【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年7月26日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 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】	新屋敷　昇
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

半期報告書を提出しましたので平成29年 1月26日付をもって提出しました有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出します。

2【訂正の内容】

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

第二部【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】

＜更新後＞

③　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。

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。
※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60%、債券などに40%投資します。

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

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

※基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。
※基本投資比率からカイ離した場合は、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。

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なわないこともあります。
※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

（３）【ファンドの仕組み】

＜更新後＞

②　委託会社の概況（平成29年4月末現在）
１）資本金

17,363百万円

２）沿革

昭和34年：日興證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

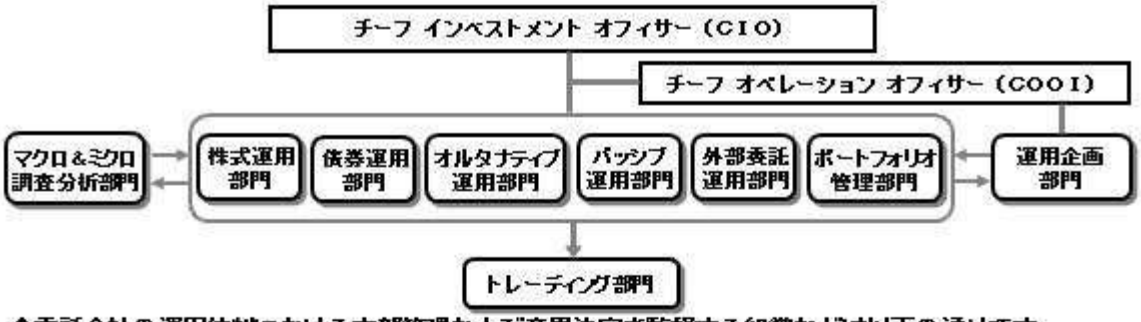
名　　称	住　　所	所有株数	所有比率
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目４番１号	179,869,100株	91.29%
DBS Bank Ltd.	6 Shenton Way, #46-00, DBS Building Tower One, Singapore 068809	14,283,400株	7.24%

２【投資方針】

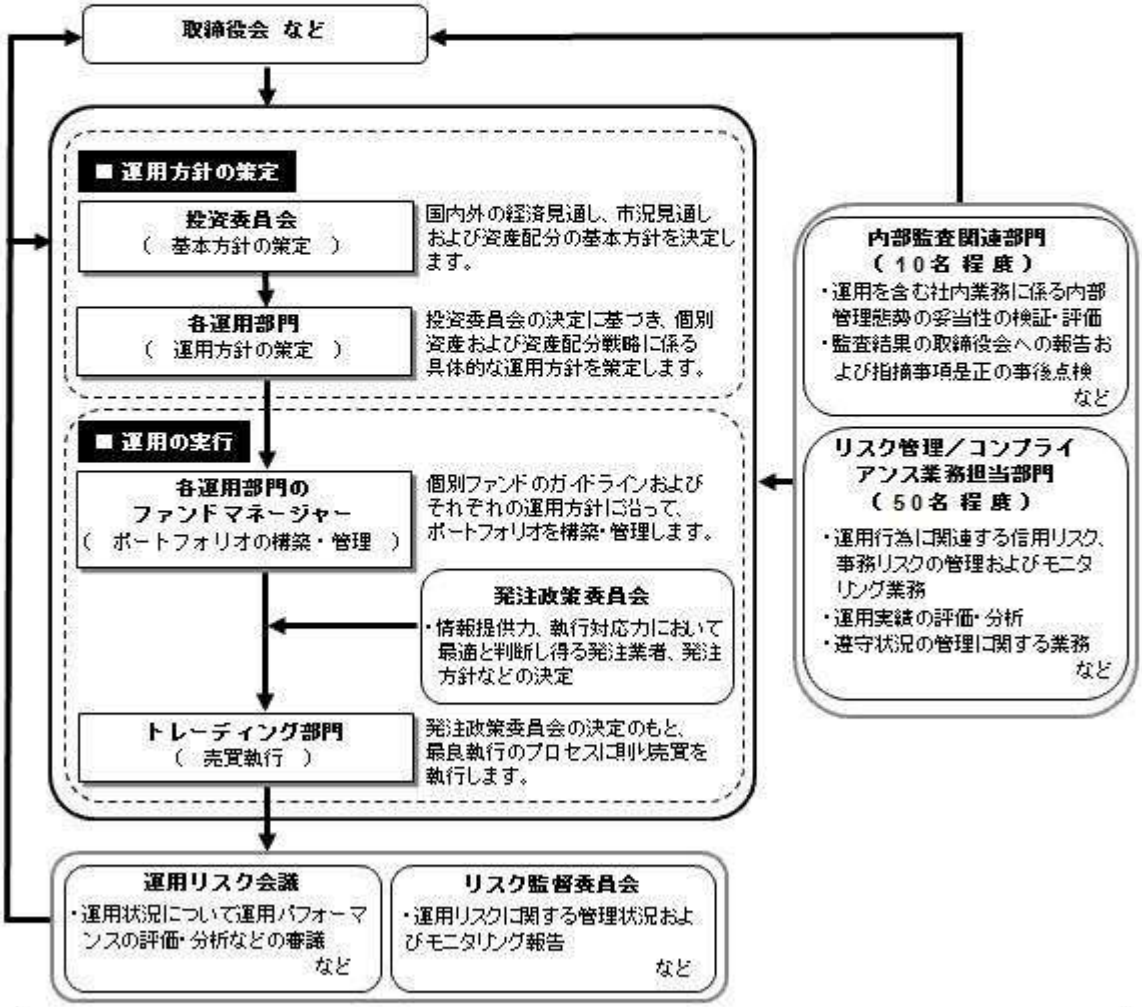
（３）【運用体制】

＜更新後＞

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

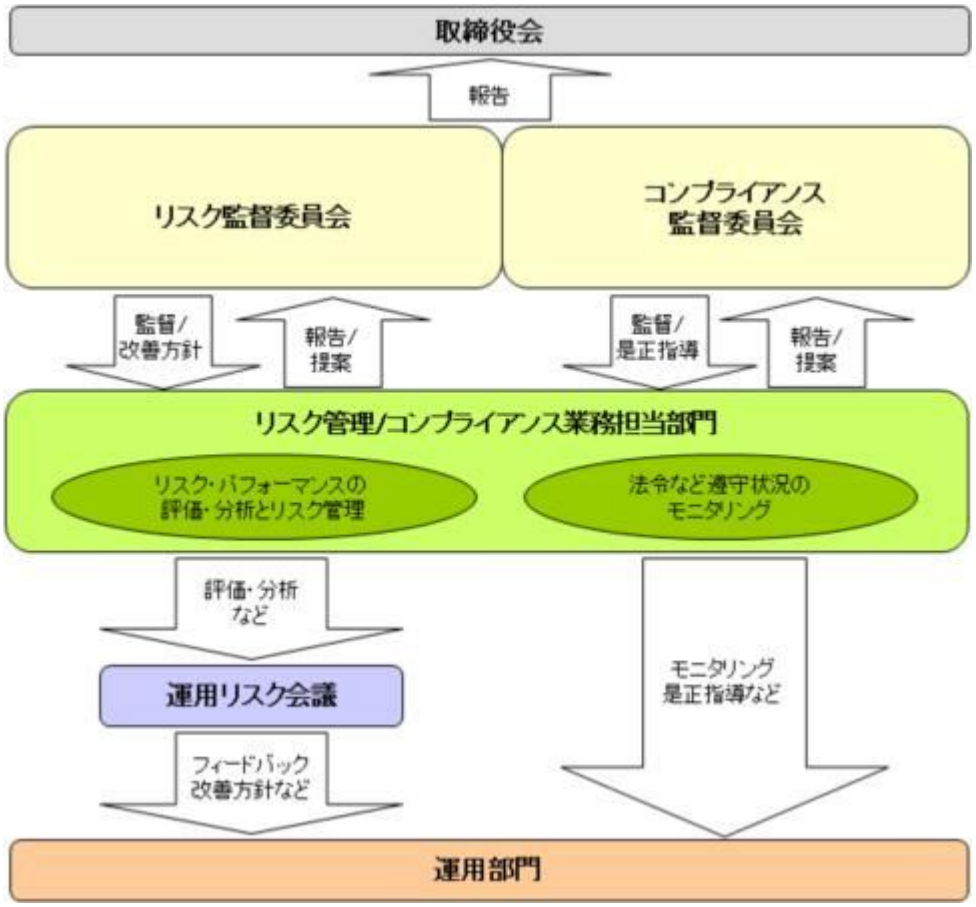
「受託会社」に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっております。また、独立した監査法人が所定の手続きで受託業務について監査を行なっており、内部統制が有効に機能している旨の監査報告書を定期的に受け取っております。

※上記体制は平成29年4月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

3【投資リスク】

＜更新後＞

（2）リスク管理体制



■全社的リスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理／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会議においては、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リスク会議に報告し、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

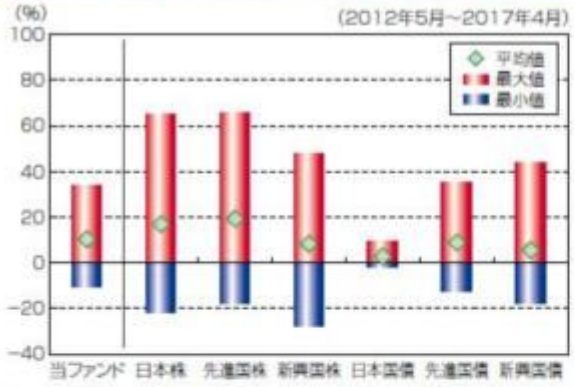
運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

※上記体制は平成29年4月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

＜更新後＞

（参考情報）

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	10.3%	16.9%	19.2%	8.3%	2.9%	8.9%	5.5%
最大値	34.1%	65.0%	65.7%	47.4%	9.3%	34.9%	43.7%
最小値	-10.4%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-1.8%	-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2012年5月から2017年4月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものとして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)

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、2012年5月末の基準価額を起点として指数化しています。
※当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)は、分配金(税引前)を再投資したものとして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)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込、円ベース）
当指数は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc．に帰属します。

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

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】

（５）【課税上の取扱い】

＜更新後＞

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

≪確定拠出年金の場合≫

確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会の場合、所得税および地方税はかかりません。

なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

≪確定拠出年金でない場合≫

① 個人受益者の場合

１）収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税５%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）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ます。）と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益（譲渡益）、普通分配金および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）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。なお、確定拠出年金制度を通じて公募株式投資信託などを購入する場合は、NISAをご利用になれません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

② 法人受益者の場合

１）収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

２）益金不算入制度の適用

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。

③　個別元本

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

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

④　普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

２）受益者が収益分配金を受け取る際

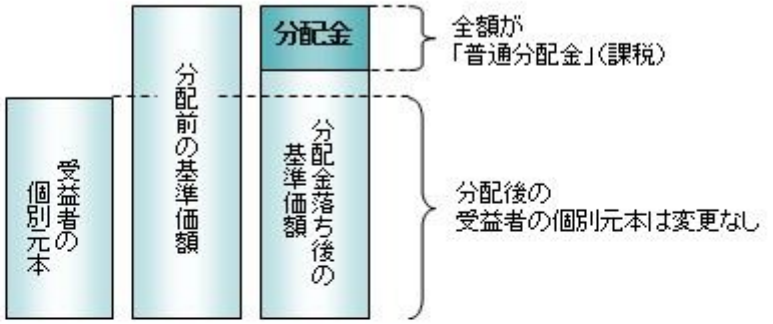
イ）収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の１口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

