

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年2月7日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 柴田 拓美
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	森川 晃
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	DCインデックスバランス（株式40）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

DCインデックスバランス（株式40）（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29年 2月 8日から平成30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	アフリカ	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)))		中近東 (中東)		
		エマージング		
資産複合 ()				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

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

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

年1回

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

グローバル(含む日本)

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジなし

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、シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

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

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

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

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

3. 株式に40%、債券などに60%投資します。

資産の標準実質組入比率は、株式40%、債券など60%とします。
組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンドへの投資比率を調整することで行ないます。

各マザーファンドおよび短期金融資産への投資比率は以下を基本とします。

投資対象	基本投資比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	30%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	10%
日本債券インデックスマザーファンド	45%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	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70%未満とします。
- ・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の50%以下とします。

分配方針

- ・毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行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。

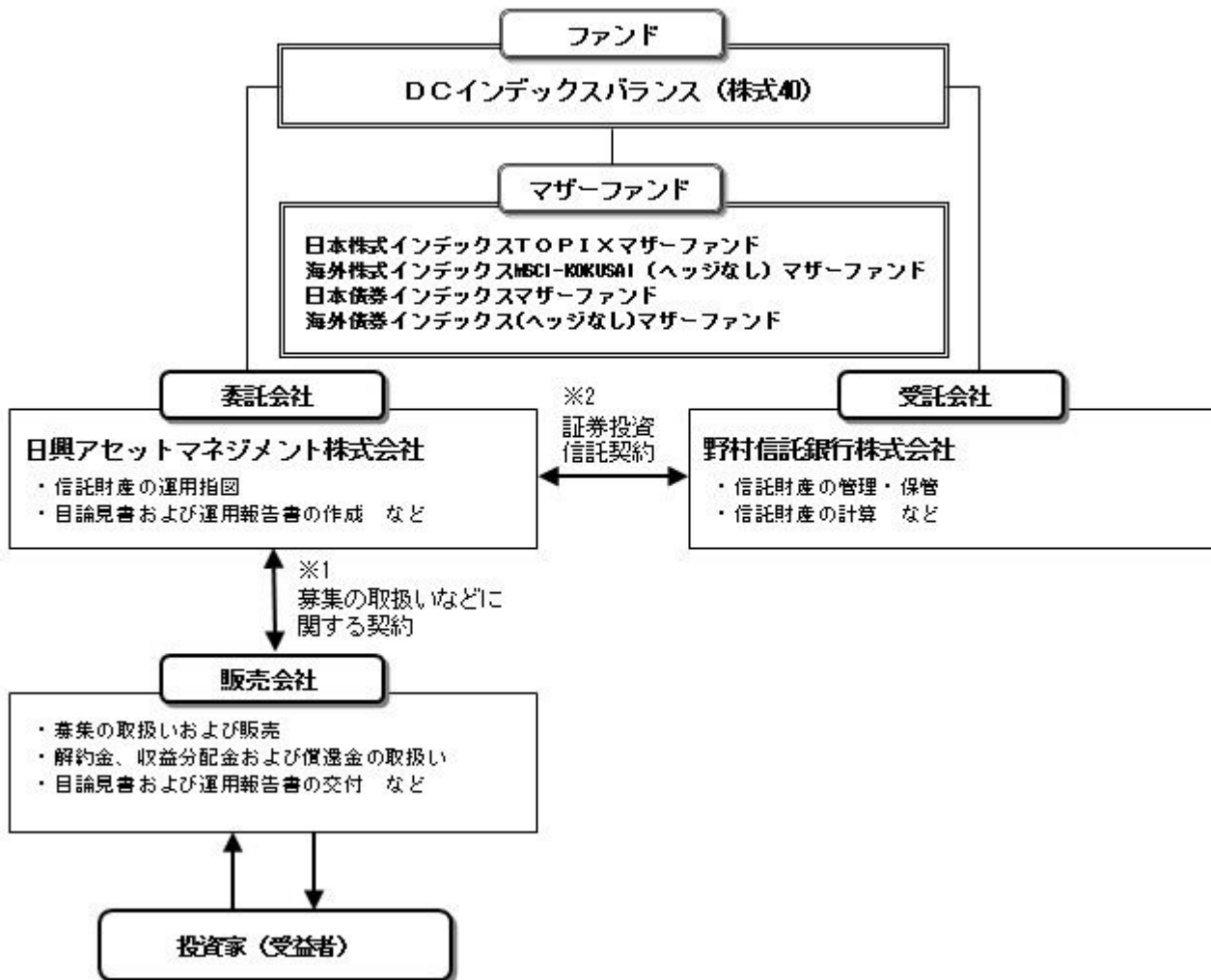
(2) 【ファンドの沿革】

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28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.....40%
 - 公社債および短期金融資産の標準実質組入比率.....60%
- ・組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンド受益証券への投資比率を調整することで行ないますが、市況動向などによっては内外の有価証券などへの直接投資を行なうことがあります。
- ・また、資金動向などによっては組入比率を引き下げることもあります。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

< DCインデックスバランス（株式40） >

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

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

- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 1) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」受益証券
- 2) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券
- 3) 証券投資信託「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券
- 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"> ・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。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

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

ファンドに係る費用

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入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） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

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

ファンドに係る費用

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入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 [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 運用の効率化をはかるため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式への投資は行ないません。 外貨建資産への投資は行ないません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用

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

その他

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

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

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 >

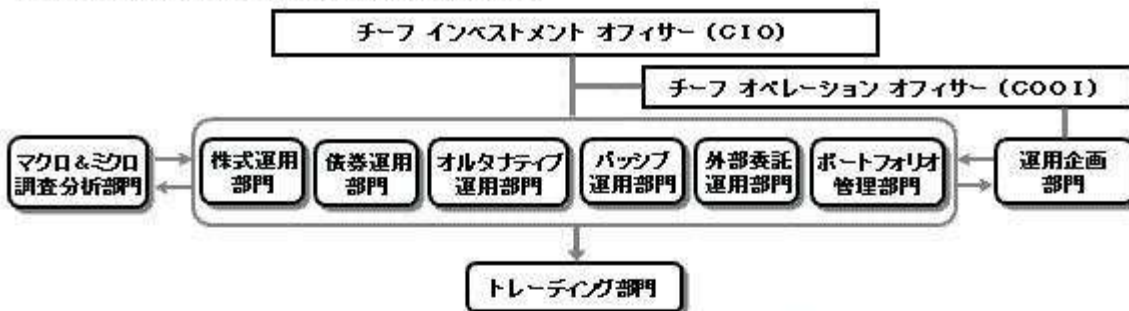
運用の基本方針

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

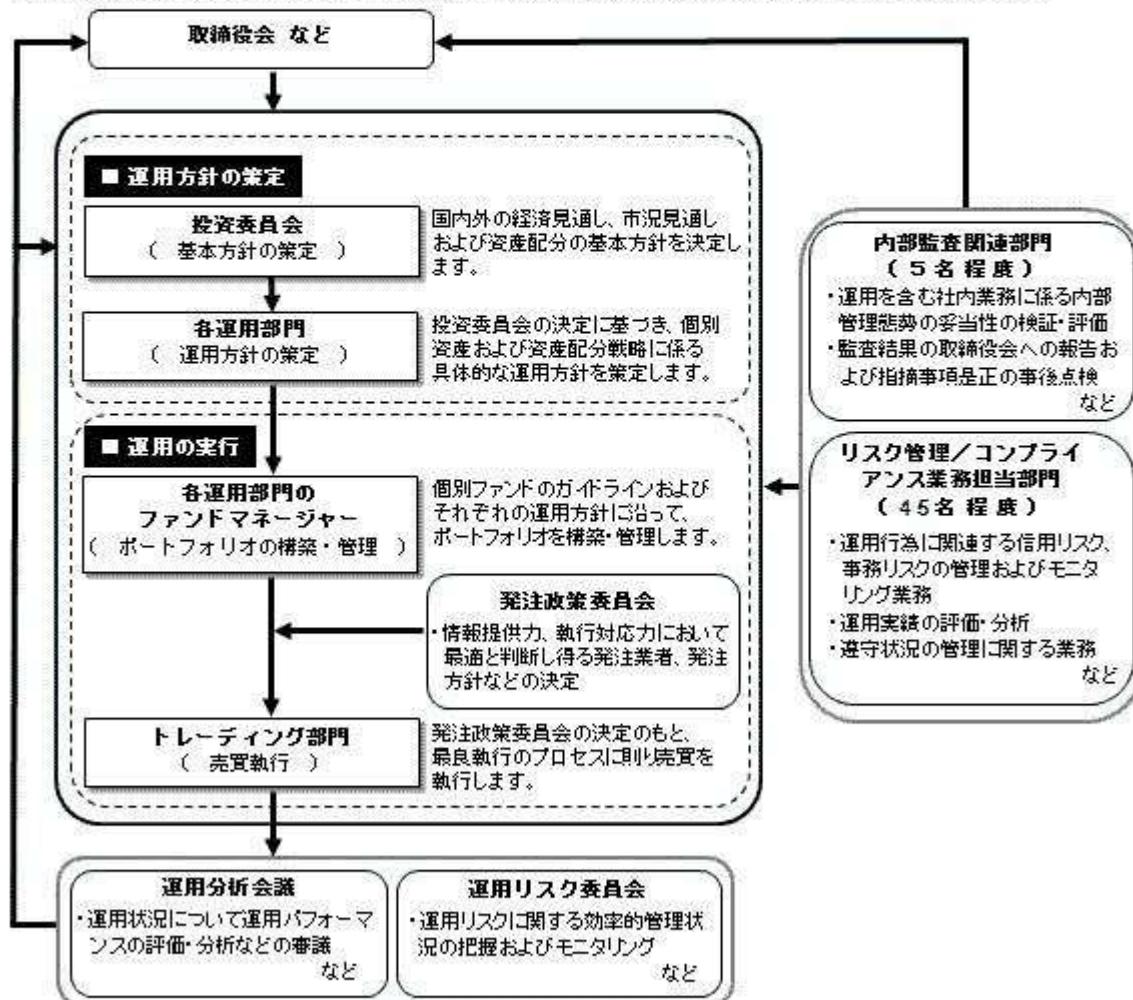
^{*}シティ世界国債インデックス（除く日本）は、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが開発した、日本を除く世界の主要国の国債市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

（3）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

上記体制は平成28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

< D C インデックスバランス（株式40） >

- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の70%未満とします。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 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。

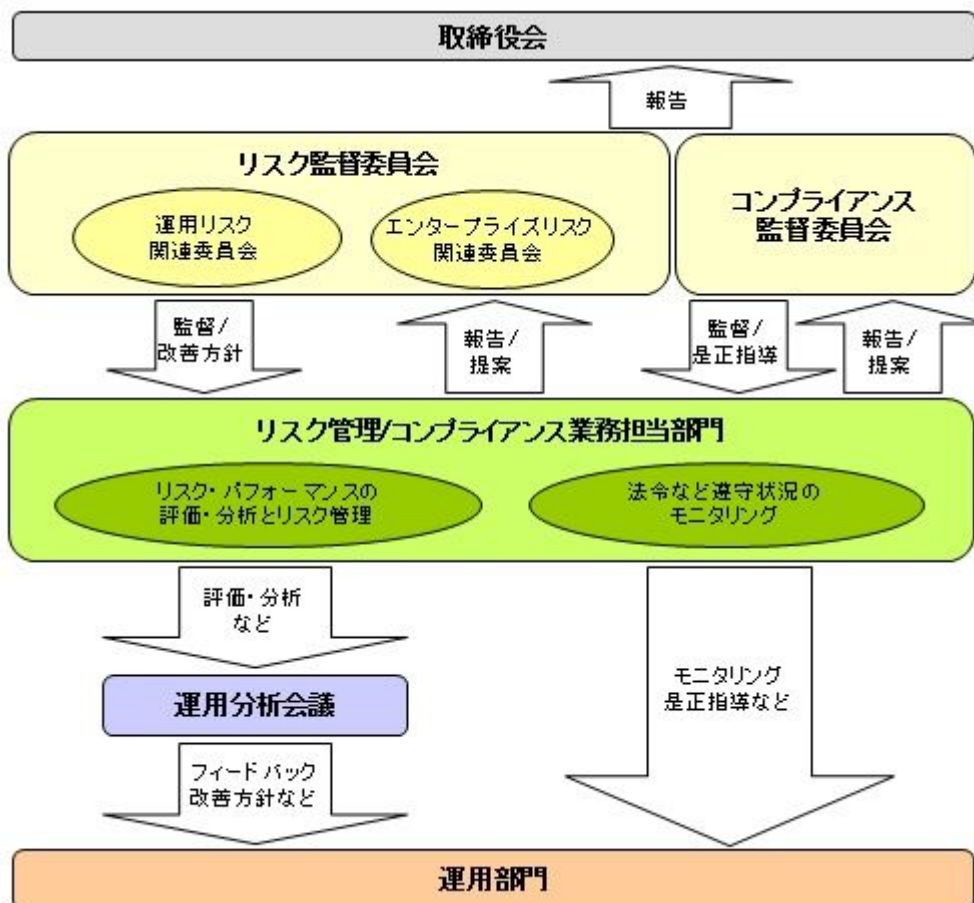
<その他の留意事項>

- ・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



全社的リスク管理

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

運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

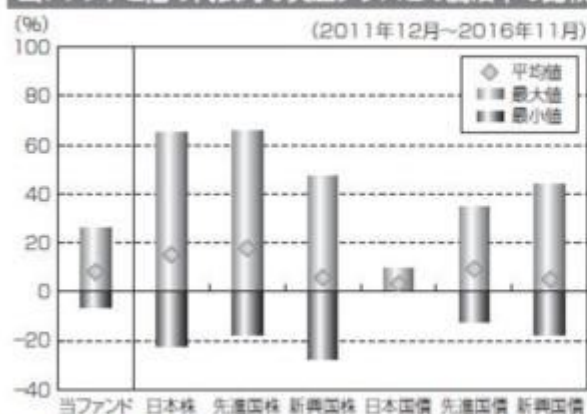
法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は平成28年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	8.1%	15.1%	17.7%	5.7%	3.1%	9.3%	5.0%
最大値	26.0%	65.0%	65.7%	47.4%	9.3%	34.9%	43.7%
最小値	-6.3%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	0.5%	-12.3%	-17.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2011年12月から2016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……シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
 新興国債……JPモルガンGBI-EMグローバル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。

シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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0.1944%（税抜0.18%）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
0.18%	0.05%	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）^{*}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

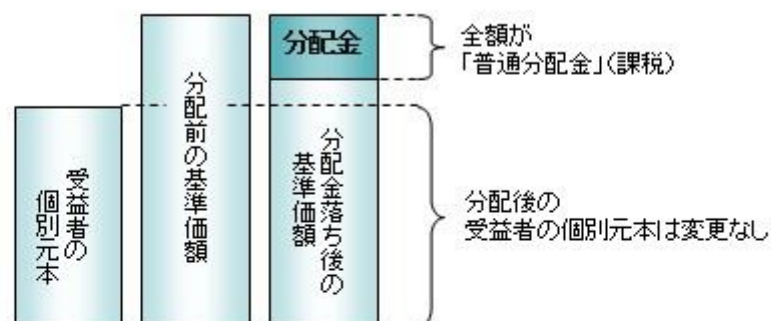
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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。

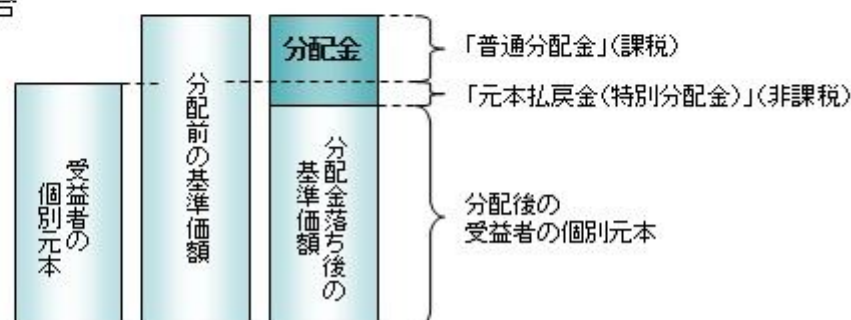
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<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29年 2月 7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40)】

以下の運用状況は2016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	3,171,540,764	95.02
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		166,286,108	4.98
合計(純資産総額)		3,337,826,872	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	1,076,367,938	1.4028	1,509,995,432	1.3943	1,500,779,815	44.96
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	787,636,142	1.1795	929,074,159	1.2721	1,001,951,936	30.02
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	156,153,652	2.0666	322,714,061	2.1464	335,168,198	10.04
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	171,484,794	1.7297	296,617,249	1.9456	333,640,815	10.00

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5計算期間末 (2007年11月 6日)	1,085	1,085	1.3957	1.3967
第6計算期間末 (2008年11月 6日)	1,009	1,009	1.1219	1.1229
第7計算期間末 (2009年11月 6日)	1,203	1,204	1.1521	1.1531
第8計算期間末 (2010年11月 8日)	1,338	1,339	1.1621	1.1631
第9計算期間末 (2011年11月 7日)	1,435	1,436	1.1334	1.1344
第10計算期間末 (2012年11月 6日)	1,609	1,610	1.1729	1.1739
第11計算期間末 (2013年11月 6日)	2,074	2,076	1.4699	1.4709
第12計算期間末 (2014年11月 6日)	2,656	2,657	1.6212	1.6222
第13計算期間末 (2015年11月 6日)	3,050	3,052	1.7361	1.7371
第14計算期間末 (2016年11月 7日)	3,190	3,192	1.6726	1.6736
2015年11月末日	3,051		1.7435	
12月末日	3,064		1.7311	
2016年 1月末日	3,009		1.6914	
2月末日	2,906		1.6423	
3月末日	3,009		1.6837	
4月末日	3,010		1.6815	
5月末日	3,064		1.7024	
6月末日	2,968		1.6355	
7月末日	3,074		1.6726	
8月末日	3,107		1.6665	
9月末日	3,137		1.6611	
10月末日	3,210		1.6891	
11月末日	3,337		1.7337	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第5期	2006年11月 7日～2007年11月 6日	0.0010
第6期	2007年11月 7日～2008年11月 6日	0.0010
第7期	2008年11月 7日～2009年11月 6日	0.0010
第8期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	0.0010
第9期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	0.0010
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	0.0010
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	0.0010

第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	0.0010
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

【収益率の推移】

期	期間	収益率(%)
第5期	2006年11月 7日～2007年11月 6日	3.28
第6期	2007年11月 7日～2008年11月 6日	19.55
第7期	2008年11月 7日～2009年11月 6日	2.78
第8期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	0.95
第9期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	2.38
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	3.57
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	25.41
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	10.36
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	7.15
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	3.60

(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5期	2006年11月 7日～2007年11月 6日	256,467,907	73,913,335
第6期	2007年11月 7日～2008年11月 6日	212,320,920	90,369,023
第7期	2008年11月 7日～2009年11月 6日	223,234,805	78,013,735
第8期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	206,736,758	99,558,607
第9期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	199,510,879	84,921,462
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	232,315,742	126,886,432
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	252,340,970	212,819,956
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	402,200,788	175,054,267
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	312,108,595	193,535,396
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	311,896,821	161,785,450

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2016年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	26,320,034,960	98.71
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		345,224,270	1.29
合計（純資産総額）		26,665,259,230	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	324,280,000	1.22

(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	152,600	6,025.00	919,415,000	6,649.00	1,014,637,400	3.81
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	917,900	532.90	489,148,910	669.80	614,809,420	2.31
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	97,200	4,721.67	458,946,324	4,625.00	449,550,000	1.69
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	97,000	3,547.87	344,143,390	4,206.00	407,982,000	1.53
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	110,500	3,144.17	347,430,785	3,332.00	368,186,000	1.38
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	54,500	6,585.00	358,882,500	6,712.00	365,804,000	1.37
日本	株式	KDDI	情報・通信業	119,800	3,111.46	372,752,908	2,999.00	359,280,200	1.35
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,644,600	171.50	282,048,900	202.60	333,195,960	1.25
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	76,200	3,965.44	302,166,528	3,946.00	300,685,200	1.13
日本	株式	ソニー	電気機器	86,700	3,324.68	288,249,756	3,288.00	285,069,600	1.07
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	49,100	4,056.39	199,168,749	4,899.00	240,540,900	0.90
日本	株式	ファナック	電気機器	12,400	19,717.70	244,499,480	19,305.00	239,382,000	0.90
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	90,500	2,600.60	235,354,300	2,624.00	237,472,000	0.89
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	23,800	9,404.76	223,833,288	9,766.00	232,430,800	0.87
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	48,200	4,804.00	231,552,800	4,685.00	225,817,000	0.85
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	50,700	4,492.78	227,783,946	4,435.00	224,854,500	0.84
日本	株式	三菱商事	卸売業	90,900	2,361.49	214,659,441	2,471.50	224,659,350	0.84
日本	株式	キーエンス	電気機器	2,800	77,230.00	216,244,000	78,230.00	219,044,000	0.82
日本	株式	キヤノン	電気機器	66,100	3,052.26	201,754,386	3,261.00	215,552,100	0.81

日本	株式	任天堂	その他製品	7,600	24,534.34	186,460,984	27,775.00	211,090,000	0.79
日本	株式	三菱地所	不動産業	90,000	2,041.13	183,701,700	2,305.50	207,495,000	0.78
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	131,300	1,557.00	204,434,100	1,579.50	207,388,350	0.78
日本	株式	三菱電機	電気機器	130,900	1,399.27	183,164,443	1,576.50	206,363,850	0.77
日本	株式	村田製作所	電気機器	12,900	14,447.35	186,370,815	15,425.00	198,982,500	0.75
日本	株式	信越化学工業	化学	23,000	7,693.30	176,945,900	8,460.00	194,580,000	0.73
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	10,200	17,520.00	178,704,000	18,680.00	190,536,000	0.71
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	43,400	3,960.73	171,895,682	4,367.00	189,527,800	0.71
日本	株式	日立製作所	電気機器	295,000	525.10	154,904,500	609.30	179,743,500	0.67
日本	株式	ダイキン工業	機械	16,700	9,879.00	164,979,300	10,715.00	178,940,500	0.67
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	38,100	4,025.27	153,362,787	4,645.00	176,974,500	0.66

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.34
		建設業	3.08
		食料品	4.47
		繊維製品	0.69
		パルプ・紙	0.24
		化学	6.31
		医薬品	4.70
		石油・石炭製品	0.47
		ゴム製品	0.95
		ガラス・土石製品	0.93
		鉄鋼	1.24
		非鉄金属	0.90
		金属製品	0.69
		機械	5.02
		電気機器	12.39
		輸送用機器	9.66
		精密機器	1.50
		その他製品	1.90
		電気・ガス業	1.81
		陸運業	4.25
		海運業	0.22
空運業	0.55		
倉庫・運輸関連業	0.20		
情報・通信業	7.46		
卸売業	4.37		
小売業	4.71		
銀行業	8.19		

	証券、商品先物取引業	1.14
	保険業	2.60
	その他金融業	1.31
	不動産業	2.66
	サービス業	3.64
合 計		98.71

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2016年 12月	買建	22	日本円	306,246,880	324,280,000	1.22

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

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

以下の運用状況は2016年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	7,405,949	0.01
株式	アメリカ	44,607,336,959	60.15
	カナダ	2,864,129,718	3.86
	モーリシャス	4,465,754	0.01
	ドイツ	2,566,792,182	3.46
	イタリア	454,734,070	0.61
	フランス	2,555,719,002	3.45
	オランダ	1,217,855,174	1.64
	スペイン	858,388,500	1.16
	ベルギー	347,648,303	0.47
	オーストリア	56,845,360	0.08
	ルクセンブルク	81,092,290	0.11
	フィンランド	259,076,361	0.35
	アイルランド	1,193,152,300	1.61
	ポルトガル	40,512,610	0.05
	イギリス	4,788,841,659	6.46
スイス	2,697,014,288	3.64	

	スウェーデン	784,606,220	1.06
	ノルウェー	184,972,348	0.25
	デンマーク	453,439,932	0.61
	ケイマン	187,397,261	0.25
	オーストラリア	1,923,989,389	2.59
	バミューダ	179,805,539	0.24
	ニュージーランド	58,522,936	0.08
	香港	766,359,750	1.03
	シンガポール	518,688,859	0.70
	イスラエル	165,133,310	0.22
	ジャージー	388,356,001	0.52
	英ヴァージン諸島	21,454,233	0.03
	小計	70,226,330,308	94.69
投資証券	アメリカ	1,411,595,722	1.90
	カナダ	11,889,220	0.02
	フランス	97,152,320	0.13
	イギリス	68,756,976	0.09
	オーストラリア	202,990,340	0.27
	香港	36,818,400	0.05
	シンガポール	27,429,044	0.04
	小計	1,856,632,022	2.50
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		2,075,902,054	2.80
合計（純資産総額）		74,166,270,333	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,548,444,975	2.09
	買建	ドイツ	421,044,750	0.57

(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		534,691,900	0.72
	売建		6,711,600	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	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	116,972	13,293.66	1,554,986,582	12,530.33	1,465,698,135	1.98
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	159,744	6,856.49	1,095,284,065	6,867.73	1,097,079,907	1.48
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	88,631	9,749.06	864,069,150	9,656.87	855,898,754	1.15
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	58,821	12,811.38	753,578,371	12,645.00	743,791,639	1.00
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	8,565	93,890.93	804,175,864	85,722.49	734,213,199	0.99
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	78,140	7,734.49	604,373,517	8,872.18	693,272,645	0.93
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	196,473	3,220.83	632,806,722	3,490.64	685,816,709	0.92
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	49,380	14,872.04	734,381,424	13,588.20	670,985,583	0.90
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	102,930	5,139.84	529,043,978	5,830.10	600,092,316	0.81
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	131,367	4,125.81	541,995,808	4,438.34	583,051,621	0.79
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	6,612	90,798.26	600,358,104	86,657.83	572,981,590	0.77
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	6,270	93,145.59	584,022,856	88,748.84	556,455,257	0.75
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	68,033	8,011.03	545,014,472	7,588.81	516,289,715	0.70
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	54,669	9,777.16	534,507,965	9,318.49	509,432,738	0.69
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	219,039	1,879.66	411,719,372	2,281.00	499,628,353	0.67
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	87,157	5,378.17	468,745,406	5,728.92	499,315,759	0.67
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	40,231	11,328.56	455,759,434	12,292.00	494,519,565	0.67
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	129,780	3,628.91	470,960,926	3,588.44	465,708,574	0.63
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	25,450	16,123.27	410,337,385	17,726.38	451,136,514	0.61
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	59,133	6,964.41	411,826,988	6,991.39	413,422,444	0.56
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア	51,677	7,253.33	374,830,769	7,885.13	407,480,318	0.55
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	87,972	4,782.34	420,712,613	4,626.08	406,965,774	0.55
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	101,072	3,945.94	398,824,250	3,969.55	401,210,378	0.54
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	62,587	5,574.90	348,916,755	6,241.55	390,640,416	0.53
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	26,660	13,865.88	369,664,435	14,571.88	388,486,331	0.52
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	14,988	25,355.30	380,025,266	25,155.30	377,027,696	0.51
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	422,501	879.27	371,496,511	887.42	374,938,490	0.51

スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	47,623	8,061.03	383,890,456	7,783.25	370,661,977	0.50
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	32,863	10,426.95	342,661,022	11,204.90	368,226,675	0.50
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	40,762	9,221.81	375,899,525	8,898.04	362,702,029	0.49

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
出資金			0.01
株式	国外	エネルギー	7.15
		素材	4.82
		資本財	7.13
		商業・専門サービス	0.97
		運輸	1.92
		自動車・自動車部品	1.52
		耐久消費財・アパレル	1.70
		消費者サービス	1.81
		メディア	2.62
		小売	3.96
		食品・生活必需品小売り	1.98
		食品・飲料・タバコ	5.74
		家庭用品・パーソナル用品	2.07
		ヘルスケア機器・サービス	3.80
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.49
		銀行	9.06
		各種金融	4.22
		保険	4.16
		不動産	0.52
		ソフトウェア・サービス	9.02
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.54		
電気通信サービス	2.92		
公益事業	3.18		
半導体・半導体製造装置	2.40		
投資証券			2.50
合計			97.20

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI1612	買建	125	米ドル	13,576,062.5	1,526,220,946	13,773,750	1,548,444,975	2.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1612	買建	125	ユーロ	3,535,090	423,150,273	3,517,500	421,044,750	0.57

(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	1,950,000.00	208,513,340	218,765,500	0.29
	ユーロ	買建	2,640,000.00	311,269,914	315,926,400	0.43
	シンガポールドル	売建	85,000.00	6,682,700	6,711,600	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2016年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	26,137,571,674	76.36
地方債証券	日本	2,102,269,000	6.14
特殊債券	日本	3,936,092,000	11.50
社債券	日本	1,481,361,000	4.33
	オーストラリア	300,834,354	0.88
	小計	1,782,195,354	5.21
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		273,202,704	0.80
合計(純資産総額)		34,231,330,732	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第107回利付国債(5年)	705,000,000	100.56	709,004,400	100.47	708,369,900	0.200	2017/12/20	2.07
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	581,000,000	104.75	608,603,310	104.35	606,319,980	1.400	2019/9/20	1.77

日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	560,000,000	101.19	566,686,400	100.80	564,485,600	0.100	2020/6/20	1.65
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	505,000,000	101.11	510,605,500	100.77	508,923,850	0.100	2020/3/20	1.49
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	473,000,000	104.83	495,845,900	104.40	493,854,570	1.300	2019/12/20	1.44
日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	410,000,000	103.70	425,186,400	103.36	423,792,400	1.300	2019/3/20	1.24
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	370,000,000	106.66	394,675,300	106.08	392,514,500	1.300	2021/3/20	1.15
日本	国債証券	第29回利付国債(30年)	276,000,000	141.98	391,864,800	139.26	384,371,400	2.400	2038/9/20	1.12
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	300,000,000	123.07	369,210,000	121.90	365,706,000	2.300	2026/6/20	1.07
日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	290,000,000	126.67	367,348,800	125.19	363,071,300	2.100	2029/9/20	1.06
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	280,000,000	124.35	348,191,200	122.59	343,274,400	1.700	2032/9/20	1.00
日本	国債証券	第120回利付国債(5年)	330,000,000	101.26	334,184,400	100.99	333,293,400	0.200	2019/9/20	0.97
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	325,000,000	101.25	329,085,250	100.83	327,726,750	0.100	2020/9/20	0.96
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	295,000,000	109.92	324,264,000	109.06	321,732,900	1.400	2022/12/20	0.94
日本	国債証券	第292回利付国債(10年)	306,000,000	102.75	314,442,540	102.48	313,613,280	1.700	2018/3/20	0.92
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	250,000,000	123.55	308,887,500	122.36	305,900,000	2.300	2026/9/20	0.89
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	300,000,000	101.04	303,135,000	100.75	302,250,000	0.100	2019/12/20	0.88
日本	特殊債券	第45回日本学生支援債券	300,000,000	99.99	299,970,000	100.00	300,003,000	0.001	2018/11/20	0.88
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	208,000,000	137.09	285,147,200	134.97	280,743,840	2.400	2034/3/20	0.82
日本	国債証券	第137回利付国債(20年)	220,000,000	124.16	273,165,200	122.43	269,352,600	1.700	2032/6/20	0.79
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	250,000,000	104.63	261,582,500	103.55	258,877,500	0.400	2025/6/20	0.76
日本	国債証券	第50回利付国債(20年)	237,000,000	109.34	259,135,800	108.66	257,531,310	1.900	2021/3/22	0.75
日本	国債証券	第149回利付国債(20年)	215,000,000	121.63	261,517,400	119.70	257,365,750	1.500	2034/6/20	0.75
日本	国債証券	第43回利付国債(30年)	195,000,000	132.35	258,098,100	129.52	252,573,750	1.700	2044/6/20	0.74
日本	国債証券	第2回利付国債(40年)	165,000,000	150.96	249,095,550	147.47	243,332,100	2.200	2049/3/20	0.71
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	230,000,000	106.69	245,403,100	105.75	243,241,100	0.800	2023/6/20	0.71
日本	国債証券	第141回利付国債(20年)	195,000,000	124.53	242,835,450	122.65	239,181,150	1.700	2032/12/20	0.70
日本	国債証券	第290回利付国債(10年)	226,000,000	102.34	231,288,400	102.09	230,741,480	1.400	2018/3/20	0.67
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	210,000,000	106.91	224,525,700	105.94	222,482,400	0.800	2023/9/20	0.65
日本	国債証券	第126回利付国債(5年)	220,000,000	101.31	222,897,400	100.87	221,922,800	0.100	2020/12/20	0.65

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	76.36

地方債証券	6.14
特殊債券	11.50
社債券	5.21
合 計	99.20

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2016年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	68,840,840,496	43.85
	カナダ	3,295,657,278	2.10
	メキシコ	1,258,298,881	0.80
	ドイツ	11,472,187,255	7.31
	イタリア	14,772,718,410	9.41
	フランス	15,261,894,082	9.72
	オランダ	3,652,977,014	2.33
	スペイン	8,552,548,502	5.45
	ベルギー	3,919,356,435	2.50
	オーストリア	2,365,446,821	1.51
	フィンランド	915,482,335	0.58
	アイルランド	1,192,779,370	0.76
	イギリス	11,283,537,347	7.19
	スイス	378,788,369	0.24
	スウェーデン	699,500,722	0.45
	ノルウェー	417,569,119	0.27
	デンマーク	1,085,497,680	0.69
	ポーランド	875,276,457	0.56
	オーストラリア	3,197,573,576	2.04
	シンガポール	603,710,347	0.38
マレーシア	684,778,626	0.44	
南アフリカ	783,508,544	0.50	

	小計	155,509,927,666	99.04
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		1,499,491,676	0.96
合計(純資産総額)		157,009,419,342	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		606,741,870	0.39

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,490,000	14,920.68	1,714,386,814	14,527.86	1,669,252,030	8.000	2021/11/15	1.06
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,780,000	12,033.98	1,297,263,870	11,901.36	1,282,967,232	3.375	2019/11/15	0.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,270,000	12,171.71	1,250,034,966	12,013.78	1,233,815,800	3.625	2020/2/15	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,600,000	14,433.89	1,096,976,103	14,157.23	1,075,949,516	8.750	2020/8/15	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,100,000	11,894.03	1,082,357,276	11,816.83	1,075,332,184	3.750	2018/11/15	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,850,000	11,885.99	1,051,910,820	11,812.44	1,045,401,078	4.000	2018/8/15	0.67
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,300,000	11,588.26	1,077,708,630	11,217.18	1,043,198,568	2.000	2023/2/15	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,550,000	12,372.12	1,057,816,648	12,128.40	1,036,978,988	3.625	2021/2/15	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,830,000	11,381.42	1,004,979,676	11,330.92	1,000,520,609	1.500	2018/12/31	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,260,000	12,171.71	1,005,383,527	11,993.14	990,633,816	3.500	2020/5/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,340,000	11,517.56	960,564,830	11,471.23	956,701,051	2.250	2018/7/31	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,950,000	11,634.59	924,950,153	11,588.47	921,284,036	3.500	2018/2/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	11,483.30	918,664,762	11,378.56	910,285,425	1.750	2019/9/30	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,150,000	11,405.35	929,536,636	11,019.57	898,095,528	1.750	2023/5/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,550,000	11,783.45	889,651,207	11,716.92	884,628,180	3.875	2018/5/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,460,000	11,592.75	864,819,179	11,415.90	851,626,326	2.000	2020/7/31	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,400,000	11,535.34	853,615,807	11,492.96	850,479,514	2.750	2018/2/28	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	11,528.97	807,028,217	11,480.89	803,662,475	2.375	2018/6/30	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,800,000	11,657.42	792,704,942	11,604.73	789,121,937	4.250	2017/11/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,400,000	11,674.99	747,199,800	11,419.84	730,870,300	2.125	2021/6/30	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,170,000	11,504.82	709,847,808	11,463.33	707,287,615	2.750	2017/12/31	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	12,714.65	750,164,765	11,624.04	685,818,840	3.125	2044/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,350,000	13,882.76	742,728,103	12,737.71	681,467,719	3.625	2043/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,930,000	11,748.99	696,715,209	11,263.07	667,900,570	2.250	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	11,967.89	694,137,964	11,502.19	667,127,373	2.500	2024/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,940,000	11,731.42	696,846,376	11,206.20	665,648,605	2.250	2025/11/15	0.42
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,140,000	16,989.02	703,345,469	16,052.20	664,561,118	5.250	2029/11/1	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	12,128.84	703,473,164	11,089.40	643,185,263	2.875	2043/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	11,945.50	657,002,604	11,525.68	633,912,435	2.500	2023/8/15	0.40

