

【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29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40）
【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40）（以下「ファンド」といいます。）

- ・愛称として「Aナビ40」、「ステージ3」、「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29年 1月27日から平成30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。

(1 0) 【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。

(1 1) 【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。

(1 2) 【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	ファミリーファンド	あり (部分ヘッジ)
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		
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(資産 複合 資産配分 固定型(株式、債 券)))	その他 ()	アフリカ 中近東 (中東) エマージング		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券）））

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

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

年1回

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

グローバル（含む日本）

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジあり（部分ヘッジ）

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。
2. インデックスファンドで構成しています。
3. 株式に40%、債券などに60%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全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、NOMURA-BPI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。
 ※NOMURA-BPI総合：同指数は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
 ※シティ世界国債インデックス(除く日本)：同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

3. 株式に40%、債券などに60%投資します。

- 資産の標準実質組入比率は、株式40%、債券など60%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	30%
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%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	5%
日本債券インデックスマザーファンド	45%
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

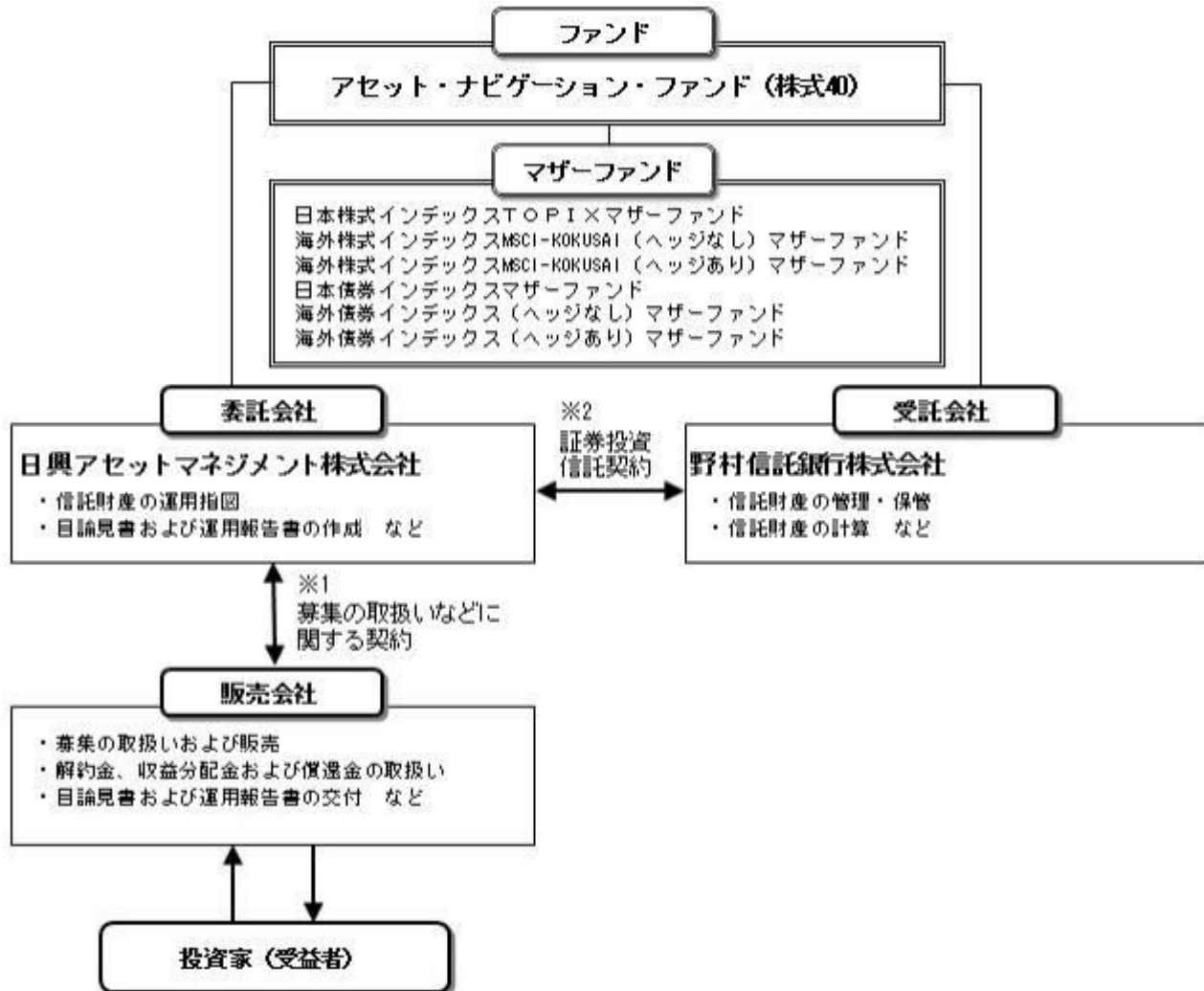
・ファンド名称変更

新名称：アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）

旧名称：アセット・ナビゲーション・ファンド（ステージ3）

（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28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.....40%
 - 公社債および短期金融資産の標準実質組入比率.....60%
- ・組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンド受益証券への投資比率を調整することで行ないますが、市況動向などによっては内外の有価証券などへの直接投資を行なうことがあります。
- ・また、資金動向などによっては組入比率を引き下げることもあります。
- ・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40）>

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。）
- 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

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。
 - 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。
 - 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。
 - 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せん。）
 - 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せん。）
 - 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

< 日本債券インデックスマザーファンド >

わが国の公社債を主要投資対象とします。

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

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

内外の公社債を主要投資対象とします。

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。

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

< 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。）

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

投資対象とするマザーファンドの概要

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

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

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主としてわが国の株式に投資し、T O P I X（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・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、 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用

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

その他

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

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

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

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

運用の基本方針

基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカン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ないます。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・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。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
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。（円ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。

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

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

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジあり・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカントリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えること、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額の合計額が外貨建資産の組入総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないます。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・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。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成12年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

* MSCI-KOKUSAIインデックスは、MSCI Inc.が発表している、日本を除く世界の主要国の株式市場の合成バ

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、NOMURA-BPI総合 [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 運用の効率化をはかるため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式への投資は行ないません。 外貨建資産への投資は行ないません。 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。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.1%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成10年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

* NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が公表している、わが国の債券市場の動きを示す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債、MBS、ABSなど、国内で発行された円建公募利付債で構成されています。対象となる債券は残存期間1年以上、残存額面10億円以上で、事業債、円建外債、MBS、ABSについては、A格相当以上の格付を取得しているものに限りま

す。

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

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として世界各国の債券に投資し、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式への投資は行ないません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 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。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成10年10月30日設定）

決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）
-----	-----------------------

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

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

< 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として世界各国の債券に投資し、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えること、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額が外貨建資産の組入総額を超えることがあります。 外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないます。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式への投資は行ないません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 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。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
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

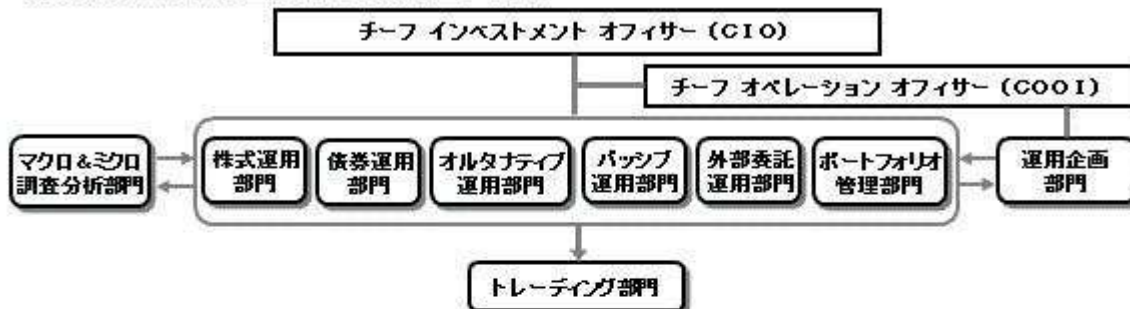
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成10年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

*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・マーケット・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。

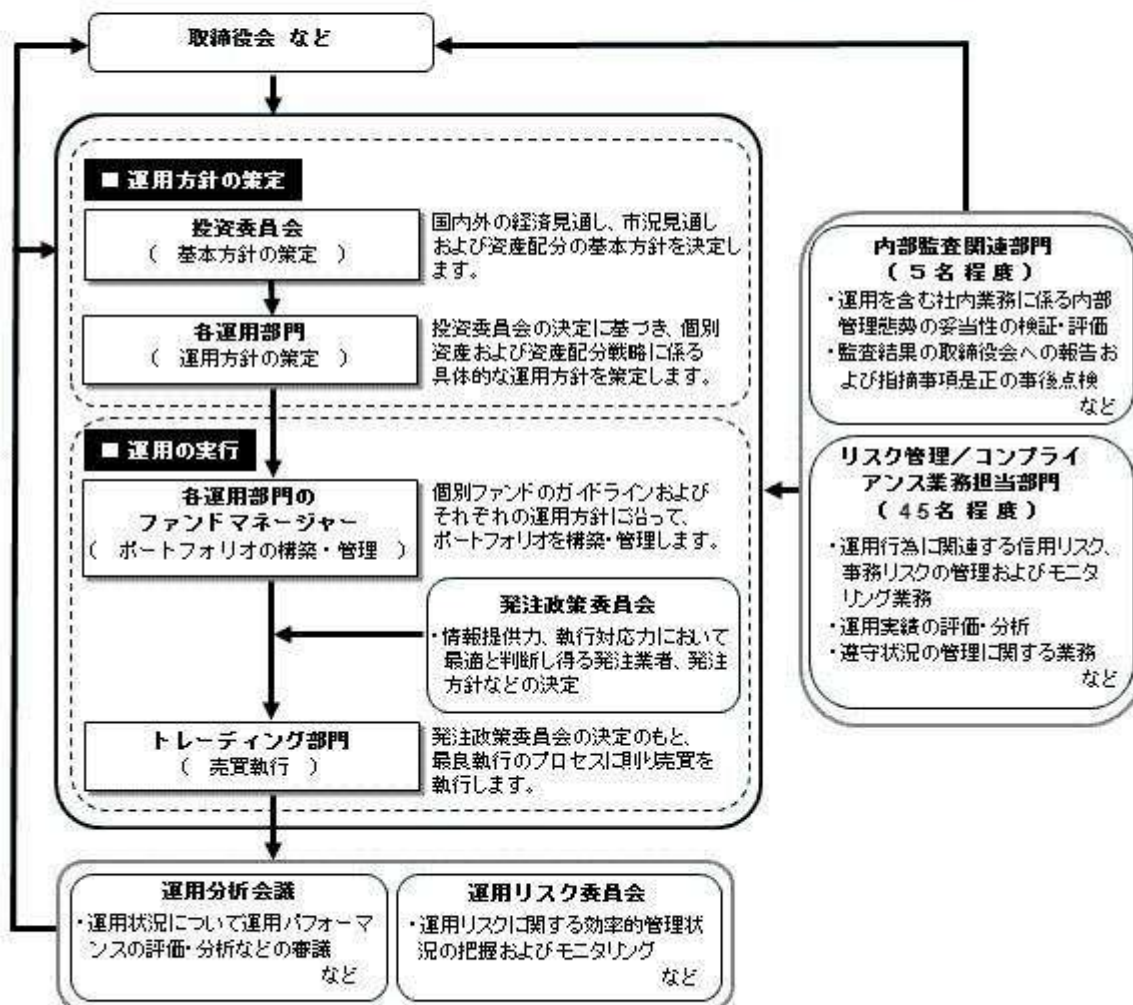
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケット・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケット・インクは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

（3）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

上記体制は平成28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40）>

- 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、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公

社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
 - 14) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入れ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支弁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。
 - 16) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<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。
- 13) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<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、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡し取引および為替先渡し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。
- 16) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

< 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、当該取引の契約期間が、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。
- 16) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<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。
- 11) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

< 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。
- 13) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

< 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。
- 13) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

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せん。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。

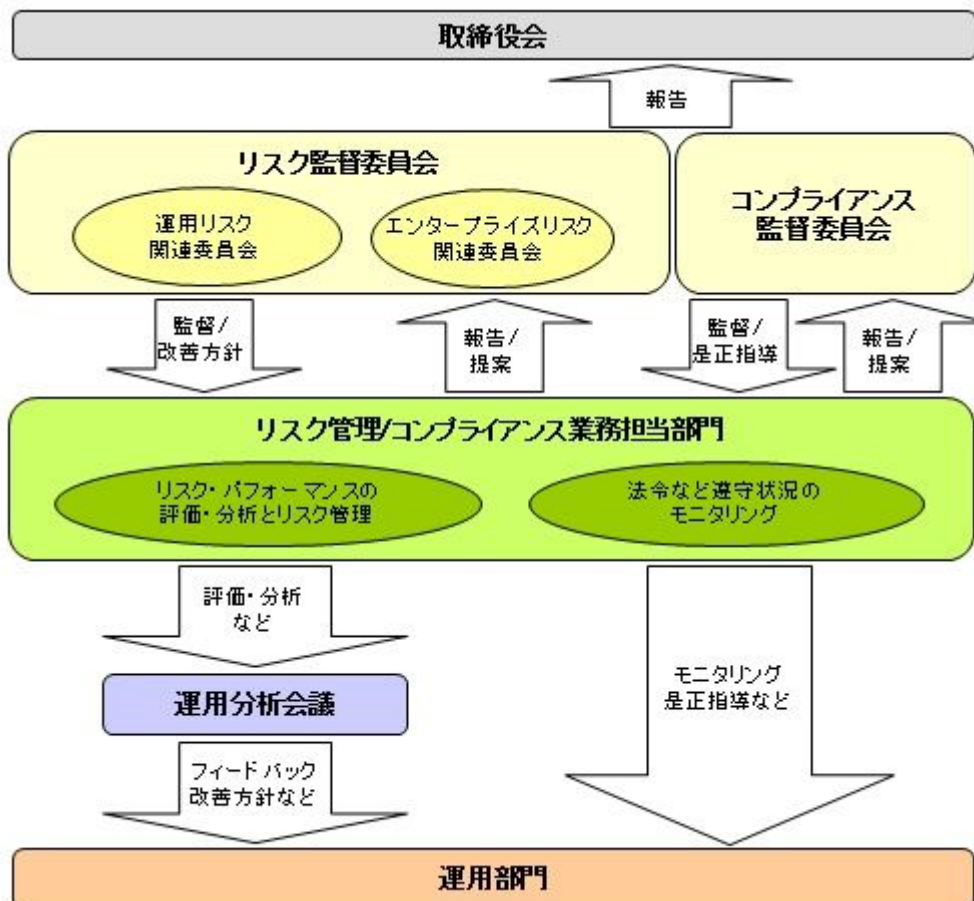
- ・投資対象とする投資信託証券に関する事項

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。

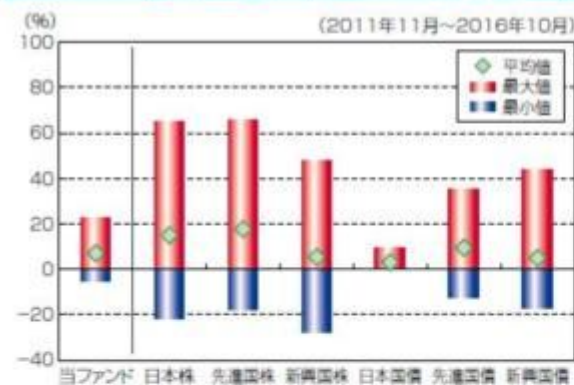
法令など遵守状況のモニタリング

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28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	7.0%	15.0%	17.7%	5.4%	3.1%	9.4%	4.9%
最大値	22.8%	65.0%	65.7%	47.4%	9.3%	34.9%	43.7%
最小値	-5.2%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	0.5%	-12.3%	-17.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2011年11月から2016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>

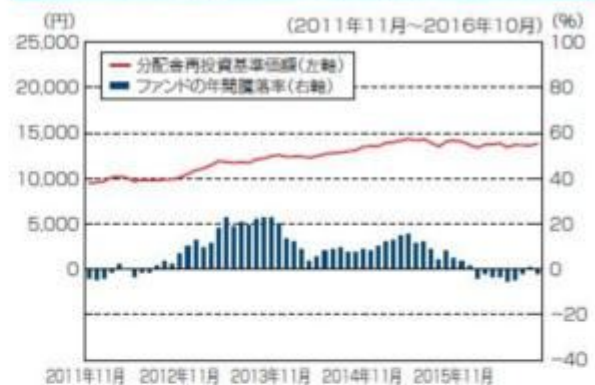
日本株 ……東証株価指数(TOPIX、配当込)

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。

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、2011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-BPI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)

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

東証株価指数(TOPIX、配当込)

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

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

当指数は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

当指数は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc. に帰属します。

NOMURA-BPI国債

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

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・ディバーシファイド（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0.2%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0.6588%（税抜0.61%）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
0.61%	0.22%	0.35%	0.04%

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。

組入る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

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す。）を控除した利益

確定申告等により、解約時および償還時の差損(譲渡損失)については、上場株式等の譲渡益、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、)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、)については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

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

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

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

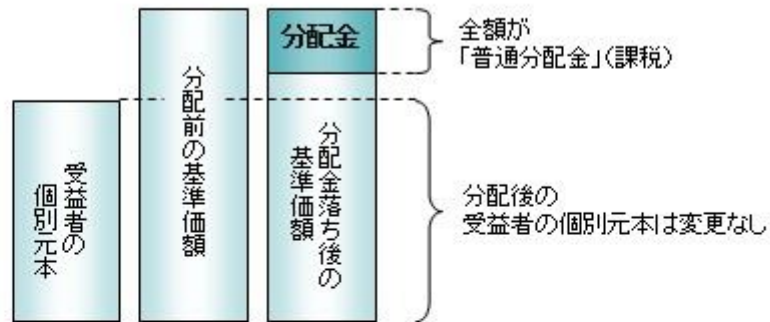
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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。

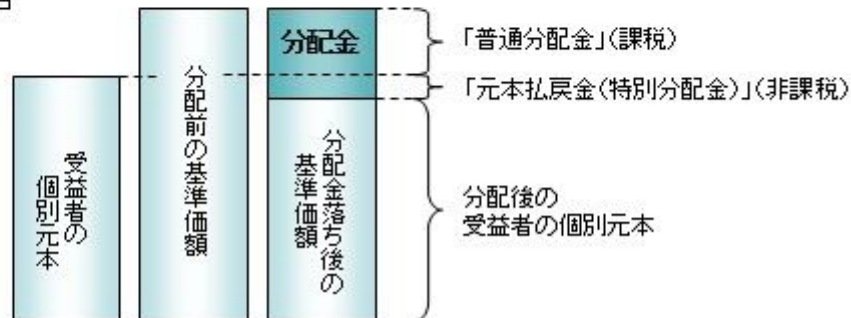
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は平成29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40）】

以下の運用状況は2016年10月31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	294,499,231	95.21
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		14,831,139	4.79
合計（純資産総額）		309,330,370	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	日本債券インデックスマザーファンド	97,785,955	1.4048	137,379,204	1.4029	137,183,916	44.35

日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	79,982,268	1.1966	95,706,782	1.2055	96,418,624	31.17
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	8,664,661	1.7802	15,425,695	1.7803	15,425,695	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	7,395,757	2.0612	15,244,158	2.0631	15,258,186	4.93
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	11,682,993	1.3079	15,281,284	1.2988	15,173,871	4.91
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	9,922,108	1.5289	15,170,703	1.5157	15,038,939	4.86

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.21
合計	95.21

【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8計算期間末 (2007年10月26日)	807	807	1.1554	1.1564
第9計算期間末 (2008年10月27日)	596	596	0.8732	0.8732
第10計算期間末 (2009年10月26日)	678	678	0.9839	0.9839
第11計算期間末 (2010年10月26日)	646	646	0.9762	0.9762
第12計算期間末 (2011年10月26日)	560	560	0.9571	0.9571
第13計算期間末 (2012年10月26日)	515	515	0.9913	0.9913
第14計算期間末 (2013年10月28日)	466	466	1.2162	1.2172
第15計算期間末 (2014年10月27日)	360	360	1.2757	1.2767
第16計算期間末 (2015年10月26日)	343	344	1.4047	1.4057
第17計算期間末 (2016年10月26日)	308	308	1.3778	1.3788
2015年10月末日	344		1.4047	
11月末日	341		1.4115	
12月末日	322		1.4025	
2016年1月末日	316		1.3680	

2月末日	307		1.3356
3月末日	314		1.3673
4月末日	314		1.3684
5月末日	317		1.3843
6月末日	306		1.3397
7月末日	312		1.3678
8月末日	308		1.3636
9月末日	304		1.3610
10月末日	309		1.3790

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
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
第17期	2015年10月27日～2016年10月26日	0.0010

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第8期	2006年10月27日～2007年10月26日	0.94
第9期	2007年10月27日～2008年10月27日	24.42
第10期	2008年10月28日～2009年10月26日	12.68
第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	0.78
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	1.96
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	3.57
第14期	2012年10月27日～2013年10月28日	22.79
第15期	2013年10月29日～2014年10月27日	4.97
第16期	2014年10月28日～2015年10月26日	10.19
第17期	2015年10月27日～2016年10月26日	1.84

(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8期	2006年10月27日～2007年10月26日	124,313,633	168,417,903
第9期	2007年10月27日～2008年10月27日	75,494,820	90,623,951
第10期	2008年10月28日～2009年10月26日	59,505,614	53,844,794
第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	44,772,360	71,522,165
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	38,817,760	115,309,278
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	27,776,150	93,719,970
第14期	2012年10月27日～2013年10月28日	18,386,017	154,999,819
第15期	2013年10月29日～2014年10月27日	11,663,810	112,584,086
第16期	2014年10月28日～2015年10月26日	11,849,353	49,640,624
第17期	2015年10月27日～2016年10月26日	8,937,726	29,583,310

（参考）

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2016年10月31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	25,880,642,850	98.74
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		330,181,041	1.26
合計（純資産総額）		26,210,823,891	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	279,000,000	1.06

(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	158,200	6,025.00	953,155,000	6,079.00	961,697,800	3.67
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	951,500	532.90	507,054,350	544.60	518,186,900	1.98
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	100,800	4,721.67	475,945,000	4,660.00	469,728,000	1.79
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	61,700	6,585.00	406,294,500	6,602.00	407,343,400	1.55
日本	株式	KDDI	情報・通信業	124,200	3,111.46	386,443,800	3,192.00	396,446,400	1.51
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	100,400	3,547.87	356,206,800	3,653.00	366,761,200	1.40
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	114,700	3,144.17	360,637,200	3,144.00	360,616,800	1.38
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	79,100	3,965.44	313,666,700	3,994.00	315,925,400	1.21
日本	株式	ソニー	電気機器	90,200	3,324.68	299,886,500	3,361.00	303,162,200	1.16
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,706,500	171.50	292,664,750	177.10	302,221,150	1.15
日本	株式	ファナック	電気機器	12,900	19,717.70	254,358,400	19,680.00	253,872,000	0.97
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	93,800	2,600.60	243,937,100	2,640.50	247,678,900	0.94
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	50,000	4,804.00	240,200,000	4,700.00	235,000,000	0.90
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	52,600	4,492.78	236,320,600	4,383.00	230,545,800	0.88
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	24,700	9,404.76	232,297,800	9,257.00	228,647,900	0.87
日本	株式	キーエンス	電気機器	2,900	77,230.00	223,967,000	77,060.00	223,474,000	0.85
日本	株式	三菱商事	卸売業	94,200	2,361.49	222,452,400	2,291.00	215,812,200	0.82
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	136,100	1,557.00	211,907,700	1,559.50	212,247,950	0.81
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	50,900	4,056.39	206,470,700	4,149.00	211,184,100	0.81
日本	株式	キャノン	電気機器	68,500	3,052.26	209,080,100	3,017.00	206,664,500	0.79
日本	株式	任天堂	その他製品	7,800	24,534.34	191,367,900	25,440.00	198,432,000	0.76
日本	株式	村田製作所	電気機器	13,300	14,447.35	192,149,800	14,670.00	195,111,000	0.74
日本	株式	三菱地所	不動産業	93,000	2,041.13	189,826,000	2,081.50	193,579,500	0.74
日本	株式	三菱電機	電気機器	135,700	1,399.27	189,881,700	1,422.50	193,033,250	0.74
日本	株式	信越化学工業	化学	23,900	7,693.30	183,870,000	7,971.00	190,506,900	0.73
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	10,500	17,520.00	183,960,000	17,865.00	187,582,500	0.72
日本	株式	花王	化学	33,800	5,747.17	194,254,600	5,405.00	182,689,000	0.70
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	44,900	3,960.73	177,837,000	3,915.00	175,783,500	0.67
日本	株式	ダイキン工業	機械	17,400	9,879.00	171,894,600	10,080.00	175,392,000	0.67
日本	株式	日立製作所	電気機器	305,000	525.10	160,155,500	559.20	170,556,000	0.65

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	0.11
		鉱業	0.33
		建設業	3.05
		食料品	4.78
		繊維製品	0.73
		パルプ・紙	0.25
		化学	6.45

医薬品	5.02
石油・石炭製品	0.47
ゴム製品	0.92
ガラス・土石製品	0.91
鉄鋼	1.14
非鉄金属	0.88
金属製品	0.69
機械	4.93
電気機器	12.48
輸送用機器	9.50
精密機器	1.52
その他製品	1.89
電気・ガス業	1.82
陸運業	4.14
海運業	0.22
空運業	0.54
倉庫・運輸関連業	0.19
情報・通信業	8.06
卸売業	4.31
小売業	4.82
銀行業	7.53
証券、商品先物取引業	1.06
保険業	2.38
その他金融業	1.29
不動産業	2.55
サービス業	3.78
合 計	98.74

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 2016年12月	買建	20	日本円	276,322,160	279,000,000	1.06

(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2016年10月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）	
出資金	アメリカ	7,123,350	0.01	
株式	アメリカ	41,098,759,893	59.26	
	カナダ	2,689,379,993	3.88	
	モーリシャス	3,867,168	0.01	
	ドイツ	2,544,143,603	3.67	
	イタリア	495,352,851	0.71	
	フランス	2,520,692,292	3.63	
	オランダ	1,188,975,333	1.71	
	スペイン	891,579,138	1.29	
	ベルギー	363,630,658	0.52	
	オーストリア	58,716,830	0.08	
	ルクセンブルク	75,744,833	0.11	
	フィンランド	268,130,103	0.39	
	アイルランド	1,171,802,616	1.69	
	ポルトガル	41,590,852	0.06	
	イギリス	4,631,783,638	6.68	
	スイス	2,677,339,263	3.86	
	スウェーデン	758,201,228	1.09	
	ノルウェー	185,848,959	0.27	
	デンマーク	459,227,232	0.66	
	ケイマン	171,996,558	0.25	
	オーストラリア	1,808,038,481	2.61	
	バミューダ	162,451,500	0.23	
	ニュージーランド	55,142,222	0.08	
	香港	767,075,693	1.11	
	シンガポール	478,473,496	0.69	
	イスラエル	167,189,034	0.24	
	ジャージー	358,616,549	0.52	
	英ヴァージン諸島	21,022,333	0.03	
		小計	66,114,772,349	95.33
	投資証券	アメリカ	1,357,761,649	1.96
カナダ		11,022,289	0.02	
フランス		97,433,364	0.14	
イギリス		63,199,757	0.09	
オーストラリア		197,045,880	0.28	
香港		35,692,800	0.05	
シンガポール		30,156,082	0.04	
小計		1,792,311,821	2.58	

コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		1,436,818,025	2.07
合計(純資産総額)		69,351,025,545	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	1,113,508,340	1.61
	買建	ドイツ	324,901,200	0.47

(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		507,688,000	0.73

(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	120,022	12,399.69	1,488,236,193	11,924.67	1,431,223,847	2.06
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	163,934	6,395.41	1,048,425,373	6,277.96	1,029,172,439	1.48
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	90,821	9,093.45	825,877,058	8,890.03	807,401,487	1.16
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	60,261	11,949.84	720,109,646	12,093.50	728,766,633	1.05
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	8,785	87,576.97	769,363,724	81,404.91	715,142,180	1.03
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	50,630	13,871.92	702,335,786	13,767.06	697,026,724	1.01
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	201,513	3,004.23	605,393,214	3,064.00	617,437,686	0.89
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	80,130	7,214.36	578,087,308	7,246.87	580,692,062	0.84
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	6,782	84,692.27	574,383,017	83,402.49	565,635,743	0.82
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	6,420	86,881.75	557,780,855	85,939.06	551,728,776	0.80
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	69,893	7,649.08	534,617,777	7,723.35	539,808,241	0.78
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	134,927	3,848.36	519,247,940	3,828.43	516,559,735	0.74
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	105,800	4,794.19	507,226,275	4,847.67	512,884,311	0.74
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	56,179	9,119.67	512,334,177	9,106.04	511,568,356	0.74

アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	89,487	5,016.50	448,911,750	5,055.30	452,383,685	0.65
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	41,251	10,566.74	435,888,682	10,886.56	449,081,701	0.65
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	132,780	3,384.88	449,444,473	3,348.17	444,571,314	0.64
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	90,252	4,460.74	402,591,104	4,428.23	399,657,318	0.58
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	26,200	15,039.02	394,022,355	15,099.84	395,615,808	0.57
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	224,319	1,753.25	393,289,351	1,749.06	392,348,467	0.57
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	103,452	3,680.58	380,763,983	3,642.83	376,858,711	0.54
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	15,428	24,209.73	373,507,838	24,379.48	376,126,648	0.54
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	60,643	6,496.07	393,941,598	6,169.96	374,165,030	0.54
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	49,003	7,696.82	377,167,736	7,542.99	369,629,580	0.53
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	41,862	8,601.66	360,082,934	8,621.58	360,916,967	0.52
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	27,480	12,933.43	355,410,722	12,958.59	356,102,295	0.51
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	31,701	11,244.13	356,450,413	11,227.36	355,918,546	0.51
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	110,030	3,181.45	350,055,208	3,207.66	352,939,644	0.51
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	435,221	800.16	348,246,818	797.86	347,245,949	0.50
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	34,078	10,127.37	345,120,815	10,099.06	344,155,992	0.50

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
出資金			0.01
株式	国外	エネルギー	7.32
		素材	4.86
		資本財	6.93
		商業・専門サービス	1.00
		運輸	1.85
		自動車・自動車部品	1.56
		耐久消費財・アパレル	1.76
		消費者サービス	1.77
		メディア	2.55
		小売	3.91
		食品・生活必需品小売り	2.04

	食品・飲料・タバコ	6.17
	家庭用品・パーソナル用品	2.22
	ヘルスケア機器・サービス	3.76
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.69
	銀行	8.67
	各種金融	4.03
	保険	4.01
	不動産	0.56
	ソフトウェア・サービス	9.27
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.64
	電気通信サービス	3.02
	公益事業	3.41
	半導体・半導体製造装置	2.34
投資証券		2.58
合計		97.93

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI 1612	買建	100	米ドル	10,683,812.5	1,120,304,579	10,619,000	1,113,508,340	1.61
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1612	買建	100	ユーロ	2,840,810	326,835,191	2,824,000	324,901,200	0.47

(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	2,440,000.00	254,476,033	255,698,500	0.37
	ユーロ	買建	2,190,000.00	248,967,334	251,989,500	0.36

(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2016年10月31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	1,839,960,063	57.02
	カナダ	123,655,286	3.83
	ドイツ	110,247,465	3.42
	イタリア	22,365,380	0.69
	フランス	112,532,028	3.49
	オランダ	52,839,480	1.64
	スペイン	41,146,909	1.28
	ベルギー	19,063,880	0.59
	オーストリア	1,698,940	0.05
	ルクセンブルク	2,659,568	0.08
	フィンランド	9,895,576	0.31
	アイルランド	51,177,983	1.59
	ポルトガル	1,273,037	0.04
	イギリス	204,832,411	6.35
	スイス	119,155,052	3.69
	スウェーデン	34,512,344	1.07
	ノルウェー	7,258,189	0.22
	デンマーク	22,194,347	0.69
	ケイマン	7,612,820	0.24
	オーストラリア	80,613,077	2.50
	バミューダ	5,389,004	0.17
	香港	34,619,849	1.07
	シンガポール	23,324,708	0.72
	イスラエル	6,538,547	0.20
ジャージー	16,918,490	0.52	
英ヴァージン諸島	898,705	0.03	
	小計	2,952,383,138	91.50
投資証券	アメリカ	60,767,333	1.88
	フランス	4,310,907	0.13
	イギリス	3,137,942	0.10
	オーストラリア	9,447,342	0.29
	香港	1,908,821	0.06
		小計	79,572,345
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		194,681,794	6.03
合計（純資産総額）		3,226,637,277	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	144,756,084	4.49
	買建	ドイツ	42,237,156	1.31

(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		3,097,805,860	96.01

(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	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	5,411	12,399.69	67,094,750	11,924.67	64,524,439	2.00
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	7,358	6,395.41	47,057,437	6,277.96	46,193,290	1.43
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	4,132	9,093.45	37,574,173	8,890.03	36,733,607	1.14
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	2,725	11,949.84	32,563,329	12,093.50	32,954,798	1.02
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	394	87,576.97	34,505,328	81,404.91	32,073,537	0.99
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	2,194	13,871.92	30,435,013	13,767.06	30,204,950	0.94
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	9,086	3,004.23	27,296,516	3,064.00	27,839,588	0.86
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	3,596	7,214.36	25,942,867	7,246.87	26,059,761	0.81
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	305	84,692.27	25,831,144	83,402.49	25,437,762	0.79
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	292	86,881.75	25,369,472	85,939.06	25,094,206	0.78
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	2,998	7,649.08	22,931,969	7,723.35	23,154,609	0.72
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	4,757	4,794.19	22,806,005	4,847.67	23,060,403	0.71
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	2,508	9,119.67	22,872,143	9,106.04	22,837,954	0.71
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	5,787	3,848.36	22,270,471	3,828.43	22,155,174	0.69
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	4,069	5,016.50	20,412,148	5,055.30	20,570,018	0.64
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	1,791	10,566.74	18,925,035	10,886.56	19,497,838	0.60
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	5,725	3,384.88	19,378,442	3,348.17	19,168,329	0.59
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	10,313	1,753.25	18,081,362	1,749.06	18,038,105	0.56
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	4,844	3,680.58	17,828,759	3,642.83	17,645,900	0.55

アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	3,893	4,460.74	17,365,678	4,428.23	17,239,130	0.53
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	2,271	7,696.82	17,479,500	7,542.99	17,130,151	0.53
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	1,130	15,039.02	16,994,094	15,099.83	17,062,819	0.53
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	678	24,209.73	16,414,203	24,379.48	16,529,289	0.51
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5,081	3,181.45	16,164,960	3,207.66	16,298,158	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	2,624	6,496.07	17,045,706	6,169.96	16,189,981	0.50
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	3,008	5,200.00	15,641,623	5,196.86	15,632,160	0.48
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	1,812	8,601.66	15,586,219	8,621.58	15,622,320	0.48
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	1,373	11,244.13	15,438,202	11,227.36	15,415,166	0.48
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	1,554	9,725.76	15,113,838	9,841.11	15,293,086	0.47
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	18,910	800.16	15,131,042	797.86	15,087,555	0.47

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	7.05
		素材	4.60
		資本財	6.94
		商業・専門サービス	1.15
		運輸	1.75
		自動車・自動車部品	1.53
		耐久消費財・アパレル	1.53
		消費者サービス	1.60
		メディア	2.47
		小売	3.73
		食品・生活必需品小売り	1.79
		食品・飲料・タバコ	5.78
		家庭用品・パーソナル用品	2.09
		ヘルスケア機器・サービス	3.68
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.26
		銀行	8.43
		各種金融	4.09
		保険	3.89
		不動産	0.64
ソフトウェア・サービス	8.93		

		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.45
		電気通信サービス	2.77
		公益事業	3.14
		半導体・半導体製造装置	2.26
投資証券			2.47
合計			93.97

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 EMINI1612	買建	13	米ドル	1,389,700	145,723,942	1,380,470	144,756,084	4.49
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1612	買建	13	ユーロ	369,590	42,521,330	367,120	42,237,156	1.31

(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	19,473,000.00	2,024,408,870	2,037,379,840	63.14
	加ドル	売建	1,555,000.00	121,114,305	121,268,700	3.76
	ユーロ	売建	3,388,000.00	384,004,778	389,829,520	12.08
	英ポンド	売建	1,727,000.00	218,663,792	220,379,700	6.83
	スイスフラン	売建	1,046,000.00	109,592,440	111,058,690	3.44
	スウェーデンクローナ	売建	2,968,000.00	34,609,192	34,545,630	1.07
	ノルウェークローネ	売建	615,000.00	7,715,664	7,770,430	0.24
	デンマーククローネ	売建	1,435,000.00	21,869,400	22,199,450	0.69
	豪ドル	売建	1,142,000.00	91,089,440	90,525,890	2.81
	香港ドル	売建	3,001,000.00	40,209,070	40,479,160	1.25
	シンガポールドル	売建	209,000.00	15,642,420	15,704,380	0.49
	イスラエルシェケル	売建	245,000.00	6,622,820	6,664,470	0.21

(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2016年10月31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	25,947,692,169	76.38
地方債証券	日本	2,108,630,000	6.21
特殊債券	日本	3,945,238,000	11.61
社債券	日本	1,588,863,000	4.68
	オーストラリア	301,416,284	0.89
	小計	1,890,279,284	5.56
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		81,049,537	0.24
合計（純資産総額）		33,972,888,990	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107回利付国債（5年）	705,000,000	100.56	709,004,400	100.56	708,997,350	0.200	2017/12/20	2.09
日本	国債証券	第303回利付国債（10年）	581,000,000	104.75	608,603,310	104.72	608,475,490	1.400	2019/9/20	1.79
日本	国債証券	第124回利付国債（5年）	560,000,000	101.19	566,686,400	101.18	566,658,400	0.100	2020/6/20	1.67
日本	国債証券	第123回利付国債（5年）	505,000,000	101.11	510,605,500	101.10	510,585,300	0.100	2020/3/20	1.50
日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	473,000,000	104.83	495,845,900	104.80	495,746,570	1.300	2019/12/20	1.46
日本	国債証券	第299回利付国債（10年）	410,000,000	103.70	425,186,400	103.69	425,149,500	1.300	2019/3/20	1.25
日本	国債証券	第313回利付国債（10年）	370,000,000	106.66	394,675,300	106.62	394,512,500	1.300	2021/3/20	1.16
日本	国債証券	第29回利付国債（30年）	276,000,000	141.98	391,864,800	141.37	390,206,040	2.400	2038/9/20	1.15
日本	国債証券	第88回利付国債（20年）	300,000,000	123.07	369,210,000	122.91	368,754,000	2.300	2026/6/20	1.09
日本	国債証券	第113回利付国債（20年）	290,000,000	126.67	367,348,800	126.40	366,562,900	2.100	2029/9/20	1.08
日本	国債証券	第140回利付国債（20年）	280,000,000	124.35	348,191,200	124.04	347,323,200	1.700	2032/9/20	1.02
日本	国債証券	第120回利付国債（5年）	330,000,000	101.26	334,184,400	101.27	334,210,800	0.200	2019/9/20	0.98
日本	国債証券	第125回利付国債（5年）	325,000,000	101.25	329,085,250	101.23	329,007,250	0.100	2020/9/20	0.97
日本	国債証券	第60回利付国債（20年）	295,000,000	109.92	324,264,000	109.82	323,995,550	1.400	2022/12/20	0.95
日本	国債証券	第292回利付国債（10年）	306,000,000	102.75	314,442,540	102.73	314,381,340	1.700	2018/3/20	0.93
日本	国債証券	第91回利付国債（20年）	250,000,000	123.55	308,887,500	123.33	308,345,000	2.300	2026/9/20	0.91
日本	国債証券	第122回利付国債（5年）	300,000,000	101.04	303,135,000	101.05	303,168,000	0.100	2019/12/20	0.89
日本	特殊債券	第45回日本学生支援債券	300,000,000	99.99	299,970,000	100.00	300,003,000	0.001	2018/11/20	0.88

日本	国債証券	第14回利付国債 (30年)	208,000,000	137.09	285,147,200	136.71	284,373,440	2.400	2034/3/20	0.84
日本	国債証券	第137回利付国債 (20年)	220,000,000	124.16	273,165,200	123.86	272,492,000	1.700	2032/6/20	0.80
日本	国債証券	第339回利付国債 (10年)	250,000,000	104.63	261,582,500	104.48	261,222,500	0.400	2025/6/20	0.77
日本	国債証券	第149回利付国債 (20年)	215,000,000	121.63	261,517,400	121.31	260,820,800	1.500	2034/6/20	0.77
日本	国債証券	第50回利付国債 (20年)	237,000,000	109.34	259,135,800	109.28	259,007,820	1.900	2021/3/22	0.76
日本	国債証券	第43回利付国債 (30年)	195,000,000	132.35	258,098,100	131.52	256,475,700	1.700	2044/6/20	0.75
日本	国債証券	第2回利付国債 (40年)	165,000,000	150.96	249,095,550	149.66	246,950,550	2.200	2049/3/20	0.73
日本	国債証券	第329回利付国債 (10年)	230,000,000	106.69	245,403,100	106.57	245,124,800	0.800	2023/6/20	0.72
日本	国債証券	第141回利付国債 (20年)	195,000,000	124.53	242,835,450	124.21	242,223,150	1.700	2032/12/20	0.71
日本	国債証券	第290回利付国債 (10年)	226,000,000	102.34	231,288,400	102.32	231,252,240	1.400	2018/3/20	0.68
日本	国債証券	第34回利付国債 (30年)	160,000,000	141.09	225,758,400	140.29	224,468,800	2.200	2041/3/20	0.66
日本	国債証券	第330回利付国債 (10年)	210,000,000	106.91	224,525,700	106.79	224,261,100	0.800	2023/9/20	0.66

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	76.38
地方債証券	6.21
特殊債券	11.61
社債券	5.56
合計	99.76

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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2016年10月31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	66,151,388,120	43.36
	カナダ	3,090,133,892	2.03

メキシコ	1,339,317,640	0.88
ドイツ	11,282,087,394	7.40
イタリア	14,471,141,391	9.49
フランス	15,324,794,684	10.05
オランダ	3,549,252,115	2.33
スペイン	8,424,074,026	5.52
ベルギー	3,846,202,666	2.52
オーストリア	2,286,376,853	1.50
フィンランド	895,114,221	0.59
アイルランド	1,235,159,117	0.81
イギリス	10,551,720,709	6.92
スイス	364,959,187	0.24
スウェーデン	678,157,502	0.44
ノルウェー	401,786,115	0.26
デンマーク	1,057,540,065	0.69
ポーランド	940,405,172	0.62
オーストラリア	3,029,638,682	1.99
シンガポール	597,879,675	0.39
マレーシア	720,197,281	0.47
南アフリカ	751,528,763	0.49
小計	150,988,855,270	98.97
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	1,567,743,652	1.03
合計（純資産総額）	152,556,598,922	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		59,484,370	0.04
	売建		73,446,224	0.05

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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	11,490,000	13,917.30	1,599,098,037	13,874.49	1,594,179,874	8.000	2021/11/15	1.04
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,070,000	11,353.75	1,256,861,060	11,348.23	1,256,249,318	3.625	2020/2/15	0.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,780,000	11,224.72	1,210,025,702	11,221.24	1,209,650,412	3.375	2019/11/15	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,400,000	11,095.08	1,042,938,441	11,092.63	1,042,707,791	3.750	2018/11/15	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,600,000	13,463.24	1,023,206,851	13,439.48	1,021,400,994	8.750	2020/8/15	0.67

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,300,000	10,808.97	1,005,235,073	10,763.30	1,000,987,111	2.000	2023/2/15	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,710,000	11,353.95	988,929,713	11,343.92	988,055,656	3.500	2020/5/15	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,550,000	11,540.12	986,680,784	11,519.23	984,894,850	3.625	2021/2/15	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,850,000	11,086.69	981,172,110	11,084.84	981,008,780	4.000	2018/8/15	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,830,000	10,616.04	937,396,983	10,617.28	937,506,241	1.500	2018/12/31	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,340,000	10,743.03	895,968,938	10,743.03	895,968,938	2.250	2018/7/31	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,250,000	10,813.27	892,095,480	10,804.68	891,386,102	2.000	2020/7/31	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,150,000	10,638.37	867,027,323	10,590.45	863,121,760	1.750	2023/5/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,950,000	10,852.19	862,749,271	10,853.01	862,814,295	3.500	2018/2/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	10,711.08	856,886,560	10,712.09	856,967,931	1.750	2019/9/30	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,550,000	10,991.04	829,824,102	10,987.56	829,561,260	3.875	2018/5/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,400,000	10,759.62	796,212,005	10,757.56	796,059,916	2.750	2018/2/28	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	10,753.67	752,757,328	10,753.06	752,714,755	2.375	2018/6/30	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,800,000	10,873.48	739,397,263	10,869.80	739,146,983	4.250	2017/11/15	0.48
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,430,000	16,330.03	723,420,592	15,994.30	708,547,868	5.250	2029/11/1	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,600,000	10,600.89	699,659,077	10,601.71	699,713,059	1.875	2017/9/30	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,400,000	10,889.87	696,952,241	10,867.96	695,549,634	2.125	2021/6/30	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	11,859.62	699,717,820	11,605.05	684,698,271	3.125	2044/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,350,000	12,949.18	692,781,257	12,686.83	678,745,573	3.625	2043/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,170,000	10,731.15	662,112,090	10,729.10	661,985,928	2.750	2017/12/31	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,930,000	10,958.89	649,862,629	10,897.04	646,194,514	2.250	2024/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,940,000	10,942.50	649,984,976	10,868.57	645,593,131	2.250	2025/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	11,163.08	647,458,699	11,103.48	644,002,366	2.500	2024/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	11,313.20	656,166,126	11,075.62	642,386,411	2.875	2043/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	11,142.19	612,820,610	11,088.73	609,880,440	2.500	2023/8/15	0.40

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.97
合計	98.97

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	メキシコペソ	買建	1,182,000.00	6,511,127	6,512,820	0.00
	ユーロ	買建	426,000.00	49,003,206	49,011,300	0.03
	英ポンド	買建	31,000.00	3,961,523	3,960,250	0.00
	米ドル	売建	567,193.00	59,475,856	59,470,184	0.04
	ポーランドズロチ	売建	527,000.00	13,950,744	13,976,040	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2016年10月31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	10,759,744,663	43.89
	カナダ	508,073,860	2.07
	メキシコ	222,735,686	0.91
	ドイツ	1,664,647,789	6.79
	イタリア	2,380,572,235	9.71
	フランス	2,528,676,565	10.31
	オランダ	593,741,780	2.42
	スペイン	1,385,412,313	5.65
	ベルギー	581,296,595	2.37
	オーストリア	395,508,089	1.61
	フィンランド	148,155,786	0.60
	アイルランド	211,097,262	0.86
	イギリス	1,700,274,023	6.94
	スイス	51,854,703	0.21
	スウェーデン	127,878,211	0.52
	ノルウェー	72,041,272	0.29
	デンマーク	179,571,695	0.73
	ポーランド	156,988,887	0.64
	オーストラリア	486,589,346	1.98
	シンガポール	86,335,384	0.35
マレーシア	160,548,942	0.65	
南アフリカ	113,534,902	0.46	
	小計	24,515,279,988	100.00
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		288,130	0.00
合計（純資産総額）		24,514,991,858	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		24,991,902,880	101.95

(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	3,600,000	10,566.28	380,386,109	10,553.99	379,943,684	1.375	2020/9/30	1.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	10,606.42	339,405,479	10,608.06	339,458,161	1.500	2018/8/31	1.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,750,000	10,852.19	298,435,283	10,853.01	298,457,775	3.500	2018/2/15	1.22
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,800,000	10,605.60	296,956,893	10,568.74	295,924,861	1.625	2022/8/15	1.21
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,800,000	14,967.70	269,418,706	14,827.32	266,891,794	4.800	2024/1/31	1.09
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,500,000	10,589.22	264,730,605	10,587.99	264,699,933	1.375	2020/1/31	1.08
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,420,000	10,886.80	263,460,715	10,864.68	262,925,279	2.125	2021/8/15	1.07
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,350,000	10,678.31	250,940,361	10,646.77	250,199,127	1.750	2022/5/15	1.02
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,200,000	10,514.06	231,309,332	10,516.92	231,372,311	1.000	2018/5/31	0.94
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,530,000	15,004.19	229,564,217	14,885.00	227,740,543	6.125	2027/11/15	0.93
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,200,000	10,369.87	228,137,316	10,292.45	226,434,117	1.625	2026/5/15	0.92
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,050,000	10,825.56	221,924,147	10,797.09	221,340,522	2.000	2022/2/15	0.90
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,650,000	13,256.99	218,740,383	13,162.70	217,184,706	2.250	2022/10/25	0.89
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,000,000	10,875.74	217,514,872	10,858.94	217,178,901	2.125	2021/1/31	0.89
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,050,000	10,480.06	214,841,332	10,231.84	209,752,727	2.500	2046/2/15	0.86
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,650,000	12,947.75	213,637,978	12,679.87	209,217,862	3.625	2044/2/15	0.85
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,900,000	11,064.16	210,219,165	11,001.90	209,036,114	2.375	2024/8/15	0.85
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,700,000	12,307.42	209,226,271	12,295.54	209,024,232	4.000	2018/4/25	0.85
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,700,000	12,382.46	210,501,876	12,208.04	207,536,808	1.000	2025/11/25	0.85
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,480,000	13,339.95	197,431,341	13,217.02	195,611,963	3.750	2021/8/1	0.80
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,100,000	17,642.73	194,070,068	17,426.94	191,696,402	6.000	2025/10/25	0.78
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,650,000	11,348.84	187,255,869	11,323.65	186,840,277	3.125	2021/5/15	0.76
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	11,540.12	184,642,018	11,519.23	184,307,808	3.625	2021/2/15	0.75
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	10,731.15	182,429,587	10,729.10	182,394,826	2.750	2017/12/31	0.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	10,663.76	181,284,076	10,665.61	181,315,450	1.750	2018/10/31	0.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	10,474.11	178,060,029	10,476.16	178,094,790	0.625	2017/11/30	0.73
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	11,060.27	176,964,421	11,056.79	176,908,719	3.125	2019/5/15	0.72
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,150,000	15,110.17	173,766,982	14,976.50	172,229,833	4.250	2023/10/25	0.70
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,150,000	14,701.49	169,067,154	14,452.35	166,202,035	4.500	2026/3/1	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,550,000	10,638.37	164,894,767	10,590.45	164,151,991	1.750	2023/5/15	0.67

