

## 【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27年10月26日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 柴田 拓美
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	森川 晃
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	DCインデックスバランス（株式20）
【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】

平成27年 2月 6日付をもって提出しました有価証券届出書（平成27年7月22日付で有価証券届出書の訂正届出書を提出済み。以下「原届出書」といいます。）において、信託報酬の変更など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」および「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 2 ファンドの現況」は原届出書の更新後の内容を記載しています。

## 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】

## (3)【ファンドの仕組み】

&lt;更新後&gt;

委託会社の概況（平成27年8月末現在）

## 1) 資本金

17,363百万円

## 2) 沿革

昭和34年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

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

## 3) 大株主の状況

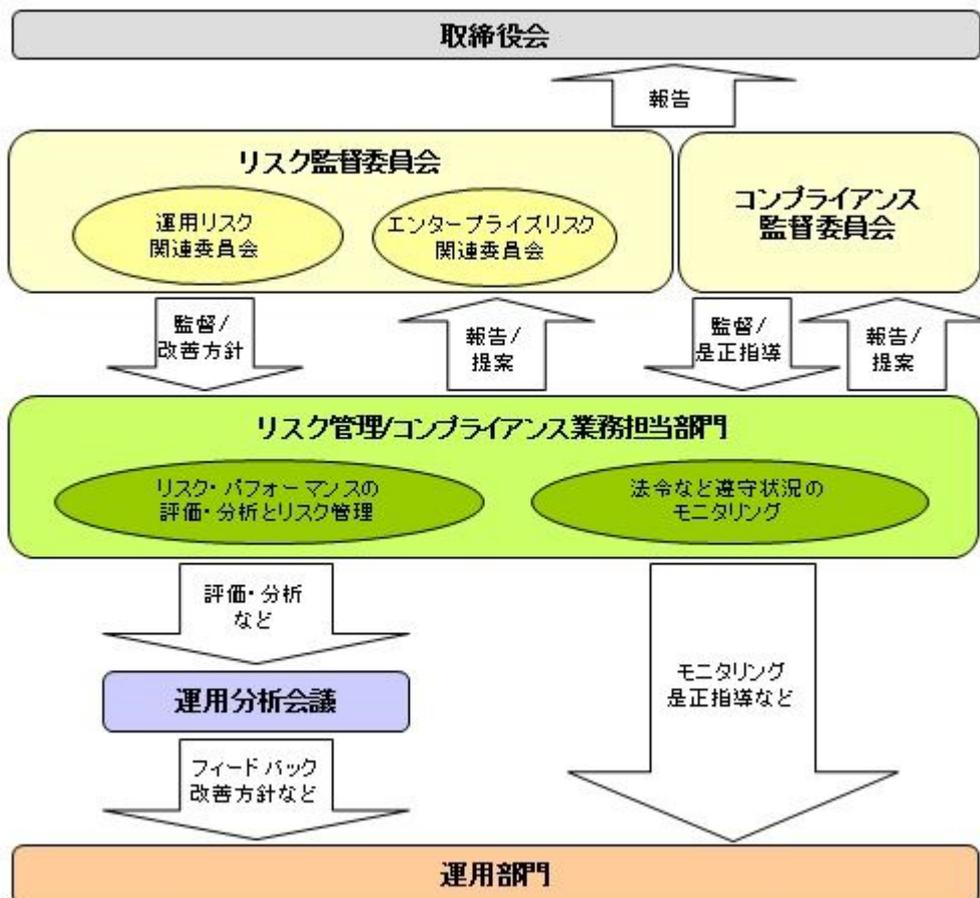
名 称	住 所	所有株数	所有比率
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	179,869,100株	91.29%
DBS Bank Ltd.	6 Shenton Way, #46-00, DBS Building Tower One, Singapore 068809	14,283,400株	7.24%

## 2【投資方針】

## (3)【運用体制】

&lt;更新後&gt;





### 全社的なリスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理/コンプライアンス業務担当部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況についてはコンプライアンス部門が事務局を務めるコンプライアンス監督委員会、リスク管理状況についてはリスク管理部門が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。両委員会およびそれに関連する部門別委員会においては、法令遵守状況や各種リスク（運用リスク、事務リスク、システムリスクなど）に関するモニタリングとその報告に加えて、重要事故への対応と各種リスク対応、事故防止のための施策やその管理手法の構築などの支援に努めております。