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,520,000	11,272.08	622,219,014	11,242.87	620,606,804	1.000	2018/5/31	0.40
------	------	-----------------	-----------	-----------	-------------	-----------	-------------	-------	-----------	------

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.04
合 計	99.04

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	売建	2,200,000.00	246,458,710	247,275,000	0.16
	加ドル	売建	118,000.00	9,867,927	9,870,700	0.01
	メキシコペソ	売建	2,728,000.00	14,781,668	14,840,320	0.01
	ユーロ	売建	2,044,000.00	243,088,026	244,646,360	0.16
	英ポンド	売建	207,000.00	28,737,189	29,071,080	0.02
	スウェーデンクローナ	売建	610,240.00	7,414,293	7,475,440	0.00
	デンマーククローネ	売建	643,000.00	10,332,302	10,339,440	0.01
	ポーランドズロチ	売建	375,000.00	10,116,637	10,117,500	0.01
	豪ドル	売建	262,000.00	21,943,868	22,038,910	0.01
	南アフリカランド	売建	1,368,000.00	10,932,782	11,067,120	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

参考情報



分配の推移(税引前、1万口当たり)

2012年11月	2013年11月	2014年11月	2015年11月	2016年11月	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	110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	30.02%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	10.00%
日本債券インデックスマザーファンド	44.96%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	10.04%
現金その他	4.98%

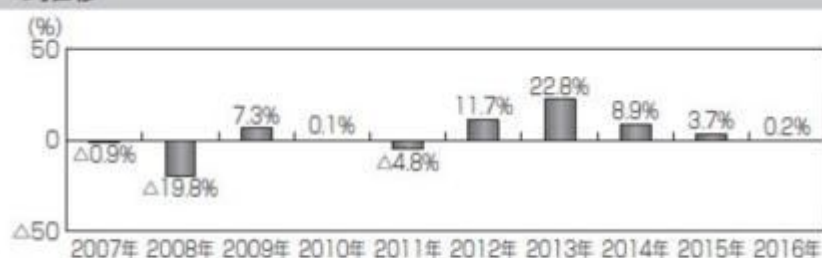
※当ファンドの対純資産額類比です。

<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	3.81%	
	2 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.31%	
	3 日本電信電話	情報・通信業	1.69%	
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	1.98%	
	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1.48%	
	3 EXXON MOBIL CORP	エネルギー	1.15%	
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107回利付国債(5年)	国債証券	2017/12/20	2.07%
	2 第303回利付国債(10年)	国債証券	2019/9/20	1.77%
	3 第124回利付国債(5年)	国債証券	2020/6/20	1.65%
海外債券インデックス (ヘッジなし)マザーファンド	1 US TREASURY N/B (クーポン8.000%)	国債証券	2021/11/15	1.06%
	2 US TREASURY N/B (クーポン3.375%)	国債証券	2019/11/15	0.82%
	3 US TREASURY N/B (クーポン3.625%)	国債証券	2020/2/15	0.79%

※各マザーファンドの対純資産額類比です。

年間収益率の推移



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

※当ファンドにはベンチマークはありません。

※2016年は、2016年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。

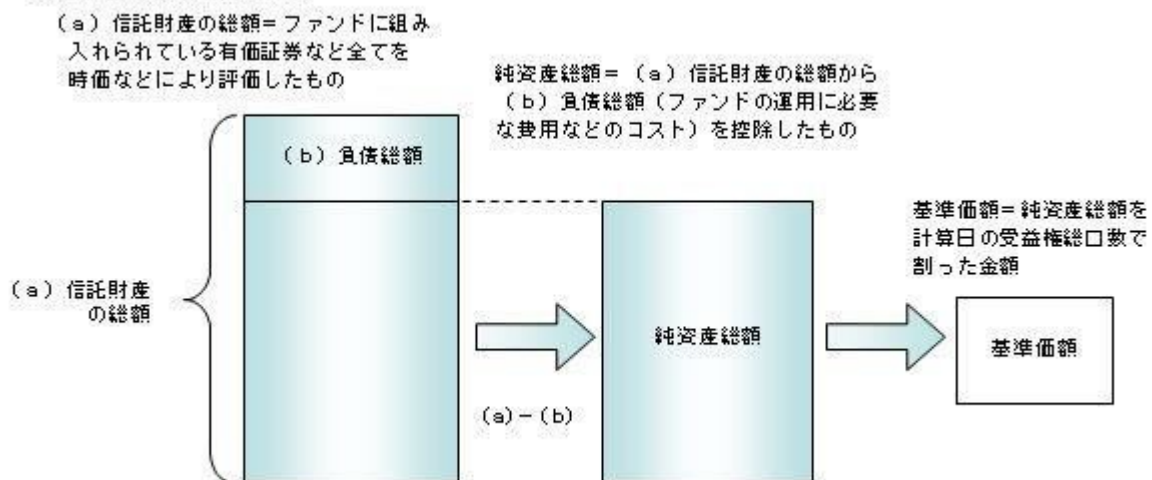
3【資産管理等の概要】

(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^{*}における以下のいずれかの価額で評価します。

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

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

^{*}外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします（平成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することができます。（後述の

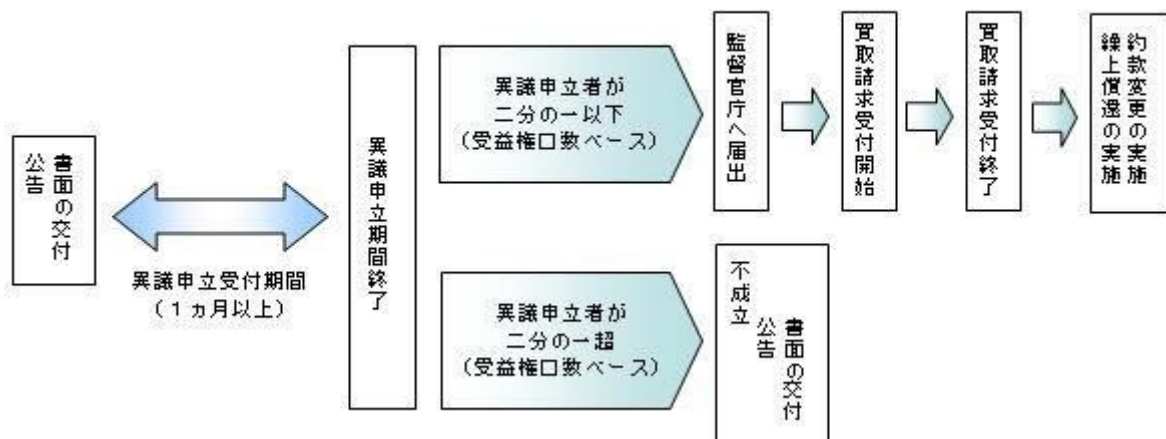
「異議の申立て」をご覧ください。）

- 4) 委託会社は、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わない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。
- 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

ことができます。

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期計算期間(平成27年11月7日から平成28年11月7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40）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第13期 平成27年11月 6日現在	第14期 平成28年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	154,050,016	166,476,282
親投資信託受益証券	2,903,764,889	3,031,949,732
未収利息	251	-
流動資産合計	3,057,815,156	3,198,426,014
資産合計	3,057,815,156	3,198,426,014
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,757,126	1,907,237
未払解約金	617,376	3,331,270
未払受託者報酬	485,882	501,763
未払委託者報酬	4,255,200	2,509,106
未払利息	-	157
その他未払費用	79,307	81,901
流動負債合計	7,194,891	8,331,434
負債合計	7,194,891	8,331,434
純資産の部		
元本等		
元本	1,757,126,484	1,907,237,855
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,293,493,781	1,282,856,725
（分配準備積立金）	627,312,638	617,107,389
元本等合計	3,050,620,265	3,190,094,580
純資産合計	3,050,620,265	3,190,094,580
負債純資産合計	3,057,815,156	3,198,426,014

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期		第14期	
	自	平成26年11月 7日 至 平成27年11月 6日	自	平成27年11月 7日 至 平成28年11月 7日
営業収益				
受取利息		83,149		22,986
有価証券売買等損益		197,484,506		103,413,401
営業収益合計		197,567,655		103,390,415
営業費用				
支払利息		-		38,450
受託者報酬		932,303		984,105
委託者報酬		8,273,485		4,921,119
その他費用		152,169		161,030
営業費用合計		9,357,957		6,104,704
営業利益又は営業損失（ ）		188,209,698		109,495,119
経常利益又は経常損失（ ）		188,209,698		109,495,119
当期純利益又は当期純損失（ ）		188,209,698		109,495,119
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（ ）		14,008,474		8,145,844
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,017,793,770		1,293,493,781
剰余金増加額又は欠損金減少額		224,475,190		211,209,524
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		224,475,190		211,209,524
剰余金減少額又は欠損金増加額		121,219,277		118,590,068
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		121,219,277		118,590,068
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		1,757,126		1,907,237
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,293,493,781		1,282,856,725

(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27年11月 7日から平成28年11月 7日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

		第13期 平成27年11月 6日現在	第14期 平成28年11月 7日現在
1.	期首元本額	1,638,553,285円	1,757,126,484円
	期中追加設定元本額	312,108,595円	311,896,821円
	期中一部解約元本額	193,535,396円	161,785,450円
2.	受益権の総数	1,757,126,484口	1,907,237,855口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第13期 自 平成26年11月 7日 至 平成27年11月 6日		第14期 自 平成27年11月 7日 至 平成28年11月 7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	46,752,828円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 45,637,690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	127,448,396円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金	666,181,143円	C 信託約款に定める収益調整金 792,255,352円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	454,868,540円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 573,376,936円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	1,295,250,907円	E 分配対象収益 (A+B+C+D) 1,411,269,978円
F	分配対象収益(1万口当たり)	7,371円	F 分配対象収益(1万口当たり) 7,399円
G	分配金額	1,757,126円	G 分配金額 1,907,237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13期 自 平成26年11月 7日 至 平成27年11月 6日	第14期 自 平成27年11月 7日 至 平成28年11月 7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13期 平成27年11月 6日現在	第14期 平成28年11月 7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13期（平成27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	179,502,452
合計	179,502,452

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	86,163,483
合計	86,163,483

(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13期 平成27年11月 6日現在		第14期 平成28年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	1.7361円	1口当たり純資産額	1.6726円
(1万口当たり純資産額)	(17,361円)	(1万口当たり純資産額)	(16,726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	180,333,319	311,904,508	
	日本債券インデックスマザーファンド	1,026,669,053	1,440,827,348	
	海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド	155,237,497	320,767,240	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	812,659,519	958,450,636	
合計		2,174,899,388	3,031,949,732	

(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27年11月 6日現在	平成28年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	68,621,670	44,977,231
株式	27,907,326,060	25,119,698,830
派生商品評価勘定	18,679,740	1,774,600
未収入金	77,357,070	201,776,220
未収配当金	207,525,785	217,451,697
未収利息	112	-
前払金	-	3,550,000
流動資産合計	28,279,510,437	25,589,228,578
資産合計	28,279,510,437	25,589,228,578
負債の部		
流動負債		

派生商品評価勘定	-	852,020
前受金	17,540,000	-
未払解約金	46,138,822	95,632,741
未払利息	-	42
流動負債合計	63,678,822	96,484,803
負債合計	63,678,822	96,484,803
純資産の部		
元本等		
元本	21,313,752,367	21,614,291,321
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	6,902,079,248	3,878,452,454
元本等合計	28,215,831,615	25,492,743,775
純資産合計	28,215,831,615	25,492,743,775
負債純資産合計	28,279,510,437	25,589,228,578

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成27年11月 6日現在	平成28年11月 7日現在
1.	期首	平成26年11月 7日	平成27年11月 7日
	期首元本額	25,502,591,555円	21,313,752,367円
	期首からの追加設定元本額	1,825,029,839円	3,753,988,127円
	期首からの一部解約元本額	6,013,869,027円	3,453,449,173円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	182,944,304円	240,921,581円
	DCインデックスバランス（株式40）	713,946,648円	812,659,519円
	DCインデックスバランス（株式60）	1,348,998,781円	1,476,706,820円
	DCインデックスバランス（株式80）	1,605,725,499円	1,674,820,350円

インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,164,952,931円	1,342,019,022円
世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	5,497,114,326円	5,350,505,667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	5,124,803円	5,113,692円
日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産）	23,674,244円	4,079,233円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	65,422,399円	64,849,435円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	52,091,722円	52,835,497円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	80,607,291円	79,884,061円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	95,992,107円	99,146,523円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	6,996,040,892円	6,690,320,683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）	19,068,512円	17,528,685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）	42,455,918円	39,632,807円
グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	41,930,365円	36,400,738円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	266,671,393円	301,756,164円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	812,132,628円	900,722,367円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,143,415,021円	1,211,519,643円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,155,442,583円	1,212,868,834円
計	21,313,752,367円	21,614,291,321円
2. 受益権の総数	21,313,752,367口	21,614,291,321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	489,070,000円	366,605,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成26年11月 7日 至 平成27年11月 6日	自 平成27年11月 7日 至 平成28年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	平成27年11月 6日現在	平成28年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成27年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	85,344,064
合計	85,344,064

（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

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（平成27年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	278,755,000	-	297,445,000	18,690,000
合計		278,755,000	-	297,445,000	18,690,000

（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

（注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成27年11月 6日現在		平成28年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	1.3238円	1口当たり純資産額	1.1794円
(1万口当たり純資産額)	(13,238円)	(1万口当たり純資産額)	(11,794円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	600	2,633.00	1,579,800	
日本水産	18,400	504.00	9,273,600	
マルハニチロ	2,700	2,873.00	7,757,100	
カネコ種苗	500	1,423.00	711,500	
サカタのタネ	2,100	2,948.00	6,190,800	
ホクト	1,400	2,001.00	2,801,400	
ホクリヨウ	200	752.00	150,400	
住石ホールディングス	4,500	88.00	396,000	
日鉄鉱業	400	4,150.00	1,660,000	
三井松島産業	900	1,228.00	1,105,200	
国際石油開発帝石	74,500	947.30	70,573,850	
日本海洋掘削	500	2,260.00	1,130,000	
石油資源開発	2,200	2,209.00	4,859,800	
K & O エナジーグループ	1,000	1,450.00	1,450,000	

ショーボンドホールディングス	1,500	4,935.00	7,402,500	
ミライト・ホールディングス	4,300	989.00	4,252,700	
サンヨーホームズ	300	576.00	172,800	
ダイセキ環境ソリューション	400	1,458.00	583,200	
安藤・間	10,200	694.00	7,078,800	
東急建設	5,000	1,048.00	5,240,000	
コムシスホールディングス	5,600	1,853.00	10,376,800	
ミサワホーム	1,700	825.00	1,402,500	
高松コンストラクショングループ	1,100	2,501.00	2,751,100	
東建コーポレーション	600	7,470.00	4,482,000	
ソネック	200	611.00	122,200	
ヤマウラ	700	525.00	367,500	
大成建設	72,000	783.00	56,376,000	
大林組	42,500	993.00	42,202,500	
清水建設	43,000	921.00	39,603,000	
飛鳥建設	13,900	182.00	2,529,800	
長谷工コーポレーション	16,500	1,020.00	16,830,000	
松井建設	1,600	1,100.00	1,760,000	
銭高組	2,000	344.00	688,000	
鹿島建設	62,000	699.00	43,338,000	
不動テトラ	11,700	177.00	2,070,900	
大末建設	500	870.00	435,000	
鉄建建設	9,000	330.00	2,970,000	
西松建設	16,000	495.00	7,920,000	
三井住友建設	54,600	99.00	5,405,400	
大豊建設	5,000	570.00	2,850,000	
前田建設工業	9,000	947.00	8,523,000	
ナカノフドー建設	1,100	417.00	458,700	
奥村組	11,000	610.00	6,710,000	
東鉄工業	1,700	2,939.00	4,996,300	
イチケン	2,000	380.00	760,000	
浅沼組	5,000	250.00	1,250,000	
戸田建設	16,000	561.00	8,976,000	
熊谷組	22,000	274.00	6,028,000	
青木あすなろ建設	1,000	719.00	719,000	
北野建設	3,000	272.00	816,000	

植木組	2,000	220.00	440,000
三井ホーム	2,000	450.00	900,000
矢作建設工業	1,900	1,048.00	1,991,200
ピーエス三菱	1,700	356.00	605,200
日本ハウスホールディングス	2,900	392.00	1,136,800
大東建託	5,200	17,435.00	90,662,000
新日本建設	1,700	1,007.00	1,711,900
N I P P O	3,000	2,009.00	6,027,000
東亜道路工業	3,000	276.00	828,000
前田道路	4,000	1,940.00	7,760,000
日本道路	4,000	427.00	1,708,000
東亜建設工業	1,100	2,249.00	2,473,900
若築建設	9,000	153.00	1,377,000
東洋建設	4,100	420.00	1,722,000
五洋建設	15,700	618.00	9,702,600
大林道路	1,500	652.00	978,000
福田組	2,000	1,188.00	2,376,000
住友林業	9,700	1,468.00	14,239,600
日本基礎技術	1,600	343.00	548,800
日成ビルド工業	4,000	472.00	1,888,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	8,000	75.00	600,000
巴コーポレーション	1,900	338.00	642,200
パナホーム	5,000	759.00	3,795,000
大和ハウス工業	41,800	2,844.50	118,900,100
ライト工業	2,800	1,257.00	3,519,600
積水ハウス	44,500	1,712.00	76,184,000
日特建設	1,300	486.00	631,800
北陸電気工事	700	852.00	596,400
ユアテック	2,000	743.00	1,486,000
西部電気工業	300	2,001.00	600,300
四電工	1,000	409.00	409,000
中電工	1,800	2,126.00	3,826,800
関電工	6,000	1,007.00	6,042,000
きんでん	9,500	1,416.00	13,452,000
東京エネシス	2,000	953.00	1,906,000
トーエネック	2,000	502.00	1,004,000

住友電設	1,000	1,104.00	1,104,000	
日本電設工業	2,300	1,789.00	4,114,700	
協和エクシオ	5,600	1,569.00	8,786,400	
新日本空調	1,100	1,129.00	1,241,900	
N D S	200	2,573.00	514,600	
九電工	2,800	3,250.00	9,100,000	
三機工業	3,100	917.00	2,842,700	
日揮	13,200	1,788.00	23,601,600	
中外炉工業	4,000	199.00	796,000	
ヤマト	1,400	557.00	779,800	
太平電業	2,000	1,000.00	2,000,000	
高砂熱学工業	3,900	1,453.00	5,666,700	
三晃金属工業	200	2,948.00	589,600	
朝日工業社	300	2,930.00	879,000	
明星工業	2,600	537.00	1,396,200	
大気社	1,800	2,581.00	4,645,800	
ダイダン	2,000	867.00	1,734,000	
日比谷総合設備	1,600	1,622.00	2,595,200	
東芝プラントシステム	2,300	1,667.00	3,834,100	
東洋エンジニアリング	8,000	348.00	2,784,000	
千代田化工建設	10,000	872.00	8,720,000	
新興プランテック	2,900	774.00	2,244,600	
日本製粉	4,200	1,542.00	6,476,400	
日清製粉グループ本社	15,500	1,553.00	24,071,500	
日東富士製粉	100	3,730.00	373,000	
昭和産業	6,000	585.00	3,510,000	
鳥越製粉	1,100	762.00	838,200	
中部飼料	1,500	899.00	1,348,500	
フィード・ワン	8,500	135.00	1,147,500	
東洋精糖	2,000	109.00	218,000	
日本甜菜製糖	700	2,048.00	1,433,600	
三井製糖	1,000	2,348.00	2,348,000	
塩水港精糖	1,700	238.00	404,600	
日新製糖	600	1,478.00	886,800	
森永製菓	2,700	4,900.00	13,230,000	
中村屋	300	4,575.00	1,372,500	

江崎グリコ	3,500	5,830.00	20,405,000
名糖産業	600	1,357.00	814,200
不道家	8,000	204.00	1,632,000
山崎製パン	10,400	2,332.00	24,252,800
第一屋製パン	2,000	134.00	268,000
モロゾフ	2,000	435.00	870,000
亀田製菓	800	5,240.00	4,192,000
寿スピリッツ	1,000	2,934.00	2,934,000
カルビー	5,800	3,465.00	20,097,000
森永乳業	13,000	882.00	11,466,000
六甲バター	600	2,757.00	1,654,200
ヤクルト本社	7,600	4,840.00	36,784,000
明治ホールディングス	8,400	10,420.00	87,528,000
雪印メグミルク	3,100	3,450.00	10,695,000
プリマハム	9,000	413.00	3,717,000
日本ハム	10,000	2,823.00	28,230,000
林兼産業	500	870.00	435,000
丸大食品	7,000	514.00	3,598,000
S Foods	800	2,798.00	2,238,400
伊藤ハム米久ホールディングス	8,200	1,035.00	8,487,000
サッポロホールディングス	4,600	2,842.00	13,073,200
アサヒグループホールディングス	26,500	3,670.00	97,255,000
キリンホールディングス	60,900	1,853.50	112,878,150
宝ホールディングス	10,300	972.00	10,011,600
オエノンホールディングス	4,000	242.00	968,000
養命酒製造	400	1,825.00	730,000
コカ・コーラウエスト	4,800	3,070.00	14,736,000
コカ・コーライーストジャパン	5,500	2,276.00	12,518,000
サントリー食品インターナショナル	9,700	4,715.00	45,735,500
ダイドードリンコ	700	5,710.00	3,997,000
伊藤園	4,200	3,770.00	15,834,000
キーコーヒー	1,200	2,046.00	2,455,200
ユニカフェ	400	954.00	381,600
ジャパンフーズ	200	1,146.00	229,200
日清オイリオグループ	8,000	476.00	3,808,000
不二製油グループ本社	3,800	2,030.00	7,714,000

かどや製油	100	3,180.00	318,000	
J - オイルミルズ	600	3,755.00	2,253,000	
キッコーマン	10,000	3,440.00	34,400,000	
味の素	29,100	2,348.00	68,326,800	
キュービー	7,200	2,855.00	20,556,000	
ハウス食品グループ本社	5,200	2,323.00	12,079,600	
カゴメ	5,100	2,660.00	13,566,000	
焼津水産化学工業	700	1,009.00	706,300	
アリアケジャパン	1,100	5,990.00	6,589,000	
ピエトロ	200	1,564.00	312,800	
エバラ食品工業	300	1,959.00	587,700	
ニチレイ	7,000	2,365.00	16,555,000	
東洋水産	6,900	4,140.00	28,566,000	
イトアンド	200	2,109.00	421,800	
日清食品ホールディングス	5,500	5,930.00	32,615,000	
永谷園ホールディングス	1,000	1,315.00	1,315,000	
一正蒲鉾	500	1,102.00	551,000	
フジッコ	1,400	2,349.00	3,288,600	
ロック・フィールド	1,500	1,448.00	2,172,000	
日本たばこ産業	78,400	3,925.00	307,720,000	
ケンコーマヨネーズ	500	3,690.00	1,845,000	
わらべや日洋ホールディングス	800	2,450.00	1,960,000	
なとり	700	1,804.00	1,262,800	
北の達人コーポレーション	300	451.00	135,300	
ユーグレナ	4,500	1,366.00	6,147,000	
ミヨシ油脂	5,000	131.00	655,000	
理研ビタミン	400	4,375.00	1,750,000	
片倉工業	1,700	1,223.00	2,079,100	
ゲンゼ	10,000	369.00	3,690,000	
東洋紡	53,000	171.00	9,063,000	
ユニチカ	37,000	73.00	2,701,000	
富士紡ホールディングス	600	3,485.00	2,091,000	
倉敷紡績	13,000	208.00	2,704,000	
シキボウ	7,000	120.00	840,000	
日本毛織	3,700	759.00	2,808,300	
ダイトウボウ	2,000	68.00	136,000	

トーア紡コーポレーション	600	512.00	307,200
ダイドーリミテッド	1,500	402.00	603,000
帝国繊維	1,400	1,528.00	2,139,200
帝人	10,800	1,955.00	21,114,000
東レ	96,000	954.70	91,651,200
サカイオーベックス	400	1,872.00	748,800
住江織物	3,000	213.00	639,000
日本フェルト	800	489.00	391,200
イチカワ	1,000	269.00	269,000
日東製網	100	1,650.00	165,000
アツギ	11,000	115.00	1,265,000
ダイニック	3,000	170.00	510,000
セーレン	3,300	1,199.00	3,956,700
ソトー	500	1,185.00	592,500
東海染工	2,000	128.00	256,000
小松精練	1,900	629.00	1,195,100
ワコールホールディングス	8,000	1,228.00	9,824,000
ホギメディカル	800	6,810.00	5,448,000
レナウン	3,600	103.00	370,800
クラウドディア	300	492.00	147,600
T S Iホールディングス	5,400	577.00	3,115,800
三陽商会	7,000	158.00	1,106,000
ナイガイ	5,000	56.00	280,000
オンワードホールディングス	9,000	706.00	6,354,000
ルック	3,000	158.00	474,000
キムラタン	58,000	7.00	406,000
ゴールドウイン	600	4,940.00	2,964,000
デサント	3,000	1,273.00	3,819,000
キング	600	393.00	235,800
ヤマトインターナショナル	800	384.00	307,200
特種東海製紙	800	3,480.00	2,784,000
王子ホールディングス	51,000	417.00	21,267,000
日本製紙	5,900	1,869.00	11,027,100
三菱製紙	1,900	682.00	1,295,800
北越紀州製紙	7,400	644.00	4,765,600
中越パルプ工業	5,000	220.00	1,100,000

巴川製紙所	2,000	250.00	500,000
大王製紙	5,200	1,234.00	6,416,800
レンゴー	12,800	669.00	8,563,200
トモク	4,000	304.00	1,216,000
ザ・バック	900	2,715.00	2,443,500
クラレ	22,300	1,580.00	35,234,000
旭化成	83,000	949.50	78,808,500
共和レザー	800	783.00	626,400
昭和電工	8,800	1,493.00	13,138,400
住友化学	97,000	483.00	46,851,000
日本化成	3,000	142.00	426,000
住友精化	500	3,860.00	1,930,000
日産化学工業	7,200	3,615.00	26,028,000
ラサ工業	5,000	125.00	625,000
クレハ	1,000	3,950.00	3,950,000
多木化学	1,000	757.00	757,000
テイカ	2,000	526.00	1,052,000
石原産業	2,400	787.00	1,888,800
片倉コープアグリ	2,000	203.00	406,000
日東エフシー	800	846.00	676,800
日本曹達	8,000	464.00	3,712,000
東ソー	38,000	710.00	26,980,000
トクヤマ	21,000	448.00	9,408,000
セントラル硝子	13,000	405.00	5,265,000
東亜合成	8,300	1,133.00	9,403,900
大阪ソーダ	6,000	457.00	2,742,000
関東電化工業	3,000	868.00	2,604,000
デンカ	27,000	468.00	12,636,000
信越化学工業	23,700	7,916.00	187,609,200
日本カーバイド工業	5,000	139.00	695,000
堺化学工業	5,000	370.00	1,850,000
エア・ウォーター	10,900	1,887.00	20,568,300
大陽日酸	10,200	1,031.00	10,516,200
日本化学工業	5,000	269.00	1,345,000
日本パーカライズン	6,800	1,366.00	9,288,800
高圧ガス工業	2,000	656.00	1,312,000

四国化成工業	2,000	964.00	1,928,000	
戸田工業	3,000	284.00	852,000	
ステラ ケミファ	600	3,040.00	1,824,000	
保土谷化学工業	500	2,901.00	1,450,500	
日本触媒	2,100	6,750.00	14,175,000	
大日精化工業	5,000	553.00	2,765,000	
カネカ	18,000	839.00	15,102,000	
三菱瓦斯化学	12,300	1,610.00	19,803,000	
三井化学	60,000	481.00	28,860,000	
J S R	13,300	1,531.00	20,362,300	
東京応化工業	2,500	3,700.00	9,250,000	
大阪有機化学工業	900	775.00	697,500	
三菱ケミカルホールディングス	88,500	681.30	60,295,050	
ダイセル	17,800	1,149.00	20,452,200	
住友ベークライト	12,000	557.00	6,684,000	
積水化学工業	30,000	1,645.00	49,350,000	
日本ゼオン	11,000	968.00	10,648,000	
アイカ工業	4,200	3,030.00	12,726,000	
宇部興産	67,000	215.00	14,405,000	
積水樹脂	2,100	1,695.00	3,559,500	
タキロン	3,000	482.00	1,446,000	
旭有機材	4,000	204.00	816,000	
日立化成	7,400	2,450.00	18,130,000	
ニチバン	1,000	886.00	886,000	
リケンテクノス	2,800	543.00	1,520,400	
大倉工業	3,000	411.00	1,233,000	
積水化成成品工業	1,900	759.00	1,442,100	
群栄化学工業	300	2,924.00	877,200	
タイガースポリマー	600	681.00	408,600	
ミライアル	500	754.00	377,000	
ダイキアクシス	200	963.00	192,600	
ダイキョーニシカワ	2,300	1,366.00	3,141,800	
日本化薬	9,000	1,222.00	10,998,000	
カーリットホールディングス	1,300	523.00	679,900	
日本精化	1,100	761.00	837,100	
扶桑化学工業	900	2,417.00	2,175,300	

A D E K A	5,700	1,511.00	8,612,700
日油	11,000	1,044.00	11,484,000
新日本理化	2,200	159.00	349,800
ハリマ化成グループ	1,100	643.00	707,300
花王	33,600	5,282.00	177,475,200
第一工業製薬	3,000	335.00	1,005,000
ニイタカ	200	1,487.00	297,400
三洋化成工業	800	4,585.00	3,668,000
有機合成薬品工業	800	223.00	178,400
大日本塗料	8,000	220.00	1,760,000
日本ペイントホールディングス	10,200	3,435.00	35,037,000
関西ペイント	13,900	2,201.00	30,593,900
神東塗料	1,000	201.00	201,000
中国塗料	3,800	733.00	2,785,400
日本特殊塗料	900	1,395.00	1,255,500
藤倉化成	1,800	614.00	1,105,200
太陽ホールディングス	1,100	3,890.00	4,279,000
D I C	5,200	3,155.00	16,406,000
サカタインクス	2,700	1,367.00	3,690,900
東洋インキ S C ホールディングス	13,000	490.00	6,370,000
T & K T O K A	1,000	976.00	976,000
富士フイルムホールディングス	26,200	3,981.00	104,302,200
資生堂	25,100	2,637.50	66,201,250
ライオン	17,000	1,895.00	32,215,000
高砂香料工業	900	2,782.00	2,503,800
マンダム	1,300	4,745.00	6,168,500
ミルボン	700	4,715.00	3,300,500
ファンケル	2,800	1,524.00	4,267,200
コーセー	2,100	8,570.00	17,997,000
コタ	500	1,219.00	609,500
シーズ・ホールディングス	1,700	2,917.00	4,958,900
シーボン	200	2,188.00	437,600
ポーラ・オルビスホールディングス	1,300	8,080.00	10,504,000
ノエビアホールディングス	800	3,135.00	2,508,000
アジュバンコスメジャパン	300	862.00	258,600
エステー	900	1,263.00	1,136,700

アグロ カネショウ	500	1,128.00	564,000
コニシ	2,100	1,233.00	2,589,300
長谷川香料	1,700	1,850.00	3,145,000
星光PMC	700	1,129.00	790,300
小林製薬	3,700	5,100.00	18,870,000
荒川化学工業	1,100	1,502.00	1,652,200
メック	1,000	973.00	973,000
日本高純度化学	400	2,426.00	970,400
タカラバイオ	2,900	1,458.00	4,228,200
JCU	400	4,890.00	1,956,000
新田ゼラチン	800	707.00	565,600
OATアグリオ	200	1,271.00	254,200
デクセリアルズ	3,400	821.00	2,791,400
アース製薬	900	4,805.00	4,324,500
イハラケミカル工業	1,800	889.00	1,600,200
北興化学工業	1,000	352.00	352,000
大成ラミック	400	2,911.00	1,164,400
クミアイ化学工業	2,700	580.00	1,566,000
日本農薬	3,000	570.00	1,710,000
アキレス	1,100	1,478.00	1,625,800
有沢製作所	2,200	559.00	1,229,800
日東電工	9,500	7,241.00	68,789,500
レック	400	2,780.00	1,112,000
きもと	2,400	237.00	568,800
藤森工業	1,000	2,525.00	2,525,000
前澤化成工業	900	1,134.00	1,020,600
JSP	600	2,566.00	1,539,600
エフピコ	1,200	5,610.00	6,732,000
天馬	900	1,769.00	1,592,100
信越ポリマー	2,600	700.00	1,820,000
東リ	3,000	366.00	1,098,000
ニフコ	2,300	6,020.00	13,846,000
日本バルカー工業	1,000	1,388.00	1,388,000
ユニ・チャーム	26,800	2,388.50	64,011,800
協和発酵キリン	15,800	1,507.00	23,810,600

				代用有価証券 10,000株
武田薬品工業	49,600	4,540.00	225,184,000	
アステラス製薬	135,100	1,483.00	200,353,300	
大日本住友製薬	9,400	1,716.00	16,130,400	
塩野義製薬	17,900	5,092.00	91,146,800	
田辺三菱製薬	15,400	2,026.00	31,200,400	
わかもと製薬	2,000	225.00	450,000	
あすか製薬	1,500	1,733.00	2,599,500	
日本新薬	3,000	5,140.00	15,420,000	
ピオフェルミン製薬	200	2,626.00	525,200	
中外製薬	13,200	3,335.00	44,022,000	
科研製薬	2,500	6,370.00	15,925,000	
エーザイ	16,300	6,435.00	104,890,500	
ロート製薬	6,500	1,791.00	11,641,500	
小野薬品工業	30,000	2,644.50	79,335,000	
久光製薬	3,700	5,540.00	20,498,000	
持田製薬	900	8,050.00	7,245,000	
参天製薬	24,400	1,447.00	35,306,800	
扶桑薬品工業	500	2,671.00	1,335,500	
日本ケミファ	200	4,600.00	920,000	
ツムラ	4,500	3,030.00	13,635,000	
日医工	3,100	1,780.00	5,518,000	
キッセイ薬品工業	2,300	2,688.00	6,182,400	
生化学工業	2,500	1,620.00	4,050,000	
栄研化学	1,100	2,759.00	3,034,900	
日水製薬	500	1,135.00	567,500	
鳥居薬品	900	2,345.00	2,110,500	
JCRファーマ	1,000	2,735.00	2,735,000	
東和薬品	600	3,805.00	2,283,000	
富士製薬工業	400	2,462.00	984,800	
沢井製薬	2,300	6,500.00	14,950,000	
ゼリア新薬工業	2,700	1,696.00	4,579,200	
第一三共	38,900	2,307.50	89,761,750	
キョーリン製薬ホールディングス	3,200	2,259.00	7,228,800	
大幸薬品	700	1,615.00	1,130,500	
ダイト	600	2,230.00	1,338,000	