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	100.00
合計	100.00

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	104,091,000.00	10,831,843,720	10,903,240,850	44.48
	加ドル	売建	6,585,000.00	512,823,590	513,419,950	2.09
	メキシコペソ	売建	41,500,000.00	231,118,980	226,867,270	0.93
	ユーロ	売建	87,923,000.00	9,965,945,480	10,116,433,040	41.27
	英ポンド	売建	13,543,000.00	1,714,476,350	1,728,041,900	7.05
	スイスフラン	売建	501,000.00	52,487,870	53,191,520	0.22
	スウェーデンクローナ	売建	11,212,000.00	130,768,950	130,496,970	0.53
	ノルウェークローネ	売建	5,761,000.00	72,254,260	72,772,750	0.30
	デンマーククローネ	売建	11,950,000.00	182,103,470	184,866,500	0.75
	ポーランドズロチ	売建	6,097,000.00	159,356,730	161,065,650	0.66
	豪ドル	売建	6,213,000.00	495,795,200	492,695,720	2.01
	シンガポールドollar	売建	1,172,000.00	87,665,410	88,007,660	0.36
	マレーシアリングgit	売建	8,276,000.00	207,975,880	206,237,920	0.84
	南アフリカランド	売建	15,353,000.00	114,114,150	114,565,180	0.47

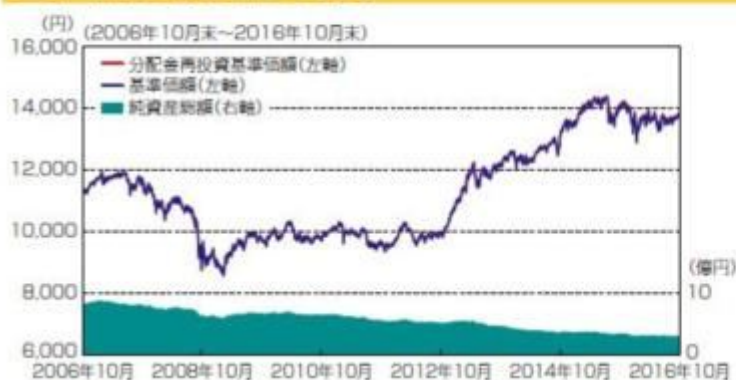
(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

参考情報

運用実績

2016年10月31日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 13,790円

純資産総額…………… 3.09億円

※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、2006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)

2012年10月	2013年10月	2014年10月	2015年10月	2016年10月	設定来累計
0円	10円	10円	10円	10円	70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	31.17%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	4.99%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	4.91%
日本債券インデックスマザーファンド	44.35%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	4.93%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	4.86%
現金その他	4.79%

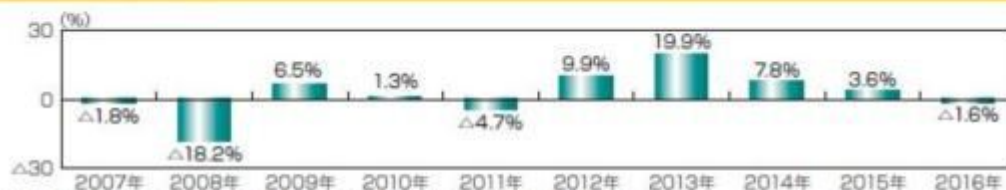
※当ファンドの対純資産総額比です。

<組入上位銘柄>

組入資産	銘柄	業種・種類	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.67%
	2 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.98%
	3 日本電信電話	情報・通信業	1.79%
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	2.06%
	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1.48%
	3 EXXON MOBIL CORP	エネルギー	1.16%
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	2.00%
	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1.43%
	3 EXXON MOBIL CORP	エネルギー	1.14%
日本債券インデックスマザーファンド	1 第107回利付国債(5年)	国債証券	2.09%
	2 第303回利付国債(10年)	国債証券	1.79%
	3 第124回利付国債(5年)	国債証券	1.67%
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	1.04%
	2 US TREASURY N/B(クーポン3.625%)	国債証券	0.82%
	3 US TREASURY N/B(クーポン3.375%)	国債証券	0.79%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	1 US TREASURY N/B(クーポン1.375%)	国債証券	1.55%
	2 US TREASURY N/B(クーポン1.500%)	国債証券	1.38%
	3 US TREASURY N/B(クーポン3.500%)	国債証券	1.22%

※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。

※2016年は、2016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0.2%の率を乗じて得た額)を控除した価額とします。

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

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(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。

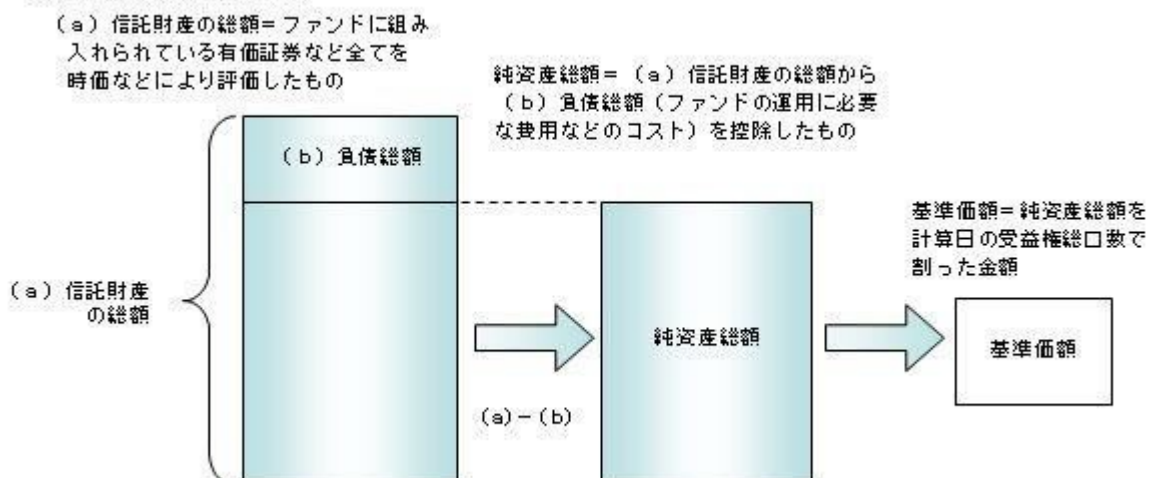
3【資産管理等の概要】

(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1万口あ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^{*}における以下のいずれかの価額で評価します。

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

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

*外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

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。

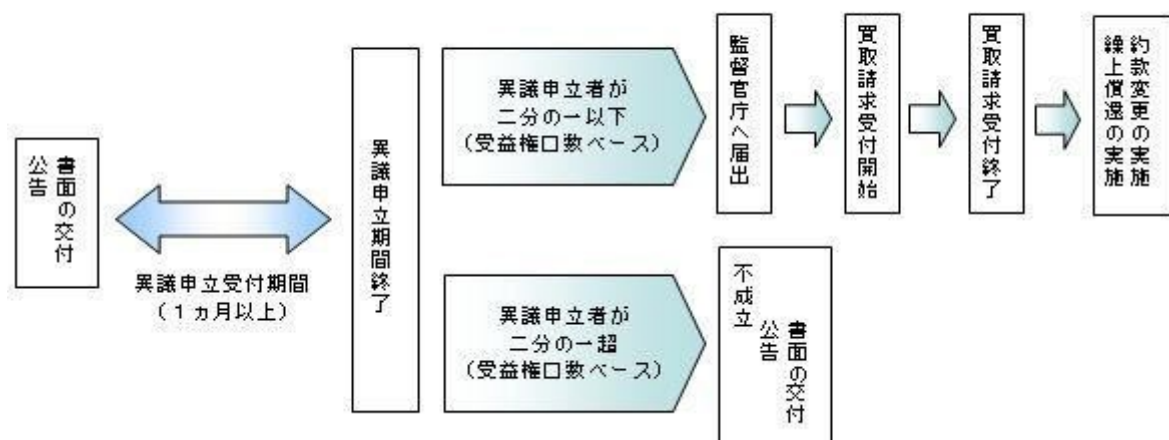
信託約款の変更

- 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することができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。
- 2）委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行わない場合は、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17期計算期間（平成27年10月27日から平成28年10月26日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任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40）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第16期 平成27年10月26日現在	第17期 平成28年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	17,578,361	15,967,818
親投資信託受益証券	327,785,639	294,077,474
未収入金	209,720	87,378
未収利息	28	-
流動資産合計	345,573,748	310,132,670
資産合計	345,573,748	310,132,670
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	244,731	224,085
未払解約金	390,627	136,746
未払受託者報酬	75,940	66,657
未払委託者報酬	1,082,990	950,707
未払利息	-	18
その他未払費用	9,256	8,121
流動負債合計	1,803,544	1,386,334
負債合計	1,803,544	1,386,334
純資産の部		
元本等		
元本	244,731,492	224,085,908
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	99,038,712	84,660,428
（分配準備積立金）	89,251,570	78,467,082
元本等合計	343,770,204	308,746,336
純資産合計	343,770,204	308,746,336
負債純資産合計	345,573,748	310,132,670

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期		第17期	
	自	平成26年10月28日 至 平成27年10月26日	自	平成27年10月27日 至 平成28年10月26日
営業収益				
受取利息		10,172		2,712
有価証券売買等損益		38,321,155		4,187,294
営業収益合計		38,331,327		4,184,582
営業費用				
支払利息		-		3,585
受託者報酬		155,468		136,089
委託者報酬		2,217,127		1,940,994
その他費用		18,948		16,618
営業費用合計		2,391,543		2,097,286
営業利益又は営業損失（ ）		35,939,784		6,281,868
経常利益又は経常損失（ ）		35,939,784		6,281,868
当期純利益又は当期純損失（ ）		35,939,784		6,281,868
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（ ）		5,379,380		724,542
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		77,897,681		99,038,712
剰余金増加額又は欠損金減少額		4,525,386		3,288,434
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		4,525,386		3,288,434
剰余金減少額又は欠損金増加額		13,700,028		11,885,307
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		13,700,028		11,885,307
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		244,731		224,085
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		99,038,712		84,660,428

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		第16期 平成27年10月26日現在	第17期 平成28年10月26日現在
1.	期首元本額	282,522,763円	244,731,492円
	期中追加設定元本額	11,849,353円	8,937,726円
	期中一部解約元本額	49,640,624円	29,583,310円
2.	受益権の総数	244,731,492口	224,085,908口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第16期 自 平成26年10月28日 至 平成27年10月26日		第17期 自 平成27年10月27日 至 平成28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	8,862円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 0円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	30,551,542円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金	29,955,052円	C 信託約款に定める収益調整金 30,536,197円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	58,935,897円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 78,691,167円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	119,451,353円	E 分配対象収益 (A+B+C+D) 109,227,364円
F	分配対象収益(1万口当たり)	4,880円	F 分配対象収益(1万口当たり) 4,874円
G	分配金額	244,731円	G 分配金額 224,085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16期 自 平成26年10月28日 至 平成27年10月26日	第17期 自 平成27年10月27日 至 平成28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16期 平成27年10月26日現在	第17期 平成28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)

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	29,760,457
合計	29,760,457

第17期(平成28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	1,889,270
合計	1,889,270

(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16期 平成27年10月26日現在		第17期 平成28年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.4047円	1口当たり純資産額	1.3778円
(1万口当たり純資産額)	(14,047円)	(1万口当たり純資産額)	(13,778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	8,664,553	15,425,503	
	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI (ヘッジあり)マザーファンド	11,671,765	15,266,668	

日本債券インデックスマザーファンド	97,697,259	137,254,879	
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	7,389,414	15,231,060	
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	9,906,785	15,147,474	
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	80,019,965	95,751,890	
合計	215,349,741	294,077,474	

(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27年10月26日現在	平成28年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	100,707,229	74,004,493
株式	28,010,291,140	25,801,778,970
派生商品評価勘定	22,629,740	8,119,200
未収入金	50,383,230	47,146,960
未収配当金	203,921,722	216,734,395
未収利息	163	-
流動資産合計	28,387,933,224	26,147,784,018
資産合計	28,387,933,224	26,147,784,018
負債の部		
流動負債		

前受金	21,170,000	7,880,000
未払解約金	47,870,666	58,439,520
未払利息	-	85
流動負債合計	69,040,666	66,319,605
負債合計	69,040,666	66,319,605
純資産の部		
元本等		
元本	21,458,722,226	21,796,501,197
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	6,860,170,332	4,284,963,216
元本等合計	28,318,892,558	26,081,464,413
純資産合計	28,318,892,558	26,081,464,413
負債純資産合計	28,387,933,224	26,147,784,018

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27年10月26日現在	平成28年10月26日現在
1.	期首	平成26年10月28日	平成27年10月27日
	期首元本額	25,810,439,886円	21,458,722,226円
	期首からの追加設定元本額	1,828,412,937円	3,751,599,477円
	期首からの一部解約元本額	6,180,130,597円	3,413,820,506円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	189,907,164円	239,816,527円
	DCインデックスバランス（株式40）	714,213,076円	812,936,819円
	DCインデックスバランス（株式60）	1,350,467,087円	1,477,110,439円
	DCインデックスバランス（株式80）	1,600,692,719円	1,676,193,204円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,171,993,590円	1,337,447,149円

世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	5,497,114,326円	5,417,402,166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	5,128,110円	5,113,692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)	23,674,244円	4,079,233円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	65,422,399円	64,875,756円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	53,467,149円	52,860,753円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	81,115,328円	80,019,965円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	97,867,053円	100,340,782円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	7,073,787,445円	6,780,173,464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)	20,238,189円	18,417,277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)	45,719,600円	41,662,571円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	41,930,365円	37,909,904円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	276,300,644円	304,993,776円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	828,292,055円	907,512,348円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	1,161,429,024円	1,223,362,763円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	1,159,962,659円	1,214,272,609円
計	21,458,722,226円	21,796,501,197円
2. 受益権の総数	21,458,722,226口	21,796,501,197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	488,500,000円	378,205,000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26年10月28日 至 平成27年10月26日	自 平成27年10月27日 至 平成28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27年10月26日現在	平成28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

(平成28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	2,598,053,084
合計	2,598,053,084

(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	273,665,000	-	296,305,000	22,640,000
合計		273,665,000	-	296,305,000	22,640,000

(平成28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	268,170,000	-	276,300,000	8,130,000
合計		268,170,000	-	276,300,000	8,130,000

(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27年10月26日現在		平成28年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.3197円	1口当たり純資産額	1.1966円
(1万口当たり純資産額)	(13,197円)	(1万口当たり純資産額)	(11,966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	600	2,769.00	1,661,400	
日本水産	18,100	494.00	8,941,400	
マルハニチロ	2,900	2,902.00	8,415,800	
カネコ種苗	500	1,499.00	749,500	
サカタのタネ	2,100	3,030.00	6,363,000	
ホクト	1,400	1,934.00	2,707,600	
ホクリヨウ	100	750.00	75,000	
住石ホールディングス	4,400	88.00	387,200	
日鉄鉱業	400	4,130.00	1,652,000	
三井松島産業	1,000	1,242.00	1,242,000	
国際石油開発帝石	74,400	986.40	73,388,160	
日本海洋掘削	400	2,383.00	953,200	
石油資源開発	2,200	2,337.00	5,141,400	
K & O エナジーグループ	1,000	1,493.00	1,493,000	

ショーボンドホールディングス	1,500	5,030.00	7,545,000	
ミライト・ホールディングス	4,400	923.00	4,061,200	
サンヨーホームズ	300	557.00	167,100	
ダイセキ環境ソリューション	400	1,484.00	593,600	
安藤・間	9,500	669.00	6,355,500	
東急建設	4,600	1,069.00	4,917,400	
コムシスホールディングス	6,100	1,851.00	11,291,100	
ミサワホーム	1,700	789.00	1,341,300	
高松コンストラクショングループ	1,100	2,531.00	2,784,100	
東建コーポレーション	600	7,580.00	4,548,000	
ソネック	200	624.00	124,800	
ヤマウラ	700	525.00	367,500	
大成建設	73,000	785.00	57,305,000	
大林組	42,400	1,014.00	42,993,600	
清水建設	43,000	923.00	39,689,000	
飛島建設	11,600	184.00	2,134,400	
長谷工コーポレーション	16,500	1,021.00	16,846,500	
松井建設	1,600	1,144.00	1,830,400	
銭高組	2,000	353.00	706,000	
鹿島建設	66,000	699.00	46,134,000	
不動テトラ	10,200	183.00	1,866,600	
大末建設	600	904.00	542,400	
鉄建建設	9,000	343.00	3,087,000	
西松建設	16,000	478.00	7,648,000	
三井住友建設	54,600	99.00	5,405,400	
大豊建設	6,000	583.00	3,498,000	
前田建設工業	9,000	947.00	8,523,000	
ナカノフドー建設	1,100	422.00	464,200	
奥村組	14,000	596.00	8,344,000	
東鉄工業	1,700	2,919.00	4,962,300	
イチケン	2,000	310.00	620,000	
浅沼組	5,000	243.00	1,215,000	
戸田建設	17,000	578.00	9,826,000	
熊谷組	21,000	281.00	5,901,000	
青木あすなろ建設	1,000	724.00	724,000	
北野建設	3,000	272.00	816,000	

植木組	2,000	219.00	438,000
三井ホーム	2,000	460.00	920,000
矢作建設工業	1,900	975.00	1,852,500
ピーエス三菱	1,800	362.00	651,600
日本ハウスホールディングス	3,000	433.00	1,299,000
大東建託	5,200	17,300.00	89,960,000
新日本建設	1,700	995.00	1,691,500
N I P P O	3,000	1,998.00	5,994,000
東亜道路工業	3,000	273.00	819,000
前田道路	4,000	1,905.00	7,620,000
日本道路	4,000	435.00	1,740,000
東亜建設工業	1,300	2,116.00	2,750,800
若築建設	9,000	154.00	1,386,000
東洋建設	4,500	431.00	1,939,500
五洋建設	15,700	613.00	9,624,100
大林道路	1,700	639.00	1,086,300
福田組	2,000	1,178.00	2,356,000
住友林業	9,700	1,447.00	14,035,900
日本基礎技術	1,600	346.00	553,600
日成ビルド工業	4,000	507.00	2,028,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	8,000	77.00	616,000
巴コーポレーション	1,900	340.00	646,000
パナホーム	5,000	793.00	3,965,000
大和ハウス工業	41,700	2,854.50	119,032,650
ライト工業	2,700	1,221.00	3,296,700
積水ハウス	47,200	1,710.00	80,712,000
日特建設	1,600	468.00	748,800
北陸電気工事	700	789.00	552,300
ユアテック	2,000	627.00	1,254,000
西部電気工業	300	2,031.00	609,300
四電工	1,000	395.00	395,000
中電工	2,000	2,131.00	4,262,000
関電工	6,000	1,009.00	6,054,000
きんでん	8,600	1,265.00	10,879,000
東京エネシス	2,000	1,013.00	2,026,000
トーエネック	2,000	498.00	996,000

住友電設	1,200	1,161.00	1,393,200
日本電設工業	2,300	1,929.00	4,436,700
協和エクシオ	5,500	1,532.00	8,426,000
新日本空調	1,200	1,159.00	1,390,800
N D S	200	2,524.00	504,800
九電工	2,600	3,680.00	9,568,000
三機工業	3,200	944.00	3,020,800
日揮	14,200	1,872.00	26,582,400
中外炉工業	4,000	200.00	800,000
ヤマト	1,400	556.00	778,400
太平電業	2,000	1,014.00	2,028,000
高砂熱学工業	4,200	1,527.00	6,413,400
三晃金属工業	200	2,847.00	569,400
朝日工業社	300	3,065.00	919,500
明星工業	2,600	530.00	1,378,000
大気社	1,800	2,619.00	4,714,200
ダイダン	2,000	815.00	1,630,000
日比谷総合設備	1,700	1,658.00	2,818,600
東芝プラントシステム	2,300	1,608.00	3,698,400
東洋エンジニアリング	8,000	352.00	2,816,000
千代田化工建設	10,000	914.00	9,140,000
新興プランテック	2,900	780.00	2,262,000
日本製粉	4,500	1,572.00	7,074,000
日清製粉グループ本社	15,500	1,608.00	24,924,000
日東富士製粉	100	3,685.00	368,500
昭和産業	6,000	576.00	3,456,000
鳥越製粉	1,100	769.00	845,900
中部飼料	1,300	875.00	1,137,500
フィード・ワン	8,500	136.00	1,156,000
東洋精糖	3,000	111.00	333,000
日本甜菜製糖	700	2,003.00	1,402,100
三井製糖	1,100	2,466.00	2,712,600
塩水港精糖	1,600	249.00	398,400
日新製糖	600	1,435.00	861,000
森永製菓	2,600	4,850.00	12,610,000
中村屋	300	4,750.00	1,425,000

江崎グリコ	3,300	5,980.00	19,734,000	
名糖産業	600	1,383.00	829,800	
不道家	8,000	206.00	1,648,000	
山崎製パン	10,400	2,492.00	25,916,800	
第一屋製パン	3,000	136.00	408,000	
モロゾフ	2,000	442.00	884,000	
亀田製菓	800	5,740.00	4,592,000	
寿スピリッツ	1,000	2,517.00	2,517,000	
カルビー	5,200	3,860.00	20,072,000	
森永乳業	13,000	834.00	10,842,000	
六甲バター	600	2,835.00	1,701,000	
ヤクルト本社	7,600	4,850.00	36,860,000	
明治ホールディングス	8,400	10,480.00	88,032,000	
雪印メグミルク	3,300	3,615.00	11,929,500	
プリマハム	9,000	385.00	3,465,000	
日本ハム	10,000	2,531.00	25,310,000	
林兼産業	500	904.00	452,000	
丸大食品	7,000	505.00	3,535,000	
S Foods	900	2,803.00	2,522,700	
伊藤ハム米久ホールディングス	8,400	1,022.00	8,584,800	
サッポロホールディングス	4,600	2,974.00	13,680,400	
アサヒグループホールディングス	26,500	3,617.00	95,850,500	
キリンホールディングス	60,900	1,771.00	107,853,900	
宝ホールディングス	10,200	991.00	10,108,200	
オエノンホールディングス	4,000	252.00	1,008,000	
養命酒製造	400	1,853.00	741,200	
コカ・コーラウエスト	4,800	3,100.00	14,880,000	
コカ・コーライーストジャパン	5,500	2,320.00	12,760,000	
サントリー食品インターナショナル	9,700	4,600.00	44,620,000	
ダイトードリンコ	700	5,800.00	4,060,000	
伊藤園	4,200	3,845.00	16,149,000	
キーコーヒー	1,300	2,044.00	2,657,200	
ユニカフェ	400	960.00	384,000	
ジャパンフーズ	200	1,172.00	234,400	
日清オイリオグループ	7,000	475.00	3,325,000	
不二製油グループ本社	3,800	2,124.00	8,071,200	

かどや製油	200	3,190.00	638,000	
J - オイルミルズ	600	3,750.00	2,250,000	
キッコーマン	11,000	3,320.00	36,520,000	
味の素	29,100	2,322.50	67,584,750	
キュービー	7,200	2,989.00	21,520,800	
ハウス食品グループ本社	4,800	2,314.00	11,107,200	
カゴメ	5,100	2,698.00	13,759,800	
焼津水産化学工業	700	1,020.00	714,000	
アリアケジャパン	1,200	5,880.00	7,056,000	
ピエトロ	200	1,547.00	309,400	
エバラ食品工業	300	1,973.00	591,900	
ニチレイ	7,500	2,367.00	17,752,500	
東洋水産	6,900	4,390.00	30,291,000	
イトアンド	200	2,067.00	413,400	
日清食品ホールディングス	6,000	6,080.00	36,480,000	
永谷園ホールディングス	1,000	1,338.00	1,338,000	
一正蒲鉾	500	1,134.00	567,000	
フジッコ	1,400	2,494.00	3,491,600	
ロック・フィールド	1,500	1,492.00	2,238,000	
日本たばこ産業	78,400	3,965.00	310,856,000	
ケンコーマヨネーズ	500	3,870.00	1,935,000	
わらべや日洋ホールディングス	800	2,533.00	2,026,400	
なとり	700	1,810.00	1,267,000	
北の達人コーポレーション	300	463.00	138,900	
ユーグレナ	4,500	1,431.00	6,439,500	
ミヨシ油脂	5,000	135.00	675,000	
理研ビタミン	300	5,080.00	1,524,000	
片倉工業	1,700	1,277.00	2,170,900	
ゲンゼ	11,000	348.00	3,828,000	
東洋紡	52,000	172.00	8,944,000	
ユニチカ	39,000	72.00	2,808,000	
富士紡ホールディングス	600	3,215.00	1,929,000	
倉敷紡績	13,000	210.00	2,730,000	
シキボウ	8,000	118.00	944,000	
日本毛織	3,700	757.00	2,800,900	
ダイトウボウ	3,000	70.00	210,000	

トーア紡コーポレーション	600	509.00	305,400
ダイドーリミテッド	1,500	409.00	613,500
帝国繊維	1,400	1,545.00	2,163,000
帝人	10,800	1,975.00	21,330,000
東レ	96,000	974.70	93,571,200
サカイオーベックス	400	1,887.00	754,800
住江織物	3,000	235.00	705,000
日本フェルト	700	513.00	359,100
イチカワ	1,000	266.00	266,000
日東製網	1,000	165.00	165,000
アツギ	10,000	115.00	1,150,000
ダイニック	3,000	172.00	516,000
セーレン	3,300	1,248.00	4,118,400
ソトー	500	1,224.00	612,000
東海染工	2,000	127.00	254,000
小松精練	2,000	651.00	1,302,000
ワコールホールディングス	8,000	1,190.00	9,520,000
ホギメディカル	800	6,860.00	5,488,000
レナウン	3,700	103.00	381,100
クラウディア	300	490.00	147,000
T S Iホールディングス	5,900	598.00	3,528,200
三陽商会	7,000	166.00	1,162,000
ナイガイ	5,000	59.00	295,000
オンワードホールディングス	9,000	694.00	6,246,000
ルック	2,000	155.00	310,000
キムラタン	58,000	7.00	406,000
ゴールドウイン	600	4,840.00	2,904,000
デサント	3,000	1,434.00	4,302,000
キング	600	400.00	240,000
ヤマトインターナショナル	800	388.00	310,400
特種東海製紙	800	3,600.00	2,880,000
王子ホールディングス	51,000	438.00	22,338,000
日本製紙	6,800	1,951.00	13,266,800
三菱製紙	2,000	673.00	1,346,000
北越紀州製紙	8,200	653.00	5,354,600
中越パルプ工業	5,000	226.00	1,130,000

巴川製紙所	2,000	253.00	506,000	
大王製紙	5,900	1,244.00	7,339,600	
レンゴー	11,700	662.00	7,745,400	
トーマク	4,000	299.00	1,196,000	
ザ・バック	900	2,839.00	2,555,100	
クラレ	22,200	1,547.00	34,343,400	
旭化成	82,000	940.00	77,080,000	
共和レザー	900	755.00	679,500	
昭和電工	8,800	1,373.00	12,082,400	
住友化学	97,000	512.00	49,664,000	
日本化成	3,000	144.00	432,000	
住友精化	500	3,930.00	1,965,000	
日産化学工業	7,900	3,540.00	27,966,000	
ラサ工業	5,000	126.00	630,000	
クレハ	1,000	3,930.00	3,930,000	
多木化学	1,000	747.00	747,000	
テイカ	2,000	549.00	1,098,000	
石原産業	2,400	787.00	1,888,800	
片倉コープアグリ	2,000	219.00	438,000	
日東エフシー	800	845.00	676,000	
日本曹達	9,000	452.00	4,068,000	
東ソー	36,000	695.00	25,020,000	
トクヤマ	22,000	476.00	10,472,000	
セントラル硝子	14,000	436.00	6,104,000	
東亜合成	8,300	1,186.00	9,843,800	
大阪ソーダ	6,000	441.00	2,646,000	
関東電化工業	3,000	875.00	2,625,000	
デンカ	27,000	468.00	12,636,000	
信越化学工業	23,700	7,692.00	182,300,400	
日本カーバイド工業	5,000	139.00	695,000	
堺化学工業	5,000	356.00	1,780,000	
エア・ウォーター	10,900	1,956.00	21,320,400	
大陽日酸	10,200	1,095.00	11,169,000	
日本化学工業	5,000	271.00	1,355,000	
日本パーカライジング	6,700	1,443.00	9,668,100	
高圧ガス工業	2,000	706.00	1,412,000	

四国化成工業	2,000	971.00	1,942,000	
戸田工業	3,000	301.00	903,000	
ステラ ケミファ	700	3,805.00	2,663,500	
保土谷化学工業	400	2,879.00	1,151,600	
日本触媒	1,900	7,130.00	13,547,000	
大日精化工業	5,000	571.00	2,855,000	
カネカ	18,000	863.00	15,534,000	
三菱瓦斯化学	11,400	1,607.00	18,319,800	
三井化学	56,000	531.00	29,736,000	
J S R	12,400	1,601.00	19,852,400	
東京応化工業	2,600	3,355.00	8,723,000	
大阪有機化学工業	900	798.00	718,200	
三菱ケミカルホールディングス	88,500	688.80	60,958,800	
ダイセル	17,800	1,368.00	24,350,400	
住友ベークライト	12,000	566.00	6,792,000	
積水化学工業	30,000	1,569.00	47,070,000	
日本ゼオン	11,000	1,003.00	11,033,000	
アイカ工業	4,000	2,820.00	11,280,000	
宇部興産	71,000	213.00	15,123,000	
積水樹脂	2,000	1,696.00	3,392,000	
タキロン	3,000	482.00	1,446,000	
旭有機材	4,000	197.00	788,000	
日立化成	6,500	2,487.00	16,165,500	
ニチバン	1,000	929.00	929,000	
リケンテクノス	2,900	545.00	1,580,500	
大倉工業	3,000	403.00	1,209,000	
積水化成成品工業	1,700	762.00	1,295,400	
群栄化学工業	400	2,999.00	1,199,600	
タイガースポリマー	700	702.00	491,400	
ミライアル	500	716.00	358,000	
ダイキアクシス	200	999.00	199,800	
ダイキョーニシカワ	1,700	1,357.00	2,306,900	
日本化薬	9,000	1,198.00	10,782,000	
カーリットホールディングス	1,300	535.00	695,500	
日本精化	1,100	809.00	889,900	
扶桑化学工業	800	2,296.00	1,836,800	

A D E K A	6,500	1,561.00	10,146,500
日油	10,000	1,134.00	11,340,000
新日本理化	2,200	161.00	354,200
ハリマ化成グループ	1,200	583.00	699,600
花王	33,600	5,751.00	193,233,600
第一工業製薬	3,000	351.00	1,053,000
ニイタカ	200	1,474.00	294,800
三洋化成工業	800	4,825.00	3,860,000
有機合成薬品工業	1,000	224.00	224,000
大日本塗料	8,000	228.00	1,824,000
日本ペイントホールディングス	10,200	3,570.00	36,414,000
関西ペイント	14,900	2,225.00	33,152,500
神東塗料	1,000	202.00	202,000
中国塗料	3,800	739.00	2,808,200
日本特殊塗料	900	1,425.00	1,282,500
藤倉化成	1,800	626.00	1,126,800
太陽ホールディングス	1,000	3,895.00	3,895,000
D I C	5,200	3,230.00	16,796,000
サカタインクス	2,700	1,354.00	3,655,800
東洋インキ S C ホールディングス	13,000	482.00	6,266,000
T & K T O K A	1,000	993.00	993,000
富士フイルムホールディングス	30,200	4,129.00	124,695,800
資生堂	25,100	2,695.00	67,644,500
ライオン	16,000	1,718.00	27,488,000
高砂香料工業	900	2,827.00	2,544,300
マンダム	1,200	4,755.00	5,706,000
ミルボン	700	4,660.00	3,262,000
ファンケル	3,100	1,647.00	5,105,700
コーセー	2,100	9,700.00	20,370,000
コタ	400	1,241.00	496,400
シーズ・ホールディングス	1,700	3,005.00	5,108,500
シーボン	100	2,152.00	215,200
ポーラ・オルビスホールディングス	1,400	8,800.00	12,320,000
ノエビアホールディングス	800	3,160.00	2,528,000
アジュバンコスメジャパン	300	872.00	261,600
エステー	900	1,329.00	1,196,100

アグロ カネショウ	500	1,152.00	576,000
コニシ	2,100	1,310.00	2,751,000
長谷川香料	1,700	1,884.00	3,202,800
星光PMC	700	1,129.00	790,300
小林製薬	4,000	5,450.00	21,800,000
荒川化学工業	1,100	1,515.00	1,666,500
メック	1,000	1,081.00	1,081,000
日本高純度化学	400	2,459.00	983,600
タカラバイオ	2,800	1,522.00	4,261,600
JCU	400	4,260.00	1,704,000
新田ゼラチン	900	729.00	656,100
OATアグリオ	200	1,317.00	263,400
デクセリアルズ	4,000	914.00	3,656,000
アース製薬	900	4,855.00	4,369,500
イハラケミカル工業	1,800	945.00	1,701,000
北興化学工業	1,000	347.00	347,000
大成ラミック	400	3,035.00	1,214,000
クミアイ化学工業	2,700	611.00	1,649,700
日本農薬	3,000	572.00	1,716,000
アキレス	1,100	1,494.00	1,643,400
有沢製作所	1,900	544.00	1,033,600
日東電工	10,200	7,433.00	75,816,600
レック	400	2,767.00	1,106,800
きもと	2,300	247.00	568,100
藤森工業	1,100	2,492.00	2,741,200
前澤化成工業	900	1,080.00	972,000
JSP	900	2,420.00	2,178,000
エフピコ	1,200	5,710.00	6,852,000
天馬	1,000	1,778.00	1,778,000
信越ポリマー	2,600	696.00	1,809,600
東リ	3,000	329.00	987,000
ニフコ	2,500	5,570.00	13,925,000
日本バルカー工業	1,000	1,399.00	1,399,000
ユニ・チャーム	26,700	2,473.00	66,029,100
協和発酵キリン	15,800	1,616.00	25,532,800

				代用有価証券 10,000株
武田薬品工業	52,600	4,804.00	252,690,400	
アステラス製薬	143,400	1,557.00	223,273,800	
大日本住友製薬	9,300	1,875.00	17,437,500	
塩野義製薬	19,200	5,270.00	101,184,000	
田辺三菱製薬	15,400	2,122.00	32,678,800	
わかもと製薬	1,000	239.00	239,000	
あすか製薬	1,700	1,892.00	3,216,400	
日本新薬	3,000	5,390.00	16,170,000	
ピオフェルミン製薬	200	2,660.00	532,000	
中外製薬	13,100	3,490.00	45,719,000	
科研製薬	2,300	6,590.00	15,157,000	
エーザイ	16,300	6,850.00	111,655,000	
ロート製薬	6,500	1,802.00	11,713,000	
小野薬品工業	30,000	2,700.00	81,000,000	
久光製薬	4,100	5,530.00	22,673,000	
持田製薬	900	8,270.00	7,443,000	
参天製薬	24,400	1,513.00	36,917,200	
扶桑薬品工業	500	2,670.00	1,335,000	
日本ケミファ	200	4,420.00	884,000	
ツムラ	4,200	3,025.00	12,705,000	
日医工	3,100	1,941.00	6,017,100	
キッセイ薬品工業	2,300	2,771.00	6,373,300	
生化学工業	2,400	1,682.00	4,036,800	
栄研化学	1,100	3,025.00	3,327,500	
日水製薬	500	1,148.00	574,000	
鳥居薬品	900	2,310.00	2,079,000	
JCRファーマ	1,000	2,557.00	2,557,000	
東和薬品	600	4,145.00	2,487,000	
富士製薬工業	400	2,605.00	1,042,000	
沢井製薬	2,200	6,910.00	15,202,000	
ゼリア新薬工業	2,700	1,761.00	4,754,700	
第一三共	44,400	2,425.00	107,670,000	
キョーリン製薬ホールディングス	3,500	2,312.00	8,092,000	
大幸薬品	700	1,615.00	1,130,500	
ダイト	800	2,321.00	1,856,800	

大塚ホールディングス	28,400	4,609.00	130,895,600	
大正製薬ホールディングス	3,200	10,300.00	32,960,000	
ペプチドリーム	2,200	5,400.00	11,880,000	
日本コークス工業	11,000	90.00	990,000	
昭和シェル石油	11,800	966.00	11,398,800	
ニチレキ	1,700	808.00	1,373,600	
東燃ゼネラル石油	22,000	1,019.00	22,418,000	
ユシロ化学工業	700	1,440.00	1,008,000	
ピーピー・カストロール	500	1,364.00	682,000	
富士石油	3,100	336.00	1,041,600	
MORESCO	400	1,393.00	557,200	
出光興産	6,900	2,364.00	16,311,600	
JXホールディングス	156,300	412.50	64,473,750	
コスモエネルギーホールディングス	4,000	1,361.00	5,444,000	
横浜ゴム	8,000	1,811.00	14,488,000	
東洋ゴム工業	7,000	1,639.00	11,473,000	
ブリヂストン	44,600	3,960.00	176,616,000	
住友ゴム工業	12,400	1,709.00	21,191,600	
藤倉ゴム工業	1,200	565.00	678,000	
オカモト	4,000	1,178.00	4,712,000	
フコク	500	864.00	432,000	
ニッタ	1,400	2,668.00	3,735,200	
住友理工	2,800	1,070.00	2,996,000	
三ツ星ベルト	3,000	886.00	2,658,000	
バンドー化学	2,400	1,017.00	2,440,800	
日東紡績	9,000	356.00	3,204,000	
旭硝子	65,000	725.00	47,125,000	
日本板硝子	6,400	841.00	5,382,400	
石塚硝子	2,000	174.00	348,000	
日本山村硝子	5,000	188.00	940,000	
日本電気硝子	27,000	563.00	15,201,000	
オハラ	500	640.00	320,000	
住友大阪セメント	26,000	446.00	11,596,000	
太平洋セメント	84,000	309.00	25,956,000	
日本ヒューム	1,300	681.00	885,300	
日本コンクリート工業	2,800	371.00	1,038,800	

三谷セキサン	700	2,638.00	1,846,600
アジアパイルホールディングス	1,700	449.00	763,300
東海カーボン	12,000	315.00	3,780,000
日本カーボン	7,000	209.00	1,463,000
東洋炭素	700	1,495.00	1,046,500
ノリタケカンパニーリミテド	700	2,387.00	1,670,900
TOTO	9,700	4,160.00	40,352,000
日本碍子	16,700	2,147.00	35,854,900
日本特殊陶業	11,400	1,992.00	22,708,800
ダントーホールディングス	1,000	189.00	189,000
MARUWA	500	3,960.00	1,980,000
品川リフラクトリーズ	3,000	215.00	645,000
黒崎播磨	3,000	300.00	900,000
ヨータイ	1,000	306.00	306,000
イソライト工業	700	285.00	199,500
東京窯業	1,600	169.00	270,400
ニッカトー	500	387.00	193,500
フジミインコーポレーテッド	1,100	1,645.00	1,809,500
エーアンドエーマテリアル	3,000	98.00	294,000
ニチアス	7,000	941.00	6,587,000
ニチハ	1,800	2,625.00	4,725,000
新日鐵住金	59,600	2,045.50	121,911,800
神戸製鋼所	24,300	853.00	20,727,900
合同製鐵	800	1,893.00	1,514,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	36,100	1,456.50	52,579,650
日新製鋼	6,000	1,395.00	8,370,000
東京製鐵	7,300	735.00	5,365,500
共英製鋼	1,400	2,013.00	2,818,200
大和工業	2,900	3,055.00	8,859,500
東京鐵鋼	3,000	447.00	1,341,000
大阪製鐵	800	1,859.00	1,487,200
淀川製鋼所	2,000	2,838.00	5,676,000
東洋鋼鈹	3,200	299.00	956,800
丸一鋼管	4,400	3,360.00	14,784,000
モリ工業	400	1,945.00	778,000
大同特殊鋼	22,000	481.00	10,582,000

日本高周波鋼業	6,000	76.00	456,000	
日本冶金工業	10,000	150.00	1,500,000	
山陽特殊製鋼	8,000	570.00	4,560,000	
愛知製鋼	800	5,110.00	4,088,000	
日立金属	15,100	1,351.00	20,400,100	
日本金属	400	1,091.00	436,400	
大太平洋金属	9,000	314.00	2,826,000	
新日本電工	7,700	193.00	1,486,100	
栗本鐵工所	700	1,908.00	1,335,600	
虹技	2,000	241.00	482,000	
日本鑄鉄管	2,000	198.00	396,000	
三菱製鋼	9,000	186.00	1,674,000	
日亜鋼業	2,000	249.00	498,000	
日本精線	1,000	490.00	490,000	
シンニッタン	1,200	487.00	584,400	
新家工業	3,000	145.00	435,000	
大紀アルミニウム工業所	2,000	400.00	800,000	
日本軽金属ホールディングス	30,000	237.00	7,110,000	
三井金属鉱業	34,000	238.00	8,092,000	
東邦亜鉛	7,000	365.00	2,555,000	
三菱マテリアル	8,300	2,927.00	24,294,100	
住友金属鉱山	36,000	1,350.00	48,600,000	
DOWAホールディングス	17,000	765.00	13,005,000	
古河機械金属	21,000	168.00	3,528,000	
エス・サイエンス	6,600	35.00	231,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,300	1,479.00	1,922,700	
東邦チタニウム	2,300	746.00	1,715,800	
UACJ	18,000	344.00	6,192,000	
古河電気工業	4,200	2,951.00	12,394,200	
住友電気工業	52,900	1,541.50	81,545,350	
フジクラ	18,400	628.00	11,555,200	
昭和電線ホールディングス	17,000	74.00	1,258,000	
タツタ電線	2,800	390.00	1,092,000	
沖電線	1,000	232.00	232,000	
カナレ電気	200	1,998.00	399,600	
平河ヒューテック	600	943.00	565,800	

リヨービ	8,000	449.00	3,592,000	
アーレスティ	1,500	1,151.00	1,726,500	
アサヒホールディングス	2,000	1,828.00	3,656,000	
稲葉製作所	700	1,323.00	926,100	
宮地エンジニアリンググループ	4,000	167.00	668,000	
トーカロ	900	2,312.00	2,080,800	
アルファC o	400	1,019.00	407,600	
SUMCO	13,800	917.00	12,654,600	
川田テクノロジーズ	300	4,820.00	1,446,000	
東洋製罐グループホールディングス	9,400	1,899.00	17,850,600	
ホッカンホールディングス	4,000	352.00	1,408,000	
コロナ	700	1,117.00	781,900	
横河ブリッジホールディングス	2,500	1,151.00	2,877,500	
駒井ハルテック	200	1,996.00	399,200	
高田機工	1,000	212.00	212,000	
三和ホールディングス	13,100	1,033.00	13,532,300	
文化シャッター	3,700	855.00	3,163,500	
三協立山	1,700	1,660.00	2,822,000	
アルインコ	1,000	968.00	968,000	
東洋シャッター	400	546.00	218,400	
LIXILグループ	18,400	2,427.00	44,656,800	
日本フィルコン	1,000	540.00	540,000	
ノーリツ	2,600	2,199.00	5,717,400	
長府製作所	1,400	2,695.00	3,773,000	
リンナイ	2,500	9,960.00	24,900,000	
ダイニチ工業	800	650.00	520,000	
日東精工	2,000	400.00	800,000	
三洋工業	2,000	178.00	356,000	
岡部	2,800	909.00	2,545,200	
ジーテクト	1,400	1,980.00	2,772,000	
中国工業	200	684.00	136,800	
東プレ	2,500	2,267.00	5,667,500	
高周波熱錬	2,500	869.00	2,172,500	
東京製綱	900	1,734.00	1,560,600	
サンコール	700	461.00	322,700	
モリテック スチール	700	265.00	185,500	

パイオラックス	700	6,670.00	4,669,000
日本発條	12,400	971.00	12,040,400
中央発條	1,000	289.00	289,000
アドバネクス	300	1,154.00	346,200
立川ブラインド工業	600	755.00	453,000
三益半導体工業	1,000	1,195.00	1,195,000
日本ドライケミカル	200	2,297.00	459,400
日本製鋼所	4,400	2,275.00	10,010,000
三浦工業	5,900	1,784.00	10,525,600
タクマ	5,000	961.00	4,805,000
ツガミ	4,000	568.00	2,272,000
オークマ	9,000	858.00	7,722,000
東芝機械	7,000	373.00	2,611,000
アマダホールディングス	19,200	1,179.00	22,636,800
アイダエンジニアリング	3,500	899.00	3,146,500
滝澤鉄工所	4,000	137.00	548,000
富士機械製造	4,300	1,321.00	5,680,300
牧野フライス製作所	6,000	676.00	4,056,000
オーエスジー	6,000	2,214.00	13,284,000
ダイジェット工業	2,000	155.00	310,000
旭ダイヤモンド工業	3,600	760.00	2,736,000
D M G 森精機	7,800	1,094.00	8,533,200
ソディック	3,400	768.00	2,611,200
ディスコ	1,700	12,260.00	20,842,000
日東工器	800	2,454.00	1,963,200
パンチ工業	500	901.00	450,500
豊和工業	800	548.00	438,400
O K K	5,000	107.00	535,000
東洋機械金属	1,000	389.00	389,000
津田駒工業	3,000	143.00	429,000
島精機製作所	1,900	2,801.00	5,321,900
N C ホールディングス	400	863.00	345,200
フリー	200	3,290.00	658,000
ヤマシンフィルタ	300	642.00	192,600
日阪製作所	1,700	828.00	1,407,600
やまびこ	2,400	1,014.00	2,433,600

ベガサスミシン製造	1,400	598.00	837,200
ナブテスコ	6,900	3,115.00	21,493,500
三井海洋開発	1,300	1,801.00	2,341,300
レオン自動機	1,100	826.00	908,600
S M C	4,000	30,660.00	122,640,000
新川	1,200	687.00	824,400
ホソカワミクロン	2,000	648.00	1,296,000
ユニオンツール	600	2,731.00	1,638,600
オイレス工業	1,700	1,850.00	3,145,000
日精エー・エス・ビー機械	400	1,860.00	744,000
サトーホールディングス	1,800	2,279.00	4,102,200
日本エアージェット	400	635.00	254,000
日精樹脂工業	1,000	788.00	788,000
オカダアイヨン	300	811.00	243,300
ワイエイシイ	500	1,315.00	657,500
小松製作所	64,700	2,320.50	150,136,350
住友重機械工業	38,000	544.00	20,672,000
日立建機	5,900	2,139.00	12,620,100
日工	400	1,699.00	679,600
巴工業	500	1,562.00	781,000
井関農機	13,000	253.00	3,289,000
T O W A	1,300	1,134.00	1,474,200
丸山製作所	3,000	174.00	522,000
北川鉄工所	600	1,761.00	1,056,600
ローツェ	500	1,835.00	917,500
タカキタ	500	539.00	269,500
クボタ	63,400	1,639.00	103,912,600
荏原実業	400	1,274.00	509,600
三菱化工機	4,000	207.00	828,000
月島機械	2,500	1,262.00	3,155,000
帝国電機製作所	1,000	794.00	794,000
新東工業	3,000	882.00	2,646,000
澁谷工業	1,100	2,181.00	2,399,100
アイチ コーポレーション	1,900	790.00	1,501,000
小森コーポレーション	2,900	1,361.00	3,946,900
鶴見製作所	1,000	1,528.00	1,528,000

住友精密工業	2,000	343.00	686,000	
酒井重工業	2,000	208.00	416,000	
荏原製作所	5,800	3,135.00	18,183,000	
石井鐵工所	200	1,547.00	309,400	
西島製作所	1,400	1,107.00	1,549,800	
北越工業	1,400	681.00	953,400	
ダイキン工業	18,400	9,879.00	181,773,600	
オルガノ	2,000	459.00	918,000	
トーヨーカネツ	6,000	232.00	1,392,000	
栗田工業	7,900	2,487.00	19,647,300	
樫本チエイン	7,000	825.00	5,775,000	
大同工業	3,000	230.00	690,000	
木村化工機	1,200	358.00	429,600	
アネスト岩田	2,100	1,050.00	2,205,000	
ダイフク	6,800	1,874.00	12,743,200	
サムコ	300	906.00	271,800	
加藤製作所	600	2,536.00	1,521,600	
油研工業	2,000	176.00	352,000	
タダノ	6,100	1,182.00	7,210,200	
フジテック	3,700	1,193.00	4,414,100	
C K D	3,500	1,184.00	4,144,000	
キトー	1,600	993.00	1,588,800	
平和	3,900	2,426.00	9,461,400	
理想科学工業	1,400	1,732.00	2,424,800	
S A N K Y O	3,500	3,665.00	12,827,500	
日本金銭機械	1,200	1,510.00	1,812,000	
マースエンジニアリング	700	2,088.00	1,461,600	
福島工業	800	3,530.00	2,824,000	
オーイズミ	600	749.00	449,400	
ダイコク電機	500	1,650.00	825,000	
竹内製作所	2,500	2,021.00	5,052,500	
アマノ	3,900	1,840.00	7,176,000	
J U K I	2,000	770.00	1,540,000	
サンデンホールディングス	8,000	324.00	2,592,000	
蛇の目ミシン工業	1,300	788.00	1,024,400	
マックス	2,000	1,241.00	2,482,000	

