関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの	投資信託	8,544	7,535	1,008
	小計	8,544	7,535	1,008
貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの	投資信託	5,561	5,982	420
	小計	5,561	5,982	420
合計		14,106	13,518	588

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

2 非上場株式等（貸借対照表計上額 16百万円）については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	2,792	199	133
合計	2,792	199	133

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの	投資信託	9,340	8,440	900
	小計	9,340	8,440	900

貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	7,400	7,589	188
	小計	7,400	7,589	188
合計		16,740	16,029	711

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

2 非上場株式等(貸借対照表計上額 16百万円)については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「其他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却した其他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	4,189	218	176
合計	4,189	218	176

(デリバティブ取引関係)

第59期(2018年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	2,422	-	14	14
	買建	-	-	-	-
合計		2,422	-	14	14

(注) 1 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引 通貨関連

ヘッジ会計の 方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		4,447	-	196
	豪ドル		109	-	10
	シンガポール ドル		1,783	-	65
	香港ドル		541	-	25
	人民元		2,156	-	32
	ユーロ		154	-	6
合計			9,192	-	336

(注) 1 時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第60期(2019年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	2,407	-	3	3
	買建	-	-	-	-
合計		2,407	-	3	3

(注) 1 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。

2 時価の算定方法
金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建 米ドル	1,792	-	35	35
合計		1,792	-	35	35

(注) 1 時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計の 方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引	投資有価証券			
	売建				
	米ドル		2,251	-	42
	豪ドル		63	-	0
	シンガポール ドル		975	-	18
	香港ドル		518	-	8
	人民元		2,149	-	58
	ユーロ		81	-	0
合計			6,040	-	127

(注) 1 時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額 3,008	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,010
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 10,409	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 10,668
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,827	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,704

(退職給付関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,190
勤務費用	130
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	66
退職給付の支払額	76
退職給付債務の期末残高	1,313

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

退職給付債務	1,313
未積立退職給付債務	1,313
未認識数理計算上の差異	2
貸借対照表に計上された負債の額	1,316
退職給付引当金	1,316
貸借対照表に計上された負債の額	1,316

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	130
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	0
確定給付制度に係る退職給付費用	132

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%
-----	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、222百万円でありました。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)

退職給付債務の期首残高	1,313
勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	12
退職給付の支払額	59
退職給付債務の期末残高	1,411

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

退職給付債務	1,411
未積立退職給付債務	1,411
未認識数理計算上の差異	6
貸借対照表に計上された負債の額	1,405
退職給付引当金	1,405
貸借対照表に計上された負債の額	1,405

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	3
確定給付制度に係る退職給付費用	148

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.2%

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、230百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定条件	2012年1月22日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左

対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から 2年を経過した日まで	同左
権利行使期間	2012年1月22日から 2020年1月21日まで	同左

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 186名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 16名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 6,101,700株	普通株式 4,437,000株
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定条件	2013年10月7日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2018年7月15日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から 2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から 2年を経過した日まで
権利行使期間	2013年10月7日から 2021年10月6日まで	2018年7月15日から 2026年7月31日まで

	2016年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 4,409,000株
付与日	2017年4月27日
権利確定条件	2019年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から 2年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで

（注） 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション（新株予約権）の規模及びその変動状況 ストックオプション（新株予約権）の数

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定前(株)		
期首	1,689,600	174,900
付与	0	0
失効	194,700	66,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,494,900	108,900
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定前(株)		
期首	2,890,800	4,404,000
付与	0	0
失効	204,600	786,000
権利確定	0	0
権利未確定残	2,686,200	3,618,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2016年度ストックオプション(2)
付与日	2017年4月27日
権利確定前(株)	
期首	-
付与	4,409,000
失効	532,000
権利確定	0
権利未確定残	3,877,000
権利確定後(株)	
期首	-
権利確定	-
権利行使	-
失効	-
権利未行使残	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利行使価格(円)	625	625
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利行使価格(円)	737(注) 3	558
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

	2016年度ストックオプション(2)
付与日	2017年4月27日
権利行使価格(円)	553
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値（取引事例比準法等による評価額と行使価格との差額）の見積りに
よっております。
- 2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 1,149百万円
- 3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分
割又は併合の内容を適切に反映するように調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公
開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定条件	2012年1月22日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、「当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	同左

