

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年1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 柴田 拓美
【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】	森川 晃
【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60）
【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。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）（以下「ファンド」といいます。）

- ・愛称として「Aナビ60」、「ステージ2」、「アセット・ナビゲーション・ファンド」、「Aナビ」という名称を用いることがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

- ・追加型証券投資信託受益権です。（以下「受益権」といいます。）
- ・信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社債、株式等の振替に関する法律第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情などがある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

### （５）【申込手数料】

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

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

### （６）【申込単位】

販売会社または「（８）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

### （７）【申込期間】

平成28年 1月27日から平成29年 1月26日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

### （８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

( 9 ) 【払込期日】

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

( 10 ) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

( 11 ) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

( 12 ) 【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

4つの異なる資産に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざします。

ファンドの基本的性格

## 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

## 2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券）））

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

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

年1回

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

グローバル（含む日本）

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジあり（部分ヘッジ）

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

## ファンドの特色

1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。

2. インデックスファンドで構成しています。

3. 株式に60%、債券などに40%投資します。

## ファンドの仕組み

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



(主な投資制限) ・株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。  
・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

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

## 1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。

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

## 2. インデックスファンドで構成しています。

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

### <国内株式>

#### 「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

### <海外株式>

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

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

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

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

### <国内債券>

#### 「日本債券インデックスマザーファンド」

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

### <海外債券>

#### 「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」

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

#### 「海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド」

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

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

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

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

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

## 3. 株式に60%、債券などに40%投資します。

- 資産の標準実質組入比率は、株式60%、債券など40%とします。
- 組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンドへの投資比率を調整することで行ないます。
- 各マザーファンドおよび短期金融資産への投資比率は以下を基本とします。

投資対象	基本投資比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	45%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	7.5%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	7.5%
日本債券インデックスマザーファンド	25%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	5%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	5%
短期金融資産	5%

※基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。

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

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

### 信託金限度額

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

## (2) 【ファンドの沿革】

平成11年10月29日

- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

平成13年6月1日

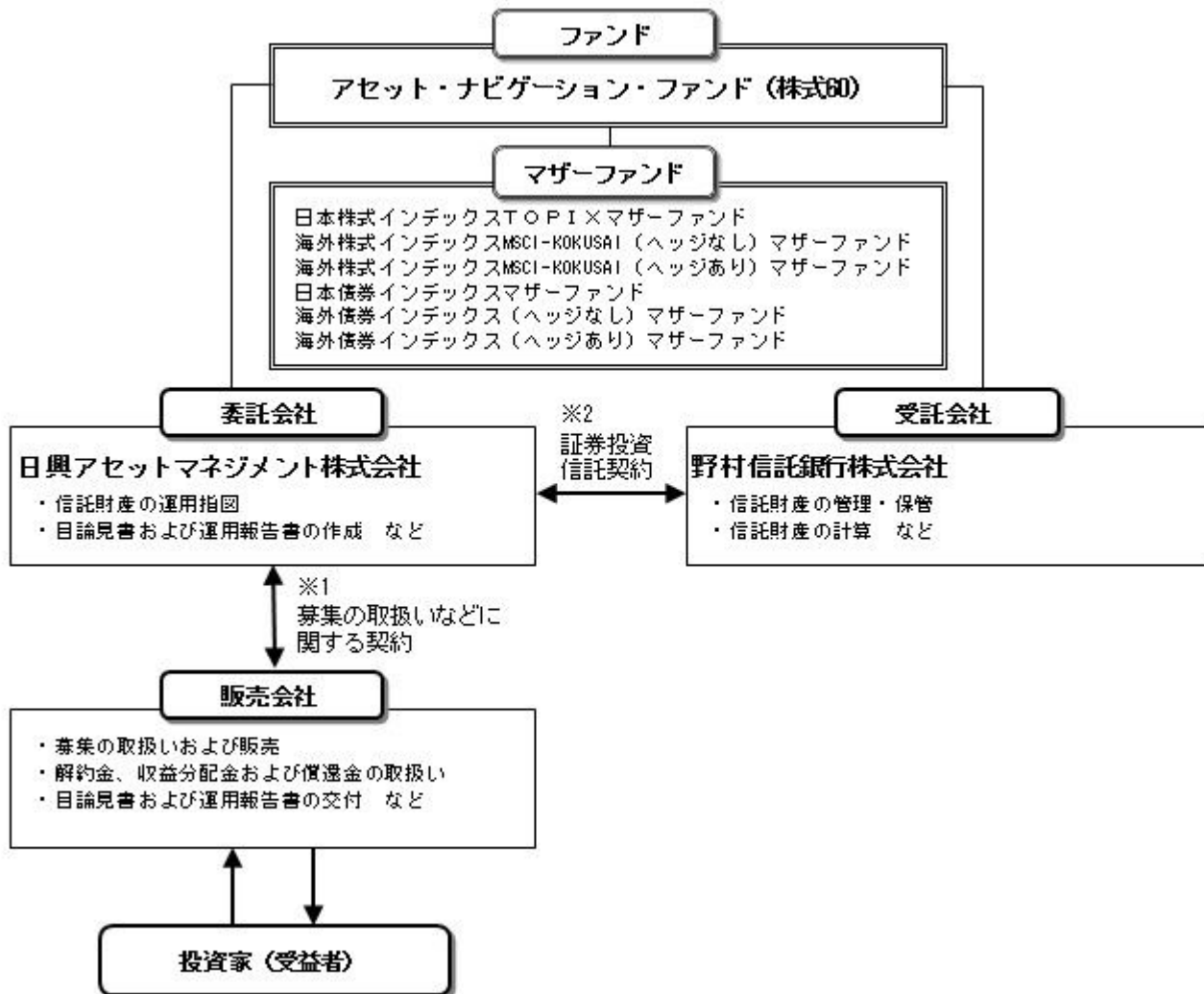
- ・ファンド名称変更

新名称：アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）

旧名称：アセット・ナビゲーション・ファンド（ステージ2）

## (3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

委託会社の概況（平成27年10月末現在）

## 1) 資本金

17,363百万円

## 2) 沿革

昭和34年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

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

## 3) 大株主の状況

名称	住所	所有株数	所有比率
----	----	------	------



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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

- ・主として、以下に掲げる各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長をめざします。
  - 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
  - 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド」
  - 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド」
  - 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
  - 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」
  - 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド」
- ・純資産総額に対する株式ならびに公社債および短期金融資産の実質組入比率については、次の標準実質組入比率を目処として投資を行ないます。
  - 株式の標準実質組入比率.....60%
  - 公社債および短期金融資産の標準実質組入比率.....40%
- ・組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンド受益証券への投資比比率を調整することで行ないますが、市況動向などによっては内外の有価証券などへの直接投資を行なうことがあります。
- ・また、資金動向などによっては組入比率を引き下げることがあります。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

### (2)【投資対象】

#### <アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)>

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

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

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条、第21条および第22条に定めるものに限りません。)
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

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

- 7) 株券または新株引受権証書
  - 8) 国債証券
  - 9) 地方債証券
  - 10) 特別の法律により法人の発行する債券
  - 11) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
  - 12) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
  - 13) コマーシャル・ペーパー
  - 14) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
  - 15) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)～14)の証券または証書の性質を有するもの
  - 16) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
  - 17) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  - 18) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
  - 19) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  - 20) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  - 21) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
  - 22) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  - 23) 外国の者に対する権利で22)の有価証券の性質を有するもの  
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
    - 1) 預金
    - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
    - 3) コール・ローン
    - 4) 手形割引市場において売買される手形
    - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
    - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの  
次の取引ができます。
      - 1) 信用取引
      - 2) 先物取引等
      - 3) スワップ取引
      - 4) 金利先渡取引
      - 5) 為替先渡取引
      - 6) 有価証券の貸付
      - 7) 公社債の空売
      - 8) 公社債の借入
      - 9) 外国為替予約取引
      - 10) 資金の借入
- <日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>  
わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。  
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
  - 1) 有価証券
  - 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限ります。）
  - 3) 金銭債権
  - 4) 約束手形
  - 5) 為替手形

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

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)~8)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。))で投資法人債券に類する証券
- 11) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 12) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 13) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 14) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

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

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券(短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定す

る相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。)を除きます。)には投資しません。

- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
  - 2) 国債証券
  - 3) 地方債証券
  - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
  - 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
  - 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
  - 7) コマーシャル・ペーパー
  - 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
  - 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)~7)の証券の性質を有するもの
  - 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
  - 11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))で12)に定めるもの以外のもの
  - 12) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
  - 13) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
  - 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
  - 15) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  - 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
  - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  - 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの  
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。))により運用することができます。
    - 1) 預金
    - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
    - 3) コール・ローン
    - 4) 手形割引市場において売買される手形
    - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
    - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの  
次の取引ができます。
      - 1) 信用取引
      - 2) 先物取引等
      - 3) スワップ取引
      - 4) 金利先渡取引
      - 5) 為替先渡取引
      - 6) 有価証券の貸付
      - 7) 公社債の空売
      - 8) 公社債の借入
      - 9) 外国為替予約取引
- < 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド >  
日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。  
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
  - 1) 有価証券
  - 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限ります。)

- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
  - 2) 国債証券
  - 3) 地方債証券
  - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
  - 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
  - 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
  - 7) コマーシャル・ペーパー
  - 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
  - 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)～7)の証券の性質を有するもの
  - 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
  - 11) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で12)に定めるもの以外のもの
  - 12) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
  - 13) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  - 14) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
  - 15) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  - 17) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
  - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  - 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
- 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

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

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

## &lt;日本債券インデックスマザーファンド&gt;

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

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

## &lt;海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド&gt;

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

4) 約束手形

5) 為替手形

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

1) 国債証券

2) 地方債証券

3) 特別の法律により法人の発行する債券

4) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。))に限ります。)

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

6) コマーシャル・ペーパー

7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)~6)の証券の性質を有するもの

8) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)で投資法人債券に類する証券

9) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)

10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書

11) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

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

13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの

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

1) 預金

2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)

3) コール・ローン

4) 手形割引市場において売買される手形

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

6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

次の取引ができます。

1) 先物取引等

2) スワップ取引

3) 金利先渡取引

4) 為替先渡取引

5) 有価証券の貸付

6) 公社債の空売

7) 公社債の借入

8) 外国為替予約取引

< 海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド >

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします

1) 有価証券(株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。)

2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいひ、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限ります。)

3) 金銭債権

4) 約束手形

## 5) 為替手形

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

## 1) 国債証券

## 2) 地方債証券

## 3) 特別の法律により法人の発行する債券

## 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限りま。

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

## 6) コマーシャル・ペーパー

## 7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの

## 8) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券

## 9) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

## 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書

## 11) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りま。

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

## 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの

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

## 1) 預金

## 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

## 3) コール・ローン

## 4) 手形割引市場において売買される手形

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

## 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

次の取引ができます。

## 1) 先物取引等

## 2) スワップ取引

## 3) 金利先渡取引

## 4) 為替先渡取引

## 5) 有価証券の貸付

## 6) 公社債の空売

## 7) 公社債の借入

## 8) 外国為替予約取引

## 投資対象とするマザーファンドの概要

## &lt;日本株式インデックスTOPIXマザーファンド&gt;

運用の基本方針	
基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX（東証株価指数） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。



投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主としてわが国の株式に投資し、T O P I X（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。</li> <li>・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。

#### ファンドに係る費用

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

#### その他

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

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

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

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

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカンツリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。</li> <li>・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行いません。</li> <li>・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行いません。

#### ファンドに係る費用

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

#### その他

委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成12年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

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

##### 運用の基本方針

基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジあり・円ベース） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカンントリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えること、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額の合計額が外貨建資産の組入総額を超えることがあります。</li> <li>・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。</li> <li>・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。

#### ファンドに係る費用

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

#### その他

委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成12年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

#### < 日本債券インデックスマザーファンド >

##### 運用の基本方針

基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、日興債券パフォーマンスインデックス（総合） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主としてわが国の公社債に投資し、日興債券パフォーマンスインデックス（総合）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>・運用の効率化をはかるため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への投資は行ないません。</li> <li>・外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.1%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
<b>その他</b>	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成10年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

#### < 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として世界各国の債券に投資し、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。</li> <li>・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への投資は行ないません。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとしします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
<b>その他</b>	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成10年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

#### < 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド >

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として世界各国の債券に投資し、シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジあり・円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えること、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額が外貨建資産の組入総額を超えることがあります。</li> <li>・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないます。</li> <li>・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への投資は行ないません。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。

#### ファンドに係る費用

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%(1口当たり)
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

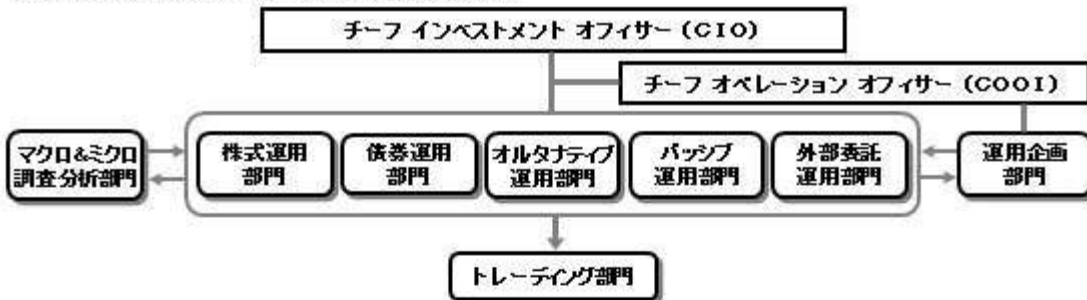
#### その他

委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限(平成10年10月30日設定)
決算日	毎年10月26日(休業日の場合は翌営業日)

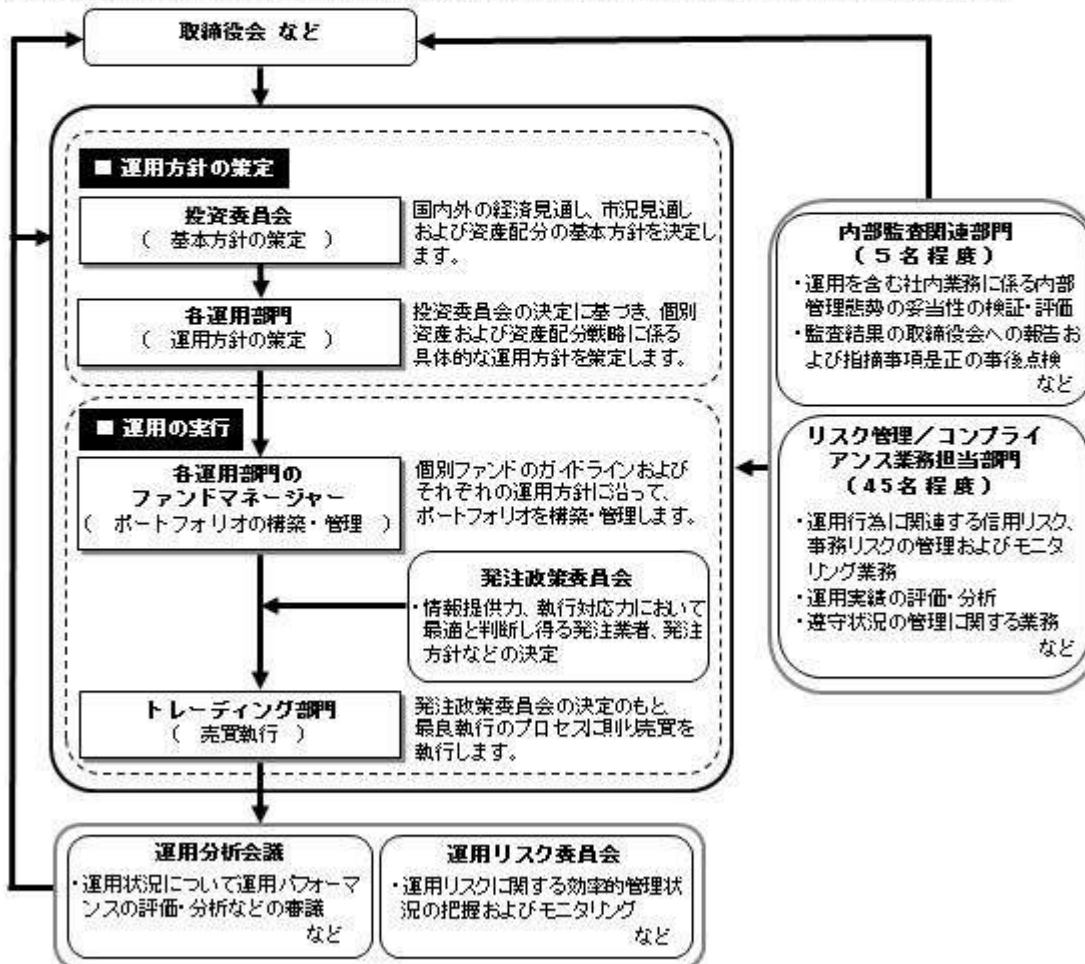
\*シティ世界国債インデックス(除く日本)は、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが開発した、日本を除く世界の主要国の国債市場の合成パフォーマンスを表す指数です。(ヘッジあり・円ベース)とは、現地通貨ベースの指数を対円でヘッジし、円換算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

#### (3)【運用体制】

## ◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



## 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

上記体制は平成27年10月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## (4) 【分配方針】

## 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

## 1) 分配対象額の範囲

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

## 2) 分配対象額についての分配方針

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

## 3) 留保益の運用方針

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

## 収益分配金の支払い

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

## （５）【投資制限】

約款に定める投資制限

<アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）>

- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- 4) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 5) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 6) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 7) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期間が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
  - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 14) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投



資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。

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

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

ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内

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

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

15) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

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

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

3) 外貨建資産への投資は行ないません。

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

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

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

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

8) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。

イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価

総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
  - 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- < 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド >
- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。
  - 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
  - 3) 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
  - 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
  - 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
  - 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
  - 7) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
  - 8) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
  - 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
  - 10) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
  - 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
    - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
    - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
  - 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
  - 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
  - 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
  - 15) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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

- 1) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。)されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
  - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 15) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

<日本債券インデックスマザーファンド>

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 3) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有

価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

- 4) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 7) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 10) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

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

- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
  - 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- < 海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド >
- 1) 株式への投資は行ないません。
  - 2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
  - 3) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。 )および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。 )ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
  - 4) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
  - 5) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
  - 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。 )を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
  - 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
  - 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
  - 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
  - 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
  - 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
  - 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

法令による投資制限

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律)

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 価格変動リスク

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

#### 流動性リスク

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

#### 信用リスク

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

#### 為替変動リスク

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

#### < その他の留意事項 >

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由によ

り基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。

・投資対象とする投資信託証券に関する事項

ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴う資金流出入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

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

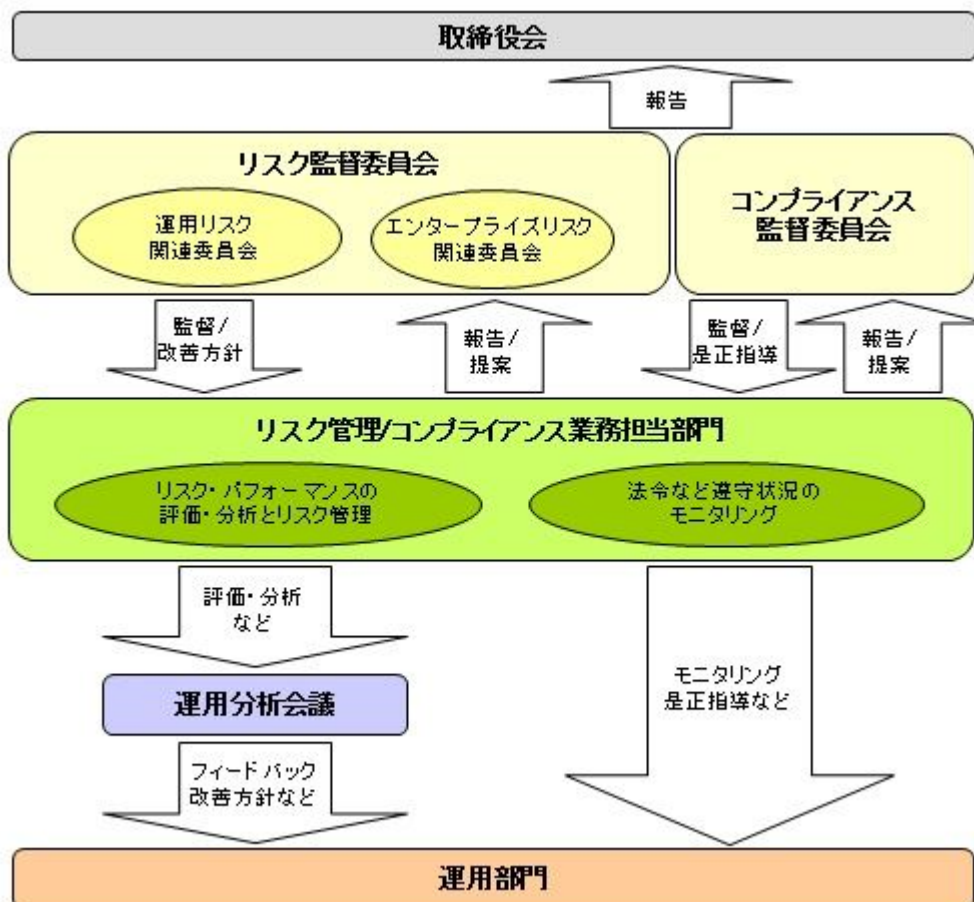
・運用制限や規制上の制限に関する事項

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

・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

(2) リスク管理体制



**全社的なリスク管理**

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理/コンプライアンス業務担当部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況についてはコンプライアンス部門が事務局を務めるコンプライアンス監督委員会、リスク管理状況につ

いてはリスク管理部門が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。両委員会およびそれに関連する部門別委員会においては、法令遵守状況や各種リスク(運用リスク、事務リスク、システムリスクなど)に関するモニタリングとその報告に加えて、重要事故への対応と各種リスク対応、事故防止のための施策やその管理手法の構築などの支援に努めております。

### 運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

### 法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は平成27年10月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

### (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	10.2%	16.2%	20.6%	9.6%	2.3%	10.0%	7.6%
最大値	34.2%	65.0%	65.7%	47.4%	4.5%	34.9%	43.7%
最小値	-8.1%	-17.0%	-13.6%	-22.8%	0.4%	-12.7%	-12.4%

※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2010年11月から2015年10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。

#### 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、2010年11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-ボンドパフォーマンス・インデックス国債

先進国債……シティ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・ディバーシファイド(円ヘッジなし、円ベース)



**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-ボンド・パフォーマンス・インデックス国債**

当指数は、野村証券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、当指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村証券株式会社に帰属します。

**シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）**

当指数は、Citigroup Index LLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、当指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、Citigroup Index LLC に帰属します。

**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】**

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

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

**（２）【換金（解約）手数料】**

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.25%の率を乗じて得た額（1口当たり）が差し引かれます。

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

**（３）【信託報酬等】**

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.7398%（税抜0.685%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.685%	0.240%	0.400%	0.045%

委託会社	委託した資金の運用の対価
販売会社	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
受託会社	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

#### 支払時期

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

#### （４）【その他の手数料等】

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

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

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

#### < 投資対象とするマザーファンドに係る費用 >

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

#### （５）【課税上の取扱い】

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

##### 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（配当控除の適用はありません。）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、平成28年4月1日より、未成年者口座内の少額上場株式等に係る配当所得及び譲渡所得等の非課税措置(ジュニアNISA)が開始され、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年間非課税となる予定です。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

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

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

#### 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

##### 2) 受益者が収益分配金を受け取る際

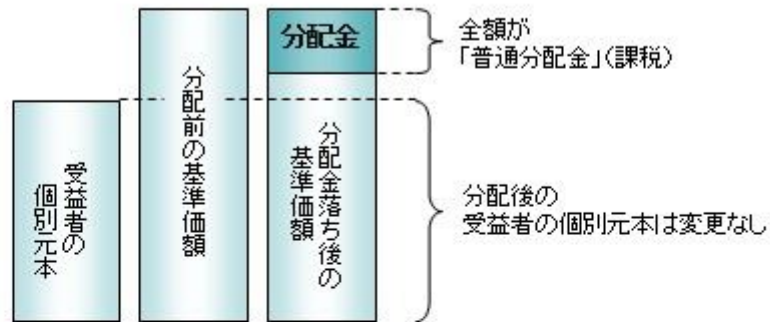
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

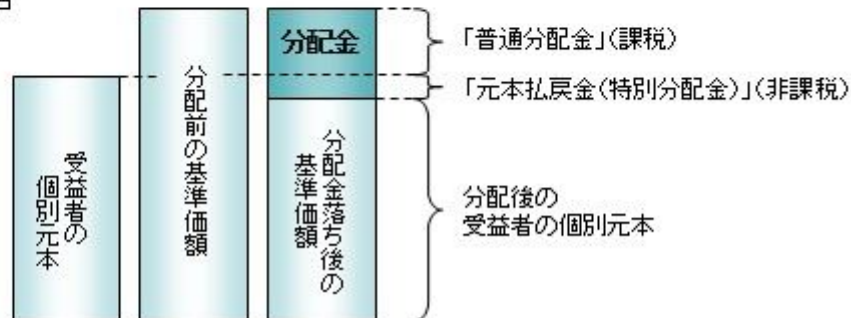
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

## &lt;分配金に関するイメージ図&gt;

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は平成28年 1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60）】

以下の運用状況は2015年10月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	145,149,207	95.02
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		7,607,414	4.98
合計（純資産総額）		152,756,621	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トピックスマザーファンド	52,091,722	1.3197	68,745,446	1.3191	68,714,190	44.98

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	28,565,887	1.3374	38,205,134	1.3389	38,246,866	25.04
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	9,044,295	1.2675	11,464,519	1.2717	11,501,629	7.53
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	5,650,404	2.0297	11,469,047	2.0292	11,465,799	7.51
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	5,176,293	1.4761	7,641,026	1.4729	7,624,161	4.99
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	3,257,531	2.3456	7,641,026	2.3320	7,596,562	4.97

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.02
合計	95.02

### 【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7計算期間末 (2006年10月26日)	349	349	1.1655	1.1665
第8計算期間末 (2007年10月26日)	307	307	1.1685	1.1695
第9計算期間末 (2008年10月27日)	209	209	0.7633	0.7633
第10計算期間末 (2009年10月26日)	263	263	0.8967	0.8967
第11計算期間末 (2010年10月26日)	254	254	0.8705	0.8705
第12計算期間末 (2011年10月26日)	231	231	0.8421	0.8421
第13計算期間末 (2012年10月26日)	212	212	0.8765	0.8765
第14計算期間末 (2013年10月28日)	194	194	1.1747	1.1757
第15計算期間末 (2014年10月27日)	161	161	1.2457	1.2467
第16計算期間末 (2015年10月26日)	152	152	1.4221	1.4231
2014年10月末日	167		1.2862	
11月末日	154		1.3430	
12月末日	150		1.3479	
2015年1月末日	146		1.3445	

2月末日	153	1.3991
3月末日	153	1.4121
4月末日	155	1.4340
5月末日	159	1.4714
6月末日	155	1.4428
7月末日	158	1.4624
8月末日	152	1.3998
9月末日	144	1.3391
10月末日	152	1.4216

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第7期	2005年10月27日～2006年10月26日	0.0010
第8期	2006年10月27日～2007年10月26日	0.0010
第9期	2007年10月27日～2008年10月27日	0.0000
第10期	2008年10月28日～2009年10月26日	0.0000
第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	0.0000
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	0.0000
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	0.0000
第14期	2012年10月27日～2013年10月28日	0.0010
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

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第7期	2005年10月27日～2006年10月26日	11.63
第8期	2006年10月27日～2007年10月26日	0.34
第9期	2007年10月27日～2008年10月27日	34.68
第10期	2008年10月28日～2009年10月26日	17.48
第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	2.92
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	3.26
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	4.09
第14期	2012年10月27日～2013年10月28日	34.14
第15期	2013年10月29日～2014年10月27日	6.13
第16期	2014年10月28日～2015年10月26日	14.24

(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7期	2005年10月27日～2006年10月26日	163,976,841	107,674,925
第8期	2006年10月27日～2007年10月26日	55,068,040	92,074,900
第9期	2007年10月27日～2008年10月27日	47,687,195	36,434,455
第10期	2008年10月28日～2009年10月26日	41,843,319	21,585,947
第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	33,201,856	34,634,105
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	26,680,654	44,387,324
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	20,263,564	53,249,131
第14期	2012年10月27日～2013年10月28日	13,435,003	89,964,637
第15期	2013年10月29日～2014年10月27日	7,930,592	43,967,513
第16期	2014年10月28日～2015年10月26日	6,943,852	29,304,372

（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2015年10月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	27,950,786,320	98.99
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		285,283,503	1.01
合計（純資産総額）		28,236,069,823	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	264,945,000	0.94

（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	155,200	7,560.00	1,173,312,000	7,469.00	1,159,188,800	4.11
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	964,700	789.80	761,920,060	790.60	762,691,820	2.70
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	96,300	4,893.35	471,229,605	4,860.00	468,018,000	1.66
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	68,100	6,663.48	453,782,988	6,797.00	462,875,700	1.64
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	109,600	4,087.00	447,935,200	4,044.00	443,222,400	1.57
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,693,400	248.40	420,640,560	250.30	423,858,020	1.50
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	93,000	4,575.00	425,475,000	4,486.00	417,198,000	1.48
日本	株式	KDDI	情報・通信業	122,200	2,929.00	357,923,800	2,946.00	360,001,200	1.27
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	80,700	4,229.00	341,280,300	4,211.00	339,827,700	1.20
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	50,800	5,788.10	294,035,480	5,930.00	301,244,000	1.07
日本	株式	ソニー	電気機器	86,000	3,507.00	301,602,000	3,480.00	299,280,000	1.06
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	50,300	5,375.00	270,362,500	5,511.00	277,203,300	0.98
日本	株式	ファナック	電気機器	12,500	20,400.00	255,000,000	21,555.00	269,437,500	0.95
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	22,300	11,450.00	255,335,000	11,570.00	258,011,000	0.91
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	142,900	1,684.00	240,643,600	1,765.00	252,218,500	0.89
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	10,900	21,560.00	235,004,000	22,200.00	241,980,000	0.86
日本	株式	キヤノン	電気機器	65,600	3,812.00	250,067,200	3,640.00	238,784,000	0.85
日本	株式	三菱地所	不動産業	89,000	2,596.50	231,088,500	2,607.00	232,023,000	0.82
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	48,700	4,793.00	233,419,100	4,692.00	228,500,400	0.81
日本	株式	村田製作所	電気機器	12,800	17,170.00	219,776,000	17,355.00	222,144,000	0.79
日本	株式	日立製作所	電気機器	311,000	728.77	226,650,000	702.90	218,601,900	0.77
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	92,700	2,337.50	216,686,250	2,357.50	218,540,250	0.77
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	171,000	1,244.50	212,809,500	1,266.50	216,571,500	0.77
日本	株式	花王	化学	34,300	5,913.00	202,815,900	6,239.00	213,997,700	0.76
日本	株式	三井不動産	不動産業	64,000	3,339.00	213,696,000	3,310.00	211,840,000	0.75
日本	株式	パナソニック	電気機器	139,200	1,419.50	197,594,400	1,435.00	199,752,000	0.71
日本	株式	三菱商事	卸売業	90,200	2,269.00	204,663,800	2,212.50	199,567,500	0.71
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	43,000	4,420.00	190,060,000	4,476.00	192,468,000	0.68
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	38,500	4,639.00	178,601,500	4,728.00	182,028,000	0.64
日本	株式	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	231,400	788.80	182,528,320	765.60	177,159,840	0.63

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.34
		建設業	2.83
		食料品	4.29
		繊維製品	0.72
		パルプ・紙	0.27



化学	5.92
医薬品	5.01
石油・石炭製品	0.48
ゴム製品	0.94
ガラス・土石製品	0.92
鉄鋼	1.22
非鉄金属	0.91
金属製品	0.64
機械	4.52
電気機器	11.81
輸送用機器	10.69
精密機器	1.48
その他製品	1.60
電気・ガス業	2.25
陸運業	4.37
海運業	0.26
空運業	0.67
倉庫・運輸関連業	0.20
情報・通信業	7.24
卸売業	4.08
小売業	4.61
銀行業	9.24
証券、商品先物取引業	1.26
保険業	2.55
その他金融業	1.37
不動産業	2.86
サービス業	3.33
合 計	98.99

## 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 2015年12月	買建	17	日本円	265,135,540	264,945,000	0.94

(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2015年10月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	46,560,725,638	58.53
	カナダ	2,743,428,601	3.45
	モーリシャス	4,382,508	0.01
	ドイツ	2,936,054,233	3.69
	イタリア	722,002,327	0.91
	フランス	2,966,483,694	3.73
	オランダ	1,241,675,701	1.56
	スペイン	1,113,104,609	1.40
	ベルギー	437,508,504	0.55
	オーストリア	56,521,319	0.07
	ルクセンブルク	73,386,966	0.09
	フィンランド	283,374,074	0.36
	アイルランド	1,290,479,082	1.62
	ポルトガル	47,924,431	0.06
	イギリス	6,110,935,970	7.68
	スイス	3,237,610,753	4.07
	スウェーデン	889,934,590	1.12
	ノルウェー	188,655,930	0.24
	デンマーク	562,472,128	0.71
	ケイマン	176,186,852	0.22
	オーストラリア	1,826,841,913	2.30
	パミューダ	161,111,459	0.20
	ニュージーランド	37,310,285	0.05
	香港	760,435,030	0.96
シンガポール	471,540,565	0.59	
イスラエル	198,560,341	0.25	
ジャージー	352,731,279	0.44	
英ヴァージン諸島	21,236,399	0.03	
	小計	75,472,615,181	94.87
投資証券	アメリカ	1,455,227,553	1.83
	カナダ	12,570,539	0.02
	フランス	110,360,127	0.14
	イギリス	119,109,029	0.15
	オーストラリア	212,235,560	0.27
	香港	37,720,800	0.05
	シンガポール	26,584,881	0.03
	小計	1,973,808,489	2.48

コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		2,103,350,238	2.64
合計(純資産総額)		79,549,773,908	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,511,008,200	1.90
	買建	ドイツ	511,859,088	0.64

(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		1,564,281,500	1.97

(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	122,012	14,396.77	1,756,578,945	14,572.07	1,777,968,259	2.24
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	162,614	6,391.98	1,039,425,924	6,451.22	1,049,059,340	1.32
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	88,761	10,032.28	890,475,383	9,941.60	882,426,979	1.11
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	212,693	3,567.75	758,837,365	3,547.20	754,465,886	0.95
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	58,821	12,127.47	713,350,443	12,255.63	720,888,589	0.91
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	103,780	6,619.27	686,948,359	6,660.38	691,214,340	0.87
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	68,323	9,229.11	630,561,165	9,290.23	634,737,067	0.80
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	8,345	72,422.72	604,367,657	75,749.89	632,132,874	0.79
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	78,970	7,721.88	609,797,100	7,883.88	622,590,714	0.78
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	45,230	12,354.77	558,806,292	12,679.99	573,516,038	0.72
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	6,502	84,871.79	551,836,443	86,675.62	563,564,933	0.71
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	129,610	4,116.64	533,558,359	4,203.69	544,840,650	0.68
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	6,040	86,966.99	525,280,662	90,052.36	543,916,285	0.68

スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	48,783	11,050.49	539,076,346	11,038.27	538,480,023	0.68
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	57,109	9,312.92	531,851,948	9,311.71	531,782,903	0.67
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	129,497	4,079.16	528,239,760	4,056.19	525,265,084	0.66
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	14,878	32,308.03	480,678,900	32,796.99	487,953,647	0.61
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	86,147	5,580.74	480,764,354	5,609.76	483,263,995	0.61
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	34,253	13,672.58	468,326,917	13,908.33	476,402,233	0.60
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	222,679	1,997.26	444,749,641	2,066.18	460,095,119	0.58
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	87,642	5,173.31	453,399,323	5,173.31	453,399,323	0.57
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	39,751	11,030.91	438,489,941	10,867.70	432,001,982	0.54
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	27,980	15,065.34	421,528,465	14,946.86	418,213,339	0.53
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	64,377	6,485.07	417,489,737	6,487.49	417,645,401	0.53
アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	31,494	13,055.99	411,185,381	13,203.48	415,830,683	0.52
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	100,232	4,219.40	422,919,903	4,114.22	412,377,201	0.52
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	24,480	16,657.60	407,778,096	16,670.90	408,103,656	0.51
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	60,153	6,393.19	384,569,679	6,633.78	399,041,949	0.50
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	41,492	9,317.76	386,612,623	9,491.85	393,836,214	0.50
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	31,411	12,383.78	388,987,134	12,428.52	390,392,242	0.49

#### ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	7.03
		素材	4.37
		資本財	6.87
		商業・専門サービス	0.87
		運輸	1.88
		自動車・自動車部品	1.64
		耐久消費財・アパレル	1.80
		消費者サービス	1.81
		メディア	3.09
		小売	3.93
		食品・生活必需品小売り	2.03

	食品・飲料・タバコ	6.13
	家庭用品・パーソナル用品	2.14
	ヘルスケア機器・サービス	3.46
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.89
	銀行	8.86
	各種金融	3.93
	保険	4.28
	不動産	0.63
	ソフトウェア・サービス	8.13
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.29
	電気通信サービス	3.05
	公益事業	3.02
	半導体・半導体製造装置	1.74
投資証券		2.48
合計		97.36

#### 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

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500 1512	買建	24	米ドル	12,396,000	1,498,676,400	12,498,000	1,511,008,200	1.90
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1512	買建	120	ユーロ	3,872,400	514,409,616	3,853,200	511,859,088	0.64

(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	10,200,000.00	1,233,394,100	1,232,181,500	1.55
	ユーロ	買建	2,500,000.00	333,669,000	332,100,000	0.42

(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。

#### 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2015年10月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	1,465,309,163	56.62
	カナダ	88,826,344	3.43
	ドイツ	91,183,168	3.52
	イタリア	23,284,385	0.90
	フランス	91,305,404	3.53
	オランダ	36,420,490	1.41
	スペイン	35,431,920	1.37
	ベルギー	14,666,516	0.57
	ルクセンブルク	1,356,239	0.05
	フィンランド	8,844,022	0.34
	アイルランド	43,651,906	1.69
	ポルトガル	972,158	0.04
	イギリス	188,848,946	7.30
	スイス	103,869,776	4.01
	スウェーデン	27,427,958	1.06
	ノルウェー	7,003,740	0.27
	デンマーク	17,187,472	0.66
	ケイマン	5,285,701	0.20
	オーストラリア	59,378,997	2.29
	バミューダ	1,931,384	0.07
	香港	24,315,774	0.94
シンガポール	14,340,434	0.55	
イスラエル	6,060,783	0.23	
ジャージー	14,180,006	0.55	
英ヴァージン諸島	799,873	0.03	
	小計	2,371,882,559	91.64
投資証券	アメリカ	45,182,087	1.75
	フランス	3,591,382	0.14
	イギリス	6,029,083	0.23
	オーストラリア	5,223,998	0.20
	香港	1,136,701	0.04
	小計	61,163,251	2.36
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		155,087,726	5.99
合計（純資産総額）		2,588,133,536	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	113,325,615	4.38
	買建	ドイツ	38,389,431	1.48

(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		2,473,005,570	95.55

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 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	3,839	14,396.77	55,269,208	14,572.07	55,942,204	2.16
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	5,134	6,391.98	32,816,441	6,451.22	33,120,584	1.28
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	2,786	10,032.28	27,949,938	9,941.60	27,697,317	1.07
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	6,732	3,567.75	24,018,154	3,547.20	23,879,791	0.92
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,851	12,127.47	22,447,964	12,255.63	22,685,177	0.88
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	3,266	6,619.27	21,618,552	6,660.38	21,752,804	0.84
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	265	72,422.72	19,192,022	75,749.89	20,073,722	0.78
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	2,155	9,229.11	19,888,753	9,290.23	20,020,467	0.77
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	2,480	7,721.88	19,150,270	7,883.88	19,552,045	0.76
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	1,432	12,354.77	17,692,033	12,679.99	18,157,749	0.70
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	206	84,871.79	17,483,590	86,675.62	17,855,179	0.69
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	4,214	4,116.64	17,347,542	4,203.69	17,714,362	0.68
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	192	86,966.99	16,697,663	90,052.36	17,290,054	0.67
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	1,818	9,312.92	16,930,901	9,311.71	16,928,703	0.65
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,522	11,050.49	16,818,855	11,038.27	16,800,250	0.65
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	4,117	4,079.16	16,793,927	4,056.19	16,699,355	0.65
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	471	32,308.03	15,217,083	32,796.99	15,447,383	0.60
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	1,083	13,672.58	14,807,405	13,908.33	15,062,728	0.58

アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	2,650	5,580.74	14,788,972	5,609.76	14,865,864	0.57
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	7,053	1,997.26	14,086,732	2,066.18	14,572,775	0.56
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	2,783	5,173.31	14,397,325	5,173.31	14,397,325	0.56
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	1,265	11,030.91	13,954,109	10,867.70	13,747,642	0.53
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	2,039	6,485.07	13,223,070	6,487.49	13,228,000	0.51
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	3,200	4,219.41	13,502,112	4,114.22	13,165,526	0.51
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	784	16,657.60	13,059,560	16,670.90	13,069,986	0.50
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,901	6,393.19	12,153,458	6,633.78	12,610,821	0.49
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	840	15,065.34	12,654,893	14,946.86	12,555,368	0.49
アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	949	13,055.99	12,390,135	13,203.48	12,530,111	0.48
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	13,129	960.32	12,608,044	950.67	12,481,476	0.48
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	1,252	9,317.76	11,665,839	9,491.85	11,883,807	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 (%)
株式	国外	エネルギー	6.67
		素材	4.04
		資本財	6.98
		商業・専門サービス	0.87
		運輸	1.63
		自動車・自動車部品	1.65
		耐久消費財・アパレル	1.66
		消費者サービス	1.75
		メディア	3.18
		小売	3.61
		食品・生活必需品小売り	1.81
		食品・飲料・タバコ	5.90
		家庭用品・パーソナル用品	2.09
		ヘルスケア機器・サービス	3.46
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.43
		銀行	8.59
		各種金融	3.93
		保険	4.21
		不動産	0.78
		ソフトウェア・サービス	7.88
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.06		



		電気通信サービス	2.81
		公益事業	2.97
		半導体・半導体製造装置	1.70
投資証券			2.36
合計			94.01

### 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 EMINI1512	買建		9米ドル	929,700	112,400,730	937,350	113,325,615	4.38
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1512	買建		9ユーロ	290,430	38,580,721	288,990	38,389,431	1.48

(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	13,215,000.00	1,599,329,133	1,596,211,990	61.67
	加ドル	売建	970,000.00	89,048,268	89,097,500	3.44
	ユーロ	売建	2,392,000.00	319,243,592	317,731,310	12.28
	英ポンド	売建	1,103,000.00	204,436,568	204,254,840	7.89
	スイスフラン	売建	808,000.00	100,054,046	98,865,760	3.82
	スウェーデンクローナ	売建	1,933,000.00	27,536,876	27,429,270	1.06
	ノルウェークローネ	売建	546,000.00	7,853,967	7,689,460	0.30
	デンマーククローネ	売建	966,000.00	17,291,962	17,212,220	0.67
	豪ドル	売建	764,000.00	66,620,735	65,420,220	2.53
	香港ドル	売建	2,008,000.00	31,343,924	31,290,710	1.21
	シンガポールドル	売建	136,000.00	11,749,624	11,717,220	0.45
	イスラエルシェケル	売建	195,000.00	6,056,445	6,085,070	0.24

(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2015年10月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	27,739,132,500	79.77
地方債証券	日本	2,324,673,000	6.68
特殊債証券	日本	2,595,955,000	7.47
社債券	日本	1,888,438,524	5.43
	オーストラリア	101,369,000	0.29
	小計	1,989,807,524	5.72
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		125,220,150	0.36
合計（純資産総額）		34,774,788,174	100.00

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	利率 （％）	償還期限	投資 比率 （％）
日本	国債証券	第299回利付国債（10年）	750,000,000	104.33	782,535,000	104.34	782,617,500	1.300	2019/3/20	2.25
日本	国債証券	第107回利付国債（5年）	705,000,000	100.39	707,791,800	100.41	707,918,700	0.200	2017/12/20	2.04
日本	国債証券	第303回利付国債（10年）	581,000,000	105.33	611,973,110	105.34	612,054,450	1.400	2019/9/20	1.76
日本	国債証券	第60回利付国債（20年）	545,000,000	109.22	595,259,900	109.35	595,973,850	1.400	2022/12/20	1.71
日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	563,000,000	105.21	592,354,820	105.25	592,585,650	1.300	2019/12/20	1.70
日本	国債証券	第124回利付国債（5年）	560,000,000	100.25	561,422,400	100.32	561,808,800	0.100	2020/6/20	1.62
日本	国債証券	第123回利付国債（5年）	505,000,000	100.26	506,328,150	100.32	506,651,350	0.100	2020/3/20	1.46
日本	国債証券	第117回利付国債（5年）	470,000,000	100.61	472,867,000	100.64	473,008,000	0.200	2019/3/20	1.36
日本	国債証券	第284回利付国債（10年）	462,000,000	101.94	470,990,520	101.91	470,842,680	1.700	2016/12/20	1.35
日本	国債証券	第313回利付国債（10年）	410,000,000	106.63	437,203,500	106.72	437,576,600	1.300	2021/3/20	1.26
日本	国債証券	第102回利付国債（5年）	400,000,000	100.34	401,372,000	100.33	401,348,000	0.300	2016/12/20	1.15
日本	国債証券	第29回利付国債（30年）	276,000,000	123.77	341,621,760	123.98	342,204,120	2.400	2038/9/20	0.98
日本	国債証券	第120回利付国債（5年）	330,000,000	100.66	332,181,300	100.71	332,362,800	0.200	2019/9/20	0.96
日本	国債証券	第292回利付国債（10年）	306,000,000	104.02	318,325,680	104.02	318,304,260	1.700	2018/3/20	0.92
日本	国債証券	第140回利付国債（20年）	280,000,000	113.39	317,506,000	113.63	318,178,000	1.700	2032/9/20	0.91
日本	国債証券	第91回利付国債（20年）	260,000,000	120.34	312,884,000	120.49	313,284,400	2.300	2026/9/20	0.90
日本	国債証券	第88回利付国債（20年）	260,000,000	120.13	312,345,800	120.28	312,735,800	2.300	2026/6/20	0.90
日本	国債証券	第106回利付国債（5年）	310,000,000	100.36	311,116,000	100.37	311,162,500	0.200	2017/9/20	0.89
日本	国債証券	第122回利付国債（5年）	300,000,000	100.26	300,807,000	100.32	300,987,000	0.100	2019/12/20	0.87

日本	国債証券	第291回利付国債(10年)	287,000,000	103.07	295,816,640	103.07	295,816,640	1.300	2018/3/20	0.85
日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	240,000,000	119.77	287,464,800	119.98	287,959,200	2.100	2029/9/20	0.83
日本	国債証券	第36回利付国債(30年)	230,000,000	115.91	266,611,400	116.14	267,126,600	2.000	2042/3/20	0.77
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	261,000,000	102.36	267,175,260	102.33	267,089,130	1.700	2017/3/20	0.77
日本	国債証券	第50回利付国債(20年)	237,000,000	109.89	260,458,260	109.98	260,654,970	1.900	2021/3/22	0.75
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	208,000,000	124.06	258,046,880	124.43	258,820,640	2.400	2034/3/20	0.74
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	255,000,000	100.26	255,665,750	100.31	255,805,800	0.100	2020/9/20	0.74
日本	国債証券	第137回利付国債(20年)	220,000,000	113.55	249,814,400	113.79	250,338,000	1.700	2032/6/20	0.72
日本	国債証券	第301回利付国債(10年)	223,000,000	105.36	234,972,870	105.39	235,037,540	1.500	2019/6/20	0.68
日本	国債証券	第149回利付国債(20年)	215,000,000	108.62	233,543,750	108.96	234,268,300	1.500	2034/6/20	0.67
日本	国債証券	第290回利付国債(10年)	226,000,000	103.31	233,482,860	103.30	233,478,340	1.400	2018/3/20	0.67

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	79.77
地方債証券	6.68
特殊債券	7.47
社債券	5.72
合計	99.64

## 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2015年10月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	77,740,091,724	42.53
	カナダ	3,633,469,028	1.99
	メキシコ	1,827,975,596	1.00

	ドイツ	13,607,286,440	7.44
	イタリア	17,618,346,552	9.64
	フランス	17,585,063,356	9.62
	オランダ	4,523,939,716	2.48
	スペイン	9,851,309,648	5.39
	ベルギー	4,539,513,492	2.48
	オーストリア	2,787,808,911	1.53
	フィンランド	1,085,292,773	0.59
	アイルランド	1,425,583,349	0.78
	イギリス	15,036,902,184	8.23
	スイス	529,561,428	0.29
	スウェーデン	817,727,012	0.45
	ノルウェー	501,720,810	0.27
	デンマーク	1,229,199,890	0.67
	ポーランド	1,025,116,086	0.56
	オーストラリア	3,012,853,282	1.65
	シンガポール	644,877,939	0.35
	マレーシア	785,523,814	0.43
	南アフリカ	864,662,045	0.47
	小計	180,673,825,075	98.85
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		2,110,488,318	1.15
合計（純資産総額）		182,784,313,393	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		95,888,633	0.05
	売建		21,317,610	0.01

(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	12,000,000	16,511.35	1,981,362,094	16,425.39	1,971,047,813	8.000	2021/11/15	1.08
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	14,250,000	13,380.22	1,906,682,730	13,308.44	1,896,453,457	3.625	2021/2/15	1.04
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,300,000	13,250.82	1,762,360,244	13,190.37	1,754,320,394	3.625	2020/2/15	0.96
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,000,000	13,104.42	1,703,575,453	13,043.97	1,695,716,953	3.375	2019/11/15	0.93
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,950,000	16,224.21	1,289,824,955	16,137.31	1,282,916,653	8.750	2020/8/15	0.70
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,500,000	13,214.93	1,255,418,988	13,149.76	1,249,227,585	3.500	2020/5/15	0.68