グローリー	4,300	3,490.00	15,007,000
新晃工業	900	1,280.00	1,152,000
大和冷機工業	2,000	922.00	1,844,000
セガサミーホールディングス	13,600	1,534.00	20,862,400
日本ピストンリング	500	1,577.00	788,500
リケン	600	3,755.00	2,253,000
T P R	1,500	3,015.00	4,522,500
ツバキ・ナカシマ	1,400	1,596.00	2,234,400
ホシザキ	2,800	9,380.00	26,264,000
大豊工業	1,000	1,204.00	1,204,000
日本精工	25,900	1,161.00	30,069,900
N T N	31,000	397.00	12,307,000
ジェイテクト	13,400	1,561.00	20,917,400
不二越	13,000	398.00	5,174,000
日本トムソン	4,300	405.00	1,741,500
T H K	8,400	2,173.00	18,253,200
ユーシン精機	500	2,428.00	1,214,000
前澤給装工業	500	1,406.00	703,000
イーグル工業	1,600	1,466.00	2,345,600
前澤工業	1,000	347.00	347,000
日本ピラー工業	1,300	1,035.00	1,345,500
キッツ	5,600	614.00	3,438,400
日立工機	3,400	842.00	2,862,800
マキタ	8,200	7,500.00	61,500,000
日立造船	10,000	522.00	5,220,000
三菱重工業	225,000	451.00	101,475,000
I H I	97,000	267.00	25,899,000
スター精密	2,400	1,454.00	3,489,600
日清紡ホールディングス	7,000	1,062.00	7,434,000
イビデン	7,700	1,519.00	11,696,300
コニカミノルタ	31,500	936.00	29,484,000
ブラザー工業	16,300	1,855.00	30,236,500
ミネベア	20,400	1,035.00	21,114,000
日立製作所	322,000	525.10	169,082,200
東芝	266,000	376.50	100,149,000
三菱電機	134,600	1,399.00	188,305,400

富士電機	38,000	527.00	20,026,000	
東洋電機製造	2,000	295.00	590,000	
安川電機	15,700	1,646.00	25,842,200	
シンフォニアテクノロジー	8,000	190.00	1,520,000	
明電舎	12,000	355.00	4,260,000	
オリジン電気	2,000	275.00	550,000	
山洋電気	3,000	658.00	1,974,000	
デンヨー	1,200	1,263.00	1,515,600	
東芝テック	9,000	459.00	4,131,000	
芝浦メカトロニクス	2,000	260.00	520,000	
マブチモーター	3,600	6,010.00	21,636,000	
日本電産	15,200	10,050.00	152,760,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	200	2,303.00	460,600	
東光高岳	700	2,148.00	1,503,600	
ダブル・スコープ	1,200	1,770.00	2,124,000	
ダイヘン	7,000	593.00	4,151,000	
田淵電機	1,500	338.00	507,000	
ヤーマン	100	3,305.00	330,500	
JVCケンウッド	9,300	291.00	2,706,300	
ミマキエンジニアリング	1,200	583.00	699,600	
第一精工	600	1,163.00	697,800	
日新電機	3,000	1,540.00	4,620,000	
大崎電気工業	2,000	969.00	1,938,000	
オムロン	14,200	3,805.00	54,031,000	
日東工業	2,000	1,472.00	2,944,000	
I D E C	1,600	934.00	1,494,400	
不二電機工業	100	1,379.00	137,900	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	24,000	449.00	10,776,000	
サクサホールディングス	3,000	217.00	651,000	
メルコホールディングス	700	2,754.00	1,927,800	
テクノメディカ	300	1,770.00	531,000	
日本電気	173,000	273.00	47,229,000	
富士通	122,000	555.80	67,807,600	
沖電気工業	5,500	1,543.00	8,486,500	
岩崎通信機	6,000	76.00	456,000	
電気興業	3,000	554.00	1,662,000	

サンケン電気	7,000	365.00	2,555,000	
ナカヨ	1,000	370.00	370,000	
アイホン	700	1,840.00	1,288,000	
ルネサスエレクトロニクス	6,500	629.00	4,088,500	
セイコーエプソン	18,800	2,037.00	38,295,600	
ワコム	9,800	314.00	3,077,200	
アルバック	2,300	3,195.00	7,348,500	
アクセル	600	859.00	515,400	
E I Z O	1,200	2,929.00	3,514,800	
ジャパンディスプレイ	23,600	206.00	4,861,600	
日本信号	3,500	930.00	3,255,000	
京三製作所	3,000	381.00	1,143,000	
能美防災	1,400	1,559.00	2,182,600	
ホーチキ	900	1,201.00	1,080,900	
エレコム	1,100	2,110.00	2,321,000	
日本無線	800	1,504.00	1,203,200	
パナソニック	144,100	1,074.00	154,763,400	
アンリツ	7,600	608.00	4,620,800	
富士通ゼネラル	4,000	2,353.00	9,412,000	
日立国際電気	2,900	1,940.00	5,626,000	
ソニー	89,100	3,325.00	296,257,500	
T D K	7,600	7,250.00	55,100,000	
帝国通信工業	3,000	160.00	480,000	
ミツミ電機	4,800	617.00	2,961,600	
タムラ製作所	5,000	428.00	2,140,000	
アルプス電気	10,900	2,569.00	28,002,100	
池上通信機	4,000	137.00	548,000	
パイオニア	20,500	257.00	5,268,500	
日本電波工業	1,200	853.00	1,023,600	
鈴木	500	528.00	264,000	
日本トリム	300	5,480.00	1,644,000	
ローランド ディー . ジー .	600	2,427.00	1,456,200	
フォスター電機	1,600	1,903.00	3,044,800	
クラリオン	7,000	328.00	2,296,000	
S M K	3,000	388.00	1,164,000	
ヨコオ	900	703.00	632,700	

ホシデン	3,800	726.00	2,758,800
ヒロセ電機	2,000	13,590.00	27,180,000
日本航空電子工業	4,000	1,732.00	6,928,000
TOA	1,500	949.00	1,423,500
日立マクセル	2,100	1,632.00	3,427,200
古野電気	1,500	778.00	1,167,000
ユニデンホールディングス	4,000	149.00	596,000
アルパイン	3,000	1,416.00	4,248,000
スミダコーポレーション	1,000	1,187.00	1,187,000
アイコム	700	1,909.00	1,336,300
リオン	500	1,511.00	755,500
本多通信工業	300	1,299.00	389,700
船井電機	1,300	827.00	1,075,100
横河電機	12,600	1,475.00	18,585,000
新電元工業	4,000	454.00	1,816,000
アズビル	4,100	3,070.00	12,587,000
東亜ディーケーケー	700	472.00	330,400
日本光電工業	5,300	2,559.00	13,562,700
チノー	400	1,050.00	420,000
共和電業	1,500	376.00	564,000
日本電子材料	500	531.00	265,500
堀場製作所	2,500	4,950.00	12,375,000
アドバンテスト	8,600	1,374.00	11,816,400
小野測器	600	920.00	552,000
エスベック	1,300	1,349.00	1,753,700
パナソニック デバイスSUNX	1,100	616.00	677,600
キーエンス	2,900	77,230.00	223,967,000
日置電機	700	2,008.00	1,405,600
シスメックス	9,800	7,320.00	71,736,000
日本マイクロニクス	2,300	1,169.00	2,688,700
メガチップス	1,300	1,922.00	2,498,600
OBARA GROUP	700	4,500.00	3,150,000
澤藤電機	1,000	210.00	210,000
コーセル	1,700	1,251.00	2,126,700
イリソ電子工業	400	5,720.00	2,288,000
新日本無線	1,000	339.00	339,000

オブテックス	900	2,635.00	2,371,500	
千代田インテグレ	700	2,145.00	1,501,500	
アイ・オー・データ機器	400	991.00	396,400	
レーザーテック	1,500	2,062.00	3,093,000	
スタンレー電気	9,000	2,887.00	25,983,000	
岩崎電気	5,000	157.00	785,000	
ウシオ電機	7,600	1,218.00	9,256,800	
岡谷電機産業	700	393.00	275,100	
ヘリオス テクノ ホールディング	1,100	417.00	458,700	
日本セラミック	1,000	1,912.00	1,912,000	
遠藤照明	600	827.00	496,200	
日本デジタル研究所	1,100	1,655.00	1,820,500	
古河電池	1,000	716.00	716,000	
双信電機	600	281.00	168,600	
山一電機	1,100	821.00	903,100	
図研	900	1,068.00	961,200	
日本電子	5,000	404.00	2,020,000	
カシオ計算機	12,600	1,504.00	18,950,400	
ファナック	12,800	19,720.00	252,416,000	
日本シイエムケイ	2,700	546.00	1,474,200	
エンプラス	600	3,180.00	1,908,000	
大真空	500	1,108.00	554,000	
ローム	6,100	5,440.00	33,184,000	
浜松ホトニクス	9,800	3,135.00	30,723,000	
三井ハイテック	1,800	701.00	1,261,800	
新光電気工業	4,700	635.00	2,984,500	
京セラ	20,700	5,157.00	106,749,900	
太陽誘電	6,100	1,095.00	6,679,500	
村田製作所	13,300	14,445.00	192,118,500	
ユーシン	1,700	745.00	1,266,500	
双葉電子工業	2,100	1,711.00	3,593,100	
北陸電気工業	5,000	130.00	650,000	
ニチコン	3,900	889.00	3,467,100	
日本ケミコン	10,000	177.00	1,770,000	
K O A	1,800	980.00	1,764,000	
市光工業	3,000	308.00	924,000	

小糸製作所	7,500	5,340.00	40,050,000	
ミツバ	2,100	1,498.00	3,145,800	
S C R E E Nホールディングス	2,600	6,610.00	17,186,000	
キャノン電子	1,100	1,638.00	1,801,800	
キャノン	67,900	3,053.00	207,298,700	代用有価証券 10,000株
リコー	40,800	916.00	37,372,800	
M U T O Hホールディングス	1,000	239.00	239,000	
東京エレクトロン	10,300	9,031.00	93,019,300	
トヨタ紡織	4,400	2,473.00	10,881,200	
芦森工業	3,000	166.00	498,000	
ユニプレス	2,600	1,944.00	5,054,400	
豊田自動織機	11,500	4,930.00	56,695,000	
モリタホールディングス	2,200	1,485.00	3,267,000	
三櫻工業	1,600	684.00	1,094,400	
デンソー	28,000	4,400.00	123,200,000	
東海理化電機製作所	3,700	2,106.00	7,792,200	
三井造船	49,000	147.00	7,203,000	
川崎重工業	98,000	302.00	29,596,000	
名村造船所	3,800	703.00	2,671,400	
サノヤスホールディングス	1,600	282.00	451,200	
日本車輛製造	5,000	276.00	1,380,000	
ニチユ三菱フォークリフト	1,500	631.00	946,500	
近畿車輛	200	2,356.00	471,200	
日産自動車	172,000	1,036.00	178,192,000	
いすゞ自動車	36,600	1,276.50	46,719,900	
トヨタ自動車	160,800	6,025.00	968,820,000	代用有価証券 35,000株
日野自動車	18,000	1,166.00	20,988,000	
三菱自動車工業	50,100	575.00	28,807,500	
エフテック	700	1,331.00	931,700	
レシップホールディングス	400	895.00	358,000	
G M B	200	1,012.00	202,400	
ファルテック	200	1,245.00	249,000	
武蔵精密工業	1,300	2,517.00	3,272,100	
日産車体	6,100	1,043.00	6,362,300	
新明和工業	6,000	736.00	4,416,000	

極東開発工業	2,500	1,219.00	3,047,500	
日信工業	2,800	1,645.00	4,606,000	
トピー工業	1,000	2,301.00	2,301,000	
ティラド	5,000	235.00	1,175,000	
曙ブレーキ工業	6,500	198.00	1,287,000	
タチエス	2,000	1,686.00	3,372,000	
NOK	6,100	2,324.00	14,176,400	
フタバ産業	3,900	533.00	2,078,700	
KYB	14,000	469.00	6,566,000	
大同メタル工業	1,800	1,105.00	1,989,000	
プレス工業	6,700	495.00	3,316,500	
ミクニ	1,600	346.00	553,600	
カルソニックカンセイ	10,000	1,034.00	10,340,000	
太平洋工業	2,800	1,240.00	3,472,000	
ケーヒン	2,900	1,648.00	4,779,200	
河西工業	1,600	1,160.00	1,856,000	
アイシン精機	12,900	4,680.00	60,372,000	
富士機工	1,500	397.00	595,500	
マツダ	39,900	1,710.00	68,229,000	
今仙電機製作所	1,200	927.00	1,112,400	
本田技研工業	113,500	3,144.00	356,844,000	
スズキ	23,100	3,693.00	85,308,300	
富士重工業	39,200	4,024.00	157,740,800	
安永	500	528.00	264,000	
ヤマハ発動機	17,800	2,268.00	40,370,400	
ショーワ	3,300	565.00	1,864,500	
TBK	1,500	440.00	660,000	
エクセディ	1,700	2,769.00	4,707,300	
豊田合成	4,600	2,500.00	11,500,000	
愛三工業	2,200	858.00	1,887,600	
盟和産業	200	1,072.00	214,400	
ヨロズ	1,200	1,622.00	1,946,400	
エフ・シー・シー	2,100	2,252.00	4,729,200	
シマノ	5,100	17,850.00	91,035,000	
タカタ	2,300	365.00	839,500	
テイ・エス テック	2,900	2,857.00	8,285,300	

ジャムコ	700	2,181.00	1,526,700
テルモ	19,300	4,075.00	78,647,500
クリエートメディック	400	948.00	379,200
日機装	4,500	917.00	4,126,500
島津製作所	16,000	1,531.00	24,496,000
JMS	2,000	272.00	544,000
長野計器	800	640.00	512,000
ブイ・テクノロジー	300	12,670.00	3,801,000
東京計器	4,000	178.00	712,000
愛知時計電機	200	3,165.00	633,000
オーバル	1,300	252.00	327,600
東京精密	2,400	2,775.00	6,660,000
マニー	1,700	2,421.00	4,115,700
ニコン	23,600	1,566.00	36,957,600
トプコン	4,200	1,501.00	6,304,200
オリンパス	18,800	3,780.00	71,064,000
理研計器	1,000	1,328.00	1,328,000
タムロン	1,100	1,789.00	1,967,900
H O Y A	28,000	4,364.00	122,192,000
ノーリツ鋼機	1,200	800.00	960,000
エー・アンド・デイ	1,200	441.00	529,200
シチズン時計	15,500	585.00	9,067,500
リズム時計工業	6,000	182.00	1,092,000
大研医器	1,000	769.00	769,000
メニコン	900	2,959.00	2,663,100
松風	600	1,420.00	852,000
セイコーホールディングス	8,000	333.00	2,664,000
ニプロ	9,400	1,304.00	12,257,600
スノーピーク	200	3,525.00	705,000
パラマウントベッドホールディングス	1,300	4,000.00	5,200,000
トランザクション	300	1,908.00	572,400
S H O - B I	500	419.00	209,500
ニホンフラッシュ	500	1,240.00	620,000
前田工織	1,300	1,133.00	1,472,900
永大産業	2,000	448.00	896,000
アートネイチャー	1,400	643.00	900,200

ダンロップスポーツ	800	1,028.00	822,400
バンダイナムコホールディングス	13,000	3,200.00	41,600,000
アイフィスジャパン	300	438.00	131,400
共立印刷	2,200	307.00	675,400
S H O E I	600	1,860.00	1,116,000
フランスベッドホールディングス	1,800	880.00	1,584,000
パイロットコーポレーション	2,200	4,645.00	10,219,000
萩原工業	400	2,460.00	984,000
トッパン・フォームズ	2,200	1,083.00	2,382,600
フジシールインターナショナル	1,500	4,350.00	6,525,000
タカラトミー	4,200	1,160.00	4,872,000
廣済堂	1,200	309.00	370,800
A s - m e エステール	400	653.00	261,200
アーク	5,600	78.00	436,800
タカノ	600	760.00	456,000
プロネクサス	1,200	1,110.00	1,332,000
ホクシン	1,100	205.00	225,500
ウッドワン	2,000	245.00	490,000
大建工業	1,000	2,221.00	2,221,000
凸版印刷	35,000	993.00	34,755,000
大日本印刷	36,000	1,059.00	38,124,000
図書印刷	2,000	466.00	932,000
共同印刷	4,000	346.00	1,384,000
日本写真印刷	2,100	2,478.00	5,203,800
光村印刷	1,000	212.00	212,000
宝印刷	600	1,469.00	881,400
アシックス	12,600	2,199.00	27,707,400
ツツミ	700	1,614.00	1,129,800
小松ウオール工業	500	1,720.00	860,000
ヤマハ	9,300	3,680.00	34,224,000
河合楽器製作所	500	2,042.00	1,021,000
クリナップ	1,500	895.00	1,342,500
ピジョン	7,100	3,035.00	21,548,500
兼松サステック	2,000	165.00	330,000
キングジム	1,100	849.00	933,900
リンテック	3,000	2,279.00	6,837,000

T A S A K I	400	1,500.00	600,000	
イトーキ	2,700	668.00	1,803,600	
任天堂	7,800	24,520.00	191,256,000	
三菱鉛筆	1,000	5,520.00	5,520,000	
タカラスタANDARD	2,500	1,960.00	4,900,000	
コクヨ	6,500	1,499.00	9,743,500	
ナカバヤシ	3,000	235.00	705,000	
岡村製作所	4,400	1,061.00	4,668,400	
美津濃	7,000	555.00	3,885,000	
アデランス	2,200	619.00	1,361,800	
東京電力ホールディングス	107,000	410.00	43,870,000	
中部電力	38,600	1,529.50	59,038,700	
関西電力	51,500	969.00	49,903,500	
中国電力	17,400	1,248.00	21,715,200	
北陸電力	12,400	1,244.00	15,425,600	
東北電力	31,500	1,312.00	41,328,000	
四国電力	11,400	984.00	11,217,600	
九州電力	27,900	953.00	26,588,700	
北海道電力	11,800	868.00	10,242,400	
沖縄電力	2,000	2,257.00	4,514,000	
電源開発	10,800	2,498.00	26,978,400	
エフオン	500	719.00	359,500	
イーレックス	400	3,400.00	1,360,000	
東京瓦斯	135,000	489.20	66,042,000	
大阪瓦斯	130,000	447.70	58,201,000	
東邦瓦斯	32,000	988.00	31,616,000	
北海道瓦斯	3,000	274.00	822,000	
広島ガス	2,200	366.00	805,200	
西部瓦斯	14,000	251.00	3,514,000	
静岡ガス	3,900	830.00	3,237,000	
メタウォーター	800	2,903.00	2,322,400	
S B S ホールディングス	1,300	906.00	1,177,800	
東武鉄道	67,000	524.00	35,108,000	
相鉄ホールディングス	22,000	510.00	11,220,000	
東京急行電鉄	73,000	789.00	57,597,000	
京浜急行電鉄	35,000	1,051.00	36,785,000	

小田急電鉄	20,200	2,259.00	45,631,800	
京王電鉄	35,000	887.00	31,045,000	
京成電鉄	9,500	2,603.00	24,728,500	
富士急行	3,000	1,184.00	3,552,000	
東日本旅客鉄道	22,900	9,407.00	215,420,300	
西日本旅客鉄道	12,100	6,529.00	79,000,900	
東海旅客鉄道	11,300	17,520.00	197,976,000	
西武ホールディングス	13,400	1,837.00	24,615,800	
鴻池運輸	1,800	1,393.00	2,507,400	
西日本鉄道	16,000	498.00	7,968,000	
ハマキョウレックス	1,000	1,989.00	1,989,000	
サカイ引越センター	500	2,231.00	1,115,500	
近鉄グループホールディングス	127,000	427.00	54,229,000	
阪急阪神ホールディングス	16,900	3,490.00	58,981,000	
南海電気鉄道	28,000	491.00	13,748,000	
京阪ホールディングス	28,000	701.00	19,628,000	
神戸電鉄	3,000	371.00	1,113,000	
名古屋鉄道	46,000	552.00	25,392,000	
山陽電気鉄道	5,000	519.00	2,595,000	
日本通運	49,000	500.00	24,500,000	
ヤマトホールディングス	22,500	2,367.00	53,257,500	
山九	16,000	600.00	9,600,000	
丸運	600	245.00	147,000	
丸全昭和運輸	4,000	422.00	1,688,000	
センコー	5,700	727.00	4,143,900	
トナミホールディングス	3,000	278.00	834,000	
ニッコンホールディングス	4,000	2,277.00	9,108,000	
日本石油輸送	100	2,253.00	225,300	
福山通運	8,000	590.00	4,720,000	
セイノーホールディングス	8,900	1,138.00	10,128,200	
神奈川中央交通	1,000	745.00	745,000	
日立物流	2,600	2,071.00	5,384,600	
丸和運輸機関	400	2,500.00	1,000,000	
C & F ロジホールディングス	1,200	1,053.00	1,263,600	
日本郵船	113,000	203.00	22,939,000	
商船三井	61,000	250.00	15,250,000	

川崎汽船	55,000	264.00	14,520,000
N S ユナイテッド海運	6,000	147.00	882,000
明治海運	1,200	358.00	429,600
飯野海運	6,500	398.00	2,587,000
共栄タンカー	1,000	197.00	197,000
乾汽船	1,000	985.00	985,000
日本航空	24,200	3,099.00	74,995,800
A N A ホールディングス	234,000	283.50	66,339,000
パスコ	1,000	372.00	372,000
トランコム	400	6,090.00	2,436,000
日新	5,000	347.00	1,735,000
三菱倉庫	9,000	1,453.00	13,077,000
三井倉庫ホールディングス	7,000	322.00	2,254,000
住友倉庫	9,000	557.00	5,013,000
澁澤倉庫	3,000	300.00	900,000
東陽倉庫	2,200	270.00	594,000
日本トランスシティ	3,000	376.00	1,128,000
ケイヒン	3,000	140.00	420,000
中央倉庫	700	1,000.00	700,000
安田倉庫	1,000	680.00	680,000
東洋埠頭	4,000	173.00	692,000
宇徳	1,100	339.00	372,900
上組	15,000	880.00	13,200,000
サンリツ	300	489.00	146,700
キムラユニティー	300	1,063.00	318,900
キューソー流通システム	400	2,310.00	924,000
郵船ロジスティクス	1,200	1,102.00	1,322,400
近鉄エクスプレス	2,300	1,394.00	3,206,200
東海運	800	369.00	295,200
エーアイティー	800	917.00	733,600
内外トランスライン	400	993.00	397,200
N E C ネットズエスアイ	1,600	1,841.00	2,945,600
システナ	1,200	1,889.00	2,266,800
デジタルアーツ	600	2,668.00	1,600,800
新日鉄住金ソリューションズ	2,100	1,967.00	4,130,700
キューブシステム	600	649.00	389,400

コア	600	1,234.00	740,400
ソフトクリエイトホールディングス	600	1,173.00	703,800
T I S	4,100	2,753.00	11,287,300
ネオス	400	479.00	191,600
電算システム	500	1,705.00	852,500
グリー	7,600	578.00	4,392,800
コーエーテクモホールディングス	2,900	1,975.00	5,727,500
三菱総合研究所	500	3,260.00	1,630,000
ボルテージ	200	1,040.00	208,000
電算	100	2,041.00	204,100
A G S	300	1,182.00	354,600
ファインデックス	900	1,383.00	1,244,700
ヒト・コミュニケーションズ	300	1,569.00	470,700
ブレインパッド	200	1,020.00	204,000
K L a b	2,400	628.00	1,507,200
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	800	890.00	712,000
イーブックイニシアティブジャパン	200	918.00	183,600
ネクソン	13,700	1,719.00	23,550,300
アイスタイル	1,900	809.00	1,537,100
エムアップ	400	604.00	241,600
エイチーム	700	2,280.00	1,596,000
テクノスジャパン	400	2,335.00	934,000
e n i s h	400	490.00	196,000
コロブラ	3,500	1,549.00	5,421,500
モバイルクリエイト	900	377.00	339,300
ブロードリーフ	1,500	1,116.00	1,674,000
ハーツユニテッドグループ	800	2,035.00	1,628,000
メディアドゥ	300	1,451.00	435,300
ブイキューブ	700	824.00	576,800
サイバーリンクス	200	915.00	183,000
ディー・エル・イー	400	680.00	272,000
VOYAGE GROUP	400	1,097.00	438,800
オブティム	100	5,920.00	592,000
ベリサーブ	100	3,380.00	338,000
ティーガイア	1,200	1,604.00	1,924,800

日本アジアグループ	1,500	381.00	571,500	
豆蔵ホールディングス	1,000	1,131.00	1,131,000	
テクマトリックス	500	2,185.00	1,092,500	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	29,100	260.00	7,566,000	
GMOペイメントゲートウェイ	1,000	5,020.00	5,020,000	
ザップラス	800	371.00	296,800	
インターネットイニシアティブ	2,000	1,868.00	3,736,000	
さくらインターネット	800	994.00	795,200	
GMOクラウド	300	1,055.00	316,500	
SRAホールディングス	700	2,517.00	1,761,900	
Minorityソリューションズ	300	946.00	283,800	
システムインテグレータ	200	587.00	117,400	
朝日ネット	1,200	434.00	520,800	
フリービット	700	876.00	613,200	
コムチュア	200	3,825.00	765,000	
サイバーコム	200	909.00	181,800	
gumi	1,300	759.00	986,700	
パイブドHD	200	1,203.00	240,600	
LINE	2,100	4,795.00	10,069,500	
ソルクシーズ	400	543.00	217,200	
フェイス	300	1,184.00	355,200	
ハイマックス	100	1,206.00	120,600	
野村総合研究所	8,400	3,755.00	31,542,000	
サイバネットシステム	1,000	712.00	712,000	
CEホールディングス	200	1,030.00	206,000	
インテージホールディングス	700	1,897.00	1,327,900	
東邦システムサイエンス	400	619.00	247,600	
ソースネクスト	700	536.00	375,200	
ティー・ワイ・オー	2,600	149.00	387,400	
フォーカスシステムズ	500	516.00	258,000	
クレスコ	300	2,250.00	675,000	
フジ・メディア・ホールディングス	13,000	1,461.00	18,993,000	
オービック	4,300	5,550.00	23,865,000	
ジャストシステム	2,300	1,015.00	2,334,500	
TDCソフトウェアエンジニアリング	600	1,248.00	748,800	
ヤフー	89,200	417.00	37,196,400	

トレンドマイクロ	6,600	3,685.00	24,321,000
インフォメーション・ディベロプメント	200	1,036.00	207,200
日本オラクル	2,000	5,650.00	11,300,000
アルファシステムズ	400	1,750.00	700,000
フューチャー	1,700	772.00	1,312,400
C A C Holdings	900	891.00	801,900
ソフトバンク・テクノロジー	300	3,825.00	1,147,500
トーセ	400	823.00	329,200
オービックビジネスコンサルタント	600	4,995.00	2,997,000
伊藤忠テクノソリューションズ	2,800	2,665.00	7,462,000
アイティフォー	1,600	671.00	1,073,600
東計電算	200	2,048.00	409,600
エクスネット	100	1,576.00	157,600
大塚商会	3,300	5,130.00	16,929,000
サイボウズ	1,700	449.00	763,300
ソフトブレーン	1,700	371.00	630,700
電通国際情報サービス	800	2,008.00	1,606,400
デジタルガレージ	2,000	1,926.00	3,852,000
E Mシステムズ	400	1,648.00	659,200
ウェザーニューズ	400	3,245.00	1,298,000
C I J	1,200	502.00	602,400
東洋ビジネスエンジニアリング	100	1,455.00	145,500
日本エンタープライズ	1,300	287.00	373,100
WOWOW	600	2,887.00	1,732,200
フュージョンパートナー	800	999.00	799,200
日本コロムビア	500	611.00	305,500
イマジカ・ロボットホールディングス	1,100	658.00	723,800
ネットワンシステムズ	5,400	728.00	3,931,200
アルゴグラフィックス	600	2,048.00	1,228,800
マーベラス	2,100	799.00	1,677,900
エイベックス・グループ・ホールディングス	2,300	1,410.00	3,243,000
日本ユニシス	3,400	1,288.00	4,379,200
兼松エレクトロニクス	800	2,035.00	1,628,000
東京放送ホールディングス	7,500	1,694.00	12,705,000
日本テレビホールディングス	11,400	1,896.00	21,614,400
朝日放送	1,200	689.00	826,800

テレビ朝日ホールディングス	3,400	1,977.00	6,721,800
スカパーJ S A Tホールディングス	9,400	516.00	4,850,400
テレビ東京ホールディングス	1,100	2,443.00	2,687,300
日本BS放送	300	982.00	294,600
U-NEXT	300	647.00	194,100
ワイヤレスゲート	400	1,799.00	719,600
コネクシオ	1,100	1,390.00	1,529,000
日本通信	9,300	178.00	1,655,400
クロップス	300	532.00	159,600
日本電信電話	96,200	4,725.00	454,545,000
KDDI	123,200	3,111.00	383,275,200
光通信	1,500	9,470.00	14,205,000
NTTドコモ	93,000	2,600.50	241,846,500
エムティーアイ	1,900	673.00	1,278,700
GMOインターネット	4,600	1,411.00	6,490,600
カドカワ	3,900	1,540.00	6,006,000
学研ホールディングス	4,000	346.00	1,384,000
ゼンリン	1,700	1,872.00	3,182,400
昭文社	700	622.00	435,400
インプレスホールディングス	1,100	139.00	152,900
アイネット	700	1,036.00	725,200
松竹	8,000	1,180.00	9,440,000
東宝	8,900	3,175.00	28,257,500
東映	5,000	846.00	4,230,000
AOI Pro.	600	826.00	495,600
エヌ・ティ・ティ・データ	7,700	5,420.00	41,734,000
ピー・シー・エー	200	1,232.00	246,400
ビジネスブレイン太田昭和	200	976.00	195,200
DTS	1,400	2,313.00	3,238,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,300	3,540.00	18,762,000
シーイーシー	800	2,041.00	1,632,800
カブコン	3,200	2,406.00	7,699,200
アイ・エス・ビー	200	884.00	176,800
ジャステック	800	1,103.00	882,400
SCSK	3,000	4,135.00	12,405,000
日本システムウエア	500	1,672.00	836,000

アイネス	1,600	1,200.00	1,920,000
T K C	1,100	3,060.00	3,366,000
富士ソフト	1,900	2,811.00	5,340,900
N S D	2,600	1,611.00	4,188,600
コナミホールディングス	5,600	4,175.00	23,380,000
福井コンピュータホールディングス	400	2,797.00	1,118,800
J B C Cホールディングス	1,100	681.00	749,100
ミロク情報サービス	900	2,142.00	1,927,800
ソフトバンクグループ	70,600	6,585.00	464,901,000
ハウスイ	1,000	109.00	109,000
高千穂交易	500	930.00	465,000
伊藤忠食品	300	4,150.00	1,245,000
エレマテック	600	1,995.00	1,197,000
J A L U X	400	1,844.00	737,600
あらた	600	2,400.00	1,440,000
トーメンデバイス	200	2,050.00	410,000
東京エレクトロン デバイス	400	1,515.00	606,000
フィールズ	1,100	1,275.00	1,402,500
双日	78,400	274.00	21,481,600
アルフレッサ ホールディングス	15,600	2,192.00	34,195,200
横浜冷凍	3,100	1,068.00	3,310,800
神栄	2,000	144.00	288,000
山下医科器械	100	1,691.00	169,100
ラサ商事	600	589.00	353,400
ラクーン	600	532.00	319,200
アルコニックス	700	1,391.00	973,700
神戸物産	700	3,585.00	2,509,500
あい ホールディングス	2,200	2,555.00	5,621,000
ディーブイエックス	400	1,395.00	558,000
ダイワボウホールディングス	11,000	250.00	2,750,000
マクニカ・富士エレホールディングス	2,200	1,238.00	2,723,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,200	1,143.00	2,514,600
八洲電機	1,000	580.00	580,000
U K Cホールディングス	800	1,768.00	1,414,400
O C H Iホールディングス	400	1,099.00	439,600
T O K A Iホールディングス	5,500	681.00	3,745,500

大阪工機	100	702.00	70,200	
三洋貿易	700	1,319.00	923,300	
ビューティガレージ	100	1,150.00	115,000	
ウイン・パートナーズ	500	1,752.00	876,000	
ミタチ産業	300	613.00	183,900	
シップヘルスケアホールディングス	2,500	3,040.00	7,600,000	
明治電機工業	400	1,060.00	424,000	
デリカフーズ	300	966.00	289,800	
スターティア	300	528.00	158,400	
コメダホールディングス	1,700	1,698.00	2,886,600	
富士興産	500	427.00	213,500	
協栄産業	2,000	138.00	276,000	
小野建	1,100	1,299.00	1,428,900	
佐島電機	1,000	743.00	743,000	
エコートレーディング	300	645.00	193,500	
伯東	900	952.00	856,800	
コンドーテック	1,000	797.00	797,000	
中山福	800	812.00	649,600	
ナガイレーベン	1,800	2,255.00	4,059,000	
三菱食品	1,400	3,440.00	4,816,000	
松田産業	900	1,480.00	1,332,000	
第一興商	2,200	4,470.00	9,834,000	
メディバルホールディングス	12,500	1,781.00	22,262,500	
S P K	300	2,156.00	646,800	
萩原電気	400	1,980.00	792,000	
アズワン	1,000	4,610.00	4,610,000	
スズデン	400	984.00	393,600	
シモジマ	900	1,052.00	946,800	
ドウシシャ	1,500	2,169.00	3,253,500	
小津産業	300	2,033.00	609,900	
高速	700	1,046.00	732,200	
たけびし	500	1,074.00	537,000	
黒田電気	2,300	1,979.00	4,551,700	
リックス	300	1,281.00	384,300	
丸文	1,100	598.00	657,800	
ハビネット	1,200	1,102.00	1,322,400	

橋本総業ホールディングス	300	1,597.00	479,100
日本ライフライン	600	5,610.00	3,366,000
エクセル	600	1,356.00	813,600
マルカキカイ	400	1,318.00	527,200
I D O M	3,400	510.00	1,734,000
日本エム・ディ・エム	1,100	783.00	861,300
進和	800	1,596.00	1,276,800
エスケイジャパン	400	310.00	124,000
ダイトエレクトロン	600	805.00	483,000
シークス	900	4,080.00	3,672,000
田中商事	400	688.00	275,200
オーハシテクニカ	700	1,372.00	960,400
白銅	400	1,218.00	487,200
伊藤忠商事	97,700	1,285.00	125,544,500
丸紅	122,500	549.80	67,350,500
高島	2,000	168.00	336,000
長瀬産業	7,400	1,343.00	9,938,200
蝶理	800	1,646.00	1,316,800
豊田通商	13,900	2,449.00	34,041,100
三共生興	1,800	350.00	630,000
兼松	26,000	173.00	4,498,000
ツカモトコーポレーション	3,000	116.00	348,000
三井物産	112,600	1,451.00	163,382,600
日本紙パルプ商事	7,000	352.00	2,464,000
日立ハイテクノロジーズ	4,300	4,200.00	18,060,000
カメイ	1,600	974.00	1,558,400
東都水産	200	1,655.00	331,000
O U Gホールディングス	2,000	266.00	532,000
スターゼン	400	5,570.00	2,228,000
山善	4,800	828.00	3,974,400
椿本興業	1,000	306.00	306,000
住友商事	78,300	1,201.00	94,038,300
内田洋行	3,000	436.00	1,308,000
三菱商事	93,500	2,362.00	220,847,000
第一実業	3,000	569.00	1,707,000
キヤノンマーケティングジャパン	3,600	1,803.00	6,490,800

西華産業	4,000	290.00	1,160,000	
佐藤商事	1,100	785.00	863,500	
菱洋エレクトロ	1,400	1,299.00	1,818,600	
東京産業	1,300	397.00	516,100	
ユアサ商事	1,200	2,504.00	3,004,800	
神鋼商事	300	1,828.00	548,400	
小林産業	900	261.00	234,900	
阪和興業	12,000	647.00	7,764,000	
カナデン	1,200	1,024.00	1,228,800	
菱電商事	2,000	664.00	1,328,000	
フルサト工業	700	1,495.00	1,046,500	
岩谷産業	15,000	624.00	9,360,000	
すてきナイスグループ	6,000	141.00	846,000	
昭光通商	5,000	85.00	425,000	
二チモウ	2,000	162.00	324,000	
極東貿易	2,000	203.00	406,000	
イワキ	2,000	209.00	418,000	
三愛石油	3,000	747.00	2,241,000	
稲畑産業	3,000	1,127.00	3,381,000	
G S Iクレオス	4,000	118.00	472,000	
明和産業	1,200	325.00	390,000	
ワキタ	2,600	883.00	2,295,800	
東邦ホールディングス	4,000	2,197.00	8,788,000	
サンゲツ	4,300	2,033.00	8,741,900	
ミツウロコグループホールディングス	2,000	693.00	1,386,000	
シナネンホールディングス	500	2,049.00	1,024,500	
伊藤忠エネクス	3,200	820.00	2,624,000	
サンリオ	3,900	1,999.00	7,796,100	
サンワテクノス	800	797.00	637,600	
リョーサン	2,000	3,145.00	6,290,000	
新光商事	1,500	1,065.00	1,597,500	
トーヨー	600	2,472.00	1,483,200	
三信電気	1,700	859.00	1,460,300	
東陽テクニカ	1,700	1,070.00	1,819,000	
モスフードサービス	1,600	3,490.00	5,584,000	
加賀電子	1,100	1,436.00	1,579,600	

ソーダニッカ	1,300	494.00	642,200
立花エレテック	900	1,114.00	1,002,600
フォーバル	700	721.00	504,700
PALTAC	2,000	2,409.00	4,818,000
三谷産業	1,400	342.00	478,800
太平洋興発	5,000	90.00	450,000
ヤマタネ	600	1,383.00	829,800
丸紅建材リース	1,000	192.00	192,000
日鉄住金物産	1,100	3,830.00	4,213,000
トラスコ中山	1,400	5,440.00	7,616,000
オートバックスセブン	4,600	1,517.00	6,978,200
加藤産業	1,900	2,539.00	4,824,100
イノテック	1,200	483.00	579,600
イエローハット	1,200	2,228.00	2,673,600
JKホールディングス	1,300	545.00	708,500
日伝	500	3,000.00	1,500,000
北沢産業	1,100	175.00	192,500
杉本商事	700	1,275.00	892,500
因幡電機産業	1,700	3,875.00	6,587,500
パイテックホールディングス	500	1,066.00	533,000
ミスミグループ本社	14,000	1,954.00	27,356,000
アルテック	1,200	141.00	169,200
タキヒヨー	2,000	433.00	866,000
蔵王産業	200	1,333.00	266,600
スズケン	5,700	3,355.00	19,123,500
ジェコス	900	987.00	888,300
ルネサスイーストン	1,100	449.00	493,900
ローソン	4,700	7,940.00	37,318,000
サンエー	800	5,830.00	4,664,000
カワチ薬品	1,000	2,504.00	2,504,000
エービーシー・マート	1,600	6,520.00	10,432,000
ハードオフコーポレーション	600	1,148.00	688,800
アスクル	1,500	4,425.00	6,637,500
ゲオホールディングス	2,100	1,316.00	2,763,600
アダストリア	2,300	2,674.00	6,150,200
ジーフット	800	762.00	609,600

シー・ヴィ・エス・バイエリア	200	783.00	156,600	
くらコーポレーション	800	5,190.00	4,152,000	
キャンドウ	700	1,827.00	1,278,900	
パルグループホールディングス	700	2,593.00	1,815,100	
エディオ	5,300	924.00	4,897,200	
サーラコーポレーション	1,300	624.00	811,200	
ワッツ	600	1,108.00	664,800	
ハローズ	400	2,390.00	956,000	
あみやき亭	300	3,765.00	1,129,500	
ひらまつ	1,800	601.00	1,081,800	
ゲンキー	300	5,940.00	1,782,000	
大黒天物産	300	4,920.00	1,476,000	
ハニーズ	1,100	1,242.00	1,366,200	
ファーマライズホールディングス	300	547.00	164,100	
アルペン	1,100	1,928.00	2,120,800	
クオール	1,300	1,619.00	2,104,700	
ジェイアイエヌ	800	5,580.00	4,464,000	
ビックカメラ	7,200	895.00	6,444,000	
D C Mホールディングス	6,100	927.00	5,654,700	
Monotaro	4,400	2,749.00	12,095,600	
東京一番フーズ	400	555.00	222,000	
ダイヤモンドダイニング	300	1,095.00	328,500	
きちり	400	692.00	276,800	
アークランドサービスホールディングス	400	3,095.00	1,238,000	
J.フロント リテイリング	15,700	1,431.00	22,466,700	
ドトール・日レスホールディングス	2,200	2,107.00	4,635,400	
マツモトキヨシホールディングス	2,600	5,480.00	14,248,000	
ブロンコピリー	600	3,135.00	1,881,000	
スタートトゥデイ	11,400	1,848.00	21,067,200	
トレジャー・ファクトリー	400	830.00	332,000	
物語コーポレーション	300	4,830.00	1,449,000	
ココカラファイン	1,300	4,060.00	5,278,000	
三越伊勢丹ホールディングス	24,800	1,111.00	27,552,800	
Hamee	100	2,029.00	202,900	
ウエルシアホールディングス	1,100	7,300.00	8,030,000	
クリエイトSDホールディングス	1,800	2,168.00	3,902,400	

丸善C H Iホールディングス	1,500	368.00	552,000	
ミサワ	300	457.00	137,100	
エー・ピーカンパニー	200	701.00	140,200	
チムニー	400	2,963.00	1,185,200	
シュッピン	500	1,122.00	561,000	
ネクステージ	300	1,687.00	506,100	
ジョイフル本田	2,000	2,820.00	5,640,000	
鳥貴族	300	2,858.00	857,400	
キリン堂ホールディングス	400	784.00	313,600	
ホットランド	600	1,023.00	613,800	
すかいらく	5,400	1,487.00	8,029,800	
綿半ホールディングス	500	1,744.00	872,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,100	956.00	3,919,600	
ブックオフコーポレーション	800	814.00	651,200	
ゴルフダイジェスト・オンライン	500	839.00	419,500	
あさひ	900	1,277.00	1,149,300	
日本調剤	300	4,625.00	1,387,500	
コスモス薬品	600	23,000.00	13,800,000	
トーエル	600	930.00	558,000	
一六堂	400	352.00	140,800	
オンリー	100	798.00	79,800	
セブン&アイ・ホールディングス	52,100	4,493.00	234,085,300	
薬王堂	200	7,170.00	1,434,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	3,400	1,002.00	3,406,800	
ツルハホールディングス	2,900	11,990.00	34,771,000	
サンマルクホールディングス	1,000	2,895.00	2,895,000	
フェリシモ	400	1,010.00	404,000	
トリドールホールディングス	1,500	2,694.00	4,041,000	
クスリのアオキ	1,100	5,100.00	5,610,000	
サツドラホールディングス	200	1,998.00	399,600	
ダイユー・リックホールディングス	400	650.00	260,000	
メディカルシステムネットワーク	1,400	457.00	639,800	
総合メディカル	600	3,230.00	1,938,000	
はるやま商事	500	815.00	407,500	
ノジマ	1,500	1,304.00	1,956,000	

カップ・クリエイト	1,700	1,250.00	2,125,000
ライトオン	900	1,006.00	905,400
ジーンズメイト	500	175.00	87,500
良品計画	1,400	22,840.00	31,976,000
三城ホールディングス	1,500	440.00	660,000
アドヴァン	1,300	963.00	1,251,900
アルビス	300	2,217.00	665,100
コナカ	1,600	494.00	790,400
ハウス オブ ローゼ	200	1,465.00	293,000
G - 7ホールディングス	400	1,374.00	549,600
イオン北海道	900	549.00	494,100
コジマ	1,900	234.00	444,600
ヒマラヤ	400	804.00	321,600
コーナン商事	1,800	2,089.00	3,760,200
エコス	500	1,237.00	618,500
マルシェ	400	824.00	329,600
ドンキホーテホールディングス	8,000	4,065.00	32,520,000
西松屋チェーン	2,500	1,487.00	3,717,500
ゼンショーホールディングス	6,400	1,942.00	12,428,800
幸楽苑ホールディングス	800	1,562.00	1,249,600
ハークスレイ	400	954.00	381,600
サイゼリヤ	2,100	2,804.00	5,888,400
V Tホールディングス	4,200	566.00	2,377,200
魚力	400	1,300.00	520,000
ポプラ	400	507.00	202,800
ユナイテッドアローズ	1,800	2,722.00	4,899,600
ハイデイ日高	1,100	2,618.00	2,879,800
京都きもの友禅	900	929.00	836,100
コロワイド	4,100	2,070.00	8,487,000
ピーシーデボコーポレーション	1,600	523.00	836,800
壱番屋	1,100	3,985.00	4,383,500
トップカルチャー	500	475.00	237,500
P L A N T	300	1,188.00	356,400
スギホールディングス	2,200	5,760.00	12,672,000
スクロール	1,900	386.00	733,400
ヨンドシーホールディングス	1,000	2,632.00	2,632,000

ユニー・ファミリーマートホールディングス	5,500	6,550.00	36,025,000	
木曽路	1,500	2,348.00	3,522,000	
サトレストランシシステムズ	1,500	823.00	1,234,500	
千趣会	2,300	733.00	1,685,900	
タカキュー	1,100	185.00	203,500	
ケーヨー	2,100	530.00	1,113,000	
上新電機	3,000	879.00	2,637,000	
日本瓦斯	1,900	3,250.00	6,175,000	
ベスト電器	4,100	137.00	561,700	
ロイヤルホールディングス	2,100	1,842.00	3,868,200	
東天紅	1,000	141.00	141,000	
いなげや	1,400	1,421.00	1,989,400	
島忠	3,200	2,781.00	8,899,200	
チヨダ	1,500	2,497.00	3,745,500	
ライフコーポレーション	800	3,540.00	2,832,000	
リンガーハット	1,100	2,664.00	2,930,400	
さが美	1,000	116.00	116,000	
MrMax	1,100	376.00	413,600	
テンアライド	1,200	375.00	450,000	
AOKIホールディングス	2,800	1,265.00	3,542,000	
オークワ	2,000	1,087.00	2,174,000	
コメリ	1,900	2,526.00	4,799,400	
青山商事	2,400	3,695.00	8,868,000	
しまむら	1,500	13,590.00	20,385,000	
はせがわ	600	444.00	266,400	
高島屋	18,000	866.00	15,588,000	
松屋	2,500	822.00	2,055,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	6,400	1,554.00	9,945,600	
近鉄百貨店	5,000	348.00	1,740,000	
丸栄	3,000	81.00	243,000	
パルコ	1,200	966.00	1,159,200	
丸井グループ	15,300	1,456.00	22,276,800	
アクシアル リテイリング	1,000	3,775.00	3,775,000	
イオン	51,200	1,482.50	75,904,000	
イズミ	2,500	4,895.00	12,237,500	
東武ストア	200	2,840.00	568,000	

平和堂	2,500	2,158.00	5,395,000
フジ	1,400	2,230.00	3,122,000
ヤオコー	1,400	4,415.00	6,181,000
ゼビオホールディングス	1,700	1,612.00	2,740,400
ケーズホールディングス	5,300	1,825.00	9,672,500
O l y m p i cグループ	800	570.00	456,000
日産東京販売ホールディングス	2,200	241.00	530,200
アインホールディングス	1,500	7,030.00	10,545,000
元気寿司	400	2,064.00	825,600
ヤマダ電機	37,900	547.00	20,731,300
アークランドサカモト	2,100	1,255.00	2,635,500
ニトリホールディングス	5,400	12,750.00	68,850,000
愛眼	1,000	201.00	201,000
ケーユーホールディングス	600	793.00	475,800
吉野家ホールディングス	4,600	1,573.00	7,235,800
松屋フーズ	600	3,165.00	1,899,000
サガミチェーン	1,700	1,257.00	2,136,900
関西スーパーマーケット	1,000	1,616.00	1,616,000
王将フードサービス	900	4,040.00	3,636,000
プレナス	1,400	2,148.00	3,007,200
ミニストップ	900	1,814.00	1,632,600
アークス	2,300	2,708.00	6,228,400
パローホールディングス	2,700	3,000.00	8,100,000
藤久	100	1,719.00	171,900
ベルク	600	4,135.00	2,481,000
大庄	700	1,527.00	1,068,900
ファーストリテイリング	2,100	36,450.00	76,545,000
サンドラッグ	2,600	8,240.00	21,424,000
サクスパー ホールディングス	1,200	1,125.00	1,350,000
ヤマザワ	300	1,727.00	518,100
やまや	300	1,492.00	447,600
ペルーナ	3,100	686.00	2,126,600
島根銀行	300	1,271.00	381,300
じもとホールディングス	9,100	166.00	1,510,600
めぶきフィナンシャルグループ	61,800	377.00	23,298,600
東京ＴＹフィナンシャルグループ	1,700	3,255.00	5,533,500