### 運用状況の評価・分析および運用リスク管理

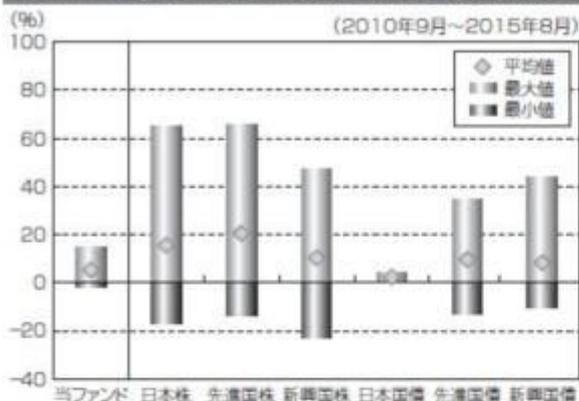
ファンド財産について運用状況の評価・分析および運用リスクの管理状況をモニタリングします。運用パフォーマンスおよび運用リスクに係る評価と分析の結果については運用分析会議に報告し、運用リスクの管理状況についてはリスク監督委員会あるいはその部門別委員会へ報告され、問題点の原因の究明や改善策の策定が図られます。加えて外部委託運用部門は、外部委託ファンドの運用管理を行ない、投資方針に沿った運用が行なわれているかなどのモニタリングを行なっています。

### 法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は平成27年8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	5.3%	15.5%	20.5%	10.3%	2.3%	9.6%	8.3%
最大値	14.8%	65.0%	65.7%	47.4%	4.5%	34.9%	43.7%
最小値	-1.6%	-17.0%	-13.6%	-22.8%	0.4%	-12.7%	-10.1%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2010年9月から2015年8月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

**<各資産クラスの指数>**

日本株……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

**当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移**

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。  
※分配金再投資基準価額は、2010年9月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

※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-ボンド・パフォーマンス・インデックス国債**

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

**シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース)**

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

Index LLC に帰属します。

#### JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド（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】

##### (2)【換金（解約）手数料】

<訂正前>

信託財産留保額

<解約請求受付日が平成27年8月17日以前の場合>

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.15%の率を乗じて得た額（1口当たり）が差し引かれます。

<解約請求受付日が平成27年8月18日以降の場合>

ありません。

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

<訂正後>

信託財産留保額

ありません。

##### (3)【信託報酬等】

<更新後>

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.1836%（税抜0.17%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.17%	0.04%	0.10%	0.03%

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

## （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せん。

#### 確定拠出年金でない場合

##### 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）<sup>\*</sup>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。

<sup>\*</sup>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および上場株式等の配当等（申告分離課税を選択したものに限り、）と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益（譲渡益）および普通分配金（申告分離課税を選択したものに限り、）については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間100万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。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をご利用できません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

### < 平成28年1月1日以降 >

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、平成28年4月1日より、未成年者口座内の少額上場株式等に係る配当所得及び譲渡所得等の非課税措置（ジュニアNISA）が開始され、20歳未満の居住者などを対象に、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となる予定です。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をご利用できません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### 法人受益者の場合

## 1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

## 2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

## 個別元本

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

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

## 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

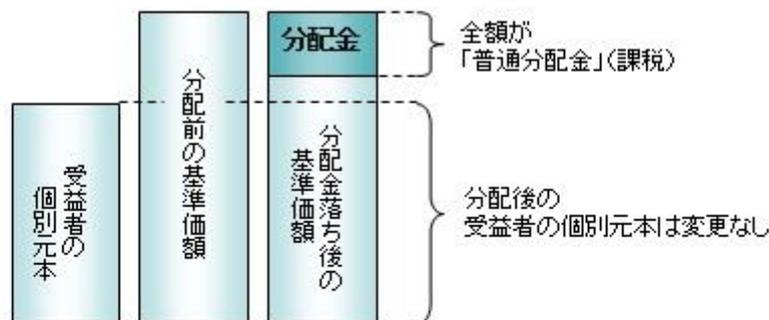
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

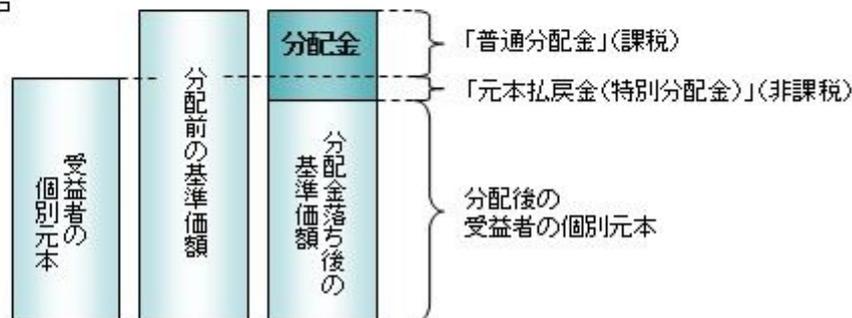
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

## &lt;分配金に関するイメージ図&gt;

## イ) の場合



## ロ)、ハ) の場合



上記は平成27年10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】

## 【DCインデックスバランス（株式20）】

以下の運用状況は2015年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### （１）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	1,469,459,065	95.03
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		76,859,688	4.97
合計（純資産総額）		1,546,318,753	100.00