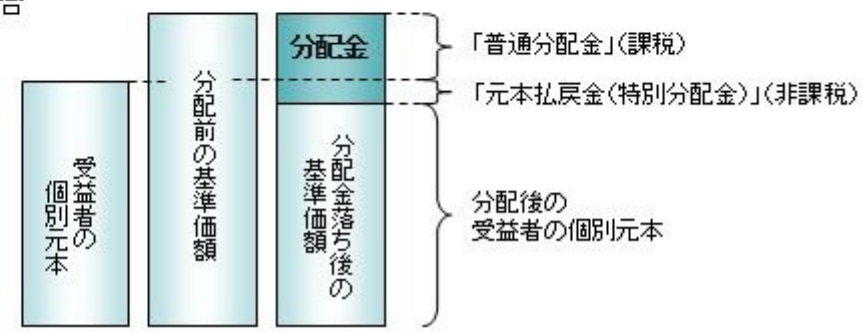
ハ）収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

＜分配金に関するイメージ図＞

イ）の場合



ロ）、ハ）の場合



※上記は平成29年 7月26日現在のものですので、税法または確定拠出年金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】

【年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）】

以下の運用状況は2017年 4月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（１）【投資状況】

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	3,255,846,029	95.10
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	167,739,068	4.90
合計（純資産総額）		3,423,585,097	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド	1,151,237,131	1.1973	1,378,376,217	1.3412	1,544,039,240	45.10
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	612,953,086	1.4031	860,034,475	1.3882	850,901,473	24.85
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	121,723,653	1.7837	217,118,480	2.1377	260,208,653	7.60
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	177,078,429	1.3082	231,654,001	1.4596	258,463,674	7.55
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	79,568,077	2.0652	164,323,993	2.1627	172,081,880	5.03
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	114,210,706	1.5234	173,988,590	1.4898	170,151,109	4.97

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.10
合　　計	95.10

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額（百万円）	1口当たり純資産額(円)

期別	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第6計算期間末 (2007年10月26日)	1,645	1,647	1.3550	1.3560
第7計算期間末 (2008年10月27日)	1,185	1,186	0.8825	0.8835
第8計算期間末 (2009年10月26日)	1,595	1,597	1.0345	1.0355
第9計算期間末 (2010年10月26日)	1,707	1,708	1.0044	1.0054
第10計算期間末 (2011年10月26日)	1,796	1,797	0.9699	0.9709
第11計算期間末 (2012年10月26日)	1,935	1,937	1.0083	1.0093
第12計算期間末 (2013年10月28日)	2,659	2,661	1.3498	1.3508
第13計算期間末 (2014年10月27日)	2,905	2,907	1.4311	1.4321
第14計算期間末 (2015年10月26日)	3,316	3,318	1.6333	1.6343
第15計算期間末 (2016年10月26日)	3,188	3,190	1.5609	1.5619
2016年 4月末日	3,147	—	1.5403	—
5月末日	3,185	—	1.5644	—
6月末日	3,023	—	1.4834	—
7月末日	3,119	—	1.5347	—
8月末日	3,132	—	1.5341	—
9月末日	3,142	—	1.5306	—
10月末日	3,201	—	1.5642	—
11月末日	3,300	—	1.6154	—
12月末日	3,365	—	1.6516	—
2017年 1月末日	3,359	—	1.6477	—
2月末日	3,387	—	1.6620	—
3月末日	3,402	—	1.6585	—
4月末日	3,423	—	1.6725	—

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第6期	2006年10月27日～2007年10月26日	0.0010
第7期	2007年10月27日～2008年10月27日	0.0010
第8期	2008年10月28日～2009年10月26日	0.0010
第9期	2009年10月27日～2010年10月26日	0.0010
第10期	2010年10月27日～2011年10月26日	0.0010
第11期	2011年10月27日～2012年10月26日	0.0010
第12期	2012年10月27日～2013年10月28日	0.0010
第13期	2013年10月29日～2014年10月27日	0.0010
第14期	2014年10月28日～2015年10月26日	0.0010
第15期	2015年10月27日～2016年10月26日	0.0010
当中間期	2016年10月27日～2017年 4月26日	—

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第6期	2006年10月27日～2007年10月26日	0.36
第7期	2007年10月27日～2008年10月27日	△34.80
第8期	2008年10月28日～2009年10月26日	17.34
第9期	2009年10月27日～2010年10月26日	△2.81
第10期	2010年10月27日～2011年10月26日	△3.34
第11期	2011年10月27日～2012年10月26日	4.06
第12期	2012年10月27日～2013年10月28日	33.97
第13期	2013年10月29日～2014年10月27日	6.10
第14期	2014年10月28日～2015年10月26日	14.20
第15期	2015年10月27日～2016年10月26日	△4.37
当中間期	2016年10月27日～2017年 4月26日	7.31

(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6期	2006年10月27日～2007年10月26日	319,186,483	100,699,380
第7期	2007年10月27日～2008年10月27日	299,533,604	171,215,492
第8期	2008年10月28日～2009年10月26日	323,904,029	124,482,247
第9期	2009年10月27日～2010年10月26日	251,339,992	94,053,017
第10期	2010年10月27日～2011年10月26日	259,354,855	107,276,034
第11期	2011年10月27日～2012年10月26日	215,219,731	147,704,230
第12期	2012年10月27日～2013年10月28日	301,227,668	250,419,228
第13期	2013年10月29日～2014年10月27日	221,180,213	160,786,741
第14期	2014年10月28日～2015年10月26日	219,233,352	219,220,569
第15期	2015年10月27日～2016年10月26日	185,024,011	172,613,627
当中間期	2016年10月27日～2017年 4月26日	103,568,671	99,199,504

（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2017年 4月28日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	26,161,282,670	98.80
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	317,547,094	1.20

合計（純資産総額）	26,478,829,764	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	306,000,000	1.16

(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	142,300	6,023.40	857,130,500	6,035.00	858,780,500	3.24
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	875,300	533.73	467,175,100	709.20	620,762,760	2.34
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	92,700	4,721.84	437,715,207	4,769.00	442,086,300	1.67
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	52,000	6,593.59	342,866,800	8,442.00	438,984,000	1.66
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	92,500	3,549.64	328,342,453	4,124.00	381,470,000	1.44
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	105,300	3,143.98	331,062,082	3,232.00	340,329,600	1.29
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	114,300	3,109.69	355,437,910	2,955.50	337,813,650	1.28
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,568,200	171.62	269,138,140	203.60	319,285,520	1.21
日本	株式	ソニー	電気機器	82,700	3,325.38	275,009,428	3,759.00	310,869,300	1.17
日本	株式	ファナック	電気機器	11,900	19,736.41	234,863,360	22,655.00	269,594,500	1.02
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	72,700	3,963.05	288,113,824	3,706.00	269,426,200	1.02
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	45,900	4,806.18	220,603,800	5,342.00	245,197,800	0.93
日本	株式	キーエンス	電気機器	5,300	38,615.00	204,659,500	44,800.00	237,440,000	0.90
日本	株式	キヤノン	電気機器	63,000	3,054.82	192,453,750	3,696.00	232,848,000	0.88
日本	株式	ＮＴＴドコモ	情報・通信業	84,900	2,600.35	220,769,715	2,688.00	228,211,200	0.86
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	48,300	4,493.27	217,025,040	4,710.00	227,493,000	0.86
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	22,600	9,405.42	212,562,500	9,954.00	224,960,400	0.85
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	46,400	4,059.40	188,356,160	4,692.00	217,708,800	0.82
日本	株式	信越化学工業	化学	22,000	7,708.27	169,582,140	9,684.00	213,048,000	0.80
日本	株式	三菱商事	卸売業	86,700	2,361.28	204,723,690	2,403.50	208,383,450	0.79
日本	株式	任天堂	その他製品	7,200	24,534.34	176,647,248	28,045.00	201,924,000	0.76
日本	株式	三菱電機	電気機器	124,900	1,399.81	174,836,980	1,554.00	194,094,600	0.73
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	41,400	3,963.49	164,088,603	4,648.00	192,427,200	0.73
日本	株式	花王	化学	30,500	5,748.97	175,343,585	6,148.00	187,514,000	0.71
日本	株式	村田製作所	電気機器	12,300	14,445.05	177,674,170	14,945.00	183,823,500	0.69
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	125,200	1,556.63	194,890,950	1,468.00	183,793,600	0.69

日本	株式	三菱地所	不動産業	85,900	2,041.08	175,329,350	2,130.00	182,967,000	0.69
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	9,700	17,520.00	169,944,000	18,685.00	181,244,500	0.68
日本	株式	パナソニック	電気機器	134,400	1,074.43	144,404,388	1,330.50	178,819,200	0.68
日本	株式	ダイキン工業	機械	16,000	9,882.63	158,122,100	10,825.00	173,200,000	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	0.32
		建設業	2.98
		食料品	4.52
		繊維製品	0.71
		パルプ・紙	0.26
		化学	6.77
		医薬品	4.68
		石油・石炭製品	0.53
		ゴム製品	0.99
		ガラス・土石製品	0.99
		鉄鋼	1.21
		非鉄金属	0.95
		金属製品	0.73
		機械	5.13
		電気機器	12.69
		輸送用機器	8.84
		精密機器	1.57
		その他製品	1.87
		電気・ガス業	1.81
		陸運業	4.15
		海運業	0.23
		空運業	0.55
		倉庫・運輸関連業	0.19
		情報・通信業	7.78
		卸売業	4.41
		小売業	4.71
		銀行業	8.03
		証券、商品先物取引業	1.14
		保険業	2.57
		その他金融業	1.22
		不動産業	2.41
		サービス業	3.77
合　　計			98.80

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　２０１７年０６月	買建	20	日本円	303,080,800	306,000,000	1.16

(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2017年 4月28日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

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	6,720,172	0.01
株式	アメリカ	46,395,167,470	59.71
	カナダ	2,888,996,152	3.72
	モーリシャス	3,678,617	0.00
	ドイツ	2,951,441,126	3.80
	イタリア	554,572,624	0.71
	フランス	2,940,843,918	3.79
	オランダ	1,412,369,169	1.82
	スペイン	1,060,484,692	1.36
	ベルギー	356,717,955	0.46
	オーストリア	68,916,503	0.09
	ルクセンブルク	94,484,982	0.12
	フィンランド	297,579,887	0.38
	アイルランド	1,264,677,322	1.63
	ポルトガル	46,782,516	0.06
	イギリス	5,138,143,156	6.61
	スイス	2,924,352,257	3.76
	スウェーデン	881,397,592	1.13
	ノルウェー	184,949,254	0.24
	デンマーク	525,361,018	0.68
	ケイマン	186,241,558	0.24
	オーストラリア	2,048,794,357	2.64
	バミューダ	214,268,485	0.28
	ニュージーランド	54,657,883	0.07
	香港	829,929,430	1.07
	シンガポール	589,575,746	0.76

	イスラエル	175,248,099	0.23
	ジャージー	402,611,038	0.52
	英ヴァージン諸島	14,932,369	0.02
	小計	74,507,175,175	95.90
投資証券	アメリカ	1,521,445,794	1.96
	カナダ	11,634,887	0.01
	フランス	104,755,749	0.13
	イギリス	80,393,885	0.10
	オーストラリア	220,482,344	0.28
	香港	38,404,080	0.05
	シンガポール	29,891,489	0.04
	小計	2,007,008,228	2.58
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	1,174,647,019	1.51
合計（純資産総額）		77,695,550,594	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	863,034,474	1.11
	買建	ドイツ	247,833,137	0.32

(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	—	628,276,500	0.81

(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	111,232	13,160.04	1,463,817,847	16,002.38	1,779,977,744	2.29
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	154,084	6,787.57	1,045,857,030	7,597.76	1,170,694,531	1.51
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	8,385	92,947.18	779,362,123	102,206.51	857,001,588	1.10
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	48,330	14,722.55	711,541,040	16,437.53	794,425,970	1.02
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	56,931	12,682.60	722,033,579	13,771.02	783,998,202	1.01

アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	86,221	9,651.06	832,124,803	9,043.42	779,733,181	1.00
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	75,090	7,656.75	574,945,508	9,750.11	732,136,278	0.94
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	6,442	89,885.59	579,042,999	97,295.28	626,776,210	0.81
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	6,120	92,209.32	564,321,097	99,208.35	607,155,149	0.78
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	99,640	5,088.17	506,986,136	6,058.62	603,681,654	0.78
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	184,403	3,188.45	587,961,313	3,236.31	596,785,863	0.77
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	128,037	4,084.34	522,947,025	4,441.58	568,687,078	0.73
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	64,813	8,068.71	522,957,366	8,667.42	561,762,108	0.72
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	212,229	1,860.76	394,909,102	2,632.00	558,588,532	0.72
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	53,239	9,678.89	515,294,494	9,759.02	519,560,471	0.67
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	126,130	3,592.44	453,114,609	3,768.27	475,293,081	0.61
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	25,320	15,995.71	405,011,420	18,535.34	469,315,049	0.60
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	39,201	11,214.69	439,627,192	11,737.75	460,131,785	0.59
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	25,760	13,726.50	353,594,861	17,374.59	447,569,562	0.58
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	84,907	5,324.11	452,054,513	5,193.90	440,998,832	0.57
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア	99,894	3,590.21	358,640,977	4,405.97	440,130,077	0.57
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	14,628	25,537.86	373,567,846	29,130.17	426,116,171	0.55
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	98,332	3,906.27	384,112,227	4,165.58	409,610,275	0.53
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	31,713	10,322.14	327,346,264	12,891.83	408,838,719	0.53
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	85,302	4,734.27	403,843,263	4,786.58	408,305,095	0.53
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	57,533	6,894.41	396,656,407	6,964.52	400,690,201	0.52
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	39,222	9,129.11	358,062,293	10,194.16	399,835,500	0.51
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	46,443	8,119.07	377,073,991	8,605.87	399,682,838	0.51
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	60,347	5,518.87	333,047,314	6,609.51	398,864,287	0.51
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	32,358	10,748.38	347,796,345	12,263.04	396,807,613	0.51

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
出資金	—	—	0.01
株式	国外	エネルギー	6.68

		素材	4.82
		資本財	7.51
		商業・専門サービス	0.99
		運輸	1.97
		自動車・自動車部品	1.47
		耐久消費財・アパレル	1.78
		消費者サービス	1.83
		メディア	2.69
		小売	3.96
		食品・生活必需品小売り	1.92
		食品・飲料・タバコ	5.78
		家庭用品・パーソナル用品	2.17
		ヘルスケア機器・サービス	3.95
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.49
		銀行	9.35
		各種金融	4.21
		保険	4.16
		不動産	0.55
		ソフトウェア・サービス	9.37
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.90
		電気通信サービス	2.74
		公益事業	3.16
		半導体・半導体製造装置	2.47
投資証券	—	—	2.58
合　　計			98.49

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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 EMINI1706	買建	65	米ドル	7,674,362.5	854,079,802	7,754,825	863,034,474	1.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1706	買建	65	ユーロ	1,990,750	240,582,137	2,050,750	247,833,137	0.32

(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	4,400,000.00	486,091,700	489,266,000	0.63

	ユーロ	買建	1,150,000.00	137,210,605	139,010,500	0.18

(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2017年 4月28日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

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	2,618,237,526	58.36
	カナダ	167,422,865	3.73
	ドイツ	162,730,358	3.63
	イタリア	32,412,665	0.72
	フランス	166,308,216	3.71
	オランダ	77,888,519	1.74
	スペイン	60,468,185	1.35
	ベルギー	22,564,080	0.50
	オーストリア	1,985,601	0.04
	ルクセンブルク	3,109,731	0.07
	フィンランド	15,974,036	0.36
	アイルランド	71,648,104	1.60
	ポルトガル	2,324,521	0.05
	イギリス	287,118,916	6.40
	スイス	170,450,596	3.80
	スウェーデン	50,124,993	1.12
	ノルウェー	11,073,956	0.25
	デンマーク	30,226,308	0.67
	ケイマン	10,265,757	0.23
	オーストラリア	114,185,852	2.55
	バミューダ	9,414,153	0.21
	香港	46,639,639	1.04
	シンガポール	34,816,994	0.78
	イスラエル	10,757,994	0.24
	ジャージー	23,906,995	0.53
	英ヴァージン諸島	723,353	0.02
	小計	4,202,779,913	93.68
投資証券	アメリカ	85,018,041	1.90
	フランス	5,049,094	0.11
	イギリス	3,907,766	0.09
	オーストラリア	13,354,383	0.30
	香港	2,853,903	0.06
	小計	110,183,187	2.46

コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	173,326,606	3.86
合計（純資産総額）		4,486,289,706	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	159,329,441	3.55
	買建	ドイツ	45,753,810	1.02

(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	―	4,373,817,620	△97.49

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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	6,257	13,395.31	83,814,478	16,002.38	100,126,949	2.23
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	8,679	6,850.25	59,453,402	7,597.76	65,941,031	1.47
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	471	92,942.12	43,775,739	102,206.50	48,139,266	1.07
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	2,744	14,736.23	40,436,233	16,437.53	45,104,591	1.01
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	3,200	12,778.62	40,891,594	13,771.02	44,067,279	0.98
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	4,836	9,592.90	46,391,299	9,043.42	43,734,005	0.97
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	4,174	8,022.72	33,486,852	9,750.11	40,696,988	0.91
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	365	90,182.12	32,916,474	97,295.28	35,512,778	0.79
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	344	92,446.10	31,801,459	99,208.35	34,127,675	0.76
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	5,623	5,272.68	29,648,327	6,058.62	34,067,663	0.76
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	10,423	3,233.01	33,697,742	3,236.31	33,732,092	0.75
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	7,169	4,177.33	29,947,304	4,441.58	31,841,715	0.71
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	3,669	8,130.52	29,830,912	8,667.42	31,800,799	0.71
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	11,732	1,986.04	23,300,306	2,632.00	30,878,724	0.69

アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	2,986	9,685.31	28,920,356	9,759.02	29,140,434	0.65
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	1,431	16,467.18	23,564,547	18,535.34	26,524,085	0.59
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6,977	3,608.95	25,179,696	3,768.27	26,291,285	0.59
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	2,206	11,449.79	25,258,249	11,737.75	25,893,490	0.58
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	4,764	5,384.63	25,652,398	5,193.90	24,743,760	0.55
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	1,424	14,088.36	20,061,832	17,374.59	24,741,423	0.55
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア	5,574	3,678.83	20,505,816	4,405.97	24,558,883	0.55
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	832	25,835.50	21,495,140	29,130.17	24,236,304	0.54
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	5,543	3,935.29	21,813,347	4,165.58	23,089,836	0.51
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	4,791	4,722.14	22,623,782	4,786.58	22,932,519	0.51
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	1,768	10,677.65	18,878,097	12,891.83	22,792,762	0.51
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	2,633	8,148.84	21,455,921	8,605.87	22,659,279	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	3,224	6,905.85	22,264,488	6,964.52	22,453,639	0.50
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	2,184	9,196.08	20,084,240	10,194.16	22,264,054	0.50
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	1,814	10,869.27	19,716,862	12,263.04	22,245,164	0.50
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	5,872	3,406.15	20,000,944	3,756.03	22,055,452	0.49

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	6.60
		素材	4.66
		資本財	7.57
		商業・専門サービス	0.99
		運輸	1.78
		自動車・自動車部品	1.46
		耐久消費財・アパレル	1.58
		消費者サービス	1.81
		メディア	2.65
		小売	3.81
		食品・生活必需品小売り	1.73
		食品・飲料・タバコ	5.63

		家庭用品・パーソナル用品	2.10
		ヘルスケア機器・サービス	3.87
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.32
		銀行	9.25
		各種金融	4.21
		保険	4.01
		不動産	0.58
		ソフトウェア・サービス	9.15
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.77
		電気通信サービス	2.64
		公益事業	3.08
		半導体・半導体製造装置	2.45
投資証券	—	—	2.46
合　　計			96.14

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 EMINI1706	買建	12	米ドル	1,409,137.5	156,822,912	1,431,660	159,329,441	3.55
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1706	買建	12	ユーロ	369,990	44,713,291	378,600	45,753,810	1.02

(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	25,824,000.00	2,872,688,672	2,867,346,420	△63.91
	加ドル	売建	2,034,000.00	170,819,904	165,806,350	△3.70
	ユーロ	売建	4,728,000.00	565,004,788	571,622,410	△12.74
	英ポンド	売建	2,145,000.00	298,512,338	307,670,460	△6.86
	スイスフラン	売建	1,401,000.00	156,437,316	156,963,330	△3.50
	スウェーデンクローナ	売建	3,995,000.00	49,920,507	50,290,820	△1.12
	ノルウェークローネ	売建	855,000.00	11,130,302	11,078,020	△0.25
	デンマーククローネ	売建	1,839,000.00	29,525,687	29,896,050	△0.67
	豪ドル	売建	1,532,000.00	129,445,060	127,078,800	△2.83
	香港ドル	売建	3,893,000.00	55,699,789	55,571,230	△1.24
	シンガポールドル	売建	271,000.00	21,487,671	21,561,290	△0.48
	イスラエルシュケル	売建	292,000.00	8,849,101	8,932,440	△0.20

(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2017年 4月28日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	26,519,634,480	76.56
地方債証券	日本	2,206,295,000	6.37
特殊債券	日本	4,035,029,000	11.65
社債券	日本	1,485,602,000	4.29
	オーストラリア	301,285,000	0.87
	小計	1,786,887,000	5.16
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	88,968,499	0.26
合計（純資産総額）		34,636,813,979	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３０３回利付国債（１０年）	581,000,000	104.75	608,603,310	103.83	603,287,160	1.400	2019/9/20	1.74
日本	国債証券	第１２４回利付国債（５年）	560,000,000	101.19	566,686,400	100.91	565,118,400	0.100	2020/6/20	1.63
日本	国債証券	第１２３回利付国債（５年）	505,000,000	101.11	510,605,500	100.85	509,317,750	0.100	2020/3/20	1.47
日本	国債証券	第３０５回利付国債（１０年）	473,000,000	104.83	495,845,900	103.96	491,730,800	1.300	2019/12/20	1.42
日本	国債証券	第２９９回利付国債（１０年）	410,000,000	103.70	425,186,400	102.86	421,738,300	1.300	2019/3/20	1.22
日本	国債証券	第３１３回利付国債（１０年）	370,000,000	106.66	394,675,300	105.78	391,408,200	1.300	2021/3/20	1.13
日本	国債証券	第２９回利付国債（３０年）	276,000,000	141.98	391,864,800	135.92	375,139,200	2.400	2038/9/20	1.08
日本	国債証券	第８８回利付国債（２０年）	300,000,000	123.07	369,210,000	121.23	363,690,000	2.300	2026/6/20	1.05
日本	国債証券	第１１３回利付国債（２０年）	290,000,000	126.67	367,348,800	124.08	359,858,100	2.100	2029/9/20	1.04
日本	国債証券	第１４０回利付国債（２０年）	280,000,000	124.35	348,191,200	121.03	338,898,000	1.700	2032/9/20	0.98
日本	国債証券	第１２０回利付国債（５年）	330,000,000	101.26	334,184,400	100.94	333,121,800	0.200	2019/9/20	0.96
日本	国債証券	第３４０回利付国債（１０年）	320,000,000	103.64	331,661,600	103.78	332,124,800	0.400	2025/9/20	0.96