九州フィナンシャルグループ	19,100	695.00	13,274,500	
ゆうちょ銀行	31,900	1,218.00	38,854,200	
富山第一銀行	3,200	493.00	1,577,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	86,800	474.60	41,195,280	
西日本フィナンシャルホールディングス	8,000	1,052.00	8,416,000	
新生銀行	108,000	164.00	17,712,000	
あおぞら銀行	79,000	344.00	27,176,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	999,100	532.90	532,420,390	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	145,700	445.20	64,865,640	
三井住友トラスト・ホールディングス	25,500	3,423.00	87,286,500	
三井住友フィナンシャルグループ	99,700	3,547.00	353,635,900	代用有価証券 10,000株
第四銀行	15,000	437.00	6,555,000	
北越銀行	1,300	2,451.00	3,186,300	
千葉銀行	48,000	631.00	30,288,000	
群馬銀行	27,700	494.00	13,683,800	
武蔵野銀行	2,000	2,846.00	5,692,000	
千葉興業銀行	3,500	453.00	1,585,500	
筑波銀行	5,300	307.00	1,627,100	
七十七銀行	19,000	461.00	8,759,000	
青森銀行	9,000	349.00	3,141,000	
秋田銀行	8,000	345.00	2,760,000	
山形銀行	7,000	445.00	3,115,000	
岩手銀行	900	4,305.00	3,874,500	
東邦銀行	11,000	392.00	4,312,000	
東北銀行	6,000	148.00	888,000	
みちのく銀行	6,000	208.00	1,248,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	54,000	448.00	24,192,000	
静岡銀行	37,000	866.00	32,042,000	
十六銀行	16,000	314.00	5,024,000	
スルガ銀行	11,800	2,524.00	29,783,200	
八十二銀行	22,500	563.00	12,667,500	
山梨中央銀行	8,000	498.00	3,984,000	
大垣共立銀行	17,000	367.00	6,239,000	
福井銀行	11,000	278.00	3,058,000	
北國銀行	13,000	352.00	4,576,000	

清水銀行	400	3,090.00	1,236,000	
富山銀行	200	4,080.00	816,000	
滋賀銀行	12,000	527.00	6,324,000	
南都銀行	1,200	3,925.00	4,710,000	
百五銀行	11,000	390.00	4,290,000	
京都銀行	24,000	757.00	18,168,000	
紀陽銀行	4,900	1,720.00	8,428,000	
三重銀行	600	2,119.00	1,271,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	8,500	1,495.00	12,707,500	
広島銀行	37,000	444.00	16,428,000	
山陰合同銀行	7,500	743.00	5,572,500	
中国銀行	8,800	1,364.00	12,003,200	
鳥取銀行	400	1,715.00	686,000	
伊予銀行	13,300	627.00	8,339,100	
百十四銀行	14,000	358.00	5,012,000	
四国銀行	10,000	244.00	2,440,000	
阿波銀行	10,000	697.00	6,970,000	
大分銀行	7,000	393.00	2,751,000	
宮崎銀行	8,000	290.00	2,320,000	
佐賀銀行	8,000	266.00	2,128,000	
十八銀行	8,000	322.00	2,576,000	
沖縄銀行	1,100	3,555.00	3,910,500	
琉球銀行	2,600	1,348.00	3,504,800	
セブン銀行	46,700	331.00	15,457,700	
みずほフィナンシャルグループ	1,790,100	171.50	307,002,150	
高知銀行	5,000	115.00	575,000	
山口フィナンシャルグループ	12,000	1,127.00	13,524,000	
長野銀行	400	2,006.00	802,400	
名古屋銀行	1,000	3,700.00	3,700,000	
北洋銀行	18,700	388.00	7,255,600	
愛知銀行	400	5,660.00	2,264,000	
第三銀行	700	1,771.00	1,239,700	
中京銀行	500	2,359.00	1,179,500	
大光銀行	5,000	252.00	1,260,000	
愛媛銀行	1,400	1,389.00	1,944,600	
トマト銀行	500	1,589.00	794,500	

みなと銀行	1,100	1,915.00	2,106,500
京葉銀行	10,000	447.00	4,470,000
関西アーバン銀行	1,700	1,149.00	1,953,300
栃木銀行	6,400	495.00	3,168,000
北日本銀行	400	3,020.00	1,208,000
東和銀行	23,000	103.00	2,369,000
福島銀行	16,000	97.00	1,552,000
大東銀行	8,000	168.00	1,344,000
トモニホールディングス	9,600	532.00	5,107,200
フィデアホールディングス	10,200	181.00	1,846,200
池田泉州ホールディングス	13,200	468.00	6,177,600
F P G	4,500	934.00	4,203,000
S B Iホールディングス	15,000	1,205.00	18,075,000
ジャフコ	2,100	3,395.00	7,129,500
大和証券グループ本社	116,000	587.80	68,184,800
野村ホールディングス	239,700	494.50	118,531,650
岡三証券グループ	11,000	522.00	5,742,000
丸三証券	3,700	856.00	3,167,200
東洋証券	5,000	183.00	915,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	14,300	516.00	7,378,800
光世証券	3,000	122.00	366,000
水戸証券	4,000	247.00	988,000
いちよし証券	2,800	782.00	2,189,600
松井証券	6,100	836.00	5,099,600
だいこう証券ビジネス	600	503.00	301,800
マネックスグループ	14,500	240.00	3,480,000
カブドットコム証券	10,500	327.00	3,433,500
極東証券	1,700	1,457.00	2,476,900
岩井コスモホールディングス	1,200	898.00	1,077,600
藍澤証券	2,300	561.00	1,290,300
マネースクウェアHD	500	1,246.00	623,000
マネーパートナーズグループ	1,200	478.00	573,600
かんぽ生命保険	5,100	2,143.00	10,929,300
S O M P Oホールディングス	27,600	3,338.00	92,128,800
アニコムホールディングス	900	2,358.00	2,122,200

MS & ADインシュアランスグループホールディングス	37,200	3,008.00	111,897,600
ソニーフィナンシャルホールディングス	11,900	1,404.00	16,707,600
第一生命ホールディングス	79,800	1,480.00	118,104,000
東京海上ホールディングス	50,400	4,056.00	204,422,400
T & Dホールディングス	45,400	1,214.50	55,138,300
アドバンスクリエイト	300	1,668.00	500,400
全国保証	3,300	4,430.00	14,619,000
クレディセゾン	9,400	1,776.00	16,694,400
芙蓉総合リース	1,400	5,290.00	7,406,000
興銀リース	2,400	2,168.00	5,203,200
東京センチュリー	2,900	3,610.00	10,469,000
日本証券金融	5,500	458.00	2,519,000
アイフル	21,000	316.00	6,636,000
ポケットカード	1,300	499.00	648,700
リコーリース	1,000	3,015.00	3,015,000
イオンフィナンシャルサービス	8,300	1,824.00	15,139,200
アコム	25,100	484.00	12,148,400
ジャックス	7,000	408.00	2,856,000
オリエントコーポレーション	54,100	194.00	10,495,400
日立キャピタル	3,000	2,295.00	6,885,000
アプラスフィナンシャル	6,300	106.00	667,800
オリックス	88,200	1,495.50	131,903,100
三菱UFJリース	31,600	497.00	15,705,200
日本取引所グループ	36,600	1,598.00	58,486,800
イー・ギャランティ	400	2,618.00	1,047,200
アサックス	200	1,501.00	300,200
NECキャピタルソリューション	500	1,743.00	871,500
いちご	13,800	455.00	6,279,000
日本駐車場開発	15,100	142.00	2,144,200
ヒューリック	26,000	1,036.00	26,936,000
三栄建築設計	500	1,778.00	889,000
野村不動産ホールディングス	8,300	1,837.00	15,247,100
三重交通グループホールディングス	2,200	389.00	855,800
サムティ	1,000	1,063.00	1,063,000
ディア・ライフ	900	338.00	304,200

エー・ディー・ワークス	12,100	39.00	471,900	
日本商業開発	600	1,805.00	1,083,000	
プレサンスコーポレーション	1,600	1,209.00	1,934,400	
ユニゾホールディングス	800	2,797.00	2,237,600	
THEグローバル社	400	455.00	182,000	
日本管理センター	900	1,407.00	1,266,300	
サンセイランディック	300	722.00	216,600	
エストラスト	200	560.00	112,000	
フージャースホールディングス	1,800	520.00	936,000	
オープンハウス	1,800	2,209.00	3,976,200	
東急不動産ホールディングス	30,100	585.00	17,608,500	
飯田グループホールディングス	11,500	2,009.00	23,103,500	
ムゲンエステート	400	764.00	305,600	
シーアールイー	100	3,600.00	360,000	
エコナックホールディングス	4,000	48.00	192,000	
パーク24	6,300	3,390.00	21,357,000	
パラカ	400	1,929.00	771,600	
三井不動産	66,000	2,409.00	158,994,000	
三菱地所	93,000	2,040.50	189,766,500	
平和不動産	2,300	1,516.00	3,486,800	
東京建物	14,500	1,317.00	19,096,500	
ダイビル	3,200	930.00	2,976,000	
京阪神ビルディング	2,100	549.00	1,152,900	
住友不動産	30,000	2,796.50	83,895,000	
大京	23,000	198.00	4,554,000	
テーオーシー	4,800	973.00	4,670,400	
東京楽天地	2,000	508.00	1,016,000	
レオパレス21	14,700	683.00	10,040,100	
スターツコーポレーション	1,400	1,948.00	2,727,200	
フジ住宅	1,600	684.00	1,094,400	
空港施設	1,500	559.00	838,500	
明和地所	700	576.00	403,200	
住友不動産販売	900	2,327.00	2,094,300	
ゴールドクレスト	1,000	1,695.00	1,695,000	
日本エスリード	500	1,089.00	544,500	
日神不動産	1,700	382.00	649,400	

日本エスコン	1,700	318.00	540,600
タカラレーベン	5,400	740.00	3,996,000
サンヨーハウジング名古屋	700	899.00	629,300
イオンモール	8,000	1,575.00	12,600,000
ファースト住建	500	1,339.00	669,500
トーセイ	1,700	775.00	1,317,500
穴吹興産	1,000	247.00	247,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	7,700	974.00	7,499,800
サンフロンティア不動産	1,500	1,006.00	1,509,000
エフ・ジェー・ネクスト	1,100	600.00	660,000
インテリックス	300	722.00	216,600
ランドビジネス	800	263.00	210,400
グランディハウス	1,100	367.00	403,700
日本空港ビルデング	4,000	3,950.00	15,800,000
日本工営	4,000	489.00	1,956,000
ネクスト	3,700	923.00	3,415,100
ジェイエシーリクルートメント	800	1,312.00	1,049,600
日本M&Aセンター	4,100	3,305.00	13,550,500
ノバレーゼ	300	1,937.00	581,100
アコーディア・ゴルフ	3,700	1,055.00	3,903,500
中広	100	687.00	68,700
タケエイ	1,200	884.00	1,060,800
トラスト・テック	500	1,663.00	831,500
パソナグループ	1,200	882.00	1,058,400
CDS	300	968.00	290,400
リンクアンドモチベーション	3,100	319.00	988,900
GCA	1,200	780.00	936,000
エス・エム・エス	1,600	2,581.00	4,129,600
テンプホールディングス	9,200	1,810.00	16,652,000
リニカル	800	1,404.00	1,123,200
クックパッド	3,000	1,005.00	3,015,000
エスクリ	600	549.00	329,400
アイ・ケイ・ケイ	600	627.00	376,200
学情	600	1,154.00	692,400
スタジオアリス	500	2,160.00	1,080,000
シミックホールディングス	700	1,539.00	1,077,300

N J S	300	1,267.00	380,100
総合警備保障	4,400	5,290.00	23,276,000
カカクコム	9,400	1,820.00	17,108,000
ルネサンス	700	1,343.00	940,100
ディップ	1,500	2,755.00	4,132,500
オプトホールディング	1,000	720.00	720,000
新日本科学	1,300	613.00	796,900
ツクイ	3,100	695.00	2,154,500
キャリアデザインセンター	300	929.00	278,700
エムスリー	11,400	3,205.00	36,537,000
ツカダ・グローバルホールディング	1,000	722.00	722,000
アウトソーシング	700	4,035.00	2,824,500
ウェルネット	1,000	1,301.00	1,301,000
ワールドホールディングス	300	1,644.00	493,200
ディー・エヌ・エー	5,900	3,420.00	20,178,000
博報堂D Yホールディングス	18,300	1,272.00	23,277,600
ぐるなび	1,500	2,951.00	4,426,500
エスアールジータカミヤ	1,400	537.00	751,800
ジャパンベストレスキューシステム	1,700	245.00	416,500
ファンコミュニケーションズ	3,400	790.00	2,686,000
ジェイコムホールディングス	300	1,955.00	586,500
W D Bホールディングス	500	1,086.00	543,000
ティア	700	621.00	434,700
バリューコマース	1,300	354.00	460,200
インフォマート	2,800	1,255.00	3,514,000
J Pホールディングス	3,300	263.00	867,900
E P Sホールディングス	1,700	1,380.00	2,346,000
レッグス	300	818.00	245,400
プレステージ・インターナショナル	2,200	793.00	1,744,600
アミューズ	700	1,779.00	1,245,300
ドリームインキュベータ	400	2,391.00	956,400
クイック	700	1,075.00	752,500
T A C	800	213.00	170,400
ケネディクス	17,700	437.00	7,734,900
電通	14,700	5,200.00	76,440,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	507.00	304,200

ぴあ	400	2,450.00	980,000
イオンファンタジー	500	3,075.00	1,537,500
シーティーエス	400	984.00	393,600
みらかホールディングス	3,400	5,090.00	17,306,000
アルプス技研	500	2,289.00	1,144,500
ダイオーズ	300	967.00	290,100
日本空調サービス	1,200	570.00	684,000
オリエンタルランド	14,200	6,220.00	88,324,000
ダスキン	3,400	2,009.00	6,830,600
明光ネットワークジャパン	1,600	981.00	1,569,600
ファルコホールディングス	600	1,379.00	827,400
秀英予備校	300	353.00	105,900
田谷	300	650.00	195,000
ラウンドワン	4,100	723.00	2,964,300
リゾートトラスト	5,500	2,159.00	11,874,500
ピー・エム・エル	1,500	2,824.00	4,236,000
ワタベウェディング	400	462.00	184,800
りらいあコミュニケーションズ	2,200	1,001.00	2,202,200
リソー教育	2,500	585.00	1,462,500
早稲田アカデミー	200	900.00	180,000
ユー・エス・エス	16,000	1,766.00	28,256,000
東京個別指導学院	700	551.00	385,700
サイバーエージェント	6,900	3,110.00	21,459,000
楽天	67,300	1,277.00	85,942,100
クリーク・アンド・リバー社	500	775.00	387,500
テー・オー・ダブリュー	1,100	665.00	731,500
セントラルスポーツ	400	2,475.00	990,000
フルキャストホールディングス	1,400	975.00	1,365,000
リソルホールディングス	2,000	325.00	650,000
テクノプロ・ホールディングス	2,100	3,615.00	7,591,500
アトラ	200	1,285.00	257,000
インターワークス	200	1,127.00	225,400
K e e P e r 技研	200	1,631.00	326,200
ファーストロジック	100	1,709.00	170,900
デザインワン・ジャパン	100	2,192.00	219,200
リブセンス	900	452.00	406,800

ジャパンマテリアル	500	3,680.00	1,840,000
ベクトル	1,200	1,135.00	1,362,000
ウチヤマホールディングス	700	417.00	291,900
サクセスホールディングス	100	1,193.00	119,300
キャリアリンク	400	784.00	313,600
I B J	1,000	731.00	731,000
アサンテ	500	1,572.00	786,000
N・フィールド	600	1,560.00	936,000
M&Aキャピタルパートナーズ	200	2,233.00	446,600
ライドオン・エクスプレス	300	1,031.00	309,300
E R Iホールディングス	400	805.00	322,000
アビスト	200	2,698.00	539,600
ウィルグループ	300	970.00	291,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	100	2,527.00	252,700
日本ビューホテル	200	1,311.00	262,200
リクルートホールディングス	26,600	4,265.00	113,449,000
エラン	200	1,349.00	269,800
日本郵政	38,700	1,299.00	50,271,300
ベルシステム24ホールディングス	2,600	982.00	2,553,200
ソラスト	600	1,115.00	669,000
リログループ	500	17,410.00	8,705,000
東祥	400	4,450.00	1,780,000
エイチ・アイ・エス	2,100	2,866.00	6,018,600
ラックランド	200	1,800.00	360,000
共立メンテナンス	1,000	6,170.00	6,170,000
イチネンホールディングス	1,400	1,009.00	1,412,600
建設技術研究所	800	1,036.00	828,800
スペース	700	1,254.00	877,800
燦ホールディングス	300	1,517.00	455,100
スバル興業	1,000	414.00	414,000
東京テアトル	5,000	122.00	610,000
ナガワ	200	3,975.00	795,000
よみうりランド	3,000	452.00	1,356,000
東京都競馬	9,000	205.00	1,845,000
常磐興産	500	1,535.00	767,500
カナモト	1,800	2,537.00	4,566,600

東京ドーム	5,300	998.00	5,289,400	
西尾レントオール	1,100	3,125.00	3,437,500	
トランス・コスモス	1,500	2,735.00	4,102,500	
乃村工藝社	2,800	1,726.00	4,832,800	
藤田観光	4,000	347.00	1,388,000	
KNT - CTホールディングス	8,000	115.00	920,000	
日本管財	1,100	1,530.00	1,683,000	
トーカイ	600	3,630.00	2,178,000	
白洋舎	100	2,500.00	250,000	
セコム	13,700	7,706.00	105,572,200	
セントラル警備保障	600	2,059.00	1,235,400	
丹青社	2,500	801.00	2,002,500	
メイテック	1,600	3,575.00	5,720,000	
アサツー ディ・ケイ	2,100	2,910.00	6,111,000	
応用地質	1,200	1,229.00	1,474,800	
船井総研ホールディングス	1,700	1,604.00	2,726,800	
進学会	600	496.00	297,600	
オオバ	1,000	438.00	438,000	
学究社	200	1,274.00	254,800	
ベネッセホールディングス	4,400	2,774.00	12,205,600	
イオンディライト	1,300	3,195.00	4,153,500	
ナック	800	891.00	712,800	
ニチイ学館	2,300	845.00	1,943,500	
ダイセキ	2,500	2,126.00	5,315,000	
ステップ	400	1,253.00	501,200	
合 計	19,403,000		25,801,778,970	

(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27年10月26日現在	平成28年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	177,066,966	666,098,048
コール・ローン	1,451,209,522	336,611,313
出資金	-	7,425,950
株式	75,505,109,512	66,078,687,682
投資証券	1,981,318,708	1,844,665,412
派生商品評価勘定	134,593,946	10,453,502
未収配当金	77,009,683	67,364,205
未収利息	2,351	-
差入委託証拠金	246,475,696	281,658,417
流動資産合計	79,572,786,384	69,292,964,529
資産合計	79,572,786,384	69,292,964,529
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,675,620	5,439,197
未払金	480,762	-
未払解約金	60,434,373	72,735,081
未払利息	-	390
流動負債合計	62,590,755	78,174,668
負債合計	62,590,755	78,174,668
純資産の部		
元本等		
元本	39,171,763,417	38,877,746,606
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	40,338,432,212	30,337,043,255
元本等合計	79,510,195,629	69,214,789,861
純資産合計	79,510,195,629	69,214,789,861
負債純資産合計	79,572,786,384	69,292,964,529

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>出資金、株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>（1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>（2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券</p>
--------------------	---

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

（貸借対照表に関する注記）

		平成27年10月26日現在	平成28年10月26日現在
1.	期首	平成26年10月28日	平成27年10月27日
	期首元本額	45,139,625,708円	39,171,763,417円
	期首からの追加設定元本額	2,576,874,474円	3,330,056,187円
	期首からの一部解約元本額	8,544,736,765円	3,624,072,998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）	14,134,604,963円	14,771,411,678円
	DCインデックスバランス（株式20）	40,898,613円	53,008,910円
	DCインデックスバランス（株式40）	155,460,192円	178,940,471円
	DCインデックスバランス（株式60）	291,520,885円	327,631,735円
	DCインデックスバランス（株式80）	344,001,546円	370,479,311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	3,617,735,817円	3,533,390,362円
	日興五大陸株式ファンド	7,510,629,328円	6,931,109,823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	29,831,206円	31,269,716円
	インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）	-円	39,075,632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）	13,338,738円	1,837,557円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	7,085,288円	7,043,309円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	5,812,895円	5,843,299円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	8,708,606円	8,664,553円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	10,511,254円	11,084,688円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	7,602,436,095円	7,445,144,841円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	10,775,646円	9,975,313円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	29,702,650円	33,731,074円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	88,655,614円	99,681,217円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	124,909,158円	134,087,849円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	125,029,817円	133,359,275円
インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	5,020,115,106円	4,750,975,993円
計	39,171,763,417円	38,877,746,606円
2. 受益権の総数	39,171,763,417口	38,877,746,606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26年10月28日 至 平成27年10月26日	自 平成27年10月27日 至 平成28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27年10月26日現在	平成28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	(1)有価証券

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

（有価証券に関する注記）

（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

（平成28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
出資金	1,934,424
株式	1,180,683,444
投資証券	31,074,566
合計	1,213,692,434

(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

(平成28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	1,288,947,542	-	1,292,242,077	3,294,535
合計		1,288,947,542	-	1,292,242,077	3,294,535

(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

（平成28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	380,668,230	-	382,388,000	1,719,770
	米ドル	157,881,500	-	161,412,500	3,531,000
	ユーロ	222,786,730	-	220,975,500	1,811,230
	合計	380,668,230	-	382,388,000	1,719,770

（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27年10月26日現在		平成28年10月26日現在	
1口当たり純資産額	2.0298円	1口当たり純資産額	1.7803円
(1万口当たり純資産額)	(20,298円)	(1万口当たり純資産額)	(17,803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	12,193	61.05	744,382.65	
	ANTERO RESOURCES CORP	3,670	25.35	93,034.50	
	APACHE CORP	8,294	60.57	502,367.58	
	BAKER HUGHES INC	9,665	54.39	525,679.35	
	CABOT OIL & GAS CORP	11,490	20.63	237,038.70	
	CHENIERE ENERGY INC	4,380	40.09	175,594.20	
	CHEVRON CORP	41,251	100.77	4,156,863.27	
	CIMAREX ENERGY CO	2,005	133.90	268,469.50	
	CONCHO RESOURCES INC	3,055	133.07	406,528.85	
	CONOCOPHILLIPS	26,990	41.81	1,128,451.90	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,960	51.21	100,371.60	
	CORE LABORATORIES N.V.	1,080	104.52	112,881.60	
	DEVON ENERGY CORPORATION	11,061	40.67	449,850.87	
	EOG RESOURCES INC	12,022	92.67	1,114,078.74	
	EQT CORP	3,885	64.92	252,214.20	
	EXXON MOBIL CORP	90,821	86.72	7,875,997.12	
	FMC TECHNOLOGIES INC	4,415	32.42	143,134.30	
	HALLIBURTON CO	18,607	47.77	888,856.39	
	HELMERICH & PAYNE	2,120	65.51	138,881.20	
	HESS CORP	6,000	50.90	305,400.00	
	HOLLYFRONTIER CORP	3,740	24.82	92,826.80	
	KINDER MORGAN INC	41,580	21.32	886,485.60	
	MARATHON OIL CORP	17,867	14.18	253,354.06	
	MARATHON PETROLEUM CORP	11,412	43.69	498,590.28	
MURPHY OIL CORP	3,715	28.73	106,731.95		
NATIONAL OILWELL VARCO INC	8,231	36.16	297,632.96		
NEWFIELD EXPLORATION CO	4,040	42.00	169,680.00		
NOBLE ENERGY INC	9,492	34.28	325,385.76		

OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	16,761	74.43	1,247,521.23	
ONEOK INC	4,590	49.17	225,690.30	
PHILLIPS 66	10,115	80.76	816,887.40	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,590	183.03	657,077.70	
RANGE RESOURCES CORP	4,050	35.89	145,354.50	
SCHLUMBERGER LTD	30,601	80.22	2,454,812.22	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	10,435	10.76	112,280.60	
SPECTRA ENERGY CORP	15,234	42.00	639,828.00	
TESORO CORP	2,820	82.80	233,496.00	
VALERO ENERGY CORP	10,332	58.93	608,864.76	
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	20,199	6.16	124,425.84	
WILLIAMS COS INC	15,624	29.17	455,752.08	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	4,515	133.51	602,797.65	
ALBEMARLE CORP	2,540	82.10	208,534.00	
ALCOA INC	10,663	27.29	290,993.27	
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	1,610	111.33	179,241.30	
AVERY DENNISON CORP	2,260	75.77	171,240.20	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	4,170	25.89	107,961.30	
BALL CORP	3,670	79.75	292,682.50	
CELANESE CORP-SERIES A	3,270	71.77	234,687.90	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,850	25.54	123,869.00	
CROWN HOLDINGS INC	2,815	54.62	153,755.30	
DOW CHEMICAL CO/THE	24,643	54.11	1,333,432.73	
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	19,108	69.62	1,330,298.96	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,395	66.40	225,428.00	
ECOLAB INC	5,690	115.95	659,755.50	
FMC CORP	3,270	47.34	154,801.80	
FREEPORT-MCMORAN INC	25,748	10.55	271,641.40	
INTERNATIONAL PAPER CO	8,670	46.60	404,022.00	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,664	130.50	217,152.00	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,140	79.96	650,874.40	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,325	178.03	235,889.75	
MONSANTO CO	9,581	101.40	971,513.40	
MOSAIC CO/THE	7,490	24.60	184,254.00	
NEWMONT MINING CORP	11,290	36.59	413,101.10	

NUCOR CORP	7,169	47.00	336,943.00	
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,950	80.88	157,716.00	
PPG INDUSTRIES INC	5,874	91.22	535,826.28	
PRAXAIR INC	6,190	118.53	733,700.70	
SEALED AIR CORP	4,356	42.45	184,912.20	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,687	247.61	417,718.07	
VALSPAR CORP/THE	1,530	105.23	161,001.90	
VULCAN MATERIALS CO	2,893	110.83	320,631.19	
WESTROCK CO	5,959	46.96	279,834.64	
WR GRACE & CO	1,400	68.59	96,026.00	
3M CO	13,236	166.23	2,200,220.28	
ACUITY BRANDS INC	960	233.89	224,534.40	
AERCAP HOLDINGS NV	3,450	40.80	140,760.00	
AGCO CORP	1,670	51.71	86,355.70	
AMETEK INC	5,073	44.80	227,270.40	
B/E AEROSPACE INC	2,570	59.69	153,403.30	
BOEING CO/THE	13,172	139.02	1,831,171.44	
CATERPILLAR INC	12,686	84.48	1,071,713.28	
CUMMINS INC	3,695	125.57	463,981.15	
DEERE & CO	5,710	86.52	494,029.20	
DOVER CORP	3,640	67.97	247,410.80	
EATON CORP PLC	9,756	63.18	616,384.08	
EMERSON ELECTRIC CO	13,830	50.11	693,021.30	
FASTENAL CO	6,153	38.64	237,751.92	
FLOWSERVE CORP	2,965	43.19	128,058.35	
FLUOR CORP	3,203	49.77	159,413.31	
FORTIVE CORP	6,734	47.92	322,693.28	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,160	52.31	165,299.60	
GENERAL DYNAMICS CORP	5,722	152.59	873,119.98	
GENERAL ELECTRIC CO	201,513	28.65	5,773,347.45	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	15,926	109.07	1,737,048.82	
ILLINOIS TOOL WORKS	6,900	111.84	771,696.00	
INGERSOLL-RAND PLC	5,866	64.60	378,943.60	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,810	50.43	141,708.30	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	5,300	60.91	322,823.00	

L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	1,751	147.93	259,025.43
LOCKHEED MARTIN CORP	5,741	249.26	1,431,001.66
MASCO CORP	7,529	30.38	228,731.02
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,844	219.53	843,873.32
PACCAR INC	7,684	54.80	421,083.20
PARKER HANNIFIN CORP	3,010	121.35	365,263.50
PENTAIR PLC	4,018	55.92	224,686.56
RAYTHEON COMPANY	6,432	139.75	898,872.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,943	118.62	349,098.66
ROCKWELL COLLINS INC.	2,995	80.00	239,600.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,150	171.34	368,381.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,970	37.43	148,597.10
SMITH (A.O.) CORP	3,020	46.74	141,154.80
SNAP-ON INC	1,250	156.76	195,950.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,116	117.02	364,634.32
TEXTRON INC	5,416	39.13	211,928.08
TRANSDIGM GROUP INC	1,190	268.12	319,062.80
UNITED RENTALS INC	2,250	76.49	172,102.50
UNITED TECHNOLOGIES CORP	17,315	101.36	1,755,048.40
WABCO HOLDINGS INC	1,110	96.92	107,581.20
WABTEC CORP	2,090	78.61	164,294.90
WW GRAINGER INC	1,317	203.08	267,456.36
XYLEM INC	4,368	48.03	209,795.04
CINTAS CORP	2,037	106.73	217,409.01
DUN & BRADSTREET CORP	872	125.79	109,688.88
EQUIFAX INC	2,634	130.43	343,552.62
IHS MARKIT LTD	7,543	37.61	283,692.23
MANPOWERGROUP INC	1,937	78.25	151,570.25
NIELSEN HOLDINGS PLC	7,835	45.65	357,667.75
REPUBLIC SERVICES INC	5,100	50.95	259,845.00
ROBERT HALF INTL INC	2,375	38.66	91,817.50
STERICYCLE INC	1,705	75.90	129,409.50
VERISK ANALYTICS INC	3,170	82.09	260,225.30
WASTE CONNECTIONS INC	3,871	75.28	291,408.88
WASTE MANAGEMENT INC	9,924	62.74	622,631.76

AMERCO	155	328.67	50,943.85
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,290	39.69	130,580.10
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,250	69.43	225,647.50
CSX CORP	20,923	30.85	645,474.55
DELTA AIR LINES INC	4,285	41.21	176,584.85
EXPEDITORS INTL WASH INC	3,647	50.36	183,662.92
FEDEX CORP	5,758	171.93	989,972.94
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,000	78.84	157,680.00
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	97,000	0.44	43,165.00
KANSAS CITY SOUTHERN	2,390	90.48	216,247.20
NORFOLK SOUTHERN CORP	6,530	93.27	609,053.10
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,400	41.95	142,630.00
UNION PACIFIC CORP	18,406	89.99	1,656,355.94
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	1,915	54.63	104,616.45
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	15,197	107.84	1,638,844.48
AUTOLIV INC	2,020	99.65	201,293.00
BORGWARNER INC	4,330	34.95	151,333.50
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	6,090	63.23	385,070.70
FORD MOTOR COMPANY	80,915	11.85	958,842.75
GENERAL MOTORS CORP	30,275	31.60	956,690.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	5,430	31.12	168,981.60
HARLEY-DAVIDSON INC	4,079	56.60	230,871.40
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	20,254	43.91	889,353.14
LEAR CORP	1,560	114.10	177,996.00
TESLA MOTORS INC	2,480	202.34	501,803.20
COACH INC	6,286	35.65	224,095.90
DR HORTON INC	7,936	28.81	228,636.16
GARMIN LTD	2,865	49.51	141,846.15
HANESBRANDS INC	8,800	23.86	209,968.00
HARMAN INTERNATIONAL	1,600	78.17	125,072.00
HASBRO INC	2,538	83.30	211,415.40
LEGGETT & PLATT INC	3,348	45.10	150,994.80
LENNAR CORP-CL A	4,320	41.21	178,027.20
LULULEMON ATHLETICA INC	2,440	55.11	134,468.40
MATTEL INC	7,349	32.60	239,577.40

MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	4,000	48.55	194,200.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,488	185.90	276,619.20
NEWELL BRANDS INC	9,996	51.63	516,093.48
NIKE INC -CL B	29,428	51.05	1,502,299.40
POLARIS INDUSTRIES INC	1,420	78.61	111,626.20
PULTE GROUP INC	6,890	18.57	127,947.30
PVH CORP	2,030	105.53	214,225.90
RALPH LAUREN CORP	1,365	97.82	133,524.30
TOLL BROTHERS INC	3,781	28.22	106,699.82
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	3,560	32.89	117,088.40
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	4,652	28.37	131,977.24
VF CORP	7,680	53.07	407,577.60
WHIRLPOOL CORP	1,814	152.09	275,891.26
ARAMARK	4,960	36.92	183,123.20
CARNIVAL CORP	7,957	46.92	373,342.44
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	685	405.67	277,883.95
DARDEN RESTAURANTS INC	2,903	61.72	179,173.16
DOMINO'S PIZZA INC	1,020	164.89	168,187.80
H&R BLOCK INC	5,610	23.00	129,030.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	11,130	22.73	252,984.90
LAS VEGAS SANDS CORP	9,480	58.00	549,840.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	7,703	67.21	517,718.63
MCDONALD'S CORP	19,191	112.72	2,163,209.52
MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	4,100	16.77	68,757.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	9,760	26.08	254,540.80
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	3,730	37.73	140,732.90
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,538	70.63	249,888.94
STARBUCKS CORP	32,214	53.67	1,728,925.38
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,540	67.86	172,364.40
WYNN RESORTS LTD	1,660	95.57	158,646.20
YUM! BRANDS INC	9,214	85.73	789,916.22
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	9,418	55.99	527,313.82
CHARTER COMMUNICATION-A	4,701	257.06	1,208,439.06
COMCAST CORP-CLASS A	52,957	64.52	3,416,785.64
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,320	26.18	86,917.60

DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	5,600	25.47	142,632.00
DISH NETWORK CORP-A	4,769	58.76	280,226.44
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	8,736	22.69	198,219.84
LIBERTY BROADBAND-C	2,140	67.81	145,113.40
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	2,981	27.28	81,321.68
LIBERTY GLOBAL PLC-A	6,215	32.24	200,371.60
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	13,641	31.56	430,509.96
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	4,930	33.71	166,190.30
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	1,975	34.04	67,229.00
NEWS CORP - CLASS A	7,570	12.65	95,760.50
OMNICOM GROUP	5,417	80.08	433,793.36
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	1,950	65.19	127,120.50
SIRIUS XM HOLDINGS INC	42,510	4.19	178,116.90
TEGNA INC	4,330	19.84	85,907.20
THE WALT DISNEY CO.	33,723	92.75	3,127,808.25
TIME WARNER INC	17,148	87.16	1,494,619.68
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	9,769	25.71	251,160.99
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	24,572	25.56	628,060.32
VIACOM INC-CLASS B	7,748	37.43	290,007.64
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,608	143.81	231,246.48
AMAZON.COM INC	8,785	835.18	7,337,056.30
AUTONATION INC	1,650	45.81	75,586.50
AUTOZONE INC	682	750.39	511,765.98
BED BATH & BEYOND INC	3,512	40.72	143,008.64
BEST BUY CO INC	6,504	39.26	255,347.04
CARMAX INC	4,269	50.93	217,420.17
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,110	55.07	116,197.70
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	6,280	68.17	428,107.60
DOLLAR TREE INC	4,896	75.82	371,214.72
EXPEDIA INC	2,682	127.99	343,269.18
FOOT LOCKER INC	3,100	68.00	210,800.00
GAP INC/THE	5,106	26.61	135,870.66
GENUINE PARTS CO	3,201	90.49	289,658.49
HOME DEPOT INC	27,480	123.34	3,389,383.20
KOHL'S CORP	4,402	43.51	191,531.02

L BRANDS INC	5,308	72.72	385,997.76
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	9,700	18.89	183,233.00
LKQ CORP	6,990	32.97	230,460.30
LOWE'S COS INC	19,742	68.47	1,351,734.74
MACY'S INC	7,009	35.93	251,833.37
NETFLIX INC	9,290	126.51	1,175,277.90
NORDSTROM INC	2,850	54.14	154,299.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,145	280.27	601,179.15
PRICELINE GROUP INC/THE	1,085	1,479.03	1,604,747.55
ROSS STORES INC	8,572	63.13	541,150.36
SIGNET JEWELERS LTD	1,660	81.16	134,725.60
STAPLES INC	13,744	7.53	103,492.32
TARGET CORP	12,330	67.95	837,823.50
TIFFANY & CO	2,980	73.39	218,702.20
TJX COMPANIES INC	14,513	73.62	1,068,447.06
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,960	63.14	186,894.40
TRIPADVISOR INC	2,330	63.53	148,024.90
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	1,320	246.99	326,026.80
COSTCO WHOLESALE CORP	9,609	150.99	1,450,862.91
CVS HEALTH CORP	23,917	87.41	2,090,584.97
KROGER CO	19,670	30.91	607,999.70
RITE AID CORP	22,930	7.01	160,739.30
SYSCO CORP	12,076	47.44	572,885.44
WAL-MART STORES INC	34,772	69.36	2,411,785.92
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	19,942	82.45	1,644,217.90
WHOLE FOODS MARKET INC	7,080	28.59	202,417.20
ALTRIA GROUP INC	42,938	64.71	2,778,517.98
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	13,013	42.53	553,442.89
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5,014	45.47	227,986.58
BUNGE LTD	3,107	61.45	190,925.15
CAMPBELL SOUP CO	4,215	53.44	225,249.60
COCA-COLA CO/THE	90,252	42.54	3,839,320.08
CONAGRA FOODS INC	8,960	47.84	428,646.40
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,720	168.14	625,480.80
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	4,109	88.32	362,906.88

GENERAL MILLS INC	12,569	61.10	767,965.90
HERSHEY CO/THE	3,395	95.81	325,274.95
HORMEL FOODS CORP	6,600	38.03	250,998.00
INGREDION INC	1,470	131.65	193,525.50
JM SMUCKER CO/THE	2,530	130.19	329,380.70
KELLOGG CO	5,708	74.21	423,590.68
KRAFT HEINZ CO/THE	13,191	88.36	1,165,556.76
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,275	95.91	218,195.25
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	3,991	80.88	322,792.08
MOLSON COORS BREWING CO -B	4,080	108.10	441,048.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	34,005	42.76	1,454,053.80
MONSTER BEVERAGE CORP	2,930	149.81	438,943.30
PEPSICO INC	31,701	107.23	3,399,298.23
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	34,078	96.58	3,291,253.24
REYNOLDS AMERICAN INC	18,616	54.96	1,023,135.36
TYSON FOODS INC-CL A	6,456	69.04	445,722.24
WHITELAVE FOODS CO	3,520	54.74	192,684.80
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,930	48.11	285,292.30
CLOROX COMPANY	2,736	119.58	327,170.88
COLGATE-PALMOLIVE CO	18,690	71.31	1,332,783.90
COTY INC-CL A	10,000	23.11	231,100.00
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	1,311	76.74	100,606.14
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,740	86.18	408,493.20
KIMBERLY-CLARK CORP	7,883	113.73	896,533.59
PROCTER & GAMBLE CO	56,179	86.97	4,885,887.63
ABBOTT LABORATORIES	31,867	40.19	1,280,734.73
AETNA INC	7,649	111.64	853,934.36
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,024	80.39	323,489.36
ANTHEM INC	5,606	124.50	697,947.00
BAXTER INTERNATIONAL INC	10,949	49.16	538,252.84
BECTON DICKINSON AND CO	4,607	170.98	787,704.86
BOSTON SCIENTIFIC CORP	28,738	22.44	644,880.72
CARDINAL HEALTH INC	7,115	74.91	532,984.65
CENTENE CORP	3,770	65.36	246,407.20
CERNER CORP	6,590	58.90	388,151.00

CIGNA CORP	5,580	124.30	693,594.00
COOPER COS INC/THE	1,040	181.61	188,874.40
CR BARD INC	1,574	214.94	338,315.56
DANAHER CORP	13,469	78.77	1,060,953.13
DAVITA INC	3,938	58.29	229,546.02
DENTSPLY SIRONA INC	5,382	56.76	305,482.32
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,690	113.68	533,159.20
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	3,630	21.59	78,371.70
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	14,464	70.07	1,013,492.48
HCA HOLDINGS INC	6,905	80.96	559,028.80
HENRY SCHEIN INC	1,850	150.59	278,591.50
HOLOGIC INC	5,708	37.67	215,020.36
HUMANA INC	3,275	174.86	572,666.50
IDEXX LABORATORIES INC	1,830	110.98	203,093.40
INTUITIVE SURGICAL INC	820	679.50	557,190.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,155	138.41	298,273.55
MCKESSON CORP	4,914	158.50	778,869.00
MEDNAX INC	2,240	65.43	146,563.20
MEDTRONIC PLC	30,608	82.47	2,524,241.76
PATTERSON COS INC	2,042	44.44	90,746.48
QUEST DIAGNOSTICS	3,116	83.17	259,157.72
RESMED INC	3,370	64.13	216,118.10
ST JUDE MEDICAL INC	6,120	79.01	483,541.20
STRYKER CORP	7,453	113.19	843,605.07
UNITEDHEALTH GROUP INC	20,780	143.78	2,987,748.40
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,050	121.60	249,280.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,344	95.45	223,734.80
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	4,462	125.59	560,382.58
ABBVIE INC	35,416	61.55	2,179,854.80
AGILENT TECHNOLOGIES INC	7,010	43.51	305,005.10
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	4,910	121.41	596,123.10
ALKERMES PLC	3,220	54.46	175,361.20
ALLERGAN PLC	8,665	225.29	1,952,137.85
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,530	36.67	56,105.10
AMGEN INC	16,441	157.89	2,595,951.69

BIOGEN INC	4,803	286.00	1,373,658.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,500	80.96	283,360.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	36,461	49.55	1,806,642.55
CELGENE CORP	16,984	97.63	1,658,147.92
ELI LILLY & CO	21,733	77.75	1,689,740.75
ENDO INTERNATIONAL PLC	4,160	21.48	89,356.80
GILEAD SCIENCES INC	29,724	74.41	2,211,762.84
ILLUMINA INC	3,175	138.18	438,721.50
INCYTE CORP	3,680	87.20	320,896.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,330	118.96	158,216.80
JOHNSON & JOHNSON	60,261	113.96	6,867,343.56
MALLINCKRODT PLC	2,400	63.08	151,392.00
MERCK & CO. INC.	60,643	61.95	3,756,833.85
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	600	401.92	241,152.00
MYLAN NV	10,735	38.68	415,229.80
PERRIGO CO PLC	3,039	90.17	274,026.63
PFIZER INC	132,780	32.28	4,286,138.40
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	3,643	74.43	271,148.49
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,680	366.93	616,442.40
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	8,614	147.97	1,274,613.58
UNITED THERAPEUTICS CORP	940	112.17	105,439.80
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,320	78.71	418,737.20
WATERS CORP	1,886	138.60	261,399.60
ZOETIS INC	10,200	49.99	509,898.00
BANK OF AMERICA CORP	224,319	16.72	3,750,613.68
BB&T CORP	17,528	38.88	681,488.64
CIT GROUP INC	4,565	35.96	164,157.40
CITIGROUP INC	64,107	49.59	3,179,066.13
CITIZENS FINANCIAL GROUP	11,210	26.46	296,616.60
COMERICA INC	3,360	51.80	174,048.00
FIFTH THIRD BANCORP	16,559	21.28	352,375.52
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,070	75.48	231,723.60
HUNTINGTON BANCSHARES INC	24,200	10.19	246,598.00
JPMORGAN CHASE & CO	80,130	68.80	5,512,944.00
KEYCORP	22,678	13.87	314,543.86

M & T BANK CORP	3,073	119.05	365,840.65
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	9,654	14.37	138,727.98
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	6,370	16.28	103,703.60
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	10,840	93.14	1,009,637.60
REGIONS FINANCIAL CORP	29,784	10.62	316,306.08
SIGNATURE BANK	990	116.23	115,067.70
SUNTRUST BANKS INC	11,067	45.17	499,896.39
US BANCORP	37,701	43.84	1,652,811.84
WELLS FARGO & CO	105,800	45.72	4,837,176.00
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,220	141.77	172,959.40
ALLY FINANCIAL INC	9,120	19.55	178,296.00
AMERICAN EXPRESS CO	17,914	66.74	1,195,580.36
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,660	97.23	355,861.80
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	23,532	43.40	1,021,288.80
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	26,200	143.42	3,757,604.00
BLACKROCK INC	2,685	341.54	917,034.90
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	11,625	75.39	876,408.75
CME GROUP INC	7,500	103.33	774,975.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	9,370	56.14	526,031.80
E*TRADE FINANCIAL CORP	5,840	28.09	164,045.60
EATON VANCE CORP	2,880	37.39	107,683.20
FRANKLIN RESOURCES INC	7,995	34.82	278,385.90
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8,298	175.55	1,456,713.90
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	2,636	266.94	703,653.84
INVESCO LTD	9,377	29.58	277,371.66
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	18.66	136,311.30
MOODY'S CORP	3,917	102.77	402,550.09
MORGAN STANLEY	31,715	33.35	1,057,695.25
MSCI INC	2,000	83.19	166,380.00
NASDAQ INC	2,555	66.36	169,549.80
NAVIENT CORP	8,682	13.15	114,168.30
NORTHERN TRUST CORP	4,690	70.32	329,800.80
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,500	58.55	146,375.00
S&P GLOBAL INC	5,832	124.25	724,626.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	25,884	31.71	820,781.64

SEI INVESTMENTS COMPANY	3,225	45.12	145,512.00
STATE STREET CORP	8,707	70.89	617,239.23
SYNCHRONY FINANCIAL	18,290	28.58	522,728.20
T ROWE PRICE GROUP INC	5,465	66.04	360,908.60
TD AMERITRADE HOLDING CORP	5,980	34.32	205,233.60
VOYA FINANCIAL INC	4,650	30.30	140,895.00
AFLAC INC	9,092	69.64	633,166.88
ALLEGHANY CORP	330	512.52	169,131.60
ALLSTATE CORP	8,143	67.61	550,548.23
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	24,895	60.55	1,507,392.25
AON PLC	5,797	107.79	624,858.63
ARCH CAPITAL GROUP LTD	2,775	77.84	216,006.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,300	48.37	159,621.00
ASSURANT INC	1,530	82.25	125,842.50
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,175	55.61	120,951.75
CHUBB LTD	10,235	122.45	1,253,275.75
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,400	71.77	244,018.00
EVEREST RE GROUP LTD	1,014	201.73	204,554.22
FNF GROUP	5,881	36.55	214,950.55
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	8,312	42.71	355,005.52
LINCOLN NATIONAL CORP	5,363	48.24	258,711.12
LOEWS CORP	6,485	40.88	265,106.80
MARKEL CORP	310	888.05	275,295.50
MARSH & MCLENNAN COS	11,363	62.70	712,460.10
METLIFE INC	20,085	46.29	929,734.65
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6,430	52.96	340,532.80
PROGRESSIVE CORP	12,350	31.87	393,594.50
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	9,492	82.89	786,791.88
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	887	124.61	110,529.07
TORCHMARK CORP	2,216	63.19	140,029.04
TRAVELERS COS INC/THE	6,354	109.03	692,776.62
UNUM GROUP	4,788	35.28	168,920.64
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,758	126.45	348,749.10
WR BERKLEY CORP	2,063	55.83	115,177.29
XL GROUP LTD	6,310	34.06	214,918.60

CBRE GROUP INC	6,610	27.91	184,485.10
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	23,700	6.81	161,397.00
JONES LANG LASALLE INC	890	102.69	91,394.10
REALOGY HOLDINGS CORP	3,160	24.17	76,377.20
ACCENTURE PLC-CL A	13,828	115.27	1,593,953.56
ACTIVISION BLIZZARD INC	12,800	45.06	576,768.00
ADOBE SYSTEMS INC	10,989	109.03	1,198,130.67
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	4,220	59.07	249,275.40
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,275	203.90	259,972.50
ALPHABET INC-CL A	6,420	828.55	5,319,291.00
ALPHABET INC-CL C	6,782	807.67	5,477,617.94
ANSYS INC	2,090	91.12	190,440.80
AUTODESK INC	4,420	71.36	315,411.20
AUTOMATIC DATA PROCESSING	10,106	87.50	884,275.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	2,420	65.08	157,493.60
CA INC	6,760	32.41	219,091.60
CADENCE DESIGN SYS INC	6,170	25.50	157,335.00
CDK GLOBAL INC	2,720	54.35	147,832.00
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2,990	78.52	234,774.80
CITRIX SYSTEMS INC	3,628	84.90	308,017.20
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	13,218	50.64	669,359.52
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	4,720	46.99	221,792.80
EBAY INC	24,517	29.05	712,218.85
ELECTRONIC ARTS INC	6,504	82.94	539,441.76
FACEBOOK INC-A	50,630	132.29	6,697,842.70
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	6,925	75.56	523,253.00
FISERV INC	4,948	99.72	493,414.56
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,110	172.90	364,819.00
FORTINET INC	3,100	30.67	95,077.00
GARTNER INC	1,750	86.22	150,885.00
GLOBAL PAYMENTS INC	3,200	73.27	234,464.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	20,032	150.88	3,022,428.16
INTUIT INC	5,366	108.32	581,245.12
LINKEDIN CORP - A	2,540	189.30	480,822.00
MASTERCARD INC	21,360	102.88	2,197,516.80

MICROSOFT CORP	163,934	60.99	9,998,334.66
MOBILEYE NV	3,560	37.84	134,710.40
NETSUITE INC	850	100.75	85,637.50
NUANCE COMMUNICATIONS INC	5,800	13.76	79,808.00
ORACLE CORP	68,663	38.36	2,633,912.68
PAYCHEX INC	7,052	55.84	393,783.68
PAYPAL HOLDINGS INC	23,977	43.31	1,038,443.87
RED HAT INC	4,070	77.35	314,814.50
SABRE CORP	4,520	25.81	116,661.20
SALESFORCE.COM INC	14,140	75.06	1,061,348.40
SERVICENOW INC	3,630	79.79	289,637.70
SPLUNK INC	2,830	59.14	167,366.20
SYMANTEC CORP	13,905	24.99	347,485.95
SYNOPSYS INC	3,207	58.61	187,962.27
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,636	48.23	175,364.28
TWITTER INC	12,260	17.26	211,607.60
VANTIV INC - CL-A	3,730	57.58	214,773.40
VERISIGN INC	2,220	79.64	176,800.80
VISA INC-CLASS A SHARES	41,862	82.03	3,433,939.86
VMWARE INC	1,835	73.20	134,322.00
WESTERN UNION CO	10,451	20.36	212,782.36
WORKDAY INC-CLASS A	2,520	87.71	221,029.20
XEROX CORP	19,754	9.61	189,835.94
YAHOO! INC	20,475	42.55	871,211.25
ZILLOW GROUP INC - C	2,000	32.96	65,920.00
AMPHENOL CORP-CL A	6,450	65.19	420,475.50
APPLE INC	120,022	118.25	14,192,601.50
ARROW ELECTRONICS INC	2,310	62.58	144,559.80
AVNET INC	3,460	42.41	146,738.60
CDW CORP/DE	3,420	44.77	153,113.40
CISCO SYSTEMS INC	110,030	30.34	3,338,310.20
CORNING INC	24,328	22.97	558,814.16
F5 NETWORKS INC	1,445	117.22	169,382.90
FLEX LTD	12,536	13.54	169,737.44
FLIR SYSTEMS INC	3,195	29.37	93,837.15