### （２）【投資資産】

#### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデクスマザーファンド	751,292,685	1.3143	987,424,017	1.3302	999,369,529	64.63
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデクスTOPIXマザーファンド	186,348,378	1.1494	214,197,393	1.2911	240,594,390	15.56
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデクス（ヘッジなし）マザーファンド	64,827,028	2.2935	148,681,202	2.3373	151,520,212	9.80
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデクスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	39,726,378	1.9019	75,556,349	1.9628	77,974,934	5.04

#### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	95.03
合計	95.03

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

### （３）【運用実績】

#### 【純資産の推移】

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3計算期間末 (2005年11月 7日)	304	304	1.1451	1.1451
第4計算期間末 (2006年11月 6日)	410	410	1.1823	1.1833
第5計算期間末 (2007年11月 6日)	559	560	1.2188	1.2198
第6計算期間末 (2008年11月 6日)	574	574	1.0938	1.0948
第7計算期間末 (2009年11月 6日)	658	659	1.1229	1.1239
第8計算期間末 (2010年11月 8日)	730	731	1.1402	1.1412
第9計算期間末 (2011年11月 7日)	812	813	1.1301	1.1311
第10計算期間末 (2012年11月 6日)	907	908	1.1621	1.1631
第11計算期間末 (2013年11月 6日)	1,087	1,088	1.3288	1.3298
第12計算期間末 (2014年11月 6日)	1,377	1,378	1.4209	1.4219
2014年 8月末日	1,325		1.3840	
9月末日	1,347		1.3996	
10月末日	1,364		1.4069	
11月末日	1,412		1.4437	
12月末日	1,448		1.4555	
2015年 1月末日	1,461		1.4492	
2月末日	1,471		1.4651	
3月末日	1,479		1.4691	
4月末日	1,497		1.4796	
5月末日	1,549		1.4924	
6月末日	1,564		1.4808	
7月末日	1,572		1.4914	
8月末日	1,546		1.4697	

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金(円)
第3期	2004年11月 9日～2005年11月 7日	0.0000
第4期	2005年11月 8日～2006年11月 6日	0.0010
第5期	2006年11月 7日～2007年11月 6日	0.0010
第6期	2007年11月 7日～2008年11月 6日	0.0010
第7期	2008年11月 7日～2009年11月 6日	0.0010
第8期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	0.0010
第9期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	0.0010
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	0.0010
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	0.0010
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	0.0010
当中間期	2014年11月 7日～2015年 5月 6日	

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第3期	2004年11月 9日～2005年11月 7日	7.25
第4期	2005年11月 8日～2006年11月 6日	3.34
第5期	2006年11月 7日～2007年11月 6日	3.17
第6期	2007年11月 7日～2008年11月 6日	10.17
第7期	2008年11月 7日～2009年11月 6日	2.75
第8期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	1.63
第9期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	0.80
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	2.92
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	14.43
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	7.01
当中間期	2014年11月 7日～2015年 5月 6日	3.98

(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3期	2004年11月 9日～2005年11月 7日	188,257,844	13,524,446
第4期	2005年11月 8日～2006年11月 6日	125,745,689	44,778,550
第5期	2006年11月 7日～2007年11月 6日	163,992,962	51,915,246
第6期	2007年11月 7日～2008年11月 6日	136,224,486	70,649,369
第7期	2008年11月 7日～2009年11月 6日	112,641,207	50,706,866
第8期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	113,017,851	58,786,346
第9期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	116,169,305	38,356,384
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	147,565,250	85,574,433
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	176,253,275	138,405,358
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	252,432,163	101,614,168
当中間期	2014年11月 7日～2015年 5月 6日	112,700,214	67,537,831

（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2015年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	27,628,675,290	99.21

コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		220,388,514	0.79
合計(純資産総額)		27,849,063,804	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	184,020,000	0.66

