

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成30年2月6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】	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。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

DCインデックスバランス（株式20）（以下「ファンド」といいます。）

当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。取得申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて取得の申込みを行なう資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関に限るものとします。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （６）【申込単位】

1円以上1円単位

### （７）【申込期間】

平成30年2月7日から平成31年2月6日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

### （８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

**（ 9 ） 【 払込期日 】**

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

**（ 1 0 ） 【 払込取扱場所 】**

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

**（ 1 1 ） 【 振替機関に関する事項 】**

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

**（ 1 2 ） 【 その他 】**

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

4つの異なる資産に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざします。

ファンドの基本的性格

## 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

## 2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

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

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

年1回

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

グローバル(含む日本)

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジなし

目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないものをいいます。

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

# 1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。

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。

## <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、FTSE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。

- ※**TOPIX(東証株価指数)**: TOPIXの指数値およびTOPIXの高標は、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の高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。
- ※**FTSE世界国債インデックス(除く日本)**: 当指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。当指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

### 3. 株式に20%、債券などに80%投資します。

資産の標準実質組入比率は、株式20%、債券など80%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	15%
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%
日本債券インデックスマザーファンド	65%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	10%
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。

※当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。

購入申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて購入の申込みを行なう資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関に限るものとします。



#### 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30%以下とします。
- ・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。

#### 信託金限度額

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

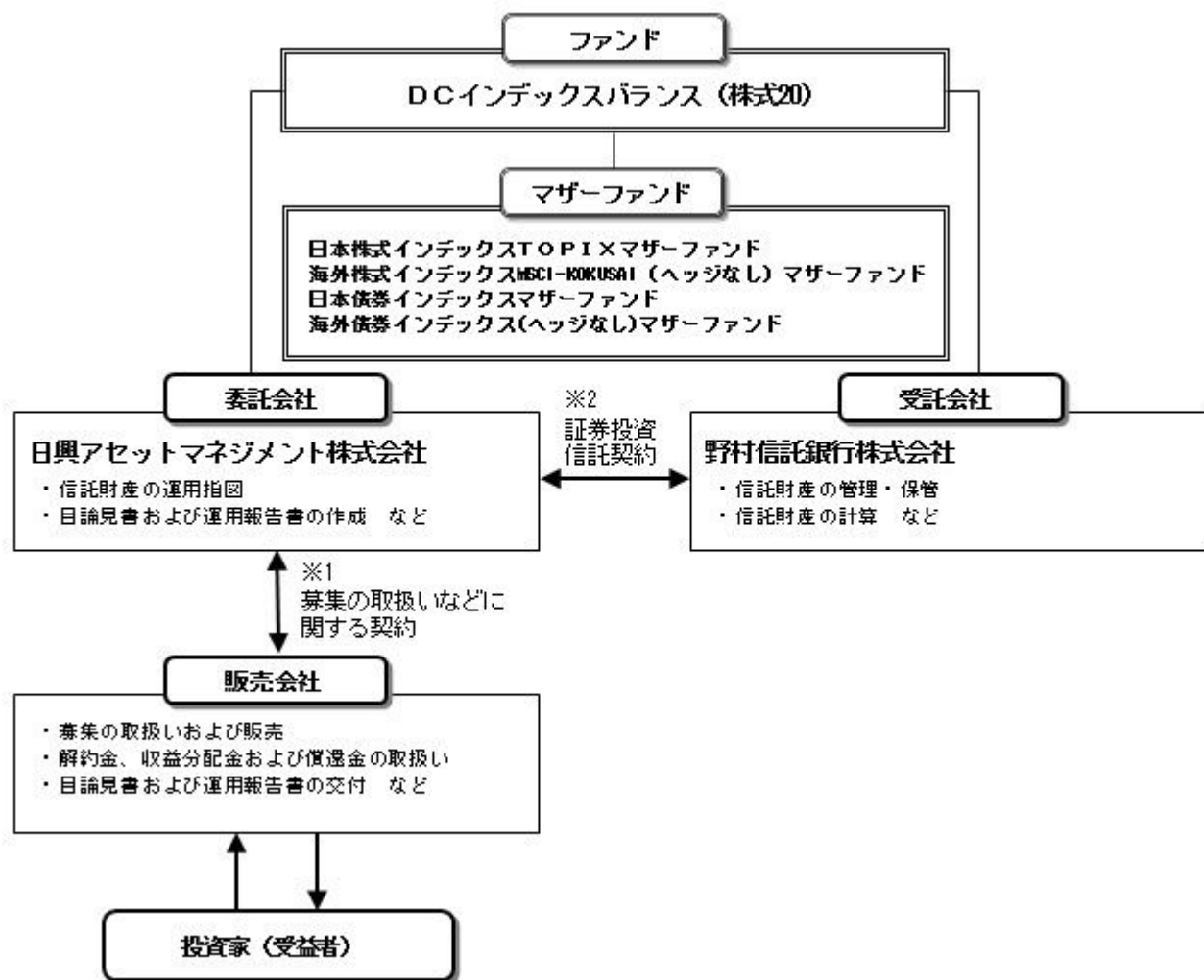
#### (2) 【ファンドの沿革】

平成14年12月10日

- ・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

## ファンドの仕組み



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

## 委託会社の概況（平成29年11月末現在）

- 1) 資本金  
17,363百万円
- 2) 沿革  
昭和34年：日興証券投資信託委託株式会社として設立  
平成11年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更
- 3) 大株主の状況

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

## 2 【投資方針】

## (1) 【投資方針】



- ・主として、以下に掲げる各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長をめざします。
  - 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
  - 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド」
  - 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
  - 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」
- ・純資産総額に対する株式ならびに公社債および短期金融資産の実質組入比率については、次の標準実質組入比率を目処として投資を行ないます。
  - 株式の標準実質組入比率.....20%
  - 公社債および短期金融資産の標準実質組入比率.....80%
- ・組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンド受益証券への投資比率を調整することで行ないますが、市況動向などによっては内外の有価証券などへの直接投資を行なうことがあります。
- ・また、資金動向などによっては組入比率を引き下げることもあります。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

## (2)【投資対象】

### < DCインデックスバランス(株式20) >

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

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

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」受益証券
- 2) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド」受益証券
- 3) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券
- 4) 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」受益証券
- 5) 株券または新株引受権証書
- 6) 国債証券
- 7) 地方債証券
- 8) 特別の法律により法人の発行する債券
- 9) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 10) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 11) コマーシャル・ペーパー
- 12) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
- 13) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、5)~12)の証券または証書の性質を有するもの
- 14) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。)
- 15) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下

同じ。)で16)に定めるもの以外のもの

- 16) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
- 17) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 18) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りま。
- 19) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 20) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 21) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りま。
- 22) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 23) 外国の者に対する権利で22)の有価証券の性質を有するもの  
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
  - 1) 預金
  - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
  - 3) コール・ローン
  - 4) 手形割引市場において売買される手形
  - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの  
次の取引ができます。
    - 1) 信用取引
    - 2) 先物取引等
    - 3) スワップ取引
    - 4) 金利先渡取引
    - 5) 為替先渡取引
    - 6) 有価証券の貸付
    - 7) 公社債の空売
    - 8) 公社債の借入
    - 9) 外国為替予約取引
    - 10) 資金の借入

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限りま。
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

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

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

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

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券

- 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)～7)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 11) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で12)に定めるもの以外のもの
- 12) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
- 13) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 14) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- 15) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 17) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの  
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの  
次の取引ができます。
- 1) 信用取引
- 2) 先物取引等
- 3) スワップ取引
- 4) 金利先渡取引
- 5) 為替先渡取引
- 6) 有価証券の貸付
- 7) 公社債の空売
- 8) 公社債の借入
- 9) 外国為替予約取引
- <日本債券インデックスマザーファンド>  
わが国の公社債を主要投資対象とします。  
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限ります。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形
- 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付

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

- 5) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、1)~6)の証券の性質を有するもの
- 8) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)で投資法人債券に類する証券
- 9) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 10) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

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

#### <海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)に限ります。)
- 5) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)~6)の証券の性質を有するもの

- 8) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)で投資法人債券に類する証券
- 9) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 11) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの  
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
- 1) 預金
  - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
  - 3) コール・ローン
  - 4) 手形割引市場において売買される手形
  - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの  
次の取引ができます。
    - 1) 先物取引等
    - 2) スワップ取引
    - 3) 金利先渡取引
    - 4) 為替先渡取引
    - 5) 有価証券の貸付
    - 6) 公社債の空売
    - 7) 公社債の借入
    - 8) 外国為替予約取引

#### 投資対象とするマザーファンドの概要

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX(東証株価指数)*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。</li> <li>・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとし、</li> <li>・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。

### ファンドに係る費用

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

### その他

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

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

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

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

#### 運用の基本方針

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

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカン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います。</li> <li>・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行いません。</li> <li>・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。

#### ファンドに係る費用

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

#### その他

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

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

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

#### <日本債券インデックスマザーファンド>

#### 運用の基本方針



基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、NOMURA-BPI総合 <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>主としてわが国の公社債に投資し、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。</li> <li>運用の効率化をはかるため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式への投資は行ないません。</li> <li>外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。

#### ファンドに係る費用

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.1%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

#### その他

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

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

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

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

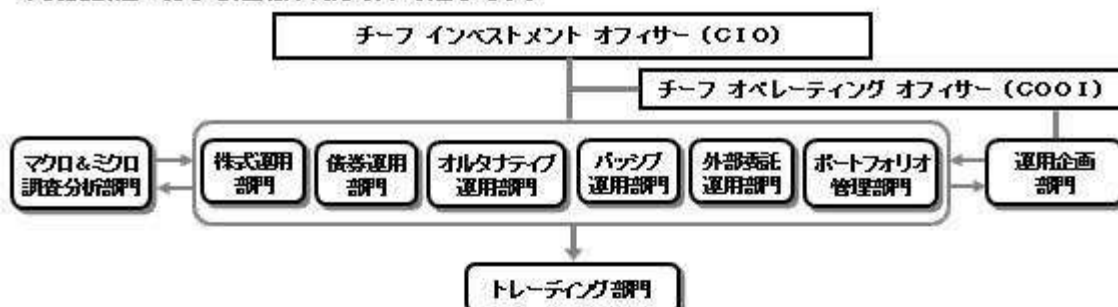
#### 運用の基本方針

基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。</li> <li>・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への投資は行ないません。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
<b>その他</b>	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成10年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

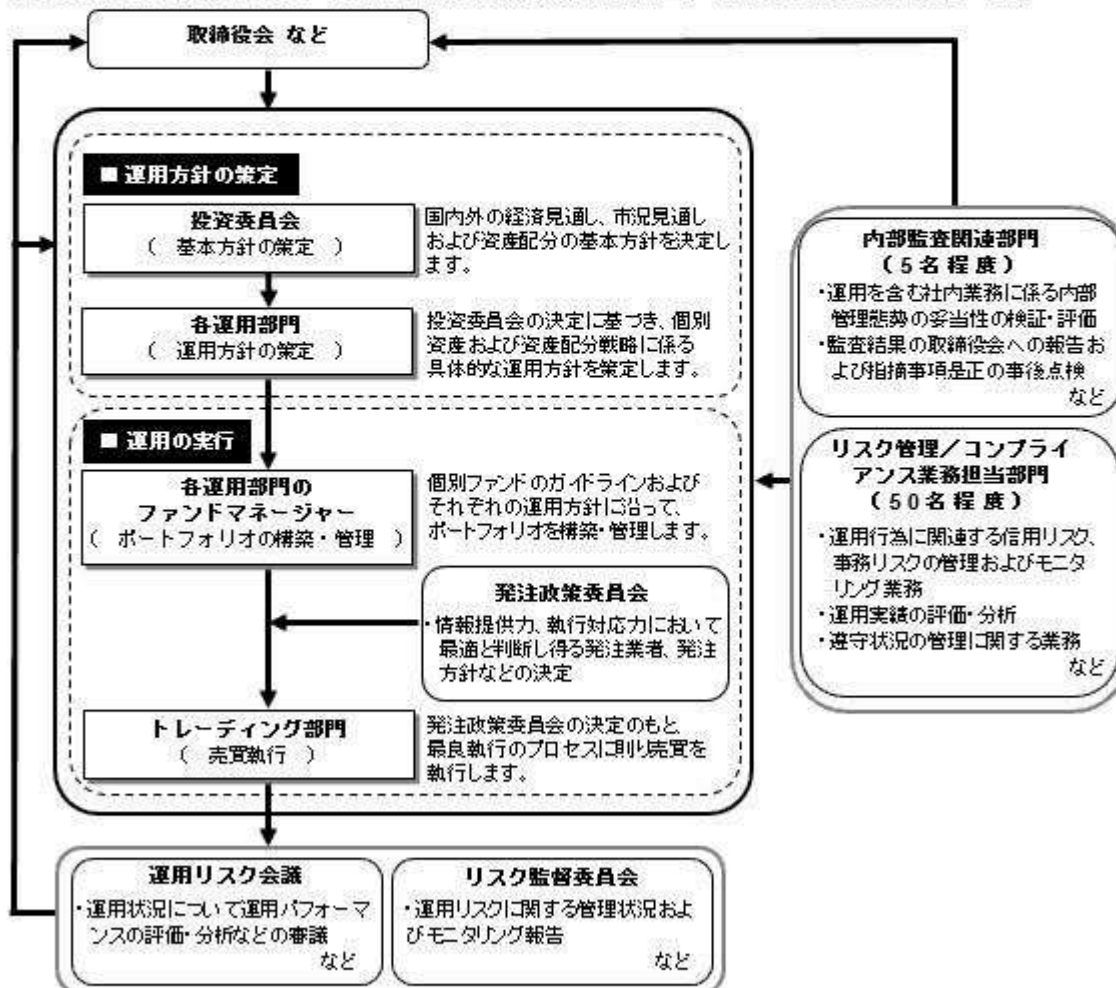
\* FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権などの知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

### （3）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



#### 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

上記体制は平成29年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### (4) 【分配方針】

##### 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

- 1) 分配対象額の範囲  
経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。
- 2) 分配対象額についての分配方針  
分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。
- 3) 留保益の運用方針  
収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用

を行いません。

収益分配金の支払い

原則として、収益分配金は無手数料で自動的に再投資されます。

#### （５）【投資制限】

約款に定める投資制限

< DCインデックスバランス（株式20） >

- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の30%以下とします。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。
- 4) 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。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
  - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額

を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

- 15) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て(解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
    - イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
    - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
    - ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
    - ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
    - ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。
  - 16) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
  - 17) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
- <日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>
- 1) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には、制限を設けません。
  - 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。)されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
  - 3) 外貨建資産への投資は行ないません。
  - 4) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
  - 5) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
  - 6) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
  - 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
  - 8) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについ

てはこの限りではありません。

- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
  - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 13) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

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

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

社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 15) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 16) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<日本債券インデックスマザーファンド>

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 3) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 4) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 7) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 10) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 11) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこ

とします。

<海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 3) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 4) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期間が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 13) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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



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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 価格変動リスク

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

#### 流動性リスク

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

#### 信用リスク

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

#### 為替変動リスク

外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。

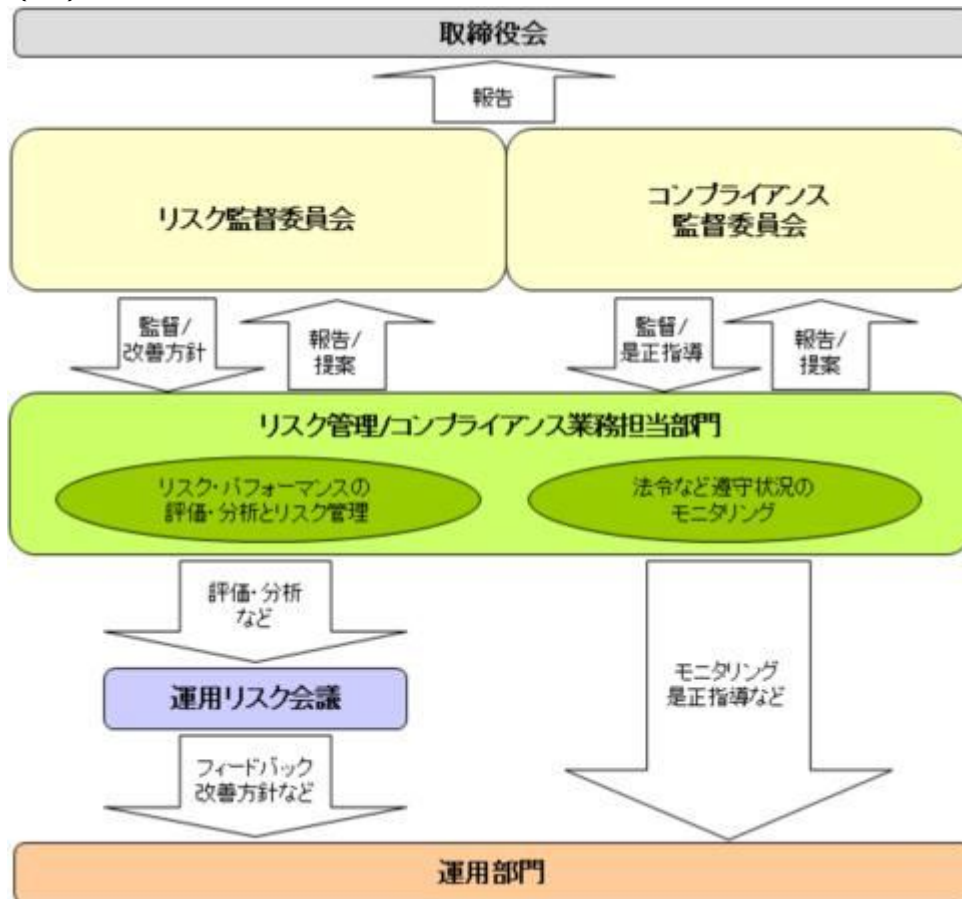
#### <その他の留意事項>

- ・ システムリスク・市場リスクなどに関する事項  
証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由により基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。
- ・ 投資対象とする投資信託証券に関する事項  
ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴う資金流入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場

合があります。

- ・ 解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項  
一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。
- ・ 基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項  
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。
- ・ 運用制限や規制上の制限に関する事項  
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。
- ・ 法令・税制・会計方針などの変更に関する事項  
ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

## (2) リスク管理体制



### 全社的なリスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理/コンプライアンス業務担当部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況についてはコンプライアンス部門が事務局を務めるコンプライアンス監督委員会、リスク管理状況についてはリスク管理部門が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。両委員会およびそれに関連する部門別会議においては、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

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。

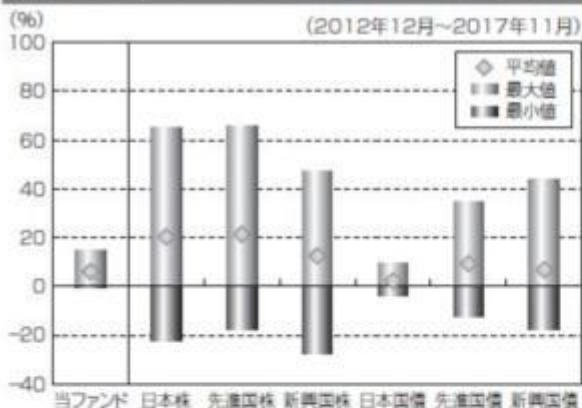
### 法令など遵守状況のモニタリング

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11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## (参考情報)

### 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	6.0%	20.3%	21.4%	12.5%	2.3%	9.3%	6.8%
最大値	14.8%	65.0%	65.7%	47.4%	9.3%	34.9%	43.7%
最小値	-0.6%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2012年12月から2017年11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)

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債……JPモルガンGBI-EMグローバルレディバースファイド(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。

#### FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

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

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

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

### 4【手数料等及び税金】

#### (1)【申込手数料】

ありません。

#### (2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

#### (3)【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.1836%（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。

#### （４）【その他の手数料等】

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

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

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

<投資対象とするマザーファンドに係る費用>

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

#### （５）【課税上の取扱い】

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

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。

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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購

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

#### 法人受益者の場合

##### 1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

##### 2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

#### 個別元本

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

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

#### 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

##### 2) 受益者が収益分配金を受け取る際

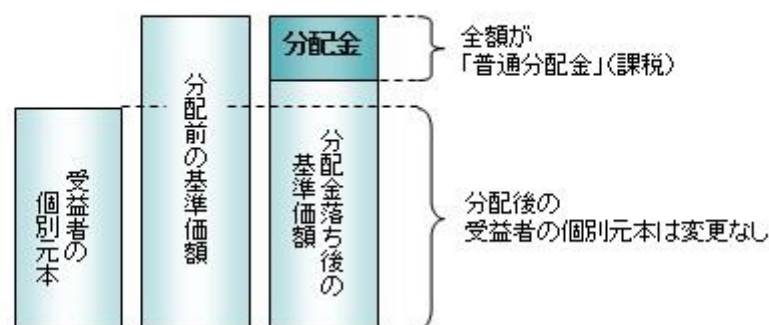
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

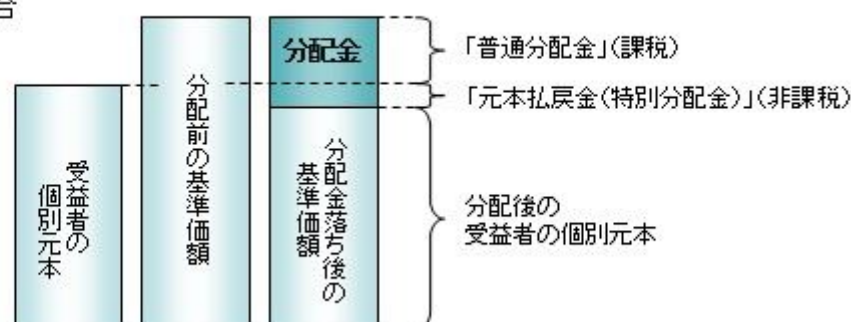
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

#### <分配金に関するイメージ図>

##### イ) の場合



##### ロ)、ハ) の場合



上記は平成30年 2月 6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2017年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### (1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,685,181,867	95.02
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		140,791,312	4.98
合計(純資産総額)		2,825,973,179	100.00

#### (2)【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	1,319,858,554	1.3886	1,832,872,905	1.3879	1,831,831,687	64.82
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	269,499,104	1.5848	427,123,959	1.5854	427,263,879	15.12
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	123,314,808	2.3172	285,754,578	2.2953	283,044,478	10.02
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	59,940,422	2.4065	144,247,620	2.3864	143,041,823	5.06

##### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.02
合計	95.02

##### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

##### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## ( 3 ) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第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
第13計算期間末 (2015年11月 6日)	1,596	1,597	1.4811	1.4821
第14計算期間末 (2016年11月 7日)	1,897	1,898	1.4739	1.4749
第15計算期間末 (2017年11月 6日)	2,786	2,788	1.5734	1.5744
2016年11月末日	2,009		1.4996	
12月末日	2,087		1.5115	
2017年 1月末日	2,163		1.5025	
2月末日	2,180		1.5082	
3月末日	2,245		1.5062	
4月末日	2,309		1.5156	
5月末日	2,371		1.5228	
6月末日	2,511		1.5304	
7月末日	2,543		1.5319	
8月末日	2,614		1.5387	
9月末日	2,690		1.5504	
10月末日	2,765		1.5647	
11月末日	2,825		1.5703	

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
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



第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	0.0010
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	0.0010
第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	0.0010

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
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
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	4.31
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	0.42
第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	6.82

(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	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
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	268,579,632	160,353,535
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	366,937,574	157,154,931
第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	810,944,162	327,224,124

（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11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	28,742,966,090	98.92
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		315,104,881	1.08
合計（純資産総額）		29,058,070,971	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	287,520,000	0.99

(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	136,600	7,032.66	960,661,356	7,044.00	962,210,400	3.31
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	782,900	769.70	602,598,130	792.10	620,135,090	2.13
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	49,900	10,158.48	506,908,152	9,485.00	473,301,500	1.63
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	79,100	5,370.00	424,767,000	5,879.00	465,028,900	1.60
日本	株式	ソニー	電気機器	75,000	4,270.00	320,250,000	5,201.00	390,075,000	1.34
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	83,900	4,520.00	379,228,000	4,547.00	381,493,300	1.31
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	101,100	3,508.50	354,709,350	3,744.00	378,518,400	1.30
日本	株式	キーエンス	電気機器	5,500	61,965.53	340,810,415	64,910.00	357,005,000	1.23
日本	株式	KDDI	情報・通信業	99,300	3,020.00	299,886,000	3,215.00	319,249,500	1.10
日本	株式	任天堂	その他製品	6,900	42,417.64	292,681,716	45,200.00	311,880,000	1.07
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,505,500	204.93	308,522,115	203.90	306,971,450	1.06
日本	株式	ファナック	電気機器	10,700	25,075.00	268,302,500	27,945.00	299,011,500	1.03
日本	株式	キヤノン	電気機器	60,500	4,178.73	252,813,165	4,298.00	260,029,000	0.89
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	69,800	3,799.76	265,223,248	3,720.00	259,656,000	0.89
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	41,400	6,328.00	261,979,200	6,184.00	256,017,600	0.88
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	81,600	2,701.69	220,457,904	2,907.50	237,252,000	0.82
日本	株式	信越化学工業	化学	19,600	11,320.00	221,872,000	11,765.00	230,594,000	0.79
日本	株式	日立製作所	電気機器	270,000	863.19	233,061,300	834.20	225,234,000	0.78
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	20,200	10,875.00	219,675,000	10,865.00	219,473,000	0.76

日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	82,800	2,743.75	227,182,500	2,647.00	219,171,600	0.75
日本	株式	三菱商事	卸売業	77,700	2,665.00	207,070,500	2,813.00	218,570,100	0.75
日本	株式	パナソニック	電気機器	128,400	1,710.51	219,629,484	1,668.00	214,171,200	0.74
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	46,400	4,556.01	211,398,864	4,605.00	213,672,000	0.74
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	10,100	20,613.24	208,193,800	20,775.00	209,827,500	0.72
日本	株式	三菱電機	電気機器	112,400	1,952.50	219,461,000	1,852.50	208,221,000	0.72
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	41,700	4,871.00	203,120,700	4,960.00	206,832,000	0.71
日本	株式	日本電産	電気機器	13,500	14,590.00	196,965,000	15,270.00	206,145,000	0.71
日本	株式	花王	化学	27,600	7,130.52	196,802,352	7,438.00	205,288,800	0.71
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	39,700	5,433.97	215,728,609	5,095.00	202,271,500	0.70
日本	株式	ダイキン工業	機械	15,300	12,524.62	191,626,686	12,920.00	197,676,000	0.68

#### 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	0.10
		鉱業	0.31
		建設業	3.28
		食料品	4.44
		繊維製品	0.68
		パルプ・紙	0.26
		化学	7.21
		医薬品	4.33
		石油・石炭製品	0.63
		ゴム製品	0.95
		ガラス・土石製品	1.01
		鉄鋼	1.15
		非鉄金属	0.96
		金属製品	0.70
		機械	5.42
		電気機器	13.79
		輸送用機器	8.67
		精密機器	1.59
		その他製品	2.12
		電気・ガス業	1.57
		陸運業	3.92
		海運業	0.23
		空運業	0.60
倉庫・運輸関連業	0.20		
情報・通信業	7.71		
卸売業	4.43		
小売業	4.61		
銀行業	7.21		

	証券、商品先物取引業	0.98
	保険業	2.23
	その他金融業	1.21
	不動産業	2.25
	サービス業	4.17
合 計		98.92

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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 12月	2017年 買建	16	日本円	284,833,640	287,520,000	0.99

(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11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
出資金	アメリカ	4,465,284	0.01
株式	アメリカ	49,886,359,138	59.80
	カナダ	3,186,203,991	3.82
	モーリシャス	4,109,586	0.00
	ドイツ	3,287,308,823	3.94
	イタリア	659,055,198	0.79
	フランス	3,232,098,634	3.87
	オランダ	1,580,845,838	1.90
	スペイン	1,139,009,427	1.37
	ベルギー	384,234,183	0.46
	オーストリア	91,585,062	0.11
	ルクセンブルク	102,906,999	0.12
	フィンランド	315,392,836	0.38
	アイルランド	1,199,428,768	1.44
	ポルトガル	52,284,210	0.06
	イギリス	5,508,978,333	6.60
スイス	3,014,191,843	3.61	

	スウェーデン	914,114,450	1.10
	ノルウェー	223,523,975	0.27
	デンマーク	598,693,671	0.72
	ケイマン	223,033,523	0.27
	オーストラリア	2,047,424,384	2.45
	バミューダ	223,055,017	0.27
	ニュージーランド	51,240,660	0.06
	香港	886,438,084	1.06
	シンガポール	674,902,071	0.81
	イスラエル	142,637,043	0.17
	ジャージー	406,807,625	0.49
	英ヴァージン諸島	23,198,216	0.03
	小計	80,059,061,588	95.98
投資証券	アメリカ	1,620,657,821	1.94
	カナダ	11,594,752	0.01
	フランス	113,677,619	0.14
	イギリス	74,236,969	0.09
	オーストラリア	222,301,349	0.27
	香港	48,457,080	0.06
	シンガポール	34,302,015	0.04
	小計	2,125,227,605	2.55
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,226,319,536	1.47
合計（純資産総額）		83,415,074,013	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	955,962,978	1.15
	買建	ドイツ	274,172,964	0.33

(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		924,948,500	1.11

(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	105,972	17,525.74	1,857,237,772	18,990.23	2,012,433,077	2.41
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	149,264	8,810.49	1,315,089,203	9,338.24	1,393,864,100	1.67
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	8,255	109,014.56	899,915,238	130,120.30	1,074,143,105	1.29
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	48,020	19,115.72	917,937,354	19,623.31	942,311,658	1.13
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	54,841	15,951.43	874,792,812	15,665.71	859,123,230	1.03
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	72,160	11,319.29	816,800,038	11,622.94	838,711,819	1.01
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	86,131	9,319.19	802,671,886	9,218.35	793,986,005	0.95
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	6,342	109,061.62	691,668,835	114,477.00	726,013,153	0.87
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	6,040	111,093.09	671,002,282	116,238.42	702,080,111	0.84
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	202,039	3,095.94	625,500,925	3,168.77	640,215,930	0.77
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	96,380	6,190.76	596,665,690	6,350.99	612,108,802	0.73
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	63,183	9,282.83	586,517,459	9,669.85	610,970,670	0.73
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	25,320	21,144.95	535,390,273	21,272.69	538,624,574	0.65
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	52,049	9,732.66	506,575,376	10,015.02	521,272,244	0.62
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	125,227	3,752.55	469,921,143	4,087.58	511,875,882	0.61
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	38,461	13,271.20	510,423,700	13,130.01	504,993,661	0.61
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	121,390	4,051.72	491,839,262	4,057.33	492,519,349	0.59
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	19,640	23,257.09	456,769,405	24,973.70	490,483,547	0.59
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	24,320	18,608.14	452,550,050	19,860.86	483,016,176	0.58
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	95,962	4,569.39	438,488,667	4,924.59	472,574,225	0.57
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	55,897	8,249.12	461,101,116	8,408.23	469,994,944	0.56
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	83,217	5,450.11	453,541,970	5,591.29	465,290,796	0.56
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	37,622	12,268.35	461,560,033	12,309.81	463,119,785	0.56
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	406,321	1,115.29	453,169,107	1,117.25	453,963,177	0.54
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	45,243	9,163.31	414,575,861	9,527.57	431,055,895	0.52
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	101,650	3,843.31	390,672,970	4,199.63	426,892,796	0.51

アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	82,512	5,159.90	425,753,875	5,098.27	420,668,867	0.50
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	14,288	26,055.68	372,283,656	28,207.07	403,022,673	0.48
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア	96,244	4,126.80	397,179,884	4,167.13	401,062,174	0.48
アメリカ	株式	DOWDUPONT INC	素材	47,417	7,965.63	377,706,491	8,042.94	381,372,513	0.46

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
出資金			0.01
株式	国外	エネルギー	6.55
		素材	4.89
		資本財	7.36
		商業・専門サービス	0.97
		運輸	2.03
		自動車・自動車部品	1.55
		耐久消費財・アパレル	1.78
		消費者サービス	1.84
		メディア	2.22
		小売	3.92
		食品・生活必需品小売り	1.72
		食品・飲料・タバコ	5.30
		家庭用品・パーソナル用品	2.04
		ヘルスケア機器・サービス	4.17
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.10
		銀行	9.56
		各種金融	4.51
		保険	4.22
		不動産	0.57
		ソフトウェア・サービス	10.09
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.05		
電気通信サービス	2.47		
公益事業	3.18		
半導体・半導体製造装置	2.90		
投資証券			2.55
合計			98.53

### 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 EMINI1712	買建	65	米ドル	8,370,812.5	937,949,540	8,531,575	955,962,978	1.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1712	買建	65	ユーロ	2,052,490	272,591,197	2,064,400	274,172,964	0.33

(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	6,550,000.00	733,811,920	732,309,500	0.88
	ユーロ	買建	1,450,000.00	192,596,710	192,639,000	0.23

(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11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	28,940,187,056	78.15
地方債証券	日本	2,808,542,715	7.58
特殊債券	日本	3,513,386,810	9.49
社債券	日本	1,343,756,000	3.63
	オーストラリア	300,911,000	0.81
	小計	1,644,667,000	4.44
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		123,656,311	0.33
合計(純資産総額)		37,030,439,892	100.00

### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	1,090,000,000	102.40	1,116,184,200	102.66	1,118,994,000	0.300	2025/12/20	3.02
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	610,000,000	100.63	613,903,400	100.85	615,233,800	0.100	2026/12/20	1.66



日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	581,000,000	102.94	598,127,880	102.78	597,204,090	1.400	2019/9/20	1.61
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	560,000,000	100.60	563,404,800	100.61	563,427,200	0.100	2020/6/20	1.52
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	490,000,000	103.65	507,929,100	103.92	509,237,400	0.500	2024/9/20	1.38
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	505,000,000	100.56	507,838,100	100.56	507,843,150	0.100	2020/3/20	1.37
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	490,000,000	100.51	492,518,600	100.78	493,861,200	0.100	2027/3/20	1.33
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	473,000,000	103.10	487,667,730	102.96	487,010,260	1.300	2019/12/20	1.32
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	420,000,000	103.15	433,255,200	103.44	434,448,000	0.400	2025/9/20	1.17
日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	410,000,000	102.02	418,286,100	101.87	417,683,400	1.300	2019/3/20	1.13
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	340,000,000	120.12	408,428,400	120.42	409,458,600	1.700	2032/9/20	1.11
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	370,000,000	104.79	387,730,400	104.72	387,482,500	1.300	2021/3/20	1.05
日本	国債証券	第29回利付国債(30年)	276,000,000	134.28	370,629,360	135.02	372,669,000	2.400	2038/9/20	1.01
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	300,000,000	119.66	358,983,000	119.74	359,247,000	2.300	2026/6/20	0.97
日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	290,000,000	122.85	356,267,900	123.02	356,778,300	2.100	2029/9/20	0.96
日本	国債証券	第120回利付国債(5年)	330,000,000	100.67	332,220,900	100.62	332,075,700	0.200	2019/9/20	0.90
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	325,000,000	100.65	327,119,000	100.68	327,232,750	0.100	2020/9/20	0.88
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	310,000,000	103.10	319,628,600	103.40	320,558,600	0.400	2025/3/20	0.87
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	295,000,000	107.61	317,449,500	107.63	317,511,450	1.400	2022/12/20	0.86
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	300,000,000	103.13	309,402,000	103.40	310,218,000	0.400	2025/6/20	0.84
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	300,000,000	100.51	301,545,000	100.50	301,506,000	0.100	2019/12/20	0.81
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	250,000,000	120.12	300,317,500	120.22	300,567,500	2.300	2026/9/20	0.81
日本	特殊債券	第45回日本学生支援債券	300,000,000	99.99	299,970,810	99.99	299,970,810	0.001	2018/11/20	0.81
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	208,000,000	131.56	273,655,200	132.00	274,560,000	2.400	2034/3/20	0.74
日本	国債証券	第34回利付国債(30年)	200,000,000	131.73	263,466,000	132.69	265,390,000	2.200	2041/3/20	0.72
日本	国債証券	第149回利付国債(20年)	215,000,000	117.34	252,287,450	117.79	253,265,700	1.500	2034/6/20	0.68
日本	国債証券	第50回利付国債(20年)	237,000,000	106.82	253,172,880	106.73	252,966,690	1.900	2021/3/22	0.68
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	230,000,000	104.89	241,258,500	104.98	241,467,800	0.800	2023/6/20	0.65
日本	国債証券	第137回利付国債(20年)	200,000,000	119.96	239,936,000	120.26	240,524,000	1.700	2032/6/20	0.65
日本	国債証券	第43回利付国債(30年)	195,000,000	121.76	237,447,600	122.65	239,183,100	1.700	2044/6/20	0.65

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	78.15

地方債証券	7.58
特殊債券	9.49
社債券	4.44
合 計	99.67

#### 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11月30日現在です。

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

#### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	67,141,967,595	42.74
	カナダ	3,321,360,476	2.11
	メキシコ	1,332,441,029	0.85
	ドイツ	11,277,350,997	7.18
	イタリア	15,489,964,458	9.86
	フランス	16,080,261,117	10.24
	オランダ	3,456,367,674	2.20
	スペイン	9,114,392,727	5.80
	ベルギー	4,023,598,479	2.56
	オーストリア	2,453,616,312	1.56
	フィンランド	964,492,906	0.61
	アイルランド	1,242,818,846	0.79
	イギリス	10,865,324,158	6.92
	スイス	278,546,346	0.18
	スウェーデン	731,546,542	0.47
	ノルウェー	451,077,782	0.29
	デンマーク	1,036,699,072	0.66
	ポーランド	979,196,572	0.62
	オーストラリア	3,302,897,205	2.10
	シンガポール	596,314,484	0.38
マレーシア	693,722,781	0.44	
南アフリカ	811,692,530	0.52	

	小計	155,645,650,088	99.08
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,442,294,397	0.92
合計（純資産総額）		157,087,944,485	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	13,869.68	1,593,626,630	13,773.61	1,582,587,995	8.000	2021/11/15	1.01
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,530,000	11,602.86	1,221,781,910	11,552.31	1,216,458,262	3.375	2019/11/15	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,700,000	11,116.58	1,078,308,390	11,104.98	1,077,183,464	1.875	2022/7/31	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	11,040.86	993,678,224	11,019.42	991,748,051	0.750	2019/8/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,070,000	11,705.94	944,669,514	11,652.32	940,342,709	3.625	2020/2/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,830,000	11,714.91	917,278,012	11,660.42	913,011,452	3.500	2020/5/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,140,000	11,205.00	912,087,000	11,183.99	910,376,837	1.500	2018/12/31	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,150,000	10,972.58	894,265,750	10,976.95	894,621,901	1.750	2023/5/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,450,000	11,237.39	837,185,827	11,203.25	834,642,275	1.750	2019/9/30	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,900,000	11,345.06	782,809,312	11,315.73	780,785,992	2.250	2021/7/31	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,610,000	13,370.06	750,060,574	13,262.82	744,044,239	8.750	2020/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,050,000	11,300.42	683,675,518	11,269.33	681,795,016	2.125	2021/6/30	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,650,000	11,611.74	656,063,395	11,885.61	671,537,197	3.125	2044/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,930,000	11,174.80	662,665,790	11,194.93	663,859,818	2.250	2024/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,940,000	11,108.92	659,870,342	11,147.00	662,131,973	2.250	2025/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,120,000	12,644.58	647,402,741	12,916.38	661,318,885	3.625	2043/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	11,376.79	659,854,114	11,379.41	660,006,188	2.500	2024/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	11,107.18	644,216,460	11,363.44	659,080,094	2.875	2043/5/15	0.42
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,930,000	16,635.63	653,780,436	16,675.65	655,353,051	4.250	2023/10/25	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	11,141.74	646,221,371	11,137.37	645,967,914	2.000	2023/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	11,413.12	627,721,692	11,405.24	627,288,451	2.500	2023/8/15	0.40
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,820,000	21,676.99	611,291,284	22,042.47	621,597,815	5.750	2032/10/25	0.40
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4,300,000	14,451.21	621,402,266	14,405.80	619,449,733	3.750	2019/10/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,370,000	11,290.34	606,291,713	11,254.68	604,376,475	2.000	2020/7/31	0.38
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,160,000	18,718.65	591,509,439	19,017.58	600,955,587	6.500	2027/11/1	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,055.31	585,931,557	11,334.55	600,731,267	2.875	2045/8/15	0.38
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,110,000	18,804.96	584,834,452	19,204.97	597,274,777	6.000	2031/5/1	0.38
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,920,000	15,180.52	595,076,710	15,168.82	594,618,048	3.250	2021/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,500,000	12,914.63	581,158,642	13,187.75	593,449,126	3.750	2043/11/15	0.38
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,900,000	15,217.88	593,497,623	15,189.65	592,396,442	3.750	2021/4/25	0.38