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,400,000	13,107.26	1,232,082,454	13,070.42	1,228,619,803	3.750	2018/11/15	0.67
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,250,000	12,747.39	1,179,133,922	12,721.89	1,176,774,955	4.625	2017/2/15	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,850,000	13,141.26	1,163,001,800	13,110.09	1,160,243,297	4.000	2018/8/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,300,000	12,413.97	1,154,499,601	12,352.57	1,148,789,910	2.000	2020/7/31	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,300,000	12,216.56	1,136,140,747	12,141.00	1,129,113,435	2.000	2023/2/15	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,800,000	12,830.51	1,129,085,100	12,808.78	1,127,173,369	4.500	2017/5/15	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	12,502.76	1,125,248,414	12,484.81	1,123,633,266	3.125	2017/1/31	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,600,000	12,983.52	1,116,583,284	12,962.74	1,114,796,231	4.750	2017/8/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,800,000	12,556.59	1,104,980,663	12,541.48	1,103,650,763	3.250	2017/3/31	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,800,000	12,511.26	1,100,990,963	12,498.98	1,099,910,419	2.750	2017/5/31	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,950,000	12,267.57	1,097,947,683	12,234.51	1,094,988,938	1.500	2018/12/31	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	13,618.25	1,089,460,125	13,593.69	1,087,495,500	8.750	2017/5/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,700,000	12,490.48	1,086,671,868	12,480.09	1,085,767,951	3.250	2016/12/31	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,340,000	12,538.65	1,045,723,605	12,507.48	1,043,124,066	2.250	2018/7/31	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,300,000	12,325.18	1,022,990,627	12,279.85	1,019,227,614	1.750	2019/9/30	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,950,000	12,842.79	1,021,001,916	12,810.67	1,018,448,849	3.500	2018/2/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,500,000	11,963.43	1,016,891,789	11,881.25	1,009,906,980	1.750	2023/5/15	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,550,000	13,024.14	983,322,675	12,994.86	981,112,000	3.875	2018/5/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,390,000	12,987.30	959,761,816	12,972.19	958,645,002	7.500	2016/11/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,400,000	12,641.60	935,478,862	12,612.32	933,312,107	2.750	2018/2/28	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,800,000	12,963.69	881,531,015	12,938.18	879,796,856	4.250	2017/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	12,569.82	879,887,531	12,546.20	878,234,601	3.125	2017/4/30	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	12,568.87	879,821,414	12,534.87	877,441,195	2.375	2018/6/30	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	12,398.86	867,920,320	12,386.58	867,060,797	2.750	2016/11/30	0.47

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.85
合 計	98.85

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	140,000.00	16,924,838	16,924,600	0.01
	加ドル	買建	40,000.00	3,677,320	3,677,600	0.00
	メキシコペソ	買建	1,076,000.00	7,821,551	7,822,520	0.00
	ユーロ	買建	315,000.00	41,812,785	41,844,600	0.02
	英ポンド	買建	33,000.00	6,116,394	6,117,540	0.00
	デンマーククローネ	買建	331,784.01	5,909,139	5,909,073	0.00
	豪ドル	買建	84,000.00	7,220,707	7,219,800	0.00

南アフリカランド	買建	730,000.00	6,391,004	6,372,900	0.00
ポーランドズロチ	売建	687,000.00	21,290,542	21,317,610	0.01

(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2015年10月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	11,405,031,941	41.75
	カナダ	533,084,979	1.95
	メキシコ	276,844,659	1.01
	ドイツ	1,989,858,305	7.28
	イタリア	2,587,394,969	9.47
	フランス	2,542,943,311	9.31
	オランダ	661,085,132	2.42
	スペイン	1,421,633,196	5.20
	ベルギー	646,428,385	2.37
	オーストリア	420,533,235	1.54
	フィンランド	165,042,310	0.60
	アイルランド	195,329,509	0.72
	イギリス	2,190,803,049	8.02
	スイス	94,364,243	0.35
	スウェーデン	114,820,094	0.42
	ノルウェー	66,768,543	0.24
	デンマーク	179,868,102	0.66
	ポーランド	139,593,088	0.51
	オーストラリア	421,033,791	1.54
	シンガポール	96,934,584	0.35
マレーシア	154,936,174	0.57	
南アフリカ	134,182,187	0.49	
	小計	26,438,513,786	96.79
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		876,892,240	3.21
合計(純資産総額)		27,315,406,026	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		26,760,389,300	97.97

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,900,000	12,156.11	474,088,570	12,144.78	473,646,529	0.875	2017/1/31	1.73
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,600,000	12,065.44	434,355,919	12,006.88	432,247,725	1.375	2020/9/30	1.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	12,285.51	393,136,575	12,255.29	392,169,375	1.500	2018/8/31	1.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,500,000	12,118.33	302,958,398	12,062.60	301,565,214	1.375	2020/1/31	1.10
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,150,000	12,924.02	277,866,452	12,876.79	276,851,081	3.125	2019/5/15	1.01
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,200,000	12,130.61	266,873,526	12,101.33	266,229,356	1.000	2018/5/31	0.97
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,000,000	13,077.97	261,559,593	13,006.19	260,123,906	3.125	2021/5/15	0.95
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,700,000	14,683.59	249,621,148	14,676.49	249,500,420	4.000	2018/4/25	0.91
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,650,000	13,889.33	229,173,978	13,714.59	226,290,797	3.625	2044/2/15	0.83
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,100,000	19,981.75	219,799,253	19,924.07	219,164,812	6.000	2025/10/25	0.80
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	12,838.06	218,247,169	12,738.89	216,561,180	2.750	2023/11/15	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,750,000	12,374.30	216,550,318	12,352.57	216,170,144	1.875	2017/9/30	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	13,380.22	214,083,675	13,308.44	212,935,125	3.625	2021/2/15	0.78
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,750,000	12,073.94	211,294,002	12,002.15	210,037,775	1.750	2022/5/15	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	12,176.89	207,007,246	12,161.78	206,750,334	1.000	2017/3/31	0.76
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	12,068.27	205,160,688	12,047.49	204,807,433	0.625	2017/11/30	0.75
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,200,000	16,782.40	201,388,894	16,756.23	201,074,860	4.800	2024/1/31	0.74
イギリス	国債証券	UK TREASURY	800,000	25,128.30	201,026,430	24,981.56	199,852,511	4.250	2046/12/7	0.73
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,280,000	15,436.67	197,589,404	15,449.02	197,747,537	3.750	2021/8/1	0.72
イギリス	国債証券	UK TREASURY	960,000	20,474.66	196,556,831	20,435.72	196,182,961	5.000	2018/3/7	0.72
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,350,000	14,083.54	190,127,791	14,074.84	190,010,344	3.750	2017/4/25	0.70
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	950,000	19,945.39	189,481,249	19,967.31	189,689,476	6.500	2027/11/1	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,400,000	13,250.82	185,511,604	13,190.37	184,665,304	3.625	2020/2/15	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	12,107.94	181,619,191	12,087.16	181,307,495	0.750	2017/10/31	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	12,101.33	181,520,016	12,085.27	181,279,160	0.625	2017/5/31	0.66
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,200,000	14,914.27	178,971,347	14,902.72	178,832,662	4.250	2018/7/4	0.65
イギリス	国債証券	UK TREASURY	830,000	20,806.89	172,697,238	20,748.37	172,211,474	4.500	2019/3/7	0.63
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	950,000	17,211.41	163,508,439	17,182.12	163,230,159	4.250	2023/10/25	0.60
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,050,000	15,448.43	162,208,555	15,449.62	162,221,053	4.000	2020/9/1	0.59
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,050,000	15,322.35	160,884,676	15,309.05	160,745,096	4.250	2019/4/25	0.59

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	96.79
合計	96.79

## 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	95,034,000.00	11,497,822,177	11,473,264,860	42.00
	加ドル	売建	5,876,000.00	539,116,333	539,392,530	1.97
	メキシコペソ	売建	39,035,000.00	283,801,379	282,260,290	1.03
	ユーロ	売建	81,113,000.00	10,827,870,155	10,773,436,020	39.44
	英ポンド	売建	11,941,000.00	2,211,919,232	2,209,850,320	8.09
	スイスフラン	売建	782,000.00	96,858,702	95,697,820	0.35
	スウェーデンクローナ	売建	8,305,000.00	118,320,836	117,847,950	0.43
	ノルウェークローネ	売建	4,798,000.00	68,967,443	67,566,240	0.25
	デンマーククローネ	売建	10,399,000.00	186,210,198	185,297,170	0.68
	ポーランドズロチ	売建	4,501,000.00	140,743,976	139,237,420	0.51
	豪ドル	売建	4,944,000.00	431,061,186	423,287,870	1.55
	シンガポールドル	売建	1,127,000.00	97,292,040	97,012,990	0.36
	マレーシアリングギット	売建	7,858,000.00	223,795,840	220,809,800	0.81
	南アフリカランド	売建	15,712,000.00	137,769,088	135,428,020	0.50

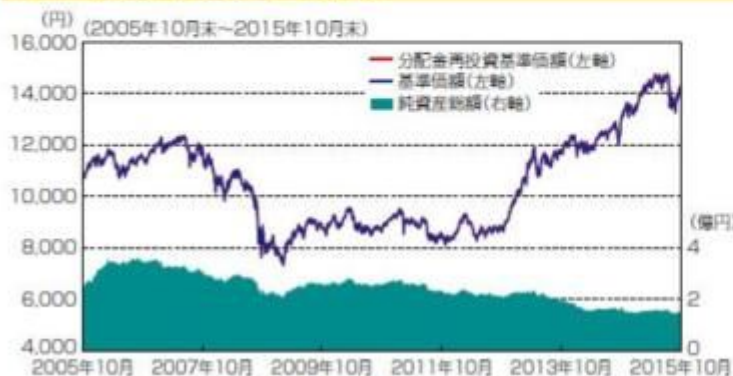
(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 参考情報

## 運用実績

2015年10月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



基準価額..... 14,216円

純資産総額..... 1.52億円

※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、2005年10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)

2011年10月	2012年10月	2013年10月	2014年10月	2015年10月	設定来累計
0円	0円	10円	10円	10円	60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	44.98%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	7.51%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	7.53%
日本債券インデックスマザーファンド	25.04%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	4.97%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	4.99%
現金その他	4.98%

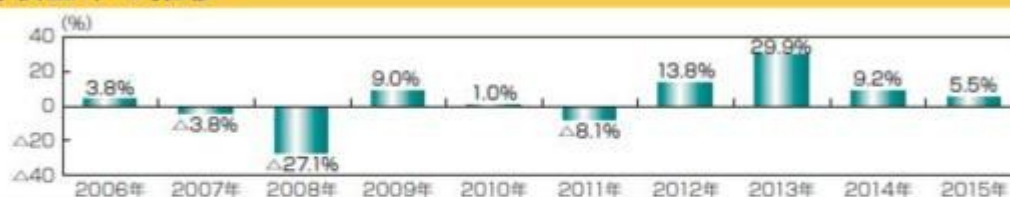
※当ファンドの対純資産総額比です。

### <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	4.11%
	2 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.70%
	3 三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.66%
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	2.24%
	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1.32%
	3 EXXON MOBIL CORP	エネルギー	1.11%
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	2.16%
	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1.28%
	3 EXXON MOBIL CORP	エネルギー	1.07%
日本債券インデックスマザーファンド	1 第299回利付国債(10年)	国債証券	2.25%
	2 第107回利付国債(5年)	国債証券	2.04%
	3 第303回利付国債(10年)	国債証券	1.76%
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	1.08%
	2 US TREASURY N/B(クーポン3.625%)	国債証券	1.04%
	3 US TREASURY N/B(クーポン3.625%)	国債証券	0.96%
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0.875%)	国債証券	1.73%
	2 US TREASURY N/B(クーポン1.375%)	国債証券	1.58%
	3 US TREASURY N/B(クーポン1.500%)	国債証券	1.44%

※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。

※2015年は、2015年10月末までの騰落率です。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込(販売)手続等】

#### (1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

#### (2) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(3) 取扱時間

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

(4) 申込金額

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

(5) 申込単位

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(6) 申込代金の支払い

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

(7) 受付の中止および取消

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

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

(8) 償還乗換

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

(9) 乗換優遇

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

## 2【換金（解約）手続等】

< 解約請求による換金 >

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約制限

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

(4) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額（当該基準価額に0.25%の率を乗じて得た額）を控除した価額とします。

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(5) 手取額

- 1口当たりの手取額は、解約価額から所得税および地方税を差し引いた金額となります。税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(6) 解約単位

1口単位

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

(7) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(8) 受付の中止および取消

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

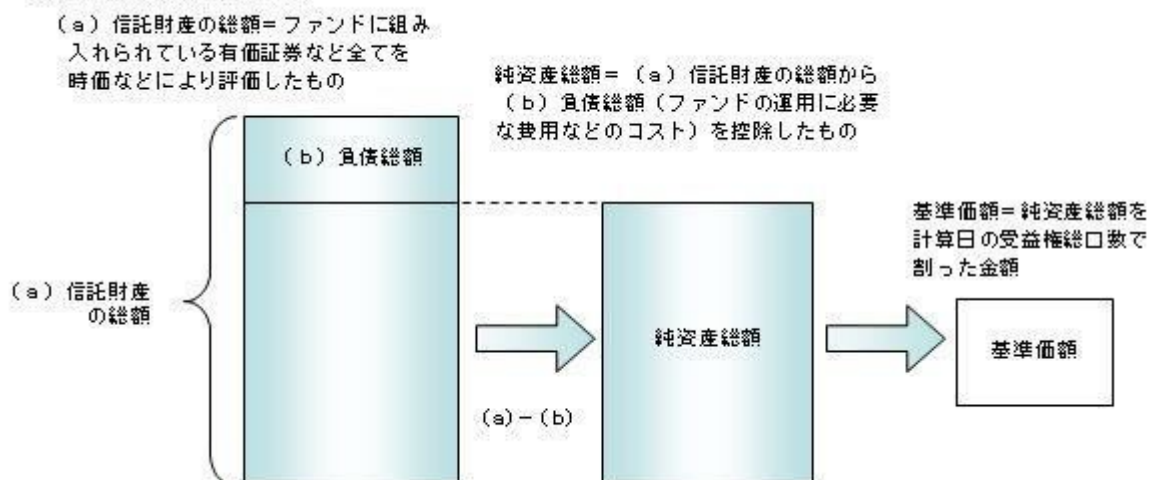
### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### 基準価額の算出

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

##### <基準価額算出の流れ>



##### 有価証券などの評価基準

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

##### <主な資産の評価方法>

**マザーファンド受益証券**

基準価額計算日の基準価額で評価します。

**国内上場株式**

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

**外国株式**

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

**公社債（国内・外国）**

原則として、基準価額計算日<sup>\*</sup>における以下のいずれかの価額で評価します。

- ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
  - ・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）
  - ・価格情報会社の提供する価額
- 残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。

<sup>\*</sup>外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

**基準価額の照会方法**

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

**< 委託会社の照会先 >**

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

**(2) 【保管】**

該当事項はありません。

**(3) 【信託期間】**

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

**(4) 【計算期間】**

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

**(5) 【その他】**

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
  - イ) 受益者の解約により受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合
  - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
  - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内（1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。）に異議を述べるすることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。

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

ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

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

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

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

償還金について

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

・ 償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

信託約款の変更

1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。

3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）

4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

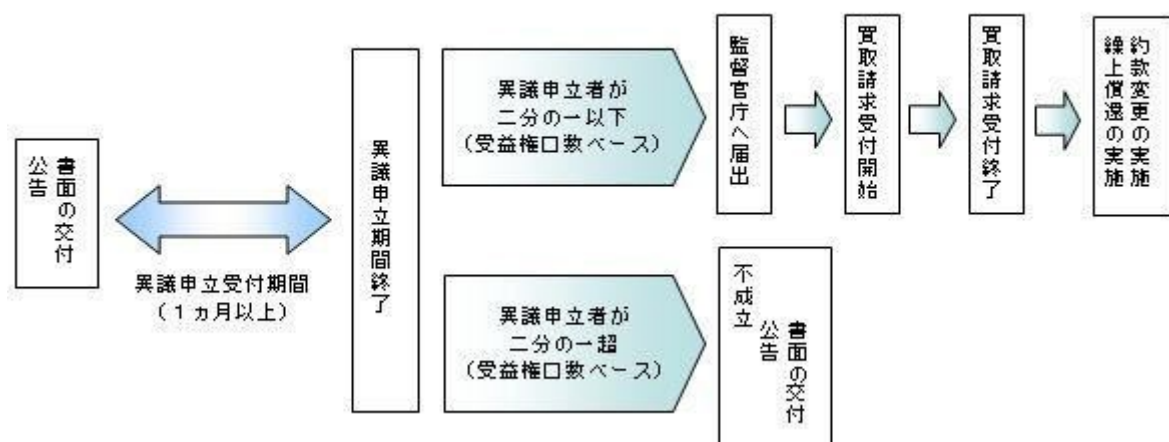
異議の申立て

1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。

2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行なわない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。

3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

・ 委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。

- ・ 交付運用報告書は、原則として知っている受益者に対して交付されます。
- ・ 運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。  
ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

#### 関係法人との契約について

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

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

##### (1) 収益分配金・償還金受領権

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

##### (2) 解約請求権

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

##### (3) 帳簿閲覧権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づき作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期計算期間(平成26年10月28日から平成27年10月26日まで)の財務諸表について、PwCあらた監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第15期 平成26年10月27日現在	第16期 平成27年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,405,867	7,727,739
親投資信託受益証券	153,809,382	145,509,198
未収利息	11	12
流動資産合計	162,215,260	153,236,949
資産合計	162,215,260	153,236,949
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	129,633	107,273
未払受託者報酬	39,168	37,278
未払委託者報酬	557,960	530,997
その他未払費用	4,206	4,002
流動負債合計	730,967	679,550
負債合計	730,967	679,550
純資産の部		
元本等		
元本	129,633,963	107,273,443
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	31,850,330	45,283,956
（分配準備積立金）	32,517,691	43,245,185
元本等合計	161,484,293	152,557,399
純資産合計	161,484,293	152,557,399
負債純資産合計	162,215,260	153,236,949



## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期		第16期	
	自	平成25年10月29日 至 平成26年10月27日	自	平成26年10月28日 至 平成27年10月26日
<b>営業収益</b>				
受取利息		4,772		4,251
有価証券売買等損益		11,514,922		22,016,657
営業収益合計		11,519,694		22,020,908
<b>営業費用</b>				
受託者報酬		80,775		74,413
委託者報酬		1,150,519		1,060,058
その他費用		8,665		7,993
営業費用合計		1,239,959		1,142,464
営業利益又は営業損失（ ）		10,279,735		20,878,444
経常利益又は経常損失（ ）		10,279,735		20,878,444
当期純利益又は当期純損失（ ）		10,279,735		20,878,444
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		1,335,008		2,856,849
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		28,944,936		31,850,330
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,696,520		2,702,338
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,696,520		2,702,338
剰余金減少額又は欠損金増加額		7,606,220		7,183,034
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		7,606,220		7,183,034
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		129,633		107,273
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		31,850,330		45,283,956

## （ 3 ）【注記表】

## （ 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ）

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

## （ 貸借対照表に関する注記 ）

		第15期 平成26年10月27日現在	第16期 平成27年10月26日現在
1.	期首元本額	165,670,884円	129,633,963円
	期中追加設定元本額	7,930,592円	6,943,852円
	期中一部解約元本額	43,967,513円	29,304,372円
2.	受益権の総数	129,633,963口	107,273,443口

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第15期 自 平成25年10月29日 至 平成26年10月27日		第16期 自 平成26年10月28日 至 平成27年10月26日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	3,984円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 3,844円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	8,940,743円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 18,017,751円
C	信託約款に定める収益調整金	25,190,214円	C 信託約款に定める収益調整金 22,487,610円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	23,702,597円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 25,330,863円
E	分配対象収益（A+B+C+D）	57,837,538円	E 分配対象収益（A+B+C+D） 65,840,068円
F	分配対象収益(1万口当たり)	4,461円	F 分配対象収益(1万口当たり) 6,137円
G	分配金額	129,633円	G 分配金額 107,273円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり) 10円

## （ 金融商品に関する注記 ）

金融商品の状況に関する事項

	第15期 自 平成25年10月29日 至 平成26年10月27日	第16期 自 平成26年10月28日 至 平成27年10月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	第15期 平成26年10月27日現在	第16期 平成27年10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ぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第15期（平成26年10月27日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	9,717,520
合計	9,717,520

第16期（平成27年10月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	18,067,348
合計	18,067,348

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

第15期 平成26年10月27日現在		第16期 平成27年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.2457円	1口当たり純資産額	1.4221円
(1万口当たり純資産額)	(12,457円)	(1万口当たり純資産額)	(14,221円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI (ヘッジなし) マザーファンド	5,812,895	11,799,014	
	海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI (ヘッジあり) マザーファンド	9,250,832	11,726,354	
	日本債券インデックスマザーファンド	27,448,221	36,709,250	
	海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド	3,141,804	7,369,729	
	海外債券インデックス(ヘッジあり) マザーファンド	4,975,446	7,344,255	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	53,467,149	70,560,596	
合計		104,096,347	145,509,198	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

(参考)

### 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

#### 貸借対照表

(単位：円)

	平成26年10月27日現在	平成27年10月26日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	199,737,855	100,707,229
株式	26,552,269,460	28,010,291,140
派生商品評価勘定	2,624,875	22,629,740
未収入金	-	50,383,230

未収配当金	205,942,225	203,921,722
未収利息	275	163
前払金	13,160,000	-
流動資産合計	26,973,734,690	28,387,933,224
資産合計	26,973,734,690	28,387,933,224
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	13,013,526	-
前受金	-	21,170,000
未払金	87,710,100	-
未払解約金	6,618,756	47,870,666
流動負債合計	107,342,382	69,040,666
負債合計	107,342,382	69,040,666
純資産の部		
元本等		
元本	25,810,439,886	21,458,722,226
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,055,952,422	6,860,170,332
元本等合計	26,866,392,308	28,318,892,558
純資産合計	26,866,392,308	28,318,892,558
負債純資産合計	26,973,734,690	28,387,933,224

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成26年10月27日現在	平成27年10月26日現在
1.	期首	平成25年10月29日	平成26年10月28日
	期首元本額	28,535,557,496円	25,810,439,886円
	期首からの追加設定元本額	1,614,921,276円	1,828,412,937円
	期首からの一部解約元本額	4,340,038,886円	6,180,130,597円

元本の内訳		
DCインデックスバランス（株式20）	199,050,793円	189,907,164円
DCインデックスバランス（株式40）	746,489,090円	714,213,076円
DCインデックスバランス（株式60）	1,375,400,721円	1,350,467,087円
DCインデックスバランス（株式80）	1,622,735,239円	1,600,692,719円
インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,102,978,773円	1,171,993,590円
世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	7,701,764,892円	5,497,114,326円
全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	6,818,156円	5,128,110円
日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産）	32,558,972円	23,674,244円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	86,579,690円	65,422,399円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	70,644,917円	53,467,149円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	105,571,690円	81,115,328円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	132,571,175円	97,867,053円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	8,728,480,826円	7,073,787,445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）	35,523,870円	20,238,189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）	56,560,448円	45,719,600円
グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	52,235,800円	41,930,365円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	325,131,480円	276,300,644円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	915,340,940円	828,292,055円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,270,208,834円	1,161,429,024円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,243,793,580円	1,159,962,659円
計	25,810,439,886円	21,458,722,226円
2. 受益権の総数	25,810,439,886口	21,458,722,226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	374,734,600円	488,500,000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）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成25年10月29日 至 平成26年10月27日	自 平成26年10月28日 至 平成27年10月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年10月27日現在	平成27年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成26年10月27日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)



種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,154,246,609
合計	1,154,246,609

(平成27年10月26日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	5,218,527,179
合計	5,218,527,179

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成26年10月27日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	324,285,000	-	314,000,000	10,285,000
合計		324,285,000	-	314,000,000	10,285,000

(平成27年10月26日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	273,665,000	-	296,305,000	22,640,000
合計		273,665,000	-	296,305,000	22,640,000

(注) 1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成26年10月27日現在		平成27年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.0409円	1口当たり純資産額	1.3197円
(1万口当たり純資産額)	(10,409円)	(1万口当たり純資産額)	(13,197円)

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	6,000	268.00	1,608,000	
日本水産	16,900	403.00	6,810,700	
マルハニチロ	2,800	1,823.00	5,104,400	
サカタのタネ	2,200	2,460.00	5,412,000	
ホクト	1,500	2,383.00	3,574,500	
住石ホールディングス	4,000	118.00	472,000	
日鉄鉱業	4,000	554.00	2,216,000	
三井松島産業	9,000	120.00	1,080,000	
国際石油開発帝石	72,300	1,184.50	85,639,350	
日本海洋掘削	400	2,728.00	1,091,200	
石油資源開発	2,000	3,725.00	7,450,000	
K & O エナジーグループ	900	1,553.00	1,397,700	
ショーボンドホールディングス	1,300	4,765.00	6,194,500	
ミライト・ホールディングス	4,200	1,069.00	4,489,800	
サンヨーホームズ	200	562.00	112,400	

ダイセキ環境ソリューション	300	1,350.00	405,000	
安藤・間	9,200	770.00	7,084,000	
東急建設	4,900	948.00	4,645,200	
コムシスホールディングス	6,100	1,613.00	9,839,300	
ミサワホーム	1,600	737.00	1,179,200	
高松コンストラクショングループ	1,000	2,491.00	2,491,000	
東建コーポレーション	500	9,200.00	4,600,000	
ヤマウラ	700	489.00	342,300	
大成建設	71,000	790.00	56,090,000	
大林組	41,000	1,064.00	43,624,000	
清水建設	42,000	1,046.00	43,932,000	
飛鳥建設	10,600	224.00	2,374,400	
長谷工コーポレーション	17,200	1,227.00	21,104,400	
松井建設	1,500	709.00	1,063,500	
銭高組	2,000	664.00	1,328,000	
鹿島建設	60,000	697.00	41,820,000	
不動テトラ	10,500	157.00	1,648,500	
大末建設	500	809.00	404,500	
鉄建建設	9,000	329.00	2,961,000	
西松建設	15,000	501.00	7,515,000	
三井住友建設	55,800	120.00	6,696,000	
大豊建設	4,000	547.00	2,188,000	
前田建設工業	9,000	904.00	8,136,000	
ナカノフドー建設	1,100	774.00	851,400	
奥村組	13,000	647.00	8,411,000	
東鉄工業	1,700	2,635.00	4,479,500	
イチケン	2,000	453.00	906,000	
浅沼組	4,000	317.00	1,268,000	
戸田建設	17,000	671.00	11,407,000	
熊谷組	17,000	376.00	6,392,000	
青木あすなる建設	900	909.00	818,100	
北野建設	3,000	325.00	975,000	
植木組	2,000	252.00	504,000	
三井ホーム	2,000	586.00	1,172,000	
矢作建設工業	1,700	1,076.00	1,829,200	
ピーエス三菱	1,500	407.00	610,500	

日本ハウスホールディングス	2,800	530.00	1,484,000
大東建託	5,100	13,060.00	66,606,000
新日本建設	1,700	571.00	970,700
N I P P O	3,000	2,130.00	6,390,000
東亜道路工業	3,000	488.00	1,464,000
前田道路	4,000	2,254.00	9,016,000
日本道路	4,000	685.00	2,740,000
東亜建設工業	10,000	299.00	2,990,000
若築建設	8,000	156.00	1,248,000
東洋建設	4,100	537.00	2,201,700
五洋建設	15,300	557.00	8,522,100
大林道路	2,000	880.00	1,760,000
福田組	2,000	1,207.00	2,414,000
住友林業	10,100	1,466.00	14,806,600
日本基礎技術	1,700	522.00	887,400
日成ビルド工業	4,000	374.00	1,496,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	7,000	88.00	616,000
巴コーポレーション	1,800	370.00	666,000
パナホーム	5,000	828.00	4,140,000
大和ハウス工業	40,500	3,103.00	125,671,500
ライト工業	2,200	1,155.00	2,541,000
積水ハウス	43,200	1,960.00	84,672,000
日特建設	1,900	551.00	1,046,900
北陸電気工事	700	1,145.00	801,500
ユアテック	2,000	1,148.00	2,296,000
西部電気工業	1,000	425.00	425,000
四電工	1,000	426.00	426,000
中電工	2,000	2,637.00	5,274,000
関電工	6,000	841.00	5,046,000
きんでん	9,100	1,614.00	14,687,400
東京エネシス	1,000	1,075.00	1,075,000
トーエネック	2,000	949.00	1,898,000
住友電設	1,100	1,552.00	1,707,200
日本電設工業	2,300	2,319.00	5,333,700
協和エクシオ	5,900	1,304.00	7,693,600
新日本空調	1,200	1,075.00	1,290,000

N D S	3,000	299.00	897,000
九電工	3,000	2,086.00	6,258,000
三機工業	2,800	943.00	2,640,400
日揮	14,000	2,001.00	28,014,000
中外炉工業	4,000	233.00	932,000
ヤマト	1,300	478.00	621,400
太平電業	2,000	1,287.00	2,574,000
高砂熱学工業	3,800	1,757.00	6,676,600
三晃金属工業	2,000	277.00	554,000
朝日工業社	2,000	453.00	906,000
明星工業	2,300	597.00	1,373,100
大気社	2,000	2,952.00	5,904,000
ダイダン	2,000	882.00	1,764,000
日比谷総合設備	1,800	1,556.00	2,800,800
東芝プラントシステム	2,200	1,320.00	2,904,000
東洋エンジニアリング	7,000	318.00	2,226,000
千代田化工建設	10,000	949.00	9,490,000
新興プランテック	2,800	989.00	2,769,200
日本製粉	9,000	756.00	6,804,000
日清製粉グループ本社	15,000	1,788.00	26,820,000
日東富士製粉	1,000	351.00	351,000
昭和産業	6,000	463.00	2,778,000
鳥越製粉	1,100	791.00	870,100
中部飼料	1,300	1,095.00	1,423,500
フィード・ワン	8,400	147.00	1,234,800
東洋精糖	2,000	113.00	226,000
日本甜菜製糖	7,000	194.00	1,358,000
三井製糖	5,000	505.00	2,525,000
塩水港精糖	1,600	243.00	388,800
森永製菓	12,000	581.00	6,972,000
中村屋	3,000	458.00	1,374,000
江崎グリコ	3,200	5,570.00	17,824,000
名糖産業	600	1,314.00	788,400
不二家	8,000	196.00	1,568,000
山崎製パン	10,000	2,127.00	21,270,000
第一屋製パン	2,000	120.00	240,000

モロゾフ	2,000	408.00	816,000	
亀田製菓	800	4,605.00	3,684,000	
寿スピリッツ	300	3,940.00	1,182,000	
カルビー	5,100	4,385.00	22,363,500	
森永乳業	12,000	503.00	6,036,000	
六甲バター	600	1,685.00	1,011,000	
ヤクルト本社	7,400	6,410.00	47,434,000	
明治ホールディングス	8,100	9,120.00	73,872,000	
雪印メグミルク	3,200	2,546.00	8,147,200	
プリマハム	8,000	341.00	2,728,000	
日本ハム	10,000	2,531.00	25,310,000	
伊藤ハム	8,000	627.00	5,016,000	
林兼産業	4,000	127.00	508,000	
丸大食品	7,000	456.00	3,192,000	
米久	400	2,261.00	904,400	
S Foods	800	2,111.00	1,688,800	
サッポロホールディングス	21,000	494.00	10,374,000	
アサヒグループホールディングス	25,700	3,777.00	97,068,900	
キリンホールディングス	55,600	1,698.00	94,408,800	
宝ホールディングス	10,800	866.00	9,352,800	
オエノンホールディングス	4,000	226.00	904,000	
養命酒製造	400	1,929.00	771,600	
コカ・コーラウエスト	4,600	2,327.00	10,704,200	
コカ・コーライーストジャパン	4,800	1,659.00	7,963,200	
サントリー食品インターナショナル	9,400	4,865.00	45,731,000	
ダйдードリンコ	700	5,180.00	3,626,000	
伊藤園	4,100	2,536.00	10,397,600	
キーコーヒー	1,200	1,997.00	2,396,400	
ユニカフェ	400	915.00	366,000	
ジャパンフーズ	200	1,147.00	229,400	
日清オイリオグループ	7,000	444.00	3,108,000	
不二製油グループ本社	3,700	1,718.00	6,356,600	
かどや製油	100	2,624.00	262,400	
J - オイルミルズ	6,000	342.00	2,052,000	
キッコーマン	11,000	3,730.00	41,030,000	
味の素	32,000	2,701.00	86,432,000	

キューピー	7,000	2,789.00	19,523,000
ハウス食品グループ本社	5,100	2,071.00	10,562,100
カゴメ	4,900	2,019.00	9,893,100
焼津水産化学工業	700	989.00	692,300
アリアケジャパン	1,300	5,500.00	7,150,000
エバラ食品工業	200	2,026.00	405,200
ニチレイ	15,000	758.00	11,370,000
東洋水産	7,200	4,495.00	32,364,000
イトアンド	200	2,159.00	431,800
日清食品ホールディングス	5,800	5,680.00	32,944,000
永谷園ホールディングス	1,000	1,046.00	1,046,000
一正蒲鉾	500	1,030.00	515,000
フジッコ	1,300	2,257.00	2,934,100
ロック・フィールド	700	3,020.00	2,114,000
日本たばこ産業	81,100	4,229.00	342,971,900
ケンコーマヨネーズ	500	1,612.00	806,000
わらべや日洋	800	2,366.00	1,892,800
なとり	600	1,543.00	925,800
ユーグレナ	4,600	1,685.00	7,751,000
ミヨシ油脂	5,000	137.00	685,000
理研ビタミン	400	3,940.00	1,576,000
片倉工業	1,600	1,322.00	2,115,200
ゲンゼ	10,000	398.00	3,980,000
東洋紡	51,000	181.00	9,231,000
ユニチカ	38,000	64.00	2,432,000
富士紡ホールディングス	6,000	227.00	1,362,000
倉敷紡績	13,000	223.00	2,899,000
シキボウ	8,000	124.00	992,000
日本毛織	4,000	971.00	3,884,000
大東紡織	3,000	69.00	207,000
トーア紡コーポレーション	600	658.00	394,800
ダイドーリミテッド	1,500	502.00	753,000
帝国繊維	1,300	1,533.00	1,992,900
帝人	53,000	419.00	22,207,000
東レ	99,000	1,075.00	106,425,000
サカイオーベックス	3,000	208.00	624,000

住江織物	3,000	357.00	1,071,000	
日本フェルト	700	505.00	353,500	
イチカワ	1,000	352.00	352,000	
日本バイリーン	2,000	1,191.00	2,382,000	
日東製網	1,000	149.00	149,000	
芦森工業	3,000	198.00	594,000	
アツギ	11,000	120.00	1,320,000	
ダイニック	3,000	170.00	510,000	
セーレン	3,200	1,453.00	4,649,600	
東海染工	2,000	121.00	242,000	
小松精練	2,100	738.00	1,549,800	
ワコールホールディングス	8,000	1,533.00	12,264,000	
ホギメディカル	800	5,750.00	4,600,000	
レナウン	3,200	142.00	454,400	
クラウドディア	400	592.00	236,800	
T S Iホールディングス	5,700	858.00	4,890,600	
三陽商会	7,000	362.00	2,534,000	
ナイガイ	6,000	63.00	378,000	
オンワードホールディングス	9,000	781.00	7,029,000	
ルック	2,000	184.00	368,000	
キムラタン	61,000	9.00	549,000	
ゴールドウイン	600	6,110.00	3,666,000	
デサント	2,900	1,619.00	4,695,100	
キング	600	437.00	262,200	
ヤマトインターナショナル	800	415.00	332,000	
特種東海製紙	7,000	385.00	2,695,000	
王子ホールディングス	53,000	624.00	33,072,000	
日本製紙	6,200	2,189.00	13,571,800	
三菱製紙	20,000	84.00	1,680,000	
北越紀州製紙	8,000	821.00	6,568,000	
中越パルプ工業	5,000	215.00	1,075,000	
巴川製紙所	2,000	231.00	462,000	
大王製紙	5,700	1,169.00	6,663,300	
レンゴー	11,000	570.00	6,270,000	
トーモク	4,000	262.00	1,048,000	
ザ・バック	900	2,807.00	2,526,300	



クラレ	20,200	1,479.00	29,875,800	
旭化成	80,000	767.80	61,424,000	
共和レザー	800	1,123.00	898,400	
昭和電工	86,000	154.00	13,244,000	
住友化学	95,000	681.00	64,695,000	
日本化成	3,000	127.00	381,000	
住友精化	3,000	830.00	2,490,000	
日産化学工業	8,300	2,956.00	24,534,800	
ラサ工業	5,000	137.00	685,000	
クレハ	9,000	464.00	4,176,000	
多木化学	1,000	709.00	709,000	
テイカ	2,000	513.00	1,026,000	
石原産業	22,000	114.00	2,508,000	
片倉コープアグリ	1,550	273.00	423,150	
日東エフシー	800	1,048.00	838,400	
日本曹達	8,000	923.00	7,384,000	
東ソー	34,000	648.00	22,032,000	
トクヤマ	20,000	227.00	4,540,000	
セントラル硝子	13,000	613.00	7,969,000	
東亜合成	8,000	1,007.00	8,056,000	
大阪ソーダ	5,000	435.00	2,175,000	
関東電化工業	3,000	947.00	2,841,000	
デンカ	26,000	558.00	14,508,000	
信越化学工業	23,000	7,029.00	161,667,000	
日本カーバイド工業	5,000	192.00	960,000	
堺化学工業	5,000	366.00	1,830,000	
エア・ウォーター	11,000	1,999.00	21,989,000	
大陽日酸	16,500	1,299.00	21,433,500	
日本化学工業	5,000	266.00	1,330,000	
日本パーカライジング	6,100	1,084.00	6,612,400	
高压ガス工業	2,000	642.00	1,284,000	
四国化成工業	2,000	1,108.00	2,216,000	
戸田工業	3,000	316.00	948,000	
ステラ ケミファ	700	1,201.00	840,700	
保土谷化学工業	4,000	171.00	684,000	
日本触媒	2,000	9,060.00	18,120,000	

大日精化工業	5,000	578.00	2,890,000
カネカ	17,000	1,049.00	17,833,000
三菱瓦斯化学	22,000	680.00	14,960,000
三井化学	58,000	458.00	26,564,000
J S R	12,700	1,890.00	24,003,000
東京応化工業	2,700	3,830.00	10,341,000
大阪有機化学工業	900	636.00	572,400
三菱ケミカルホールディングス	80,200	746.60	59,877,320
日本合成化学工業	3,000	859.00	2,577,000
ダイセル	18,000	1,600.00	28,800,000
住友ベークライト	12,000	514.00	6,168,000
積水化学工業	29,700	1,353.00	40,184,100
日本ゼオン	11,000	1,098.00	12,078,000
アイカ工業	3,900	2,450.00	9,555,000
宇部興産	65,000	244.00	15,860,000
積水樹脂	2,000	1,623.00	3,246,000
タキロン	3,000	509.00	1,527,000
旭有機材工業	5,000	225.00	1,125,000
日立化成	6,300	1,992.00	12,549,600
ニチパン	1,000	574.00	574,000
リケンテクノス	2,100	411.00	863,100
大倉工業	3,000	346.00	1,038,000
積水化成成品工業	4,000	402.00	1,608,000
群栄化学工業	3,000	291.00	873,000
タイガースポリマー	600	736.00	441,600
ミライアル	500	1,212.00	606,000
ダイキアクシス	200	1,007.00	201,400
ダイキョーニシカワ	400	6,460.00	2,584,000
日本化薬	8,000	1,247.00	9,976,000
カーリットホールディングス	1,200	532.00	638,400
日本精化	1,100	889.00	977,900
A D E K A	5,900	1,715.00	10,118,500
日油	11,000	900.00	9,900,000
新日本理化	2,100	207.00	434,700
ハリマ化成グループ	1,100	465.00	511,500
花王	34,500	5,913.00	203,998,500

第一工業製薬	3,000	382.00	1,146,000	
ニイタカ	200	1,575.00	315,000	
三洋化成工業	4,000	889.00	3,556,000	
大日本塗料	7,000	169.00	1,183,000	
日本ペイントホールディングス	11,100	2,620.00	29,082,000	
関西ペイント	15,600	1,840.00	28,704,000	
神東塗料	1,000	201.00	201,000	
中国塗料	4,000	887.00	3,548,000	
日本特殊塗料	1,000	1,050.00	1,050,000	
藤倉化成	1,800	577.00	1,038,600	
太陽ホールディングス	1,100	4,120.00	4,532,000	
D I C	52,000	329.00	17,108,000	
サカタインクス	2,600	1,109.00	2,883,400	
東洋インキＳＣホールディングス	13,000	498.00	6,474,000	
T & K T O K A	400	2,239.00	895,600	
富士フイルムホールディングス	29,300	4,758.00	139,409,400	
資生堂	22,800	2,920.50	66,587,400	
ライオン	15,000	1,138.00	17,070,000	
高砂香料工業	900	3,300.00	2,970,000	
マンダム	1,300	4,485.00	5,830,500	
ミルボン	700	4,505.00	3,153,500	
ファンケル	3,000	1,882.00	5,646,000	
コーセー	2,100	11,700.00	24,570,000	
コタ	400	1,235.00	494,000	
ドクターシーラボ	1,700	2,236.00	3,801,200	
シーボン	200	2,612.00	522,400	
ポーラ・オルビスホールディングス	1,300	7,580.00	9,854,000	
ノエビアホールディングス	800	2,944.00	2,355,200	
アジュバンコスメジャパン	300	905.00	271,500	
エステー	900	1,018.00	916,200	
アグロ カネショウ	500	980.00	490,000	
コニシ	1,000	2,247.00	2,247,000	
長谷川香料	1,600	1,626.00	2,601,600	
星光P M C	700	1,105.00	773,500	
小林製薬	2,100	9,000.00	18,900,000	
荒川化学工業	1,100	1,202.00	1,322,200	

メック	1,000	755.00	755,000	
日本高純度化学	400	2,278.00	911,200	
J C U	300	4,440.00	1,332,000	
新田ゼラチン	800	778.00	622,400	
デクセリアルズ	2,900	1,382.00	4,007,800	
アース製薬	900	4,760.00	4,284,000	
イハラケミカル工業	2,000	1,424.00	2,848,000	
北興化学工業	1,000	454.00	454,000	
大成ラミック	400	2,868.00	1,147,200	
クミアイ化学工業	2,700	979.00	2,643,300	
日本農薬	3,000	819.00	2,457,000	
アキレス	11,000	151.00	1,661,000	
有沢製作所	2,200	793.00	1,744,600	
日東電工	9,900	8,043.00	79,625,700	
レック	400	1,361.00	544,400	
きもと	2,300	260.00	598,000	
藤森工業	1,100	3,310.00	3,641,000	
前澤化成工業	900	1,072.00	964,800	
J S P	1,000	2,508.00	2,508,000	
エフピコ	1,100	4,930.00	5,423,000	
天馬	1,000	2,082.00	2,082,000	
信越ポリマー	2,500	634.00	1,585,000	
東リ	3,000	347.00	1,041,000	
ニフコ	2,900	4,730.00	13,717,000	
日本バルカー工業	5,000	303.00	1,515,000	
ユニ・チャーム	26,000	2,543.50	66,131,000	
協和発酵キリン	15,000	1,943.00	29,145,000	
武田薬品工業	48,000	5,784.00	277,632,000	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	143,600	1,684.00	241,822,400	
大日本住友製薬	9,100	1,340.00	12,194,000	
塩野義製薬	20,000	4,240.00	84,800,000	
田辺三菱製薬	14,900	2,004.00	29,859,600	
わかもと製薬	1,000	288.00	288,000	
あすか製薬	1,500	1,417.00	2,125,500	
日本新薬	3,000	4,470.00	13,410,000	

ピオフェルミン製薬	200	3,390.00	678,000	
中外製薬	12,800	3,810.00	48,768,000	
科研製薬	2,200	8,130.00	17,886,000	
エーザイ	16,900	7,279.00	123,015,100	
ロート製薬	5,800	1,941.00	11,257,800	
小野薬品工業	5,800	14,840.00	86,072,000	
久光製薬	3,600	4,665.00	16,794,000	
有機合成薬品工業	1,000	297.00	297,000	
持田製薬	900	7,140.00	6,426,000	
参天製薬	23,600	1,584.00	37,382,400	
扶桑薬品工業	4,000	279.00	1,116,000	
日本ケミファ	2,000	603.00	1,206,000	
ツムラ	4,000	2,874.00	11,496,000	
日医工	3,000	3,210.00	9,630,000	
キッセイ薬品工業	2,300	3,040.00	6,992,000	
生化学工業	2,500	1,498.00	3,745,000	
栄研化学	1,100	2,212.00	2,433,200	
日水製薬	500	1,320.00	660,000	
鳥居薬品	900	2,900.00	2,610,000	
J C R ファーマ	1,000	2,475.00	2,475,000	
東和薬品	600	7,740.00	4,644,000	
富士製薬工業	300	2,016.00	604,800	
沢井製薬	2,000	7,630.00	15,260,000	
ゼリア新薬工業	2,600	1,721.00	4,474,600	
第一三共	43,100	2,306.00	99,388,600	
キョーリン製薬ホールディングス	3,400	2,003.00	6,810,200	
大幸薬品	600	1,891.00	1,134,600	
ダイト	600	2,828.00	1,696,800	
大塚ホールディングス	27,600	3,871.00	106,839,600	
大正製薬ホールディングス	3,100	7,600.00	23,560,000	
日本コークス工業	11,600	102.00	1,183,200	
昭和シェル石油	12,900	1,069.00	13,790,100	
ニチレキ	1,000	990.00	990,000	
東燃ゼネラル石油	19,000	1,253.00	23,807,000	
ユシロ化学工業	700	1,408.00	985,600	
ピーピー・カストロール	500	1,274.00	637,000	

富士石油	3,000	379.00	1,137,000	
MORESCO	300	1,593.00	477,900	
出光興産	6,100	1,999.00	12,193,900	
JXホールディングス	142,300	485.50	69,086,650	
コスモエネルギーホールディングス	3,600	1,682.00	6,055,200	
横浜ゴム	7,700	2,349.00	18,087,300	
東洋ゴム工業	5,800	2,640.00	15,312,000	
ブリヂストン	43,300	4,420.00	191,386,000	
住友ゴム工業	12,000	1,825.00	21,900,000	
藤倉ゴム工業	1,100	603.00	663,300	
オカモト	4,000	1,212.00	4,848,000	
フコク	500	1,016.00	508,000	
ニッタ	1,300	3,200.00	4,160,000	
住友理工	2,400	1,109.00	2,661,600	
三ツ星ベルト	3,000	969.00	2,907,000	
バンドー化学	5,000	519.00	2,595,000	
日東紡績	9,000	366.00	3,294,000	
旭硝子	68,000	763.00	51,884,000	
日本板硝子	62,000	116.00	7,192,000	
石塚硝子	2,000	246.00	492,000	
日本山村硝子	5,000	181.00	905,000	
日本電気硝子	27,000	597.00	16,119,000	
オハラ	500	606.00	303,000	
住友大阪セメント	24,000	468.00	11,232,000	
太平洋セメント	80,000	395.00	31,600,000	
デイ・シイ	1,400	377.00	527,800	
日本ヒューム	1,400	770.00	1,078,000	
日本コンクリート工業	2,300	416.00	956,800	
三谷セキサン	600	1,708.00	1,024,800	
アジアパイルホールディングス	1,700	808.00	1,373,600	
東海カーボン	11,000	329.00	3,619,000	
日本カーボン	6,000	328.00	1,968,000	
東洋炭素	700	1,790.00	1,253,000	
ノリタケカンパニーリミテド	7,000	282.00	1,974,000	
TOTO	9,400	4,165.00	39,151,000	
日本碍子	16,000	2,599.00	41,584,000	

日本特殊陶業	11,100	3,045.00	33,799,500	
ダントーホールディングス	1,000	211.00	211,000	
MARUWA	400	2,740.00	1,096,000	
品川リフラクトリーズ	3,000	282.00	846,000	
黒崎播磨	3,000	247.00	741,000	
ヨータイ	1,000	348.00	348,000	
イソライト工業	700	213.00	149,100	
東京窯業	2,000	190.00	380,000	
ニッカトー	400	406.00	162,400	
フジインコーポレーテッド	1,200	1,870.00	2,244,000	
エーアンドエーマテリアル	3,000	96.00	288,000	
ニチアス	6,000	762.00	4,572,000	
ニチハ	1,700	1,688.00	2,869,600	
新日鐵住金	54,700	2,567.00	140,414,900	
神戸製鋼所	222,000	159.00	35,298,000	
合同製鐵	7,000	216.00	1,512,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	32,700	1,998.00	65,334,600	
日新製鋼	5,500	1,305.00	7,177,500	
東京製鐵	6,500	815.00	5,297,500	
共英製鋼	1,400	2,219.00	3,106,600	
大和工業	2,900	2,998.00	8,694,200	
東京鐵鋼	2,000	558.00	1,116,000	
大阪製鐵	800	2,082.00	1,665,600	
淀川製鋼所	1,800	2,365.00	4,257,000	
東洋鋼鈑	3,100	408.00	1,264,800	
丸一鋼管	3,900	3,155.00	12,304,500	
モリ工業	2,000	378.00	756,000	
大同特殊鋼	22,000	427.00	9,394,000	
日本高周波鋼業	6,000	106.00	636,000	
日本冶金工業	10,200	172.00	1,754,400	
山陽特殊製鋼	8,000	533.00	4,264,000	
愛知製鋼	8,000	538.00	4,304,000	
日立金属	13,100	1,689.00	22,125,900	
日本金属	4,000	140.00	560,000	
大平洋金属	8,000	329.00	2,632,000	
新日本電工	7,300	254.00	1,854,200	

栗本鐵工所	7,000	209.00	1,463,000	
虹技	2,000	180.00	360,000	
日本鑄鉄管	1,000	195.00	195,000	
三菱製鋼	8,000	249.00	1,992,000	
日亜鋼業	1,900	279.00	530,100	
日本精線	1,000	522.00	522,000	
シンニッタン	1,300	576.00	748,800	
新家工業	3,000	145.00	435,000	
大紀アルミニウム工業所	2,000	334.00	668,000	
日本軽金属ホールディングス	31,300	207.00	6,479,100	
三井金属鉱業	35,000	262.00	9,170,000	
東邦亜鉛	7,000	351.00	2,457,000	
三菱マテリアル	80,000	435.00	34,800,000	
住友金属鉱山	35,000	1,579.00	55,265,000	
DOWAホールディングス	15,000	1,072.00	16,080,000	
古河機械金属	20,000	288.00	5,760,000	
エス・サイエンス	6,600	45.00	297,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,300	3,430.00	4,459,000	
東邦チタニウム	2,200	1,602.00	3,524,400	
UACJ	15,000	236.00	3,540,000	
古河電気工業	38,000	217.00	8,246,000	
住友電気工業	48,300	1,721.50	83,148,450	
フジクラ	18,000	586.00	10,548,000	
昭和電線ホールディングス	15,000	81.00	1,215,000	
タツタ電線	2,400	470.00	1,128,000	
沖電線	1,000	230.00	230,000	
カナレ電気	200	2,045.00	409,000	
平河ヒューテック	300	1,269.00	380,700	
リョービ	7,000	456.00	3,192,000	
アーレスティ	1,500	835.00	1,252,500	
アサヒホールディングス	1,900	1,889.00	3,589,100	
稲葉製作所	700	1,300.00	910,000	
宮地エンジニアリンググループ	4,000	225.00	900,000	
トーカロ	800	2,417.00	1,933,600	
アルファC O	400	1,310.00	524,000	
SUMCO	10,000	1,238.00	12,380,000	