日本	国債証券	第１２５回利付国債（５年）	325,000,000	101.25	329,085,250	100.97	328,155,750	0.100	2020/9/20	0.95
日本	国債証券	第６０回利付国債（２０年）	295,000,000	109.92	324,264,000	108.71	320,712,200	1.400	2022/12/20	0.93
日本	国債証券	第２９２回利付国債（１０年）	306,000,000	101.80	311,536,054	101.80	311,536,054	1.700	2018/3/20	0.90
日本	国債証券	第３３９回利付国債（１０年）	300,000,000	104.42	313,262,000	103.71	311,151,000	0.400	2025/6/20	0.90
日本	国債証券	第９１回利付国債（２０年）	250,000,000	123.55	308,887,500	121.70	304,255,000	2.300	2026/9/20	0.88
日本	国債証券	第１２２回利付国債（５年）	300,000,000	101.04	303,135,000	100.78	302,343,000	0.100	2019/12/20	0.87
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	100.01	300,051,000	0.001	2018/11/20	0.87
日本	国債証券	第１４回利付国債（３０年）	208,000,000	137.09	285,147,200	132.78	276,188,640	2.400	2034/3/20	0.80
日本	国債証券	第３４回利付国債（３０年）	200,000,000	139.96	279,923,200	133.84	267,682,000	2.200	2041/3/20	0.77
日本	国債証券	第３４１回利付国債（１０年）	250,000,000	103.13	257,849,100	102.94	257,365,000	0.300	2025/12/20	0.74
日本	国債証券	第５０回利付国債（２０年）	237,000,000	109.34	259,135,800	108.14	256,298,910	1.900	2021/3/22	0.74
日本	国債証券	第１４９回利付国債（２０年）	215,000,000	121.63	261,517,400	118.01	253,736,550	1.500	2034/6/20	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	105.75	243,225,000	0.800	2023/6/20	0.70
日本	国債証券	第１３７回利付国債（２０年）	200,000,000	124.16	248,320,000	120.96	241,936,000	1.700	2032/6/20	0.70
日本	国債証券	第４３回利付国債（３０年）	195,000,000	132.35	258,098,100	123.79	241,392,450	1.700	2044/6/20	0.70
日本	国債証券	第１４１回利付国債（２０年）	195,000,000	124.53	242,835,450	121.08	236,123,550	1.700	2032/12/20	0.68
日本	国債証券	第２９０回利付国債（１０年）	226,000,000	101.54	229,483,696	101.54	229,483,696	1.400	2018/3/20	0.66
日本	国債証券	第２回利付国債（４０年）	165,000,000	150.96	249,095,550	138.91	229,211,400	2.200	2049/3/20	0.66

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	76.56
地方債証券	6.37
特殊債券	11.65
社債券	5.16
合　　計	99.74

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

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2017年 4月28日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

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	67,658,676,785	43.88
	カナダ	3,142,712,107	2.04
	メキシコ	1,337,581,413	0.87
	ドイツ	10,967,292,289	7.11
	イタリア	14,316,952,392	9.29
	フランス	15,158,606,622	9.83
	オランダ	3,494,944,781	2.27
	スペイン	8,441,455,506	5.47
	ベルギー	3,828,429,417	2.48
	オーストリア	2,224,759,708	1.44
	フィンランド	929,740,683	0.60
	アイルランド	1,221,233,342	0.79
	イギリス	11,218,467,736	7.28
	スイス	294,930,936	0.19
	スウェーデン	686,862,125	0.45
	ノルウェー	411,013,058	0.27
	デンマーク	907,425,915	0.59
	ポーランド	1,027,913,875	0.67
	オーストラリア	3,240,949,838	2.10
	シンガポール	626,850,842	0.41
	マレーシア	639,802,372	0.41
	南アフリカ	836,728,712	0.54
	小計	152,613,330,454	98.97
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	1,581,032,431	1.03
合計（純資産総額）		154,194,362,885	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,490,000	14,770.70	1,697,154,496	14,153.60	1,626,249,356	8.000	2021/11/15	1.05
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,780,000	11,913.02	1,284,224,302	11,691.31	1,260,323,755	3.375	2019/11/15	0.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,270,000	12,049.36	1,237,470,124	11,808.04	1,212,686,433	3.625	2020/2/15	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,100,000	11,774.48	1,071,477,862	11,559.81	1,051,943,139	3.750	2018/11/15	0.68

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,300,000	11,471.78	1,066,875,942	11,150.30	1,036,977,984	2.000	2023/2/15	0.67
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,830,000	11,267.02	994,878,031	11,179.85	987,181,597	1.500	2018/12/31	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,530,000	11,765.57	1,003,603,872	11,536.55	984,068,151	4.000	2018/8/15	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,340,000	11,401.79	950,909,624	11,282.45	940,956,979	2.250	2018/7/31	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,830,000	12,049.36	943,465,537	11,803.91	924,246,795	3.500	2020/5/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,550,000	12,247.46	924,683,569	11,948.89	902,141,624	3.625	2021/2/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,150,000	11,290.71	920,193,313	10,965.53	893,691,286	1.750	2023/5/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,550,000	11,665.01	880,708,796	11,443.52	863,986,349	3.875	2018/5/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,450,000	11,367.16	846,853,465	11,241.15	837,466,276	1.750	2019/9/30	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	11,413.08	798,916,298	11,289.41	790,258,938	2.375	2018/6/30	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,900,000	11,453.60	790,299,002	11,369.18	784,473,839	2.250	2021/7/31	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,610,000	14,288.52	801,586,146	13,711.06	769,190,553	8.750	2020/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,400,000	11,557.64	739,689,252	11,315.49	724,191,986	2.125	2021/6/30	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	12,586.85	742,624,415	11,479.60	677,296,873	3.125	2044/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,350,000	13,743.22	735,262,503	12,525.98	670,140,464	3.625	2043/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,930,000	11,630.89	689,712,112	11,197.25	663,997,172	2.250	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	11,847.59	687,160,773	11,417.66	662,224,512	2.500	2024/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,940,000	11,613.50	689,841,961	11,126.60	660,920,472	2.250	2025/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	12,006.93	696,402,138	10,963.36	635,875,291	2.875	2043/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	11,825.43	650,398,681	11,437.44	629,059,213	2.500	2023/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,520,000	11,158.78	615,964,722	11,112.05	613,385,189	1.000	2018/5/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,170,000	12,044.74	622,713,563	11,751.31	607,542,801	3.125	2021/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,370,000	11,476.22	616,273,272	11,299.62	606,790,122	2.000	2020/7/31	0.39
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,900,000	15,871.23	618,977,990	15,293.42	596,443,477	4.250	2023/10/25	0.39
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,530,000	18,183.26	641,869,085	16,830.33	594,110,732	6.500	2027/11/1	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	11,591.96	591,190,286	11,429.82	582,921,228	2.750	2019/2/15	0.38

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

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

以下の運用状況は2017年 4月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

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	10,789,045,440	43.99
	カナダ	488,126,257	1.99
	メキシコ	199,757,725	0.81
	ドイツ	1,742,963,009	7.11
	イタリア	2,288,212,345	9.33
	フランス	2,411,268,505	9.83
	オランダ	543,264,371	2.21
	スペイン	1,293,848,710	5.27
	ベルギー	619,079,509	2.52
	オーストリア	357,289,418	1.46
	フィンランド	151,970,619	0.62
	アイルランド	187,844,043	0.77
	イギリス	1,756,445,405	7.16
	スイス	36,068,783	0.15
	スウェーデン	174,119,606	0.71
	ノルウェー	73,045,461	0.30
	デンマーク	151,075,413	0.62
	ポーランド	160,569,300	0.65
	オーストラリア	494,504,261	2.02
	シンガポール	89,675,503	0.37
	マレーシア	150,057,529	0.61
	南アフリカ	158,195,004	0.64
	小計	24,316,426,216	99.14
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	211,752,114	0.86
合計（純資産総額）		24,528,178,330	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	—	24,626,020,940	△100.40

(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	11,214.20	403,711,330	11,060.10	398,163,613	1.375	2020/9/30	1.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	11,256.80	360,217,774	11,175.95	357,630,504	1.500	2018/8/31	1.46

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,000,000	10,855.36	325,660,938	10,537.99	316,139,834	1.625	2026/5/15	1.29
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,800,000	11,255.93	315,166,247	10,980.53	307,455,096	1.625	2022/8/15	1.25
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,500,000	11,238.55	280,963,846	11,123.78	278,094,512	1.375	2020/1/31	1.13
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,420,000	11,554.38	279,616,087	11,315.93	273,845,598	2.125	2021/8/15	1.12
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,350,000	11,333.10	266,327,988	11,082.91	260,448,498	1.750	2022/5/15	1.06
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,200,000	11,158.78	245,493,187	11,112.05	244,465,112	1.000	2018/5/31	1.00
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,060,000	11,504.13	236,985,244	11,429.82	235,454,457	2.750	2019/2/15	0.96
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,050,000	11,489.39	235,532,503	11,238.11	230,381,457	2.000	2022/2/15	0.94
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,500,000	15,721.73	235,826,013	15,155.55	227,333,352	4.800	2024/1/31	0.93
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,000,000	11,542.64	230,852,854	11,328.32	226,566,408	2.125	2021/1/31	0.92
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,450,000	15,782.63	228,848,273	15,293.42	221,754,626	4.250	2023/10/25	0.90
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,700,000	13,006.69	221,113,880	12,519.39	212,829,721	1.000	2025/11/25	0.87
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,900,000	11,085.87	210,631,537	11,073.57	210,397,974	0.625	2018/4/30	0.86
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,650,000	13,741.71	226,738,228	12,539.68	206,904,881	3.625	2044/2/15	0.84
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,480,000	14,012.46	207,384,420	13,614.92	201,500,886	3.750	2021/8/1	0.82
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,100,000	18,532.15	203,853,696	17,634.43	193,978,752	6.000	2025/10/25	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,650,000	12,044.74	198,738,371	11,751.31	193,896,638	3.125	2021/5/15	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	12,247.76	195,964,240	11,948.89	191,182,331	3.625	2021/2/15	0.78
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	11,317.66	192,400,389	11,221.59	190,767,086	1.750	2018/10/31	0.78
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,400,000	13,924.33	194,940,718	13,593.14	190,304,066	2.250	2022/10/25	0.78
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	11,057.50	187,977,662	11,100.74	188,712,639	1.875	2022/10/31	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,230,000	15,923.37	195,857,491	15,087.84	185,580,448	6.125	2027/11/15	0.76
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	11,738.49	187,815,853	11,544.37	184,710,061	3.125	2019/5/15	0.75
イギリス	国債証券	UK TREASURY	800,000	22,909.74	183,277,999	22,704.78	181,638,314	4.250	2046/12/7	0.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,550,000	11,290.71	175,006,090	10,965.53	169,965,827	1.750	2023/5/15	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	11,493.08	172,396,278	11,243.98	168,659,772	2.000	2021/11/15	0.69
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000	17,922.20	179,222,001	16,830.33	168,303,324	6.500	2027/11/1	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,440,000	12,023.44	173,137,663	11,604.80	167,109,253	2.750	2023/11/15	0.68

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.14
合　　計	99.14

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	97,632,000.00	10,569,225,793	10,828,715,810	△44.15
	加ドル	売建	6,063,000.00	504,950,512	494,192,670	△2.01

	メキシコペソ	売建	35,217,000.00	198,019,516	203,437,380	△0.83
	ユーロ	売建	80,625,000.00	9,685,216,515	9,749,107,720	△39.75
	英ポンド	売建	12,346,000.00	1,710,332,886	1,770,852,640	△7.22
	スイスフラン	売建	423,000.00	47,148,060	47,392,980	△0.19
	スウェーデンクローナ	売建	14,193,000.00	176,966,698	178,670,740	△0.73
	ノルウェークローネ	売建	5,775,000.00	74,537,447	74,798,650	△0.30
	デンマーククローネ	売建	9,414,000.00	150,756,658	153,046,800	△0.62
	ポーランドズロチ	売建	5,737,000.00	159,570,377	163,686,590	△0.67
	豪ドル	売建	6,034,000.00	510,596,257	500,671,330	△2.04
	シンガポールドル	売建	1,151,000.00	90,881,379	91,533,100	△0.37
	マレーシアリンギット	売建	8,244,000.00	205,579,749	210,634,200	△0.86
	南アフリカランド	売建	19,407,000.00	156,627,510	159,280,330	△0.65