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
----	---------

国債証券	99.08
合 計	99.08

### 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

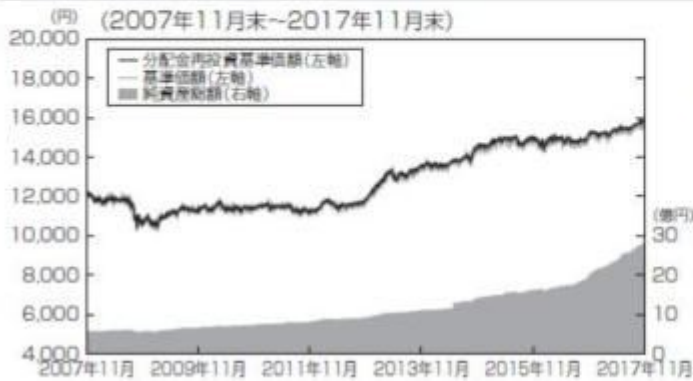
該当事項はありません。

### 参考情報

## 運用実績

2017年11月30日現在

### 基準価額・純資産の推移



基準価額……………15,703円  
純資産総額……………28.25億円

※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、2007年11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)

2013年11月	2014年11月	2015年11月	2016年11月	2017年11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	15.12%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	5.06%
日本債券インデックスマザーファンド	64.82%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	10.02%
現金その他	4.98%

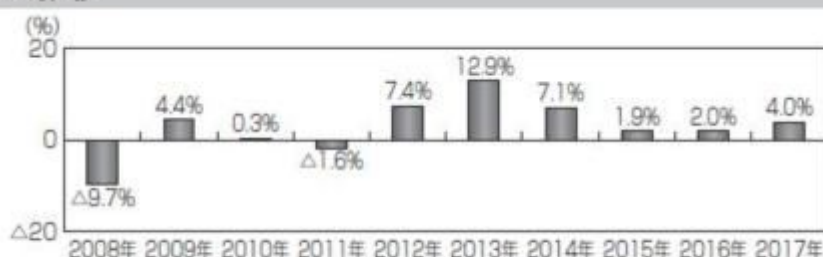
\*当ファンドの対純資産総額比です。

### <組入上位銘柄>

組入資産	銘柄	業種	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	3.31%	
	2 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.13%	
	3 ソフトバンクグループ	情報・通信業	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	2.41%	
	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1.67%	
	3 AMAZON.COM INC	小売	1.29%	
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341回利付国債(10年) (クーポン0.300%)	国債証券	2025/12/20	3.02%
	2 第345回利付国債(10年) (クーポン0.100%)	国債証券	2026/12/20	1.66%
	3 第303回利付国債(10年) (クーポン1.400%)	国債証券	2019/9/20	1.61%
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	1.01%
	2 US TREASURY N/B (クーポン3.375%)	国債証券	2019/11/15	0.77%
	3 US TREASURY N/B (クーポン1.875%)	国債証券	2022/7/31	0.69%

\*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。

\*2017年は、2017年11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】

### 1【申込(販売)手続等】

#### (1) 申込方法

- ・確定拠出年金制度の規定に従い、販売会社所定の方法でお申し込みください。
- ・当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。取得申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて取得の申込みを行なう

資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関に限るものとします。

(2) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(3) 取扱時間

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

(4) 申込金額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

(5) 申込単位

1円以上1円単位

(6) 申込代金の支払い

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

(7) 受付の中止および取消

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

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

## 2【換金(解約)手続等】

### <解約請求による換金>

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約制限

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

(4) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額に基づいて計算された金額となります。

上記の手取額は、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が委託する事務委託先金融機関の場合を記載しています。

税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、課税上の取扱いが変更になる場合があります。

(6) 解約単位

1口単位

販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。

(7) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(8) 受付の中止および取消

・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむ

を得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。

- ・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

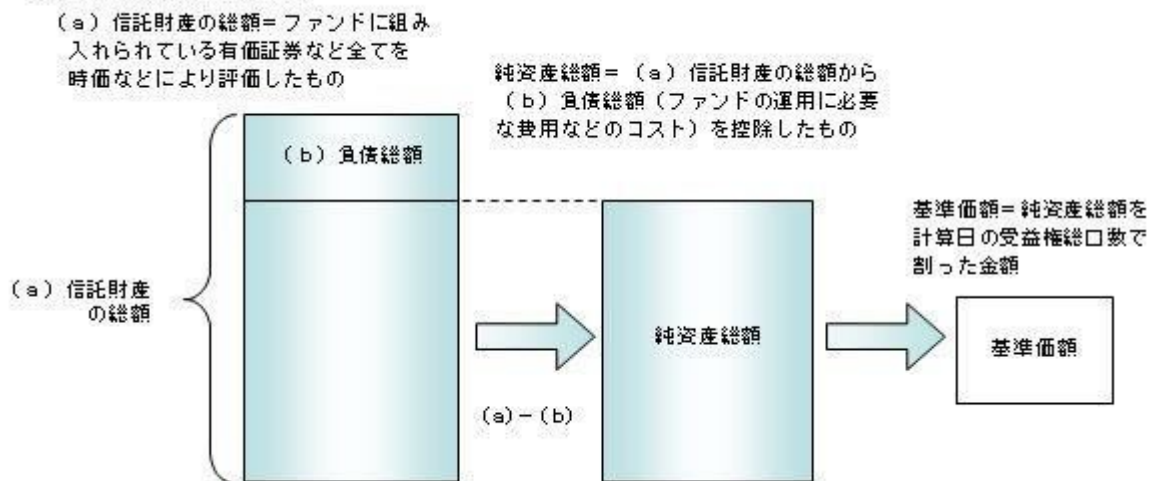
### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### 基準価額の算出

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

##### <基準価額算出の流れ>



##### 有価証券などの評価基準

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

##### <主な資産の評価方法>

###### マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

###### 国内上場株式

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

###### 外国株式

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

###### 公社債(国内・外国)

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

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

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

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

##### 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします（平成14年12月10日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年11月7日から翌年11月6日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5) 【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
  - イ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
  - ロ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内（1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。）に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
  - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
  - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
  - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。）
  - ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

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

信託約款の変更

  - 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
  - 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。

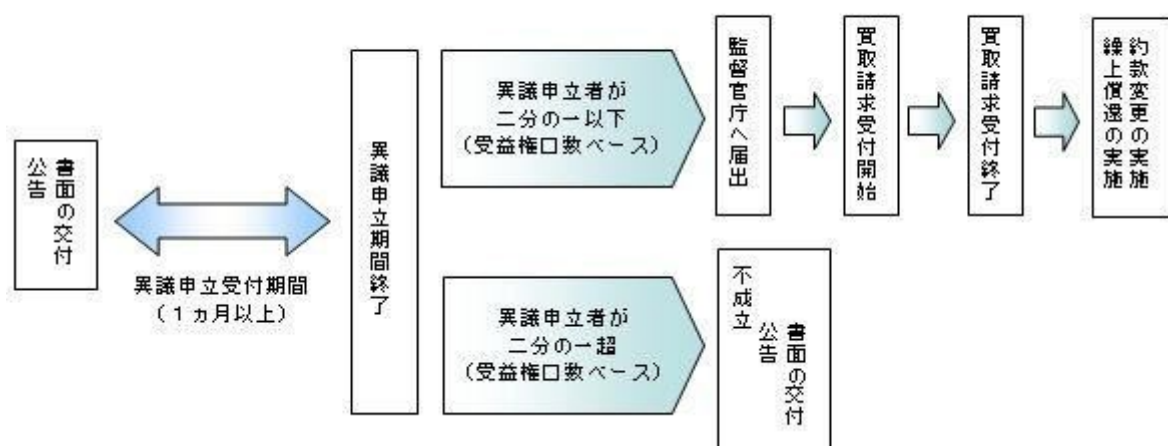


- 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
- 4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

#### 異議の申立て

- 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。
- 2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行なわない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。
- 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



#### 公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

#### 運用報告書の作成

- 委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。
- 交付運用報告書は、原則として知っている受益者に対して交付されます。
- 運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

#### 関係法人との契約について

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

## 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

### (1) 収益分配金・償還金受領権

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

### (2) 解約請求権

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

### (3) 帳簿閲覧権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間（平成28年11月 8日から平成29年11月 6日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【DCインデックスバランス(株式20)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第14期 平成28年11月7日現在	第15期 平成29年11月6日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	96,878,352	142,939,334
親投資信託受益証券	1,803,891,778	2,650,275,974
未収入金	-	1,631,317
流動資産合計	1,900,770,130	2,794,846,625
資産合計	1,900,770,130	2,794,846,625
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	1,287,475	1,771,195
未払解約金	156,830	3,907,238
未払受託者報酬	289,264	411,969
未払委託者報酬	1,350,195	1,922,809
未払利息	91	169
その他未払費用	47,202	67,231
流動負債合計	3,131,057	8,080,611
負債合計	3,131,057	8,080,611
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,287,475,428	1,771,195,466
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	610,163,645	1,015,570,548
(分配準備積立金)	212,643,640	289,693,105
元本等合計	1,897,639,073	2,786,766,014
純資産合計	1,897,639,073	2,786,766,014
負債純資産合計	1,900,770,130	2,794,846,625

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期		第15期	
	自	平成27年11月 7日 至 平成28年11月 7日	自	平成28年11月 8日 至 平成29年11月 6日
営業収益				
受取利息		12,946		30
有価証券売買等損益		3,442,363		159,239,083
営業収益合計		3,429,417		159,239,113
営業費用				
支払利息		22,235		54,515
受託者報酬		552,984		757,767
委託者報酬		2,581,170		3,536,808
その他費用		90,449		123,662
営業費用合計		3,246,838		4,472,752
営業利益又は営業損失（ ）		6,676,255		154,766,361
経常利益又は経常損失（ ）		6,676,255		154,766,361
当期純利益又は当期純損失（ ）		6,676,255		154,766,361
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		1,297,496		13,022,936
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		518,525,047		610,163,645
剰余金増加額又は欠損金減少額		173,781,943		423,648,926
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		173,781,943		423,648,926
剰余金減少額又は欠損金増加額		75,477,111		158,214,253
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		75,477,111		158,214,253
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		1,287,475		1,771,195
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		610,163,645		1,015,570,548

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年11月7日から翌年11月6日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は平成28年11月 8日から平成29年11月 6日までとなっております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

		第14期 平成28年11月 7日現在	第15期 平成29年11月 6日現在
1.	期首元本額	1,077,692,785円	1,287,475,428円
	期中追加設定元本額	366,937,574円	810,944,162円
	期中一部解約元本額	157,154,931円	327,224,124円
2.	受益権の総数	1,287,475,428口	1,771,195,466口

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第14期 自 平成27年11月 7日 至 平成28年11月 7日		第15期 自 平成28年11月 8日 至 平成29年11月 6日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	22,307,021円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 32,236,715円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 87,095,449円
C	信託約款に定める収益調整金	397,520,005円	C 信託約款に定める収益調整金 725,877,443円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	191,624,094円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 172,132,136円
E	分配対象収益 ( A+B+C+D )	611,451,120円	E 分配対象収益 ( A+B+C+D ) 1,017,341,743円
F	分配対象収益(1万口当たり)	4,749円	F 分配対象収益(1万口当たり) 5,743円
G	分配金額	1,287,475円	G 分配金額 1,771,195円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり) 10円

## ( 金融商品に関する注記 )

## 金融商品の状況に関する事項

	第14期 自 平成27年11月 7日 至 平成28年11月 7日	第15期 自 平成28年11月 8日 至 平成29年11月 6日

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

## 金融商品の時価等に関する事項

	第14期 平成28年11月 7日現在	第15期 平成29年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第14期（平成28年11月 7日現在）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	987,194
合計	987,194

第15期（平成29年11月 6日現在）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	145,455,738
合計	145,455,738

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

第14期 平成28年11月 7日現在		第15期 平成29年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	1.4739円	1口当たり純資産額	1.5734円
(1万口当たり純資産額)	(14,739円)	(1万口当たり純資産額)	(15,734円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	------	-----	----



親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	58,183,752	140,100,656	
	日本債券インデックスマザーファンド	1,299,980,063	1,805,412,311	
	海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	120,311,772	278,870,656	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	268,600,121	425,892,351	
合計		1,747,075,708	2,650,275,974	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

(参考)

### 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

#### 貸借対照表

(単位：円)

	平成28年11月 7日現在	平成29年11月 6日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	44,977,231	228,584,154
株式	25,119,698,830	29,043,675,810
派生商品評価勘定	1,774,600	6,351,360
未収入金	201,776,220	4,774,600
未収配当金	217,451,697	225,926,812
前払金	3,550,000	-
流動資産合計	25,589,228,578	29,509,312,736
資産合計	25,589,228,578	29,509,312,736
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	852,020	-
前受金	-	9,795,000

	平成28年11月 7日現在	平成29年11月 6日現在
未払解約金	95,632,741	76,594,333
未払利息	42	271
流動負債合計	96,484,803	86,389,604
負債合計	96,484,803	86,389,604
純資産の部		
元本等		
元本	21,614,291,321	18,556,735,435
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	3,878,452,454	10,866,187,697
元本等合計	25,492,743,775	29,422,923,132
純資産合計	25,492,743,775	29,422,923,132
負債純資産合計	25,589,228,578	29,509,312,736

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	平成28年11月 7日現在	平成29年11月 6日現在
1. 期首	平成27年11月 7日	平成28年11月 8日
期首元本額	21,313,752,367円	21,614,291,321円
期首からの追加設定元本額	3,753,988,127円	1,876,867,251円
期首からの一部解約元本額	3,453,449,173円	4,934,423,137円
元本の内訳		
DCインデックスバランス（株式20）	240,921,581円	268,600,121円
DCインデックスバランス（株式40）	812,659,519円	842,883,256円
DCインデックスバランス（株式60）	1,476,706,820円	1,628,235,422円
DCインデックスバランス（株式80）	1,674,820,350円	1,772,214,419円
インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,342,019,022円	1,242,601,594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	5,350,505,667円	3,707,983,912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	4,593,260円
インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	-円	495,308,762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	-円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	64,849,435円	52,613,017円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	52,835,497円	39,783,177円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	79,884,061円	60,796,114円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	99,146,523円	65,446,430円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	6,690,320,683円	5,178,393,256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)	17,528,685円	9,778,573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)	39,632,807円	30,641,917円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	36,400,738円	-円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	301,756,164円	253,585,146円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	900,722,367円	737,069,541円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	1,211,519,643円	1,071,286,651円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	1,212,868,834円	1,094,920,867円
計	21,614,291,321円	18,556,735,435円
2. 受益権の総数	21,614,291,321口	18,556,735,435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	366,605,000円	479,045,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 平成27年11月 7日 至 平成28年11月 7日	自 平成28年11月 8日 至 平成29年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成28年11月 7日現在	平成29年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成28年11月 7日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	371,955,556
合計	371,955,556

（平成29年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	621,760,680
合計	621,760,680

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（平成28年11月 7日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	313,360,000	-	314,295,000	935,000
合計		313,360,000	-	314,295,000	935,000

（平成29年11月 6日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	281,000,000	-	287,360,000	6,360,000
合計		281,000,000	-	287,360,000	6,360,000

（注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成28年11月 7日現在		平成29年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	1.1794円	1口当たり純資産額	1.5856円
(1万口当たり純資産額)	(11,794円)	(1万口当たり純資産額)	(15,856円)

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	500	3,850.00	1,925,000	
日本水産	14,300	652.00	9,323,600	
マルハニチロ	2,400	3,475.00	8,340,000	
カネコ種苗	300	1,732.00	519,600	
サカタのタネ	1,900	3,545.00	6,735,500	
ホクト	1,300	1,994.00	2,592,200	
ホクリヨウ	200	1,162.00	232,400	
住石ホールディングス	3,200	160.00	512,000	
日鉄鉱業	400	7,650.00	3,060,000	
三井松島産業	600	1,483.00	889,800	
国際石油開発帝石	61,800	1,273.00	78,671,400	
日本海洋掘削	500	2,157.00	1,078,500	
石油資源開発	2,000	2,442.00	4,884,000	
K & O エナジーグループ	800	1,880.00	1,504,000	
ショーボンドホールディングス	1,200	7,100.00	8,520,000	

ミライト・ホールディングス	4,000	1,504.00	6,016,000	
サンヨーホームズ	200	781.00	156,200	
ファーストコーポレーション	300	1,208.00	362,400	
ベステラ	200	2,166.00	433,200	
インベスターズクラウド	200	7,060.00	1,412,000	
ダイセキ環境ソリューション	300	1,417.00	425,100	
安藤・間	9,700	950.00	9,215,000	
東急建設	4,900	1,009.00	4,944,100	
コムシスホールディングス	4,400	2,979.00	13,107,600	
ミサワホーム	1,100	1,075.00	1,182,500	
高松コンストラクショングループ	800	3,115.00	2,492,000	
東建コーポレーション	500	13,430.00	6,715,000	
ソネック	200	863.00	172,600	
ヤマウラ	600	968.00	580,800	
大成建設	12,900	6,560.00	84,624,000	
大林組	38,200	1,549.00	59,171,800	
清水建設	38,800	1,381.00	53,582,800	
飛鳥建設	11,500	171.00	1,966,500	
長谷工コーポレーション	14,900	1,669.00	24,868,100	
松井建設	1,400	1,029.00	1,440,600	
銭高組	200	5,680.00	1,136,000	
鹿島建設	55,000	1,251.00	68,805,000	
不動テトラ	9,600	192.00	1,843,200	
大末建設	400	1,088.00	435,200	
鉄建建設	800	3,830.00	3,064,000	
西松建設	3,000	3,570.00	10,710,000	
三井住友建設	9,100	714.00	6,497,400	
大豊建設	5,000	581.00	2,905,000	
前田建設工業	9,000	1,547.00	13,923,000	
ナカノフドー建設	1,000	658.00	658,000	
奥村組	2,100	4,595.00	9,649,500	
東鉄工業	1,500	3,880.00	5,820,000	
イチケン	300	2,808.00	842,400	
浅沼組	5,000	432.00	2,160,000	
戸田建設	15,000	973.00	14,595,000	
熊谷組	2,000	3,615.00	7,230,000	

青木あすなる建設	800	1,021.00	816,800	
北野建設	3,000	514.00	1,542,000	
植木組	200	2,713.00	542,600	
三井ホーム	2,000	747.00	1,494,000	
矢作建設工業	1,800	1,019.00	1,834,200	
ピーエス三菱	1,500	721.00	1,081,500	
日本ハウスホールディングス	2,500	614.00	1,535,000	
大東建託	4,700	19,925.00	93,647,500	
新日本建設	1,500	1,022.00	1,533,000	
N I P P O	3,000	2,441.00	7,323,000	
東亜道路工業	300	4,505.00	1,351,500	
前田道路	4,000	2,503.00	10,012,000	
日本道路	400	6,500.00	2,600,000	
東亜建設工業	1,000	2,464.00	2,464,000	
若築建設	700	1,925.00	1,347,500	
東洋建設	4,000	586.00	2,344,000	
五洋建設	14,100	777.00	10,955,700	
福田組	400	6,770.00	2,708,000	
住友林業	8,100	1,929.00	15,624,900	
日本基礎技術	1,400	404.00	565,600	
日成ビルド工業	1,800	1,240.00	2,232,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	6,000	83.00	498,000	
巴コーポレーション	1,500	487.00	730,500	
大和ハウス工業	37,600	4,234.00	159,198,400	
ライト工業	2,500	1,168.00	2,920,000	
積水ハウス	41,500	2,144.00	88,976,000	
日特建設	1,100	614.00	675,400	
北陸電気工事	700	1,048.00	733,600	
ユアテック	2,000	1,022.00	2,044,000	
西部電気工業	100	2,534.00	253,400	
四電工	200	3,180.00	636,000	
中電工	1,600	3,205.00	5,128,000	
関電工	5,100	1,184.00	6,038,400	
きんでん	8,400	1,919.00	16,119,600	
東京エネシス	1,500	1,313.00	1,969,500	
トーエネック	400	3,360.00	1,344,000	



住友電設	1,000	2,503.00	2,503,000	
日本電設工業	1,900	2,392.00	4,544,800	
協和エクシオ	4,500	2,504.00	11,268,000	
新日本空調	1,000	1,613.00	1,613,000	
N D S	200	4,095.00	819,000	
九電工	2,500	4,945.00	12,362,500	
三機工業	2,700	1,332.00	3,596,400	
日揮	10,900	1,928.00	21,015,200	
中外炉工業	400	2,243.00	897,200	
ヤマト	1,100	816.00	897,600	
太平電業	900	2,883.00	2,594,700	
高砂熱学工業	3,500	2,038.00	7,133,000	
三晃金属工業	200	4,220.00	844,000	
朝日工業社	300	3,660.00	1,098,000	
明星工業	2,200	855.00	1,881,000	
大気社	1,700	3,430.00	5,831,000	
ダイダン	800	2,917.00	2,333,600	
日比谷総合設備	1,400	2,453.00	3,434,200	
東芝プラントシステム	2,800	1,987.00	5,563,600	
東洋エンジニアリング	1,500	1,367.00	2,050,500	
千代田化工建設	8,300	676.00	5,610,800	
新興プランテック	2,500	1,109.00	2,772,500	
日本製粉	3,800	1,774.00	6,741,200	
日清製粉グループ本社	13,900	2,070.00	28,773,000	
日東富士製粉	100	4,210.00	421,000	
昭和産業	1,100	2,966.00	3,262,600	
鳥越製粉	1,000	965.00	965,000	
中部飼料	1,400	2,106.00	2,948,400	
フィード・ワン	7,600	286.00	2,173,600	
東洋精糖	200	1,205.00	241,000	
日本甜菜製糖	700	2,449.00	1,714,300	
三井製糖	900	3,885.00	3,496,500	
塩水港精糖	1,300	270.00	351,000	
日新製糖	600	2,081.00	1,248,600	
森永製菓	2,600	6,490.00	16,874,000	
中村屋	300	5,030.00	1,509,000	

江崎グリコ	3,100	5,700.00	17,670,000	
名糖産業	600	1,498.00	898,800	
不二家	700	2,628.00	1,839,600	
山崎製パン	9,300	2,062.00	19,176,600	
第一屋製パン	200	1,231.00	246,200	
モロゾフ	200	7,460.00	1,492,000	
亀田製菓	700	5,350.00	3,745,000	
寿スピリッツ	1,100	4,880.00	5,368,000	
カルビー	5,100	3,915.00	19,966,500	
森永乳業	2,300	4,420.00	10,166,000	
六甲バター	600	2,642.00	1,585,200	
ヤクルト本社	6,800	9,500.00	64,600,000	
明治ホールディングス	7,500	9,370.00	70,275,000	
雪印メグミルク	2,800	3,225.00	9,030,000	
プリマハム	8,000	754.00	6,032,000	
日本ハム	10,000	2,887.00	28,870,000	
林兼産業	400	960.00	384,000	
丸大食品	6,000	533.00	3,198,000	
S Foods	800	4,395.00	3,516,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	7,300	1,088.00	7,942,400	
サッポロホールディングス	4,200	3,440.00	14,448,000	
アサヒグループホールディングス	23,900	5,380.00	128,582,000	
キリンホールディングス	54,700	2,642.00	144,517,400	
宝ホールディングス	9,200	1,150.00	10,580,000	
オエノンホールディングス	3,300	334.00	1,102,200	
養命酒製造	400	2,331.00	932,400	
コカ・コーラボトラーズジャパン	8,000	3,970.00	31,760,000	
サントリー食品インターナショナル	8,700	5,030.00	43,761,000	
ダイドーグループホールディングス	600	5,570.00	3,342,000	
伊藤園	3,700	4,020.00	14,874,000	
キーコーヒー	1,100	2,134.00	2,347,400	
ユニカフェ	400	1,131.00	452,400	
ジャパンフーズ	200	1,427.00	285,400	
日清オイリオグループ	1,300	3,370.00	4,381,000	
不二製油グループ本社	3,100	3,045.00	9,439,500	
かどや製油	100	6,260.00	626,000	

J - オイルミルズ	600	4,085.00	2,451,000	
キッコーマン	8,900	4,015.00	35,733,500	
味の素	26,200	2,312.00	60,574,400	
キューピー	6,500	2,873.00	18,674,500	
ハウス食品グループ本社	4,400	3,490.00	15,356,000	
カゴメ	4,500	3,995.00	17,977,500	
焼津水産化学工業	600	1,225.00	735,000	
アリアケジャパン	1,000	8,850.00	8,850,000	
ピエトロ	200	1,665.00	333,000	
エバラ食品工業	200	2,095.00	419,000	
ニチレイ	5,500	3,075.00	16,912,500	
東洋水産	6,300	4,695.00	29,578,500	
イートアンド	100	2,591.00	259,100	
大冷	100	2,060.00	206,000	
日清食品ホールディングス	5,000	7,270.00	36,350,000	
永谷園ホールディングス	1,000	1,367.00	1,367,000	
一正蒲鉾	500	1,326.00	663,000	
フジッコ	1,200	2,553.00	3,063,600	
ロック・フィールド	1,200	1,994.00	2,392,800	
日本たばこ産業	70,400	3,743.00	263,507,200	
ケンコーマヨネーズ	800	2,959.00	2,367,200	
わらべや日洋ホールディングス	800	2,868.00	2,294,400	
なとり	600	2,050.00	1,230,000	
イフジ産業	200	806.00	161,200	
北の達人コーポレーション	1,000	939.00	939,000	
ユーグレナ	4,300	1,126.00	4,841,800	
ミヨシ油脂	400	1,479.00	591,600	
理研ビタミン	400	4,375.00	1,750,000	
片倉工業	1,400	1,338.00	1,873,200	
グンゼ	900	5,620.00	5,058,000	
東洋紡	4,400	2,209.00	9,719,600	
ユニチカ	3,400	984.00	3,345,600	
富士紡ホールディングス	700	3,480.00	2,436,000	
倉敷紡績	12,000	325.00	3,900,000	
シキボウ	600	1,527.00	916,200	
日本毛織	3,400	1,024.00	3,481,600	

ダイトウボウ	1,800	101.00	181,800	
トーア紡コーポレーション	500	633.00	316,500	
ダイドーリミテッド	1,400	440.00	616,000	
帝国繊維	1,300	2,380.00	3,094,000	
帝人	9,700	2,402.00	23,299,400	
東レ	86,300	1,173.00	101,229,900	
サカイオーベックス	300	2,322.00	696,600	
住江織物	3,000	313.00	939,000	
日本フェルト	700	510.00	357,000	
イチカワ	1,000	346.00	346,000	
日東製網	100	1,837.00	183,700	
アツギ	800	1,308.00	1,046,400	
ダイニック	400	1,209.00	483,600	
セーレン	2,700	1,979.00	5,343,300	
ソトー	500	1,152.00	576,000	
東海染工	200	1,521.00	304,200	
小松精練	1,900	940.00	1,786,000	
ワコールホールディングス	3,300	3,295.00	10,873,500	
ホギメディカル	700	7,930.00	5,551,000	
レナウン	3,200	195.00	624,000	
クラウドシアホールディングス	300	585.00	175,500	
T S Iホールディングス	4,400	927.00	4,078,800	
三陽商会	600	2,073.00	1,243,800	
ナイガイ	500	584.00	292,000	
オンワードホールディングス	7,000	934.00	6,538,000	
ルック	2,000	423.00	846,000	
キムラタン	5,100	56.00	285,600	
ゴールドウイン	300	8,000.00	2,400,000	
デサント	2,700	1,554.00	4,195,800	
キング	600	532.00	319,200	
ヤマトインターナショナル	800	447.00	357,600	
特種東海製紙	700	4,490.00	3,143,000	
王子ホールディングス	50,000	664.00	33,200,000	
日本製紙	5,400	2,329.00	12,576,600	
三菱製紙	1,700	769.00	1,307,300	
北越紀州製紙	6,700	733.00	4,911,100	

中越パルプ工業	500	2,165.00	1,082,500	
巴川製紙所	2,000	308.00	616,000	
大王製紙	4,800	1,408.00	6,758,400	
阿波製紙	300	710.00	213,000	
レンゴー	11,500	769.00	8,843,500	
トーモク	700	2,140.00	1,498,000	
ザ・バック	800	3,880.00	3,104,000	
クラレ	20,100	2,321.00	46,652,100	
旭化成	74,100	1,371.50	101,628,150	
共和レザー	700	963.00	674,100	
昭和電工	7,900	3,930.00	31,047,000	
住友化学	88,000	822.00	72,336,000	
住友精化	500	5,980.00	2,990,000	
日産化学工業	6,900	4,360.00	30,084,000	
ラサ工業	400	2,051.00	820,400	
クレハ	1,000	6,850.00	6,850,000	
多木化学	200	5,100.00	1,020,000	
テイカ	900	2,630.00	2,367,000	
石原産業	2,100	1,726.00	3,624,600	
片倉コープアグリ	300	1,384.00	415,200	
日東エフシー	700	852.00	596,400	
日本曹達	8,000	720.00	5,760,000	
東ソー	17,200	2,523.00	43,395,600	
トクヤマ	3,500	3,505.00	12,267,500	
セントラル硝子	2,400	2,244.00	5,385,600	
東亜合成	6,900	1,407.00	9,708,300	
大阪ソーダ	1,000	2,938.00	2,938,000	
関東電化工業	2,900	1,115.00	3,233,500	
デンカ	4,300	3,850.00	16,555,000	
信越化学工業	19,800	12,320.00	243,936,000	
日本カーバイド工業	400	2,286.00	914,400	
堺化学工業	800	2,880.00	2,304,000	
エア・ウォーター	9,800	2,205.00	21,609,000	
太陽日酸	9,300	1,439.00	13,382,700	
日本化学工業	500	2,621.00	1,310,500	
東邦アセチレン	200	1,659.00	331,800	

日本パーカラライジング	6,000	1,856.00	11,136,000	
高压ガス工業	1,700	851.00	1,446,700	
四国化成工業	1,700	1,873.00	3,184,100	
戸田工業	200	4,610.00	922,000	
ステラ ケミファ	600	3,635.00	2,181,000	
保土谷化学工業	400	6,570.00	2,628,000	
日本触媒	1,800	8,420.00	15,156,000	
大日精化工業	900	5,180.00	4,662,000	
カネカ	16,000	946.00	15,136,000	
三菱瓦斯化学	10,100	2,999.00	30,289,900	
三井化学	10,800	3,405.00	36,774,000	
J S R	12,000	2,194.00	26,328,000	
東京応化工業	2,100	4,145.00	8,704,500	
大阪有機化学工業	800	1,354.00	1,083,200	
三菱ケミカルホールディングス	79,600	1,215.50	96,753,800	
K Hネオケム	1,800	2,857.00	5,142,600	
ダイセル	16,000	1,276.00	20,416,000	
住友ベークライト	9,000	935.00	8,415,000	
積水化学工業	24,600	2,269.00	55,817,400	
日本ゼオン	10,000	1,562.00	15,620,000	
アイカ工業	3,400	3,950.00	13,430,000	
宇部興産	5,900	3,335.00	19,676,500	
積水樹脂	1,900	2,498.00	4,746,200	
タキロンシーアイ	3,000	730.00	2,190,000	
旭有機材	700	1,756.00	1,229,200	
日立化成	5,800	3,180.00	18,444,000	
ニチバン	600	2,596.00	1,557,600	
リケンテクノス	2,500	704.00	1,760,000	
大倉工業	3,000	805.00	2,415,000	
積水化成品工業	1,500	1,549.00	2,323,500	
群栄化学工業	300	3,755.00	1,126,500	
タイガースポリマー	600	799.00	479,400	
ミライアル	400	1,638.00	655,200	
ダイキアクシス	400	1,276.00	510,400	
ダイキョーニシカワ	2,300	1,905.00	4,381,500	
竹本容器	200	1,969.00	393,800	

日本化薬	7,700	1,803.00	13,883,100
カーリットホールディングス	1,100	814.00	895,400
日本精化	1,000	1,086.00	1,086,000
扶桑化学工業	800	3,345.00	2,676,000
A D E K A	5,200	1,854.00	9,640,800
日油	4,600	3,145.00	14,467,000
新日本理化	1,900	285.00	541,500
ハリマ化成グループ	900	898.00	808,200
花王	28,000	6,941.00	194,348,000
第一工業製薬	2,000	836.00	1,672,000
日華化学	400	1,204.00	481,600
ニイタカ	200	1,929.00	385,800
三洋化成工業	700	5,680.00	3,976,000
有機合成薬品工業	800	298.00	238,400
大日本塗料	1,400	1,752.00	2,452,800
日本ペイントホールディングス	9,200	3,960.00	36,432,000
関西ペイント	12,600	2,911.00	36,678,600
神東塗料	900	243.00	218,700
中国塗料	3,400	924.00	3,141,600
日本特殊塗料	800	1,992.00	1,593,600
藤倉化成	1,500	710.00	1,065,000
太陽ホールディングス	900	5,440.00	4,896,000
D I C	4,600	4,205.00	19,343,000
サカティンクス	2,400	2,153.00	5,167,200
東洋インキ S C ホールディングス	11,000	651.00	7,161,000
T & K T O K A	800	1,286.00	1,028,800
富士フイルムホールディングス	23,600	4,568.00	107,804,800
資生堂	21,100	4,641.00	97,925,100
ライオン	15,800	2,171.00	34,301,800
高砂香料工業	700	3,925.00	2,747,500
マンダム	2,100	3,455.00	7,255,500
ミルボン	800	7,230.00	5,784,000
ファンケル	2,800	2,967.00	8,307,600
コーセー	1,900	14,370.00	27,303,000
コタ	500	1,463.00	731,500
シーズ・ホールディングス	1,500	4,215.00	6,322,500

シーボン	200	2,786.00	557,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	4,900	3,775.00	18,497,500	
ノエビアホールディングス	800	7,060.00	5,648,000	
アジュバンコスメジャパン	300	995.00	298,500	
エステー	800	2,765.00	2,212,000	
アグロ カネショウ	500	2,200.00	1,100,000	
コニシ	1,800	2,005.00	3,609,000	
長谷川香料	1,500	2,335.00	3,502,500	
星光PMC	600	1,237.00	742,200	
小林製薬	3,100	6,710.00	20,801,000	
荒川化学工業	1,000	2,446.00	2,446,000	
メック	800	2,122.00	1,697,600	
日本高純度化学	300	2,675.00	802,500	
タカラバイオ	3,000	1,519.00	4,557,000	
JCU	700	5,790.00	4,053,000	
新田ゼラチン	800	809.00	647,200	
OATアグリオ	200	2,076.00	415,200	
デクセリアルズ	2,900	1,411.00	4,091,900	
アース製薬	900	5,330.00	4,797,000	
北興化学工業	1,200	689.00	826,800	
大成ラミック	400	3,045.00	1,218,000	
クミアイ化学工業	5,100	748.00	3,814,800	
日本農薬	2,900	652.00	1,890,800	
アキレス	900	2,258.00	2,032,200	
有沢製作所	1,900	997.00	1,894,300	
日東電工	8,600	11,325.00	97,395,000	
レック	700	3,005.00	2,103,500	
きもと	1,900	278.00	528,200	
藤森工業	1,000	3,845.00	3,845,000	
前澤化成工業	800	1,232.00	985,600	
JSP	700	3,585.00	2,509,500	
エフピコ	900	6,230.00	5,607,000	
天馬	900	2,390.00	2,151,000	
信越ポリマー	2,400	1,170.00	2,808,000	
東リ	2,900	409.00	1,186,100	
ニフコ	2,100	7,690.00	16,149,000	



日本バルカー工業	900	2,636.00	2,372,400	
ユニ・チャーム	24,100	2,600.00	62,660,000	
協和発酵キリン	14,300	2,144.00	30,659,200	
武田薬品工業	41,800	6,409.00	267,896,200	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	116,600	1,502.00	175,133,200	
大日本住友製薬	8,400	1,674.00	14,061,600	
塩野義製薬	16,300	6,242.00	101,744,600	
田辺三菱製薬	13,900	2,473.00	34,374,700	
わかもと製薬	2,000	288.00	576,000	
あすか製薬	1,300	2,191.00	2,848,300	
日本新薬	3,000	7,950.00	23,850,000	
ピオフェルミン製薬	200	3,105.00	621,000	
中外製薬	11,800	5,510.00	65,018,000	
科研製薬	2,100	5,700.00	11,970,000	
エーザイ	13,600	6,386.00	86,849,600	
ロート製薬	6,300	2,720.00	17,136,000	
小野薬品工業	29,100	2,602.50	75,732,750	
久光製薬	3,300	6,370.00	21,021,000	
持田製薬	800	8,200.00	6,560,000	
参天製薬	21,500	1,753.00	37,689,500	
扶桑薬品工業	400	2,847.00	1,138,800	
日本ケミファ	200	5,010.00	1,002,000	
ツムラ	4,000	4,240.00	16,960,000	
日医工	2,900	1,761.00	5,106,900	
キッセイ薬品工業	2,100	3,160.00	6,636,000	
生化学工業	2,200	2,030.00	4,466,000	
栄研化学	900	4,300.00	3,870,000	
日水製薬	500	1,489.00	744,500	
鳥居薬品	700	3,070.00	2,149,000	
JCRファーマ	800	4,335.00	3,468,000	
東和薬品	500	5,970.00	2,985,000	
富士製薬工業	400	4,215.00	1,686,000	
沢井製薬	2,000	6,530.00	13,060,000	
ゼリア新薬工業	2,400	2,195.00	5,268,000	
第一三共	32,500	2,670.50	86,791,250	

キョーリン製薬ホールディングス	3,200	2,273.00	7,273,600	
大幸薬品	600	2,518.00	1,510,800	
ダイト	700	2,971.00	2,079,700	
大塚ホールディングス	23,600	4,762.00	112,383,200	
大正製薬ホールディングス	2,600	8,740.00	22,724,000	
ペプチドリーム	4,700	3,550.00	16,685,000	
日本コークス工業	9,600	133.00	1,276,800	
昭和シェル石油	10,600	1,396.00	14,797,600	
ニチレキ	1,500	1,416.00	2,124,000	
ユシロ化学工業	700	1,711.00	1,197,700	
ビービー・カストロール	500	1,996.00	998,000	
富士石油	2,800	484.00	1,355,200	
MORESCO	400	2,052.00	820,800	
出光興産	9,500	3,435.00	32,632,500	
JXTGホールディングス	181,100	610.50	110,561,550	
コスモエネルギーホールディングス	3,200	2,755.00	8,816,000	
横浜ゴム	6,600	2,563.00	16,915,800	
東洋ゴム工業	6,700	2,576.00	17,259,200	
ブリヂストン	40,100	5,460.00	218,946,000	
住友ゴム工業	11,100	2,163.00	24,009,300	
藤倉ゴム工業	1,000	912.00	912,000	
オカモト	4,000	1,212.00	4,848,000	
フコク	500	1,080.00	540,000	
ニッタ	1,100	4,505.00	4,955,500	
住友理工	2,200	1,140.00	2,508,000	
三ツ星ベルト	3,000	1,457.00	4,371,000	
バンドー化学	2,100	1,238.00	2,599,800	
日東紡績	1,700	3,340.00	5,678,000	
旭硝子	11,700	4,740.00	55,458,000	
日本板硝子	5,700	980.00	5,586,000	
石塚硝子	200	2,600.00	520,000	
日本山村硝子	5,000	200.00	1,000,000	
日本電気硝子	4,800	4,660.00	22,368,000	
オハラ	500	2,228.00	1,114,000	
住友大阪セメント	22,000	505.00	11,110,000	
太平洋セメント	7,200	4,560.00	32,832,000	

日本ヒューム	1,200	782.00	938,400
日本コンクリート工業	2,400	468.00	1,123,200
三谷セキサン	600	2,682.00	1,609,200
アジアパイルホールディングス	1,500	644.00	966,000
東海カーボン	10,300	1,168.00	12,030,400
日本カーボン	600	4,640.00	2,784,000
東洋炭素	700	3,235.00	2,264,500
ノリタケカンパニーリミテド	700	5,310.00	3,717,000
TOTO	8,700	5,680.00	49,416,000
日本碍子	13,900	2,155.00	29,954,500
日本特殊陶業	9,700	2,664.00	25,840,800
ダントーホールディングス	1,000	159.00	159,000
MARUWA	400	7,420.00	2,968,000
品川リフラクトリーズ	300	3,475.00	1,042,500
黒崎播磨	100	4,530.00	453,000
ヨータイ	700	454.00	317,800
イソライト工業	600	1,107.00	664,200
東京窯業	1,400	388.00	543,200
ニッカトー	400	623.00	249,200
フジインコーポレーテッド	1,000	2,404.00	2,404,000
エーアンドエーマテリアル	300	1,361.00	408,300
ニチアス	6,000	1,536.00	9,216,000
ニチハ	1,600	4,570.00	7,312,000
新日鐵住金	50,200	2,635.50	132,302,100
神戸製鋼所	20,500	1,090.00	22,345,000
合同製鐵	600	2,125.00	1,275,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	30,300	2,528.50	76,613,550
日新製鋼	3,000	1,643.00	4,929,000
東京製鐵	6,100	960.00	5,856,000
共英製鋼	1,300	1,827.00	2,375,100
大和工業	2,400	3,230.00	7,752,000
東京鐵鋼	500	2,103.00	1,051,500
大阪製鐵	600	2,490.00	1,494,000
淀川製鋼所	1,700	3,415.00	5,805,500
東洋鋼鈹	2,800	462.00	1,293,600
丸一鋼管	3,900	3,470.00	13,533,000