川田テクノロジーズ	300	4,520.00	1,356,000	
東洋製罐グループホールディングス	9,100	2,278.00	20,729,800	
ホッカホホールディングス	3,000	308.00	924,000	
コロナ	700	1,168.00	817,600	
横河ブリッジホールディングス	2,500	1,141.00	2,852,500	
駒井ハルテック	3,000	223.00	669,000	
高田機工	1,000	226.00	226,000	
三和ホールディングス	12,100	891.00	10,781,100	
文化シャッター	3,600	950.00	3,420,000	
三協立山	1,700	1,752.00	2,978,400	
アルインコ	600	1,150.00	690,000	
東洋シャッター	300	784.00	235,200	
LIXILグループ	19,100	2,627.00	50,175,700	
日本フィルコン	1,000	534.00	534,000	
ノーリツ	2,500	1,996.00	4,990,000	
長府製作所	1,400	2,517.00	3,523,800	
リンナイ	2,400	9,860.00	23,664,000	
ダイニチ工業	700	719.00	503,300	
日東精工	2,000	315.00	630,000	
三洋工業	2,000	177.00	354,000	
岡部	2,700	945.00	2,551,500	
ジーテクト	1,200	1,582.00	1,898,400	
中国工業	200	730.00	146,000	
東プレ	2,500	2,465.00	6,162,500	
高周波熱錬	2,200	889.00	1,955,800	
東京製網	9,000	194.00	1,746,000	
サンコール	800	653.00	522,400	
モリテック スチール	700	297.00	207,900	
パイオラックス	600	6,380.00	3,828,000	
日本発條	11,100	1,241.00	13,775,100	
中央発條	2,000	292.00	584,000	
アドバネクス	200	1,766.00	353,200	
立川ブラインド工業	500	807.00	403,500	
三益半導体工業	900	1,170.00	1,053,000	
日本ドライケミカル	200	2,230.00	446,000	
日本製鋼所	19,000	460.00	8,740,000	

三浦工業	5,700	1,446.00	8,242,200	
タクマ	4,000	958.00	3,832,000	
ツガミ	4,000	610.00	2,440,000	
オークマ	8,000	935.00	7,480,000	
東芝機械	7,000	429.00	3,003,000	
アマダホールディングス	19,100	1,103.00	21,067,300	
アイダエンジニアリング	2,800	1,145.00	3,206,000	
滝澤鉄工所	4,000	187.00	748,000	
富士機械製造	4,200	1,175.00	4,935,000	
牧野フライス製作所	6,000	939.00	5,634,000	
オーエスジー	5,800	2,272.00	13,177,600	
ダイジェット工業	2,000	175.00	350,000	
旭ダイヤモンド工業	3,500	1,310.00	4,585,000	
D M G 森精機	8,100	1,791.00	14,507,100	
ソディック	2,400	904.00	2,169,600	
ディスコ	1,500	10,990.00	16,485,000	
日東工器	700	2,599.00	1,819,300	
パンチ工業	500	946.00	473,000	
豊和工業	800	716.00	572,800	
OKK	5,000	148.00	740,000	
東洋機械金属	900	452.00	406,800	
津田駒工業	3,000	120.00	360,000	
島精機製作所	1,800	1,841.00	3,313,800	
日阪製作所	1,600	963.00	1,540,800	
やまびこ	2,000	1,141.00	2,282,000	
ベガサスミシン製造	1,100	495.00	544,500	
ナブテスコ	7,800	2,478.00	19,328,400	
三井海洋開発	1,500	1,718.00	2,577,000	
レオン自動機	1,000	583.00	583,000	
S M C	3,900	31,180.00	121,602,000	
新川	1,100	727.00	799,700	
ホソカワミクロン	2,000	605.00	1,210,000	
ユニオンツール	500	3,030.00	1,515,000	
オイレス工業	1,500	1,921.00	2,881,500	
日精エー・エス・ビー機械	500	2,477.00	1,238,500	
サトーホールディングス	1,600	2,491.00	3,985,600	

日本エアーテック	500	714.00	357,000	
日精樹脂工業	900	1,023.00	920,700	
ワイエイシイ	500	916.00	458,000	
小松製作所	62,800	2,047.00	128,551,600	
住友重機械工業	35,000	607.00	21,245,000	
日立建機	5,700	1,965.00	11,200,500	
日工	2,000	399.00	798,000	
巴工業	500	1,664.00	832,000	
井関農機	13,000	204.00	2,652,000	
TOWA	1,100	640.00	704,000	
丸山製作所	3,000	200.00	600,000	
北川鉄工所	6,000	317.00	1,902,000	
クボタ	61,000	1,905.50	116,235,500	
荏原実業	400	1,468.00	587,200	
三菱化工機	4,000	317.00	1,268,000	
月島機械	2,300	1,186.00	2,727,800	
帝国電機製作所	900	858.00	772,200	
新東工業	2,900	1,045.00	3,030,500	
澁谷工業	1,100	1,901.00	2,091,100	
アイチ コーポレーション	1,800	765.00	1,377,000	
小森コーポレーション	3,100	1,463.00	4,535,300	
鶴見製作所	900	2,037.00	1,833,300	
住友精密工業	2,000	467.00	934,000	
酒井重工業	2,000	241.00	482,000	
荏原製作所	27,000	524.00	14,148,000	
石井鐵工所	2,000	198.00	396,000	
西島製作所	1,300	897.00	1,166,100	
北越工業	1,300	857.00	1,114,100	
ダイキン工業	17,800	8,044.00	143,183,200	
オルガノ	3,000	498.00	1,494,000	
トーヨーカネツ	7,000	201.00	1,407,000	
栗田工業	7,300	2,900.00	21,170,000	
椿本チエイン	6,000	896.00	5,376,000	
大同工業	2,000	207.00	414,000	
日本コンベヤ	4,000	184.00	736,000	
木村化工機	1,200	526.00	631,200	

アネスト岩田	1,900	874.00	1,660,600	
ダイフク	6,000	1,780.00	10,680,000	
サムコ	200	933.00	186,600	
加藤製作所	3,000	540.00	1,620,000	
油研工業	3,000	240.00	720,000	
タダノ	6,000	1,469.00	8,814,000	
フジテック	3,600	1,300.00	4,680,000	
C K D	3,400	1,102.00	3,746,800	
キトー	1,400	967.00	1,353,800	
平和	3,600	2,235.00	8,046,000	
理想科学工業	1,500	2,235.00	3,352,500	
S A N K Y O	3,400	4,655.00	15,827,000	
日本金銭機械	1,100	1,296.00	1,425,600	
マースエンジニアリング	700	2,056.00	1,439,200	
福島工業	700	2,794.00	1,955,800	
オーイズミ	500	641.00	320,500	
ダイコク電機	500	1,631.00	815,500	
竹内製作所	1,500	2,370.00	3,555,000	
アマノ	4,100	1,489.00	6,104,900	
J U K I	1,800	1,505.00	2,709,000	
サンデンホールディングス	7,000	437.00	3,059,000	
蛇の目マシン工業	1,200	921.00	1,105,200	
マックス	2,000	1,224.00	2,448,000	
グローリー	3,900	3,160.00	12,324,000	
新晃工業	900	1,291.00	1,161,900	
大和冷機工業	2,000	810.00	1,620,000	
セガサミーホールディングス	13,200	1,296.00	17,107,200	
日本ピストンリング	500	2,019.00	1,009,500	
リケン	5,000	455.00	2,275,000	
T P R	1,400	3,010.00	4,214,000	
ホシザキ電機	2,700	8,840.00	23,868,000	
大豊工業	1,000	1,462.00	1,462,000	
日本精工	25,200	1,416.00	35,683,200	
N T N	28,000	604.00	16,912,000	
ジェイテクト	13,100	2,108.00	27,614,800	
不二越	11,000	546.00	6,006,000	

日本トムソン	4,000	572.00	2,288,000	
T H K	8,200	2,323.00	19,048,600	
ユーシン精機	500	2,240.00	1,120,000	
前澤給装工業	500	1,542.00	771,000	
イーグル工業	1,700	2,413.00	4,102,100	
前澤工業	900	419.00	377,100	
日本ピラー工業	1,300	1,025.00	1,332,500	
キット	5,500	566.00	3,113,000	
日立工機	3,300	915.00	3,019,500	
マキタ	8,000	7,050.00	56,400,000	
日立造船	9,600	694.00	6,662,400	
三菱重工業	205,000	628.10	128,760,500	
I H I	88,000	342.00	30,096,000	
日清紡ホールディングス	8,200	1,600.00	13,120,000	
イビデン	8,000	1,758.00	14,064,000	
コニカミノルタ	28,700	1,426.00	40,926,200	
ブラザー工業	15,800	1,630.00	25,754,000	
ミネベア	18,000	1,445.00	26,010,000	
日立製作所	294,000	730.50	214,767,000	
東芝	258,000	356.10	91,873,800	
三菱電機	122,000	1,303.00	158,966,000	
富士電機	34,000	523.00	17,782,000	
東洋電機製造	3,000	437.00	1,311,000	
安川電機	15,000	1,463.00	21,945,000	
シンフォニアテクノロジー	8,000	208.00	1,664,000	
明電舎	11,000	432.00	4,752,000	
オリジン電気	2,000	340.00	680,000	
山洋電気	3,000	787.00	2,361,000	
デンヨー	1,000	2,015.00	2,015,000	
東芝テック	9,000	465.00	4,185,000	
芝浦メカトロニクス	2,000	231.00	462,000	
マブチモーター	3,500	6,090.00	21,315,000	
日本電産	13,600	9,261.00	125,949,600	
東光高岳	600	1,428.00	856,800	
ダイヘン	7,000	583.00	4,081,000	
田淵電機	1,400	887.00	1,241,800	

ヤーマン	200	1,705.00	341,000	
JVCケンウッド	9,100	348.00	3,166,800	
ミマキエンジニアリング	800	627.00	501,600	
第一精工	500	1,621.00	810,500	
日新電機	2,900	790.00	2,291,000	
大崎電気工業	2,000	635.00	1,270,000	
オムロン	13,200	4,285.00	56,562,000	
日東工業	2,000	2,338.00	4,676,000	
I D E C	1,400	1,030.00	1,442,000	
不二電機工業	100	1,478.00	147,800	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	24,000	528.00	12,672,000	
サクサホールディングス	3,000	245.00	735,000	
メルコホールディングス	700	2,233.00	1,563,100	
テクノメディカ	300	2,750.00	825,000	
日本電気	158,000	413.00	65,254,000	
富士通	118,000	603.60	71,224,800	
沖電気工業	43,000	201.00	8,643,000	
岩崎通信機	6,000	84.00	504,000	
電気興業	3,000	528.00	1,584,000	
サンケン電気	6,000	461.00	2,766,000	
ナカヨ	1,000	342.00	342,000	
アイホン	600	1,973.00	1,183,800	
ルネサスエレクトロニクス	6,300	784.00	4,939,200	
セイコーエプソン	16,700	2,117.00	35,353,900	
ワコム	9,700	455.00	4,413,500	
アルバック	2,100	2,204.00	4,628,400	
アクセル	600	1,431.00	858,600	
E I Z O	1,100	2,883.00	3,171,300	
ジャパンディスプレイ	25,200	402.00	10,130,400	
日本信号	3,400	1,245.00	4,233,000	
京三製作所	3,000	337.00	1,011,000	
能美防災	1,600	1,457.00	2,331,200	
ホーチキ	900	1,215.00	1,093,500	
エレコム	900	1,463.00	1,316,700	
日本無線	3,000	425.00	1,275,000	
パナソニック	149,900	1,419.50	212,783,050	

シャープ	104,000	137.00	14,248,000	
アンリツ	7,300	831.00	6,066,300	
富士通ゼネラル	4,000	1,513.00	6,052,000	
日立国際電気	3,000	1,589.00	4,767,000	
ソニー	86,100	3,507.00	301,952,700	
T D K	7,400	7,860.00	58,164,000	
帝国通信工業	3,000	201.00	603,000	
ミツミ電機	4,400	720.00	3,168,000	
タムラ製作所	5,000	388.00	1,940,000	
アルプス電気	10,100	3,580.00	36,158,000	
池上通信機	4,000	156.00	624,000	
パイオニア	18,500	352.00	6,512,000	
日本電波工業	1,100	859.00	944,900	
鈴木	300	610.00	183,000	
日本トリム	300	4,400.00	1,320,000	
ローランド ディー . ジー .	500	2,766.00	1,383,000	
フォスター電機	1,400	2,860.00	4,004,000	
クラリオン	6,000	467.00	2,802,000	
S M K	4,000	649.00	2,596,000	
ヨコオ	1,000	659.00	659,000	
東光	3,000	305.00	915,000	
ティアック	7,000	45.00	315,000	
ホシデン	3,700	763.00	2,823,100	
ヒロセ電機	2,100	15,320.00	32,172,000	
日本航空電子工業	3,000	2,318.00	6,954,000	
T O A	1,300	1,181.00	1,535,300	
日立マクセル	2,400	2,088.00	5,011,200	
古野電気	1,500	825.00	1,237,500	
ユニデンホールディングス	3,000	194.00	582,000	
アルパイン	2,900	1,594.00	4,622,600	
スミダコーポレーション	1,000	899.00	899,000	
アイコム	700	2,464.00	1,724,800	
リオン	500	1,816.00	908,000	
船井電機	1,200	1,299.00	1,558,800	
横河電機	12,300	1,302.00	16,014,600	
新電元工業	5,000	468.00	2,340,000	

アズビル	4,000	3,035.00	12,140,000	
東亜ディーケーケー	500	491.00	245,500	
日本光電工業	5,100	2,249.00	11,469,900	
チノー	400	1,096.00	438,400	
共和電業	1,500	436.00	654,000	
日本電子材料	500	702.00	351,000	
堀場製作所	2,300	4,720.00	10,856,000	
アドバンテスト	8,400	992.00	8,332,800	
小野測器	600	933.00	559,800	
エスベック	1,400	1,122.00	1,570,800	
パナソニック デバイス S U N X	1,100	681.00	749,100	
キーエンス	2,800	59,850.00	167,580,000	
日置電機	600	2,227.00	1,336,200	
シスメックス	9,500	6,670.00	63,365,000	
メガチップス	1,300	1,273.00	1,654,900	
O B A R A G R O U P	800	5,160.00	4,128,000	
澤藤電機	1,000	230.00	230,000	
コーセル	1,700	1,166.00	1,982,200	
新日本無線	1,000	543.00	543,000	
オブテックス	900	2,268.00	2,041,200	
千代田インテグレ	600	2,985.00	1,791,000	
レーザーテック	1,200	1,321.00	1,585,200	
スタンレー電気	8,800	2,744.00	24,147,200	
岩崎電気	4,000	281.00	1,124,000	
ウシオ電機	7,400	1,689.00	12,498,600	
岡谷電機産業	600	397.00	238,200	
ヘリオス テクノ ホールディング	1,200	442.00	530,400	
日本セラミック	700	1,710.00	1,197,000	
遠藤照明	600	1,246.00	747,600	
日本デジタル研究所	1,000	1,679.00	1,679,000	
古河電池	1,000	848.00	848,000	
双信電機	600	346.00	207,600	
山一電機	1,400	1,078.00	1,509,200	
図研	900	1,137.00	1,023,300	
日本電子	5,000	700.00	3,500,000	
カシオ計算機	12,300	2,257.00	27,761,100	



ファナック	12,800	20,400.00	261,120,000	
日本シイエムケイ	3,200	229.00	732,800	
エンプラス	600	4,650.00	2,790,000	
大真空	2,000	252.00	504,000	
ローム	6,000	6,300.00	37,800,000	
浜松ホトニクス	9,500	3,090.00	29,355,000	
三井ハイテック	1,600	738.00	1,180,800	
新光電気工業	4,600	837.00	3,850,200	
京セラ	20,100	5,991.00	120,419,100	
太陽誘電	6,400	1,726.00	11,046,400	
村田製作所	12,800	17,170.00	219,776,000	
ユーシン	1,600	770.00	1,232,000	
双葉電子工業	2,100	1,594.00	3,347,400	
北陸電気工業	5,000	171.00	855,000	
ニチコン	3,900	981.00	3,825,900	
日本ケミコン	10,000	291.00	2,910,000	
K O A	1,700	1,058.00	1,798,600	
市光工業	3,000	216.00	648,000	
小糸製作所	7,300	4,610.00	33,653,000	
ミツバ	2,200	1,968.00	4,329,600	
スター精密	2,300	1,673.00	3,847,900	
S C R E E Nホールディングス	12,000	690.00	8,280,000	
キヤノン電子	1,100	2,159.00	2,374,900	
キヤノン	65,900	3,812.00	251,210,800	代用有価証券 10,000株
リコー	36,800	1,359.00	50,011,200	
M U T O Hホールディングス	1,000	308.00	308,000	
東京エレクトロン	10,300	6,809.00	70,132,700	
トヨタ紡織	4,300	2,534.00	10,896,200	
鬼怒川ゴム工業	3,000	707.00	2,121,000	
ユニプレス	2,400	2,790.00	6,696,000	
豊田自動織機	11,200	6,320.00	70,784,000	
モリタホールディングス	2,100	1,238.00	2,599,800	
三櫻工業	1,600	789.00	1,262,400	
デンソー	30,200	5,858.00	176,911,600	
東海理化電機製作所	3,200	2,678.00	8,569,600	

三井造船	47,000	205.00	9,635,000	
川崎重工業	89,000	500.00	44,500,000	
名村造船所	3,400	1,046.00	3,556,400	
サノヤスホールディングス	1,600	275.00	440,000	
日本車輛製造	4,000	331.00	1,324,000	
ニチュ三菱フォークリフト	1,400	526.00	736,400	
近畿車輛	2,000	380.00	760,000	
日産自動車	171,800	1,244.50	213,805,100	
いすゞ自動車	38,700	1,422.00	55,031,400	
トヨタ自動車	168,900	7,560.00	1,276,884,000	代用有価証券 35,000株
日野自動車	17,500	1,443.00	25,252,500	
三菱自動車工業	44,900	1,009.00	45,304,100	
エフテック	700	1,123.00	786,100	
レシップホールディングス	400	861.00	344,400	
G M B	200	1,123.00	224,600	
ファルテック	200	1,462.00	292,400	
武蔵精密工業	1,300	2,491.00	3,238,300	
日産車体	5,400	1,544.00	8,337,600	
新明和工業	5,000	1,335.00	6,675,000	
極東開発工業	2,300	1,312.00	3,017,600	
日信工業	2,300	1,927.00	4,432,100	
トピー工業	10,000	278.00	2,780,000	
ティラド	5,000	203.00	1,015,000	
曙ブレーキ工業	5,300	365.00	1,934,500	
タチエス	1,900	1,635.00	3,106,500	
N O K	5,900	2,938.00	17,334,200	
フタバ産業	3,800	496.00	1,884,800	
K Y B	14,000	355.00	4,970,000	
シロキ工業	3,000	349.00	1,047,000	
大同メタル工業	1,700	1,145.00	1,946,500	
プレス工業	6,100	503.00	3,068,300	
ミクニ	1,200	487.00	584,400	
カルソニックカンセイ	9,000	953.00	8,577,000	
太平洋工業	2,500	1,385.00	3,462,500	
ケーヒン	2,800	2,039.00	5,709,200	

河西工業	1,500	1,483.00	2,224,500
アイシン精機	11,200	4,765.00	53,368,000
富士機工	1,400	528.00	739,200
マツダ	36,500	2,363.00	86,249,500
ダイハツ工業	14,600	1,480.00	21,608,000
今仙電機製作所	1,100	1,122.00	1,234,200
本田技研工業	110,200	4,087.00	450,387,400
スズキ	25,600	3,970.00	101,632,000
富士重工業	41,700	4,639.00	193,446,300
安永	400	542.00	216,800
ヤマハ発動機	17,300	2,800.00	48,440,000
ショーワ	2,900	1,069.00	3,100,100
T B K	1,600	487.00	779,200
エクセディ	1,700	2,901.00	4,931,700
豊田合成	3,900	2,729.00	10,643,100
愛三工業	1,900	1,257.00	2,388,300
盟和産業	100	1,150.00	115,000
ヨロズ	1,200	2,593.00	3,111,600
エフ・シー・シー	1,800	2,127.00	3,828,600
シマノ	4,900	19,190.00	94,031,000
タカタ	2,200	1,399.00	3,077,800
テイ・エス テック	2,600	3,395.00	8,827,000
ジャムコ	500	5,120.00	2,560,000
テルモ	18,800	3,460.00	65,048,000
クリエートメディック	400	944.00	377,600
日機装	4,000	958.00	3,832,000
島津製作所	15,000	1,852.00	27,780,000
J M S	2,000	287.00	574,000
モリテックス	300	220.00	66,000
長野計器	800	799.00	639,200
ブイ・テクノロジー	200	4,085.00	817,000
東京計器	4,000	233.00	932,000
愛知時計電機	2,000	330.00	660,000
オーバル	1,300	271.00	352,300
東京精密	2,200	2,701.00	5,942,200
マニー	1,100	2,160.00	2,376,000

ニコン	22,900	1,600.00	36,640,000
トプコン	3,700	1,719.00	6,360,300
オリンパス	18,300	3,925.00	71,827,500
理研計器	1,100	1,533.00	1,686,300
タムロン	1,000	2,438.00	2,438,000
H O Y A	28,500	4,615.00	131,527,500
ノーリツ鋼機	1,100	598.00	657,800
エー・アンド・デイ	1,100	441.00	485,100
シチズンホールディングス	15,100	905.00	13,665,500
リズム時計工業	5,000	171.00	855,000
大研医器	900	1,028.00	925,200
メニコン	600	2,835.00	1,701,000
松風	600	1,598.00	958,800
セイコーホールディングス	9,000	764.00	6,876,000
ニプロ	7,800	1,239.00	9,664,200
パラマウントベッドホールディングス	1,300	3,625.00	4,712,500
トランザクション	200	516.00	103,200
S H O - B I	500	405.00	202,500
ニホンフラッシュ	400	1,287.00	514,800
前田工織	1,400	950.00	1,330,000
永大産業	2,000	432.00	864,000
アートネイチャー	900	1,155.00	1,039,500
ダンロップスポーツ	800	1,229.00	983,200
バンダイナムコホールディングス	13,500	2,989.00	40,351,500
アイフィスジャパン	200	511.00	102,200
共立印刷	2,300	316.00	726,800
フランスベッドホールディングス	1,700	950.00	1,615,000
パイロットコーポレーション	2,100	5,150.00	10,815,000
萩原工業	300	2,127.00	638,100
トッパン・フォームズ	2,200	1,513.00	3,328,600
フジシールインターナショナル	1,500	4,185.00	6,277,500
タカラトミー	4,500	600.00	2,700,000
廣濟堂	1,200	396.00	475,200
A s - m e エステール	400	742.00	296,800
アーク	4,000	120.00	480,000
タカノ	600	687.00	412,200

プロネクサス	1,200	864.00	1,036,800	
ホクシン	1,200	130.00	156,000	
ウッドワン	2,000	251.00	502,000	
大建工業	5,000	381.00	1,905,000	
凸版印刷	35,000	1,066.00	37,310,000	
大日本印刷	36,000	1,250.00	45,000,000	
図書印刷	2,000	512.00	1,024,000	
共同印刷	4,000	345.00	1,380,000	
日本写真印刷	2,100	2,608.00	5,476,800	
光村印刷	1,000	248.00	248,000	
宝印刷	700	1,340.00	938,000	
アシックス	11,400	3,335.00	38,019,000	
ツツミ	600	2,562.00	1,537,200	
小松ウオール工業	400	2,035.00	814,000	
ヤマハ	9,000	2,952.00	26,568,000	
河合楽器製作所	400	2,183.00	873,200	
クリナップ	1,100	805.00	885,500	
ピジョン	6,900	3,180.00	21,942,000	
兼松日産農林	2,000	175.00	350,000	
キングジム	1,000	839.00	839,000	
リンテック	2,900	2,857.00	8,285,300	
T A S A K I	300	2,085.00	625,500	
イトーキ	2,600	867.00	2,254,200	
任天堂	7,500	24,010.00	180,075,000	
三菱鉛筆	900	5,550.00	4,995,000	
タカラスタANDARD	5,000	936.00	4,680,000	
コクヨ	6,400	1,251.00	8,006,400	
ナカバヤシ	3,000	308.00	924,000	
岡村製作所	4,700	1,116.00	5,245,200	
美津濃	7,000	592.00	4,144,000	
アデランス	1,400	869.00	1,216,600	
東京電力	103,900	838.00	87,068,200	
中部電力	37,500	1,878.50	70,443,750	
関西電力	50,000	1,526.50	76,325,000	
中国電力	16,900	1,814.00	30,656,600	
北陸電力	12,000	1,781.00	21,372,000	

東北電力	30,600	1,809.00	55,355,400	
四国電力	11,000	2,046.00	22,506,000	
九州電力	27,100	1,472.00	39,891,200	
北海道電力	11,500	1,289.00	14,823,500	
沖縄電力	1,200	3,010.00	3,612,000	
電源開発	8,900	3,895.00	34,665,500	
東京瓦斯	146,000	617.30	90,125,800	
大阪瓦斯	127,000	488.30	62,014,100	
東邦瓦斯	31,000	762.00	23,622,000	
北海道瓦斯	3,000	283.00	849,000	
広島ガス	2,000	430.00	860,000	
西部瓦斯	14,000	274.00	3,836,000	
静岡ガス	3,500	821.00	2,873,500	
メタウォーター	800	2,875.00	2,300,000	
SBSホールディングス	1,200	1,081.00	1,297,200	
東武鉄道	66,000	582.00	38,412,000	
相鉄ホールディングス	21,000	696.00	14,616,000	
東京急行電鉄	66,000	975.00	64,350,000	
京浜急行電鉄	34,000	1,009.00	34,306,000	
小田急電鉄	39,000	1,184.00	46,176,000	
京王電鉄	34,000	968.00	32,912,000	
京成電鉄	18,000	1,450.00	26,100,000	
富士急行	3,000	1,259.00	3,777,000	
東日本旅客鉄道	22,400	11,450.00	256,480,000	
西日本旅客鉄道	11,800	8,331.00	98,305,800	
東海旅客鉄道	11,000	21,560.00	237,160,000	
西武ホールディングス	9,800	2,368.00	23,206,400	
鴻池運輸	1,500	1,458.00	2,187,000	
西日本鉄道	16,000	636.00	10,176,000	
ハマキョウレックス	800	2,390.00	1,912,000	
サカイ引越センター	200	6,250.00	1,250,000	
近鉄グループホールディングス	123,000	465.00	57,195,000	
阪急阪神ホールディングス	82,000	781.00	64,042,000	
南海電気鉄道	28,000	641.00	17,948,000	
京阪電気鉄道	27,000	846.00	22,842,000	
神戸電鉄	3,000	360.00	1,080,000	

名古屋鉄道	45,000	499.00	22,455,000
山陽電気鉄道	4,000	473.00	1,892,000
日本通運	47,000	631.00	29,657,000
ヤマトホールディングス	21,000	2,594.00	54,474,000
山九	15,000	658.00	9,870,000
丸運	700	263.00	184,100
丸全昭和運輸	4,000	438.00	1,752,000
センコー	5,000	854.00	4,270,000
トナミホールディングス	3,000	398.00	1,194,000
ニッコンホールディングス	4,000	2,342.00	9,368,000
日本石油輸送	2,000	238.00	476,000
福山通運	7,000	687.00	4,809,000
セイノーホールディングス	9,500	1,385.00	13,157,500
神奈川中央交通	2,000	673.00	1,346,000
日立物流	2,600	2,141.00	5,566,600
丸和運輸機関	200	2,626.00	525,200
C & F ロジホールディングス	500	788.00	394,000
日本郵船	104,000	326.00	33,904,000
商船三井	64,000	336.00	21,504,000
川崎汽船	54,000	283.00	15,282,000
N S ユナイテッド海運	5,000	256.00	1,280,000
明治海運	1,100	577.00	634,700
飯野海運	6,400	578.00	3,699,200
共栄タンカー	1,000	194.00	194,000
乾汽船	800	959.00	767,200
日本航空	23,400	4,490.00	105,066,000
A N A ホールディングス	241,000	362.10	87,266,100
パスコ	1,000	337.00	337,000
トランコム	300	6,650.00	1,995,000
日新	5,000	375.00	1,875,000
三菱倉庫	8,000	1,777.00	14,216,000
三井倉庫ホールディングス	7,000	399.00	2,793,000
住友倉庫	9,000	659.00	5,931,000
濹澤倉庫	3,000	318.00	954,000
東陽倉庫	2,000	259.00	518,000
日本トランスシティ	3,000	450.00	1,350,000

ケイヒン	3,000	193.00	579,000	
中央倉庫	700	968.00	677,600	
安田倉庫	1,000	951.00	951,000	
東洋埠頭	4,000	195.00	780,000	
宇徳	1,000	502.00	502,000	
上組	15,000	1,052.00	15,780,000	
サンリツ	400	532.00	212,800	
キムラユニティー	300	1,277.00	383,100	
キューソー流通システム	300	2,589.00	776,700	
郵船ロジスティクス	1,100	1,396.00	1,535,600	
近鉄エクスプレス	2,200	2,314.00	5,090,800	
東海運	700	285.00	199,500	
エーアイティー	600	1,134.00	680,400	
内外トランスライン	300	1,151.00	345,300	
N E C ネットズエスアイ	1,500	2,456.00	3,684,000	
システナ	1,200	1,163.00	1,395,600	
デジタルアーツ	600	2,121.00	1,272,600	
新日鉄住金ソリューションズ	1,000	5,090.00	5,090,000	
キューブシステム	500	589.00	294,500	
コア	500	863.00	431,500	
ソフトクリエイトホールディングス	400	939.00	375,600	
I T ホールディングス	4,000	2,901.00	11,604,000	
ネオス	400	564.00	225,600	
電算システム	400	2,046.00	818,400	
グリー	7,400	602.00	4,454,800	
コーエーテクモホールディングス	3,240	1,800.00	5,832,000	
三菱総合研究所	500	2,986.00	1,493,000	
ボルテージ	200	1,877.00	375,400	
電算	100	2,240.00	224,000	
A G S	200	962.00	192,400	
ファインデックス	800	922.00	737,600	
ヒト・コミュニケーションズ	200	2,522.00	504,400	
ブレインパッド	200	515.00	103,000	
K L a b	1,900	1,315.00	2,498,500	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	800	1,054.00	843,200	



イーブックイニシアティブジャパン	300	774.00	232,200
ネクソン	11,500	1,713.00	19,699,500
アイスタイル	1,000	1,036.00	1,036,000
エムアップ	300	653.00	195,900
エイチーム	400	1,962.00	784,800
コロプラ	3,300	2,044.00	6,745,200
モバイルクリエイト	700	476.00	333,200
オルトプラス	500	524.00	262,000
ブロードリーフ	1,200	1,377.00	1,652,400
ハーツユナイテッドグループ	400	1,861.00	744,400
ブイキューブ	300	2,496.00	748,800
ベリサーブ	100	1,400.00	140,000
ティーガイア	1,200	1,806.00	2,167,200
日本アジアグループ	1,000	475.00	475,000
豆蔵ホールディングス	1,000	511.00	511,000
テクマトリックス	500	1,185.00	592,500
GMOペイメントゲートウェイ	1,100	4,805.00	5,285,500
ザッパラス	700	509.00	356,300
インターネットイニシアティブ	2,000	2,396.00	4,792,000
GMOクラウド	300	787.00	236,100
ビットアイル	1,400	915.00	1,281,000
SRAホールディングス	600	2,236.00	1,341,600
システムインテグレータ	200	696.00	139,200
朝日ネット	1,200	534.00	640,800
コムチュア	200	1,990.00	398,000
gumi	1,200	1,688.00	2,025,600
パイプドHD	200	1,519.00	303,800
フェイス	400	1,396.00	558,400
ハイマックス	200	1,187.00	237,400
野村総合研究所	7,590	4,940.00	37,494,600
サイバネットシステム	1,000	403.00	403,000
CEホールディングス	200	813.00	162,600
インテージホールディングス	700	1,749.00	1,224,300
東邦システムサイエンス	400	699.00	279,600
ソースネクスト	600	519.00	311,400
ティー・ワイ・オー	1,800	203.00	365,400

クレスコ	300	1,928.00	578,400
フジ・メディア・ホールディングス	12,600	1,502.00	18,925,200
オービック	4,200	6,230.00	26,166,000
ジャストシステム	2,200	965.00	2,123,000
TDCソフトウェアエンジニアリング	300	1,272.00	381,600
ヤフー	86,600	502.00	43,473,200
トレンドマイクロ	5,900	4,635.00	27,346,500
インフォメーション・ディベロプメント	200	941.00	188,200
日本オラクル	1,900	5,370.00	10,203,000
アルファシステムズ	400	2,083.00	833,200
フューチャーアーキテクト	1,500	699.00	1,048,500
CAC Holdings	900	1,016.00	914,400
ソフトバンク・テクノロジー	300	1,236.00	370,800
トーセ	300	840.00	252,000
オービックビジネスコンサルタント	800	6,990.00	5,592,000
伊藤忠テクノソリューションズ	2,700	2,924.00	7,894,800
アイティフォー	1,500	514.00	771,000
東計電算	200	2,152.00	430,400
エクスネット	100	1,487.00	148,700
大塚商会	3,300	6,160.00	20,328,000
サイボウズ	1,700	312.00	530,400
ソフトブレーン	1,900	184.00	349,600
電通国際情報サービス	700	1,758.00	1,230,600
EMシステムズ	200	2,178.00	435,600
ウェザーニューズ	400	3,915.00	1,566,000
C I J	1,100	516.00	567,600
東洋ビジネスエンジニアリング	100	1,368.00	136,800
日本エンタープライズ	1,100	272.00	299,200
WOWOW	600	3,225.00	1,935,000
フュージョンパートナー	700	531.00	371,700
日本コロムビア	500	476.00	238,000
イマジカ・ロボットホールディングス	900	495.00	445,500
ネットワンシステムズ	4,900	723.00	3,542,700
アルゴグラフィックス	500	1,803.00	901,500
マーベラス	2,000	1,022.00	2,044,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	2,400	1,607.00	3,856,800

日本ユニシス	3,300	1,301.00	4,293,300
兼松エレクトロニクス	700	1,810.00	1,267,000
東京放送ホールディングス	7,200	1,778.00	12,801,600
日本テレビホールディングス	11,000	2,095.00	23,045,000
朝日放送	1,200	799.00	958,800
テレビ朝日ホールディングス	3,300	2,000.00	6,600,000
スカパーJ S A Tホールディングス	9,200	663.00	6,099,600
テレビ東京ホールディングス	1,000	2,142.00	2,142,000
日本BS放送	200	959.00	191,800
コネクシオ	900	1,250.00	1,125,000
日本通信	5,700	314.00	1,789,800
クロップス	200	514.00	102,800
日本電信電話	94,600	4,575.00	432,795,000
K D D I	122,800	2,929.00	359,681,200
光通信	1,100	9,060.00	9,966,000
N T T ドコモ	93,200	2,337.50	217,855,000
エムティーアイ	1,600	762.00	1,219,200
G M O インターネット	4,500	1,709.00	7,690,500
カドカワ	3,000	1,611.00	4,833,000
学研ホールディングス	4,000	235.00	940,000
ゼンリン	1,600	1,736.00	2,777,600
昭文社	700	743.00	520,100
インプレスホールディングス	900	175.00	157,500
アイネット	600	1,214.00	728,400
松竹	8,000	1,077.00	8,616,000
東宝	8,600	3,075.00	26,445,000
東映	4,000	1,022.00	4,088,000
A O I P r o .	600	898.00	538,800
エヌ・ティ・ティ・データ	7,500	6,090.00	45,675,000
ピー・シー・エー	100	1,531.00	153,100
ビジネスブレイン太田昭和	200	1,020.00	204,000
D T S	1,200	2,780.00	3,336,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	4,700	3,240.00	15,228,000
シーイーシー	800	1,092.00	873,600
カプコン	3,100	2,411.00	7,474,100
アイ・エス・ピー	100	819.00	81,900

ジャステック	800	1,115.00	892,000	
S C S K	2,900	4,520.00	13,108,000	
日本システムウエア	500	880.00	440,000	
アイネス	1,600	1,147.00	1,835,200	
T K C	1,100	2,855.00	3,140,500	
富士ソフト	1,800	2,292.00	4,125,600	
N S D	2,800	1,668.00	4,670,400	
コナミホールディングス	4,900	2,641.00	12,940,900	
福井コンピュータホールディングス	300	928.00	278,400	
J B C Cホールディングス	1,000	813.00	813,000	
ミロク情報サービス	800	856.00	684,800	
ソフトバンクグループ	63,900	6,651.00	424,998,900	
ハウスイ	1,000	132.00	132,000	
高千穂交易	400	976.00	390,400	
伊藤忠食品	300	4,175.00	1,252,500	
エレマテック	500	2,746.00	1,373,000	
J A L U X	400	2,254.00	901,600	
あらた	500	2,630.00	1,315,000	
トーメンデバイス	200	1,987.00	397,400	
東京エレクトロン デバイス	300	1,618.00	485,400	
フィールズ	800	1,814.00	1,451,200	
双日	81,000	265.00	21,465,000	
アルフレッサ ホールディングス	14,300	2,243.00	32,074,900	
横浜冷凍	3,000	976.00	2,928,000	
神栄	2,000	144.00	288,000	
山下医科器械	100	1,721.00	172,100	
ラサ商事	600	593.00	355,800	
アルコニックス	700	1,752.00	1,226,400	
神戸物産	400	9,670.00	3,868,000	
あい ホールディングス	1,900	2,931.00	5,568,900	
ディーブイエックス	400	1,190.00	476,000	
ダイワボウホールディングス	11,000	237.00	2,607,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	2,100	1,637.00	3,437,700	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,300	860.00	1,978,000	
八洲電機	900	602.00	541,800	
U K Cホールディングス	800	2,495.00	1,996,000	

OCHIホールディングス	300	1,014.00	304,200	
TOKAIホールディングス	5,900	500.00	2,950,000	
三洋貿易	700	1,605.00	1,123,500	
ウイン・パートナーズ	400	1,717.00	686,800	
ミタチ産業	300	724.00	217,200	
シップヘルスケアホールディングス	2,200	2,899.00	6,377,800	
明治電機工業	400	1,189.00	475,600	
デリカフーズ	200	999.00	199,800	
スターティア	300	676.00	202,800	
富士興産	500	495.00	247,500	
協栄産業	2,000	184.00	368,000	
小野建	1,100	1,071.00	1,178,100	
佐島電機	1,000	815.00	815,000	
エコートレーディング	300	647.00	194,100	
伯東	800	1,474.00	1,179,200	
コンドーテック	900	773.00	695,700	
中山福	700	848.00	593,600	
ナガイレーベン	1,700	2,057.00	3,496,900	
三菱食品	1,300	3,045.00	3,958,500	
松田産業	900	1,465.00	1,318,500	
メディバルホールディングス	12,100	2,057.00	24,889,700	
アドヴァン	1,200	1,069.00	1,282,800	
S P K	300	2,248.00	674,400	
萩原電気	300	1,840.00	552,000	
アズワン	900	4,080.00	3,672,000	
スズデン	400	923.00	369,200	
シモジマ	700	1,097.00	767,900	
ドウシシャ	1,600	2,246.00	3,593,600	
小津産業	200	2,165.00	433,000	
高速	700	906.00	634,200	
たけびし	400	1,053.00	421,200	
黒田電気	2,100	2,532.00	5,317,200	
丸文	1,100	882.00	970,200	
ハビネット	700	1,275.00	892,500	
橋本総業	200	1,306.00	261,200	
エクセル	600	1,624.00	974,400	

マルカキカイ	400	1,739.00	695,600
ガリバーインターナショナル	3,700	1,180.00	4,366,000
日本エム・ディ・エム	1,000	628.00	628,000
進和	700	1,751.00	1,225,700
エスケイジャパン	400	388.00	155,200
ダイトエレクトロン	500	907.00	453,500
シークス	800	3,465.00	2,772,000
田中商事	400	702.00	280,800
オーハシテクニカ	700	1,385.00	969,500
白銅	400	1,328.00	531,200
伊藤忠商事	101,100	1,543.50	156,047,850
丸紅	105,700	699.90	73,979,430
高島	2,000	263.00	526,000
長瀬産業	6,800	1,542.00	10,485,600
蝶理	800	1,740.00	1,392,000
豊田通商	13,500	2,820.00	38,070,000
三共生興	2,000	460.00	920,000
兼松	24,000	205.00	4,920,000
ツカモトコーポレーション	2,000	134.00	268,000
三井物産	102,400	1,541.50	157,849,600
日本紙パルプ商事	6,000	341.00	2,046,000
日立ハイテクノロジーズ	4,200	3,040.00	12,768,000
カメイ	1,600	1,271.00	2,033,600
東都水産	2,000	193.00	386,000
OUGホールディングス	2,000	248.00	496,000
スターゼン	500	3,180.00	1,590,000
山善	4,700	1,076.00	5,057,200
椿本興業	1,000	337.00	337,000
住友商事	71,300	1,338.00	95,399,400
内田洋行	3,000	406.00	1,218,000
三菱商事	90,700	2,269.00	205,798,300
第一実業	3,000	542.00	1,626,000
キャノンマーケティングジャパン	3,500	1,929.00	6,751,500
西華産業	4,000	276.00	1,104,000
佐藤商事	1,100	740.00	814,000
菱洋エレクトロ	1,400	1,516.00	2,122,400

東京産業	1,200	540.00	648,000	
ユアサ商事	1,100	2,826.00	3,108,600	
神鋼商事	3,000	257.00	771,000	
小林産業	800	236.00	188,800	
阪和興業	12,000	512.00	6,144,000	
カナデン	1,100	943.00	1,037,300	
菱電商事	2,000	809.00	1,618,000	
フルサト工業	700	1,797.00	1,257,900	
岩谷産業	13,000	676.00	8,788,000	
すてきナイスグループ	5,000	178.00	890,000	
昭光通商	5,000	93.00	465,000	
ニチモウ	2,000	250.00	500,000	
極東貿易	1,000	247.00	247,000	
イワキ	2,000	227.00	454,000	
三愛石油	3,000	903.00	2,709,000	
稲畑産業	2,900	1,412.00	4,094,800	
G S Iクレオス	3,000	116.00	348,000	
明和産業	1,000	430.00	430,000	
ワキタ	2,600	1,005.00	2,613,000	
東邦ホールディングス	4,200	2,632.00	11,054,400	
サンゲツ	4,100	1,959.00	8,031,900	
ミツウロコグループホールディングス	2,000	584.00	1,168,000	
シナネンホールディングス	2,000	453.00	906,000	
伊藤忠エネクス	2,700	966.00	2,608,200	
サンリオ	3,400	3,160.00	10,744,000	
サンワテクノス	800	1,138.00	910,400	
リョーサン	2,000	3,030.00	6,060,000	
新光商事	1,400	1,337.00	1,871,800	
トーヨー	500	2,302.00	1,151,000	
三信電気	1,700	1,323.00	2,249,100	
東陽テクニカ	1,800	975.00	1,755,000	
モスフードサービス	1,600	2,601.00	4,161,600	
加賀電子	1,100	1,737.00	1,910,700	
ソーダニッカ	1,200	499.00	598,800	
立花エレテック	900	1,407.00	1,266,300	
フォーバル	500	769.00	384,500	

PALTAC	1,900	2,232.00	4,240,800
三谷産業	1,300	394.00	512,200
太平洋興発	5,000	89.00	445,000
ヤマタネ	6,000	191.00	1,146,000
丸紅建材リース	1,000	231.00	231,000
日鉄住金物産	8,000	419.00	3,352,000
トラスコ中山	1,400	4,260.00	5,964,000
オートバックスセブン	4,300	2,054.00	8,832,200
加藤産業	1,900	2,981.00	5,663,900
イノテック	1,100	472.00	519,200
イエローハット	1,100	2,710.00	2,981,000
J Kホールディングス	1,200	522.00	626,400
日伝	500	2,947.00	1,473,500
北沢産業	1,100	208.00	228,800
杉本商事	700	1,301.00	910,700
因幡電機産業	1,800	3,910.00	7,038,000
バイテックホールディングス	400	1,488.00	595,200
ミスミグループ本社	13,600	1,579.00	21,474,400
アルテック	1,200	188.00	225,600
タキヒヨー	2,000	459.00	918,000
蔵王産業	200	1,406.00	281,200
スズケン	5,500	4,400.00	24,200,000
ジェコス	800	1,157.00	925,600
ルネサスイーストン	600	472.00	283,200
ローソン	4,600	8,900.00	40,940,000
サンエー	900	4,595.00	4,135,500
ダイユーエイト	300	811.00	243,300
カワチ薬品	900	2,069.00	1,862,100
エービーシー・マート	1,800	6,880.00	12,384,000
ハードオフコーポレーション	600	1,553.00	931,800
アスクル	1,300	4,590.00	5,967,000
ゲオホールディングス	2,300	1,754.00	4,034,200
アダストリア	1,000	6,820.00	6,820,000
シー・ヴィ・エス・バイエリア	2,000	109.00	218,000
くらコーポレーション	700	3,590.00	2,513,000
キャンドウ	700	1,586.00	1,110,200



パル	700	2,731.00	1,911,700
エディオン	5,600	878.00	4,916,800
サーラコーポレーション	1,100	606.00	666,600
ワッツ	500	900.00	450,000
あみやき亭	200	4,365.00	873,000
ひらまつ	1,700	648.00	1,101,600
ゲンキー	200	4,220.00	844,000
サッポロドラッグストア	100	2,336.00	233,600
大黒天物産	300	4,085.00	1,225,500
ハニーズ	1,100	1,021.00	1,123,100
ファーマライズホールディングス	300	615.00	184,500
アルペン	1,100	1,975.00	2,172,500
クオール	1,200	1,607.00	1,928,400
ジェイアイエヌ	800	4,400.00	3,520,000
ビックカメラ	6,300	1,025.00	6,457,500
D C Mホールディングス	6,000	806.00	4,836,000
MonotaRO	4,300	3,260.00	14,018,000
東京一番フーズ	200	662.00	132,400
ダイヤモンドダイニング	200	1,131.00	226,200
きちり	400	709.00	283,600
アークランドサービス	200	4,850.00	970,000
J . フロント リテイリング	15,300	1,958.00	29,957,400
ドトール・日レスホールディングス	2,100	1,738.00	3,649,800
マツモトキヨシホールディングス	2,700	5,280.00	14,256,000
ブロンコビリー	500	2,429.00	1,214,500
スタートトゥデイ	3,800	4,210.00	15,998,000
トレジャー・ファクトリー	300	1,190.00	357,000
物語コーポレーション	300	5,150.00	1,545,000
ココカラファイン	1,300	4,830.00	6,279,000
三越伊勢丹ホールディングス	24,000	1,928.00	46,272,000
ウエルシアホールディングス	1,200	5,820.00	6,984,000
クリエイトSDホールディングス	600	7,090.00	4,254,000
丸善CHIホールディングス	1,500	354.00	531,000
ミサワ	100	730.00	73,000
エー・ピーカンパニー	200	1,488.00	297,600
チムニー	300	2,977.00	893,100

ネクステージ	200	819.00	163,800
ジョイフル本田	1,800	2,367.00	4,260,600
キリン堂ホールディングス	400	1,406.00	562,400
すかいらーく	3,700	1,512.00	5,594,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,000	1,069.00	4,276,000
ブックオフコーポレーション	700	932.00	652,400
あさひ	800	1,232.00	985,600
日本調剤	300	4,595.00	1,378,500
コスモス薬品	600	15,150.00	9,090,000
トーエル	700	651.00	455,700
一六堂	300	402.00	120,600
セブン&アイ・ホールディングス	50,600	5,375.00	271,975,000
薬王堂	200	3,090.00	618,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	800	3,195.00	2,556,000
ツルハホールディングス	2,600	9,440.00	24,544,000
サンマルクホールディングス	900	3,475.00	3,127,500
フェリシモ	300	1,115.00	334,500
トリドール	1,300	1,445.00	1,878,500
クスリのアオキ	1,000	5,790.00	5,790,000
メディカルシステムネットワーク	1,300	657.00	854,100
総合メディカル	600	4,270.00	2,562,000
はるやま商事	500	736.00	368,000
カッパ・クリエイト	1,700	1,194.00	2,029,800
ライトオン	900	1,119.00	1,007,100
ジーンズメイト	500	251.00	125,500
良品計画	1,500	23,270.00	34,905,000
三城ホールディングス	1,500	462.00	693,000
アルピス	300	2,290.00	687,000
コナカ	1,400	625.00	875,000
ハウス オブ ローゼ	200	1,436.00	287,200
G - 7ホールディングス	300	1,804.00	541,200
イオン北海道	900	534.00	480,600
コジマ	1,900	283.00	537,700
ヒマラヤ	400	1,095.00	438,000
コーナン商事	1,800	1,731.00	3,115,800

エコス	500	1,534.00	767,000
マルシェ	400	852.00	340,800
ドンキホーテホールディングス	7,800	4,500.00	35,100,000
西松屋チェーン	2,400	1,059.00	2,541,600
ゼンショーホールディングス	6,200	1,127.00	6,987,400
幸楽苑ホールディングス	800	1,524.00	1,219,200
ハークスレイ	400	1,341.00	536,400
サイゼリヤ	2,000	2,742.00	5,484,000
V Tホールディングス	3,800	742.00	2,819,600
魚力	400	1,699.00	679,600
ポブラ	400	533.00	213,200
ユナイテッドアローズ	1,600	5,160.00	8,256,000
ハイデイ日高	900	3,030.00	2,727,000
京都きもの友禅	700	986.00	690,200
コロワイド	4,000	1,662.00	6,648,000
壺番屋	500	5,380.00	2,690,000
トップカルチャー	600	509.00	305,400
P L A N T	300	1,292.00	387,600
スギホールディングス	2,200	5,900.00	12,980,000
スクロール	1,600	505.00	808,000
ヨンドシーホールディングス	900	2,546.00	2,291,400
ファミリーマート	4,100	4,945.00	20,274,500
木曽路	1,500	2,007.00	3,010,500
サトレストランシステムズ	1,400	856.00	1,198,400
千趣会	2,400	807.00	1,936,800
タカキュー	900	194.00	174,600
ケーヨー	2,300	499.00	1,147,700
上新電機	3,000	925.00	2,775,000
日本瓦斯	1,900	3,215.00	6,108,500
ベスト電器	4,200	138.00	579,600
ロイヤルホールディングス	2,000	2,104.00	4,208,000
東天紅	1,000	168.00	168,000
いなげや	1,300	1,211.00	1,574,300
島忠	3,100	2,708.00	8,394,800
チヨダ	1,400	3,695.00	5,173,000
ライフコーポレーション	800	3,080.00	2,464,000