(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	169,000	6,223.86	1,051,833,020	7,192.00	1,215,448,000	4.36
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	969,900	595.03	577,126,710	800.10	776,016,990	2.79
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	91,400	4,043.96	369,618,680	4,964.00	453,709,600	1.63
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	63,900	7,415.72	473,864,626	7,063.00	451,325,700	1.62
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	94,600	3,272.99	309,625,787	4,629.50	437,950,700	1.57
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,696,600	192.19	326,078,094	248.70	421,944,420	1.52
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	110,200	3,341.57	368,241,390	3,824.00	421,404,800	1.51
日本	株式	KDDI	情報・通信業	122,800	2,288.10	280,979,730	3,018.00	370,610,400	1.33
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	81,100	3,648.93	295,928,510	4,329.50	351,122,450	1.26
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	48,100	4,630.37	222,720,840	5,962.00	286,772,200	1.03
日本	株式	ソニー	電気機器	86,100	2,072.67	178,457,175	3,162.00	272,248,200	0.98
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	50,600	4,035.07	204,174,735	5,290.00	267,674,000	0.96
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	143,600	1,630.95	234,204,982	1,800.00	258,480,000	0.93
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	22,500	8,390.35	188,782,905	11,205.00	252,112,500	0.91
日本	株式	ファナック	電気機器	12,700	17,957.48	228,060,000	19,715.00	250,380,500	0.90
日本	株式	キヤノン	電気機器	65,900	3,289.96	216,808,492	3,707.00	244,291,300	0.88
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	49,000	3,305.99	161,993,920	4,876.00	238,924,000	0.86
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	93,200	1,768.42	164,817,476	2,538.50	236,588,200	0.85
日本	株式	三菱地所	不動産業	90,000	2,341.69	210,752,940	2,609.00	234,810,000	0.84
日本	株式	村田製作所	電気機器	12,900	11,984.99	154,606,386	17,550.00	226,395,000	0.81
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	11,000	15,121.36	166,335,000	19,885.00	218,735,000	0.79
日本	株式	三井不動産	不動産業	64,000	3,061.20	195,917,260	3,360.00	215,040,000	0.77
日本	株式	三菱商事	卸売業	92,600	2,047.69	189,616,308	2,255.00	208,813,000	0.75
日本	株式	パナソニック	電気機器	150,000	1,222.03	183,304,914	1,337.50	200,625,000	0.72
日本	株式	日立製作所	電気機器	294,000	798.68	234,812,100	681.80	200,449,200	0.72
日本	株式	花王	化学	34,500	4,217.72	145,511,660	5,552.00	191,544,000	0.69

日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	247,100	611.35	151,066,722	766.10	189,303,310	0.68
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	171,900	949.55	163,228,496	1,097.00	188,574,300	0.68
日本	株式	任天堂	その他製品	7,500	11,626.80	87,201,000	25,010.00	187,575,000	0.67
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	41,700	3,336.56	139,134,843	4,270.50	178,079,850	0.64

#### 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	0.07
		鉱業	0.37
		建設業	2.84
		食料品	4.54
		繊維製品	0.80
		パルプ・紙	0.26
		化学	5.83
		医薬品	5.19
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.89
		ガラス・土石製品	0.93
		鉄鋼	1.18
		非鉄金属	0.88
		金属製品	0.62
		機械	4.40
		電気機器	11.59
		輸送用機器	10.54
		精密機器	1.47
		その他製品	1.75
		電気・ガス業	2.31
		陸運業	4.15
		海運業	0.27
		空運業	0.67
		倉庫・運輸関連業	0.19
		情報・通信業	7.31
		卸売業	4.04
		小売業	4.79
銀行業	9.43		
証券、商品先物取引業	1.33		
保険業	2.75		
その他金融業	1.28		
不動産業	2.87		
サービス業	3.18		
合計			99.21

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2015年09月	買建	12	日本円	177,896,480	184,020,000	0.66

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

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

以下の運用状況は2015年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	44,640,492,576	57.99
	カナダ	2,752,362,498	3.58
	モーリシャス	3,457,740	0.00
	ドイツ	2,873,943,649	3.73
	イタリア	729,569,421	0.95
	フランス	2,922,943,004	3.80
	オランダ	1,253,005,495	1.63
	スペイン	1,144,131,216	1.49
	ベルギー	418,776,748	0.54
	オーストリア	56,188,153	0.07
	ルクセンブルク	82,204,311	0.11
	フィンランド	268,600,256	0.35
	アイルランド	1,294,988,443	1.68
	ポルトガル	48,284,061	0.06
	イギリス	5,969,931,832	7.75
	スイス	3,215,331,113	4.18
	スウェーデン	908,971,429	1.18
	ノルウェー	192,395,394	0.25
	デンマーク	569,431,326	0.74
	ケイマン	173,326,946	0.23
オーストラリア	1,845,201,713	2.40	
バミューダ	154,526,129	0.20	
ニュージーランド	34,656,828	0.05	
香港	713,042,636	0.93	

	シンガポール	465,141,127	0.60
	イスラエル	206,108,749	0.27
	ジャージー	365,398,272	0.47
	英ヴァージン諸島	23,750,286	0.03
	小計	73,326,161,351	95.25
投資証券	アメリカ	1,366,232,480	1.77
	カナダ	12,089,825	0.02
	フランス	102,843,957	0.13
	イギリス	112,968,597	0.15
	オーストラリア	206,894,328	0.27
	香港	33,913,776	0.04
	シンガポール	24,950,039	0.03
	小計	1,859,893,002	2.42
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,798,304,401	2.34
合計（純資産総額）		76,984,358,754	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,386,393,114	1.80
	買建	ドイツ	485,992,714	0.63