モリ工業	400	3,540.00	1,416,000	
大同特殊鋼	2,000	7,100.00	14,200,000	
日本高周波鋼業	400	947.00	378,800	
日本冶金工業	9,300	220.00	2,046,000	
山陽特殊製鋼	1,300	3,050.00	3,965,000	
愛知製鋼	600	4,645.00	2,787,000	
日立金属	12,100	1,506.00	18,222,600	
日本金属	300	2,859.00	857,700	
大平洋金属	700	3,270.00	2,289,000	
新日本電工	6,700	478.00	3,202,600	
栗本鐵工所	600	2,294.00	1,376,400	
虹技	200	2,240.00	448,000	
日本鑄鉄管	1,000	183.00	183,000	
三菱製鋼	800	2,735.00	2,188,000	
日亜鋼業	1,600	334.00	534,400	
日本精線	200	5,560.00	1,112,000	
シンニッタン	900	741.00	666,900	
新家工業	300	2,214.00	664,200	
大紀アルミニウム工業所	1,900	900.00	1,710,000	
日本軽金属ホールディングス	32,800	327.00	10,725,600	
三井金属鉱業	3,100	6,080.00	18,848,000	
東邦亜鉛	600	5,600.00	3,360,000	
三菱マテリアル	7,400	4,375.00	32,375,000	
住友金属鉱山	14,400	4,781.00	68,846,400	
DOWAホールディングス	2,900	4,830.00	14,007,000	
古河機械金属	1,800	2,103.00	3,785,400	
エス・サイエンス	5,400	109.00	588,600	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,200	1,671.00	2,005,200	
東邦チタニウム	2,000	970.00	1,940,000	
UACJ	1,700	3,060.00	5,202,000	
古河電気工業	3,700	6,080.00	22,496,000	
住友電気工業	42,000	1,887.00	79,254,000	
フジクラ	13,600	987.00	13,423,200	
昭和電線ホールディングス	1,400	1,085.00	1,519,000	
タツタ電線	2,200	827.00	1,819,400	
沖電線	100	3,640.00	364,000	

カナレ電気	200	2,524.00	504,800
平河ヒューテック	600	1,335.00	801,000
リョービ	1,400	2,840.00	3,976,000
アーレスティ	1,400	920.00	1,288,000
アサヒホールディングス	1,800	2,463.00	4,433,400
稲葉製作所	700	1,434.00	1,003,800
宮地エンジニアリンググループ	300	3,115.00	934,500
トーカロ	800	4,900.00	3,920,000
アルファC o	400	2,333.00	933,200
SUMCO	10,300	2,523.00	25,986,900
川田テクノロジーズ	200	6,770.00	1,354,000
RS Technologies	100	4,415.00	441,500
東洋製罐グループホールディングス	7,700	1,912.00	14,722,400
ホッカンホールディングス	3,000	445.00	1,335,000
コロナ	600	1,353.00	811,800
横河ブリッジホールディングス	2,100	2,496.00	5,241,600
駒井ハルテック	300	2,654.00	796,200
高田機工	100	3,510.00	351,000
三和ホールディングス	10,900	1,501.00	16,360,900
文化シャッター	3,300	969.00	3,197,700
三協立山	1,600	1,658.00	2,652,800
アルインコ	800	1,267.00	1,013,600
東洋シャッター	300	636.00	190,800
LIXILグループ	16,600	3,120.00	51,792,000
日本ファイルコン	800	791.00	632,800
ノーリツ	2,500	2,092.00	5,230,000
長府製作所	1,200	2,747.00	3,296,400
リンナイ	2,000	9,900.00	19,800,000
ダイニチ工業	600	842.00	505,200
日東精工	1,600	654.00	1,046,400
三洋工業	200	2,189.00	437,800
岡部	2,300	1,007.00	2,316,100
ジーテクト	1,300	2,410.00	3,133,000
中国工業	200	819.00	163,800
東プレ	2,000	3,215.00	6,430,000
高周波熱錬	2,200	1,190.00	2,618,000

東京製綱	800	1,753.00	1,402,400	
サンコール	600	715.00	429,000	
モリテック スチール	700	675.00	472,500	
パイオラックス	1,700	3,165.00	5,380,500	
エイチワン	800	1,610.00	1,288,000	
日本発條	11,200	1,327.00	14,862,400	
中央発條	200	3,745.00	749,000	
アドバネクス	200	3,055.00	611,000	
立川ブラインド工業	500	1,364.00	682,000	
三益半導体工業	1,000	2,026.00	2,026,000	
日本ドライケミカル	200	2,420.00	484,000	
日本製綱所	3,700	2,876.00	10,641,200	
三浦工業	4,900	2,715.00	13,303,500	
タクマ	3,700	1,478.00	5,468,600	
ツガミ	3,000	1,098.00	3,294,000	
オークマ	1,300	7,160.00	9,308,000	
東芝機械	6,000	710.00	4,260,000	
アマダホールディングス	17,400	1,417.00	24,655,800	
アイダエンジニアリング	2,900	1,344.00	3,897,600	
滝澤鉄工所	400	2,114.00	845,600	
富士機械製造	3,400	2,316.00	7,874,400	
牧野フライス製作所	6,000	1,120.00	6,720,000	
オーエスジー	5,000	2,431.00	12,155,000	
ダイジェット工業	200	1,893.00	378,600	
旭ダイヤモンド工業	3,400	1,247.00	4,239,800	
D M G 森精機	6,300	2,360.00	14,868,000	
ソディック	2,500	1,566.00	3,915,000	
ディスコ	1,500	27,100.00	40,650,000	
日東工器	700	2,982.00	2,087,400	
日進工具	300	2,400.00	720,000	
パンチ工業	500	1,969.00	984,500	
富士ダイス	400	944.00	377,600	
豊和工業	600	1,859.00	1,115,400	
O K K	500	1,228.00	614,000	
東洋機械金属	900	862.00	775,800	
津田駒工業	3,000	201.00	603,000	

島精機製作所	1,400	7,460.00	10,444,000	
N Cホールディングス	400	865.00	346,000	
フリー	800	1,147.00	917,600	
ヤマシンフィルタ	300	4,140.00	1,242,000	
日阪製作所	1,600	1,043.00	1,668,800	
やまびこ	2,100	1,525.00	3,202,500	
平田機工	300	13,530.00	4,059,000	
ペガサスミシン製造	1,100	746.00	820,600	
ナブテスコ	6,100	4,455.00	27,175,500	
三井海洋開発	1,200	2,842.00	3,410,400	
レオン自動機	1,000	1,703.00	1,703,000	
S M C	3,500	44,780.00	156,730,000	
新川	900	881.00	792,900	
ホソカワミクロン	400	7,030.00	2,812,000	
ユニオンツール	500	3,680.00	1,840,000	
オイレス工業	1,500	2,153.00	3,229,500	
日精エー・エス・ビー機械	400	5,560.00	2,224,000	
サトーホールディングス	1,500	3,130.00	4,695,000	
技研製作所	600	3,205.00	1,923,000	
日本エアテック	400	870.00	348,000	
日精樹脂工業	900	1,491.00	1,341,900	
オカダアイヨン	400	1,927.00	770,800	
ワイエイシイホールディングス	400	1,117.00	446,800	
小松製作所	54,800	3,787.00	207,527,600	
住友重機械工業	6,500	4,900.00	31,850,000	
日立建機	5,400	3,890.00	21,006,000	
日工	300	2,298.00	689,400	
巴工業	500	2,128.00	1,064,000	
井関農機	1,200	2,479.00	2,974,800	
T O W A	900	2,016.00	1,814,400	
丸山製作所	300	1,968.00	590,400	
北川鉄工所	600	3,065.00	1,839,000	
ローツェ	600	2,882.00	1,729,200	
タカキタ	400	750.00	300,000	
クボタ	61,300	2,141.50	131,273,950	
荏原実業	400	1,839.00	735,600	

三菱化工機	400	2,396.00	958,400
月島機械	2,300	1,331.00	3,061,300
帝国電機製作所	800	1,203.00	962,400
新東工業	2,700	1,300.00	3,510,000
澁谷工業	1,000	4,395.00	4,395,000
アイチ コーポレーション	1,900	826.00	1,569,400
小森コーポレーション	2,900	1,552.00	4,500,800
鶴見製作所	1,000	1,889.00	1,889,000
住友精密工業	2,000	381.00	762,000
酒井重工業	200	3,945.00	789,000
荏原製作所	4,600	4,210.00	19,366,000
石井鐵工所	200	1,787.00	357,400
西島製作所	1,100	1,178.00	1,295,800
北越工業	1,300	1,169.00	1,519,700
ダイキン工業	15,500	13,000.00	201,500,000
オルガノ	400	2,880.00	1,152,000
トーヨーカネツ	500	4,255.00	2,127,500
栗田工業	6,200	3,540.00	21,948,000
椿本チエイン	7,000	921.00	6,447,000
大同工業	500	1,813.00	906,500
木村化工機	1,000	450.00	450,000
アネスト岩田	1,800	1,148.00	2,066,400
ダイフク	5,700	5,890.00	33,573,000
サムコ	300	1,091.00	327,300
加藤製作所	600	3,705.00	2,223,000
油研工業	200	2,672.00	534,400
タダノ	5,500	1,770.00	9,735,000
フジテック	3,600	1,769.00	6,368,400
C K D	3,200	2,343.00	7,497,600
キトー	900	1,467.00	1,320,300
平和	3,600	2,141.00	7,707,600
理想科学工業	1,100	2,075.00	2,282,500
S A N K Y O	2,900	3,675.00	10,657,500
日本金銭機械	1,000	1,134.00	1,134,000
マースエンジニアリング	700	2,281.00	1,596,700
福島工業	700	4,465.00	3,125,500



オーイズミ	500	567.00	283,500
ダイコク電機	500	1,708.00	854,000
竹内製作所	1,900	2,448.00	4,651,200
アマノ	3,600	2,795.00	10,062,000
J U K I	1,700	1,799.00	3,058,300
サンデンホールディングス	1,400	2,310.00	3,234,000
蛇の目マシン工業	1,100	786.00	864,600
マックス	1,800	1,621.00	2,917,800
グローリー	3,400	4,280.00	14,552,000
新晃工業	1,200	1,945.00	2,334,000
大和冷機工業	1,800	1,316.00	2,368,800
セガサミーホールディングス	11,300	1,476.00	16,678,800
日本ピストンリング	400	2,439.00	975,600
リケン	500	5,910.00	2,955,000
T P R	1,300	4,020.00	5,226,000
ツバキ・ナカシマ	1,200	2,606.00	3,127,200
ホシザキ	3,500	10,920.00	38,220,000
大豊工業	900	1,773.00	1,595,700
日本精工	23,300	1,667.00	38,841,100
N T N	26,300	554.00	14,570,200
ジェイテクト	12,000	1,983.00	23,796,000
不二越	11,000	717.00	7,887,000
日本トムソン	3,700	615.00	2,275,500
T H K	7,000	4,350.00	30,450,000
ユーシン精機	500	3,210.00	1,605,000
前澤給装工業	500	1,864.00	932,000
イーグル工業	1,400	2,191.00	3,067,400
前澤工業	800	415.00	332,000
日本ピラー工業	1,100	1,598.00	1,757,800
キッツ	5,100	902.00	4,600,200
マキタ	14,800	4,880.00	72,224,000
日立造船	9,000	617.00	5,553,000
三菱重工業	19,100	4,382.00	83,696,200
I H I	8,700	3,630.00	31,581,000
スター精密	1,800	1,995.00	3,591,000
日清紡ホールディングス	6,900	1,367.00	9,432,300

イビデン	6,900	1,841.00	12,702,900
コニカミノルタ	26,500	1,061.00	28,116,500
ブラザー工業	13,900	2,759.00	38,350,100
ミネベアミツミ	20,500	2,137.00	43,808,500
日立製作所	272,000	886.10	241,019,200
三菱電機	113,400	1,913.50	216,990,900
富士電機	34,000	842.00	28,628,000
東洋電機製造	500	1,982.00	991,000
安川電機	13,100	4,175.00	54,692,500
シンフォニアテクノロジー	7,000	473.00	3,311,000
明電舎	9,000	442.00	3,978,000
オリジン電気	400	1,978.00	791,200
山洋電気	600	7,660.00	4,596,000
デンヨー	900	1,945.00	1,750,500
東芝テック	8,000	660.00	5,280,000
芝浦メカトロニクス	2,000	500.00	1,000,000
マブチモーター	3,100	6,110.00	18,941,000
日本電産	13,600	15,355.00	208,828,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	400	2,484.00	993,600
東光高岳	600	1,851.00	1,110,600
ダブル・スコープ	1,700	2,060.00	3,502,000
ダイヘン	6,000	1,078.00	6,468,000
田淵電機	1,600	301.00	481,600
ヤーマン	1,500	1,305.00	1,957,500
JVCケンウッド	8,400	366.00	3,074,400
ミマキエンジニアリング	1,000	946.00	946,000
第一精工	500	2,847.00	1,423,500
日新電機	2,700	1,433.00	3,869,100
大崎電気工業	2,400	813.00	1,951,200
オムロン	12,100	6,440.00	77,924,000
日東工業	1,700	1,925.00	3,272,500
I D E C	1,500	2,341.00	3,511,500
不二電機工業	100	1,389.00	138,900
ジーエス・ユアサ コーポレーション	21,000	568.00	11,928,000
サクサホールディングス	300	2,123.00	636,900
メルコホールディングス	500	3,540.00	1,770,000

テクノメディカ	300	1,930.00	579,000	
日本電気	14,700	3,005.00	44,173,500	
富士通	117,000	851.80	99,660,600	
沖電気工業	4,700	1,588.00	7,463,600	
岩崎通信機	500	831.00	415,500	
電気興業	700	2,856.00	1,999,200	
サンケン電気	7,000	734.00	5,138,000	
ナカヨ	200	1,943.00	388,600	
アイホン	600	1,914.00	1,148,400	
ルネサスエレクトロニクス	5,800	1,426.00	8,270,800	
セイコーエプソン	16,900	2,694.00	45,528,600	
ワコム	8,800	565.00	4,972,000	
アルバック	1,900	8,370.00	15,903,000	
アクセル	500	784.00	392,000	
E I Z O	1,000	4,925.00	4,925,000	
ジャパンディスプレイ	23,300	240.00	5,592,000	
日本信号	3,100	1,293.00	4,008,300	
京三製作所	3,000	658.00	1,974,000	
能美防災	1,500	2,040.00	3,060,000	
ホーチキ	800	2,782.00	2,225,600	
エレコム	1,000	2,320.00	2,320,000	
パナソニック	129,600	1,699.50	220,255,200	
アンリツ	8,300	1,045.00	8,673,500	
富士通ゼネラル	3,400	2,141.00	7,279,400	
日立国際電気	2,100	3,175.00	6,667,500	
ソニー	75,800	5,222.00	395,827,600	
T D K	5,900	8,910.00	52,569,000	
帝国通信工業	500	1,172.00	586,000	
タムラ製作所	4,300	794.00	3,414,200	
アルプス電気	9,900	3,610.00	35,739,000	
池上通信機	4,000	169.00	676,000	
パイオニア	19,000	226.00	4,294,000	
日本電波工業	1,100	807.00	887,700	
鈴木	500	1,045.00	522,500	
日本トリム	300	4,830.00	1,449,000	
ローランド ディー . ジー .	600	3,110.00	1,866,000	

フォスター電機	1,300	2,669.00	3,469,700	
クラリオン	6,000	444.00	2,664,000	
S M K	3,000	518.00	1,554,000	
ヨコオ	800	1,527.00	1,221,600	
ホシデン	2,900	1,831.00	5,309,900	
ヒロセ電機	1,800	16,950.00	30,510,000	
日本航空電子工業	3,000	2,151.00	6,453,000	
T O A	1,100	1,211.00	1,332,100	
マクセルホールディングス	2,300	2,618.00	6,021,400	
古野電気	1,300	771.00	1,002,300	
ユニデンホールディングス	3,000	348.00	1,044,000	
アルパイン	2,700	2,634.00	7,111,800	
スミダコーポレーション	1,100	1,985.00	2,183,500	
アイコム	600	2,561.00	1,536,600	
リオン	500	2,175.00	1,087,500	
本多通信工業	500	2,430.00	1,215,000	
船井電機	1,200	915.00	1,098,000	
横河電機	11,400	2,189.00	24,954,600	
新電元工業	400	7,640.00	3,056,000	
アズビル	3,400	5,190.00	17,646,000	
東亜ディーケーケー	600	866.00	519,600	
日本光電工業	4,800	2,605.00	12,504,000	
チノー	400	1,334.00	533,600	
共和電業	1,300	451.00	586,300	
日本電子材料	500	625.00	312,500	
堀場製作所	2,200	6,880.00	15,136,000	
アドバンテスト	6,300	2,649.00	16,688,700	
小野測器	500	747.00	373,500	
エスペック	1,000	2,615.00	2,615,000	
キーエンス	5,600	64,000.00	358,400,000	
日置電機	600	2,494.00	1,496,400	
シスメックス	8,800	7,860.00	69,168,000	
日本マイクロニクス	2,000	1,139.00	2,278,000	
メガチップス	900	3,550.00	3,195,000	
O B A R A G R O U P	700	6,390.00	4,473,000	
澤藤電機	100	2,756.00	275,600	

コーセル	1,600	1,520.00	2,432,000	
イリソ電子工業	900	6,750.00	6,075,000	
新日本無線	700	921.00	644,700	
オブテックスグループ	900	4,820.00	4,338,000	
千代田インテグレ	600	2,744.00	1,646,400	
アイ・オー・データ機器	500	1,121.00	560,500	
レーザーテック	2,500	2,561.00	6,402,500	
スタンレー電気	8,800	4,360.00	38,368,000	
岩崎電気	500	1,832.00	916,000	
ウシオ電機	6,900	1,634.00	11,274,600	
岡谷電機産業	600	509.00	305,400	
ヘリオス テクノ ホールディング	900	789.00	710,100	
日本セラミック	1,200	3,300.00	3,960,000	
遠藤照明	600	1,306.00	783,600	
古河電池	800	1,124.00	899,200	
双信電機	500	853.00	426,500	
山一電機	700	2,343.00	1,640,100	
図研	800	1,950.00	1,560,000	
日本電子	4,000	594.00	2,376,000	
カシオ計算機	9,100	1,657.00	15,078,700	
ファナック	10,800	27,315.00	295,002,000	
日本シイエムケイ	2,000	1,198.00	2,396,000	
エンプラス	500	4,650.00	2,325,000	
大真空	400	1,908.00	763,200	
ローム	5,100	11,410.00	58,191,000	
浜松ホトニクス	8,400	3,740.00	31,416,000	
三井ハイテック	1,500	2,388.00	3,582,000	
新光電気工業	4,200	883.00	3,708,600	
京セラ	18,600	7,799.00	145,061,400	
太陽誘電	5,200	1,994.00	10,368,800	
村田製作所	11,800	16,290.00	192,222,000	
ユーシン	1,600	774.00	1,238,400	
双葉電子工業	1,900	2,257.00	4,288,300	
北陸電気工業	300	1,590.00	477,000	
ニチコン	3,500	1,579.00	5,526,500	
日本ケミコン	900	4,245.00	3,820,500	

K O A	1,500	2,393.00	3,589,500	
市光工業	1,700	850.00	1,445,000	
小糸製作所	6,800	7,760.00	52,768,000	
ミツバ	2,100	1,933.00	4,059,300	
S C R E E Nホールディングス	2,200	10,280.00	22,616,000	
キャノン電子	1,100	2,614.00	2,875,400	
キャノン	61,000	4,274.00	260,714,000	代用有価証券 10,000株
リコー	34,100	992.00	33,827,200	
M U T O Hホールディングス	200	2,563.00	512,600	
東京エレクトロン	7,600	22,315.00	169,594,000	
トヨタ紡織	3,200	2,171.00	6,947,200	
芦森工業	300	3,095.00	928,500	
ユニプレス	2,200	3,080.00	6,776,000	
豊田自動織機	9,200	6,960.00	64,032,000	
モリタホールディングス	1,700	2,017.00	3,428,900	
三櫻工業	1,400	989.00	1,384,600	
デンソー	25,100	6,362.00	159,686,200	
東海理化電機製作所	2,900	2,408.00	6,983,200	
三井造船	4,000	1,539.00	6,156,000	
川崎重工業	8,800	3,900.00	34,320,000	
名村造船所	3,400	714.00	2,427,600	
サノヤスホールディングス	1,400	293.00	410,200	
日本車輛製造	4,000	325.00	1,300,000	
三菱ロジスネクスト	1,300	1,014.00	1,318,200	
近畿車輛	200	2,694.00	538,800	
日産自動車	133,900	1,108.50	148,428,150	
いすゞ自動車	32,900	1,731.00	56,949,900	
トヨタ自動車	137,900	7,169.00	988,605,100	代用有価証券 35,000株
日野自動車	16,200	1,372.00	22,226,400	
三菱自動車工業	42,000	898.00	37,716,000	
エフテック	700	1,817.00	1,271,900	
レシップホールディングス	400	944.00	377,600	
G M B	200	2,102.00	420,400	
ファルテック	200	1,396.00	279,200	
武蔵精密工業	1,200	3,810.00	4,572,000	

日産車体	4,400	1,203.00	5,293,200
新明和工業	4,900	1,136.00	5,566,400
極東開発工業	2,100	2,047.00	4,298,700
日信工業	2,300	2,268.00	5,216,400
トビー工業	1,000	3,465.00	3,465,000
ティラド	400	4,660.00	1,864,000
曙ブレーキ工業	5,200	381.00	1,981,200
タチエス	2,000	2,125.00	4,250,000
N O K	6,100	2,808.00	17,128,800
フタバ産業	3,500	1,037.00	3,629,500
K Y B	1,200	6,860.00	8,232,000
大同メタル工業	1,400	1,031.00	1,443,400
プレス工業	6,000	632.00	3,792,000
ミクニ	1,500	585.00	877,500
太平洋工業	2,400	1,452.00	3,484,800
ケーヒン	2,600	2,176.00	5,657,600
河西工業	1,400	1,730.00	2,422,000
アイシン精機	9,400	5,650.00	53,110,000
富士機工	1,100	738.00	811,800
マツダ	35,700	1,582.00	56,477,400
今仙電機製作所	1,000	1,426.00	1,426,000
本田技研工業	102,100	3,829.00	390,940,900
スズキ	22,500	6,315.00	142,087,500
S U B A R U	35,200	3,811.00	134,147,200
安永	600	3,080.00	1,848,000
ヤマハ発動機	16,000	3,580.00	57,280,000
ショーワ	3,000	1,362.00	4,086,000
T B K	1,400	524.00	733,600
エクセディ	1,400	3,440.00	4,816,000
豊田合成	4,100	2,789.00	11,434,900
愛三工業	1,900	1,301.00	2,471,900
盟和産業	200	1,325.00	265,000
ヨロズ	1,200	2,283.00	2,739,600
エフ・シー・シー	1,800	2,858.00	5,144,400
シマノ	4,500	15,180.00	68,310,000
テイ・エス テック	2,600	4,530.00	11,778,000

ジャムコ	600	2,388.00	1,432,800
テルモ	17,500	4,775.00	83,562,500
クリエートメディック	400	1,128.00	451,200
日機装	4,000	1,060.00	4,240,000
島津製作所	13,600	2,451.00	33,333,600
JMS	1,100	696.00	765,600
長野計器	900	1,279.00	1,151,100
ブイ・テクノロジー	300	19,450.00	5,835,000
東京計器	700	1,535.00	1,074,500
愛知時計電機	100	4,465.00	446,500
インターアクション	400	779.00	311,600
オーバル	1,100	346.00	380,600
東京精密	2,100	4,675.00	9,817,500
マニー	1,400	3,205.00	4,487,000
ニコン	19,700	2,197.00	43,280,900
トプコン	6,100	2,317.00	14,133,700
オリンパス	16,900	4,290.00	72,501,000
理研計器	1,100	2,458.00	2,703,800
タムロン	900	2,448.00	2,203,200
HOYA	23,400	6,275.00	146,835,000
シード	100	3,785.00	378,500
ノーリツ鋼機	1,100	1,754.00	1,929,400
エー・アンド・デイ	900	534.00	480,600
シチズン時計	13,600	834.00	11,342,400
リズム時計工業	400	2,359.00	943,600
大研医器	1,000	775.00	775,000
メニコン	800	5,150.00	4,120,000
松風	600	1,403.00	841,800
セイコーホールディングス	1,800	2,790.00	5,022,000
ニプロ	7,900	1,643.00	12,979,700
中本パックス	100	3,690.00	369,000
スノーピーク	200	3,045.00	609,000
パラマウントベッドホールディングス	1,200	5,310.00	6,372,000
トランザクション	500	1,127.00	563,500
SHO-BI	400	451.00	180,400
ニホンフラッシュ	500	2,033.00	1,016,500



前田工織	1,100	2,120.00	2,332,000	
永大産業	2,000	566.00	1,132,000	
アートネイチャー	1,200	770.00	924,000	
ダンロップスポーツ	700	1,691.00	1,183,700	
バンダイナムコホールディングス	11,700	3,930.00	45,981,000	
アイフィスジャパン	300	602.00	180,600	
共立印刷	1,900	354.00	672,600	
S H O E I	500	3,940.00	1,970,000	
フランスベッドホールディングス	1,200	1,083.00	1,299,600	
パイロットコーポレーション	2,000	5,800.00	11,600,000	
萩原工業	600	1,856.00	1,113,600	
トッパン・フォームズ	2,400	1,234.00	2,961,600	
フジシールインターナショナル	2,600	3,735.00	9,711,000	
タカラトミー	4,800	1,903.00	9,134,400	
廣済堂	900	509.00	458,100	
A s - m e エステール	400	740.00	296,000	
アーク	4,700	112.00	526,400	
タカノ	500	1,187.00	593,500	
プロネクサス	1,100	1,356.00	1,491,600	
ホクシン	800	214.00	171,200	
ウッドワン	400	1,704.00	681,600	
大建工業	900	3,035.00	2,731,500	
凸版印刷	32,000	1,157.00	37,024,000	
大日本印刷	14,900	2,791.00	41,585,900	
図書印刷	800	1,123.00	898,400	
共同印刷	300	3,700.00	1,110,000	
N I S S H A	2,200	3,625.00	7,975,000	
光村印刷	100	2,380.00	238,000	
宝印刷	600	1,780.00	1,068,000	
アシックス	11,300	1,600.00	18,080,000	
ツツミ	400	1,982.00	792,800	
小松ウオール工業	400	2,185.00	874,000	
ヤマハ	7,700	4,055.00	31,223,500	
河合楽器製作所	400	2,342.00	936,800	
クリナップ	1,100	859.00	944,900	
ピジョン	6,900	4,030.00	27,807,000	

兼松サステック	100	2,269.00	226,900	
キングジム	1,000	1,029.00	1,029,000	
リンテック	2,700	3,170.00	8,559,000	
イトーキ	2,400	875.00	2,100,000	
任天堂	7,000	42,520.00	297,640,000	
三菱鉛筆	1,900	2,644.00	5,023,600	
タカラスタンダード	2,400	1,855.00	4,452,000	
コクヨ	5,500	2,150.00	11,825,000	
ナカバヤシ	1,100	720.00	792,000	
岡村製作所	3,900	1,497.00	5,838,300	
美津濃	1,100	3,180.00	3,498,000	
東京電力ホールディングス	90,500	469.00	42,444,500	
中部電力	34,600	1,484.50	51,363,700	
関西電力	46,300	1,562.00	72,320,600	
中国電力	15,700	1,313.00	20,614,100	
北陸電力	11,100	1,035.00	11,488,500	
東北電力	26,500	1,510.00	40,015,000	
四国電力	10,200	1,493.00	15,228,600	
九州電力	25,100	1,312.00	32,931,200	
北海道電力	11,400	876.00	9,986,400	
沖縄電力	1,800	2,888.00	5,198,400	
電源開発	9,000	3,285.00	29,565,000	
エフオン	600	1,520.00	912,000	
イーレックス	1,800	1,092.00	1,965,600	
東京瓦斯	24,200	2,763.50	66,876,700	
大阪瓦斯	22,100	2,213.50	48,918,350	
東邦瓦斯	5,700	3,240.00	18,468,000	
北海道瓦斯	3,000	292.00	876,000	
広島ガス	2,400	366.00	878,400	
西部瓦斯	1,400	2,821.00	3,949,400	
静岡ガス	3,300	891.00	2,940,300	
メタウォーター	700	2,870.00	2,009,000	
SBSホールディングス	1,100	890.00	979,000	
東武鉄道	12,100	3,450.00	41,745,000	
相鉄ホールディングス	3,700	2,984.00	11,040,800	
東京急行電鉄	30,900	1,741.00	53,796,900	

京浜急行電鉄	15,600	2,345.00	36,582,000	
小田急電鉄	16,900	2,274.00	38,430,600	
京王電鉄	6,400	4,930.00	31,552,000	
京成電鉄	7,900	3,395.00	26,820,500	
富士急行	1,600	2,834.00	4,534,400	
東日本旅客鉄道	20,400	11,160.00	227,664,000	
西日本旅客鉄道	10,200	8,142.00	83,048,400	
東海旅客鉄道	10,100	20,880.00	210,888,000	
西武ホールディングス	14,500	2,098.00	30,421,000	
鴻池運輸	1,600	1,774.00	2,838,400	
西日本鉄道	3,200	3,015.00	9,648,000	
ハマキョウレックス	800	3,185.00	2,548,000	
サカイ引越センター	600	6,310.00	3,786,000	
近鉄グループホールディングス	10,700	4,350.00	46,545,000	
阪急阪神ホールディングス	14,400	4,445.00	64,008,000	
南海電気鉄道	5,100	2,851.00	14,540,100	
京阪ホールディングス	4,700	3,400.00	15,980,000	
神戸電鉄	300	3,815.00	1,144,500	
名古屋鉄道	8,300	2,581.00	21,422,300	
山陽電気鉄道	800	2,883.00	2,306,400	
日本通運	4,300	7,000.00	30,100,000	
ヤマトホールディングス	18,900	2,254.50	42,610,050	
山九	2,700	4,530.00	12,231,000	
丸運	600	331.00	198,600	
丸全昭和運輸	4,000	534.00	2,136,000	
センコーグループホールディングス	6,400	801.00	5,126,400	
トナミホールディングス	300	5,430.00	1,629,000	
ニッコンホールディングス	4,100	2,904.00	11,906,400	
日本石油輸送	100	3,700.00	370,000	
福山通運	1,500	3,795.00	5,692,500	
セイノーホールディングス	8,100	1,639.00	13,275,900	
神奈川中央交通	300	3,760.00	1,128,000	
日立物流	2,400	2,730.00	6,552,000	
丸和運輸機関	600	2,309.00	1,385,400	
C & F ロジホールディングス	1,200	1,440.00	1,728,000	
九州旅客鉄道	9,100	3,630.00	33,033,000	

日本郵船	9,000	2,631.00	23,679,000	
商船三井	6,900	3,640.00	25,116,000	
川崎汽船	5,000	2,931.00	14,655,000	
N Sユナイテッド海運	500	2,770.00	1,385,000	
明治海運	1,000	463.00	463,000	
飯野海運	5,400	608.00	3,283,200	
共栄タンカー	100	2,239.00	223,900	
乾汽船	900	822.00	739,800	
日本航空	19,900	4,028.00	80,157,200	
A N Aホールディングス	21,000	4,434.00	93,114,000	
パスコ	1,000	346.00	346,000	
ランコム	300	6,910.00	2,073,000	
日新	900	3,135.00	2,821,500	
三菱倉庫	3,800	3,045.00	11,571,000	
三井倉庫ホールディングス	6,000	351.00	2,106,000	
住友倉庫	7,000	783.00	5,481,000	
澁澤倉庫	600	2,112.00	1,267,200	
東陽倉庫	2,000	336.00	672,000	
日本トランスシティ	3,000	497.00	1,491,000	
ケイヒン	200	1,688.00	337,600	
中央倉庫	700	1,287.00	900,900	
川西倉庫	200	2,810.00	562,000	
安田倉庫	1,000	934.00	934,000	
東洋埠頭	300	1,898.00	569,400	
宇徳	900	504.00	453,600	
上組	6,700	2,748.00	18,411,600	
サンリツ	300	813.00	243,900	
キムラユニティー	300	1,182.00	354,600	
キューソー流通システム	300	3,195.00	958,500	
郵船ロジスティクス	1,100	1,497.00	1,646,700	
近鉄エクスプレス	2,100	1,995.00	4,189,500	
東海運	600	414.00	248,400	
エーアイティー	800	1,377.00	1,101,600	
内外トランスライン	400	1,729.00	691,600	
日本コンセプト	200	1,270.00	254,000	
N E C ネットエスアイ	1,100	3,040.00	3,344,000	

システナ	900	3,550.00	3,195,000
デジタルアーツ	600	4,630.00	2,778,000
新日鉄住金ソリューションズ	1,700	2,746.00	4,668,200
キューブシステム	600	838.00	502,800
コア	500	1,640.00	820,000
ソフトクリエイトホールディングス	600	1,605.00	963,000
T I S	3,700	3,735.00	13,819,500
ネオス	300	448.00	134,400
電算システム	400	2,078.00	831,200
グリー	6,900	756.00	5,216,400
コーエーテクモホールディングス	1,900	2,236.00	4,248,400
三菱総合研究所	500	3,570.00	1,785,000
ボルテージ	200	1,015.00	203,000
電算	100	2,429.00	242,900
A G S	600	956.00	573,600
ファインデックス	900	798.00	718,200
ヒト・コミュニケーションズ	300	1,951.00	585,300
ブレインパッド	300	1,242.00	372,600
K L a b	2,100	2,004.00	4,208,400
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	800	1,740.00	1,392,000
イーブックイニシアティブジャパン	200	1,138.00	227,600
ネクソン	12,500	3,215.00	40,187,500
アイスタイル	2,500	770.00	1,925,000
エムアップ	400	1,344.00	537,600
エイチーム	700	2,932.00	2,052,400
テクノスジャパン	1,000	993.00	993,000
e n i s h	400	1,703.00	681,200
コロプラ	3,600	1,317.00	4,741,200
モバイルクリエイト	900	369.00	332,100
オルトプラス	600	973.00	583,800
ブロードリーフ	2,700	916.00	2,473,200
ハーツユナイテッドグループ	600	1,635.00	981,000
メディアドゥホールディングス	400	2,549.00	1,019,600
ブイキューブ	700	581.00	406,700
サイバーリンクス	200	1,439.00	287,800

ディー・エル・イー	400	417.00	166,800
フィックスターズ	200	4,095.00	819,000
VOYAGE GROUP	600	1,408.00	844,800
オブティム	200	2,648.00	529,600
セレス	400	1,278.00	511,200
ベリサーブ	200	3,720.00	744,000
ティーガイア	1,100	2,256.00	2,481,600
セック	100	2,460.00	246,000
日本アジアグループ	1,200	465.00	558,000
豆蔵ホールディングス	800	1,257.00	1,005,600
テクマトリックス	600	1,512.00	907,200
プロシップ	200	2,430.00	486,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	30,200	330.00	9,966,000
GMOペイメントゲートウェイ	800	8,170.00	6,536,000
ザッパラス	600	430.00	258,000
システムリサーチ	100	2,273.00	227,300
インターネットイニシアティブ	1,800	2,311.00	4,159,800
さくらインターネット	1,300	854.00	1,110,200
GMOクラウド	300	2,942.00	882,600
SRAホールディングス	600	3,280.00	1,968,000
Minor iソリューションズ	200	1,332.00	266,400
システムインテグレータ	200	868.00	173,600
朝日ネット	1,000	545.00	545,000
アドソル日進	400	1,193.00	477,200
フリービット	800	903.00	722,400
コムチュア	600	2,435.00	1,461,000
サイバーコム	200	1,020.00	204,000
メディカル・データ・ビジョン	400	2,038.00	815,200
gumi	1,300	1,102.00	1,432,600
ショーケース・ティービー	200	1,594.00	318,800
モバイルファクトリー	200	1,348.00	269,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	100	2,063.00	206,300
PCIホールディングス	200	3,330.00	666,000
パイプドHD	200	1,171.00	234,200
アイビーシー	100	954.00	95,400

オーブンドア	200	5,060.00	1,012,000	
アカツキ	200	9,260.00	1,852,000	
L I N E	3,100	4,795.00	14,864,500	
シンクロ・フード	100	1,753.00	175,300	
オークネット	400	1,473.00	589,200	
A O I T Y O H o l d i n g s	900	1,208.00	1,087,200	
マクロミル	1,400	3,225.00	4,515,000	
ソルクシーズ	400	831.00	332,400	
フェイス	400	1,319.00	527,600	
ハイマックス	100	1,656.00	165,600	
野村総合研究所	7,500	4,975.00	37,312,500	
サイバネットシステム	900	760.00	684,000	
C E ホールディングス	300	712.00	213,600	
日本システム技術	200	1,438.00	287,600	
インテージホールディングス	1,300	1,452.00	1,887,600	
東邦システムサイエンス	400	809.00	323,600	
ソースネクスト	800	682.00	545,600	
フォーカスシステムズ	700	949.00	664,300	
クレスコ	300	4,570.00	1,371,000	
フジ・メディア・ホールディングス	11,700	1,692.00	19,796,400	
オービック	3,500	7,650.00	26,775,000	
ジャストシステム	1,800	2,484.00	4,471,200	
T D C ソフト	500	1,126.00	563,000	
ヤフー	80,300	508.00	40,792,400	
トレンドマイクロ	5,500	6,090.00	33,495,000	
インフォメーション・ディベロプメント	400	1,246.00	498,400	
日本オラクル	1,800	9,650.00	17,370,000	
アルファシステムズ	400	2,426.00	970,400	
フューチャー	1,500	1,136.00	1,704,000	
C A C H o l d i n g s	900	1,139.00	1,025,100	
ソフトバンク・テクノロジー	400	2,057.00	822,800	
トーセ	300	3,245.00	973,500	
オービックビジネスコンサルタント	600	5,730.00	3,438,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	2,600	4,795.00	12,467,000	
アイティフォー	1,400	670.00	938,000	
東計電算	200	3,430.00	686,000	

エクスネット	200	909.00	181,800
大塚商会	3,400	8,210.00	27,914,000
サイボウズ	1,500	514.00	771,000
ソフトブレーン	900	407.00	366,300
電通国際情報サービス	700	2,325.00	1,627,500
デジタルガレージ	2,000	2,401.00	4,802,000
E Mシステムズ	400	2,134.00	853,600
ウェザーニューズ	400	3,695.00	1,478,000
C I J	1,000	716.00	716,000
東洋ビジネスエンジニアリング	100	1,779.00	177,900
日本エンタープライズ	1,200	255.00	306,000
WOWOW	500	3,365.00	1,682,500
スカラ	800	781.00	624,800
イマジカ・ロボット ホールディングス	900	910.00	819,000
ネットワンシステムズ	4,500	1,478.00	6,651,000
システムソフト	2,700	145.00	391,500
アルゴグラフィックス	500	3,445.00	1,722,500
マーベラス	1,900	1,103.00	2,095,700
エイベックス	2,000	1,437.00	2,874,000
日本ユニシス	3,100	1,922.00	5,958,200
兼松エレクトロニクス	700	3,470.00	2,429,000
東京放送ホールディングス	6,800	2,452.00	16,673,600
日本テレビホールディングス	10,200	2,024.00	20,644,800
朝日放送	1,100	917.00	1,008,700
テレビ朝日ホールディングス	3,000	2,287.00	6,861,000
スカパー J S A Tホールディングス	8,600	514.00	4,420,400
テレビ東京ホールディングス	900	2,487.00	2,238,300
日本BS放送	400	1,293.00	517,200
ビジョン	300	2,709.00	812,700
U - N E X T	300	1,127.00	338,100
ワイヤレスゲート	500	1,263.00	631,500
コネクシオ	800	2,101.00	1,680,800
日本通信	9,700	130.00	1,261,000
クロップス	300	1,060.00	318,000
日本電信電話	79,900	5,635.00	450,236,500
K D D I	100,200	3,107.00	311,321,400