リンガーハット	1,200	2,487.00	2,984,400	
さが美	1,000	136.00	136,000	
MrMax	1,300	319.00	414,700	
テンアライド	1,100	390.00	429,000	
AOKIホールディングス	2,800	1,445.00	4,046,000	
オークワ	2,000	1,039.00	2,078,000	
コメリ	2,100	2,630.00	5,523,000	
青山商事	2,700	4,295.00	11,596,500	
しまむら	1,400	13,920.00	19,488,000	
はせがわ	500	500.00	250,000	
高島屋	17,000	1,077.00	18,309,000	
松屋	2,400	1,495.00	3,588,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	5,700	2,365.00	13,480,500	
近鉄百貨店	5,000	329.00	1,645,000	
丸栄	2,000	113.00	226,000	
ニッセンホールディングス	1,900	193.00	366,700	
パルコ	1,200	1,047.00	1,256,400	
丸井グループ	12,700	1,530.00	19,431,000	
アクシアル リテイリング	900	4,290.00	3,861,000	
イオン	49,800	1,787.00	88,992,600	
ユニグループ・ホールディングス	11,600	668.00	7,748,800	
イズミ	2,700	4,360.00	11,772,000	
東武ストア	2,000	302.00	604,000	
平和堂	2,500	2,702.00	6,755,000	
フジ	1,300	2,576.00	3,348,800	
ヤオコー	1,400	4,915.00	6,881,000	
ゼビオホールディングス	1,600	2,249.00	3,598,400	
ケーズホールディングス	2,800	4,335.00	12,138,000	
Olympicグループ	800	590.00	472,000	
日産東京販売ホールディングス	2,000	301.00	602,000	
アインファーマシーズ	1,500	5,610.00	8,415,000	
元気寿司	400	2,198.00	879,200	
ヤマダ電機	47,800	560.00	26,768,000	
アークランドサカモト	900	2,619.00	2,357,100	
ニトリホールディングス	5,200	9,430.00	49,036,000	
愛眼	1,200	251.00	301,200	

ケーユーホールディングス	600	837.00	502,200	
吉野家ホールディングス	3,400	1,476.00	5,018,400	
松屋フーズ	600	2,340.00	1,404,000	
サガミチェーン	1,500	1,235.00	1,852,500	
関西スーパーマーケット	900	833.00	749,700	
王将フードサービス	900	3,985.00	3,586,500	
プレナス	1,400	1,866.00	2,612,400	
ミニストップ	900	2,237.00	2,013,300	
アークス	2,100	2,373.00	4,983,300	
パローホールディングス	2,600	2,813.00	7,313,800	
藤久	100	1,752.00	175,200	
ベルク	500	4,545.00	2,272,500	
大庄	600	1,443.00	865,800	
ファーストリテイリング	2,400	44,000.00	105,600,000	
サンドラッグ	2,500	6,370.00	15,925,000	
サックスパー ホールディングス	900	1,950.00	1,755,000	
ヤマザワ	300	1,665.00	499,500	
やまや	200	2,416.00	483,200	
ベルーナ	3,000	698.00	2,094,000	
島根銀行	300	1,424.00	427,200	
じもとホールディングス	8,600	214.00	1,840,400	
足利ホールディングス	7,600	508.00	3,860,800	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	1,500	3,885.00	5,827,500	
九州フィナンシャルグループ	19,290	926.00	17,862,540	
新生銀行	115,000	254.00	29,210,000	
あおぞら銀行	82,000	440.00	36,080,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	969,600	789.80	765,790,080	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	141,400	648.60	91,712,040	
三井住友トラスト・ホールディングス	267,000	478.70	127,812,900	
三井住友フィナンシャルグループ	91,400	4,896.00	447,494,400	代用有価証券 10,000株
第四銀行	15,000	569.00	8,535,000	
北越銀行	13,000	255.00	3,315,000	
西日本シティ銀行	42,000	360.00	15,120,000	
千葉銀行	47,000	901.00	42,347,000	
横浜銀行	81,000	775.90	62,847,900	

常陽銀行	44,000	644.00	28,336,000	
群馬銀行	29,000	783.00	22,707,000	
武蔵野銀行	1,900	4,550.00	8,645,000	
千葉興業銀行	3,000	711.00	2,133,000	
筑波銀行	5,000	434.00	2,170,000	
七十七銀行	20,000	679.00	13,580,000	
青森銀行	10,000	389.00	3,890,000	
秋田銀行	8,000	390.00	3,120,000	
山形銀行	7,000	487.00	3,409,000	
岩手銀行	900	5,560.00	5,004,000	
東邦銀行	11,000	455.00	5,005,000	
東北銀行	7,000	152.00	1,064,000	
みちのく銀行	6,000	209.00	1,254,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	49,000	640.00	31,360,000	
静岡銀行	35,000	1,244.00	43,540,000	
十六銀行	15,000	546.00	8,190,000	
スルガ銀行	12,800	2,404.00	30,771,200	
八十二銀行	22,000	841.00	18,502,000	
山梨中央銀行	7,000	591.00	4,137,000	
大垣共立銀行	15,000	470.00	7,050,000	
福井銀行	11,000	253.00	2,783,000	
北國銀行	14,000	495.00	6,930,000	
清水銀行	400	3,055.00	1,222,000	
滋賀銀行	12,000	617.00	7,404,000	
南都銀行	12,000	392.00	4,704,000	
百五銀行	12,000	623.00	7,476,000	
京都銀行	23,000	1,256.00	28,888,000	
紀陽銀行	4,700	1,895.00	8,906,500	
三重銀行	5,000	266.00	1,330,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	82,000	274.00	22,468,000	
広島銀行	36,000	692.00	24,912,000	
山陰合同銀行	7,300	1,159.00	8,460,700	
中国銀行	8,600	1,777.00	15,282,200	
鳥取銀行	4,000	216.00	864,000	
伊予銀行	12,900	1,336.00	17,234,400	
百十四銀行	13,000	468.00	6,084,000	

四国銀行	9,000	262.00	2,358,000	
阿波銀行	10,000	705.00	7,050,000	
大分銀行	7,000	498.00	3,486,000	
宮崎銀行	8,000	414.00	3,312,000	
佐賀銀行	7,000	280.00	1,960,000	
十八銀行	7,000	368.00	2,576,000	
沖縄銀行	1,000	4,870.00	4,870,000	
琉球銀行	2,500	1,776.00	4,440,000	
セブン銀行	40,800	553.00	22,562,400	
みずほフィナンシャルグループ	1,698,500	248.40	421,907,400	
高知銀行	5,000	150.00	750,000	
山口フィナンシャルグループ	12,000	1,517.00	18,204,000	
長野銀行	4,000	204.00	816,000	
名古屋銀行	11,000	455.00	5,005,000	
北洋銀行	18,200	475.00	8,645,000	
愛知銀行	400	6,700.00	2,680,000	
第三銀行	7,000	182.00	1,274,000	
中京銀行	5,000	242.00	1,210,000	
東日本銀行	5,000	420.00	2,100,000	
大光銀行	4,000	241.00	964,000	
愛媛銀行	7,000	254.00	1,778,000	
トマト銀行	5,000	176.00	880,000	
みなと銀行	11,000	203.00	2,233,000	
京葉銀行	10,000	616.00	6,160,000	
関西アーバン銀行	1,700	1,376.00	2,339,200	
栃木銀行	6,000	691.00	4,146,000	
北日本銀行	400	3,300.00	1,320,000	
東和銀行	17,000	108.00	1,836,000	
福島銀行	15,000	98.00	1,470,000	
大東銀行	8,000	185.00	1,480,000	
トモニホールディングス	9,300	488.00	4,538,400	
フィデアホールディングス	8,400	244.00	2,049,600	
池田泉州ホールディングス	11,400	522.00	5,950,800	
F P G	3,600	941.00	3,387,600	
S B Iホールディングス	14,500	1,505.00	21,822,500	
ジャフコ	1,600	4,680.00	7,488,000	

大和証券グループ本社	113,000	863.70	97,598,100
野村ホールディングス	247,100	788.80	194,912,480
岡三証券グループ	10,000	776.00	7,760,000
丸三証券	3,900	1,188.00	4,633,200
東洋証券	5,000	401.00	2,005,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	13,900	760.00	10,564,000
光世証券	3,000	194.00	582,000
水戸証券	3,800	391.00	1,485,800
いちよし証券	2,600	1,124.00	2,922,400
松井証券	6,100	1,086.00	6,624,600
だいこう証券ビジネス	600	1,183.00	709,800
マネックスグループ	14,300	339.00	4,847,700
カブドットコム証券	10,700	412.00	4,408,400
極東証券	1,600	1,589.00	2,542,400
岩井コスモホールディングス	1,200	1,354.00	1,624,800
藍澤證券	1,700	742.00	1,261,400
マネースクウェアHD	500	1,713.00	856,500
マネーパートナーズグループ	1,300	447.00	581,100
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	26,900	3,970.00	106,793,000
アニコムホールディングス	700	2,838.00	1,986,600
MS & ADインシュアランスグループホールディングス	38,500	3,649.00	140,486,500
ソニーフィナンシャルホールディングス	11,600	2,275.00	26,390,000
第一生命保険	77,400	2,145.00	166,023,000
東京海上ホールディングス	48,900	4,793.00	234,377,700
T & Dホールディングス	44,100	1,636.00	72,147,600
全国保証	3,100	4,065.00	12,601,500
クレディセゾン	9,900	2,501.00	24,759,900
芙蓉総合リース	1,300	5,330.00	6,929,000
興銀リース	2,300	2,570.00	5,911,000
東京センチュリーリース	2,800	4,115.00	11,522,000
日本証券金融	5,400	660.00	3,564,000
アイフル	20,300	482.00	9,784,600
ポケットカード	900	583.00	524,700
リコーリース	1,000	3,645.00	3,645,000
イオンフィナンシャルサービス	7,900	2,945.00	23,265,500



アコム	24,300	676.00	16,426,800
ジャックス	7,000	515.00	3,605,000
オリエントコーポレーション	37,600	232.00	8,723,200
日立キャピタル	2,400	3,280.00	7,872,000
アプラスフィナンシャル	6,000	120.00	720,000
オリックス	85,600	1,842.50	157,718,000
三菱UFJリース	30,700	622.00	19,095,400
日本取引所グループ	35,500	1,944.00	69,012,000
イー・ギャランティ	400	2,464.00	985,600
アサックス	200	1,619.00	323,800
NECキャピタルソリューション	500	1,731.00	865,500
日本駐車場開発	13,300	140.00	1,862,000
ヒューリック	25,200	1,134.00	28,576,800
三栄建築設計	500	1,341.00	670,500
野村不動産ホールディングス	7,300	2,397.00	17,498,100
三重交通グループホールディングス	2,200	441.00	970,200
ディア・ライフ	600	441.00	264,600
プレサンスコーポレーション	400	4,805.00	1,922,000
ユニゾホールディングス	700	5,010.00	3,507,000
日本管理センター	800	1,247.00	997,600
サンセイランディック	300	1,003.00	300,900
エストラスト	200	533.00	106,600
フージャースホールディングス	1,800	480.00	864,000
オープンハウス	1,700	2,196.00	3,733,200
東急不動産ホールディングス	31,700	875.00	27,737,500
飯田グループホールディングス	7,800	2,217.00	17,292,600
エコナックホールディングス	5,000	67.00	335,000
パーク24	6,100	2,455.00	14,975,500
パラカ	400	1,542.00	616,800
三井不動産	64,000	3,339.00	213,696,000
三菱地所	90,000	2,596.50	233,685,000
平和不動産	2,300	1,447.00	3,328,100
東京建物	13,200	1,535.00	20,262,000
ダイビル	3,100	1,030.00	3,193,000
京阪神ビルディング	2,100	690.00	1,449,000
住友不動産	29,000	4,121.00	119,509,000

大京	19,000	203.00	3,857,000	
テ-オーシー	4,200	887.00	3,725,400	
東京楽天地	2,000	491.00	982,000	
レオパレス21	13,200	636.00	8,395,200	
スターツコーポレーション	1,400	1,922.00	2,690,800	
フジ住宅	1,600	690.00	1,104,000	
空港施設	1,500	591.00	886,500	
明和地所	700	536.00	375,200	
住友不動産販売	900	2,880.00	2,592,000	
ゴールドクレスト	1,100	2,255.00	2,480,500	
日本エスリード	500	1,144.00	572,000	
日神不動産	1,600	423.00	676,800	
タカラレーベン	5,400	615.00	3,321,000	
サンヨーハウジング名古屋	700	1,237.00	865,900	
イオンモール	7,800	2,019.00	15,748,200	
ファースト住建	500	1,382.00	691,000	
トーセイ	1,900	764.00	1,451,600	
穴吹興産	1,000	245.00	245,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	7,500	1,225.00	9,187,500	
サンフロンティア不動産	1,300	931.00	1,210,300	
エフ・ジェー・ネクスト	900	551.00	495,900	
ランドビジネス	900	367.00	330,300	
グランディハウス	1,100	387.00	425,700	
日本空港ビルデング	4,200	6,190.00	25,998,000	
日本工営	4,000	492.00	1,968,000	
ネクスト	3,000	919.00	2,757,000	
ジェイエイシーリクルートメント	600	815.00	489,000	
日本M&Aセンター	2,000	5,020.00	10,040,000	
ノバレーゼ	300	889.00	266,700	
アコーディア・ゴルフ	4,800	1,073.00	5,150,400	
タケエイ	1,300	1,159.00	1,506,700	
トラスト・テック	200	2,193.00	438,600	
パソナグループ	1,000	962.00	962,000	
CDS	300	961.00	288,300	
リンクアンドモチベーション	2,600	132.00	343,200	
GCAサヴィアン	1,100	1,470.00	1,617,000	

エス・エム・エス	1,400	2,070.00	2,898,000
テンプホールディングス	7,800	1,739.00	13,564,200
リニカル	300	1,521.00	456,300
クックパッド	2,900	2,412.00	6,994,800
エスクリ	500	914.00	457,000
アイ・ケイ・ケイ	700	563.00	394,100
学情	500	1,126.00	563,000
スタジオアリス	600	2,282.00	1,369,200
シミックホールディングス	600	1,591.00	954,600
N J S	300	1,467.00	440,100
総合警備保障	4,300	5,600.00	24,080,000
カカクコム	8,400	2,228.00	18,715,200
ルネサンス	700	1,247.00	872,900
ディップ	1,400	2,162.00	3,026,800
オプトホールディング	800	638.00	510,400
新日本科学	1,200	617.00	740,400
ツクイ	1,500	1,306.00	1,959,000
総合臨床ホールディングス	700	443.00	310,100
キャリアデザインセンター	400	1,176.00	470,400
エムスリー	11,100	2,425.00	26,917,500
ツカダ・グローバルホールディング	900	770.00	693,000
アウトソーシング	600	2,292.00	1,375,200
ウェルネット	500	2,404.00	1,202,000
ディー・エヌ・エー	6,300	2,425.00	15,277,500
博報堂D Yホールディングス	17,700	1,234.00	21,841,800
ぐるなび	1,500	2,325.00	3,487,500
エスアールジータカミヤ	1,000	586.00	586,000
一休	1,000	2,421.00	2,421,000
ジャパンベストレスキューシステム	1,500	231.00	346,500
ファンコミュニケーションズ	3,000	910.00	2,730,000
ジェイコムホールディングス	300	1,117.00	335,100
W D Bホールディングス	500	1,214.00	607,000
ティア	600	719.00	431,400
バリューコマース	1,200	512.00	614,400
J Pホールディングス	3,200	337.00	1,078,400
E P Sホールディングス	1,200	1,150.00	1,380,000

レッグス	200	726.00	145,200	
プレステージ・インターナショナル	1,000	1,142.00	1,142,000	
アミューズ	400	4,710.00	1,884,000	
ドリームインキュベータ	400	2,198.00	879,200	
クイック	600	856.00	513,600	
T A C	800	248.00	198,400	
ケネディクス	17,300	448.00	7,750,400	
電通	14,300	6,720.00	96,096,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	701.00	350,500	
ぴあ	400	2,241.00	896,400	
イオンファンタジー	400	1,932.00	772,800	
シーティーエス	300	737.00	221,100	
みらかホールディングス	3,300	5,320.00	17,556,000	
アルプス技研	500	2,260.00	1,130,000	
サニックス	1,500	283.00	424,500	
ダイオーズ	300	1,236.00	370,800	
日本空調サービス	600	1,113.00	667,800	
オリエンタルランド	13,800	6,979.00	96,310,200	
ダスキン	3,600	2,066.00	7,437,600	
明光ネットワークジャパン	1,500	1,445.00	2,167,500	
ファルコホールディングス	600	1,497.00	898,200	
秀英予備校	300	673.00	201,900	
田谷	300	711.00	213,300	
ラウンドワン	3,700	552.00	2,042,400	
リゾートトラスト	5,000	3,010.00	15,050,000	
ビー・エム・エル	800	3,570.00	2,856,000	
ワタベウエディング	500	506.00	253,000	
りらいあコミュニケーションズ	2,400	1,138.00	2,731,200	
リソー教育	2,000	278.00	556,000	
早稲田アカデミー	200	835.00	167,000	
ユー・エス・エス	15,500	2,097.00	32,503,500	
東京個別指導学院	600	579.00	347,400	
サイバーエージェント	3,100	4,940.00	15,314,000	
楽天	59,800	1,738.00	103,932,400	
テー・オー・ダブリュー	800	777.00	621,600	
セントラルスポーツ	400	2,279.00	911,600	

フルキャストホールディングス	1,200	782.00	938,400
リゾートソリューション	1,000	278.00	278,000
テクノプロ・ホールディングス	1,800	3,125.00	5,625,000
リブセンス	900	452.00	406,800
ジャパンマテリアル	500	2,103.00	1,051,500
ベクトル	300	1,866.00	559,800
ウチヤマホールディングス	800	467.00	373,600
サクセスホールディングス	100	1,305.00	130,500
キャリアリンク	200	1,686.00	337,200
I B J	200	1,304.00	260,800
アサンテ	400	1,497.00	598,800
N・フィールド	400	1,551.00	620,400
M&Aキャピタルパートナーズ	100	1,604.00	160,400
E R Iホールディングス	400	881.00	352,400
アビスト	200	1,611.00	322,200
ウィルグループ	300	894.00	268,200
日本ビューホテル	200	2,346.00	469,200
リクルートホールディングス	19,300	3,795.00	73,243,500
リロ・ホールディング	400	12,890.00	5,156,000
東祥	300	3,145.00	943,500
エイチ・アイ・エス	2,100	4,035.00	8,473,500
共立メンテナンス	800	8,220.00	6,576,000
イチネンホールディングス	1,300	1,037.00	1,348,100
建設技術研究所	800	1,255.00	1,004,000
スペース	700	1,317.00	921,900
燦ホールディングス	300	1,563.00	468,900
スバル興業	1,000	427.00	427,000
東京テアトル	5,000	135.00	675,000
よみうりランド	3,000	424.00	1,272,000
東京都競馬	9,000	290.00	2,610,000
常磐興産	5,000	152.00	760,000
カナモト	1,800	2,516.00	4,528,800
東京ドーム	9,000	558.00	5,022,000
西尾レントオール	1,000	2,877.00	2,877,000
トランス・コスモス	1,700	3,370.00	5,729,000
乃村工藝社	2,500	1,622.00	4,055,000

藤田観光	5,000	460.00	2,300,000	
KNT - CTホールディングス	6,000	286.00	1,716,000	
日本管財	1,200	1,852.00	2,222,400	
トーカイ	600	3,915.00	2,349,000	
白洋舎	1,000	275.00	275,000	
セコム	12,400	7,948.00	98,555,200	
セントラル警備保障	600	1,585.00	951,000	
丹青社	2,200	852.00	1,874,400	
メイテック	1,700	4,390.00	7,463,000	
アサツー ディ・ケイ	2,200	2,946.00	6,481,200	
応用地質	1,300	1,561.00	2,029,300	
船井総研ホールディングス	1,500	1,714.00	2,571,000	
進学会	600	732.00	439,200	
オオバ	700	510.00	357,000	
ベネッセホールディングス	4,700	3,220.00	15,134,000	
イオンディライト	1,200	3,485.00	4,182,000	
ナック	900	852.00	766,800	
ニチイ学館	2,500	861.00	2,152,500	
ダイセキ	2,100	1,942.00	4,078,200	
ステップ	400	1,016.00	406,400	
合 計	20,047,670		28,010,291,140	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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

## 貸借対照表

（単位：円）

	平成26年10月27日現在	平成27年10月26日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	167,090,090	177,066,966
コール・ローン	1,292,481,877	1,451,209,522
株式	74,933,360,854	75,505,109,512
投資証券	1,794,169,065	1,981,318,708
派生商品評価勘定	20,329,083	134,593,946
未収入金	5,731,444	-
未収配当金	73,303,010	77,009,683
未収利息	1,784	2,351
差入委託証拠金	263,956,662	246,475,696
流動資産合計	78,550,423,869	79,572,786,384
<b>資産合計</b>		
78,550,423,869		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	48,776,936	1,675,620
未払金	-	480,762
未払解約金	14,693,756	60,434,373
流動負債合計	63,470,692	62,590,755
<b>負債合計</b>		
63,470,692		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	45,139,625,708	39,171,763,417
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	33,347,327,469	40,338,432,212
元本等合計	78,486,953,177	79,510,195,629
<b>純資産合計</b>		
78,486,953,177		
<b>負債純資産合計</b>		
78,550,423,869		

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## (貸借対照表に関する注記)

		平成26年10月27日現在	平成27年10月26日現在
1.	期首	平成25年10月29日	平成26年10月28日
	期首元本額	53,121,420,340円	45,139,625,708円
	期首からの追加設定元本額	2,095,102,985円	2,576,874,474円
	期首からの一部解約元本額	10,076,897,617円	8,544,736,765円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外株式ヘッジなし(DC専用)	14,416,020,567円	14,134,604,963円
	DCインデックスバランス(株式20)	40,405,838円	40,898,613円
	DCインデックスバランス(株式40)	150,299,341円	155,460,192円
	DCインデックスバランス(株式60)	277,980,724円	291,520,885円
	DCインデックスバランス(株式80)	327,220,138円	344,001,546円
	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	4,694,129,197円	3,617,735,817円
	日興五大陸株式ファンド	9,846,288,041円	7,510,629,328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	38,205,791円	29,831,206円
	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(株式資産)	14,998,528円	13,338,738円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	8,709,856円	7,085,288円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	7,136,125円	5,812,895円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	10,620,750円	8,708,606円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	13,298,188円	10,511,254円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	8,908,454,732円	7,602,436,095円
	グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	12,570,328円	10,775,646円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	32,442,318円	29,702,650円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	92,482,195円	88,655,614円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	128,381,599円	124,909,158円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	125,941,100円	125,029,817円



	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	5,994,040,352円	5,020,115,106円
	計	45,139,625,708円	39,171,763,417円
2.	受益権の総数	45,139,625,708口	39,171,763,417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）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成25年10月29日 至 平成26年10月27日	自 平成26年10月28日 至 平成27年10月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成26年10月27日現在	平成27年10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

（有価証券に関する注記）

（平成26年10月27日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	4,892,510,673
投資証券	146,834,232
合計	5,039,344,905

（平成27年10月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	3,974,262,839
投資証券	149,920,154
合計	4,124,182,993

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（平成26年10月27日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		

市場取引	株価指数先物取引 買建	1,787,545,829	-	1,747,703,244	39,842,585
合計		1,787,545,829	-	1,747,703,244	39,842,585

(平成27年10月26日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,894,593,323	-	2,018,461,944	123,868,621
合計		1,894,593,323	-	2,018,461,944	123,868,621

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(平成26年10月27日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,370,033,968	-	1,381,428,700	11,394,732
	米ドル	991,104,850	-	1,003,488,500	12,383,650
	ユーロ	378,929,118	-	377,940,200	988,918
	合計	1,370,033,968	-	1,381,428,700	11,394,732

(平成27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	1,499,049,795	-	1,508,099,500	9,049,705
	米ドル	1,164,156,875	-	1,174,430,500	10,273,625
	ユーロ	334,892,920	-	333,669,000	1,223,920
	合計	1,499,049,795	-	1,508,099,500	9,049,705

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

平成26年10月27日現在		平成27年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.7388円	1口当たり純資産額	2.0298円
(1万口当たり純資産額)	(17,388円)	(1万口当たり純資産額)	(20,298円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	10,983	72.03	791,105.49	
	ANTERO RESOURCES CORP	1,060	21.97	23,288.20	

APACHE CORP	8,294	46.49	385,588.06
BAKER HUGHES INC	9,665	53.93	521,233.45
CABOT OIL & GAS CORP	9,030	21.10	190,533.00
CAMERON INTERNATIONAL CORP	4,221	68.10	287,450.10
CHENIERE ENERGY INC	5,020	46.43	233,078.60
CHESAPEAKE ENERGY CORP	11,290	7.83	88,400.70
CHEVRON CORP	39,751	91.24	3,626,881.24
CIMAREX ENERGY CO	2,005	117.03	234,645.15
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	5,890	7.66	45,117.40
COLUMBIA PIPELINE GROUP	6,385	20.94	133,701.90
CONCHO RESOURCES INC	2,395	112.60	269,677.00
CONOCOPHILLIPS	25,980	54.61	1,418,767.80
CONSOL ENERGY INC	5,288	9.50	50,236.00
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,960	34.14	66,914.40
CORE LABORATORIES N.V.	790	113.06	89,317.40
DEVON ENERGY CORPORATION	8,551	44.96	384,452.96
ENERGEN CORP	1,520	57.50	87,400.00
ENSCO PLC-CL A	4,530	16.33	73,974.90
EOG RESOURCES INC	11,362	85.43	970,655.66
EQT CORP	3,405	69.44	236,443.20
EXXON MOBIL CORP	88,761	82.98	7,365,387.78
FMC TECHNOLOGIES INC	4,415	33.27	146,887.05
HALLIBURTON CO	18,517	39.21	726,051.57
HELMERICH & PAYNE	2,120	56.94	120,712.80
HESS CORP	5,530	60.87	336,611.10
HOLLYFRONTIER CORP	4,520	46.93	212,123.60
KINDER MORGAN INC	38,340	29.23	1,120,678.20
MARATHON OIL CORP	14,067	18.30	257,426.10
MARATHON PETROLEUM CORP	11,412	48.59	554,509.08
MURPHY OIL CORP	4,295	28.35	121,763.25
NABORS INDUSTRIES LTD	5,821	10.53	61,295.13
NATIONAL OILWELL VARCO INC	8,231	38.81	319,445.11
NOBLE ENERGY INC	8,662	35.93	311,225.66
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	16,231	73.71	1,196,387.01
OCEANEERING INTL INC	2,060	46.31	95,398.60

ONEOK INC	4,150	36.23	150,354.50
PHILLIPS 66	11,405	83.35	950,606.75
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,290	137.39	452,013.10
RANGE RESOURCES CORP	4,050	31.32	126,846.00
SCHLUMBERGER LTD	27,079	78.35	2,121,639.65
SOUTHWESTERN ENERGY CO	8,835	11.18	98,775.30
SPECTRA ENERGY CORP	14,814	28.77	426,198.78
TESORO CORP	2,820	103.63	292,236.60
VALERO ENERGY CORP	10,782	61.75	665,788.50
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	16,939	10.20	172,777.80
WHITING PETROLEUM CORP	3,115	18.15	56,537.25
WILLIAMS COS INC	14,734	39.20	577,572.80
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	4,205	139.99	588,657.95
AIRGAS INC	1,430	92.73	132,603.90
ALBEMARLE CORP	1,630	52.58	85,705.40
ALCOA INC	26,179	9.14	239,276.06
ASHLAND INC	1,610	107.73	173,445.30
AVERY DENNISON CORP	2,260	63.91	144,436.60
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	2,100	29.73	62,433.00
BALL CORP	3,133	67.83	212,511.39
CELANESE CORP-SERIES A	3,270	69.41	226,970.70
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,850	54.12	262,482.00
CROWN HOLDINGS INC	2,815	52.77	148,547.55
DOW CHEMICAL CO/THE	24,383	50.32	1,226,952.56
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	19,078	60.27	1,149,831.06
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	2,915	72.80	212,212.00
ECOLAB INC	5,830	119.99	699,541.70
FMC CORP	3,270	37.50	122,625.00
FREEMPORT-MCMORAN INC	22,998	12.13	278,965.74
INTERNATIONAL PAPER CO	7,910	43.85	346,853.50
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,664	113.52	188,897.28
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,690	94.16	818,250.40
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,045	152.88	159,759.60
MONSANTO CO	10,181	91.36	930,136.16
MOSAIC CO/THE	6,650	35.62	236,873.00

NEWMONT MINING CORP	11,290	19.55	220,719.50
NUCOR CORP	6,309	43.50	274,441.50
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,950	66.63	129,928.50
PPG INDUSTRIES INC	5,874	103.99	610,837.26
PRAXAIR INC	6,190	111.75	691,732.50
SEALED AIR CORP	4,356	51.70	225,205.20
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,787	245.77	439,190.99
SIGMA-ALDRICH	2,705	139.75	378,023.75
VULCAN MATERIALS CO	2,893	94.50	273,388.50
WESTLAKE CHEMICAL CORP	960	59.94	57,542.40
WESTROCK CO	5,959	53.37	318,031.83
3M CO	13,366	155.79	2,082,289.14
ACUITY BRANDS INC	870	209.00	181,830.00
AGCO CORP	1,670	46.33	77,371.10
AMETEK INC	5,073	55.86	283,377.78
B/E AEROSPACE INC	2,570	43.44	111,640.80
BOEING CO/THE	14,162	146.70	2,077,565.40
CATERPILLAR INC	12,116	71.75	869,323.00
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	2,410	41.63	100,328.30
CUMMINS INC	3,695	112.84	416,943.80
DANAHER CORP	13,369	92.82	1,240,910.58
DEERE & CO	6,670	80.26	535,334.20
DOVER CORP	3,640	64.44	234,561.60
EATON CORP PLC	9,756	54.31	529,848.36
EMERSON ELECTRIC CO	14,140	48.18	681,265.20
FASTENAL CO	6,153	38.75	238,428.75
FLOWSERVE CORP	2,425	43.77	106,142.25
FLUOR CORP	3,203	46.21	148,010.63
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,160	51.78	163,624.80
GENERAL DYNAMICS CORP	5,912	148.28	876,631.36
GENERAL ELECTRIC CO.	212,693	29.51	6,276,570.43
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	15,726	103.13	1,621,822.38
ILLINOIS TOOL WORKS	7,250	90.59	656,777.50
INGERSOLL-RAND PLC	5,866	56.58	331,898.28
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,200	39.75	87,450.00

L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	1,551	114.84	178,116.84
LOCKHEED MARTIN CORP	5,691	219.32	1,248,150.12
MASCO CORP	8,569	27.57	236,247.33
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,994	179.83	718,241.02
PACCAR INC	7,684	54.85	421,467.40
PARKER HANNIFIN CORP	2,740	103.07	282,411.80
PENTAIR PLC	4,018	55.79	224,164.22
PRECISION CASTPARTS CORP	3,060	230.50	705,330.00
QUANTA SERVICES INC	4,645	19.48	90,484.60
RAYTHEON COMPANY	6,782	117.77	798,716.14
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,943	108.04	317,961.72
ROCKWELL COLLINS INC.	2,605	86.85	226,244.25
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,970	176.86	348,414.20
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,100	48.02	148,862.00
SNAP-ON INC	1,250	164.00	205,000.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,116	106.05	330,451.80
TEXTRON INC	5,416	39.03	211,386.48
TRANSDIGM GROUP INC	1,190	217.62	258,967.80
UNITED RENTALS INC	2,250	73.96	166,410.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	17,275	100.62	1,738,210.50
WABCO HOLDINGS INC	1,110	111.02	123,232.20
WABTEC CORP	2,090	83.20	173,888.00
WW GRAINGER INC	1,357	207.85	282,052.45
XYLEM INC	4,368	36.19	158,077.92
ADT CORP/THE	3,537	33.69	119,161.53
CINTAS CORP	2,037	93.50	190,459.50
DUN & BRADSTREET CORP	872	112.15	97,794.80
EQUIFAX INC	2,634	106.03	279,283.02
IHS INC-CLASS A	1,300	120.70	156,910.00
MANPOWERGROUP INC	1,937	85.65	165,904.05
NIELSEN HOLDINGS PLC	6,945	48.27	335,235.15
REPUBLIC SERVICES INC	5,100	43.48	221,748.00
ROBERT HALF INTL INC	2,375	50.96	121,030.00
STERICYCLE INC	1,705	120.31	205,128.55
TOWERS WATSON & CO-CL-A	1,630	122.67	199,952.10



TYCO INTERNATIONAL PLC	8,715	36.95	322,019.25
VERISK ANALYTICS INC	3,170	81.14	257,229.65
WASTE MANAGEMENT INC	9,924	53.19	527,857.56
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	4,080	45.67	186,333.60
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,250	72.79	236,567.50
CSX CORP	20,923	28.37	593,585.51
DELTA AIR LINES INC	4,285	51.00	218,535.00
EXPEDITORS INTL WASH INC	3,647	51.48	187,747.56
FEDEX CORP	5,758	159.52	918,516.16
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	9,780	19.22	187,971.60
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,310	78.48	181,288.80
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	97,000	0.55	53,835.00
KANSAS CITY SOUTHERN	2,390	86.13	205,850.70
NORFOLK SOUTHERN CORP	6,710	81.00	543,510.00
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,190	45.23	189,513.70
UNION PACIFIC CORP	18,596	96.92	1,802,324.32
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	1,915	59.68	114,287.20
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	14,917	106.80	1,593,135.60
AUTOLIV INC	2,020	121.46	245,349.20
BORGWARNER INC	4,330	43.66	189,047.80
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	6,290	85.06	535,027.40
FORD MOTOR COMPANY	78,435	15.67	1,229,076.45
GENERAL MOTORS CORP	30,675	35.95	1,102,766.25
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	5,430	32.97	179,027.10
HARLEY-DAVIDSON INC	4,829	48.20	232,757.80
JOHNSON CONTROLS INC	14,278	45.01	642,652.78
LEAR CORP	1,560	120.94	188,666.40
TESLA MOTORS INC	1,980	209.09	413,998.20
COACH INC	5,876	30.13	177,043.88
DR HORTON INC	6,906	31.13	214,983.78
GARMIN LTD	2,865	35.40	101,421.00
HANESBRANDS INC	8,800	27.06	238,128.00
HARMAN INTERNATIONAL	1,390	108.20	150,398.00
HASBRO INC	2,128	78.87	167,835.36
JARDEN CORP	3,510	46.51	163,250.10

LEGGETT & PLATT INC	2,648	44.15	116,909.20
LENNAR CORP-CL A	3,660	52.12	190,759.20
LULULEMON ATHLETICA INC	2,790	48.49	135,287.10
MATTEL INC	6,309	24.74	156,084.66
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	4,540	38.53	174,926.20
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,378	195.48	269,371.44
NEWELL RUBBERMAID INC	5,800	42.95	249,110.00
NIKE INC -CL B	14,594	130.53	1,904,954.82
POLARIS INDUSTRIES INC	1,250	110.33	137,912.50
PULTE GROUP INC	6,890	18.34	126,362.60
PVH CORP	2,030	88.17	178,985.10
RALPH LAUREN CORP	1,365	113.69	155,186.85
TOLL BROTHERS INC	3,111	36.78	114,422.58
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	3,560	92.02	327,591.20
VF CORP	7,270	63.75	463,462.50
WHIRLPOOL CORP	1,814	145.90	264,662.60
ARAMARK	3,180	30.83	98,039.40
CARNIVAL CORP	8,417	53.58	450,982.86
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	685	649.72	445,058.20
DARDEN RESTAURANTS INC	2,333	63.91	149,102.03
H&R BLOCK INC	5,610	36.20	203,082.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	11,130	24.56	273,352.80
LAS VEGAS SANDS CORP	9,050	49.19	445,169.50
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	4,826	75.29	363,373.67
MCDONALD'S CORP	20,421	112.59	2,299,200.39
MGM RESORTS INTERNATIONAL	7,560	21.29	160,952.40
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	2,930	62.24	182,363.20
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,538	97.99	346,688.62
STARBUCKS CORP	31,894	62.61	1,996,883.34
STARWOOD HOTELS & RESORTS	3,597	67.61	243,193.17
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,540	76.07	193,217.80
WYNN RESORTS LTD	1,660	67.60	112,216.00
YUM! BRANDS INC	9,214	72.89	671,608.46
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	4,265	32.71	139,508.15
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	9,798	44.49	435,913.02

CHARTER COMMUNICATION-A	1,780	183.00	325,740.00
COMCAST CORP-CLASS A	45,106	61.98	2,795,669.88
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	8,581	62.35	535,025.35
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,320	29.77	98,836.40
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	6,530	27.81	181,599.30
DISH NETWORK CORP-A	4,769	62.43	297,728.67
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	8,736	22.40	195,686.40
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,355	44.26	237,012.30
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	13,541	42.54	576,034.14
LIBERTY MEDIA CORP-A	2,465	39.80	98,107.00
LIBERTY MEDIA CORP-C	4,930	38.44	189,509.20
NEWS CORP - CLASS A	7,570	15.00	113,550.00
OMNICOM GROUP	5,417	73.74	399,449.58
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	1,950	56.99	111,130.50
SIRIUS XM HOLDINGS INC	55,940	4.02	224,878.80
TEGNA INC	4,330	26.17	113,316.10
THE WALT DISNEY CO.	34,253	113.09	3,873,671.77
TIME WARNER CABLE	5,917	185.19	1,095,769.23
TIME WARNER INC	17,698	73.27	1,296,732.46
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	9,769	30.42	297,172.98
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	27,572	30.11	830,192.92
VIACOM INC-CLASS B	7,748	50.34	390,034.32
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,608	191.94	308,639.52
AMAZON.COM INC	8,345	599.03	4,998,905.35
AUTONATION INC	1,650	61.58	101,607.00
AUTOZONE INC	702	762.24	535,092.48
BED BATH & BEYOND INC	4,262	59.21	252,353.02
BEST BUY CO INC	6,504	35.20	228,940.80
CARMAX INC	4,859	58.05	282,064.95
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,110	42.02	88,662.20
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	6,280	65.75	412,910.00
DOLLAR TREE INC	4,896	62.53	306,146.88
EXPEDIA INC	2,232	125.41	279,915.12
FOOT LOCKER INC	3,100	63.61	197,191.00
GAMESTOP CORP-CLASS A	2,480	45.35	112,468.00

GAP INC/THE	5,106	26.95	137,606.70
GENUINE PARTS CO	3,521	89.19	314,037.99
HOME DEPOT INC	27,980	124.61	3,486,587.80
KOHL'S CORP	4,402	44.06	193,952.12
L BRANDS INC	5,558	93.88	521,785.04
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	9,700	27.99	271,503.00
LKQ CORP	6,990	28.28	197,677.20
LOWE'S COS INC	20,642	73.55	1,518,219.10
MACY'S INC	7,009	47.97	336,221.73
NETFLIX INC	8,820	100.04	882,352.80
NORDSTROM INC	2,850	64.99	185,221.50
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,235	260.03	581,167.05
PRICELINE GROUP INC/THE	1,095	1,366.49	1,496,306.55
ROSS STORES INC	9,232	49.66	458,461.12
SIGNET JEWELERS LTD	1,660	144.76	240,301.60
STAPLES INC	13,744	12.61	173,311.84
TARGET CORP	12,870	72.94	938,737.80
TIFFANY & CO	2,980	78.61	234,257.80
TJX COMPANIES INC	14,413	71.76	1,034,276.88
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,960	90.43	267,672.80
TRIPADVISOR INC	2,330	82.90	193,157.00
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	1,320	165.91	219,001.20
URBAN OUTFITTERS INC	2,040	27.44	55,977.60
COSTCO WHOLESALE CORP	9,339	155.74	1,454,455.86
CVS HEALTH CORP	23,907	103.95	2,485,132.65
KROGER CO	19,670	37.82	743,919.40
RITE AID CORP	19,870	6.18	122,796.60
SYSCO CORP	13,076	41.76	546,053.76
WAL-MART STORES INC	34,222	58.30	1,995,142.60
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	18,502	89.96	1,664,439.92
WHOLE FOODS MARKET INC	7,790	32.28	251,461.20
ALTRIA GROUP INC	41,728	61.05	2,547,494.40
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	13,943	46.89	653,787.27
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2,227	108.48	241,584.96
BUNGE LTD	3,107	79.41	246,726.87

CAMPBELL SOUP CO	4,215	51.43	216,777.45
COCA-COLA CO/THE	87,642	42.79	3,750,201.18
COCA-COLA ENTERPRISES	4,480	51.51	230,764.80
CONAGRA FOODS INC	9,730	41.28	401,654.40
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,720	136.20	506,664.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	4,109	89.89	369,358.01
GENERAL MILLS INC	13,169	58.33	768,147.77
HERSHEY CO/THE	3,485	95.67	333,409.95
HORMEL FOODS CORP	2,800	68.33	191,324.00
JM SMUCKER CO/THE	2,160	118.27	255,463.20
KELLOGG CO	5,928	71.70	425,037.60
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	2,865	55.01	157,603.65
KRAFT HEINZ CO/THE	12,381	77.98	965,470.38
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,275	85.17	193,761.75
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	3,991	81.12	323,749.92
MOLSON COORS BREWING CO -B	3,120	88.48	276,057.60
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	34,765	46.53	1,617,615.45
MONSTER BEVERAGE CORP	2,930	141.58	414,829.40
PEPSICO INC	31,411	102.43	3,217,428.73
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	32,788	89.63	2,938,788.44
REYNOLDS AMERICAN INC	18,336	48.89	896,447.04
TYSON FOODS INC-CL A	6,456	47.44	306,272.64
WHITEWAVE FOODS CO	3,520	40.75	143,440.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,965	87.81	260,356.65
CLOROX COMPANY	2,736	123.25	337,212.00
COLGATE-PALMOLIVE CO	18,150	68.94	1,251,261.00
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	1,311	84.95	111,369.45
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,740	84.21	399,155.40
KIMBERLY-CLARK CORP	7,923	121.24	960,584.52
PROCTER & GAMBLE CO	57,109	77.03	4,399,106.27
ABBOTT LABORATORIES	31,957	43.60	1,393,325.20
AETNA INC	7,649	105.89	809,952.61
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,714	93.13	439,014.82
ANTHEM INC	5,656	140.95	797,213.20
BAXTER INTERNATIONAL INC	11,519	35.40	407,772.60

BECTON DICKINSON AND CO	4,617	140.22	647,395.74
BOSTON SCIENTIFIC CORP	28,738	16.73	480,786.74
CARDINAL HEALTH INC	7,295	80.14	584,621.30
CENTENE CORP	2,260	57.25	129,385.00
CERNER CORP	6,590	64.63	425,911.70
CIGNA CORP	5,420	132.54	718,366.80
COOPER COS INC/THE	1,040	146.31	152,162.40
CR BARD INC	1,574	179.42	282,407.08
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	3,938	75.94	299,051.72
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	2,972	58.76	174,634.72
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,160	149.88	323,740.80
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	3,630	27.57	100,079.10
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	15,364	85.11	1,307,630.04
HCA HOLDINGS INC	7,315	68.98	504,588.70
HENRY SCHEIN INC	1,630	149.92	244,369.60
HOLOGIC INC	4,538	36.96	167,724.48
HUMANA INC	3,115	168.20	523,943.00
INTUITIVE SURGICAL INC	820	500.03	410,024.60
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,155	111.95	241,252.25
MCKESSON CORP	4,964	186.96	928,069.44
MEDTRONIC PLC	30,038	73.69	2,213,500.22
PATTERSON COS INC	2,042	47.01	95,994.42
QUEST DIAGNOSTICS	3,116	64.84	202,041.44
RESMED INC	3,370	56.25	189,562.50
ST JUDE MEDICAL INC	6,120	62.86	384,703.20
STRYKER CORP	7,533	94.44	711,416.52
UNITEDHEALTH GROUP INC	20,280	115.92	2,350,857.60
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,820	115.95	211,029.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,474	77.26	191,141.24
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	3,572	94.56	337,768.32
ABBVIE INC	36,316	50.34	1,828,147.44
AGILENT TECHNOLOGIES INC	7,010	37.11	260,141.10
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	4,690	171.15	802,693.50
ALKERMES PLC	3,220	61.46	197,901.20
ALLERGAN PLC	8,305	268.55	2,230,307.75

ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,530	79.71	121,956.30
AMGEN INC	16,031	155.75	2,496,828.25
BAXALTA INC	11,519	33.41	384,849.79
BIOGEN INC	4,953	276.99	1,371,931.47
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,500	104.14	364,490.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	35,151	65.16	2,290,439.16
CELGENE CORP	16,904	120.08	2,029,832.32
ELI LILLY & CO	21,163	78.31	1,657,274.53
ENDO INTERNATIONAL PLC	4,160	56.60	235,456.00
GILEAD SCIENCES INC	31,494	107.99	3,401,037.06
ILLUMINA INC	2,985	147.43	440,078.55
INCYTE CORP	3,340	110.02	367,466.80
ISIS PHARMACEUTICALS INC	2,570	45.52	116,986.40
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,330	131.34	174,682.20
JOHNSON & JOHNSON	58,821	100.31	5,900,334.51
MALLINCKRODT PLC	2,400	65.75	157,800.00
MEDIVATION INC	3,320	45.19	150,030.80
MERCK & CO. INC.	60,153	52.88	3,180,890.64
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	600	304.27	182,562.00
MYLAN NV	8,585	40.96	351,641.60
PERRIGO CO PLC	3,039	150.57	457,582.23
PFIZER INC	129,610	34.05	4,413,220.50
PUMA BIOTECHNOLOGY INC	550	87.87	48,328.50
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	1,950	68.27	133,126.50
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,650	536.70	885,555.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	8,374	126.47	1,059,059.78
UNITED THERAPEUTICS CORP	940	126.04	118,477.60
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,320	114.37	608,448.40
WATERS CORP	1,886	124.27	234,373.22
ZOETIS INC	10,200	42.54	433,908.00
BANK OF AMERICA CORP	222,679	16.52	3,678,657.08
BB&T CORP	15,428	37.66	581,018.48
CIT GROUP INC	3,435	45.76	157,185.60
CITIGROUP INC	64,377	53.64	3,453,182.28
CITIZENS FINANCIAL GROUP	9,120	24.22	220,886.40

COMERICA INC	3,360	42.89	144,110.40
FIFTH THIRD BANCORP	16,559	19.11	316,442.49
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,330	65.47	152,545.10
HUDSON CITY BANCORP INC	12,310	10.11	124,454.10
HUNTINGTON BANCSHARES INC	17,700	11.13	197,001.00
JPMORGAN CHASE & CO	78,970	63.87	5,043,813.90
KEYCORP	17,678	13.52	239,006.56
M & T BANK CORP	2,453	122.60	300,737.80
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	9,654	18.95	182,943.30
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	6,370	16.44	104,722.80
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	11,100	91.24	1,012,764.00
REGIONS FINANCIAL CORP	29,784	9.45	281,458.80
SUNTRUST BANKS INC	11,067	41.75	462,047.25
US BANCORP	37,991	42.62	1,619,176.42
WELLS FARGO & CO	103,780	54.75	5,681,955.00
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,220	181.71	221,686.20
ALLY FINANCIAL INC	9,120	19.99	182,308.80
AMERICAN EXPRESS CO	19,344	74.59	1,442,868.96
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,090	116.08	474,767.20
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	23,662	42.25	999,719.50
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	24,480	137.78	3,372,854.40
BLACKROCK INC	2,705	340.79	921,836.95
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	11,835	81.12	960,055.20
CME GROUP INC	6,690	93.95	628,525.50
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	9,370	57.10	535,027.00
E*TRADE FINANCIAL CORP	5,840	28.31	165,330.40
EATON VANCE CORP	2,880	36.60	105,408.00
FRANKLIN RESOURCES INC	7,995	40.18	321,239.10
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8,338	185.50	1,546,699.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	2,456	248.80	611,052.80
INVESCO LTD	8,347	33.90	282,963.30
LEGG MASON INC	2,185	45.56	99,548.60
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	20.20	147,561.00
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	6,022	95.39	574,438.58
MOODY'S CORP	3,917	100.50	393,658.50



MORGAN STANLEY	31,145	32.62	1,015,949.90
NASDAQ INC	3,055	58.72	179,389.60
NAVIENT CORP	8,682	13.55	117,641.10
NORTHERN TRUST CORP	4,690	69.17	324,407.30
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,500	53.37	133,425.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	24,604	30.43	748,699.72
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,225	50.58	163,120.50
STATE STREET CORP	8,707	67.14	584,587.98
SYNCHRONY FINANCIAL	3,410	31.69	108,062.90
T ROWE PRICE GROUP INC	5,735	74.39	426,626.65
TD AMERITRADE HOLDING CORP	5,050	33.93	171,346.50
VOYA FINANCIAL INC	4,650	40.47	188,185.50
ACE LTD	6,983	114.83	801,857.89
AFLAC INC	9,482	63.45	601,632.90
ALLEGHANY CORP	400	498.05	199,220.00
ALLSTATE CORP	9,313	61.68	574,425.84
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	29,045	61.28	1,779,877.60
AON PLC	5,617	92.49	519,516.33
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,115	77.51	241,443.65
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,300	43.56	143,748.00
ASSURANT INC	1,530	81.85	125,230.50
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,175	54.63	118,820.25
CHUBB CORP	5,033	130.58	657,209.14
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,690	59.04	158,817.60
EVEREST RE GROUP LTD	1,014	179.27	181,779.78
FNF GROUP	5,881	34.50	202,894.50
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	9,442	49.24	464,924.08
LINCOLN NATIONAL CORP	5,833	52.34	305,299.22
LOEWS CORP	6,865	36.70	251,945.50
MARSH & MCLENNAN COS	10,903	55.30	602,935.90
METLIFE INC	19,985	50.98	1,018,835.30
PARTNERRE LTD	1,052	138.96	146,185.92
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	5,820	50.51	293,968.20
PROGRESSIVE CORP	12,350	33.05	408,167.50
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	9,492	82.48	782,900.16

RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	887	110.49	98,004.63
TORCHMARK CORP	3,106	59.03	183,347.18
TRAVELERS COS INC/THE	6,754	112.28	758,339.12
UNUM GROUP	4,788	33.54	160,589.52
WILLIS GROUP HOLDING	2,990	43.97	131,470.30
WR BERKLEY CORP	2,573	55.48	142,750.04
XL GROUP PLC	6,310	38.89	245,395.90
CBRE GROUP INC	6,610	34.92	230,821.20
JONES LANG LASALLE INC	890	152.95	136,125.50
REALOGY HOLDINGS CORP	3,160	38.71	122,323.60
ACCENTURE PLC-CL A	13,288	107.99	1,434,971.12
ACTIVISION BLIZZARD INC	10,200	34.90	355,980.00
ADOBE SYSTEMS INC	10,519	87.86	924,199.34
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	4,220	74.08	312,617.60
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,275	295.87	377,234.25
ALPHABET INC-CL A	6,040	719.33	4,344,753.20
ALPHABET INC-CL C	6,502	702.00	4,564,404.00
ANSYS INC	2,090	93.58	195,582.20
AUTODESK INC	5,210	52.39	272,951.90
AUTOMATIC DATA PROCESSING	9,896	90.53	895,884.88
CA INC	6,760	27.75	187,590.00
CDK GLOBAL INC	2,720	49.89	135,700.80
CITRIX SYSTEMS INC	3,628	81.14	294,375.92
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	12,648	68.83	870,561.84
COMPUTER SCIENCES CORP	3,453	66.31	228,968.43
EBAY INC	22,957	28.16	646,469.12
ELECTRONIC ARTS INC	6,984	74.92	523,241.28
FACEBOOK INC-A	45,230	102.19	4,622,053.70
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	6,105	71.23	434,859.15
FIREEYE INC	1,850	27.23	50,375.50
FISERV INC	5,278	95.75	505,368.50
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,740	148.51	258,407.40
GARTNER INC	1,750	88.09	154,157.50
INTL BUSINESS MACHINES CORP	19,932	144.68	2,883,761.76
INTUIT INC	5,366	97.94	525,546.04