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		1,534,926,580	1.99

(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	123,312	12,750.55	1,572,297,005	13,728.48	1,692,886,597	2.20
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	164,914	5,590.03	921,874,768	5,323.43	877,909,355	1.14
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	88,761	11,450.29	1,016,339,919	9,096.98	807,457,273	1.05
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	58,821	12,497.29	735,103,295	11,532.70	678,364,982	0.88
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	103,780	6,204.41	643,894,293	6,487.97	673,322,274	0.87

アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	212,693	3,107.05	660,848,892	3,048.88	648,477,306	0.84
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	78,970	7,118.11	562,117,399	7,771.27	613,697,460	0.80
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	68,323	8,579.36	586,168,091	8,951.83	611,616,154	0.79
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	48,783	10,826.79	528,163,541	11,893.69	580,209,977	0.75
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	8,345	34,785.93	290,288,592	62,772.45	523,836,110	0.68
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	129,497	4,023.55	521,038,558	4,034.08	522,401,543	0.68
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	129,610	3,527.54	457,205,730	3,957.73	512,962,526	0.67
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	6,502	65,203.32	423,952,003	76,389.44	496,684,193	0.65
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	14,878	35,100.28	522,221,966	33,231.63	494,420,221	0.64
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	57,109	10,319.68	589,347,107	8,629.22	492,806,570	0.64
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	88,147	5,909.94	520,944,239	5,582.76	492,103,775	0.64
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	6,040	66,515.70	401,754,841	79,941.23	482,845,055	0.63
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	42,510	9,775.59	415,560,356	11,028.59	468,825,437	0.61
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	222,679	2,026.12	451,176,513	1,982.50	441,462,186	0.57
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	34,253	10,737.75	367,800,487	12,418.52	425,371,785	0.55
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	87,642	4,970.80	435,651,169	4,780.55	418,977,051	0.54
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	64,377	6,277.12	404,102,412	6,456.47	415,648,195	0.54
アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	31,494	13,415.83	422,518,396	13,060.78	411,336,218	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	60,153	6,981.17	419,938,909	6,709.73	403,610,786	0.52
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	24,480	16,911.88	414,002,842	16,448.97	402,670,864	0.52
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	27,980	11,510.88	322,074,652	14,241.07	398,465,239	0.52
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	406,751	1,175.47	478,125,713	969.34	394,282,681	0.51
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	39,751	14,045.97	558,341,505	9,746.50	387,433,416	0.50
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	41,492	6,467.37	268,344,390	8,780.70	364,328,921	0.47
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	19,932	19,640.85	391,481,510	17,932.21	357,424,937	0.46

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
----	-------	----	---------

株式	国外	エネルギー	7.08
		素材	4.52
		資本財	6.92
		商業・専門サービス	0.89
		運輸	1.88
		自動車・自動車部品	1.67
		耐久消費財・アパレル	1.81
		消費者サービス	1.77
		メディア	3.01
		小売	3.85
		食品・生活必需品小売り	2.13
		食品・飲料・タバコ	5.84
		家庭用品・パーソナル用品	2.03
		ヘルスケア機器・サービス	3.62
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10.47
		銀行	9.24
		各種金融	4.02
		保険	4.22
		不動産	0.62
		ソフトウェア・サービス	7.59
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.19
電気通信サービス	3.14		
公益事業	3.08		
半導体・半導体製造装置	1.65		
投資証券		2.42	
合計		97.66	

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500 1509	買建	23	米ドル	11,484,300	1,391,667,474	11,440,775	1,386,393,114	1.80
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1509	買建	115	ユーロ	3,631,750	494,135,905	3,571,900	485,992,714	0.63

(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	9,400,000.00	1,140,981,525	1,138,299,500	1.48
	ユーロ	買建	2,800,000.00	383,210,115	380,930,000	0.49
	英ポンド	買建	84,000.00	15,719,760	15,697,080	0.02

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2015年 8月31日現在です。

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

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	27,669,076,530	79.62
地方債証券	日本	2,220,900,000	6.39
特殊債券	日本	2,593,900,000	7.46
社債券	日本	1,990,095,000	5.73
	オーストラリア	101,617,000	0.29
	小計	2,091,712,000	6.02
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		174,805,525	0.50
合計(純資産総額)		34,750,394,055	100.00