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

≪参考情報≫

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
10円	10円	10円	10円	10円	120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	45.10%
海外株式インデックスMSCI−KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	7.60%
海外株式インデックスMSCI−KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド	7.55%
日本債券インデックスマザーファンド	24.85%
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	5.03%
海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	4.97%
現金その他	4.90%

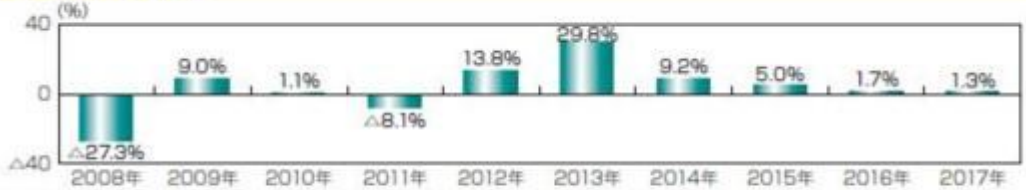
※当ファンドの対純資産総額比です。

<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	3.24%
	2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.34%
	3	日本電信電話	情報・通信業	1.67%
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	2.29%
	2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1.51%
	3	AMAZON.COM INC	小売	1.10%
海外株式インデックスMSCI−KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド	1	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.23%
	2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1.47%
	3	AMAZON.COM INC	小売	1.07%
日本債券インデックスマザーファンド	1	第303回利付国債（10年）	国債証券	1.74%
	2	第124回利付国債（5年）	国債証券	1.63%
	3	第123回利付国債（5年）	国債証券	1.47%
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	1.05%
	2	US TREASURY N/B（クーポン3.375%）	国債証券	0.82%
	3	US TREASURY N/B（クーポン3.625%）	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	1.62%
	2	US TREASURY N/B（クーポン1.500%）	国債証券	1.46%
	3	US TREASURY N/B（クーポン1.625%）	国債証券	1.29%

※各マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は分配金（税引前）を再投資したものとして計算しております。
※当ファンドには、ベンチマークはありません。
※2017年は、2017年4月末までの騰落率です。

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

第３【ファンドの経理状況】

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

（２）　当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成28年10月27日から平成29年 4月26日まで）の中間財務諸表について、ＰｗＣあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	前計算期間末 平成28年10月26日現在	当中間計算期間末 平成29年 4月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	167,062,057	180,627,100
親投資信託受益証券	3,035,710,069	3,261,408,189
未収入金	1,239	-
流動資産合計	3,202,773,365	3,442,035,289
資産合計	3,202,773,365	3,442,035,289
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	2,042,961	-
未払解約金	195,347	304,730
未払受託者報酬	755,906	811,243
未払委託者報酬	10,751,453	11,538,559
未払利息	193	365
その他未払費用	82,255	88,281
流動負債合計	13,828,115	12,743,178
負債合計	13,828,115	12,743,178
純資産の部		
元本等		
元本	2,042,961,706	2,047,330,873
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,145,983,544	1,381,961,238
（分配準備積立金）	850,863,265	810,812,731
元本等合計	3,188,945,250	3,429,292,111
純資産合計	3,188,945,250	3,429,292,111
負債純資産合計	3,202,773,365	3,442,035,289

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前中間計算期間 自　平成27年10月27日 至　平成28年 4月26日	当中間計算期間 自　平成28年10月27日 至　平成29年 4月26日
営業収益		
受取利息	27,669	30
有価証券売買等損益	△119,642,593	244,503,561
営業収益合計	△119,614,924	244,503,591

	前中間計算期間 自　平成27年10月27日 至　平成28年 4月26日	当中間計算期間 自　平成28年10月27日 至　平成29年 4月26日
営業費用		
支払利息	2,881	33,907
受託者報酬	772,791	811,243
委託者報酬	10,991,668	11,538,559
その他費用	84,088	88,281
営業費用合計	11,851,428	12,471,990
営業利益又は営業損失（△）	△131,466,352	232,031,601
経常利益又は経常損失（△）	△131,466,352	232,031,601
中間純利益又は中間純損失（△）	△131,466,352	232,031,601
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	△3,810,814	6,826,585
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,285,931,913	1,145,983,544
剰余金増加額又は欠損金減少額	58,031,403	66,224,419
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	58,031,403	66,224,419
剰余金減少額又は欠損金増加額	56,552,971	55,451,741
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	56,552,971	55,451,741
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,159,754,807	1,381,961,238

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

		前計算期間末 平成28年10月26日現在	当中間計算期間末 平成29年 4月26日現在
１．	期首元本額	2,030,551,322円	2,042,961,706円
	期中追加設定元本額	185,024,011円	103,568,671円
	期中一部解約元本額	172,613,627円	99,199,504円
２．	受益権の総数	2,042,961,706口	2,047,330,873口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

前中間計算期間 自　平成27年10月27日 至　平成28年 4月26日	当中間計算期間 自　平成28年10月27日 至　平成29年 4月26日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	前計算期間末 平成28年10月26日現在	当中間計算期間末 平成29年 4月26日現在
中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	中間貸借対照表計上額は中間計算期間末日の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（１口当たり情報）

前計算期間末 平成28年10月26日現在		当中間計算期間末 平成29年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	1.5609円	1口当たり純資産額	1.6750円
(1万口当たり純資産額)	(15,609円)	(1万口当たり純資産額)	(16,750円)

当ファンドは、「日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド」「海外株式インデックスＭＳＣＩ－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、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

（参考）

日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成28年10月26日現在	平成29年 4月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	74,004,493	122,770,144
株式	25,801,778,970	26,218,604,880
派生商品評価勘定	8,119,200	4,787,580
未収入金	47,146,960	-
未収配当金	216,734,395	244,343,425
流動資産合計	26,147,784,018	26,590,506,029
資産合計	26,147,784,018	26,590,506,029
負債の部		
流動負債		
前受金	7,880,000	545,000
未払解約金	58,439,520	4,982,592
未払利息	85	248
流動負債合計	66,319,605	5,527,840
負債合計	66,319,605	5,527,840
純資産の部		
元本等		
元本	21,796,501,197	19,751,953,946
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	4,284,963,216	6,833,024,243
元本等合計	26,081,464,413	26,584,978,189
純資産合計	26,081,464,413	26,584,978,189
負債純資産合計	26,147,784,018	26,590,506,029

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 （1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 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。 （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。 （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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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。

（貸借対照表に関する注記）

		平成28年10月26日現在	平成29年 4月26日現在
１．	期首	平成27年10月27日	平成28年10月27日
	期首元本額	21,458,722,226円	21,796,501,197円
	期首からの追加設定元本額	3,751,599,477円	658,802,851円
	期首からの一部解約元本額	3,413,820,506円	2,703,350,102円
	元本の内訳　※		
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	239,816,527円	266,065,076円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	812,936,819円	814,756,838円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	1,477,110,439円	1,521,242,565円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	1,676,193,204円	1,741,775,057円
	インデックスファンド日本株式（ＤＣ専用）	1,337,447,149円	1,315,402,759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	5,417,402,166円	4,515,315,782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	5,113,692円	4,954,840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）	4,079,233円	3,974,162円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	64,875,756円	58,748,345円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	52,860,753円	48,949,666円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	80,019,965円	70,586,457円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	100,340,782円	85,618,099円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	6,780,173,464円	5,801,600,554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）	18,417,277円	15,810,245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）	41,662,571円	36,822,388円
	グローバルバランスファンド３５（適格機関投資家向け）	37,909,904円	32,142,299円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	304,993,776円	281,700,269円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	907,512,348円	822,498,547円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	1,223,362,763円	1,151,455,270円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	1,214,272,609円	1,162,534,728円
	計	21,796,501,197円	19,751,953,946円
２．	受益権の総数	21,796,501,197口	19,751,953,946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	378,205,000円	418,600,000円

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成28年10月26日現在	平成29年 4月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

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

（平成29年 4月26日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	348,940,000	－	353,740,000	4,800,000

合計	348,940,000	－	353,740,000	4,800,000

（注）1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（１口当たり情報）

平成28年10月26日現在		平成29年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	1.1966円	1口当たり純資産額	1.3459円
(1万口当たり純資産額)	(11,966円)	(1万口当たり純資産額)	(13,459円)

海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成28年10月26日現在	平成29年 4月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	666,098,048	282,787,293
コール・ローン	336,611,313	507,013,157
出資金	7,425,950	6,945,997
株式	66,078,687,682	74,629,359,780
投資証券	1,844,665,412	2,021,412,093
派生商品評価勘定	10,453,502	22,998,665
未収入金	-	2,170,628
未収配当金	67,364,205	97,728,278
差入委託証拠金	281,658,417	206,366,950
流動資産合計	69,292,964,529	77,776,782,841
資産合計	69,292,964,529	77,776,782,841
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,439,197	1,272,650
未払解約金	72,735,081	15,204,324
未払利息	390	1,026
流動負債合計	78,174,668	16,478,000
負債合計	78,174,668	16,478,000
純資産の部		
元本等		
元本	38,877,746,606	36,322,860,847
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	30,337,043,255	41,437,443,994
元本等合計	69,214,789,861	77,760,304,841
純資産合計	69,214,789,861	77,760,304,841
負債純資産合計	69,292,964,529	77,776,782,841

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	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。 （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。 （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。 （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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	（1）デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 （2）為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

		平成28年10月26日現在	平成29年 4月26日現在
1．	期首	平成27年10月27日	平成28年10月27日
	期首元本額	39,171,763,417円	38,877,746,606円
	期首からの追加設定元本額	3,330,056,187円	1,197,340,129円
	期首からの一部解約元本額	3,624,072,998円	3,752,225,888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）	14,771,411,678円	14,967,617,040円
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	53,008,910円	55,898,386円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	178,940,471円	171,702,525円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	327,631,735円	321,086,160円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	370,479,311円	367,833,740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	3,533,390,362円	2,862,775,046円
	日興五大陸株式ファンド	6,931,109,823円	6,293,982,418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	31,269,716円	28,946,906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）	39,075,632円	213,555,298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）	1,837,557円	1,885,558円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	7,043,309円	6,191,658円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	5,843,299円	5,167,357円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	8,664,553円	7,472,990円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	11,084,688円	9,036,774円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	7,445,144,841円	6,162,897,193円
	グローバルバランスファンド３５（適格機関投資家向け）	9,975,313円	8,169,627円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	33,731,074円	29,775,324円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	99,681,217円	87,232,256円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	134,087,849円	121,796,233円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	133,359,275円	122,957,684円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,750,975,993円	4,476,880,674円
	計	38,877,746,606円	36,322,860,847円
２．	受益権の総数	38,877,746,606口	36,322,860,847口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成28年10月26日現在	平成29年 4月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

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

（デリバティブ取引等に関する注記）
取引の時価等に関する事項
(株式関連)

（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

（平成29年 4月26日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,011,281,927	－	1,026,838,662	15,556,735
合計		1,011,281,927	－	1,026,838,662	15,556,735

（注）1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

（平成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	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

（平成29年 4月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	549,550,220	－	555,719,500	6,169,280
	米ドル	430,565,200	－	433,927,000	3,361,800
	ユーロ	118,985,020	－	121,792,500	2,807,480
合計		549,550,220	－	555,719,500	6,169,280

（注）1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（１口当たり情報）

平成28年10月26日現在		平成29年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	1.7803円	1口当たり純資産額	2.1408円
(1万口当たり純資産額)	(17,803円)	(1万口当たり純資産額)	(21,408円)

海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成28年10月26日現在	平成29年 4月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	31,076,453	18,225,692
コール・ローン	160,378,578	72,247,176
株式	2,950,271,981	4,210,325,898
投資証券	82,017,268	111,165,079
派生商品評価勘定	11,489,570	33,973,476
未収入金	3,133,055	21,931,758
未収配当金	3,020,279	5,176,162
差入委託証拠金	40,882,451	43,239,185
流動資産合計	3,282,269,635	4,516,284,426
資産合計	3,282,269,635	4,516,284,426
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	56,076,391	41,437,954
未払金	638,364	32,829
未払解約金	1,228,756	432,497
未払利息	186	146
流動負債合計	57,943,697	41,903,426
負債合計	57,943,697	41,903,426
純資産の部		
元本等		
元本	2,465,038,729	3,065,602,620
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	759,287,209	1,408,778,380
元本等合計	3,224,325,938	4,474,381,000
純資産合計	3,224,325,938	4,474,381,000
負債純資産合計	3,282,269,635	4,516,284,426