光通信	1,300	14,730.00	19,149,000
NTTドコモ	82,400	2,778.00	228,907,200
エムティーアイ	1,500	689.00	1,033,500
GMOインターネット	4,100	1,708.00	7,002,800
アイドママーケティングコミュニケーション	200	682.00	136,400
カドカワ	3,300	1,296.00	4,276,800
学研ホールディングス	400	3,210.00	1,284,000
ゼンリン	1,400	3,680.00	5,152,000
昭文社	500	754.00	377,000
インプレスホールディングス	1,000	152.00	152,000
アイネット	600	1,788.00	1,072,800
松竹	700	17,320.00	12,124,000
東宝	7,300	3,755.00	27,411,500
東映	400	12,060.00	4,824,000
エヌ・ティ・ティ・データ	34,600	1,349.00	46,675,400
ピー・シー・エー	200	1,809.00	361,800
ビジネスブレイン太田昭和	200	1,601.00	320,200
D T S	1,100	4,120.00	4,532,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,200	4,980.00	25,896,000
シーイーシー	700	2,662.00	1,863,400
カプコン	2,400	2,886.00	6,926,400
アイ・エス・ピー	200	1,323.00	264,600
ジャステック	700	1,342.00	939,400
S C S K	2,700	4,725.00	12,757,500
日本システムウエア	400	2,500.00	1,000,000
アイネス	1,400	1,059.00	1,482,600
T K C	1,000	3,790.00	3,790,000
富士ソフト	1,500	3,505.00	5,257,500
N S D	1,900	2,391.00	4,542,900
コナミホールディングス	4,500	5,980.00	26,910,000
福井コンピュータホールディングス	300	2,824.00	847,200
J B C Cホールディングス	800	1,014.00	811,200
ミロク情報サービス	1,000	2,893.00	2,893,000
ソフトバンクグループ	50,400	9,945.00	501,228,000
ハウスイ	100	1,235.00	123,500
高千穂交易	500	1,158.00	579,000

伊藤忠食品	300	5,360.00	1,608,000
エレマテック	500	2,658.00	1,329,000
JALUX	200	2,838.00	567,600
あらた	500	5,570.00	2,785,000
トーメンデバイス	100	3,390.00	339,000
東京エレクトロン デバイス	400	2,046.00	818,400
フィールズ	900	1,091.00	981,900
双日	66,100	333.00	22,011,300
アルフレッサ ホールディングス	12,400	2,205.00	27,342,000
横浜冷凍	2,700	1,085.00	2,929,500
神栄	200	1,622.00	324,400
山下医科器械	100	1,733.00	173,300
ラサ商事	500	1,121.00	560,500
ラクーン	600	627.00	376,200
アルコニックス	1,200	1,942.00	2,330,400
神戸物産	700	4,785.00	3,349,500
ペッパーフードサービス	600	7,060.00	4,236,000
あい ホールディングス	1,600	2,835.00	4,536,000
ディーブイエックス	400	1,317.00	526,800
ダイワボウホールディングス	900	4,445.00	4,000,500
マクニカ・富士エレホールディングス	2,000	2,251.00	4,502,000
ラクト・ジャパン	200	3,975.00	795,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,100	924.00	1,940,400
八洲電機	900	1,042.00	937,800
メディアスホールディングス	200	2,829.00	565,800
UKCホールディングス	700	1,939.00	1,357,300
ジューテックホールディングス	300	1,729.00	518,700
大光	300	1,053.00	315,900
OCHIホールディングス	300	1,419.00	425,700
TOKAIホールディングス	6,000	887.00	5,322,000
大阪工機	200	1,138.00	227,600
三洋貿易	600	2,824.00	1,694,400
ビューティガレージ	200	1,851.00	370,200
ウイン・パートナーズ	800	1,422.00	1,137,600
ミタチ産業	300	1,482.00	444,600
シップヘルスケアホールディングス	2,400	3,590.00	8,616,000

明治電機工業	400	1,794.00	717,600	
デリカフーズホールディングス	200	1,505.00	301,000	
スターティア	200	642.00	128,400	
コメダホールディングス	2,000	1,933.00	3,866,000	
富士興産	500	607.00	303,500	
協栄産業	200	2,378.00	475,600	
小野建	1,000	1,952.00	1,952,000	
佐島電機	800	1,040.00	832,000	
エコートレーディング	300	708.00	212,400	
伯東	700	1,732.00	1,212,400	
コンドーテック	900	1,191.00	1,071,900	
中山福	700	767.00	536,900	
ナガイレーベン	1,500	2,789.00	4,183,500	
三菱食品	1,200	3,330.00	3,996,000	
松田産業	800	1,654.00	1,323,200	
第一興商	1,700	5,390.00	9,163,000	
メディバルホールディングス	11,200	2,235.00	25,032,000	
S P K	300	3,255.00	976,500	
萩原電気	400	3,620.00	1,448,000	
アズワン	900	6,240.00	5,616,000	
スズデン	400	1,449.00	579,600	
シモジマ	700	1,162.00	813,400	
ドウシシャ	1,200	2,357.00	2,828,400	
小津産業	300	2,228.00	668,400	
高速	600	1,321.00	792,600	
たけびし	400	1,646.00	658,400	
黒田電気	1,400	2,709.00	3,792,600	
リックス	200	1,939.00	387,800	
丸文	1,000	986.00	986,000	
ハビネット	700	2,026.00	1,418,200	
橋本総業ホールディングス	300	1,740.00	522,000	
日本ライフライン	1,600	4,520.00	7,232,000	
エクセル	500	2,566.00	1,283,000	
マルカキカイ	400	2,222.00	888,800	
I D O M	3,400	820.00	2,788,000	
日本エム・ディ・エム	800	898.00	718,400	

進和	700	2,638.00	1,846,600	
エスケイジャパン	300	358.00	107,400	
ダイترون	500	2,368.00	1,184,000	
シークス	700	4,910.00	3,437,000	
田中商事	400	770.00	308,000	
オーハシテクニカ	600	1,698.00	1,018,800	
白銅	400	2,282.00	912,800	
伊藤忠商事	82,000	2,007.50	164,615,000	
丸紅	91,700	786.40	72,112,880	
高島	200	2,257.00	451,400	
長瀬産業	6,700	2,171.00	14,545,700	
蝶理	700	2,071.00	1,449,700	
豊田通商	12,500	4,295.00	53,687,500	
三共生興	1,900	479.00	910,100	
兼松	4,700	1,458.00	6,852,600	
ツカモトコーポレーション	200	1,296.00	259,200	
三井物産	94,900	1,681.50	159,574,350	
日本紙パルプ商事	600	4,765.00	2,859,000	
日立ハイテクノロジーズ	3,800	4,955.00	18,829,000	
カメイ	1,400	1,965.00	2,751,000	
東都水産	200	2,071.00	414,200	
OUGホールディングス	200	2,741.00	548,200	
スターゼン	400	5,870.00	2,348,000	
山善	4,300	1,346.00	5,787,800	
椿本興業	300	2,887.00	866,100	
住友商事	70,600	1,740.00	122,844,000	
内田洋行	500	3,505.00	1,752,500	
三菱商事	78,400	2,789.50	218,696,800	
第一実業	500	3,575.00	1,787,500	
キャノンマーケティングジャパン	3,200	2,899.00	9,276,800	
西華産業	700	2,932.00	2,052,400	
佐藤商事	1,000	1,200.00	1,200,000	
菱洋エレクトロ	1,100	2,144.00	2,358,400	
東京産業	1,000	538.00	538,000	
ユアサ商事	1,100	4,055.00	4,460,500	
神鋼商事	300	3,175.00	952,500	

小林産業	800	380.00	304,000	
阪和興業	2,100	4,345.00	9,124,500	
正栄食品工業	600	4,560.00	2,736,000	
カナデン	1,000	1,326.00	1,326,000	
菱電商事	800	1,745.00	1,396,000	
フルサト工業	600	1,819.00	1,091,400	
岩谷産業	2,500	3,525.00	8,812,500	
すてきナイスグループ	500	1,598.00	799,000	
昭光通商	4,000	119.00	476,000	
ニチモウ	200	2,028.00	405,600	
極東貿易	2,000	402.00	804,000	
イワキ	1,000	487.00	487,000	
三愛石油	2,900	1,353.00	3,923,700	
稲畑産業	2,600	1,660.00	4,316,000	
G S Iクレオス	300	1,812.00	543,600	
明和産業	1,000	533.00	533,000	
ワキタ	2,400	1,407.00	3,376,800	
東邦ホールディングス	3,200	2,272.00	7,270,400	
サンゲツ	3,700	2,042.00	7,555,400	
ミツウロコグループホールディングス	1,600	835.00	1,336,000	
シナネンホールディングス	500	2,493.00	1,246,500	
伊藤忠エネクス	2,400	1,158.00	2,779,200	
サンリオ	3,200	1,808.00	5,785,600	
サンワテクノス	700	2,044.00	1,430,800	
リョーサン	1,400	4,355.00	6,097,000	
新光商事	1,200	2,044.00	2,452,800	
トーホー	500	2,840.00	1,420,000	
三信電気	1,100	1,764.00	1,940,400	
東陽テクニカ	1,300	1,010.00	1,313,000	
モスフードサービス	1,500	3,490.00	5,235,000	
加賀電子	1,000	3,430.00	3,430,000	
ソーダニッカ	1,200	582.00	698,400	
立花エレテック	800	1,924.00	1,539,200	
フォーバル	500	751.00	375,500	
P A L T A C	1,600	4,650.00	7,440,000	
三谷産業	1,100	428.00	470,800	

太平洋興発	500	1,009.00	504,500	
西本Wismettacホールディングス	200	4,415.00	883,000	
ヤマタネ	600	2,095.00	1,257,000	
丸紅建材リース	1,000	246.00	246,000	
日鉄住金物産	900	5,880.00	5,292,000	
トラスコ中山	2,300	3,215.00	7,394,500	
オートバックスセブン	4,500	2,028.00	9,126,000	
モリト	900	1,086.00	977,400	
加藤産業	1,800	3,560.00	6,408,000	
イノテック	1,000	994.00	994,000	
イエローハット	1,100	3,325.00	3,657,500	
J Kホールディングス	1,100	890.00	979,000	
日伝	900	2,416.00	2,174,400	
北沢産業	1,000	232.00	232,000	
杉本商事	600	1,735.00	1,041,000	
因幡電機産業	1,500	5,110.00	7,665,000	
バイテックホールディングス	500	1,982.00	991,000	
ミスミグループ本社	13,000	3,205.00	41,665,000	
アルテック	1,000	307.00	307,000	
タキヒヨー	400	2,361.00	944,400	
蔵王産業	200	1,752.00	350,400	
スズケン	5,100	4,065.00	20,731,500	
ジェコス	800	1,275.00	1,020,000	
ルネサスイーストン	1,100	718.00	789,800	
ローソン	2,800	7,350.00	20,580,000	
サンエー	800	5,130.00	4,104,000	
カワチ薬品	900	2,806.00	2,525,400	
エービーシー・マート	2,000	5,690.00	11,380,000	
ハードオフコーポレーション	500	1,155.00	577,500	
アスクル	1,200	3,020.00	3,624,000	
ゲオホールディングス	2,100	1,819.00	3,819,900	
アダストリア	1,700	2,410.00	4,097,000	
ジーフット	700	766.00	536,200	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	100	714.00	71,400	
くらコーポレーション	600	5,060.00	3,036,000	
キャンドウ	500	1,807.00	903,500	

パルグループホールディングス	600	3,205.00	1,923,000	
エディオン	4,400	1,127.00	4,958,800	
サーラコーポレーション	1,900	741.00	1,407,900	
ワッツ	500	1,168.00	584,000	
ハローズ	400	2,580.00	1,032,000	
あみやき亭	200	5,510.00	1,102,000	
ひらまつ	1,600	630.00	1,008,000	
ゲンキー	500	4,110.00	2,055,000	
大黒天物産	300	5,210.00	1,563,000	
ハニーズホールディングス	1,100	1,191.00	1,310,100	
ファーマライズホールディングス	300	644.00	193,200	
アルペン	900	2,291.00	2,061,900	
クオール	1,200	2,300.00	2,760,000	
ジーンズ	700	5,870.00	4,109,000	
ビックカメラ	6,400	1,417.00	9,068,800	
D C Mホールディングス	6,100	1,049.00	6,398,900	
MonotaRO	4,000	3,000.00	12,000,000	
東京一番フーズ	300	619.00	185,700	
D Dホールディングス	200	4,565.00	913,000	
きちり	300	741.00	222,300	
アークランドサービスホールディングス	1,000	2,501.00	2,501,000	
J . フロント リテイリング	13,400	1,711.00	22,927,400	
ドトール・日レスホールディングス	1,900	2,707.00	5,143,300	
マツモトキヨシホールディングス	2,300	8,380.00	19,274,000	
ブロンコビリー	600	2,914.00	1,748,400	
スタートトゥデイ	11,100	3,160.00	35,076,000	
トレジャー・ファクトリー	300	947.00	284,100	
物語コーポレーション	300	8,130.00	2,439,000	
ココカラファイン	1,100	6,690.00	7,359,000	
三越伊勢丹ホールディングス	20,900	1,223.00	25,560,700	
H a m e e	300	1,576.00	472,800	
ウエルシアホールディングス	3,000	4,320.00	12,960,000	
クリエイトSDホールディングス	1,700	2,850.00	4,845,000	
丸善C H Iホールディングス	1,300	349.00	453,700	
ミサワ	200	510.00	102,000	
ティーライフ	100	1,414.00	141,400	

エー・ピーカンパニー	200	812.00	162,400	
チムニー	400	2,866.00	1,146,400	
シュッピン	400	2,593.00	1,037,200	
ネクステージ	400	2,571.00	1,028,400	
ジョイフル本田	1,800	3,295.00	5,931,000	
鳥貴族	400	3,095.00	1,238,000	
キリン堂ホールディングス	400	1,436.00	574,400	
ホットランド	700	1,427.00	998,900	
すかいらーく	7,000	1,726.00	12,082,000	
綿半ホールディングス	400	2,554.00	1,021,600	
ヨシックス	200	2,711.00	542,200	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3,800	1,071.00	4,069,800	
ブックオフコーポレーション	600	819.00	491,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	500	1,057.00	528,500	
B E E N O S	200	1,460.00	292,000	
あさひ	800	1,425.00	1,140,000	
日本調剤	400	3,775.00	1,510,000	
コスモス薬品	500	23,560.00	11,780,000	
トーエル	500	958.00	479,000	
一六堂	300	456.00	136,800	
オンリー	200	907.00	181,400	
セブン&アイ・ホールディングス	46,900	4,593.00	215,411,700	
薬王堂	500	3,185.00	1,592,500	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	3,000	1,230.00	3,690,000	
ツルハホールディングス	2,300	13,950.00	32,085,000	
サンマルクホールディングス	800	3,485.00	2,788,000	
フェリシモ	300	1,340.00	402,000	
トリドールホールディングス	1,400	3,705.00	5,187,000	
T O K Y O B A S E	200	4,880.00	976,000	
サツドラホールディングス	200	2,033.00	406,600	
ダイユー・リックホールディングス	500	1,034.00	517,000	
パロックジャパンリミテッド	900	965.00	868,500	
クスリのアオキホールディングス	900	6,320.00	5,688,000	
スシローグローバルホールディングス	1,000	3,535.00	3,535,000	
L I X I L ビバ	1,100	1,808.00	1,988,800	



メディカルシステムネットワーク	1,300	533.00	692,900
総合メディカル	500	6,100.00	3,050,000
はるやまホールディングス	500	1,017.00	508,500
ノジマ	1,900	2,317.00	4,402,300
カッパ・クリエイト	1,400	1,255.00	1,757,000
ライトオン	1,000	935.00	935,000
ジーンズメイト	400	752.00	300,800
良品計画	1,500	33,950.00	50,925,000
三城ホールディングス	1,400	472.00	660,800
アドヴァン	1,100	1,086.00	1,194,600
アルビス	200	4,635.00	927,000
コナカ	1,500	597.00	895,500
ハウス オブ ローゼ	200	1,749.00	349,800
G - 7ホールディングス	300	2,347.00	704,100
イオン北海道	1,100	663.00	729,300
コジマ	1,900	366.00	695,400
ヒマラヤ	300	1,007.00	302,100
コーナン商事	1,600	2,365.00	3,784,000
エコス	400	1,229.00	491,600
ワタミ	1,300	1,472.00	1,913,600
マルシェ	300	809.00	242,700
ドンキホーテホールディングス	7,300	4,740.00	34,602,000
西松屋チェーン	2,500	1,263.00	3,157,500
ゼンショーホールディングス	5,700	2,138.00	12,186,600
幸楽苑ホールディングス	700	2,266.00	1,586,200
ハークスレイ	300	1,220.00	366,000
サイゼリヤ	1,700	3,490.00	5,933,000
V Tホールディングス	3,800	597.00	2,268,600
魚力	300	1,186.00	355,800
ポブラ	300	672.00	201,600
フジ・コーポレーション	200	2,164.00	432,800
ユナイテッドアローズ	1,400	4,080.00	5,712,000
ハイデイ日高	1,200	3,360.00	4,032,000
京都きもの友禅	700	814.00	569,800
コロワイド	3,700	2,167.00	8,017,900
ピーシーデボコーポレーション	1,700	885.00	1,504,500

壱番屋	800	4,420.00	3,536,000	
トップカルチャー	400	500.00	200,000	
P L A N T	300	1,288.00	386,400	
スギホールディングス	2,500	5,800.00	14,500,000	
ヴィア・ホールディングス	1,000	823.00	823,000	
スクロール	1,800	441.00	793,800	
ヨンドシーホールディングス	1,200	3,090.00	3,708,000	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	3,600	6,430.00	23,148,000	
木曽路	1,400	2,787.00	3,901,800	
S R S ホールディングス	1,200	936.00	1,123,200	
千趣会	2,000	691.00	1,382,000	
タカキュー	900	217.00	195,300	
ケーヨー	2,100	731.00	1,535,100	
上新電機	1,300	3,955.00	5,141,500	
日本瓦斯	2,000	3,785.00	7,570,000	
ロイヤルホールディングス	2,000	2,906.00	5,812,000	
東天紅	100	2,302.00	230,200	
いなげや	1,300	1,831.00	2,380,300	
島忠	2,800	3,210.00	8,988,000	
チヨダ	1,300	2,820.00	3,666,000	
ライフコーポレーション	800	3,015.00	2,412,000	
リンガーハット	1,400	2,481.00	3,473,400	
さが美	1,000	125.00	125,000	
MrMaxHD	1,400	724.00	1,013,600	
テンアライド	1,100	439.00	482,900	
AOKIホールディングス	2,200	1,562.00	3,436,400	
オークワ	2,000	1,157.00	2,314,000	
コメリ	1,700	3,165.00	5,380,500	
青山商事	2,200	4,180.00	9,196,000	
しまむら	1,300	12,760.00	16,588,000	
はせがわ	600	510.00	306,000	
高島屋	18,000	1,064.00	19,152,000	
松屋	2,200	1,213.00	2,668,600	
エイチ・ツー・オー リテイリング	5,300	2,089.00	11,071,700	
近鉄百貨店	400	3,715.00	1,486,000	
パルコ	1,100	1,552.00	1,707,200	

丸井グループ	10,700	1,731.00	18,521,700
アクシアル リテイリング	900	4,225.00	3,802,500
イオン	43,000	1,739.00	74,777,000
イズミ	2,000	6,050.00	12,100,000
東武ストア	200	3,060.00	612,000
平和堂	2,200	2,474.00	5,442,800
フジ	1,200	2,590.00	3,108,000
ヤオコー	1,200	5,540.00	6,648,000
ゼビオホールディングス	1,500	2,181.00	3,271,500
ケーズホールディングス	4,800	2,606.00	12,508,800
O l y m p i cグループ	700	599.00	419,300
日産東京販売ホールディングス	1,700	428.00	727,600
アインホールディングス	1,600	7,490.00	11,984,000
元気寿司	300	3,540.00	1,062,000
ヤマダ電機	37,500	601.00	22,537,500
アークランドサカモト	1,900	1,832.00	3,480,800
ニトリホールディングス	4,500	16,440.00	73,980,000
愛眼	900	330.00	297,000
ケーユーホールディングス	600	1,029.00	617,400
吉野家ホールディングス	3,700	1,906.00	7,052,200
松屋フーズ	500	4,255.00	2,127,500
サガミチェーン	1,500	1,378.00	2,067,000
関西スーパーマーケット	800	1,364.00	1,091,200
王将フードサービス	800	5,060.00	4,048,000
プレナス	1,200	2,324.00	2,788,800
ミニストップ	800	2,281.00	1,824,800
アークス	2,100	2,533.00	5,319,300
パローホールディングス	2,600	2,572.00	6,687,200
藤久	100	1,742.00	174,200
ベルク	500	6,120.00	3,060,000
大庄	600	1,703.00	1,021,800
ファーストリテイリング	1,800	38,600.00	69,480,000
サンドラッグ	4,700	5,010.00	23,547,000
サックスパー ホールディングス	1,100	1,413.00	1,554,300
ヤマザワ	300	1,741.00	522,300
やまや	200	2,376.00	475,200

ペルーナ	2,800	1,244.00	3,483,200	
島根銀行	300	1,352.00	405,600	
じもとホールディングス	7,600	212.00	1,611,200	
めぶきフィナンシャルグループ	58,200	473.00	27,528,600	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	1,500	3,055.00	4,582,500	
九州フィナンシャルグループ	18,300	723.00	13,230,900	
ゆうちょ銀行	31,700	1,419.00	44,982,300	
富山第一銀行	2,900	570.00	1,653,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	68,000	594.00	40,392,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	7,600	1,303.00	9,902,800	
新生銀行	9,700	1,815.00	17,605,500	
あおぞら銀行	6,600	4,475.00	29,535,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	790,300	761.50	601,813,450	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	122,800	614.50	75,460,600	
三井住友トラスト・ホールディングス	21,900	4,429.00	96,995,100	
三井住友フィナンシャルグループ	84,700	4,515.00	382,420,500	代用有価証券 10,000株
第四銀行	1,400	5,420.00	7,588,000	
北越銀行	1,100	2,608.00	2,868,800	
千葉銀行	41,000	848.00	34,768,000	
群馬銀行	22,800	708.00	16,142,400	
武蔵野銀行	1,800	3,550.00	6,390,000	
千葉興業銀行	3,100	631.00	1,956,100	
筑波銀行	4,700	390.00	1,833,000	
七十七銀行	3,500	2,839.00	9,936,500	
青森銀行	900	3,640.00	3,276,000	
秋田銀行	700	3,495.00	2,446,500	
山形銀行	1,300	2,620.00	3,406,000	
岩手銀行	800	4,550.00	3,640,000	
東邦銀行	10,000	418.00	4,180,000	
東北銀行	600	1,541.00	924,600	
みちのく銀行	700	1,912.00	1,338,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	46,000	577.00	26,542,000	
静岡銀行	30,000	1,088.00	32,640,000	
十六銀行	1,500	3,690.00	5,535,000	
スルガ銀行	11,500	2,532.00	29,118,000	

八十二銀行	20,300	681.00	13,824,300	
山梨中央銀行	7,000	483.00	3,381,000	
大垣共立銀行	1,800	3,125.00	5,625,000	
福井銀行	1,000	2,984.00	2,984,000	
北國銀行	1,300	4,985.00	6,480,500	
清水銀行	400	3,625.00	1,450,000	
富山銀行	200	4,375.00	875,000	
滋賀銀行	11,000	633.00	6,963,000	
南都銀行	1,300	3,140.00	4,082,000	
百五銀行	10,700	517.00	5,531,900	
京都銀行	4,300	5,880.00	25,284,000	
紀陽銀行	4,300	1,895.00	8,148,500	
三重銀行	500	2,644.00	1,322,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	7,500	1,810.00	13,575,000	
広島銀行	16,500	924.00	15,246,000	
山陰合同銀行	6,700	1,037.00	6,947,900	
中国銀行	7,800	1,586.00	12,370,800	
鳥取銀行	300	1,797.00	539,100	
伊予銀行	16,000	938.00	15,008,000	
百十四銀行	12,000	404.00	4,848,000	
四国銀行	1,700	1,725.00	2,932,500	
阿波銀行	9,000	763.00	6,867,000	
大分銀行	600	4,425.00	2,655,000	
宮崎銀行	600	3,900.00	2,340,000	
佐賀銀行	700	2,740.00	1,918,000	
十八銀行	7,000	295.00	2,065,000	
沖縄銀行	1,100	4,485.00	4,933,500	
琉球銀行	2,200	1,688.00	3,713,600	
セブン銀行	42,000	414.00	17,388,000	
みずほフィナンシャルグループ	1,520,600	204.30	310,658,580	
高知銀行	400	1,285.00	514,000	
山口フィナンシャルグループ	11,000	1,349.00	14,839,000	
長野銀行	300	1,969.00	590,700	
名古屋銀行	900	4,360.00	3,924,000	
北洋銀行	16,900	373.00	6,303,700	
愛知銀行	400	6,800.00	2,720,000	

第三銀行	600	1,861.00	1,116,600	
中京銀行	500	2,323.00	1,161,500	
大光銀行	400	2,535.00	1,014,000	
愛媛銀行	1,500	1,442.00	2,163,000	
トマト銀行	400	1,571.00	628,400	
みなと銀行	1,000	2,098.00	2,098,000	
京葉銀行	10,000	528.00	5,280,000	
関西アーバン銀行	1,600	1,419.00	2,270,400	
栃木銀行	5,800	497.00	2,882,600	
北日本銀行	300	3,415.00	1,024,500	
東和銀行	2,000	1,156.00	2,312,000	
福島銀行	1,000	903.00	903,000	
大東銀行	500	1,665.00	832,500	
トモニホールディングス	9,200	529.00	4,866,800	
フィデアホールディングス	10,900	213.00	2,321,700	
池田泉州ホールディングス	11,900	434.00	5,164,600	
F P G	4,000	1,344.00	5,376,000	
S B Iホールディングス	12,700	1,756.00	22,301,200	
ジャフコ	1,600	5,710.00	9,136,000	
大和証券グループ本社	97,000	716.00	69,452,000	
野村ホールディングス	201,700	648.00	130,701,600	
岡三証券グループ	10,000	698.00	6,980,000	
丸三証券	3,500	1,052.00	3,682,000	
東洋証券	4,000	313.00	1,252,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	12,900	727.00	9,378,300	
光世証券	300	1,659.00	497,700	
水戸証券	3,500	394.00	1,379,000	
いちよし証券	2,400	1,371.00	3,290,400	
松井証券	5,500	975.00	5,362,500	
だいこう証券ビジネス	600	756.00	453,600	
マネックスグループ	11,900	353.00	4,200,700	
カブドットコム証券	7,100	359.00	2,548,900	
極東証券	1,500	1,672.00	2,508,000	
岩井コスモホールディングス	1,200	1,497.00	1,796,400	
藍澤証券	2,100	812.00	1,705,200	
マネーパートナーズグループ	1,400	452.00	632,800	

かんぽ生命保険	4,300	2,431.00	10,453,300
S O M P Oホールディングス	22,000	4,594.00	101,068,000
アニコム ホールディングス	800	2,861.00	2,288,800
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	29,300	3,825.00	112,072,500
ソニーフィナンシャルホールディングス	9,200	1,838.00	16,909,600
第一生命ホールディングス	63,300	2,153.00	136,284,900
東京海上ホールディングス	42,100	4,823.00	203,048,300
T & Dホールディングス	34,600	1,759.50	60,878,700
アドバンスクリエイト	200	1,892.00	378,400
全国保証	3,200	4,715.00	15,088,000
クレディセゾン	8,500	2,304.00	19,584,000
芙蓉総合リース	1,300	7,260.00	9,438,000
興銀リース	2,100	2,915.00	6,121,500
東京センチュリー	2,200	4,910.00	10,802,000
日本証券金融	4,600	626.00	2,879,600
アイフル	18,700	379.00	7,087,300
ポケットカード	900	1,070.00	963,000
リコーリース	900	4,070.00	3,663,000
イオンフィナンシャルサービス	8,000	2,439.00	19,512,000
アコム	22,500	452.00	10,170,000
ジャックス	1,400	2,785.00	3,899,000
オリエントコーポレーション	24,200	179.00	4,331,800
日立キャピタル	3,100	2,906.00	9,008,600
アプラスフィナンシャル	5,400	108.00	583,200
オリックス	74,600	1,999.50	149,162,700
三菱UFJリース	28,500	604.00	17,214,000
日本取引所グループ	32,900	2,016.00	66,326,400
イー・ギャランティ	200	3,215.00	643,000
アサックス	200	1,821.00	364,200
N E Cキャピタルソリューション	500	2,250.00	1,125,000
いちご	16,000	403.00	6,448,000
日本駐車場開発	13,500	166.00	2,241,000
ヒューリック	23,400	1,179.00	27,588,600
三栄建築設計	500	2,399.00	1,199,500
スター・マイカ	400	1,615.00	646,000

野村不動産ホールディングス	7,500	2,485.00	18,637,500	
三重交通グループホールディングス	2,300	479.00	1,101,700	
サムティ	900	1,635.00	1,471,500	
ディア・ライフ	1,100	454.00	499,400	
エー・ディー・ワークス	14,800	41.00	606,800	
日本商業開発	600	1,654.00	992,400	
プレサンスコーポレーション	1,600	1,493.00	2,388,800	
ユニゾホールディングス	1,300	2,964.00	3,853,200	
THEグローバル社	500	847.00	423,500	
日本管理センター	700	1,578.00	1,104,600	
サンセイランディック	300	979.00	293,700	
エストラスト	200	860.00	172,000	
フージャースホールディングス	1,500	1,059.00	1,588,500	
オープンハウス	1,800	4,395.00	7,911,000	
東急不動産ホールディングス	27,200	758.00	20,617,600	
飯田グループホールディングス	9,300	2,173.00	20,208,900	
ムゲンエステート	700	1,199.00	839,300	
ファーストブラザーズ	300	1,103.00	330,900	
ハウズドゥ	200	1,872.00	374,400	
シーアールイー	200	1,527.00	305,400	
ケイアイスター不動産	400	2,315.00	926,000	
パーク24	6,200	2,627.00	16,287,400	
パラカ	400	2,408.00	963,200	
三井不動産	55,900	2,692.00	150,482,800	
三菱地所	83,300	2,056.00	171,264,800	
平和不動産	2,000	2,115.00	4,230,000	
東京建物	12,300	1,632.00	20,073,600	
ダイビル	2,900	1,308.00	3,793,200	
京阪神ビルディング	1,800	814.00	1,465,200	
住友不動産	26,000	3,810.00	99,060,000	
大京	1,800	2,214.00	3,985,200	
テーオーシー	3,900	1,027.00	4,005,300	
東京楽天地	200	5,880.00	1,176,000	
レオパレス21	14,000	859.00	12,026,000	
スターツコーポレーション	1,500	3,050.00	4,575,000	
フジ住宅	1,300	814.00	1,058,200	



空港施設	1,100	627.00	689,700
明和地所	600	910.00	546,000
ゴールドクレスト	900	2,474.00	2,226,600
日本エスリード	500	2,033.00	1,016,500
日神不動産	1,500	800.00	1,200,000
日本エスコン	2,000	519.00	1,038,000
タカラレーベン	5,300	509.00	2,697,700
サンヨーハウジング名古屋	600	1,211.00	726,600
イオンモール	7,200	2,037.00	14,666,400
ファースト住建	400	1,806.00	722,400
トーセイ	1,400	1,111.00	1,555,400
エヌ・ティ・ティ都市開発	6,900	1,188.00	8,197,200
サンフロンティア不動産	1,200	1,347.00	1,616,400
エフ・ジェー・ネクスト	900	950.00	855,000
インテリックス	400	995.00	398,000
ランドビジネス	600	332.00	199,200
グランディハウス	1,000	471.00	471,000
日本空港ビルデング	3,200	4,075.00	13,040,000
日本工営	700	4,210.00	2,947,000
L I F U L L	3,800	857.00	3,256,600
ジェイエイシーリクルートメント	900	1,969.00	1,772,100
日本M&Aセンター	3,700	5,570.00	20,609,000
メンバーズ	300	702.00	210,600
中広	100	744.00	74,400
タケエイ	1,000	1,138.00	1,138,000
トラスト・テック	500	3,475.00	1,737,500
コシダカホールディングス	600	4,700.00	2,820,000
パソナグループ	900	1,529.00	1,376,100
C D S	300	1,341.00	402,300
リンクアンドモチベーション	2,000	750.00	1,500,000
G C A	1,300	1,033.00	1,342,900
エス・エム・エス	2,200	3,400.00	7,480,000
パーソルホールディングス	10,000	2,831.00	28,310,000
リニカル	700	1,466.00	1,026,200
クックパッド	3,400	746.00	2,536,400
エスクリ	400	873.00	349,200

アイ・ケイ・ケイ	600	876.00	525,600
学情	500	1,372.00	686,000
スタジオアリス	500	2,624.00	1,312,000
シミックホールディングス	600	1,667.00	1,000,200
N J S	300	1,451.00	435,300
総合警備保障	4,300	5,910.00	25,413,000
カカクコム	8,400	1,685.00	14,154,000
アイロムグループ	400	1,620.00	648,000
セントケア・ホールディング	200	2,894.00	578,800
サイネックス	100	1,014.00	101,400
ルネサンス	500	1,787.00	893,500
ディップ	1,600	2,650.00	4,240,000
オプトホールディング	800	1,206.00	964,800
新日本科学	1,300	553.00	718,900
ツクイ	2,600	805.00	2,093,000
キャリアデザインセンター	300	1,696.00	508,800
エムスリー	11,500	3,470.00	39,905,000
ツカダ・グローバルホールディング	900	577.00	519,300
プラス	100	1,047.00	104,700
アウトソーシング	3,300	1,760.00	5,808,000
ウェルネット	900	1,080.00	972,000
ワールドホールディングス	400	3,595.00	1,438,000
ディー・エヌ・エー	5,900	2,612.00	15,410,800
博報堂D Yホールディングス	15,000	1,579.00	23,685,000
ぐるなび	1,700	1,390.00	2,363,000
エスアールジータカミヤ	1,300	721.00	937,300
ジャパンベストレスキューシステム	1,400	469.00	656,600
ファンコミュニケーションズ	3,000	1,160.00	3,480,000
ライク	400	2,035.00	814,000
ビジネス・ブレークスルー	500	457.00	228,500
W D Bホールディングス	500	2,724.00	1,362,000
ティア	600	964.00	578,400
C D G	100	1,846.00	184,600
バリューコマース	1,000	795.00	795,000
インフォマート	5,400	688.00	3,715,200
J Pホールディングス	3,400	363.00	1,234,200

エコナックホールディングス	2,100	143.00	300,300	
E P Sホールディングス	1,600	2,212.00	3,539,200	
レッグス	300	874.00	262,200	
プレステージ・インターナショナル	2,200	1,283.00	2,822,600	
アミューズ	600	3,020.00	1,812,000	
ドリームインキュベータ	400	2,251.00	900,400	
クイック	700	1,676.00	1,173,200	
T A C	700	284.00	198,800	
ケネディクス	15,100	665.00	10,041,500	
電通	13,200	4,795.00	63,294,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	830.00	415,000	
ぴあ	400	5,490.00	2,196,000	
イオンファンタジー	400	4,475.00	1,790,000	
シーティーエス	1,100	870.00	957,000	
みらかホールディングス	3,300	5,310.00	17,523,000	
アルプス技研	500	3,890.00	1,945,000	
ダイオーズ	200	1,477.00	295,400	
日本空調サービス	1,200	813.00	975,600	
オリエンタルランド	12,800	9,390.00	120,192,000	
ダスキン	2,900	3,035.00	8,801,500	
明光ネットワークジャパン	1,400	1,286.00	1,800,400	
ファルコホールディングス	600	1,770.00	1,062,000	
秀英予備校	300	483.00	144,900	
田谷	200	675.00	135,000	
ラウンドワン	3,300	1,528.00	5,042,400	
リゾートトラスト	4,500	2,239.00	10,075,500	
ビー・エム・エル	1,400	2,543.00	3,560,200	
ワタベウェディング	200	667.00	133,400	
りらいあコミュニケーションズ	1,600	1,265.00	2,024,000	
リソー教育	1,900	879.00	1,670,100	
早稲田アカデミー	200	1,708.00	341,600	
ユー・エス・エス	13,300	2,302.00	30,616,600	
東京個別指導学院	400	994.00	397,600	
サイバーエージェント	7,200	3,730.00	26,856,000	
楽天	55,600	1,180.50	65,635,800	
クリーク・アンド・リバー社	600	1,144.00	686,400	

テー・オー・ダブリュー	1,000	893.00	893,000	
セントラルスポーツ	400	4,075.00	1,630,000	
フルキャストホールディングス	900	2,123.00	1,910,700	
リソルホールディングス	100	3,980.00	398,000	
テクノプロ・ホールディングス	1,900	5,420.00	10,298,000	
アトラ	200	710.00	142,000	
インターワークス	300	1,175.00	352,500	
K e e P e r 技研	400	1,374.00	549,600	
ファーストロジック	100	2,510.00	251,000	
三機サービス	100	1,331.00	133,100	
デザインワン・ジャパン	200	1,326.00	265,200	
イー・ガーディアン	600	2,282.00	1,369,200	
リブセンス	700	554.00	387,800	
ジャパンマテリアル	1,000	3,360.00	3,360,000	
ベクトル	1,300	1,419.00	1,844,700	
ウチヤマホールディングス	600	534.00	320,400	
ライクキッズネクスト	100	2,282.00	228,200	
キャリアリンク	400	573.00	229,200	
I B J	800	927.00	741,600	
アサンテ	400	2,134.00	853,600	
N・フィールド	600	1,937.00	1,162,200	
バリューHR	100	4,645.00	464,500	
M&Aキャピタルパートナーズ	200	6,140.00	1,228,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	500	1,064.00	532,000	
E R Iホールディングス	300	933.00	279,900	
アビスト	200	4,450.00	890,000	
ウィルグループ	500	1,368.00	684,000	
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	300	2,967.00	890,100	
日本ビューホテル	300	1,390.00	417,000	
リクルートホールディングス	83,700	2,737.00	229,086,900	
エラン	300	1,605.00	481,500	
土木管理総合試験所	300	805.00	241,500	
日本郵政	61,600	1,303.00	80,264,800	
ベルシステム24ホールディングス	1,800	1,268.00	2,282,400	
鎌倉新書	200	1,765.00	353,000	
一蔵	100	1,111.00	111,100	

LITALICO	200	1,624.00	324,800	
グローバルグループ	100	2,108.00	210,800	
エボラブルアジア	200	2,426.00	485,200	
ストライク	100	4,960.00	496,000	
ソラスト	600	2,391.00	1,434,600	
インソース	200	1,898.00	379,600	
リログループ	5,900	2,791.00	16,466,900	
東祥	700	3,095.00	2,166,500	
エイチ・アイ・エス	1,700	3,970.00	6,749,000	
ラックランド	200	2,172.00	434,400	
共立メンテナンス	1,900	3,565.00	6,773,500	
イチネンホールディングス	1,200	1,590.00	1,908,000	
建設技術研究所	800	1,085.00	868,000	
スペース	700	1,713.00	1,199,100	
燦ホールディングス	300	2,895.00	868,500	
スバル興業	100	8,410.00	841,000	
東京テアトル	500	1,461.00	730,500	
タナベ経営	200	1,504.00	300,800	
ナガワ	200	4,745.00	949,000	
よみうりランド	200	4,775.00	955,000	
東京都競馬	800	4,060.00	3,248,000	
常磐興産	500	1,855.00	927,500	
カナモト	1,700	3,765.00	6,400,500	
東京ドーム	4,400	1,090.00	4,796,000	
西尾レントオール	1,000	4,065.00	4,065,000	
トランス・コスモス	1,100	2,528.00	2,780,800	
乃村工藝社	2,600	2,326.00	6,047,600	
藤田観光	400	3,660.00	1,464,000	
KNT-CTホールディングス	700	1,973.00	1,381,100	
日本管財	1,200	2,069.00	2,482,800	
トーカイ	500	5,180.00	2,590,000	
白洋舎	100	3,570.00	357,000	
セコム	11,500	8,728.00	100,372,000	
セントラル警備保障	500	2,049.00	1,024,500	
丹青社	2,100	1,387.00	2,912,700	
メイテック	1,300	5,390.00	7,007,000	