HARRIS CORP	2,830	90.71	256,709.30
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	38,615	21.60	834,084.00
HP INC	38,615	13.90	536,748.50
JUNIPER NETWORKS INC	7,633	23.72	181,054.76
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3,395	74.16	251,773.20
NETAPP INC	7,006	34.00	238,204.00
PALO ALTO NETWORKS INC	1,900	149.82	284,658.00
SEAGATE TECHNOLOGY	6,974	34.27	238,998.98
TE CONNECTIVITY LTD	8,365	61.90	517,793.50
TRIMBLE INC	6,050	28.64	173,272.00
WESTERN DIGITAL CORP	6,048	53.63	324,354.24
AT&T INC	134,927	36.70	4,951,820.90
CENTURYLINK INC	12,616	28.45	358,925.20
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	25,774	4.11	105,931.14
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	6,500	46.90	304,850.00
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	2,580	115.13	297,035.40
SPRINT CORP	17,350	6.50	112,775.00
T-MOBILE US INC	6,372	49.60	316,051.20
VERIZON COMMUNICATIONS INC	89,487	47.84	4,281,058.08
AES CORP	13,728	12.02	165,010.56
ALLIANT ENERGY CORP	5,230	37.39	195,549.70
AMEREN CORPORATION	5,182	49.03	254,073.46
AMERICAN ELECTRIC POWER	10,698	63.46	678,895.08
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,095	72.64	297,460.80
ATMOS ENERGY CORP	2,360	72.14	170,250.40
CALPINE CORP	8,060	12.16	98,009.60
CENTERPOINT ENERGY INC	8,142	22.67	184,579.14
CMS ENERGY CORP	6,140	41.61	255,485.40
CONSOLIDATED EDISON INC	6,306	73.65	464,436.90
DOMINION RESOURCES INC/VA	13,457	73.40	987,743.80
DTE ENERGY COMPANY	3,698	93.99	347,575.02
DUKE ENERGY CORP	15,026	78.59	1,180,893.34
EDISON INTERNATIONAL	7,059	71.62	505,565.58
ENTERGY CORP	3,847	72.48	278,830.56
EVERSOURCE ENERGY	6,900	54.30	374,670.00

EXELON CORP	19,686	32.90	647,669.40
FIRSTENERGY CORP	8,995	33.62	302,411.90
NEXTERA ENERGY INC	10,055	125.52	1,262,103.60
NISOURCE INC	6,540	22.82	149,242.80
NRG ENERGY INC	7,670	10.95	83,986.50
OGE ENERGY CORP	4,680	30.69	143,629.20
P G & E CORP	10,581	60.79	643,218.99
PINNACLE WEST CAPITAL	2,199	75.20	165,364.80
PPL CORP	14,578	33.70	491,278.60
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	10,978	41.17	451,964.26
SCANA CORP	3,153	71.28	224,745.84
SEMPRA ENERGY	5,067	106.41	539,179.47
SOUTHERN CO	20,405	50.97	1,040,042.85
UGI CORP	3,500	45.23	158,305.00
WEC ENERGY GROUP INC	6,860	58.13	398,771.80
WESTAR ENERGY INC	2,880	57.08	164,390.40
XCEL ENERGY INC	11,524	40.48	466,491.52
ANALOG DEVICES INC	6,481	64.06	415,172.86
APPLIED MATERIALS INC	24,833	28.86	716,680.38
BROADCOM LTD	8,560	173.65	1,486,444.00
INTEL CORP	103,452	35.10	3,631,165.20
KLA-TENCOR CORPORATION	3,199	74.90	239,605.10
LAM RESEARCH CORP	3,247	98.08	318,465.76
LINEAR TECHNOLOGY CORP	4,954	60.32	298,825.28
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	9,254	13.16	121,782.64
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	5,850	40.03	234,175.50
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	4,614	60.91	281,038.74
MICRON TECHNOLOGY INC	23,297	17.54	408,629.38
NVIDIA CORP	11,505	71.87	826,864.35
NXP SEMICONDUCTORS NV	6,337	100.64	637,755.68
QORVO INC	3,100	56.33	174,623.00
QUALCOMM INC	32,462	67.71	2,198,002.02
SKYWORKS SOLUTIONS INC	4,200	78.08	327,936.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	22,022	71.20	1,567,966.40
XILINX INC	5,075	50.31	255,323.25

米ドル小計		6,893,699		414,172,484.33 (43,148,489,417)	
加ドル	ALTAGAS LTD	3,050	34.37	104,828.50	
	ARC RESOURCES LTD	7,925	23.96	189,883.00	
	CAMECO CORP	7,892	10.52	83,023.84	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	24,024	43.68	1,049,368.32	
	CENOVUS ENERGY INC	17,463	20.45	357,118.35	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	11,475	17.15	196,796.25	
	ENBRIDGE INC	19,985	58.05	1,160,129.25	
	ENCANA CORP	21,068	13.88	292,423.84	
	HUSKY ENERGY INC	6,873	15.39	105,775.47	
	IMPERIAL OIL LTD	6,942	43.90	304,753.80	
	INTER PIPELINE LTD	7,180	28.24	202,763.20	
	KEYERA CORP	4,120	41.18	169,661.60	
	PEMBINA PIPELINE CORP	7,915	41.39	327,601.85	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	3,680	35.40	130,272.00	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	5,320	29.99	159,546.80	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY -A	5,920	29.40	174,048.00	
	SUNCOR ENERGY INC	36,249	39.00	1,413,711.00	
	TOURMALINE OIL CORP	4,575	36.60	167,445.00	
	TRANSCANADA CORP	17,673	61.13	1,080,350.49	
	VERESEN INC	5,360	13.29	71,234.40	
	VERMILION ENERGY INC	2,640	54.05	142,692.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	4,695	66.24	310,996.80	
	AGRIUM INC	3,015	123.72	373,015.80	
	BARRICK GOLD CORP	26,114	22.57	589,392.98	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	610	242.15	147,711.50	
	ELDORADO GOLD CORP	14,630	4.81	70,370.30	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	14,710	12.15	178,726.50	
FRANCO-NEVADA CORP	3,805	86.65	329,703.25		
GOLDCORP INC	17,917	20.83	373,211.11		
KINROSS GOLD CORP	25,015	5.21	130,328.15		
METHANEX CORP	2,330	49.54	115,428.20		
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	17,917	22.22	398,115.74		
SILVER WHEATON CORP	9,395	32.41	304,491.95		

TECK RESOURCES LTD-CLS B	13,885	28.15	390,862.75
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	23,419	4.11	96,252.09
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,460	44.18	64,502.80
YAMANA GOLD INC	19,626	5.14	100,877.64
BOMBARDIER INC 'B'	34,746	1.80	62,542.80
CAE INC	6,315	18.61	117,522.15
FINNING INTERNATIONAL INC	2,845	24.77	70,470.65
SNC-LAVALIN GROUP INC	3,195	54.00	172,530.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	17,148	87.67	1,503,365.16
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,125	196.37	613,656.25
MAGNA INTERNATIONAL INC	8,378	54.13	453,501.14
GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,400	34.39	185,706.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	4,948	59.46	294,208.08
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	9,685	26.35	255,199.75
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,560	129.91	202,659.60
DOLLARAMA INC	2,510	101.18	253,961.80
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	9,120	67.30	613,776.00
EMPIRE CO LTD 'A'	3,000	19.30	57,900.00
LOBLAW COMPANIES LTD	4,989	66.15	330,022.35
METRO INC	5,790	41.73	241,616.70
WESTON (GEORGE) LTD	1,182	107.74	127,348.68
SAPUTO INC	5,040	46.70	235,368.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	6,734	29.43	198,181.62
BANK OF MONTREAL	13,961	86.10	1,202,042.10
BANK OF NOVA SCOTIA	26,129	71.81	1,876,323.49
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	8,295	100.52	833,813.40
NATIONAL BANK OF CANADA	7,340	46.67	342,557.80
ROYAL BANK OF CANADA	32,539	83.48	2,716,355.72
TORONTO-DOMINION BANK	40,690	60.32	2,454,420.80
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	18,933	47.32	895,909.56
CI FINANCIAL CORP	5,550	24.26	134,643.00
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	7,180	13.06	93,770.80
IGM FINANCIAL INC	2,535	35.66	90,398.10
ONEX CORPORATION	1,905	84.56	161,086.80
THOMSON REUTERS CORP	8,044	52.66	423,597.04

	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	490	704.50	345,205.00	
	GREAT-WEST LIFECO INC	5,974	33.71	201,383.54	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	1,735	50.72	87,999.20	
	INTACT FINANCIAL CORP	2,485	91.20	226,632.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	43,001	19.39	833,789.39	
	POWER CORP OF CANADA	7,800	28.71	223,938.00	
	POWER FINANCIAL CORP	5,715	31.67	180,994.05	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	13,374	43.97	588,054.78	
	CGI GROUP INC - CL A	4,650	63.44	294,996.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	420	582.04	244,456.80	
	OPEN TEXT CORP	3,070	84.78	260,274.60	
	BLACKBERRY LTD	10,328	9.72	100,388.16	
	BCE INC	2,930	60.57	177,470.10	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	8,355	53.40	446,157.00	
	TELUS CORP	4,366	42.91	187,345.06	
	ATCO LTD -CLASS I	1,920	45.71	87,763.20	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,590	36.86	95,467.40	
	FORTIS INC	8,595	43.37	372,765.15	
	HYDRO ONE LTD	3,450	24.45	84,352.50	
	加ドル小計	865,931		34,111,301.79 (2,661,022,652)	
ユーロ	ENI SPA	54,006	13.68	738,802.08	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	9,315	12.75	118,766.25	
	NESTE OYJ	2,740	38.50	105,490.00	
	OMV AG	3,490	28.36	98,993.85	
	REPSOL SA	24,709	12.95	319,981.55	
	SAIPEM SPA	123,510	0.41	51,688.93	
	TECHNIP SA	2,468	60.77	149,980.36	
	TENARIS SA	9,355	13.45	125,824.75	
	TOTAL SA	48,847	44.46	2,171,737.62	
	VOPAK	1,270	46.67	59,270.90	
	AIR LIQUIDE SA	8,408	93.99	790,267.92	
	AKZO NOBEL	5,898	59.27	349,574.46	
	ARCELORMITTAL	38,948	6.28	244,866.07	
	ARKEMA	1,615	86.52	139,729.80	

BASF SE	20,025	80.44	1,610,811.00
COVESTRO AG	1,350	52.10	70,335.00
CRH PLC	19,090	30.14	575,372.60
EVONIK INDUSTRIES AG	3,580	27.72	99,237.60
FUCHS PETROLUB SE-PRF	1,720	41.04	70,588.80
HEIDELBERGCEMENT AG	3,245	85.61	277,804.45
IMERYS SA	830	67.78	56,257.40
K+S AG	3,880	18.31	71,062.20
KONINKLIJKE DSM NV	3,842	61.26	235,360.92
LANXESS AG	1,935	58.63	113,449.05
LINDE AG	4,105	147.35	604,871.75
OCI NV	2,000	12.77	25,540.00
SOLVAY SA	1,581	105.40	166,637.40
STORA ENSO OYJ-R SHS	12,085	8.62	104,233.12
SYMRISE AG	2,640	62.29	164,445.60
THYSSENKRUPP AG	7,415	21.91	162,462.65
UMICORE	2,120	55.85	118,402.00
UPM-KYMMENE OYJ	12,618	21.02	265,230.36
VOESTALPINE AG	2,509	32.65	81,918.85
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4,176	27.24	113,775.12
AIRBUS GROUP SE	12,608	53.39	673,141.12
ALSTOM	3,590	23.73	85,190.70
ANDRITZ AG	1,980	49.21	97,445.70
BOSKALIS WESTMINSTER	1,695	30.95	52,468.72
BOUYGUES SA	4,210	30.22	127,226.20
BRENTAG AG	3,765	48.47	182,508.37
CNH INDUSTRIAL NV	22,370	6.97	156,030.75
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	10,566	39.30	415,243.80
EIFFAGE	1,130	68.09	76,941.70
FERROVIAL SA	9,975	18.68	186,333.00
GEA GROUP AG	3,940	37.06	146,016.40
HOCHTIEF AG	440	125.95	55,418.00
KONE OYJ-B	7,424	43.67	324,206.08
KONINKLIJKE PHILIPS NV	19,861	27.30	542,304.60
LEGRAND SA	5,628	51.86	291,868.08

LEONARDO-FINMECCANICA SPA	9,630	10.98	105,737.40
MAN SE	824	92.94	76,582.56
METSO OYJ	2,420	24.72	59,822.40
OSRAM LICHT AG	1,962	52.89	103,770.18
PRYSMIAN SPA	5,185	22.97	119,099.45
REXEL SA	7,240	12.87	93,178.80
SAFRAN SA	6,790	62.75	426,072.50
SCHNEIDER ELECTRIC SE	11,908	62.40	743,059.20
SIEMENS AG-REG	16,826	106.75	1,796,175.50
THALES SA	2,345	84.92	199,137.40
VINCI SA	10,950	67.48	738,906.00
WARTSILA OYJ ABP	3,290	39.32	129,362.80
ZARDOYA OTIS SA	4,418	7.79	34,416.22
ZODIAC AEROSPACE	4,550	21.99	100,054.50
BUREAU VERITAS SA	5,650	17.52	99,016.25
EDENRED	3,906	21.65	84,564.90
RANDSTAD HOLDING NV	2,865	46.91	134,411.47
RELX NV	20,559	15.36	315,786.24
SOCIETE BIC SA	735	126.80	93,198.00
WOLTERS KLUWER	6,927	35.60	246,601.20
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	13,091	13.65	178,692.15
ADP	650	90.28	58,682.00
AENA SA	1,490	135.95	202,565.50
ATLANTIA SPA	9,360	22.78	213,220.80
BOLLORE	20,400	3.00	61,200.00
DEUTCHE LUFTHANSA	5,680	11.47	65,178.00
DEUTSCHE POST AG-REG	20,993	28.20	592,002.60
FRAPORT AG	980	54.15	53,067.00
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	8,760	8.67	75,984.24
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	16,992	4.46	75,903.26
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	7,155	79.63	569,752.65
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,190	69.00	82,110.00
CONTINENTAL AG	2,345	174.50	409,202.50
DAIMLER AG	21,012	64.88	1,363,258.56
FERRARI NV	3,164	48.52	153,517.28

FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	19,647	5.95	116,899.65
MICHELIN (CGDE)-B	4,149	98.93	410,460.57
NOKIAN RENKAAT OYJ	2,915	30.94	90,190.10
PEUGEOT SA	9,800	13.29	130,242.00
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	3,490	48.76	170,172.40
RENAULT SA	4,117	76.71	315,815.07
SCHAEFFLER AG-PRF	3,550	13.78	48,936.75
VALEO SA	4,860	53.32	259,135.20
VOLKSWAGEN AG	771	134.80	103,930.80
VOLKSWAGEN AG-PFD	4,003	126.90	507,980.70
ADIDAS AG	4,141	152.70	632,330.70
CHRISTIAN DIOR SE	1,310	175.25	229,577.50
HERMES INTERNATIONAL	652	368.35	240,164.20
HUGO BOSS AG -ORD	1,490	53.94	80,370.60
KERING	1,827	188.40	344,206.80
LUXOTTICA GROUP SPA	3,976	44.50	176,932.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	6,094	166.90	1,017,088.60
ACCOR SA	4,136	34.60	143,105.60
PADDY POWER BETFAIR PLC	1,800	95.00	171,000.00
SODEXO	1,970	104.00	204,880.00
ALTICE NV -A	8,340	17.11	142,697.40
ALTICE NV -B	1,940	17.24	33,455.30
AXEL SPRINGER SE	995	45.11	44,884.45
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	17.40	66,033.00
JC DECAUX SA	1,950	27.38	53,400.75
LAGARDERE S.C.A.	2,980	22.43	66,856.30
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	4,805	39.04	187,587.20
PUBLICIS GROUPE	4,075	61.16	249,227.00
RTL GROUP	920	70.55	64,906.00
SES	8,600	19.21	165,249.00
TELENET GROUP HOLDING NV	1,240	48.25	59,830.00
VIVENDI	25,330	18.26	462,525.80
INDITEX	24,265	32.57	790,311.05
ZALANDO SE	1,700	40.22	68,382.50
CARREFOUR SA	12,213	24.28	296,531.64

CASINO GUICHARD PERRACHON	1,344	46.38	62,334.72
COLRUYT SA	1,375	49.15	67,581.25
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	11,008	5.11	56,261.88
JERONIMO MARTINS	5,075	15.94	80,895.50
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	28,248	20.63	582,897.48
METRO AG	4,140	27.60	114,264.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	17,611	113.75	2,003,251.25
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	4,910	34.44	169,100.40
DANONE	13,044	62.94	820,989.36
HEINEKEN HOLDING NV	2,125	73.27	155,698.75
HEINEKEN NV	5,033	79.00	397,607.00
KERRY GROUP PLC-A	3,380	68.36	231,056.80
PERNOD-RICARD SA	4,646	107.75	500,606.50
REMY COINTREAU	470	75.79	35,621.30
BEIERSDORF AG	2,015	80.30	161,804.50
HENKEL AG & CO KGAA	2,190	100.40	219,876.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	3,953	117.80	465,663.40
L'OREAL	5,526	165.65	915,381.90
UNILEVER NV-CVA	35,715	39.03	1,394,135.02
ESSILOR INTERNATIONAL	4,465	101.95	455,206.75
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	4,683	74.35	348,181.05
FRESENIUS SE & CO KGAA	9,065	68.44	620,408.60
BAYER AG	18,120	91.50	1,657,980.00
GRIFOLS SA	6,820	18.34	125,112.90
MERCK KGAA	2,930	95.85	280,840.50
ORION OYJ-CLASS B	2,590	37.20	96,348.00
QIAGEN N.V.	5,145	23.13	119,029.57
SANOFI	25,516	68.52	1,748,356.32
UCB SA	2,798	64.77	181,226.46
ABN AMRO GROUP NV-CVA	4,670	20.45	95,501.50
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	142,393	6.30	897,360.68
BANCO DE SABADELL SA	109,692	1.23	135,469.62
BANCO POPULAR ESPANOL	75,856	1.11	84,200.16
BANCO SANTANDER SA	315,079	4.44	1,399,265.83
BANK OF IRELAND	558,550	0.19	107,241.60

BANKIA SA	95,000	0.80	76,190.00
BANKINTER SA	13,960	6.89	96,282.12
BNP PARIBAS	23,142	52.82	1,222,360.44
CAIXABANK S.A	68,530	2.71	185,716.30
COMMERZBANK AG	23,524	6.16	144,931.36
CREDIT AGRICOLE SA	21,992	9.89	217,676.81
ERSTE GROUP BANK AG	6,438	29.02	186,830.76
ING GROEP NV-CVA	85,185	11.95	1,017,960.75
INTESA SANPAOLO	292,263	2.15	629,534.50
KBC GROEP NV	5,519	53.71	296,425.49
MEDIOBANCA SPA	11,670	6.80	79,356.00
NATIXIS	22,980	4.59	105,501.18
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	2,770	15.14	41,937.80
SOCIETE GENERALE	17,659	35.82	632,545.38
UBI BANCA SCPA	22,584	2.52	57,092.35
UNICREDIT SPA	110,353	2.30	253,811.90
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	30,335	13.14	398,753.57
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	4,000	70.13	280,520.00
EURAZEO	958	52.55	50,342.90
EXOR SPA	2,944	38.15	112,313.60
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,882	79.45	149,524.90
WENDEL	750	104.80	78,600.00
AEGON NV	38,139	3.95	150,954.16
AGEAS	4,044	33.57	135,777.30
ALLIANZ SE-REG	9,948	143.00	1,422,564.00
ASSICURAZIONI GENERALI	25,868	12.06	311,968.08
AXA	42,162	20.76	875,283.12
CNP ASSURANCES	3,530	15.69	55,385.70
HANNOVER RUECK SE-REG	1,355	101.25	137,193.75
MAPFRE SA	20,814	2.65	55,157.10
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,646	178.65	651,357.90
NN GROUP NV	7,180	27.89	200,250.20
POSTE ITALIANE SPA	10,260	6.14	63,047.70
SAMPO OYJ-A SHS	9,639	42.04	405,223.56
SCOR SE	3,152	29.78	93,866.56

UNIPOLSAI SPA	18,580	1.69	31,418.78
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	7,500	30.57	229,312.50
IMMOEAST AG-TEMPORARY	16,150	-	-
IMMOFINANZ AG-TEMPORARY	13,000	-	-
VONOVIA SE	10,088	32.93	332,248.28
AMADEUS IT GROUP SA	9,610	43.22	415,392.25
ATOS SE	2,060	95.65	197,039.00
CAP GEMINI SA	3,639	82.64	300,726.96
DASSAULT SYSTEMES SA	2,790	71.28	198,871.20
GEMALTO	1,850	55.47	102,619.50
SAP SE	21,622	81.07	1,752,895.54
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2,930	38.03	111,427.90
INGENICO GROUP	1,160	76.21	88,403.60
NOKIA OYJ	126,056	4.53	571,033.68
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	70,416	15.14	1,066,098.24
ELISA OYJ	2,505	32.10	80,410.50
ILIAD SA	520	187.40	97,448.00
KONINKLIJKE KPN NV	75,066	2.93	220,468.84
ORANGE S.A.	43,324	14.66	635,346.46
PROXIMUS	3,780	26.43	99,905.40
SFR GROUP SA	2,250	25.00	56,250.00
TELECOM ITALIA SPA	239,753	0.79	191,442.77
TELECOM ITALIA-RSP	125,887	0.65	82,078.32
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16,000	3.66	58,672.00
TELEFONICA SA	98,419	9.22	908,308.95
E.ON SE	44,099	6.67	294,449.02
EDF	6,075	9.98	60,628.50
ENAGAS	5,680	25.84	146,771.20
ENDESA SA	6,840	19.09	130,609.80
ENEL SPA	167,087	3.90	652,975.99
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	54,991	3.00	165,467.91
ENGIE	32,514	13.21	429,672.51
FORTUM OYJ	9,825	15.36	150,912.00
GAS NATURAL SDG SA	7,722	17.74	136,988.28
IBERDROLA SA	117,842	6.17	727,792.19

	INNOGY SE	2,850	37.50	106,875.00	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	10,440	19.09	199,351.80	
	RWE AG	10,685	14.09	150,551.65	
	SNAM SPA	59,470	4.82	286,764.34	
	SUEZ	6,199	14.07	87,250.92	
	TERNA SPA	34,477	4.40	151,905.66	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	9,184	19.80	181,843.20	
	ASML HOLDING NV	7,962	95.87	763,316.94	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	24,715	16.04	396,428.60	
	STMICROELECTRONICS NV	12,733	7.24	92,263.31	
ユーロ小計		5,035,295		72,663,331.05 (8,233,482,041)	
英ポンド	BP PLC	408,298	4.95	2,021,687.54	
	PETROFAC LTD	5,025	9.05	45,476.25	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	93,768	20.83	1,953,656.28	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	82,039	21.82	1,790,501.17	
	ANGLO AMERICAN PLC	30,274	11.14	337,252.36	
	ANTOFAGASTA PLC	8,730	5.40	47,185.65	
	BHP BILLITON PLC	45,961	12.61	579,568.21	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	2,751	35.91	98,788.41	
	FRESNILLO PLC	5,160	16.43	84,778.80	
	GLENCORE PLC	266,823	2.46	656,784.81	
	JOHNSON MATTHEY PLC	4,199	34.50	144,865.50	
	MONDI PLC	7,400	16.22	120,028.00	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	2,250	72.00	162,000.00	
	RIO TINTO PLC	27,025	27.96	755,619.00	
	ASHTREAD GROUP PLC	10,920	13.05	142,506.00	
	BAE SYSTEMS PLC ORD	69,635	5.40	376,377.17	
	BUNZL PLC	7,276	22.25	161,891.00	
	COBHAM PLC	34,837	1.45	50,827.18	
	DCC PLC	1,810	67.05	121,360.50	
	IMI PLC	6,116	10.09	61,710.44	
	MEGGITT PLC	13,905	4.30	59,819.31	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	43,425	7.39	320,910.75	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C(N)	1,997,550	0.00	1,997.55	

SMITHS GROUP PLC	8,813	14.47	127,524.11
TRAVIS PERKINS PLC	5,800	13.46	78,068.00
WEIR GROUP PLC/THE	3,880	17.39	67,473.20
WOLSELEY PLC	5,594	44.13	246,863.22
AGGREKO PLC	6,006	8.18	49,129.08
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,275	10.12	63,503.00
CAPITA PLC	15,309	6.06	92,849.08
EXPERIAN PLC	20,558	15.64	321,527.12
G4S PLC	34,639	2.27	78,665.16
INTERTEK GROUP PLC	3,545	34.39	121,912.55
RELX PLC	23,666	14.59	345,286.94
EASYJET PLC	3,840	9.25	35,520.00
ROYAL MAIL PLC	19,950	4.89	97,615.35
GKN PLC	33,065	3.13	103,791.03
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	22,900	4.69	107,401.00
BERKELEY GROUP HOLDINGS	2,600	23.57	61,282.00
BURBERRY GROUP PLC	10,304	14.60	150,438.40
PERSIMMON PLC	7,000	16.93	118,510.00
TAYLOR WIMPEY PLC	73,610	1.42	105,115.08
CARNIVAL PLC	4,400	37.79	166,276.00
COMPASS GROUP PLC	36,617	14.70	538,269.90
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	4,031	31.59	127,339.29
MERLIN ENTERTAINME	15,550	4.57	71,063.50
TUI AG-DI	11,263	10.29	115,896.27
WHITBREAD PLC	4,140	36.99	153,138.60
WILLIAM HILL PLC	18,010	2.89	52,102.93
ITV PLC	77,235	1.70	131,531.20
PEARSON PLC	17,749	7.46	132,496.28
SKY PLC	23,224	8.07	187,533.80
WPP PLC	28,904	17.04	492,524.16
DIXONS CARPHONE PLC	22,000	3.23	71,060.00
KINGFISHER PLC	50,397	3.58	180,572.45
MARKS & SPENCER GROUP PLC	34,970	3.34	116,939.68
NEXT PLC	2,987	47.20	140,986.40
SAINSBURY (J) PLC	44,761	2.40	107,515.92

TESCO PLC	177,834	2.10	373,718.15
WM MORRISON SUPERMARKETS	49,255	2.28	112,301.40
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	7,795	24.40	190,198.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	40,807	47.18	1,925,478.29
COCA-COLA HBC AG-CDI	5,000	18.23	91,150.00
DIAGEO PLC	55,192	22.03	1,216,155.72
IMPERIAL BRANDS PLC	21,062	39.19	825,525.09
TATE & LYLE PLC	10,510	7.79	81,925.45
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	13,925	72.47	1,009,144.75
UNILEVER PLC	28,167	34.77	979,507.42
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	7,000	9.03	63,245.00
SMITH & NEPHEW PLC	19,376	12.08	234,062.08
ASTRAZENECA PLC	27,713	48.11	1,333,410.99
GLAXOSMITHKLINE PLC	106,671	16.29	1,738,203.94
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2,860	18.42	52,681.20
SHIRE PLC	19,725	48.92	965,045.62
BARCLAYS PLC	364,051	1.83	668,761.68
HSBC HOLDINGS PLC	435,221	6.26	2,725,789.12
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,410,966	0.55	780,969.68
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	79,530	1.92	152,936.19
STANDARD CHARTERED PLC	72,250	7.05	509,651.50
3I GROUP PLC	20,499	6.64	136,113.36
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	22,730	3.20	72,758.73
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,720	11.67	66,752.40
ICAP PLC	12,270	4.86	59,681.28
INVESTEC PLC	13,185	5.02	66,188.70
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	6,577	28.90	190,075.30
PROVIDENT FINANCIAL PLC	3,310	30.87	102,179.70
SCHRODERS PLC	2,971	28.57	84,881.47
ADMIRAL GROUP PLC	4,925	19.58	96,431.50
AVIVA PLC	89,285	4.48	400,443.22
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	29,333	3.51	103,046.82
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	127,081	2.08	265,090.96
OLD MUTUAL PLC	104,159	2.01	209,567.90
PRUDENTIAL PLC	56,542	14.02	793,001.55

	RSA INSURANCE GROUP PLC	24,738	5.59	138,409.11	
	ST JAMES'S PLACE PLC	11,000	9.64	106,040.00	
	STANDARD LIFE PLC	40,716	3.39	138,352.96	
	AUTO TRADER GROUP PLC	23,390	3.77	88,203.69	
	SAGE GROUP PLC/THE	24,400	7.25	176,900.00	
	WORLDPAY GROUP PLC	42,180	2.81	118,905.42	
	BT GROUP PLC	183,192	3.87	710,235.38	
	INMARSAT PLC	10,010	6.95	69,569.50	
	VODAFONE GROUP PLC	581,048	2.26	1,313,168.48	
	CENTRICA PLC	119,035	2.15	256,877.53	
	NATIONAL GRID PLC	82,285	10.57	870,163.87	
	SEVERN TRENT PLC	5,493	23.25	127,712.25	
	SSE PLC	21,427	15.79	338,332.33	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	16,215	9.34	151,529.17	
英債券小計		8,517,395		38,533,786.43 (4,884,542,767)	
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	220	502.00	110,440.00	
	GIVAUDAN-REG	203	1,930.00	391,790.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	9,939	53.65	533,227.35	
	SIKA AG-BR	47	4,515.00	212,205.00	
	SYNGENTA AG-REG	2,108	403.00	849,524.00	
	ABB LTD-REG	42,515	22.00	935,330.00	
	GEBERIT AG-REG	805	422.00	339,710.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	360	184.10	66,276.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,090	186.00	202,740.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	3,557	58.80	209,151.60	
	SGS SA-REG	133	2,112.00	280,896.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,150	135.00	155,250.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	11,809	65.15	769,356.35	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	680	308.80	209,984.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,350	59.00	79,650.00	
	DUFREY AG-REG	1,050	120.40	126,420.00	
	ARYZTA AG	2,110	43.30	91,363.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	45	1,258.00	56,610.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	25	5,155.00	128,875.00	

	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	61,890.00	123,780.00	
	NESTLE SA-REG	69,893	72.10	5,039,285.30	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,160	134.00	155,440.00	
	ACTELION LTD-REG	2,310	144.00	332,640.00	
	GALENICA AG-REG	70	984.50	68,915.00	
	LONZA GROUP AG-REG	1,250	177.30	221,625.00	
	NOVARTIS AG-REG	49,003	72.55	3,555,167.65	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	15,428	228.20	3,520,669.60	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	41,158	13.67	562,629.86	
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,210	40.68	211,942.80	
	PARGESA HOLDING SA-BR	655	66.80	43,754.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	370	502.50	185,925.00	
	UBS GROUP AG-REG	79,852	13.69	1,093,173.88	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,080	119.40	128,952.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	640	257.60	164,864.00	
	SWISS RE AG	7,439	93.05	692,198.95	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,301	259.40	856,279.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,840	82.15	151,156.00	
	SWISSCOM AG-REG	584	457.70	267,296.80	
	スイスフラン小計	360,441		23,124,493.54 (2,420,440,738)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	4,320	165.30	714,096.00	
	BOLIDEN AB	7,260	206.80	1,501,368.00	
	ALFA LAVAL AB	6,930	127.20	881,496.00	
	ASSA ABLOY AB-B	20,910	165.20	3,454,332.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	15,185	267.00	4,054,395.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	8,620	239.50	2,064,490.00	
	SANDVIK AB	21,690	100.60	2,182,014.00	
	SKANSKA AB-B SHS	7,170	205.10	1,470,567.00	
	SKF AB-B SHARES-B	8,909	149.90	1,335,459.10	
	VOLVO AB-B SHS-B	33,960	95.70	3,249,972.00	
	SECURITAS AB-B SHS	7,249	142.60	1,033,707.40	
	ELECTROLUX AB - B	5,455	206.40	1,125,912.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	8,480	69.65	590,632.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	20,568	254.70	5,238,669.60	

	ICA GRUPPEN AB	1,450	275.60	399,620.00	
	SWEDISH MATCH AB	4,860	304.30	1,478,898.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	13,015	252.20	3,282,383.00	
	GETINGE AB-B SHS	4,450	151.70	675,065.00	
	NORDEA BANK AB	64,688	92.65	5,993,343.20	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	31,870	92.15	2,936,820.50	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	32,620	125.30	4,087,286.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	19,900	211.20	4,202,880.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,400	160.70	707,080.00	
	INVESTOR AB-B SHS	10,175	325.50	3,311,962.50	
	KINNEVIK AB - B	5,505	231.60	1,274,958.00	
	ERICSSON LM-B SHS	64,235	44.55	2,861,669.25	
	HEXAGON AB-B SHS	5,930	369.00	2,188,170.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,370	429.90	588,963.00	
	TELE2 AB-B SHS	6,255	78.50	491,017.50	
	TELIA CO AB	53,480	37.01	1,979,294.80	
スウェーデンクローナ小計		500,909		65,356,520.85	(762,057,033)
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	24,664	137.30	3,386,367.20	
	NORSK HYDRO A S	30,900	36.71	1,134,339.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	3,780	290.50	1,098,090.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	2,400	188.20	451,680.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	1,650	200.10	330,165.00	
	MARINE HARVEST	7,720	150.70	1,163,404.00	
	ORKLA ASA	19,380	79.65	1,543,617.00	
	DNB ASA	22,215	116.60	2,590,269.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,200	158.30	664,860.00	
	TELENOR ASA	17,305	139.80	2,419,239.00	
ノルウェークローネ小計		134,214		14,782,030.20	(185,957,939)
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,890	386.60	730,674.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	4,865	286.00	1,391,390.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	4,690	542.00	2,541,980.00	
	ISS A/S	3,100	269.30	834,830.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	90	9,795.00	881,550.00	

	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	138	10,250.00	1,414,500.00	
	DSV A/S	4,320	335.00	1,447,200.00	
	PANDORA A/S	2,500	895.00	2,237,500.00	
	CARLSBERG AS-B	2,390	619.50	1,480,605.00	
	COLOPLAST-B	2,545	481.90	1,226,435.50	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	3,000	129.40	388,200.00	
	GENMAB A/S	1,280	1,114.00	1,425,920.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	41,685	276.90	11,542,576.50	
	DANSKE BANK A/S	14,975	211.90	3,173,202.50	
	TRYG A/S	2,575	133.20	342,990.00	
	TDC A/S	14,545	37.41	544,128.45	
	デンマーククロネ小計	104,588		31,603,681.95 (481,324,076)	
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	5,335	30.82	164,424.70	
	OIL SEARCH LTD	36,460	6.98	254,490.80	
	ORIGIN ENERGY LTD	41,910	5.59	234,276.90	
	SANTOS LTD	37,665	3.70	139,360.50	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	16,528	28.91	477,824.48	
	ALUMINA LTD	46,512	1.60	74,419.20	
	AMCOR LIMITED	26,490	15.08	399,469.20	
	BHP BILLITON LTD	70,216	23.19	1,628,309.04	
	BORAL LTD	17,115	6.69	114,499.35	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	29,665	5.44	161,377.60	
	INCITEC PIVOT LTD	31,550	2.93	92,441.50	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	10,985	20.74	227,828.90	
	NEWCREST MINING LTD	17,209	21.90	376,877.10	
	ORICA LIMITED	6,935	16.48	114,288.80	
	RIO TINTO LTD	9,978	52.48	523,645.44	
	SOUTH32 LTD	117,667	2.64	310,640.88	
	CIMIC GROUP LTD	1,867	30.46	56,868.82	
	BRAMBLES LTD	35,548	11.98	425,865.04	
	SEEK LTD	8,040	15.33	123,253.20	
	AURIZON HOLDINGS LTD	46,150	4.90	226,135.00	
	QANTAS AIRWAYS LTD	13,113	3.17	41,568.21	
	SYDNEY AIRPORT	24,156	6.60	159,429.60	

TRANSURBAN GROUP	43,195	10.84	468,233.80
ARISTOCRAT LEISURE LTD	12,510	15.55	194,530.50
CROWN RESORTS LTD	6,745	10.70	72,171.50
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,180	66.26	78,186.80
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	970	34.67	33,629.90
TABCORP HOLDINGS LTD	15,336	4.91	75,299.76
TATTS GROUP LTD	37,700	4.14	156,078.00
REA GROUP LTD	1,150	51.00	58,650.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	14,370	5.31	76,304.70
WESFARMERS LTD	24,485	43.96	1,076,360.60
WOOLWORTHS LTD	27,662	25.25	698,465.50
COCA-COLA AMATIL LTD	10,650	9.66	102,879.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	15,946	11.45	182,581.70
COCHLEAR LTD	1,277	127.85	163,264.45
HEALTHSCOPE LTD	44,380	2.28	101,186.40
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,935	72.45	212,640.75
SONIC HEALTHCARE LTD	9,830	21.32	209,575.60
CSL LTD	10,012	102.98	1,031,035.76
AUST AND NZ BANKING GROUP	63,819	28.52	1,820,117.88
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	8,120	11.41	92,649.20
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	10,478	11.18	117,144.04
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	37,567	75.23	2,826,165.41
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	58,163	27.80	1,616,931.40
WESTPAC BANKING CORP	73,131	30.90	2,259,747.90
AMP LTD	62,647	5.27	330,149.69
ASX LTD	4,995	47.73	238,411.35
CHALLENGER LTD	9,950	10.51	104,574.50
MACQUARIE GROUP LTD	6,754	82.81	559,298.74
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	50,298	5.67	285,189.66
MEDIBANK PRIVATE LTD	62,000	2.63	163,060.00
QBE INSURANCE GROUP LTD	29,380	10.33	303,495.40
SUNCORP GROUP LTD	29,020	12.53	363,620.60
COMPUTERSHARE LTD	11,490	10.64	122,253.60
TELSTRA CORPORATION LTD	93,164	5.05	470,478.20
TPG TELECOM LTD	7,200	7.45	53,640.00

	VOCUS COMMUNICATIONS LTD	12,010	5.89	70,738.90	
	AGL ENERGY LTD	15,301	19.28	295,003.28	
	AUSNET SERVICES	40,750	1.49	60,921.25	
	DUET GROUP	54,050	2.33	125,936.50	
豪ドル小計		1,671,714		23,597,896.48	(1,889,719,550)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	17,130	10.21	174,897.30	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	24,545	6.89	169,115.05	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	8,500	8.57	72,845.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	45,157	3.58	161,662.06	
	CONTACT ENERGY LIMITED	19,340	4.80	92,832.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	28,000	2.55	71,400.00	
ニュージーランドドル小計		142,672		742,751.41	(55,401,827)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	58,208	98.50	5,733,488.00	
	NWS HOLDINGS LTD	28,500	13.58	387,030.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	25,000	10.50	262,500.00	
	MTR CORP	34,000	43.70	1,485,800.00	
	LI & FUNG LTD	138,000	3.93	542,340.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	29,000	29.85	865,650.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	14,500	29.05	421,225.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	50,000	31.45	1,572,500.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	16,800	13.14	220,752.00	
	SANDS CHINA LTD	49,800	35.05	1,745,490.00	
	SJM HOLDINGS LTD	48,000	5.62	269,760.00	
	WYNN MACAU LTD	35,800	12.20	436,760.00	
	WH GROUP LTD	153,500	7.03	1,079,105.00	
	BANK OF EAST ASIA	21,640	32.05	693,562.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	77,000	27.90	2,148,300.00	
	HANG SENG BANK LTD	16,300	142.70	2,326,010.00	
	FIRST PACIFIC CO	44,250	5.82	257,535.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	24,500	208.60	5,110,700.00	
	AIA GROUP LTD	264,200	53.00	14,002,600.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	60,208	55.45	3,338,533.60	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	57,000	17.80	1,014,600.00		

	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	26,842	46.45	1,246,810.90	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	15,000	36.70	550,500.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	11,450	24.95	285,677.50	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	134,666	9.85	1,326,460.10	
	SINO LAND CO	63,050	13.40	844,870.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	33,480	115.90	3,880,332.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	13,017	83.00	1,080,411.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	23,200	22.85	530,120.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	27,800	58.00	1,612,400.00	
	WHEELOCK & CO LTD	19,600	48.25	945,700.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	67,000	11.00	737,000.00	
	PCCW LTD	80,000	4.75	380,000.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	15,000	63.90	958,500.00	
	CLP HOLDINGS LTD	38,000	78.70	2,990,600.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	56,000	7.61	426,160.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	179,925	15.04	2,706,072.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS	32,500	73.15	2,377,375.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	4,200	71.70	301,140.00	
香港ドル小計		2,086,936		67,094,369.10 (901,077,377)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	34,660	5.34	185,084.40	
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	21,000	2.55	53,550.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,000	3.19	105,270.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,000	2.67	122,820.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	12,800	10.27	131,456.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	156,500	0.77	120,505.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	32,550	3.81	124,015.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,000	42.78	85,560.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	130,000	0.40	52,000.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	44,700	3.37	150,639.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	36,715	15.06	552,927.90	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	68,240	8.65	590,276.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	29,200	18.91	552,172.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	20,000	7.24	144,800.00	
	CAPITALAND LTD	68,600	3.16	216,776.00	

	CITY DEVELOPMENTS LTD	10,000	8.78	87,800.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	60,000	1.82	109,200.00	
	UOL GROUP LTD	12,250	5.79	70,927.50	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	172,180	3.92	674,945.60	
シンガポールドル小計		990,395		4,130,724.90	(309,763,060)
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	9,770	14.20	138,734.00	
	TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	20,080	167.80	3,369,424.00	
	BANK HAPOLIM BM	27,725	22.30	618,267.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	36,465	14.93	544,422.45	
	NICE LTD	1,385	256.90	355,806.50	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	48,790	7.07	344,945.30	
イスラエルシュケル小計		144,215		5,371,599.75	(145,409,205)
合 計		27,448,404		66,078,687,682	(66,078,687,682)

(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	出資金	PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A-LP	5,400.00	71,280.00	
	出資金小計		5,400.00	71,280.00	(7,425,950)
	投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	7,010	141,461.80	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	1,490	159,936.60	
		AMERICAN TOWER CORP	9,269	1,082,155.75	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	20,020	207,607.40	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,085	514,793.95	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,417	428,252.61	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	7,800	208,104.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,940	153,725.60	
		CROWN CASTLE INTL CORP	7,430	697,974.20	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,235	313,471.50	

		DUKE REALTY CORPORATION	6,875	178,750.00	
		EQUINIX INC	1,478	551,619.16	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	7,980	481,752.60	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,400	286,468.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	2,800	210,784.00	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,415	209,207.75	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	12,545	326,797.25	
		HCP INC	10,125	360,348.75	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	16,589	255,470.60	
		IRON MOUNTAIN INC	5,515	188,888.75	
		KIMCO REALTY CORPORATION	8,795	243,357.65	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	124,831.30	
		MACERICH CO/THE	2,870	219,669.80	
		MID AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	1,500	139,200.00	
		PROLOGIS INC	11,402	600,201.28	
		PUBLIC STORAGE	3,209	681,431.15	
		REALTY INCOME CORP	5,400	336,420.00	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	2,355	173,445.75	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	6,814	1,344,197.78	
		SL GREEN REALTY CORP	2,260	227,130.00	
		UDR INC	5,820	195,202.80	
		VENTAS INC	7,285	501,208.00	
		VEREIT INC	24,234	234,585.12	
		VORNADO REALTY TRUST	3,811	359,148.64	
		WELLTOWER INC	7,680	545,049.60	
		WEYERHAEUSER CO	16,498	513,912.70	
		投資証券小計	244,464	13,396,561.84	(1,395,653,812)
		米ドル小計	249,864	13,467,841.84	(1,403,079,762)
加ドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2,340	53,422.20	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,380	89,265.80	
		加ドル小計	5,720	142,688.00	(11,131,090)
ユーロ	投資証券	FONCIERE DES REGIONS	595	48,492.50	

		GECINA SA	970	131,144.00	
		ICADE	685	46,347.10	
		KLEPIERRE	4,732	185,589.04	
		UNIBAIL-RODAMCO SE-NA	2,070	475,375.50	
ユーロ小計			9,052	886,948.14 (100,500,093)	
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	21,701	130,531.51	
		HAMMERSON PLC	15,295	86,187.32	
		INTU PROPERTIES PLC	19,860	56,839.32	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	16,229	166,347.25	
		SEGRO PLC	15,053	67,196.59	
英ポンド小計			88,138	507,101.99 (64,280,248)	
豪ドル	投資証券	APA GROUP	26,406	212,568.30	
		DEXUS PROPERTY GROUP	18,487	165,458.65	
		GOODMAN GROUP	39,332	272,177.44	
		GPT GROUP	44,885	212,306.05	
		LENDLEASE GROUP	12,197	168,440.57	
		MIRVAC GROUP	86,525	180,837.25	
		SCENTRE GROUP	116,381	508,584.97	
		STOCKLAND	55,310	252,766.70	
		VICINITY CENTRES	72,862	215,671.52	
		WESTFIELD CORP	41,745	381,966.75	
豪ドル小計			514,130	2,570,778.20 (205,867,918)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	48,000	2,712,000.00	
香港ドル小計			48,000	2,712,000.00 (36,422,160)	
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	51,900	126,636.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	40,000	63,600.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	66,300	142,545.00	
		SUNTEC REIT	45,000	78,075.00	
シンガポールドル小計			203,200	410,856.00 (30,810,091)	
合計				1,852,091,362 (1,852,091,362)	

(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	組入出資金 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	出資金 1銘柄		0.0%		0.0%
	株式 588銘柄	96.9%			63.5%
	投資証券 36銘柄			3.1%	2.1%
加ドル	株式 87銘柄	99.6%			3.9%
	投資証券 2銘柄			0.4%	0.0%
ユーロ	株式 234銘柄	98.8%			12.1%
	投資証券 5銘柄			1.2%	0.1%
英ポンド	株式 107銘柄	98.7%			7.2%
	投資証券 5銘柄			1.3%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%			3.6%
スウェーデンクローナ	株式 30銘柄	100.0%			1.1%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 16銘柄	100.0%			0.7%
豪ドル	株式 61銘柄	90.2%			2.8%
	投資証券 10銘柄			9.8%	0.3%
ニュージーランドドル	株式 6銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 39銘柄	96.1%			1.3%
	投資証券 1銘柄			3.9%	0.1%
シンガポールドル	株式 19銘柄	91.0%			0.5%
	投資証券 4銘柄			9.0%	0.0%
イスラエルシケル	株式 6銘柄	100.0%			0.2%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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

貸借対照表

（単位：円）

	平成27年10月26日現在	平成28年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	14,368,244	31,076,453
コール・ローン	88,072,934	160,378,578
株式	2,372,466,980	2,950,271,981
投資証券	61,162,352	82,017,268
派生商品評価勘定	31,616,542	11,489,570
未収入金	1,511,079	3,133,055
未収配当金	2,444,843	3,020,279
未収利息	142	-
差入委託証拠金	16,863,167	40,882,451
流動資産合計	2,588,506,283	3,282,269,635
資産合計	2,588,506,283	3,282,269,635
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	17,879,003	56,076,391
未払金	-	638,364
未払解約金	1,127,977	1,228,756
未払利息	-	186
流動負債合計	19,006,980	57,943,697
負債合計	19,006,980	57,943,697
純資産の部		
元本等		
元本	2,027,129,180	2,465,038,729
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	542,370,123	759,287,209
元本等合計	2,569,499,303	3,224,325,938
純資産合計	2,569,499,303	3,224,325,938
負債純資産合計	2,588,506,283	3,282,269,635

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</p>
--------------------	---

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

（貸借対照表に関する注記）

		平成27年10月26日現在	平成28年10月26日現在
1.	期首	平成26年10月28日	平成27年10月27日
	期首元本額	1,603,941,396円	2,027,129,180円
	期首からの追加設定元本額	745,545,630円	675,788,682円
	期首からの一部解約元本額	322,357,846円	237,879,133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）	858,947,438円	1,341,801,114円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	11,265,627円	9,510,522円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	9,250,832円	7,894,106円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	13,922,681円	11,671,765円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	16,733,236円	15,089,442円
	世界アセットバランスファンド40（適格機関投資家向け）	62,912,269円	48,337,514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）	71,063,091円	54,673,284円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	47,271,688円	45,830,367円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	141,923,282円	133,922,441円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	199,132,305円	180,334,940円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	199,129,142円	179,522,148円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジあり）	395,577,589円	436,451,086円
	計	2,027,129,180円	2,465,038,729円
2.	受益権の総数	2,027,129,180口	2,465,038,729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26年10月28日 至 平成27年10月26日	自 平成27年10月27日 至 平成28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27年10月26日現在	平成28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

（平成28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	76,940,088
投資証券	1,261,776
合計	75,678,312

（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

（平成28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	187,035,764	-	186,657,188	378,576
合計		187,035,764	-	186,657,188	378,576

（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	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
	イスラエルシェケル	6,036,023	-	5,993,850	42,173
	合計	2,458,861,219	-	2,454,835,990	4,025,229