大塚ホールディングス	28,400	4,542.00	128,992,800	
大正製薬ホールディングス	2,800	9,580.00	26,824,000	
ペプチドリーム	2,300	5,080.00	11,684,000	
日本コークス工業	10,900	90.00	981,000	
昭和シェル石油	11,800	958.00	11,304,400	
ニチレキ	1,700	824.00	1,400,800	
東燃ゼネラル石油	21,000	1,003.00	21,063,000	
ユシロ化学工業	700	1,424.00	996,800	
ビーピー・カストロール	600	1,367.00	820,200	
富士石油	3,100	312.00	967,200	
MORESCO	500	1,482.00	741,000	
出光興産	6,300	2,325.00	14,647,500	
JXホールディングス	146,600	404.40	59,285,040	
コスモエネルギーホールディングス	4,000	1,324.00	5,296,000	
横浜ゴム	8,000	1,808.00	14,464,000	
東洋ゴム工業	7,000	1,585.00	11,095,000	
ブリヂストン	44,600	3,892.00	173,583,200	
住友ゴム工業	12,400	1,724.00	21,377,600	
藤倉ゴム工業	1,200	562.00	674,400	
オカモト	4,000	1,138.00	4,552,000	
フコク	500	820.00	410,000	
ニッタ	1,200	2,667.00	3,200,400	
住友理工	2,400	998.00	2,395,200	
三ツ星ベルト	3,000	858.00	2,574,000	
バンドー化学	2,400	995.00	2,388,000	
日東紡績	11,000	378.00	4,158,000	
旭硝子	65,000	708.00	46,020,000	
日本板硝子	6,100	805.00	4,910,500	
石塚硝子	2,000	188.00	376,000	
日本山村硝子	5,000	194.00	970,000	
日本電気硝子	27,000	570.00	15,390,000	
オハラ	500	600.00	300,000	
住友大阪セメント	25,000	423.00	10,575,000	
太平洋セメント	80,000	301.00	24,080,000	
日本ヒューム	1,300	678.00	881,400	
日本コンクリート工業	3,000	365.00	1,095,000	

三谷セキサン	700	2,575.00	1,802,500
アジアパイルホールディングス	1,700	446.00	758,200
東海カーボン	12,000	362.00	4,344,000
日本カーボン	7,000	215.00	1,505,000
東洋炭素	800	1,535.00	1,228,000
ノリタケカンパニーリミテド	700	2,387.00	1,670,900
TOTO	9,700	4,090.00	39,673,000
日本碍子	16,700	1,944.00	32,464,800
日本特殊陶業	11,400	2,023.00	23,062,200
ダントーホールディングス	1,000	188.00	188,000
MARUWA	500	4,150.00	2,075,000
品川リフラクトリーズ	3,000	228.00	684,000
黒崎播磨	3,000	323.00	969,000
ヨータイ	1,000	309.00	309,000
イソライト工業	700	269.00	188,300
東京窯業	1,600	176.00	281,600
ニッカトー	500	387.00	193,500
フジインコーポレーテッド	1,100	1,827.00	2,009,700
エーアンドエーマテリアル	3,000	95.00	285,000
ニチアス	7,000	927.00	6,489,000
ニチハ	1,800	2,462.00	4,431,600
新日鐵住金	59,600	2,147.00	127,961,200
神戸製鋼所	22,900	862.00	19,739,800
合同製鐵	800	1,910.00	1,528,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	36,100	1,475.50	53,265,550
日新製鋼	6,000	1,364.00	8,184,000
東京製鐵	6,700	731.00	4,897,700
共英製鋼	1,400	1,907.00	2,669,800
大和工業	2,700	2,900.00	7,830,000
東京鐵鋼	3,000	462.00	1,386,000
大阪製鐵	800	1,883.00	1,506,400
淀川製鋼所	1,800	2,956.00	5,320,800
東洋鋼鈹	3,200	319.00	1,020,800
丸一鋼管	4,400	3,380.00	14,872,000
モリ工業	400	1,958.00	783,200
大同特殊鋼	22,000	436.00	9,592,000

日本高周波鋼業	5,000	76.00	380,000	
日本冶金工業	11,200	155.00	1,736,000	
山陽特殊製鋼	8,000	526.00	4,208,000	
愛知製鋼	800	5,020.00	4,016,000	
日立金属	13,500	1,343.00	18,130,500	
日本金属	400	1,070.00	428,000	
大太平洋金属	9,000	321.00	2,889,000	
新日本電工	7,600	203.00	1,542,800	
栗本鐵工所	500	1,997.00	998,500	
虹技	2,000	239.00	478,000	
日本鑄鉄管	2,000	179.00	358,000	
三菱製鋼	9,000	183.00	1,647,000	
日亜鋼業	1,900	240.00	456,000	
日本精線	1,000	509.00	509,000	
シンニッタン	1,100	500.00	550,000	
新家工業	3,000	146.00	438,000	
大紀アルミニウム工業所	2,000	443.00	886,000	
日本軽金属ホールディングス	30,000	237.00	7,110,000	
三井金属鉱業	36,000	235.00	8,460,000	
東邦亜鉛	8,000	390.00	3,120,000	
三菱マテリアル	8,300	3,015.00	25,024,500	
住友金属鉱山	34,000	1,372.50	46,665,000	
DOWAホールディングス	15,000	785.00	11,775,000	
古河機械金属	21,000	155.00	3,255,000	
エス・サイエンス	6,800	35.00	238,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,500	1,333.00	1,999,500	
東邦チタニウム	2,300	679.00	1,561,700	
UACJ	17,000	333.00	5,661,000	
古河電気工業	4,400	3,150.00	13,860,000	
住友電気工業	49,800	1,388.00	69,122,400	
フジクラ	17,400	602.00	10,474,800	
昭和電線ホールディングス	17,000	74.00	1,258,000	
タツタ電線	2,600	430.00	1,118,000	
沖電線	1,000	216.00	216,000	
カナレ電気	200	1,981.00	396,200	
平河ヒューテック	600	1,039.00	623,400	

リヨービ	8,000	428.00	3,424,000
アーレスティ	1,500	1,141.00	1,711,500
アサヒホールディングス	2,000	1,934.00	3,868,000
稲葉製作所	700	1,314.00	919,800
宮地エンジニアリンググループ	4,000	171.00	684,000
トーカロ	900	2,327.00	2,094,300
アルファC o	400	993.00	397,200
SUMCO	13,800	1,111.00	15,331,800
川田テクノロジーズ	200	4,630.00	926,000
東洋製罐グループホールディングス	9,400	1,955.00	18,377,000
ホッカンホールディングス	2,000	384.00	768,000
コロナ	700	1,104.00	772,800
横河ブリッジホールディングス	2,400	1,170.00	2,808,000
駒井ハルテック	300	2,001.00	600,300
高田機工	1,000	210.00	210,000
三和ホールディングス	13,100	1,049.00	13,741,900
文化シャッター	3,700	858.00	3,174,600
三協立山	1,700	1,633.00	2,776,100
アルインコ	900	975.00	877,500
東洋シャッター	300	525.00	157,500
LIXILグループ	18,400	2,397.00	44,104,800
日本フィルコン	1,000	558.00	558,000
ノーリツ	2,600	2,077.00	5,400,200
長府製作所	1,400	2,608.00	3,651,200
リンナイ	2,300	9,290.00	21,367,000
ダイニチ工業	700	656.00	459,200
日東精工	2,000	405.00	810,000
三洋工業	2,000	179.00	358,000
岡部	2,700	948.00	2,559,600
ジーテクト	1,400	2,100.00	2,940,000
中国工業	300	683.00	204,900
東プレ	2,500	2,527.00	6,317,500
高周波熱錬	2,500	840.00	2,100,000
東京製綱	900	1,735.00	1,561,500
サンコール	700	458.00	320,600
モリテック スチール	800	256.00	204,800

パイオラックス	700	6,530.00	4,571,000
日本発條	12,400	1,001.00	12,412,400
中央発條	2,000	295.00	590,000
アドバネクス	300	1,239.00	371,700
立川ブラインド工業	600	761.00	456,600
三益半導体工業	1,000	1,265.00	1,265,000
日本ドライケミカル	200	2,243.00	448,600
日本製鋼所	4,400	2,315.00	10,186,000
三浦工業	5,400	1,731.00	9,347,400
タクマ	4,000	967.00	3,868,000
ツガミ	4,000	571.00	2,284,000
オークマ	9,000	885.00	7,965,000
東芝機械	8,000	379.00	3,032,000
アマダホールディングス	17,800	1,207.00	21,484,600
アイダエンジニアリング	3,700	905.00	3,348,500
滝澤鉄工所	4,000	140.00	560,000
富士機械製造	4,000	1,330.00	5,320,000
牧野フライス製作所	6,000	663.00	3,978,000
オーエスジー	6,000	2,254.00	13,524,000
ダイジェット工業	2,000	150.00	300,000
旭ダイヤモンド工業	3,800	775.00	2,945,000
D M G 森精機	7,800	1,105.00	8,619,000
ソディック	3,400	753.00	2,560,200
ディスコ	1,600	12,580.00	20,128,000
日東工器	800	2,364.00	1,891,200
パンチ工業	500	870.00	435,000
豊和工業	800	526.00	420,800
O K K	5,000	105.00	525,000
東洋機械金属	900	407.00	366,300
津田駒工業	3,000	147.00	441,000
島精機製作所	1,700	3,390.00	5,763,000
N C ホールディングス	500	874.00	437,000
フリー	300	3,255.00	976,500
ヤマシンフィルタ	300	650.00	195,000
日阪製作所	1,800	798.00	1,436,400
やまびこ	2,400	1,050.00	2,520,000

ベガサスミシン製造	1,300	654.00	850,200
ナブテスコ	6,900	2,935.00	20,251,500
三井海洋開発	1,300	1,743.00	2,265,900
レオン自動機	1,100	821.00	903,100
S M C	3,900	30,700.00	119,730,000
新川	1,100	726.00	798,600
ホソカワミクロン	2,000	633.00	1,266,000
ユニオンツール	600	2,668.00	1,600,800
オイレス工業	1,700	1,862.00	3,165,400
日精エー・エス・ピー機械	400	1,949.00	779,600
サトーホールディングス	1,700	2,077.00	3,530,900
日本エアージェット	400	625.00	250,000
日精樹脂工業	1,100	832.00	915,200
オカダアイヨン	300	811.00	243,300
ワイエイシイ	500	1,189.00	594,500
小松製作所	61,000	2,259.50	137,829,500
住友重機械工業	39,000	601.00	23,439,000
日立建機	5,900	2,179.00	12,856,100
日工	400	1,688.00	675,200
巴工業	400	1,528.00	611,200
井関農機	14,000	247.00	3,458,000
T O W A	1,100	1,153.00	1,268,300
丸山製作所	3,000	169.00	507,000
北川鉄工所	600	1,731.00	1,038,600
ローツェ	500	1,774.00	887,000
タカキタ	400	523.00	209,200
クボタ	63,500	1,664.50	105,695,750
荏原実業	400	1,267.00	506,800
三菱化工機	4,000	202.00	808,000
月島機械	2,500	1,145.00	2,862,500
帝国電機製作所	1,000	794.00	794,000
新東工業	3,000	881.00	2,643,000
澁谷工業	1,100	2,110.00	2,321,000
アイチ コーポレーション	1,900	842.00	1,599,800
小森コーポレーション	3,200	1,349.00	4,316,800
鶴見製作所	1,000	1,482.00	1,482,000

住友精密工業	2,000	314.00	628,000	
酒井重工業	2,000	211.00	422,000	
荏原製作所	5,500	3,050.00	16,775,000	
石井鐵工所	200	1,521.00	304,200	
西島製作所	1,300	1,116.00	1,450,800	
北越工業	1,400	678.00	949,200	
ダイキン工業	17,200	10,055.00	172,946,000	
オルガノ	3,000	443.00	1,329,000	
トーヨーカネツ	6,000	229.00	1,374,000	
栗田工業	7,500	2,403.00	18,022,500	
樁本チエイン	8,000	827.00	6,616,000	
大同工業	3,000	240.00	720,000	
木村化工機	1,200	347.00	416,400	
アネスト岩田	2,300	1,120.00	2,576,000	
ダイフク	6,300	1,912.00	12,045,600	
サムコ	400	910.00	364,000	
加藤製作所	700	2,616.00	1,831,200	
油研工業	2,000	181.00	362,000	
タダノ	6,600	1,088.00	7,180,800	
フジテック	3,700	1,170.00	4,329,000	
C K D	3,800	1,281.00	4,867,800	
キトー	1,600	959.00	1,534,400	
平和	3,900	2,445.00	9,535,500	
理想科学工業	1,200	1,769.00	2,122,800	
S A N K Y O	3,500	3,670.00	12,845,000	
日本金銭機械	1,200	1,615.00	1,938,000	
マースエンジニアリング	700	1,999.00	1,399,300	
福島工業	800	3,365.00	2,692,000	
オーイズミ	500	704.00	352,000	
ダイコク電機	500	1,564.00	782,000	
竹内製作所	2,300	1,943.00	4,468,900	
アマノ	3,900	1,939.00	7,562,100	
J U K I	2,000	899.00	1,798,000	
サンデンホールディングス	8,000	318.00	2,544,000	
蛇の目ミシン工業	1,300	813.00	1,056,900	
マックス	2,000	1,297.00	2,594,000	

グローリー	4,000	3,465.00	13,860,000
新晃工業	900	1,287.00	1,158,300
大和冷機工業	2,000	900.00	1,800,000
セガサミーホールディングス	12,500	1,629.00	20,362,500
日本ピストンリング	500	1,540.00	770,000
リケン	600	3,725.00	2,235,000
T P R	1,400	3,035.00	4,249,000
ツバキ・ナカシマ	1,400	1,706.00	2,388,400
ホシザキ	2,800	9,280.00	25,984,000
大豊工業	1,000	1,510.00	1,510,000
日本精工	25,900	1,106.00	28,645,400
N T N	29,000	353.00	10,237,000
ジェイテクト	13,500	1,563.00	21,100,500
不二越	13,000	398.00	5,174,000
日本トムソン	4,000	376.00	1,504,000
T H K	8,900	2,191.00	19,499,900
ユーシン精機	600	2,434.00	1,460,400
前澤給装工業	500	1,376.00	688,000
イーグル工業	1,400	1,482.00	2,074,800
前澤工業	900	346.00	311,400
日本ピラー工業	1,300	1,076.00	1,398,800
キッツ	6,100	647.00	3,946,700
日立工機	3,300	908.00	2,996,400
マキタ	8,200	7,340.00	60,188,000
日立造船	10,000	536.00	5,360,000
三菱重工業	212,000	426.30	90,375,600
I H I	97,000	279.00	27,063,000
スター精密	2,200	1,460.00	3,212,000
日清紡ホールディングス	7,000	1,091.00	7,637,000
イビデン	8,800	1,360.00	11,968,000
コニカミノルタ	29,500	923.00	27,228,500
ブラザー工業	16,300	1,844.00	30,057,200
ミネベア	20,300	969.00	19,670,700
日立製作所	303,000	548.30	166,134,900
東芝	282,000	375.50	105,891,000
三菱電機	134,700	1,470.50	198,076,350

富士電機	38,000	532.00	20,216,000
東洋電機製造	3,000	297.00	891,000
安川電機	14,600	1,670.00	24,382,000
シンフォニアテクノロジー	8,000	194.00	1,552,000
明電舎	12,000	327.00	3,924,000
オリジン電気	2,000	269.00	538,000
山洋電気	3,000	712.00	2,136,000
デンヨー	1,200	1,291.00	1,549,200
東芝テック	8,000	457.00	3,656,000
芝浦メカトロニクス	2,000	244.00	488,000
マブチモーター	3,500	6,340.00	22,190,000
日本電産	16,400	10,150.00	166,460,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	200	2,358.00	471,600
東光高岳	600	1,991.00	1,194,600
ダブル・スコープ	1,200	1,817.00	2,180,400
ダイヘン	7,000	607.00	4,249,000
田淵電機	2,000	324.00	648,000
ヤーマン	100	3,080.00	308,000
JVCケンウッド	9,300	317.00	2,948,100
ミマキエンジニアリング	1,200	538.00	645,600
第一精工	600	1,149.00	689,400
日新電機	2,600	1,302.00	3,385,200
大崎電気工業	3,000	963.00	2,889,000
オムロン	13,400	3,985.00	53,399,000
日東工業	1,900	1,515.00	2,878,500
I D E C	1,600	967.00	1,547,200
不二電機工業	100	1,392.00	139,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	24,000	448.00	10,752,000
サクサホールディングス	3,000	213.00	639,000
メルコホールディングス	700	2,884.00	2,018,800
テクノメディカ	300	1,778.00	533,400
日本電気	174,000	288.00	50,112,000
富士通	122,000	611.60	74,615,200
沖電気工業	5,400	1,350.00	7,290,000
岩崎通信機	6,000	75.00	450,000
電気興業	4,000	565.00	2,260,000

サンケン電気	7,000	356.00	2,492,000	
ナカヨ	1,000	361.00	361,000	
アイホン	700	1,795.00	1,256,500	
ルネサスエレクトロニクス	6,600	743.00	4,903,800	
セイコーエプソン	18,800	2,138.00	40,194,400	
ワコム	9,800	306.00	2,998,800	
アルバック	2,300	3,205.00	7,371,500	
アクセル	500	782.00	391,000	
E I Z O	1,300	3,170.00	4,121,000	
ジャパンディスプレイ	23,600	206.00	4,861,600	
日本信号	3,500	910.00	3,185,000	
京三製作所	3,000	389.00	1,167,000	
能美防災	1,400	1,646.00	2,304,400	
ホーチキ	900	1,262.00	1,135,800	
エレコム	1,100	2,040.00	2,244,000	
日本無線	700	1,350.00	945,000	
パナソニック	144,300	995.00	143,578,500	
アンリツ	9,200	546.00	5,023,200	
富士通ゼネラル	4,000	2,364.00	9,456,000	
日立国際電気	3,300	2,131.00	7,032,300	
ソニー	89,200	3,149.00	280,890,800	
T D K	7,100	7,050.00	50,055,000	
帝国通信工業	3,000	160.00	480,000	
ミツミ電機	4,500	579.00	2,605,500	
タムラ製作所	5,000	424.00	2,120,000	
アルプス電気	11,600	2,441.00	28,315,600	
池上通信機	4,000	131.00	524,000	
パイオニア	19,000	249.00	4,731,000	
日本電波工業	1,200	828.00	993,600	
鈴木	500	509.00	254,500	
日本トリム	300	4,445.00	1,333,500	
ローランド ディー . ジー .	500	2,349.00	1,174,500	
フォスター電機	1,500	1,810.00	2,715,000	
クラリオン	7,000	345.00	2,415,000	
S M K	2,000	403.00	806,000	
ヨコオ	900	678.00	610,200	

ホシデン	3,800	827.00	3,142,600	
ヒロセ電機	2,000	13,470.00	26,940,000	
日本航空電子工業	3,000	1,432.00	4,296,000	
TOA	1,500	938.00	1,407,000	
日立マクセル	1,900	1,902.00	3,613,800	
古野電気	1,600	758.00	1,212,800	
ユニデンホールディングス	4,000	148.00	592,000	
アルパイン	3,000	1,399.00	4,197,000	
スミダコーポレーション	1,000	1,046.00	1,046,000	
アイコム	700	1,938.00	1,356,600	
リオン	500	1,443.00	721,500	
本多通信工業	400	1,277.00	510,800	
船井電機	1,400	859.00	1,202,600	
横河電機	13,700	1,479.00	20,262,300	
新電元工業	5,000	424.00	2,120,000	
アズビル	3,800	3,085.00	11,723,000	
東亜ディーケーケー	700	485.00	339,500	
日本光電工業	5,300	2,621.00	13,891,300	
チノー	400	1,031.00	412,400	
共和電業	1,500	375.00	562,500	
日本電子材料	500	555.00	277,500	
堀場製作所	2,500	4,980.00	12,450,000	
アドバンテスト	8,600	1,477.00	12,702,200	
小野測器	600	872.00	523,200	
エスペック	1,100	1,229.00	1,351,900	
パナソニック デバイスSUNX	1,100	619.00	680,900	
キーエンス	2,900	74,430.00	215,847,000	
日置電機	700	2,004.00	1,402,800	
シスメックス	9,800	7,100.00	69,580,000	
日本マイクロニクス	2,400	1,189.00	2,853,600	
メガチップス	1,200	2,235.00	2,682,000	
OBARA GROUP	700	4,495.00	3,146,500	
澤藤電機	1,000	204.00	204,000	
コーセル	1,700	1,205.00	2,048,500	
イリソ電子工業	400	6,150.00	2,460,000	
新日本無線	1,100	321.00	353,100	

オブテックス	900	2,572.00	2,314,800	
千代田インテグレ	700	2,168.00	1,517,600	
アイ・オー・データ機器	400	973.00	389,200	
レーザーテック	1,500	1,898.00	2,847,000	
スタンレー電気	9,000	2,959.00	26,631,000	
岩崎電気	5,000	163.00	815,000	
ウシオ電機	7,700	1,342.00	10,333,400	
岡谷電機産業	700	385.00	269,500	
ヘリオス テクノ ホールディング	1,200	426.00	511,200	
日本セラミック	1,000	2,048.00	2,048,000	
遠藤照明	600	835.00	501,000	
日本デジタル研究所	1,200	2,411.00	2,893,200	
古河電池	1,000	725.00	725,000	
双信電機	600	273.00	163,800	
山一電機	1,200	875.00	1,050,000	
図研	800	1,043.00	834,400	
日本電子	5,000	443.00	2,215,000	
カシオ計算機	10,600	1,323.00	14,023,800	
ファナック	12,800	18,840.00	241,152,000	
日本シイエムケイ	2,700	559.00	1,509,300	
エンプラス	600	3,275.00	1,965,000	
大真空	500	1,090.00	545,000	
ローム	6,100	5,910.00	36,051,000	
浜松ホトニクス	9,800	3,065.00	30,037,000	
三井ハイテック	1,700	677.00	1,150,900	
新光電気工業	4,800	658.00	3,158,400	
京セラ	20,700	5,125.00	106,087,500	
太陽誘電	6,100	1,065.00	6,496,500	
村田製作所	13,200	13,465.00	177,738,000	
ユーシン	1,700	744.00	1,264,800	
双葉電子工業	2,100	1,746.00	3,666,600	
北陸電気工業	5,000	126.00	630,000	
ニチコン	3,900	926.00	3,611,400	
日本ケミコン	11,000	175.00	1,925,000	
K O A	1,700	938.00	1,594,600	
市光工業	3,000	303.00	909,000	

小糸製作所	7,600	5,420.00	41,192,000	
ミツバ	2,300	1,532.00	3,523,600	
S C R E E Nホールディングス	2,600	7,070.00	18,382,000	
キャノン電子	1,100	1,610.00	1,771,000	
キャノン	68,000	2,951.50	200,702,000	代用有価証券 10,000株
リコー	38,000	851.00	32,338,000	
M U T O Hホールディングス	2,000	237.00	474,000	
東京エレクトロン	8,400	9,590.00	80,556,000	
トヨタ紡織	4,400	2,724.00	11,985,600	
芦森工業	3,000	160.00	480,000	
ユニプレス	2,400	1,912.00	4,588,800	
豊田自動織機	11,500	4,670.00	53,705,000	
モリタホールディングス	2,200	1,547.00	3,403,400	
三櫻工業	1,600	718.00	1,148,800	
デンソー	31,100	4,512.00	140,323,200	
東海理化電機製作所	3,300	1,967.00	6,491,100	
三井造船	46,000	144.00	6,624,000	
川崎重工業	98,000	293.00	28,714,000	
名村造船所	3,800	609.00	2,314,200	
サノヤスホールディングス	1,600	266.00	425,600	
日本車輛製造	5,000	263.00	1,315,000	
ニチユ三菱フォークリフト	1,500	695.00	1,042,500	
近畿車輛	200	2,393.00	478,600	
日産自動車	151,100	1,029.00	155,481,900	
いすゞ自動車	36,600	1,256.50	45,987,900	
トヨタ自動車	157,000	5,810.00	912,170,000	代用有価証券 35,000株
日野自動車	18,000	1,140.00	20,520,000	
三菱自動車工業	46,300	544.00	25,187,200	
エフテック	700	1,350.00	945,000	
レシップホールディングス	400	860.00	344,000	
G M B	200	1,040.00	208,000	
ファルテック	200	1,265.00	253,000	
武蔵精密工業	1,500	2,481.00	3,721,500	
日産車体	5,500	1,052.00	5,786,000	
新明和工業	5,000	874.00	4,370,000	

極東開発工業	2,500	1,273.00	3,182,500
日信工業	2,800	1,549.00	4,337,200
トビー工業	1,000	2,508.00	2,508,000
ティラド	5,000	239.00	1,195,000
曙ブレーキ工業	6,000	263.00	1,578,000
タチエス	2,200	1,718.00	3,779,600
N O K	6,100	2,326.00	14,188,600
フタバ産業	3,800	661.00	2,511,800
K Y B	14,000	464.00	6,496,000
大同メタル工業	1,600	1,118.00	1,788,800
プレス工業	6,700	495.00	3,316,500
ミクニ	1,600	350.00	560,000
カルソニックカンセイ	8,000	1,330.00	10,640,000
太平洋工業	2,600	1,275.00	3,315,000
ケーヒン	2,900	1,677.00	4,863,300
河西工業	1,700	1,178.00	2,002,600
アイシン精機	11,500	4,565.00	52,497,500
富士機工	1,300	381.00	495,300
マツダ	40,000	1,616.50	64,660,000
今仙電機製作所	1,200	877.00	1,052,400
本田技研工業	113,600	2,941.00	334,097,600
スズキ	25,000	3,831.00	95,775,000
富士重工業	39,200	3,933.00	154,173,600
安永	500	520.00	260,000
ヤマハ発動機	17,800	2,393.00	42,595,400
ショーワ	3,300	617.00	2,036,100
T B K	1,600	429.00	686,400
エクセディ	1,700	2,943.00	5,003,100
豊田合成	4,100	2,341.00	9,598,100
愛三工業	2,200	850.00	1,870,000
盟和産業	200	1,087.00	217,400
ヨロズ	1,200	1,662.00	1,994,400
エフ・シー・シー	2,100	1,929.00	4,050,900
シマノ	5,100	17,880.00	91,188,000
タカタ	2,300	356.00	818,800
テイ・エス テック	2,900	2,735.00	7,931,500

ジャムコ	700	1,937.00	1,355,900
テルモ	19,300	4,065.00	78,454,500
クリエートメディック	500	926.00	463,000
日機装	4,400	892.00	3,924,800
島津製作所	16,000	1,488.00	23,808,000
JMS	2,000	271.00	542,000
長野計器	1,000	634.00	634,000
ブイ・テクノロジー	300	12,320.00	3,696,000
東京計器	5,000	176.00	880,000
愛知時計電機	200	3,375.00	675,000
オーバル	1,300	255.00	331,500
東京精密	2,400	2,833.00	6,799,200
マニー	1,700	2,359.00	4,010,300
ニコン	22,000	1,626.00	35,772,000
トプコン	6,400	1,718.00	10,995,200
オリンパス	20,200	3,525.00	71,205,000
理研計器	1,100	1,273.00	1,400,300
タムロン	1,100	1,671.00	1,838,100
H O Y A	26,500	4,312.00	114,268,000
ノーリツ鋼機	1,300	776.00	1,008,800
エー・アンド・デイ	1,200	426.00	511,200
シチズン時計	14,300	580.00	8,294,000
リズム時計工業	5,000	182.00	910,000
大研医器	1,200	792.00	950,400
メニコン	900	2,943.00	2,648,700
松風	700	1,257.00	879,900
セイコーホールディングス	9,000	336.00	3,024,000
ニプロ	8,700	1,262.00	10,979,400
スノーピーク	200	3,450.00	690,000
パラマウントベッドホールディングス	1,200	4,100.00	4,920,000
トランザクション	300	1,800.00	540,000
S H O - B I	500	418.00	209,000
ニホンフラッシュ	600	1,137.00	682,200
前田工織	1,300	1,087.00	1,413,100
永大産業	2,000	463.00	926,000
アートネイチャー	1,400	606.00	848,400

ダンロップスポーツ	800	1,007.00	805,600
バンダイナムコホールディングス	13,900	3,055.00	42,464,500
アイフィスジャパン	300	418.00	125,400
共立印刷	2,200	304.00	668,800
S H O E I	600	1,896.00	1,137,600
フランスベッドホールディングス	1,600	888.00	1,420,800
パイロットコーポレーション	2,200	4,530.00	9,966,000
萩原工業	400	2,422.00	968,800
トッパン・フォームズ	2,200	1,036.00	2,279,200
フジシールインターナショナル	1,400	4,185.00	5,859,000
タカラトミー	4,900	1,098.00	5,380,200
廣濟堂	1,300	306.00	397,800
A s - m e エステール	400	646.00	258,400
アーク	5,800	78.00	452,400
タカノ	600	746.00	447,600
プロネクサス	1,200	1,000.00	1,200,000
ホクシン	1,000	207.00	207,000
ウッドワン	2,000	260.00	520,000
大建工業	900	2,003.00	1,802,700
凸版印刷	35,000	968.00	33,880,000
大日本印刷	36,000	1,041.00	37,476,000
図書印刷	2,000	456.00	912,000
共同印刷	4,000	350.00	1,400,000
日本写真印刷	2,100	2,483.00	5,214,300
光村印刷	1,000	217.00	217,000
宝印刷	600	1,440.00	864,000
アシックス	12,600	2,318.00	29,206,800
ツツミ	400	1,658.00	663,200
小松ウオール工業	500	1,705.00	852,500
ヤマハ	8,500	3,735.00	31,747,500
河合楽器製作所	500	2,038.00	1,019,000
クリナップ	1,500	876.00	1,314,000
ピジョン	7,600	2,846.00	21,629,600
兼松サステック	1,000	159.00	159,000
キングジム	1,000	833.00	833,000
リンテック	3,000	2,294.00	6,882,000

T A S A K I	300	1,452.00	435,600	
イトーキ	2,700	637.00	1,719,900	
任天堂	7,800	24,535.00	191,373,000	
三菱鉛筆	1,000	5,330.00	5,330,000	
タカスタンダード	2,600	1,798.00	4,674,800	
コクヨ	6,500	1,338.00	8,697,000	
ナカバヤシ	2,000	237.00	474,000	
岡村製作所	4,400	980.00	4,312,000	
美津濃	7,000	572.00	4,004,000	
アデランス	2,300	618.00	1,421,400	
東京電力ホールディングス	107,200	410.00	43,952,000	
中部電力	41,600	1,534.50	63,835,200	
関西電力	51,500	1,027.50	52,916,250	
中国電力	17,500	1,192.00	20,860,000	
北陸電力	12,400	1,166.00	14,458,400	
東北電力	31,500	1,249.00	39,343,500	
四国電力	11,400	1,003.00	11,434,200	
九州電力	27,900	1,062.00	29,629,800	
北海道電力	11,800	797.00	9,404,600	
沖縄電力	1,900	2,410.00	4,579,000	
電源開発	10,100	2,259.00	22,815,900	
エフオン	600	715.00	429,000	
イーレックス	500	3,120.00	1,560,000	
東京瓦斯	135,000	479.70	64,759,500	
大阪瓦斯	122,000	434.10	52,960,200	
東邦瓦斯	32,000	928.00	29,696,000	
北海道瓦斯	3,000	268.00	804,000	
広島ガス	2,600	362.00	941,200	
西部瓦斯	14,000	244.00	3,416,000	
静岡ガス	3,900	822.00	3,205,800	
メタウォーター	700	2,780.00	1,946,000	
S B S ホールディングス	1,300	932.00	1,211,600	
東武鉄道	67,000	522.00	34,974,000	
相鉄ホールディングス	20,000	488.00	9,760,000	
東京急行電鉄	69,000	783.00	54,027,000	
京浜急行電鉄	34,000	1,050.00	35,700,000	

小田急電鉄	20,200	2,095.00	42,319,000	
京王電鉄	35,000	867.00	30,345,000	
京成電鉄	9,500	2,508.00	23,826,000	
富士急行	4,000	1,034.00	4,136,000	
東日本旅客鉄道	24,400	9,088.00	221,747,200	
西日本旅客鉄道	12,100	6,367.00	77,040,700	
東海旅客鉄道	10,500	17,510.00	183,855,000	
西武ホールディングス	17,500	1,776.00	31,080,000	
鴻池運輸	1,800	1,404.00	2,527,200	
西日本鉄道	15,000	483.00	7,245,000	
ハマキョウレックス	800	1,907.00	1,525,600	
サカイ引越センター	400	2,314.00	925,600	
近鉄グループホールディングス	127,000	416.00	52,832,000	
阪急阪神ホールディングス	16,000	3,450.00	55,200,000	
南海電気鉄道	26,000	491.00	12,766,000	
京阪ホールディングス	28,000	681.00	19,068,000	
神戸電鉄	3,000	366.00	1,098,000	
名古屋鉄道	46,000	552.00	25,392,000	
山陽電気鉄道	5,000	510.00	2,550,000	
日本通運	49,000	539.00	26,411,000	
ヤマトホールディングス	22,600	2,234.50	50,499,700	
山九	16,000	619.00	9,904,000	
丸運	600	240.00	144,000	
丸全昭和運輸	4,000	430.00	1,720,000	
センコー	5,700	750.00	4,275,000	
トナミホールディングス	3,000	282.00	846,000	
ニッコンホールディングス	4,300	2,179.00	9,369,700	
日本石油輸送	100	2,267.00	226,700	
福山通運	8,000	583.00	4,664,000	
セイノーホールディングス	9,000	1,174.00	10,566,000	
神奈川中央交通	2,000	743.00	1,486,000	
日立物流	2,600	2,143.00	5,571,800	
丸和運輸機関	300	2,993.00	897,900	
C & F ロジホールディングス	1,300	1,031.00	1,340,300	
日本郵船	107,000	190.00	20,330,000	
商船三井	66,000	247.00	16,302,000	