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	750,000,000	105.31	789,840,000	104.53	784,005,000	1.300	2019/3/20	2.26
日本	国債証券	第107回利付国債(5年)	705,000,000	100.51	708,644,850	100.44	708,158,400	0.200	2017/12/20	2.04
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	581,000,000	106.30	617,626,240	105.49	612,943,380	1.400	2019/9/20	1.76
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	545,000,000	108.65	592,175,200	108.86	593,325,150	1.400	2022/12/20	1.71
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	563,000,000	106.08	597,230,400	105.33	593,058,570	1.300	2019/12/20	1.71
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	560,000,000	99.97	559,882,400	100.16	560,935,200	0.100	2020/6/20	1.61
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	505,000,000	99.89	504,449,300	100.18	505,914,050	0.100	2020/3/20	1.46
日本	国債証券	第102回利付国債(5年)	500,000,000	100.51	502,590,200	100.38	501,945,000	0.300	2016/12/20	1.44
日本	国債証券	第117回利付国債(5年)	470,000,000	100.49	472,331,000	100.63	472,993,900	0.200	2019/3/20	1.36
日本	国債証券	第284回利付国債(10年)	462,000,000	103.59	478,618,140	102.20	472,196,340	1.700	2016/12/20	1.36

日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	410,000,000	107.14	439,312,200	106.64	437,248,600	1.300	2021/3/20	1.26
日本	国債証券	第29回利付国債(30年)	276,000,000	118.22	326,289,960	122.32	337,628,040	2.400	2038/9/20	0.97
日本	国債証券	第120回利付国債(5年)	330,000,000	100.57	331,888,300	100.64	332,131,800	0.200	2019/9/20	0.96
日本	国債証券	第292回利付国債(10年)	306,000,000	105.61	323,166,600	104.31	319,197,780	1.700	2018/3/20	0.92
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	280,000,000	108.88	304,886,400	111.99	313,572,000	1.700	2032/9/20	0.90
日本	国債証券	第106回利付国債(5年)	310,000,000	100.48	311,488,000	100.39	311,236,900	0.200	2017/9/20	0.90
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	260,000,000	119.13	309,753,600	119.66	311,118,600	2.300	2026/9/20	0.90
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	260,000,000	119.01	309,439,000	119.41	310,486,800	2.300	2026/6/20	0.89
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	300,000,000	100.28	300,840,000	100.19	300,576,000	0.100	2019/12/20	0.86
日本	国債証券	第291回利付国債(10年)	287,000,000	104.26	299,237,680	103.29	296,456,650	1.300	2018/3/20	0.85
日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	240,000,000	116.75	280,214,400	118.74	284,983,200	2.100	2029/9/20	0.82
日本	国債証券	第290回利付国債(10年)	266,000,000	104.60	278,236,000	103.55	275,443,000	1.400	2018/3/20	0.79
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	261,000,000	104.01	271,468,710	102.62	267,853,860	1.700	2017/3/20	0.77
日本	国債証券	第36回利付国債(30年)	230,000,000	109.28	251,344,000	114.26	262,809,500	2.000	2042/3/20	0.76
日本	国債証券	第50回利付国債(20年)	237,000,000	110.97	263,017,860	109.99	260,690,520	1.900	2021/3/22	0.75
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	208,000,000	119.25	248,040,000	122.57	254,949,760	2.400	2034/3/20	0.73
日本	国債証券	第137回利付国債(20年)	220,000,000	109.97	241,953,000	112.16	246,760,800	1.700	2032/6/20	0.71
日本	国債証券	第301回利付国債(10年)	223,000,000	106.49	237,477,160	105.57	235,432,250	1.500	2019/6/20	0.68
日本	国債証券	第149回利付国債(20年)	215,000,000	104.80	225,341,300	107.23	230,548,800	1.500	2034/6/20	0.66
日本	国債証券	第298回利付国債(10年)	221,000,000	105.05	232,178,180	104.23	230,361,560	1.300	2018/12/20	0.66

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	79.62
地方債証券	6.39
特殊債券	7.46
社債券	6.02
合計	99.50

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2015年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	78,652,026,839	41.98
	カナダ	3,936,615,813	2.10
	メキシコ	1,805,549,802	0.96
	ドイツ	13,995,743,510	7.47
	イタリア	18,449,341,826	9.85
	フランス	17,833,894,757	9.52
	オランダ	4,644,935,267	2.48
	スペイン	9,847,336,694	5.26
	ベルギー	4,827,409,623	2.58
	オーストリア	3,022,393,397	1.61
	フィンランド	1,101,464,631	0.59
	アイルランド	1,467,415,979	0.78
	イギリス	16,101,701,759	8.59
	スイス	577,138,179	0.31
	スウェーデン	839,334,090	0.45
	ノルウェー	533,738,310	0.28
	デンマーク	1,297,683,864	0.69
	ポーランド	1,046,437,271	0.56
	オーストラリア	2,964,573,806	1.58
	シンガポール	694,577,503	0.37
マレーシア	831,789,450	0.44	
南アフリカ	919,842,451	0.49	
	小計	185,390,944,821	98.95
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,976,501,385	1.05
合計（純資産総額）		187,367,446,206	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		85,135,174	0.05