（平成28年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	3,059,453,485	-	3,103,661,730	44,208,245
	米ドル	1,999,776,695	-	2,049,288,770	49,512,075
	加ドル	120,519,186	-	120,647,160	127,974
	ユーロ	385,060,737	-	383,084,470	1,976,267
	英ポンド	223,281,289	-	218,281,100	5,000,189
	スイスフラン	110,883,045	-	110,639,440	243,605
	スウェーデンクローナ	35,050,810	-	34,295,250	755,560
	ノルウェークローネ	7,687,165	-	7,627,300	59,865
	デンマーククローネ	23,622,308	-	23,332,170	290,138
	豪ドル	90,708,193	-	93,168,920	2,460,727
	香港ドル	40,179,668	-	40,638,510	458,842
	シンガポールドル	15,794,400	-	15,792,320	2,080
	イスラエルシェケル	6,889,989	-	6,866,320	23,669
	合計		3,059,453,485	-	3,103,661,730

（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27年10月26日現在		平成28年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.2676円	1口当たり純資産額	1.3080円
(1万口当たり純資産額)	(12,676円)	(1万口当たり純資産額)	(13,080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	649	61.05	39,621.45	
	APACHE CORP	417	60.57	25,257.69	
	BAKER HUGHES INC	479	54.39	26,052.81	
	CABOT OIL & GAS CORP	412	20.63	8,499.56	
	CHEVRON CORP	1,791	100.77	180,479.07	
	CIMAREX ENERGY CO	120	133.90	16,068.00	
	CONCHO RESOURCES INC	126	133.07	16,766.82	
	CONOCOPHILLIPS	1,355	41.81	56,652.55	
	DEVON ENERGY CORPORATION	561	40.67	22,815.87	
	EOG RESOURCES INC	590	92.67	54,675.30	
	EQT CORP	171	64.92	11,101.32	
	EXXON MOBIL CORP	4,132	86.72	358,327.04	

HALLIBURTON CO	834	47.77	39,840.18
HELMERICH & PAYNE	287	65.51	18,801.37
HESS CORP	389	50.90	19,800.10
KINDER MORGAN INC	1,960	21.32	41,787.20
MARATHON OIL CORP	1,089	14.18	15,442.02
MARATHON PETROLEUM CORP	438	43.69	19,136.22
NATIONAL OILWELL VARCO INC	478	36.16	17,284.48
NEWFIELD EXPLORATION CO	378	42.00	15,876.00
NOBLE ENERGY INC	413	34.28	14,157.64
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	855	74.43	63,637.65
ONEOK INC	281	49.17	13,816.77
PHILLIPS 66	422	80.76	34,080.72
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	140	183.03	25,624.20
RANGE RESOURCES CORP	192	35.89	6,890.88
SCHLUMBERGER LTD	1,278	80.22	102,521.16
SOUTHWESTERN ENERGY CO	347	10.76	3,733.72
SPECTRA ENERGY CORP	860	42.00	36,120.00
TESORO CORP	144	82.80	11,923.20
VALERO ENERGY CORP	410	58.93	24,161.30
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	710	6.16	4,373.60
WILLIAMS COS INC	818	29.17	23,861.06
ADVANSIX INC	25	16.56	414.00
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	247	133.51	32,976.97
ALBEMARLE CORP	165	82.10	13,546.50
ALCOA INC	441	27.29	12,034.89
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	126	111.33	14,027.58
BALL CORP	237	79.75	18,900.75
CELANESE CORP-SERIES A	251	71.77	18,014.27
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	223	25.54	5,695.42
CROWN HOLDINGS INC	274	54.62	14,965.88
DOW CHEMICAL CO/THE	1,045	54.11	56,544.95
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	739	69.62	51,449.18
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	188	66.40	12,483.20
ECOLAB INC	322	115.95	37,335.90
FREEPORT-MCMORAN INC	1,223	10.55	12,902.65

INTERNATIONAL PAPER CO	506	46.60	23,579.60
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	132	130.50	17,226.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	308	79.96	24,627.68
MARTIN MARIETTA MATERIALS	50	178.03	8,901.50
MONSANTO CO	388	101.40	39,343.20
MOSAIC CO/THE	532	24.60	13,087.20
NEWMONT MINING CORP	432	36.59	15,806.88
NUCOR CORP	450	47.00	21,150.00
PPG INDUSTRIES INC	270	91.22	24,629.40
PRAXAIR INC	272	118.53	32,240.16
SEALED AIR CORP	300	42.45	12,735.00
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	75	247.61	18,570.75
VULCAN MATERIALS CO	174	110.83	19,284.42
WESTROCK CO	366	46.96	17,187.36
3M CO	531	166.23	88,268.13
ACUITY BRANDS INC	69	233.89	16,138.41
AMETEK INC	332	44.80	14,873.60
BOEING CO/THE	526	139.02	73,124.52
CATERPILLAR INC	624	84.48	52,715.52
CUMMINS INC	205	125.57	25,741.85
DEERE & CO	235	86.52	20,332.20
DOVER CORP	241	67.97	16,380.77
EATON CORP PLC	459	63.18	28,999.62
EMERSON ELECTRIC CO	621	50.11	31,118.31
FASTENAL CO	457	38.64	17,658.48
FLUOR CORP	183	49.77	9,107.91
FORTIVE CORP	443	47.92	21,228.56
GENERAL DYNAMICS CORP	269	152.59	41,046.71
GENERAL ELECTRIC CO	9,086	28.65	260,313.90
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	642	109.07	70,022.94
ILLINOIS TOOL WORKS	318	111.84	35,565.12
INGERSOLL-RAND PLC	325	64.60	20,995.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	400	60.91	24,364.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	146	147.93	21,597.78
LOCKHEED MARTIN CORP	269	249.26	67,050.94

MASCO CORP	473	30.38	14,369.74
NORTHROP GRUMMAN CORP	193	219.53	42,369.29
PACCAR INC	330	54.80	18,084.00
PARKER HANNIFIN CORP	184	121.35	22,328.40
PENTAIR PLC	195	55.92	10,904.40
RAYTHEON COMPANY	250	139.75	34,937.50
ROCKWELL AUTOMATION INC	164	118.62	19,453.68
ROCKWELL COLLINS INC.	158	80.00	12,640.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	134	171.34	22,959.56
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	358	37.43	13,399.94
SNAP-ON INC	86	156.76	13,481.36
STANLEY BLACK & DECKER INC	239	117.02	27,967.78
TEXTRON INC	317	39.13	12,404.21
TRANSDIGM GROUP INC	64	268.12	17,159.68
UNITED TECHNOLOGIES CORP	694	101.36	70,343.84
WABTEC CORP	153	78.61	12,027.33
WW GRAINGER INC	71	203.08	14,418.68
XYLEM INC	392	48.03	18,827.76
EQUIFAX INC	193	130.43	25,172.99
IHS MARKIT LTD	501	37.61	18,842.61
NIELSEN HOLDINGS PLC	538	45.65	24,559.70
REPUBLIC SERVICES INC	354	50.95	18,036.30
STERICYCLE INC	119	75.90	9,032.10
VERISK ANALYTICS INC	202	82.09	16,582.18
WASTE CONNECTIONS INC	311	75.28	23,412.08
WASTE MANAGEMENT INC	508	62.74	31,871.92
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	155	69.43	10,761.65
CSX CORP	820	30.85	25,297.00
DELTA AIR LINES INC	343	41.21	14,135.03
EXPEDITORS INTL WASH INC	230	50.36	11,582.80
FEDEX CORP	265	171.93	45,561.45
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	176	78.84	13,875.84
KANSAS CITY SOUTHERN	160	90.48	14,476.80
NORFOLK SOUTHERN CORP	293	93.27	27,328.11
UNION PACIFIC CORP	823	89.99	74,061.77

UNITED PARCEL SERVICE-CL B	676	107.84	72,899.84
AUTOLIV INC	143	99.65	14,249.95
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	297	63.23	18,779.31
FORD MOTOR COMPANY	3,171	11.85	37,576.35
GENERAL MOTORS CORP	1,198	31.60	37,856.80
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	458	31.12	14,252.96
HARLEY-DAVIDSON INC	196	56.60	11,093.60
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	968	43.91	42,504.88
LEAR CORP	113	114.10	12,893.30
TESLA MOTORS INC	128	202.34	25,899.52
COACH INC	470	35.65	16,755.50
DR HORTON INC	575	28.81	16,565.75
HANESBRANDS INC	468	23.86	11,166.48
LENNAR CORP-CL A	312	41.21	12,857.52
MATTEL INC	345	32.60	11,247.00
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	171	48.55	8,302.05
MOHAWK INDUSTRIES INC	72	185.90	13,384.80
NEWELL BRANDS INC	673	51.63	34,746.99
NIKE INC -CL B	1,306	51.05	66,671.30
POLARIS INDUSTRIES INC	85	78.61	6,681.85
PVH CORP	120	105.53	12,663.60
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	119	32.89	3,913.91
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	406	28.37	11,518.22
VF CORP	281	53.07	14,912.67
WHIRLPOOL CORP	73	152.09	11,102.57
ARAMARK	400	36.92	14,768.00
CARNIVAL CORP	435	46.92	20,410.20
DARDEN RESTAURANTS INC	216	61.72	13,331.52
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	509	22.73	11,569.57
LAS VEGAS SANDS CORP	499	58.00	28,942.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	377	67.21	25,338.17
MCDONALD'S CORP	817	112.72	92,092.24
MGM RESORTS INTERNATIONAL	369	26.08	9,623.52
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	167	70.63	11,795.21
STARBUCKS CORP	1,390	53.67	74,601.30

WYNDHAM WORLDWIDE CORP	163	67.86	11,061.18
YUM! BRANDS INC	455	85.73	39,007.15
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	415	55.99	23,235.85
CHARTER COMMUNICATION-A	217	257.06	55,782.02
COMCAST CORP-CLASS A	2,297	64.52	148,202.44
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	414	25.47	10,544.58
DISH NETWORK CORP-A	329	58.76	19,332.04
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	714	22.69	16,200.66
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	93	27.28	2,537.04
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	747	31.56	23,575.32
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	798	33.71	26,900.58
NEWS CORP - CLASS A	521	12.65	6,590.65
OMNICOM GROUP	283	80.08	22,662.64
SIRIUS XM HOLDINGS INC	3,371	4.19	14,124.49
THE WALT DISNEY CO.	1,554	92.75	144,133.50
TIME WARNER INC	663	87.16	57,787.08
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	1,319	25.56	33,713.64
VIACOM INC-CLASS B	310	37.43	11,603.30
ADVANCE AUTO PARTS INC	116	143.81	16,681.96
AMAZON.COM INC	394	835.18	329,060.92
AUTOZONE INC	43	750.39	32,266.77
BEST BUY CO INC	371	39.26	14,565.46
CARMAX INC	202	50.93	10,287.86
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	270	68.17	18,405.90
DOLLAR TREE INC	300	75.82	22,746.00
EXPEDIA INC	143	127.99	18,302.57
FOOT LOCKER INC	210	68.00	14,280.00
GAP INC/THE	227	26.61	6,040.47
GENUINE PARTS CO	202	90.49	18,278.98
HOME DEPOT INC	1,155	123.34	142,457.70
L BRANDS INC	250	72.72	18,180.00
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	590	18.89	11,145.10
LKQ CORP	467	32.97	15,396.99
LOWE'S COS INC	798	68.47	54,639.06
MACY'S INC	442	35.93	15,881.06

NETFLIX INC	345	126.51	43,645.95
NORDSTROM INC	117	54.14	6,334.38
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	120	280.27	33,632.40
PRICELINE GROUP INC/THE	49	1,479.03	72,472.47
ROSS STORES INC	385	63.13	24,305.05
STAPLES INC	489	7.53	3,682.17
TARGET CORP	596	67.95	40,498.20
TIFFANY & CO	125	73.39	9,173.75
TJX COMPANIES INC	561	73.62	41,300.82
TRACTOR SUPPLY COMPANY	146	63.14	9,218.44
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	49	246.99	12,102.51
COSTCO WHOLESALE CORP	430	150.99	64,925.70
CVS HEALTH CORP	990	87.41	86,535.90
KROGER CO	1,016	30.91	31,404.56
SYSCO CORP	574	47.44	27,230.56
WAL-MART STORES INC	1,407	69.36	97,589.52
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	899	82.45	74,122.55
ALTRIA GROUP INC	1,871	64.71	121,072.41
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	594	42.53	25,262.82
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	304	45.47	13,822.88
CAMPBELL SOUP CO	333	53.44	17,795.52
COCA-COLA CO/THE	3,893	42.54	165,608.22
CONAGRA FOODS INC	420	47.84	20,092.80
CONSTELLATION BRANDS INC-A	154	168.14	25,893.56
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	242	88.32	21,373.44
GENERAL MILLS INC	515	61.10	31,466.50
HERSHEY CO/THE	171	95.81	16,383.51
HORMEL FOODS CORP	351	38.03	13,348.53
INGREDION INC	110	131.65	14,481.50
JM SMUCKER CO/THE	124	130.19	16,143.56
KELLOGG CO	224	74.21	16,623.04
KRAFT HEINZ CO/THE	518	88.36	45,770.48
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	172	95.91	16,496.52
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	197	80.88	15,933.36
MOLSON COORS BREWING CO -B	175	108.10	18,917.50

MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,675	42.76	71,623.00
MONSTER BEVERAGE CORP	126	149.81	18,876.06
PEPSICO INC	1,373	107.23	147,226.79
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,476	96.58	142,552.08
REYNOLDS AMERICAN INC	635	54.96	34,899.60
TYSON FOODS INC-CL A	262	69.04	18,088.48
WHITEWAVE FOODS CO	256	54.74	14,013.44
CHURCH & DWIGHT CO INC	350	48.11	16,838.50
CLOROX COMPANY	124	119.58	14,827.92
COLGATE-PALMOLIVE CO	840	71.31	59,900.40
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	263	86.18	22,665.34
KIMBERLY-CLARK CORP	305	113.73	34,687.65
PROCTER & GAMBLE CO	2,508	86.97	218,120.76
ABBOTT LABORATORIES	1,252	40.19	50,317.88
AETNA INC	305	111.64	34,050.20
AMERISOURCEBERGEN CORP	231	80.39	18,570.09
ANTHEM INC	232	124.50	28,884.00
BAXTER INTERNATIONAL INC	488	49.16	23,990.08
BECTON DICKINSON AND CO	254	170.98	43,428.92
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,565	22.44	35,118.60
CARDINAL HEALTH INC	300	74.91	22,473.00
CENTENE CORP	139	65.36	9,085.04
CERNER CORP	382	58.90	22,499.80
CIGNA CORP	258	124.30	32,069.40
COOPER COS INC/THE	69	181.61	12,531.09
CR BARD INC	90	214.94	19,344.60
DANAHER CORP	519	78.77	40,881.63
DAVITA INC	260	58.29	15,155.40
DENTSPLY SIRONA INC	274	56.76	15,552.24
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	202	113.68	22,963.36
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	583	70.07	40,850.81
HCA HOLDINGS INC	280	80.96	22,668.80
HENRY SCHEIN INC	132	150.59	19,877.88
HOLOGIC INC	380	37.67	14,314.60
HUMANA INC	122	174.86	21,332.92

IDEXX LABORATORIES INC	114	110.98	12,651.72
INTUITIVE SURGICAL INC	47	679.50	31,936.50
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	108	138.41	14,948.28
MCKESSON CORP	233	158.50	36,930.50
MEDTRONIC PLC	1,236	82.47	101,932.92
QUEST DIAGNOSTICS	200	83.17	16,634.00
ST JUDE MEDICAL INC	270	79.01	21,332.70
STRYKER CORP	375	113.19	42,446.25
UNITEDHEALTH GROUP INC	908	143.78	130,552.24
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	100	121.60	12,160.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	141	95.45	13,458.45
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	238	125.59	29,890.42
ABBVIE INC	1,492	61.55	91,832.60
AGILENT TECHNOLOGIES INC	406	43.51	17,665.06
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	251	121.41	30,473.91
ALLERGAN PLC	406	225.29	91,467.74
AMGEN INC	704	157.89	111,158.08
BIOGEN INC	221	286.00	63,206.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	137	80.96	11,091.52
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,506	49.55	74,622.30
CELGENE CORP	752	97.63	73,417.76
ELI LILLY & CO	875	77.75	68,031.25
ENDO INTERNATIONAL PLC	173	21.48	3,716.04
GILEAD SCIENCES INC	1,403	74.41	104,397.23
ILLUMINA INC	129	138.18	17,825.22
INCYTE CORP	125	87.20	10,900.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	103	118.96	12,252.88
JOHNSON & JOHNSON	2,725	113.96	310,541.00
MALLINCKRODT PLC	104	63.08	6,560.32
MERCK & CO. INC.	2,624	61.95	162,556.80
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	38	401.92	15,272.96
MYLAN NV	343	38.68	13,267.24
PERRIGO CO PLC	102	90.17	9,197.34
PFIZER INC	5,725	32.28	184,803.00
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	171	74.43	12,727.53

REGENERON PHARMACEUTICALS	70	366.93	25,685.10
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	387	147.97	57,264.39
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	304	78.71	23,927.84
WATERS CORP	125	138.60	17,325.00
ZOETIS INC	672	49.99	33,593.28
BANK OF AMERICA CORP	10,313	16.72	172,433.36
BB&T CORP	982	38.88	38,180.16
CIT GROUP INC	365	35.96	13,125.40
CITIGROUP INC	3,008	49.59	149,166.72
CITIZENS FINANCIAL GROUP	589	26.46	15,584.94
COMERICA INC	247	51.80	12,794.60
FIFTH THIRD BANCORP	940	21.28	20,003.20
FIRST REPUBLIC BANK/CA	257	75.48	19,398.36
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,705	10.19	17,373.95
JPMORGAN CHASE & CO	3,596	68.80	247,404.80
KEYCORP	1,033	13.87	14,327.71
M & T BANK CORP	163	119.05	19,405.15
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	530	93.14	49,364.20
REGIONS FINANCIAL CORP	1,381	10.62	14,666.22
SUNTRUST BANKS INC	510	45.17	23,036.70
US BANCORP	1,694	43.84	74,264.96
WELLS FARGO & CO	4,757	45.72	217,490.04
AFFILIATED MANAGERS GROUP	74	141.77	10,490.98
ALLY FINANCIAL INC	701	19.55	13,704.55
AMERICAN EXPRESS CO	711	66.74	47,452.14
AMERIPRISE FINANCIAL INC	216	97.23	21,001.68
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	1,004	43.40	43,573.60
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,130	143.42	162,064.60
BLACKROCK INC	132	341.54	45,083.28
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	481	75.39	36,262.59
CME GROUP INC	349	103.33	36,062.17
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	472	56.14	26,498.08
E*TRADE FINANCIAL CORP	481	28.09	13,511.29
FRANKLIN RESOURCES INC	492	34.82	17,131.44
GOLDMAN SACHS GROUP INC	411	175.55	72,151.05

INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	97	266.94	25,893.18
INVESCO LTD	633	29.58	18,724.14
LEUCADIA NATIONAL CORP	546	18.66	10,188.36
MOODY'S CORP	294	102.77	30,214.38
MORGAN STANLEY	1,613	33.35	53,793.55
NORTHERN TRUST CORP	299	70.32	21,025.68
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	232	58.55	13,583.60
S&P GLOBAL INC	266	124.25	33,050.50
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,026	31.71	32,534.46
STATE STREET CORP	524	70.89	37,146.36
SYNCHRONY FINANCIAL	735	28.58	21,006.30
T ROWE PRICE GROUP INC	275	66.04	18,161.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	429	34.32	14,723.28
VOYA FINANCIAL INC	316	30.30	9,574.80
AFLAC INC	401	69.64	27,925.64
ALLSTATE CORP	272	67.61	18,389.92
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	1,193	60.55	72,236.15
AON PLC	212	107.79	22,851.48
ARTHUR J GALLAGHER & CO	290	48.37	14,027.30
CHUBB LTD	391	122.45	47,877.95
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	509	42.71	21,739.39
LINCOLN NATIONAL CORP	283	48.24	13,651.92
LOEWS CORP	384	40.88	15,697.92
MARKEL CORP	19	888.05	16,872.95
MARSH & MCLENNAN COS	449	62.70	28,152.30
METLIFE INC	817	46.29	37,818.93
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	394	52.96	20,866.24
PROGRESSIVE CORP	659	31.87	21,002.33
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	374	82.89	31,000.86
TORCHMARK CORP	215	63.19	13,585.85
TRAVELERS COS INC/THE	296	109.03	32,272.88
UNUM GROUP	310	35.28	10,936.80
WILLIS TOWERS WATSON PLC	167	126.45	21,117.15
XL GROUP LTD	375	34.06	12,772.50
CBRE GROUP INC	357	27.91	9,963.87

HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	2,000	6.81	13,620.00
ACCENTURE PLC-CL A	631	115.27	72,735.37
ACTIVISION BLIZZARD INC	741	45.06	33,389.46
ADOBE SYSTEMS INC	522	109.03	56,913.66
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	196	59.07	11,577.72
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	56	203.90	11,418.40
ALPHABET INC-CL A	292	828.55	241,936.60
ALPHABET INC-CL C	305	807.67	246,339.35
ANSYS INC	172	91.12	15,672.64
AUTODESK INC	212	71.36	15,128.32
AUTOMATIC DATA PROCESSING	526	87.50	46,025.00
CA INC	648	32.41	21,001.68
CITRIX SYSTEMS INC	258	84.90	21,904.20
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	537	50.64	27,193.68
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	185	46.99	8,693.15
EBAY INC	982	29.05	28,527.10
ELECTRONIC ARTS INC	240	82.94	19,905.60
FACEBOOK INC-A	2,194	132.29	290,244.26
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	342	75.56	25,841.52
FISERV INC	282	99.72	28,121.04
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	157	172.90	27,145.30
GLOBAL PAYMENTS INC	266	73.27	19,489.82
INTL BUSINESS MACHINES CORP	868	150.88	130,963.84
INTUIT INC	308	108.32	33,362.56
LINKEDIN CORP - A	124	189.30	23,473.20
MASTERCARD INC	959	102.88	98,661.92
MICROSOFT CORP	7,358	60.99	448,764.42
ORACLE CORP	2,769	38.36	106,218.84
PAYCHEX INC	442	55.84	24,681.28
PAYPAL HOLDINGS INC	1,119	43.31	48,463.89
RED HAT INC	245	77.35	18,950.75
SALESFORCE.COM INC	637	75.06	47,813.22
SERVICENOW INC	131	79.79	10,452.49
SYMANTEC CORP	702	24.99	17,542.98
SYNOPSYS INC	285	58.61	16,703.85

VERISIGN INC	195	79.64	15,529.80
VISA INC-CLASS A SHARES	1,812	82.03	148,638.36
WESTERN UNION CO	688	20.36	14,007.68
WORKDAY INC-CLASS A	168	87.71	14,735.28
YAHOO! INC	895	42.55	38,082.25
AMPHENOL CORP-CL A	474	65.19	30,900.06
APPLE INC	5,411	118.25	639,850.75
CISCO SYSTEMS INC	5,081	30.34	154,157.54
CORNING INC	1,141	22.97	26,208.77
FLEX LTD	1,074	13.54	14,541.96
HARRIS CORP	186	90.71	16,872.06
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	1,663	21.60	35,920.80
HP INC	1,780	13.90	24,742.00
JUNIPER NETWORKS INC	445	23.72	10,555.40
MOTOROLA SOLUTIONS INC	185	74.16	13,719.60
NETAPP INC	302	34.00	10,268.00
PALO ALTO NETWORKS INC	95	149.82	14,232.90
TE CONNECTIVITY LTD	372	61.90	23,026.80
WESTERN DIGITAL CORP	198	53.63	10,618.74
AT&T INC	5,787	36.70	212,382.90
CENTURYLINK INC	721	28.45	20,512.45
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	453	46.90	21,245.70
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	129	115.13	14,851.77
T-MOBILE US INC	234	49.60	11,606.40
VERIZON COMMUNICATIONS INC	4,069	47.84	194,660.96
AMEREN CORPORATION	394	49.03	19,317.82
AMERICAN ELECTRIC POWER	383	63.46	24,305.18
AMERICAN WATER WORKS CO INC	253	72.64	18,377.92
CENTERPOINT ENERGY INC	442	22.67	10,020.14
CMS ENERGY CORP	476	41.61	19,806.36
CONSOLIDATED EDISON INC	194	73.65	14,288.10
DOMINION RESOURCES INC/VA	570	73.40	41,838.00
DTE ENERGY COMPANY	186	93.99	17,482.14
DUKE ENERGY CORP	587	78.59	46,132.33
EDISON INTERNATIONAL	284	71.62	20,340.08

	ENERGY CORP	273	72.48	19,787.04	
	EVERSOURCE ENERGY	293	54.30	15,909.90	
	EXELON CORP	669	32.90	22,010.10	
	FIRSTENERGY CORP	576	33.62	19,365.12	
	NEXTERA ENERGY INC	392	125.52	49,203.84	
	P G & E CORP	382	60.79	23,221.78	
	PINNACLE WEST CAPITAL	151	75.20	11,355.20	
	PPL CORP	571	33.70	19,242.70	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	336	41.17	13,833.12	
	SEMPRA ENERGY	266	106.41	28,305.06	
	SOUTHERN CO	787	50.97	40,113.39	
	WEC ENERGY GROUP INC	282	58.13	16,392.66	
	XCEL ENERGY INC	554	40.48	22,425.92	
	ANALOG DEVICES INC	338	64.06	21,652.28	
	APPLIED MATERIALS INC	1,308	28.86	37,748.88	
	BROADCOM LTD	343	173.65	59,561.95	
	INTEL CORP	4,844	35.10	170,024.40	
	KLA-TENCOR CORPORATION	127	74.90	9,512.30	
	LAM RESEARCH CORP	198	98.08	19,419.84	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	249	60.32	15,019.68	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	234	40.03	9,367.02	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	310	60.91	18,882.10	
	MICRON TECHNOLOGY INC	1,304	17.54	22,872.16	
	NVIDIA CORP	526	71.87	37,803.62	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	235	100.64	23,650.40	
	QUALCOMM INC	1,314	67.71	88,970.94	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	159	78.08	12,414.72	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	883	71.20	62,869.60	
	VERSUM MATERIALS INC	123	23.04	2,833.92	
	XILINX INC	216	50.31	10,866.96	
米ドル小計		299,816		18,492,012.76	(1,926,497,889)
加ドル	CAMECO CORP	350	10.52	3,682.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	1,078	43.68	47,087.04	
	CENOVUS ENERGY INC	666	20.45	13,619.70	

CRESCENT POINT ENERGY CORP	1,098	17.15	18,830.70
ENBRIDGE INC	981	58.05	56,947.05
HUSKY ENERGY INC	284	15.39	4,370.76
IMPERIAL OIL LTD	459	43.90	20,150.10
INTER PIPELINE LTD	744	28.24	21,010.56
PEMBINA PIPELINE CORP	475	41.39	19,660.25
SUNCOR ENERGY INC	1,757	39.00	68,523.00
TRANSCANADA CORP	822	61.13	50,248.86
AGNICO EAGLE MINES LTD	328	66.24	21,726.72
AGRIUM INC	154	123.72	19,052.88
BARRICK GOLD CORP	1,373	22.57	30,988.61
ELDORADO GOLD CORP	598	4.81	2,876.38
FRANCO-NEVADA CORP	307	86.65	26,601.55
GOLDCORP INC	679	20.83	14,143.57
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	977	22.22	21,708.94
SILVER WHEATON CORP	436	32.41	14,130.76
BOMBARDIER INC 'B'	1,631	1.80	2,935.80
SNC-LAVALIN GROUP INC	315	54.00	17,010.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	824	87.67	72,240.08
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	196	196.37	38,488.52
MAGNA INTERNATIONAL INC	410	54.13	22,193.30
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	199	59.46	11,832.54
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	643	26.35	16,943.05
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	139	129.91	18,057.49
DOLLARAMA INC	178	101.18	18,010.04
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	367	67.30	24,699.10
LOBLAW COMPANIES LTD	237	66.15	15,677.55
METRO INC	506	41.73	21,115.38
SAPUTO INC	498	46.70	23,256.60
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	203	29.43	5,974.29
BANK OF MONTREAL	580	86.10	49,938.00
BANK OF NOVA SCOTIA	1,047	71.81	75,185.07
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	376	100.52	37,795.52
NATIONAL BANK OF CANADA	372	46.67	17,361.24
ROYAL BANK OF CANADA	1,306	83.48	109,024.88

	TORONTO-DOMINION BANK	1,631	60.32	98,381.92	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	1,241	47.32	58,724.12	
	CI FINANCIAL CORP	575	24.26	13,949.50	
	THOMSON REUTERS CORP	610	52.66	32,122.60	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	27	704.50	19,021.50	
	GREAT-WEST LIFECO INC	624	33.71	21,035.04	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	2,763	19.39	53,574.57	
	POWER CORP OF CANADA	949	28.71	27,245.79	
	POWER FINANCIAL CORP	525	31.67	16,626.75	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	646	43.97	28,404.62	
	CGI GROUP INC - CL A	352	63.44	22,330.88	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	30	582.04	17,461.20	
	OPEN TEXT CORP	202	84.78	17,125.56	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	606	53.40	32,360.40	
	FORTIS INC	491	43.37	21,294.67	
加ドル小計		34,865		1,552,757.00	(121,130,573)
ユーロ	ENI SPA	2,922	13.68	39,972.96	
	REPSOL SA	1,073	12.95	13,895.35	
	SAIPEM SPA	11,817	0.41	4,945.41	
	TECHNIP SA	204	60.77	12,397.08	
	TOTAL SA	2,381	44.46	105,859.26	
	AIR LIQUIDE SA	449	93.99	42,201.51	
	AKZO NOBEL	265	59.27	15,706.55	
	ARCELORMITTAL	2,548	6.28	16,019.27	
	BASF SE	923	80.44	74,246.12	
	CRH PLC	865	30.14	26,071.10	
	HEIDELBERGCEMENT AG	173	85.61	14,810.53	
	K+S AG	190	18.31	3,479.85	
	KONINKLIJKE DSM NV	338	61.26	20,705.88	
	LANXESS AG	140	58.63	8,208.20	
	LINDE AG	167	147.35	24,607.45	
	SOLVAY SA	120	105.40	12,648.00	
	THYSSENKRUPP AG	421	21.91	9,224.11	
	UMICORE	187	55.85	10,443.95	

UPM-KYMMENE OYJ	507	21.02	10,657.14
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	456	27.24	12,423.72
AIRBUS GROUP SE	630	53.39	33,635.70
ALSTOM	186	23.73	4,413.78
BRENTAG AG	222	48.47	10,761.45
CNH INDUSTRIAL NV	2,110	6.97	14,717.25
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	539	39.30	21,182.70
FERROVIAL SA	749	18.68	13,991.32
GEA GROUP AG	251	37.06	9,302.06
KONE OYJ-B	488	43.67	21,310.96
KONINKLIJKE PHILIPS NV	853	27.30	23,291.16
LEGRAND SA	314	51.86	16,284.04
MAN SE	83	92.94	7,714.02
SAFRAN SA	402	62.75	25,225.50
SCHNEIDER ELECTRIC SE	648	62.40	40,435.20
SIEMENS AG-REG	758	106.75	80,916.50
VINCI SA	534	67.48	36,034.32
WARTSILA OYJ ABP	412	39.32	16,199.84
EDENRED	362	21.65	7,837.30
RANDSTAD HOLDING NV	207	46.91	9,711.40
RELX NV	1,644	15.36	25,251.84
WOLTERS KLUWER	514	35.60	18,298.40
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	814	13.65	11,111.10
ATLANTIA SPA	492	22.78	11,207.76
DEUTSCHE POST AG-REG	1,082	28.20	30,512.40
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	1,713	4.46	7,651.97
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	439	79.63	34,957.57
CONTINENTAL AG	97	174.50	16,926.50
DAIMLER AG	998	64.88	64,750.24
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	871	5.95	5,182.45
MICHELIN (CGDE)-B	196	98.93	19,390.28
PEUGEOT SA	948	13.29	12,598.92
RENAULT SA	257	76.71	19,714.47
VALEO SA	279	53.32	14,876.28
VOLKSWAGEN AG-PFD	155	126.90	19,669.50

ADIDAS AG	187	152.70	28,554.90
CHRISTIAN DIOR SE	63	175.25	11,040.75
HERMES INTERNATIONAL	31	368.35	11,418.85
KERING	74	188.40	13,941.60
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	285	166.90	47,566.50
ACCOR SA	243	34.60	8,407.80
SODEXO	105	104.00	10,920.00
LAGARDERE S.C.A.	340	22.43	7,627.90
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	363	39.04	14,171.52
PUBLICIS GROUPE	193	61.16	11,803.88
SES	366	19.21	7,032.69
VIVENDI	1,194	18.26	21,802.44
INDITEX	966	32.57	31,462.62
CARREFOUR SA	701	24.28	17,020.28
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	1,337	20.63	27,588.99
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	762	113.75	86,677.50
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	292	34.44	10,056.48
DANONE	624	62.94	39,274.56
HEINEKEN NV	152	79.00	12,008.00
KERRY GROUP PLC-A	279	68.36	19,072.44
PERNOD-RICARD SA	266	107.75	28,661.50
BEIERSDORF AG	163	80.30	13,088.90
HENKEL AG & CO KGAA	85	100.40	8,534.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	189	117.80	22,264.20
L'OREAL	217	165.65	35,946.05
UNILEVER NV-CVA	1,596	39.03	62,299.86
ESSILOR INTERNATIONAL	249	101.95	25,385.55
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	218	74.35	16,208.30
FRESENIUS SE & CO KGAA	461	68.44	31,550.84
BAYER AG	817	91.50	74,755.50
MERCK KGAA	126	95.85	12,077.10
SANOFI	1,077	68.52	73,796.04
UCB SA	176	64.77	11,399.52
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	7,507	6.30	47,309.11
BANCO DE SABADELL SA	5,362	1.23	6,622.07

BANCO SANTANDER SA	12,907	4.44	57,319.98
BANCO SANTANDER SA-RTS	12,907	0.05	658.25
BNP PARIBAS	1,097	52.82	57,943.54
ERSTE GROUP BANK AG	501	29.02	14,539.02
ING GROEP NV-CVA	3,903	11.95	46,640.85
INTESA SANPAOLO	13,040	2.15	28,088.16
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	2,782	-	-
KBC GROEP NV	268	53.71	14,394.28
MEDIOBANCA SPA	1,534	6.80	10,431.20
SOCIETE GENERALE	904	35.82	32,381.28
UNICREDIT SPA	4,312	2.30	9,917.60
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	1,612	13.14	21,189.74
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	241	70.13	16,901.33
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	273	79.45	21,689.85
AEGON NV	2,522	3.95	9,982.07
AGEAS	414	33.57	13,900.05
ALLIANZ SE-REG	445	143.00	63,635.00
ASSICURAZIONI GENERALI	1,194	12.06	14,399.64
AXA	2,258	20.76	46,876.08
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	168	178.65	30,013.20
NN GROUP NV	566	27.89	15,785.74
SAMPO OYJ-A SHS	317	42.04	13,326.68
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	512	30.57	15,654.40
VONOVIA SE	441	32.93	14,524.33
AMADEUS IT GROUP SA	728	43.22	31,467.80
ATOS SE	128	95.65	12,243.20
CAP GEMINI SA	243	82.64	20,081.52
SAP SE	863	81.07	69,963.41
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	339	38.03	12,892.17
NOKIA OYJ	4,779	4.53	21,648.87
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	3,259	15.14	49,341.26
KONINKLIJKE KPN NV	3,725	2.93	10,940.32
ORANGE S.A.	1,626	14.66	23,845.29
TELECOM ITALIA SPA	11,938	0.79	9,532.49
TELEFONICA SA	4,267	9.22	39,380.14

	E.ON SE	2,092	6.67	13,968.28
	ENAGAS	514	25.84	13,281.76
	ENEL SPA	9,142	3.90	35,726.93
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	3,681	3.00	11,076.12
	ENGIE	1,395	13.21	18,434.92
	FORTUM OYJ	342	15.36	5,253.12
	GAS NATURAL SDG SA	720	17.74	12,772.80
	IBERDROLA SA	5,794	6.17	35,783.74
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	989	19.09	18,884.95
	SNAM SPA	3,128	4.82	15,083.21
	SUEZ	520	14.07	7,319.00
	TERNA SPA	3,500	4.40	15,421.00
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	518	19.80	10,256.40
	ASML HOLDING NV	412	95.87	39,498.44
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,559	16.04	25,006.36
	STMICROELECTRONICS NV	664	7.24	4,811.34
ユーロ小計		205,442		3,245,042.97 (367,695,818)
英債券	BP PLC	17,369	4.95	86,002.60
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	4,173	20.83	86,944.45
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	3,449	21.82	75,274.42
	ANGLO AMERICAN PLC	1,677	11.14	18,681.78
	ANTOFAGASTA PLC	612	5.40	3,307.86
	BHP BILLITON PLC	2,650	12.61	33,416.50
	GLENCORE PLC	10,573	2.46	26,025.43
	JOHNSON MATTHEY PLC	258	34.50	8,901.00
	RANDGOLD RESOURCES LTD	93	72.00	6,696.00
	RIO TINTO PLC	1,156	27.96	32,321.76
	BAE SYSTEMS PLC ORD	4,318	5.40	23,338.79
	BUNZL PLC	536	22.25	11,926.00
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	2,093	7.39	15,467.27
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C(N)	96,278	0.00	96.27
	SMITHS GROUP PLC	845	14.47	12,227.15
	TRAVIS PERKINS PLC	386	13.46	5,195.56
	WOLSELEY PLC	261	44.13	11,517.93

CAPITA PLC	1,094	6.06	6,635.11
EXPERIAN PLC	1,515	15.64	23,694.60
RELX PLC	1,361	14.59	19,856.99
GKN PLC	2,586	3.13	8,117.45
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,325	4.69	6,214.25
BURBERRY GROUP PLC	594	14.60	8,672.40
PERSIMMON PLC	410	16.93	6,941.30
CARNIVAL PLC	202	37.79	7,633.58
COMPASS GROUP PLC	2,041	14.70	30,002.70
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	433	31.59	13,678.47
WHITBREAD PLC	254	36.99	9,395.46
ITV PLC	3,576	1.70	6,089.92
SKY PLC	1,067	8.07	8,616.02
WPP PLC	1,665	17.04	28,371.60
KINGFISHER PLC	2,100	3.58	7,524.30
MARKS & SPENCER GROUP PLC	2,694	3.34	9,008.73
NEXT PLC	165	47.20	7,788.00
TESCO PLC	7,054	2.10	14,823.98
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	314	24.40	7,661.60
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,715	47.18	80,922.27
DIAGEO PLC	2,528	22.03	55,704.48
IMPERIAL BRANDS PLC	965	39.19	37,823.17
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	558	72.47	40,438.26
UNILEVER PLC	1,313	34.77	45,659.57
SMITH & NEPHEW PLC	1,335	12.08	16,126.80
ASTRAZENECA PLC	1,265	48.11	60,865.47
GLAXOSMITHKLINE PLC	4,515	16.29	73,571.92
SHIRE PLC	937	48.92	45,842.72
BARCLAYS PLC	14,463	1.83	26,568.53
HSBC HOLDINGS PLC	18,910	6.26	118,433.33
LLOYDS BANKING GROUP PLC	71,041	0.55	39,321.19
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	4,488	1.92	8,630.42
STANDARD CHARTERED PLC	3,546	7.05	25,013.48
3I GROUP PLC	1,628	6.64	10,809.92
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	425	28.90	12,282.50

	AVIVA PLC	4,721	4.48	21,173.68	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	5,314	2.08	11,085.00	
	OLD MUTUAL PLC	5,652	2.01	11,371.82	
	PRUDENTIAL PLC	2,647	14.02	37,124.17	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	1,153	5.59	6,451.03	
	ST JAMES'S PLACE PLC	1,130	9.64	10,893.20	
	STANDARD LIFE PLC	2,850	3.39	9,684.30	
	SAGE GROUP PLC/THE	1,882	7.25	13,644.50	
	WORLDPAY GROUP PLC	3,477	2.81	9,801.66	
	BT GROUP PLC	9,975	3.87	38,673.07	
	VODAFONE GROUP PLC	28,686	2.26	64,830.36	
	CENTRICA PLC	5,576	2.15	12,033.00	
	NATIONAL GRID PLC	3,191	10.57	33,744.82	
	SEVERN TRENT PLC	491	23.25	11,415.75	
	SSE PLC	894	15.79	14,116.26	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	900	9.34	8,410.50	
英債券小計		385,348		1,700,534.38	(215,559,738)
スイスフラン	GIVAUDAN-REG	11	1,930.00	21,230.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	433	53.65	23,230.45	
	SIKA AG-BR	3	4,515.00	13,545.00	
	SYNGENTA AG-REG	69	403.00	27,807.00	
	ABB LTD-REG	1,901	22.00	41,822.00	
	GEBERIT AG-REG	50	422.00	21,100.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	242	58.80	14,229.60	
	SGS SA-REG	10	2,112.00	21,120.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	82	135.00	11,070.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	509	65.15	33,161.35	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	51	308.80	15,748.80	
	NESTLE SA-REG	2,998	72.10	216,155.80	
	SONOVA HOLDING AG-REG	102	134.00	13,668.00	
	ACTELION LTD-REG	95	144.00	13,680.00	
	LONZA GROUP AG-REG	92	177.30	16,311.60	
	NOVARTIS AG-REG	2,271	72.55	164,761.05	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	678	228.20	154,719.60	

	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	2,233	13.67	30,525.11	
	JULIUS BAER GROUP LTD	372	40.68	15,132.96	
	UBS GROUP AG-REG	3,813	13.69	52,199.97	
	BALOISE HOLDING AG - REG	127	119.40	15,163.80	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	60	257.60	15,456.00	
	SWISS RE AG	277	93.05	25,774.85	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	148	259.40	38,391.20	
	SWISS PRIME SITE-REG	203	82.15	16,676.45	
	SWISSCOM AG-REG	32	457.70	14,646.40	
	スイスフラン小計	16,862		1,047,326.99	(109,623,716)
スウェーデンクローナ	ASSA ABLOY AB-B	1,398	165.20	230,949.60	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	736	267.00	196,512.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	603	239.50	144,418.50	
	SANDVIK AB	1,241	100.60	124,844.60	
	SKANSKA AB-B SHS	682	205.10	139,878.20	
	VOLVO AB-B SHS-B	1,297	95.70	124,122.90	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	1,034	254.70	263,359.80	
	SWEDISH MATCH AB	414	304.30	125,980.20	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	557	252.20	140,475.40	
	NORDEA BANK AB	2,870	92.65	265,905.50	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,376	92.15	126,798.40	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	2,001	125.30	250,725.30	
	SWEDBANK AB - A SHARES	1,036	211.20	218,803.20	
	INVESTOR AB-B SHS	576	325.50	187,488.00	
	ERICSSON LM-B SHS	3,508	44.55	156,281.40	
	HEXAGON AB-B SHS	423	369.00	156,087.00	
	TELIA CO AB	2,792	37.01	103,331.92	
	スウェーデンクローナ小計	22,544		2,955,961.92	(34,466,515)
ノルウェークローネ	STATOIL ASA	1,204	137.30	165,309.20	
	NORSK HYDRO A S	1,642	36.71	60,277.82	
	YARA INTERNATIONAL ASA	199	290.50	57,809.50	
	ORKLA ASA	1,079	79.65	85,942.35	
	DNB ASA	960	116.60	111,936.00	

	TELENOR ASA	666	139.80	93,106.80	
ノルウェークローネ小計		5,750		574,381.67 (7,225,721)	
デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	336	286.00	96,096.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	241	542.00	130,622.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	8	10,250.00	82,000.00	
	DSV A/S	452	335.00	151,420.00	
	PANDORA A/S	119	895.00	106,505.00	
	CARLSBERG AS-B	163	619.50	100,978.50	
	COLOPLAST-B	186	481.90	89,633.40	
	GENMAB A/S	99	1,114.00	110,286.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	1,749	276.90	484,298.10	
	DANSKE BANK A/S	812	211.90	172,062.80	
デンマーククローネ小計		4,165		1,523,901.80 (23,209,024)	
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	536	30.82	16,519.52	
	ORIGIN ENERGY LTD	2,933	5.59	16,395.47	
	SANTOS LTD	807	3.70	2,985.90	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	1,074	28.91	31,049.34	
	AMCOR LIMITED	1,260	15.08	19,000.80	
	BHP BILLITON LTD	3,195	23.19	74,092.05	
	NEWCREST MINING LTD	983	21.90	21,527.70	
	ORICA LIMITED	480	16.48	7,910.40	
	RIO TINTO LTD	486	52.48	25,505.28	
	SOUTH32 LTD	8,960	2.64	23,654.40	
	CIMIC GROUP LTD	219	30.46	6,670.74	
	BRAMBLES LTD	2,754	11.98	32,992.92	
	TRANSURBAN GROUP	3,406	10.84	36,921.04	
	CROWN RESORTS LTD	629	10.70	6,730.30	
	TABCORP HOLDINGS LTD	1,958	4.91	9,613.78	
	WESFARMERS LTD	1,006	43.96	44,223.76	
	WOOLWORTHS LTD	1,605	25.25	40,526.25	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	245	72.45	17,750.25	
	CSL LTD	430	102.98	44,281.40	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	3,001	28.52	85,588.52	

	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	1,610	75.23	121,120.30	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	2,773	27.80	77,089.40	
	WESTPAC BANKING CORP	3,246	30.90	100,301.40	
	AMP LTD	3,505	5.27	18,471.35	
	ASX LTD	490	47.73	23,387.70	
	MACQUARIE GROUP LTD	288	82.81	23,849.28	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	3,491	5.67	19,793.97	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	1,510	10.33	15,598.30	
	SUNCORP GROUP LTD	1,427	12.53	17,880.31	
	COMPUTERSHARE LTD	820	10.64	8,724.80	
	TELSTRA CORPORATION LTD	5,367	5.05	27,103.35	
	AGL ENERGY LTD	1,271	19.28	24,504.88	
豪ドル小計		61,765		1,041,764.86	(83,424,529)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,598	98.50	255,903.00	
	LI & FUNG LTD	4,000	3.93	15,720.00	
	SANDS CHINA LTD	3,400	35.05	119,170.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	4,000	27.90	111,600.00	
	HANG SENG BANK LTD	950	142.70	135,565.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	1,337	208.60	278,898.20	
	AIA GROUP LTD	11,063	53.00	586,339.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	3,598	55.45	199,509.10	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	3,000	17.80	53,400.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	10,000	9.85	98,500.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,933	115.90	224,034.70	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	2,254	83.00	187,082.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	2,000	58.00	116,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	2,194	78.70	172,667.80	
	HONG KONG & CHINA GAS	11,025	15.04	165,816.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS	2,500	73.15	182,875.00	
香港ドル小計		65,852		2,903,079.80	(38,988,361)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	3,600	5.34	19,224.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	1,400	10.27	14,378.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	14,000	0.77	10,780.00	

	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	5,000	3.81	19,050.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	2,202	15.06	33,162.12	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	4,208	8.65	36,399.20	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,642	18.91	31,050.22	
	CAPITALAND LTD	6,000	3.16	18,960.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	6,900	3.92	27,048.00	
シンガポールドル小計		44,952		210,051.54	(15,751,764)
イスラエルシュケル	TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	940	167.80	157,732.00	
	BANK HAPOALIM BM	4,023	22.30	89,712.90	
イスラエルシュケル小計		4,963		247,444.90	(6,698,333)
合 計		1,152,324		2,950,271,981	(2,950,271,981)

(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	385	44,948.75	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	157	26,198.59	
		BOSTON PROPERTIES INC	222	27,823.26	
		CROWN CASTLE INTL CORP	283	26,585.02	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	184	17,829.60	
		EQUINIX INC	83	30,977.26	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	422	25,476.14	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	71	14,528.02	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	231	17,389.68	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	110	16,263.50	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	613	15,968.65	
		HCP INC	552	19,645.68	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	948	14,599.20	
		IRON MOUNTAIN INC	538	18,426.50	
KIMCO REALTY CORPORATION	540	14,941.80			

		MACERICH CO/THE	187	14,312.98	
		PROLOGIS INC	526	27,688.64	
		PUBLIC STORAGE	151	32,064.85	
		REALTY INCOME CORP	279	17,381.70	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	262	51,684.74	
		SL GREEN REALTY CORP	147	14,773.50	
		UDR INC	413	13,852.02	
		VENTAS INC	270	18,576.00	
		VORNADO REALTY TRUST	292	27,518.08	
		WELLTOWER INC	396	28,104.12	
		WEYERHAEUSER CO	718	22,365.70	
米ドル小計			8,980	599,923.98	(62,500,080)
ユーロ	投資証券	KLEPIERRE	263	10,314.86	
		UNIBAIL-RODAMCO SE-NA	127	29,165.55	
ユーロ小計			390	39,480.41	(4,473,525)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	1,166	7,013.49	
		HAMMERSON PLC	1,445	8,142.57	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	974	9,983.50	
英ポンド小計			3,585	25,139.56	(3,186,690)
豪ドル	投資証券	APA GROUP	2,425	19,521.25	
		LENDLEASE GROUP	919	12,691.39	
		SCENTRE GROUP	7,042	30,773.54	
		STOCKLAND	4,905	22,415.85	
		VICINITY CENTRES	6,167	18,254.32	
		WESTFIELD CORP	2,195	20,084.25	
豪ドル小計			23,653	123,740.60	(9,909,147)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	2,567	145,035.50	
香港ドル小計			2,567	145,035.50	(1,947,826)
合計				82,017,268	(82,017,268)