LINKEDIN CORP - A	2,410	210.39	507,039.90
MASTERCARD INC-CLASS A	21,170	99.79	2,112,554.30
MICROSOFT CORP	162,614	52.87	8,597,402.18
NETSUITE INC	740	85.02	62,914.80
NUANCE COMMUNICATIONS INC	4,240	17.01	72,122.40
ORACLE CORP	74,413	38.07	2,832,902.91
PAYCHEX INC	6,712	51.78	347,580.92
PAYPAL HOLDINGS INC	22,957	34.99	803,265.43
RACKSPACE HOSTING INC	2,500	25.01	62,525.00
RED HAT INC	4,070	77.39	314,977.30
SALESFORCE.COM INC	12,500	78.56	982,000.00
SERVICENOW INC	3,030	78.89	239,036.70
SPLUNK INC	2,530	56.25	142,312.50
SYMANTEC CORP	13,905	20.64	286,999.20
SYNOPSYS INC	3,207	49.72	159,452.04
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	1,000	83.70	83,700.00
TERADATA CORP	3,025	28.28	85,547.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,636	51.22	186,235.92
TWITTER INC	10,380	30.28	314,306.40
VANTIV INC - CL-A	2,410	46.73	112,619.30
VERISIGN INC	2,720	80.18	218,089.60
VISA INC-CLASS A SHARES	41,492	77.07	3,197,788.44
VMWARE INC	1,835	58.18	106,760.30
WESTERN UNION CO	10,451	19.76	206,511.76
WORKDAY INC-CLASS A	2,070	79.85	165,289.50
XEROX CORP	22,644	10.34	234,138.96
YAHOO! INC	18,265	33.17	605,850.05
ZILLOW GROUP INC - A	1,000	32.90	32,900.00
ZILLOW GROUP INC - C	2,000	29.99	59,980.00
AMPHENOL CORP-CL A	5,990	53.53	320,644.70
APPLE INC	122,012	119.08	14,529,188.96
ARROW ELECTRONICS INC	2,310	59.29	136,959.90
AVNET INC	3,460	46.12	159,575.20
CISCO SYSTEMS INC	108,340	29.35	3,179,779.00
CORNING INC	25,868	17.60	455,276.80

EMC CORP/MASS	41,859	26.10	1,092,519.90
F5 NETWORKS INC	1,445	119.50	172,677.50
FLEXTRONICS INTL LTD	14,686	11.57	169,917.02
FLIR SYSTEMS INC	3,195	27.67	88,405.65
HARRIS CORP	2,130	76.49	162,923.70
HEWLETT-PACKARD CO	38,615	29.03	1,120,993.45
JUNIPER NETWORKS INC	7,633	31.49	240,363.17
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4,135	70.48	291,434.80
NETAPP INC	7,006	34.67	242,898.02
PALO ALTO NETWORKS INC	1,450	159.20	230,840.00
QUALCOMM INC	35,032	60.72	2,127,318.20
SANDISK CORP	4,653	78.37	364,655.61
SEAGATE TECHNOLOGY	6,974	41.15	286,980.10
TE CONNECTIVITY LTD	8,365	63.86	534,188.90
TRIMBLE NAVIGATION LTD	6,050	18.52	112,046.00
WESTERN DIGITAL CORP	4,755	69.34	329,711.70
AT&T INC	129,497	33.74	4,369,228.78
CENTURYLINK INC	12,616	28.02	353,500.32
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	21,304	5.39	114,935.08
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	5,700	48.96	279,072.00
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	2,580	116.08	299,486.40
SPRINT CORP	15,130	4.71	71,262.30
T-MOBILE US INC	6,372	41.27	262,972.44
VERIZON COMMUNICATIONS INC	86,147	46.16	3,976,545.52
AES CORP	13,728	11.05	151,694.40
ALLIANT ENERGY CORP	2,160	60.36	130,377.60
AMEREN CORPORATION	5,782	43.99	254,350.18
AMERICAN ELECTRIC POWER	10,698	57.48	614,921.04
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,095	57.63	235,994.85
CALPINE CORP	8,060	15.19	122,431.40
CENTERPOINT ENERGY INC	8,142	18.62	151,604.04
CMS ENERGY CORP	5,290	36.74	194,354.60
CONSOLIDATED EDISON INC	6,306	67.04	422,754.24
DOMINION RESOURCES INC/VA	12,177	73.08	889,895.16
DTE ENERGY COMPANY	3,698	83.33	308,154.34

DUKE ENERGY CORP	14,986	73.74	1,105,067.64
EDISON INTERNATIONAL	7,059	64.55	455,658.45
ENTERGY CORP	3,427	68.65	235,263.55
EVERSOURCE ENERGY	6,900	51.72	356,868.00
EXELON CORP	18,576	29.86	554,679.36
FIRSTENERGY CORP	8,255	31.67	261,435.85
MDU RESOURCES GROUP INC	4,180	18.86	78,834.80
NEXTERA ENERGY INC	9,225	104.56	964,566.00
NRG ENERGY INC	7,670	14.02	107,533.40
OGE ENERGY CORP	3,560	28.79	102,492.40
P G & E CORP	10,391	53.63	557,269.33
PEPCO HOLDINGS INC	4,500	26.39	118,755.00
PINNACLE WEST CAPITAL	2,199	65.71	144,496.29
PPL CORP	13,608	34.18	465,121.44
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	10,168	42.66	433,766.88
SCANA CORP	2,473	57.28	141,653.44
SEMPRA ENERGY	4,687	101.47	475,589.89
SOUTHERN CO	19,585	45.81	897,188.85
WEC ENERGY GROUP INC	6,860	52.81	362,276.60
XCEL ENERGY INC	9,704	36.44	353,613.76
ALTERA CORPORATION	5,946	52.57	312,581.22
ANALOG DEVICES INC	6,481	63.62	412,321.22
APPLIED MATERIALS INC	24,833	16.44	408,254.52
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	5,350	129.58	693,253.00
BROADCOM CORP-CL A	11,716	53.13	622,471.08
FREESCALE SEMICONDUCTOR LTD	2,010	39.71	79,817.10
INTEL CORP	100,232	34.90	3,498,096.80
KLA-TENCOR CORPORATION	3,779	65.35	246,957.65
LAM RESEARCH CORP	3,247	74.57	242,128.79
LINEAR TECHNOLOGY CORP	5,594	46.02	257,435.88
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	9,254	9.56	88,468.24
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	5,850	37.95	222,007.50
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	3,794	49.11	186,323.34
MICRON TECHNOLOGY INC	23,297	17.24	401,640.28
NVIDIA CORP	11,505	28.59	328,927.95

	QORVO INC	3,100	51.50	159,650.00	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	4,200	82.55	346,710.00	
	SUNEDISON INC	5,490	7.77	42,657.30	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	22,052	58.98	1,300,626.96	
	XILINX INC	6,125	47.16	288,855.00	
米ドル小計		6,807,783		398,047,586.66 (48,219,484,647)	
加ドル	ALTAGAS LTD	3,050	34.49	105,194.50	
	ARC RESOURCES LTD	7,925	20.02	158,658.50	
	BAYTEX ENERGY CORP	3,375	5.78	19,507.50	
	CAMECO CORP	7,892	19.00	149,948.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	24,024	31.11	747,386.64	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	11,160	9.91	110,595.60	
	CENOVUS ENERGY INC	17,463	19.88	347,164.44	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	7,395	18.21	134,662.95	
	ENBRIDGE INC	17,995	56.90	1,023,915.50	
	ENCANA CORP	17,968	10.59	190,281.12	
	ENERPLUS CORP	4,690	6.62	31,047.80	
	HUSKY ENERGY INC	6,729	21.49	144,606.21	
	IMPERIAL OIL LTD	6,942	43.78	303,920.76	
	INTER PIPELINE LTD	7,180	25.49	183,018.20	
	KEYERA CORP	4,120	40.31	166,077.20	
	MEG ENERGY CORP	2,710	10.56	28,617.60	
	PARAMOUNT RESOURCES LTD -A	1,010	13.69	13,826.90	
	PEMBINA PIPELINE CORP	6,245	33.94	211,955.30	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	3,680	29.90	110,032.00	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	2,590	25.87	67,003.30	
	SUNCOR ENERGY INC	29,675	37.50	1,112,812.50	
	TOURMALINE OIL CORP	4,005	28.91	115,784.55	
	TRANSCANADA CORP	14,523	44.90	652,082.70	
	VERESEN INC	5,360	12.14	65,070.40	
	VERMILION ENERGY INC	1,830	46.77	85,589.10	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	4,695	38.34	180,006.30	
	AGRIUM INC	3,015	126.69	381,970.35	
	BARRICK GOLD CORP	26,114	10.21	266,623.94	

ELDORADO GOLD CORP	14,630	5.38	78,709.40
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	12,590	7.67	96,565.30
FRANCO-NEVADA CORP	2,925	70.00	204,750.00
GOLDCORP INC	17,917	20.48	366,940.16
KINROSS GOLD CORP	25,015	3.05	76,295.75
METHANEX CORP	2,330	53.25	124,072.50
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	17,917	28.83	516,547.11
SILVER WHEATON CORP	8,645	18.97	163,995.65
TECK RESOURCES LTD-CLS B	13,885	8.95	124,270.75
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	13,419	3.99	53,541.81
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,460	47.52	69,379.20
YAMANA GOLD INC	19,626	3.33	65,354.58
BOMBARDIER INC 'B'	34,746	1.52	52,813.92
CAE INC	6,315	15.16	95,735.40
FINNING INTERNATIONAL INC	2,845	21.66	61,622.70
SNC-LAVALIN GROUP INC	3,195	43.16	137,896.20
CANADIAN NATL RAILWAY CO	17,018	81.42	1,385,605.56
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,335	202.17	674,236.95
MAGNA INTERNATIONAL INC	8,378	70.20	588,135.60
GILDAN ACTIVEWEAR INC	4,060	38.12	154,767.20
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	4,328	49.17	212,807.76
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	8,325	26.11	217,365.75
THOMSON REUTERS CORP	8,044	54.60	439,202.40
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,560	117.79	183,752.40
DOLLARAMA INC	2,920	92.53	270,187.60
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	8,650	60.98	527,477.00
EMPIRE CO LTD 'A'	3,000	27.94	83,820.00
LOBLAW COMPANIES LTD	4,519	71.18	321,662.42
METRO INC	5,790	38.08	220,483.20
WESTON (GEORGE) LTD	942	113.71	107,114.82
SAPUTO INC	5,040	32.13	161,935.20
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	6,734	152.69	1,028,214.46
BANK OF MONTREAL	13,731	77.53	1,064,564.43
BANK OF NOVA SCOTIA	25,609	62.05	1,589,038.45
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	8,295	101.87	845,011.65

	NATIONAL BANK OF CANADA	7,340	42.94	315,179.60	
	ROYAL BANK OF CANADA	30,449	74.85	2,279,107.65	
	TORONTO-DOMINION BANK	39,000	54.39	2,121,210.00	
	CI FINANCIAL CORP	3,410	31.49	107,380.90	
	IGM FINANCIAL INC	2,535	37.63	95,392.05	
	ONEX CORPORATION	1,905	79.40	151,257.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	490	644.68	315,893.20	
	GREAT-WEST LIFECO INC	5,974	34.50	206,103.00	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	1,735	43.34	75,194.90	
	INTACT FINANCIAL CORP	3,045	95.61	291,132.45	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	39,991	22.44	897,398.04	
	POWER CORP OF CANADA	7,800	29.68	231,504.00	
	POWER FINANCIAL CORP	5,715	32.49	185,680.35	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	11,984	45.17	541,317.28	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	18,933	46.49	880,195.17	
	CGI GROUP INC - CL A	4,650	49.38	229,617.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	370	573.94	212,357.80	
	OPEN TEXT CORP	3,070	62.18	190,892.60	
	BLACKBERRY LTD	10,328	9.66	99,768.48	
	BCE INC	2,930	58.75	172,137.50	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	8,355	53.02	442,982.10	
	TELUS CORP	4,366	44.21	193,020.86	
	ATCO LTD -CLASS I	1,920	40.24	77,260.80	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,590	36.61	94,819.90	
	FORTIS INC	4,785	39.44	188,720.40	
	TRANSALTA CORP	4,760	6.91	32,891.60	
加ドル小計		819,528		30,099,647.77	(2,766,157,630)
ユーロ	ENI SPA	55,546	15.53	862,629.38	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	9,315	9.86	91,855.21	
	NESTE OYJ	2,740	21.53	58,992.20	
	OMV AG	3,490	25.36	88,523.85	
	REPSOL SA	21,989	11.57	254,522.67	
	SAIPEM SPA	5,370	8.17	43,899.75	
	TECHNIP SA	2,468	47.72	117,772.96	



TENARIS SA	9,355	11.58	108,330.90
TOTAL SA	45,197	45.50	2,056,463.50
VOPAK	1,270	36.89	46,850.30
AIR LIQUIDE SA	7,424	115.90	860,441.60
AKZO NOBEL	5,028	65.05	327,071.40
ARCELORMITTAL	22,911	5.46	125,094.06
ARKEMA	1,615	67.75	109,416.25
BASF SE	19,385	76.64	1,485,666.40
CRH PLC	16,080	25.44	409,155.60
EVONIK INDUSTRIES AG	1,820	33.03	60,114.60
FUCHS PETROLUB SE-PRF	1,720	44.33	76,247.60
HEIDELBERGCEMENT AG	3,245	68.34	221,763.30
IMERYS SA	540	62.18	33,577.20
K+S AG	3,880	24.29	94,245.20
KONINKLIJKE DSM NV	3,442	48.53	167,057.47
LANXESS AG	1,935	49.66	96,101.77
LINDE AG	3,845	155.45	597,705.25
OCI NV	2,000	26.07	52,140.00
SOLVAY ET CIE SA -A	1,271	101.85	129,451.35
STORA ENSO OYJ-R SHS	12,085	8.74	105,683.32
SYMRISE AG	2,640	60.10	158,664.00
THYSSENKRUPP AG	7,415	18.81	139,476.15
UMICORE	2,120	39.00	82,690.60
UPM-KYMMENE OYJ	12,618	16.86	212,739.48
VOESTALPINE AG	2,509	34.42	86,372.32
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4,176	29.99	125,259.12
AIRBUS GROUP SE	12,608	60.17	758,623.36
ALSTOM	4,490	28.78	129,244.65
ANDRITZ AG	1,980	45.80	90,684.00
BOSKALIS WESTMINSTER	1,695	43.41	73,588.42
BOUYGUES SA	4,210	35.17	148,086.75
BRENNTAG AG	3,765	53.85	202,745.25
CNH INDUSTRIAL NV	22,370	6.25	139,812.50
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	9,246	39.57	365,910.45
FERROVIAL SA	9,975	23.14	230,821.50

FINMECCANICA SPA	9,630	12.20	117,486.00
GEA GROUP AG	3,230	36.05	116,457.65
KONE OYJ-B	6,434	38.74	249,253.16
KONINKLIJKE PHILIPS NV	19,861	23.75	471,698.75
LEGRAND SA	5,628	50.45	283,932.60
MAN SE	624	94.40	58,905.60
METSO OYJ	2,420	22.32	54,014.40
OSRAM LICHT AG	2,332	53.06	123,735.92
PRYSMIAN SPA	3,095	19.99	61,869.05
REXEL SA	7,240	12.62	91,368.80
SAFRAN SA	6,190	70.34	435,404.60
SCHNEIDER ELECTRIC SE	11,898	54.85	652,605.30
SIEMENS AG-REG	16,726	90.02	1,505,674.52
THALES SA	2,345	66.85	156,763.25
VINCI SA	10,490	60.12	630,658.80
WARTSILA OYJ ABP	2,460	37.39	91,979.40
ZARDOYA OTIS SA	4,249	11.29	47,971.21
ZODIAC AEROSPACE	4,550	23.62	107,471.00
BUREAU VERITAS SA	5,650	20.66	116,757.25
EDENRED	3,906	17.61	68,784.66
RANDSTAD HOLDING NV	2,865	52.48	150,355.20
SOCIETE BIC SA	735	144.60	106,281.00
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	10,531	15.41	162,282.71
ADP	650	116.80	75,920.00
AENA SA	1,280	102.65	131,392.00
ATLANTIA SPA	9,360	25.49	238,586.40
BOLLORE	11,000	4.47	49,170.00
DEUTCHE LUFTHANSA	5,680	13.91	79,037.20
DEUTSCHE POST AG-REG	20,993	27.54	578,252.18
FRAPORT AG	980	60.59	59,378.20
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	8,760	12.45	109,105.80
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	16,992	8.33	141,543.36
TNT EXPRESS NV	9,060	7.66	69,399.60
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	7,245	93.29	675,886.05
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,190	73.30	87,227.00

CONTINENTAL AG	2,435	220.90	537,891.50
DAIMLER AG	20,322	78.71	1,599,544.62
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	19,647	13.90	273,093.30
MICHELIN (CGDE)-B	4,149	90.80	376,729.20
NOKIAN RENKAAT OYJ	2,915	30.48	88,849.20
PEUGEOT SA	7,500	16.23	121,725.00
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	3,490	42.16	147,138.40
RENAULT SA	4,117	82.72	340,558.24
VALEO SA	1,620	142.40	230,688.00
VOLKSWAGEN AG	771	121.85	93,946.35
VOLKSWAGEN AG-PFD	3,433	107.70	369,734.10
ADIDAS AG	4,421	81.41	359,913.61
CHRISTIAN DIOR SE	1,080	180.40	194,832.00
HERMES INTERNATIONAL	542	344.30	186,610.60
HUGO BOSS AG -ORD	1,490	96.06	143,129.40
KERING	1,547	172.75	267,244.25
LUXOTTICA GROUP SPA	3,976	65.00	258,440.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	5,874	170.65	1,002,398.10
ACCOR SA	4,976	45.09	224,367.84
SODEXO	1,970	80.67	158,919.90
TUI AG	5,500	16.83	92,592.50
ALTICE NV -A	5,820	17.87	104,032.50
ALTICE NV -B	1,940	18.22	35,346.80
AXEL SPRINGER SE	995	51.23	50,973.85
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	30.36	115,235.17
JC DECAUX SA	1,140	36.83	41,986.20
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	460	119.15	54,809.00
LAGARDERE S.C.A.	2,980	26.78	79,804.40
NUMERICABLE-SFR	2,250	44.22	99,495.00
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	4,805	48.16	231,432.82
PUBLICIS GROUPE	4,075	59.91	244,133.25
RELX NV	20,559	15.56	320,000.83
RTL GROUP	920	78.21	71,953.20
SES	6,700	28.75	192,625.00
TELENET GROUP HOLDING NV	840	51.79	43,503.60

VIVENDI	25,330	22.49	569,671.70
WOLTERS KLUWER	5,647	30.46	172,007.62
INDITEX	22,755	33.75	768,095.02
CARREFOUR SA	11,113	30.20	335,612.60
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,344	54.92	73,812.48
COLRUYT SA	1,375	44.73	61,503.75
DELHAIZE GROUP	2,426	81.12	196,797.12
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	11,008	6.16	67,809.28
JERONIMO MARTINS	5,075	12.85	65,213.75
KONINKLIJKE AHOLD NV	19,721	17.84	351,921.24
METRO AG	3,260	28.21	91,980.90
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	16,981	107.15	1,819,514.15
DANONE	11,924	63.15	753,000.60
HEINEKEN HOLDING NV	2,595	71.29	184,997.55
HEINEKEN NV	5,033	80.00	402,640.00
KERRY GROUP PLC-A	3,750	72.60	272,250.00
PERNOD-RICARD SA	4,276	106.45	455,180.20
REMY COINTREAU	470	63.45	29,821.50
BEIERSDORF AG	2,015	85.86	173,007.90
HENKEL AG & CO KGAA	2,030	84.89	172,326.70
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	3,953	99.92	394,983.76
L'OREAL	5,496	173.60	954,105.60
UNILEVER NV-CVA	34,345	41.63	1,429,782.35
ESSILOR INTERNATIONAL	4,465	116.45	519,949.25
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	4,683	78.13	365,882.79
FRESENIUS SE & CO KGAA	8,475	63.29	536,382.75
BAYER AG	17,470	116.40	2,033,508.00
GRIFOLS SA	3,810	41.36	157,581.60
MERCK KGAA	2,930	84.21	246,735.30
ORION OYJ-CLASS B	2,590	33.51	86,790.90
QIAGEN N.V.	5,145	23.02	118,463.62
SANOFI	25,086	92.45	2,319,200.70
UCB SA	2,798	69.83	195,384.34
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	52,861	1.67	88,489.31
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	133,873	8.11	1,086,111.64

BANCO COMERCIAL PORTUGUES	750,000	0.05	39,600.00
BANCO DE SABADELL SA	108,391	1.90	206,593.24
BANCO POPOLARE SC	5,500	14.03	77,165.00
BANCO POPULAR ESPANOL	39,339	3.56	140,400.89
BANCO SANTANDER SA	303,609	5.27	1,600,323.03
BANCO SANTANDER SA-RTS	303,609	0.05	15,484.05
BANK OF IRELAND	558,550	0.35	198,285.25
BANKIA SA	95,000	1.16	110,580.00
BANKINTER SA	13,960	6.57	91,814.92
BNP PARIBAS	22,352	55.91	1,249,700.32
CAIXABANK S.A	54,940	3.58	197,179.66
COMMERZBANK AG	23,524	10.27	241,709.10
CREDIT AGRICOLE SA	21,992	11.46	252,028.32
ERSTE GROUP BANK AG	4,878	26.79	130,706.01
ING GROEP NV-CVA	81,305	13.36	1,086,641.32
INTESA SANPAOLO	275,093	3.21	884,699.08
KBC GROEP NV	5,519	52.63	290,464.97
NATIXIS	22,980	5.63	129,561.24
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	2,770	14.50	40,165.00
SOCIETE GENERALE	15,039	43.30	651,188.70
UBI BANCA SCPA	22,584	7.06	159,555.96
UNICREDIT SPA	98,103	6.06	594,994.69
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	28,835	27.75	800,315.42
DEUTSCHE BOERSE AG	3,830	82.90	317,507.00
EURAZEO	913	62.86	57,391.18
EXOR SPA	1,714	45.58	78,124.12
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,882	74.06	139,380.92
MEDIOBANCA SPA	11,670	9.32	108,764.40
WENDEL	750	111.40	83,550.00
AEGON NV	38,139	5.54	211,518.89
AGEAS	4,044	39.67	160,425.48
ALLIANZ SE-REG	9,638	156.10	1,504,491.80
ASSICURAZIONI GENERALI	25,718	17.25	443,635.50
AXA	40,412	24.05	971,908.60
CNP ASSURANCES	3,530	13.10	46,260.65

DELTA LLOYD NV	3,600	7.59	27,327.60
HANNOVER RUECK SE-REG	1,355	100.95	136,787.25
MAPFRE SA	20,814	2.68	55,802.33
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,776	177.80	671,372.80
NN GROUP NV	4,480	28.55	127,904.00
SAMPO OYJ-A SHS	9,639	44.45	428,453.55
SCOR SE	2,612	33.67	87,959.10
UNIPOLSAI SPA	12,650	2.23	28,260.10
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	6,680	25.43	169,872.40
IMMOEAST AG-TEMPORARY	16,150	-	-
IMMOFINANZ AG-TEMPORARY	13,000	-	-
VONOVIA SE	10,088	29.33	295,931.48
AMADEUS IT HOLDING SA	9,610	40.05	384,880.50
ATOS SE	1,650	73.00	120,450.00
CAP GEMINI SA	3,209	82.45	264,582.05
DASSAULT SYSTEMES SA	3,080	70.18	216,154.40
GEMALTO	1,850	63.21	116,938.50
SAP SE	20,712	69.92	1,448,183.04
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2,930	47.75	139,907.50
ALCATEL-LUCENT	55,970	3.38	189,626.36
INGENICO GROUP	1,160	109.25	126,730.00
NOKIA OYJ	79,936	6.22	497,601.60
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	67,336	16.97	1,142,691.92
ELISA OYJ	2,505	34.43	86,247.15
ILIAD SA	520	193.80	100,776.00
KONINKLIJKE KPN NV	61,096	3.39	207,298.72
ORANGE S.A.	41,284	15.93	657,654.12
PROXIMUS	3,780	32.00	120,960.00
TELECOM ITALIA SPA	207,723	1.14	237,427.38
TELECOM ITALIA-RSP	125,887	0.93	117,515.51
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	11,110	5.80	64,515.77
TELEFONICA SA	94,689	12.02	1,138,635.22
E.ON SE	40,559	9.89	401,169.06
EDF	6,075	17.79	108,104.62
ENAGAS	4,190	27.49	115,204.05

	ENDESA SA	6,840	19.99	136,731.60	
	ENEL GREEN POWER SPA	43,650	1.85	80,927.10	
	ENEL SPA	145,874	4.22	616,463.52	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	49,221	3.41	167,942.05	
	ENGIE	30,044	16.24	487,914.56	
	FORTUM OYJ	9,825	14.08	138,336.00	
	GAS NATURAL SDG SA	7,722	19.88	153,551.97	
	IBERDROLA SA	115,162	6.47	745,558.78	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	2,610	79.12	206,503.20	
	RWE AG	10,685	12.92	138,103.62	
	SNAM SPA	47,520	4.71	224,009.28	
	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	6,199	17.70	109,753.29	
	TERNA SPA	34,477	4.57	157,697.79	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	9,184	21.36	196,170.24	
	ASML HOLDING NV	7,582	85.14	645,531.48	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	24,715	11.87	293,367.05	
	STMICROELECTRONICS NV	16,783	7.12	119,562.09	
ユーロ小計		5,748,134		74,049,456.37	(9,882,640,447)
英債券	AMEC FOSTER WHEELER PLC	8,850	7.57	66,994.50	
	BG GROUP PLC	71,924	10.57	760,236.68	
	BP PLC	385,938	3.88	1,497,825.37	
	PETROFAC LTD	5,025	8.88	44,647.12	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	82,458	17.62	1,453,322.25	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	51,464	17.75	913,743.32	
	TULLOW OIL PLC	19,950	2.12	42,353.85	
	ANGLO AMERICAN PLC	29,014	6.09	176,956.38	
	ANTOFAGASTA PLC	8,730	5.74	50,153.85	
	BHP BILLITON PLC	45,961	11.40	524,185.20	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	2,850	29.12	82,992.00	
	FRESNILLO PLC	5,160	7.58	39,112.80	
	GLENCORE PLC	240,813	1.19	286,928.68	
	JOHNSON MATTHEY PLC	4,447	25.86	114,999.42	
	MONDI PLC	7,400	14.77	109,298.00	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	2,250	46.15	103,837.50	

REXAM PLC	11,772	5.42	63,804.24
RIO TINTO PLC	27,025	25.06	677,381.62
SOUTH32 LTD	46,811	0.70	33,118.78
ASHTED GROUP PLC	10,920	10.12	110,510.40
BAE SYSTEMS PLC ORD	71,015	4.54	322,408.10
BUNZL PLC	7,276	18.33	133,369.08
COBHAM PLC	23,225	2.95	68,676.32
IMI PLC	6,116	9.88	60,456.66
MEGGITT PLC	20,865	4.82	100,611.03
MELROSE INDUSTRIES PLC	20,907	2.69	56,281.64
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	38,295	6.88	263,469.60
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENTITL-C(N)	3,549,946	0.00	3,549.94
SMITHS GROUP PLC	8,813	10.02	88,306.26
TRAVIS PERKINS PLC	4,350	19.39	84,346.50
WEIR GROUP PLC/THE	3,880	10.91	42,330.80
WOLSELEY PLC	5,004	38.57	193,004.28
AGGREKO PLC	6,006	9.90	59,459.40
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,275	9.97	62,561.75
CAPITA PLC	15,309	12.75	195,189.75
EXPERIAN PLC	20,558	11.27	231,688.66
G4S PLC	34,639	2.51	86,943.89
INTERTEK GROUP PLC	3,545	26.06	92,382.70
EASYJET PLC	3,840	17.66	67,814.40
ROYAL MAIL PLC	14,990	4.48	67,245.14
GKN PLC	33,065	2.93	97,045.77
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	20,100	6.53	131,353.50
BURBERRY GROUP PLC	9,334	13.51	126,102.34
PERSIMMON PLC	5,870	20.24	118,808.80
TAYLOR WIMPEY PLC	66,170	1.96	129,891.71
CARNIVAL PLC	3,660	35.85	131,211.00
COMPASS GROUP PLC	36,157	11.00	397,727.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	5,768	25.16	145,122.88
MERLIN ENTERTAINME	15,550	3.98	61,935.65
TUI AG-DI	3,393	12.08	40,987.44
WHITBREAD PLC	4,140	49.35	204,309.00



WILLIAM HILL PLC	18,010	3.18	57,271.80
ITV PLC	77,235	2.57	198,493.95
PEARSON PLC	17,749	9.00	159,829.74
REED ELSEVIER PLC	23,666	11.74	277,838.84
SKY PLC	23,224	11.20	260,108.80
WPP PLC	27,154	14.80	401,879.20
DIXONS CARPHONE PLC	22,000	4.58	100,804.00
KINGFISHER PLC	50,397	3.61	182,185.15
MARKS & SPENCER GROUP PLC	34,970	5.17	180,969.75
NEXT PLC	2,987	79.50	237,466.50
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	5,460	6.79	37,100.70
SAINSBURY (J) PLC	23,451	2.69	63,130.09
TESCO PLC	177,834	1.90	338,951.60
WM MORRISON SUPERMARKETS	37,925	1.75	66,368.75
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	7,795	33.99	264,952.05
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	39,367	38.43	1,513,070.64
COCA-COLA HBC AG-CDI	5,000	15.60	78,000.00
DIAGEO PLC	53,032	18.58	985,599.72
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	20,012	34.99	700,219.88
SABMILLER PLC	20,411	39.40	804,193.40
TATE & LYLE PLC	12,180	5.90	71,862.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	13,605	62.49	850,176.45
UNILEVER PLC	27,027	29.48	796,755.96
SMITH & NEPHEW PLC	19,376	11.47	222,242.72
ASTRAZENECA PLC	26,693	40.69	1,086,271.63
GLAXOSMITHKLINE PLC	102,721	13.69	1,406,250.49
SHIRE PLC	12,425	46.41	576,644.25
BARCLAYS PLC	348,481	2.51	875,558.51
HSBC HOLDINGS PLC	406,751	5.18	2,106,970.18
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,208,196	0.77	940,338.94
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	57,230	3.30	188,859.00
STANDARD CHARTERED PLC	54,009	7.44	401,934.97
3I GROUP PLC	20,499	5.03	103,212.46
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	22,730	3.51	79,873.22
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,720	14.38	82,253.60

	ICAP PLC	12,270	4.37	53,644.44
	INVESTEC PLC	13,185	5.51	72,715.27
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	6,577	25.47	167,516.19
	SCHRODERS PLC	2,231	29.61	66,059.91
	ADMIRAL GROUP PLC	4,925	16.57	81,607.25
	AVIVA PLC	83,965	4.80	403,535.79
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	29,333	3.92	115,132.02
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	127,081	2.56	325,962.76
	OLD MUTUAL PLC	104,159	2.12	221,546.19
	PRUDENTIAL PLC	54,122	15.35	830,772.70
	RSA INSURANCE GROUP PLC	24,738	4.15	102,662.70
	ST JAMES'S PLACE PLC	11,000	9.23	101,585.00
	STANDARD LIFE PLC	40,716	4.22	172,106.53
	SAGE GROUP PLC/THE	22,090	5.40	119,286.00
	BT GROUP PLC	177,832	4.50	800,599.66
	INMARSAT PLC	10,010	9.76	97,697.60
	VODAFONE GROUP PLC	559,658	2.18	1,220,054.44
	CENTRICA PLC	100,135	2.34	235,217.11
	NATIONAL GRID PLC	78,695	9.34	735,011.30
	SEVERN TRENT PLC	5,493	22.70	124,691.10
	SSE PLC	21,427	15.78	338,118.06
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	16,215	9.94	161,177.10
	ARM HOLDINGS PLC	30,650	10.73	328,874.50
英債券小計		9,698,652		34,590,205.51 (6,417,866,730)
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	7,955	15.46	122,984.30
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	140	405.00	56,700.00
	GIVAUDAN-REG	213	1,767.00	376,371.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	10,389	56.25	584,381.25
	SIKA AG-BR	47	3,269.00	153,643.00
	SYNGENTA AG-REG	1,978	335.10	662,827.80
	ABB LTD-REG	46,245	18.15	839,346.75
	GEBERIT AG-REG	895	334.30	299,198.50
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	360	156.30	56,268.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,090	154.10	167,969.00

	SULZER AG-REG	520	100.60	52,312.00	
	ADECCO SA-REG	3,557	72.90	259,305.30	
	SGS SA-REG	103	1,861.00	191,683.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,020	135.00	137,700.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	11,339	83.70	949,074.30	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	610	390.60	238,266.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	930	74.60	69,378.00	
	DUFRY AG-REG	800	119.50	95,600.00	
	ARYZTA AG	2,110	47.95	101,174.50	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	25	6,025.00	150,625.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	2	73,000.00	146,000.00	
	NESTLE SA-REG	68,323	75.50	5,158,386.50	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,160	134.70	156,252.00	
	ACTELION LTD-REG	2,000	132.30	264,600.00	
	LONZA GROUP AG-REG	1,250	142.50	178,125.00	
	NOVARTIS AG-REG	48,783	90.40	4,409,983.20	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	14,878	264.30	3,932,255.40	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	31,898	24.22	772,569.56	
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,210	49.12	255,915.20	
	PARGESA HOLDING SA-BR	655	63.05	41,297.75	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	370	351.25	129,962.50	
	UBS GROUP AG-REG	77,032	20.09	1,547,572.88	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,080	116.90	126,252.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	640	234.00	149,760.00	
	SWISS RE AG	7,729	89.80	694,064.20	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,131	259.80	813,433.80	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,370	77.15	105,695.50	
	SWISSCOM AG-REG	494	512.00	252,928.00	
	スイスフラン小計	356,331		24,699,861.19 (3,056,113,825)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	4,320	123.80	534,816.00	
	BOLIDEN AB	4,510	164.10	740,091.00	
	ALFA LAVAL AB	4,660	149.40	696,204.00	
	ASSA ABLOY AB-B	20,910	166.10	3,473,151.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	13,095	224.50	2,939,827.50	

	ATLAS COPCO AB-B SHS	8,620	208.80	1,799,856.00	
	SANDVIK AB	21,690	80.30	1,741,707.00	
	SKANSKA AB-B SHS	7,170	156.90	1,124,973.00	
	SKF AB-B SHARES-B	7,459	151.40	1,129,292.60	
	VOLVO AB-B SHS-B	31,320	89.60	2,806,272.00	
	SECURITAS AB-B SHS	7,249	106.50	772,018.50	
	ELECTROLUX AB - B	4,595	260.30	1,196,078.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	8,480	55.50	470,640.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	19,758	333.00	6,579,414.00	
	ICA GRUPPEN AB	1,450	298.70	433,115.00	
	SWEDISH MATCH AB	4,860	267.40	1,299,564.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	13,015	240.10	3,124,901.50	
	GETINGE AB-B SHS	4,450	214.40	954,080.00	
	NORDEA BANK AB	66,368	98.50	6,537,248.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	31,870	92.85	2,959,129.50	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	31,030	117.60	3,649,128.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	18,520	197.60	3,659,552.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,630	154.00	405,020.00	
	INVESTOR AB-B SHS	9,045	317.80	2,874,501.00	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	5,505	273.90	1,507,819.50	
	ERICSSON LM-B SHS	64,235	83.00	5,331,505.00	
	HEXAGON AB-B SHS	4,880	283.50	1,383,480.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,370	466.10	638,557.00	
	TELE2 AB-B SHS	6,255	85.25	533,238.75	
	TELIASONERA AB	53,480	44.66	2,388,416.80	
	スウェーデンクローナ小計	482,799		63,683,597.15 (906,854,423)	
ノルウェーク ローネ	SEADRILL LTD	9,735	56.95	554,408.25	
	STATOIL ASA	24,664	143.70	3,544,216.80	
	SUBSEA 7 SA	4,325	69.10	298,857.50	
	NORSK HYDRO A S	30,900	30.51	942,759.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	3,780	380.50	1,438,290.00	
	ORKLA ASA	19,380	69.55	1,347,879.00	
	DNB ASA	22,215	109.50	2,432,542.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,200	128.00	537,600.00	

	TELENOR ASA	15,275	171.70	2,622,717.50	
ノルウェークローネ小計		134,474		13,719,270.55	(197,694,688)
デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,645	314.90	1,777,610.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	5,260	390.40	2,053,504.00	
	ISS A/S	3,100	237.30	735,630.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	90	9,745.00	877,050.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	138	9,925.00	1,369,650.00	
	DSV A/S	3,680	274.00	1,008,320.00	
	PANDORA A/S	2,660	779.00	2,072,140.00	
	CARLSBERG AS-B	2,390	538.00	1,285,820.00	
	COLOPLAST-B	2,545	482.40	1,227,708.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	600	590.50	354,300.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	41,505	373.00	15,481,365.00	
	DANSKE BANK A/S	14,975	197.90	2,963,552.50	
	TRYG A/S	2,575	121.70	313,377.50	
	TDC A/S	14,545	36.76	534,674.20	
デンマーククローネ小計		99,708		32,054,701.70	(573,458,613)
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	5,335	31.79	169,599.65	
	ORIGIN ENERGY LTD	26,670	6.02	160,553.40	
	ORIGIN ENERGY LTD-RTS	15,240	1.47	22,479.00	
	SANTOS LTD	23,715	6.46	153,198.90	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	16,528	31.10	514,020.80	
	WORLEYPARSONS LTD	4,340	7.02	30,466.80	
	ALUMINA LTD	46,512	1.19	55,349.28	
	AMCOR LIMITED	26,490	13.61	360,528.90	
	BHP BILLITON LTD	67,716	24.59	1,665,136.44	
	BORAL LTD	17,115	5.49	93,961.35	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	29,665	2.58	76,535.70	
	ILUKA RESOURCES LTD	8,735	6.71	58,611.85	
	INCITEC PIVOT LTD	31,550	3.97	125,253.50	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	10,985	18.30	201,025.50	
	NEWCREST MINING LTD	14,929	13.85	206,766.65	
	ORICA LIMITED	6,935	16.73	116,022.55	

RIO TINTO LTD	9,928	53.39	530,055.92
SOUTH32 LTD	70,856	1.53	108,409.68
CIMIC GROUP LTD	1,867	26.50	49,475.50
BRAMBLES LTD	29,708	10.17	302,130.36
SEEK LTD	8,040	12.93	103,957.20
ASCIANO LTD	24,833	7.85	194,939.05
AURIZON HOLDINGS LTD	46,150	5.09	234,903.50
QANTAS AIRWAYS LTD	13,965	3.86	53,904.90
SYDNEY AIRPORT	13,366	6.47	86,478.02
TRANSURBAN GROUP	43,195	10.34	446,636.30
ARISTOCRAT LEISURE LTD	10,000	9.17	91,700.00
CROWN RESORTS LTD	6,745	11.83	79,793.35
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	970	39.09	37,917.30
TABCORP HOLDINGS LTD	15,336	4.96	76,066.56
TATTS GROUP LTD	37,700	4.00	150,800.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	8,720	3.81	33,223.20
WESFARMERS LTD	23,695	41.68	987,607.60
WOOLWORTHS LTD	26,272	27.81	730,624.32
COCA-COLA AMATIL LTD	15,150	9.12	138,168.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	14,070	7.20	101,304.00
TREASURY WINE ESTATES LTD-RTS	1,876	1.59	2,982.84
COCHLEAR LTD	1,277	84.20	107,523.40
HEALTHSCOPE LTD	19,970	2.67	53,319.90
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,935	60.20	176,687.00
SONIC HEALTHCARE LTD	9,830	18.78	184,607.40
CSL LTD	10,362	90.39	936,621.18
AUST AND NZ BANKING GROUP	58,319	28.90	1,685,419.10
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	8,120	13.55	110,026.00
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	10,478	10.70	112,114.60
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	35,387	77.35	2,737,184.45
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	55,493	32.44	1,800,192.92
WESTPAC BANKING CORP	65,801	31.56	2,076,679.56
WESTPAC BANKING CORP-RTS(N)	2,860	5.15	14,729.00
ASX LTD	4,995	41.11	205,344.45
MACQUARIE GROUP LTD	6,404	83.24	533,068.96

	AMP LTD	62,647	5.95	372,749.65	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	50,298	5.54	278,650.92	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	62,000	2.44	151,280.00	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	27,200	13.50	367,200.00	
	SUNCORP GROUP LTD	29,020	13.30	385,966.00	
	COMPUTERSHARE LTD	11,490	10.93	125,585.70	
	TELSTRA CORPORATION LTD	93,164	5.58	519,855.12	
	AGL ENERGY LTD	15,301	16.41	251,089.41	
	AUSNET SERVICES	29,110	1.45	42,355.05	
豪ドル小計		1,447,363		21,778,837.64	(1,906,737,235)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	17,130	7.39	126,590.70	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	24,545	5.34	131,070.30	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	45,157	3.33	150,372.81	
	CONTACT ENERGY LIMITED	9,430	5.13	48,375.90	
ニュージーランドドル小計		96,262		456,409.71	(37,348,006)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	56,708	108.20	6,135,805.60	
	NWS HOLDINGS LTD	28,500	11.18	318,630.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	25,000	15.52	388,000.00	
	MTR CORP	34,000	35.45	1,205,300.00	
	LI & FUNG LTD	138,000	6.18	852,840.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	29,000	28.80	835,200.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	14,500	27.85	403,825.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	50,000	26.95	1,347,500.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	16,800	11.00	184,800.00	
	SANDS CHINA LTD	49,800	28.10	1,399,380.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	28,000	7.13	199,640.00	
	SJM HOLDINGS LTD	48,000	6.43	308,640.00	
	WYNN MACAU LTD	35,800	10.94	391,652.00	
	WH GROUP LTD	63,500	4.52	287,020.00	
	BANK OF EAST ASIA	21,640	29.45	637,298.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	77,000	26.05	2,005,850.00	
HANG SENG BANK LTD	16,300	144.70	2,358,610.00		
FIRST PACIFIC CO	44,250	5.30	234,525.00		

	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	23,500	205.40	4,826,900.00	
	AIA GROUP LTD	254,200	46.75	11,883,850.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	54,208	58.00	3,144,064.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	57,000	19.90	1,134,300.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	24,402	51.20	1,249,382.40	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	15,000	34.75	521,250.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	16,950	23.25	394,087.50	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	134,666	8.42	1,133,887.72	
	SINO LAND CO	63,050	12.98	818,389.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	36,480	106.90	3,899,712.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	13,017	91.65	1,193,008.05	
	SWIRE PROPERTIES LTD	23,200	23.80	552,160.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	27,800	47.30	1,314,940.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	19,600	36.30	711,480.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	67,000	9.41	630,470.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	15,000	71.20	1,068,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	42,500	68.95	2,930,375.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	135,569	15.90	2,155,547.10	
	POWER ASSETS HOLDINGS	27,500	76.80	2,112,000.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	4,200	55.00	231,000.00	
	香港ドル小計	1,831,640		61,399,318.37	(959,671,346)
シンガポールド ル	KEPPEL CORP LTD	34,660	7.25	251,285.00	
	NOBLE GROUP LTD	82,854	0.54	44,741.16	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	21,000	3.70	77,700.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	16,000	2.46	39,360.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,000	3.30	108,900.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	42,010	1.26	53,142.65	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,000	3.09	142,140.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	12,800	11.16	142,848.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	102,000	0.83	84,660.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	32,550	3.97	129,223.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,000	32.40	64,800.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	130,000	0.39	50,700.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	44,700	3.18	142,146.00	



	DBS GROUP HOLDINGS LTD	36,715	18.00	660,870.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	62,240	9.47	589,412.80	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	29,200	20.40	595,680.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	20,000	7.66	153,200.00	
	CAPITALAND LTD	46,100	3.14	144,754.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	10,000	8.40	84,000.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	60,000	2.35	141,000.00	
	UOL GROUP LTD	12,250	6.84	83,790.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	164,980	4.02	663,219.60	
シンガポールドル小計		1,041,059		4,447,572.71 (385,248,748)	
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	9,770	22.13	216,210.10	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	78	1,033.00	80,574.00	
	TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	18,340	232.40	4,262,216.00	
	BANK HAPOALIM BM	27,725	20.95	580,838.75	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	29,355	14.89	437,095.95	
	NICE SYSTEMS LTD	1,385	229.60	317,996.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	48,790	8.28	403,981.20	
イスラエルシュケル小計		135,443		6,298,912.00 (195,833,174)	
合 計		28,699,176		75,505,109,512 (75,505,109,512)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	7,010	134,451.80	
		AMERICAN TOWER CORP	8,759	868,630.03	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	20,020	203,803.60	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,745	501,923.25	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,417	416,429.79	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	3,340	86,071.80	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,200	171,842.00	

		COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	3,071	61,604.26	
		CROWN CASTLE INTL CORP	7,300	622,836.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,235	237,416.65	
		DUKE REALTY CORPORATION	6,875	144,100.00	
		EQUINIX INC	1,177	347,026.68	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	7,970	633,375.90	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,400	322,350.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	2,220	179,331.60	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,415	202,345.00	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	12,545	357,407.05	
		HCP INC	10,125	391,230.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	14,569	240,971.26	
		IRON MOUNTAIN INC	3,285	102,032.10	
		KIMCO REALTY CORPORATION	8,795	231,484.40	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	108,519.18	
		MACERICH CO/THE	3,250	273,357.50	
		PLUM CREEK TIMBER CO	3,408	139,216.80	
		PROLOGIS INC	10,732	461,797.96	
		PUBLIC STORAGE	3,089	710,161.10	
		REALTY INCOME CORP	5,400	269,460.00	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	2,355	157,973.40	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	6,674	1,355,088.96	
		SL GREEN REALTY CORP	2,260	265,956.80	
		UDR INC	5,820	207,017.40	
		VENTAS INC	6,675	367,992.75	
		VEREIT INC	18,644	157,914.68	
		VORNADO REALTY TRUST	3,321	330,539.13	
		WELLTOWER INC	6,990	478,675.20	
		WEYERHAEUSER CO	10,286	308,888.58	
米ドル小計			223,490	12,049,222.61	(1,459,642,826)
加ドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2,340	49,888.80	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,380	88,860.20	
加ドル小計			5,720	138,749.00	(12,751,033)

ユーロ	投資証券	FONCIERE DES REGIONS	595	49,985.95	
		GECINA SA	580	67,280.00	
		ICADE	685	45,004.50	
		KLEPIERRE	3,142	134,917.48	
		UNIBAIL-RODAMCO SE-NA	2,070	526,194.00	
ユーロ小計			7,072	823,381.93	(109,888,552)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	21,701	187,822.15	
		HAMMERSON PLC	15,295	98,652.75	
		INTU PROPERTIES PLC	19,860	70,145.52	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	16,229	217,306.31	
		SEGRO PLC	15,053	67,271.85	
英ポンド小計			88,138	641,198.58	(118,967,984)
豪ドル	投資証券	APA GROUP	26,406	242,935.20	
		DEXUS PROPERTY GROUP	18,487	142,904.51	
		FEDERATION CENTRES	72,862	211,299.80	
		GOODMAN GROUP	43,442	260,652.00	
		GPT GROUP	33,165	157,202.10	
		LEND LEASE GROUP	12,197	156,731.45	
		MIRVAC GROUP	86,525	154,879.75	
		SCENTRE GROUP	116,381	479,489.72	
		STOCKLAND	55,310	219,027.60	
		WESTFIELD CORP	41,745	424,964.10	
豪ドル小計			506,520	2,450,086.23	(214,505,049)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	52,000	2,449,200.00	
香港ドル小計			52,000	2,449,200.00	(38,280,996)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	39,000	97,500.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	40,000	56,400.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	41,800	85,690.00	
		SUNTEC REIT	45,000	75,375.00	
シンガポールドル小計			165,800	314,965.00	(27,282,268)
				1,981,318,708	

合計	(1,981,318,708)
----	-----------------

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 602銘柄	97.1%		62.2%
	投資証券 36銘柄		2.9%	1.9%
加ドル	株式 89銘柄	99.5%		3.6%
	投資証券 2銘柄		0.5%	0.0%
ユーロ	株式 234銘柄	98.9%		12.8%
	投資証券 5銘柄		1.1%	0.1%
英ポンド	株式 109銘柄	98.2%		8.3%
	投資証券 5銘柄		1.8%	0.2%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%		3.9%
スウェーデンクローナ	株式 30銘柄	100.0%		1.2%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%		0.3%
デンマーククローネ	株式 14銘柄	100.0%		0.7%
豪ドル	株式 60銘柄	89.9%		2.5%
	投資証券 10銘柄		10.1%	0.3%
ニュージーランドドル	株式 4銘柄	100.0%		0.0%
香港ドル	株式 38銘柄	96.2%		1.2%
	投資証券 1銘柄		3.8%	0.0%
シンガポールドル	株式 22銘柄	93.4%		0.5%
	投資証券 4銘柄		6.6%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 7銘柄	100.0%		0.3%

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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

### 貸借対照表

（単位：円）

	平成26年10月27日現在	平成27年10月26日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	4,503,191	14,368,244
コール・ローン	126,763,079	88,072,934
株式	1,701,802,775	2,372,466,980
投資証券	39,974,456	61,162,352
派生商品評価勘定	5,365,583	31,616,542
未収入金	8,687	1,511,079
未収配当金	1,692,134	2,444,843
未収利息	175	142
差入委託証拠金	40,678,834	16,863,167
流動資産合計	1,920,788,914	2,588,506,283
資産合計	1,920,788,914	2,588,506,283
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	32,551,015	17,879,003
未払解約金	2,358,164	1,127,977
流動負債合計	34,909,179	19,006,980
負債合計	34,909,179	19,006,980
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,603,941,396	2,027,129,180
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	281,938,339	542,370,123
元本等合計	1,885,879,735	2,569,499,303
純資産合計	1,885,879,735	2,569,499,303
負債純資産合計	1,920,788,914	2,588,506,283

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## (貸借対照表に関する注記)