アサツー ディ・ケイ	2,000	3,690.00	7,380,000	
応用地質	1,200	1,603.00	1,923,600	
船井総研ホールディングス	1,500	4,160.00	6,240,000	
進学会ホールディングス	500	648.00	324,000	
オオバ	900	518.00	466,200	
いであ	200	1,207.00	241,400	
学究社	300	1,623.00	486,900	
ベネッセホールディングス	3,900	3,885.00	15,151,500	
イオンディライト	1,400	4,200.00	5,880,000	
ナック	600	965.00	579,000	
ニチイ学館	2,100	1,150.00	2,415,000	
ダイセキ	1,800	2,816.00	5,068,800	
ステップ	400	1,633.00	653,200	
合 計	13,688,300		29,043,675,810	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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

## 貸借対照表

（単位：円）

	平成28年11月 7日現在	平成29年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
預金	707,287,843	140,338,295
コール・ローン	454,466,522	712,070,236
出資金	6,618,717	4,692,609

	平成28年11月 7日現在	平成29年11月 6日現在
株式	64,194,957,102	80,952,665,413
投資証券	1,753,040,590	2,108,714,076
派生商品評価勘定	2,150,781	31,404,542
未収入金	846,886	575,576
未収配当金	66,614,031	54,649,626
差入委託証拠金	280,902,424	199,676,489
流動資産合計	67,466,884,896	84,204,786,862
資産合計	67,466,884,896	84,204,786,862
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	40,549,636	454,800
未払金	121,108	-
未払解約金	78,803,598	28,488,977
未払利息	430	846
流動負債合計	119,474,772	28,944,623
負債合計	119,474,772	28,944,623
純資産の部		
元本等		
元本	38,937,887,089	34,958,724,833
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	28,409,523,035	49,217,117,406
元本等合計	67,347,410,124	84,175,842,239
純資産合計	67,347,410,124	84,175,842,239
負債純資産合計	67,466,884,896	84,204,786,862

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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11月 7日現在	平成29年11月 6日現在
1.	期首	平成27年11月 7日	平成28年11月 8日
	期首元本額	39,104,730,095円	38,937,887,089円
	期首からの追加設定元本額	3,384,278,028円	2,423,639,335円
	期首からの一部解約元本額	3,551,121,034円	6,402,801,591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）	14,862,488,326円	15,227,006,665円
	DCインデックスバランス（株式20）	54,123,899円	58,183,752円
	DCインデックスバランス（株式40）	180,333,319円	180,498,349円
	DCインデックスバランス（株式60）	330,462,762円	358,102,586円
	DCインデックスバランス（株式80）	376,551,830円	389,197,181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	3,519,481,915円	2,419,472,471円
	日興五大陸株式ファンド	6,936,165,834円	5,837,131,998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	26,855,309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）	41,655,430円	192,874,715円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	- 円	114,014,686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	- 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	7,053,711円	5,711,678円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	5,845,048円	4,323,836円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	8,664,661円	6,613,469円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	11,090,160円	7,150,949円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	7,412,991,437円	5,555,193,719円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	9,877,396円	- 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	33,765,511円	27,374,782円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	99,645,290円	79,964,166円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	134,239,074円	117,000,605円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	133,564,187円	119,108,256円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,746,780,026円	4,232,945,661円
	計	38,937,887,089円	34,958,724,833円
2.	受益権の総数	38,937,887,089口	34,958,724,833口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額



## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

	自 平成27年11月 7日 至 平成28年11月 7日	自 平成28年11月 8日 至 平成29年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成28年11月 7日現在	平成29年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）

（平成28年11月 7日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
出資金	675,626
株式	2,085,557,323
投資証券	91,042,227
合計	2,177,275,176

（平成29年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
出資金	227,211
株式	1,146,432,958
投資証券	23,777,786
合計	1,170,437,955

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（平成28年11月 7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	1,363,779,084	-	1,325,027,956	38,751,128
合計		1,363,779,084	-	1,325,027,956	38,751,128

（平成29年11月 6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	1,022,185,279	-	1,048,170,216	25,984,937
合計		1,022,185,279	-	1,048,170,216	25,984,937

## （注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## （通貨関連）

（平成28年11月 7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	484,550,804	-	485,332,077	781,273
	米ドル	257,060,765	-	255,825,377	1,235,388
	ユーロ	227,490,039	-	229,506,700	2,016,661
	売建	90,090,000	-	90,519,000	429,000
	イスラエルシケル	90,090,000	-	90,519,000	429,000
	合計	574,640,804	-	575,851,077	352,273

（平成29年11月 6日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	690,170,195	-	695,135,000	4,964,805
	米ドル	537,200,690	-	542,463,500	5,262,810
	ユーロ	152,969,505	-	152,671,500	298,005
合計		690,170,195	-	695,135,000	4,964,805

## （注）1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

平成28年11月 7日現在		平成29年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	1.7296円	1口当たり純資産額	2.4079円
(1万口当たり純資産額)	(17,296円)	(1万口当たり純資産額)	(24,079円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	11,203	49.51	554,660.53	
	ANDEAVOR	3,000	110.17	330,510.00	
	ANTERO RESOURCES CORP	3,670	19.24	70,610.80	
	APACHE CORP	7,904	42.75	337,896.00	
	BAKER HUGHES A GE CO	8,105	31.18	252,713.90	
	CABOT OIL & GAS CORP	9,730	28.23	274,677.90	
	CHENIERE ENERGY INC	4,070	48.96	199,267.20	
	CHEVRON CORP	38,461	114.99	4,422,630.39	
	CIMAREX ENERGY CO	2,005	122.53	245,672.65	
	CONCHO RESOURCES INC	3,055	142.85	436,406.75	
	CONOCOPHILLIPS	25,240	52.96	1,336,710.40	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,960	42.37	83,045.20	
	CORE LABORATORIES N.V.	790	102.20	80,738.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	9,991	39.27	392,346.57	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	1,940	111.15	215,631.00	
	EOG RESOURCES INC	11,802	104.50	1,233,309.00	
	EQT CORP	3,445	62.78	216,277.10	
	EXXON MOBIL CORP	86,131	83.18	7,164,376.58	
	HALLIBURTON CO	18,027	43.23	779,307.21	
	HELMERICH & PAYNE	2,120	54.91	116,409.20	
	HESS CORP	6,000	45.46	272,760.00	
	HOLLYFRONTIER CORP	3,740	40.14	150,123.60	
	KINDER MORGAN INC	40,700	17.74	722,018.00	
	MARATHON OIL CORP	17,867	15.58	278,367.86	
	MARATHON PETROLEUM CORP	10,852	62.20	674,994.40	
	MURPHY OIL CORP	3,715	27.60	102,534.00	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	7,521	33.42	251,351.82	
	NEWFIELD EXPLORATION CO	4,040	30.66	123,866.40	
	NOBLE ENERGY INC	9,492	28.30	268,623.60	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	15,801	68.26	1,078,576.26	
ONEOK INC	7,690	52.65	404,878.50		
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	4,490	27.53	123,609.70		
PHILLIPS 66	9,045	93.58	846,431.10		

PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,420	150.29	513,991.80
RANGE RESOURCES CORP	4,050	18.13	73,426.50
SCHLUMBERGER LTD	28,141	63.58	1,789,204.78
TARGA RESOURCES CORP	4,560	43.89	200,138.40
TECHNIPFMC PLC	9,351	28.58	267,251.58
VALERO ENERGY CORP	9,172	80.88	741,831.36
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	20,199	3.99	80,594.01
WILLIAMS COS INC	16,874	28.26	476,859.24
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	4,255	159.25	677,608.75
ALBEMARLE CORP	2,320	140.04	324,892.80
AVERY DENNISON CORP	1,820	108.09	196,723.80
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	4,170	32.84	136,942.80
BALL CORP	6,840	41.75	285,570.00
CELANESE CORP-SERIES A	2,990	106.13	317,328.70
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,850	38.60	187,210.00
CROWN HOLDINGS INC	2,815	60.42	170,082.30
DOWDUPONT INC	47,417	71.16	3,374,193.72
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,015	91.32	275,329.80
ECOLAB INC	5,440	131.38	714,707.20
FMC CORP	2,790	91.11	254,196.90
FREEMPORT-MCMORAN INC	25,748	14.15	364,334.20
INTERNATIONAL PAPER CO	8,120	57.12	463,814.40
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,664	148.31	246,787.84
LYONDELLBASELL INDU-CL A	6,750	105.58	712,665.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,245	211.81	263,703.45
MONSANTO CO	8,881	119.87	1,064,565.47
MOSAIC CO/THE	6,820	22.38	152,631.60
NEWMONT MINING CORP	10,560	36.04	380,582.40
NUCOR CORP	6,569	58.00	381,002.00
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,950	115.74	225,693.00
PPG INDUSTRIES INC	5,004	116.53	583,116.12
PRAXAIR INC	5,920	147.50	873,200.00
SEALED AIR CORP	3,966	44.14	175,059.24
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,747	397.11	693,751.17
STEEL DYNAMICS INC	4,510	37.51	169,170.10

VULCAN MATERIALS CO	2,743	126.43	346,797.49
WESTROCK CO	5,329	59.95	319,473.55
WR GRACE & CO	1,400	75.32	105,448.00
3M CO	12,156	232.22	2,822,866.32
ACUITY BRANDS INC	960	162.07	155,587.20
AERCAP HOLDINGS NV	2,660	52.51	139,676.60
AGCO CORP	1,250	69.00	86,250.00
ALLEGION PLC	1,750	82.02	143,535.00
AMETEK INC	4,533	67.66	306,702.78
ARCONIC INC	7,943	25.34	201,275.62
BOEING CO/THE	11,692	261.75	3,060,381.00
CATERPILLAR INC	11,946	136.63	1,632,181.98
CUMMINS INC	3,195	173.07	552,958.65
DEERE & CO	5,710	135.03	771,021.30
DOVER CORP	3,150	95.92	302,148.00
EATON CORP PLC	9,026	78.10	704,930.60
EMERSON ELECTRIC CO	12,970	64.10	831,377.00
FASTENAL CO	6,153	47.91	294,790.23
FLOWSERVE CORP	2,575	39.25	101,068.75
FLUOR CORP	2,903	46.86	136,034.58
FORTIVE CORP	6,364	73.64	468,644.96
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,160	64.17	202,777.20
GENERAL DYNAMICS CORP	5,182	204.06	1,057,438.92
GENERAL ELECTRIC CO	176,273	20.14	3,550,138.22
HD SUPPLY HOLDINGS INC	3,740	36.12	135,088.80
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	14,746	144.97	2,137,727.62
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	960	235.07	225,667.20
IDEX CORP	1,420	127.81	181,490.20
ILLINOIS TOOL WORKS	6,320	157.30	994,136.00
INGERSOLL-RAND PLC	5,336	86.25	460,230.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,420	59.29	143,481.80
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4,370	64.66	282,564.20
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	4,500	42.00	189,000.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	18,864	40.68	767,387.52
L3 TECHNOLOGIES INC	1,651	186.52	307,944.52

LENNOX INTERNATIONAL INC	700	190.17	133,119.00
LOCKHEED MARTIN CORP	5,331	309.99	1,652,556.69
MASCO CORP	6,789	39.02	264,906.78
MIDDLEBY CORP	1,180	118.95	140,361.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,384	301.66	1,020,817.44
PACCAR INC	7,014	71.32	500,238.48
PARKER HANNIFIN CORP	2,760	185.38	511,648.80
PENTAIR PLC	3,498	69.36	242,621.28
RAYTHEON COMPANY	5,822	184.71	1,075,381.62
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,683	198.38	532,253.54
ROCKWELL COLLINS INC.	3,373	135.93	458,491.89
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,150	258.06	554,829.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,460	47.87	165,630.20
SMITH (A.O.) CORP	3,020	59.54	179,810.80
SNAP-ON INC	1,250	158.22	197,775.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,116	163.13	508,313.08
TEXTRON INC	5,416	54.55	295,442.80
TRANSDIGM GROUP INC	1,100	282.52	310,772.00
UNITED RENTALS INC	1,840	144.71	266,266.40
UNITED TECHNOLOGIES CORP	15,475	121.07	1,873,558.25
WABCO HOLDINGS INC	1,110	150.46	167,010.60
WABTEC CORP	1,880	77.03	144,816.40
WW GRAINGER INC	1,057	200.01	211,410.57
XYLEM INC	3,548	66.57	236,190.36
CINTAS CORP	1,727	148.37	256,234.99
EQUIFAX INC	2,404	108.70	261,314.80
IHS MARKIT LTD	7,543	43.49	328,045.07
MANPOWERGROUP INC	1,447	126.00	182,322.00
NIELSEN HOLDINGS PLC	7,405	36.84	272,800.20
REPUBLIC SERVICES INC	5,100	63.90	325,890.00
ROBERT HALF INTL INC	2,375	52.34	124,307.50
ROLLINS INC	1,610	45.28	72,900.80
STERICYCLE INC	1,705	67.32	114,780.60
VERISK ANALYTICS INC	3,170	91.03	288,565.10
WASTE CONNECTIONS INC	5,806	69.62	404,213.72



WASTE MANAGEMENT INC	9,154	81.70	747,881.80
AMERCO	155	386.66	59,932.30
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	2,840	47.45	134,758.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	2,900	79.44	230,376.00
CSX CORP	18,723	51.31	960,677.13
DELTA AIR LINES INC	3,955	50.40	199,332.00
EXPEDITORS INTL WASH INC	3,647	57.95	211,343.65
FEDEX CORP	5,148	224.24	1,154,387.52
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,670	107.22	179,057.40
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	97,000	0.43	41,710.00
KANSAS CITY SOUTHERN	2,160	104.86	226,497.60
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	2,750	41.22	113,355.00
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	1,570	68.25	107,152.50
NORFOLK SOUTHERN CORP	5,860	130.36	763,909.60
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,400	54.14	184,076.00
UNION PACIFIC CORP	16,376	117.18	1,918,939.68
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	1,715	59.65	102,299.75
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	14,057	115.46	1,623,021.22
AUTOLIV INC	1,770	125.67	222,435.90
BORGWARNER INC	4,330	52.97	229,360.10
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	5,420	96.89	525,143.80
FORD MOTOR COMPANY	76,235	12.36	942,264.60
GENERAL MOTORS CORP	27,575	42.34	1,167,525.50
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	5,430	29.45	159,913.50
HARLEY-DAVIDSON INC	3,709	47.04	174,471.36
LEAR CORP	1,370	175.79	240,832.30
TESLA INC	2,660	306.09	814,199.40
DR HORTON INC	7,936	44.32	351,723.52
GARMIN LTD	2,395	59.55	142,622.25
HANESBRANDS INC	7,940	19.36	153,718.40
HASBRO INC	2,288	90.69	207,498.72
LEGGETT & PLATT INC	2,778	46.00	127,788.00
LENNAR CORP-CL A	3,900	54.62	213,018.00
LULULEMON ATHLETICA INC	2,010	61.15	122,911.50
MATTEL INC	7,349	13.12	96,418.88

MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	3,530	47.62	168,098.60	
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,318	257.33	339,160.94	
NEWELL BRANDS INC	9,146	30.77	281,422.42	
NIKE INC -CL B	26,868	55.71	1,496,816.28	
NVR INC	70	3,210.65	224,745.50	
POLARIS INDUSTRIES INC	1,240	116.74	144,757.60	
PULTE GROUP INC	5,660	30.31	171,554.60	
PVH CORP	1,750	126.88	222,040.00	
RALPH LAUREN CORP	1,165	90.67	105,630.55	
TAPESTRY INC	5,696	41.15	234,390.40	
TOLL BROTHERS INC	3,781	43.90	165,985.90	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	3,560	11.61	41,331.60	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	4,112	10.59	43,546.08	
VF CORP	7,100	69.47	493,237.00	
WHIRLPOOL CORP	1,614	163.86	264,470.04	
ARAMARK	4,960	43.75	217,000.00	
CARNIVAL CORP	7,257	65.43	474,825.51	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	485	273.53	132,662.05	
DARDEN RESTAURANTS INC	2,553	82.28	210,060.84	
DOMINO'S PIZZA INC	1,020	177.94	181,498.80	
H&R BLOCK INC	4,510	24.06	108,510.60	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,710	73.16	271,423.60	
LAS VEGAS SANDS CORP	8,180	65.88	538,898.40	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	6,503	121.55	790,439.65	
MCDONALD'S CORP	16,691	168.65	2,814,937.15	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	4,100	25.91	106,231.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	9,760	31.26	305,097.60	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	3,220	55.03	177,196.60	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,538	123.18	435,810.84	
STARBUCKS CORP	29,314	56.03	1,642,463.42	
VAIL RESORTS INC	740	235.62	174,358.80	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,240	108.91	243,958.40	
WYNN RESORTS LTD	1,660	150.09	249,149.40	
YUM! BRANDS INC	6,804	78.91	536,903.64	
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	7,458	55.40	413,173.20	

CHARTER COMMUNICATION-A	4,401	335.43	1,476,227.43
COMCAST CORP-CLASS A	96,244	35.68	3,433,985.92
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,320	16.52	54,846.40
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	4,690	15.39	72,179.10
DISH NETWORK CORP-A	4,769	48.07	229,245.83
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	6,846	18.93	129,594.78
LIBERTY BROADBAND-C	2,140	87.35	186,929.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,475	30.51	136,532.25
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	12,321	29.60	364,701.60
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	3,210	40.93	131,385.30
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	1,975	40.85	80,678.75
NEWS CORP - CLASS A	7,570	13.87	104,995.90
OMNICOM GROUP	4,577	66.21	303,043.17
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	1,620	79.61	128,968.20
SIRIUS XM HOLDINGS INC	34,250	5.30	181,525.00
THE WALT DISNEY CO.	31,743	98.64	3,131,129.52
TIME WARNER INC	15,778	93.28	1,471,771.84
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	9,599	24.43	234,503.57
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	20,442	24.97	510,436.74
VIACOM INC-CLASS B	7,248	23.27	168,660.96
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,508	81.80	123,354.40
AMAZON.COM INC	8,255	1,111.60	9,176,258.00
AUTONATION INC	1,650	53.69	88,588.50
AUTOZONE INC	552	606.41	334,738.32
BED BATH & BEYOND INC	3,062	19.56	59,892.72
BEST BUY CO INC	5,564	56.92	316,702.88
CARMAX INC	3,969	75.19	298,429.11
DICK'S SPORTING GOODS INC	1,780	24.48	43,574.40
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	5,450	81.87	446,191.50
DOLLAR TREE INC	4,896	93.75	459,000.00
EXPEDIA INC	2,552	123.05	314,023.60
FOOT LOCKER INC	2,820	29.85	84,177.00
GAP INC/THE	5,106	26.38	134,696.28
GENUINE PARTS CO	2,841	87.80	249,439.80
HOME DEPOT INC	24,320	164.39	3,997,964.80

KOHL'S CORP	3,872	42.03	162,740.16	
L BRANDS INC	5,308	46.72	247,989.76	
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	8,930	22.45	200,478.50	
LKQ CORP	6,330	37.71	238,704.30	
LOWE'S COS INC	17,242	77.92	1,343,496.64	
MACY'S INC	6,469	18.36	118,770.84	
NETFLIX INC	8,750	200.01	1,750,087.50	
NORDSTROM INC	2,850	38.50	109,725.00	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,775	212.50	377,187.50	
PRICELINE GROUP INC/THE	995	1,894.49	1,885,017.55	
ROSS STORES INC	7,732	64.13	495,853.16	
SIGNET JEWELERS LTD	1,500	65.39	98,085.00	
TARGET CORP	10,600	59.36	629,216.00	
TIFFANY & CO	2,610	92.56	241,581.60	
TJX COMPANIES INC	13,193	68.60	905,039.80	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,750	58.97	162,167.50	
TRIPADVISOR INC	2,330	38.88	90,590.40	
ULTA BEAUTY INC	1,240	202.05	250,542.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	8,879	166.44	1,477,820.76	
CVS HEALTH CORP	20,707	69.25	1,433,959.75	
KROGER CO	19,050	21.50	409,575.00	
SYSCO CORP	10,546	56.66	597,536.36	
WAL-MART STORES INC	30,922	89.68	2,773,084.96	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	18,672	66.87	1,248,596.64	
ALTRIA GROUP INC	39,168	63.91	2,503,226.88	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	11,343	39.78	451,224.54	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	4,224	55.61	234,896.64	
BUNGE LTD	2,857	67.86	193,876.02	
CAMPBELL SOUP CO	3,485	46.48	161,982.80	
COCA-COLA CO/THE	82,512	45.97	3,793,076.64	
CONAGRA BRANDS INC	8,960	33.91	303,833.60	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,460	215.91	747,048.60	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	3,769	85.62	322,701.78	
GENERAL MILLS INC	11,439	51.34	587,278.26	
HERSHEY CO/THE	3,015	105.92	319,348.80	

HORMEL FOODS CORP	5,960	31.32	186,667.20
INGREDION INC	1,470	129.99	191,085.30
JM SMUCKER CO/THE	2,250	102.22	229,995.00
KELLOGG CO	5,408	61.96	335,079.68
KRAFT HEINZ CO/THE	12,241	78.00	954,798.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,275	96.90	220,447.50
MOLSON COORS BREWING CO -B	3,870	79.76	308,671.20
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	30,685	40.97	1,257,164.45
MONSTER BEVERAGE CORP	8,290	57.67	478,084.30
PEPSICO INC	29,061	110.22	3,203,103.42
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	31,688	102.66	3,253,090.08
TYSON FOODS INC-CL A	5,736	72.80	417,580.80
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,430	43.92	238,485.60
CLOROX COMPANY	2,736	128.11	350,508.96
COLGATE-PALMOLIVE CO	17,140	70.15	1,202,371.00
COTY INC-CL A	10,000	14.36	143,600.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,480	121.71	545,260.80
KIMBERLY-CLARK CORP	7,293	110.79	807,991.47
PROCTER & GAMBLE CO	52,049	86.58	4,506,402.42
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	520	104.04	54,100.80
ABBOTT LABORATORIES	35,396	55.47	1,963,416.12
AETNA INC	6,819	176.99	1,206,894.81
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,470	241.35	354,784.50
AMERISOURCEBERGEN CORP	3,254	74.80	243,399.20
ANTHEM INC	5,436	211.80	1,151,344.80
BAXTER INTERNATIONAL INC	10,399	64.90	674,895.10
BECTON DICKINSON AND CO	5,257	224.41	1,179,723.37
BOSTON SCIENTIFIC CORP	28,738	27.86	800,640.68
CARDINAL HEALTH INC	6,565	61.38	402,959.70
CENTENE CORP	3,530	96.03	338,985.90
CERNER CORP	6,230	65.43	407,628.90
CIGNA CORP	5,220	201.90	1,053,918.00
COOPER COS INC/THE	1,040	229.27	238,440.80
DANAHER CORP	12,719	93.13	1,184,520.47
DAVITA INC	3,438	59.91	205,970.58

DENTSPLY SIRONA INC	4,852	64.80	314,409.60	
DEXCOM INC	1,700	49.12	83,504.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,410	102.72	452,995.20	
ENVISION HEALTHCARE CORP	2,312	27.04	62,516.48	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	12,254	60.54	741,857.16	
HCA HEALTHCARE INC	6,425	76.43	491,062.75	
HENRY SCHEIN INC	3,340	77.64	259,317.60	
HOLOGIC INC	5,708	39.56	225,808.48	
HUMANA INC	2,945	256.69	755,952.05	
IDEXX LABORATORIES INC	1,830	155.49	284,546.70	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,250	384.25	864,562.50	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,155	153.74	331,309.70	
MCKESSON CORP	4,324	137.61	595,025.64	
MEDNAX INC	1,860	43.37	80,668.20	
MEDTRONIC PLC	27,988	78.43	2,195,098.84	
PATTERSON COS INC	2,042	36.15	73,818.30	
QUEST DIAGNOSTICS	3,116	94.09	293,184.44	
RESMED INC	2,950	83.12	245,204.00	
STRYKER CORP	7,043	156.18	1,099,975.74	
TELEFLEX INC	900	256.41	230,769.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	19,640	212.87	4,180,766.80	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,810	101.61	183,914.10	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,924	106.09	204,117.16	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	1,910	61.62	117,694.20	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	4,162	109.25	454,698.50	
ABBVIE INC	32,426	92.31	2,993,244.06	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	6,620	68.37	452,609.40	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	4,540	117.95	535,493.00	
ALKERMES PLC	3,220	50.99	164,187.80	
ALLERGAN PLC	6,815	174.92	1,192,079.80	
AMGEN INC	14,961	173.44	2,594,835.84	
BIOGEN INC	4,333	314.14	1,361,168.62	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,500	84.13	294,455.00	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	33,421	62.22	2,079,454.62	
CELGENE CORP	15,854	100.04	1,586,034.16	

ELI LILLY & CO	20,133	83.51	1,681,306.83
GILEAD SCIENCES INC	26,584	73.46	1,952,860.64
ILLUMINA INC	3,025	213.99	647,319.75
INCYTE CORP	3,520	105.08	369,881.60
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,180	137.89	162,710.20
JOHNSON & JOHNSON	54,841	140.08	7,682,127.28
MALLINCKRODT PLC	2,400	30.88	74,112.00
MERCK & CO. INC.	55,633	56.06	3,118,785.98
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	540	646.00	348,840.00
MYLAN NV	9,585	35.72	342,376.20
PERRIGO CO PLC	2,559	82.36	210,759.24
PFIZER INC	121,390	35.55	4,315,414.50
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	2,793	108.02	301,699.86
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,620	408.41	661,624.20
SEATTLE GENETICS INC	2,020	61.38	123,987.60
TESARO INC	660	110.91	73,200.60
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	19,610	11.40	223,554.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	7,944	193.71	1,538,832.24
UNITED THERAPEUTICS CORP	940	120.95	113,693.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,100	149.97	764,847.00
WATERS CORP	1,666	197.92	329,734.72
ZOETIS INC	9,740	68.69	669,040.60
BANK OF AMERICA CORP	202,039	27.82	5,620,724.98
BB&T CORP	15,838	49.54	784,614.52
CIT GROUP INC	2,655	45.88	121,811.40
CITIGROUP INC	55,897	74.05	4,139,172.85
CITIZENS FINANCIAL GROUP	10,590	38.82	411,103.80
COMERICA INC	3,360	79.75	267,960.00
EAST WEST BANCORP INC	2,660	59.72	158,855.20
FIFTH THIRD BANCORP	15,509	29.12	451,622.08
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,070	94.45	289,961.50
HUNTINGTON BANCSHARES INC	21,790	13.78	300,266.20
JPMORGAN CHASE & CO	72,160	101.41	7,317,745.60
KEYCORP	22,678	18.51	419,769.78
M & T BANK CORP	2,813	168.76	474,721.88

NEW YORK COMMUNITY BANCORP	9,654	12.59	121,543.86
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	6,370	18.49	117,781.30
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	9,790	138.64	1,357,285.60
REGIONS FINANCIAL CORP	23,184	15.81	366,539.04
SIGNATURE BANK	990	131.60	130,284.00
SUNTRUST BANKS INC	9,557	60.40	577,242.80
SVB FINANCIAL GROUP	990	219.52	217,324.80
US BANCORP	34,141	54.65	1,865,805.65
WELLS FARGO & CO	96,380	56.35	5,431,013.00
ZIONS BANCORPORATION	3,750	46.81	175,537.50
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,100	185.35	203,885.00
ALLY FINANCIAL INC	9,120	26.68	243,321.60
AMERICAN EXPRESS CO	15,444	96.43	1,489,264.92
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,060	159.59	488,345.40
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	20,892	51.33	1,072,386.36
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	25,320	187.27	4,741,676.40
BLACKROCK INC	2,475	479.11	1,185,797.25
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	9,795	91.60	897,222.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,880	115.02	216,237.60
CME GROUP INC	6,840	140.06	958,010.40
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	7,640	67.44	515,241.60
E*TRADE FINANCIAL CORP	5,840	44.02	257,076.80
EATON VANCE CORP	2,260	51.07	115,418.20
FRANKLIN RESOURCES INC	6,635	42.79	283,911.65
GOLDMAN SACHS GROUP INC	7,228	244.40	1,766,523.20
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	11,990	66.24	794,217.60
INVESCO LTD	8,467	36.05	305,235.35
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	25.75	188,103.75
MOODY'S CORP	3,637	146.29	532,056.73
MORGAN STANLEY	28,325	50.02	1,416,816.50
MSCI INC	2,000	126.04	252,080.00
NASDAQ INC	2,555	72.40	184,982.00
NAVIENT CORP	7,192	12.22	87,886.24
NORTHERN TRUST CORP	4,420	94.39	417,203.80
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,500	85.70	214,250.00



S&P GLOBAL INC	5,442	158.69	863,590.98
SCHWAB (CHARLES) CORP	24,634	44.82	1,104,095.88
SEI INVESTMENTS COMPANY	2,715	64.91	176,230.65
STATE STREET CORP	7,617	92.53	704,801.01
SYNCHRONY FINANCIAL	16,310	33.11	540,024.10
T ROWE PRICE GROUP INC	4,925	94.57	465,757.25
TD AMERITRADE HOLDING CORP	5,270	49.73	262,077.10
VOYA FINANCIAL INC	4,150	41.85	173,677.50
AFLAC INC	7,822	83.98	656,891.56
ALLEGHANY CORP	330	583.68	192,614.40
ALLSTATE CORP	7,763	97.84	759,531.92
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,490	102.76	153,112.40
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	18,905	62.00	1,172,110.00
AON PLC	5,357	138.64	742,694.48
ARCH CAPITAL GROUP LTD	2,775	94.50	262,237.50
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,300	63.69	210,177.00
ASSURANT INC	1,270	100.14	127,177.80
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	2,270	47.57	107,983.90
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	1,485	54.37	80,739.45
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	1,774	57.82	102,572.68
CHUBB LTD	9,545	148.27	1,415,237.15
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,400	72.57	246,738.00
EVEREST RE GROUP LTD	874	227.84	199,132.16
FNF GROUP	5,241	37.98	199,053.18
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	6,942	55.84	387,641.28
LINCOLN NATIONAL CORP	4,513	75.64	341,363.32
LOEWS CORP	6,105	49.61	302,869.05
MARKEL CORP	280	1,073.00	300,440.00
MARSH & MCLENNAN COS	10,823	82.38	891,598.74
METLIFE INC	18,535	54.63	1,012,567.05
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6,000	68.32	409,920.00
PROGRESSIVE CORP	12,350	50.15	619,352.50
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	8,932	111.84	998,954.88
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,310	150.27	196,853.70
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	887	139.37	123,621.19

TORCHMARK CORP	2,216	85.42	189,290.72
TRAVELERS COS INC/THE	5,924	133.32	789,787.68
UNUM GROUP	4,788	52.46	251,178.48
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,568	159.59	409,827.12
WR BERKLEY CORP	2,063	69.25	142,862.75
XL GROUP LTD	5,720	40.04	229,028.80
CBRE GROUP INC	5,950	39.90	237,405.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	23,700	7.42	175,854.00
JONES LANG LASALLE INC	890	133.50	118,815.00
ACCENTURE PLC-CL A	12,678	144.04	1,826,139.12
ACTIVISION BLIZZARD INC	14,600	63.20	922,720.00
ADOBE SYSTEMS INC	10,089	182.30	1,839,224.70
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	3,690	53.01	195,606.90
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,075	225.59	242,509.25
ALPHABET INC-CL A	6,040	1,049.99	6,341,939.60
ALPHABET INC-CL C	6,342	1,032.48	6,547,988.16
ANSYS INC	1,820	149.10	271,362.00
AUTODESK INC	4,190	124.85	523,121.50
AUTOMATIC DATA PROCESSING	9,116	112.24	1,023,179.84
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	2,420	86.84	210,152.80
CA INC	6,760	32.65	220,714.00
CADENCE DESIGN SYS INC	6,170	43.90	270,863.00
CDK GLOBAL INC	2,720	64.74	176,092.80
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2,670	105.65	282,085.50
CITRIX SYSTEMS INC	3,228	84.90	274,057.20
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	12,078	74.27	897,033.06
COSTAR GROUP INC	660	295.78	195,214.80
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	4,320	80.87	349,358.40
DXC TECHNOLOGY CO	5,903	91.45	539,829.35
EBAY INC	21,227	37.50	796,012.50
ELECTRONIC ARTS INC	6,204	113.20	702,292.80
FACEBOOK INC-A	48,020	178.92	8,591,738.40
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	6,455	93.18	601,476.90
FIRST DATA CORP- CLASS-A	6,130	17.13	105,006.90
FISERV INC	4,508	127.03	572,651.24

FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,950	178.80	348,660.00
FORTINET INC	3,100	39.01	120,931.00
GARTNER INC	1,750	118.66	207,655.00
GLOBAL PAYMENTS INC	3,200	103.61	331,552.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	18,202	151.58	2,759,059.16
INTUIT INC	4,966	153.64	762,976.24
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,530	111.61	170,763.30
LEIDOS HOLDINGS INC	2,630	63.66	167,425.80
MASTERCARD INC	19,390	149.29	2,894,733.10
MERCADOLIBRE INC	810	267.35	216,553.50
MICROSOFT CORP	149,264	84.14	12,559,072.96
NUANCE COMMUNICATIONS INC	5,800	15.31	88,798.00
ORACLE CORP	63,033	50.18	3,162,995.94
PAYCHEX INC	6,562	63.99	419,902.38
PAYPAL HOLDINGS INC	23,257	73.39	1,706,831.23
RED HAT INC	3,600	121.64	437,904.00
SABRE CORP	4,520	18.74	84,704.80
SALESFORCE.COM INC	13,700	102.71	1,407,127.00
SERVICENOW INC	3,400	124.91	424,694.00
SPLUNK INC	2,830	67.63	191,392.90
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	3,120	40.55	126,516.00
SYMANTEC CORP	13,055	29.87	390,018.12
SYNOPSIS INC	3,207	86.92	278,752.44
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,636	72.26	262,737.36
TWITTER INC	12,260	19.90	243,974.00
VANTIV INC - CL-A	3,230	68.84	222,353.20
VERISIGN INC	1,810	108.49	196,366.90
VISA INC-CLASS A SHARES	37,622	111.36	4,189,585.92
VMWARE INC	1,555	117.94	183,396.70
WESTERN UNION CO	10,451	19.50	203,794.50
WORKDAY INC-CLASS A	2,520	109.76	276,595.20
ZILLOW GROUP INC - C	2,000	40.48	80,960.00
AMPHENOL CORP-CL A	6,450	87.33	563,278.50
APPLE INC	105,972	172.50	18,280,170.00
ARISTA NETWORKS INC	840	201.49	169,251.60

ARROW ELECTRONICS INC	1,930	78.17	150,868.10
AVNET INC	2,610	39.21	102,338.10
CDW CORP/DE	2,960	70.04	207,318.40
CISCO SYSTEMS INC	101,650	34.47	3,503,875.50
COMMSCOPE HOLDING CO INC	3,570	33.51	119,630.70
CORNING INC	18,388	31.67	582,347.96
F5 NETWORKS INC	1,205	119.65	144,178.25
FLEX LTD	10,936	18.27	199,800.72
FLIR SYSTEMS INC	2,675	46.97	125,644.75
HARRIS CORP	2,550	139.41	355,495.50
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	32,915	13.50	444,352.50
HP INC	34,005	21.47	730,087.35
JUNIPER NETWORKS INC	7,023	24.55	172,414.65
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3,655	94.25	344,483.75
NETAPP INC	5,236	44.24	231,640.64
PALO ALTO NETWORKS INC	1,900	146.36	278,084.00
SEAGATE TECHNOLOGY	6,264	36.33	227,571.12
TE CONNECTIVITY LTD	6,955	92.73	644,937.15
TRIMBLE INC	5,170	40.10	207,317.00
WESTERN DIGITAL CORP	5,848	87.01	508,834.48
XEROX CORP	4,938	29.06	143,498.28
AT&T INC	125,227	33.30	4,170,059.10
CENTURYLINK INC	19,626	16.37	321,277.62
SPRINT CORP	17,350	6.67	115,724.50
T-MOBILE US INC	6,082	58.91	358,290.62
VERIZON COMMUNICATIONS INC	83,217	47.42	3,946,150.14
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	3,700	34.40	127,280.00
AES CORP	13,728	10.49	144,006.72
ALLIANT ENERGY CORP	4,250	43.83	186,277.50
AMEREN CORPORATION	4,602	62.19	286,198.38
AMERICAN ELECTRIC POWER	9,798	74.08	725,835.84
AMERICAN WATER WORKS CO INC	3,455	88.76	306,665.80
ATMOS ENERGY CORP	1,920	87.59	168,172.80
CENTERPOINT ENERGY INC	8,142	29.59	240,921.78
CMS ENERGY CORP	5,350	48.13	257,495.50

CONSOLIDATED EDISON INC	6,306	87.04	548,874.24
DOMINION RESOURCES INC/VA	12,627	80.67	1,018,620.09
DTE ENERGY COMPANY	3,698	110.90	410,108.20
DUKE ENERGY CORP	14,256	88.52	1,261,941.12
EDISON INTERNATIONAL	6,589	79.52	523,957.28
ENTERGY CORP	3,847	87.00	334,689.00
EVERSOURCE ENERGY	6,300	63.54	400,302.00
EXELON CORP	19,006	40.94	778,105.64
FIRSTENERGY CORP	8,995	32.75	294,586.25
NEXTERA ENERGY INC	9,565	152.65	1,460,097.25
NISOURCE INC	6,540	27.33	178,738.20
OGE ENERGY CORP	3,830	35.63	136,462.90
P G & E CORP	10,191	56.80	578,848.80
PINNACLE WEST CAPITAL	2,199	89.12	195,974.88
PPL CORP	13,758	36.74	505,468.92
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	10,188	50.31	512,558.28
SCANA CORP	2,683	41.67	111,800.61
SEMPRA ENERGY	4,827	118.98	574,316.46
SOUTHERN CO	19,895	52.44	1,043,293.80
UGI CORP	3,500	47.59	166,565.00
WEC ENERGY GROUP INC	6,320	68.17	430,834.40
WESTAR ENERGY INC	2,880	54.00	155,520.00
XCEL ENERGY INC	10,414	49.59	516,430.26
ADVANCED MICRO DEVICES	16,000	11.12	177,920.00
ANALOG DEVICES INC	7,630	91.81	700,510.30
APPLIED MATERIALS INC	21,863	56.55	1,236,352.65
BROADCOM LTD	8,170	273.63	2,235,557.10
INTEL CORP	95,962	46.34	4,446,879.08
KLA-TENCOR CORPORATION	3,199	106.30	340,053.70
LAM RESEARCH CORP	3,247	207.07	672,356.29
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	8,004	18.51	148,154.04
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	5,850	53.45	312,682.50
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	4,614	93.66	432,147.24
MICRON TECHNOLOGY INC	21,887	43.71	956,680.77
NVIDIA CORP	12,135	208.69	2,532,453.15

	NXP SEMICONDUCTORS NV	6,097	115.02	701,276.94	
	QORVO INC	2,670	73.84	197,152.80	
	QUALCOMM INC	30,012	61.81	1,855,041.72	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	3,920	113.19	443,704.80	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	20,312	97.98	1,990,169.76	
	XILINX INC	5,075	72.80	369,460.00	
米ドル小計		6,340,945		459,424,324.80 (52,548,954,270)	
加ドル	ALTAGAS LTD	3,050	29.51	90,005.50	
	ARC RESOURCES LTD	7,925	16.61	131,634.25	
	CAMECO CORP	7,892	10.84	85,549.28	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	23,194	46.01	1,067,155.94	
	CENOVUS ENERGY INC	17,463	13.57	236,972.91	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	11,475	10.48	120,258.00	
	ENBRIDGE INC	33,597	46.85	1,574,019.45	
	ENCANA CORP	21,068	15.75	331,821.00	
	HUSKY ENERGY INC	6,873	16.70	114,779.10	
	IMPERIAL OIL LTD	5,952	39.82	237,008.64	
	INTER PIPELINE LTD	7,180	26.47	190,054.60	
	KEYERA CORP	3,540	37.34	132,183.60	
	PEMBINA PIPELINE CORP	10,212	44.40	453,412.80	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	3,680	18.35	67,528.00	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	4,100	34.79	142,639.00	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY -A	4,430	19.78	87,625.40	
	SUNCOR ENERGY INC	33,899	44.99	1,525,116.01	
	TOURMALINE OIL CORP	4,575	23.65	108,198.75	
	TRANSCANADA CORP	17,673	61.16	1,080,880.68	
	VERMILION ENERGY INC	2,640	45.76	120,806.40	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	4,695	56.30	264,328.50	
	AGRIUM INC	2,705	137.98	373,235.90	
	BARRICK GOLD CORP	23,944	17.89	428,358.16	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,050	62.27	189,923.50	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	14,710	14.87	218,737.70	
	FRANCO-NEVADA CORP	3,805	101.59	386,549.95	
	GOLDCORP INC	17,917	16.71	299,393.07	