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,000,000	16,998.33	2,039,800,219	16,556.21	1,986,746,100	8.000	2021/11/15	1.06
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	14,250,000	13,404.93	1,910,202,753	13,348.73	1,902,194,648	3.625	2021/2/15	1.02
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,300,000	13,368.57	1,778,020,821	13,244.59	1,761,531,176	3.625	2020/2/15	0.94
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,000,000	13,199.15	1,715,889,866	13,089.33	1,701,613,347	3.375	2019/11/15	0.91
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	15,875.52	1,428,797,404	15,310.33	1,377,930,206	8.125	2019/8/15	0.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,950,000	16,857.27	1,340,153,288	16,293.97	1,295,371,124	8.750	2020/8/15	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,700,000	13,850.49	1,343,498,045	13,135.72	1,274,165,097	7.500	2016/11/15	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,500,000	13,305.56	1,264,028,580	13,204.83	1,254,459,147	3.500	2020/5/15	0.67
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,400,000	13,301.92	1,250,381,288	13,133.82	1,234,579,946	3.750	2018/11/15	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,250,000	13,242.70	1,224,949,922	12,820.46	1,185,893,040	4.625	2017/2/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,850,000	13,394.02	1,185,371,248	13,175.48	1,166,030,409	4.000	2018/8/15	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,300,000	12,308.25	1,144,667,491	12,382.13	1,151,538,510	2.000	2020/7/31	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,800,000	13,298.55	1,170,273,129	12,904.72	1,135,615,649	4.500	2017/5/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	12,819.51	1,153,756,673	12,551.59	1,129,643,747	3.125	2017/1/31	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,300,000	11,999.66	1,115,968,393	12,131.25	1,128,206,627	2.000	2023/2/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,600,000	13,444.35	1,156,214,355	13,059.03	1,123,077,306	4.750	2017/8/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,150,000	12,199.19	1,116,225,940	12,241.07	1,120,058,219	1.500	2018/12/31	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,800,000	12,885.78	1,133,949,424	12,624.49	1,110,955,519	3.250	2017/3/31	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,800,000	12,765.55	1,123,368,895	12,554.43	1,104,790,486	2.750	2017/5/31	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	14,596.50	1,167,720,775	13,790.85	1,103,268,163	8.750	2017/5/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,700,000	12,831.82	1,116,368,856	12,554.43	1,092,236,048	3.250	2016/12/31	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,500,000	12,589.39	1,070,098,167	12,534.55	1,065,437,281	2.250	2018/7/31	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,950,000	13,095.92	1,041,125,847	12,874.42	1,023,517,048	3.500	2018/2/15	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,300,000	12,273.95	1,018,738,569	12,296.92	1,020,645,176	1.750	2019/9/30	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,500,000	11,724.16	996,554,025	11,874.69	1,009,348,928	1.750	2023/5/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,550,000	13,293.82	1,003,683,763	13,052.41	985,457,061	3.875	2018/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,400,000	12,802.66	947,397,358	12,662.36	937,014,882	2.750	2018/2/28	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,800,000	13,346.76	907,580,034	13,030.63	886,083,308	4.250	2017/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	12,864.01	900,481,006	12,612.18	882,853,103	3.125	2017/4/30	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	12,644.37	885,106,294	12,572.42	880,069,750	2.375	2018/6/30	0.47

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.95
合計	98.95

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	米ドル	買建	311,000.00	37,677,650	37,683,870	0.02
	ユーロ	買建	348,778.42	47,430,377	47,451,304	0.03

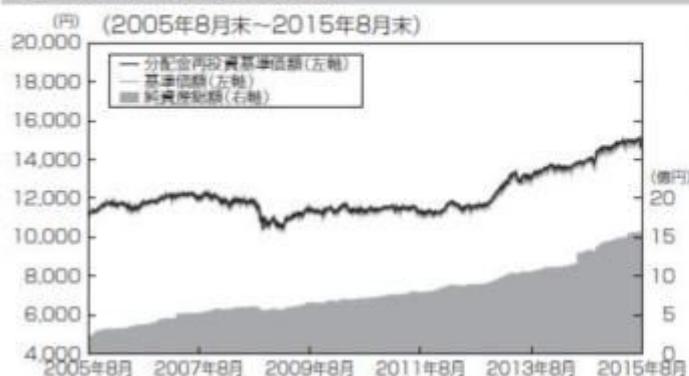
(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 参考情報

# 運用実績

2015年8月31日現在

## 基準価額・純資産の推移



基準価額……………14,697円  
純資産総額……………15.46億円

※基準価額は、運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。  
※分配金再投資基準価額は、2005年8月末の基準価額を起点として指数化しています。  
※分配金再投資基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものである点にご留意ください。