		平成26年10月27日現在	平成27年10月26日現在
1.	期首	平成25年10月29日	平成26年10月28日
	期首元本額	1,469,650,974円	1,603,941,396円
	期首からの追加設定元本額	388,409,868円	745,545,630円
	期首からの一部解約元本額	254,119,446円	322,357,846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)	417,033,345円	858,947,438円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	12,816,904円	11,265,627円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	10,471,331円	9,250,832円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	15,567,280円	13,922,681円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	19,496,244円	16,733,236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)	98,307,055円	62,912,269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)	78,259,728円	71,063,091円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	47,439,659円	47,271,688円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	135,447,065円	141,923,282円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	187,856,619円	199,132,305円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	186,700,421円	199,129,142円
	インデックスファンド海外株式(ヘッジあり)	394,545,745円	395,577,589円
	計	1,603,941,396円	2,027,129,180円
2.	受益権の総数	1,603,941,396口	2,027,129,180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)

金融商品の状況に関する事項

	自 平成25年10月29日 至 平成26年10月27日	自 平成26年10月28日 至 平成27年10月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年10月27日現在	平成27年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

（平成26年10月27日現在）

## 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	98,083,993
投資証券	4,267,214
合計	102,351,207

（平成27年10月26日現在）

## 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	89,617,302
投資証券	3,487,704
合計	93,105,006

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（平成26年10月27日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	160,758,275	-	160,206,129	552,146
合計		160,758,275	-	160,206,129	552,146

（平成27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	141,672,335	-	151,384,645	9,712,310
	合計	141,672,335	-	151,384,645	9,712,310

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (通貨関連)

(平成26年10月27日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,746,548,694	-	1,773,181,980	26,633,286
	米ドル	1,091,054,418	-	1,115,504,570	24,450,152
	加ドル	75,014,079	-	75,919,470	905,391
	ユーロ	226,963,298	-	227,026,290	62,992
	英ポンド	153,058,408	-	154,053,680	995,272
	スイスフラン	73,559,801	-	73,776,550	216,749
	スウェーデンクローナ	11,163,341	-	11,041,540	121,801
	ノルウェークローネ	8,447,801	-	8,276,900	170,901
	デンマーククローネ	10,142,400	-	10,132,890	9,510
	豪ドル	57,887,586	-	57,919,580	31,994
	香港ドル	25,005,193	-	25,350,070	344,877
	シンガポールドル	10,489,515	-	10,497,930	8,415
イスラエルシケル	3,762,854	-	3,682,510	80,344	
	合計	1,746,548,694	-	1,773,181,980	26,633,286

(平成27年10月26日現在)

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	2,458,861,219	-	2,454,835,990	4,025,229
	米ドル	1,566,311,028	-	1,574,488,210	8,177,182
	加ドル	90,222,795	-	88,695,200	1,527,595
	ユーロ	326,160,242	-	318,981,630	7,178,612
	英ポンド	206,858,340	-	204,456,670	2,401,670
	スイスフラン	99,292,800	-	98,721,970	570,830
	スウェーデンクローナ	27,971,194	-	27,455,660	515,534
	ノルウェークローネ	7,915,462	-	7,852,590	62,872
	デンマーククローネ	17,769,780	-	17,491,690	278,090
	豪ドル	67,270,270	-	67,355,660	85,390
	香港ドル	31,249,754	-	31,418,400	168,646
	シンガポールドル	11,803,531	-	11,924,460	120,929
	イスラエルシケル	6,036,023	-	5,993,850	42,173
合計		2,458,861,219	-	2,454,835,990	4,025,229

## （注）1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

平成26年10月27日現在		平成27年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.1758円	1口当たり純資産額	1.2676円
(1万口当たり純資産額)	(11,758円)	(1万口当たり純資産額)	(12,676円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	437	72.03	31,477.11	
	APACHE CORP	219	46.49	10,181.31	
	BAKER HUGHES INC	290	53.93	15,639.70	
	CABOT OIL & GAS CORP	412	21.10	8,693.20	
	CHENIERE ENERGY INC	200	46.43	9,286.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	438	7.83	3,429.54	
	CHEVRON CORP	1,265	91.24	115,418.60	
	CIMAREX ENERGY CO	120	117.03	14,043.60	
	COLUMBIA PIPELINE GROUP	419	20.94	8,773.86	
	CONCHO RESOURCES INC	126	112.60	14,187.60	
	CONOCOPHILLIPS	785	54.61	42,868.85	
	CONSOL ENERGY INC	243	9.50	2,308.50	
	DEVON ENERGY CORPORATION	254	44.96	11,419.84	
	ENSCO PLC-CL A	227	16.33	3,706.91	
	EOG RESOURCES INC	464	85.43	39,639.52	
	EQT CORP	171	69.44	11,874.24	
	EXXON MOBIL CORP	2,786	82.98	231,182.28	
	FMC TECHNOLOGIES INC	229	33.27	7,618.83	
	HALLIBURTON CO	834	39.21	32,701.14	
	HESS CORP	203	60.87	12,356.61	
	KINDER MORGAN INC	1,154	29.23	33,731.42	
	MARATHON OIL CORP	467	18.30	8,546.10	
	MARATHON PETROLEUM CORP	310	48.59	15,062.90	
NABORS INDUSTRIES LTD	405	10.53	4,264.65		
NATIONAL OILWELL VARCO INC	239	38.81	9,275.59		

NOBLE ENERGY INC	236	35.93	8,479.48
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	491	73.71	36,191.61
PHILLIPS 66	348	83.35	29,005.80
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	86	137.39	11,815.54
RANGE RESOURCES CORP	192	31.32	6,013.44
SCHLUMBERGER LTD	815	78.35	63,855.25
SOUTHWESTERN ENERGY CO	347	11.18	3,879.46
SPECTRA ENERGY CORP	860	28.77	24,742.20
VALERO ENERGY CORP	313	61.75	19,327.75
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	710	10.20	7,242.00
WILLIAMS COS INC	444	39.20	17,404.80
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	166	139.99	23,238.34
AIRGAS INC	131	92.73	12,147.63
ALCOA INC	776	9.14	7,092.64
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	223	54.12	12,068.76
DOW CHEMICAL CO/THE	738	50.32	37,136.16
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	577	60.27	34,775.79
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	188	72.80	13,686.40
ECOLAB INC	222	119.99	26,637.78
FREEPORT-MCMORAN INC	532	12.13	6,453.16
INTERNATIONAL PAPER CO	327	43.85	14,338.95
LYONDELLBASELL INDU-CL A	238	94.16	22,410.08
MONSANTO CO	308	91.36	28,138.88
MOSAIC CO/THE	216	35.62	7,693.92
NUCOR CORP	261	43.50	11,353.50
PPG INDUSTRIES INC	184	103.99	19,134.16
PRAXAIR INC	194	111.75	21,679.50
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	45	245.77	11,059.65
SIGMA-ALDRICH	95	139.75	13,276.25
VULCAN MATERIALS CO	174	94.50	16,443.00
3M CO	404	155.79	62,939.16
AMETEK INC	332	55.86	18,545.52
BOEING CO/THE	426	146.70	62,494.20
CATERPILLAR INC	367	71.75	26,332.25
CUMMINS INC	121	112.84	13,653.64

DANAHER CORP	405	92.82	37,592.10
DEERE & CO	235	80.26	18,861.10
DOVER CORP	132	64.44	8,506.08
EATON CORP PLC	459	54.31	24,928.29
EMERSON ELECTRIC CO	457	48.18	22,018.26
FASTENAL CO	242	38.75	9,377.50
FLUOR CORP	183	46.21	8,456.43
GENERAL DYNAMICS CORP	208	148.28	30,842.24
GENERAL ELECTRIC CO.	6,732	29.51	198,661.32
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	474	103.13	48,883.62
ILLINOIS TOOL WORKS	236	90.59	21,379.24
INGERSOLL-RAND PLC	325	56.58	18,388.50
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	130	39.75	5,167.50
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	72	114.84	8,268.48
LOCKHEED MARTIN CORP	171	219.32	37,503.72
MASCO CORP	473	27.57	13,040.61
NORTHROP GRUMMAN CORP	144	179.83	25,895.52
PACCAR INC	330	54.85	18,100.50
PARKER HANNIFIN CORP	103	103.07	10,616.21
PENTAIR PLC	195	55.79	10,879.05
PRECISION CASTPARTS CORP	80	230.50	18,440.00
RAYTHEON COMPANY	203	117.77	23,907.31
ROCKWELL AUTOMATION INC	164	108.04	17,718.56
ROCKWELL COLLINS INC.	158	86.85	13,722.30
ROPER TECHNOLOGIES INC	134	176.86	23,699.24
SNAP-ON INC	86	164.00	14,104.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	139	106.05	14,740.95
TEXTRON INC	317	39.03	12,372.51
TRANSDIGM GROUP INC	64	217.62	13,927.68
UNITED TECHNOLOGIES CORP	579	100.62	58,258.98
WABTEC CORP	153	83.20	12,729.60
WW GRAINGER INC	71	207.85	14,757.35
XYLEM INC	218	36.19	7,889.42
ADT CORP/THE	183	33.69	6,165.27
EQUIFAX INC	131	106.03	13,889.93

NIELSEN HOLDINGS PLC	323	48.27	15,591.21
STERICYCLE INC	119	120.31	14,316.89
TYCO INTERNATIONAL PLC	447	36.95	16,516.65
VERISK ANALYTICS INC	202	81.14	16,391.29
WASTE MANAGEMENT INC	352	53.19	18,722.88
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	155	72.79	11,282.45
CSX CORP	575	28.37	16,312.75
EXPEDITORS INTL WASH INC	230	51.48	11,840.40
FEDEX CORP	167	159.52	26,639.84
NORFOLK SOUTHERN CORP	293	81.00	23,733.00
UNION PACIFIC CORP	562	96.92	54,469.04
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	447	106.80	47,739.60
BORGWARNER INC	252	43.66	11,002.32
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	297	85.06	25,262.82
FORD MOTOR COMPANY	2,353	15.67	36,871.51
GENERAL MOTORS CORP	924	35.95	33,217.80
HARLEY-DAVIDSON INC	196	48.20	9,447.20
JOHNSON CONTROLS INC	449	45.01	20,209.49
LEAR CORP	113	120.94	13,666.22
TESLA MOTORS INC	53	209.09	11,081.77
HANESBRANDS INC	468	27.06	12,664.08
JARDEN CORP	282	46.51	13,115.82
MATTEL INC	345	24.74	8,535.30
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	171	38.53	6,588.63
MOHAWK INDUSTRIES INC	72	195.48	14,074.56
NEWELL RUBBERMAID INC	430	42.95	18,468.50
NIKE INC -CL B	437	130.53	57,041.61
POLARIS INDUSTRIES INC	85	110.33	9,378.05
VF CORP	281	63.75	17,913.75
WHIRLPOOL CORP	73	145.90	10,650.70
CARNIVAL CORP	296	53.58	15,859.68
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	21	649.72	13,644.12
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	509	24.56	12,501.04
LAS VEGAS SANDS CORP	266	49.19	13,084.54
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	253	75.29	19,049.63

MCDONALD'S CORP	612	112.59	68,905.08
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	167	97.99	16,364.33
STARBUCKS CORP	956	62.61	59,855.16
STARWOOD HOTELS & RESORTS	156	67.61	10,547.16
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	163	76.07	12,399.41
WYNN RESORTS LTD	54	67.60	3,650.40
YUM! BRANDS INC	248	72.89	18,076.72
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	294	44.49	13,080.06
CHARTER COMMUNICATION-A	80	183.00	14,640.00
COMCAST CORP-CLASS A	1,359	61.98	84,230.82
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	296	62.35	18,455.60
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	414	27.81	11,513.34
DISH NETWORK CORP-A	157	62.43	9,801.51
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	747	42.54	31,777.38
LIBERTY MEDIA CORP-C	341	38.44	13,108.04
NEWS CORP - CLASS A	521	15.00	7,815.00
OMNICOM GROUP	283	73.74	20,868.42
THE WALT DISNEY CO.	1,083	113.09	122,476.47
TIME WARNER CABLE	180	185.19	33,334.20
TIME WARNER INC	529	73.27	38,759.83
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	1,319	30.11	39,715.09
VIACOM INC-CLASS B	310	50.34	15,605.40
AMAZON.COM INC	265	599.03	158,742.95
AUTOZONE INC	29	762.24	22,104.96
BED BATH & BEYOND INC	154	59.21	9,118.34
CARMAX INC	202	58.05	11,726.10
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	198	65.75	13,018.50
DOLLAR TREE INC	201	62.53	12,568.53
GAP INC/THE	227	26.95	6,117.65
GENUINE PARTS CO	202	89.19	18,016.38
HOME DEPOT INC	840	124.61	104,672.40
KOHL'S CORP	178	44.06	7,842.68
L BRANDS INC	196	93.88	18,400.48
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	396	27.99	11,084.04
LOWE'S COS INC	620	73.55	45,601.00

MACY'S INC	215	47.97	10,313.55
NETFLIX INC	282	100.04	28,211.28
NORDSTROM INC	117	64.99	7,603.83
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	86	260.03	22,362.58
PRICELINE GROUP INC/THE	33	1,366.49	45,094.17
ROSS STORES INC	246	49.66	12,216.36
STAPLES INC	489	12.61	6,166.29
TARGET CORP	387	72.94	28,227.78
TIFFANY & CO	125	78.61	9,826.25
TJX COMPANIES INC	561	71.76	40,257.36
TRACTOR SUPPLY COMPANY	146	90.43	13,202.78
COSTCO WHOLESALE CORP	280	155.74	43,607.20
CVS HEALTH CORP	717	103.95	74,532.15
KROGER CO	520	37.82	19,666.40
SYSCO CORP	388	41.76	16,202.88
WAL-MART STORES INC	1,027	58.30	59,874.10
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	556	89.96	50,017.76
WHOLE FOODS MARKET INC	230	32.28	7,424.40
ALTRIA GROUP INC	1,255	61.05	76,617.75
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	372	46.89	17,443.08
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	152	108.48	16,488.96
BUNGE LTD	139	79.41	11,037.99
COCA-COLA CO/THE	2,783	42.79	119,084.57
COCA-COLA ENTERPRISES	292	51.51	15,040.92
CONAGRA FOODS INC	299	41.28	12,342.72
CONSTELLATION BRANDS INC-A	154	136.20	20,974.80
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	242	89.89	21,753.38
GENERAL MILLS INC	515	58.33	30,039.95
HERSHEY CO/THE	171	95.67	16,359.57
JM SMUCKER CO/THE	124	118.27	14,665.48
KELLOGG CO	224	71.70	16,060.80
KRAFT HEINZ CO/THE	359	77.98	27,994.82
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	135	81.12	10,951.20
MOLSON COORS BREWING CO -B	175	88.48	15,484.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,119	46.53	52,067.07



MONSTER BEVERAGE CORP	126	141.58	17,839.08
PEPSICO INC	945	102.43	96,796.35
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,047	89.63	93,842.61
REYNOLDS AMERICAN INC	508	48.89	24,836.12
TYSON FOODS INC-CL A	262	47.44	12,429.28
CHURCH & DWIGHT CO INC	175	87.81	15,366.75
CLOROX COMPANY	124	123.25	15,283.00
COLGATE-PALMOLIVE CO	549	68.94	37,848.06
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	157	84.21	13,220.97
KIMBERLY-CLARK CORP	251	121.24	30,431.24
PROCTER & GAMBLE CO	1,818	77.03	140,040.54
ABBOTT LABORATORIES	962	43.60	41,943.20
AETNA INC	237	105.89	25,095.93
AMERISOURCEBERGEN CORP	231	93.13	21,513.03
ANTHEM INC	171	140.95	24,102.45
BAXTER INTERNATIONAL INC	302	35.40	10,690.80
BECTON DICKINSON AND CO	134	140.22	18,789.48
BOSTON SCIENTIFIC CORP	753	16.73	12,597.69
CARDINAL HEALTH INC	229	80.14	18,352.06
CERNER CORP	231	64.63	14,929.53
CIGNA CORP	186	132.54	24,652.44
CR BARD INC	90	179.42	16,147.80
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	126	75.94	9,568.44
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	274	58.76	16,100.24
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	101	149.88	15,137.88
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	463	85.11	39,405.93
HCA HOLDINGS INC	200	68.98	13,796.00
HENRY SCHEIN INC	132	149.92	19,789.44
HUMANA INC	122	168.20	20,520.40
INTUITIVE SURGICAL INC	22	500.03	11,000.66
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	108	111.95	12,090.60
MCKESSON CORP	148	186.96	27,670.08
MEDTRONIC PLC	903	73.69	66,542.07
QUEST DIAGNOSTICS	200	64.84	12,968.00
ST JUDE MEDICAL INC	181	62.86	11,377.66

STRYKER CORP	270	94.44	25,498.80
UNITEDHEALTH GROUP INC	608	115.92	70,479.36
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	100	115.95	11,595.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	141	77.26	10,893.66
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	160	94.56	15,129.60
ABBVIE INC	1,097	50.34	55,222.98
AGILENT TECHNOLOGIES INC	248	37.11	9,203.28
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	182	171.15	31,149.30
ALLERGAN PLC	277	268.55	74,388.35
AMGEN INC	549	155.75	85,506.75
BAXALTA INC	302	33.41	10,089.82
BIOGEN INC	149	276.99	41,271.51
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	137	104.14	14,267.18
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,060	65.16	69,069.60
CELGENE CORP	510	120.08	61,240.80
ELI LILLY & CO	637	78.31	49,883.47
ENDO INTERNATIONAL PLC	173	56.60	9,791.80
GILEAD SCIENCES INC	949	107.99	102,482.51
ILLUMINA INC	91	147.43	13,416.13
INCYTE CORP	125	110.02	13,752.50
JOHNSON & JOHNSON	1,851	100.31	185,673.81
MALLINCKRODT PLC	104	65.75	6,838.00
MERCK & CO. INC.	1,901	52.88	100,524.88
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	38	304.27	11,562.26
MYLAN NV	238	40.96	9,748.48
PERRIGO CO PLC	102	150.57	15,358.14
PFIZER INC	4,214	34.05	143,486.70
REGENERON PHARMACEUTICALS	54	536.70	28,981.80
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	253	126.47	31,996.91
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	145	114.37	16,583.65
WATERS CORP	72	124.27	8,947.44
ZOETIS INC	461	42.54	19,610.94
BANK OF AMERICA CORP	7,053	16.52	116,515.56
BB&T CORP	462	37.66	17,398.92
CITIGROUP INC	2,039	53.64	109,371.96

COMERICA INC	247	42.89	10,593.83
FIFTH THIRD BANCORP	940	19.11	17,963.40
JPMORGAN CHASE & CO	2,480	63.87	158,397.60
KEYCORP	1,033	13.52	13,966.16
M & T BANK CORP	105	122.60	12,873.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	332	91.24	30,291.68
REGIONS FINANCIAL CORP	1,381	9.45	13,050.45
SUNTRUST BANKS INC	356	41.75	14,863.00
US BANCORP	1,136	42.62	48,416.32
WELLS FARGO & CO	3,266	54.75	178,813.50
AFFILIATED MANAGERS GROUP	74	181.71	13,446.54
AMERICAN EXPRESS CO	585	74.59	43,635.15
AMERIPRISE FINANCIAL INC	216	116.08	25,073.28
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	788	42.25	33,293.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	784	137.78	108,019.52
BLACKROCK INC	91	340.79	31,011.89
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	351	81.12	28,473.12
CME GROUP INC	220	93.95	20,669.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	310	57.10	17,701.00
FRANKLIN RESOURCES INC	252	40.18	10,125.36
GOLDMAN SACHS GROUP INC	250	185.50	46,375.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	62	248.80	15,425.60
INVESCO LTD	383	33.90	12,983.70
LEUCADIA NATIONAL CORP	546	20.20	11,029.20
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	208	95.39	19,841.12
MOODY'S CORP	165	100.50	16,582.50
MORGAN STANLEY	936	32.62	30,532.32
NORTHERN TRUST CORP	188	69.17	13,003.96
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	232	53.37	12,381.84
SCHWAB (CHARLES) CORP	816	30.43	24,830.88
STATE STREET CORP	323	67.14	21,686.22
T ROWE PRICE GROUP INC	275	74.39	20,457.25
VOYA FINANCIAL INC	316	40.47	12,788.52
ACE LTD	181	114.83	20,784.23
AFLAC INC	401	63.45	25,443.45

ALLSTATE CORP	272	61.68	16,776.96
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	875	61.28	53,620.00
AON PLC	212	92.49	19,607.88
ARTHUR J GALLAGHER & CO	290	43.56	12,632.40
CHUBB CORP	146	130.58	19,064.68
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	509	49.24	25,063.16
LINCOLN NATIONAL CORP	283	52.34	14,812.22
LOEWS CORP	384	36.70	14,092.80
MARSH & MCLENNAN COS	361	55.30	19,963.30
METLIFE INC	605	50.98	30,842.90
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	394	50.51	19,900.94
PROGRESSIVE CORP	476	33.05	15,731.80
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	374	82.48	30,847.52
TRAVELERS COS INC/THE	210	112.28	23,578.80
UNUM GROUP	310	33.54	10,397.40
XL GROUP PLC	375	38.89	14,583.75
CBRE GROUP INC	357	34.92	12,466.44
ACCENTURE PLC-CL A	400	107.99	43,196.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	493	34.90	17,205.70
ADOBE SYSTEMS INC	311	87.86	27,324.46
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	196	74.08	14,519.68
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	56	295.87	16,568.72
ALPHABET INC-CL A	192	719.33	138,111.36
ALPHABET INC-CL C	206	702.00	144,612.00
AUTODESK INC	212	52.39	11,106.68
AUTOMATIC DATA PROCESSING	384	90.53	34,763.52
CA INC	302	27.75	8,380.50
CITRIX SYSTEMS INC	145	81.14	11,765.30
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	537	68.83	36,961.71
COMPUTER SCIENCES CORP	169	66.31	11,206.39
EBAY INC	694	28.16	19,543.04
ELECTRONIC ARTS INC	240	74.92	17,980.80
FACEBOOK INC-A	1,432	102.19	146,336.08
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	342	71.23	24,360.66
FISERV INC	210	95.75	20,107.50

FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	82	148.51	12,177.82
INTL BUSINESS MACHINES CORP	598	144.68	86,518.64
INTUIT INC	205	97.94	20,077.70
LINKEDIN CORP - A	79	210.39	16,620.81
MASTERCARD INC-CLASS A	749	99.79	74,742.71
MICROSOFT CORP	5,134	52.87	271,434.58
ORACLE CORP	2,240	38.07	85,276.80
PAYCHEX INC	323	51.78	16,726.55
PAYPAL HOLDINGS INC	694	34.99	24,283.06
RED HAT INC	170	77.39	13,156.30
SALESFORCE.COM INC	502	78.56	39,437.12
SYMANTEC CORP	435	20.64	8,978.40
SYNOPSYS INC	285	49.72	14,170.20
TWITTER INC	365	30.28	11,052.20
VISA INC-CLASS A SHARES	1,252	77.07	96,491.64
WESTERN UNION CO	688	19.76	13,594.88
XEROX CORP	839	10.34	8,675.26
YAHOO! INC	638	33.17	21,162.46
AMPHENOL CORP-CL A	266	53.53	14,238.98
APPLE INC	3,839	119.08	457,148.12
CISCO SYSTEMS INC	3,255	29.35	95,534.25
CORNING INC	799	17.60	14,062.40
EMC CORP/MASS	1,267	26.10	33,068.70
F5 NETWORKS INC	66	119.50	7,887.00
HARRIS CORP	186	76.49	14,227.14
HEWLETT-PACKARD CO	1,165	29.03	33,819.95
JUNIPER NETWORKS INC	445	31.49	14,013.05
MOTOROLA SOLUTIONS INC	185	70.48	13,038.80
NETAPP INC	302	34.67	10,470.34
QUALCOMM INC	1,052	60.72	63,882.70
SANDISK CORP	146	78.37	11,442.02
SEAGATE TECHNOLOGY	199	41.15	8,188.85
TE CONNECTIVITY LTD	283	63.86	18,072.38
WESTERN DIGITAL CORP	164	69.34	11,371.76
AT&T INC	4,117	33.74	138,907.58

CENTURYLINK INC	408	28.02	11,432.16
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	263	48.96	12,876.48
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	129	116.08	14,974.32
VERIZON COMMUNICATIONS INC	2,650	46.16	122,324.00
AES CORP	673	11.05	7,436.65
AMERICAN ELECTRIC POWER	298	57.48	17,129.04
CENTERPOINT ENERGY INC	442	18.62	8,230.04
CONSOLIDATED EDISON INC	194	67.04	13,005.76
DOMINION RESOURCES INC/VA	321	73.08	23,458.68
DTE ENERGY COMPANY	186	83.33	15,499.38
DUKE ENERGY CORP	451	73.74	33,256.74
EDISON INTERNATIONAL	284	64.55	18,332.20
ENERGY CORP	134	68.65	9,199.10
EVERSOURCE ENERGY	293	51.72	15,153.96
EXELON CORP	474	29.86	14,153.64
FIRSTENERGY CORP	277	31.67	8,772.59
NEXTERA ENERGY INC	278	104.56	29,067.68
P G & E CORP	280	53.63	15,016.40
PINNACLE WEST CAPITAL	151	65.71	9,922.21
PPL CORP	384	34.18	13,125.12
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	336	42.66	14,333.76
SEMPRA ENERGY	174	101.47	17,655.78
SOUTHERN CO	522	45.81	23,912.82
WEC ENERGY GROUP INC	282	52.81	14,892.42
XCEL ENERGY INC	554	36.44	20,187.76
ALTERA CORPORATION	384	52.57	20,186.88
ANALOG DEVICES INC	191	63.62	12,151.42
APPLIED MATERIALS INC	1,308	16.44	21,503.52
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	186	129.58	24,101.88
BROADCOM CORP-CL A	364	53.13	19,339.32
INTEL CORP	3,200	34.90	111,680.00
LAM RESEARCH CORP	198	74.57	14,764.86
LINEAR TECHNOLOGY CORP	249	46.02	11,458.98
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	310	49.11	15,224.10
MICRON TECHNOLOGY INC	656	17.24	11,309.44

	SKYWORKS SOLUTIONS INC	159	82.55	13,125.45	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	667	58.98	39,339.66	
	XILINX INC	216	47.16	10,186.56	
米ドル小計		204,503		12,516,331.88 (1,516,228,443)	
加ドル	CAMECO CORP	350	19.00	6,650.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	1,078	31.11	33,536.58	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	466	9.91	4,618.06	
	CENOVUS ENERGY INC	666	19.88	13,240.08	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	456	18.21	8,303.76	
	ENBRIDGE INC	584	56.90	33,229.60	
	ENERPLUS CORP	346	6.62	2,290.52	
	HUSKY ENERGY INC	279	21.49	5,995.71	
	IMPERIAL OIL LTD	196	43.78	8,580.88	
	PEMBINA PIPELINE CORP	475	33.94	16,121.50	
	SUNCOR ENERGY INC	940	37.50	35,250.00	
	TRANSCANADA CORP	552	44.90	24,784.80	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	152	38.34	5,827.68	
	AGRIUM INC	154	126.69	19,510.26	
	BARRICK GOLD CORP	873	10.21	8,913.33	
	ELDORADO GOLD CORP	598	5.38	3,217.24	
	FRANCO-NEVADA CORP	307	70.00	21,490.00	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	482	28.83	13,896.06	
	SILVER WHEATON CORP	436	18.97	8,270.92	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	382	8.95	3,418.90	
	BOMBARDIER INC 'B'	1,631	1.52	2,479.12	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	138	43.16	5,956.08	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	509	81.42	41,442.78	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	125	202.17	25,271.25	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	410	70.20	28,782.00	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	199	49.17	9,784.83	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	643	26.11	16,788.73	
	THOMSON REUTERS CORP	289	54.60	15,779.40	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	367	60.98	22,379.66	
	LOBLAW COMPANIES LTD	237	71.18	16,869.66	

	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	203	152.69	30,996.07	
	BANK OF MONTREAL	580	77.53	44,967.40	
	BANK OF NOVA SCOTIA	775	62.05	48,088.75	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	376	101.87	38,303.12	
	NATIONAL BANK OF CANADA	372	42.94	15,973.68	
	ROYAL BANK OF CANADA	920	74.85	68,862.00	
	TORONTO-DOMINION BANK	1,179	54.39	64,125.81	
	CI FINANCIAL CORP	575	31.49	18,106.75	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	1,750	22.44	39,270.00	
	POWER CORP OF CANADA	445	29.68	13,207.60	
	POWER FINANCIAL CORP	525	32.49	17,057.25	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	646	45.17	29,179.82	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	592	46.49	27,522.08	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	332	53.02	17,602.64	
	TELUS CORP	200	44.21	8,842.00	
	FORTIS INC	491	39.44	19,365.04	
	TRANSALTA CORP	960	6.91	6,633.60	
加ドル小計		25,241		970,783.00	(89,214,957)
ユーロ	ENI SPA	2,250	15.53	34,942.50	
	REPSOL SA	1,073	11.57	12,419.97	
	SAIPEM SPA	337	8.17	2,754.97	
	TECHNIP SA	63	47.72	3,006.36	
	TOTAL SA	1,365	45.50	62,107.50	
	AIR LIQUIDE SA	237	115.90	27,468.30	
	AKZO NOBEL	155	65.05	10,082.75	
	BASF SE	585	76.64	44,834.40	
	CRH PLC	865	25.44	22,009.92	
	HEIDELBERGCEMENT AG	173	68.34	11,822.82	
	K+S AG	190	24.29	4,615.10	
	LANXESS AG	140	49.66	6,953.10	
	LINDE AG	167	155.45	25,960.15	
	SOLVAY ET CIE SA -A	57	101.85	5,805.45	
	THYSSENKRUPP AG	421	18.81	7,919.01	
	UMICORE	187	39.00	7,293.93	



UPM-KYMMENE OYJ	507	16.86	8,548.02
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	250	29.99	7,498.75
AIRBUS GROUP SE	352	60.17	21,179.84
ALSTOM	186	28.78	5,354.01
BRENTAG AG	222	53.85	11,954.70
CNH INDUSTRIAL NV	875	6.25	5,468.75
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	364	39.57	14,405.30
KONE OYJ-B	264	38.74	10,227.36
KONINKLIJKE PHILIPS NV	583	23.75	13,846.25
LEGRAND SA	314	50.45	15,841.30
MAN SE	83	94.40	7,835.20
SAFRAN SA	268	70.34	18,851.12
SCHNEIDER ELECTRIC SE	488	54.85	26,766.80
SIEMENS AG-REG	505	90.02	45,460.10
VINCI SA	305	60.12	18,336.60
WARTSILA OYJ ABP	177	37.39	6,618.03
EDENRED	362	17.61	6,374.82
RANDSTAD HOLDING NV	207	52.48	10,863.36
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	814	15.41	12,543.74
ATLANTIA SPA	492	25.49	12,541.08
DEUTSCHE POST AG-REG	736	27.54	20,273.12
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	1,713	8.33	14,269.29
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	305	93.29	28,453.45
CONTINENTAL AG	65	220.90	14,358.50
DAIMLER AG	614	78.71	48,327.94
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	871	13.90	12,106.90
MICHELIN (CGDE)-B	119	90.80	10,805.20
RENAULT SA	154	82.72	12,738.88
VALEO SA	93	142.40	13,243.20
VOLKSWAGEN AG-PFD	100	107.70	10,770.00
ADIDAS AG	187	81.41	15,223.67
CHRISTIAN DIOR SE	63	180.40	11,365.20
HERMES INTERNATIONAL	31	344.30	10,673.30
KERING	44	172.75	7,601.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	178	170.65	30,375.70

ACCOR SA	243	45.09	10,956.87
SODEXO	105	80.67	8,470.35
LAGARDERE S.C.A.	340	26.78	9,105.20
PUBLICIS GROUPE	193	59.91	11,562.63
RELX NV	1,044	15.56	16,249.86
SES	366	28.75	10,522.50
VIVENDI	801	22.49	18,014.49
WOLTERS KLUWER	514	30.46	15,656.44
INDITEX	966	33.75	32,607.33
CARREFOUR SA	401	30.20	12,110.20
KONINKLIJKE AHOLD NV	993	17.84	17,720.08
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	512	107.15	54,860.80
DANONE	325	63.15	20,523.75
HEINEKEN NV	152	80.00	12,160.00
KERRY GROUP PLC-A	177	72.60	12,850.20
PERNOD-RICARD SA	131	106.45	13,944.95
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	189	99.92	18,884.88
L'OREAL	177	173.60	30,727.20
UNILEVER NV-CVA	1,038	41.63	43,211.94
ESSILOR INTERNATIONAL	132	116.45	15,371.40
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	160	78.13	12,500.80
FRESENIUS SE & CO KGAA	318	63.29	20,126.22
BAYER AG	594	116.40	69,141.60
MERCK KGAA	126	84.21	10,610.46
SANOFI	757	92.45	69,984.65
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	5,127	8.11	41,595.35
BANCO DE SABADELL SA	5,299	1.90	10,099.89
BANCO SANTANDER SA	9,162	5.27	48,292.90
BANCO SANTANDER SA-RTS	9,162	0.05	467.26
BNP PARIBAS	797	55.91	44,560.27
CAIXABANK S.A	2,567	3.58	9,212.96
COMMERZBANK AG	980	10.27	10,069.50
CREDIT AGRICOLE SA	708	11.46	8,113.68
ING GROEP NV-CVA	2,460	13.36	32,877.90
INTESA SANPAOLO	10,051	3.21	32,324.01

IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	2,782	-	-
KBC GROEP NV	268	52.63	14,104.84
SOCIETE GENERALE	630	43.30	27,279.00
UNICREDIT SPA	3,109	6.06	18,856.08
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	861	27.75	23,897.05
DEUTSCHE BOERSE AG	241	82.90	19,978.90
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	146	74.06	10,812.76
MEDIOBANCA SPA	857	9.32	7,987.24
AEGON NV	2,522	5.54	13,987.01
AGEAS	414	39.67	16,423.38
ALLIANZ SE-REG	291	156.10	45,425.10
ASSICURAZIONI GENERALI	773	17.25	13,334.25
AXA	1,246	24.05	29,966.30
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	112	177.80	19,913.60
SAMPO OYJ-A SHS	317	44.45	14,090.65
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	512	25.43	13,020.16
VONOVIA SE	441	29.33	12,936.73
AMADEUS IT HOLDING SA	491	40.05	19,664.55
CAP GEMINI SA	173	82.45	14,263.85
SAP SE	626	69.92	43,769.92
NOKIA OYJ	3,280	6.22	20,418.00
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	2,024	16.97	34,347.28
ORANGE S.A.	1,247	15.93	19,864.71
TELECOM ITALIA SPA	11,938	1.14	13,645.13
TELEFONICA SA	2,840	12.02	34,151.00
E.ON SE	1,343	9.89	13,283.61
ENEL SPA	5,990	4.22	25,313.74
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	2,180	3.41	7,438.16
ENGIE	805	16.24	13,073.20
FORTUM OYJ	342	14.08	4,815.36
IBERDROLA SA	4,182	6.47	27,074.26
SNAM SPA	3,128	4.71	14,745.39
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	520	17.70	9,206.60
VEOLIA ENVIRONNEMENT	518	21.36	11,064.48
ASML HOLDING NV	207	85.14	17,623.98

	INFINEON TECHNOLOGIES AG	968	11.87	11,490.16	
	STMICROELECTRONICS NV	664	7.12	4,730.33	
ユーロ小計		137,211		2,298,581.99 (306,768,752)	
英債券	BG GROUP PLC	2,177	10.57	23,010.89	
	BP PLC	11,635	3.88	45,155.43	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,483	17.62	43,762.87	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,556	17.75	27,626.78	
	TULLOW OIL PLC	596	2.12	1,265.30	
	ANGLO AMERICAN PLC	780	6.09	4,757.22	
	ANTOFAGASTA PLC	612	5.74	3,515.94	
	BHP BILLITON PLC	1,694	11.40	19,320.07	
	GLENCORE PLC	10,573	1.19	12,597.72	
	JOHNSON MATTHEY PLC	274	25.86	7,085.64	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	93	46.15	4,291.95	
	RIO TINTO PLC	811	25.06	20,327.71	
	BAE SYSTEMS PLC ORD	1,945	4.54	8,830.30	
	BUNZL PLC	536	18.33	9,824.88	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,174	6.88	8,077.12	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENTITL-C(N)	108,829	0.00	108.82	
	TRAVIS PERKINS PLC	386	19.39	7,484.54	
	WOLSELEY PLC	261	38.57	10,066.77	
	CAPITA PLC	748	12.75	9,537.00	
	EXPERIAN PLC	658	11.27	7,415.66	
	GKN PLC	2,586	2.93	7,589.91	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,325	6.53	8,658.87	
	BURBERRY GROUP PLC	594	13.51	8,024.94	
	PERSIMMON PLC	410	20.24	8,298.40	
	CARNIVAL PLC	202	35.85	7,241.70	
	COMPASS GROUP PLC	1,163	11.00	12,793.00	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	212	25.16	5,333.92	
	WHITBREAD PLC	152	49.35	7,501.20	
	ITV PLC	3,576	2.57	9,190.32	
	PEARSON PLC	514	9.00	4,628.57	
	REED ELSEVIER PLC	1,361	11.74	15,978.14	

SKY PLC	616	11.20	6,899.20
WPP PLC	1,178	14.80	17,434.40
KINGFISHER PLC	2,100	3.61	7,591.50
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,326	5.17	6,862.05
NEXT PLC	112	79.50	8,904.00
TESCO PLC	4,514	1.90	8,603.68
WM MORRISON SUPERMARKETS	1,579	1.75	2,763.25
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	314	33.99	10,672.86
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,188	38.43	45,660.78
DIAGEO PLC	1,604	18.58	29,810.34
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	756	34.99	26,452.44
SABMILLER PLC	618	39.40	24,349.20
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	411	62.49	25,683.39
UNILEVER PLC	818	29.48	24,114.64
SMITH & NEPHEW PLC	824	11.47	9,451.28
ASTRAZENECA PLC	805	40.69	32,759.47
GLAXOSMITHKLINE PLC	3,102	13.69	42,466.38
SHIRE PLC	361	46.41	16,754.01
BARCLAYS PLC	10,524	2.51	26,441.55
HSBC HOLDINGS PLC	13,129	5.18	68,008.22
LLOYDS BANKING GROUP PLC	36,416	0.77	28,342.57
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	1,630	3.30	5,379.00
STANDARD CHARTERED PLC	1,335	7.44	9,935.07
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	425	25.47	10,824.75
AVIVA PLC	2,180	4.80	10,477.08
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	5,314	2.56	13,630.41
OLD MUTUAL PLC	5,652	2.12	12,021.80
PRUDENTIAL PLC	1,637	15.35	25,127.95
RSA INSURANCE GROUP PLC	1,153	4.15	4,784.95
STANDARD LIFE PLC	1,739	4.22	7,350.75
BT GROUP PLC	6,684	4.50	30,091.36
VODAFONE GROUP PLC	16,908	2.18	36,859.44
CENTRICA PLC	2,783	2.34	6,537.26
NATIONAL GRID PLC	2,384	9.34	22,266.56
SEVERN TRENT PLC	309	22.70	7,014.30

	SSE PLC	625	15.78	9,862.50	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	900	9.94	8,946.00	
	ARM HOLDINGS PLC	854	10.73	9,163.42	
英ボンド小計		294,723		1,069,599.39	(198,453,470)
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	232	15.46	3,586.72	
	GIVAUDAN-REG	11	1,767.00	19,437.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	433	56.25	24,356.25	
	SYNGENTA AG-REG	52	335.10	17,425.20	
	ABB LTD-REG	1,901	18.15	34,503.15	
	GEBERIT AG-REG	50	334.30	16,715.00	
	ADECCO SA-REG	242	72.90	17,641.80	
	SGS SA-REG	6	1,861.00	11,166.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	82	135.00	11,070.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	397	83.70	33,228.90	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	29	390.60	11,327.40	
	NESTLE SA-REG	2,155	75.50	162,702.50	
	SONOVA HOLDING AG-REG	102	134.70	13,739.40	
	ACTELION LTD-REG	95	132.30	12,568.50	
	NOVARTIS AG-REG	1,522	90.40	137,588.80	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	471	264.30	124,485.30	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,288	24.22	31,195.36	
	UBS GROUP AG-REG	2,329	20.09	46,789.61	
	BALOISE HOLDING AG - REG	127	116.90	14,846.30	
	SWISS RE AG	277	89.80	24,874.60	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	82	259.80	21,303.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	150	77.15	11,572.50	
スイスフラン小計		12,033		802,123.89	(99,246,788)
スウェーデンク ローナ	ASSA ABLOY AB-B	555	166.10	92,185.50	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	372	224.50	83,514.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	603	208.80	125,906.40	
	SANDVIK AB	1,241	80.30	99,652.30	
	SKANSKA AB-B SHS	682	156.90	107,005.80	
	VOLVO AB-B SHS-B	1,297	89.60	116,211.20	

	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	552	333.00	183,816.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	557	240.10	133,735.70	
	NORDEA BANK AB	1,939	98.50	190,991.50	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	841	92.85	78,086.85	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	813	117.60	95,608.80	
	SWEDBANK AB - A SHARES	709	197.60	140,098.40	
	INVESTOR AB-B SHS	576	317.80	183,052.80	
	ERICSSON LM-B SHS	2,255	83.00	187,165.00	
	TELIASONERA AB	2,792	44.66	124,690.72	
スウェーデンクローナ小計		15,784		1,941,720.97	(27,650,106)
ノルウェークローネ	STATOIL ASA	600	143.70	86,220.00	
	NORSK HYDRO A S	1,642	30.51	50,097.42	
	YARA INTERNATIONAL ASA	199	380.50	75,719.50	
	ORKLA ASA	1,079	69.55	75,044.45	
	DNB ASA	960	109.50	105,120.00	
	TELENOR ASA	666	171.70	114,352.20	
ノルウェークローネ小計		5,146		506,553.57	(7,299,436)
デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	336	314.90	105,806.40	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	8	9,925.00	79,400.00	
	PANDORA A/S	119	779.00	92,701.00	
	CARLSBERG AS-B	110	538.00	59,180.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	1,405	373.00	524,065.00	
	DANSKE BANK A/S	622	197.90	123,093.80	
デンマーククローネ小計		2,600		984,246.20	(17,608,164)
豪ドル	ORIGIN ENERGY LTD	944	6.02	5,682.88	
	SANTOS LTD	807	6.46	5,213.22	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	558	31.10	17,353.80	
	WORLEYPARSONS LTD	285	7.02	2,000.70	
	AMCOR LIMITED	1,260	13.61	17,148.60	
	BHP BILLITON LTD	2,048	24.59	50,360.32	
	NEWCREST MINING LTD	538	13.85	7,451.30	
	ORICA LIMITED	480	16.73	8,030.40	

	RIO TINTO LTD	244	53.39	13,027.16	
	SOUTH32 LTD	1,762	1.53	2,695.86	
	CIMIC GROUP LTD	219	26.50	5,803.50	
	BRAMBLES LTD	1,733	10.17	17,624.61	
	TRANSURBAN GROUP	2,103	10.34	21,745.02	
	CROWN RESORTS LTD	629	11.83	7,441.07	
	TABCORP HOLDINGS LTD	1,958	4.96	9,711.68	
	WESFARMERS LTD	1,006	41.68	41,930.08	
	WOOLWORTHS LTD	691	27.81	19,216.71	
	COCA-COLA AMATIL LTD	768	9.12	7,004.16	
	CSL LTD	341	90.39	30,822.99	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	1,764	28.90	50,979.60	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	1,157	77.35	89,493.95	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,667	32.44	54,077.48	
	WESTPAC BANKING CORP	1,990	31.56	62,804.40	
	WESTPAC BANKING CORP-RTS(N)	86	5.15	442.90	
	ASX LTD	490	41.11	20,143.90	
	MACQUARIE GROUP LTD	288	83.24	23,973.12	
	AMP LTD	3,505	5.95	20,854.75	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	1,863	5.54	10,321.02	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	853	13.50	11,515.50	
	SUNCORP GROUP LTD	1,427	13.30	18,979.10	
	COMPUTERSHARE LTD	820	10.93	8,962.60	
	TELSTRA CORPORATION LTD	5,367	5.58	29,947.86	
	AGL ENERGY LTD	726	16.41	11,913.66	
豪ドル小計		40,377		704,673.90	(61,694,199)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,098	108.20	227,003.60	
	LI & FUNG LTD	4,000	6.18	24,720.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	2,000	26.95	53,900.00	
	BANK OF EAST ASIA	1,880	29.45	55,366.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,000	26.05	52,100.00	
	HANG SENG BANK LTD	550	144.70	79,585.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	637	205.40	130,839.80	
	AIA GROUP LTD	7,663	46.75	358,245.25	



	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	2,098	58.00	121,684.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	3,000	19.90	59,700.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,331	51.20	68,147.20	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,933	106.90	206,637.70	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	754	91.65	69,104.10	
	CLP HOLDINGS LTD	1,194	68.95	82,326.30	
	HONG KONG & CHINA GAS	10,023	15.90	159,365.70	
	POWER ASSETS HOLDINGS	2,500	76.80	192,000.00	
香港ドル小計		43,661		1,940,724.65 (30,333,526)	
シンガポールドル	SINGAPORE AIRLINES LTD	1,400	11.16	15,624.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	14,000	0.83	11,620.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,202	18.00	21,636.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,708	9.47	16,174.76	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	842	20.40	17,176.80	
	CAPITALAND LTD	6,000	3.14	18,840.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	2,000	8.40	16,800.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	5,000	4.02	20,100.00	
シンガポールドル小計		32,152		137,971.56 (11,951,096)	
イスラエルシェケル	TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	586	232.40	136,186.40	
	BANK HAPOLIM BM	2,739	20.95	57,382.05	
イスラエルシェケル小計		3,325		193,568.45 (6,018,043)	
合計		816,756		2,372,466,980 (2,372,466,980)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	AMERICAN TOWER CORP	242	23,999.14	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	104	19,016.40	
		BOSTON PROPERTIES INC	143	17,427.41	
		CROWN CASTLE INTL CORP	198	16,893.36	

		EQUINIX INC	58	17,100.72	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	200	15,894.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	71	16,347.75	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	110	15,730.00	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	613	17,464.37	
		HCP INC	315	12,171.60	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	948	15,679.92	
		IRON MOUNTAIN INC	274	8,510.44	
		KIMCO REALTY CORPORATION	540	14,212.80	
		MACERICH CO/THE	187	15,728.57	
		PROLOGIS INC	526	22,633.78	
		PUBLIC STORAGE	79	18,162.10	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	200	40,608.00	
		SL GREEN REALTY CORP	147	17,298.96	
		VENTAS INC	159	8,765.67	
		VORNADO REALTY TRUST	157	15,626.21	
		WELLTOWER INC	187	12,805.76	
		WEYERHAEUSER CO	347	10,420.41	
米ドル小計			5,805	372,497.37	(45,124,331)
ユーロ	投資証券	KLEPIERRE	263	11,293.22	
		UNIBAIL-RODAMCO SE-NA	61	15,506.20	
ユーロ小計			324	26,799.42	(3,576,650)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	1,166	10,091.73	
		HAMMERSON PLC	1,445	9,320.25	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	974	13,041.86	
英ポンド小計			3,585	32,453.84	(6,021,485)
豪ドル	投資証券	FEDERATION CENTRES	6,167	17,884.30	
		LEND LEASE GROUP	919	11,809.15	
		SCENTRE GROUP	4,461	18,379.32	
		WESTFIELD CORP	1,209	12,307.62	
豪ドル小計			12,756	60,380.39	(5,286,303)

香港ドル	投資証券	LINK REIT	1,567	73,805.70	
香港ドル小計			1,567	73,805.70	(1,153,583)
合計				61,162,352	(61,162,352)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 413銘柄	97.1%		62.5%
	投資証券 22銘柄		2.9%	1.9%
加ドル	株式 47銘柄	100.0%		3.7%
ユーロ	株式 123銘柄	98.8%		12.6%
	投資証券 2銘柄		1.2%	0.1%
英ポンド	株式 69銘柄	97.1%		8.2%
	投資証券 3銘柄		2.9%	0.2%
スイスフラン	株式 22銘柄	100.0%		4.1%
スウェーデンクローナ	株式 15銘柄	100.0%		1.1%
ノルウェークローネ	株式 6銘柄	100.0%		0.3%
デンマーククローネ	株式 6銘柄	100.0%		0.7%
豪ドル	株式 33銘柄	92.1%		2.5%
	投資証券 4銘柄		7.9%	0.2%
香港ドル	株式 16銘柄	96.3%		1.2%
	投資証券 1銘柄		3.7%	0.0%
シンガポールドル	株式 8銘柄	100.0%		0.5%
イスラエルシェケル	株式 2銘柄	100.0%		0.2%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

## 日本債券インデックスマザーファンド

### 貸借対照表

	(単位：円)	
	平成26年10月27日現在	平成27年10月26日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	49,160,167	27,871,274
国債証券	27,424,549,200	27,678,374,440
地方債証券	2,328,445,000	2,221,989,000
特殊債券	2,401,371,000	2,594,129,000
社債券	1,989,210,000	1,989,299,000
未収利息	91,166,286	85,847,629
前払費用	2,027,603	943,005
流動資産合計	34,285,929,256	34,598,453,348
<b>資産合計</b>	<b>34,285,929,256</b>	<b>34,598,453,348</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	30,453,951	9,508,230
流動負債合計	30,453,951	9,508,230
<b>負債合計</b>	<b>30,453,951</b>	<b>9,508,230</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	26,150,712,081	25,862,890,330
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,104,763,224	8,726,054,788
元本等合計	34,255,475,305	34,588,945,118
<b>純資産合計</b>	<b>34,255,475,305</b>	<b>34,588,945,118</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>34,285,929,256</b>	<b>34,598,453,348</b>

### 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</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。

（貸借対照表に関する注記）

		平成26年10月27日現在	平成27年10月26日現在
1.	期首	平成25年10月29日	平成26年10月28日
	期首元本額	26,729,401,948円	26,150,712,081円
	期首からの追加設定元本額	1,823,363,124円	2,407,160,797円
	期首からの一部解約元本額	2,402,052,991円	2,694,982,548円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	655,257,447円	771,348,083円
	DCインデックスバランス（株式40）	861,047,402円	987,092,558円
	DCインデックスバランス（株式60）	589,961,363円	697,721,318円
	DCインデックスバランス（株式80）	105,288,919円	125,920,088円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	1,283,595,025円	1,439,648,776円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	6,357,801,070円	5,428,334,138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	5,537,922円	4,781,927円
	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（債券資産）	49,251,969円	49,382,817円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	5,673,295円	5,175,634円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	30,297,443円	27,448,221円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	123,058,905円	113,428,964円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	448,156,563円	398,533,980円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	7,138,754,587円	6,647,988,644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）	74,882,366円	45,364,368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）	166,913,429円	143,499,757円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	32,961,745円	31,066,594円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	1,061,792,792円	1,118,428,990円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,058,427,897円	1,152,391,400円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	545,250,657円	598,751,146円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	85,061,352円	91,145,819円
	インデックスファンド日本債券（1年決算型）	5,292,390,478円	5,789,757,316円
	日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	179,349,455円	195,679,792円
	計	26,150,712,081円	25,862,890,330円
2.	受益権の総数	26,150,712,081口	25,862,890,330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）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成25年10月29日 至 平成26年10月27日	自 平成26年10月28日 至 平成27年10月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成26年10月27日現在	平成27年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）