川崎汽船	48,000	242.00	11,616,000	
N S ユナイテッド海運	6,000	142.00	852,000	
明治海運	1,100	360.00	396,000	
飯野海運	6,600	374.00	2,468,400	
共栄タンカー	1,000	192.00	192,000	
乾汽船	900	991.00	891,900	
日本航空	22,800	3,146.00	71,728,800	
A N A ホールディングス	234,000	293.30	68,632,200	
パスコ	1,000	368.00	368,000	
トランコム	400	5,560.00	2,224,000	
日新	5,000	353.00	1,765,000	
三菱倉庫	8,000	1,410.00	11,280,000	
三井倉庫ホールディングス	7,000	301.00	2,107,000	
住友倉庫	9,000	565.00	5,085,000	
澁澤倉庫	3,000	301.00	903,000	
東陽倉庫	2,200	268.00	589,600	
日本トランスシティ	3,000	387.00	1,161,000	
ケイヒン	2,000	142.00	284,000	
中央倉庫	700	1,000.00	700,000	
安田倉庫	1,000	680.00	680,000	
東洋埠頭	4,000	171.00	684,000	
宇徳	1,000	373.00	373,000	
上組	15,000	906.00	13,590,000	
サンリツ	300	486.00	145,800	
キムラユニティー	300	1,085.00	325,500	
キューソー流通システム	400	2,281.00	912,400	
郵船ロジスティクス	1,200	1,022.00	1,226,400	
近鉄エクスプレス	2,200	1,381.00	3,038,200	
東海運	700	380.00	266,000	
エーアイティー	800	917.00	733,600	
内外トランスライン	400	992.00	396,800	
N E C ネットズエスアイ	1,400	1,963.00	2,748,200	
システナ	1,000	1,769.00	1,769,000	
デジタルアーツ	600	2,651.00	1,590,600	
新日鉄住金ソリューションズ	2,100	1,959.00	4,113,900	
キューブシステム	500	657.00	328,500	

コア	500	1,184.00	592,000
ソフトクリエイトホールディングス	600	1,178.00	706,800
T I S	4,100	2,307.00	9,458,700
ネオス	400	466.00	186,400
電算システム	500	1,700.00	850,000
グリー	7,600	608.00	4,620,800
コーエーテクモホールディングス	3,000	1,928.00	5,784,000
三菱総合研究所	500	3,125.00	1,562,500
ボルテージ	200	1,000.00	200,000
電算	100	2,023.00	202,300
A G S	300	1,130.00	339,000
ファインデックス	900	890.00	801,000
ヒト・コミュニケーションズ	300	1,473.00	441,900
ブレインパッド	200	940.00	188,000
K L a b	2,400	621.00	1,490,400
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	900	855.00	769,500
イーブックイニシアティブジャパン	200	852.00	170,400
ネクソン	13,700	1,670.00	22,879,000
アイスタイル	1,900	653.00	1,240,700
エムアップ	400	586.00	234,400
エイチーム	700	2,241.00	1,568,700
テクノスジャパン	500	2,488.00	1,244,000
e n i s h	400	454.00	181,600
コロブラ	3,500	1,417.00	4,959,500
モバイルクリエイト	800	356.00	284,800
ブロードリーフ	1,500	1,019.00	1,528,500
ハーツユナイテッドグループ	700	1,843.00	1,290,100
メディアドゥ	300	1,400.00	420,000
ブイキューブ	700	779.00	545,300
サイバーリンクス	200	903.00	180,600
ディー・エル・イー	400	717.00	286,800
VOYAGE GROUP	400	908.00	363,200
オブティム	100	5,890.00	589,000
ベリサーブ	100	2,973.00	297,300
ティーガイア	1,100	1,602.00	1,762,200

日本アジアグループ	1,500	357.00	535,500
豆蔵ホールディングス	900	1,023.00	920,700
テクマトリックス	400	1,883.00	753,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	26,200	253.00	6,628,600
GMOペイメントゲートウェイ	1,000	5,010.00	5,010,000
ザッパラス	800	390.00	312,000
インターネットイニシアティブ	1,800	1,628.00	2,930,400
さくらインターネット	1,000	951.00	951,000
GMOクラウド	300	1,045.00	313,500
SRAホールディングス	700	2,357.00	1,649,900
Minorityソリューションズ	300	997.00	299,100
システムインテグレータ	200	586.00	117,200
朝日ネット	1,200	424.00	508,800
アドソル日進	300	1,340.00	402,000
フリービット	700	835.00	584,500
コムチュア	200	3,205.00	641,000
サイバーコム	200	827.00	165,400
gumi	1,300	692.00	899,600
PCIホールディングス	200	2,329.00	465,800
パイブドHD	200	1,111.00	222,200
LINE	2,100	4,015.00	8,431,500
ソルクシーズ	400	544.00	217,600
フェイス	400	1,150.00	460,000
ハイマックス	200	1,256.00	251,200
野村総合研究所	8,500	3,565.00	30,302,500
サイバネットシステム	1,000	661.00	661,000
CEホールディングス	200	1,060.00	212,000
インテージホールディングス	700	1,795.00	1,256,500
東邦システムサイエンス	400	595.00	238,000
ソースネクスト	800	510.00	408,000
ティー・ワイ・オー	2,700	150.00	405,000
フォーカスシステムズ	500	495.00	247,500
クレスコ	300	2,184.00	655,200
フジ・メディア・ホールディングス	13,000	1,502.00	19,526,000
オービック	4,300	5,180.00	22,274,000
ジャストシステム	2,000	1,033.00	2,066,000

TDCソフトウェアエンジニアリング	600	1,280.00	768,000	
ヤフー	89,300	418.00	37,327,400	
トレンドマイクロ	6,600	3,585.00	23,661,000	
インフォメーション・ディベロプメント	200	1,391.00	278,200	
日本オラクル	2,000	5,570.00	11,140,000	
アルファシステムズ	400	1,739.00	695,600	
フューチャー	1,700	711.00	1,208,700	
CAC Holdings	900	863.00	776,700	
ソフトバンク・テクノロジー	300	3,110.00	933,000	
トーセ	400	759.00	303,600	
オービックビジネスコンサルタント	600	4,965.00	2,979,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	2,800	2,924.00	8,187,200	
アイティフォー	1,600	619.00	990,400	
東計電算	200	2,016.00	403,200	
エクスネット	100	1,553.00	155,300	
大塚商会	3,400	5,300.00	18,020,000	
サイボウズ	1,700	424.00	720,800	
ソフトブレーン	1,700	356.00	605,200	
電通国際情報サービス	800	1,767.00	1,413,600	
デジタルガレージ	2,000	1,870.00	3,740,000	
EMシステムズ	400	1,548.00	619,200	
ウェザーニューズ	400	3,300.00	1,320,000	
C I J	1,100	497.00	546,700	
東洋ビジネスエンジニアリング	200	1,441.00	288,200	
日本エンタープライズ	1,300	262.00	340,600	
WOWOW	600	2,931.00	1,758,600	
フュージョンパートナー	800	902.00	721,600	
日本コロムビア	400	582.00	232,800	
イマジカ・ロボットホールディングス	1,100	586.00	644,600	
ネットワンシステムズ	5,400	742.00	4,006,800	
システムソフト	2,300	153.00	351,900	
アルゴグラフィックス	600	1,969.00	1,181,400	
マーベラス	2,100	759.00	1,593,900	
エイベックス・グループ・ホールディングス	2,300	1,386.00	3,187,800	
日本ユニシス	3,400	1,229.00	4,178,600	
兼松エレクトロニクス	800	2,205.00	1,764,000	

東京放送ホールディングス	8,200	1,637.00	13,423,400
日本テレビホールディングス	11,400	1,867.00	21,283,800
朝日放送	1,200	659.00	790,800
テレビ朝日ホールディングス	3,400	2,037.00	6,925,800
スカパーJ S A Tホールディングス	8,100	496.00	4,017,600
テレビ東京ホールディングス	1,000	2,283.00	2,283,000
日本BS放送	300	1,000.00	300,000
U-NEXT	400	610.00	244,000
ワイヤレスゲート	500	1,717.00	858,500
コネクシオ	1,100	1,398.00	1,537,800
日本通信	10,500	165.00	1,732,500
クロップス	300	535.00	160,500
日本電信電話	100,000	4,558.00	455,800,000
KDDI	123,300	3,009.00	371,009,700
光通信	1,500	9,520.00	14,280,000
NTTドコモ	93,100	2,555.50	237,917,050
エムティーアイ	1,900	707.00	1,343,300
GMOインターネット	4,500	1,344.00	6,048,000
カドカワ	3,600	1,563.00	5,626,800
学研ホールディングス	4,000	339.00	1,356,000
ゼンリン	1,600	1,797.00	2,875,200
昭文社	700	601.00	420,700
インプレスホールディングス	1,100	136.00	149,600
アイネット	700	1,045.00	731,500
松竹	8,000	1,163.00	9,304,000
東宝	8,200	3,075.00	25,215,000
東映	5,000	817.00	4,085,000
AOI Pro.	600	819.00	491,400
エヌ・ティ・ティ・データ	7,700	5,610.00	43,197,000
ピー・シー・エー	200	1,232.00	246,400
ビジネスブレイン太田昭和	200	967.00	193,400
DTS	1,300	2,391.00	3,108,300
スクウェア・エニックス・ホールディングス	4,800	3,450.00	16,560,000
シーイーシー	700	1,960.00	1,372,000
カプコン	2,900	2,649.00	7,682,100
アイ・エス・ピー	300	879.00	263,700

ジャステック	800	1,092.00	873,600
S C S K	3,300	3,800.00	12,540,000
日本システムウエア	400	1,542.00	616,800
アイネス	1,600	1,169.00	1,870,400
T K C	1,200	2,926.00	3,511,200
富士ソフト	1,800	2,784.00	5,011,200
N S D	2,600	1,697.00	4,412,200
コナミホールディングス	5,600	4,385.00	24,556,000
福井コンピュータホールディングス	400	2,584.00	1,033,600
J B C Cホールディングス	1,100	669.00	735,900
ミロク情報サービス	900	2,139.00	1,925,100
ソフトバンクグループ	61,200	6,364.00	389,476,800
ハウスイ	1,000	115.00	115,000
高千穂交易	500	939.00	469,500
伊藤忠食品	300	4,025.00	1,207,500
エレマテック	500	1,738.00	869,000
J A L U X	400	1,770.00	708,000
あらた	600	2,457.00	1,474,200
トーメンデバイス	200	1,991.00	398,200
東京エレクトロン デバイス	500	1,500.00	750,000
フィールズ	1,000	1,222.00	1,222,000
双日	73,600	268.00	19,724,800
アルフレッサ ホールディングス	14,700	1,781.00	26,180,700
横浜冷凍	3,100	1,060.00	3,286,000
神栄	2,000	140.00	280,000
山下医科器械	100	1,712.00	171,200
ラサ商事	600	609.00	365,400
ラクーン	500	499.00	249,500
アルコニックス	700	1,374.00	961,800
神戸物産	700	3,275.00	2,292,500
あい ホールディングス	2,200	2,583.00	5,682,600
ディーブイエックス	500	1,399.00	699,500
ダイワボウホールディングス	11,000	252.00	2,772,000
マクニカ・富士エレホールディングス	2,300	1,366.00	3,141,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,300	1,065.00	2,449,500
八洲電機	1,000	568.00	568,000

U K Cホールディングス	800	1,826.00	1,460,800
O C H Iホールディングス	400	1,069.00	427,600
T O K A Iホールディングス	5,500	712.00	3,916,000
大阪工機	100	693.00	69,300
三洋貿易	700	1,298.00	908,600
ビューティガレージ	100	1,145.00	114,500
ウイン・パートナーズ	500	1,723.00	861,500
ミタチ産業	300	617.00	185,100
シップヘルスケアホールディングス	2,400	2,930.00	7,032,000
明治電機工業	400	1,072.00	428,800
デリカフーズ	300	970.00	291,000
スターティア	300	504.00	151,200
コメダホールディングス	1,700	1,691.00	2,874,700
富士興産	500	420.00	210,000
協栄産業	2,000	136.00	272,000
小野建	1,100	1,173.00	1,290,300
佐島電機	1,000	735.00	735,000
エコートレーディング	300	644.00	193,200
伯東	800	947.00	757,600
コンドーテック	1,000	786.00	786,000
中山福	800	759.00	607,200
ナガイレーベン	1,800	2,186.00	3,934,800
三菱食品	1,400	3,400.00	4,760,000
松田産業	900	1,444.00	1,299,600
第一興商	2,000	4,450.00	8,900,000
メディバルホールディングス	12,500	1,510.00	18,875,000
S P K	300	2,142.00	642,600
萩原電気	400	1,951.00	780,400
アズワン	1,000	4,555.00	4,555,000
スズデン	400	973.00	389,200
シモジマ	800	1,046.00	836,800
ドウシシャ	1,500	1,974.00	2,961,000
小津産業	300	2,064.00	619,200
高速	700	1,030.00	721,000
たけびし	400	1,079.00	431,600
黒田電気	1,700	2,088.00	3,549,600

リックス	300	1,369.00	410,700
丸文	1,100	618.00	679,800
ハビネット	1,000	1,110.00	1,110,000
橋本総業ホールディングス	300	1,583.00	474,900
日本ライフライン	500	5,360.00	2,680,000
エクセル	600	1,414.00	848,400
マルカキカイ	400	1,341.00	536,400
I D O M	3,400	538.00	1,829,200
日本エム・ディ・エム	1,000	813.00	813,000
進和	700	1,556.00	1,089,200
エスケイジャパン	300	285.00	85,500
ダイトエレクトロン	600	857.00	514,200
シークス	900	4,110.00	3,699,000
田中商事	400	677.00	270,800
オーハシテクニカ	700	1,357.00	949,900
白銅	400	1,205.00	482,000
伊藤忠商事	91,300	1,365.50	124,670,150
丸紅	122,600	533.20	65,370,320
高島	3,000	169.00	507,000
長瀬産業	7,500	1,309.00	9,817,500
蝶理	800	1,606.00	1,284,800
豊田通商	13,900	2,477.00	34,430,300
三共生興	1,900	359.00	682,100
兼松	27,000	172.00	4,644,000
ツカモトコーポレーション	2,000	112.00	224,000
三井物産	112,700	1,400.00	157,780,000
日本紙パルプ商事	5,000	351.00	1,755,000
日立ハイテクノロジーズ	4,300	4,360.00	18,748,000
カメイ	1,600	988.00	1,580,800
東都水産	200	1,672.00	334,400
O U G ホールディングス	2,000	264.00	528,000
スターゼン	500	5,140.00	2,570,000
山善	4,800	824.00	3,955,200
椿本興業	2,000	309.00	618,000
住友商事	78,400	1,223.50	95,922,400
内田洋行	3,000	427.00	1,281,000

三菱商事	93,500	2,280.50	213,226,750	
第一実業	3,000	610.00	1,830,000	
キヤノンマーケティングジャパン	3,500	1,808.00	6,328,000	
西華産業	4,000	305.00	1,220,000	
佐藤商事	1,100	798.00	877,800	
菱洋エレクトロ	1,200	1,274.00	1,528,800	
東京産業	1,300	396.00	514,800	
ユアサ商事	1,200	2,549.00	3,058,800	
神鋼商事	300	1,945.00	583,500	
小林産業	1,000	254.00	254,000	
阪和興業	13,000	640.00	8,320,000	
カナデン	1,200	1,003.00	1,203,600	
菱電商事	2,000	676.00	1,352,000	
フルサト工業	700	1,493.00	1,045,100	
岩谷産業	14,000	609.00	8,526,000	
すてきナイスグループ	6,000	140.00	840,000	
昭光通商	5,000	87.00	435,000	
ニチモウ	2,000	165.00	330,000	
極東貿易	2,000	208.00	416,000	
イワキ	2,000	203.00	406,000	
三愛石油	3,300	693.00	2,286,900	
稲畑産業	3,000	1,113.00	3,339,000	
G S I クレオス	3,000	114.00	342,000	
明和産業	1,200	329.00	394,800	
ワキタ	2,700	880.00	2,376,000	
東邦ホールディングス	4,000	2,030.00	8,120,000	
サンゲツ	4,300	1,887.00	8,114,100	
ミツウロコグループホールディングス	2,000	691.00	1,382,000	
シナネンホールディングス	500	2,019.00	1,009,500	
伊藤忠エネクス	2,800	836.00	2,340,800	
サンリオ	3,800	1,823.00	6,927,400	
サンワテクノス	700	866.00	606,200	
リョーサン	1,900	3,200.00	6,080,000	
新光商事	1,300	1,149.00	1,493,700	
トーホー	600	2,399.00	1,439,400	
三信電気	1,400	915.00	1,281,000	

東陽テクニカ	1,600	941.00	1,505,600
モスフードサービス	1,600	3,470.00	5,552,000
加賀電子	1,100	1,610.00	1,771,000
ソーダニッカ	1,300	483.00	627,900
立花エレテック	800	1,160.00	928,000
フォーバル	600	742.00	445,200
PALTAC	2,000	2,576.00	5,152,000
三谷産業	1,300	328.00	426,400
太平洋興発	5,000	89.00	445,000
ヤマタネ	700	1,364.00	954,800
丸紅建材リース	1,000	189.00	189,000
日鉄住金物産	1,100	3,795.00	4,174,500
トラスコ中山	1,400	5,140.00	7,196,000
オートバックスセブン	4,600	1,458.00	6,706,800
加藤産業	1,900	2,448.00	4,651,200
イノテック	1,100	488.00	536,800
イエローハット	1,200	2,265.00	2,718,000
J Kホールディングス	1,300	542.00	704,600
日伝	500	2,978.00	1,489,000
北沢産業	1,100	168.00	184,800
杉本商事	700	1,357.00	949,900
因幡電機産業	1,800	3,720.00	6,696,000
バイテックホールディングス	500	1,080.00	540,000
ミスミグループ本社	14,000	1,970.00	27,580,000
アルテック	1,200	246.00	295,200
タキヒヨー	2,000	439.00	878,000
蔵王産業	200	1,330.00	266,000
スズケン	5,600	3,200.00	17,920,000
ジェコス	900	951.00	855,900
ルネサスイーストン	1,000	462.00	462,000
ローソン	4,300	7,730.00	33,239,000
サンエー	900	5,560.00	5,004,000
カワチ薬品	1,000	2,691.00	2,691,000
エービーシー・マート	2,300	6,450.00	14,835,000
ハードオフコーポレーション	600	1,051.00	630,600
アスクル	1,500	4,345.00	6,517,500

ゲオホールディングス	2,100	1,292.00	2,713,200	
アダストリア	1,900	2,895.00	5,500,500	
ジーフット	800	778.00	622,400	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	200	768.00	153,600	
くらコーポレーション	800	5,050.00	4,040,000	
キャンドウ	700	1,831.00	1,281,700	
パルグループホールディングス	600	2,719.00	1,631,400	
エディオン	4,800	963.00	4,622,400	
サーラコーポレーション	1,600	621.00	993,600	
ワッツ	500	1,096.00	548,000	
ハローズ	400	2,305.00	922,000	
あみやき亭	300	3,800.00	1,140,000	
ひらまつ	1,700	599.00	1,018,300	
ゲンキー	300	6,780.00	2,034,000	
大黒天物産	300	4,960.00	1,488,000	
ハニーズ	1,100	1,189.00	1,307,900	
ファーマライズホールディングス	300	543.00	162,900	
アルペン	1,100	2,115.00	2,326,500	
クオール	1,400	1,462.00	2,046,800	
ジェイアイエヌ	800	5,450.00	4,360,000	
ビックカメラ	7,200	909.00	6,544,800	
D C Mホールディングス	7,200	916.00	6,595,200	
MonotaRO	4,400	2,408.00	10,595,200	
東京一番フーズ	300	537.00	161,100	
ダイヤモンドダイニング	300	1,099.00	329,700	
きちり	400	683.00	273,200	
アーランドサービスホールディングス	400	3,005.00	1,202,000	
J.フロント リテイリング	15,800	1,433.00	22,641,400	
ドトール・日レスホールディングス	2,200	2,099.00	4,617,800	
マツモトキヨシホールディングス	2,400	5,240.00	12,576,000	
ブロンコビリー	700	2,981.00	2,086,700	
スタートトゥデイ	11,400	1,808.00	20,611,200	
トレジャー・ファクトリー	300	803.00	240,900	
物語コーポレーション	300	4,780.00	1,434,000	
ココカラファイン	1,300	3,905.00	5,076,500	
三越伊勢丹ホールディングス	24,800	1,075.00	26,660,000	

H a m e e	200	839.00	167,800
ウエルシアホールディングス	1,200	7,210.00	8,652,000
クリエイトSDホールディングス	1,800	2,191.00	3,943,800
丸善CHIホールディングス	1,500	366.00	549,000
ミサワ	300	474.00	142,200
エー・ピーカンパニー	200	696.00	139,200
チムニー	400	2,927.00	1,170,800
シュッピン	500	1,190.00	595,000
ネクステージ	300	1,490.00	447,000
ジョイフル本田	2,000	2,620.00	5,240,000
鳥貴族	300	2,612.00	783,600
麒麟堂ホールディングス	400	788.00	315,200
ホットランド	600	1,012.00	607,200
すかいらーく	5,300	1,470.00	7,791,000
綿半ホールディングス	500	1,547.00	773,500
ヨシックス	100	1,456.00	145,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,100	944.00	3,870,400
ブックオフコーポレーション	700	766.00	536,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	500	784.00	392,000
あさひ	900	1,251.00	1,125,900
日本調剤	400	4,280.00	1,712,000
コスモス薬品	600	22,560.00	13,536,000
トーエル	600	919.00	551,400
一六堂	400	368.00	147,200
オンリー	100	770.00	77,000
セブン&アイ・ホールディングス	52,200	4,362.00	227,696,400
薬王堂	200	6,980.00	1,396,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	3,300	992.00	3,273,600
ツルハホールディングス	2,800	11,610.00	32,508,000
サンマルクホールディングス	800	2,961.00	2,368,800
フェリシモ	400	1,014.00	405,600
トリドールホールディングス	1,500	2,479.00	3,718,500
クスリのアオキ	1,100	5,350.00	5,885,000
サツドラホールディングス	200	1,970.00	394,000
ダイユー・リックホールディングス	400	655.00	262,000

メディカルシステムネットワーク	1,400	434.00	607,600	
総合メディカル	600	3,325.00	1,995,000	
はるやま商事	500	797.00	398,500	
ノジマ	1,400	1,345.00	1,883,000	
カッパ・クリエイト	1,800	1,226.00	2,206,800	
ライトオン	1,000	1,005.00	1,005,000	
ジーンズメイト	500	176.00	88,000	
良品計画	1,600	22,550.00	36,080,000	
三城ホールディングス	1,500	445.00	667,500	
アドヴァン	1,300	959.00	1,246,700	
アルビス	300	2,217.00	665,100	
コナカ	1,500	502.00	753,000	
ハウス オブ ローゼ	200	1,465.00	293,000	
G - 7ホールディングス	400	1,310.00	524,000	
イオン北海道	1,300	542.00	704,600	
コジマ	1,900	234.00	444,600	
ヒマラヤ	400	803.00	321,200	
コーナン商事	1,800	2,118.00	3,812,400	
エコス	500	1,192.00	596,000	
ワタミ	1,500	1,091.00	1,636,500	
マルシェ	300	816.00	244,800	
ドンキホーテホールディングス	8,100	4,080.00	33,048,000	
西松屋チェーン	2,200	1,443.00	3,174,600	
ゼンショーホールディングス	6,500	1,942.00	12,623,000	
幸楽苑ホールディングス	800	1,572.00	1,257,600	
ハークスレイ	300	950.00	285,000	
サイゼリヤ	2,100	2,752.00	5,779,200	
V Tホールディングス	4,200	560.00	2,352,000	
魚力	400	1,269.00	507,600	
ポブラ	400	487.00	194,800	
ユナイテッドアローズ	1,700	2,869.00	4,877,300	
ハイデイ日高	1,100	2,522.00	2,774,200	
京都きもの友禅	800	928.00	742,400	
コロワイド	4,100	1,923.00	7,884,300	
ピーシーデポコーポレーション	1,700	520.00	884,000	
壱番屋	1,100	3,870.00	4,257,000	

トップカルチャー	500	475.00	237,500	
P L A N T	300	1,074.00	322,200	
スギホールディングス	2,700	5,460.00	14,742,000	
スクロール	1,900	350.00	665,000	
ヨンドシーホールディングス	900	2,649.00	2,384,100	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	5,500	6,700.00	36,850,000	
木曽路	1,500	2,232.00	3,348,000	
サトレストランシステムズ	1,500	802.00	1,203,000	
千趣会	2,300	716.00	1,646,800	
タカキュー	1,200	185.00	222,000	
ケーヨー	2,100	530.00	1,113,000	
上新電機	3,000	894.00	2,682,000	
日本瓦斯	2,300	3,080.00	7,084,000	
ベスト電器	4,100	141.00	578,100	
ロイヤルホールディングス	2,100	1,840.00	3,864,000	
東天紅	1,000	142.00	142,000	
いなげや	1,400	1,383.00	1,936,200	
島忠	3,200	2,814.00	9,004,800	
チヨダ	1,500	2,520.00	3,780,000	
ライフコーポレーション	900	3,330.00	2,997,000	
リンガーハット	1,200	2,320.00	2,784,000	
さが美	1,000	106.00	106,000	
MrMax	1,600	383.00	612,800	
テンアライド	1,300	368.00	478,400	
AOKIホールディングス	2,500	1,281.00	3,202,500	
オークワ	2,000	1,112.00	2,224,000	
コメリ	1,900	2,544.00	4,833,600	
青山商事	2,600	3,750.00	9,750,000	
しまむら	1,500	13,310.00	19,965,000	
はせがわ	800	444.00	355,200	
高島屋	21,000	869.00	18,249,000	
松屋	2,700	885.00	2,389,500	
エイチ・ツー・オー リテイリング	6,400	1,534.00	9,817,600	
近鉄百貨店	5,000	341.00	1,705,000	
丸栄	3,000	81.00	243,000	
パルコ	1,200	977.00	1,172,400	

丸井グループ	13,100	1,415.00	18,536,500
アクシアル リテイリング	1,000	3,715.00	3,715,000
イオン	51,300	1,462.50	75,026,250
イズミ	2,500	4,810.00	12,025,000
東武ストア	100	2,795.00	279,500
平和堂	2,500	2,164.00	5,410,000
フジ	1,400	2,183.00	3,056,200
ヤオコー	1,400	4,320.00	6,048,000
ゼビオホールディングス	1,700	1,608.00	2,733,600
ケーズホールディングス	5,700	1,955.00	11,143,500
O l y m p i cグループ	800	595.00	476,000
日産東京販売ホールディングス	1,900	251.00	476,900
アインホールディングス	1,500	7,070.00	10,605,000
元気寿司	300	2,042.00	612,600
ヤマダ電機	41,700	547.00	22,809,900
アークランドサカモト	2,100	1,226.00	2,574,600
ニトリホールディングス	5,400	12,140.00	65,556,000
愛眼	1,000	197.00	197,000
ケーユーホールディングス	600	782.00	469,200
吉野家ホールディングス	4,400	1,559.00	6,859,600
松屋フーズ	600	3,410.00	2,046,000
サガミチェーン	1,600	1,242.00	1,987,200
関西スーパーマーケット	1,000	1,335.00	1,335,000
王将フードサービス	900	4,060.00	3,654,000
プレナス	1,400	2,181.00	3,053,400
ミニストップ	900	1,820.00	1,638,000
アークス	2,300	2,652.00	6,099,600
パローホールディングス	2,700	2,746.00	7,414,200
藤久	100	1,700.00	170,000
ベルク	500	4,090.00	2,045,000
大庄	700	1,525.00	1,067,500
ファーストリテイリング	2,100	36,640.00	76,944,000
サンドラッグ	2,400	7,940.00	19,056,000
サックスパー ホールディングス	1,200	1,143.00	1,371,600
ヤマザワ	200	1,719.00	343,800
やまや	300	1,517.00	455,100

ペルーナ	3,100	651.00	2,018,100	
島根銀行	300	1,251.00	375,300	
じもとホールディングス	9,100	171.00	1,556,100	
めぶきフィナンシャルグループ	60,100	374.00	22,477,400	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	1,800	3,335.00	6,003,000	
九州フィナンシャルグループ	20,500	675.00	13,837,500	
ゆうちょ銀行	35,300	1,213.00	42,818,900	
富山第一銀行	3,100	511.00	1,584,100	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	81,600	477.00	38,923,200	
西日本フィナンシャルホールディングス	8,500	1,004.00	8,534,000	
新生銀行	119,000	168.00	19,992,000	
あおぞら銀行	79,000	345.00	27,255,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	944,400	529.40	499,965,360	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	145,800	455.30	66,382,740	
三井住友トラスト・ホールディングス	26,400	3,492.00	92,188,800	
三井住友フィナンシャルグループ	99,800	3,540.00	353,292,000	代用有価証券 10,000株
第四銀行	15,000	442.00	6,630,000	
北越銀行	1,400	2,454.00	3,435,600	
千葉銀行	48,000	640.00	30,720,000	
群馬銀行	27,700	493.00	13,656,100	
武蔵野銀行	2,000	2,878.00	5,756,000	
千葉興業銀行	3,500	454.00	1,589,000	
筑波銀行	5,200	302.00	1,570,400	
七十七銀行	20,000	465.00	9,300,000	
青森銀行	10,000	341.00	3,410,000	
秋田銀行	8,000	337.00	2,696,000	
山形銀行	7,000	444.00	3,108,000	
岩手銀行	800	4,360.00	3,488,000	
東邦銀行	11,000	397.00	4,367,000	
東北銀行	7,000	143.00	1,001,000	
みちのく銀行	6,000	206.00	1,236,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	51,000	445.00	22,695,000	
静岡銀行	33,000	856.00	28,248,000	
十六銀行	17,000	315.00	5,355,000	
スルガ銀行	12,800	2,503.00	32,038,400	

八十二銀行	24,000	565.00	13,560,000	
山梨中央銀行	8,000	494.00	3,952,000	
大垣共立銀行	17,000	370.00	6,290,000	
福井銀行	11,000	270.00	2,970,000	
北國銀行	13,000	357.00	4,641,000	
清水銀行	400	3,040.00	1,216,000	
富山銀行	300	3,990.00	1,197,000	
滋賀銀行	12,000	538.00	6,456,000	
南都銀行	1,200	3,835.00	4,602,000	
百五銀行	11,000	379.00	4,169,000	
京都銀行	22,000	746.00	16,412,000	
紀陽銀行	4,900	1,717.00	8,413,300	
三重銀行	600	2,038.00	1,222,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	8,300	1,524.00	12,649,200	
広島銀行	36,000	443.00	15,948,000	
山陰合同銀行	7,500	758.00	5,685,000	
中国銀行	8,800	1,397.00	12,293,600	
鳥取銀行	400	1,660.00	664,000	
伊予銀行	13,300	647.00	8,605,100	
百十四銀行	14,000	355.00	4,970,000	
四国銀行	9,000	246.00	2,214,000	
阿波銀行	11,000	677.00	7,447,000	
大分銀行	7,000	393.00	2,751,000	
宮崎銀行	8,000	295.00	2,360,000	
佐賀銀行	8,000	266.00	2,128,000	
十八銀行	8,000	325.00	2,600,000	
沖縄銀行	1,100	3,620.00	3,982,000	
琉球銀行	2,600	1,377.00	3,580,200	
セブン銀行	46,800	310.00	14,508,000	
みずほフィナンシャルグループ	1,692,000	175.00	296,100,000	
高知銀行	5,000	113.00	565,000	
山口フィナンシャルグループ	12,000	1,149.00	13,788,000	
長野銀行	400	1,976.00	790,400	
名古屋銀行	900	3,640.00	3,276,000	
北洋銀行	20,300	392.00	7,957,600	
愛知銀行	400	5,520.00	2,208,000	

第三銀行	700	1,716.00	1,201,200	
中京銀行	500	2,340.00	1,170,000	
大光銀行	5,000	261.00	1,305,000	
愛媛銀行	1,500	1,356.00	2,034,000	
トマト銀行	500	1,556.00	778,000	
みなと銀行	1,100	1,850.00	2,035,000	
京葉銀行	10,000	444.00	4,440,000	
関西アーバン銀行	1,700	1,143.00	1,943,100	
栃木銀行	6,900	485.00	3,346,500	
北日本銀行	400	3,010.00	1,204,000	
東和銀行	24,000	101.00	2,424,000	
福島銀行	14,000	94.00	1,316,000	
大東銀行	7,000	171.00	1,197,000	
トモニホールディングス	10,300	539.00	5,551,700	
フィデアホールディングス	12,100	188.00	2,274,800	
池田泉州ホールディングス	13,200	473.00	6,243,600	
F P G	4,400	852.00	3,748,800	
S B Iホールディングス	14,100	1,225.00	17,272,500	
ジャフコ	2,100	3,415.00	7,171,500	
大和証券グループ本社	116,000	604.40	70,110,400	
野村ホールディングス	254,800	513.90	130,941,720	
岡三証券グループ	11,000	547.00	6,017,000	
丸三証券	4,000	845.00	3,380,000	
東洋証券	5,000	183.00	915,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	14,300	518.00	7,407,400	
光世証券	3,000	123.00	369,000	
水戸証券	4,000	234.00	936,000	
いちよし証券	2,800	762.00	2,133,600	
松井証券	7,100	821.00	5,829,100	
だいこう証券ビジネス	600	510.00	306,000	
マネックスグループ	13,400	231.00	3,095,400	
カブドットコム証券	9,200	317.00	2,916,400	
極東証券	1,700	1,479.00	2,514,300	
岩井コスモホールディングス	1,200	880.00	1,056,000	
藍澤証券	2,300	560.00	1,288,000	
マネースクウェアHD	500	1,240.00	620,000	

マネーパートナーズグループ	1,600	470.00	752,000	
かんぽ生命保険	4,700	2,147.00	10,090,900	
S O M P Oホールディングス	26,100	3,235.00	84,433,500	
アニコム ホールディングス	800	2,374.00	1,899,200	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	37,200	3,009.00	111,934,800	
ソニーフィナンシャルホールディングス	12,000	1,411.00	16,932,000	
第一生命ホールディングス	75,100	1,491.00	111,974,100	
東京海上ホールディングス	50,500	4,011.00	202,555,500	
T & Dホールディングス	45,400	1,234.50	56,046,300	
アドバンスクリエイト	300	1,519.00	455,700	
全国保証	3,500	4,065.00	14,227,500	
クレディセゾン	9,500	1,804.00	17,138,000	
芙蓉総合リース	1,400	4,920.00	6,888,000	
興銀リース	2,300	2,125.00	4,887,500	
東京センチュリー	2,500	3,535.00	8,837,500	
日本証券金融	5,500	461.00	2,535,500	
アイフル	21,000	317.00	6,657,000	
ポケットカード	1,000	503.00	503,000	
リコーリース	1,000	2,981.00	2,981,000	
イオンフィナンシャルサービス	8,000	1,809.00	14,472,000	
アコム	25,100	489.00	12,273,900	
ジャックス	7,000	455.00	3,185,000	
オリエントコーポレーション	27,300	190.00	5,187,000	
日立キャピタル	2,900	2,322.00	6,733,800	
アプラスフィナンシャル	6,500	104.00	676,000	
オリックス	88,200	1,609.50	141,957,900	
三菱U F Jリース	31,600	496.00	15,673,600	
日本取引所グループ	38,700	1,504.00	58,204,800	
イー・ギャランティ	400	2,612.00	1,044,800	
アサックス	200	1,508.00	301,600	
N E Cキャピタルソリューション	500	1,606.00	803,000	
いちご	11,900	429.00	5,105,100	
日本駐車場開発	15,100	142.00	2,144,200	
ヒューリック	26,000	993.00	25,818,000	
三栄建築設計	500	1,752.00	876,000	