KINROSS GOLD CORP	25,015	5.07	126,826.05
METHANEX CORP	1,650	64.25	106,012.50
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	17,917	24.64	441,474.88
TECK RESOURCES LTD-CLS B	11,955	26.59	317,883.45
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	23,419	4.00	93,676.00
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,460	78.69	114,887.40
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	9,395	26.13	245,491.35
YAMANA GOLD INC	19,626	3.29	64,569.54
BOMBARDIER INC 'B'	34,746	3.13	108,754.98
CAE INC	6,315	23.10	145,876.50
FINNING INTERNATIONAL INC	2,845	31.64	90,015.80
SNC-LAVALIN GROUP INC	3,195	58.98	188,441.10
CANADIAN NATL RAILWAY CO	15,368	102.44	1,574,297.92
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	2,915	220.66	643,223.90
LINAMAR CORP	980	79.38	77,792.40
MAGNA INTERNATIONAL INC	7,018	70.33	493,575.94
GILDAN ACTIVEWEAR INC	4,540	37.03	168,116.20
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	4,638	83.85	388,896.30
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	8,165	29.35	239,642.75
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,560	156.00	243,360.00
DOLLARAMA INC	2,180	142.98	311,696.40
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	8,510	61.99	527,534.90
EMPIRE CO LTD 'A'	3,000	23.73	71,190.00
LOBLAW COMPANIES LTD	4,989	67.04	334,462.56
METRO INC	4,380	41.28	180,806.40
WESTON (GEORGE) LTD	1,182	109.09	128,944.38
SAPUTO INC	5,040	45.00	226,800.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	6,734	14.73	99,191.82
BANK OF MONTREAL	13,261	99.27	1,316,419.47
BANK OF NOVA SCOTIA	24,319	83.65	2,034,284.35
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	8,705	114.11	993,327.55
NATIONAL BANK OF CANADA	6,740	63.15	425,631.00
ROYAL BANK OF CANADA	29,529	101.42	2,994,831.18
TORONTO-DOMINION BANK	37,350	73.28	2,737,008.00
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	18,183	53.22	967,699.26

	CI FINANCIAL CORP	4,630	28.40	131,492.00	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	7,180	10.01	71,871.80	
	IGM FINANCIAL INC	1,945	44.49	86,533.05	
	ONEX CORPORATION	1,905	96.19	183,241.95	
	THOMSON REUTERS CORP	5,534	56.89	314,829.26	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	590	674.74	398,096.60	
	GREAT-WEST LIFECO INC	5,974	36.03	215,243.22	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	1,735	58.78	101,983.30	
	INTACT FINANCIAL CORP	2,485	106.45	264,528.25	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	41,291	26.59	1,097,927.69	
	POWER CORP OF CANADA	7,800	33.21	259,038.00	
	POWER FINANCIAL CORP	5,715	36.52	208,711.80	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	12,944	50.38	652,118.72	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	3,320	20.57	68,292.40	
	CGI GROUP INC - CL A	4,650	67.99	316,153.50	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	420	735.60	308,952.00	
	OPEN TEXT CORP	5,100	43.98	224,298.00	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	1,800	126.06	226,908.00	
	BLACKBERRY LTD	10,328	14.01	144,695.28	
	BCE INC	2,930	60.58	177,499.40	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	7,185	66.24	475,934.40	
	TELUS CORP	4,366	46.47	202,888.02	
	ATCO LTD -CLASS I	1,920	45.94	88,204.80	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,590	38.67	100,155.30	
	FORTIS INC	8,075	47.50	383,562.50	
	HYDRO ONE LTD	6,290	22.69	142,720.10	
加ドル小計		836,770		36,126,697.66	(3,236,229,576)
ユーロ	ENAGAS SA	5,680	24.23	137,654.80	
	ENI SPA	51,366	14.38	738,643.08	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	9,315	15.90	148,108.50	
	NESTE OYJ	2,740	48.82	133,766.80	
	OMV AG	3,490	53.18	185,598.20	
	REPSOL SA	24,709	15.91	393,243.73	
	SAIPEM SPA	12,351	3.84	47,477.24	



SNAM SPA	46,120	4.44	204,957.28
TENARIS SA	9,355	13.06	122,176.30
TOTAL SA	48,107	48.47	2,331,986.82
VOPAK	1,270	36.72	46,640.75
AIR LIQUIDE SA	8,929	111.45	995,137.05
AKZO NOBEL	5,058	77.92	394,119.36
ARCELORMITTAL	12,982	25.49	330,976.09
ARKEMA	1,335	109.40	146,049.00
BASF SE	18,615	97.01	1,805,841.15
COVESTRO AG	2,140	83.81	179,353.40
CRH PLC	17,110	31.48	538,622.80
EVONIK INDUSTRIES AG	3,580	32.03	114,685.30
FUCHS PETROLUB SE-PRF	1,720	48.62	83,626.40
HEIDELBERGCEMENT AG	2,845	85.45	243,105.25
IMERYS SA	830	79.89	66,308.70
K+S AG	3,880	21.37	82,915.60
KONINKLIJKE DSM NV	3,842	75.93	291,723.06
LANXESS AG	1,935	70.30	136,030.50
LINDE AG	3,695	188.65	697,061.75
SOLVAY SA	1,581	130.70	206,636.70
STORA ENSO OYJ-R SHS	12,085	13.72	165,806.20
SYMRISE AG	2,640	68.28	180,259.20
THYSSENKRUPP AG	7,415	23.35	173,140.25
UMICORE	4,240	39.70	168,328.00
UPM-KYMMENE OYJ	10,878	26.36	286,744.08
VOESTALPINE AG	2,509	47.55	119,302.95
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4,176	34.18	142,756.56
AIRBUS GROUP SE	11,848	87.17	1,032,790.16
ALSTOM	3,590	34.90	125,308.95
ANDRITZ AG	1,420	47.73	67,783.70
BOSKALIS WESTMINSTER	1,695	31.09	52,697.55
BOUYGUES SA	4,210	41.67	175,451.75
BRENNTAG AG	3,095	50.95	157,690.25
CNH INDUSTRIAL NV	22,370	11.28	252,333.60
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	10,106	49.82	503,531.45

DASSAULT AVIATION SA	50	1,345.00	67,250.00
EIFFAGE	1,130	90.30	102,039.00
FERROVIAL SA	9,975	18.50	184,537.50
FERROVIAL SA -RTS	9,975	0.41	4,089.75
GEA GROUP AG	3,940	41.99	165,460.30
HOCHTIEF AG	440	153.50	67,540.00
KION GROUP AG	1,400	68.67	96,138.00
KONE OYJ-B	6,474	46.34	300,005.16
LEGRAND SA	5,628	64.20	361,317.60
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	8,130	14.83	120,567.90
MAN SE	824	95.33	78,551.92
METSO OYJ	2,420	31.68	76,665.60
OSRAM LICHT AG	1,582	65.80	104,095.60
PRYSMIAN SPA	3,425	29.95	102,578.75
REXEL SA	6,250	15.37	96,062.50
SAFRAN SA	6,520	91.34	595,536.80
SCHNEIDER ELECTRIC SE	11,448	74.94	857,913.12
SIEMENS AG-REG	15,506	124.20	1,925,845.20
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	4,180	11.94	49,909.20
THALES SA	2,345	89.94	210,909.30
VINCI SA	10,390	85.83	891,773.70
WARTSILA OYJ ABP	2,940	57.30	168,462.00
ZODIAC AEROSPACE	4,550	24.63	112,089.25
BUREAU VERITAS SA	5,650	22.75	128,565.75
EDENRED	3,906	24.94	97,415.64
RANDSTAD HOLDING NV	2,285	52.52	120,008.20
RELX NV	20,559	19.19	394,630.00
SOCIETE BIC SA	565	89.27	50,437.55
WOLTERS KLUWER	6,297	42.52	267,779.92
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	12,000	18.52	222,240.00
ADP	650	147.45	95,842.50
AENA SA	1,490	159.90	238,251.00
ATLANTIA SPA	9,360	27.47	257,119.20
BOLLORE	20,400	4.21	85,904.40
DEUTCHE LUFTHANSA	5,680	28.04	159,267.20

DEUTSCHE POST AG-REG	20,063	40.21	806,833.54
FRAPORT AG	980	80.25	78,645.00
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	8,760	10.84	94,958.40
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	12,822	7.01	89,882.22
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	6,645	89.57	595,192.65
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,190	76.49	91,023.10
CONTINENTAL AG	2,235	222.25	496,728.75
DAIMLER AG	19,492	73.25	1,427,789.00
FERRARI NV	2,384	101.40	241,737.60
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	19,647	15.66	307,672.02
MICHELIN (CGDE)-B	3,679	127.20	467,968.80
NOKIAN RENKAAT OYJ	1,965	38.40	75,456.00
PEUGEOT SA	9,800	20.61	201,978.00
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	3,150	64.09	201,883.50
RENAULT SA	3,477	90.00	312,930.00
SCHAEFFLER AG-PRF	3,550	13.54	48,084.75
VALEO SA	4,860	60.00	291,600.00
VOLKSWAGEN AG	591	165.10	97,574.10
VOLKSWAGEN AG-PFD	3,853	162.95	627,846.35
ADIDAS AG	3,831	187.00	716,397.00
HERMES INTERNATIONAL	612	446.25	273,105.00
HUGO BOSS AG -ORD	1,230	71.94	88,486.20
KERING	1,607	404.35	649,790.45
LUXOTTICA GROUP SPA	3,486	48.72	169,837.92
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	5,724	258.15	1,477,650.60
SEB SA	480	157.15	75,432.00
ACCOR SA	3,456	42.70	147,571.20
PADDY POWER BETFAIR PLC	1,630	93.61	152,584.30
SODEXO	1,970	109.80	216,306.00
ALTICE NV -A	8,340	12.51	104,333.40
ALTICE NV -B	1,940	12.58	24,414.90
AXEL SPRINGER SE	995	60.41	60,107.95
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	21.50	81,592.50
JC DECAUX SA	1,200	32.79	39,354.00
LAGARDERE S.C.A.	2,980	28.35	84,483.00

PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	4,805	28.87	138,720.35
PUBLICIS GROUPE	4,075	55.20	224,940.00
RTL GROUP	630	63.86	40,231.80
SES	7,520	13.59	102,234.40
TELENET GROUP HOLDING NV	1,240	60.00	74,400.00
VIVENDI	20,560	21.74	446,974.40
INDITEX	22,705	31.15	707,260.75
ZALANDO SE	1,700	43.73	74,349.50
CARREFOUR SA	12,213	17.42	212,811.52
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,344	48.71	65,466.24
COLRUYT SA	1,375	44.01	60,520.62
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	11,008	4.07	44,879.61
JERONIMO MARTINS	5,075	16.07	81,580.62
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	26,448	16.27	430,308.96
METRO WHOLESALE & FOOD SPECI	4,140	16.38	67,833.90
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	15,451	105.20	1,625,445.20
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	4,910	34.41	168,977.65
DANONE	12,354	70.53	871,327.62
HEINEKEN HOLDING NV	2,125	80.66	171,402.50
HEINEKEN NV	5,293	84.80	448,846.40
KERRY GROUP PLC-A	3,380	85.64	289,463.20
PERNOD-RICARD SA	4,406	129.05	568,594.30
REMY COINTREAU	470	113.25	53,227.50
BEIERSDORF AG	2,015	97.88	197,228.20
HENKEL AG & CO KGAA	1,850	110.25	203,962.50
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	3,743	123.30	461,511.90
L'OREAL	5,106	192.60	983,415.60
UNILEVER NV-CVA	33,315	49.42	1,646,427.30
ESSILOR INTERNATIONAL	4,215	108.00	455,220.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	4,303	83.20	358,009.60
FRESENIUS SE & CO KGAA	8,675	69.77	605,254.75
KONINKLIJKE PHILIPS NV	19,211	35.77	687,273.52
BAYER AG	16,770	116.00	1,945,320.00
EUROFINS SCIENTIFIC	220	533.35	117,337.00
GRIFOLS SA	6,820	26.72	182,264.50

IPSEN	640	107.85	69,024.00
MERCK KGAA	2,630	92.61	243,564.30
ORION OYJ-CLASS B	1,830	35.35	64,690.50
QIAGEN N.V.	4,364	29.11	127,036.04
RECORDATI SPA	1,730	40.60	70,238.00
SANOFI	23,086	79.02	1,824,255.72
UCB SA	2,798	61.45	171,937.10
ABN AMRO GROUP NV-CVA	7,170	26.29	188,535.15
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	135,993	7.33	996,828.69
BANCO DE SABADELL SA	109,692	1.68	185,050.40
BANCO SANTANDER SA	325,679	5.71	1,859,952.76
BANK OF IRELAND GROUP PLC	18,619	6.72	125,268.63
BANKIA SA	23,750	4.00	95,166.25
BANKINTER SA	13,960	7.78	108,678.60
BNP PARIBAS	22,732	65.76	1,494,856.32
CAIXABANK S.A	76,740	3.97	304,888.02
COMMERZBANK AG	21,334	11.78	251,421.19
CREDIT AGRICOLE SA	21,992	14.80	325,481.60
ERSTE GROUP BANK AG	6,438	36.21	233,119.98
ING GROEP NV-CVA	79,405	15.75	1,251,025.77
INTESA SANPAOLO	270,973	2.85	772,273.05
INTESA SANPAOLO-RSP	20,000	2.69	53,800.00
KBC GROEP NV	5,119	71.17	364,319.23
MEDIOBANCA SPA	11,670	9.60	112,032.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	2,770	29.36	81,327.20
SOCIETE GENERALE	15,469	45.70	706,933.30
UNICREDIT SPA	39,726	16.39	651,109.14
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	42,465	14.51	616,167.15
DEUTSCHE BOERSE AG	4,000	91.03	364,120.00
EURAZEO SE	1,005	80.65	81,053.25
EXOR NV	2,264	56.50	127,916.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,432	94.32	135,066.24
NATIXIS	19,150	6.72	128,745.45
WENDEL	600	146.95	88,170.00
AEGON NV	38,139	5.12	195,576.79

AGEAS	4,044	41.21	166,673.46
ALLIANZ SE-REG	9,288	202.85	1,884,070.80
ASSICURAZIONI GENERALI	23,958	15.75	377,338.50
AXA	39,772	25.47	1,013,191.70
CNP ASSURANCES	3,530	19.94	70,388.20
HANNOVER RUECK SE-REG	1,355	106.50	144,307.50
MAPFRE SA	20,814	2.73	56,988.73
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,096	194.85	603,255.60
NN GROUP NV	6,340	35.53	225,260.20
POSTE ITALIANE SPA	10,260	6.24	64,022.40
SAMPO OYJ-A SHS	9,109	44.75	407,627.75
SCOR SE	3,152	35.21	110,997.68
UNIPOLSAI SPA	18,580	1.94	36,138.10
DEUTSCHE WOHNEN SE	7,500	37.09	278,212.50
VONOVIA SE	9,298	38.73	360,111.54
AMADEUS IT GROUP SA	9,370	58.79	550,862.30
ATOS SE	2,060	130.85	269,551.00
CAP GEMINI SA	3,149	103.70	326,551.30
DASSAULT SYSTEMES SA	2,790	91.24	254,559.60
GEMALTO	1,850	33.39	61,780.75
SAP SE	19,972	98.85	1,974,232.20
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2,930	54.40	159,392.00
INGENICO GROUP	1,160	84.34	97,834.40
NOKIA OYJ	119,986	4.32	518,579.49
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	66,416	15.64	1,038,746.24
ELISA OYJ	2,505	34.88	87,374.40
ILIAD SA	520	212.90	110,708.00
KONINKLIJKE KPN NV	65,606	2.97	194,849.82
ORANGE S.A.	41,574	14.29	594,092.46
PROXIMUS	2,440	28.82	70,320.80
TELECOM ITALIA SPA	233,203	0.75	176,767.87
TELECOM ITALIA-RSP	125,887	0.61	77,924.05
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	12,220	4.38	53,523.60
TELEFONICA SA	94,699	8.89	841,968.80
E.ON SE	44,659	10.36	462,890.53

	EDF	7,875	11.82	93,121.87
	ENDESA SA	6,840	19.45	133,072.20
	ENEL SPA	164,637	5.37	884,923.87
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	54,991	2.95	162,553.39
	ENGIE	35,254	14.63	515,942.29
	FORTUM OYJ	8,865	18.36	162,761.40
	GAS NATURAL SDG SA	7,722	18.14	140,077.08
	IBERDROLA SA	117,842	6.85	808,278.27
	INNOGY SE	2,850	40.79	116,265.75
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	9,010	18.25	164,477.55
	RWE AG	10,685	22.25	237,741.25
	SUEZ	6,199	15.27	94,658.73
	TERNA SPA	27,677	5.23	144,889.09
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	9,184	20.47	188,042.40
	ASML HOLDING NV	7,662	157.60	1,207,531.20
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	23,445	24.37	571,471.87
	STMICROELECTRONICS NV	12,733	20.98	267,138.34
ユーロ小計		3,979,037		83,077,090.52 (11,026,822,224)
英ポンド	BP PLC	399,108	5.16	2,062,590.14
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	89,948	24.35	2,190,233.80
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	76,749	24.71	1,896,851.53
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	13,000	7.31	95,095.00
	ANGLO AMERICAN PLC	27,074	14.85	402,048.90
	ANTOFAGASTA PLC	8,730	9.90	86,427.00
	BHP BILLITON PLC	42,721	14.27	609,842.27
	CRODA INTERNATIONAL PLC	2,751	42.42	116,697.42
	FRESNILLO PLC	3,990	12.90	51,471.00
	GLENCORE PLC	250,373	3.78	948,538.11
	JOHNSON MATTHEY PLC	4,199	35.03	147,090.97
	MONDI PLC	7,400	18.30	135,420.00
	RANDGOLD RESOURCES LTD	1,840	69.45	127,788.00
	RIO TINTO PLC	25,265	37.25	941,121.25
	ASHTREAD GROUP PLC	9,930	19.77	196,316.10
	BAE SYSTEMS PLC ORD	65,595	5.91	387,666.45

BUNZL PLC	7,276	23.20	168,803.20
COBHAM PLC	48,771	1.39	68,084.31
DCC PLC	1,810	72.65	131,496.50
FERGUSON PLC	5,324	53.60	285,366.40
IMI PLC	6,116	12.73	77,856.68
MEGGITT PLC	13,905	5.26	73,140.30
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	33,045	9.77	322,849.65
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENTITL-C(N)	1,520,070	0.00	1,520.07
SMITHS GROUP PLC	8,813	15.89	140,038.57
TRAVIS PERKINS PLC	5,800	15.68	90,944.00
WEIR GROUP PLC/THE	3,880	20.45	79,346.00
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,275	8.17	51,298.12
CAPITA PLC	15,309	5.24	80,219.16
EXPERIAN PLC	18,678	16.04	299,595.12
G4S PLC	34,639	2.86	99,240.73
INTERTEK GROUP PLC	3,545	53.70	190,366.50
RELX PLC	20,676	17.41	359,969.16
EASYJET PLC	3,840	13.14	50,457.60
ROYAL MAIL PLC	19,950	3.78	75,590.55
GKN PLC	33,065	3.18	105,245.89
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	22,900	6.54	149,880.50
BERKELEY GROUP HOLDINGS	2,600	36.99	96,174.00
BURBERRY GROUP PLC	8,904	19.15	170,511.60
PERSIMMON PLC	7,000	28.31	198,170.00
TAYLOR WIMPEY PLC	73,610	2.00	147,293.61
CARNIVAL PLC	4,050	49.75	201,487.50
COMPASS GROUP PLC	32,468	16.65	540,592.20
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	3,859	43.63	168,368.17
MERLIN ENTERTAINME	15,550	3.77	58,747.90
TUI AG-DI	9,943	13.63	135,523.09
WHITBREAD PLC	3,520	37.05	130,416.00
ITV PLC	77,235	1.59	123,421.53
PEARSON PLC	17,749	6.93	123,089.31
SKY PLC	21,334	9.46	201,926.31
WPP PLC	25,184	13.18	331,925.12



DIXONS CARPHONE PLC	22,000	1.63	35,860.00
KINGFISHER PLC	45,257	3.17	143,509.94
MARKS & SPENCER GROUP PLC	34,970	3.28	114,806.51
NEXT PLC	2,987	44.73	133,608.51
SAINSBURY (J) PLC	32,441	2.35	76,268.79
TESCO PLC	171,154	1.79	306,536.81
WM MORRISON SUPERMARKETS	49,255	2.19	107,868.45
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	7,335	33.33	244,475.55
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	46,667	49.95	2,331,249.98
COCA-COLA HBC AG-CDI	3,550	26.38	93,649.00
DIAGEO PLC	50,982	25.94	1,322,473.08
IMPERIAL BRANDS PLC	19,242	30.38	584,571.96
TATE & LYLE PLC	10,510	6.90	72,519.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	13,145	65.83	865,335.35
UNILEVER PLC	26,037	42.78	1,113,862.86
CONVATEC GROUP PLC	27,730	1.82	50,468.60
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	7,000	5.95	41,650.00
SMITH & NEPHEW PLC	18,786	14.12	265,258.32
ASTRAZENECA PLC	25,683	51.80	1,330,379.40
GLAXOSMITHKLINE PLC	100,071	13.61	1,361,966.31
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2,860	10.92	31,231.20
SHIRE PLC	18,675	37.23	695,270.25
BARCLAYS PLC	338,381	1.83	620,083.18
HSBC HOLDINGS PLC	406,321	7.38	2,999,055.30
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,450,176	0.67	977,273.60
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	72,080	2.78	200,814.88
STANDARD CHARTERED PLC	65,660	7.23	475,050.10
3I GROUP PLC	20,499	9.67	198,327.82
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,720	15.82	90,490.40
INVESTEC PLC	13,185	5.26	69,353.10
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	6,577	37.44	246,242.88
SCHRODERS PLC	1,921	34.97	67,177.37
ST JAMES'S PLACE PLC	11,000	11.82	130,020.00
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	53,130	4.35	231,328.02
ADMIRAL GROUP PLC	3,295	18.66	61,484.70

	AVIVA PLC	84,235	5.09	429,177.32	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	29,333	3.65	107,212.11	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	115,841	2.72	316,014.24	
	OLD MUTUAL PLC	104,159	1.93	201,443.50	
	PRUDENTIAL PLC	52,292	18.68	976,814.56	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	21,498	6.17	132,750.15	
	AUTO TRADER GROUP PLC	17,950	3.48	62,591.65	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	8,700	26.69	232,203.00	
	SAGE GROUP PLC/THE	20,480	7.61	155,852.80	
	WORLDPAY GROUP PLC	42,180	4.09	172,727.10	
	BT GROUP PLC	173,382	2.49	433,108.23	
	INMARSAT PLC	10,010	5.94	59,509.45	
	VODAFONE GROUP PLC	541,898	2.19	1,188,653.26	
	CENTRICA PLC	111,175	1.67	186,440.47	
	NATIONAL GRID PLC	68,318	9.18	627,432.51	
	SEVERN TRENT PLC	4,423	21.31	94,254.13	
	SSE PLC	19,737	13.67	269,804.79	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	13,325	8.35	111,263.75	
英ボンド小計		7,788,584		39,370,927.53	(5,884,772,537)
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	170	656.50	111,605.00	
	GIVAUDAN-REG	183	2,271.00	415,593.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	9,359	56.95	532,995.05	
	SIKA AG-BR	47	7,415.00	348,505.00	
	ABB LTD-REG	40,195	26.18	1,052,305.10	
	GEBERIT AG-REG	805	444.40	357,742.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	360	221.40	79,704.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	970	227.80	220,966.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	3,557	78.85	280,469.45	
	SGS SA-REG	113	2,470.00	279,110.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,150	173.50	199,525.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	10,429	92.25	962,075.25	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	680	392.70	267,036.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	930	75.00	69,750.00	
	DUFREY AG-REG	690	144.60	99,774.00	

	BARRY CALLEBAUT AG-REG	45	1,578.00	71,010.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	18	5,680.00	102,240.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	68,020.00	136,040.00	
	NESTLE SA-REG	63,183	84.75	5,354,759.25	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,160	180.00	208,800.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	170	701.00	119,170.00	
	LONZA GROUP AG-REG	1,608	268.20	431,265.60	
	NOVARTIS AG-REG	45,243	83.60	3,782,314.80	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	14,288	232.70	3,324,817.60	
	VIFOR PHARMA AG	1,070	129.40	138,458.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	50,088	16.14	808,420.32	
	JULIUS BAER GROUP LTD	4,600	59.45	273,470.00	
	PARGESA HOLDING SA-BR	655	85.05	55,707.75	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	370	677.00	250,490.00	
	UBS GROUP AG-REG	74,892	17.07	1,278,406.44	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,080	157.10	169,668.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	640	344.80	220,672.00	
	SWISS RE AG	6,569	93.35	613,216.15	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,171	302.90	960,495.90	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,460	86.40	126,144.00	
	SWISSCOM AG-REG	504	502.00	253,008.00	
	スイスフラン小計	340,454		23,955,728.66 (2,735,983,770)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	4,320	208.60	901,152.00	
	BOLIDEN AB	5,920	298.30	1,765,936.00	
	ALFA LAVAL AB	5,430	213.90	1,161,477.00	
	ASSA ABLOY AB-B	20,910	176.20	3,684,342.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	13,705	373.20	5,114,706.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	7,670	338.10	2,593,227.00	
	SANDVIK AB	21,690	153.80	3,335,922.00	
	SKANSKA AB-B SHS	7,170	184.60	1,323,582.00	
	SKF AB-B SHARES-B	7,829	188.30	1,474,200.70	
	VOLVO AB-B SHS-B	32,660	169.40	5,532,604.00	
	SECURITAS AB-B SHS	5,849	147.00	859,803.00	
	ELECTROLUX AB - B	5,455	297.60	1,623,408.00	

	HUSQVARNA AB-B SHS	8,480	81.50	691,120.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	18,788	209.50	3,936,086.00	
	ICA GRUPPEN AB	1,450	309.90	449,355.00	
	SWEDISH MATCH AB	4,040	315.10	1,273,004.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	13,015	246.10	3,202,991.50	
	GETINGE AB-B SHS	4,450	162.70	724,015.00	
	NORDEA BANK AB	62,628	101.00	6,325,428.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	31,870	102.90	3,279,423.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	31,220	119.60	3,733,912.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	17,930	205.70	3,688,201.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,700	219.80	593,460.00	
	INVESTOR AB-B SHS	9,135	416.60	3,805,641.00	
	KINNEVIK AB - B	4,235	275.30	1,165,895.50	
	LUNDBERGS AB-B SHS	700	660.00	462,000.00	
	ERICSSON LM-B SHS	64,235	53.90	3,462,266.50	
	HEXAGON AB-B SHS	5,260	428.10	2,251,806.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,370	543.50	744,595.00	
	TELE2 AB-B SHS	6,255	107.20	670,536.00	
	TELIA CO AB	53,480	38.37	2,052,027.60	
	スウェーデンクローナ小計	479,849		71,882,122.80	(974,721,585)
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	23,294	165.40	3,852,827.60	
	NORSK HYDRO A S	26,460	64.00	1,693,440.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	3,780	393.10	1,485,918.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	1,430	234.00	334,620.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	1,650	257.30	424,545.00	
	MARINE HARVEST	7,720	153.60	1,185,792.00	
	ORKLA ASA	17,310	79.85	1,382,203.50	
	DNB ASA	19,945	158.80	3,167,266.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,200	150.30	631,260.00	
	TELENOR ASA	14,895	173.10	2,578,324.50	
	ノルウェークローネ小計	120,684		16,736,196.60	(234,306,752)
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,890	557.50	1,053,675.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	4,865	352.50	1,714,912.50	

	VESTAS WIND SYSTEMS AS	4,440	517.00	2,295,480.00	
	ISS A/S	3,100	273.80	848,780.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	80	11,610.00	928,800.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	138	12,070.00	1,665,660.00	
	DSV A/S	3,870	496.60	1,921,842.00	
	PANDORA A/S	2,320	599.50	1,390,840.00	
	CARLSBERG AS-B	2,180	752.00	1,639,360.00	
	COLOPLAST-B	2,545	480.90	1,223,890.50	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	3,000	183.00	549,000.00	
	GENMAB A/S	1,180	1,206.00	1,423,080.00	
	H LUNDBECK A/S	1,090	366.10	399,049.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	37,205	316.60	11,779,103.00	
	DANSKE BANK A/S	15,655	244.00	3,819,820.00	
	TRYG A/S	2,575	151.50	390,112.50	
	TDC A/S	14,545	36.68	533,510.60	
	ORSTED A/S	2,990	340.40	1,017,796.00	
	デンマーククローネ小計	103,668		34,594,711.10 (616,823,698)	
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	5,335	34.88	186,084.80	
	OIL SEARCH LTD	28,830	7.20	207,576.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	35,950	8.17	293,711.50	
	SANTOS LTD	33,135	4.56	151,095.60	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	15,438	31.80	490,928.40	
	ALUMINA LTD	46,512	2.44	113,489.28	
	AMCOR LIMITED	23,840	14.91	355,454.40	
	BHP BILLITON LTD	65,796	27.69	1,821,891.24	
	BLUESCOPE STEEL LTD	9,840	12.88	126,739.20	
	BORAL LTD	17,115	7.43	127,164.45	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	29,665	4.80	142,392.00	
	INCITEC PIVOT LTD	31,550	3.86	121,783.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	8,505	19.35	164,571.75	
	NEWCREST MINING LTD	15,439	22.99	354,942.61	
	ORICA LIMITED	6,935	21.37	148,200.95	
	RIO TINTO LTD	8,718	73.11	637,372.98	
	SOUTH32 LTD	106,097	3.61	383,010.17	

CIMIC GROUP LTD	1,867	50.76	94,768.92
BRAMBLES LTD	32,868	9.43	309,945.24
SEEK LTD	8,040	18.30	147,132.00
AURIZON HOLDINGS LTD	46,150	5.19	239,518.50
QANTAS AIRWAYS LTD	7,093	6.21	44,047.53
SYDNEY AIRPORT	24,156	7.25	175,131.00
TRANSURBAN GROUP	43,195	12.42	536,481.90
ARISTOCRAT LEISURE LTD	10,890	23.73	258,419.70
CROWN RESORTS LTD	6,745	11.79	79,523.55
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,180	47.51	56,061.80
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	970	47.26	45,842.20
TABCORP HOLDINGS LTD	15,336	4.44	68,091.84
TATTS GROUP LTD	30,060	4.12	123,847.20
REA GROUP LTD	1,150	73.42	84,433.00
WESFARMERS LTD	23,665	42.44	1,004,342.60
WOOLWORTHS LTD	26,772	26.06	697,678.32
COCA-COLA AMATIL LTD	10,650	8.01	85,306.50
TREASURY WINE ESTATES LTD	15,946	15.29	243,814.34
COCHLEAR LTD	1,277	176.62	225,543.74
HEALTHSCOPE LTD	33,080	1.93	64,009.80
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,935	67.65	198,552.75
SONIC HEALTHCARE LTD	8,110	21.71	176,068.10
CSL LTD	9,502	140.99	1,339,686.98
AUST AND NZ BANKING GROUP	59,389	29.90	1,775,731.10
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	8,120	12.48	101,337.60
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	10,478	11.12	116,515.36
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	35,097	77.79	2,730,195.63
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	54,133	31.78	1,720,346.74
WESTPAC BANKING CORP	67,991	33.27	2,262,060.57
AMP LTD	62,647	5.05	316,367.35
ASX LTD	3,445	54.05	186,202.25
CHALLENGER LTD	9,950	13.26	131,937.00
MACQUARIE GROUP LTD	6,494	99.17	644,009.98
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	50,298	6.75	339,511.50
MEDIBANK PRIVATE LTD	62,000	3.11	192,820.00

	QBE INSURANCE GROUP LTD	29,380	10.91	320,535.80	
	SUNCORP GROUP LTD	27,180	13.86	376,714.80	
	COMPUTERSHARE LTD	11,490	15.37	176,601.30	
	TELSTRA CORPORATION LTD	87,384	3.50	305,844.00	
	AGL ENERGY LTD	12,851	25.17	323,459.67	
	AUSNET SERVICES	40,750	1.79	73,146.25	
豪ドル小計		1,489,414		24,217,992.74 (2,117,621,285)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	15,180	7.18	108,992.40	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	21,455	6.19	132,913.72	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	8,500	9.24	78,540.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	35,157	3.64	127,971.48	
	CONTACT ENERGY LIMITED	15,350	5.77	88,569.50	
	MERCURY NZ LTD	13,500	3.36	45,360.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	28,000	2.84	79,520.00	
ニュージーランドドル小計		137,142		661,867.10 (52,267,644)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	56,708	99.15	5,622,598.20	
	NWS HOLDINGS LTD	28,500	15.94	454,290.00	
	MTR CORP	34,000	44.85	1,524,900.00	
	LI & FUNG LTD	138,000	3.85	531,300.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	29,000	45.30	1,313,700.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	14,500	30.75	445,875.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	50,000	53.95	2,697,500.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	16,800	18.20	305,760.00	
	SANDS CHINA LTD	49,800	37.85	1,884,930.00	
	SJM HOLDINGS LTD	48,000	6.65	319,200.00	
	WYNN MACAU LTD	35,800	20.55	735,690.00	
	WH GROUP LTD	153,500	7.84	1,203,440.00	
	BANK OF EAST ASIA	21,640	33.95	734,678.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	77,000	36.80	2,833,600.00	
	HANG SENG BANK LTD	14,600	184.00	2,686,400.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	23,600	224.20	5,291,120.00	
	AIA GROUP LTD	246,390	60.25	14,844,997.50	
CK ASSET HOLDINGS LTD	55,708	66.55	3,707,367.40		

	HANG LUNG GROUP LTD	17,000	27.35	464,950.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	46,000	17.98	827,080.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	25,126	52.90	1,329,165.40	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	15,000	38.35	575,250.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	11,450	35.35	404,757.50	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	134,666	11.98	1,613,298.68	
	SINO LAND CO	63,050	13.66	861,263.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	30,480	128.00	3,901,440.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	10,517	77.40	814,015.80	
	SWIRE PROPERTIES LTD	23,200	26.60	617,120.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	24,800	74.75	1,853,800.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	19,600	55.75	1,092,700.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	54,000	9.55	515,700.00	
	PCCW LTD	80,000	4.30	344,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	13,000	68.00	884,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	34,500	79.30	2,735,850.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	56,000	7.19	402,640.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	171,517	14.80	2,538,451.60	
	POWER ASSETS HOLDINGS	28,500	67.50	1,923,750.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	4,200	117.00	491,400.00	
	香港ドル小計	1,956,152		71,327,978.08 (1,045,668,158)	
シンガポールド ル	KEPPEL CORP LTD	29,060	7.60	220,856.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	21,000	3.30	69,300.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,000	3.47	114,510.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,000	2.04	93,840.00	
	SATS LTD	13,000	4.77	62,010.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	12,800	10.28	131,584.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	114,500	1.22	140,262.50	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	32,550	2.66	86,583.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,000	39.09	78,180.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	130,000	0.39	50,700.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	29,660	3.39	100,547.40	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	36,715	22.97	843,343.55	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	61,540	11.81	726,787.40	



	UNITED OVERSEAS BANK LTD	26,300	24.77	651,451.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	12,300	7.69	94,587.00	
	CAPITALAND LTD	51,800	3.69	191,142.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	10,000	12.69	126,900.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	60,000	3.33	199,800.00	
	UOL GROUP LTD	12,250	8.95	109,637.50	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	172,180	3.77	649,118.60	
シンガポールドル小計		906,655		4,741,139.95	(397,307,527)
イスラエルシュケル	FRUTAROM	810	292.80	237,168.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	9,770	14.76	144,205.20	
	ELBIT SYSTEMS LTD	500	523.10	261,550.00	
	BANK HAPOALIM BM	21,225	24.66	523,408.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	24,465	18.99	464,590.35	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	2,900	64.75	187,775.00	
	NICE LTD	1,385	301.40	417,439.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	48,790	5.25	256,537.82	
イスラエルシュケル小計		109,845		2,492,673.87	(81,186,387)
合 計		24,589,199		80,952,665,413	(80,952,665,413)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	出資金	PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A-LP	2,027.00	41,026.48	
	出資金小計		2,027.00	41,026.48	(4,692,609)
	投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	7,010	138,657.80	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	1,490	186,697.00	
		AMERICAN TOWER CORP	8,589	1,220,496.90	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	20,020	224,824.60	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,855	519,524.35	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,147	379,779.96	

BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	6,100	106,750.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	1,940	179,430.60	
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	10,000	123,800.00	
CROWN CASTLE INTL CORP	8,010	853,145.10	
DIGITAL REALTY TRUST INC	4,135	492,313.10	
DUKE REALTY CORPORATION	6,875	198,137.50	
EQUINIX INC	1,628	792,266.20	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	7,530	513,621.30	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,400	355,572.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	2,450	208,348.00	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,415	179,082.40	
GGP INC	12,545	239,609.50	
HCP INC	9,285	251,994.90	
HOST HOTELS & RESORTS INC	15,169	297,767.47	
IRON MOUNTAIN INC	5,515	221,261.80	
KIMCO REALTY CORPORATION	8,795	163,323.15	
LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	137,189.91	
MACERICH CO/THE	2,460	133,799.40	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,270	234,695.30	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	2,990	122,021.90	
PROLOGIS INC	10,932	724,463.64	
PUBLIC STORAGE	3,039	635,059.83	
REALTY INCOME CORP	5,400	297,972.00	
REGENCY CENTERS CORP	3,175	203,517.50	
SBA COMMUNICATIONS CORP	2,580	398,687.40	
SIMON PROPERTY GROUP INC	6,374	987,970.00	
SL GREEN REALTY CORP	2,040	192,066.00	
UDR INC	5,820	223,895.40	
VENTAS INC	7,285	466,968.50	
VEREIT INC	19,554	154,867.68	
VORNADO REALTY TRUST	3,491	255,715.75	
WELLTOWER INC	7,380	502,947.00	
WEYERHAEUSER CO	15,508	553,790.68	
投資証券小計	249,314	14,072,031.52	(1,609,558,965)

米ドル小計			251,341	14,113,058.00 (1,614,251,574)
加ドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2,340	50,590.80
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,380	83,857.80
加ドル小計			5,720	134,448.60 (12,043,905)
ユーロ	投資証券	FONCIERE DES REGIONS	595	52,044.65
		GECINA SA	970	134,684.50
		ICADE	685	52,101.10
		KLEPIERRE	4,732	162,212.96
		UNIBAIL-RODAMCO SE-NA	2,070	447,223.50
ユーロ小計			9,052	848,266.71 (112,590,440)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	21,701	130,314.50
		HAMMERSON PLC	15,295	81,063.50
		INTU PROPERTIES PLC	19,860	43,334.52
		LAND SECURITIES GROUP PLC	15,214	145,750.12
		SEGRO PLC	18,063	98,985.24
英ポンド小計			90,133	499,447.88 (74,652,474)
豪ドル	投資証券	APA GROUP	21,286	184,975.34
		DEXUS	18,487	180,617.99
		GOODMAN GROUP	39,332	331,962.08
		GPT GROUP	33,695	172,855.35
		LENDLEASE GROUP	12,197	199,786.86
		MIRVAC GROUP	86,525	207,660.00
		SCENTRE GROUP	116,381	469,015.43
		STOCKLAND	55,310	251,660.50
		VICINITY CENTRES	72,862	194,541.54
		WESTFIELD CORP	41,745	321,019.05
豪ドル小計			497,820	2,514,094.14 (219,832,391)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	48,000	3,124,800.00
香港ドル小計			48,000	3,124,800.00 (45,809,568)
シンガ	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	51,900	139,092.00

ポールドル	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	46,640	83,718.80	
	CAPITALAND MALL TRUST	48,100	97,643.00	
	SUNTEC REIT	45,000	87,975.00	
シンガポールドル小計		191,640	408,428.80 (34,226,333)	
合計			2,113,406,685 (2,113,406,685)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

### 外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入出資金 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	出資金 1銘柄		0.0%		0.0%
	株式 599銘柄	97.0%			63.2%
	投資証券 39銘柄			3.0%	1.9%
加ドル	株式 88銘柄	99.6%			3.9%
	投資証券 2銘柄			0.4%	0.0%
ユーロ	株式 234銘柄	99.0%			13.3%
	投資証券 5銘柄			1.0%	0.1%
英ポンド	株式 104銘柄	98.7%			7.1%
	投資証券 5銘柄			1.3%	0.1%
スイスフラン	株式 36銘柄	100.0%			3.3%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	100.0%			1.2%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.0%			0.7%
豪ドル	株式 58銘柄	90.6%			2.5%
	投資証券 10銘柄			9.4%	0.3%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 38銘柄	95.8%			1.3%
	投資証券 1銘柄			4.2%	0.1%
シンガポールドル	株式 20銘柄	92.1%			0.5%