(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 462銘柄	96.9%		63.6%
	投資証券 26銘柄		3.1%	2.1%
加ドル	株式 53銘柄	100.0%		4.0%
ユーロ	株式 139銘柄	98.8%		12.1%
	投資証券 2銘柄		1.2%	0.1%
英ポンド	株式 68銘柄	98.5%		7.1%
	投資証券 3銘柄		1.5%	0.1%
スイスフラン	株式 26銘柄	100.0%		3.6%
スウェーデンクローナ	株式 17銘柄	100.0%		1.1%
ノルウェークローネ	株式 6銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式 10銘柄	100.0%		0.8%
豪ドル	株式 32銘柄	89.4%		2.8%
	投資証券 6銘柄		10.6%	0.3%
香港ドル	株式 16銘柄	95.2%		1.3%
	投資証券 1銘柄		4.8%	0.1%
シンガポールドル	株式 9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。

貸借対照表

（単位：円）

	平成27年10月26日現在	平成28年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	27,871,274	39,649,730
国債証券	27,678,374,440	25,999,933,439
地方債証券	2,221,989,000	2,108,744,000
特殊債券	2,594,129,000	3,945,453,000
社債券	1,989,299,000	1,890,962,939
未収入金	-	228,902,250
未収利息	85,847,629	77,489,348
前払費用	943,005	296,730
流動資産合計	34,598,453,348	34,291,431,436
資産合計	34,598,453,348	34,291,431,436
負債の部		
流動負債		
未払金	-	327,563,150
未払解約金	9,508,230	11,866,028
未払利息	-	46
流動負債合計	9,508,230	339,429,224
負債合計	9,508,230	339,429,224
純資産の部		
元本等		
元本	25,862,890,330	24,166,629,108
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,726,054,788	9,785,373,104
元本等合計	34,588,945,118	33,952,002,212
純資産合計	34,588,945,118	33,952,002,212
負債純資産合計	34,598,453,348	34,291,431,436

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参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>（3）時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
-----------------	---

（貸借対照表に関する注記）

		平成27年10月26日現在	平成28年10月26日現在
1.	期首	平成26年10月28日	平成27年10月27日
	期首元本額	26,150,712,081円	25,862,890,330円
	期首からの追加設定元本額	2,407,160,797円	2,188,944,591円
	期首からの一部解約元本額	2,694,982,548円	3,885,205,813円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	771,348,083円	871,459,048円
	DCインデックスバランス（株式40）	987,092,558円	1,011,780,903円
	DCインデックスバランス（株式60）	697,721,318円	688,561,701円
	DCインデックスバランス（株式80）	125,920,088円	117,425,374円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	1,439,648,776円	1,553,086,938円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	5,428,334,138円	4,441,791,698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	4,781,927円	4,217,572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）	49,382,817円	- 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	5,175,634円	4,433,313円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	27,448,221円	24,528,793円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	113,428,964円	97,697,259円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	398,533,980円	365,711,084円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	6,647,988,644円	5,536,506,848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）	45,364,368円	37,474,130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）	143,499,757円	118,679,718円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	31,066,594円	25,175,832円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	1,118,428,990円	1,109,502,156円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,152,391,400円	1,119,891,482円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	598,751,146円	558,776,523円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	91,145,819円	83,546,916円
	インデックスファンド日本債券（1年決算型）	5,789,757,316円	6,174,652,045円
	日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	195,679,792円	221,729,775円
	計	25,862,890,330円	24,166,629,108円
2.	受益権の総数	25,862,890,330口	24,166,629,108口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成26年10月28日 至 平成27年10月26日	自 平成27年10月27日 至 平成28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27年10月26日現在	平成28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

（平成28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	1,178,866,750
地方債証券	4,164,000
特殊債券	25,070,000
社債券	4,087,939
合計	1,212,188,689

(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27年10月26日現在		平成28年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.3374円	1口当たり純資産額	1.4049円
(1万口当たり純資産額)	(13,374円)	(1万口当たり純資産額)	(14,049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357回利付国債(2年)	38,000,000	38,156,029	
	第106回利付国債(5年)	14,000,000	14,060,200	
	第107回利付国債(5年)	705,000,000	709,004,400	
	第109回利付国債(5年)	180,000,000	180,954,000	
	第111回利付国債(5年)	40,000,000	40,380,000	
	第112回利付国債(5年)	70,000,000	70,767,900	
	第114回利付国債(5年)	90,000,000	90,959,400	
	第116回利付国債(5年)	110,000,000	111,091,200	
	第117回利付国債(5年)	90,000,000	90,984,600	
	第118回利付国債(5年)	100,000,000	101,197,000	
	第119回利付国債(5年)	74,000,000	74,688,940	
	第120回利付国債(5年)	330,000,000	334,184,400	
	第121回利付国債(5年)	100,000,000	100,976,000	
	第122回利付国債(5年)	300,000,000	303,135,000	
	第123回利付国債(5年)	505,000,000	510,605,500	
	第124回利付国債(5年)	560,000,000	566,686,400	
	第125回利付国債(5年)	325,000,000	329,085,250	
	第126回利付国債(5年)	220,000,000	222,897,400	
	第1回利付国債(40年)	40,000,000	62,224,800	
	第2回利付国債(40年)	165,000,000	249,095,550	
	第3回利付国債(40年)	50,000,000	76,063,000	
	第4回利付国債(40年)	95,000,000	145,597,000	
	第5回利付国債(40年)	35,000,000	51,719,850	
	第6回利付国債(40年)	70,000,000	101,899,000	
	第7回利付国債(40年)	50,000,000	69,780,500	
	第8回利付国債(40年)	75,000,000	97,368,000	
第9回利付国債(40年)	35,000,000	33,192,600		

第289回利付国債(10年)	199,000,000	203,091,440	
第290回利付国債(10年)	226,000,000	231,288,400	
第291回利付国債(10年)	187,000,000	191,114,000	
第292回利付国債(10年)	306,000,000	314,442,540	
第293回利付国債(10年)	56,000,000	57,909,040	
第294回利付国債(10年)	32,000,000	33,038,080	
第295回利付国債(10年)	13,000,000	13,378,820	
第296回利付国債(10年)	14,000,000	14,469,420	
第297回利付国債(10年)	28,000,000	28,993,160	
第298回利付国債(10年)	11,000,000	11,366,410	
第299回利付国債(10年)	410,000,000	425,186,400	
第300回利付国債(10年)	36,000,000	37,506,600	
第301回利付国債(10年)	206,000,000	215,506,900	
第302回利付国債(10年)	94,000,000	98,088,060	
第303回利付国債(10年)	581,000,000	608,603,310	
第304回利付国債(10年)	36,000,000	37,605,600	
第305回利付国債(10年)	473,000,000	495,845,900	
第306回利付国債(10年)	93,000,000	98,147,550	
第308回利付国債(10年)	140,000,000	147,789,600	
第309回利付国債(10年)	134,000,000	140,470,860	
第310回利付国債(10年)	78,000,000	81,706,560	
第311回利付国債(10年)	23,000,000	23,912,410	
第312回利付国債(10年)	205,000,000	217,086,800	
第313回利付国債(10年)	370,000,000	394,675,300	
第315回利付国債(10年)	65,000,000	69,265,300	
第316回利付国債(10年)	35,000,000	37,132,550	
第317回利付国債(10年)	105,000,000	111,721,050	
第318回利付国債(10年)	185,000,000	195,926,100	
第319回利付国債(10年)	5,000,000	5,336,500	
第320回利付国債(10年)	190,000,000	201,799,000	
第321回利付国債(10年)	175,000,000	186,394,250	
第322回利付国債(10年)	75,000,000	79,474,500	
第323回利付国債(10年)	45,000,000	47,811,600	
第324回利付国債(10年)	25,000,000	26,419,500	
第325回利付国債(10年)	210,000,000	222,461,400	
第326回利付国債(10年)	30,000,000	31,669,800	

第327回利付国債(10年)	65,000,000	69,022,200	
第328回利付国債(10年)	115,000,000	120,916,750	
第329回利付国債(10年)	230,000,000	245,403,100	
第330回利付国債(10年)	210,000,000	224,525,700	
第331回利付国債(10年)	80,000,000	84,416,000	
第333回利付国債(10年)	110,000,000	116,383,300	
第334回利付国債(10年)	120,000,000	127,106,400	
第335回利付国債(10年)	130,000,000	136,805,500	
第337回利付国債(10年)	30,000,000	31,113,000	
第338回利付国債(10年)	90,000,000	94,126,500	
第339回利付国債(10年)	250,000,000	261,582,500	
第340回利付国債(10年)	80,000,000	83,740,000	
第341回利付国債(10年)	110,000,000	114,165,700	
第14回利付国債(30年)	208,000,000	285,147,200	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	204,271,200	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	48,697,950	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	149,781,500	
第21回利付国債(30年)	20,000,000	27,365,800	
第22回利付国債(30年)	40,000,000	56,281,200	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	77,446,050	
第24回利付国債(30年)	68,000,000	95,907,200	
第25回利付国債(30年)	20,000,000	27,494,200	
第26回利付国債(30年)	100,000,000	139,683,000	
第27回利付国債(30年)	29,000,000	41,301,510	
第28回利付国債(30年)	14,000,000	20,050,240	
第29回利付国債(30年)	276,000,000	391,864,800	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	206,520,300	
第31回利付国債(30年)	120,000,000	166,880,400	
第32回利付国債(30年)	40,000,000	56,803,200	
第33回利付国債(30年)	135,000,000	183,512,250	
第34回利付国債(30年)	160,000,000	225,758,400	
第35回利付国債(30年)	78,000,000	106,982,460	
第36回利付国債(30年)	135,000,000	185,859,900	
第37回利付国債(30年)	46,000,000	62,484,100	
第38回利付国債(30年)	40,000,000	53,559,600	
第39回利付国債(30年)	75,000,000	102,457,500	

第40回利付国債(30年)	90,000,000	120,889,800	
第42回利付国債(30年)	65,000,000	85,966,400	
第43回利付国債(30年)	195,000,000	258,098,100	
第44回利付国債(30年)	70,000,000	92,836,800	
第45回利付国債(30年)	15,000,000	19,125,600	
第46回利付国債(30年)	100,000,000	127,720,000	
第47回利付国債(30年)	115,000,000	150,078,450	
第48回利付国債(30年)	105,000,000	131,515,650	
第49回利付国債(30年)	90,000,000	112,902,300	
第50回利付国債(30年)	25,000,000	27,271,250	
第51回利付国債(30年)	70,000,000	66,643,500	
第52回利付国債(30年)	50,000,000	50,327,000	
第34回利付国債(20年)	2,000,000	2,028,850	
第39回利付国債(20年)	86,000,000	89,453,760	
第41回利付国債(20年)	27,000,000	28,140,210	
第42回利付国債(20年)	168,000,000	179,541,600	
第43回利付国債(20年)	47,000,000	51,295,800	
第44回利付国債(20年)	51,000,000	55,730,760	
第47回利付国債(20年)	21,000,000	22,989,330	
第48回利付国債(20年)	99,000,000	110,202,840	
第49回利付国債(20年)	57,000,000	62,829,390	
第50回利付国債(20年)	237,000,000	259,135,800	
第51回利付国債(20年)	39,000,000	43,013,880	
第54回利付国債(20年)	15,000,000	16,862,700	
第55回利付国債(20年)	66,000,000	73,897,560	
第57回利付国債(20年)	52,000,000	58,216,600	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	151,868,250	
第59回利付国債(20年)	33,000,000	36,877,830	
第60回利付国債(20年)	295,000,000	324,264,000	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	29,097,630	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	35,150,900	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	61,864,020	
第65回利付国債(20年)	100,000,000	115,055,000	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	38,872,540	
第67回利付国債(20年)	34,000,000	39,268,300	
第68回利付国債(20年)	78,000,000	91,837,980	

第70回利付国債(20年)	104,000,000	124,602,400	
第72回利付国債(20年)	112,000,000	132,135,360	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	132,978,400	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	139,834,720	
第75回利付国債(20年)	10,000,000	11,897,000	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	24,627,120	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	47,248,400	
第79回利付国債(20年)	160,000,000	189,708,800	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	71,944,800	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	158,197,000	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	369,210,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	19,609,440	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	308,887,500	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	73,191,000	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	72,810,600	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	61,197,500	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	102,510,660	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	120,417,500	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	55,969,650	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	115,886,960	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	144,786,330	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	37,604,100	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	84,236,460	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	103,756,140	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	13,962,080	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	41,117,010	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	96,292,350	
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,524,920	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	163,155,200	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	164,920,500	
第109回利付国債(20年)	27,000,000	33,315,570	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	123,348,680	
第111回利付国債(20年)	25,000,000	31,893,500	
第113回利付国債(20年)	290,000,000	367,348,800	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	66,050,400	
第115回利付国債(20年)	55,000,000	70,580,950	

第116回利付国債(20年)	55,000,000	70,777,300	
第117回利付国債(20年)	93,000,000	118,440,150	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	12,642,500	
第119回利付国債(20年)	30,000,000	37,114,200	
第120回利付国債(20年)	70,000,000	84,702,800	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	27,597,460	
第122回利付国債(20年)	17,000,000	21,090,880	
第123回利付国債(20年)	65,000,000	83,539,950	
第124回利付国債(20年)	80,000,000	101,696,800	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	65,127,500	
第126回利付国債(20年)	25,000,000	31,852,000	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	82,063,150	
第129回利付国債(20年)	50,000,000	62,402,500	
第130回利付国債(20年)	60,000,000	75,025,800	
第131回利付国債(20年)	12,000,000	14,828,880	
第132回利付国債(20年)	35,000,000	43,322,300	
第133回利付国債(20年)	30,000,000	37,580,700	
第134回利付国債(20年)	30,000,000	37,645,200	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	37,191,300	
第136回利付国債(20年)	140,000,000	171,442,600	
第137回利付国債(20年)	220,000,000	273,165,200	
第138回利付国債(20年)	90,000,000	108,987,300	
第140回利付国債(20年)	280,000,000	348,191,200	
第141回利付国債(20年)	195,000,000	242,835,450	
第142回利付国債(20年)	55,000,000	69,359,950	
第143回利付国債(20年)	54,000,000	66,420,000	
第144回利付国債(20年)	40,000,000	48,561,200	
第145回利付国債(20年)	125,000,000	155,955,000	
第146回利付国債(20年)	75,000,000	93,692,250	
第147回利付国債(20年)	60,000,000	73,985,400	
第148回利付国債(20年)	120,000,000	145,972,800	
第149回利付国債(20年)	215,000,000	261,517,400	
第150回利付国債(20年)	90,000,000	107,913,600	
第151回利付国債(20年)	150,000,000	174,582,000	
第152回利付国債(20年)	90,000,000	104,665,500	
第153回利付国債(20年)	120,000,000	141,687,600	

	第154回利付国債(20年)	120,000,000	139,561,200	
	第155回利付国債(20年)	140,000,000	157,599,400	
	第156回利付国債(20年)	110,000,000	111,301,300	
	第157回利付国債(20年)	50,000,000	48,576,500	
	第158回利付国債(20年)	70,000,000	71,885,800	
国債証券 合計		22,647,000,000	25,999,933,439	
地方債証券	第26回東京都公募公債(20年)	100,000,000	121,789,000	
	第660回東京都公募公債	100,000,000	102,597,000	
	第708回東京都公募公債	100,000,000	104,999,000	
	第731回東京都公募公債	100,000,000	104,541,000	
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	119,277,000	
	平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	210,224,000	
	平成26年度第3回広島県公募公債	100,000,000	104,147,000	
	平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	105,744,000	
	平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	105,063,000	
	平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	104,218,000	
	第10回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	104,558,000	
	第64回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,192,000	
	第162回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,492,000	
	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	104,702,000	
	平成25年度第1回島根県公募公債	200,000,000	200,956,000	
	平成26年度第1回栃木県公募公債	100,000,000	103,794,000	
	平成23年度第2回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	105,451,000	
地方債証券 合計		2,000,000,000	2,108,744,000	
特殊債券	第1回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	104,923,000	
	第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	105,987,000	
	第5回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,907,000	
	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,097,000	
	第6回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,914,000	
	第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	105,068,000	
	第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	105,081,000	
	第21回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,168,000	
	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,914,000	
	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	104,362,000	
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	121,802,000	

	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	107,685,000	
	第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,150,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,307,000	
	第135回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,982,000	
	第139回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,460,000	
	第146回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,145,000	
	第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,310,000	
	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	207,530,000	
	第271回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,141,000	
	第1回地方公営企業等金融機構債券（20年）	100,000,000	122,473,000	
	第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	103,016,000	
	第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,810,000	
	F290回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,160,000	
	第55回株式会社日本政策金融公庫社債（一般担保付）	200,000,000	199,982,000	
	第44回日本学生支援債券	200,000,000	199,980,000	
	第45回日本学生支援債券	300,000,000	299,970,000	
	第316回信金中金債（5年）	100,000,000	100,178,000	
	第318回信金中金債（5年）	100,000,000	100,046,000	
	第320回信金中金債（5年）	100,000,000	99,905,000	
	第322回信金中金債（5年）	200,000,000	200,000,000	
	特殊債券 合計	3,800,000,000	3,945,453,000	
社債券	第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債（2014）	100,000,000	100,645,000	
	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	100,400,939	
	第11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	100,000,000	100,455,000	
	第63回中日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人日本高速道路保有・債務返済機構重畳の債務引受条項付）	100,000,000	104,456,000	
	第14回森永乳業株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	102,924,000	
	第6回サントリー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	98,928,000	

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	104,626,000	
第10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	100,201,000	
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	104,049,000	
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	101,406,000	
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	101,217,000	
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	121,135,000	
第83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	113,867,000	
第25回日本郵船株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	118,383,000	
第540回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,026,000	
第299回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,723,000	
第281回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,924,000	
第19回沖縄電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,597,000	
社債券 合計	1,800,000,000	1,890,962,939	
合計	30,247,000,000	33,945,093,378	

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

	平成27年10月26日現在	平成28年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	38,919,789	231,855,186
コール・ローン	51,917,372	12,180,364
国債証券	181,390,413,587	150,747,275,002
派生商品評価勘定	709,293	68,508
未収入金	126,117,059	33,952,531
未収利息	2,212,855,064	1,403,726,868
前払費用	40,007,026	26,787,696
流動資産合計	183,860,939,190	152,455,846,155
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	386,446	312,048
未払解約金	155,487,166	73,186,928
未払利息	-	14
流動負債合計	155,873,612	73,498,990
負債合計	155,873,612	73,498,990
純資産の部		
元本等		
元本	78,315,710,776	73,927,331,286
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	105,389,354,802	78,455,015,879
元本等合計	183,705,065,578	152,382,347,165
純資産合計	183,705,065,578	152,382,347,165
負債純資産合計	183,860,939,190	152,455,846,155

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27年10月26日現在	平成28年10月26日現在
1.	期首	平成26年10月28日	平成27年10月27日
	期首元本額	94,320,172,210円	78,315,710,776円
	期首からの追加設定元本額	1,407,849,739円	2,818,708,551円
	期首からの一部解約元本額	17,412,311,173円	7,207,088,041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）	10,658,545,736円	11,212,363,646円
	DCインデックスバランス（株式20）	67,731,260円	91,399,681円
	DCインデックスバランス（株式40）	125,991,920円	152,876,762円
	DCインデックスバランス（株式60）	159,512,271円	187,090,479円
	DCインデックスバランス（株式80）	143,835,234円	159,562,286円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	24,025,600,925円	24,213,113,798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	3,090,679,030円	2,948,863,601円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	30,477,712,110円	26,426,980,834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	24,348,601円	26,330,945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）	1,005,002,492円	998,969,384円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	146,323,601円	204,310,268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）	18,308,969円	- 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	2,957,976円	3,010,313円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	3,141,804円	3,325,848円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	7,165,554円	7,389,414円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	17,504,009円	19,083,574円
	世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	864,659,550円	415,344,427円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,261,792,428円	1,246,813,928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）	36,355,505円	35,819,111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）	93,884,765円	92,603,401円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	40,477,070円	38,271,205円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	49,259,970円	57,973,019円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	73,209,935円	84,781,902円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	68,455,872円	76,097,064円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	52,069,265円	56,760,472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	5,562,370,330円	4,923,806,084円
	海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	238,814,594円	244,389,840円

	計	78,315,710,776円	73,927,331,286円
2.	受益権の総数	78,315,710,776口	73,927,331,286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26年10月28日 至 平成27年10月26日	自 平成27年10月27日 至 平成28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27年10月26日現在	平成28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

（平成28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	2,587,242,713
合計	2,587,242,713

(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

（平成28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	100,235,160	-	100,478,700	243,540
	米ドル	18,806,400	-	18,750,600	55,800
	ユーロ	38,035,082	-	38,072,160	37,078
	英ポンド	10,275,538	-	10,266,750	8,788
	豪ドル	33,118,140	-	33,389,190	271,050
	合計	100,235,160	-	100,478,700	243,540

（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27年10月26日現在		平成28年10月26日現在	
1口当たり純資産額	2,3457円	1口当たり純資産額	2,0612円
(1万口当たり純資産額)	(23,457円)	(1万口当たり純資産額)	(20,612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-1.875%-17/09/30	6,600,000.00	6,672,316.20	
		US TREASURY N/B-0.625%-17/09/30	2,000,000.00	1,999,024.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-17/10/31	2,500,000.00	2,529,297.50	
		US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	6,800,000.00	7,051,280.40	
		US TREASURY N/B-0.625%-17/11/30	3,000,000.00	2,996,601.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-17/11/30	3,500,000.00	3,557,557.50	
		US TREASURY N/B-1.0%-17/12/15	5,200,000.00	5,215,740.40	
		US TREASURY N/B-2.75%-17/12/31	6,170,000.00	6,314,248.43	
		US TREASURY N/B-2.625%-18/01/31	4,000,000.00	4,092,968.00	
		US TREASURY N/B-0.875%-18/01/31	1,200,000.00	1,201,593.60	
		US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	7,950,000.00	8,227,629.90	
		US TREASURY N/B-2.75%-18/02/28	7,400,000.00	7,593,095.60	
		US TREASURY N/B-0.75%-18/02/28	5,100,000.00	5,097,312.30	
		US TREASURY N/B-1.0%-18/03/15	1,000,000.00	1,002,910.00	
		US TREASURY N/B-0.75%-18/03/31	3,000,000.00	2,997,774.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-18/03/31	2,500,000.00	2,572,802.50	
		US TREASURY N/B-0.625%-18/04/30	3,000,000.00	2,991,621.00	
		US TREASURY N/B-0.75%-18/04/30	3,000,000.00	2,997,129.00	
		US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	7,550,000.00	7,913,638.20	
		US TREASURY N/B-1.0%-18/05/31	5,520,000.00	5,534,771.52	
US TREASURY N/B-2.375%-18/06/30	7,000,000.00	7,178,689.00			
US TREASURY N/B-2.25%-18/07/31	8,340,000.00	8,544,430.08			

US TREASURY N/B-1.375%-18/07/31	2,500,000.00	2,522,557.50	
US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	8,850,000.00	9,356,972.25	
US TREASURY N/B-1.375%-18/09/30	970,000.00	979,093.75	
US TREASURY N/B-1.75%-18/10/31	3,000,000.00	3,050,859.00	
US TREASURY N/B-1.25%-18/10/31	3,000,000.00	3,020,802.00	
US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	9,400,000.00	9,946,008.40	
US TREASURY N/B-1.25%-18/11/30	3,100,000.00	3,121,737.20	
US TREASURY N/B-1.5%-18/12/31	8,830,000.00	8,939,509.66	
US TREASURY N/B-1.125%-19/01/15	500,000.00	502,138.50	
US TREASURY N/B-1.5%-19/01/31	3,000,000.00	3,037,968.00	
US TREASURY N/B-1.25%-19/01/31	200,000.00	201,410.20	
US TREASURY N/B-8.875%-19/02/15	4,550,000.00	5,384,729.35	
US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	5,400,000.00	5,625,072.00	
US TREASURY N/B-1.375%-19/02/28	3,000,000.00	3,030,177.00	
US TREASURY N/B-1.5%-19/02/28	4,000,000.00	4,051,092.00	
US TREASURY N/B-1.0%-19/03/15	500,000.00	500,644.50	
US TREASURY N/B-1.625%-19/03/31	2,000,000.00	2,032,110.00	
US TREASURY N/B-0.875%-19/04/15	1,200,000.00	1,197,632.40	
US TREASURY N/B-1.625%-19/04/30	5,000,000.00	5,082,715.00	
US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	4,000,000.00	4,219,064.00	
US TREASURY N/B-0.875%-19/05/15	3,000,000.00	2,993,436.00	
US TREASURY N/B-1.5%-19/05/31	4,100,000.00	4,155,813.30	
US TREASURY N/B-1.625%-19/06/30	1,090,000.00	1,108,585.59	
US TREASURY N/B-1.625%-19/07/31	3,000,000.00	3,052,032.00	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	4,320,000.00	4,634,889.12	
US TREASURY N/B-8.125%-19/08/15	3,210,000.00	3,843,159.66	
US TREASURY N/B-1.0%-19/08/31	3,300,000.00	3,300,257.40	
US TREASURY N/B-1.625%-19/08/31	3,600,000.00	3,663,072.00	
US TREASURY N/B-1.75%-19/09/30	8,000,000.00	8,171,720.00	
US TREASURY N/B-1.5%-19/10/31	4,100,000.00	4,158,297.90	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	10,780,000.00	11,539,440.22	
US TREASURY N/B-1.625%-19/12/31	1,800,000.00	1,832,203.80	
US TREASURY N/B-1.25%-20/01/31	4,000,000.00	4,023,048.00	
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	11,070,000.00	11,986,086.78	
US TREASURY N/B-1.375%-20/03/31	1,100,000.00	1,110,334.50	

US TREASURY N/B-1.375%-20/04/30	1,930,000.00	1,948,055.15	
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	8,710,000.00	9,430,952.83	
US TREASURY N/B-1.375%-20/05/31	2,440,000.00	2,461,493.96	
US TREASURY N/B-1.5%-20/05/31	5,100,000.00	5,167,437.30	
US TREASURY N/B-1.875%-20/06/30	380,000.00	390,063.92	
US TREASURY N/B-1.625%-20/06/30	4,000,000.00	4,070,704.00	
US TREASURY N/B-2.0%-20/07/31	8,250,000.00	8,507,490.75	
US TREASURY N/B-1.625%-20/07/31	4,000,000.00	4,069,608.00	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	7,600,000.00	9,757,837.60	
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	5,000,000.00	5,271,775.00	
US TREASURY N/B-2.125%-20/08/31	1,450,000.00	1,502,363.85	
US TREASURY N/B-1.375%-20/08/31	2,300,000.00	2,318,508.10	
US TREASURY N/B-1.375%-20/09/30	3,800,000.00	3,829,092.80	
US TREASURY N/B-1.75%-20/10/31	2,000,000.00	2,044,024.00	
US TREASURY N/B-1.375%-20/10/31	1,060,000.00	1,067,722.10	
US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	3,500,000.00	3,697,557.50	
US TREASURY N/B-1.625%-20/11/30	1,120,000.00	1,138,987.36	
US TREASURY N/B-2.375%-20/12/31	3,000,000.00	3,143,202.00	
US TREASURY N/B-1.75%-20/12/31	2,000,000.00	2,044,024.00	
US TREASURY N/B-1.375%-21/01/31	2,000,000.00	2,012,618.00	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	8,550,000.00	9,409,505.85	
US TREASURY N/B-1.125%-21/02/28	2,000,000.00	1,991,640.00	
US TREASURY N/B-1.25%-21/03/31	500,000.00	500,215.00	
US TREASURY N/B-2.25%-21/04/30	4,800,000.00	5,009,529.60	
US TREASURY N/B-1.375%-21/04/30	2,000,000.00	2,010,664.00	
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	5,170,000.00	5,595,413.45	
US TREASURY N/B-1.375%-21/05/31	220,000.00	221,241.90	
US TREASURY N/B-2.125%-21/06/30	6,400,000.00	6,646,502.40	
US TREASURY N/B-2.25%-21/07/31	3,000,000.00	3,132,423.00	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	3,900,000.00	4,049,069.70	
US TREASURY N/B-1.125%-21/08/31	4,400,000.00	4,370,181.20	
US TREASURY N/B-2.125%-21/09/30	500,000.00	519,316.50	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	11,490,000.00	15,249,838.23	
US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	4,000,000.00	4,130,860.00	
US TREASURY N/B-2.125%-21/12/31	4,800,000.00	4,986,748.80	

US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,500,000.00	2,580,957.50	
US TREASURY N/B-1.75%-22/02/28	2,900,000.00	2,956,753.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/04/30	3,000,000.00	3,056,544.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	2,000,000.00	2,036,680.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/05/31	2,000,000.00	2,050,546.00	
US TREASURY N/B-2.125%-22/06/30	2,500,000.00	2,596,387.50	
US TREASURY N/B-2.0%-22/07/31	5,300,000.00	5,467,904.00	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	2,000,000.00	2,022,812.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/08/31	1,900,000.00	1,946,386.60	
US TREASURY N/B-1.75%-22/09/30	4,000,000.00	4,068,048.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	3,000,000.00	3,071,544.00	
US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	1,000,000.00	1,009,102.00	
US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	1,000,000.00	1,030,723.00	
US TREASURY N/B-2.125%-22/12/31	4,000,000.00	4,152,420.00	
US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	2,000,000.00	2,031,172.00	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	9,300,000.00	9,586,449.30	
US TREASURY N/B-1.5%-23/02/28	1,000,000.00	1,000,176.00	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	8,150,000.00	8,268,427.65	
US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	4,000,000.00	3,962,032.00	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,500,000.00	5,844,179.00	
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	4,321,484.00	
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	2,900,000.00	3,136,474.70	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	5,800,000.00	6,174,506.00	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,874,732.94	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	5,930,000.00	6,197,431.14	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	3,850,000.00	3,945,572.40	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	4,963,780.80	
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	3,920,000.00	4,011,798.56	
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	5,940,000.00	6,198,597.90	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	2,463,996.60	
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,070,000.00	3,039,898.65	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	3,100,000.00	3,065,670.60	
US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,450,000.00	3,521,779.45	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	2,920,000.00	4,178,166.68	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,000,000.00	1,363,203.00	

		US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	2,600,000.00	3,945,702.80	
		US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	3,500,000.00	5,016,826.50	
		US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	1,900,000.00	2,783,091.50	
		US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	1,170,000.00	1,594,490.04	
		US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	1,800,000.00	2,494,652.40	
		US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	2,300,000.00	3,074,092.60	
		US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,820,000.00	2,514,371.86	
		US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	1,750,000.00	2,378,734.75	
		US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	2,710,000.00	3,809,560.82	
		US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	2,610,000.00	3,551,740.20	
		US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	2,440,000.00	3,096,750.40	
		US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	2,500,000.00	3,349,950.00	
		US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,600,000.00	2,297,905.60	
		US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	2,650,000.00	3,621,285.95	
		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	3,700,000.00	4,618,928.30	
		US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	500,000.00	527,304.50	
		US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	2,259,648.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	5,800,000.00	6,257,544.60	
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	5,350,000.00	6,606,725.70	
		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	4,500,000.00	5,680,282.50	
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	3,000,000.00	3,704,298.00	
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	3,400,000.00	4,021,231.00	
		US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	5,900,000.00	6,672,876.40	
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	3,300,000.00	3,645,790.50	
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	3,300,966.90	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	3,200,000.00	3,535,062.40	
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	5,300,000.00	5,716,341.50	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	3,900,000.00	4,309,347.90	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	2,800,000.00	2,798,415.20	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	2,500,000.00	2,499,512.50	
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	2,036,705.75	
米ドル小計			588,270,000.00	633,270,241.00	(65,974,093,707)
加ドル	国債証券	CANADA GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	441,533.35	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-17/11/01	860,000.00	857,471.60	

		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/02/01	1,480,000.00	1,493,186.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/03/01	1,340,000.00	1,352,797.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-18/05/01	1,480,000.00	1,473,650.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	1,400,000.00	1,482,628.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-18/08/01	1,350,000.00	1,349,041.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/09/01	650,000.00	658,684.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-18/11/01	700,000.00	699,531.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/03/01	1,050,000.00	1,080,198.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	1,900,000.00	2,057,719.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/09/01	1,050,000.00	1,085,710.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-20/03/01	1,170,000.00	1,206,363.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	1,530,000.00	1,689,334.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-20/09/01	1,150,000.00	1,157,509.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/03/01	1,210,000.00	1,217,381.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	1,150,000.00	1,287,632.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/09/01	1,340,000.00	1,346,700.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	1,200,000.00	1,334,076.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,380,000.00	1,439,809.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,420,000.00	1,583,243.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	1,290,000.00	1,419,348.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	820,000.00	847,511.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	370,000.00	618,199.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	100,000.00	97,590.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	990,000.00	1,485,514.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	1,140,000.00	1,822,255.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	1,230,000.00	1,917,225.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	1,490,000.00	2,138,284.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,540,000.00	2,126,740.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	870,000.00	1,073,379.90	
			34,985,000.00	39,840,249.45	
				(3,107,937,859)	
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 17/12/14	13,600,000.00	13,997,612.32	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-4.75%- 18/06/14	18,000,000.00	17,828,523.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-18/12/13	23,900,000.00	25,357,125.64	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11	8,100,000.00	7,946,907.16	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	19,900,000.00	21,370,804.02	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	22,000,000.00	22,583,878.89	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	7,300,000.00	7,506,849.15	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	8,200,000.00	9,158,053.15	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	25,500,000.00	31,967,818.72	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	2,450,000.00	2,388,042.44	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	6,700,000.00	7,355,507.23	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	15,200,000.00	18,028,447.16	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	11,900,000.00	13,332,628.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	5,000,000.00	5,623,444.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	7,800,000.00	10,744,283.55	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	12,100,000.00	14,727,964.51	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	11,940,000.00	13,598,825.39	
		メキシコペソ小計	219,590,000.00	243,516,715.58 (1,368,563,941)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.0%-18/03/28	1,480,000.00	1,578,755.96	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-18/06/22	520,000.00	536,625.44	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	1,280,000.00	1,424,966.40	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-19/09/28	960,000.00	1,061,376.00	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	1,920,000.00	2,245,355.52	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	1,590,000.00	1,960,533.60	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	1,440,000.00	1,788,730.56	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,500,000.00	1,912,575.00	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	1,170,000.00	1,367,772.12	
		BELGIUM KINGDOM-0.2%-23/10/22	210,000.00	215,106.36	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	1,300,000.00	1,567,410.00	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,260,000.00	1,337,101.92	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	1,140,000.00	1,611,375.18	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	810,000.00	868,551.66	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,870,000.00	2,967,117.78	

BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	650,000.00	684,409.05	
BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	810,000.00	1,217,694.87	
BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	590,000.00	814,492.64	
BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,860,000.00	3,239,934.00	
BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	590,000.00	703,821.62	
BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,520,000.00	2,617,132.96	
BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	820,000.00	1,361,472.24	
BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	430,000.00	474,734.62	
BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	280,000.00	341,985.28	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%- 17/10/31	1,400,000.00	1,411,082.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.5%- 18/01/31	1,900,000.00	2,013,857.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%- 18/04/30	1,030,000.00	1,037,410.85	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%- 18/07/30	3,000,000.00	3,226,992.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.75%- 18/10/31	1,600,000.00	1,727,920.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%- 19/01/31	1,060,000.00	1,068,845.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 19/04/30	1,860,000.00	1,993,140.66	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%- 19/07/30	2,040,000.00	2,302,752.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%- 19/10/31	2,200,000.00	2,489,080.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 20/01/31	1,480,000.00	1,549,881.16	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%- 20/04/30	2,430,000.00	2,772,046.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.15%- 20/07/30	1,180,000.00	1,231,455.08	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%- 20/10/31	1,890,000.00	2,257,049.34	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	2,360,000.00	2,939,037.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.75%- 21/07/30	1,160,000.00	1,196,371.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%-	2,060,000.00	2,671,325.60	

22/01/31			
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%- 23/01/31	2,040,000.00	2,678,473.08	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	1,690,000.00	2,141,833.33	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	1,610,000.00	2,094,568.14	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	2,050,000.00	2,521,358.55	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	2,200,000.00	2,541,220.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	1,860,000.00	1,977,795.66	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,850,000.00	2,436,357.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	1,980,000.00	2,187,036.72	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 26/04/30	1,800,000.00	1,954,148.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,380,000.00	2,000,445.24	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%- 26/10/31	600,000.00	612,519.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,320,000.00	1,891,921.68	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	1,970,000.00	3,030,005.78	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,400,000.00	1,497,267.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,760,000.00	2,817,295.36	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,630,000.00	2,296,826.48	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,370,000.00	2,134,987.45	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,340,000.00	2,048,171.24	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	1,140,000.00	1,867,487.58	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%- 46/10/31	870,000.00	1,003,135.23	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-	260,000.00	315,698.50	

66/07/30			
BUNDESobligation-0.5%-18/02/23	1,850,000.00	1,878,776.75	
BUNDESobligation-0.25%-18/04/13	1,170,000.00	1,185,638.22	
BUNDESobligation-1.0%-18/10/12	1,880,000.00	1,941,413.96	
BUNDESobligation-1.0%-19/02/22	1,320,000.00	1,371,681.96	
BUNDESobligation-0.25%-20/10/16	1,000,000.00	1,033,726.00	
BUNDESobligation-0.0%-21/04/09	1,200,000.00	1,229,344.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-18/01/04	4,140,000.00	4,373,433.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-18/07/04	2,750,000.00	2,980,818.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-19/01/04	2,550,000.00	2,799,295.65	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%-19/07/04	3,770,000.00	4,196,160.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-20/01/04	3,220,000.00	3,625,829.48	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%-20/07/04	3,380,000.00	3,835,522.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%-20/09/04	2,150,000.00	2,390,507.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-21/01/04	1,800,000.00	2,035,877.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-21/07/04	1,730,000.00	2,042,593.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%-21/09/04	1,580,000.00	1,796,350.98	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%-22/01/04	2,000,000.00	2,260,382.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%-22/07/04	2,470,000.00	2,782,487.11	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-22/09/04	1,600,000.00	1,783,870.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/02/15	1,900,000.00	2,130,983.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/05/15	1,820,000.00	2,047,845.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%-23/08/15	1,780,000.00	2,071,791.84	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	1,910,000.00	2,828,757.75	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	2,780,000.00	3,205,790.36	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	1,400,000.00	1,591,346.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	1,830,000.00	2,011,956.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	1,370,000.00	1,450,103.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	2,340,000.00	2,577,034.98	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	1,590,000.00	1,673,029.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,150,000.00	1,952,818.45	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,450,000.00	2,357,901.55	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	1,140,000.00	1,761,779.94	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	830,000.00	1,499,268.01	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,670,000.00	2,909,347.08	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,840,000.00	3,239,719.28	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	2,090,000.00	3,529,209.53	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,240,000.00	2,238,357.48	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,480,000.00	2,873,081.08	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	1,390,000.00	2,276,287.63	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,900,000.00	2,813,005.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	1,600,000.00	2,402,612.80	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-18/03/16	1,000,000.00	1,009,360.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-18/06/15	1,000,000.00	1,010,897.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 17/11/01	1,700,000.00	1,764,338.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.75%- 18/01/15	850,000.00	859,857.45	

BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/02/01	2,510,000.00	2,657,301.86
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%- 18/05/15	950,000.00	955,054.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/06/01	1,100,000.00	1,163,021.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/08/01	2,880,000.00	3,110,690.88
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.3%- 18/10/15	700,000.00	704,550.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/12/01	2,150,000.00	2,309,530.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/02/01	2,660,000.00	2,914,689.68
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 19/03/01	2,720,000.00	3,006,318.08
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.1%- 19/04/15	1,000,000.00	1,001,316.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 19/05/01	1,400,000.00	1,486,003.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 19/08/01	730,000.00	758,933.55
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/09/01	3,210,000.00	3,590,770.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.05%- 19/12/01	1,100,000.00	1,132,319.10
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 20/02/01	2,640,000.00	3,015,144.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 20/03/01	2,920,000.00	3,321,850.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.7%- 20/05/01	750,000.00	764,640.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	2,950,000.00	3,378,590.75
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 20/11/01	700,000.00	712,320.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	2,100,000.00	2,415,153.30
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/05/01	1,200,000.00	1,383,174.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%- 21/06/01	100,000.00	100,432.70

BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	3,670,000.00	4,255,335.64	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 21/09/01	3,350,000.00	4,049,748.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 21/12/15	680,000.00	738,122.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	2,400,000.00	2,964,936.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 22/04/15	770,000.00	802,968.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,900,000.00	2,434,907.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 22/09/15	500,000.00	523,679.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	2,000,000.00	2,568,172.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/15	560,000.00	567,396.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	860,000.00	1,064,023.82	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,700,000.00	2,145,267.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	3,000,000.00	4,659,795.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,650,000.00	2,061,493.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,500,000.00	1,800,148.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,300,000.00	1,438,411.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	3,400,000.00	4,438,982.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	530,000.00	543,144.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	2,060,000.00	2,184,115.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,030,000.00	1,316,170.05	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	440,000.00	449,076.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	1,980,000.00	3,064,661.82	

BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	3,530,000.00	5,311,287.42	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	850,000.00	1,139,270.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	4,430,000.00	6,287,879.98	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	940,000.00	1,141,966.52	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	3,290,000.00	5,064,711.54	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,540,000.00	1,511,434.54	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,900,000.00	2,928,185.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	2,080,000.00	3,009,146.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	100,000.00	102,582.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	2,710,000.00	3,536,536.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,770,000.00	2,623,235.58	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	2,280,000.00	3,390,759.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,660,000.00	2,437,193.74	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,240,000.00	1,448,491.12	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	1,000,000.00	1,047,224.00	
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-18/09/15	210,000.00	217,075.95	
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	620,000.00	703,836.40	
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	740,000.00	841,548.72	
FINNISH GOVERNMENT-0.375%-20/09/15	300,000.00	310,197.00	
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	760,000.00	895,473.80	
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	300,000.00	335,107.20	
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	550,000.00	612,599.90	
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-23/09/15	160,000.00	162,082.88	
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	550,000.00	638,741.40	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	590,000.00	797,051.06	

FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	330,000.00	353,857.02	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	410,000.00	423,680.06	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	500,000.00	646,017.00	
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	310,000.00	324,049.20	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	410,000.00	597,908.74	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-17/10/25	3,640,000.00	3,819,947.04	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-18/04/25	3,850,000.00	4,118,522.10	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-18/05/25	3,000,000.00	3,077,610.00	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-18/10/25	2,300,000.00	2,525,584.00	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-18/11/25	1,100,000.00	1,137,071.10	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-19/02/25	570,000.00	577,997.10	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25	4,140,000.00	4,645,005.48	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-19/05/25	1,470,000.00	1,530,788.91	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-19/10/25	1,050,000.00	1,338,333.15	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	4,400,000.00	4,975,084.40	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-19/11/25	1,000,000.00	1,032,673.00	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	3,180,000.00	3,630,068.58	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-20/05/25	1,600,000.00	1,628,580.80	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	3,990,000.00	4,467,762.60	
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-20/11/25	2,550,000.00	2,622,022.20	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	3,900,000.00	4,640,181.00	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	3,920,000.00	4,634,263.20	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	3,770,000.00	4,463,680.00	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	2,950,000.00	3,399,228.95	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	1,150,000.00	1,809,229.45	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	3,230,000.00	3,648,349.60	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	3,990,000.00	5,240,294.43	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	3,290,000.00	3,876,511.59	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	4,050,000.00	4,624,350.75	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	3,010,000.00	3,117,745.96	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	2,930,000.00	4,493,108.12	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	3,635,000.00	3,912,234.18	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	3,320,000.00	4,360,647.36	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	710,000.00	727,461.74	
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	300,000.00	298,531.80	

FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,380,000.00	4,262,278.02	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	3,220,000.00	5,228,181.98	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	2,130,000.00	2,684,971.50	
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	1,220,000.00	1,372,456.08	
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	2,820,000.00	5,026,672.56	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	2,470,000.00	4,171,232.26	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	500,000.00	533,068.00	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	2,460,000.00	3,972,112.80	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	2,660,000.00	4,694,080.72	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	2,090,000.00	3,179,048.84	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	1,370,000.00	2,508,791.95	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	1,160,000.00	2,191,008.00	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-66/05/25	320,000.00	357,041.28	
IRISH TREASURY-5.5%-17/10/18	590,000.00	624,710.29	
IRISH TREASURY-4.5%-18/10/18	820,000.00	900,736.38	
IRISH TREASURY-4.4%-19/06/18	730,000.00	824,264.90	
IRISH TREASURY-5.9%-19/10/18	620,000.00	737,463.34	
IRISH TREASURY-4.5%-20/04/18	1,010,000.00	1,183,834.13	
IRISH TREASURY-5.0%-20/10/18	750,000.00	911,566.50	
IRISH TREASURY-0.8%-22/03/15	480,000.00	506,273.76	
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	510,000.00	639,881.70	
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	740,000.00	917,122.70	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	1,030,000.00	1,460,767.63	
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	540,000.00	566,830.98	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	740,000.00	892,627.22	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	535,000.00	620,538.47	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-18/01/15	1,030,000.00	1,054,521.21	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-18/04/15	990,000.00	999,422.82	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	2,080,000.00	2,247,138.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-19/01/15	1,050,000.00	1,094,202.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	1,780,000.00	2,005,737.82	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-20/01/15	1,340,000.00	1,377,818.82	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	1,530,000.00	1,764,732.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	1,590,000.00	1,872,544.59	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-22/01/15	700,000.00	714,826.70	

		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	1,500,000.00	1,730,338.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	870,000.00	1,095,721.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	970,000.00	1,451,070.53	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	950,000.00	1,081,911.30	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	940,000.00	1,096,854.98	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	760,000.00	777,153.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	150,000.00	155,399.10	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	1,480,000.00	2,364,403.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	1,250,000.00	1,670,087.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,400,000.00	2,348,351.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,560,000.00	2,709,930.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	990,000.00	1,542,433.86	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	1,110,000.00	1,181,963.52	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.15%-18/10/19	660,000.00	683,581.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	1,260,000.00	1,409,675.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.95%-19/06/18	530,000.00	566,207.48	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-19/10/18	610,000.00	624,988.92	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	1,400,000.00	1,631,890.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	1,490,000.00	1,777,316.70	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	840,000.00	1,025,446.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	1,040,000.00	1,274,899.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	890,000.00	1,013,079.88	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	890,000.00	1,013,091.45	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	680,000.00	750,492.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	750,000.00	1,088,766.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	380,000.00	400,944.08	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	800,000.00	1,322,751.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	500,000.00	648,350.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,180,000.00	1,956,005.76	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	650,000.00	1,006,453.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	360,000.00	693,564.84	
		ユーロ小計	435,010,000.00	538,822,014.54 (61,053,922,467)	
英債券	国債証券	UK TREASURY-5.0%-18/03/07	1,630,000.00	1,736,676.98	
		UK TREASURY-1.25%-18/07/22	2,930,000.00	2,981,975.27	

UK TREASURY-4.5%-19/03/07	2,110,000.00	2,324,025.74	
UK TREASURY-1.75%-19/07/22	1,880,000.00	1,955,839.20	
UK TREASURY-3.75%-19/09/07	1,650,000.00	1,815,445.50	
UK TREASURY-4.75%-20/03/07	2,090,000.00	2,401,096.50	
UK TREASURY-2.0%-20/07/22	1,870,000.00	1,980,846.12	
UK TREASURY-3.75%-20/09/07	1,920,000.00	2,171,385.60	
UK TREASURY-1.5%-21/01/22	2,580,000.00	2,690,617.50	
UK TREASURY-8.0%-21/06/07	1,270,000.00	1,706,798.72	
UK TREASURY-3.75%-21/09/07	1,880,000.00	2,175,799.20	
UK TREASURY-4.0%-22/03/07	1,520,000.00	1,800,088.88	
UK TREASURY-1.75%-22/09/07	2,130,000.00	2,269,529.91	
UK TREASURY-2.25%-23/09/07	2,010,000.00	2,215,361.70	
UK TREASURY-2.75%-24/09/07	1,500,000.00	1,716,075.00	
UK TREASURY-5.0%-25/03/07	2,170,000.00	2,888,491.34	
UK TREASURY-1.5%-26/07/22	690,000.00	717,010.05	
UK TREASURY-4.25%-27/12/07	1,420,000.00	1,873,589.18	
UK TREASURY-6.0%-28/12/07	1,000,000.00	1,538,246.00	
UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,780,000.00	2,557,149.78	
UK TREASURY-4.25%-32/06/07	2,110,000.00	2,934,906.61	
UK TREASURY-4.5%-34/09/07	2,100,000.00	3,062,367.00	
UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,670,000.00	2,403,474.02	
UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,700,000.00	2,668,258.80	
UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,460,000.00	2,168,467.92	
UK TREASURY-4.25%-40/12/07	1,920,000.00	2,887,647.36	
UK TREASURY-4.5%-42/12/07	2,790,000.00	4,436,490.60	
UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,380,000.00	1,834,974.96	
UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,740,000.00	2,430,263.22	
UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,560,000.00	2,489,496.36	
UK TREASURY-1.5%-47/07/22	90,000.00	86,520.60	
UK TREASURY-4.25%-49/12/07	1,340,000.00	2,222,617.80	
UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,530,000.00	2,407,302.00	
UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,650,000.00	2,939,852.85	
UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,440,000.00	2,546,997.12	
UK TREASURY-3.5%-68/07/22	1,590,000.00	2,686,338.39	
UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	1,180,000.00	1,282,681.24	