## 分配の推移(税引前、1万口当たり)

2010年11月	2011年11月	2012年11月	2013年11月	2014年11月	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	90円

## 主要な資産の状況

## &lt;資産構成比率&gt;

組入資産	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	15.56%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	5.04%
日本債券インデックスマザーファンド	64.63%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	9.80%
現金その他	4.97%

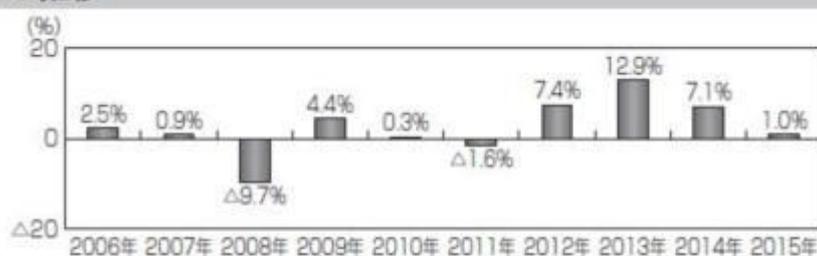
\*当ファンドの対純資産総額比です。

## &lt;組入上位銘柄&gt;

組入資産	銘柄	業種	比率	
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	1 トヨタ自動車	輸送用機器	4.36%	
	2 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.79%	
	3 三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.63%	
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	2.20%	
	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1.14%	
	3 EXXON MOBIL CORP	エネルギー	1.05%	
組入資産	銘柄	種類	償還期限	比率
日本債券インデックス マザーファンド	1 第299回利付国債(10年)	国債証券	2019/3/20	2.26%
	2 第107回利付国債(5年)	国債証券	2017/12/20	2.04%
	3 第303回利付国債(10年)	国債証券	2019/9/20	1.76%
海外債券インデックス (ヘッジなし)マザーファンド	1 US TREASURY N/B (クーポン8.000%)	国債証券	2021/11/15	1.06%
	2 US TREASURY N/B (クーポン3.625%)	国債証券	2021/2/15	1.02%
	3 US TREASURY N/B (クーポン3.625%)	国債証券	2020/2/15	0.94%

\*各マザーファンドの対純資産総額比です。

## 年間収益率の推移



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

\*当ファンドにはベンチマークはありません。

\*2015年は、2015年8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2【管理及び運営】

## 2【換金(解約)手続等】

<訂正前>

## (4) 解約価額

<解約請求受付日が平成27年8月17日以前の場合>

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額(当該基準価額に0.15%の率を乗じて得た

額)を控除した価額とします。

< 解約請求受付日が平成27年8月18日以降の場合 >

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 訂正後 >

(4) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

## 第3【ファンドの経理状況】

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2015年 8月31日現在です。

## 【DCインデックスバランス（株式20）】

## 【純資産額計算書】

資産総額	1,553,401,326円
負債総額	7,082,573円
純資産総額（ - ）	1,546,318,753円
発行済口数	1,052,158,928口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4697円

（参考）

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	27,890,365,344円
負債総額	41,301,540円
純資産総額（ - ）	27,849,063,804円
発行済口数	21,569,908,721口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2911円

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	77,074,647,595円
負債総額	90,288,841円
純資産総額（ - ）	76,984,358,754円
発行済口数	39,221,157,057口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9628円

日本債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	34,814,837,432円
負債総額	64,443,377円
純資産総額（ - ）	34,750,394,055円
発行済口数	26,125,113,159口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3302円

## 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	187,547,447,780円
負債総額	180,001,574円
純資産総額（ - ）	187,367,446,206円
発行済口数	80,163,945,539口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3373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27年8月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

###### (2) 会社の意思決定機関（平成27年8月末現在）

###### ・株主総会

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

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

###### ・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。

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

###### ・監査役会

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

###### (3) 運用の意思決定プロセス（平成27年8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27年8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	587	114,888
株式投資信託	531	89,119
単位型	99	3,003
追加型	432	86,116
公社債投資信託	56	25,769
単位型	40	392
追加型	16	25,376
投資法人合計	1	11

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

<更新後>

#### (2) 販売会社

名 称	資本金の額 (平成27年3月末現在)	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社 S B I 証券	47,937百万円	
損保ジャパン日本興亜 D C 証券株式会社	3,000百万円	
株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	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。
日本生命保険相互会社	200,000百万円 (基金の総額)	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
東京海上日動火災保険株式会社	101,994百万円	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

### 3【資本関係】

<更新後>

#### (2) 販売会社

三井住友信託銀行株式会社は、日興アセットマネジメント株式会社の発行済株式総数の91.29%を保有しております。（平成27年3月末現在）