	投資証券	4銘柄			7.9%	0.0%
イスラエルシュケル	株式	8銘柄	100.0%			0.1%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

## 日本債券インデックスマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

	平成28年11月 7日現在	平成29年11月 6日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	390,348,219	131,499,443
国債証券	26,006,422,471	28,815,877,772
地方債証券	2,106,880,000	2,812,553,000
特殊債証券	3,941,803,000	3,517,684,000
社債券	1,789,226,767	1,646,515,000
未収入金	-	102,783,000
未収利息	88,951,831	89,566,925
前払費用	352,372	1,192,355
流動資産合計	34,323,984,660	37,117,671,495
資産合計	34,323,984,660	37,117,671,495
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	300,006,000	99,927,000
未払解約金	31,278,128	37,621,920
未払利息	370	156
流動負債合計	331,284,498	137,549,076
負債合計	331,284,498	137,549,076
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	24,222,472,005	26,628,181,886
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	9,770,228,157	10,351,940,533
元本等合計	33,992,700,162	36,980,122,419
純資産合計	33,992,700,162	36,980,122,419
負債純資産合計	34,323,984,660	37,117,671,495

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## (貸借対照表に関する注記)

		平成28年11月 7日現在	平成29年11月 6日現在
1.	期首	平成27年11月 7日	平成28年11月 8日
	期首元本額	25,981,130,487円	24,222,472,005円
	期首からの追加設定元本額	2,142,590,494円	4,014,076,957円
	期首からの一部解約元本額	3,901,248,976円	1,608,367,076円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	880,051,229円	1,299,980,063円
	DCインデックスバランス（株式40）	1,026,669,053円	1,386,534,583円
	DCインデックスバランス（株式60）	697,363,697円	1,027,217,032円
	DCインデックスバランス（株式80）	119,445,273円	167,462,850円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	1,560,296,614円	1,687,936,899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	4,432,641,156円	4,137,230,806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	4,266,985円	5,029,453円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	- 円	1,094,893,656円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	4,443,290円	4,872,201円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	24,562,184円	24,740,926円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	97,787,649円	101,678,455円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	365,614,728円	319,207,373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	5,481,306,102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）	37,661,156円	27,576,235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）	119,343,818円	120,941,335円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	25,020,332円	- 円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	1,113,560,535円	1,220,118,508円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,123,465,664円	1,211,835,185円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	562,577,142円	671,580,224円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	83,961,598円	101,292,777円
インデックスファンド日本債券（1年決算型）	6,182,123,593円	6,290,601,507円
日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	225,109,461円	246,145,716円
計	24,222,472,005円	26,628,181,886円
2. 受益権の総数	24,222,472,005口	26,628,181,886口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成27年11月 7日 至 平成28年11月 7日	自 平成28年11月 8日 至 平成29年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成28年11月 7日現在	平成29年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

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

（有価証券に関する注記）

（平成28年11月 7日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	44,172,268
地方債証券	1,864,000
特殊債券	3,650,000
社債券	519,172
合計	50,205,440

（平成29年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	109,891,826
地方債証券	3,340,000
特殊債券	4,443,000
社債券	1,542,000
合計	119,216,826



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

( 関連当事者との取引に関する注記 )  
該当事項はありません。

( 1口当たり情報 )

平成28年11月 7日現在		平成29年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	1.4034円	1口当たり純資産額	1.3888円
(1万口当たり純資産額)	(14,034円)	(1万口当たり純資産額)	(13,888円)

#### 附属明細表

##### 第 1 有価証券明細表 (1)株式

該当事項はありません。

##### (2)株式以外の有価証券

( 単位 : 円 )

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第 1 1 4 回利付国債 ( 5 年 )	90,000,000	90,347,752	
	第 1 1 6 回利付国債 ( 5 年 )	110,000,000	110,478,500	
	第 1 1 7 回利付国債 ( 5 年 )	90,000,000	90,478,800	
	第 1 1 8 回利付国債 ( 5 年 )	100,000,000	100,631,000	
	第 1 1 9 回利付国債 ( 5 年 )	74,000,000	74,347,060	
	第 1 2 0 回利付国債 ( 5 年 )	330,000,000	332,409,000	
	第 1 2 1 回利付国債 ( 5 年 )	100,000,000	100,542,000	
	第 1 2 2 回利付国債 ( 5 年 )	300,000,000	301,719,000	
	第 1 2 3 回利付国債 ( 5 年 )	505,000,000	508,171,400	
	第 1 2 4 回利付国債 ( 5 年 )	560,000,000	563,819,200	
	第 1 2 5 回利付国債 ( 5 年 )	325,000,000	327,385,500	
	第 1 2 6 回利付国債 ( 5 年 )	220,000,000	221,720,400	
	第 1 回利付国債 ( 4 0 年 )	40,000,000	56,955,600	
	第 2 回利付国債 ( 4 0 年 )	165,000,000	226,896,450	
	第 3 回利付国債 ( 4 0 年 )	50,000,000	68,969,500	
	第 4 回利付国債 ( 4 0 年 )	95,000,000	131,406,850	
	第 5 回利付国債 ( 4 0 年 )	35,000,000	46,508,000	
	第 6 回利付国債 ( 4 0 年 )	70,000,000	90,973,400	

第7回利付国債(40年)	50,000,000	61,891,000	
第8回利付国債(40年)	95,000,000	108,432,050	
第9回利付国債(40年)	160,000,000	130,843,200	
第10回利付国債(40年)	30,000,000	29,111,400	
第297回利付国債(10年)	28,000,000	28,497,280	
第298回利付国債(10年)	11,000,000	11,183,040	
第299回利付国債(10年)	410,000,000	418,339,400	
第300回利付国債(10年)	36,000,000	36,830,520	
第301回利付国債(10年)	206,000,000	211,634,100	
第302回利付国債(10年)	94,000,000	96,418,620	
第303回利付国債(10年)	581,000,000	598,296,370	
第304回利付国債(10年)	36,000,000	37,004,040	
第305回利付国債(10年)	473,000,000	487,861,660	
第306回利付国債(10年)	93,000,000	96,461,460	
第308回利付国債(10年)	140,000,000	145,383,000	
第309回利付国債(10年)	134,000,000	138,448,800	
第310回利付国債(10年)	78,000,000	80,592,720	
第311回利付国債(10年)	23,000,000	23,632,270	
第312回利付国債(10年)	205,000,000	213,593,600	
第313回利付国債(10年)	370,000,000	387,993,100	
第315回利付国債(10年)	65,000,000	68,150,550	
第316回利付国債(10年)	35,000,000	36,569,400	
第317回利付国債(10年)	105,000,000	110,016,900	
第318回利付国債(10年)	185,000,000	193,121,500	
第319回利付国債(10年)	5,000,000	5,253,350	
第320回利付国債(10年)	190,000,000	198,840,700	
第321回利付国債(10年)	175,000,000	183,673,000	
第322回利付国債(10年)	75,000,000	78,371,250	
第323回利付国債(10年)	45,000,000	47,118,150	
第324回利付国債(10年)	25,000,000	26,061,000	
第325回利付国債(10年)	210,000,000	219,347,100	
第326回利付国債(10年)	30,000,000	31,249,800	
第327回利付国債(10年)	65,000,000	68,042,650	
第328回利付国債(10年)	115,000,000	119,371,150	
第329回利付国債(10年)	230,000,000	241,684,000	
第330回利付国債(10年)	210,000,000	221,085,900	
第331回利付国債(10年)	80,000,000	83,279,200	
第333回利付国債(10年)	210,000,000	219,200,100	
第334回利付国債(10年)	120,000,000	125,425,200	
第335回利付国債(10年)	490,000,000	509,443,200	
第336回利付国債(10年)	80,000,000	83,320,000	
第337回利付国債(10年)	30,000,000	30,815,700	

第338回利付国債(10年)	310,000,000	320,778,700
第339回利付国債(10年)	300,000,000	310,554,000
第340回利付国債(10年)	420,000,000	434,922,600
第341回利付国債(10年)	1,090,000,000	1,120,171,200
第342回利付国債(10年)	130,000,000	131,415,700
第343回利付国債(10年)	200,000,000	202,158,000
第345回利付国債(10年)	450,000,000	454,099,500
第346回利付国債(10年)	490,000,000	494,351,200
第347回利付国債(10年)	160,000,000	161,304,000
第14回利付国債(30年)	208,000,000	274,836,640
第15回利付国債(30年)	147,000,000	196,930,020
第16回利付国債(30年)	35,000,000	46,984,000
第18回利付国債(30年)	110,000,000	144,515,800
第21回利付国債(30年)	20,000,000	26,351,800
第22回利付国債(30年)	40,000,000	54,182,800
第23回利付国債(30年)	55,000,000	74,556,900
第24回利付国債(30年)	68,000,000	92,320,880
第25回利付国債(30年)	20,000,000	26,442,400
第26回利付国債(30年)	170,000,000	228,024,400
第27回利付国債(30年)	29,000,000	39,552,520
第28回利付国債(30年)	94,000,000	128,504,580
第29回利付国債(30年)	276,000,000	372,967,080
第30回利付国債(30年)	147,000,000	196,362,600
第31回利付国債(30年)	120,000,000	158,182,800
第32回利付国債(30年)	50,000,000	67,089,500
第33回利付国債(30年)	135,000,000	173,002,500
第34回利付国債(30年)	200,000,000	265,294,000
第35回利付国債(30年)	168,000,000	215,972,400
第36回利付国債(30年)	135,000,000	173,877,300
第37回利付国債(30年)	61,000,000	77,321,770
第38回利付国債(30年)	70,000,000	87,336,200
第39回利付国債(30年)	75,000,000	95,480,250
第40回利付国債(30年)	90,000,000	112,544,100
第42回利付国債(30年)	105,000,000	128,941,050
第43回利付国債(30年)	195,000,000	239,551,650
第44回利付国債(30年)	70,000,000	86,121,000
第45回利付国債(30年)	45,000,000	53,143,650
第46回利付国債(30年)	100,000,000	118,099,000
第47回利付国債(30年)	115,000,000	138,788,900
第48回利付国債(30年)	105,000,000	121,430,400
第49回利付国債(30年)	90,000,000	104,066,100
第50回利付国債(30年)	25,000,000	25,086,750

第5 1 回利付国債(30年)	70,000,000	61,208,700	
第5 2 回利付国債(30年)	90,000,000	83,180,700	
第5 3 回利付国債(30年)	105,000,000	99,570,450	
第5 4 回利付国債(30年)	110,000,000	109,869,100	
第5 5 回利付国債(30年)	110,000,000	109,737,100	
第5 6 回利付国債(30年)	50,000,000	49,819,500	
第4 1 回利付国債(20年)	27,000,000	27,622,890	
第4 2 回利付国債(20年)	168,000,000	174,397,440	
第4 3 回利付国債(20年)	47,000,000	49,718,950	
第4 4 回利付国債(20年)	51,000,000	54,222,180	
第4 7 回利付国債(20年)	21,000,000	22,424,850	
第4 8 回利付国債(20年)	99,000,000	107,201,160	
第4 9 回利付国債(20年)	57,000,000	61,319,460	
第5 0 回利付国債(20年)	237,000,000	253,398,030	
第5 1 回利付国債(20年)	39,000,000	42,033,420	
第5 4 回利付国債(20年)	15,000,000	16,442,550	
第5 5 回利付国債(20年)	66,000,000	72,170,340	
第5 7 回利付国債(20年)	52,000,000	56,859,920	
第5 8 回利付国債(20年)	135,000,000	148,346,100	
第5 9 回利付国債(20年)	33,000,000	36,072,300	
第6 0 回利付国債(20年)	295,000,000	317,912,650	
第6 1 回利付国債(20年)	27,000,000	28,608,660	
第6 3 回利付国債(20年)	31,000,000	34,325,060	
第6 4 回利付国債(20年)	54,000,000	60,336,360	
第6 5 回利付国債(20年)	100,000,000	112,236,000	
第6 6 回利付国債(20年)	34,000,000	37,951,140	
第6 7 回利付国債(20年)	34,000,000	38,316,640	
第6 8 回利付国債(20年)	78,000,000	89,399,700	
第7 0 回利付国債(20年)	104,000,000	121,108,000	
第7 2 回利付国債(20年)	112,000,000	128,766,400	
第7 3 回利付国債(20年)	113,000,000	129,725,130	
第7 4 回利付国債(20年)	118,000,000	136,308,880	
第7 5 回利付国債(20年)	10,000,000	11,597,100	
第7 6 回利付国債(20年)	21,000,000	24,043,320	
第7 7 回利付国債(20年)	40,000,000	46,092,800	
第7 9 回利付国債(20年)	160,000,000	185,137,600	
第8 2 回利付国債(20年)	60,000,000	70,186,800	
第8 7 回利付国債(20年)	130,000,000	154,365,900	
第8 8 回利付国債(20年)	300,000,000	360,210,000	
第9 0 回利付国債(20年)	16,000,000	19,146,080	
第9 1 回利付国債(20年)	250,000,000	301,377,500	
第9 2 回利付国債(20年)	60,000,000	71,517,000	

第93回利付国債(20年)	60,000,000	71,200,200	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	59,801,500	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	100,035,080	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	117,671,540	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	54,658,800	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	113,251,200	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	141,351,210	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	36,667,500	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	82,030,080	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	101,042,640	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	13,605,790	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	40,121,070	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	93,906,120	
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,460,700	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	159,017,300	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	160,956,780	
第109回利付国債(20年)	27,000,000	32,514,480	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	120,220,520	
第111回利付国債(20年)	25,000,000	31,045,000	
第113回利付国債(20年)	290,000,000	357,593,200	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	64,294,880	
第115回利付国債(20年)	55,000,000	68,660,900	
第116回利付国債(20年)	55,000,000	68,850,650	
第117回利付国債(20年)	93,000,000	115,289,310	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	12,297,800	
第119回利付国債(20年)	30,000,000	36,150,000	
第120回利付国債(20年)	70,000,000	82,565,000	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	26,825,480	
第122回利付国債(20年)	17,000,000	20,514,580	
第123回利付国債(20年)	65,000,000	81,146,000	
第124回利付国債(20年)	80,000,000	98,844,800	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	63,219,500	
第126回利付国債(20年)	25,000,000	30,936,750	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	79,749,800	
第129回利付国債(20年)	50,000,000	60,682,500	
第130回利付国債(20年)	60,000,000	72,902,400	
第131回利付国債(20年)	12,000,000	14,418,720	
第132回利付国債(20年)	35,000,000	42,091,350	
第133回利付国債(20年)	30,000,000	36,489,000	
第134回利付国債(20年)	50,000,000	60,913,000	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	36,130,800	
第136回利付国債(20年)	180,000,000	214,133,400	

	第137回利付国債(20年)	200,000,000	241,054,000	
	第138回利付国債(20年)	120,000,000	141,147,600	
	第139回利付国債(20年)	150,000,000	178,675,500	
	第140回利付国債(20年)	340,000,000	410,074,000	
	第141回利付国債(20年)	195,000,000	235,324,050	
	第142回利付国債(20年)	55,000,000	67,171,500	
	第143回利付国債(20年)	54,000,000	64,403,100	
	第144回利付国債(20年)	90,000,000	106,014,600	
	第145回利付国債(20年)	125,000,000	151,101,250	
	第146回利付国債(20年)	75,000,000	90,696,000	
	第147回利付国債(20年)	60,000,000	71,659,200	
	第148回利付国債(20年)	120,000,000	141,464,400	
	第149回利付国債(20年)	215,000,000	253,420,500	
	第150回利付国債(20年)	90,000,000	104,633,100	
	第151回利付国債(20年)	150,000,000	169,357,500	
	第152回利付国債(20年)	90,000,000	101,605,500	
	第153回利付国債(20年)	120,000,000	137,431,200	
	第154回利付国債(20年)	120,000,000	135,330,000	
	第155回利付国債(20年)	140,000,000	152,896,800	
	第156回利付国債(20年)	110,000,000	108,331,300	
	第157回利付国債(20年)	50,000,000	47,324,500	
	第158回利付国債(20年)	170,000,000	169,561,400	
	第159回利付国債(20年)	150,000,000	151,953,000	
	第160回利付国債(20年)	140,000,000	144,051,600	
	第161回利付国債(20年)	120,000,000	120,954,000	
	第162回利付国債(20年)	70,000,000	70,437,500	
	<b>国債証券 合計</b>	<b>25,944,000,000</b>	<b>28,815,877,772</b>	
地方債証券	第26回東京都公募公債(20年)	100,000,000	118,343,000	
	第690回東京都公募公債	100,000,000	104,009,000	
	第694回東京都公募公債	200,000,000	209,144,000	
	第708回東京都公募公債	100,000,000	104,136,000	
	第709回東京都公募公債	100,000,000	103,628,000	
	第712回東京都公募公債	200,000,000	207,556,000	
	第730回東京都公募公債	100,000,000	104,030,000	
	第731回東京都公募公債	100,000,000	103,846,000	
	平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	208,268,000	
	平成22年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	104,229,000	
	平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	104,646,000	
	平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	104,240,000	
	平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	103,568,000	
	第10回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	103,773,000	
	第83回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,303,000	

	第9 3 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,910,000	
	第9 9 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,268,000	
	平成2 4 年度第1 回長崎県公募公債	100,000,000	103,938,000	
	平成2 5 年度第1 回島根県公募公債	200,000,000	200,504,000	
	平成2 6 年度第1 回栃木県公募公債	100,000,000	103,114,000	
	第3 回川崎市公募公債( 1 5 年)	100,000,000	105,655,000	
	第5 1 回川崎市公募公債( 5 年)	100,000,000	100,029,000	
	平成2 3 年度第2 回岡山県公募公債( 1 0 年)	100,000,000	104,416,000	
地方債証券 合計		2,700,000,000	2,812,553,000	
特殊債券	第1 回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	104,056,000	
	第2 回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	105,065,000	
	第5 回新関西国際空港株式会社社債( 一般担保付)	100,000,000	104,535,000	
	第2 回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,618,000	
	第6 回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,650,000	
	第1 4 回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,140,000	
	第1 6 回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,195,000	
	第2 2 回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,271,000	
	第3 1 回株式会社日本政策投資銀行無担保社債( 社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,630,000	
	第3 6 回日本政策投資銀行債券	100,000,000	119,364,000	
	第2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,835,000	
	第5 6 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,052,000	
	第1 0 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,502,000	
	第1 3 5 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,199,000	
	第1 4 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,283,000	
	第2 3 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,327,000	
	第2 7 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,630,000	
	第1 回地方公営企業等金融機構債券( 2 0 年)	100,000,000	119,501,000	
	第4 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	101,641,000	
	第4 5 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,794,000	
	F 2 2 3 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,286,000	
	F 2 9 0 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,663,000	
	第4 5 回日本学生支援債券	300,000,000	300,048,000	
	第1 7 回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	104,348,000	
	第2 9 8 回信金中金債( 5 年)	200,000,000	200,584,000	
	第3 1 6 回信金中金債( 5 年)	100,000,000	100,035,000	
	第3 1 8 回信金中金債( 5 年)	100,000,000	99,943,000	
	第3 2 0 回信金中金債( 5 年)	100,000,000	99,835,000	
	第3 2 2 回信金中金債( 5 年)	200,000,000	199,654,000	
特殊債券 合計		3,400,000,000	3,517,684,000	

社債券	第8回成田国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,526,000	
	第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債(2014)	100,000,000	100,359,000	
	第10回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,295,000	
	第11回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,316,000	
	第14回森永乳業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,399,000	
	第6回サントリーホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,441,000	
	第6回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,272,000	
	第8回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,462,000	
	第28回東レ株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,718,000	
	第7回株式会社セブン銀行無担保社債(社債間限定同順位特約付)	200,000,000	201,798,000	
	第43回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	105,714,000	
	第83回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	112,678,000	
	第563回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,987,000	
	第299回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,024,000	
第19回沖縄電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,526,000		
社債券 合計	1,600,000,000	1,646,515,000		
合計	33,644,000,000	36,792,629,772		

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド

### 貸借対照表

(単位:円)

	平成28年11月 7日現在	平成29年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
預金	253,976,737	837,560,116
コール・ローン	14,091,148	165,237,118
国債証券	151,120,639,275	157,741,251,099
派生商品評価勘定	108,996	-



	平成28年11月 7日現在	平成29年11月 6日現在
未収入金	20,409,959	146,567,421
未収利息	1,372,177,670	1,357,790,881
前払費用	31,004,275	18,996,145
流動資産合計	152,812,408,060	160,267,402,780
資産合計	152,812,408,060	160,267,402,780
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	427,730	41,944
未払金	64,123,681	690,365,082
未払解約金	124,638,437	70,358,933
未払利息	13	196
流動負債合計	189,189,861	760,766,155
負債合計	189,189,861	760,766,155
純資産の部		
元本等		
元本	73,864,517,578	68,813,700,349
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	78,758,700,621	90,692,936,276
元本等合計	152,623,218,199	159,506,636,625
純資産合計	152,623,218,199	159,506,636,625
負債純資産合計	152,812,408,060	160,267,402,780

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	平成28年11月 7日現在	平成29年11月 6日現在
--	---------------	---------------

1.	期首	平成27年11月 7日	平成28年11月 8日
	期首元本額	78,349,209,668円	73,864,517,578円
	期首からの追加設定元本額	2,789,882,054円	2,564,470,551円
	期首からの一部解約元本額	7,274,574,144円	7,615,287,780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)	11,258,142,748円	11,581,356,815円
	DCインデックスバランス(株式20)	92,470,734円	120,311,772円
	DCインデックスバランス(株式40)	155,237,497円	185,599,379円
	DCインデックスバランス(株式60)	190,009,348円	246,887,356円
	DCインデックスバランス(株式80)	162,410,395円	201,193,535円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	24,214,740,382円	24,009,643,571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	2,492,204,828円
	日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	26,307,633,130円	22,163,069,508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	26,606,000円	27,380,363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)	997,780,943円	948,027,456円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	206,645,646円	282,781,980円
	インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	- 円	112,785,347円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	3,018,048円	2,937,698円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	3,333,157円	2,970,589円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	7,395,863円	6,819,295円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	19,118,029円	14,757,936円
	世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	415,188,653円	458,972,132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	1,122,097,048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)	35,853,198円	23,300,031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)	92,746,529円	83,430,561円
	グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	38,254,859円	- 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	58,271,520円	56,531,512円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	84,989,462円	81,754,055円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	76,574,398円	80,813,771円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	57,038,041円	61,086,829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	4,920,656,211円	4,204,298,604円
	海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	244,725,258円	242,688,378円
	計	73,864,517,578円	68,813,700,349円
2.	受益権の総数	73,864,517,578口	68,813,700,349口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額  
(金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

	自 平成27年11月 7日 至 平成28年11月 7日	自 平成28年11月 8日 至 平成29年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成28年11月 7日現在	平成29年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）

（平成28年11月 7日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	972,553,311
合計	972,553,311

（平成29年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	1,165,819,291
合計	1,165,819,291

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（平成28年11月 7日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	44,329	-	44,334	5
	米ドル	44,329	-	44,334	5
	売建	205,546,590	-	205,865,329	318,739
	米ドル	205,502,261	-	205,821,000	318,739

	スウェーデンク ローナ	19,518	-	19,518	-
	デンマーククロー ネ	24,811	-	24,811	-
	合計	205,590,919	-	205,909,663	318,734

（平成29年11月 6日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	61,227,656	-	61,269,600	41,944
	ポーランドズロチ	61,227,656	-	61,269,600	41,944
	合計	61,227,656	-	61,269,600	41,944

（注）1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成28年11月 7日現在		平成29年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	2.0663円	1口当たり純資産額	2.3179円
(1万口当たり純資産額)	(20,663円)	(1万口当たり純資産額)	(23,179円)

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-1.75%-18/10/31	3,000,000.00	3,007,089.00	
		US TREASURY N/B-1.25%-18/10/31	2,000,000.00	1,995,040.00	
		US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	5,050,000.00	5,163,625.00	
		US TREASURY N/B-1.25%-18/11/30	3,100,000.00	3,091,282.80	
		US TREASURY N/B-1.5%-18/12/31	8,430,000.00	8,428,027.38	
		US TREASURY N/B-1.25%-18/12/31	2,000,000.00	1,993,868.00	
		US TREASURY N/B-1.125%-19/01/15	760,000.00	756,467.52	
		US TREASURY N/B-1.5%-19/01/31	3,000,000.00	2,999,064.00	
		US TREASURY N/B-1.25%-19/01/31	1,170,000.00	1,166,115.60	
		US TREASURY N/B-1.125%-19/01/31	1,500,000.00	1,492,792.50	
		US TREASURY N/B-8.875%-19/02/15	4,550,000.00	4,975,393.15	
		US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	4,650,000.00	4,720,475.40	
		US TREASURY N/B-0.75%-19/02/15	1,400,000.00	1,386,028.00	
		US TREASURY N/B-1.375%-19/02/28	3,000,000.00	2,993,847.00	
		US TREASURY N/B-1.5%-19/02/28	4,000,000.00	3,997,500.00	
		US TREASURY N/B-1.0%-19/03/15	1,070,000.00	1,062,113.03	
		US TREASURY N/B-1.625%-19/03/31	2,000,000.00	2,002,148.00	
		US TREASURY N/B-1.25%-19/03/31	1,500,000.00	1,493,818.50	
		US TREASURY N/B-0.875%-19/04/15	1,200,000.00	1,188,492.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-19/04/30	3,900,000.00	3,903,962.40	
		US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	4,000,000.00	4,094,140.00	
		US TREASURY N/B-0.875%-19/05/15	3,000,000.00	2,968,887.00	
		US TREASURY N/B-1.5%-19/05/31	4,100,000.00	4,095,354.70	
		US TREASURY N/B-0.875%-19/06/15	3,000,000.00	2,966,250.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-19/06/30	2,510,000.00	2,511,372.97	
		US TREASURY N/B-0.75%-19/07/15	2,650,000.00	2,613,149.10	
US TREASURY N/B-1.625%-19/07/31	3,000,000.00	3,001,173.00			

US TREASURY N/B-1.375%-19/07/31	800,000.00	796,952.80	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	4,320,000.00	4,472,889.12	
US TREASURY N/B-8.125%-19/08/15	4,110,000.00	4,580,081.25	
US TREASURY N/B-0.75%-19/08/15	9,000,000.00	8,866,755.00	
US TREASURY N/B-1.0%-19/08/31	3,300,000.00	3,264,228.00	
US TREASURY N/B-1.625%-19/08/31	3,600,000.00	3,601,123.20	
US TREASURY N/B-1.75%-19/09/30	7,450,000.00	7,468,185.45	
US TREASURY N/B-1.0%-19/10/15	5,100,000.00	5,040,233.10	
US TREASURY N/B-1.5%-19/10/31	4,100,000.00	4,090,311.70	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	10,530,000.00	10,895,264.64	
US TREASURY N/B-1.5%-19/11/30	5,000,000.00	4,985,155.00	
US TREASURY N/B-1.625%-19/12/31	1,900,000.00	1,899,034.80	
US TREASURY N/B-1.25%-20/01/31	4,000,000.00	3,964,296.00	
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	8,070,000.00	8,422,586.37	
US TREASURY N/B-1.375%-20/03/31	1,100,000.00	1,092,050.30	
US TREASURY N/B-1.375%-20/04/30	1,930,000.00	1,915,034.78	
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	7,830,000.00	8,180,971.92	
US TREASURY N/B-1.375%-20/05/31	2,440,000.00	2,420,175.00	
US TREASURY N/B-1.5%-20/05/31	5,100,000.00	5,074,000.20	
US TREASURY N/B-1.875%-20/06/30	380,000.00	381,625.26	
US TREASURY N/B-1.625%-20/06/30	4,000,000.00	3,990,936.00	
US TREASURY N/B-2.0%-20/07/31	5,370,000.00	5,409,958.17	
US TREASURY N/B-1.625%-20/07/31	4,000,000.00	3,989,764.00	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	5,610,000.00	6,682,256.13	
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	4,850,000.00	4,968,407.90	
US TREASURY N/B-2.125%-20/08/31	1,450,000.00	1,465,689.00	
US TREASURY N/B-1.375%-20/08/31	2,300,000.00	2,277,494.50	
US TREASURY N/B-1.375%-20/09/30	3,700,000.00	3,661,771.60	
US TREASURY N/B-1.75%-20/10/31	2,000,000.00	1,999,766.00	
US TREASURY N/B-1.375%-20/10/31	1,060,000.00	1,048,385.58	
US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	3,500,000.00	3,588,935.00	
US TREASURY N/B-1.625%-20/11/30	1,120,000.00	1,115,166.08	
US TREASURY N/B-2.375%-20/12/31	3,000,000.00	3,054,198.00	
US TREASURY N/B-1.75%-20/12/31	2,000,000.00	1,997,812.00	
US TREASURY N/B-2.125%-21/01/31	2,400,000.00	2,424,703.20	

US TREASURY N/B-1.375%-21/01/31	2,000,000.00	1,973,398.00	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	4,730,000.00	5,005,484.66	
US TREASURY N/B-2.0%-21/02/28	2,370,000.00	2,384,720.07	
US TREASURY N/B-1.125%-21/02/28	2,000,000.00	1,955,976.00	
US TREASURY N/B-2.25%-21/03/31	340,000.00	344,754.56	
US TREASURY N/B-1.25%-21/03/31	1,270,000.00	1,246,262.43	
US TREASURY N/B-2.25%-21/04/30	4,600,000.00	4,665,407.40	
US TREASURY N/B-1.375%-21/04/30	2,000,000.00	1,969,648.00	
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	4,320,000.00	4,512,628.80	
US TREASURY N/B-1.375%-21/05/31	2,060,000.00	2,027,048.24	
US TREASURY N/B-2.125%-21/06/30	6,050,000.00	6,108,134.45	
US TREASURY N/B-1.125%-21/06/30	3,900,000.00	3,800,444.70	
US TREASURY N/B-2.25%-21/07/31	6,900,000.00	6,995,951.40	
US TREASURY N/B-1.125%-21/07/31	5,000,000.00	4,867,285.00	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	3,900,000.00	3,936,714.60	
US TREASURY N/B-1.125%-21/08/31	4,400,000.00	4,278,568.80	
US TREASURY N/B-2.125%-21/09/30	2,400,000.00	2,421,374.40	
US TREASURY N/B-1.125%-21/09/30	1,500,000.00	1,457,110.50	
US TREASURY N/B-2.0%-21/10/31	4,830,000.00	4,849,619.46	
US TREASURY N/B-1.25%-21/10/31	2,000,000.00	1,950,782.00	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	11,490,000.00	14,223,137.79	
US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	4,000,000.00	4,018,124.00	
US TREASURY N/B-1.75%-21/11/30	600,000.00	596,355.60	
US TREASURY N/B-2.125%-21/12/31	4,800,000.00	4,840,032.00	
US TREASURY N/B-1.5%-22/01/31	800,000.00	786,140.80	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,500,000.00	2,508,692.50	
US TREASURY N/B-1.75%-22/02/28	2,900,000.00	2,877,684.50	
US TREASURY N/B-1.75%-22/03/31	1,800,000.00	1,784,883.60	
US TREASURY N/B-1.75%-22/04/30	3,000,000.00	2,972,871.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/04/30	500,000.00	498,076.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	2,000,000.00	1,983,360.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/05/31	2,000,000.00	1,992,578.00	
US TREASURY N/B-2.125%-22/06/30	2,500,000.00	2,516,112.50	
US TREASURY N/B-2.0%-22/07/31	3,930,000.00	3,932,302.98	
US TREASURY N/B-1.875%-22/07/31	9,700,000.00	9,648,473.60	



US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	2,000,000.00	1,968,672.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/08/31	1,900,000.00	1,889,090.20	
US TREASURY N/B-1.75%-22/09/30	3,550,000.00	3,506,874.60	
US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	3,000,000.00	2,980,314.00	
US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	1,000,000.00	981,562.00	
US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	1,000,000.00	998,945.00	
US TREASURY N/B-2.125%-22/12/31	3,900,000.00	3,917,140.50	
US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	2,000,000.00	1,970,468.00	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	5,800,000.00	5,785,273.80	
US TREASURY N/B-1.5%-23/02/28	1,000,000.00	972,188.00	
US TREASURY N/B-1.5%-23/03/31	2,000,000.00	1,942,618.00	
US TREASURY N/B-1.625%-23/04/30	660,000.00	644,788.98	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	8,150,000.00	8,011,833.05	
US TREASURY N/B-1.625%-23/05/31	1,500,000.00	1,464,228.00	
US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	4,000,000.00	3,848,828.00	
US TREASURY N/B-1.25%-23/07/31	2,000,000.00	1,909,062.00	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,500,000.00	5,623,211.00	
US TREASURY N/B-1.375%-23/08/31	1,850,000.00	1,776,506.90	
US TREASURY N/B-1.375%-23/09/30	2,500,000.00	2,398,242.50	
US TREASURY N/B-1.625%-23/10/31	1,700,000.00	1,653,914.70	
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	4,144,764.00	
US TREASURY N/B-2.125%-23/11/30	3,230,000.00	3,232,083.35	
US TREASURY N/B-2.25%-23/12/31	2,500,000.00	2,517,137.50	
US TREASURY N/B-2.25%-24/01/31	2,000,000.00	2,012,774.00	
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	3,300,000.00	3,417,110.40	
US TREASURY N/B-2.125%-24/02/29	1,500,000.00	1,497,774.00	
US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	3,000,000.00	2,994,258.00	
US TREASURY N/B-2.0%-24/04/30	2,000,000.00	1,980,274.00	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	5,800,000.00	5,918,378.00	
US TREASURY N/B-2.0%-24/05/31	4,330,000.00	4,284,755.83	
US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	1,100,000.00	1,088,033.10	
US TREASURY N/B-2.125%-24/07/31	180,000.00	179,363.70	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,675,222.86	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	5,930,000.00	5,948,068.71	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,970,000.00	4,895,062.34	

US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	4,762,593.60	
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	4,720,000.00	4,633,987.44	
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	5,940,000.00	5,931,992.88	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	2,310,750.00	
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,750,000.00	3,563,160.00	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	3,400,000.00	3,223,026.60	
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,743,128.00	
US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,450,000.00	3,293,623.20	
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	5,040,000.00	4,908,879.36	
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	4,800,000.00	4,767,657.60	
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	2,330,000.00	2,337,963.94	
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	5,090,000.00	5,048,944.06	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	2,760,000.00	3,699,746.88	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,000,000.00	1,281,113.00	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,510,000.00	2,139,953.88	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	1,860,000.00	2,488,802.76	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	1,900,000.00	2,606,710.70	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	1,170,000.00	1,493,464.05	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	1,600,000.00	2,076,436.80	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	2,200,000.00	2,768,046.60	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,820,000.00	2,366,496.86	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	1,750,000.00	2,239,760.25	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	1,680,000.00	2,223,145.68	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	2,037,933.21	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,990,000.00	2,380,577.30	
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	2,010,000.00	2,536,368.75	
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	2,026,026.00	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	2,200,000.00	2,829,879.80	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	1,960,000.00	2,306,024.28	
US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	796,484.00	
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	1,988,868.00	
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	2,124,648.00	
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	5,800,000.00	5,890,509.00	
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	5,120,000.00	5,913,400.32	
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	4,500,000.00	5,307,889.50	

		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	3,000,000.00	3,469,686.00	
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	3,400,000.00	3,772,670.60	
		US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	5,900,000.00	6,266,673.20	
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	3,300,000.00	3,424,911.60	
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	3,102,514.80	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	3,200,000.00	3,318,499.20	
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	5,300,000.00	5,363,144.20	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	3,900,000.00	4,041,527.10	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	2,800,000.00	2,624,235.60	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	2,500,000.00	2,341,407.50	
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	1,905,858.90	
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	1,500,000.00	1,516,318.50	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	1,800,000.00	1,864,863.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	2,680,000.00	2,776,836.44	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	2,000,000.00	1,971,172.00	
米ドル小計			584,090,000.00	601,920,943.40 (68,847,717,506)	
加ドル	国債証券	CANADA GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	384,804.45	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-18/11/01	1,230,000.00	1,220,086.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-19/02/01	1,110,000.00	1,098,500.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/03/01	1,050,000.00	1,055,544.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-19/05/01	1,190,000.00	1,179,099.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	1,800,000.00	1,865,484.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-19/08/01	1,090,000.00	1,077,715.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/09/01	1,390,000.00	1,398,326.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-19/11/01	850,000.00	846,897.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-20/03/01	2,170,000.00	2,171,996.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	1,150,000.00	1,208,592.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-20/09/01	2,020,000.00	1,978,650.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/03/01	1,210,000.00	1,179,060.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	950,000.00	1,005,765.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/09/01	1,340,000.00	1,300,188.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-22/03/01	1,190,000.00	1,135,033.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	1,100,000.00	1,154,637.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-22/09/01	1,110,000.00	1,076,478.00	

		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,380,000.00	1,364,337.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,120,000.00	1,169,716.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	1,130,000.00	1,163,007.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	1,100,000.00	1,065,284.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	370,000.00	564,483.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	1,160,000.00	1,063,662.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	310,000.00	309,748.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	890,000.00	1,228,395.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	1,015,000.00	1,500,007.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	1,090,000.00	1,568,193.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	1,345,000.00	1,765,917.75	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,460,000.00	1,824,897.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	1,055,000.00	1,167,463.00	
			35,710,000.00	38,091,975.20	
				(3,412,279,138)	
加ドル小計					
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-18/12/13	21,400,000.00	21,702,559.62	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11	17,200,000.00	16,534,550.06	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	20,900,000.00	21,399,361.61	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	25,100,000.00	24,668,920.05	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	14,100,000.00	13,798,326.27	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	8,200,000.00	8,572,946.66	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	24,500,000.00	28,461,721.05	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	7,150,000.00	6,520,760.67	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	8,200,000.00	8,348,776.70	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	11,750,000.00	12,842,077.90	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	11,900,000.00	12,290,584.18	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	5,800,000.00	5,986,943.86	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	7,800,000.00	9,776,147.94	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	10,300,000.00	11,368,882.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	15,500,000.00	15,863,890.39	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	3,100,000.00	3,259,272.11	

メキシコペソ小計			212,900,000.00	221,395,721.57 (1,321,732,457)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	980,000.00	1,043,984.20
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-19/09/28	960,000.00	1,026,696.00
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	1,628,000.00	1,834,112.94
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	1,425,000.00	1,688,830.20
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	1,180,000.00	1,408,524.70
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,320,000.00	1,614,766.56
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	1,080,000.00	1,225,790.28
		BELGIUM KINGDOM-0.2%-23/10/22	410,000.00	415,801.50
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	1,410,000.00	1,646,404.83
		BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	420,000.00	429,954.00
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,320,000.00	1,372,546.56
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	1,020,000.00	1,375,969.80
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	1,210,000.00	1,269,187.15
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	730,000.00	743,644.42
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,760,000.00	2,636,780.96
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	750,000.00	750,187.50
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	760,000.00	1,069,289.60
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	590,000.00	754,565.16
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,585,000.00	2,551,059.08
		BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	220,000.00	223,872.44
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	530,000.00	579,751.10
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,430,000.00	2,232,045.53
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	815,000.00	1,208,962.85
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	650,000.00	635,691.55
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	260,000.00	287,864.20
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	280,000.00	298,013.52
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.75%-18/10/31	1,690,000.00	1,759,036.50
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%-19/01/31	1,290,000.00	1,299,758.85
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%-19/04/30	1,860,000.00	1,946,274.24
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%-19/07/30	1,870,000.00	2,030,259.00

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%- 19/10/31	2,030,000.00	2,215,807.93
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 20/01/31	1,480,000.00	1,533,663.32
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%- 20/04/30	2,280,000.00	2,517,484.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.15%- 20/07/30	1,180,000.00	1,221,961.98
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%- 20/10/31	1,790,000.00	2,054,651.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.05%- 21/01/31	190,000.00	190,558.22
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	2,250,000.00	2,682,753.75
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.75%- 21/07/30	1,535,000.00	1,577,883.29
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	2,060,000.00	2,559,585.02
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.4%- 22/04/30	1,630,000.00	1,645,555.09
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%- 23/01/31	1,880,000.00	2,368,256.68
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	1,750,000.00	2,145,890.25
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	1,510,000.00	1,895,433.54
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	1,680,000.00	2,009,316.96
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	1,960,000.00	2,216,438.56
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	1,660,000.00	1,741,178.98
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,850,000.00	2,356,023.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	1,760,000.00	1,904,524.16
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 26/04/30	1,660,000.00	1,763,494.36
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,620,000.00	2,251,774.08
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%- 26/10/31	1,525,000.00	1,531,978.40