権利行使期間	2012年1月22日から 2020年1月21日まで	同左
--------	------------------------------	----

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 186名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 16名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 6,101,700株	普通株式 4,437,000株
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定条件	2013年10月7日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2018年7月15日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2013年10月7日から 2021年10月6日まで	2018年7月15日から 2026年7月31日まで

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 36名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 4,409,000株	普通株式 4,422,000株
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定条件	2019年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2020年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

（注） 株式数に換算して記載しております。

(2) スtockオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況
ストックオプション(新株予約権)の数

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日

権利確定前(株)		
期首	1,494,900	108,900
付与	0	0
失効	323,400	33,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,171,500	75,900
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定前(株)		
期首	2,686,200	3,618,000
付与	0	0
失効	630,300	0
権利確定	0	0
権利未確定残	2,055,900	3,618,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定前(株)		
期首	3,877,000	-
付与	0	4,422,000
失効	66,000	66,000
権利確定	0	0
権利未確定残	3,811,000	4,356,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利行使価格(円)	625	625
付与日における公正な評価単価(円) (注)1	0	0

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利行使価格(円)	737(注)3	558
付与日における公正な評価単価(円) (注)1	0	0

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利行使価格(円)	553	694
付与日における公正な評価単価(円) (注)1	0	0

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値（取引事例比準法等による評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。
- 2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 2,128百万円
- 3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するように調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

(税効果会計関係)

第59期 (2018年3月31日)	第60期 (2019年3月31日)
1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主原因別の内訳 (単位：百万円)	1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主原因別の内訳 (単位：百万円)
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金 700	賞与引当金 820
投資有価証券評価損 96	投資有価証券評価損 96
関係会社株式評価損 1,430	関係会社株式評価損 1,430
退職給付引当金 402	退職給付引当金 430
固定資産減価償却費 111	固定資産減価償却費 103
その他 526	その他 761
繰延税金資産小計 3,268	繰延税金資産小計 3,643
評価性引当金 1,430	評価性引当金 1,430
繰延税金資産合計 1,838	繰延税金資産合計 2,212
繰延税金負債	繰延税金負債
その他有価証券評価差額金 180	その他有価証券評価差額金 217
繰延ヘッジ利益 152	繰延ヘッジ利益 81
繰延税金負債合計 333	繰延税金負債合計 299
繰延税金資産の純額 1,504	繰延税金資産の純額 1,913

<p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <p>法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。</p>	<p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 70%;">法定実効税率 (調整)</td> <td style="text-align: right;">30.6%</td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない 項目</td> <td style="text-align: right;">0.8%</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に参入されない 項目</td> <td style="text-align: right;">4.4%</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">0.6%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right;">27.6%</td> </tr> </table>	法定実効税率 (調整)	30.6%	交際費等永久に損金に算入されない 項目	0.8%	受取配当金等永久に益金に参入されない 項目	4.4%	その他	0.6%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.6%
法定実効税率 (調整)	30.6%										
交際費等永久に損金に算入されない 項目	0.8%										
受取配当金等永久に益金に参入されない 項目	4.4%										
その他	0.6%										
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.6%										

(関連当事者情報)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	342,369 (SGD千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	資金の貸付	資金の貸付 (シンガポールドル 貸建) (注1)	159 (SGD 2,000千) (注2)	関係会社 短期 貸付金	550 (SGD 6,800千)
							貸付金利息 (シンガポールドル 貸建) (注1)	13 (SGD 162千)	未収収益	8 (SGD 110千)
							資金の貸付 (円貸建) (注3)	-	関係会社 短期 貸付金	577
							貸付金利息 (円貸建) (注3)	12	未収収益	3
							増資の引受 (注4)	2,466 (SGD 30,369千)	-	-
子会社	日本インステイテューショナル証券設立準備株式会社	日本	100 (百万円)	金融商品取引業者として登録を受けるための準備会社	直接 100.00	-	増資の引受 (注5)	100	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 資金の貸付に係る取引金額159百万円(SGD2,000千)の内訳は、貸付159百万円(SGD2,000千)であります。

- 3 融資枠5,000百万円、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 4 Nikko Asset Management International Limitedの行った30,369,000株の新株発行増資を、1株につき1シンガポールドルで当社が引受けたものであります。
- 5 日本インスティテューショナル証券設立準備株式会社の行った2,000株の新株発行を、1株につき50千円で当社が引受けたものであります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社(非上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2017年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	27,012百万円
負債合計	5,141百万円
純資産合計	21,871百万円