野村不動産ホールディングス	8,300	1,732.00	14,375,600	
三重交通グループホールディングス	2,200	379.00	833,800	
サムティ	1,000	1,080.00	1,080,000	
ディア・ライフ	900	336.00	302,400	
エー・ディー・ワークス	12,200	38.00	463,600	
日本商業開発	700	1,786.00	1,250,200	
プレサンスコーポレーション	2,000	1,212.00	2,424,000	
ユニゾホールディングス	1,000	2,664.00	2,664,000	
THEグローバル社	500	448.00	224,000	
日本管理センター	900	1,368.00	1,231,200	
サンセイランディック	300	687.00	206,100	
エストラスト	300	568.00	170,400	
フージャースホールディングス	1,700	528.00	897,600	
オープンハウス	1,800	2,223.00	4,001,400	
東急不動産ホールディングス	30,200	606.00	18,301,200	
飯田グループホールディングス	10,400	1,979.00	20,581,600	
ムゲンエステート	500	777.00	388,500	
シーアールイー	200	1,636.00	327,200	
エコナックホールディングス	5,000	45.00	225,000	
パーク24	6,300	3,265.00	20,569,500	
パラカ	400	1,817.00	726,800	
三井不動産	66,000	2,352.50	155,265,000	
三菱地所	93,000	2,113.50	196,555,500	
平和不動産	2,300	1,533.00	3,525,900	
東京建物	14,500	1,322.00	19,169,000	
ダイビル	3,200	897.00	2,870,400	
京阪神ビルディング	2,100	544.00	1,142,400	
住友不動産	30,000	2,665.50	79,965,000	
大京	23,000	223.00	5,129,000	
テーオーシー	4,800	975.00	4,680,000	
東京楽天地	2,000	500.00	1,000,000	
レオパレス21	15,800	592.00	9,353,600	
スターツコーポレーション	1,300	1,930.00	2,509,000	
フジ住宅	1,600	691.00	1,105,600	
空港施設	1,500	541.00	811,500	
明和地所	700	577.00	403,900	

住友不動産販売	1,100	2,459.00	2,704,900
ゴールドクレスト	1,100	1,958.00	2,153,800
日本エスリード	500	1,232.00	616,000
日神不動産	1,500	396.00	594,000
日本エスコン	1,700	316.00	537,200
タカラレーベン	5,400	682.00	3,682,800
サンヨーハウジング名古屋	600	917.00	550,200
イオンモール	8,000	1,527.00	12,216,000
ファースト住建	500	1,426.00	713,000
トーセイ	1,700	784.00	1,332,800
エヌ・ティ・ティ都市開発	7,700	957.00	7,368,900
サンフロンティア不動産	1,400	985.00	1,379,000
エフ・ジェー・ネクスト	1,100	607.00	667,700
インテリックス	300	710.00	213,000
ランドビジネス	900	263.00	236,700
グランディハウス	1,100	372.00	409,200
日本空港ビルデング	3,900	4,030.00	15,717,000
日本工営	4,000	472.00	1,888,000
ネクスト	3,300	883.00	2,913,900
ジェイエシーリクルートメント	800	1,430.00	1,144,000
日本M&Aセンター	3,800	3,410.00	12,958,000
アコーディア・ゴルフ	4,000	1,042.00	4,168,000
中広	100	672.00	67,200
タケエイ	1,200	828.00	993,600
トラスト・テック	500	1,545.00	772,500
パソナグループ	1,200	825.00	990,000
CDS	400	961.00	384,400
リンクアンドモチベーション	3,100	309.00	957,900
GCA	1,200	763.00	915,600
エス・エム・エス	1,800	2,769.00	4,984,200
テンプホールディングス	10,200	1,771.00	18,064,200
リニカル	800	1,340.00	1,072,000
クックパッド	2,900	1,010.00	2,929,000
エスクリ	500	541.00	270,500
アイ・ケイ・ケイ	600	600.00	360,000
学情	600	1,132.00	679,200

スタジオアリス	500	2,056.00	1,028,000
シミックホールディングス	700	1,450.00	1,015,000
N J S	300	1,279.00	383,700
総合警備保障	4,800	4,540.00	21,792,000
カカクコム	9,400	1,740.00	16,356,000
ルネサンス	700	1,463.00	1,024,100
ディップ	1,700	2,628.00	4,467,600
オプトホールディング	1,000	683.00	683,000
新日本科学	1,500	565.00	847,500
ツクイ	3,200	677.00	2,166,400
キャリアデザインセンター	300	908.00	272,400
エムスリー	11,400	3,080.00	35,112,000
ツカダ・グローバルホールディング	900	720.00	648,000
アウトソーシング	800	3,835.00	3,068,000
ウェルネット	1,000	1,314.00	1,314,000
ワールドホールディングス	300	1,583.00	474,900
ディー・エヌ・エー	5,900	3,265.00	19,263,500
博報堂D Yホールディングス	18,300	1,248.00	22,838,400
ぐるなび	1,900	2,643.00	5,021,700
エスアールジータカミヤ	1,400	558.00	781,200
ジャパンベストレスキューシステム	1,800	246.00	442,800
ファンコミュニケーションズ	3,300	769.00	2,537,700
ジェイコムホールディングス	300	1,903.00	570,900
W D Bホールディングス	500	1,091.00	545,500
ティア	700	616.00	431,200
バリューコマース	1,300	333.00	432,900
インフォマート	2,800	1,131.00	3,166,800
J Pホールディングス	3,900	261.00	1,017,900
E P Sホールディングス	1,600	1,356.00	2,169,600
レッグス	300	827.00	248,100
プレステージ・インターナショナル	1,900	762.00	1,447,800
アミューズ	700	1,764.00	1,234,800
ドリームインキュベータ	400	2,836.00	1,134,400
クイック	700	911.00	637,700
T A C	900	203.00	182,700
ケネディクス	17,800	443.00	7,885,400

電通	14,700	5,130.00	75,411,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	601.00	360,600
ぴあ	400	2,418.00	967,200
イオンファンタジー	400	3,040.00	1,216,000
シーティーエス	400	1,031.00	412,400
みらかホールディングス	3,400	5,000.00	17,000,000
アルプス技研	500	2,190.00	1,095,000
ダイオーズ	200	952.00	190,400
日本空調サービス	1,300	544.00	707,200
オリエンタルランド	14,200	6,041.00	85,782,200
ダスキン	3,400	2,136.00	7,262,400
明光ネットワークジャパン	1,600	970.00	1,552,000
ファルコホールディングス	600	1,379.00	827,400
秀英予備校	300	359.00	107,700
田谷	200	638.00	127,600
ラウンドワン	4,100	745.00	3,054,500
リゾートトラスト	5,100	2,113.00	10,776,300
ピー・エム・エル	1,700	2,728.00	4,637,600
ワタベウェディング	200	403.00	80,600
りらいあコミュニケーションズ	2,200	995.00	2,189,000
リソー教育	2,300	569.00	1,308,700
早稲田アカデミー	200	896.00	179,200
ユー・エス・エス	16,000	1,707.00	27,312,000
東京個別指導学院	400	581.00	232,400
サイバーエージェント	6,900	2,847.00	19,644,300
楽天	67,400	1,165.00	78,521,000
クリーク・アンド・リバー社	500	716.00	358,000
テー・オー・ダブリュー	1,100	651.00	716,100
セントラルスポーツ	400	2,521.00	1,008,400
フルキャストホールディングス	1,400	953.00	1,334,200
リソルホールディングス	2,000	317.00	634,000
テクノプロ・ホールディングス	2,100	3,595.00	7,549,500
アトラ	200	1,045.00	209,000
インターワークス	300	963.00	288,900
Keeper 技研	100	1,502.00	150,200
ファーストロジック	100	1,683.00	168,300

デザインワン・ジャパン	100	2,004.00	200,400
イー・ガーディアン	400	1,256.00	502,400
リブセンス	900	439.00	395,100
ジャパンマテリアル	500	3,565.00	1,782,500
ベクトル	1,100	1,168.00	1,284,800
ウチヤマホールディングス	600	411.00	246,600
サクセスホールディングス	100	1,190.00	119,000
キャリアリンク	300	763.00	228,900
I B J	1,000	770.00	770,000
アサント	500	1,619.00	809,500
N・フィールド	600	1,110.00	666,000
M&Aキャピタルパートナーズ	200	2,839.00	567,800
ライドオン・エクスプレス	300	1,025.00	307,500
E R Iホールディングス	400	798.00	319,200
アビスト	200	2,632.00	526,400
ウィルグループ	300	902.00	270,600
エスクロー・エージェント・ジャパン	100	2,578.00	257,800
日本ビューホテル	200	1,263.00	252,600
リクルートホールディングス	28,800	4,150.00	119,520,000
エラン	200	1,312.00	262,400
日本郵政	34,400	1,284.00	44,169,600
ベルシステム24ホールディングス	2,000	962.00	1,924,000
ソラスト	600	1,108.00	664,800
リログループ	500	16,960.00	8,480,000
東祥	300	4,750.00	1,425,000
エイチ・アイ・エス	2,200	2,879.00	6,333,800
ラックランド	200	1,808.00	361,600
共立メンテナンス	1,100	6,310.00	6,941,000
イチネンホールディングス	1,400	1,067.00	1,493,800
建設技術研究所	900	970.00	873,000
スペース	700	1,233.00	863,100
燦ホールディングス	300	1,472.00	441,600
スバル興業	1,000	419.00	419,000
東京テアトル	6,000	121.00	726,000
タナベ経営	300	1,195.00	358,500
ナガワ	200	4,160.00	832,000

よみうりランド	3,000	448.00	1,344,000	
東京都競馬	9,000	233.00	2,097,000	
常磐興産	500	1,502.00	751,000	
カナモト	1,800	2,412.00	4,341,600	
東京ドーム	5,300	1,065.00	5,644,500	
西尾レントオール	1,100	3,070.00	3,377,000	
トランス・コスモス	1,500	2,621.00	3,931,500	
乃村工藝社	2,800	1,710.00	4,788,000	
藤田観光	4,000	340.00	1,360,000	
KNT-CTホールディングス	8,000	117.00	936,000	
日本管財	1,100	1,519.00	1,670,900	
トーカイ	600	3,515.00	2,109,000	
白洋舎	100	2,489.00	248,900	
セコム	13,700	7,669.00	105,065,300	
セントラル警備保障	600	2,059.00	1,235,400	
丹青社	2,300	767.00	1,764,100	
メイテック	1,600	3,550.00	5,680,000	
アサツー ディ・ケイ	2,200	2,882.00	6,340,400	
応用地質	1,100	1,179.00	1,296,900	
船井総研ホールディングス	1,700	1,580.00	2,686,000	
進学会	600	493.00	295,800	
オオバ	1,000	426.00	426,000	
学究社	300	1,286.00	385,800	
ベネッセホールディングス	4,400	2,910.00	12,804,000	
イオンディライト	1,500	3,025.00	4,537,500	
ナック	800	854.00	683,200	
ニチイ学館	2,300	855.00	1,966,500	
ダイセキ	2,300	2,128.00	4,894,400	
ステップ	500	1,194.00	597,000	
合 計	19,082,300		25,119,698,830	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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

貸借対照表

（単位：円）

	平成27年11月 6日現在	平成28年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
預金	134,025,829	707,287,843
コール・ローン	1,516,004,646	454,466,522
出資金	-	6,618,717
株式	76,137,853,498	64,194,957,102
投資証券	1,981,283,255	1,753,040,590
派生商品評価勘定	148,332,453	2,150,781
未収入金	3,193,364	846,886
未収配当金	85,311,594	66,614,031
未収利息	2,474	-
差入委託証拠金	258,162,445	280,902,424
流動資産合計	80,264,169,558	67,466,884,896
資産合計	80,264,169,558	67,466,884,896
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,211,600	40,549,636
未払金	596,660	121,108
未払解約金	178,586,814	78,803,598
未払利息	-	430
流動負債合計	182,395,074	119,474,772
負債合計	182,395,074	119,474,772
純資産の部		
元本等		
元本	39,104,730,095	38,937,887,089
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	40,977,044,389	28,409,523,035
元本等合計	80,081,774,484	67,347,410,124
純資産合計	80,081,774,484	67,347,410,124
負債純資産合計	80,264,169,558	67,466,884,896

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>出資金、株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 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られ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られ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 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 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		平成27年11月 6日現在	平成28年11月 7日現在
1.	期首	平成26年11月 7日	平成27年11月 7日
	期首元本額	45,063,157,199円	39,104,730,095円
	期首からの追加設定元本額	2,553,715,826円	3,384,278,028円
	期首からの一部解約元本額	8,512,142,930円	3,551,121,034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）	14,228,655,621円	14,862,488,326円
	DCインデックスバランス（株式20）	39,671,130円	54,123,899円
	DCインデックスバランス（株式40）	155,402,482円	180,333,319円
	DCインデックスバランス（株式60）	290,756,638円	330,462,762円
	DCインデックスバランス（株式80）	345,428,532円	376,551,830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	3,603,552,397円	3,519,481,915円
	日興五大陸株式ファンド	7,495,776,901円	6,936,165,834円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	29,801,029円	31,269,716円
	インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）	- 円	41,655,430円
	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産）	13,338,738円	1,837,557円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	7,085,288円	7,053,711円

アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	5,650,402円	5,845,048円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	8,642,901円	8,664,661円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	10,342,211円	11,090,160円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	7,520,445,780円	7,412,991,437円
グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	10,775,646円	9,877,396円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	28,538,861円	33,765,511円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	87,252,162円	99,645,290円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	123,067,808円	134,239,074円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	124,828,054円	133,564,187円
インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,975,717,514円	4,746,780,026円
計	39,104,730,095円	38,937,887,089円
2. 受益権の総数	39,104,730,095口	38,937,887,089口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成26年11月 7日 至 平成27年11月 6日	自 平成27年11月 7日 至 平成28年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成27年11月 6日現在	平成28年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成27年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	514,991,759
投資証券	5,106,007
合計	509,885,752

(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

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成27年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	1,739,040,038	-	1,874,524,641	135,484,603
	合計	1,739,040,038	-	1,874,524,641	135,484,603

(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	1,363,779,084	-	1,325,027,956	38,751,128
	合計	1,363,779,084	-	1,325,027,956	38,751,128

(注) 1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(平成27年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
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,369,787,750	-	1,379,424,000	9,636,250
	米ドル	1,081,800,650	-	1,094,648,500	12,847,850
	ユーロ	287,987,100	-	284,775,500	3,211,600
合計		1,369,787,750	-	1,379,424,000	9,636,250

（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
	イスラエルシェケル	90,090,000	-	90,519,000	429,000
合計		574,640,804	-	575,851,077	352,273

（注）1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成27年11月 6日現在		平成28年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	2.0479円	1口当たり純資産額	1.7296円
(1万口当たり純資産額)	(20,479円)	(1万口当たり純資産額)	(17,296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	ADIENT PLC	2,025	44.20	89,505.00	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	12,193	58.62	714,753.66	
	ANTERO RESOURCES CORP	3,670	24.65	90,465.50	
	APACHE CORP	8,294	56.14	465,625.16	
	BAKER HUGHES INC	9,665	58.11	561,633.15	
	CABOT OIL & GAS CORP	11,490	20.05	230,374.50	
	CHENIERE ENERGY INC	4,380	36.84	161,359.20	
	CHEVRON CORP	41,251	104.78	4,322,279.78	
	CIMAREX ENERGY CO	2,005	120.11	240,820.55	
	CONCHO RESOURCES INC	3,055	126.68	387,007.40	
	CONOCOPHILLIPS	26,990	42.76	1,154,092.40	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,960	45.19	88,572.40	
	CORE LABORATORIES N.V.	1,080	97.34	105,127.20	
	DEVON ENERGY CORPORATION	11,061	40.19	444,541.59	
	EOG RESOURCES INC	12,022	91.80	1,103,619.60	
	EQT CORP	3,885	63.34	246,075.90	
	EXXON MOBIL CORP	90,821	83.57	7,589,910.97	
	FMC TECHNOLOGIES INC	4,415	32.24	142,339.60	
	HALLIBURTON CO	18,607	46.38	862,992.66	
	HELMERICH & PAYNE	2,120	62.42	132,330.40	
HESS CORP	6,000	46.42	278,520.00		

HOLLYFRONTIER CORP	3,740	23.67	88,525.80
KINDER MORGAN INC	41,580	19.87	826,194.60
MARATHON OIL CORP	17,867	13.69	244,599.23
MARATHON PETROLEUM CORP	11,412	41.23	470,516.76
MURPHY OIL CORP	3,715	26.01	96,627.15
NATIONAL OILWELL VARCO INC	8,231	31.88	262,404.28
NEWFIELD EXPLORATION CO	4,040	37.84	152,873.60
NOBLE ENERGY INC	9,492	37.08	351,963.36
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	16,761	66.59	1,116,114.99
ONEOK INC	4,590	46.65	214,123.50
PHILLIPS 66	10,115	78.60	795,039.00
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,590	171.11	614,284.90
RANGE RESOURCES CORP	4,050	32.02	129,681.00
SCHLUMBERGER LTD	30,601	77.84	2,381,981.84
SOUTHWESTERN ENERGY CO	10,435	9.51	99,236.85
SPECTRA ENERGY CORP	15,234	40.03	609,817.02
TESORO CORP	2,820	79.92	225,374.40
VALERO ENERGY CORP	10,332	57.87	597,912.84
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	20,199	3.85	77,766.15
WILLIAMS COS INC	15,624	28.60	446,846.40
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	4,515	133.37	602,165.55
ALBEMARLE CORP	2,540	83.48	212,039.20
ALCOA CORP	3,554	25.20	89,560.80
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	1,610	113.01	181,946.10
AVERY DENNISON CORP	2,260	70.68	159,736.80
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	4,170	24.53	102,290.10
BALL CORP	3,670	76.48	280,681.60
CELANESE CORP-SERIES A	3,270	72.07	235,668.90
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,850	23.11	112,083.50
CROWN HOLDINGS INC	2,815	53.04	149,307.60
DOW CHEMICAL CO/THE	24,643	53.13	1,309,282.59
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	19,108	68.61	1,310,999.88
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,395	71.26	241,927.70
ECOLAB INC	5,690	110.67	629,712.30
FMC CORP	3,270	52.46	171,544.20

FREEMPORT-MCMORAN INC	25,748	11.05	284,515.40
INTERNATIONAL PAPER CO	8,670	43.98	381,306.60
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,664	128.66	214,090.24
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,140	78.45	638,583.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,325	192.33	254,837.25
MONSANTO CO	9,581	98.52	943,920.12
MOSAIC CO/THE	7,490	24.50	183,505.00
NEWMONT MINING CORP	11,290	37.80	426,762.00
NUCOR CORP	7,169	49.95	358,091.55
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,950	79.07	154,186.50
PPG INDUSTRIES INC	5,874	92.81	545,165.94
PRAXAIR INC	6,190	114.50	708,755.00
SEALED AIR CORP	4,356	44.95	195,802.20
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,687	242.54	409,164.98
VALSPAR CORP/THE	1,530	99.85	152,770.50
VULCAN MATERIALS CO	2,893	116.75	337,757.75
WESTROCK CO	5,959	46.35	276,199.65
WR GRACE & CO	1,400	67.71	94,794.00
3M CO	13,236	166.48	2,203,529.28
ACUITY BRANDS INC	960	226.32	217,267.20
AERCAP HOLDINGS NV	3,450	41.29	142,450.50
AGCO CORP	1,670	49.55	82,748.50
AMETEK INC	5,073	44.39	225,190.47
ARCONIC INC	10,663	17.68	188,521.84
B/E AEROSPACE INC	2,570	58.92	151,424.40
BOEING CO/THE	13,172	139.54	1,838,020.88
CATERPILLAR INC	12,686	82.31	1,044,184.66
CUMMINS INC	3,695	124.31	459,325.45
DEERE & CO	5,710	88.06	502,822.60
DOVER CORP	3,640	65.53	238,529.20
EATON CORP PLC	9,756	60.76	592,774.56
EMERSON ELECTRIC CO	13,830	49.41	683,340.30
FASTENAL CO	6,153	39.44	242,674.32
FLOWSERVE CORP	2,965	41.35	122,602.75
FLUOR CORP	3,203	44.80	143,494.40

FORTIVE CORP	6,734	51.11	344,174.74
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,160	52.86	167,037.60
GENERAL DYNAMICS CORP	5,722	149.81	857,212.82
GENERAL ELECTRIC CO	201,513	28.44	5,731,029.72
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	15,926	108.25	1,723,989.50
ILLINOIS TOOL WORKS	6,900	114.02	786,738.00
INGERSOLL-RAND PLC	5,866	68.75	403,287.50
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,810	49.25	138,392.50
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	5,300	58.95	312,435.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	1,751	134.59	235,667.09
LOCKHEED MARTIN CORP	5,741	236.28	1,356,483.48
MASCO CORP	7,529	29.84	224,665.36
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,844	225.23	865,784.12
PACCAR INC	7,684	54.52	418,931.68
PARKER HANNIFIN CORP	3,010	120.55	362,855.50
PENTAIR PLC	4,018	54.70	219,784.60
RAYTHEON COMPANY	6,432	132.97	855,263.04
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,943	117.56	345,979.08
ROCKWELL COLLINS INC.	2,995	82.16	246,069.20
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,150	169.47	364,360.50
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,970	35.81	142,165.70
SMITH (A.O.) CORP	3,020	44.86	135,477.20
SNAP-ON INC	1,250	153.88	192,350.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,116	114.58	357,031.28
TEXTRON INC	5,416	39.08	211,657.28
TRANSDIGM GROUP INC	1,190	267.45	318,265.50
UNITED RENTALS INC	2,250	72.16	162,360.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	17,315	101.33	1,754,528.95
WABCO HOLDINGS INC	1,110	97.35	108,058.50
WABTEC CORP	2,090	76.30	159,467.00
WW GRAINGER INC	1,317	205.25	270,314.25
XYLEM INC	4,368	47.40	207,043.20
CINTAS CORP	2,037	103.06	209,933.22
DUN & BRADSTREET CORP	872	116.29	101,404.88
EQUIFAX INC	2,634	123.61	325,588.74

IHS MARKIT LTD	7,543	35.53	268,002.79
MANPOWERGROUP INC	1,937	77.28	149,691.36
NIELSEN HOLDINGS PLC	7,835	43.50	340,822.50
REPUBLIC SERVICES INC	5,100	51.23	261,273.00
ROBERT HALF INTL INC	2,375	37.43	88,896.25
STERICYCLE INC	1,705	72.64	123,851.20
VERISK ANALYTICS INC	3,170	81.76	259,179.20
WASTE CONNECTIONS INC	3,871	74.07	286,724.97
WASTE MANAGEMENT INC	9,924	63.37	628,883.88
AMERCO	155	315.47	48,897.85
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,290	39.74	130,744.60
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,250	68.69	223,242.50
CSX CORP	20,923	30.92	646,939.16
DELTA AIR LINES INC	4,285	42.88	183,740.80
EXPEDITORS INTL WASH INC	3,647	50.86	185,486.42
FEDEX CORP	5,758	174.80	1,006,498.40
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,000	80.28	160,560.00
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	97,000	0.43	41,710.00
KANSAS CITY SOUTHERN	2,390	87.97	210,248.30
NORFOLK SOUTHERN CORP	6,530	91.62	598,278.60
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,400	40.38	137,292.00
UNION PACIFIC CORP	18,406	88.76	1,633,716.56
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	1,915	57.23	109,595.45
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	15,197	106.94	1,625,167.18
AUTOLIV INC	2,020	95.50	192,910.00
BORGWARNER INC	4,330	34.09	147,609.70
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	6,090	66.76	406,568.40
FORD MOTOR COMPANY	80,915	11.34	917,576.10
GENERAL MOTORS CORP	30,275	31.16	943,369.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	5,430	27.79	150,899.70
HARLEY-DAVIDSON INC	4,079	55.88	227,934.52
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	20,254	40.88	827,983.52
LEAR CORP	1,560	120.43	187,870.80
TESLA MOTORS INC	2,480	190.56	472,588.80
COACH INC	6,286	35.34	222,147.24

DR HORTON INC	7,936	28.75	228,160.00
GARMIN LTD	2,865	47.01	134,683.65
HANESBRANDS INC	8,800	23.76	209,088.00
HARMAN INTERNATIONAL	1,600	82.33	131,728.00
HASBRO INC	2,538	81.12	205,882.56
LEGGETT & PLATT INC	3,348	45.05	150,827.40
LENNAR CORP-CL A	4,320	41.40	178,848.00
LULULEMON ATHLETICA INC	2,440	55.84	136,249.60
MATTEL INC	7,349	30.46	223,850.54
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	4,000	49.09	196,360.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,488	190.75	283,836.00
NEWELL BRANDS INC	9,996	47.54	475,209.84
NIKE INC -CL B	29,428	49.96	1,470,222.88
POLARIS INDUSTRIES INC	1,420	76.73	108,956.60
PULTE GROUP INC	6,890	18.24	125,673.60
PVH CORP	2,030	104.32	211,769.60
RALPH LAUREN CORP	1,365	98.59	134,575.35
TOLL BROTHERS INC	3,781	27.42	103,675.02
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	3,560	30.80	109,648.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	4,652	25.61	119,137.72
VF CORP	7,680	53.54	411,187.20
WHIRLPOOL CORP	1,814	152.79	277,161.06
ARAMARK	4,960	36.14	179,254.40
CARNIVAL CORP	7,957	48.04	382,254.28
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	685	370.43	253,744.55
DARDEN RESTAURANTS INC	2,903	63.86	185,385.58
DOMINO'S PIZZA INC	1,020	166.76	170,095.20
H&R BLOCK INC	5,610	21.93	123,027.30
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	11,130	22.59	251,426.70
LAS VEGAS SANDS CORP	9,480	59.08	560,078.40
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	7,703	69.61	536,205.83
MCDONALD'S CORP	19,191	111.04	2,130,968.64
MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	4,100	17.60	72,160.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	9,760	26.41	257,761.60
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	3,730	37.00	138,010.00

ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,538	75.23	266,163.74
STARBUCKS CORP	32,214	52.75	1,699,288.50
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,540	64.24	163,169.60
WYNN RESORTS LTD	1,660	88.04	146,146.40
YUM CHINA HOLDINGS INC	9,214	27.58	254,122.12
YUM! BRANDS INC	9,214	59.81	551,089.34
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	9,418	57.01	536,920.18
CHARTER COMMUNICATION-A	4,701	250.23	1,176,331.23
COMCAST CORP-CLASS A	52,957	60.66	3,212,371.62
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,320	25.64	85,124.80
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	5,600	24.59	137,704.00
DISH NETWORK CORP-A	4,769	54.93	261,961.17
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	8,736	22.05	192,628.80
LIBERTY BROADBAND-C	2,140	65.27	139,677.80
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	2,981	19.37	57,741.97
LIBERTY GLOBAL PLC-A	6,215	31.66	196,766.90
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	13,641	30.85	420,824.85
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	4,930	32.22	158,844.60
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	1,975	32.47	64,128.25
NEWS CORP - CLASS A	7,570	11.89	90,007.30
OMNICOM GROUP	5,417	79.52	430,759.84
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	1,950	64.84	126,438.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	42,510	4.14	175,991.40
TEGNA INC	4,330	18.02	78,026.60
THE WALT DISNEY CO.	33,723	92.45	3,117,691.35
TIME WARNER INC	17,148	86.42	1,481,930.16
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	9,769	26.69	260,734.61
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	24,572	26.94	661,969.68
VIACOM INC-CLASS B	7,748	36.56	283,266.88
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,608	136.19	218,993.52
AMAZON.COM INC	8,785	755.05	6,633,114.25
AUTONATION INC	1,650	40.86	67,419.00
AUTOZONE INC	682	731.65	498,985.30
BED BATH & BEYOND INC	3,512	38.67	135,809.04
BEST BUY CO INC	6,504	38.19	248,387.76

CARMAX INC	4,269	50.51	215,627.19
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,110	56.72	119,679.20
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	6,280	68.53	430,368.40
DOLLAR TREE INC	4,896	73.62	360,443.52
EXPEDIA INC	2,682	125.21	335,813.22
FOOT LOCKER INC	3,100	66.17	205,127.00
GAP INC/THE	5,106	25.76	131,530.56
GENUINE PARTS CO	3,201	87.67	280,631.67
HOME DEPOT INC	27,480	120.91	3,322,606.80
KOHL'S CORP	4,402	42.82	188,493.64
L BRANDS INC	5,308	65.00	345,020.00
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	9,700	18.12	175,764.00
LKQ CORP	6,990	31.39	219,416.10
LOWE'S COS INC	19,742	66.25	1,307,907.50
MACY'S INC	7,009	36.85	258,281.65
NETFLIX INC	9,290	122.03	1,133,658.70
NORDSTROM INC	2,850	50.39	143,611.50
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,145	261.20	560,274.00
PRICELINE GROUP INC/THE	1,085	1,424.28	1,545,343.80
ROSS STORES INC	8,572	61.40	526,320.80
SIGNET JEWELERS LTD	1,660	81.39	135,107.40
STAPLES INC	13,744	7.36	101,155.84
TARGET CORP	12,330	66.53	820,314.90
TIFFANY & CO	2,980	72.93	217,331.40
TJX COMPANIES INC	14,513	71.92	1,043,774.96
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,960	65.44	193,702.40
TRIPADVISOR INC	2,330	63.64	148,281.20
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	1,320	228.17	301,184.40
COSTCO WHOLESALE CORP	9,609	142.24	1,366,784.16
CVS HEALTH CORP	23,917	82.31	1,968,608.27
KROGER CO	19,670	30.92	608,196.40
RITE AID CORP	22,930	6.45	147,898.50
SYSCO CORP	12,076	48.04	580,131.04
WAL-MART STORES INC	34,772	69.16	2,404,831.52
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	19,942	80.35	1,602,339.70

WHOLE FOODS MARKET INC	7,080	28.93	204,824.40
ALTRIA GROUP INC	42,938	64.38	2,764,348.44
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	13,013	46.92	610,569.96
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5,014	46.03	230,794.42
BUNGE LTD	3,107	69.31	215,346.17
CAMPBELL SOUP CO	4,215	52.61	221,751.15
COCA-COLA CO/THE	90,252	41.69	3,762,605.88
CONAGRA FOODS INC	8,960	46.56	417,177.60
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,720	159.59	593,674.80
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	4,109	86.53	355,551.77
GENERAL MILLS INC	12,569	60.65	762,309.85
HERSHEY CO/THE	3,395	100.00	339,500.00
HORMEL FOODS CORP	6,600	36.43	240,438.00
INGREDION INC	1,470	128.24	188,512.80
JM SMUCKER CO/THE	2,530	129.27	327,053.10
KELLOGG CO	5,708	73.67	420,508.36
KRAFT HEINZ CO/THE	13,191	84.05	1,108,703.55
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,275	93.35	212,371.25
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	3,991	72.68	290,065.88
MOLSON COORS BREWING CO -B	4,080	102.81	419,464.80
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	34,005	42.61	1,448,953.05
MONSTER BEVERAGE CORP	2,930	135.23	396,223.90
PEPSICO INC	31,701	105.81	3,354,282.81
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	34,078	95.49	3,254,108.22
REYNOLDS AMERICAN INC	18,616	54.46	1,013,827.36
TYSON FOODS INC-CL A	6,456	67.18	433,714.08
WHITEWAVE FOODS CO	3,520	53.78	189,305.60
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,930	43.78	259,615.40
CLOROX COMPANY	2,736	113.26	309,879.36
COLGATE-PALMOLIVE CO	18,690	69.57	1,300,263.30
COTY INC-CL A	10,000	21.89	218,900.00
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	1,311	73.87	96,843.57
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,740	79.02	374,554.80
KIMBERLY-CLARK CORP	7,883	112.35	885,655.05
PROCTER & GAMBLE CO	56,179	85.08	4,779,709.32

ABBOTT LABORATORIES	31,867	39.09	1,245,681.03
AETNA INC	7,649	106.10	811,558.90
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,024	70.47	283,571.28
ANTHEM INC	5,606	119.29	668,739.74
BAXTER INTERNATIONAL INC	10,949	46.99	514,493.51
BECTON DICKINSON AND CO	4,607	174.99	806,178.93
BOSTON SCIENTIFIC CORP	28,738	21.56	619,591.28
CARDINAL HEALTH INC	7,115	65.17	463,684.55
CENTENE CORP	3,770	61.61	232,269.70
CERNER CORP	6,590	52.32	344,788.80
CIGNA CORP	5,580	121.65	678,807.00
COOPER COS INC/THE	1,040	175.82	182,852.80
CR BARD INC	1,574	217.69	342,644.06
DANAHER CORP	13,469	76.94	1,036,304.86
DAVITA INC	3,938	58.63	230,884.94
DENTSPLY SIRONA INC	5,382	60.60	326,149.20
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,690	89.63	420,364.70
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	3,630	21.39	77,645.70
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	14,464	67.86	981,527.04
HCA HOLDINGS INC	6,905	75.33	520,153.65
HENRY SCHEIN INC	1,850	154.86	286,491.00
HOLOGIC INC	5,708	38.08	217,360.64
HUMANA INC	3,275	167.42	548,300.50
IDEXX LABORATORIES INC	1,830	106.21	194,364.30
INTUITIVE SURGICAL INC	820	671.42	550,564.40
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,155	121.89	262,672.95
MCKESSON CORP	4,914	130.76	642,554.64
MEDNAX INC	2,240	60.38	135,251.20
MEDTRONIC PLC	30,608	82.14	2,514,141.12
PATTERSON COS INC	2,042	45.75	93,431.71
QUEST DIAGNOSTICS	3,116	81.22	253,081.52
RESMED INC	3,370	57.42	193,505.40
ST JUDE MEDICAL INC	6,120	77.98	477,237.60
STRYKER CORP	7,453	117.15	873,118.95
UNITEDHEALTH GROUP INC	20,780	137.71	2,861,613.80

UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,050	120.35	246,717.50
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,344	89.14	208,944.16
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	4,462	103.01	459,630.62
ABBVIE INC	35,416	56.04	1,984,712.64
AGILENT TECHNOLOGIES INC	7,010	44.32	310,683.20
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	4,910	129.00	633,390.00
ALKERMES PLC	3,220	51.96	167,311.20
ALLERGAN PLC	8,665	195.00	1,689,675.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,530	33.75	51,637.50
AMGEN INC	16,441	135.40	2,226,111.40
BIOGEN INC	4,803	277.00	1,330,431.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,500	82.00	287,000.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	36,461	51.01	1,859,875.61
CELGENE CORP	16,984	103.44	1,756,824.96
ELI LILLY & CO	21,733	72.49	1,575,425.17
ENDO INTERNATIONAL PLC	4,160	14.98	62,316.80
GILEAD SCIENCES INC	29,724	72.43	2,152,909.32
ILLUMINA INC	3,175	134.63	427,450.25
INCYTE CORP	3,680	87.57	322,257.60
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,330	103.10	137,123.00
JOHNSON & JOHNSON	60,261	115.11	6,936,643.71
MALLINCKRODT PLC	2,400	54.65	131,160.00
MERCK & CO. INC.	60,643	58.82	3,567,021.26
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	600	420.46	252,276.00
MYLAN NV	10,735	35.00	375,725.00
PERRIGO CO PLC	3,039	82.39	250,383.21
PFIZER INC	132,780	30.00	3,983,400.00
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	3,643	72.59	264,445.37
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,680	341.39	573,535.20
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	20,000	40.24	804,800.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	8,614	146.57	1,262,553.98
UNITED THERAPEUTICS CORP	940	114.14	107,291.60
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,320	78.96	420,067.20
WATERS CORP	1,886	138.04	260,343.44
ZOETIS INC	10,200	49.94	509,388.00