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 （1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 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。 （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。 （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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	（1）デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 （2）為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

		平成28年10月26日現在	平成29年 4月26日現在
１．	期首	平成27年10月27日	平成28年10月27日
	期首元本額	2,027,129,180円	2,465,038,729円
	期首からの追加設定元本額	675,788,682円	729,722,378円
	期首からの一部解約元本額	237,879,133円	129,158,487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）	1,341,801,114円	1,851,487,918円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	9,510,522円	9,098,475円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	7,894,106円	7,515,066円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	11,671,765円	10,923,142円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	15,089,442円	13,197,353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）	48,337,514円	43,491,682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）	54,673,284円	50,645,881円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	45,830,367円	43,025,422円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	133,922,441円	126,517,632円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	180,334,940円	177,118,280円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	179,522,148円	178,273,907円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジあり）	436,451,086円	554,307,862円
	計	2,465,038,729円	3,065,602,620円
２．	受益権の総数	2,465,038,729口	3,065,602,620口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成28年10月26日現在	平成29年 4月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

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

（平成29年 4月26日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	252,723,193	－	256,709,665	3,986,472
合計		252,723,193	－	256,709,665	3,986,472

（注）1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

（平成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
	イスラエルシュケル	6,889,989	－	6,866,320	23,669

合計	3,059,453,485	－	3,103,661,730	△44,208,245

（平成29年 4月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	4,367,125,090	－	4,378,576,040	△11,450,950
	米ドル	2,873,708,246	－	2,869,487,550	4,220,696
	加ドル	172,029,818	－	167,819,580	4,210,238
	ユーロ	564,518,748	－	575,493,180	△10,974,432
	英ポンド	297,512,766	－	305,221,530	△7,708,764
	スイスフラン	155,427,219	－	156,253,540	△826,321
	スウェーデンクローナ	49,755,147	－	50,679,540	△924,393
	ノルウェークローネ	11,265,357	－	11,228,700	36,657
	デンマーククローネ	29,231,909	－	29,817,630	△585,721
	豪ドル	128,534,205	－	127,326,190	1,208,015
	香港ドル	55,043,379	－	54,943,850	99,529
	シンガポールドル	21,249,195	－	21,381,520	△132,325
	イスラエルシュケル	8,849,101	－	8,923,230	△74,129
合計		4,367,125,090	－	4,378,576,040	△11,450,950

（注）1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（１口当たり情報）

平成28年10月26日現在		平成29年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	1.3080円	1口当たり純資産額	1.4595円
(1万口当たり純資産額)	(13,080円)	(1万口当たり純資産額)	(14,595円)

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成28年10月26日現在	平成29年 4月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	39,649,730	57,342,132
国債証券	25,999,933,439	26,425,425,080
地方債証券	2,108,744,000	2,200,062,000
特殊債券	3,945,453,000	4,033,303,000
社債券	1,890,962,939	1,786,463,000
未収入金	228,902,250	-
未収利息	77,489,348	77,022,371
前払費用	296,730	1,324,359
流動資産合計	34,291,431,436	34,580,941,942
資産合計	34,291,431,436	34,580,941,942
負債の部		
流動負債		
未払金	327,563,150	-
未払解約金	11,866,028	31,044,426
未払利息	46	116
流動負債合計	339,429,224	31,044,542
負債合計	339,429,224	31,044,542
純資産の部		
元本等		
元本	24,166,629,108	24,909,158,038
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	9,785,373,104	9,640,739,362
元本等合計	33,952,002,212	34,549,897,400
純資産合計	33,952,002,212	34,549,897,400
負債純資産合計	34,291,431,436	34,580,941,942

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	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。 （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。 （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。 （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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

		平成28年10月26日現在	平成29年 4月26日現在
1．	期首	平成27年10月27日	平成28年10月27日
	期首元本額	25,862,890,330円	24,166,629,108円
	期首からの追加設定元本額	2,188,944,591円	1,521,208,965円
	期首からの一部解約元本額	3,885,205,813円	778,680,035円
	元本の内訳　※		
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	871,459,048円	1,069,726,190円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	1,011,780,903円	1,149,211,260円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	688,561,701円	794,098,639円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	117,425,374円	136,604,332円
	インデックスファンド日本債券（ＤＣ専用）	1,553,086,938円	1,660,401,961円
	世界の財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	4,441,791,698円	4,314,833,446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	4,217,572円	4,766,738円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	4,433,313円	4,722,090円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	24,528,793円	25,867,054円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	97,697,259円	101,413,633円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	365,711,084円	355,869,321円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	5,536,506,848円	5,555,994,108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）	37,474,130円	37,889,760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）	118,679,718円	123,543,727円
	グローバルバランスファンド３５（適格機関投資家向け）	25,175,832円	24,944,515円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	1,109,502,156円	1,157,738,587円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	1,119,891,482円	1,179,290,816円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	558,776,523円	612,953,086円

	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	83,546,916円	92,100,793円
	インデックスファンド日本債券（１年決算型）	6,174,652,045円	6,264,295,873円
	日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	221,729,775円	242,892,109円
	計	24,166,629,108円	24,909,158,038円
２．	受益権の総数	24,166,629,108口	24,909,158,038口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	平成28年10月26日現在	平成29年 4月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（１口当たり情報）

平成28年10月26日現在		平成29年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	1.4049円	1口当たり純資産額	1.3870円
(1万口当たり純資産額)	(14,049円)	(1万口当たり純資産額)	(13,870円)

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成28年10月26日現在	平成29年 4月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	231,855,186	237,060,327
コール・ローン	12,180,364	359,693,077
国債証券	150,747,275,002	152,801,074,269
派生商品評価勘定	68,508	4,359,050
未収入金	33,952,531	-
未収利息	1,403,726,868	1,424,692,779
前払費用	26,787,696	27,651,465
流動資産合計	152,455,846,155	154,854,530,967
資産合計	152,455,846,155	154,854,530,967
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	312,048	289,800
未払金	-	302,772,469
未払解約金	73,186,928	98,868,445
未払利息	14	728
流動負債合計	73,498,990	401,931,442
負債合計	73,498,990	401,931,442
純資産の部		
元本等		
元本	73,927,331,286	71,298,787,929
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	78,455,015,879	83,153,811,596
元本等合計	152,382,347,165	154,452,599,525
純資産合計	152,382,347,165	154,452,599,525
負債純資産合計	152,455,846,155	154,854,530,967

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	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。 （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。 （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。 （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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価	為替予約取引

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

（貸借対照表に関する注記）

		平成28年10月26日現在	平成29年 4月26日現在
１．	期首	平成27年10月27日	平成28年10月27日
	期首元本額	78,315,710,776円	73,927,331,286円
	期首からの追加設定元本額	2,818,708,551円	979,247,357円
	期首からの一部解約元本額	7,207,088,041円	3,607,790,714円
	元本の内訳　※		
	インデックスファンド海外債券ヘッジなし（ＤＣ専用）	11,212,363,646円	11,292,176,669円
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	91,399,681円	108,329,789円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	152,876,762円	167,465,380円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	187,090,479円	208,048,920円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	159,562,286円	178,413,815円
	財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	24,213,113,798円	24,244,814,032円
	世界の財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,948,863,601円	2,811,198,578円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	26,426,980,834円	24,124,951,018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	26,330,945円	28,096,825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）	998,969,384円	985,550,361円
	財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	204,310,268円	234,571,678円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	3,010,313円	3,044,865円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	3,325,848円	3,356,205円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	7,389,414円	7,292,493円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	19,083,574円	17,781,821円
	世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	415,344,427円	340,896,415円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	1,246,813,928円	1,206,870,557円
	世界アセットバランスファンド４０（適格機関投資家向け）	35,819,111円	34,089,843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）	92,603,401円	90,736,613円
	グローバルバランスファンド３５（適格機関投資家向け）	38,271,205円	36,282,693円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	57,973,019円	57,888,200円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	84,781,902円	85,158,894円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	76,097,064円	79,587,485円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	56,760,472円	59,775,500円

	インデックスファンド海外債券（ヘッジなし）１年決算型	4,923,806,084円	4,645,962,804円
	海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	244,389,840円	246,446,476円
	計	73,927,331,286円	71,298,787,929円
２．	受益権の総数	73,927,331,286口	71,298,787,929口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	平成28年10月26日現在	平成29年 4月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）
取引の時価等に関する事項
(通貨関連)

（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	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

（平成29年 4月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	267,408,780	－	271,732,830	4,324,050
	米ドル	119,812,800	－	121,338,800	1,526,000
	加ドル	2,594,880	－	2,625,280	30,400
	ユーロ	121,818,600	－	124,195,200	2,376,600
	英ポンド	23,182,500	－	23,573,550	391,050
	売建	87,669,980	－	87,924,780	△254,800
	ユーロ	60,915,000	－	60,880,000	35,000
	豪ドル	26,754,980	－	27,044,780	△289,800
合計		355,078,760	－	359,657,610	4,069,250

（注）1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（１口当たり情報）

平成28年10月26日現在		平成29年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	2.0612円	1口当たり純資産額	2.1663円
(1万口当たり純資産額)	(20,612円)	(1万口当たり純資産額)	(21,663円)

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成28年10月26日現在	平成29年 4月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	104,240,666	112,041,192
コール・ローン	50,541,363	265,363,274
国債証券	24,612,582,230	24,360,561,519
派生商品評価勘定	51,187,652	16,743,520
未収入金	29,274,906	13,341,488
未収利息	232,367,477	228,606,527
前払費用	13,547,188	7,784,044
流動資産合計	25,093,741,482	25,004,441,564
資産合計	25,093,741,482	25,004,441,564
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	367,233,287	489,138,390
未払金	-	4,977,528
未払解約金	15,536,210	35,009,015
未払利息	58	537
流動負債合計	382,769,555	529,125,470
負債合計	382,769,555	529,125,470
純資産の部		
元本等		
元本	16,161,520,366	16,458,957,681
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	8,549,451,561	8,016,358,413
元本等合計	24,710,971,927	24,475,316,094
純資産合計	24,710,971,927	24,475,316,094
負債純資産合計	25,093,741,482	25,004,441,564

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

（貸借対照表に関する注記）

		平成28年10月26日現在	平成29年 4月26日現在
1．	期首	平成27年10月27日	平成28年10月27日
	期首元本額	18,545,853,210円	16,161,520,366円
	期首からの追加設定元本額	899,484,365円	921,818,327円
	期首からの一部解約元本額	3,283,817,209円	624,381,012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）	1,486,508,411円	1,611,364,877円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	4,051,425円	4,416,955円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	4,472,221円	4,835,799円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	9,906,785円	10,513,898円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	25,809,011円	25,554,589円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	13,595,561,920円	13,789,937,788円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	78,286,388円	82,826,498円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	113,311,207円	122,118,066円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	101,610,912円	114,210,706円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	76,213,618円	85,708,511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	665,788,468円	607,469,994円
	計	16,161,520,366円	16,458,957,681円
2．	受益権の総数	16,161,520,366口	16,458,957,681口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	平成28年10月26日現在	平成29年 4月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）
取引の時価等に関する事項
(通貨関連)