（平成26年10月27日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	214,990,830
地方債証券	12,566,000
特殊債券	2,601,000
社債券	8,443,000
合計	238,600,830

（平成27年10月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	285,272,000
地方債証券	1,694,000
特殊債券	3,346,000
社債券	10,419,000
合計	269,813,000

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成26年10月27日現在		平成27年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.3099円	1口当たり純資産額	1.3374円
(1万口当たり純資産額)	(13,099円)	(1万口当たり純資産額)	(13,374円)

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第101回利付国債（5年）	170,000,000	170,778,600	
	第102回利付国債（5年）	400,000,000	401,372,000	
	第103回利付国債（5年）	90,000,000	90,375,300	
	第104回利付国債（5年）	50,000,000	50,139,000	
	第105回利付国債（5年）	110,000,000	110,352,000	
	第106回利付国債（5年）	310,000,000	311,116,000	
	第107回利付国債（5年）	705,000,000	707,791,800	
	第109回利付国債（5年）	180,000,000	180,365,400	
	第111回利付国債（5年）	40,000,000	40,368,000	
	第112回利付国債（5年）	160,000,000	161,627,200	
	第114回利付国債（5年）	90,000,000	90,741,600	
	第116回利付国債（5年）	110,000,000	110,621,500	
	第117回利付国債（5年）	470,000,000	472,867,000	
	第118回利付国債（5年）	200,000,000	201,274,000	
	第119回利付国債（5年）	100,000,000	100,273,000	
	第120回利付国債（5年）	330,000,000	332,181,300	
	第121回利付国債（5年）	100,000,000	100,272,000	
	第122回利付国債（5年）	300,000,000	300,807,000	
	第123回利付国債（5年）	505,000,000	506,328,150	
	第124回利付国債（5年）	560,000,000	561,422,400	
第125回利付国債（5年）	190,000,000	190,463,600		



第1回利付国債(40年)	25,000,000	31,592,250	
第2回利付国債(40年)	165,000,000	200,042,700	
第3回利付国債(40年)	50,000,000	60,622,500	
第4回利付国債(40年)	95,000,000	115,165,650	
第5回利付国債(40年)	35,000,000	40,452,650	
第6回利付国債(40年)	55,000,000	61,901,400	
第7回利付国債(40年)	60,000,000	63,935,400	
第8回利付国債(40年)	35,000,000	34,091,050	
第284回利付国債(10年)	462,000,000	470,990,520	
第285回利付国債(10年)	261,000,000	267,175,260	
第286回利付国債(10年)	186,000,000	191,487,000	
第287回利付国債(10年)	35,000,000	36,089,900	
第288回利付国債(10年)	18,000,000	18,576,540	
第289回利付国債(10年)	199,000,000	205,336,160	
第290回利付国債(10年)	226,000,000	233,482,860	
第291回利付国債(10年)	287,000,000	295,816,640	
第292回利付国債(10年)	306,000,000	318,325,680	
第293回利付国債(10年)	56,000,000	58,641,520	
第294回利付国債(10年)	32,000,000	33,424,960	
第295回利付国債(10年)	13,000,000	13,510,120	
第296回利付国債(10年)	14,000,000	14,601,720	
第297回利付国債(10年)	28,000,000	29,214,360	
第298回利付国債(10年)	221,000,000	229,890,830	
第299回利付国債(10年)	750,000,000	782,535,000	
第300回利付国債(10年)	36,000,000	37,805,760	
第301回利付国債(10年)	223,000,000	234,972,870	
第302回利付国債(10年)	94,000,000	98,704,700	
第303回利付国債(10年)	581,000,000	611,973,110	
第304回利付国債(10年)	60,000,000	62,965,200	
第305回利付国債(10年)	563,000,000	592,354,820	
第306回利付国債(10年)	93,000,000	98,523,270	
第308回利付国債(10年)	140,000,000	148,107,400	
第309回利付国債(10年)	134,000,000	140,517,760	
第310回利付国債(10年)	78,000,000	81,618,420	
第311回利付国債(10年)	23,000,000	23,842,260	
第312回利付国債(10年)	205,000,000	217,041,700	

第313回利付国債(10年)	410,000,000	437,203,500	
第315回利付国債(10年)	65,000,000	69,128,800	
第316回利付国債(10年)	35,000,000	37,026,500	
第317回利付国債(10年)	105,000,000	111,349,350	
第318回利付国債(10年)	185,000,000	195,101,000	
第319回利付国債(10年)	5,000,000	5,313,450	
第320回利付国債(10年)	110,000,000	116,223,800	
第321回利付国債(10年)	175,000,000	185,237,500	
第322回利付国債(10年)	75,000,000	78,910,500	
第323回利付国債(10年)	45,000,000	47,422,800	
第324回利付国債(10年)	25,000,000	26,180,750	
第325回利付国債(10年)	160,000,000	167,784,000	
第326回利付国債(10年)	30,000,000	31,265,700	
第327回利付国債(10年)	65,000,000	68,203,200	
第328回利付国債(10年)	115,000,000	118,999,700	
第329回利付国債(10年)	210,000,000	220,481,100	
第330回利付国債(10年)	210,000,000	220,565,100	
第331回利付国債(10年)	80,000,000	82,776,800	
第333回利付国債(10年)	110,000,000	113,677,300	
第334回利付国債(10年)	120,000,000	123,920,400	
第335回利付国債(10年)	130,000,000	133,001,700	
第337回利付国債(10年)	30,000,000	30,134,100	
第338回利付国債(10年)	90,000,000	91,071,000	
第339回利付国債(10年)	200,000,000	202,062,000	
第340回利付国債(10年)	80,000,000	80,691,200	
第14回利付国債(30年)	208,000,000	258,046,880	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	184,696,680	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	43,937,250	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	133,987,700	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	68,763,750	
第24回利付国債(30年)	158,000,000	197,596,380	
第25回利付国債(30年)	20,000,000	24,262,800	
第26回利付国債(30年)	30,000,000	36,945,300	
第27回利付国債(30年)	29,000,000	36,324,240	
第28回利付国債(30年)	14,000,000	17,568,740	
第29回利付国債(30年)	276,000,000	341,621,760	

第30回利付国債(30年)	147,000,000	179,151,840	
第31回利付国債(30年)	120,000,000	143,887,200	
第32回利付国債(30年)	40,000,000	48,808,800	
第33回利付国債(30年)	50,000,000	57,889,500	
第34回利付国債(30年)	160,000,000	192,260,800	
第35回利付国債(30年)	120,000,000	139,102,800	
第36回利付国債(30年)	230,000,000	266,611,400	
第37回利付国債(30年)	70,000,000	79,558,500	
第38回利付国債(30年)	30,000,000	33,400,800	
第39回利付国債(30年)	75,000,000	85,190,250	
第40回利付国債(30年)	90,000,000	100,134,000	
第42回利付国債(30年)	65,000,000	70,758,350	
第43回利付国債(30年)	195,000,000	211,943,550	
第44回利付国債(30年)	40,000,000	43,452,000	
第45回利付国債(30年)	15,000,000	15,568,200	
第46回利付国債(30年)	135,000,000	139,996,350	
第47回利付国債(30年)	115,000,000	121,989,700	
第48回利付国債(30年)	50,000,000	50,532,000	
第34回利付国債(20年)	85,000,000	89,140,350	
第37回利付国債(20年)	63,000,000	66,689,910	
第39回利付国債(20年)	86,000,000	91,303,620	
第41回利付国債(20年)	27,000,000	28,354,320	
第42回利付国債(20年)	178,000,000	193,564,320	
第43回利付国債(20年)	73,000,000	81,152,640	
第44回利付国債(20年)	51,000,000	56,499,840	
第47回利付国債(20年)	21,000,000	23,206,260	
第48回利付国債(20年)	99,000,000	111,425,490	
第49回利付国債(20年)	57,000,000	63,255,180	
第50回利付国債(20年)	237,000,000	260,458,260	
第51回利付国債(20年)	39,000,000	43,245,540	
第54回利付国債(20年)	15,000,000	16,954,950	
第55回利付国債(20年)	66,000,000	74,108,760	
第57回利付国債(20年)	52,000,000	58,273,280	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	151,798,050	
第59回利付国債(20年)	33,000,000	36,745,830	
第60回利付国債(20年)	545,000,000	595,259,900	

第61回利付国債(20年)	27,000,000	28,740,690	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	34,904,760	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	61,374,240	
第65回利付国債(20年)	100,000,000	113,898,000	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	38,452,300	
第67回利付国債(20年)	34,000,000	38,818,140	
第68回利付国債(20年)	78,000,000	91,025,220	
第70回利付国債(20年)	104,000,000	123,440,720	
第72回利付国債(20年)	112,000,000	130,371,360	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	130,913,890	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	137,763,820	
第75回利付国債(20年)	50,000,000	58,488,000	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	24,179,400	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	46,423,200	
第79回利付国債(20年)	160,000,000	186,016,000	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	70,446,600	
第87回利付国債(20年)	170,000,000	202,041,600	
第88回利付国債(20年)	260,000,000	312,345,800	
第90回利付国債(20年)	156,000,000	186,093,960	
第91回利付国債(20年)	260,000,000	312,884,000	
第92回利付国債(20年)	90,000,000	106,551,000	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	59,293,000	
第95回利付国債(20年)	32,000,000	38,742,720	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	116,405,380	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	54,013,950	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	111,765,060	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	139,231,170	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	36,098,400	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	81,010,380	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	99,597,600	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	13,394,370	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	39,372,630	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	91,980,350	
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,413,360	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	155,368,200	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	156,751,860	

第109回利付国債(20年)	27,000,000	31,585,680	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	117,238,380	
第111回利付国債(20年)	25,000,000	30,254,250	
第113回利付国債(20年)	240,000,000	287,464,800	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	62,291,840	
第115回利付国債(20年)	20,000,000	24,219,600	
第116回利付国債(20年)	145,000,000	175,850,200	
第117回利付国債(20年)	30,000,000	35,961,300	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	11,852,600	
第119回利付国債(20年)	30,000,000	34,728,900	
第120回利付国債(20年)	70,000,000	79,050,300	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	25,769,700	
第122回利付国債(20年)	70,000,000	80,987,200	
第123回利付国債(20年)	85,000,000	101,993,200	
第124回利付国債(20年)	80,000,000	94,824,800	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	60,673,500	
第126回利付国債(20年)	25,000,000	29,618,500	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	76,051,300	
第129回利付国債(20年)	115,000,000	132,835,350	
第130回利付国債(20年)	80,000,000	92,323,200	
第131回利付国債(20年)	55,000,000	62,642,800	
第132回利付国債(20年)	90,000,000	102,386,700	
第133回利付国債(20年)	30,000,000	34,586,100	
第134回利付国債(20年)	30,000,000	34,572,600	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	34,110,300	
第136回利付国債(20年)	180,000,000	201,891,600	
第137回利付国債(20年)	220,000,000	249,814,400	
第138回利付国債(20年)	50,000,000	55,221,500	
第140回利付国債(20年)	280,000,000	317,506,000	
第141回利付国債(20年)	155,000,000	175,503,400	
第142回利付国債(20年)	25,000,000	28,704,250	
第143回利付国債(20年)	115,000,000	128,165,200	
第144回利付国債(20年)	40,000,000	43,939,200	
第145回利付国債(20年)	125,000,000	140,976,250	
第146回利付国債(20年)	75,000,000	84,508,500	
第147回利付国債(20年)	60,000,000	66,499,200	

	第148回利付国債(20年)	120,000,000	130,639,200	
	第149回利付国債(20年)	215,000,000	233,543,750	
	第150回利付国債(20年)	90,000,000	95,949,900	
	第151回利付国債(20年)	150,000,000	154,324,500	
	第152回利付国債(20年)	160,000,000	164,129,600	
	第153回利付国債(20年)	120,000,000	124,783,200	
	第154回利付国債(20年)	90,000,000	91,768,500	
国債証券 合計		25,486,000,000	27,678,374,440	
地方債証券	第682回東京都公募公債	100,000,000	105,338,000	
	第708回東京都公募公債	100,000,000	104,800,000	
	第731回東京都公募公債	100,000,000	102,650,000	
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	118,575,000	
	平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	209,726,000	
	平成19年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	103,001,000	
	平成19年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	102,701,000	
	平成21年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	104,953,000	
	平成26年度第3回広島県公募公債	100,000,000	101,421,000	
	平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	105,688,000	
	平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	104,402,000	
	平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	103,600,000	
	第10回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	103,122,000	
	第55回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,508,000	
	第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,383,000	
	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	104,263,000	
	第4回京都市公募公債(20年)	100,000,000	120,896,000	
	平成23年度第14回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	112,785,000	
	平成18年度第1回鹿児島県公募公債(10年)	100,000,000	101,841,000	
平成23年度第2回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	105,336,000		
地方債証券 合計		2,100,000,000	2,221,989,000	
特殊債券	第1回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	104,332,000	
	第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	105,072,000	
	第5回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,182,000	
	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,105,000	
	第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,511,000	
	第6回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,492,000	
	第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,738,000	

	第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,492,000	
	第21回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,504,000	
	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,619,000	
	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,017,000	
	第31回株式会社日本政策投資銀行無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,807,000	
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	118,230,000	
	第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,602,000	
	第135回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,636,000	
	第139回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,728,000	
	第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,508,000	
	第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	103,910,000	
	第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,472,000	
	第29回国際協力銀行債券	200,000,000	206,318,000	
	い第745号農林債	100,000,000	100,257,000	
	第267回信金中金債(5年)	100,000,000	100,374,000	
	第272回信金中金債(5年)	100,000,000	100,223,000	
特殊債券 合計		2,500,000,000	2,594,129,000	
社債券	第324回東京交通債券	100,000,000	104,228,000	
	第9回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債(2012)	100,000,000	101,381,000	
	第6回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	105,431,000	
	第28回東レ株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,811,000	
	第12回武田薬品工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,430,000	
	第2回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,209,000	
	第11回パナソニック株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,099,000	
	第18回株式会社ニコン無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,770,000	
	第137回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	200,000,000	200,390,000	
	第65回三菱地所株式会社無担保社債(担保提供制限等財務上特約無)	100,000,000	113,913,000	

第 8 3 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	110,908,000	
第 1 6 回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	106,649,000	
第 2 5 回日本郵船株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	116,978,000	
第 5 4 0 回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,160,000	
第 3 0 6 回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,421,000	
第 2 9 9 回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,919,000	
第 2 8 1 回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,097,000	
第 1 9 回沖縄電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,505,000	
社債券 合計	1,900,000,000	1,989,299,000	
合計	31,986,000,000	34,483,791,440	

## 第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

	平成26年10月27日現在	平成27年10月26日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	95,168,638	38,919,789
コール・ローン	137,073,689	51,917,372
国債証券	201,857,784,535	181,390,413,587
派生商品評価勘定	-	709,293
未収入金	-	126,117,059
未収利息	2,720,589,090	2,212,855,064
前払費用	64,324,292	40,007,026
流動資産合計	204,874,940,244	183,860,939,190
資産合計	204,874,940,244	183,860,939,190
<b>負債の部</b>		
流動負債		



	平成26年10月27日現在	平成27年10月26日現在
派生商品評価勘定	-	386,446
未払解約金	57,369,444	155,487,166
流動負債合計	57,369,444	155,873,612
<b>負債合計</b>	<b>57,369,444</b>	<b>155,873,612</b>
純資産の部		
元本等		
元本	94,320,172,210	78,315,710,776
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	110,497,398,590	105,389,354,802
元本等合計	204,817,570,800	183,705,065,578
純資産合計	204,817,570,800	183,705,065,578
<b>負債純資産合計</b>	<b>204,874,940,244</b>	<b>183,860,939,190</b>

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

	平成26年10月27日現在	平成27年10月26日現在
1. 期首	平成25年10月29日	平成26年10月28日
期首元本額	116,750,317,478円	94,320,172,210円
期首からの追加設定元本額	1,407,865,604円	1,407,849,739円
期首からの一部解約元本額	23,838,010,872円	17,412,311,173円
元本の内訳		
インデックスファンド海外債券ヘッジなし（DC専用）	10,603,938,147円	10,658,545,736円
DCインデックスバランス（株式20）	61,052,988円	67,731,260円

DCインデックスバランス(株式40)	115,905,774円	125,991,920円
DCインデックスバランス(株式60)	142,887,468円	159,512,271円
DCインデックスバランス(株式80)	127,486,785円	143,835,234円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	29,236,200,995円	24,025,600,925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	3,822,465,023円	3,090,679,030円
日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	37,799,542,855円	30,477,712,110円
全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	30,945,387円	24,348,601円
日興外国債券インデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,071,774,948円	1,005,002,492円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	66,087,080円	146,323,601円
日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(債券資産)	23,824,257円	18,308,969円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	3,413,105円	2,957,976円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	3,665,047円	3,141,804円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	8,276,960円	7,165,554円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	20,893,764円	17,504,009円
世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	830,492,705円	864,659,550円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	1,444,089,612円	1,261,792,428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)	62,522,243円	36,355,505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)	113,765,637円	93,884,765円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	44,629,924円	40,477,070円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	49,601,481円	49,259,970円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	71,162,661円	73,209,935円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	66,016,152円	68,455,872円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	51,217,745円	52,069,265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	8,202,400,500円	5,562,370,330円
海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	245,912,967円	238,814,594円
計	94,320,172,210円	78,315,710,776円
2. 受益権の総数	94,320,172,210口	78,315,710,776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)

金融商品の状況に関する事項

	自 平成25年10月29日 至 平成26年10月27日	自 平成26年10月28日 至 平成27年10月26日
--	--------------------------------	--------------------------------

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

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年10月27日現在	平成27年10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ぬ。	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 「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 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成26年10月27日現在)

## 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	6,015,128,271
合計	6,015,128,271

（平成27年10月26日現在）

## 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	1,652,357,952
合計	1,652,357,952

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（平成26年10月27日現在）

該当事項はありません。

（平成27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	159,975,447	-	159,652,600	322,847
	米ドル	54,210,820	-	54,508,500	297,680
	ユーロ	56,362,113	-	55,652,820	709,293
	英ポンド	12,944,204	-	12,987,100	42,896
	豪ドル	36,458,310	-	36,504,180	45,870
	合計	159,975,447	-	159,652,600	322,847

## （注）1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成26年10月27日現在		平成27年10月26日現在	
1口当たり純資産額	2,1715円	1口当たり純資産額	2,3457円
(1万口当たり純資産額)	(21,715円)	(1万口当たり純資産額)	(23,457円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-3.0%-16/09/30	5,100,000.00	5,225,507.81	
		US TREASURY N/B-3.125%-16/10/31	6,400,000.00	6,578,000.00	
		US TREASURY N/B-4.625%-16/11/15	6,000,000.00	6,263,906.25	
		US TREASURY N/B-7.5%-16/11/15	7,390,000.00	7,938,476.56	
		US TREASURY N/B-2.75%-16/11/30	7,000,000.00	7,178,828.12	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/12/31	8,700,000.00	8,988,187.50	

US TREASURY N/B-3.125%-17/01/31	9,000,000.00	9,307,265.62	
US TREASURY N/B-4.625%-17/02/15	9,250,000.00	9,752,968.75	
US TREASURY N/B-3.0%-17/02/28	5,400,000.00	5,581,406.25	
US TREASURY N/B-3.25%-17/03/31	8,800,000.00	9,139,625.00	
US TREASURY N/B-1.0%-17/03/31	5,500,000.00	5,539,531.25	
US TREASURY N/B-3.125%-17/04/30	7,000,000.00	7,277,812.50	
US TREASURY N/B-4.5%-17/05/15	8,800,000.00	9,339,000.00	
US TREASURY N/B-8.75%-17/05/15	8,000,000.00	9,011,250.00	
US TREASURY N/B-2.75%-17/05/31	8,800,000.00	9,106,625.00	
US TREASURY N/B-0.625%-17/05/31	5,000,000.00	5,004,687.50	
US TREASURY N/B-2.5%-17/06/30	4,000,000.00	4,127,812.50	
US TREASURY N/B-0.75%-17/06/30	5,000,000.00	5,014,453.12	
US TREASURY N/B-0.875%-17/07/15	2,200,000.00	2,210,312.50	
US TREASURY N/B-2.375%-17/07/31	1,020,000.00	1,051,396.87	
US TREASURY N/B-4.75%-17/08/15	8,600,000.00	9,235,593.75	
US TREASURY N/B-1.875%-17/08/31	2,000,000.00	2,045,468.75	
US TREASURY N/B-1.0%-17/09/15	4,900,000.00	4,933,687.50	
US TREASURY N/B-1.875%-17/09/30	7,000,000.00	7,164,609.37	
US TREASURY N/B-1.875%-17/10/31	2,500,000.00	2,559,570.31	
US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	6,800,000.00	7,291,406.25	
US TREASURY N/B-2.25%-17/11/30	3,500,000.00	3,611,835.93	
US TREASURY N/B-1.0%-17/12/15	5,200,000.00	5,231,281.25	
US TREASURY N/B-2.75%-17/12/31	6,170,000.00	6,439,455.46	
US TREASURY N/B-2.625%-18/01/31	4,000,000.00	4,167,500.00	
US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	7,950,000.00	8,445,011.71	
US TREASURY N/B-2.75%-18/02/28	7,400,000.00	7,737,625.00	
US TREASURY N/B-2.875%-18/03/31	2,500,000.00	2,625,390.62	
US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	7,550,000.00	8,133,355.46	
US TREASURY N/B-2.375%-18/06/30	7,000,000.00	7,277,265.62	
US TREASURY N/B-2.25%-18/07/31	8,340,000.00	8,649,492.18	
US TREASURY N/B-1.375%-18/07/31	2,500,000.00	2,532,617.18	
US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	8,850,000.00	9,619,535.15	
US TREASURY N/B-1.75%-18/10/31	3,000,000.00	3,071,484.37	
US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	9,400,000.00	10,190,921.87	
US TREASURY N/B-1.5%-18/12/31	8,950,000.00	9,081,453.12	

US TREASURY N/B-8.875%-19/02/15	4,850,000.00	6,094,328.12	
US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	5,400,000.00	5,696,156.25	
US TREASURY N/B-1.375%-19/02/28	3,000,000.00	3,028,359.37	
US TREASURY N/B-1.5%-19/02/28	4,000,000.00	4,054,062.50	
US TREASURY N/B-1.625%-19/03/31	2,000,000.00	2,034,375.00	
US TREASURY N/B-1.625%-19/04/30	5,000,000.00	5,084,375.00	
US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	4,400,000.00	4,703,531.25	
US TREASURY N/B-1.5%-19/05/31	4,100,000.00	4,149,328.12	
US TREASURY N/B-1.625%-19/06/30	1,090,000.00	1,107,457.03	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	4,320,000.00	4,708,462.50	
US TREASURY N/B-8.125%-19/08/15	5,030,000.00	6,333,870.31	
US TREASURY N/B-1.0%-19/08/31	3,300,000.00	3,272,414.06	
US TREASURY N/B-1.625%-19/08/31	3,600,000.00	3,655,687.50	
US TREASURY N/B-1.75%-19/09/30	8,300,000.00	8,461,460.93	
US TREASURY N/B-1.5%-19/10/31	4,100,000.00	4,138,117.18	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	13,000,000.00	14,090,781.25	
US TREASURY N/B-1.625%-19/12/31	1,800,000.00	1,823,343.75	
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	13,300,000.00	14,577,007.81	
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	9,500,000.00	10,383,945.31	
US TREASURY N/B-1.375%-20/05/31	300,000.00	299,765.62	
US TREASURY N/B-2.0%-20/07/31	9,300,000.00	9,549,210.93	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	7,950,000.00	10,668,527.34	
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	5,000,000.00	5,276,171.87	
US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	3,500,000.00	3,692,500.00	
US TREASURY N/B-2.375%-20/12/31	3,000,000.00	3,131,250.00	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	14,250,000.00	15,770,742.18	
US TREASURY N/B-2.25%-21/04/30	4,800,000.00	4,974,749.99	
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	5,320,000.00	5,754,743.75	
US TREASURY N/B-2.125%-21/06/30	6,400,000.00	6,582,500.00	
US TREASURY N/B-2.25%-21/07/31	3,000,000.00	3,104,296.87	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	3,900,000.00	4,004,203.12	
US TREASURY N/B-2.125%-21/09/30	500,000.00	513,242.18	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	12,000,000.00	16,388,437.50	
US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	4,000,000.00	4,073,750.00	
US TREASURY N/B-2.125%-21/12/31	4,800,000.00	4,917,750.00	

US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,500,000.00	2,543,945.31	
US TREASURY N/B-1.75%-22/02/28	2,900,000.00	2,901,812.50	
US TREASURY N/B-1.875%-22/05/31	2,000,000.00	2,012,656.25	
US TREASURY N/B-2.125%-22/06/30	2,500,000.00	2,555,859.37	
US TREASURY N/B-2.0%-22/07/31	5,300,000.00	5,372,046.87	
US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	1,000,000.00	987,656.25	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	9,300,000.00	9,397,359.37	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	8,500,000.00	8,411,015.62	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,500,000.00	5,736,757.81	
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	2,000,000.00	2,123,750.00	
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	2,900,000.00	3,074,453.12	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	4,000,000.00	4,156,562.50	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,748,493.75	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	3,250,000.00	3,300,781.25	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	3,850,000.00	3,825,035.15	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	4,816,125.00	
US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,700,000.00	3,856,570.31	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	2,920,000.00	4,125,640.62	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,000,000.00	1,331,093.75	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	2,600,000.00	3,839,265.62	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	3,500,000.00	4,833,007.81	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	1,900,000.00	2,653,468.75	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	1,370,000.00	1,760,878.12	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	2,200,000.00	2,878,046.87	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	2,800,000.00	3,527,781.25	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,820,000.00	2,375,810.93	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	2,750,000.00	3,527,089.84	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	3,850,000.00	5,114,785.15	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	3,470,000.00	4,451,088.28	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	3,380,000.00	4,022,992.18	
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	3,000,000.00	3,778,828.12	
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,600,000.00	2,166,750.00	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	4,000,000.00	5,150,000.00	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	4,400,000.00	5,155,562.50	
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	500,000.00	486,328.12	



		US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	2,093,593.75	
		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	5,800,000.00	5,772,359.37	
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	5,350,000.00	6,155,425.78	
		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	4,500,000.00	5,293,476.56	
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	3,000,000.00	3,446,484.37	
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,500,000.00	2,739,843.75	
		US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	5,900,000.00	6,161,351.56	
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	3,300,000.00	3,359,812.50	
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	3,026,976.56	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	3,200,000.00	3,261,499.99	
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	2,800,000.00	2,786,656.25	
米ドル小計			596,910,000.00	644,877,297.32	(78,120,435,797)
加ドル	国債証券	CANADA GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	280,000.00	318,732.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-16/11/01	480,000.00	482,385.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-17/02/01	1,570,000.00	1,589,326.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-17/03/01	1,380,000.00	1,398,064.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-17/05/01	800,000.00	796,600.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-17/06/01	2,130,000.00	2,247,107.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-17/08/01	1,530,000.00	1,548,956.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-17/09/01	1,000,000.00	1,017,670.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-17/11/01	120,000.00	119,316.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/02/01	350,000.00	355,600.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/03/01	1,420,000.00	1,443,131.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	1,520,000.00	1,664,369.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/09/01	650,000.00	662,571.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/03/01	1,050,000.00	1,089,438.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	2,000,000.00	2,221,180.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/09/01	650,000.00	676,065.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-20/03/01	1,170,000.00	1,208,235.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	1,630,000.00	1,829,397.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-20/09/01	400,000.00	398,200.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	1,150,000.00	1,292,266.50	
CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	1,400,000.00	1,542,758.00			
CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,480,000.00	1,501,519.20			

		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,420,000.00	1,546,479.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	1,220,000.00	1,300,642.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	610,000.00	1,010,245.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	1,120,000.00	1,632,668.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	1,310,000.00	2,002,675.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	1,350,000.00	1,975,657.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	1,510,000.00	1,998,817.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,620,000.00	2,039,580.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	610,000.00	669,426.20	
	加ドル小計		34,930,000.00	39,579,083.70 (3,637,317,792)	
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%- 16/12/15	14,300,000.00	14,897,025.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-17/06/15	11,500,000.00	11,715,912.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 17/12/14	17,000,000.00	18,331,950.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-4.75%- 18/06/14	18,000,000.00	18,195,300.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-18/12/13	16,400,000.00	18,276,570.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11	2,000,000.00	2,006,400.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	23,800,000.00	26,729,780.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	8,900,000.00	9,421,095.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	5,000,000.00	5,261,875.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	8,200,000.00	9,386,745.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	25,500,000.00	32,925,600.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	6,000,000.00	6,646,350.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	17,400,000.00	20,858,250.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	11,200,000.00	12,644,240.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	2,200,000.00	2,480,610.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	9,400,000.00	13,020,880.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	13,100,000.00	15,861,807.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	11,000,000.00	12,388,475.00	
			220,900,000.00	251,048,865.00	

メキシコペソ小計				(1,837,677,691)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.0%-17/03/28	1,250,000.00	1,325,836.75
		BELGIUM KINGDOM-3.5%-17/06/28	410,000.00	435,825.90
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-17/09/28	1,590,000.00	1,766,843.13
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-18/03/28	1,830,000.00	2,018,860.20
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-18/06/22	170,000.00	176,662.57
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	1,700,000.00	1,942,391.61
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-19/09/28	630,000.00	706,526.10
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	2,260,000.00	2,673,611.18
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	1,760,000.00	2,184,404.99
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	1,580,000.00	1,958,856.35
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,500,000.00	1,902,895.05
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	960,000.00	1,089,391.96
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	1,100,000.00	1,282,860.37
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	880,000.00	879,646.49
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	1,220,000.00	1,664,122.70
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,870,000.00	2,829,409.67
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	500,000.00	472,867.50
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	860,000.00	1,189,444.50
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	650,000.00	808,405.00
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,900,000.00	3,012,760.27
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	170,000.00	176,924.10
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,650,000.00	2,532,392.44
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	740,000.00	1,076,814.70
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.25%-16/10/31	2,340,000.00	2,441,415.13
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%-17/01/31	2,250,000.00	2,358,472.50
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.1%-17/04/30	1,900,000.00	1,960,058.24
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-17/07/30	2,310,000.00	2,532,259.65
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%-17/10/31	1,400,000.00	1,411,823.14
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.5%-18/01/31	1,900,000.00	2,086,818.26

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%- 18/04/30	50,000.00	50,078.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%- 18/07/30	3,180,000.00	3,519,242.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.75%- 18/10/31	1,600,000.00	1,768,958.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 19/04/30	1,760,000.00	1,907,746.18	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%- 19/07/30	2,900,000.00	3,354,691.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%- 19/10/31	2,630,000.00	3,033,073.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 20/01/31	900,000.00	933,804.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%- 20/04/30	2,900,000.00	3,337,320.29	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.15%- 20/07/30	600,000.00	613,938.84	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%- 20/10/31	1,890,000.00	2,277,419.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	2,440,000.00	3,055,340.18	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	2,060,000.00	2,667,551.46	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%- 23/01/31	1,840,000.00	2,371,852.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	1,310,000.00	1,610,099.11	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	1,940,000.00	2,450,908.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	2,400,000.00	2,842,548.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	2,000,000.00	2,201,890.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	1,710,000.00	1,714,582.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,650,000.00	2,098,866.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	900,000.00	941,827.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,700,000.00	2,384,054.50	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,320,000.00	1,788,397.64	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	2,220,000.00	3,237,652.66	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,050,000.00	1,022,295.33	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,710,000.00	2,534,780.02	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,690,000.00	2,144,948.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,430,000.00	2,009,688.68	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,400,000.00	1,915,274.62	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	1,040,000.00	1,532,544.00	
BUNDES OblIGATION-1.25%-16/10/14	200,000.00	203,036.14	
BUNDES OblIGATION-1.0%-18/10/12	2,100,000.00	2,179,943.85	
BUNDES OblIGATION-1.0%-19/02/22	1,320,000.00	1,375,485.54	
BUNDES OblIGATION-0.25%-20/10/16	1,000,000.00	1,017,140.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 17/01/04	5,450,000.00	5,716,005.78	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 17/07/04	5,650,000.00	6,086,723.53	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 18/01/04	4,750,000.00	5,201,154.05	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 18/07/04	3,200,000.00	3,592,720.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 19/01/04	2,770,000.00	3,126,253.02	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%- 19/07/04	4,100,000.00	4,666,448.21	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 20/01/04	3,700,000.00	4,235,424.04	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%- 20/07/04	3,800,000.00	4,361,315.48	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 20/09/04	2,150,000.00	2,399,797.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 21/01/04	1,800,000.00	2,042,611.74	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	3,840,000.00	4,560,628.22	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 21/09/04	1,700,000.00	1,926,601.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	2,000,000.00	2,246,965.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 22/07/04	2,540,000.00	2,826,893.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	1,950,000.00	2,137,833.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	2,050,000.00	2,251,958.21	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	2,000,000.00	2,197,944.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	1,450,000.00	1,651,025.24	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	1,910,000.00	2,839,893.05	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	1,060,000.00	1,187,487.15	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	850,000.00	934,616.39	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	1,100,000.00	1,160,678.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	1,000,000.00	1,004,720.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,350,000.00	2,251,483.56	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,600,000.00	2,532,347.68	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	1,190,000.00	1,775,497.85	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	1,070,000.00	1,854,370.56	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,590,000.00	2,628,736.82	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	2,130,000.00	3,465,605.85	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	2,390,000.00	3,671,378.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,540,000.00	2,515,337.28	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,650,000.00	2,905,970.76	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	1,500,000.00	2,195,314.05	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,450,000.00	1,894,241.28	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	1,150,000.00	1,506,871.91	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.75%- 16/11/15	990,000.00	1,018,762.96	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 17/02/01	3,960,000.00	4,160,051.67	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 17/05/01	1,700,000.00	1,821,747.54	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 17/06/01	1,700,000.00	1,828,095.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 17/08/01	3,750,000.00	4,095,655.12	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 17/11/01	1,700,000.00	1,818,072.14	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.75%- 18/01/15	850,000.00	862,319.98	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/02/01	4,090,000.00	4,496,668.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/06/01	1,000,000.00	1,086,570.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/08/01	2,880,000.00	3,224,294.49	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/12/01	2,150,000.00	2,368,572.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/02/01	2,660,000.00	3,005,239.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 19/03/01	2,720,000.00	3,103,282.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 19/05/01	1,400,000.00	1,507,826.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 19/08/01	730,000.00	761,014.26	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/09/01	3,490,000.00	4,006,775.81	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.05%- 19/12/01	1,100,000.00	1,127,387.03	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 20/02/01	2,800,000.00	3,278,505.72	

BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 20/03/01	3,000,000.00	3,489,522.30
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	2,950,000.00	3,430,659.43
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	2,100,000.00	2,431,772.07
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/05/01	1,200,000.00	1,391,692.44
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	3,760,000.00	4,369,308.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 21/09/01	3,880,000.00	4,734,085.38
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 21/12/15	130,000.00	139,293.46
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	2,400,000.00	2,995,170.48
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,900,000.00	2,452,325.63
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	2,000,000.00	2,585,698.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	500,000.00	617,072.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,300,000.00	1,634,883.12
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	3,740,000.00	5,929,183.94
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,650,000.00	2,054,352.63
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,500,000.00	1,785,612.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,300,000.00	1,413,169.16
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	3,400,000.00	4,434,682.22
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	400,000.00	509,409.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	2,630,000.00	4,094,797.96
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	3,590,000.00	5,390,241.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	200,000.00	265,015.00



BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	4,530,000.00	6,347,964.65
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	500,000.00	594,675.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	3,790,000.00	5,761,280.19
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,900,000.00	2,872,952.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	2,080,000.00	2,942,680.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	3,050,000.00	3,854,579.93
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,770,000.00	2,569,898.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	2,510,000.00	3,644,812.91
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,720,000.00	2,482,653.16
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,240,000.00	1,407,492.12
FINNISH GOVERNMENT-1.875%-17/04/15	50,000.00	51,606.53
FINNISH GOVERNMENT-3.875%-17/09/15	880,000.00	949,384.04
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-18/09/15	210,000.00	218,204.00
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	800,000.00	933,752.72
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	920,000.00	1,061,349.16
FINNISH GOVERNMENT-0.375%-20/09/15	60,000.00	61,127.80
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	900,000.00	1,067,985.00
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	300,000.00	327,300.75
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	620,000.00	670,781.10
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	510,000.00	571,456.68
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	590,000.00	773,324.80
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	160,000.00	161,726.40
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	500,000.00	606,877.50
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	310,000.00	291,497.21
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	340,000.00	438,745.04
FRANCE (GOVT OF)-5.0%-16/10/25	4,720,000.00	4,968,011.92
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-17/04/25	5,770,000.00	6,117,285.91
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-17/10/25	4,120,000.00	4,491,719.17
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-18/04/25	3,850,000.00	4,255,634.46

FRANCE (GOVT OF) -1.0%-18/05/25	3,000,000.00	3,093,110.10	
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-18/10/25	2,300,000.00	2,606,099.41	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-18/11/25	850,000.00	880,527.75	
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-19/04/25	4,900,000.00	5,651,875.60	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-19/05/25	1,370,000.00	1,424,306.80	
FRANCE (GOVT OF) -8.5%-19/10/25	1,050,000.00	1,410,866.10	
FRANCE (GOVT OF) -3.75%-19/10/25	4,400,000.00	5,071,492.80	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-19/11/25	1,000,000.00	1,022,826.70	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-20/04/25	5,270,000.00	6,100,077.70	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-20/05/25	1,600,000.00	1,598,564.32	
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-20/10/25	4,190,000.00	4,698,889.32	
FRANCE (GOVT OF) -3.75%-21/04/25	3,840,000.00	4,602,894.33	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-21/10/25	4,340,000.00	5,129,663.00	
FRANCE (GOVT OF) -3.0%-22/04/25	3,770,000.00	4,433,218.40	
FRANCE (GOVT OF) -2.25%-22/10/25	2,280,000.00	2,575,389.27	
FRANCE (GOVT OF) -8.5%-23/04/25	1,600,000.00	2,561,652.00	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-23/05/25	3,010,000.00	3,303,224.26	
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-23/10/25	4,050,000.00	5,247,382.50	
FRANCE (GOVT OF) -2.25%-24/05/25	2,430,000.00	2,769,181.34	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-24/11/25	2,470,000.00	2,704,123.14	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-25/05/25	2,610,000.00	2,545,564.05	
FRANCE (GOVT OF) -6.0%-25/10/25	2,300,000.00	3,459,652.64	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-26/04/25	3,780,000.00	4,772,756.52	
FRANCE (GOVT OF) -2.75%-27/10/25	3,380,000.00	4,015,936.18	
FRANCE (GOVT OF) -5.5%-29/04/25	3,220,000.00	4,962,132.37	
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-30/05/25	1,280,000.00	1,488,129.28	
FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	3,080,000.00	5,117,574.00	
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	2,470,000.00	3,823,477.74	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	2,410,000.00	3,501,569.25	
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	2,740,000.00	4,342,890.95	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	1,500,000.00	2,003,557.50	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	1,520,000.00	2,399,370.61	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	1,300,000.00	2,086,955.00	
FRENCH TREASURY NOTE -1.75%-17/02/25	400,000.00	410,777.52	
FRENCH TREASURY NOTE -1.0%-17/07/25	300,000.00	306,625.86	

IRISH TREASURY-5.5%-17/10/18	690,000.00	767,793.01	
IRISH TREASURY-4.5%-18/10/18	820,000.00	931,904.17	
IRISH TREASURY-4.4%-19/06/18	840,000.00	975,548.19	
IRISH TREASURY-5.9%-19/10/18	730,000.00	898,966.74	
IRISH TREASURY-4.5%-20/04/18	1,070,000.00	1,278,545.67	
IRISH TREASURY-5.0%-20/10/18	950,000.00	1,173,607.48	
IRISH TREASURY-0.8%-22/03/15	160,000.00	163,395.20	
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	520,000.00	639,186.60	
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	800,000.00	959,322.00	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	1,180,000.00	1,631,597.80	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	680,000.00	750,852.60	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	530,000.00	522,544.64	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-17/01/15	2,000,000.00	2,068,413.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.5%-17/07/15	2,430,000.00	2,630,724.31	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-18/01/15	700,000.00	723,612.81	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-18/04/15	190,000.00	191,089.78	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	2,580,000.00	2,877,591.64	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-19/01/15	800,000.00	837,187.12	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	2,080,000.00	2,401,973.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-20/01/15	630,000.00	639,380.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	1,890,000.00	2,207,203.42	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	1,870,000.00	2,208,073.56	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	1,500,000.00	1,702,497.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	1,880,000.00	2,344,862.14	
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	970,000.00	1,472,020.97	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	1,000,000.00	1,104,607.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	830,000.00	935,424.35	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	40,000.00	38,427.59	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	1,820,000.00	2,797,158.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	560,000.00	677,784.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,490,000.00	2,258,121.37	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,680,000.00	2,590,591.08	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	960,000.00	1,278,890.76	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.2%-17/02/20	1,020,000.00	1,066,510.36	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-17/09/15	850,000.00	923,346.67	

		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	1,260,000.00	1,397,921.49	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.15%-18/10/19	660,000.00	687,087.72	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	1,620,000.00	1,869,537.18	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.95%-19/06/18	320,000.00	344,534.78	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-19/10/18	510,000.00	517,344.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	1,460,000.00	1,730,877.45	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	1,490,000.00	1,784,595.35	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	900,000.00	1,098,531.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	1,100,000.00	1,337,743.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	890,000.00	980,649.43	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	400,000.00	436,022.68	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	300,000.00	312,137.01	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	810,000.00	1,136,297.72	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	850,000.00	1,353,410.37	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	500,000.00	588,545.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,220,000.00	1,836,811.62	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	650,000.00	893,772.75	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	390,000.00	663,469.32	
	ユーロ小計		449,530,000.00	548,524,362.91 (73,206,061,473)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.75%-17/01/22	1,770,000.00	1,797,932.19	
		UK TREASURY-8.75%-17/08/25	1,510,000.00	1,739,569.67	
		UK TREASURY-1.0%-17/09/07	1,150,000.00	1,159,200.00	
		UK TREASURY-5.0%-18/03/07	2,510,000.00	2,772,070.85	
		UK TREASURY-1.25%-18/07/22	2,930,000.00	2,969,464.45	
		UK TREASURY-4.5%-19/03/07	2,680,000.00	3,007,847.34	
		UK TREASURY-1.75%-19/07/22	1,700,000.00	1,746,821.57	
		UK TREASURY-3.75%-19/09/07	2,040,000.00	2,255,617.39	
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	2,960,000.00	3,426,693.43	
		UK TREASURY-2.0%-20/07/22	1,300,000.00	1,347,884.33	
		UK TREASURY-3.75%-20/09/07	1,920,000.00	2,155,159.10	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	1,460,000.00	1,990,384.56	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	2,050,000.00	2,330,706.50	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	1,580,000.00	1,832,840.60	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	2,000,000.00	2,031,661.60	

		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	2,670,000.00	2,789,720.93	
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	1,500,000.00	1,622,162.25	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	2,280,000.00	2,924,258.68	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	1,590,000.00	1,975,754.98	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	1,000,000.00	1,462,015.90	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	2,090,000.00	2,769,034.10	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	2,110,000.00	2,667,370.63	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	2,100,000.00	2,753,637.18	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,900,000.00	2,429,257.73	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,800,000.00	2,492,454.78	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,460,000.00	1,896,206.68	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	2,530,000.00	3,309,320.96	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	3,150,000.00	4,324,127.85	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,290,000.00	1,454,849.10	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	540,000.00	637,707.91	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,650,000.00	2,236,458.34	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	1,620,000.00	2,242,820.66	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,420,000.00	1,822,540.32	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,730,000.00	2,483,961.33	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,700,000.00	2,368,374.55	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	1,520,000.00	1,949,362.00	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	110,000.00	111,365.55	
英ポンド小計			67,320,000.00	81,286,615.99	(15,081,918,730)
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-4.25%-17/06/05	620,000.00	672,018.00	
		SWITZERLAND-3.0%-18/01/08	400,000.00	435,180.00	
		SWITZERLAND-3.0%-19/05/12	400,000.00	457,020.00	
		SWITZERLAND-2.25%-20/07/06	400,000.00	459,420.00	
		SWITZERLAND-2.0%-21/04/28	160,000.00	184,744.00	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	1,330,000.00	1,779,739.50	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	230,000.00	347,944.92	
スイスフラン小計			3,540,000.00	4,336,066.42	(536,501,498)
スウェーデンク	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-3.75%-17/08/12	6,650,000.00	7,155,965.25	
		SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	8,900,000.00	10,262,189.50	

ローナ		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	8,700,000.00	10,877,827.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	8,200,000.00	9,898,802.20	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	5,990,000.00	6,458,657.60	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	5,700,000.00	6,653,433.30	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	4,630,000.00	6,174,868.95	
スウェーデンクローナ小計			48,770,000.00	57,481,744.30	(818,540,038)
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-4.25%-17/05/19	6,500,000.00	6,866,593.50	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	6,650,000.00	7,524,461.70	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	7,100,000.00	8,138,332.40	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	5,250,000.00	5,504,625.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	4,570,000.00	5,138,320.63	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	2,290,000.00	2,335,800.00	
ノルウェークローネ小計			32,360,000.00	35,508,133.23	(511,672,199)
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-2.5%-16/11/15	1,200,000.00	1,236,552.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-17/11/15	8,300,000.00	9,027,080.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	12,050,000.00	14,010,535.00	
		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	5,600,000.00	6,518,405.60	
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	8,000,000.00	8,622,408.00	
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	3,150,000.00	4,925,015.55	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	4,650,000.00	5,078,739.30	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	11,700,000.00	19,262,880.00	
デンマーククローネ小計			54,650,000.00	68,681,615.45	(1,228,714,100)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-16/10/25	2,130,000.00	2,195,391.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-17/04/25	1,980,000.00	2,071,278.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-17/07/25	800,000.00	777,960.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	2,370,000.00	2,538,033.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-18/04/25	1,800,000.00	1,888,020.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-18/07/25	2,700,000.00	2,750,355.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-19/07/25	2,490,000.00	2,605,785.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	2,400,000.00	2,723,736.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.5%-20/04/25	1,030,000.00	1,004,507.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	1,980,000.00	2,270,367.00	

		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	1,810,000.00	2,157,701.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	2,400,000.00	2,908,320.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	3,010,000.00	3,329,812.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,480,000.00	2,617,640.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	930,000.00	1,228,577.43	
ポーランドズロチ小計			30,310,000.00	33,067,483.43	(1,037,988,304)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.0%-17/02/15	2,130,000.00	2,246,602.59	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-17/07/21	1,850,000.00	1,928,107.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-18/01/21	2,070,000.00	2,238,634.62	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-18/10/21	1,570,000.00	1,635,142.44	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	2,220,000.00	2,468,815.38	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-19/10/21	1,210,000.00	1,248,901.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	2,350,000.00	2,602,575.65	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-20/11/21	400,000.00	393,379.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	2,400,000.00	2,850,660.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	1,900,000.00	2,305,051.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	2,070,000.00	2,506,175.91	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	2,350,000.00	2,387,494.25	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	2,160,000.00	2,275,583.76	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	1,970,000.00	2,248,270.38	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,540,000.00	1,841,772.24	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,110,000.00	1,150,609.35	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,090,000.00	1,296,497.23	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	470,000.00	437,335.94	
AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	790,000.00	848,855.00			
豪ドル小計			31,650,000.00	34,910,464.34	(3,056,411,152)
シンガ ポールド ル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-17/04/01	780,000.00	793,614.12	
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-18/04/01	400,000.00	393,098.60	
		SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	410,000.00	440,988.86	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01	640,000.00	663,333.76	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-19/10/01	200,000.00	200,659.62	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-20/07/01	220,000.00	221,870.44	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	810,000.00	862,947.10	

		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	220,000.00	222,886.86	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	580,000.00	616,038.18	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	200,000.00	206,700.60	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	568,448.17	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	150,000.00	149,460.15	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	620,000.00	679,682.37	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	280,000.00	288,358.98	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	330,000.00	338,601.58	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	300,000.00	329,009.13	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	480,000.00	482,569.63	
シンガポールドル小計			7,160,000.00	7,458,268.15	(646,035,187)
マレーシア アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	460,000.00	461,863.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	460,000.00	453,454.20	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	510,000.00	527,508.30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.814%-17/02/15	1,900,000.00	1,922,477.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.012%-17/09/15	2,900,000.00	2,956,927.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.314%-17/10/31	350,000.00	352,492.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	2,420,000.00	2,479,522.32	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.26%-18/03/01	200,000.00	199,900.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.58%-18/09/28	700,000.00	701,687.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	1,520,000.00	1,625,928.80	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	3,500,000.00	3,577,350.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.492%-20/03/31	350,000.00	345,362.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.889%-20/07/31	500,000.00	500,570.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	2,500,000.00	2,519,625.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	650,000.00	624,273.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,750,000.00	1,678,775.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	940,609.12	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,270,000.00	1,275,867.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	430,132.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	850,000.00	779,977.00	
MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	430,000.00	400,209.60			
MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000.00	806,107.50			
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	1,110,000.00	1,126,339.20			



		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	750,000.00	714,405.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	600,000.00	548,886.00	
マレーシアリングット小計			27,820,000.00	27,950,248.44	(796,023,075)
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 17/09/15	6,200,000.00	6,330,557.74	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 18/12/21	5,500,000.00	5,591,449.32	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	6,700,000.00	6,593,304.17	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	7,000,000.00	6,655,603.85	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	5,600,000.00	5,489,747.20	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	15,600,000.00	17,965,350.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	4,600,000.00	4,302,587.92	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	11,150,000.00	9,427,609.88	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	4,070,000.00	3,845,008.56	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	9,000,000.00	6,704,589.60	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	7,000,000.00	6,617,740.50	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	8,000,000.00	5,981,451.60	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	3,750,000.00	3,596,122.87	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	9,600,000.00	9,226,579.20	
南アフリカランド小計			103,770,000.00	98,327,702.41	(875,116,551)
合計				181,390,413,587	(181,390,413,587)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 122銘柄	100.0%	42.9%
加ドル	国債証券 31銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 18銘柄	100.0%	1.0%
ユーロ	国債証券 253銘柄	100.0%	40.4%
英ポンド	国債証券 37銘柄	100.0%	8.3%
スイスフラン	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.7%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%
豪ドル	国債証券 19銘柄	100.0%	1.7%
シンガポールドル	国債証券 17銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 25銘柄	100.0%	0.4%
南アフリカランド	国債証券 14銘柄	100.0%	0.5%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

## 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

	平成26年10月27日現在	平成27年10月26日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	56,630,210	72,925,170
コール・ローン	61,258,254	285,788,705
国債証券	29,318,465,837	26,604,496,888
派生商品評価勘定	137,812,070	281,649,170
未収入金	81,557,265	-
未収利息	358,135,350	312,932,057
前払費用	13,294,950	8,181,942