BANK OF AMERICA CORP	224,319	16.55	3,712,479.45
BB&T CORP	17,528	38.25	670,446.00
CIT GROUP INC	4,565	35.80	163,427.00
CITIGROUP INC	64,107	48.17	3,088,034.19
CITIZENS FINANCIAL GROUP	11,210	26.41	296,056.10
COMERICA INC	3,360	50.53	169,780.80
FIFTH THIRD BANCORP	16,559	21.21	351,216.39
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,070	72.84	223,618.80
HUNTINGTON BANCSHARES INC	24,200	10.16	245,872.00
JPMORGAN CHASE & CO	80,130	67.76	5,429,608.80
KEYCORP	22,678	14.05	318,625.90
M & T BANK CORP	3,073	121.81	374,322.13
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	9,654	13.79	133,128.66
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	6,370	16.23	103,385.10
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	10,840	94.65	1,026,006.00
REGIONS FINANCIAL CORP	29,784	10.52	313,327.68
SIGNATURE BANK	990	120.48	119,275.20
SUNTRUST BANKS INC	11,067	44.87	496,576.29
US BANCORP	37,701	43.93	1,656,204.93
WELLS FARGO & CO	105,800	44.60	4,718,680.00
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,220	132.29	161,393.80
ALLY FINANCIAL INC	9,120	17.16	156,499.20
AMERICAN EXPRESS CO	17,914	65.51	1,173,546.14
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,660	87.77	321,238.20
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	23,532	42.99	1,011,640.68
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	26,200	142.95	3,745,290.00
BLACKROCK INC	2,685	345.80	928,473.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	11,625	73.10	849,787.50
CME GROUP INC	7,500	102.85	771,375.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	9,370	56.07	525,375.90
E*TRADE FINANCIAL CORP	5,840	27.63	161,359.20
EATON VANCE CORP	2,880	35.25	101,520.00
FRANKLIN RESOURCES INC	7,995	33.80	270,231.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8,298	175.92	1,459,784.16
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	2,636	53.37	140,683.32

INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC(N)	10,544	53.37	562,733.28
INVESCO LTD	9,377	27.86	261,243.22
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	17.91	130,832.55
MOODY'S CORP	3,917	97.61	382,338.37
MORGAN STANLEY	31,715	32.78	1,039,617.70
MSCI INC	2,000	79.37	158,740.00
NASDAQ INC	2,555	64.68	165,257.40
NAVIENT CORP	8,682	13.32	115,644.24
NORTHERN TRUST CORP	4,690	72.08	338,055.20
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,500	59.09	147,725.00
S&P GLOBAL INC	5,832	122.59	714,944.88
SCHWAB (CHARLES) CORP	25,884	30.90	799,815.60
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,225	43.65	140,771.25
STATE STREET CORP	8,707	70.39	612,885.73
SYNCHRONY FINANCIAL	18,290	28.22	516,143.80
T ROWE PRICE GROUP INC	5,465	63.70	348,120.50
TD AMERITRADE HOLDING CORP	5,980	33.48	200,210.40
VOYA FINANCIAL INC	4,650	29.90	139,035.00
AFLAC INC	9,092	68.56	623,347.52
ALLEGHANY CORP	330	523.06	172,609.80
ALLSTATE CORP	8,143	66.72	543,300.96
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	24,895	57.38	1,428,475.10
AON PLC	5,797	107.79	624,858.63
ARCH CAPITAL GROUP LTD	2,775	77.18	214,174.50
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,300	47.48	156,684.00
ASSURANT INC	1,530	79.73	121,986.90
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,175	57.99	126,128.25
CHUBB LTD	10,235	123.11	1,260,030.85
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,400	68.26	232,084.00
EVEREST RE GROUP LTD	1,014	205.45	208,326.30
FNF GROUP	5,881	33.92	199,483.52
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	8,312	43.22	359,244.64
LINCOLN NATIONAL CORP	5,363	50.28	269,651.64
LOEWS CORP	6,485	41.41	268,543.85
MARKEL CORP	310	825.07	255,771.70

MARSH & MCLENNAN COS	11,363	63.90	726,095.70
METLIFE INC	20,085	46.82	940,379.70
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6,430	53.13	341,625.90
PROGRESSIVE CORP	12,350	31.11	384,208.50
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	9,492	85.79	814,318.68
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	887	124.14	110,112.18
TORCHMARK CORP	2,216	63.65	141,048.40
TRAVELERS COS INC/THE	6,354	104.67	665,073.18
UNUM GROUP	4,788	35.79	171,362.52
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,758	116.78	322,079.24
WR BERKLEY CORP	2,063	56.00	115,528.00
XL GROUP LTD	6,310	34.56	218,073.60
CBRE GROUP INC	6,610	26.42	174,636.20
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	23,700	6.67	158,079.00
JONES LANG LASALLE INC	890	90.75	80,767.50
REALOGY HOLDINGS CORP	3,160	23.15	73,154.00
ACCENTURE PLC-CL A	13,828	117.23	1,621,056.44
ACTIVISION BLIZZARD INC	12,800	41.70	533,760.00
ADOBE SYSTEMS INC	10,989	106.20	1,167,031.80
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	4,220	65.81	277,718.20
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,275	199.80	254,745.00
ALPHABET INC-CL A	6,420	781.10	5,014,662.00
ALPHABET INC-CL C	6,782	762.02	5,168,019.64
ANSYS INC	2,090	83.62	174,765.80
AUTODESK INC	4,420	69.44	306,924.80
AUTOMATIC DATA PROCESSING	10,106	89.08	900,242.48
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	2,420	64.03	154,952.60
CA INC	6,760	30.68	207,396.80
CADENCE DESIGN SYS INC	6,170	24.93	153,818.10
CDK GLOBAL INC	2,720	55.67	151,422.40
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2,990	82.65	247,123.50
CITRIX SYSTEMS INC	3,628	83.25	302,031.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	13,218	52.08	688,393.44
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	4,720	48.62	229,486.40
EBAY INC	24,517	27.95	685,250.15

ELECTRONIC ARTS INC	6,504	80.22	521,750.88
FACEBOOK INC-A	50,630	120.75	6,113,572.50
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	6,925	75.42	522,283.50
FISERV INC	4,948	97.93	484,557.64
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,110	150.05	316,605.50
FORTINET INC	3,100	30.88	95,728.00
GARTNER INC	1,750	93.39	163,432.50
GLOBAL PAYMENTS INC	3,200	70.81	226,592.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	20,032	152.43	3,053,477.76
INTUIT INC	5,366	105.28	564,932.48
LINKEDIN CORP - A	2,540	187.60	476,504.00
MASTERCARD INC	21,360	103.03	2,200,720.80
MICROSOFT CORP	163,934	58.71	9,624,565.14
MOBILEYE NV	3,560	36.89	131,328.40
NETSUITE INC	850	90.34	76,789.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	5,800	13.45	78,010.00
ORACLE CORP	68,663	38.28	2,628,419.64
PAYCHEX INC	7,052	53.65	378,339.80
PAYPAL HOLDINGS INC	23,977	40.90	980,659.30
RED HAT INC	4,070	74.45	303,011.50
SABRE CORP	4,520	23.18	104,773.60
SALESFORCE.COM INC	14,140	74.37	1,051,591.80
SERVICENOW INC	3,630	83.21	302,052.30
SPLUNK INC	2,830	57.64	163,121.20
SYMANTEC CORP	13,905	23.49	326,628.45
SYNOPSYS INC	3,207	57.65	184,883.55
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,636	48.98	178,091.28
TWITTER INC	12,260	18.02	220,925.20
VANTIV INC - CL-A	3,730	58.05	216,526.50
VERISIGN INC	2,220	79.77	177,089.40
VISA INC-CLASS A SHARES	41,862	80.36	3,364,030.32
VMWARE INC	1,835	76.79	140,909.65
WESTERN UNION CO	10,451	19.63	205,153.13
WORKDAY INC-CLASS A	2,520	82.77	208,580.40
XEROX CORP	19,754	9.17	181,144.18

YAHOO! INC	20,475	40.28	824,733.00
ZILLOW GROUP INC - C	2,000	34.45	68,900.00
AMPHENOL CORP-CL A	6,450	64.91	418,669.50
APPLE INC	120,022	108.84	13,063,194.48
ARROW ELECTRONICS INC	2,310	60.01	138,623.10
AVNET INC	3,460	41.52	143,659.20
CDW CORP/DE	3,420	43.73	149,556.60
CISCO SYSTEMS INC	110,030	30.19	3,321,805.70
CORNING INC	24,328	22.40	544,947.20
F5 NETWORKS INC	1,445	135.73	196,129.85
FLEX LTD	12,536	13.60	170,489.60
FLIR SYSTEMS INC	3,195	31.93	102,016.35
HARRIS CORP	2,830	94.25	266,727.50
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	38,615	22.04	851,074.60
HP INC	38,615	14.71	568,026.65
JUNIPER NETWORKS INC	7,633	24.90	190,061.70
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3,395	75.90	257,680.50
NETAPP INC	7,006	30.45	213,332.70
PALO ALTO NETWORKS INC	1,900	148.00	281,200.00
SEAGATE TECHNOLOGY	6,974	33.00	230,142.00
TE CONNECTIVITY LTD	8,365	62.63	523,899.95
TRIMBLE INC	6,050	25.87	156,513.50
WESTERN DIGITAL CORP	6,048	55.02	332,760.96
AT&T INC	134,927	36.50	4,924,835.50
CENTURYLINK INC	12,616	23.05	290,798.80
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	25,774	3.12	80,414.88
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	6,500	51.50	334,750.00
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	2,580	105.99	273,454.20
SPRINT CORP	17,350	6.13	106,355.50
T-MOBILE US INC	6,372	49.35	314,458.20
VERIZON COMMUNICATIONS INC	89,487	47.08	4,213,047.96
AES CORP	13,728	12.11	166,246.08
ALLIANT ENERGY CORP	5,230	36.83	192,620.90
AMEREN CORPORATION	5,182	49.36	255,783.52
AMERICAN ELECTRIC POWER	10,698	62.40	667,555.20

AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,095	70.59	289,066.05	
ATMOS ENERGY CORP	2,360	70.97	167,489.20	
CALPINE CORP	8,060	11.14	89,788.40	
CENTERPOINT ENERGY INC	8,142	22.93	186,696.06	
CMS ENERGY CORP	6,140	40.78	250,389.20	
CONSOLIDATED EDISON INC	6,306	73.75	465,067.50	
DOMINION RESOURCES INC/VA	13,457	73.79	992,992.03	
DTE ENERGY COMPANY	3,698	93.09	344,246.82	
DUKE ENERGY CORP	15,026	77.27	1,161,059.02	
EDISON INTERNATIONAL	7,059	70.31	496,318.29	
ENERGY CORP	3,847	70.82	272,444.54	
EVERSOURCE ENERGY	6,900	53.18	366,942.00	
EXELON CORP	19,686	32.69	643,535.34	
FIRSTENERGY CORP	8,995	33.57	301,962.15	
NEXTERA ENERGY INC	10,055	123.18	1,238,574.90	
NISOURCE INC	6,540	21.92	143,356.80	
NRG ENERGY INC	7,670	11.03	84,600.10	
OGE ENERGY CORP	4,680	30.40	142,272.00	
P G & E CORP	10,581	59.83	633,061.23	
PINNACLE WEST CAPITAL	2,199	74.11	162,967.89	
PPL CORP	14,578	34.02	495,943.56	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	10,978	40.90	449,000.20	
SCANA CORP	3,153	71.01	223,894.53	
SEMPRA ENERGY	5,067	102.10	517,340.70	
SOUTHERN CO	20,405	50.11	1,022,494.55	
UGI CORP	3,500	44.32	155,120.00	
WEC ENERGY GROUP INC	6,860	57.72	395,959.20	
WESTAR ENERGY INC	2,880	56.60	163,008.00	
XCEL ENERGY INC	11,524	40.36	465,108.64	
ANALOG DEVICES INC	6,481	63.43	411,089.83	
APPLIED MATERIALS INC	24,833	28.22	700,787.26	
BROADCOM LTD	8,560	172.17	1,473,775.20	
INTEL CORP	103,452	33.61	3,477,021.72	
KLA-TENCOR CORPORATION	3,199	74.52	238,389.48	
LAM RESEARCH CORP	3,247	95.00	308,465.00	

	LINEAR TECHNOLOGY CORP	4,954	59.72	295,852.88	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	9,254	12.52	115,860.08	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	5,850	38.95	227,857.50	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	4,614	60.22	277,855.08	
	MICRON TECHNOLOGY INC	23,297	16.68	388,593.96	
	NVIDIA CORP	11,505	67.57	777,392.85	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	6,337	98.70	625,461.90	
	QORVO INC	3,100	51.08	158,348.00	
	QUALCOMM INC	32,462	66.73	2,166,189.26	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	4,200	75.07	315,294.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	22,022	67.60	1,488,687.20	
	XILINX INC	5,075	49.83	252,887.25	
米ドル小計		6,939,036		404,054,400.56	(42,005,495,482)
加ドル	ALTAGAS LTD	3,050	32.04	97,722.00	
	ARC RESOURCES LTD	7,925	22.67	179,659.75	
	CAMECO CORP	7,892	11.07	87,364.44	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	24,024	40.12	963,842.88	
	CENOVUS ENERGY INC	17,463	18.47	322,541.61	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	11,475	15.01	172,239.75	
	ENBRIDGE INC	19,985	55.24	1,103,971.40	
	ENCANA CORP	21,068	13.16	277,254.88	
	HUSKY ENERGY INC	6,873	14.08	96,771.84	
	IMPERIAL OIL LTD	6,942	43.28	300,449.76	
	INTER PIPELINE LTD	7,180	26.57	190,772.60	
	KEYERA CORP	4,120	39.40	162,328.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	7,915	39.11	309,555.65	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	3,680	34.16	125,708.80	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	5,320	28.77	153,056.40	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY -A	5,920	28.54	168,956.80	
	SUNCOR ENERGY INC	36,249	39.13	1,418,423.37	
	TOURMALINE OIL CORP	4,575	33.79	154,589.25	
	TRANSCANADA CORP	17,673	57.94	1,023,973.62	
	VERESEN INC	5,360	12.19	65,338.40	
	VERMILION ENERGY INC	2,640	52.07	137,464.80	

AGNICO EAGLE MINES LTD	4,695	69.26	325,175.70
AGRIUM INC	3,015	119.89	361,468.35
BARRICK GOLD CORP	26,114	24.50	639,793.00
CCL INDUSTRIES INC - CL B	610	239.00	145,790.00
ELDORADO GOLD CORP	14,630	4.39	64,225.70
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	14,710	12.10	177,991.00
FRANCO-NEVADA CORP	3,805	90.30	343,591.50
GOLDCORP INC	17,917	20.50	367,298.50
KINROSS GOLD CORP	25,015	5.50	137,582.50
METHANEX CORP	2,330	46.27	107,809.10
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	17,917	21.37	382,886.29
SILVER WHEATON CORP	9,395	31.90	299,700.50
TECK RESOURCES LTD-CLS B	13,885	28.16	391,001.60
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	23,419	3.92	91,802.48
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,460	45.93	67,057.80
YAMANA GOLD INC	19,626	4.95	97,148.70
BOMBARDIER INC 'B'	34,746	1.78	61,847.88
CAE INC	6,315	18.89	119,290.35
FINNING INTERNATIONAL INC	2,845	23.86	67,881.70
SNC-LAVALIN GROUP INC	3,195	53.33	170,389.35
CANADIAN NATL RAILWAY CO	17,148	83.05	1,424,141.40
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,125	188.25	588,281.25
MAGNA INTERNATIONAL INC	8,378	52.22	437,499.16
GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,400	33.01	178,254.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	4,948	59.53	294,554.44
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	9,685	26.19	253,650.15
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,560	130.69	203,876.40
DOLLARAMA INC	2,510	99.48	249,694.80
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	9,120	66.36	605,203.20
EMPIRE CO LTD 'A'	3,000	18.51	55,530.00
LOBLAW COMPANIES LTD	4,989	64.44	321,491.16
METRO INC	5,790	40.73	235,826.70
WESTON (GEORGE) LTD	1,182	104.25	123,223.50
SAPUTO INC	5,040	47.46	239,198.40
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	6,734	25.74	173,333.16

	BANK OF MONTREAL	13,961	83.83	1,170,350.63	
	BANK OF NOVA SCOTIA	26,129	70.98	1,854,636.42	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	8,295	98.17	814,320.15	
	NATIONAL BANK OF CANADA	7,340	46.83	343,732.20	
	ROYAL BANK OF CANADA	32,539	82.06	2,670,150.34	
	TORONTO-DOMINION BANK	40,690	59.71	2,429,599.90	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	18,933	46.03	871,485.99	
	CI FINANCIAL CORP	5,550	25.05	139,027.50	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	7,180	12.90	92,622.00	
	IGM FINANCIAL INC	2,535	35.74	90,600.90	
	ONEX CORPORATION	1,905	85.79	163,429.95	
	THOMSON REUTERS CORP	8,044	54.80	440,811.20	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	490	692.50	339,325.00	
	GREAT-WEST LIFECO INC	5,974	33.02	197,261.48	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	1,735	50.50	87,617.50	
	INTACT FINANCIAL CORP	2,485	92.02	228,669.70	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	43,001	19.12	822,179.12	
	POWER CORP OF CANADA	7,800	28.29	220,662.00	
	POWER FINANCIAL CORP	5,715	31.21	178,365.15	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	13,374	44.32	592,735.68	
	CGI GROUP INC - CL A	4,650	63.14	293,601.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	420	629.00	264,180.00	
	OPEN TEXT CORP	3,070	81.40	249,898.00	
	BLACKBERRY LTD	10,328	9.36	96,670.08	
	BCE INC	2,930	59.27	173,661.10	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	8,355	52.72	440,475.60	
	TELUS CORP	4,366	42.40	185,118.40	
	ATCO LTD -CLASS I	1,920	46.56	89,395.20	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,590	37.89	98,135.10	
	FORTIS INC	8,595	43.35	372,593.25	
	HYDRO ONE LTD	3,450	24.13	83,248.50	
加ドル小計		865,931		33,410,034.76	(2,594,289,199)
ユーロ	ENI SPA	54,006	12.59	679,935.54	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	9,315	11.81	110,056.72	

NESTE OYJ	2,740	37.70	103,298.00
OMV AG	3,490	27.93	97,475.70
REPSOL SA	24,709	12.40	306,515.14
SAIPEM SPA	123,510	0.36	45,686.34
TECHNIP SA	2,468	58.96	145,513.28
TENARIS SA	9,355	12.87	120,398.85
TOTAL SA	48,847	42.12	2,057,679.87
VOPAK	1,270	44.11	56,019.70
AIR LIQUIDE SA	8,408	90.91	764,371.28
AKZO NOBEL	5,898	57.57	339,547.86
ARCELORMITTAL	38,948	5.92	230,844.79
ARKEMA	1,615	83.58	134,981.70
BASF SE	20,025	77.05	1,542,926.25
COVESTRO AG	1,350	55.42	74,817.00
CRH PLC	19,090	28.78	549,505.65
EVONIK INDUSTRIES AG	3,580	27.04	96,803.20
FUCHS PETROLUB SE-PRF	1,720	37.78	64,990.20
HEIDELBERGCEMENT AG	3,245	84.00	272,580.00
IMERYS SA	830	61.94	51,410.20
K+S AG	3,880	18.46	71,624.80
KONINKLIJKE DSM NV	3,842	55.61	213,653.62
LANXESS AG	1,935	55.35	107,102.25
LINDE AG	4,105	145.85	598,714.25
OCI NV	2,000	11.38	22,770.00
SOLVAY SA	1,581	100.10	158,258.10
STORA ENSO OYJ-R SHS	12,085	8.33	100,668.05
SYMRISE AG	2,640	58.76	155,126.40
THYSSENKRUPP AG	7,415	19.77	146,594.55
UMICORE	2,120	53.94	114,352.80
UPM-KYMMENE OYJ	12,618	20.61	260,056.98
VOESTALPINE AG	2,509	31.38	78,744.96
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4,176	26.25	109,640.88
AIRBUS GROUP SE	12,608	51.92	654,607.36
ALSTOM	3,590	23.72	85,172.75
ANDRITZ AG	1,980	48.11	95,257.80

BOSKALIS WESTMINSTER	1,695	28.17	47,748.15
BOUYGUES SA	4,210	28.26	118,974.60
BRENTAG AG	3,765	47.20	177,726.82
CNH INDUSTRIAL NV	22,370	6.46	144,510.20
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	10,566	38.88	410,806.08
EIFFAGE	1,130	64.52	72,907.60
FERROVIAL SA	9,975	16.73	166,881.75
FERROVIAL SA -RTS	9,975	0.38	3,790.50
GEA GROUP AG	3,940	33.92	133,644.80
HOCHTIEF AG	440	120.50	53,020.00
KONE OYJ-B	7,424	40.61	301,488.64
KONINKLIJKE PHILIPS NV	19,861	26.79	532,175.49
LEGRAND SA	5,628	49.76	280,077.42
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	9,630	10.45	100,633.50
MAN SE	824	92.73	76,409.52
METSO OYJ	2,420	23.48	56,821.60
OSRAM LICHT AG	1,962	49.87	97,844.94
PRYSMIAN SPA	5,185	21.32	110,544.20
REXEL SA	7,240	12.43	90,029.40
SAFRAN SA	6,790	60.06	407,807.40
SCHNEIDER ELECTRIC SE	11,908	59.26	705,668.08
SIEMENS AG-REG	16,826	101.05	1,700,267.30
THALES SA	2,345	84.16	197,355.20
VINCI SA	10,950	62.85	688,207.50
WARTSILA OYJ ABP	3,290	38.24	125,809.60
ZARDOYA OTIS SA	4,418	7.40	32,693.20
ZODIAC AEROSPACE	4,550	21.20	96,482.75
BUREAU VERITAS SA	5,650	17.03	96,247.75
EDENRED	3,906	20.14	78,686.37
RANDSTAD HOLDING NV	2,865	45.60	130,644.00
RELX NV	20,559	14.67	301,703.32
SOCIETE BIC SA	735	123.95	91,103.25
WOLTERS KLUWER	6,927	32.73	226,720.71
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	13,091	13.05	170,903.00
ADP	650	89.80	58,370.00

AENA SA	1,490	128.90	192,061.00
ATLANTIA SPA	9,360	21.33	199,648.80
BOLLORE	20,400	2.85	58,282.80
DEUTCHE LUFTHANSA	5,680	11.68	66,370.80
DEUTSCHE POST AG-REG	20,993	27.87	585,074.91
FRAPORT AG	980	53.16	52,096.80
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	8,760	8.50	74,460.00
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	16,992	4.88	83,022.91
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	7,155	75.46	539,916.30
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,190	65.77	78,266.30
CONTINENTAL AG	2,345	167.30	392,318.50
DAIMLER AG	21,012	61.85	1,299,592.20
FERRARI NV	3,164	46.08	145,797.12
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	19,647	6.13	120,436.11
MICHELIN (CGDE)-B	4,149	94.86	393,574.14
NOKIAN RENKAAT OYJ	2,915	32.14	93,688.10
PEUGEOT SA	9,800	13.14	128,821.00
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	3,490	46.60	162,651.45
RENAULT SA	4,117	75.01	308,816.17
SCHAEFFLER AG-PRF	3,550	13.04	46,292.00
VALEO SA	4,860	49.89	242,489.70
VOLKSWAGEN AG	771	127.55	98,341.05
VOLKSWAGEN AG-PFD	4,003	118.70	475,156.10
ADIDAS AG	4,141	133.05	550,960.05
CHRISTIAN DIOR SE	1,310	172.35	225,778.50
HERMES INTERNATIONAL	652	365.75	238,469.00
HUGO BOSS AG -ORD	1,490	58.82	87,641.80
KERING	1,827	194.65	355,625.55
LUXOTTICA GROUP SPA	3,976	46.80	186,076.80
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	6,094	161.70	985,399.80
ACCOR SA	4,136	32.65	135,061.08
PADDY POWER BETFAIR PLC	1,800	100.50	180,900.00
SODEXO	1,970	100.90	198,773.00
ALTICE NV -A	8,340	15.29	127,560.30
ALTICE NV -B	1,940	15.48	30,040.90

AXEL SPRINGER SE	995	43.70	43,486.47
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	18.41	69,865.95
JC DECAUX SA	1,950	24.34	47,463.00
LAGARDERE S.C.A.	2,980	22.83	68,048.30
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	4,805	35.06	168,487.32
PUBLICIS GROUPE	4,075	60.25	245,518.75
RTL GROUP	920	68.17	62,716.40
SES	8,600	20.53	176,558.00
TELENET GROUP HOLDING NV	1,240	46.96	58,236.60
VIVENDI	25,330	18.09	458,346.35
INDITEX	24,265	30.76	746,391.40
ZALANDO SE	1,700	38.41	65,305.50
CARREFOUR SA	12,213	23.65	288,837.45
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,344	45.49	61,145.28
COLRUYT SA	1,375	48.40	66,550.00
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	11,008	4.72	52,056.83
JERONIMO MARTINS	5,075	15.57	79,017.75
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	28,248	19.95	563,547.60
METRO AG	4,140	26.69	110,517.30
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	17,611	101.65	1,790,158.15
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	4,910	34.33	168,584.85
DANONE	13,044	61.22	798,553.68
HEINEKEN HOLDING NV	2,125	68.30	145,137.50
HEINEKEN NV	5,033	72.85	366,654.05
KERRY GROUP PLC-A	3,380	66.75	225,615.00
PERNOD-RICARD SA	4,646	104.55	485,739.30
REMY COINTREAU	470	71.37	33,543.90
BEIERSDORF AG	2,015	81.49	164,202.35
HENKEL AG & CO KGAA	2,190	96.33	210,962.70
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	3,953	112.80	445,898.40
L'OREAL	5,526	165.10	912,342.60
UNILEVER NV-CVA	35,715	37.40	1,335,741.00
ESSILOR INTERNATIONAL	4,465	101.00	450,965.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	4,683	73.50	344,200.50
FRESENIUS SE & CO KGAA	9,065	64.90	588,318.50

BAYER AG	18,120	87.92	1,593,110.40
GRIFOLS SA	6,820	17.44	118,940.80
MERCK KGAA	2,930	91.17	267,128.10
ORION OYJ-CLASS B	2,590	38.40	99,456.00
QIAGEN N.V.	5,145	23.90	122,965.50
SANOFI	25,516	71.56	1,825,924.96
UCB SA	2,798	59.33	166,005.34
ABN AMRO GROUP NV-CVA	4,670	20.01	93,470.05
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	142,393	6.19	882,267.02
BANCO DE SABADELL SA	109,692	1.21	132,727.32
BANCO POPULAR ESPANOL	75,856	0.92	70,470.22
BANCO SANTANDER SA	315,079	4.29	1,353,894.46
BANK OF IRELAND	558,550	0.19	110,592.90
BANKIA SA	95,000	0.78	74,765.00
BANKINTER SA	13,960	6.89	96,184.40
BNP PARIBAS	23,142	50.64	1,171,910.88
CAIXABANK S.A	68,530	2.68	183,797.46
COMMERZBANK AG	23,524	5.98	140,791.14
CREDIT AGRICOLE SA	21,992	9.51	209,341.84
ERSTE GROUP BANK AG	6,438	26.19	168,611.22
ING GROEP NV-CVA	85,185	11.95	1,017,960.75
INTESA SANPAOLO	292,263	2.00	586,279.57
KBC GROEP NV	5,519	54.55	301,061.45
MEDIOBANCA SPA	11,670	6.36	74,221.20
NATIXIS	22,980	4.36	100,399.62
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	2,770	14.80	41,009.85
SOCIETE GENERALE	17,659	35.58	628,307.22
UBI BANCA SCPA	22,584	2.30	52,123.87
UNICREDIT SPA	110,353	2.12	234,389.77
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	30,335	12.23	370,997.05
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	4,000	67.54	270,160.00
EURAZEO	958	50.27	48,158.66
EXOR SPA	2,944	35.47	104,423.68
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,882	74.96	141,074.72
WENDEL	750	101.25	75,937.50

AEGON NV	38,139	3.80	144,966.33
AGEAS	4,044	31.31	126,617.64
ALLIANZ SE-REG	9,948	136.45	1,357,404.60
ASSICURAZIONI GENERALI	25,868	11.07	286,358.76
AXA	42,162	19.39	817,521.18
CNP ASSURANCES	3,530	15.48	54,644.40
HANNOVER RUECK SE-REG	1,355	97.81	132,532.55
MAPFRE SA	20,814	2.62	54,699.19
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,646	171.55	625,471.30
NN GROUP NV	7,180	26.55	190,629.00
POSTE ITALIANE SPA	10,260	5.92	60,739.20
SAMPO OYJ-A SHS	9,639	40.12	386,716.68
SCOR SE	3,152	28.25	89,059.76
UNIPOLSAI SPA	18,580	1.63	30,341.14
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	7,500	29.29	219,675.00
IMMOEAST AG-TEMPORARY	16,150	-	-
IMMOFINANZ AG-TEMPORARY	13,000	-	-
VONOVIA SE	10,088	31.72	319,991.36
AMADEUS IT GROUP SA	9,610	41.57	399,487.70
ATOS SE	2,060	94.00	193,640.00
CAP GEMINI SA	3,639	74.17	269,904.63
DASSAULT SYSTEMES SA	2,790	70.39	196,388.10
GEMALTO	1,850	48.04	88,874.00
SAP SE	21,622	77.10	1,667,056.20
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2,930	36.36	106,549.45
INGENICO GROUP	1,160	70.56	81,849.60
NOKIA OYJ	126,056	3.85	486,324.04
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	70,416	14.35	1,010,469.60
ELISA OYJ	2,505	29.79	74,623.95
ILIAD SA	520	179.75	93,470.00
KONINKLIJKE KPN NV	75,066	2.82	212,061.45
ORANGE S.A.	43,324	13.80	597,871.20
PROXIMUS	3,780	25.62	96,862.50
SFR GROUP SA	2,250	22.17	49,882.50
TELECOM ITALIA SPA	239,753	0.75	179,814.75

	TELECOM ITALIA-RSP	125,887	0.61	77,924.05	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16,000	3.43	54,944.00	
	TELEFONICA SA	98,419	8.86	872,189.17	
	E.ON SE	44,099	6.34	279,764.05	
	EDF	6,075	9.78	59,425.65	
	ENAGAS	5,680	25.12	142,681.60	
	ENDESA SA	6,840	18.67	127,737.00	
	ENEL SPA	167,087	3.81	637,938.16	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	54,991	2.85	156,724.35	
	ENGIE	32,514	12.74	414,390.93	
	FORTUM OYJ	9,825	14.80	145,410.00	
	GAS NATURAL SDG SA	7,722	17.20	132,818.40	
	IBERDROLA SA	117,842	6.02	709,408.84	
	INNOGY SE	2,850	34.75	99,051.75	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	10,440	18.02	188,181.00	
	RWE AG	10,685	13.94	149,002.32	
	SNAM SPA	59,470	4.58	272,372.60	
	SUEZ	6,199	13.30	82,477.69	
	TERNA SPA	34,477	4.22	145,699.80	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	9,184	17.67	162,327.20	
	ASML HOLDING NV	7,962	92.38	735,529.56	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	24,715	15.48	382,588.20	
	STMICROELECTRONICS NV	12,733	8.10	103,200.96	
	ユーロ小計	5,045,270		69,703,727.19	(8,038,930,856)
英債券	BP PLC	408,298	4.46	1,822,846.42	
	PETROFAC LTD	5,025	7.66	38,516.62	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	93,768	20.16	1,890,831.72	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	82,039	20.90	1,715,025.29	
	ANGLO AMERICAN PLC	30,274	10.71	324,385.91	
	ANTOFAGASTA PLC	8,730	5.31	46,399.95	
	BHP BILLITON PLC	45,961	11.66	535,905.26	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	2,751	32.59	89,655.09	
	FRESNILLO PLC	5,160	16.25	83,850.00	
	GLENCORE PLC	266,823	2.37	634,505.09	

JOHNSON MATTHEY PLC	4,199	32.42	136,131.58
MONDI PLC	7,400	15.50	114,700.00
RANDGOLD RESOURCES LTD	2,250	67.90	152,775.00
RIO TINTO PLC	27,025	27.27	737,106.87
ASHTED GROUP PLC	10,920	12.17	132,896.40
BAE SYSTEMS PLC ORD	69,635	5.39	375,332.65
BUNZL PLC	7,276	21.00	152,796.00
COBHAM PLC	34,837	1.45	50,513.65
DCC PLC	1,810	63.25	114,482.50
IMI PLC	6,116	9.48	57,979.68
MEGGITT PLC	13,905	4.27	59,416.06
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	43,425	7.12	309,403.12
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C	1,997,550	0.00	1,997.55
SMITHS GROUP PLC	8,813	13.72	120,914.36
TRAVIS PERKINS PLC	5,800	13.49	78,242.00
WEIR GROUP PLC/THE	3,880	15.80	61,304.00
WOLSELEY PLC	5,594	41.42	231,703.48
AGGREKO PLC	6,006	8.07	48,468.42
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,275	9.60	60,240.00
CAPITA PLC	15,309	5.69	87,184.75
EXPERIAN PLC	20,558	14.93	306,930.94
G4S PLC	34,639	2.44	84,692.35
INTERTEK GROUP PLC	3,545	32.21	114,184.45
RELX PLC	23,666	13.83	327,300.78
EASYJET PLC	3,840	9.83	37,766.40
ROYAL MAIL PLC	19,950	4.88	97,375.95
GKN PLC	33,065	3.02	100,153.88
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	22,900	4.57	104,721.70
BERKELEY GROUP HOLDINGS	2,600	23.45	60,970.00
BURBERRY GROUP PLC	10,304	14.15	145,801.60
PERSIMMON PLC	7,000	16.77	117,390.00
TAYLOR WIMPEY PLC	73,610	1.41	104,305.37
CARNIVAL PLC	4,400	38.47	169,268.00
COMPASS GROUP PLC	36,617	13.91	509,342.47
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	4,031	30.21	121,776.51

MERLIN ENTERTAINME	15,550	4.39	68,373.35
TUI AG-DI	11,263	10.28	115,783.64
WHITBREAD PLC	4,140	35.56	147,218.40
WILLIAM HILL PLC	18,010	2.89	52,084.92
ITV PLC	77,235	1.68	129,754.80
PEARSON PLC	17,749	7.26	128,857.74
SKY PLC	23,224	8.11	188,346.64
WPP PLC	28,904	16.95	489,922.80
DIXONS CARPHONE PLC	22,000	3.23	71,214.00
KINGFISHER PLC	50,397	3.58	180,774.03
MARKS & SPENCER GROUP PLC	34,970	3.44	120,331.77
NEXT PLC	2,987	49.42	147,617.54
SAINSBURY (J) PLC	44,761	2.54	114,051.02
TESCO PLC	177,834	2.02	360,113.85
WM MORRISON SUPERMARKETS	49,255	2.19	108,016.21
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	7,795	24.70	192,536.50
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	40,807	45.20	1,844,476.40
COCA-COLA HBC AG-CDI	5,000	17.28	86,400.00
DIAGEO PLC	55,192	20.58	1,136,127.32
IMPERIAL BRANDS PLC	21,062	38.21	804,779.02
TATE & LYLE PLC	10,510	7.57	79,560.70
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	13,925	69.80	971,965.00
UNILEVER PLC	28,167	33.18	934,581.06
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	7,000	8.78	61,460.00
SMITH & NEPHEW PLC	19,376	11.25	217,980.00
ASTRAZENECA PLC	27,713	43.68	1,210,503.84
GLAXOSMITHKLINE PLC	106,671	15.28	1,630,466.23
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2,860	16.26	46,503.60
SHIRE PLC	19,725	44.28	873,423.00
BARCLAYS PLC	364,051	1.81	660,206.48
HSBC HOLDINGS PLC	435,221	5.94	2,588,694.50
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,410,966	0.55	782,521.74
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	79,530	1.85	147,130.50
STANDARD CHARTERED PLC	72,250	6.32	457,270.25
3I GROUP PLC	20,499	6.32	129,553.68