		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	860,000.00	1,132,921.00	
英債券小計			64,140,000.00	84,137,626.02	(10,665,285,474)
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-3.0%-18/01/08	435,000.00	456,214.08	
		SWITZERLAND-3.0%-19/05/12	400,000.00	440,923.20	
		SWITZERLAND-2.25%-20/07/06	400,000.00	447,406.00	
		SWITZERLAND-2.0%-21/04/28	220,000.00	248,818.24	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	1,160,000.00	1,511,670.24	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	230,000.00	347,662.02	
スイスフラン小計			2,845,000.00	3,452,693.78	(361,393,457)
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	8,900,000.00	9,960,248.10	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	8,700,000.00	10,709,917.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	9,200,000.00	11,206,612.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	7,020,000.00	7,879,950.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	6,000,000.00	7,324,284.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	4,450,000.00	4,825,410.90	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	4,480,000.00	6,712,603.52	
スウェーデンクローナ小計			48,750,000.00	58,619,026.02	(683,497,843)
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	6,700,000.00	7,346,885.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	6,900,000.00	7,774,078.20	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	4,900,000.00	5,196,293.20	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	4,190,000.00	4,752,629.01	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	3,470,000.00	3,621,951.30	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	3,110,000.00	3,174,930.58	
ノルウェークローネ小計			29,270,000.00	31,866,767.29	(400,883,932)
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-4.0%-17/11/15	5,250,000.00	5,507,244.75	
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-18/11/15	3,160,000.00	3,212,569.76	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	9,050,000.00	10,317,452.50	
		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	7,570,000.00	8,855,817.49	
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	7,200,000.00	8,025,746.40	
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	2,900,000.00	4,558,602.80	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	6,500,000.00	7,439,874.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	11,660,000.00	21,252,938.52	

デンマーククローネ小計			53,290,000.00	69,170,246.22 (1,053,462,849)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	2,140,000.00	2,219,077.28
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-18/04/25	1,800,000.00	1,856,520.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-18/07/25	2,480,000.00	2,514,596.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-18/10/25	1,450,000.00	1,400,627.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-19/07/25	2,190,000.00	2,268,183.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	1,850,000.00	2,038,330.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.5%-20/04/25	2,570,000.00	2,515,901.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	1,980,000.00	2,208,096.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25	2,410,000.00	2,376,260.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-21/07/25	2,030,000.00	1,969,100.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	1,610,000.00	1,858,487.40
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	2,220,000.00	2,602,728.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	2,790,000.00	3,013,339.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,580,000.00	2,646,435.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	3,210,000.00	3,079,032.00
POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	830,000.00	1,048,290.00		
ポーランドズロチ小計			34,140,000.00	35,615,003.18 (934,537,683)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-18/01/21	1,870,000.00	1,957,590.80
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-18/10/21	1,620,000.00	1,670,211.90
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	2,140,000.00	2,317,378.18
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-19/10/21	2,030,000.00	2,091,628.77
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	2,340,000.00	2,558,658.96
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-20/11/21	1,650,000.00	1,648,541.40
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	2,430,000.00	2,846,446.11
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	2,050,000.00	2,472,744.85
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	2,170,000.00	2,627,839.62
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	2,350,000.00	2,451,665.70
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	2,360,000.00	2,552,236.16
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	2,760,000.00	3,234,179.04
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	2,430,000.00	2,988,725.04
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	1,410,000.00	1,467,426.48
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	740,000.00	730,501.36

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,210,000.00	1,315,439.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,050,000.00	1,310,580.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	470,000.00	467,271.18	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	970,000.00	1,105,559.44	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	450,000.00	472,558.05	
豪ドル小計			34,500,000.00	38,287,183.04	(3,066,037,617)
シンガ ポールド ル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-1.375%-17/10/01	150,000.00	150,802.35	
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-18/04/01	640,000.00	636,864.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	560,000.00	592,110.40	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01	640,000.00	664,640.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-19/10/01	350,000.00	355,880.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-20/07/01	220,000.00	226,952.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	620,000.00	669,414.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	640,000.00	667,584.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	580,000.00	634,230.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	200,000.00	214,900.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	592,110.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	200,000.00	209,700.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	200,000.00	205,437.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	490,000.00	563,745.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	230,000.00	250,930.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	330,000.00	359,345.25	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	270,000.00	314,280.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	445,000.00	488,610.00	
SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	160,000.00	175,241.60			
シンガポールドドル小計			7,465,000.00	7,972,775.60	(597,878,442)
マレーシ アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.759%-19/03/15	100,000.00	101,820.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.659%-20/10/15	1,010,000.00	1,021,907.90	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	460,000.00	473,110.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.62%-21/11/30	850,000.00	863,169.05	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	380,000.00	386,653.42	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	300,000.00	305,492.10	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	880,000.00	894,080.00	

		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	450,000.00	461,138.40	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	350,000.00	348,775.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	590,000.00	619,110.60	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	550,000.00	566,916.35	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.314%-17/10/31	350,000.00	353,080.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	2,420,000.00	2,473,322.28	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.26%-18/03/01	820,000.00	828,200.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.58%-18/09/28	700,000.00	711,200.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	1,220,000.00	1,302,792.86	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	3,500,000.00	3,627,750.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.492%-20/03/31	350,000.00	353,234.70	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.889%-20/07/31	500,000.00	510,500.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	2,500,000.00	2,585,000.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	650,000.00	646,122.10	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,750,000.00	1,743,192.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	975,861.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,270,000.00	1,331,153.04	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	450,966.15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	850,000.00	821,505.45	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	430,000.00	422,582.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000.00	842,904.75	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	1,210,000.00	1,255,375.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	600,000.00	612,463.20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	450,000.00	443,497.05	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	600,000.00	569,993.40	
		マレーシアリングット小計	28,230,000.00	28,902,868.80 (726,329,092)	
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 18/12/21	4,800,000.00	4,816,110.24	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	6,000,000.00	5,865,210.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	5,500,000.00	5,203,653.67	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	5,600,000.00	5,404,205.24	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	15,600,000.00	17,378,517.78	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	6,200,000.00	5,647,535.36	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	11,150,000.00	9,228,902.38	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	5,220,000.00	4,787,604.43	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	2,350,000.00	2,253,705.81	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	8,300,000.00	6,045,923.76	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	8,200,000.00	7,530,181.77	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%- 40/01/31	3,230,000.00	3,097,117.47	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	8,000,000.00	5,815,771.20	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	6,650,000.00	6,191,292.63	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	11,000,000.00	10,265,396.35	
南アフリカランド小計		107,800,000.00	99,531,128.09 (753,450,639)	
合計			150,747,275,002 (150,747,275,002)	

(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 158銘柄	100.0%	43.7%
加ドル	国債証券 31銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 17銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 274銘柄	100.0%	40.5%
英ポンド	国債証券 38銘柄	100.0%	7.1%
スイスフラン	国債証券 6銘柄	100.0%	0.2%
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	16銘柄	100.0%	0.6%
豪ドル	国債証券	20銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	国債証券	19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	32銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券	15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27年10月26日現在	平成28年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	72,925,170	104,240,666
コール・ローン	285,788,705	50,541,363
国債証券	26,604,496,888	24,612,582,230
派生商品評価勘定	281,649,170	51,187,652
未収入金	-	29,274,906
未収利息	312,932,057	232,367,477
前払費用	8,181,942	13,547,188
流動資産合計	27,565,973,932	25,093,741,482
資産合計	27,565,973,932	25,093,741,482
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	188,640,533	367,233,287
未払解約金	1,979,140	15,536,210
未払利息	-	58
流動負債合計	190,619,673	382,769,555
負債合計	190,619,673	382,769,555
純資産の部		
元本等		
元本	18,545,853,210	16,161,520,366
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,829,501,049	8,549,451,561
元本等合計	27,375,354,259	24,710,971,927
純資産合計	27,375,354,259	24,710,971,927

平成27年10月26日現在

平成28年10月26日現在

負債純資産合計

27,565,973,932

25,093,741,482

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成27年10月26日現在	平成28年10月26日現在
1.	期首	平成26年10月28日	平成27年10月27日
	期首元本額	20,992,635,203円	18,545,853,210円
	期首からの追加設定元本額	1,001,818,363円	899,484,365円
	期首からの一部解約元本額	3,448,600,356円	3,283,817,209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)	891,171,689円	1,486,508,411円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	4,694,761円	4,051,425円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	4,975,446円	4,472,221円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	11,452,129円	9,906,785円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	27,842,931円	25,809,011円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	16,149,779,374円	13,595,561,920円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	78,119,674円	78,286,388円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	116,626,866円	113,311,207円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	108,965,676円	101,610,912円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	82,789,315円	76,213,618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	1,069,435,349円	665,788,468円
計	18,545,853,210円	16,161,520,366円
2. 受益権の総数	18,545,853,210口	16,161,520,366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26年10月28日 至 平成27年10月26日	自 平成27年10月27日 至 平成28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27年10月26日現在	平成28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。	(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。	(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。	(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

（平成28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	373,562,456
合計	373,562,456

(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	

(平成28年10月26日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超		時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引					
	買建	23,420	-	23,320	100	
	スウェーデンクローナ	23,420	-	23,320	100	
	売建	24,670,443,975	-	24,986,489,510	316,045,535	
	米ドル	10,560,572,846	-	10,883,685,520	323,112,674	
	加ドル	510,062,156	-	515,084,430	5,022,274	
	メキシコペソ	228,262,020	-	233,274,980	5,012,960	
	ユーロ	10,093,057,445	-	10,098,076,600	5,019,155	
	英ポンド	1,780,224,778	-	1,747,801,080	32,423,698	

スイスフラン	52,802,659	-	52,697,250	105,409
スウェーデンク ローナ	133,689,366	-	130,862,230	2,827,136
ノルウェークロー ネ	73,498,677	-	72,404,980	1,093,697
デンマーククロー ネ	187,370,230	-	184,844,870	2,525,360
ポーランドズロチ	163,748,566	-	160,090,610	3,657,956
豪ドル	480,266,289	-	497,474,780	17,208,491
シンガポールドル	87,939,411	-	87,665,410	274,001
マレーシアリン ギット	206,087,505	-	207,975,880	1,888,375
南アフリカランド	112,862,027	-	114,550,890	1,688,863
合計	24,670,467,395	-	24,986,512,830	316,045,635

(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27年10月26日現在		平成28年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.4761円	1口当たり純資産額	1.5290円
(1万口当たり純資産額)	(14,761円)	(1万口当たり純資産額)	(15,290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-1.875%-17/09/30	1,750,000.00	1,769,174.75	
		US TREASURY N/B-0.75%-17/10/31	1,500,000.00	1,500,790.50	
		US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	1,480,000.00	1,534,690.44	
		US TREASURY N/B-0.625%-17/11/30	1,700,000.00	1,698,073.90	
		US TREASURY N/B-2.75%-17/12/31	1,700,000.00	1,739,744.30	
		US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	2,750,000.00	2,846,035.50	
		US TREASURY N/B-0.75%-18/02/28	1,200,000.00	1,199,367.60	
		US TREASURY N/B-0.75%-18/03/31	300,000.00	299,777.40	
		US TREASURY N/B-0.625%-18/04/30	1,000,000.00	997,207.00	
		US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	200,000.00	209,632.80	
		US TREASURY N/B-1.0%-18/05/31	2,200,000.00	2,205,887.20	
		US TREASURY N/B-2.375%-18/06/30	700,000.00	717,868.90	
		US TREASURY N/B-1.375%-18/07/31	350,000.00	353,158.05	
		US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	770,000.00	814,109.45	
		US TREASURY N/B-1.5%-18/08/31	3,200,000.00	3,236,748.80	
		US TREASURY N/B-1.375%-18/09/30	600,000.00	605,625.00	
		US TREASURY N/B-1.75%-18/10/31	1,700,000.00	1,728,820.10	
		US TREASURY N/B-1.375%-18/11/30	600,000.00	605,765.40	
		US TREASURY N/B-1.375%-18/12/31	700,000.00	706,753.60	
		US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	660,000.00	687,508.80	
		US TREASURY N/B-1.5%-19/03/31	1,000,000.00	1,013,262.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-19/03/31	500,000.00	508,027.50	
		US TREASURY N/B-1.25%-19/04/30	1,200,000.00	1,208,788.80	
		US TREASURY N/B-1.625%-19/04/30	750,000.00	762,407.25	
		US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	1,600,000.00	1,687,625.60	
		US TREASURY N/B-1.5%-19/05/31	800,000.00	810,890.40	
US TREASURY N/B-1.625%-19/06/30	500,000.00	508,525.50			

US TREASURY N/B-0.875%-19/07/31	1,050,000.00	1,046,882.55	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	1,050,000.00	1,126,535.55	
US TREASURY N/B-1.25%-19/10/31	600,000.00	604,183.80	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	550,000.00	588,746.95	
US TREASURY N/B-1.0%-19/11/30	1,100,000.00	1,098,947.30	
US TREASURY N/B-1.375%-20/01/31	2,500,000.00	2,524,610.00	
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	1,400,000.00	1,515,855.60	
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	800,000.00	866,218.40	
US TREASURY N/B-1.5%-20/05/31	1,400,000.00	1,418,512.20	
US TREASURY N/B-2.0%-20/07/31	1,200,000.00	1,237,453.20	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	390,000.00	500,731.14	
US TREASURY N/B-1.375%-20/09/30	3,600,000.00	3,627,561.60	
US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	1,110,000.00	1,172,653.95	
US TREASURY N/B-2.125%-21/01/31	2,000,000.00	2,074,336.00	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	1,600,000.00	1,760,843.20	
US TREASURY N/B-2.25%-21/04/30	950,000.00	991,469.40	
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	1,650,000.00	1,785,770.25	
US TREASURY N/B-2.25%-21/07/31	300,000.00	313,242.30	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	2,420,000.00	2,512,499.66	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	970,000.00	1,287,410.19	
US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	1,500,000.00	1,549,072.50	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,050,000.00	2,116,385.15	
US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	2,350,000.00	2,393,099.00	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	2,800,000.00	2,831,936.80	
US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	1,100,000.00	1,133,795.30	
US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	400,000.00	406,234.40	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	300,000.00	309,240.30	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	1,550,000.00	1,572,523.05	
US TREASURY N/B-6.25%-23/08/15	580,000.00	758,100.60	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	1,000,000.00	1,062,578.00	
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	1,440,000.00	1,555,734.24	
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	1,200,000.00	1,297,851.60	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	1,200,000.00	1,277,484.00	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	1,900,000.00	2,004,760.30	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	1,200,000.00	1,254,117.60	

		US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	850,000.00	871,100.40	
		US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	500,000.00	517,060.50	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	2,200,000.00	2,175,637.20	
		US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	1,530,000.00	2,189,244.87	
		US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	210,000.00	286,272.63	
		US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	390,000.00	537,095.52	
		US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	170,000.00	231,678.04	
		US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	390,000.00	470,673.45	
		US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	100,000.00	135,927.70	
		US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	300,000.00	421,722.60	
		US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	230,000.00	312,988.60	
		US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	350,000.00	444,206.00	
		US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	200,000.00	273,304.60	
		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	200,000.00	249,671.80	
		US TREASURY N/B-3.125%-41/11/15	350,000.00	395,240.30	
		US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	950,000.00	1,073,556.05	
		US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	700,000.00	738,226.30	
		US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	900,000.00	1,016,841.60	
		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	750,000.00	809,165.25	
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	890,000.00	1,099,062.78	
		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	200,000.00	252,457.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	1,650,000.00	2,037,363.90	
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	120,000.00	141,925.80	
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	1,150,000.00	1,270,502.75	
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	1,300,000.00	1,300,380.90	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	450,000.00	497,118.15	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	200,000.00	220,992.20	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	2,050,000.00	2,048,839.70	
			97,900,000.00	103,551,899.21	
				(10,788,036,859)	
米ドル小計					
加ドル	国債証券	CANADA GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	100,000.00	131,801.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/02/01	350,000.00	353,118.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	500,000.00	529,510.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-18/08/01	350,000.00	349,751.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	350,000.00	379,053.50	

		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/09/01	300,000.00	310,203.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	750,000.00	828,105.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	300,000.00	335,904.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	750,000.00	833,797.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	150,000.00	250,621.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	480,000.00	720,249.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	710,000.00	1,106,691.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	200,000.00	287,018.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	100,000.00	138,100.00	
加ドル小計			5,390,000.00	6,553,924.30	(511,271,634)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 17/12/14	4,000,000.00	4,116,944.80	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-18/12/13	8,000,000.00	8,487,740.80	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	6,000,000.00	6,443,458.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	5,000,000.00	6,268,199.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	6,000,000.00	7,116,492.30	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	2,500,000.00	2,800,972.37	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	4,500,000.00	5,477,342.17	
メキシコペソ小計			36,000,000.00	40,711,150.69	(228,796,666)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	100,000.00	111,325.50	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	650,000.00	760,146.40	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	200,000.00	246,608.00	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	350,000.00	434,760.90	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	420,000.00	490,995.12	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	300,000.00	361,710.00	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	380,000.00	602,943.72	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	170,000.00	255,565.59	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	560,000.00	975,464.00	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	400,000.00	688,719.20	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	120,000.00	199,239.84	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%- 18/07/30	550,000.00	591,615.20	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%- 19/07/30	560,000.00	632,128.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%- 19/10/31	400,000.00	452,560.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 20/01/31	1,000,000.00	1,047,217.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%- 20/04/30	400,000.00	456,304.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%- 20/10/31	620,000.00	740,407.72	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	650,000.00	809,480.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	500,000.00	648,380.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	1,800,000.00	2,341,753.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	300,000.00	318,999.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	200,000.00	263,390.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	150,000.00	165,684.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	650,000.00	942,238.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	530,000.00	815,179.22	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	780,000.00	1,099,094.88	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	400,000.00	611,394.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	150,000.00	245,722.05	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 18/01/04	250,000.00	264,096.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 18/07/04	1,200,000.00	1,300,720.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 19/01/04	710,000.00	779,411.73	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 20/01/04	450,000.00	506,715.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%- 20/07/04	800,000.00	907,816.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 20/09/04	700,000.00	778,304.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 21/01/04	550,000.00	622,073.65
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	250,000.00	295,172.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	300,000.00	339,057.30
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	300,000.00	334,475.70
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	1,000,000.00	1,121,570.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	500,000.00	562,595.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	200,000.00	232,785.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	470,000.00	696,081.75
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	250,000.00	274,857.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	150,000.00	158,770.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	560,000.00	910,637.84
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	350,000.00	632,221.45
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	720,000.00	1,254,329.28
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	460,000.00	776,763.82
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	250,000.00	451,281.75
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	190,000.00	368,841.49
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	150,000.00	245,642.55
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	450,000.00	666,238.05
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	100,000.00	150,163.30
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/02/01	730,000.00	772,840.78

BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/08/01	900,000.00	972,090.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/02/01	510,000.00	558,831.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 19/05/01	500,000.00	530,715.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/09/01	700,000.00	783,034.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 20/02/01	850,000.00	970,785.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 20/03/01	950,000.00	1,080,739.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	400,000.00	458,114.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	1,480,000.00	1,716,048.16	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	800,000.00	988,312.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	750,000.00	961,147.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	450,000.00	556,756.65	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	600,000.00	757,153.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	430,000.00	667,903.95	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	200,000.00	240,019.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	650,000.00	848,628.95	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,150,000.00	1,469,510.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	900,000.00	1,354,152.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	300,000.00	402,095.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	450,000.00	638,723.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	650,000.00	1,000,626.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	250,000.00	385,287.50	

BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	250,000.00	361,676.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	160,000.00	208,799.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	600,000.00	889,232.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	500,000.00	743,587.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	150,000.00	220,228.35	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	400,000.00	467,255.20	
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	160,000.00	181,635.20	
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	350,000.00	398,029.80	
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	100,000.00	111,381.80	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	200,000.00	270,186.80	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	150,000.00	193,805.10	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	100,000.00	145,831.40	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-18/04/25	1,700,000.00	1,818,568.20	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25	750,000.00	841,486.50	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-19/10/25	590,000.00	752,015.77	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	770,000.00	870,639.77	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	700,000.00	799,071.70	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	430,000.00	481,488.20	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	530,000.00	630,588.70	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	500,000.00	591,105.00	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	150,000.00	177,600.00	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	1,650,000.00	1,901,263.65	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	750,000.00	847,140.00	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	1,150,000.00	1,510,360.55	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	350,000.00	412,394.85	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	350,000.00	399,635.25	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	400,000.00	414,318.40	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	1,100,000.00	1,686,832.40	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	1,700,000.00	1,829,655.60	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	1,100,000.00	1,444,792.80	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	660,000.00	1,071,614.94	

FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	300,000.00	534,752.40	
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	730,000.00	1,232,793.34	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	410,000.00	662,018.80	
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	250,000.00	441,173.00	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	300,000.00	456,322.80	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	320,000.00	585,995.20	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	200,000.00	377,760.00	
IRISH TREASURY -4.5%-20/04/18	800,000.00	937,690.40	
IRISH TREASURY -3.9%-23/03/20	200,000.00	250,934.00	
IRISH TREASURY -5.4%-25/03/13	300,000.00	425,466.30	
IRISH TREASURY -2.4%-30/05/15	100,000.00	120,625.30	
IRISH TREASURY -2.0%-45/02/18	100,000.00	115,988.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT -4.0%-18/07/15	620,000.00	669,820.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT -4.0%-19/07/15	200,000.00	225,363.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT -3.5%-20/07/15	600,000.00	692,052.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT -3.25%-21/07/15	300,000.00	353,310.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT -3.75%-23/01/15	270,000.00	340,051.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT -1.75%-23/07/15	150,000.00	170,828.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT -0.25%-25/07/15	150,000.00	153,385.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT -0.5%-26/07/15	200,000.00	207,198.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT -5.5%-28/01/15	820,000.00	1,310,007.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT -4.0%-37/01/15	500,000.00	838,697.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT -3.75%-42/01/15	150,000.00	260,570.25	
REPUBLIC OF AUSTRIA -4.65%-18/01/15	270,000.00	287,504.64	
REPUBLIC OF AUSTRIA -4.35%-19/03/15	350,000.00	391,576.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA -3.9%-20/07/15	200,000.00	233,127.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA -3.5%-21/09/15	250,000.00	298,207.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA -1.75%-23/10/20	150,000.00	170,743.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA -1.65%-24/10/21	350,000.00	398,406.75	
REPUBLIC OF AUSTRIA -4.85%-26/03/15	550,000.00	798,428.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA -6.25%-27/07/15	200,000.00	330,687.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA -4.15%-37/03/15	200,000.00	331,526.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA -3.15%-44/06/20	150,000.00	232,258.50	
ユーロ小計	68,290,000.00	87,560,661.98	(9,921,498,608)

英ポンド	国債証券	UK TREASURY-5.0%-18/03/07	660,000.00	703,194.36	
		UK TREASURY-4.5%-19/03/07	830,000.00	914,190.22	
		UK TREASURY-1.75%-19/07/22	450,000.00	468,153.00	
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	390,000.00	448,051.50	
		UK TREASURY-2.0%-20/07/22	200,000.00	211,855.20	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	570,000.00	766,043.52	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	300,000.00	347,202.00	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	600,000.00	639,304.20	
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	400,000.00	457,620.00	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	150,000.00	197,914.35	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	270,000.00	415,326.42	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	550,000.00	790,130.55	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	430,000.00	598,108.93	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	400,000.00	583,308.00	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	260,000.00	374,193.56	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	370,000.00	580,738.68	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	300,000.00	451,194.90	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	620,000.00	985,886.80	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	200,000.00	265,938.40	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	800,000.00	1,276,664.80	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	560,000.00	997,768.24	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	250,000.00	442,187.00	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	200,000.00	337,904.20	
UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	300,000.00	326,105.40			
英ポンド小計			10,060,000.00	13,578,984.23	(1,721,272,040)
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-3.0%-18/01/08	150,000.00	157,315.20	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	140,000.00	182,442.96	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	100,000.00	151,157.40	
スイスフラン小計			390,000.00	490,915.56	(51,384,131)
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	1,678,693.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	2,100,000.00	2,585,152.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	1,950,000.00	2,375,314.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	500,000.00	561,250.00	

		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	1,850,000.00	2,258,320.90	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	500,000.00	542,181.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	700,000.00	1,048,844.30	
スウェーデンクローナ小計			9,100,000.00	11,049,756.70	(128,840,163)
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	1,000,000.00	1,096,550.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	1,400,000.00	1,577,349.20	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	1,400,000.00	1,484,655.20	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	450,000.00	510,425.55	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	1,000,000.00	1,043,790.00	
ノルウェークローネ小計			5,250,000.00	5,712,769.95	(71,866,645)
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	1,048,999.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	1,800,000.00	2,052,090.00	
		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	2,450,000.00	2,866,149.65	
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	650,000.00	1,021,755.80	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	500,000.00	572,298.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	2,300,000.00	4,192,260.60	
デンマーククローネ小計			8,700,000.00	11,753,553.05	(179,006,612)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	2,000,000.00	2,073,904.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	1,000,000.00	1,115,200.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	1,000,000.00	1,172,400.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	800,000.00	820,600.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	800,000.00	767,360.00	
ポーランドズロチ小計			5,600,000.00	5,949,464.00	(156,113,935)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-18/01/21	300,000.00	314,052.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	1,350,000.00	1,461,897.45	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	970,000.00	1,136,235.69	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	300,000.00	361,865.10	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	300,000.00	363,295.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	400,000.00	417,304.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	180,000.00	210,924.72	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	800,000.00	983,942.40	

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	250,000.00	271,785.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	550,000.00	626,863.60	
豪ドル小計			5,400,000.00	6,148,166.56	(492,345,178)
シンガポール	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	400,000.00	422,936.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	100,000.00	104,310.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	400,000.00	460,200.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	150,000.00	164,700.00	
シンガポール小計			1,050,000.00	1,152,146.00	(86,399,428)
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	1,028,500.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	2,150,000.00	2,197,373.10	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	1,400,000.00	1,451,100.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	600,000.00	597,666.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	550,000.00	576,483.60	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	600,000.00	591,329.40	
マレーシアアリンギット小計			6,300,000.00	6,442,452.10	(161,898,821)
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	1,505,034.45	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	1,500,000.00	1,466,302.50	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	4,000,000.00	4,456,030.20	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	2,100,000.00	1,529,691.55	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	2,000,000.00	1,836,629.70	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	4,550,000.00	4,246,141.21	
南アフリカランド小計			15,650,000.00	15,039,829.61	(113,851,510)
合計				24,612,582,230	(24,612,582,230)

(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 90銘柄	100.0%	43.8%
加ドル	国債証券 14銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 139銘柄	100.0%	40.3%
英ポンド	国債証券 24銘柄	100.0%	7.0%
スイスフラン	国債証券 3銘柄	100.0%	0.2%
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 5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.7%
ポーランドズロチ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.6%
豪ドル	国債証券 10銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	国債証券 4銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 6銘柄	100.0%	0.7%
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2016年10月31日現在です。

【アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)】

【純資産額計算書】

資産総額	309,446,076円
負債総額	115,706円
純資産総額(-)	309,330,370円
発行済口数	224,318,609口
1口当たり純資産額(/)	1.3790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	26,749,562,496円
負債総額	538,738,605円
純資産総額(-)	26,210,823,891円
発行済口数	21,741,892,222口
1口当たり純資産額(/)	1.2055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	69,402,952,155円
負債総額	51,926,610円
純資産総額(-)	69,351,025,545円
発行済口数	38,955,242,918口
1口当たり純資産額(/)	1.7803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	3,300,054,051円
負債総額	73,416,774円
純資産総額（ - ）	3,226,637,277円
発行済口数	2,484,383,032口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2988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	34,278,294,973円
負債総額	305,405,983円
純資産総額（ - ）	33,972,888,990円
発行済口数	24,215,772,338口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4029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	152,805,493,618円
負債総額	248,894,696円
純資産総額（ - ）	152,556,598,922円
発行済口数	73,944,873,493口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0631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	25,094,963,278円
負債総額	579,971,420円
純資産総額（ - ）	24,514,991,858円
発行済口数	16,174,072,696口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5157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なわないものとします。

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

平成28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28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28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28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	670	118,616

株式投資信託	621	97,108
単位型	158	6,801
追加型	463	90,306
公社債投資信託	49	21,508
単位型	35	438
追加型	14	21,070

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57期事業年度（平成27年4月1日から平成28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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第58期中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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56期 (平成27年3月31日)		第57期 (平成28年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	14,206	3	14,308
金銭の信託		-	3	153
有価証券		277		86
前払費用	3	509	3	489
未収入金		3		10
未収委託者報酬		8,441		9,374
未収収益	3	1,566	3	2,280
関係会社短期貸付金		436		5,333
立替金		666		2,960
繰延税金資産		1,446		819
その他	2	195	2,3	428
流動資産合計		27,750		36,243
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	56	1	146
器具備品	1	166	1	210
有形固定資産合計		222		356

無形固定資産		
ソフトウェア	113	140
無形固定資産合計	113	140
投資その他の資産		
投資有価証券	14,184	12,195
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	740	781
長期前払費用	0	0
繰延税金資産	248	425
投資その他の資産合計	36,936	35,165
固定資産合計	37,273	35,662
資産合計	65,023	71,905

(単位：百万円)

	第56期 (平成27年3月31日)		第57期 (平成28年3月31日)
負債の部			
流動負債			
預り金	387		410
未払金	5,545		3,841
未払収益分配金	6		6
未払償還金	112		112
未払手数料	3	3,145	3
その他未払金		2,282	
未払費用	3	4,636	3
未払法人税等		814	
未払消費税等	4	1,070	4
関係会社短期借入金		-	
賞与引当金		1,990	
役員賞与引当金		120	
その他	3	82	3
流動負債合計		14,646	
固定負債			
退職給付引当金		1,111	
固定負債合計		1,111	
負債合計		15,758	
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		25,836	
利益剰余金合計		25,836	

自己株式	68	502
株主資本合計	48,351	52,028
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,002	151
繰延ヘッジ損益	88	258
評価・換算差額等合計	913	410
純資産合計	49,265	52,438
負債純資産合計	65,023	71,905

(2)【損益計算書】

(単位：百万円)

	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	63,990	66,339
その他営業収益	3,729	4,382
営業収益合計	67,719	70,722
営業費用		
支払手数料	30,408	30,529
広告宣伝費	1,045	1,098
公告費	5	3
調査費	15,571	17,470
調査費	747	821
委託調査費	14,782	16,600
図書費	41	48
委託計算費	502	505
営業雑経費	660	718
通信費	199	195
印刷費	263	321
協会費	64	65
諸会費	27	22
その他	106	113
営業費用計	48,193	50,327
一般管理費		
給料	7,585	8,138
役員報酬	289	365
役員賞与引当金繰入額	120	145
給料・手当	5,127	5,495
賞与	59	51
賞与引当金繰入額	1,990	2,080
交際費	163	185
寄付金	36	27
旅費交通費	503	503
租税公課	208	258
不動産賃借料	785	875
退職給付費用	349	372
退職金	16	113
固定資産減価償却費	148	196
福利費	908	952
諸経費	2,673	2,952

一般管理費計	13,380	14,577
営業利益	6,146	5,817

(単位：百万円)

	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業外収益		
受取利息	10	91
受取配当金	1 1,152	1 1,330
有価証券償還益	13	-
時効成立分配金・償還金	1	1
為替差益	-	32
その他	107	32
営業外収益合計	1,285	1,488
営業外費用		
支払利息	28	242
有価証券償還損	81	-
デリバティブ費用	269	69
時効成立後支払分配金・償還金	295	5
支払源泉所得税	71	119
為替差損	26	-
その他	21	94
営業外費用合計	795	531
経常利益	6,636	6,774
特別利益		
投資有価証券売却益	270	720
その他	-	0
特別利益合計	270	720
特別損失		
投資有価証券売却損	22	100
固定資産処分損	0	6
特別賞与	-	204
割増退職金	243	91
役員退職一時金	-	64
外国税関連費用	2 1,650	-
特別損失合計	1,916	467
税引前当期純利益	4,991	7,027
法人税、住民税及び事業税	2,356	1,359
法人税等調整額	466	706
法人税等合計	1,890	2,065
当期純利益	3,101	4,962

(3) 【株主資本等変動計算書】

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

第57期（自 平成27年4月1日 至 平成28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	25,836	25,836	68	48,351

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	25,836	25,836	68	48,351
当期変動額							
剰余金の配当				850	850		850
当期純利益				4,962	4,962		4,962
自己株式の取得						434	434
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	4,111	4,111	434	3,676
当期末残高	17,363	5,220	5,220	29,948	29,948	502	52,028

	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
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	1,002	88	913	49,265
当期変動額				
剰余金の配当				850
当期純利益				4,962
自己株式の取得				434
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	851	347	503	503
当期変動額合計	851	347	503	3,173
当期末残高	151	258	410	52,438

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31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 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

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。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>3年～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>5年～20年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	3年～15年	器具備品	5年～20年
建物	3年～15年				
器具備品	5年～20年				
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の日次事業年度から費用処理しております。</p>				
4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>				
5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。</p>				

(会計方針の変更)

第57期
(自 平成27年 4月 1日
至 平成28年 3月31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。）等を当事業年度から適用し、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いたしました。また、当事業年度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事業年度の財務諸表に反映させる方法に変更いたします。

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、当事業年度の期首時点から将来にわたって適用しております。

なお、当事業年度において、財務諸表及び1株当たり情報に与える影響額はありません。

（未適用の会計基準等）

- ・「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

（1）概要

繰延税金資産の回収可能性に関する取扱いについて、監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」の枠組み、すなわち企業を5つに分類し、当該分類に応じて繰延税金資産の計上額を見積もる枠組みを基本的に踏襲した上で、以下の取扱いについて必要な見直しが行われております。

（分類1）から（分類5）に係る分類の要件をいずれも満たさない企業の取扱い

（分類2）及び（分類3）に係る分類の要件

（分類2）に該当する企業におけるスケジュールリング不能な将来減算一時差異に関する取扱い

（分類3）に該当する企業における将来の一時差異等加減算前課税所得の合理的な見積可能期間に関する取扱い

（分類4）に係る分類の要件を満たす企業が（分類2）又は（分類3）に該当する場合の取扱い

（2）適用予定日

平成29年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

（貸借対照表関係）

第56期 (平成27年3月31日)	第57期 (平成28年3月31日)
1 有形固定資産の減価償却累計額	1 有形固定資産の減価償却累計額
建物 1,122百万円	建物 1,170百万円
器具備品 679百万円	器具備品 653百万円
2 信託資産	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。	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 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。	3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。
(流動資産)	(流動資産)
現金・預金 4,256百万円	現金・預金 4,072百万円
前払費用 2百万円	金銭の信託 153百万円
未収収益 110百万円	前払費用 2百万円
(流動負債)	未収収益 147百万円
未払手数料 108百万円	その他 193百万円
未払費用 500百万円	(流動負債)
その他 57百万円	未払手数料 93百万円
	未払費用 722百万円
	その他 266百万円

<p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示していません。</p> <p>5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務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>	<p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示していません。</p> <p>5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務728百万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689百万円に対して保証を行っております。</p>
--	---

(損益計算書関係)

第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28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 style="text-align: right;">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>	<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 style="text-align: right;">受取配当金 1,193百万円 支払利息 123百万円 デリバティブ費用 889百万円</p>

(株主資本等変動計算書関係)

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

	新株予約権の目的となる株式の数(株)	当事業

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	年度末残高(百万円)
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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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	704,500	-	814,100

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	-	14,140,500	1,762,200	-
平成21年度 ストックオプション (2)	普通株式	1,567,500	-	1,392,600	174,900	-

平成22年度 ストックオプション (1)	普通株式	2,310,000	-	2,310,000	-	-
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	-	18,133,500	6,675,900	-

(注) 1 当事業年度の減少は、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)1,762,200株、平成21年度ストックオプション(2) 174,900株及び平成23年度ストックオプション(1)4,738,800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28年5月30日 取締役会	普通株式	利益 剰余金	1,495	7.62	平成28年3月31日	平成28年6月22日

(リース取引関係)

第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28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	841百万円	1年内	865百万円
1年超	3,420百万円	1年超	2,653百万円
合計	4,261百万円	合計	3,518百万円

(金融商品関係)

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されており、ま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	(57)	(57)	-
デリバティブ取引計	(82)	(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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されており、ま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。

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

平成28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	14,308	14,308	-
(2) 未収委託者報酬	9,374	9,374	-
(3) 未収収益	2,280	2,280	-
(4) 関係会社短期貸付金	5,333	5,333	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	12,265	12,265	-

(6) 未払金	(3,841)	(3,841)	-
(7) 未払費用	(4,920)	(4,920)	-
(8) 関係会社短期借入金	(5,631)	(5,631)	-
(9) 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	(254)	(254)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	170	170	-
デリバティブ取引計	(84)	(84)	-

(1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金、(7) 未払費用並びに(8) 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。

(9) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されないものは貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されるもののうち193百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、23百万円は流動負債のその他に含まれております。

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

3 子会社株式(貸借対照表計上額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	14,308			
未収委託者報酬	9,374			
未収収益	2,280			
有価証券及び投資有価証券				
投資信託	86	714	1,766	963
合計	26,049	714	1,766	963

(有価証券関係)

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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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	5,593	4,872	720
	小計	5,593	4,872	720
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	6,672	7,175	502
	小計	6,672	7,175	502

合計	12,265	12,047	218
----	--------	--------	-----

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
株式	30	17	-
投資信託	5,442	703	100
合計	5,473	720	100

(デリバティブ取引関係)

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)
原則的処理方法	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	投資有価証券	2,586	-	68
	豪ドル		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。

第57期(平成28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	1,093	-	11	11
	買建	-	-	-	-
合計		1,093	-	11	11

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

2 時価の算定方法
金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等のうち 1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	買建 米ドル	5,631	-	243	243
合計		5,631	-	243	243

(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				
	米ドル	投資有価証券	3,943	-	179
	豪ドル		767	-	18
	シンガポールドル		75	-	4
	香港ドル		151	-	5
	人民元		1,948	-	8
ユーロ	173		-	0	
合計			7,060	-	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。

(持分法損益等)

第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28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 3,078	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,037
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 9,396	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 9,686
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,720	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,901

(退職給付関係)

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。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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	1,233
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期首残高	1,233
勤務費用	145
利息費用	7
数理計算上の差異の発生額	33
退職給付の支払額	119
退職給付債務の期末残高	1,299

(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	1,299
未積立退職給付債務	1,299
未認識数理計算上の差異	144
貸借対照表に計上された負債の額	1,154
退職給付引当金	1,154
貸借対照表に計上された負債の額	1,154

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	145
利息費用	7
数理計算上の差異の費用処理額	9
確定給付制度に係る退職給付費用	162

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.2%

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、209百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27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	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57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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	14,140,500	1,392,600
権利確定	0	0
権利未確定残	1,762,200	174,900
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日
権利確定前(株)		
期首	2,310,000	5,029,200
付与	0	0
失効	2,310,000	290,400
権利確定	0	0
権利未確定残	0	4,738,800
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。

(税効果会計関係)

第56期 (平成27年3月31日)		第57期 (平成28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		賞与引当金
	658		642
	その他		その他
	813		177
	小計		小計
	1,472		819
	繰延税金資産(固定)		繰延税金資産(固定)
	投資有価証券評価損		投資有価証券評価損
	134		96
	関係会社株式評価損		関係会社株式評価損
	1,510		1,430
	退職給付引当金		退職給付引当金
	360		353
	固定資産減価償却費		固定資産減価償却費
	133		122
	その他		その他
	73		65
	小計		小計
	2,213		2,068
	繰延税金資産小計		繰延税金資産小計
	3,685		2,888
	評価性引当金		評価性引当金
	1,510		1,430
	繰延税金資産合計		繰延税金資産合計
	2,174		1,457
	繰延税金負債(流動)		繰延税金負債(流動)
	その他有価証券評価差額金		その他有価証券評価差額金
	25		71
	小計		繰延ヘッジ利益
	25		114
	繰延税金負債(固定)		その他
	その他有価証券評価差額金		26
	454		小計
	454		213
	繰延税金負債合計		繰延税金負債合計
	480		213
	繰延税金資産の純額		繰延税金資産の純額
	1,694		1,244
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		法定実効税率
	35.6%		33.1%
	(調整)		(調整)
	交際費等永久に損金に算入されない項目		交際費等永久に損金に算入されない項目
	1.3%		1.4%
	受取配当金等永久に益金に算入されない項目		受取配当金等永久に益金に算入されない項目
	4.3%		4.8%
	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正		税率変更による期末繰延税金資産の減額修正
	3.6%		1.3%
	海外子会社の留保利益の影響額等		所得拡大促進税制
	1.7%		2.2%
	税効果会計適用後の法人税等の負担率		海外子会社の留保利益の影響額等
	37.9%		0.6%
			税効果会計適用後の法人税等の負担率
			29.4%

第56期 (平成27年3月31日)	第57期 (平成28年3月31日)
<p>3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」(平成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>	<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28年法律第15号)及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」(平成28年法律第13号)が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28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28年4月1日に開始する事業年度及び平成29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30.9%に、平成30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30.6%となります。この税率変更により、繰延税金資産の純額(繰延税金負債の金額を控除した金額)が59百万円減少し、その他有価証券評価差額金が3百万円、繰延ヘッジ損益が6百万円、法人税等調整額が69百万円、それぞれ増加しております。</p>

(関連当事者情報)

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 貸建) (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 貸建) (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

- 1 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 2 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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	292,000(千SGD)	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)	90(千SGD1,000)(注2)	関係会社短期貸付金	333(千SGD4,000)
							貸付金利息(シンガポールドル貨建)(注1)	18(千SGD215)	未収収益	6(千SGD74)
							資金の貸付(円貨建)(注3)	5,000	関係会社短期貸付金	5,000
							貸付金利息(円貨建)(注3)	70	未収収益	70
	Nikko Asset	アメリカ	181,542	アセット	直接	資金の借入(米ドル貨建)(注5)	6,176(千USD50,000)	関係会社短期借入金	5,631(千USD50,000)	

子会社	Management Americas, Inc.	力合衆国	(千USD) (注4)	マネジメント業	100.00	借入	借入金利息 (米ドル 貸建) (注5)	113 (千 USD 949)	未払費用	106 (千 USD 949)
-----	---------------------------	------	----------------	---------	--------	----	------------------------------	-----------------------	------	-----------------------

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 2 資金の貸付に係る取引金額 90百万円 (SGD 1,000千) の内訳は、貸付957百万円 (SGD11,000千) 及び返済1,047百万円 (SGD12,000千) であります。
- 3 融資枠5,000百万円、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 4 Nikko Asset Management Americas, Inc.の「資本金」は、資本金と資本剰余金の合計額を記載しております。
- 5 融資枠USD50,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。

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27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	30,897百万円
負債合計	9,936百万円
純資産合計	20,960百万円
営業収益	26,843百万円
税引前当期純利益	9,553百万円
当期純利益	6,411百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

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。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	250円20銭	267円27銭
1株当たり当期純利益金額	15円74銭	25円25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いません。

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
当期純利益（百万円）	3,101	4,962
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）	3,101	4,962
普通株式の期中平均株式数（千株）	196,903	196,464
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、平成23年度ストックオプション(1)5,029,200株	平成21年度ストックオプション(1)1,762,200株、平成21年度ストックオプション(2)174,900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56期 (平成27年3月31日)	第57期 (平成28年3月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	49,265	52,438
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）	49,265	52,438
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	196,198

(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58期中間会計期間
(平成28年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金	16,370
金銭の信託	152
有価証券	29
未収委託者報酬	8,443
未収収益	1,681
関係会社短期貸付金	488

繰延税金資産		821
その他	2	2,083
流動資産合計		30,070
固定資産		
有形固定資産	1	323
無形固定資産		129
投資その他の資産		
投資有価証券		11,401
関係会社株式		23,203
関係会社長期貸付金		60
長期差入保証金		781
繰延税金資産		409
長期前払費用		0
投資その他の資産合計		35,857
固定資産合計		36,311
資産合計		66,382

(単位：百万円)

第58期中間会計期間
(平成28年9月30日)

負債の部

流動負債

未払金		4,011
未払費用		4,007
未払法人税等		1,052
未払消費税等	3	440
賞与引当金		1,112
役員賞与引当金		60
その他		517
流動負債合計		11,201

固定負債

退職給付引当金		1,203
固定負債合計		1,203

負債合計

12,404

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		31,627
利益剰余金合計		31,627

自己株式 672

株主資本合計 53,537

評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	340
繰延ヘッジ損益	780
評価・換算差額等合計	439
純資産合計	53,977
負債純資産合計	66,382

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第58期中間会計期間
(自 平成28年4月1日
至 平成28年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		32,215
その他営業収益		1,942
営業収益合計		34,158
営業費用及び一般管理費	1	31,520
営業利益		2,637
営業外収益	2	1,760
営業外費用	3	327
経常利益		4,070
特別利益	4	50
特別損失	5	19
税引前中間純利益		4,102
法人税等	6	927
中間純利益		3,174

(3) 中間株主資本等変動計算書

第58期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30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	29,948	29,948	502	52,028
当中間期変動額							
剰余金の配当				1,495	1,495		1,495
中間純利益				3,174	3,174		3,174
自己株式の取得						170	170
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				1,679	1,679	170	1,508
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	31,627	31,627	672	53,537

評価・換算差額等

	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	純資産 合計
当期首残高	151	258	410	52,438
当中間期変動額				
剰余金の配当				1,495
中間純利益				3,174
自己株式の取得				170
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	491	521	29	29
当中間期変動額合計	491	521	29	1,538
当中間期末残高	340	780	439	53,977

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第58期中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30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 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> <p>(2) 金銭の信託 時価法</p> <p>(3) 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。ただし、平成28年 4月 1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。</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の翌事業年度から費用処理しております。</p>
4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
5 その他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おります。</p>

(会計方針の変更)

<p>第58期中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)</p>
<p>(減価償却方法) 法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第32号 平成28年 6月17日)を当中間会計期間に適用し、平成28年 4月 1日以後に取得した建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。 この結果、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益に与える影響は軽微であります。</p> <p>(税金費用の計算方法) 従来、年度決算と同様の方法による税金費用の計算を適用しておりましたが、当社の中間決算業務の一層の効率化を図るため、当中間会計期間より事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り算出された見積実効税率に、税引前中間純利益を乗ずる計算方法に変更しております。 なお、この変更による影響は軽微であるため、遡及適用は行っておりません。</p>

(追加情報)

<p>第58期中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)</p>
<p>「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第26号 平成28年 3月28日)を当中間会計期間から適用しております。</p>

(中間貸借対照表関係)

<p>第58期中間会計期間 (平成28年 9月30日)</p>
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額 1,891百万円</p>

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582百万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558百万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58期中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	70百万円
無形固定資産	20百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	7百万円
受取配当金	1,591百万円
デリバティブ収益	6百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	128百万円
支払源泉所得税	155百万円
4 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	50百万円
5 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	18百万円
6 中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。	

(中間株主資本等変動計算書関係)

第58期中間会計期間（自 平成28年 4月 1日 至 平成28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）	814,100	305,000	-	1,119,100

(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	1,762,200	-	19,800	1,742,400	-
平成21年度ストックオプション(2)	普通株式	174,900	-	-	174,900	-
平成23年度ストックオプション(1)	普通株式	4,738,800	-	-	4,738,800	-
平成28年度ストックオプション(1)	普通株式	-	4,437,000	-	4,437,000	-
合計		6,675,900	4,437,000	19,800	11,093,100	-

- (注) 1 平成21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28年度ストックオプション(1)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。
 3 平成21年度ストックオプション(1)1,742,400株、平成21年度ストックオプション(2) 174,900株及び平成23年度ストックオプション(1)4,738,800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28年5月30日取締役会	普通株式	1,495	7.62	平成28年3月31日	平成28年6月22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58期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28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	865百万円
1年超	2,220百万円
合計	3,085百万円

(金融商品関係)

第58期中間会計期間(平成28年9月30日)

1 金融商品の時価等に関する事項

平成28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) 現金及び預金	16,370	16,370	-
(2) 未収委託者報酬	8,443	8,443	-
(3) 未収収益	1,681	1,681	-
(4) 金銭の信託	152	152	-
(5) 関係会社短期貸付金	488	488	-
(6) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	11,431	11,431	-
(7) 未払金	(4,011)	(4,011)	-
(8) 未払費用	(4,007)	(4,007)	-
(9) 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	24	24	-
ヘッジ会計が適用されているもの	268	268	-
デリバティブ取引計	292	292	-

(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) 現金及び預金、(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) 未払金及び(8) 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。

(9) 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20,310百万円）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58期中間会計期間(平成28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	20,310

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	3,215	2,649	565
	小計	3,215	2,649	565
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	8,199	9,255	1,056
	小計	8,199	9,255	1,056
合計		11,414	11,905	490

(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58期中間会計期間(平成28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	3,386	-	24	24
合計		3,386	-	24	24

(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 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		3,575	-	156
	豪ドル		67	-	1
	シンガポールドル		685	-	38

	ユーロ		82	-	2
	香港ドル		87	-	4
	人民元		1,831	-	65
	合計		6,329	-	268

(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58期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28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	3,017百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	8,257百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,144百万円

(ストックオプション等関係)

第58期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

当中間会計期間において、ストックオプションを付与しておりますが、当該ストックオプションの付与による影響が当社の財政状態、経営成績等にとって重要でないと認められるため注記を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第58期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28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、記載しておりません。

[関連情報]

第58期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28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58期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28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58期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28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58期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28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58期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
1株当たり純資産額	275円54銭
1株当たり中間純利益金額	16円18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58期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
中間純利益(百万円)	3,174
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)	3,174
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,123
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) 1,742,400株、 平成21年度ストックオプション(2) 174,900株、 平成23年度ストックオプション(1) 4,738,800株、 平成28年度ストックオプション(1) 4,437,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第58期中間会計期間 (平成28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)	53,977
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)	53,977
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)	195,893

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

禁止されています。

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）、（5）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記（3）、（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

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28年3月末現在)	事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (平成28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	
高木証券株式会社	11,069百万円	
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	
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	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社第三銀行	1	37,461百万円	
株式会社東北銀行		13,233百万円	
株式会社もみじ銀行		10,000百万円	
株式会社琉球銀行	1	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。
信金中央金庫		690,998百万円 (出資の総額)	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。

1 募集の取扱いを行いません。

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28年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成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28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28年11月30日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

P w Cあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 鶴田 光夫
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）の平成27年10月27日から平成28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40）の平成28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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月5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28年4月1日から平成29年3月31日までの第58期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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28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28年4月1日から平成28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。