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%- 27/04/30	1,495,000.00	1,512,814.42	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 27/10/31	1,000,000.00	998,540.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,395,000.00	1,895,472.99	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	2,010,000.00	2,920,274.73	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,730,000.00	1,757,401.47	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,700,000.00	2,530,956.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%- 33/07/30	700,000.00	722,047.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,630,000.00	2,117,182.55	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,320,000.00	1,874,910.84	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,490,000.00	2,076,390.99	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	1,180,000.00	1,748,889.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%- 46/10/31	1,010,000.00	1,044,645.02	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%- 66/07/30	360,000.00	396,420.84	
BUNDES Obligation-1.0%-19/02/22	1,320,000.00	1,351,339.44	
BUNDES Obligation-0.25%-20/10/16	1,000,000.00	1,027,167.00	
BUNDES Obligation-0.0%-21/04/09	1,200,000.00	1,224,572.40	
BUNDES Obligation-0.0%-21/10/08	740,000.00	755,300.24	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 19/01/04	2,550,000.00	2,686,588.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%- 19/07/04	3,770,000.00	4,041,025.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 20/01/04	3,220,000.00	3,502,049.46	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%- 20/07/04	2,720,000.00	2,990,751.52	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 20/09/04	2,150,000.00	2,330,729.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 21/01/04	1,800,000.00	1,981,006.20	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	1,730,000.00	1,975,115.05	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 21/09/04	1,580,000.00	1,751,439.48	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	2,000,000.00	2,210,098.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 22/07/04	2,470,000.00	2,722,737.81	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	1,600,000.00	1,747,891.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	1,900,000.00	2,083,283.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	1,720,000.00	1,889,855.16	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	1,780,000.00	2,011,022.64	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	1,390,000.00	1,943,239.46	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	2,060,000.00	2,308,808.86	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	1,950,000.00	2,158,240.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	1,830,000.00	1,965,879.33	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	2,170,000.00	2,251,884.95	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	2,340,000.00	2,513,789.46	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	2,270,000.00	2,340,953.39	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 26/08/15	2,130,000.00	2,092,448.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15	2,370,000.00	2,362,477.62	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,410,000.00	2,246,538.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 27/08/15	1,020,000.00	1,033,349.76	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,150,000.00	1,757,357.55	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	980,000.00	1,423,695.98	



BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	830,000.00	1,389,896.42	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,320,000.00	2,136,991.56	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	2,540,000.00	4,107,507.66	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	1,775,000.00	2,739,625.52	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,060,000.00	1,736,370.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,280,000.00	2,253,553.92	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	1,220,000.00	1,793,190.16	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,690,000.00	2,215,759.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	1,770,000.00	2,338,554.09	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/12/01	1,960,000.00	2,040,687.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/02/01	2,230,000.00	2,355,825.52	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 19/03/01	2,320,000.00	2,467,069.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.1%- 19/04/15	1,000,000.00	1,006,007.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 19/05/01	1,400,000.00	1,457,925.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 19/08/01	730,000.00	752,465.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/09/01	2,940,000.00	3,180,456.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.05%- 19/10/15	470,000.00	472,500.87	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.05%- 19/12/01	1,100,000.00	1,128,255.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 20/02/01	2,540,000.00	2,804,891.52	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 20/03/01	2,670,000.00	2,942,588.31	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.7%- 20/05/01	750,000.00	764,544.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 20/06/15	400,000.00	404,160.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	2,550,000.00	2,839,356.15	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 20/11/01	940,000.00	957,666.36	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	2,100,000.00	2,353,806.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/05/01	1,200,000.00	1,350,337.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%- 21/06/01	540,000.00	545,588.46	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	3,450,000.00	3,904,396.05	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 21/09/01	3,050,000.00	3,572,068.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 21/11/01	770,000.00	772,403.94	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 21/12/15	1,060,000.00	1,138,408.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	2,250,000.00	2,693,844.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.2%- 22/04/01	810,000.00	836,911.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 22/04/15	970,000.00	1,008,054.07	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 22/08/01	120,000.00	121,985.52	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,900,000.00	2,347,307.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 22/09/15	1,310,000.00	1,366,100.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	2,000,000.00	2,480,014.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/15	960,000.00	971,328.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	1,300,000.00	1,561,116.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,700,000.00	2,077,680.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 23/10/15	380,000.00	374,773.10	

BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	2,740,000.00	4,032,814.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,650,000.00	2,000,912.10
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,500,000.00	1,753,981.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,400,000.00	1,519,882.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	3,230,000.00	4,070,374.94
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	690,000.00	697,340.22
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	2,060,000.00	2,145,108.90
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,430,000.00	1,766,297.39
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	1,230,000.00	1,235,142.63
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	1,710,000.00	2,523,826.62
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	1,470,000.00	1,425,200.28
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%- 27/06/01	680,000.00	708,432.16
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	120,000.00	122,881.08
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	3,160,000.00	4,534,713.76
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	1,050,000.00	1,340,139.15
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	2,870,000.00	3,858,321.81
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	940,000.00	1,083,386.66
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	3,110,000.00	4,505,945.27
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,485,000.00	1,386,139.09
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,900,000.00	2,736,997.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	490,000.00	495,939.29

BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	2,080,000.00	2,822,037.92	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	900,000.00	865,596.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	2,710,000.00	3,309,709.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,770,000.00	2,440,091.91	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	1,820,000.00	2,491,110.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,660,000.00	2,234,281.98	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,240,000.00	1,320,106.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	1,270,000.00	1,208,786.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 48/03/01	700,000.00	757,477.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 67/03/01	680,000.00	613,807.44	
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	350,000.00	379,773.80	
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	740,000.00	812,582.90	
FINNISH GOVERNMENT-0.375%-20/09/15	300,000.00	308,092.80	
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	740,000.00	842,181.42	
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	300,000.00	327,603.00	
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	550,000.00	599,344.90	
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-23/09/15	250,000.00	250,749.25	
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	600,000.00	676,418.40	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	590,000.00	761,927.77	
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	320,000.00	336,011.52	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	410,000.00	416,202.48	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	220,000.00	219,585.08	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	466,837.60	
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	385,000.00	381,861.09	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	380,000.00	500,555.76	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-18/11/25	1,200,000.00	1,220,910.00	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-19/02/25	810,000.00	817,140.15	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25	3,630,000.00	3,894,565.29	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-19/05/25	1,470,000.00	1,508,453.73	

FRANCE (GOVT OF) -8.5%-19/10/25	1,050,000.00	1,241,089.50	
FRANCE (GOVT OF) -3.75%-19/10/25	4,300,000.00	4,677,776.50	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-19/11/25	1,650,000.00	1,689,184.20	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-20/02/25	1,000,000.00	1,013,975.00	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-20/04/25	3,180,000.00	3,504,563.52	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-20/05/25	1,600,000.00	1,624,001.60	
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-20/10/25	3,480,000.00	3,796,645.20	
FRANCE (GOVT OF) -0.25%-20/11/25	2,450,000.00	2,506,974.75	
FRANCE (GOVT OF) -3.75%-21/04/25	3,900,000.00	4,476,533.10	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-21/10/25	3,920,000.00	4,491,967.20	
FRANCE (GOVT OF) -3.0%-22/04/25	3,770,000.00	4,333,735.64	
FRANCE (GOVT OF) -2.25%-22/10/25	2,750,000.00	3,088,390.25	
FRANCE (GOVT OF) -8.5%-23/04/25	960,000.00	1,417,105.92	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-23/05/25	2,940,000.00	3,245,995.20	
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-23/10/25	3,930,000.00	4,947,732.45	
FRANCE (GOVT OF) -2.25%-24/05/25	3,140,000.00	3,593,149.10	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-24/11/25	3,000,000.00	3,337,425.00	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-25/05/25	3,330,000.00	3,395,537.73	
FRANCE (GOVT OF) -6.0%-25/10/25	2,630,000.00	3,833,135.58	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-25/11/25	2,645,000.00	2,787,279.84	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-26/04/25	3,320,000.00	4,190,268.28	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-26/05/25	1,990,000.00	2,003,977.76	
FRANCE (GOVT OF) -0.25%-26/11/25	2,280,000.00	2,227,895.16	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-27/05/25	2,280,000.00	2,366,070.00	
FRANCE (GOVT OF) -2.75%-27/10/25	3,330,000.00	4,013,688.96	
FRANCE (GOVT OF) -5.5%-29/04/25	2,720,000.00	4,137,800.00	
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-30/05/25	2,600,000.00	3,089,447.40	
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-31/05/25	2,370,000.00	2,516,800.17	
FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	2,820,000.00	4,664,223.60	
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	2,390,000.00	3,736,406.50	
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-36/05/25	1,480,000.00	1,461,292.80	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	2,270,000.00	3,368,838.90	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-39/06/25	810,000.00	858,640.50	
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	2,605,000.00	4,181,686.67	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	2,080,000.00	2,823,920.32	

FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	970,000.00	1,031,012.03	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	1,270,000.00	2,028,055.38	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	1,110,000.00	1,814,247.27	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-66/05/25	370,000.00	353,562.01	
IRISH TREASURY-4.4%-19/06/18	600,000.00	648,861.60	
IRISH TREASURY-5.9%-19/10/18	570,000.00	642,575.82	
IRISH TREASURY-4.5%-20/04/18	935,000.00	1,051,648.73	
IRISH TREASURY-5.0%-20/10/18	700,000.00	815,224.20	
IRISH TREASURY-0.8%-22/03/15	480,000.00	501,483.84	
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	510,000.00	617,967.00	
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	680,000.00	820,243.20	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	965,000.00	1,317,229.82	
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	1,025,000.00	1,060,914.97	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	785,000.00	909,490.01	
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	345,000.00	355,184.05	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	615,000.00	648,754.89	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-19/01/15	1,050,000.00	1,075,350.15	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	1,380,000.00	1,491,538.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-20/01/15	1,340,000.00	1,368,395.94	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	1,380,000.00	1,536,060.06	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	1,540,000.00	1,756,499.36	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-22/01/15	700,000.00	712,061.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	1,500,000.00	1,683,909.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	500,000.00	605,005.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	970,000.00	1,363,509.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	950,000.00	1,053,884.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	1,640,000.00	1,860,030.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	1,080,000.00	1,087,536.24	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	925,000.00	939,881.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	680,000.00	697,835.72	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	1,195,000.00	1,798,176.25	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	1,200,000.00	1,484,888.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,300,000.00	1,994,801.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,335,000.00	2,080,578.81	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,105,000.00	1,507,801.23	

		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	205,000.00	179,347.53	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	300,000.00	317,267.10	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	980,000.00	1,047,216.24	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.95%-19/06/18	530,000.00	552,729.58	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-19/10/18	610,000.00	620,886.06	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	1,290,000.00	1,446,522.15	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	1,330,000.00	1,535,225.65	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	780,000.00	919,791.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	940,000.00	1,114,264.72	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/07/15	130,000.00	130,565.63	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	1,170,000.00	1,297,692.63	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	890,000.00	985,910.85	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	900,000.00	966,757.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	690,000.00	953,424.75	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	960,000.00	986,380.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	325,000.00	324,255.10	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	800,000.00	1,245,065.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	570,000.00	687,428.55	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,090,000.00	1,661,798.74	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	630,000.00	876,251.25	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	320,000.00	320,048.64	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	243,000.00	407,458.51	
ユーロ小計			409,131,000.00	484,443,615.39	(64,300,201,070)
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-4.5%-19/03/07	1,850,000.00	1,950,242.25	
		UK TREASURY-1.75%-19/07/22	2,093,000.00	2,139,527.39	
		UK TREASURY-3.75%-19/09/07	1,490,000.00	1,581,107.54	
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	1,710,000.00	1,881,940.50	
		UK TREASURY-2.0%-20/07/22	1,870,000.00	1,945,454.50	
		UK TREASURY-3.75%-20/09/07	1,610,000.00	1,757,572.60	
		UK TREASURY-1.5%-21/01/22	2,330,000.00	2,400,825.01	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	1,020,000.00	1,290,276.54	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	1,110,000.00	1,243,757.22	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	1,210,000.00	1,385,667.80	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	2,130,000.00	2,236,152.81	

		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	1,610,000.00	1,739,444.00	
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	1,290,000.00	1,443,445.50	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,805,000.00	2,316,890.78	
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	1,290,000.00	1,325,733.00	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	490,000.00	487,569.60	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	1,190,000.00	1,525,249.18	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	1,000,000.00	1,482,469.00	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,300,000.00	1,800,377.80	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,540,000.00	2,066,852.48	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	2,000,000.00	2,812,840.00	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,670,000.00	2,317,310.37	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,490,000.00	2,249,557.30	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,310,000.00	1,871,257.71	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	1,560,000.00	2,255,838.00	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	2,390,000.00	3,642,670.70	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,380,000.00	1,762,835.46	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,740,000.00	2,330,470.74	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,560,000.00	2,388,406.80	
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	615,000.00	564,784.02	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	1,340,000.00	2,127,665.40	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,530,000.00	2,306,831.49	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,580,000.00	2,684,946.14	
		UK TREASURY-1.75%-57/07/22	545,000.00	549,218.84	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,220,000.00	2,063,651.96	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	1,660,000.00	2,702,526.48	
		UNITED KINGDOM GILT-0.5%-22/07/22	1,475,000.00	1,460,832.61	
		UNITED KINGDOM GILT-0.75%-23/07/22	100,000.00	99,340.60	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	1,180,000.00	1,263,638.40	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	1,142,000.00	1,452,533.78	
	英債券小計		57,425,000.00	72,907,712.30 (10,897,515,757)	
スイス ラン	国債証券	SWITZERLAND-3.0%-19/05/12	400,000.00	423,819.20	
		SWITZERLAND-2.25%-20/07/06	400,000.00	432,902.80	
		SWITZERLAND-2.0%-21/04/28	220,000.00	240,971.50	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	651,000.00	807,793.35	



		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	385,000.00	548,355.50
スイスフラン小計			2,056,000.00	2,453,842.35 (280,253,334)
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	7,940,000.00	8,491,290.08
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	8,010,000.00	9,368,311.77
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	8,500,000.00	9,939,152.00
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	6,820,000.00	7,388,494.74
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	4,950,000.00	5,750,504.10
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	5,090,000.00	5,297,631.28
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,150,000.00	3,151,275.75
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	3,840,000.00	5,234,334.72
スウェーデンクローナ小計			48,300,000.00	54,620,994.44 (740,660,684)
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	6,980,000.00	7,405,919.60
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	6,700,000.00	7,371,889.40
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	4,900,000.00	5,123,479.20
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	4,190,000.00	4,640,500.42
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	3,270,000.00	3,358,538.52
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	3,250,000.00	3,264,046.50
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,000,000.00	2,035,920.00
ノルウェークローネ小計			31,290,000.00	33,200,293.64 (464,804,110)
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-0.25%-18/11/15	4,040,000.00	4,077,737.64
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	7,920,000.00	8,665,422.48
		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	7,570,000.00	8,611,253.50
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	6,140,000.00	6,734,892.32
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	8,190,000.00	9,229,311.00
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	2,130,000.00	2,141,171.85
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	11,030,000.00	18,718,163.69
デンマーククローネ小計			47,020,000.00	58,177,952.48 (1,037,312,892)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-19/04/25	840,000.00	823,200.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-19/07/25	2,190,000.00	2,254,605.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	1,700,000.00	1,827,075.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.5%-20/04/25	2,570,000.00	2,546,998.50

		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	1,590,000.00	1,735,803.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25	2,410,000.00	2,386,382.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-21/07/25	2,430,000.00	2,375,811.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	1,610,000.00	1,808,915.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-22/04/25	1,980,000.00	1,947,429.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	2,070,000.00	2,356,591.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-23/01/25	380,000.00	373,692.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	2,370,000.00	2,504,853.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,580,000.00	2,574,711.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	2,900,000.00	2,707,440.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	1,900,000.00	1,751,705.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	700,000.00	859,390.00	
ポーランドズロチ小計			30,220,000.00	30,834,601.50	(964,197,988)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	1,807,000.00	1,892,312.08	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-19/10/21	1,850,000.00	1,884,502.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	2,340,000.00	2,488,316.22	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-20/11/21	2,120,000.00	2,110,014.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	2,510,000.00	2,832,449.66	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.0%-21/12/21	1,155,000.00	1,152,804.34	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	2,050,000.00	2,381,687.95	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	2,020,000.00	2,361,030.54	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	2,150,000.00	2,206,562.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	2,330,000.00	2,463,662.78	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	2,660,000.00	3,018,834.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	2,330,000.00	2,764,030.07	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	2,020,000.00	2,051,817.02	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	1,570,000.00	1,518,395.67	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	1,450,000.00	1,466,329.90	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,620,000.00	1,713,968.10	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,290,000.00	1,555,817.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	630,000.00	609,344.19	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	930,000.00	1,024,729.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	625,000.00	634,368.12	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	700,000.00	655,839.10	

豪ドル小計			36,157,000.00	38,786,816.44 (3,391,519,229)
シンガ ポールド ル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01	770,000.00	783,552.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-19/10/01	450,000.00	451,845.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-20/07/01	220,000.00	223,190.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	365,000.00	382,337.50
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	640,000.00	654,080.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-21/10/01	170,000.00	167,739.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-22/04/01	210,000.00	210,998.55
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	380,000.00	404,700.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	455,000.00	477,750.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	575,802.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	200,000.00	205,000.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	200,000.00	200,900.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	540,000.00	601,489.80
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	200,000.00	212,000.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	330,000.00	349,140.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	355,000.00	398,459.10
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	145,000.00	141,356.87
SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	425,000.00	443,912.50		
SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	280,000.00	292,689.60		
シンガポールドル小計			6,875,000.00	7,176,941.92 (601,427,732)
マレーシ アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.759%-19/03/15	100,000.00	100,709.90
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.659%-20/10/15	1,010,000.00	1,014,640.95
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	460,000.00	465,781.74
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.62%-21/11/30	850,000.00	846,012.65
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	480,000.00	479,735.04
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	600,000.00	593,958.60
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	980,000.00	965,172.60
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	450,000.00	441,000.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	300,000.00	297,637.50
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	600,000.00	566,943.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	440,000.00	442,872.32
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	590,000.00	587,746.20

		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	700,000.00	672,106.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	1,220,000.00	1,269,584.46	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	2,770,000.00	2,826,599.41	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.492%-20/03/31	550,000.00	550,880.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.889%-20/07/31	800,000.00	808,521.60	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	2,130,000.00	2,166,416.61	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	650,000.00	636,834.25	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,750,000.00	1,708,308.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	947,531.28	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,270,000.00	1,293,402.29	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	436,637.70	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	650,000.00	607,744.15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	430,000.00	408,172.34	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000.00	798,387.75	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	1,210,000.00	1,212,473.24	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,005,722.95	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	450,000.00	430,181.55	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	680,000.00	628,577.72	
		マレーシアリングット小計	25,295,000.00	25,210,292.20 (679,921,580)	
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 18/12/21	3,900,000.00	3,914,330.94	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	4,850,000.00	4,777,620.54	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	4,650,000.00	4,449,379.93	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	6,100,000.00	5,887,234.44	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	15,600,000.00	16,768,774.62	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	6,200,000.00	5,436,044.06	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	11,150,000.00	8,830,575.32	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	6,220,000.00	5,421,234.44	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	5,010,000.00	4,517,802.31	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	8,300,000.00	5,688,140.23	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	8,800,000.00	7,575,401.24	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%- 40/01/31	4,310,000.00	3,837,609.56	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	7,450,000.00	5,029,590.36	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	7,850,000.00	6,765,428.69	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	12,400,000.00	10,691,842.34	
南アフリカランド小計		112,790,000.00	99,591,009.02 (801,707,622)	
合計			157,741,251,099 (157,741,251,099)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 182銘柄	100.0%	43.5%
加ドル	国債証券 31銘柄	100.0%	2.2%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 279銘柄	100.0%	40.8%
英ポンド	国債証券 40銘柄	100.0%	6.9%
スイスフラン	国債証券 5銘柄	100.0%	0.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.7%
ポーランドズロチ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.6%
豪ドル	国債証券 21銘柄	100.0%	2.2%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングギット	国債証券 30銘柄	100.0%	0.4%
南アフリカランド	国債証券 15銘柄	100.0%	0.5%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2017年11月30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	2,830,878,378円
負債総額	4,905,199円
純資産総額( - )	2,825,973,179円
発行済口数	1,799,678,344口
1口当たり純資産額( / )	1.5703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	29,092,713,780円
負債総額	34,642,809円
純資産総額( - )	29,058,070,971円
発行済口数	18,328,827,731口
1口当たり純資産額( / )	1.5854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	83,446,803,572円
負債総額	31,729,559円
純資産総額( - )	83,415,074,013円
発行済口数	34,953,943,678口
1口当たり純資産額( / )	2.3864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	37,205,750,564円
負債総額	175,310,672円
純資産総額（ - ）	37,030,439,892円
発行済口数	26,680,169,067口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3879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	157,213,824,689円
負債総額	125,880,204円
純資産総額（ - ）	157,087,944,485円
発行済口数	68,438,436,276口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2953円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### （1）名義書換

該当事項はありません。

### （2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

### （3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

#### 受益権の譲渡

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

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

### （4）受益証券の再発行

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

### （5）受益権の再分割

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

### （6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解



約請求の受付、解約金および償還金の支払いなどについては、約款の規定によるほか、民法その他の法令などにしたがって取り扱われます。

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1) 資本金の額

平成29年11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11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11月末現在）

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

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、平成29年11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	765	166,645

株式投資信託	719	136,706
単位型	215	8,855
追加型	504	127,851
公社債投資信託	46	29,938
単位型	32	320
追加型	14	29,618

### 3【委託会社等の経理状況】

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第59期中間会計期間(平成29年4月1日から平成29年9月30日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

#### (1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第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		
ソフトウェア	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】

(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】

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	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(2) 金銭の信託 時価法</p> <p>(3) デリバティブ 時価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、平成28年4月1日以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</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p>



<p>4 ヘッジ会計の方法</p> <p>5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p> <p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。</p>
--	--

## (会計方針の変更)

<p>第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)</p>	
<p>(減価償却方法)</p>	<p>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。</p> <p>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。</p>

## (追加情報)

<p>第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)</p>	
<p>「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日)を当事業年度から適用しております。</p>	

## (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	<p>有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,170百万円</p> <p>器具備品 653百万円</p>	1	<p>有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,222百万円</p> <p>器具備品 603百万円</p>
2	<p>信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>	2	<p>信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>

<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <table border="0"> <tr><td>現金・預金</td><td style="text-align: right;">4,072百万円</td></tr> <tr><td>金銭の信託</td><td style="text-align: right;">153百万円</td></tr> <tr><td>前払費用</td><td style="text-align: right;">2百万円</td></tr> <tr><td>未収収益</td><td style="text-align: right;">147百万円</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">193百万円</td></tr> </table> <p>(流動負債)</p> <table border="0"> <tr><td>未払手数料</td><td style="text-align: right;">93百万円</td></tr> <tr><td>未払費用</td><td style="text-align: right;">722百万円</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">266百万円</td></tr> </table> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務728百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソンタワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務689百万円に対して保証を行っております。</p>	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	未払手数料	93百万円	未払費用	722百万円	その他	266百万円	<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <table border="0"> <tr><td>現金・預金</td><td style="text-align: right;">3,243百万円</td></tr> <tr><td>金銭の信託</td><td style="text-align: right;">152百万円</td></tr> <tr><td>未収収益</td><td style="text-align: right;">619百万円</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">20百万円</td></tr> </table> <p>(流動負債)</p> <table border="0"> <tr><td>預り金</td><td style="text-align: right;">177百万円</td></tr> <tr><td>未払手数料</td><td style="text-align: right;">144百万円</td></tr> <tr><td>未払費用</td><td style="text-align: right;">251百万円</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">61百万円</td></tr> </table> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務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。</p>	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	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
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																																
未払手数料	93百万円																																
未払費用	722百万円																																
その他	266百万円																																
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																																
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																																

## ( 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)												
<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <table border="0"> <tr><td>受取配当金</td><td style="text-align: right;">1,193百万円</td></tr> <tr><td>支払利息</td><td style="text-align: right;">123百万円</td></tr> <tr><td>デリバティブ費用</td><td style="text-align: right;">889百万円</td></tr> </table>	受取配当金	1,193百万円	支払利息	123百万円	デリバティブ費用	889百万円	<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <table border="0"> <tr><td>受取配当金</td><td style="text-align: right;">1,550百万円</td></tr> <tr><td>デリバティブ収益</td><td style="text-align: right;">347百万円</td></tr> <tr><td>支払利息</td><td style="text-align: right;">58百万円</td></tr> </table> <p>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。</p>	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
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												
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												

## ( 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いません。

#### 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 解約不能のものに係る未経過リース料		オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	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

#### 信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

#### 市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

#### 流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

平成28年3月31日(当事業年度の決算日)における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位:百万円)

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	14,308	14,308	-
(2) 未収委託者報酬	9,374	9,374	-
(3) 未収収益	2,280	2,280	-
(4) 関係会社短期貸付金	5,333	5,333	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	12,265	12,265	-
(6) 未払金	(3,841)	(3,841)	-
(7) 未払費用	(4,920)	(4,920)	-
(8) 関係会社短期借入金	(5,631)	(5,631)	-
(9) デリバティブ取引(2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(254)	(254)	-

ヘッジ会計が適用されているもの	170	170	-
デリバティブ取引計	(84)	(84)	-

(1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金、(7) 未払費用並びに(8) 関係会社短期借入金

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

(9) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用され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 其他有価証券」には含めておりません。

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	14,308	-	-	-
未収委託者報酬	9,374	-	-	-
未収収益	2,280	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	86	714	1,766	963
合計	26,049	714	1,766	963

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

### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

### 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

### 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

平成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)
為替予約取引					

市場取引以外の取引	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	投資有価証券			
	売建				
	米ドル		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)
	為替予約取引				
	売建				
	米ドル		2,993	-	11
	豪ドル		77	-	2

原則的処理 方法	シンガポールドル	投資有価証券	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
<u>退職給付債務の期末残高</u>	<u>1,190</u>

## (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
<u>貸借対照表に計上された負債の額</u>	<u>1,259</u>

退職給付引当金	1,259
<u>貸借対照表に計上された負債の額</u>	<u>1,259</u>

## (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
<u>確定給付制度に係る退職給付費用</u>	<u>177</u>

## (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

## ストックオプション（新株予約権）の数

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定前(株)		
期首	15,902,700	1,567,500
付与	0	0
失効	14,140,500	1,392,600
権利確定	0	0
権利未確定残	1,762,200	174,900

権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

#### 単価情報

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

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

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

- 2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額  
当事業年度末における本源的価値の合計額 - 百万円
- 3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するよう調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

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

## 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。

#### 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)																																																																		
<p>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</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <p>繰延税金資産(流動)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">賞与引当金</td> <td style="text-align: right;">642</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">177</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">819</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">投資有価証券評価損</td> <td style="text-align: right;">96</td> </tr> <tr> <td>関係会社株式評価損</td> <td style="text-align: right;">1,430</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">353</td> </tr> <tr> <td>固定資産減価償却費</td> <td style="text-align: right;">122</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">65</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,068</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産小計</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">評価性引当金</td> <td style="text-align: right;">1,430</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,457</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">71</td> </tr> <tr> <td>繰延ヘッジ利益</td> <td style="text-align: right;">114</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">26</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">213</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債合計</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">1,244</td> </tr> </table>	賞与引当金	642	その他	177	小計	819	投資有価証券評価損	96	関係会社株式評価損	1,430	退職給付引当金	353	固定資産減価償却費	122	その他	65	小計	2,068	評価性引当金	1,430	繰延税金資産合計	1,457	その他有価証券評価差額金	71	繰延ヘッジ利益	114	その他	26	小計	213	繰延税金資産の純額	1,244	<p>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</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <p>繰延税金資産(流動)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">賞与引当金</td> <td style="text-align: right;">641</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">224</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">865</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">投資有価証券評価損</td> <td style="text-align: right;">96</td> </tr> <tr> <td>関係会社株式評価損</td> <td style="text-align: right;">1,430</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">385</td> </tr> <tr> <td>固定資産減価償却費</td> <td style="text-align: right;">119</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">63</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,095</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産小計</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">評価性引当金</td> <td style="text-align: right;">1,430</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,530</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債(流動)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">0</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">0</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">123</td> </tr> <tr> <td>繰延ヘッジ利益</td> <td style="text-align: right;">117</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">241</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債合計</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">1,288</td> </tr> </table>	賞与引当金	641	その他	224	小計	865	投資有価証券評価損	96	関係会社株式評価損	1,430	退職給付引当金	385	固定資産減価償却費	119	その他	63	小計	2,095	評価性引当金	1,430	繰延税金資産合計	1,530	その他有価証券評価差額金	0	小計	0	その他有価証券評価差額金	123	繰延ヘッジ利益	117	小計	241	繰延税金資産の純額	1,288
賞与引当金	642																																																																		
その他	177																																																																		
小計	819																																																																		
投資有価証券評価損	96																																																																		
関係会社株式評価損	1,430																																																																		
退職給付引当金	353																																																																		
固定資産減価償却費	122																																																																		
その他	65																																																																		
小計	2,068																																																																		
評価性引当金	1,430																																																																		
繰延税金資産合計	1,457																																																																		
その他有価証券評価差額金	71																																																																		
繰延ヘッジ利益	114																																																																		
その他	26																																																																		
小計	213																																																																		
繰延税金資産の純額	1,244																																																																		
賞与引当金	641																																																																		
その他	224																																																																		
小計	865																																																																		
投資有価証券評価損	96																																																																		
関係会社株式評価損	1,430																																																																		
退職給付引当金	385																																																																		
固定資産減価償却費	119																																																																		
その他	63																																																																		
小計	2,095																																																																		
評価性引当金	1,430																																																																		
繰延税金資産合計	1,530																																																																		
その他有価証券評価差額金	0																																																																		
小計	0																																																																		
その他有価証券評価差額金	123																																																																		
繰延ヘッジ利益	117																																																																		
小計	241																																																																		
繰延税金資産の純額	1,288																																																																		
<p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">法定実効税率 (調整)</td> <td style="text-align: right;">33.1%</td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">1.4%</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">4.8%</td> </tr> <tr> <td>税率変更による期末繰延税金資産の減額修正</td> <td style="text-align: right;">1.3%</td> </tr> <tr> <td>所得拡大促進税制</td> <td style="text-align: right;">2.2%</td> </tr> <tr> <td>海外子会社の留保利益の影響額等</td> <td style="text-align: right;">0.6%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">29.4%</td> </tr> </table>	法定実効税率 (調整)	33.1%	交際費等永久に損金に算入されない項目	1.4%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.8%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.3%	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	0.6%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.4%	<p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">法定実効税率 (調整)</td> <td style="text-align: right;">30.9%</td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">0.6%</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">5.3%</td> </tr> <tr> <td>過年度法人税等</td> <td style="text-align: right;">1.5%</td> </tr> <tr> <td>海外子会社の留保利益の影響額等</td> <td style="text-align: right;">0.2%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">27.9%</td> </tr> </table>	法定実効税率 (調整)	30.9%	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	5.3%	過年度法人税等	1.5%	海外子会社の留保利益の影響額等	0.2%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.9%																																								
法定実効税率 (調整)	33.1%																																																																		
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.4%																																																																		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.8%																																																																		
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.3%																																																																		
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	0.6%																																																																		
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.4%																																																																		
法定実効税率 (調整)	30.9%																																																																		
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	5.3%																																																																		
過年度法人税等	1.5%																																																																		
海外子会社の留保利益の影響額等	0.2%																																																																		
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.9%																																																																		

第57期 (平成28年3月31日)	第58期 (平成29年3月31日)
----------------------	----------------------

<p>3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」(平成28年法律第15号)及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」(平成28年法律第13号)が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日に開始する事業年度から、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.9%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.6%となります。この税率変更により、繰延税金資産の純額(繰延税金負債の金額を控除した金額)が59百万円減少し、その他有価証券評価差額金が3百万円、繰延ヘッジ損益が6百万円、法人税等調整額が69百万円、それぞれ増加しております。</p>	-
---	---

## ( 関連当事者情報 )

第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 (円貸建) (注3)	4,422 (注4)	関係会社短期貸付金	577
							貸付金利息 (円貸建) (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せん。

###### (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

##### 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

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せん。

###### (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

##### 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

#### 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。

新株予約権の数	4,409個
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
新株予約権の発行価額	無償
新株予約権の行使時の払込金額	1株当たり金553円
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

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

		第59期中間会計期間 (平成29年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		16,734
有価証券		17
未収委託者報酬		9,940
未収収益		2,241
関係会社短期貸付金		976
繰延税金資産		866
その他	2	2,935
流動資産合計		33,712
固定資産		
有形固定資産	1	243
無形固定資産		118
投資その他の資産		
投資有価証券		14,687
関係会社株式		23,203
関係会社長期貸付金		60
長期差入保証金		784
繰延税金資産		298
長期前払費用		0
投資その他の資産合計		39,035
固定資産合計		39,397
資産合計		73,109

(単位：百万円)

		第59期中間会計期間 (平成29年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		4,545
未払費用		4,058
未払法人税等		1,473
未払消費税等	3	495



賞与引当金	1,207
役員賞与引当金	60
その他	943
流動負債合計	12,784
固定負債	
退職給付引当金	1,305
その他	43
固定負債合計	1,348
負債合計	14,133
純資産の部	
株主資本	
資本金	17,363
資本剰余金	
資本準備金	5,220
資本剰余金合計	5,220
利益剰余金	
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	36,351
利益剰余金合計	36,351
自己株式	786
株主資本合計	58,148
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	716
繰延ヘッジ損益	111
評価・換算差額等合計	827
純資産合計	58,976
負債純資産合計	73,109

## ( 2 ) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	33,067
その他営業収益	2,422
営業収益合計	35,490
営業費用及び一般管理費	1 31,576
営業利益	3,913
営業外収益	2 1,051
営業外費用	3 431
経常利益	4,533
特別利益	4 174
特別損失	5 124
税引前中間純利益	4,582
法人税等	6 1,211

中間純利益

3,371

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第59期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

(単位：百万円)

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益剰 余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	34,015	34,015	672	55,926
当中間期変動額							
剰余金の配当				1,036	1,036		1,036
中間純利益				3,371	3,371		3,371
自己株式の取得						113	113
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)							
当中間期変動額合計				2,335	2,335	113	2,221
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	36,351	36,351	786	58,148

	評価・換算差額等			純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	282	266	548	56,475
当中間期変動額				
剰余金の配当				1,036
中間純利益				3,371
自己株式の取得				113
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	434	155	279	279
当中間期変動額合計	434	155	279	2,501
当中間期末残高	716	111	827	58,976

## 注記事項

(重要な会計方針)

項目	第59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 中間決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部 純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法

<p>2 固定資産の減価償却の方法</p>	<p>(2) デリバティブ 時価法</p> <p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
<p>3 引当金の計上基準</p>	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p>
<p>4 ヘッジ会計の方法</p>	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
<p>5 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>(1) 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。</p> <p>(2) 税金費用の計算方法 税金費用については、当中間会計期間を含む事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り、税引前中間純利益に、当該見積実効税率を乗じて計算しております。</p>

(中間貸借対照表関係)

第59期中間会計期間  
(平成29年9月30日)

1	有形固定資産の減価償却累計額 1,819百万円
2	信託資産 流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
3	消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
4	保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務599百万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476百万円に対して保証を行っております。

## (中間損益計算書関係)

第59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
1	減価償却実施額 有形固定資産 55百万円 無形固定資産 21百万円
2	営業外収益のうち主要なもの 受取利息 13百万円 受取配当金 1,005百万円
3	営業外費用のうち主要なもの 支払利息 104百万円 支払源泉所得税 97百万円 デリバティブ費用 205百万円
4	特別利益のうち主要なもの 投資有価証券売却益 174百万円
5	特別損失のうち主要なもの 投資有価証券売却損 119百万円
6	中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第59期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	197,012,500	-	-	197,012,500

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	1,119,100	182,600	-	1,301,700

(注) 自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

### 3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会計期間末残高(百万円)
		当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末	
平成21年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,689,600	-	9,900	1,679,700	-
平成21年度 ストックオプション(2)	普通株式	174,900	-	66,000	108,900	-
平成23年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,890,800	-	198,000	2,692,800	-
平成28年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,404,000	-	-	4,404,000	-
平成28年度 ストックオプション(2)	普通株式	-	4,409,000	-	4,409,000	-
合計		9,159,300	4,409,000	273,900	13,294,400	-

(注) 1 平成28年度ストックオプション(2)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。

2 平成21年度ストックオプション(1)1,679,700株、平成21年度ストックオプション(2) 108,900株及び平成23年度ストックオプション(1)2,692,800株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成28年度ストックオプション(1)及び平成28年度ストックオプション(2)は権利行使期間の初日が到来しておりません。

### 4 配当に関する事項

#### (1) 配当金支払額

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

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

該当事項はありません。

#### (リース取引関係)

第59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
オペレーティング・リース取引	
解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	865百万円
1年超	1,355百万円
合計	2,220百万円

#### (金融商品関係)

第59期中間会計期間(平成29年9月30日)

1 金融商品の時価等に関する事項

平成29年9月30日（当中間決算日）における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	中間貸借対照表 計上額( 1)	時価( 1)	差額
(1) 現金及び預金	16,734	16,734	-
(2) 未収委託者報酬	9,940	9,940	-
(3) 未収収益	2,241	2,241	-
(4) 関係会社短期貸付金	976	976	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	14,688	14,688	-
(6) 未払金	(4,545)	(4,545)	-
(7) 未払費用	(4,058)	(4,058)	-
(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	(263)	(263)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(52)	(52)	-
デリバティブ取引計	(316)	(316)	-

( 1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

- (1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益並びに(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14百万円は、貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、66百万円は、流動負債のその他に含まれております。

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

3 子会社株式（中間貸借対照表計上額20,310百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

(有価証券関係)

第59期中間会計期間(平成29年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	20,310
関連会社株式	2,892

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

## 2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	11,892	10,815	1,077
	小計	11,892	10,815	1,077
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	2,796	2,841	44
	小計	2,796	2,841	44
合計		14,688	13,656	1,032

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

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

## (デリバティブ取引関係)

第59期中間会計期間(平成29年9月30日)

## 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等のうち1年 超 (百万円)	時 価 (百万円)	評価損 益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	5,080	-	263	263
	合計	5,080	-	263	263

(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)
	為替予約取引				

原則的 処理方法	売建	投資有価証 券			
	米ドル		4,855	-	13
	豪ドル		140	-	1
	シンガ ポー ルドル		1,616	-	17
	ユーロ		167	-	3
	香港ドル		541	-	1
	人民元		2,050	-	43
	合計		9,372	-	52

## (注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (持分法損益等)

第59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	3,036百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	9,571百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	835百万円

## (ストックオプション等関係)

第59期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

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

## (セグメント情報等)

## [セグメント情報]

第59期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

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

## [関連情報]

第59期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。



## 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

## 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第59期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第59期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第59期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

該当事項はありません。

## (1株当たり情報)

項目	第59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
1株当たり純資産額	301円34銭
1株当たり中間純利益金額	17円21銭

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

## 2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
中間純利益(百万円)	3,371
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式に係る中間純利益(百万円)	3,371
普通株式の期中平均株式数(千株)	195,877
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1) 1,679,700株、平成21年度ストックオプション(2) 108,900株、平成23年度ストックオプション(1) 2,692,800株、平成28年度ストックオプション(1) 4,404,000株、平成28年度ストックオプション(2) 4,409,000株

## 3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第59期中間会計期間 (平成29年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円)	58,976
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額(百万円)	58,976

1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数（千株）	195,711
--------------------------------------	---------

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

（1）定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

（2）訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

（1）受託会社

名 称	資本金の額 (平成29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。

（2）販売会社

名 称	資本金の額 (平成29年9月末現在)	事業の内容

S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
損保ジャパン日本興亜 D C 証券株式会社	3,000百万円	
株式会社東邦銀行	23,519百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	
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。
住友生命保険相互会社	100,000百万円 (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。
ソニ - 生命保険株式会社	70,000 百万円	
日本生命保険相互会社	150,000百万円 (基金の総額)	
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。

## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

### (2) 販売会社

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

## 3【資本関係】

### (1) 受託会社

該当事項はありません。

### (2) 販売会社

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29年9月末現在)

## 第3【その他】

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

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

委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日

ファンドの基本的性格など

委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など

委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など

目論見書の使用開始日

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

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

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。

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

「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。

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

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

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

「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

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

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。

有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。

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

- (4) 有価証券届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部 ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用する場合があります。
- (7) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (8) 交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

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

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

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

## 独立監査人の監査報告書

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第58期事業年度の財務諸表、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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成29年12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

### P w C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DCインデックスバランス（株式20）の平成28年11月8日から平成29年11月6日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCインデックスバランス（株式20）の平成29年11月6日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成29年12月5日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

### 有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第59期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成29年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。