	平成26年10月27日現在	平成27年10月26日現在
流動資産合計	30,027,153,936	27,565,973,932
資産合計	30,027,153,936	27,565,973,932
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	45,415,548	188,640,533
未払金	3,147,253	-
未払解約金	37,282,594	1,979,140
流動負債合計	85,845,395	190,619,673
負債合計	85,845,395	190,619,673
純資産の部		
元本等		
元本	20,992,635,203	18,545,853,210
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,948,673,338	8,829,501,049
元本等合計	29,941,308,541	27,375,354,259
純資産合計	29,941,308,541	27,375,354,259
負債純資産合計	30,027,153,936	27,565,973,932

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

	平成26年10月27日現在	平成27年10月26日現在
1. 期首	平成25年10月29日	平成26年10月28日
期首元本額	22,305,266,953円	20,992,635,203円
期首からの追加設定元本額	513,740,541円	1,001,818,363円

期首からの一部解約元本額	1,826,372,291円	3,448,600,356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）	839,128,908円	891,171,689円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	5,193,282円	4,694,761円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	5,545,352円	4,975,446円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	12,510,038円	11,452,129円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	31,576,774円	27,842,931円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	17,526,417,254円	16,149,779,374円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	74,733,201円	78,119,674円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	107,612,513円	116,626,866円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	99,698,806円	108,965,676円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	78,227,500円	82,789,315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	2,211,991,575円	1,069,435,349円
計	20,992,635,203円	18,545,853,210円
2. 受益権の総数	20,992,635,203口	18,545,853,210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）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成25年10月29日 至 平成26年10月27日	自 平成26年10月28日 至 平成27年10月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成26年10月27日現在	平成27年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（平成26年10月27日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	920,442,760
合計	920,442,760

（平成27年10月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	297,553,224
合計	297,553,224

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(平成26年10月27日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	29,898,252,212	-	29,805,855,690	92,396,522
	米ドル	11,764,156,606	-	11,682,692,630	81,463,976
	加ドル	701,610,933	-	695,008,520	6,602,413
	メキシコペソ	311,506,869	-	308,684,590	2,822,279
	ユーロ	12,723,247,605	-	12,737,451,310	14,203,705
	英ポンド	2,484,917,808	-	2,479,588,760	5,329,048
	スイスフラン	146,023,474	-	146,190,000	166,526
	スウェーデンクローナ	173,353,548	-	171,112,360	2,241,188
	ノルウェークローネ	79,377,705	-	77,611,250	1,766,455
	デンマーククローネ	240,741,315	-	240,265,350	475,965
	ポーランドズロチ	211,353,004	-	209,153,280	2,199,724
	豪ドル	522,612,354	-	516,589,650	6,022,704
	シンガポールドル	137,904,194	-	137,653,770	250,424
	マレーシアリンギット	255,144,103	-	254,727,360	416,743
	南アフリカランド	146,302,694	-	149,126,860	2,824,166
	合計		29,898,252,212	-	29,805,855,690

(平成27年10月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	27,034,004,117	-	26,940,995,480	93,008,637
	米ドル	11,466,262,840	-	11,578,299,910	112,037,070

加ドル	537,514,041	-	539,848,550	2,334,509
メキシコペソ	277,456,723	-	283,077,690	5,620,967
ユーロ	11,055,859,878	-	10,803,737,900	252,121,978
英ポンド	2,207,144,183	-	2,230,159,250	23,015,067
スイスフラン	96,638,761	-	96,505,390	133,371
スウェーデンク ローナ	120,383,948	-	118,230,300	2,153,648
ノルウェークローネ	68,634,300	-	68,404,870	229,430
デンマーククローネ	188,116,692	-	185,392,980	2,723,712
ポーランドズロチ	147,798,086	-	145,174,150	2,623,936
豪ドル	418,709,367	-	432,284,690	13,575,323
シンガポールドル	94,749,995	-	96,638,990	1,888,995
マレーシアリン ギット	214,889,631	-	223,795,840	8,906,209
南アフリカランド	139,845,672	-	139,444,970	400,702
合計	27,034,004,117	-	26,940,995,480	93,008,637

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

平成26年10月27日現在		平成27年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.4263円	1口当たり純資産額	1.4761円
(1万口当たり純資産額)	(14,263円)	(1万口当たり純資産額)	(14,761円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-3.125%-16/10/31	1,000,000.00	1,027,812.50	
		US TREASURY N/B-4.625%-16/11/15	1,160,000.00	1,211,021.87	
		US TREASURY N/B-2.75%-16/11/30	1,000,000.00	1,025,546.87	
		US TREASURY N/B-0.875%-16/11/30	700,000.00	703,500.00	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/12/31	1,250,000.00	1,291,406.25	
		US TREASURY N/B-0.875%-16/12/31	1,000,000.00	1,005,156.25	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/01/31	380,000.00	392,973.43	
		US TREASURY N/B-0.875%-17/01/31	3,900,000.00	3,921,328.12	
		US TREASURY N/B-3.25%-17/03/31	1,170,000.00	1,215,154.68	
		US TREASURY N/B-1.0%-17/03/31	1,700,000.00	1,712,218.75	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/04/30	1,050,000.00	1,091,671.87	
		US TREASURY N/B-4.5%-17/05/15	820,000.00	870,225.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-17/05/31	1,000,000.00	1,034,843.75	
		US TREASURY N/B-0.625%-17/05/31	1,500,000.00	1,501,406.25	
		US TREASURY N/B-0.75%-17/06/30	1,200,000.00	1,203,468.75	
		US TREASURY N/B-2.375%-17/07/31	1,100,000.00	1,133,859.37	
		US TREASURY N/B-1.875%-17/09/30	1,750,000.00	1,791,152.34	
		US TREASURY N/B-0.75%-17/10/31	1,500,000.00	1,502,226.56	
		US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	480,000.00	514,687.50	
		US TREASURY N/B-0.625%-17/11/30	1,700,000.00	1,696,945.31	
		US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	250,000.00	265,566.40	
		US TREASURY N/B-0.75%-18/02/28	1,200,000.00	1,198,687.50	
		US TREASURY N/B-0.75%-18/03/31	300,000.00	299,554.68	
		US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	200,000.00	215,453.12	
US TREASURY N/B-1.0%-18/05/31	2,200,000.00	2,207,390.62			



US TREASURY N/B-2.375%-18/06/30	700,000.00	727,726.56	
US TREASURY N/B-1.375%-18/07/31	350,000.00	354,566.40	
US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	770,000.00	836,953.90	
US TREASURY N/B-1.5%-18/08/31	3,200,000.00	3,251,750.00	
US TREASURY N/B-1.75%-18/10/31	700,000.00	716,679.68	
US TREASURY N/B-1.375%-18/11/30	600,000.00	606,843.75	
US TREASURY N/B-1.375%-18/12/31	700,000.00	707,546.87	
US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	660,000.00	696,196.87	
US TREASURY N/B-1.5%-19/03/31	1,000,000.00	1,013,437.50	
US TREASURY N/B-1.625%-19/03/31	500,000.00	508,593.75	
US TREASURY N/B-1.25%-19/04/30	1,200,000.00	1,205,156.25	
US TREASURY N/B-1.625%-19/04/30	750,000.00	762,656.25	
US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	2,150,000.00	2,298,316.40	
US TREASURY N/B-1.625%-19/06/30	500,000.00	508,007.81	
US TREASURY N/B-0.875%-19/07/31	1,050,000.00	1,037,203.12	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	1,050,000.00	1,144,417.96	
US TREASURY N/B-1.25%-19/10/31	600,000.00	599,953.12	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	550,000.00	596,148.43	
US TREASURY N/B-1.375%-20/01/31	2,500,000.00	2,505,859.37	
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	1,400,000.00	1,534,421.87	
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	800,000.00	874,437.50	
US TREASURY N/B-2.0%-20/07/31	1,200,000.00	1,232,156.25	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	390,000.00	523,361.71	
US TREASURY N/B-1.375%-20/09/30	3,600,000.00	3,592,687.50	
US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	1,110,000.00	1,171,050.00	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	1,600,000.00	1,770,750.00	
US TREASURY N/B-2.25%-21/04/30	950,000.00	984,585.93	
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	2,000,000.00	2,163,437.50	
US TREASURY N/B-2.25%-21/07/31	300,000.00	310,429.68	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	750,000.00	770,039.06	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	970,000.00	1,324,732.03	
US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	500,000.00	509,218.75	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	650,000.00	661,425.78	
US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	1,750,000.00	1,747,675.78	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	850,000.00	841,167.96	

US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	550,000.00	555,757.81	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	950,000.00	940,054.68	
US TREASURY N/B-6.25%-23/08/15	880,000.00	1,161,118.75	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	1,000,000.00	1,043,046.87	
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	1,700,000.00	1,805,187.50	
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	1,200,000.00	1,272,187.50	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	1,200,000.00	1,246,968.75	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	800,000.00	822,250.00	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	1,200,000.00	1,218,750.00	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	850,000.00	844,488.28	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	500,000.00	501,679.68	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	680,000.00	960,765.62	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	210,000.00	279,529.68	
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	390,000.00	509,193.75	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	170,000.00	218,503.12	
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	390,000.00	440,242.96	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	100,000.00	128,257.81	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	300,000.00	398,554.68	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	230,000.00	295,028.90	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	350,000.00	416,582.03	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	200,000.00	257,500.00	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	200,000.00	234,343.75	
US TREASURY N/B-3.125%-41/11/15	350,000.00	368,839.84	
US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	950,000.00	1,000,468.75	
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	700,000.00	680,859.37	
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	900,000.00	942,117.18	
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	750,000.00	746,425.78	
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	890,000.00	1,023,986.71	
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	200,000.00	235,265.62	
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	1,650,000.00	1,895,566.40	
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	120,000.00	131,512.50	
US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	1,150,000.00	1,170,843.75	
US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	1,000,000.00	917,265.62	
米ドル小計	90,570,000.00	94,785,992.67	(11,482,375,152)

加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-17/03/01	300,000.00	303,927.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-17/06/01	300,000.00	316,494.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	500,000.00	547,490.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	350,000.00	388,706.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	750,000.00	841,747.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	300,000.00	337,113.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	750,000.00	826,477.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	150,000.00	248,421.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	480,000.00	699,715.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	710,000.00	1,039,049.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	200,000.00	264,744.00	
加ドル小計			4,790,000.00	5,813,885.20	(534,296,049)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%- 16/12/15	5,000,000.00	5,208,750.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 17/12/14	4,000,000.00	4,313,400.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	6,000,000.00	6,738,600.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	5,000,000.00	6,456,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	6,000,000.00	7,192,500.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	2,500,000.00	2,822,375.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	4,500,000.00	5,448,712.50	
メキシコペソ小計			33,000,000.00	38,180,337.50	(279,480,070)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-5.5%-17/09/28	720,000.00	800,079.91	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	100,000.00	114,258.33	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	650,000.00	768,958.97	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	200,000.00	248,227.84	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	150,000.00	185,967.37	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	620,000.00	703,565.64	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	300,000.00	349,871.01	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	130,000.00	196,696.92	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	560,000.00	887,971.44	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	400,000.00	613,913.32	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.25%- 16/10/31	300,000.00	313,001.94	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 17/01/31	600,000.00	628,926.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.1%- 17/04/30	700,000.00	722,126.72	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 17/07/30	580,000.00	635,805.45	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%- 18/07/30	550,000.00	608,674.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%- 19/07/30	560,000.00	647,802.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%- 19/10/31	400,000.00	461,304.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%- 20/10/31	320,000.00	385,594.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	450,000.00	563,484.87	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	500,000.00	647,463.95	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	1,200,000.00	1,516,026.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	300,000.00	300,804.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	200,000.00	254,408.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	150,000.00	156,971.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	400,000.00	560,954.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	530,000.00	772,953.11	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	780,000.00	989,976.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	400,000.00	547,221.32	
BUNDES OBLIGATION-1.25%-16/10/14	500,000.00	507,590.35	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 17/01/04	430,000.00	450,987.61	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 17/07/04	1,120,000.00	1,206,571.74	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-	250,000.00	273,744.95	

18/01/04		
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 18/07/04	1,200,000.00	1,347,270.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 19/01/04	710,000.00	801,313.95
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 20/01/04	450,000.00	515,119.14
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%- 20/07/04	800,000.00	918,171.68
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 20/09/04	700,000.00	781,329.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 21/01/04	550,000.00	624,131.36
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	250,000.00	296,915.90
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	300,000.00	337,044.87
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	300,000.00	328,897.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	300,000.00	329,554.86
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	500,000.00	549,486.15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	470,000.00	698,821.85
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	500,000.00	527,581.25
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	150,000.00	150,708.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	410,000.00	648,914.09
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	350,000.00	606,569.81
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	320,000.00	529,053.95
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	660,000.00	1,013,853.58
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	250,000.00	408,333.97
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	190,000.00	334,626.93
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-	150,000.00	219,531.40

42/07/04			
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	450,000.00	587,867.98	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 17/02/01	900,000.00	945,466.29	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 17/08/01	1,000,000.00	1,092,174.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/02/01	730,000.00	802,583.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/08/01	900,000.00	1,007,592.03	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/02/01	510,000.00	576,192.59	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 19/05/01	500,000.00	538,509.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/09/01	600,000.00	688,843.98	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 20/02/01	650,000.00	761,081.68	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 20/03/01	350,000.00	407,110.93	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	1,050,000.00	1,221,082.17	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	1,280,000.00	1,487,424.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	800,000.00	998,390.16	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	550,000.00	709,883.73	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	400,000.00	503,040.96	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	430,000.00	681,697.61	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	200,000.00	238,081.68	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	250,000.00	326,079.57	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	100,000.00	127,352.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	950,000.00	1,426,387.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-	300,000.00	397,522.50	

28/09/01		
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	450,000.00	630,592.51
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	750,000.00	1,140,095.02
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	250,000.00	378,020.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	250,000.00	353,687.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	160,000.00	202,207.47
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	600,000.00	871,152.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	500,000.00	726,058.35
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	150,000.00	216,510.45
FINNISH GOVERNMENT-1.875%-17/04/15	150,000.00	154,819.60
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	160,000.00	186,750.54
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	350,000.00	403,774.14
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	100,000.00	108,190.50
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	200,000.00	262,144.00
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	100,000.00	129,042.66
FRANCE (GOVT OF)-5.0%-16/10/25	690,000.00	726,255.98
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-17/04/25	1,350,000.00	1,431,254.07
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-18/04/25	1,700,000.00	1,879,111.32
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25	1,050,000.00	1,211,116.20
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-19/10/25	590,000.00	792,772.38
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	770,000.00	887,511.24
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	700,000.00	810,257.00
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	250,000.00	280,363.32
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	530,000.00	635,295.31
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	500,000.00	590,975.00
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	150,000.00	176,388.00
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	450,000.00	508,300.51
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	300,000.00	329,225.01
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	950,000.00	1,230,867.50
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	700,000.00	797,706.56

FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	1,100,000.00	1,654,616.48	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	600,000.00	757,580.40	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	660,000.00	1,017,083.03	
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	300,000.00	498,465.00	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	430,000.00	665,625.68	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	410,000.00	595,702.65	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	250,000.00	396,249.17	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	350,000.00	467,496.75	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	320,000.00	505,130.65	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	200,000.00	321,070.00	
IRISH TREASURY-4.5%-20/04/18	600,000.00	716,941.50	
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	200,000.00	245,841.00	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	300,000.00	414,813.00	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	100,000.00	98,593.33	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.5%-17/07/15	350,000.00	378,910.91	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	620,000.00	691,514.27	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	200,000.00	230,959.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	750,000.00	875,874.37	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	500,000.00	590,394.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	270,000.00	336,762.11	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	150,000.00	165,691.15	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	470,000.00	722,343.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	500,000.00	757,758.85	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	150,000.00	231,302.77	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	470,000.00	521,446.90	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	500,000.00	577,017.65	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	200,000.00	237,106.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	250,000.00	299,428.75	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	200,000.00	218,011.34	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	350,000.00	490,992.84	
REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	200,000.00	318,449.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	200,000.00	301,116.66	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	150,000.00	206,255.25	
ユーロ小計	64,610,000.00	80,070,486.66	(10,686,207,149)



英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.0%-17/09/07	400,000.00	403,200.00	
		UK TREASURY-5.0%-18/03/07	960,000.00	1,060,234.27	
		UK TREASURY-4.5%-19/03/07	830,000.00	931,534.81	
		UK TREASURY-1.75%-19/07/22	650,000.00	667,902.36	
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	240,000.00	277,840.00	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	570,000.00	777,067.94	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	450,000.00	511,618.50	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	400,000.00	406,332.32	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	190,000.00	243,688.22	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	150,000.00	186,391.98	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	420,000.00	614,046.67	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	550,000.00	728,693.18	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	430,000.00	543,587.38	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	210,000.00	268,496.90	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	370,000.00	512,337.92	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	300,000.00	392,409.60	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	620,000.00	851,098.18	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	800,000.00	1,084,343.44	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	560,000.00	804,056.84	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	250,000.00	348,290.37	
UK TREASURY-3.5%-68/07/22	200,000.00	256,495.00			
英ポンド小計			9,550,000.00	11,869,665.88	(2,202,297,807)
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-4.25%-17/06/05	250,000.00	270,975.00	
		SWITZERLAND-3.0%-18/01/08	150,000.00	163,192.50	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	140,000.00	187,341.00	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	100,000.00	151,280.40	
スイスフラン小計			640,000.00	772,788.90	(95,617,170)
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	1,500,000.00	1,729,582.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	3,100,000.00	3,876,007.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	500,000.00	539,120.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	850,000.00	992,178.65	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	700,000.00	933,565.50	
			6,650,000.00	8,070,454.15	

スウェーデンクローナ小計				(114,923,267)	
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-4.25%-17/05/19	1,100,000.00	1,162,038.90	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	1,000,000.00	1,131,498.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	400,000.00	458,497.60	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	1,400,000.00	1,467,900.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	450,000.00	505,961.55	
ノルウェークローネ小計			4,350,000.00	4,725,896.05	(68,100,162)
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-4.0%-17/11/15	1,000,000.00	1,087,600.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	1,800,000.00	2,092,860.00	
		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	2,450,000.00	2,851,802.45	
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	650,000.00	1,016,273.05	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	1,850,000.00	3,045,840.00	
デンマーククローネ小計			7,750,000.00	10,094,375.50	(180,588,377)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	2,000,000.00	2,141,800.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	1,000,000.00	1,146,650.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	1,000,000.00	1,211,800.00	
ポーランドズロチ小計			4,000,000.00	4,500,250.00	(141,262,847)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-18/01/21	500,000.00	540,733.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	1,000,000.00	1,112,079.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	970,000.00	1,152,141.75	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	300,000.00	363,955.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	300,000.00	363,213.90	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	400,000.00	406,382.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	400,000.00	478,382.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	250,000.00	259,146.25	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	200,000.00	214,900.00	
豪ドル小計			4,320,000.00	4,890,933.80	(428,201,254)
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	400,000.00	430,233.04	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	100,000.00	101,312.21	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	400,000.00	438,504.76	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	150,000.00	150,803.01	

シンガポールドル小計			1,050,000.00	1,120,853.02 (97,088,288)	
マレーシア アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	1,000,000.00	1,004,050.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	2,150,000.00	2,202,881.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	600,000.00	613,260.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	600,000.00	575,580.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	550,000.00	552,541.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	600,000.00	571,524.00	
マレーシアアリンギット小計			5,500,000.00	5,519,836.40 (157,204,940)	
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 18/12/21	1,500,000.00	1,524,940.72	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	2,500,000.00	2,460,188.12	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	4,000,000.00	4,606,500.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	700,000.00	521,468.08	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	2,000,000.00	1,890,783.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	4,550,000.00	4,373,014.10	
南アフリカランド小計			15,250,000.00	15,376,894.02 (136,854,356)	
合計				26,604,496,888 (26,604,496,888)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 93銘柄	100.0%	43.0%
加ドル	国債証券 11銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 7銘柄	100.0%	1.1%
ユーロ	国債証券 136銘柄	100.0%	40.2%
英ポンド	国債証券 21銘柄	100.0%	8.3%

スイスフラン	国債証券	4銘柄	100.0%	0.4%
スウェーデンクローナ	国債証券	5銘柄	100.0%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券	5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券	5銘柄	100.0%	0.7%
ポーランドズロチ	国債証券	3銘柄	100.0%	0.5%
豪ドル	国債証券	9銘柄	100.0%	1.6%
シンガポールドル	国債証券	4銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	6銘柄	100.0%	0.6%
南アフリカランド	国債証券	6銘柄	100.0%	0.5%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2015年10月30日現在です。

### 【アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)】

#### 【純資産額計算書】

資産総額	152,769,010円
負債総額	12,389円
純資産総額( - )	152,756,621円
発行済口数	107,454,360口
1口当たり純資産額( / )	1.4216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	28,717,130,132円
負債総額	481,060,309円
純資産総額( - )	28,236,069,823円
発行済口数	21,404,863,735口
1口当たり純資産額( / )	1.3191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	79,634,807,870円
負債総額	85,033,962円
純資産総額( - )	79,549,773,908円
発行済口数	39,202,683,361口
1口当たり純資産額( / )	2.0292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	2,603,382,392円
負債総額	15,248,856円
純資産総額（ - ）	2,588,133,536円
発行済口数	2,035,232,631口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2717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	34,840,664,839円
負債総額	65,876,665円
純資産総額（ - ）	34,774,788,174円
発行済口数	25,972,097,444口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3389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	182,906,576,898円
負債総額	122,263,505円
純資産総額（ - ）	182,784,313,393円
発行済口数	78,382,072,842口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3320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	27,465,019,250円
負債総額	149,613,224円
純資産総額（ - ）	27,315,406,026円
発行済口数	18,545,414,708口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4729円

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### （1）名義書換

該当事項はありません。

##### （2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

( 3 ) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

( 4 ) 受益証券の再発行

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

( 5 ) 受益権の再分割

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

( 6 ) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1) 資本金の額

平成27年10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（平成27年10月末現在）

###### ・株主総会

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

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

###### ・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。

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

###### ・監査役会

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

###### (3) 運用の意思決定プロセス（平成27年10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】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、平成27年10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	597	115,454



株式投資信託	542	90,846
単位型	103	3,260
追加型	439	87,585
公社債投資信託	55	24,608
単位型	39	384
追加型	16	24,224
投資法人合計	1	11

### 3【委託会社等の経理状況】

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

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

2. 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56期事業年度（平成26年4月1日から平成27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。

また、第57期中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

#### （1）【貸借対照表】

	(単位:百万円)			
	第55期 (平成26年3月31日)		第56期 (平成27年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	17,805	3	14,206
有価証券		234		277
前払費用	3	419	3	509
未収入金		37		3
未収委託者報酬		7,162		8,441
未収収益	3	608	3	1,566
関係会社短期貸付金		240		436
立替金		303		666
繰延税金資産		984		1,446
その他	2	30	2	195
流動資産合計		27,826		27,750
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	47	1	56
器具備品	1	134	1	166
有形固定資産合計		181		222
無形固定資産				
ソフトウェア		91		113

無形固定資産合計	91	113
投資その他の資産		
投資有価証券	7,290	14,184
関係会社株式	21,702	21,702
関係会社長期貸付金	60	60
長期差入保証金	692	740
長期前払費用	-	0
繰延税金資産	525	248
投資その他の資産合計	30,271	36,936
固定資産合計	30,544	37,273
資産合計	58,371	65,023

(単位：百万円)

	第55期 (平成26年3月31日)		第56期 (平成27年3月31日)
負債の部			
流動負債			
預り金	329		387
未払金	3,404		5,545
未払収益分配金	6		6
未払償還金	112		112
未払手数料	3	2,743	3
その他未払金	542		2,282
未払費用	3	3,239	3
未払法人税等		2,286	
未払消費税等	4	356	4
賞与引当金		1,935	
役員賞与引当金		150	
その他		-	3
流動負債合計	11,702		14,646
固定負債			
退職給付引当金		1,081	
その他		55	
固定負債合計		1,137	
負債合計	12,840		15,758
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	22,694		25,836
利益剰余金合計	22,694		25,836
自己株式	68		68

株主資本合計	45,209	48,351
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	321	1,002
繰延ヘッジ損益	-	88
評価・換算差額等合計	321	913
純資産合計	45,531	49,265
負債純資産合計	58,371	65,023

## (2) 【損益計算書】

	(単位:百万円)	
	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	63,120	63,990
その他営業収益	2,557	3,729
営業収益合計	65,678	67,719
営業費用		
支払手数料	31,207	30,408
広告宣伝費	1,081	1,045
公告費	2	5
調査費	13,405	15,571
調査費	712	747
委託調査費	12,669	14,782
図書費	23	41
委託計算費	465	502
営業雑経費	558	660
通信費	186	199
印刷費	252	263
協会費	43	64
諸会費	11	27
その他	65	106
営業費用計	46,721	48,193
一般管理費		
給料	7,171	7,585
役員報酬	316	289
役員賞与引当金繰入額	150	120
給料・手当	4,719	5,127
賞与	50	59
賞与引当金繰入額	1,935	1,990
交際費	108	163
寄付金	54	36
旅費交通費	448	503
租税公課	209	208
不動産賃借料	755	785
退職給付費用	313	349
退職金	32	16
固定資産減価償却費	109	148
福利費	847	908
諸経費	2,517	2,673

一般管理費計	12,568	13,380
営業利益	6,388	6,146

(単位：百万円)

	第55期		第56期	
	(自	平成25年4月1日	(自	平成26年4月1日
	至	平成26年3月31日)	至	平成27年3月31日)
営業外収益				
受取利息		17		10
受取配当金	1	1,774	1	1,152
有価証券償還益		-		13
時効成立分配金・償還金		4		1
為替差益		26		-
その他		19		107
営業外収益合計		1,842		1,285
営業外費用				
支払利息		19		28
有価証券償還損		-		81
デリバティブ費用		-		269
時効成立後支払分配金・償還金		22		295
支払源泉所得税		57		71
為替差損		-		26
その他		13		21
営業外費用合計		114		795
経常利益		8,116		6,636
特別利益				
投資有価証券売却益		135		270
特別利益合計		135		270
特別損失				
投資有価証券売却損		12		22
関係会社株式評価損		4,500		-
固定資産処分損		0		0
割増退職金		59		243
役員退職一時金		235		-
外国税関連費用		-	2	1,650
特別損失合計		4,807		1,916
税引前当期純利益		3,445		4,991
法人税、住民税及び事業税		3,020		2,356
法人税等調整額		119		466
法人税等合計		2,900		1,890
当期純利益		544		3,101

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26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	23,530	23,530	68	46,045
会計方針の変更による累積的影響額							-
会計方針の変更を反映した当期首残高	17,363	5,220	5,220	23,530	23,530	68	46,045
当期変動額							
剰余金の配当				1,380	1,380		1,380
当期純利益				544	544		544
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	836	836	-	836
当期末残高	17,363	5,220	5,220	22,694	22,694	68	45,209

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	362	362	46,408
会計方針の変更による累積的影響額		-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	362	362	46,408
当期変動額			
剰余金の配当			1,380
当期純利益			544
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	40	40	40
当期変動額合計	40	40	876
当期末残高	321	321	45,531

第56期（自 平成26年4月1日 至 平成27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	22,694	22,694	68	45,209
会計方針の変更による累積的影響額				41	41		41
会計方針の変更を反映した当期首残高	17,363	5,220	5,220	22,735	22,735	68	45,250
当期変動額							
当期純利益				3,101	3,101		3,101

株主資本以外の項目の当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	3,101	3,101	-	3,101
当期末残高	17,363	5,220	5,220	25,836	25,836	68	48,351

	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	321	-	321	45,531
会計方針の変更による累積的影響額			-	41
会計方針の変更を反映した当期首残高	321	-	321	45,572
当期変動額				
当期純利益				3,101
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	680	88	591	591
当期変動額合計	680	88	591	3,692
当期末残高	1,002	88	913	49,265

## [注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27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  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  定率法により償却しております。  なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。  建物 3年～15年  器具備品 4年～20年</p> <p>(2) 無形固定資産  定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金  従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p>

<p>4 ヘッジ会計の方法</p> <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>	<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。 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。 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翌事業年度から費用処理しております。</p> <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> <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>
--	---

（会計方針の変更）

<p style="text-align: center;">第56期 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)</p> <p>「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日。以下「退職給付適用指針」という。）を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めについて当事業年度より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更するとともに、割引率の決定方法を平均残存勤務年数に対応した高格付社債の流通利回りを基礎とする方法から退職給付の支払見込期間及び期間毎の金額を反映した単一の加重平均割引率を使用する方法へ変更いたしました。</p> <p>退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従い、当事業年度の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。</p> <p>この結果、当事業年度の期首の退職給付引当金が63百万円減少、繰延税金資産が22百万円減少、繰越利益剰余金が41百万円増加しております。また、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益への影響は軽微であります。なお、1株当たり純資産額及び1株当たり当期純利益金額に対する影響額は、軽微であります。</p>
--

（表示方法の変更）

<p style="text-align: center;">第56期 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)</p>
---

## （損益計算書関係）

前事業年度において、「一般管理費」の「諸経費」に含めていた「福利費」は、重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「一般管理費」の「諸経費」に表示していた3,364百万円は、「福利費」847百万円、「諸経費」2,517百万円として組み替えております。

## （貸借対照表関係）

第55期 (平成26年3月31日)	第56期 (平成27年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,091百万円</p> <p>器具備品 625百万円</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,122百万円</p> <p>器具備品 679百万円</p>
<p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>	<p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</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。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 6,249百万円</p> <p>前払費用 2百万円</p> <p>未収収益 74百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 98百万円</p> <p>未払費用 274百万円</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。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 4,256百万円</p> <p>前払費用 2百万円</p> <p>未収収益 110百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 108百万円</p> <p>未払費用 500百万円</p> <p>その他 57百万円</p>
<p>4 消費税等の取扱い</p> <p>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>4 消費税等の取扱い</p> <p>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</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務65百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務159百万円に対して保証を行っております。</p>	<p>5 保証債務</p> <p>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27百万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842百万円に対して保証を行っております。</p>

## （損益計算書関係）

第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27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> <p>受取配当金 1,290百万円</p>	<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> <p>受取配当金 719百万円</p> <p>2 外国税関連費用1,650百万円は、中国税務当局等が平成26年10月31日付に発した「通達79号」に基づき、平成21年11月17日から平成26年11月16日までのQFII(Qualified Foreign Institutional Investors)口座を通じて取得した中国A株の譲渡所得に対して税率10%で遡及課税される金額を合理的に計算したものであります。中国A株に投資している当社の対象ファンドは「中国A株マザーファンド」及び「中国A株CSI300インデックスマザーファンド」の2ファンドであり、ファンドの当時の受益者に負担を求めることが事実上不可能であるため、当社が負担しております。</p>
--	--

## (株主資本等変動計算書関係)

第55期(自平成25年4月1日至平成26年3月31日)

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

## 3 新株予約権等に関する事項

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

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

## 4 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

- (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの  
該当事項はありません。

第56期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

## 3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高 (百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
平成21年度 ストックオプション(1)	普通株式	15,902,700	-	-	15,902,700	-
平成21年度 ストックオプション(2)	普通株式	1,567,500	-	-	1,567,500	-
平成22年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,310,000	-	-	2,310,000	-
第1回新株予約権	普通株式	2,955,200	-	2,955,200	-	-
平成23年度 ストックオプション(1)	普通株式	5,388,900	-	359,700	5,029,200	-
合計		28,124,300	-	3,314,900	24,809,400	-

- (注) 1 平成23年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。  
2 第1回新株予約権の新株予約権の目的となる株式の数は、新株予約権の行使に関する通知が当社に提出された日における、当社の発行済株式数×0.25%に6を乗じた数で算出され、当事業年度末の発行済株式に基づき算出しております。なお、当該新株予約権は平成27年2月8日に失効いたしました。  
3 平成21年度ストックオプション(1)15,902,700株、平成21年度ストックオプション(2)1,567,500株、平成22年度ストックオプション(1)2,310,000株及び平成23年度ストックオプション(1)4,075,500株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

## 4 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

該当事項はありません。

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年5月25日 取締役会	普通株式	利益剰余金	850	4.32	平成27年3月31日	平成27年6月30日

## (リース取引関係)

第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27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 751百万円	1年内 841百万円
1年超 77百万円	1年超 3,420百万円
合計 828百万円	合計 4,261百万円

## (金融商品関係)

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

## 1 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

( )負債に計上されているものについては、( )で示しております。

### (注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

#### (1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

#### (4) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

#### (5) 未払金及び(6) 未払費用

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27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、また一部外貨建て預金を保有しているため為替変動リスクにも晒されております。営業債権である未収委託者報酬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。

## (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、短期間の取引が想定される金融機関の場合を除き、相手方の財政状態及び経営成績、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。

### 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

平成27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	14,206	14,206	-
(2) 未収委託者報酬	8,441	8,441	-
(3) 未収収益	1,566	1,566	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	14,431	14,431	-
(5) 未払金	(5,545)	(5,545)	-
(6) 未払費用	(4,636)	(4,636)	-
(7) 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	(25)	(25)	-
ヘッジ会計が適用されているもの デリバティブ取引計	(57) (82)	(57) (82)	- -

( 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) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(5) 未払金及び(6) 未払費用

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

(7) 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、上記金額は貸借対照表上、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30百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	14,206	-	-	-
未収委託者報酬	8,441	-	-	-
未収収益	1,566	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	277	1,219	3,205	1,232
合計	24,492	1,219	3,205	1,232

(有価証券関係)

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

## 1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	18,809
関連会社株式	2,892

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

## 2 その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

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

## 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	18,809
関連会社株式	2,892

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

## 2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
--	----	----------	------	----

貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	投資信託	12,839	11,293	1,546
	小計	12,839	11,293	1,546
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	1,591	1,656	64
	小計	1,591	1,656	64
合計		14,431	12,949	1,482

(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 30百万円）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	3,661	270	22
合計	3,661	270	22

### （デリバティブ取引関係）

第55期(平成26年3月31日)

該当事項はありません。

第56期(平成27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	2,337	-	25	25
	買建	-	-	-	-
合計		2,337	-	25	25

(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

##### （1）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	為替予約取引 売建 米ドル	投資有価	2,586	-	68



法	豪ドル	証券	276	-	8
	シンガポールドル		878	-	4
	ユーロ		219	-	1
合計			3,961	-	57

(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55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27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	3,065	(1) 関連会社に対する投資の金額	3,078
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	7,660	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	9,396
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,379	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,720

(退職給付関係)

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.8%

### 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、176百万円でありました。

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27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	1,174
会計方針の変更による累積的影響額	63
会計方針の変更を反映した期首残高	1,110
勤務費用	126
利息費用	7
数理計算上の差異の発生額	47
退職給付の支払額	59
退職給付債務の期末残高	1,233

##### (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	1,233
未積立退職給付債務	1,233
未認識数理計算上の差異	121
貸借対照表に計上された負債の額	1,111

退職給付引当金	1,111
貸借対照表に計上された負債の額	1,111

##### (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	126
利息費用	7
数理計算上の差異の費用処理額	18
確定給付制度に係る退職給付費用	152

##### (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 0.6%

### 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、196百万円でありました。

## （ストックオプション等関係）

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

## 1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

## (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

## ストックオプション（新株予約権）の数

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

## 単価情報

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

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

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

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社の従業員 1名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 186名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)	普通株式 2,310,000株	普通株式 6,101,700株
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日

権利確定条件	平成24年1月22日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	平成25年10月7日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	平成24年1月22日から 平成32年1月21日まで	平成25年10月7日から 平成33年10月6日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

### ストックオプション（新株予約権）の数

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

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日
権利確定前(株)		
期首	2,310,000	5,388,900
付与	0	0
失効	0	359,700
権利確定	0	0
権利未確定残	2,310,000	5,029,200
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

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

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

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

(税効果会計関係)

第55期 (平成26年 3 月31日)	第56期 (平成27年 3 月31日)
------------------------	------------------------

1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	(単位：百万円)	1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	(単位：百万円)
繰延税金資産(流動)		繰延税金資産(流動)	
賞与引当金	689	賞与引当金	658
その他	294	その他	813
小計	984	小計	1,472
繰延税金資産(固定)		繰延税金資産(固定)	
投資有価証券評価損	148	投資有価証券評価損	134
関係会社株式評価損	1,665	関係会社株式評価損	1,510
退職給付引当金	385	退職給付引当金	360
固定資産減価償却費	158	固定資産減価償却費	133
その他	34	その他	73
小計	2,391	小計	2,213
繰延税金資産小計	3,375	繰延税金資産小計	3,685
評価性引当金	1,665	評価性引当金	1,510
繰延税金資産合計	1,710	繰延税金資産合計	2,174
繰延税金負債(固定)		繰延税金負債(流動)	
その他有価証券評価差額金	200	その他有価証券評価差額金	25
繰延税金負債合計	200	小計	25
繰延税金資産の純額	1,510	繰延税金負債(固定)	
		その他有価証券評価差額金	454
		小計	454
		繰延税金負債合計	480
		繰延税金資産の純額	1,694
2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳		2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率	38.0%	法定実効税率	35.6%
(調整)		(調整)	
評価性引当金の増減	46.6%	交際費等永久に損金に算入されない項目	1.3%
交際費等永久に損金に算入されない項目	3.7%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.3%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	12.9%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	3.6%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.9%	海外子会社の留保利益の影響額等	1.7%
海外子会社の留保利益の影響額等	6.9%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	37.9%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	84.2%		



<p>3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」(平成26年法律第10号)の施行に伴い、「復興特別法人税に関する政令の一部を改正する政令」(平成26年政令第151号)が平成26年3月31日に公布されたことにより、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、平成26年4月1日に開始する事業年度において解消が見込まれる一時差異について、当社が使用した法定実効税率は38.0%から35.6%に変更されております。この結果、繰延税金資産の金額(繰延税金負債の金額を控除した金額)は65百万円減少し、その他有価証券評価差額金の金額が1百万円、法人税等調整額の金額が63百万円、それぞれ増加しております。</p>	<p>3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」(平成27年法律第9号)の施行に伴い平成26年4月1日に開始する事業年度から、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.1%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.3%となります。この結果、繰延税金資産の金額(繰延税金負債の金額を控除した金額)は135百万円、繰延ヘッジ損益が4百万円、それぞれ減少し、その他有価証券評価差額金が48百万円、法人税等調整額が179百万円、それぞれ増加しております。</p>
--	--

## ( 関連当事者情報 )

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

## 1 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社  
重要な該当事項はありません。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成25年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	15,790百万円
負債合計	1,713百万円
純資産合計	14,076百万円
営業収益	11,350百万円
税引前当期純利益	4,212百万円
当期純利益	3,096百万円

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社  
重要な該当事項はありません。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金 又は 出資金 (千SGD)	事業の 内容	議決権 等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連 当事者 との 関係	取引の 内容	取引金額 (百万円)	科目	期末 残高 (百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガ ポール 国	292,000	アセット マネジメ ント業	直接 100.00	資金の 貸付	資金の 貸付 (シンガ ポール ドル貨 建) (注1)	184 (千 SGD 2,059) (注2)	関係 会社 短期 貸付 金	436 (千 SGD 5,000)
							貸付金 利息 (シンガ ポール ドル貨 建) (注1)	7 (千 SGD 92)	未収 収益	7 (千 SGD 82)

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠SGD11百万、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 資金の貸付に係る取引金額184百万円(2,059千 SGD)の内訳は、貸付424百万円(5,000千 SGD)及び返済240百万円(2,940千 SGD)であります。

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成26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	23,832百万円
負債合計	6,549百万円
純資産合計	17,283百万円
営業収益	15,406百万円
税引前当期純利益	4,977百万円
当期純利益	3,441百万円

## (セグメント情報等)

## セグメント情報

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

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

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

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

## 関連情報

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

## 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

### 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

該当事項はありません。

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27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55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

該当事項はありません。

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27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55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

該当事項はありません。

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27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55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
1株当たり純資産額	231円23銭	250円20銭
1株当たり当期純利益金額	2円76銭	15円74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55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益(百万円)	544	3,101
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)	544	3,101
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,903	196,903
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1) 15,902,700株、 平成21年度ストックオプション(2) 1,567,500株、 平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株、 第1回新株予約権2,955,200株、 平成23年度ストックオプション(1) 5,388,900株	平成21年度ストックオプション(1) 15,902,700株、 平成21年度ストックオプション(2) 1,567,500株、 平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株、 平成23年度ストックオプション(1) 5,029,200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55期 (平成26年3月31日)	第56期 (平成27年3月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	45,531	49,265
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）	45,531	49,265
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末 の普通株式の数（千株）	196,903	196,903

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。

## 中間財務諸表等

## （1）中間貸借対照表

（単位：百万円）

		第57期中間会計期間 (平成27年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		13,390
金銭の信託		99
有価証券		87
未収委託者報酬		7,326
未収収益		1,121
関係会社短期貸付金		5,925
繰延税金資産		436
その他	2	2,325
流動資産合計		30,712
固定資産		
有形固定資産	1	364
無形固定資産		122
投資その他の資産		
投資有価証券		13,748
関係会社株式		21,702
関係会社長期貸付金		60
長期差入保証金		775
繰延税金資産		546
その他		0
投資その他の資産合計		36,834
固定資産合計		37,321
資産合計		68,033

（単位：百万円）

		第57期中間会計期間 (平成27年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		4,051

未払費用		4,163
未払法人税等		52
未払消費税等	3	457
関係会社短期借入金		5,997
賞与引当金		976
役員賞与引当金		115
その他		708
流動負債合計		16,521
固定負債		
退職給付引当金		1,130
固定負債合計		1,130
負債合計		17,652
純資産の部		
株主資本		
資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		28,043
利益剰余金合計		28,043
自己株式		502
株主資本合計		50,124
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		310
繰延ヘッジ損益		53
評価・換算差額等合計		257
純資産合計		50,381
負債純資産合計		68,033

## ( 2 ) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第57期中間会計期間  
(自 平成27年4月1日  
至 平成27年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		33,707
その他営業収益		1,944
営業収益合計		35,652
営業費用及び一般管理費	1	32,417
営業利益		3,235
営業外収益	2	2,115
営業外費用	3	1,200
経常利益		4,150
特別利益	4	504

特別損失	5	510
税引前中間純利益		4,145
法人税、住民税及び事業税		60
法人税等調整額		1,026
中間純利益		3,058

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第57期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

(単位：百万円)

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益 剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	25,836	25,836	68	48,351
当中間期変動額							
剰余金の配当				850	850		850
中間純利益				3,058	3,058		3,058
自己株式の取得						434	434
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)							
当中間期変動額合計				2,207	2,207	434	1,772
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	28,043	28,043	502	50,124

	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	1,002	88	913	49,265
当中間期変動額				
剰余金の配当				850
中間純利益				3,058
自己株式の取得				434
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	692	35	656	656
当中間期変動額合計	692	35	656	1,116
当中間期末残高	310	53	257	50,381

## 注記事項

(重要な会計方針)

項目	第57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法

	<p>その他有価証券 時価のあるもの 中間決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(2) 金銭の信託 時価法</p> <p>(3) デリバティブ 時価法</p> <p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間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中間会計期間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当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</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中間会計期間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 その他中間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、当中間会計期間の費用として処理してあります。</p>

(会計方針の変更)

第57期中間会計期間  
(自 平成27年4月1日  
至 平成27年9月30日)



## （企業結合に関する会計基準等の適用）

「企業結合に関する会計基準」（企業会計基準第21号 平成25年9月13日。以下「企業結合会計基準」という。）及び「事業分離等に関する会計基準」（企業会計基準第7号 平成25年9月13日。以下「事業分離等会計基準」という。）等を当中間会計期間から適用し、取得関連費用を発生した事業年度の費用として計上する方法に変更しております。また、当中間会計期間の期首以後実施される企業結合については、暫定的な会計処理の確定による取得原価の配分額の見直しを企業結合日の属する中間会計期間の中間財務諸表に反映させる方法に変更しております。

企業結合会計基準等の適用については、企業結合会計基準第58 - 2項（4）及び事業分離等会計基準第57 - 4項（4）に定める経過的な取扱いに従っており、当中間会計期間の期首時点から将来にわたって適用しております。

なお、これによる損益及び1株当たり情報に与える影響はありません。

## （中間貸借対照表関係）

第57期中間会計期間 (平成27年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 1,748百万円
2	信託資産 流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
3	消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
4	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6百万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779百万円に対して保証を行っております。

## （中間損益計算書関係）

第57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	

1	減価償却実施額	
	有形固定資産	59百万円
	無形固定資産	22百万円
2	営業外収益のうち主要なもの	
	受取利息	25百万円
	受取配当金	1,271百万円
	デリバティブ収益	816百万円
3	営業外費用のうち主要なもの	
	支払利息	63百万円
	デリバティブ費用	907百万円
	支払源泉所得税	119百万円
4	特別利益のうち主要なもの	
	投資有価証券売却益	504百万円
5	特別損失のうち主要なもの	
	特別賞与	348百万円
	割増退職金	91百万円
	役員退職一時金	64百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第57期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
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	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	109,600	704,500	-	814,100

（注）自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

3 新株予約権等に関する事項

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)				当中間会計期間末残高(百万円)
		当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末	
平成21年度ストックオプション(1)	普通株式	15,902,700	-	10,282,800	5,619,900	-
平成21年度ストックオプション(2)	普通株式	1,567,500	-	587,400	980,100	-
平成22年度ストックオプション(1)	普通株式	2,310,000	-	2,310,000	-	-
平成23年度ストックオプション(1)	普通株式	5,029,200	-	290,400	4,738,800	-
合計		24,809,400	-	13,470,600	11,338,800	-

（注）1 平成21年度ストックオプション(1)、平成21年度ストックオプション(2)、平成22年度ストックオプション(1)及び平成23年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

- 2 平成21年度ストックオプション(1)5,619,900株、平成21年度ストックオプション(2)980,100株及び平成23年度ストックオプション(1)4,075,500株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

#### 4 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年5月25日 取締役会	普通株式	850	4.32	平成27年3月31日	平成27年6月30日

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

該当事項はありません。

##### (リース取引関係)

第57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30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	
1年内	853百万円
1年超	3,047百万円
合計	3,900百万円

##### (金融商品関係)

第57期中間会計期間(平成27年9月30日)

##### 1 金融商品の時価等に関する事項

平成27年9月30日(当中間決算日)における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	中間貸借対照表 計上額( 1)	時価( 1)	差額
(1) 現金・預金	13,390	13,390	-
(2) 未収委託者報酬	7,326	7,326	-
(3) 未収収益	1,121	1,121	-
(4) 金銭の信託	99	99	-
(5) 関係会社短期貸付金	5,925	5,925	-
(6) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	13,819	13,819	-
(7) 未払金	(4,051)	(4,051)	-
(8) 未払費用	(4,163)	(4,163)	-
(9) 関係会社短期借入金	(5,997)	(5,997)	-
(10) 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	(120)	(120)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	169	169	-
デリバティブ取引計	48	48	-

( 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(5) 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。

(4) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は金融商品取引所が定める清算指数、為替予約取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(6) 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。

(7) 未払金、(8) 未払費用並びに(9) 関係会社短期借入金

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。

(10) 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、上記金額は貸借対照表上、流動資産のその他及び流動負債のその他に含まれております。

2 非上場株式等（中間貸借対照表計上額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 その他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式（中間貸借対照表計上額18,809百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、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。

（有価証券関係）

第57期中間会計期間(平成27年9月30日)

### 1 子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	18,809
関連会社株式	2,892

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

### 2 その他有価証券

（単位：百万円）

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	7,923	7,062	860
	小計	7,923	7,062	860
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	5,896	6,298	402
	小計	5,896	6,298	402
合計		13,819	13,361	458

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

2 非上場株式等(中間貸借対照表計上額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。

### (デリバティブ取引関係)

第57期中間会計期間(平成27年9月30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	4,686	-	49	49
合計		4,686	-	49	49

(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	為替予約取引 買建 米ドル	5,997	-	170	170
合計		5,997	-	170	170

(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

##### (1) 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		4,550	-	148
	豪ドル		219	-	21
	シンガポールドル		738	-	57
	ユーロ		194	-	0
	香港ドル		178	-	5
	人民元		2,155	-	63
合計			8,035	-	169

(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57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	3,071百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	9,269百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,461百万円

(ストックオプション等関係)

第57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30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57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30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、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載していません。

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57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30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57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30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57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

該当事項はありません。

## （ 1株当たり情報 ）

項目	第57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
1株当たり純資産額	256円79銭
1株当たり中間純利益金額	15円54銭

(注) 1 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、新株予約権等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株当たり中間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57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
中間純利益（百万円）	3,058
普通株主に帰属しない金額（百万円）	-
普通株式に係る中間純利益（百万円）	3,058
普通株式の期中平均株式数（千株）	196,730
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1) 5,619,900株、平成21年度ストックオプション(2) 980,100株、平成23年度ストックオプション(1) 4,738,800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57期中間会計期間 (平成27年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額（百万円）	50,381
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額（百万円）	50,381
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数（千株）	196,198

## （ 重要な後発事象 ）

該当事項はありません。

## 4 【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)、(5)に

において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。

- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記(3)、(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

## 5【その他】

### (1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名 称	資本金の額 (平成27年3月末現在)	事業の内容
野村信託銀行株式会社	30,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

名 称	資本金の額 (平成27年3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。
S M B C フレンド証券株式会社	27,270百万円	
株式会社 S B I 証券	47,937百万円	
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	87,465百万円	
株式会社琉球銀行 1	54,127百万円	
ソニー生命保険株式会社 1	70,000百万円	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

1 募集の取扱いを行ないません。



## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

### (2) 販売会社

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

## 3【資本関係】

### (1) 受託会社

該当事項はありません。

### (2) 販売会社

該当事項はありません。

## 第3【その他】

(1) 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を使用します。

(2) 目論見書の表紙、表紙裏または裏表紙に、以下を記載することがあります。

委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日

ファンドの基本的性格など

委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など

委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など

目論見書の使用開始日

(3) 目論見書の表紙または表紙裏に、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。

投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託を購入されたお客様が負う旨の記載。

「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。

「ご購入に際しては、目論見書の内容を十分にお読みください。」という趣旨の記載。

請求目論見書の入手方法（ホームページで閲覧、ダウンロードできるなど）についての記載。

請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨の記載。

「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認する旨の記載。

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。

有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。

委託会社の情報として記載することが望ましい事項と判断する事項がある場合は、当該事項の記載。

(4) 有価証券届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。

(5) 目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部 ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。

(6) 投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。

(7) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(8) 交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

ファンドの取引に関して、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用がない旨の記載。

投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。

分配金は、投資信託の純資産から支払われるので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がる旨。分配金は、計算期間中に発生した運用収益を超えて支払われる場合がある旨。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合がある旨の記載。

## 独立監査人の監査報告書

平成27年6月15日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 秋 宗 勝 彦  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第56期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成27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。

## 独立監査人の監査報告書

平成27年12月2日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

### PWCあらた監査法人

指定社員 公認会計士 鶴田 光夫  
業務執行社員

指定社員 公認会計士 辻村 和之  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）の平成26年10月28日から平成27年10月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）の平成27年10月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成27年12月4日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 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平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第57期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成27年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以 上

(注)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。