（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

（平成29年 4月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	24,315,509,270	－	24,787,904,140	△472,394,870
	米ドル	10,633,914,653	－	10,897,413,420	△263,498,767
	加ドル	504,950,512	－	496,813,290	8,137,222
	メキシコペソ	198,267,084	－	205,753,860	△7,486,776
	ユーロ	9,692,080,256	－	9,829,494,370	△137,414,114
	英ポンド	1,713,881,461	－	1,766,034,830	△52,153,369
	スイスフラン	47,148,060	－	47,484,480	△336,420
	スウェーデンクローナ	176,815,683	－	180,471,380	△3,655,697
	ノルウェークローネ	74,433,999	－	74,852,280	△418,281
	デンマーククローネ	150,334,216	－	153,727,360	△3,393,144
	ポーランドズロチ	159,456,591	－	164,822,550	△5,365,959
	豪ドル	510,596,257	－	505,288,650	5,307,607
	シンガポールドル	90,881,379	－	91,794,070	△912,691
	マレーシアリンギット	205,579,749	－	210,469,320	△4,889,571
	南アフリカランド	157,169,370	－	163,484,280	△6,314,910

合計	24,315,509,270	－	24,787,904,140	△472,394,870

（注）1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（１口当たり情報）

平成28年10月26日現在		平成29年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	1.5290円	1口当たり純資産額	1.4871円
(1万口当たり純資産額)	(15,290円)	(1万口当たり純資産額)	(14,871円)

２【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2017年 4月28日現在です。

【年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	3,428,992,186円
Ⅱ　負債総額	5,407,089円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	3,423,585,097円
Ⅳ　発行済口数	2,046,993,688口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6725円

（参考）

日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	26,562,065,705円
Ⅱ　負債総額	83,235,941円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	26,478,829,764円
Ⅳ　発行済口数	19,742,798,026口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3412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

Ⅰ　資産総額	77,744,413,346円
Ⅱ　負債総額	48,862,752円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	77,695,550,594円
Ⅳ　発行済口数	36,345,325,884口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.1377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

Ⅰ　資産総額	4,524,297,330円
Ⅱ　負債総額	38,007,624円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	4,486,289,706円
Ⅳ　発行済口数	3,073,733,475口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4596円

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	34,817,093,888円
Ⅱ　負債総額	180,279,909円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	34,636,813,979円
Ⅳ　発行済口数	24,951,103,087口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3882円

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	154,388,034,468円
Ⅱ　負債総額	193,671,583円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	154,194,362,885円
Ⅳ　発行済口数	71,297,583,029口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.1627円

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	24,938,088,730円
Ⅱ　負債総額	409,910,400円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	24,528,178,330円
Ⅳ　発行済口数	16,463,590,664口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4898円

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

＜更新後＞

（１）資本金の額

平成29年4月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

●過去５年間における主な資本金の増減　：　該当事項はありません。

（２）会社の意思決定機関（平成29年4月末現在）

・株主総会

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

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

・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。

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

・監査役会

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

（３）運用の意思決定プロセス（平成29年4月末現在）

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

２【事業の内容及び営業の概況】

＜更新後＞

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

・委託会社の運用する、平成29年4月末現在の投資信託などは次の通りです。

種　類			ファンド本数	純資産額 （単位：億円）
投資信託総合計			720	137,615
	株式投資信託		674	113,109
		単位型	187	7,917
		追加型	487	105,192
	公社債投資信託		46	24,506
		単位型	32	356
		追加型	14	24,150

3【委託会社等の経理状況】

＜更新後＞

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

2．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第58期事業年度（平成28年４月１日から平成29年３月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

＜更新後＞

（単位：百万円）

		第57期 (平成28年３月31日)		第58期 (平成29年３月31日)
資産の部				
流動資産				
現金・預金	※3	14,308	※3	16,761
金銭の信託	※3	153	※3	152
有価証券		86		10
前払費用	※3	489		506
未収入金		10		136
未収委託者報酬		9,374		10,757
未収収益	※3	2,280	※3	2,799
関係会社短期貸付金		5,333		962
立替金		2,960		1,240
繰延税金資産		819		865
その他	※2,3	428	※2,3	385
流動資産合計		36,243		34,577
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	146	※1	93
器具備品	※1	210	※1	190
有形固定資産合計		356		283

無形固定資産		
ソフトウエア	140	138
無形固定資産合計	140	138
投資その他の資産		
投資有価証券	12,195	11,783
関係会社株式	21,702	23,203
関係会社長期貸付金	60	60
長期差入保証金	781	782
長期前払費用	0	0
繰延税金資産	425	423
投資その他の資産合計	35,165	36,253
固定資産合計	35,662	36,674
資産合計	71,905	71,252

（単位：百万円）

		第57期 (平成28年３月31日)		第58期 (平成29年３月31日)
負債の部				
流動負債				
預り金		410	※3	589
未払金		3,841		4,043
未払収益分配金		6		7
未払償還金		112		91
未払手数料	※3	3,269	※3	3,499
その他未払金		453		445
未払費用	※3	4,920	※3	4,229
未払法人税等		354		1,808
未払消費税等	※4	649	※4	538
関係会社短期借入金		5,631		―
賞与引当金		2,080		2,077
役員賞与引当金		145		168
その他	※3	278	※3	62
流動負債合計		18,312		13,517
固定負債				
退職給付引当金		1,154		1,259
固定負債合計		1,154		1,259
負債合計		19,466		14,777
純資産の部				
株主資本				
資本金		17,363		17,363
資本剰余金				
資本準備金		5,220		5,220
資本剰余金合計		5,220		5,220
利益剰余金				
その他利益剰余金				

繰越利益剰余金	29,948	34,015
利益剰余金合計	29,948	34,015
自己株式	△502	△672
株主資本合計	52,028	55,926
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	151	282
繰延ヘッジ損益	258	266
評価・換算差額等合計	410	548
純資産合計	52,438	56,475
負債純資産合計	71,905	71,252

（２）【損益計算書】

＜更新後＞

（単位：百万円）

	第57期 (自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日)	第58期 (自　平成28年４月１日 至　平成29年３月31日)
営業収益		
委託者報酬	66,339	64,680
その他営業収益	4,382	4,218
営業収益合計	70,722	68,898
営業費用		
支払手数料	30,529	28,675
広告宣伝費	1,098	969
公告費	3	2
調査費	17,470	17,322
調査費	821	841
委託調査費	16,600	16,456
図書費	48	24
委託計算費	505	498
営業雑経費	718	656
通信費	195	185
印刷費	321	276
協会費	65	66
諸会費	22	17
その他	113	111
営業費用計	50,327	48,124
一般管理費		
給料	8,138	8,243
役員報酬	365	360
役員賞与引当金繰入額	145	168
給料・手当	5,495	5,576
賞与	51	61
賞与引当金繰入額	2,080	2,077
交際費	185	99
寄付金	27	17
旅費交通費	503	412
租税公課	258	375
不動産賃借料	875	889
退職給付費用	372	390

退職金	113	20
固定資産減価償却費	196	192
福利費	952	959
諸経費	2,952	2,791
一般管理費計	14,577	14,394
営業利益	5,817	6,380

（単位：百万円）

		第57期 (自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日)		第58期 (自　平成28年４月１日 至　平成29年３月31日)
営業外収益				
受取利息		91		19
受取配当金	※１	1,330	※１	1,644
時効成立分配金・償還金		1		22
為替差益		32		177
その他		32		36
営業外収益合計		1,488		1,899
営業外費用				
支払利息	※１	242	※１	223
有価証券償還損		－		7
デリバティブ費用	※１	69	※１	146
時効成立後支払分配金・償還金		5		2
支払源泉所得税		119		155
その他		94		73
営業外費用合計		531		608
経常利益		6,774		7,670
特別利益				
投資有価証券売却益		720		174
その他		0		－
特別利益合計		720		174
特別損失				
投資有価証券売却損		100		120
固定資産処分損		6		13
特別賞与		204		－
割増退職金		91		－
役員退職一時金		64		－
特別損失合計		467		134
税引前当期純利益		7,027		7,710
法人税、住民税及び事業税		1,359		2,137
過年度法人税等		－	※２	115
法人税等調整額		706		△104
法人税等合計		2,065		2,147
当期純利益		4,962		5,562

（３）【株主資本等変動計算書】

＜更新後＞

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
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
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

第58期（自　平成28年４月１日　至　平成29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	29,948	29,948	△502	52,028
当期変動額							
剰余金の配当				△1,495	△1,495		△1,495
当期純利益				5,562	5,562		5,562
自己株式の取得						△170	△170

株主資本以外の項目の当期変動額（純額）							
当期変動額合計	－	－	－	4,067	4,067	△170	3,897
当期末残高	17,363	5,220	5,220	34,015	34,015	△672	55,926

	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	151	258	410	52,438
当期変動額				
剰余金の配当				△1,495
当期純利益				5,562
自己株式の取得				△170
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	130	7	138	138
当期変動額合計	130	7	138	4,036
当期末残高	282	266	548	56,475

［注記事項］

（重要な会計方針）

項目	第58期 (自　平成28年４月１日 至　平成29年３月31日)
１　資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 ①　子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 ②　その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法 (2) 金銭の信託 時価法 (3) デリバティブ 時価法
２　固定資産の減価償却の方法	(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日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物　３年～15年 器具備品　５年～20年 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウエア(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。
３　引当金の計上基準	(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。

	(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。 (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。 ① 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ② 数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。
4 ヘッジ会計の方法	(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 (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。 (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。 (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。
5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。

（会計方針の変更）

第58期 （自 平成28年４月１日 至 平成29年３月31日）
（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）を当事業年度に適用し、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、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。

（追加情報）

第58期 （自 平成28年４月１日 至 平成29年３月31日）
「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）を当事業年度から適用しております。

（貸借対照表関係）

第57期 （平成28年３月31日）	第58期 （平成29年３月31日）
※１ 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,170百万円 器具備品 653百万円	※１ 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,222百万円 器具備品 603百万円

※２　信託資産 流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。	※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　関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 現金・預金　4,072百万円 金銭の信託　153百万円 前払費用　2百万円 未収収益　147百万円 その他　193百万円 (流動負債) 未払手数料　93百万円 未払費用　722百万円 その他　266百万円	※３　関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 現金・預金　3,243百万円 金銭の信託　152百万円 未収収益　619百万円 その他　20百万円 (流動負債) 預り金　177百万円 未払手数料　144百万円 未払費用　251百万円 その他　61百万円
※４　消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。	※４　消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
※５　保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務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。	※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587百万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546百万円に対して保証を行っております。

（損益計算書関係）

第57期 (自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日)	第58期 (自　平成28年４月１日 至　平成29年３月31日)
※１　各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金　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	※１　各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金　1,550百万円 デリバティブ収益　347百万円 支払利息　58百万円 ※２　過年度の取引に関する法人税等の追加費用計上額です。

（株主資本等変動計算書関係）

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

第58期（自　平成28年４月１日　至　平成29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）	814,100	305,000	－	1,119,100

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	1,762,200	－	72,600	1,689,600	－
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	―	1,848,000	2,890,800	―
平成28年度 ストックオプション（1）	普通株式	―	4,437,000	33,000	4,404,000	―
合計		6,675,900	4,437,000	1,953,600	9,159,300	―

(注) 1 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。
2 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
3 平成21年度ストックオプション(1)1,689,600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)2,890,800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。また、平成28年度ストックオプション（1）は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
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29年５月25日 取締役会	普通株式	利益剰余金	1,036	5.29	平成29年３月31日	平成29年６月22日

(リース取引関係)

第57期 (自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日)		第58期 (自　平成28年４月１日 至　平成29年３月31日)	
オペレーティング・リース取引		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		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年内	865百万円
１年超	2,653百万円	１年超	1,787百万円
合計	3,518百万円	合計	2,653百万円

（金融商品関係）

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されており、また一部外貨建て預金を保有しているため為替変動リスクにも晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒される

ことは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、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

① 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

当社は、預金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。

② 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

当社は、原則、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、バリュー・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。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。

③ 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、日々資金残高管理を行っております。また、適時に資金繰予定表を作成・更新するとともに、手許流動性（最低限必要な運転資金）を状況に応じて見直し・維持すること等により、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てい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ているもののうち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　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	14,308	－	－	－
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

第58期(自　平成28年４月１日　至　平成29年３月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

① 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

当社は、預金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。

② 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

当社は、原則、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、バリュー・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。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。