営業収益	15,830百万円
税引前当期純利益	5,266百万円
当期純利益	3,594百万円

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	342,369 (SGD 千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	資金の貸付	資金の貸付の返済 (シンガポールドル貨建) (注1)	554 (SGD 6,800 千) (注2)	-	-
							貸付金利息 (シンガポールドル貨建) (注1)	8 (SGD 104 千)	-	-
							資金の貸付 (米国ドル貨建) (注3)	1,807 (USD 16,500 千) (注4)	関係会社 短期貸付金	1,830 (USD 16,500 千)

							貸付金利息 (米国ドル 貨建) (注3)	17 (USD 209千)	未収収益	17 (USD 209千)
							資金の貸付 (円貨建) (注3)	-	関係会社 短期 貸付金	577
							貸付金利息 (円貨建) (注3)	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千) (注5)	アセット マネジメ ント業	直接 100.00	-	配当の受取	1,021 (USD 9,000千)	-	-
子会社	Nikko Asset Management Americas, Inc.	米国	181,542 (USD千) (注5)	アセット マネジメ ント業	間接 100.00	資金の 借入	資金の借入 (米国ドル 貨建) (注6)	5,364 (USD 50,000千) (注7)	-	-
							資金の借入 の返済 (米国ドル 貨建) (注6)	5,526 (USD 50,000千) (注7)	-	-
							借入金利息 (米国ドル 貨建) (注6)	65 (USD 593千)	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 2 取引金額554百万円 (SGD6,800千) の内訳は、貸付の返済554百万円 (SGD6,800千) であります。
- 3 融資枠5,000百万円 (若しくは5,000百万円相当額の外国通貨)、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 4 取引金額1,807百万円 (USD16,500千) の内訳は、貸付1,807百万円 (USD16,500千) であります。
- 5 Nikko AM Americas Holding Co., Inc.及びNikko Asset Management Americas, Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。
- 6 借入枠USD50,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 7 取引金額5,364百万円 (USD50,000千) 及び5,526百万円 (USD50,000千) の内訳は、借入5,364百万円 (USD50,000千) 及び借入の返済5,526百万円 (USD50,000千) であります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社 (東京証券取引所等に上場)
三井住友信託銀行株式会社 (非上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2018年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場場で円貨に換算したものであります。

資産合計 26,768百万円
負債合計 5,586百万円

純資産合計	21,181百万円
営業収益	14,075百万円
税引前当期純利益	3,894百万円
当期純利益	2,730百万円

（セグメント情報等）

セグメント情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載していません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載していません。

関連情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載していません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載していません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	319円40銭	355円59銭
1株当たり当期純利益金額	35円64銭	45円08銭

(注) 1 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株予約権の残高はありますが、当社株式が非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載しておりません。

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当期純利益(百万円)	6,979	8,823
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(百万円)	6,979	8,823
普通株式の期中平均株式数(千株)	195,794	195,677
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2009年度ストックオプション(1) 1,494,900株、2009年度ストックオプション(2) 108,900株、2011年度ストックオプション(1) 2,686,200株、2016年度ストックオプション(1) 3,618,000株、2016年度ストックオプション(2) 3,877,000株	2009年度ストックオプション(1) 1,171,500株、2009年度ストックオプション(2) 75,900株、2011年度ストックオプション(1) 2,055,900株、2016年度ストックオプション(1) 3,618,000株、2016年度ストックオプション(2) 3,811,000株、2017年度ストックオプション(1) 4,356,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第59期 (2018年3月31日)	第60期 (2019年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	62,511	69,571

純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-	-
普通株式に係る期末の純資産額(百万円)	62,511	69,571
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数(千株)	195,711	195,647

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<更新後>

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2018年9月末現在)	事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

<更新後>

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2018年9月末現在)	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
フィデリティ証券株式会社	8,557百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
ワイエム証券株式会社	1,270百万円	
株式会社足利銀行	135,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社岩手銀行	12,089百万円	
株式会社きらやか銀行	22,700百万円	
ソニー銀行株式会社 1	31,000百万円	
株式会社第三銀行 1	37,461百万円	
株式会社東北銀行	13,233百万円	
株式会社もみじ銀行	10,000百万円	
株式会社琉球銀行 1	56,967百万円	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
ソニー生命保険株式会社 1	70,000百万円	

1 募集の取扱いを行いません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年5月29日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

P w Cあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 鶴田 光夫
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）の2018年10月27日から2019年4月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）の2019年4月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2018年10月27日から2019年4月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2019年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第60期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2019年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。