	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	22,730	3.04	69,235.58	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,720	11.55	66,066.00	
	ICAP PLC	12,270	4.74	58,172.07	
	INVESTEC PLC	13,185	4.86	64,092.28	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	6,577	27.07	178,039.39	
	PROVIDENT FINANCIAL PLC	3,310	28.25	93,507.50	
	SCHRODERS PLC	2,971	27.71	82,326.41	
	ADMIRAL GROUP PLC	4,925	18.73	92,245.25	
	AVIVA PLC	89,285	4.18	374,014.86	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	29,333	3.44	101,081.51	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	127,081	2.07	263,947.23	
	OLD MUTUAL PLC	104,159	1.87	195,298.12	
	PRUDENTIAL PLC	56,542	13.04	737,590.39	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	24,738	5.25	129,874.50	
	ST JAMES'S PLACE PLC	11,000	9.08	99,935.00	
	STANDARD LIFE PLC	40,716	3.31	134,892.10	
	AUTO TRADER GROUP PLC	23,390	3.67	85,864.69	
	SAGE GROUP PLC/THE	24,400	6.83	166,774.00	
	WORLDPAY GROUP PLC	42,180	2.82	118,947.60	
	BT GROUP PLC	183,192	3.61	662,330.67	
	INMARSAT PLC	10,010	7.67	76,826.75	
	VODAFONE GROUP PLC	581,048	2.13	1,241,409.05	
	CENTRICA PLC	119,035	2.10	250,449.64	
	NATIONAL GRID PLC	82,285	10.17	836,838.45	
	SEVERN TRENT PLC	5,493	22.47	123,427.71	
	SSE PLC	21,427	15.71	336,618.17	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	16,215	9.23	149,745.52	
英債券小計		8,517,395		36,735,640.79	(4,764,245,254)
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	220	497.50	109,450.00	
	GIVAUDAN-REG	203	1,856.00	376,768.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	9,939	51.35	510,367.65	
	SIKA AG-BR	47	4,643.00	218,221.00	
	SYNGENTA AG-REG	2,108	384.00	809,472.00	
	ABB LTD-REG	42,515	19.91	846,473.65	

GEBERIT AG-REG	805	402.50	324,012.50		
SCHINDLER HOLDING AG-REG	360	178.60	64,296.00		
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,090	179.40	195,546.00		
ADECCO GROUP AG-REG	3,557	57.05	202,926.85		
SGS SA-REG	133	1,980.00	263,340.00		
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,150	131.80	151,570.00		
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	11,809	66.35	783,527.15		
SWATCH GROUP AG/THE-BR	680	293.40	199,512.00		
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,350	56.50	76,275.00		
DUFREY AG-REG	1,050	125.80	132,090.00		
ARYZTA AG	2,110	42.03	88,683.30		
BARRY CALLEBAUT AG-REG	45	1,229.00	55,305.00		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	25	5,160.00	129,000.00		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	62,000.00	124,000.00		
NESTLE SA-REG	69,893	70.50	4,927,456.50		
SONOVA HOLDING AG-REG	1,160	126.70	146,972.00		
ACTELION LTD-REG	2,310	135.30	312,543.00		
GALENICA AG-REG	70	972.50	68,075.00		
LONZA GROUP AG-REG	1,250	177.80	222,250.00		
NOVARTIS AG-REG	49,003	68.15	3,339,554.45		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	15,428	220.10	3,395,702.80		
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	41,158	12.15	500,069.70		
JULIUS BAER GROUP LTD	5,210	38.29	199,490.90		
PARGESA HOLDING SA-BR	655	62.95	41,232.25		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	370	490.00	181,300.00		
UBS GROUP AG-REG	79,852	13.16	1,050,852.32		
BALOISE HOLDING AG - REG	1,080	118.20	127,656.00		
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	640	253.50	162,240.00		
SWISS RE AG	7,439	89.25	663,930.75		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,301	249.10	822,279.10		
SWISS PRIME SITE-REG	1,840	79.70	146,648.00		
SWISSCOM AG-REG	584	441.20	257,660.80		
スイスフラン小計	360,441		22,226,749.67 (2,372,705,527)		
スウェーデン	LUNDIN PETROLEUM AB	4,320	157.90	682,128.00	

ローナ	BOLIDEN AB	7,260	202.80	1,472,328.00	
	ALFA LAVAL AB	6,930	126.60	877,338.00	
	ASSA ABLOY AB-B	20,910	162.70	3,402,057.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	15,185	254.20	3,860,027.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	8,620	226.60	1,953,292.00	
	SANDVIK AB	21,690	97.95	2,124,535.50	
	SKANSKA AB-B SHS	7,170	191.50	1,373,055.00	
	SKF AB-B SHARES-B	8,909	144.90	1,290,914.10	
	VOLVO AB-B SHS-B	33,960	91.45	3,105,642.00	
	SECURITAS AB-B SHS	7,249	137.30	995,287.70	
	ELECTROLUX AB - B	5,455	215.10	1,173,370.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	8,480	66.15	560,952.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	20,568	252.50	5,193,420.00	
	ICA GRUPPEN AB	1,450	270.50	392,225.00	
	SWEDISH MATCH AB	4,860	302.20	1,468,692.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	13,015	252.40	3,284,986.00	
	GETINGE AB-B SHS	4,450	145.10	645,695.00	
	NORDEA BANK AB	64,688	91.70	5,931,889.60	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	31,870	88.60	2,823,682.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	32,620	119.20	3,888,304.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	19,900	206.00	4,099,400.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,400	154.40	679,360.00	
	INVESTOR AB-B SHS	10,175	306.40	3,117,620.00	
	KINNEVIK AB - B	5,505	218.00	1,200,090.00	
	ERICSSON LM-B SHS	64,235	43.93	2,821,843.55	
	HEXAGON AB-B SHS	5,930	313.70	1,860,241.00	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,370	374.00	512,380.00		
TELE2 AB-B SHS	6,255	71.10	444,730.50		
TELE2 AB-RIGHTS B-RTS	6,255	2.32	14,511.60		
TELIA CO AB	53,480	34.74	1,857,895.20		
スウェーデンクローナ小計	507,164		63,107,892.25	(731,420,471)	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	24,664	132.00	3,255,648.00	
	NORSK HYDRO A S	30,900	36.52	1,128,468.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	3,780	284.90	1,076,922.00	

	SCHIBSTED ASA-B SHS	2,400	192.20	461,280.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	1,650	200.50	330,825.00	
	MARINE HARVEST	7,720	144.30	1,113,996.00	
	ORKLA ASA	19,380	78.25	1,516,485.00	
	DNB ASA	22,215	116.80	2,594,712.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,200	139.50	585,900.00	
	TELENOR ASA	17,305	128.00	2,215,040.00	
ノルウェークローネ小計		134,214		14,279,276.00	(181,917,976)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,890	385.60	728,784.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	4,865	244.80	1,190,952.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	4,690	497.80	2,334,682.00	
	ISS A/S	3,100	247.00	765,700.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	90	8,975.00	807,750.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	138	9,430.00	1,301,340.00	
	DSV A/S	4,320	310.20	1,340,064.00	
	PANDORA A/S	2,500	805.00	2,012,500.00	
	CARLSBERG AS-B	2,390	595.50	1,423,245.00	
	COLOPLAST-B	2,545	442.70	1,126,671.50	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	3,000	124.10	372,300.00	
	GENMAB A/S	1,280	1,158.00	1,482,240.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	41,685	229.30	9,558,370.50	
	DANSKE BANK A/S	14,975	199.10	2,981,522.50	
TRYG A/S	2,575	129.00	332,175.00		
TDC A/S	14,545	35.61	517,947.45		
デンマーククローネ小計		104,588		28,276,243.95	(438,281,781)
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	5,335	30.05	160,316.75	
	OIL SEARCH LTD	36,460	6.54	238,448.40	
	ORIGIN ENERGY LTD	41,910	5.17	216,674.70	
	SANTOS LTD	37,665	3.37	126,931.05	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	16,528	27.90	461,131.20	
	ALUMINA LTD	46,512	1.54	71,628.48	
	AMCOR LIMITED	26,490	14.45	382,780.50	
	BHP BILLITON LTD	70,216	22.27	1,563,710.32	

BORAL LTD	17,115	5.78	98,924.70
FORTECUE METALS GROUP LTD	29,665	5.29	156,927.85
INCITEC PIVOT LTD	31,550	2.94	92,757.00
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	10,985	18.74	205,858.90
NEWCREST MINING LTD	17,209	23.70	407,853.30
ORICA LIMITED	6,935	16.90	117,201.50
RIO TINTO LTD	9,978	53.31	531,927.18
SOUTH32 LTD	117,667	2.53	297,697.51
CIMIC GROUP LTD	1,867	28.42	53,060.14
BRAMBLES LTD	35,548	11.21	398,493.08
SEEK LTD	8,040	14.01	112,640.40
AURIZON HOLDINGS LTD	46,150	4.71	217,366.50
QANTAS AIRWAYS LTD	13,113	2.92	38,289.96
SYDNEY AIRPORT	24,156	6.20	149,767.20
TRANSURBAN GROUP	43,195	10.27	443,612.65
ARISTOCRAT LEISURE LTD	12,510	14.81	185,273.10
CROWN RESORTS LTD	6,745	10.53	71,024.85
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,180	66.30	78,234.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	970	30.30	29,391.00
TABCORP HOLDINGS LTD	15,336	4.69	71,925.84
TATTS GROUP LTD	37,700	3.97	149,669.00
REA GROUP LTD	1,150	47.85	55,027.50
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	14,370	4.95	71,131.50
WESFARMERS LTD	24,485	40.40	989,194.00
WOOLWORTHS LTD	27,662	22.96	635,119.52
COCA-COLA AMATIL LTD	10,650	9.45	100,642.50
TREASURY WINE ESTATES LTD	15,946	10.45	166,635.70
COCHLEAR LTD	1,277	124.12	158,501.24
HEALTHSCOPE LTD	44,380	2.19	97,192.20
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,935	70.64	207,328.40
SONIC HEALTHCARE LTD	9,830	20.28	199,352.40
CSL LTD	10,012	98.66	987,783.92
AUST AND NZ BANKING GROUP	63,819	26.94	1,719,283.86
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	8,120	10.02	81,362.40
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	10,478	10.53	110,333.34

	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	37,567	70.99	2,666,881.33	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	58,163	25.88	1,505,258.44	
	WESTPAC BANKING CORP	73,131	29.71	2,172,722.01	
	AMP LTD	62,647	4.53	283,790.91	
	ASX LTD	4,995	45.86	229,070.70	
	CHALLENGER LTD	9,950	10.12	100,694.00	
	MACQUARIE GROUP LTD	6,754	77.10	520,733.40	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	50,298	5.24	263,561.52	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	62,000	2.49	154,380.00	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	29,380	9.71	285,279.80	
	SUNCORP GROUP LTD	29,020	11.55	335,181.00	
	COMPUTERSHARE LTD	11,490	10.29	118,232.10	
	TELSTRA CORPORATION LTD	93,164	4.90	456,503.60	
	TPG TELECOM LTD	7,200	7.19	51,768.00	
	VOCUS COMMUNICATIONS LTD	12,010	5.40	64,854.00	
	AGL ENERGY LTD	15,301	19.76	302,347.76	
	AUSNET SERVICES	40,750	1.49	60,717.50	
	DUET GROUP	54,050	2.31	124,855.50	
豪ドル小計		1,671,714		22,405,237.11	(1,787,489,816)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	17,130	9.72	166,503.60	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	24,545	6.33	155,369.85	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	8,500	8.48	72,080.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	45,157	3.41	154,211.15	
	CONTACT ENERGY LIMITED	19,340	4.73	91,478.20	
	MERIDIAN ENERGY LTD	28,000	2.54	71,120.00	
ニュージーランドドル小計		142,672		710,762.80	(54,110,371)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	58,208	95.50	5,558,864.00	
	NWS HOLDINGS LTD	28,500	13.30	379,050.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	25,000	10.30	257,500.00	
	MTR CORP	34,000	42.55	1,446,700.00	
	LI & FUNG LTD	138,000	3.77	520,260.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	29,000	28.40	823,600.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	14,500	29.00	420,500.00	

	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	50,000	31.75	1,587,500.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	16,800	13.60	228,480.00	
	SANDS CHINA LTD	49,800	34.05	1,695,690.00	
	SJM HOLDINGS LTD	48,000	5.39	258,720.00	
	WYNN MACAU LTD	35,800	11.10	397,380.00	
	WH GROUP LTD	153,500	6.20	951,700.00	
	BANK OF EAST ASIA	21,640	30.95	669,758.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	77,000	27.25	2,098,250.00	
	HANG SENG BANK LTD	16,300	141.20	2,301,560.00	
	FIRST PACIFIC CO	44,250	5.52	244,260.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	24,500	199.70	4,892,650.00	
	AIA GROUP LTD	264,200	47.80	12,628,760.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	60,208	57.90	3,486,043.20	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	57,000	16.72	953,040.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	26,842	45.75	1,228,021.50	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	15,000	35.40	531,000.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	11,450	24.55	281,097.50	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	134,666	9.75	1,312,993.50	
	SINO LAND CO	63,050	12.66	798,213.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	33,480	115.40	3,863,592.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	13,017	80.70	1,050,471.90	
	SWIRE PROPERTIES LTD	23,200	22.15	513,880.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	27,800	57.60	1,601,280.00	
	WHEELOCK & CO LTD	19,600	47.60	932,960.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	67,000	10.38	695,460.00	
	PCCW LTD	80,000	4.51	360,800.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	15,000	65.55	983,250.00	
	CLP HOLDINGS LTD	38,000	78.20	2,971,600.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	56,000	7.58	424,480.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	179,925	15.10	2,716,867.50	
	POWER ASSETS HOLDINGS	32,500	73.65	2,393,625.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	4,200	75.50	317,100.00	
香港ドル小計		2,086,936		64,776,957.10	(868,011,225)
シンガポールド	KEPPEL CORP LTD	34,660	5.25	181,965.00	

ル	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	21,000	2.51	52,710.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,000	3.05	100,650.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,000	2.45	112,700.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	12,800	9.95	127,360.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	156,500	0.85	133,025.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	32,550	3.71	120,760.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,000	41.90	83,800.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	130,000	0.36	46,800.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	44,700	3.25	145,275.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	36,715	14.93	548,154.95	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	68,240	8.43	575,263.20	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	29,200	18.44	538,448.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	20,000	6.99	139,800.00	
	CAPITALAND LTD	68,600	3.04	208,544.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	10,000	8.42	84,200.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	60,000	2.06	123,600.00	
	UOL GROUP LTD	12,250	5.65	69,212.50	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	172,180	3.85	662,893.00	
シンガポールドル小計		990,395		4,055,161.15	(304,096,534)
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	9,770	14.00	136,780.00	
	BANK HAPOLIM BM	27,725	21.90	607,177.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	36,465	14.70	536,035.50	
	NICE LTD	1,385	249.20	345,142.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	48,790	6.99	341,432.42	
イスラエルシュケル小計		124,135		1,966,567.42	(53,962,610)
合 計		27,489,891		64,194,957,102	(64,194,957,102)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2)株式以外の有価証券

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

米ドル	出資金	PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A-LP	5,400.00	63,666.00	
	出資金小計		5,400.00	63,666.00	(6,618,717)
	投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	7,010	138,167.10	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	1,490	153,470.00	
		AMERICAN TOWER CORP	9,269	1,047,211.62	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	20,020	206,206.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,085	529,416.85	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,417	396,645.36	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	7,800	187,434.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,940	158,595.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	7,430	652,428.30	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,235	293,835.05	
		DUKE REALTY CORPORATION	6,875	169,812.50	
		EQUINIX INC	1,478	503,288.56	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	7,980	491,488.20	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,400	308,182.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	2,800	200,648.00	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,415	195,609.60	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	12,545	309,610.60	
		HCP INC	10,125	298,890.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	16,589	251,489.24	
		IRON MOUNTAIN INC	5,515	178,906.60	
		KIMCO REALTY CORPORATION	8,795	220,578.60	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	120,535.36	
		MACERICH CO/THE	2,870	193,925.90	
		MID AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	1,500	141,225.00	
		PROLOGIS INC	11,402	562,574.68	
		PUBLIC STORAGE	3,209	659,256.96	
		QUALITY CARE PROPERTIES	2,025	27,337.50	
		REALTY INCOME CORP	5,400	309,852.00	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	2,355	163,248.60	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	6,814	1,228,427.92	
		SL GREEN REALTY CORP	2,260	217,073.00	
		UDR INC	5,820	201,197.40	

		VENTAS INC	7,285	462,014.70
		VEREIT INC	24,234	214,713.24
		VORNADO REALTY TRUST	3,811	336,206.42
		WELLTOWER INC	7,680	500,275.20
		WEYERHAEUSER CO	16,498	472,667.70
	投資証券小計		246,489	12,702,444.76 (1,320,546,157)
米ドル小計			251,889	12,766,110.76 (1,327,164,874)
加ドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2,340	52,673.40
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,380	89,096.80
加ドル小計			5,720	141,770.20 (11,008,456)
ユーロ	投資証券	FONCIERE DES REGIONS	595	45,850.70
		GECINA SA	970	125,081.50
		ICADE	685	43,627.65
		KLEPIERRE	4,732	171,535.00
		UNIBAIL-RODAMCO SE-NA	2,070	437,184.00
ユーロ小計			9,052	823,278.85 (94,948,749)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	21,701	128,144.40
		HAMMERSON PLC	15,295	83,510.70
		INTU PROPERTIES PLC	19,860	52,787.88
		LAND SECURITIES GROUP PLC	16,229	159,206.49
		SEGRO PLC	15,053	63,373.13
英ポンド小計			88,138	487,022.60 (63,161,960)
豪ドル	投資証券	APA GROUP	26,406	207,815.22
		DEXUS PROPERTY GROUP	18,487	165,273.78
		GOODMAN GROUP	39,332	265,491.00
		GPT GROUP	44,885	207,368.70
		LENDLEASE GROUP	12,197	160,146.61
		MIRVAC GROUP	86,525	175,645.75
		SCENTRE GROUP	116,381	505,093.54
		STOCKLAND	55,310	241,151.60
		VICINITY CENTRES	72,862	208,385.32

		WESTFIELD CORP	41,745	361,094.25	
豪ドル小計			514,130	2,497,465.77	(199,247,819)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	48,000	2,618,400.00	
香港ドル小計			48,000	2,618,400.00	(35,086,560)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	51,900	119,370.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	40,000	61,600.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	66,300	132,268.50	
		SUNTEC REIT	45,000	74,025.00	
シンガポールドル小計			203,200	387,263.50	(29,040,889)
合計				1,759,659,307	(1,759,659,307)

(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 593銘柄	97.0%			63.7%
	投資証券 37銘柄			3.0%	2.0%
加ドル	株式 87銘柄	99.6%			3.9%
	投資証券 2銘柄			0.4%	0.0%
ユーロ	株式 235銘柄	98.8%			12.2%
	投資証券 5銘柄			1.2%	0.1%
英ポンド	株式 107銘柄	98.7%			7.2%
	投資証券 5銘柄			1.3%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%			3.6%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	100.0%			1.1%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 16銘柄	100.0%			0.7%

豪ドル	株式	61銘柄	90.0%			2.7%
	投資証券	10銘柄			10.0%	0.3%
ニュージーランドドル	株式	6銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式	39銘柄	96.1%			1.3%
	投資証券	1銘柄			3.9%	0.1%
シンガポールドル	株式	19銘柄	91.3%			0.5%
	投資証券	4銘柄			8.7%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	5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27年11月 6日現在	平成28年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	24,187,688	390,348,219
国債証券	27,814,501,380	26,006,422,471
地方債証券	2,220,325,000	2,106,880,000
特殊債証券	2,709,076,000	3,941,803,000
社債証券	1,885,695,000	1,789,226,767
未収利息	97,015,981	88,951,831
前払費用	2,206,124	352,372
流動資産合計	34,753,007,173	34,323,984,660
資産合計	34,753,007,173	34,323,984,660
負債の部		
流動負債		
未払金	-	300,006,000
未払解約金	11,984,692	31,278,128
未払利息	-	370
流動負債合計	11,984,692	331,284,498
負債合計	11,984,692	331,284,498
純資産の部		
元本等		
元本	25,981,130,487	24,222,472,005

平成27年11月 6日現在

平成28年11月 7日現在

剰余金		
剰余金又は欠損金()	8,759,891,994	9,770,228,157
元本等合計	34,741,022,481	33,992,700,162
純資産合計	34,741,022,481	33,992,700,162
負債純資産合計	34,753,007,173	34,323,984,660

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27年11月 6日現在	平成28年11月 7日現在
1.	期首	平成26年11月 7日	平成27年11月 7日
	期首元本額	26,334,764,871円	25,981,130,487円
	期首からの追加設定元本額	2,296,184,953円	2,142,590,494円
	期首からの一部解約元本額	2,649,819,337円	3,901,248,976円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス(株式20)	774,362,827円	880,051,229円
	DCインデックスバランス(株式40)	1,004,200,115円	1,026,669,053円
	DCインデックスバランス(株式60)	711,422,777円	697,363,697円
	DCインデックスバランス(株式80)	129,493,345円	119,445,273円
	インデックスファンド日本債券(DC専用)	1,453,229,784円	1,560,296,614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	5,425,859,764円	4,432,641,156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	4,785,949円	4,266,985円
	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(債券資産)	49,382,817円	-円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	5,194,004円	4,443,290円

アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	28,565,870円	24,562,184円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	113,561,274円	97,787,649円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	399,836,338円	365,614,728円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	6,647,988,644円	5,536,506,848円
世界アセットバランスファンド40（適格機関投資家向け）	47,033,167円	37,661,156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）	146,657,163円	119,343,818円
グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	31,066,594円	25,020,332円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	1,125,261,839円	1,113,560,535円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,161,341,148円	1,123,465,664円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	604,250,232円	562,577,142円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	92,713,905円	83,961,598円
インデックスファンド日本債券（1年決算型）	5,828,941,399円	6,182,123,593円
日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	195,981,532円	225,109,461円
計	25,981,130,487円	24,222,472,005円
2. 受益権の総数	25,981,130,487口	24,222,472,005口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成26年11月 7日 至 平成27年11月 6日	自 平成27年11月 7日 至 平成28年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左
----------------	---	----

金融商品の時価等に関する事項

	平成27年11月 6日現在	平成28年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成27年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	16,089,210
地方債証券	1,018,000
特殊債証券	1,895,000
社債証券	183,000
合計	19,185,210

(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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成27年11月 6日現在		平成28年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	1.3372円	1口当たり純資産額	1.4034円
(1万口当たり純資産額)	(13,372円)	(1万口当たり純資産額)	(14,034円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第357回利付国債（2年）	38,000,000	38,150,761	
	第106回利付国債（5年）	14,000,000	14,057,956	
	第107回利付国債（5年）	705,000,000	709,046,700	
	第109回利付国債（5年）	180,000,000	180,981,000	

第111回利付国債(5年)	40,000,000	40,382,000	
第112回利付国債(5年)	70,000,000	70,775,600	
第114回利付国債(5年)	90,000,000	90,977,400	
第116回利付国債(5年)	110,000,000	111,097,800	
第117回利付国債(5年)	90,000,000	90,992,700	
第118回利付国債(5年)	100,000,000	101,209,000	
第119回利付国債(5年)	74,000,000	74,700,040	
第120回利付国債(5年)	330,000,000	334,280,100	
第121回利付国債(5年)	100,000,000	101,009,000	
第122回利付国債(5年)	300,000,000	303,198,000	
第123回利付国債(5年)	505,000,000	510,640,850	
第124回利付国債(5年)	560,000,000	566,624,800	
第125回利付国債(5年)	325,000,000	329,049,500	
第126回利付国債(5年)	220,000,000	222,873,200	
第1回利付国債(40年)	40,000,000	61,860,000	
第2回利付国債(40年)	165,000,000	247,608,900	
第3回利付国債(40年)	50,000,000	75,598,500	
第4回利付国債(40年)	95,000,000	144,903,500	
第5回利付国債(40年)	35,000,000	51,470,300	
第6回利付国債(40年)	70,000,000	101,240,300	
第7回利付国債(40年)	50,000,000	69,323,500	
第8回利付国債(40年)	75,000,000	96,725,250	
第9回利付国債(40年)	35,000,000	32,928,350	
第289回利付国債(10年)	199,000,000	203,019,800	
第290回利付国債(10年)	226,000,000	231,225,120	
第291回利付国債(10年)	187,000,000	191,069,120	
第292回利付国債(10年)	306,000,000	314,326,260	
第293回利付国債(10年)	56,000,000	57,884,400	
第294回利付国債(10年)	32,000,000	33,025,280	
第295回利付国債(10年)	13,000,000	13,374,400	
第296回利付国債(10年)	14,000,000	14,466,620	
第297回利付国債(10年)	28,000,000	28,987,000	
第298回利付国債(10年)	11,000,000	11,364,430	
第299回利付国債(10年)	410,000,000	425,129,000	
第300回利付国債(10年)	36,000,000	37,499,040	
第301回利付国債(10年)	206,000,000	215,473,940	

第302回利付国債(10年)	94,000,000	98,075,840	
第303回利付国債(10年)	581,000,000	608,463,870	
第304回利付国債(10年)	36,000,000	37,598,040	
第305回利付国債(10年)	473,000,000	495,760,760	
第306回利付国債(10年)	93,000,000	98,130,810	
第308回利付国債(10年)	140,000,000	147,744,800	
第309回利付国債(10年)	134,000,000	140,437,360	
第310回利付国債(10年)	78,000,000	81,690,960	
第311回利付国債(10年)	23,000,000	23,909,190	
第312回利付国債(10年)	205,000,000	216,988,400	
第313回利付国債(10年)	370,000,000	394,490,300	
第315回利付国債(10年)	65,000,000	69,218,500	
第316回利付国債(10年)	35,000,000	37,108,750	
第317回利付国債(10年)	105,000,000	111,674,850	
第318回利付国債(10年)	185,000,000	195,852,100	
第319回利付国債(10年)	5,000,000	5,332,950	
第320回利付国債(10年)	190,000,000	201,671,700	
第321回利付国債(10年)	175,000,000	186,273,500	
第322回利付国債(10年)	75,000,000	79,425,750	
第323回利付国債(10年)	45,000,000	47,781,450	
第324回利付国債(10年)	25,000,000	26,403,500	
第325回利付国債(10年)	210,000,000	222,324,900	
第326回利付国債(10年)	30,000,000	31,650,900	
第327回利付国債(10年)	65,000,000	68,979,300	
第328回利付国債(10年)	115,000,000	120,846,600	
第329回利付国債(10年)	230,000,000	245,161,600	
第330回利付国債(10年)	210,000,000	224,298,900	
第331回利付国債(10年)	80,000,000	84,336,000	
第333回利付国債(10年)	110,000,000	116,267,800	
第334回利付国債(10年)	120,000,000	126,976,800	
第335回利付国債(10年)	130,000,000	136,669,000	
第337回利付国債(10年)	30,000,000	31,070,100	
第338回利付国債(10年)	90,000,000	93,990,600	
第339回利付国債(10年)	250,000,000	261,195,000	
第340回利付国債(10年)	80,000,000	83,613,600	
第341回利付国債(10年)	110,000,000	113,993,000	

第14回利付国債(30年)	208,000,000	284,529,440	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	203,822,850	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	48,590,150	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	149,319,500	
第21回利付国債(30年)	20,000,000	27,254,800	
第22回利付国債(30年)	40,000,000	56,049,200	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	77,267,300	
第24回利付国債(30年)	68,000,000	95,684,840	
第25回利付国債(30年)	20,000,000	27,431,000	
第26回利付国債(30年)	100,000,000	139,356,000	
第27回利付国債(30年)	29,000,000	41,162,600	
第28回利付国債(30年)	14,000,000	19,981,780	
第29回利付国債(30年)	276,000,000	390,907,080	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	206,011,680	
第31回利付国債(30年)	120,000,000	166,466,400	
第32回利付国債(30年)	40,000,000	56,659,200	
第33回利付国債(30年)	135,000,000	182,849,400	
第34回利付国債(30年)	160,000,000	224,923,200	
第35回利付国債(30年)	78,000,000	106,462,980	
第36回利付国債(30年)	135,000,000	185,156,550	
第37回利付国債(30年)	46,000,000	62,172,220	
第38回利付国債(30年)	40,000,000	53,289,200	
第39回利付国債(30年)	75,000,000	101,934,000	
第40回利付国債(30年)	90,000,000	120,271,500	
第42回利付国債(30年)	65,000,000	85,416,500	
第43回利付国債(30年)	195,000,000	256,754,550	
第44回利付国債(30年)	70,000,000	92,349,600	
第45回利付国債(30年)	15,000,000	19,025,400	
第46回利付国債(30年)	100,000,000	127,045,000	
第47回利付国債(30年)	115,000,000	149,278,050	
第48回利付国債(30年)	105,000,000	130,815,300	
第49回利付国債(30年)	90,000,000	112,296,600	
第50回利付国債(30年)	25,000,000	27,128,250	
第51回利付国債(30年)	70,000,000	66,303,300	
第52回利付国債(30年)	70,000,000	70,091,000	
第34回利付国債(20年)	2,000,000	2,026,474	

第39回利付国債(20年)	86,000,000	89,396,140	
第41回利付国債(20年)	27,000,000	28,131,030	
第42回利付国債(20年)	168,000,000	179,424,000	
第43回利付国債(20年)	47,000,000	51,261,490	
第44回利付国債(20年)	51,000,000	55,694,040	
第47回利付国債(20年)	21,000,000	22,972,320	
第48回利付国債(20年)	99,000,000	110,112,750	
第49回利付国債(20年)	57,000,000	62,785,500	
第50回利付国債(20年)	237,000,000	258,967,530	
第51回利付国債(20年)	39,000,000	42,985,410	
第54回利付国債(20年)	15,000,000	16,850,700	
第55回利付国債(20年)	66,000,000	73,828,920	
第57回利付国債(20年)	52,000,000	58,163,560	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	151,773,750	
第59回利付国債(20年)	33,000,000	36,845,490	
第60回利付国債(20年)	295,000,000	324,004,400	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	29,077,380	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	35,106,570	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	61,783,020	
第65回利付国債(20年)	100,000,000	114,902,000	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	38,821,880	
第67回利付国債(20年)	34,000,000	39,215,260	
第68回利付国債(20年)	78,000,000	91,706,940	
第70回利付国債(20年)	104,000,000	124,417,280	
第72回利付国債(20年)	112,000,000	131,946,080	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	132,733,190	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	139,573,940	
第75回利付国債(20年)	10,000,000	11,874,400	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	24,581,760	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	47,160,000	
第79回利付国債(20年)	160,000,000	189,347,200	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	71,803,200	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	157,948,700	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	368,616,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	19,568,160	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	308,230,000	

第92回利付国債(20年)	60,000,000	73,036,800	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	72,656,400	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	61,066,500	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	102,283,520	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	120,155,840	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	55,845,000	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	115,631,280	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	144,463,410	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	37,518,000	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	84,039,780	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	103,511,520	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	13,929,410	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	41,022,300	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	96,068,280	
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,518,980	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	162,770,400	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	164,538,600	
第109回利付国債(20年)	27,000,000	33,237,270	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	123,053,700	
第111回利付国債(20年)	25,000,000	31,815,500	
第113回利付国債(20年)	290,000,000	366,449,800	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	65,886,600	
第115回利付国債(20年)	55,000,000	70,403,850	
第116回利付国債(20年)	55,000,000	70,644,750	
第117回利付国債(20年)	93,000,000	118,220,670	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	12,610,600	
第119回利付国債(20年)	30,000,000	37,022,100	
第120回利付国債(20年)	70,000,000	84,496,300	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	27,527,500	
第122回利付国債(20年)	17,000,000	21,037,840	
第123回利付国債(20年)	65,000,000	83,322,200	
第124回利付国債(20年)	80,000,000	101,434,400	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	64,955,000	
第126回利付国債(20年)	25,000,000	31,768,750	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	81,848,000	
第129回利付国債(20年)	50,000,000	62,240,000	

	第130回利付国債(20年)	60,000,000	74,828,400	
	第131回利付国債(20年)	12,000,000	14,790,240	
	第132回利付国債(20年)	35,000,000	43,208,200	
	第133回利付国債(20年)	30,000,000	37,480,800	
	第134回利付国債(20年)	30,000,000	37,544,100	
	第135回利付国債(20年)	30,000,000	37,092,300	
	第136回利付国債(20年)	140,000,000	170,989,000	
	第137回利付国債(20年)	220,000,000	272,430,400	
	第138回利付国債(20年)	90,000,000	108,698,400	
	第140回利付国債(20年)	280,000,000	347,244,800	
	第141回利付国債(20年)	195,000,000	242,168,550	
	第142回利付国債(20年)	55,000,000	69,168,000	
	第143回利付国債(20年)	54,000,000	66,290,400	
	第144回利付国債(20年)	40,000,000	48,467,200	
	第145回利付国債(20年)	125,000,000	155,518,750	
	第146回利付国債(20年)	75,000,000	93,427,500	
	第147回利付国債(20年)	60,000,000	73,776,600	
	第148回利付国債(20年)	120,000,000	145,682,400	
	第149回利付国債(20年)	215,000,000	260,992,800	
	第150回利付国債(20年)	90,000,000	107,697,600	
	第151回利付国債(20年)	150,000,000	174,238,500	
	第152回利付国債(20年)	90,000,000	104,457,600	
	第153回利付国債(20年)	120,000,000	141,400,800	
	第154回利付国債(20年)	120,000,000	139,155,600	
	第155回利付国債(20年)	140,000,000	157,145,800	
	第156回利付国債(20年)	110,000,000	110,996,600	
	第157回利付国債(20年)	50,000,000	48,445,500	
	第158回利付国債(20年)	100,000,000	102,405,000	
	国債証券 合計	22,697,000,000	26,006,422,471	
地方債証券	第26回東京都公募公債(20年)	100,000,000	121,560,000	
	第660回東京都公募公債	100,000,000	102,537,000	
	第708回東京都公募公債	100,000,000	104,912,000	
	第731回東京都公募公債	100,000,000	104,445,000	
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	119,102,000	
	平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	210,048,000	
	平成26年度第3回広島県公募公債	100,000,000	104,049,000	