③ 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、日々資金残高管理を行っております。また、適時に資金繰予定表を作成・更新するとともに、手許流動性（最低限必要な運転資金）を状況に応じて見直し・維持すること等により、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29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	16,761	16,761	－
(2) 未収委託者報酬	10,757	10,757	－
(3) 未収収益	2,799	2,799	－
(4) 関係会社短期貸付金	962	962	－
(5) 有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	11,777	11,777	－
(6) 未払金	(4,043)	(4,043)	－
(7) 未払費用	(4,229)	(4,229)	－
(8) デリバティブ取引(※2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	35	35	－
ヘッジ会計が適用されているもの	(1)	(1)	－
デリバティブ取引計	34	34	－

(※1)負債に計上されているものについては、(　)で示しております。

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

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

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬 、(3) 未収収益並びに (4) 関係会社短期貸付金
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券
投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(8) デリバティブ取引
（デリバティブ取引関係）注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないもののうち75百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、39百万円は流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されているもののうち20百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、22百万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　その他有価証券」には含めておりません。

３ 子会社株式（貸借対照表計上額20,310百万円）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	16,761	―	―	―
未収委託者報酬	10,757	―	―	―
未収収益	2,799	―	―	―
有価証券及び投資有価証券 投資信託	10	616	907	735
合計	30,328	616	907	735

（有価証券関係）

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

第58期(自　平成28年４月１日　至　平成29年３月31日)

１　子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	20,310
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	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	6,299	5,590	708
	小計	6,299	5,590	708
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	5,478	5,780	△302
	小計	5,478	5,780	△302
合計		11,777	11,370	406

(注) 1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当事業年度については、該当ございません。
2 非上場株式等（貸借対照表計上額　16百万円）については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3　当事業年度中に売却したその他有価証券

（単位：百万円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	3,198	174	120
合計	3,198	174	120

（デリバティブ取引関係）

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。

第58期(平成29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	1,729	－	35	35
	買建	－	－	－	－
合計		1,729	－	35	35

（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	2,993	－	11
	豪ドル		77	－	△2
	シンガポールドル		1,639	－	△20
	香港ドル		205	－	2
	人民元		1,946	－	6
	ユーロ		57	－	0
合計			6,920	－	△1

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

（持分法損益等）

第57期 (自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日)	第58期 (自　平成28年４月１日 至　平成29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　3,037	(1)関連会社に対する投資の金額　3,030
(2)持分法を適用した場合の投資の金額　9,686	(2)持分法を適用した場合の投資の金額　9,455
(3)持分法を適用した場合の投資利益の金額　2,901	(3)持分法を適用した場合の投資利益の金額　2,092

（退職給付関係）

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
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。

第58期(自　平成28年４月１日　至　平成29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	1,299
勤務費用	150
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	△190
退職給付の支払額	△72
退職給付債務の期末残高	1,190

（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	1,190
未積立退職給付債務	1,190
未認識数理計算上の差異	69
貸借対照表に計上された負債の額	1,259

退職給付引当金	1,259
貸借対照表に計上された負債の額	1,259

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	150
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	23
確定給付制度に係る退職給付費用	177

（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、213百万円でありました。

（ストックオプション等関係）

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

①　ストックオプション（新株予約権）の数

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年２月８日	平成22年８月20日

権利確定前(株)		
期首	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。

② 単価情報

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

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

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

２ ス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58期(自　平成28年４月１日　至　平成29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23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の取締役・従業員 186名	当社及び関係会社の取締役・従業員 16名
株式の種類別のストックオプションの付与数　(注)	普通株式 6,101,700株	普通株式 4,437,000株
付与日	平成23年10月7日	平成28年７月15日
権利確定条件	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。	平成30年７月15日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の３分の１、３分の１、３分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで
権利行使期間	平成25年10月７日から平成33年10月６日まで	平成30年7月15日から平成38年7月31日まで

（注）　株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

①　ストックオプション（新株予約権）の数

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年２月８日	平成22年８月20日

権利確定前(株)		
期首	1,762,200	174,900
付与	0	0
失効	72,600	0
権利確定	0	0
権利未確定残	1,689,600	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23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与日	平成23年10月７日	平成28年７月15日
権利確定前(株)		
期首	4,738,800	－
付与	0	4,437,000
失効	1,848,000	33,000
権利確定	0	0
権利未確定残	2,890,800	4,404,000
権利確定後(株)		
期首	－	－
権利確定	－	－
権利行使	－	－
失効	－	－
権利未行使残	－	－

(注)　株式数に換算して記載しております。

② 単価情報

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

	平成23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与日	平成23年10月7日	平成28年７月15日
権利行使価格(円)	737　(注)３	558
付与日における公正な評価単価(円)　(注)１	0	0

(注)１ 公正な評価単価に代え、本源的価値（取引事例比準法等による評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。
２ ス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57期 (平成28年３月31日)	第58期 (平成29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	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)	(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 642	賞与引当金 641
その他 177	その他 224
小計 819	小計 865
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 96	投資有価証券評価損 96
関係会社株式評価損 1,430	関係会社株式評価損 1,430
退職給付引当金 353	退職給付引当金 385
固定資産減価償却費 122	固定資産減価償却費 119
その他 65	その他 63
小計 2,068	小計 2,095
繰延税金資産小計 2,888	繰延税金資産小計 2,961
評価性引当金 △1,430	評価性引当金 △1,430
繰延税金資産合計 1,457	繰延税金資産合計 1,530
繰延税金負債(固定)	繰延税金負債(流動)
その他有価証券評価差額金 71	その他有価証券評価差額金 0
繰延ヘッジ利益 114	小計 0
その他 26	繰延税金負債(固定)
小計 213	その他有価証券評価差額金 123
繰延税金負債合計 213	繰延ヘッジ利益 117
繰延税金資産の純額 1,244	小計 241
	繰延税金負債合計 242
	繰延税金資産の純額 1,288
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 33.1%	法定実効税率 30.9%
（調整）	（調整）
交際費等永久に損金に算入されない項目 1.4%	交際費等永久に損金に算入されない項目 0.6%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目 △4.8%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 △5.3%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正 1.3%	過年度法人税等 1.5%
所得拡大促進税制 △2.2%	海外子会社の留保利益の影響額等 0.2%
海外子会社の留保利益の影響額等 0.6%	税効果会計適用後の法人税等の負担率 27.9%
税効果会計適用後の法人税等の負担率 29.4%	

第57期 (平成28年３月31日)	第58期 (平成29年３月31日)

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 「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。	－

（関連当事者情報）

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(SGD 千)	アセットマネジメント業	直接100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	△90(SGD △1,000千)(注2)	関係会社短期貸付金	333(SGD 4,000千)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	18(SGD 215 千)	未収収益	6(SGD 74 千)
							資金の貸付(円貸建)(注3)	5,000	関係会社短期貸付金	5,000
							貸付金利息(円貸建)(注3)	70	未収収益	70
子会社	Nikko Asset Management Americas, Inc.	アメリカ合衆国	181,542(USD 千)(注4)	アセットマネジメント業	間接100.00	資金の借入	資金の借入(米ドル貸建)(注5)	6,176(USD 50,000千)	関係会社短期借入金	5,631(USD 50,000千)
							借入金利息(米ドル貸建)(注5)	113(USD 949 千)	未払費用	106(USD 949 千)

(注)　取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 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

第58期(自　平成28年４月１日　至　平成29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	312,000(SGD 千)	アセットマネジメント業	直接100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	65(SGD 800 千)(注2)	関係会社短期貸付金	385(SGD 4,800 千)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	13(SGD 177 千)	未収収益	8(SGD 105 千)
							資金の貸付(円貨建)(注3)	△4,422(注4)	関係会社短期貸付金	577
							貸付金利息(円貨建)(注3)	3	未収収益	3

						－	増資の引受（注5）	1,501（SGD 20,000千）	－	－
子会社	Nikko Asset Management Americas, Inc.	アメリカ合衆国	181,542（USD 千）（注6）	アセットマネジメント業	間接 100.00	資金の借入	資金の借入（米ドル貸建）（注7）	△5,549（USD △50,000千）（注8）	関係会社短期借入金	－
							借入金利息（米ドル貸建）（注7）	48（USD 453 千）	未払費用	－

（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65百万円（SGD800千）の内訳は、貸付505百万円（SGD6,600千）及び返済439百万円（SGD5,800千）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 資金の貸付に係る取引金額△4,422百万円の内訳は、貸付577百万円及び返済5,000百万円であります。
5 Nikko Asset Management International Limitedの行った20,000,000株の新株発行増資を、１株につき１シンガポールドルで当社が引受けたものであります。
6 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。
7 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。
8 資金の借入に係る取引金額△5,549百万円（USD△50,000千）は、返済であります。

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28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	25,221百万円
負債合計	5,428百万円
純資産合計	19,792百万円
営業収益	18,250百万円
税引前当期純利益	6,809百万円
当期純利益	4,680百万円

（セグメント情報等）

セグメント情報

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。

第58期(自　平成28年４月１日　至　平成29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。

第58期(自　平成28年４月１日　至　平成29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。

第58期(自　平成28年４月１日　至　平成29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。

第58期(自　平成28年４月１日　至　平成29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。

第58期(自　平成28年４月１日　至　平成29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57期 (自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日)	第58期 (自　平成28年４月１日 至　平成29年３月31日)
１株当たり純資産額	267円27銭	288円29銭
１株当たり当期純利益金額	25円25銭	28円38銭

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

２　１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第57期 (自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日)	第58期 (自　平成28年４月１日 至　平成29年３月31日)
当期純利益（百万円）	4,962	5,562
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）	4,962	5,562
普通株式の期中平均株式数（千株）	196,464	196,009
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)　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	平成21年度ストックオプション(1)　1,689,600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)　2,890,800株、平成28年度ストックオプション（1）　4,404,000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57期 (平成28年３月31日)	第58期 (平成29年３月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	52,438	56,475
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）	52,438	56,475
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）	196,198	195,893

（重要な後発事象）

新株予約権（ストックオプション）の付与

当社は平成29年３月15日付の臨時株主総会及び平成29年３月22日開催の取締役会の決議に基づき、平成29年４月27日にストックオプションとして新株予約権を当社、当社子会社の取締役及び従業員31

名に付与いたしました。

①新株予約権の数	4,409個
②新株予約権の目的となる株式の種類及び数	当社普通株式　4,409,000株
③新株予約権の発行価額	無償
④新株予約権の行使時の払込金額	１株当たり金553円
⑤新株予約権の行使期間	平成31年４月27日から平成39年４月30日まで

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

＜更新後＞

（１）受託会社

名　　称	資本金の額 （平成28年9月末現在）	事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

＜更新後＞

（２）販売会社

名　　称	資本金の額 （平成28年9月末現在）	事業の内容
ＳＭＢＣ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。
損保ジャパン日本興亜ＤＣ証券株式会社	3,000百万円	
株式会社伊予銀行	20,948百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社大垣共立銀行	36,166百万円	
株式会社紀陽銀行	80,096百万円	
株式会社きらやか銀行	22,700百万円	
株式会社佐賀銀行	16,062百万円	
株式会社山陰合同銀行	20,705百万円	
株式会社十八銀行	24,404百万円	
株式会社百十四銀行	37,322百万円	
株式会社広島銀行	54,573百万円	
株式会社福岡銀行	82,329百万円	
株式会社宮崎銀行	14,697百万円	
株式会社横浜銀行	215,628百万円	
第一生命保険株式会社	343,146百万円	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。

独 立 監 査 人 の 中 間 監 査 報 告 書

平成29年５月31日

日興アセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　鶴　田　　光　夫
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　辻　村　　和　之

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」に掲げられている年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）の平成28年10月27日から平成29年４月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）の平成29年４月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年10月27日から平成29年４月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以　上

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

2.ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

平成29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 業務執行社員	公認会計士　羽 太 典 明
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　竹 内 知 明

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29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.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。