	平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	105,652,000	
	平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	104,972,000	
	平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	104,132,000	
	第10回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	104,465,000	
	第64回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,068,000	
	第162回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,342,000	
	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	104,610,000	
	平成25年度第1回島根県公募公債	200,000,000	200,930,000	
	平成26年度第1回栃木県公募公債	100,000,000	103,697,000	
	平成23年度第2回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	105,359,000	
地方債証券 合計		2,000,000,000	2,106,880,000	
特殊債券	第1回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	104,740,000	
	第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	105,819,000	
	第5回新関西国際空港株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,808,000	
	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,008,000	
	第6回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,808,000	
	第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,895,000	
	第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,893,000	
	第21回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,094,000	
	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,818,000	
	第31回株式会社日本政策投資銀行無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	104,272,000	
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	121,481,000	
	第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,535,000	
	第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,972,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,220,000	
	第135回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,750,000	
	第139回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,365,000	
	第146回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,055,000	
	第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,148,000	
	第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,332,000	
	第271回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,046,000	
	第1回地方公営企業等金融機構債券（20年）	100,000,000	122,122,000	

	第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	102,927,000	
	第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,704,000	
	F290回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,081,000	
	第55回株式会社日本政策金融公庫社債(一般担保付)	200,000,000	199,976,000	
	第44回日本学生支援債券	200,000,000	199,984,000	
	第45回日本学生支援債券	300,000,000	299,955,000	
	第316回信金中金債(5年)	100,000,000	100,150,000	
	第318回信金中金債(5年)	100,000,000	100,022,000	
	第320回信金中金債(5年)	100,000,000	99,881,000	
	第322回信金中金債(5年)	200,000,000	199,942,000	
特殊債券 合計		3,800,000,000	3,941,803,000	
社債券	第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債(2014)	100,000,000	100,626,000	
	第9回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債(2012)	100,000,000	100,365,767	
	第11回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,441,000	
	第63回中日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人日本高速道路保有・債務返済機構重畳の債務引受条項付)	100,000,000	104,348,000	
	第14回森永乳業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,749,000	
	第6回サントリーホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	98,800,000	
	第6回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	104,607,000	
	第10回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,221,000	
	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	103,995,000	
	第11回パナソニック株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,402,000	
	第65回三菱地所株式会社無担保社債(担保提供制限等財務上特約無)	100,000,000	120,956,000	
	第83回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	113,987,000	
	第25回日本郵船株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	117,802,000	
	第540回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,015,000	
	第299回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,992,000	

	第281回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	106,186,000	
	第19回沖縄電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,734,000	
社債券 合計		1,700,000,000	1,789,226,767	
	合計	30,197,000,000	33,844,332,238	

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27年11月 6日現在	平成28年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
預金	63,615,687	253,976,737
コール・ローン	281,866,261	14,091,148
国債証券	179,970,237,594	151,120,639,275
派生商品評価勘定	-	108,996
未収入金	-	20,409,959
未収利息	1,901,055,289	1,372,177,670
前払費用	37,793,735	31,004,275
流動資産合計	182,254,568,566	152,812,408,060
資産合計	182,254,568,566	152,812,408,060
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	427,730
未払金	-	64,123,681
未払解約金	118,043,382	124,638,437
未払利息	-	13
流動負債合計	118,043,382	189,189,861
負債合計	118,043,382	189,189,861
純資産の部		
元本等		
元本	78,349,209,668	73,864,517,578
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	103,787,315,516	78,758,700,621
元本等合計	182,136,525,184	152,623,218,199
純資産合計	182,136,525,184	152,623,218,199

平成27年11月 6日現在

平成28年11月 7日現在

負債純資産合計	182,254,568,566	152,812,408,060
---------	-----------------	-----------------

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成27年11月 6日現在	平成28年11月 7日現在
1.	期首	平成26年11月 7日	平成27年11月 7日
	期首元本額	94,218,596,068円	78,349,209,668円
	期首からの追加設定元本額	1,399,091,607円	2,789,882,054円
	期首からの一部解約元本額	17,268,478,007円	7,274,574,144円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外債券ヘッジなし(DC専用)	10,717,455,388円	11,258,142,748円
	DCインデックスバランス(株式20)	68,269,726円	92,470,734円
	DCインデックスバランス(株式40)	128,006,703円	155,237,497円
	DCインデックスバランス(株式60)	162,708,003円	190,009,348円
	DCインデックスバランス(株式80)	148,356,986円	162,410,395円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	24,031,777,382円	24,214,740,382円
	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	3,090,679,030円	2,948,863,601円
	日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	30,458,219,011円	26,307,633,130円
	全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	24,372,969円	26,606,000円

日興外国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,006,770,053円	997,780,943円
財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	151,321,244円	206,645,646円
日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（債券資産）	18,308,969円	- 円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	2,967,711円	3,018,048円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	3,257,531円	3,333,157円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	7,176,948円	7,395,863円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	17,570,570円	19,118,029円
世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	864,356,054円	415,188,653円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,261,792,428円	1,246,813,928円
世界アセットバランスファンド40（適格機関投資家向け）	37,804,015円	35,853,198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）	96,229,066円	92,746,529円
グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	40,477,070円	38,254,859円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	49,540,456円	58,271,520円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	73,772,934円	84,989,462円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	69,086,349円	76,574,398円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	53,051,962円	57,038,041円
インデックスファンド海外債券（ヘッジなし）1年決算型	5,526,425,452円	4,920,656,211円
海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	239,455,658円	244,725,258円
計	78,349,209,668円	73,864,517,578円
2. 受益権の総数	78,349,209,668口	73,864,517,578口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成26年11月 7日 至 平成27年11月 6日	自 平成27年11月 7日 至 平成28年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	平成27年11月 6日現在	平成28年11月 7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	<p>(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。</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>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成27年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	1,576,368,778
合計	1,576,368,778

(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

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(平成27年11月 6日現在)

該当事項はありません。

(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

(注) 1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成27年11月 6日現在		平成28年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	2.3247円	1口当たり純資産額	2.0663円
(1万口当たり純資産額)	(23,247円)	(1万口当たり純資産額)	(20,663円)

附属明細表

第 1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-1.875%-17/10/31	2,500,000.00	2,528,710.00	
		US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	6,800,000.00	7,044,908.80	
		US TREASURY N/B-0.625%-17/11/30	3,000,000.00	2,997,540.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-17/11/30	3,500,000.00	3,556,945.00	
		US TREASURY N/B-1.0%-17/12/15	5,200,000.00	5,217,264.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-17/12/31	6,170,000.00	6,313,285.91	

US TREASURY N/B-2.625%-18/01/31	4,000,000.00	4,093,124.00	
US TREASURY N/B-0.875%-18/01/31	1,200,000.00	1,202,461.20	
US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	7,950,000.00	8,228,870.10	
US TREASURY N/B-2.75%-18/02/28	7,400,000.00	7,594,538.60	
US TREASURY N/B-0.75%-18/02/28	5,100,000.00	5,101,795.20	
US TREASURY N/B-1.0%-18/03/15	1,000,000.00	1,003,789.00	
US TREASURY N/B-0.75%-18/03/31	3,000,000.00	3,000,936.00	
US TREASURY N/B-2.875%-18/03/31	2,500,000.00	2,573,780.00	
US TREASURY N/B-0.625%-18/04/30	3,000,000.00	2,994,843.00	
US TREASURY N/B-0.75%-18/04/30	3,000,000.00	3,000,645.00	
US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	7,550,000.00	7,912,460.40	
US TREASURY N/B-1.0%-18/05/31	5,520,000.00	5,540,589.60	
US TREASURY N/B-2.375%-18/06/30	7,000,000.00	7,182,518.00	
US TREASURY N/B-2.25%-18/07/31	8,340,000.00	8,552,895.18	
US TREASURY N/B-1.375%-18/07/31	2,500,000.00	2,524,852.50	
US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	8,850,000.00	9,360,087.45	
US TREASURY N/B-1.375%-18/09/30	970,000.00	980,154.93	
US TREASURY N/B-1.75%-18/10/31	3,000,000.00	3,054,726.00	
US TREASURY N/B-1.25%-18/10/31	3,000,000.00	3,025,020.00	
US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	9,400,000.00	9,949,317.20	
US TREASURY N/B-1.25%-18/11/30	3,100,000.00	3,125,612.20	
US TREASURY N/B-1.5%-18/12/31	8,830,000.00	8,951,068.13	
US TREASURY N/B-1.125%-19/01/15	500,000.00	502,871.00	
US TREASURY N/B-1.5%-19/01/31	3,000,000.00	3,042,186.00	
US TREASURY N/B-1.25%-19/01/31	200,000.00	201,707.00	
US TREASURY N/B-8.875%-19/02/15	4,550,000.00	5,380,284.00	
US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	5,400,000.00	5,629,289.40	
US TREASURY N/B-1.375%-19/02/28	3,000,000.00	3,034,395.00	
US TREASURY N/B-1.5%-19/02/28	4,000,000.00	4,057,344.00	
US TREASURY N/B-1.0%-19/03/15	500,000.00	501,386.50	
US TREASURY N/B-1.625%-19/03/31	2,000,000.00	2,034,804.00	
US TREASURY N/B-0.875%-19/04/15	1,200,000.00	1,199,484.00	
US TREASURY N/B-1.625%-19/04/30	5,000,000.00	5,089,455.00	
US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	4,000,000.00	4,221,796.00	
US TREASURY N/B-0.875%-19/05/15	3,000,000.00	2,998,476.00	

US TREASURY N/B-1.5%-19/05/31	4,100,000.00	4,161,819.80	
US TREASURY N/B-1.625%-19/06/30	1,090,000.00	1,110,097.42	
US TREASURY N/B-1.625%-19/07/31	3,000,000.00	3,056,895.00	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	4,320,000.00	4,638,600.00	
US TREASURY N/B-8.125%-19/08/15	3,210,000.00	3,841,779.36	
US TREASURY N/B-1.0%-19/08/31	3,300,000.00	3,306,573.60	
US TREASURY N/B-1.625%-19/08/31	3,600,000.00	3,668,767.20	
US TREASURY N/B-1.75%-19/09/30	8,000,000.00	8,185,312.00	
US TREASURY N/B-1.5%-19/10/31	4,100,000.00	4,165,345.80	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	10,780,000.00	11,551,869.56	
US TREASURY N/B-1.625%-19/12/31	1,800,000.00	1,835,402.40	
US TREASURY N/B-1.25%-20/01/31	4,000,000.00	4,030,468.00	
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	11,070,000.00	11,997,112.50	
US TREASURY N/B-1.375%-20/03/31	1,100,000.00	1,112,632.40	
US TREASURY N/B-1.375%-20/04/30	1,930,000.00	1,951,637.23	
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	8,710,000.00	9,444,226.87	
US TREASURY N/B-1.375%-20/05/31	2,440,000.00	2,466,639.92	
US TREASURY N/B-1.5%-20/05/31	5,100,000.00	5,176,897.80	
US TREASURY N/B-1.875%-20/06/30	380,000.00	390,969.46	
US TREASURY N/B-1.625%-20/06/30	4,000,000.00	4,078,360.00	
US TREASURY N/B-2.0%-20/07/31	8,060,000.00	8,329,349.08	
US TREASURY N/B-1.625%-20/07/31	4,000,000.00	4,077,420.00	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	7,600,000.00	9,752,639.20	
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	5,000,000.00	5,282,030.00	
US TREASURY N/B-2.125%-20/08/31	1,450,000.00	1,504,630.20	
US TREASURY N/B-1.375%-20/08/31	2,300,000.00	2,322,730.90	
US TREASURY N/B-1.375%-20/09/30	3,800,000.00	3,836,293.80	
US TREASURY N/B-1.75%-20/10/31	2,000,000.00	2,047,618.00	
US TREASURY N/B-1.375%-20/10/31	1,060,000.00	1,069,668.26	
US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	3,500,000.00	3,703,574.00	
US TREASURY N/B-1.625%-20/11/30	1,120,000.00	1,141,066.08	
US TREASURY N/B-2.375%-20/12/31	3,000,000.00	3,147,246.00	
US TREASURY N/B-1.75%-20/12/31	2,000,000.00	2,047,226.00	
US TREASURY N/B-1.375%-21/01/31	2,000,000.00	2,015,938.00	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	8,550,000.00	9,417,354.75	

US TREASURY N/B-1.125%-21/02/28	2,000,000.00	1,995,040.00	
US TREASURY N/B-1.25%-21/03/31	500,000.00	501,025.50	
US TREASURY N/B-2.25%-21/04/30	4,800,000.00	5,015,625.60	
US TREASURY N/B-1.375%-21/04/30	2,000,000.00	2,013,946.00	
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	5,170,000.00	5,601,069.43	
US TREASURY N/B-1.375%-21/05/31	2,060,000.00	2,074,926.76	
US TREASURY N/B-2.125%-21/06/30	6,400,000.00	6,656,627.20	
US TREASURY N/B-2.25%-21/07/31	3,000,000.00	3,136,347.00	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	3,900,000.00	4,055,391.60	
US TREASURY N/B-1.125%-21/08/31	4,400,000.00	4,376,279.60	
US TREASURY N/B-2.125%-21/09/30	2,400,000.00	2,496,000.00	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	11,490,000.00	15,245,115.84	
US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	4,000,000.00	4,136,484.00	
US TREASURY N/B-2.125%-21/12/31	4,800,000.00	4,993,876.80	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,500,000.00	2,585,595.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/02/28	2,900,000.00	2,960,720.20	
US TREASURY N/B-1.75%-22/04/30	3,000,000.00	3,060,468.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	2,000,000.00	2,039,454.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/05/31	2,000,000.00	2,053,360.00	
US TREASURY N/B-2.125%-22/06/30	2,500,000.00	2,599,610.00	
US TREASURY N/B-2.0%-22/07/31	5,300,000.00	5,473,076.80	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	2,000,000.00	2,024,922.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/08/31	1,900,000.00	1,948,391.10	
US TREASURY N/B-1.75%-22/09/30	4,000,000.00	4,072,188.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	3,000,000.00	3,074,532.00	
US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	1,000,000.00	1,010,098.00	
US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	1,000,000.00	1,031,641.00	
US TREASURY N/B-2.125%-22/12/31	4,000,000.00	4,155,780.00	
US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	2,000,000.00	2,032,812.00	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	9,300,000.00	9,592,438.50	
US TREASURY N/B-1.5%-23/02/28	1,000,000.00	1,000,840.00	
US TREASURY N/B-1.625%-23/04/30	660,000.00	664,898.52	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	8,150,000.00	8,271,451.30	
US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	4,000,000.00	3,964,140.00	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,500,000.00	5,845,037.00	

US TREASURY N/B-1.375%-23/08/31	1,850,000.00	1,830,850.65	
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	4,321,172.00	
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	2,900,000.00	3,135,964.30	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	5,800,000.00	6,173,148.80	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,873,467.06	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	5,930,000.00	6,196,850.00	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	3,850,000.00	3,943,016.00	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	4,959,374.40	
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	3,920,000.00	4,006,361.52	
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	5,940,000.00	6,188,969.16	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	2,457,984.60	
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,070,000.00	3,033,783.21	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	3,100,000.00	3,060,099.90	
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,898,440.00	
US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,450,000.00	3,512,736.50	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	2,920,000.00	4,162,141.72	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,000,000.00	1,357,949.00	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	2,600,000.00	3,926,863.20	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	3,500,000.00	4,990,303.50	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	1,900,000.00	2,758,600.50	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	1,170,000.00	1,578,356.91	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	1,800,000.00	2,469,691.80	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	2,300,000.00	3,043,636.00	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,820,000.00	2,488,671.64	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	1,750,000.00	2,354,808.75	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	2,710,000.00	3,771,715.67	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	2,610,000.00	3,515,852.70	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	2,440,000.00	3,063,820.16	
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	2,500,000.00	3,315,040.00	
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,600,000.00	2,273,905.60	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	2,650,000.00	3,582,521.75	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	3,700,000.00	4,570,439.80	
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	500,000.00	521,084.00	
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	2,233,632.00	
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	5,800,000.00	6,181,645.80	

		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	5,350,000.00	6,531,494.00	
		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	4,500,000.00	5,616,913.50	
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	3,000,000.00	3,661,758.00	
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	3,400,000.00	3,974,545.60	
		US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	5,900,000.00	6,589,792.60	
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	3,300,000.00	3,598,353.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	3,254,625.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	3,200,000.00	3,486,438.40	
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	5,300,000.00	5,636,634.80	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	3,900,000.00	4,249,705.20	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	2,800,000.00	2,758,109.20	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	2,500,000.00	2,463,282.50	
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	2,007,310.95	
	米ドル小計		589,730,000.00	633,713,475.99 (65,880,852,963)	
加ドル	国債証券	CANADA GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	439,308.95	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-17/11/01	860,000.00	857,540.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/02/01	1,480,000.00	1,492,920.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/03/01	1,340,000.00	1,352,542.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-18/05/01	1,480,000.00	1,473,754.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	1,400,000.00	1,480,976.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-18/08/01	1,350,000.00	1,349,433.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/09/01	650,000.00	658,560.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-18/11/01	1,230,000.00	1,229,323.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/03/01	1,050,000.00	1,079,715.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	1,900,000.00	2,055,629.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/09/01	1,050,000.00	1,085,248.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-20/03/01	1,170,000.00	1,205,603.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	1,530,000.00	1,687,467.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-20/09/01	1,150,000.00	1,157,279.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/03/01	1,210,000.00	1,216,219.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	1,150,000.00	1,285,263.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/09/01	1,340,000.00	1,345,293.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-22/03/01	300,000.00	296,370.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	1,200,000.00	1,330,920.00	

		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,380,000.00	1,436,152.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,420,000.00	1,579,082.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	1,290,000.00	1,414,588.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	820,000.00	844,887.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	370,000.00	615,609.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	100,000.00	97,355.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	990,000.00	1,479,762.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	1,140,000.00	1,816,088.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	1,230,000.00	1,911,100.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	1,490,000.00	2,130,327.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,540,000.00	2,123,198.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	870,000.00	1,068,725.40	
加ドル小計			35,815,000.00	40,596,244.75	
				(3,152,298,404)	
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 17/12/14	13,600,000.00	13,972,747.44	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-4.75%- 18/06/14	18,000,000.00	17,780,499.90	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-18/12/13	23,900,000.00	25,216,861.32	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11	8,100,000.00	7,912,148.04	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	19,900,000.00	21,250,449.82	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	23,800,000.00	24,265,528.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	8,500,000.00	8,680,787.35	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	8,200,000.00	9,073,518.94	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	25,500,000.00	31,625,054.10	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	2,450,000.00	2,354,578.99	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	6,700,000.00	7,259,308.63	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	15,200,000.00	17,717,562.32	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	11,900,000.00	13,106,063.21	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	5,800,000.00	6,403,705.18	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	7,800,000.00	10,568,957.10	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	12,100,000.00	14,430,116.36	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	12,440,000.00	13,882,293.60	
メキシコペソ小計			223,890,000.00	245,500,180.30 (1,367,436,004)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.0%-18/03/28	1,480,000.00	1,576,510.80	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-18/06/22	520,000.00	536,122.08	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	1,280,000.00	1,421,487.36	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-19/09/28	960,000.00	1,058,635.20	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	1,920,000.00	2,236,778.88	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	1,590,000.00	1,949,770.89	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	1,440,000.00	1,777,622.40	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,500,000.00	1,899,714.00	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	1,170,000.00	1,356,441.84	
		BELGIUM KINGDOM-0.2%-23/10/22	210,000.00	213,325.14	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	1,300,000.00	1,551,396.60	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,260,000.00	1,320,319.98	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	1,140,000.00	1,590,385.50	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	810,000.00	856,025.82	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,870,000.00	2,922,959.60	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	650,000.00	670,651.15	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	810,000.00	1,194,016.95	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	590,000.00	797,740.18	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,860,000.00	3,177,776.52	
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	590,000.00	687,401.33	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,520,000.00	2,558,129.60	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	875,000.00	1,416,164.75	
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	430,000.00	461,095.02	
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	280,000.00	337,528.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%-17/10/31	1,400,000.00	1,410,617.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.5%-18/01/31	1,900,000.00	2,010,433.70	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%-18/04/30	1,030,000.00	1,037,077.13	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%-18/07/30	3,000,000.00	3,221,727.00	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.75%- 18/10/31	1,690,000.00	1,822,328.69
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%- 19/01/31	1,060,000.00	1,068,077.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 19/04/30	1,860,000.00	1,990,019.58
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%- 19/07/30	2,040,000.00	2,297,468.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%- 19/10/31	2,200,000.00	2,483,360.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 20/01/31	1,480,000.00	1,546,153.04
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%- 20/04/30	2,430,000.00	2,764,052.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.15%- 20/07/30	1,180,000.00	1,228,145.18
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%- 20/10/31	1,890,000.00	2,247,330.96
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	2,360,000.00	2,923,136.12
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.75%- 21/07/30	1,160,000.00	1,190,176.24
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	2,060,000.00	2,653,836.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%- 23/01/31	2,040,000.00	2,655,539.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	1,690,000.00	2,119,714.61
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	1,610,000.00	2,071,345.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	2,050,000.00	2,491,455.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	2,200,000.00	2,508,200.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	1,860,000.00	1,950,420.18
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,850,000.00	2,403,249.90
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	1,980,000.00	2,155,340.88
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 26/04/30	1,800,000.00	1,923,780.60

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,620,000.00	2,313,722.88
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%- 26/10/31	600,000.00	602,554.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,320,000.00	1,855,389.36
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	2,010,000.00	3,029,421.75
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,600,000.00	1,667,720.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,760,000.00	2,743,366.56
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,630,000.00	2,223,306.96
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,370,000.00	2,061,452.70
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,340,000.00	1,970,126.96
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	1,140,000.00	1,792,214.52
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%- 46/10/31	870,000.00	956,688.54
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%- 66/07/30	360,000.00	414,478.80
BUNDES Obligation-0.5%-18/02/23	1,850,000.00	1,878,057.10
BUNDES Obligation-0.25%-18/04/13	1,170,000.00	1,185,220.53
BUNDES Obligation-1.0%-18/10/12	1,880,000.00	1,939,633.60
BUNDES Obligation-1.0%-19/02/22	1,320,000.00	1,370,229.96
BUNDES Obligation-0.25%-20/10/16	1,000,000.00	1,031,391.00
BUNDES Obligation-0.0%-21/04/09	1,200,000.00	1,225,915.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 18/01/04	3,600,000.00	3,797,064.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 18/07/04	2,750,000.00	2,975,623.75
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 19/01/04	2,550,000.00	2,794,749.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%- 19/07/04	3,770,000.00	4,188,138.24
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 20/01/04	3,220,000.00	3,618,739.04
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%-	2,820,000.00	3,193,920.72

20/07/04			
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 20/09/04	2,150,000.00	2,384,186.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 21/01/04	1,800,000.00	2,029,543.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	1,730,000.00	2,034,862.33	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 21/09/04	1,580,000.00	1,789,493.78	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	2,000,000.00	2,252,814.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 22/07/04	2,470,000.00	2,772,029.13	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	1,600,000.00	1,776,884.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	1,900,000.00	2,120,061.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	1,820,000.00	2,036,174.14	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	1,780,000.00	2,059,552.56	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	1,910,000.00	2,808,977.79	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	2,780,000.00	3,185,287.86	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	1,400,000.00	1,580,430.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	1,830,000.00	1,996,594.05	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	1,370,000.00	1,437,194.39	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	2,340,000.00	2,551,599.18	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	1,590,000.00	1,655,800.56	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 26/08/15	90,000.00	88,875.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,150,000.00	1,928,751.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,450,000.00	2,329,297.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-	1,140,000.00	1,739,286.60	

28/07/04			
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	830,000.00	1,480,205.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,670,000.00	2,873,909.68	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,840,000.00	3,195,677.04	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	2,090,000.00	3,482,849.15	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,240,000.00	2,203,333.68	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,480,000.00	2,829,841.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	1,390,000.00	2,237,824.94	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,900,000.00	2,758,228.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	1,770,000.00	2,604,038.16	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-18/03/16	1,000,000.00	1,009,219.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-18/06/15	1,000,000.00	1,010,622.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 17/11/01	1,700,000.00	1,761,591.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.75%- 18/01/15	850,000.00	858,912.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/02/01	2,510,000.00	2,651,433.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%- 18/05/15	950,000.00	953,714.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/06/01	1,370,000.00	1,445,326.71	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/08/01	2,880,000.00	3,102,632.64	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.3%- 18/10/15	700,000.00	703,458.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/12/01	2,150,000.00	2,302,650.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/02/01	2,660,000.00	2,904,454.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 19/03/01	2,720,000.00	2,995,255.84	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.1%-	1,000,000.00	998,849.00	

19/04/15			
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 19/05/01	1,400,000.00	1,481,170.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 19/08/01	730,000.00	756,342.78	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/09/01	3,210,000.00	3,575,654.31	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.05%- 19/12/01	1,100,000.00	1,127,753.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 20/02/01	2,640,000.00	2,998,282.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 20/03/01	2,920,000.00	3,302,741.92	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.7%- 20/05/01	750,000.00	760,565.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	2,950,000.00	3,356,451.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 20/11/01	700,000.00	707,420.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	2,100,000.00	2,394,598.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/05/01	1,200,000.00	1,370,672.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%- 21/06/01	100,000.00	99,585.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	3,670,000.00	4,214,139.89	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 21/09/01	3,350,000.00	4,008,543.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 21/12/15	680,000.00	730,000.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	2,400,000.00	2,929,435.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 22/04/15	770,000.00	792,715.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,900,000.00	2,401,508.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 22/09/15	500,000.00	516,359.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	2,000,000.00	2,531,576.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-	560,000.00	558,325.60	

23/03/15			
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	950,000.00	1,157,118.05	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,700,000.00	2,109,484.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 23/10/15	380,000.00	367,635.18	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	3,000,000.00	4,581,252.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,650,000.00	2,022,355.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,500,000.00	1,764,481.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,300,000.00	1,408,247.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	3,400,000.00	4,346,233.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	530,000.00	530,252.28	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	2,060,000.00	2,130,328.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,030,000.00	1,283,743.59	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	740,000.00	735,704.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	1,980,000.00	2,992,684.86	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	3,530,000.00	5,180,832.74	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	850,000.00	1,108,027.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	4,430,000.00	6,100,902.97	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	940,000.00	1,104,045.98	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	3,290,000.00	4,894,062.53	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,540,000.00	1,452,805.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,900,000.00	2,815,032.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-	2,080,000.00	2,891,699.20	

34/08/01		
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	400,000.00	390,806.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	2,710,000.00	3,376,551.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,770,000.00	2,495,914.17
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	2,280,000.00	3,213,589.32
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,660,000.00	2,298,929.02
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,240,000.00	1,360,412.68
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	1,000,000.00	981,079.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 67/03/01	310,000.00	280,685.16
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-18/09/15	210,000.00	216,837.60
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	620,000.00	702,411.64
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	740,000.00	839,400.50
FINNISH GOVERNMENT-0.375%-20/09/15	300,000.00	309,568.50
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	740,000.00	868,919.10
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	300,000.00	333,044.40
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	550,000.00	607,889.15
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-23/09/15	160,000.00	160,770.56
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	550,000.00	632,335.00
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	590,000.00	788,025.83
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	330,000.00	349,823.10
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	410,000.00	418,246.74
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	500,000.00	635,292.50
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	385,000.00	393,242.85
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	410,000.00	583,195.48
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-18/04/25	3,850,000.00	4,112,620.05
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-18/05/25	3,000,000.00	3,075,546.00
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-18/10/25	2,300,000.00	2,521,030.00
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-18/11/25	1,200,000.00	1,239,231.60
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-19/02/25	570,000.00	577,603.80
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25	4,140,000.00	4,634,891.46

FRANCE (GOVT OF) -1.0%-19/05/25	1,470,000.00	1,528,885.26	
FRANCE (GOVT OF) -8.5%-19/10/25	1,050,000.00	1,334,106.90	
FRANCE (GOVT OF) -3.75%-19/10/25	4,400,000.00	4,964,304.40	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-19/11/25	1,450,000.00	1,495,287.85	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-20/04/25	3,180,000.00	3,620,204.22	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-20/05/25	1,600,000.00	1,625,569.60	
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-20/10/25	3,990,000.00	4,454,611.56	
FRANCE (GOVT OF) -0.25%-20/11/25	2,550,000.00	2,615,713.50	
FRANCE (GOVT OF) -3.75%-21/04/25	3,900,000.00	4,621,336.20	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-21/10/25	3,920,000.00	4,612,303.36	
FRANCE (GOVT OF) -3.0%-22/04/25	3,770,000.00	4,438,647.20	
FRANCE (GOVT OF) -2.25%-22/10/25	2,950,000.00	3,377,233.75	
FRANCE (GOVT OF) -8.5%-23/04/25	1,150,000.00	1,794,647.45	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-23/05/25	3,230,000.00	3,620,235.68	
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-23/10/25	3,990,000.00	5,195,279.25	
FRANCE (GOVT OF) -2.25%-24/05/25	3,290,000.00	3,839,564.89	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-24/11/25	4,050,000.00	4,575,831.75	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-25/05/25	3,010,000.00	3,081,752.38	
FRANCE (GOVT OF) -6.0%-25/10/25	2,930,000.00	4,438,744.90	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-25/11/25	3,635,000.00	3,860,333.65	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-26/04/25	3,320,000.00	4,297,408.00	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-26/05/25	1,180,000.00	1,191,245.40	
FRANCE (GOVT OF) -0.25%-26/11/25	300,000.00	293,931.00	
FRANCE (GOVT OF) -2.75%-27/10/25	3,380,000.00	4,194,776.04	
FRANCE (GOVT OF) -5.5%-29/04/25	3,220,000.00	5,149,304.86	
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-30/05/25	2,220,000.00	2,749,372.32	
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-31/05/25	1,620,000.00	1,787,326.56	
FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	2,820,000.00	4,935,394.80	
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	2,470,000.00	4,091,900.80	
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-36/05/25	500,000.00	520,442.00	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	2,460,000.00	3,892,581.00	
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	2,660,000.00	4,595,187.24	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	2,090,000.00	3,104,803.68	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	1,370,000.00	2,456,286.70	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	1,160,000.00	2,150,250.24	

FRANCE (GOVT OF)-1.75%-66/05/25	320,000.00	351,769.28	
IRISH TREASURY-4.5%-18/10/18	820,000.00	898,983.22	
IRISH TREASURY-4.4%-19/06/18	730,000.00	822,428.22	
IRISH TREASURY-5.9%-19/10/18	620,000.00	735,228.24	
IRISH TREASURY-4.5%-20/04/18	1,010,000.00	1,179,506.28	
IRISH TREASURY-5.0%-20/10/18	750,000.00	908,547.00	
IRISH TREASURY-0.8%-22/03/15	480,000.00	503,255.52	
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	510,000.00	634,071.78	
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	740,000.00	906,487.42	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	1,060,000.00	1,483,108.54	
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	620,000.00	639,224.34	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	740,000.00	872,673.12	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	535,000.00	598,205.43	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-18/01/15	940,000.00	961,701.78	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-18/04/15	990,000.00	999,263.43	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	2,080,000.00	2,244,145.28	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-19/01/15	1,050,000.00	1,093,010.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	1,780,000.00	2,002,063.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-20/01/15	1,340,000.00	1,375,418.88	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	1,530,000.00	1,759,744.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	1,590,000.00	1,866,189.36	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-22/01/15	700,000.00	712,406.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	1,500,000.00	1,721,494.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	870,000.00	1,088,628.39	
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	970,000.00	1,441,704.21	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	950,000.00	1,073,863.85	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	940,000.00	1,087,073.34	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	760,000.00	768,448.92	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	370,000.00	378,706.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	1,480,000.00	2,333,109.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	1,250,000.00	1,641,156.25	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,400,000.00	2,309,899.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,560,000.00	2,658,364.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,030,000.00	1,567,398.38	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	1,110,000.00	1,180,002.15	

		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.15%-18/10/19	660,000.00	683,055.78	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	1,260,000.00	1,406,817.72	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.95%-19/06/18	530,000.00	565,391.28	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-19/10/18	610,000.00	624,366.11	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	1,350,000.00	1,568,567.70	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	1,490,000.00	1,769,583.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	840,000.00	1,019,978.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	1,040,000.00	1,267,361.68	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	890,000.00	1,005,999.04	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	890,000.00	1,004,298.25	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	730,000.00	797,334.47	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	750,000.00	1,076,738.25	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	380,000.00	395,733.90	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	800,000.00	1,306,500.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	500,000.00	638,741.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,180,000.00	1,927,482.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	650,000.00	989,632.15	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	240,000.00	266,111.04	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	360,000.00	688,268.52	
		ユーロ小計	434,400,000.00	531,784,545.61 (61,330,711,645)	
英債券	国債証券	UK TREASURY-5.0%-18/03/07	1,630,000.00	1,735,666.38	
		UK TREASURY-1.25%-18/07/22	2,930,000.00	2,984,673.80	
		UK TREASURY-4.5%-19/03/07	1,990,000.00	2,191,557.15	
		UK TREASURY-1.75%-19/07/22	1,880,000.00	1,957,668.44	
		UK TREASURY-3.75%-19/09/07	1,650,000.00	1,815,544.50	
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	2,090,000.00	2,400,992.00	
		UK TREASURY-2.0%-20/07/22	1,870,000.00	1,981,597.86	
		UK TREASURY-3.75%-20/09/07	1,920,000.00	2,170,464.00	
		UK TREASURY-1.5%-21/01/22	2,580,000.00	2,689,095.30	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	1,270,000.00	1,703,167.79	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	1,580,000.00	1,825,247.60	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	1,520,000.00	1,795,898.24	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	2,130,000.00	2,264,794.92	
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	2,010,000.00	2,207,832.24	

		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	1,570,000.00	1,788,858.00	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	2,170,000.00	2,872,882.53	
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	730,000.00	754,148.40	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	1,420,000.00	1,859,693.06	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	1,000,000.00	1,527,622.00	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,780,000.00	2,537,886.62	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,860,000.00	2,562,453.18	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	2,100,000.00	3,034,983.00	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,670,000.00	2,376,745.67	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,700,000.00	2,636,815.60	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,460,000.00	2,138,535.00	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	1,920,000.00	2,847,361.92	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	2,790,000.00	4,375,679.76	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,380,000.00	1,807,510.20	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,740,000.00	2,391,588.24	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,560,000.00	2,456,547.60	
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	90,000.00	84,912.30	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	1,340,000.00	2,192,449.04	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,530,000.00	2,376,210.87	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,650,000.00	2,894,149.50	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,440,000.00	2,507,120.64	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	1,690,000.00	2,794,421.76	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	1,180,000.00	1,276,608.96	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	970,000.00	1,256,867.80	
英債券小計			63,790,000.00	83,076,251.87	(10,774,159,105)
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-3.0%-18/01/08	435,000.00	455,416.29	
		SWITZERLAND-3.0%-19/05/12	400,000.00	439,956.80	
		SWITZERLAND-2.25%-20/07/06	400,000.00	446,160.80	
		SWITZERLAND-2.0%-21/04/28	220,000.00	248,000.72	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	1,160,000.00	1,502,255.68	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	230,000.00	344,343.81	
スイスフラン小計			2,845,000.00	3,436,134.10	(366,807,315)
スウェー	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	8,900,000.00	9,954,133.80	

デンク ローナ		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	8,700,000.00	10,687,836.90	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	9,000,000.00	10,938,600.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	7,020,000.00	7,840,420.38	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	6,000,000.00	7,265,790.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	4,950,000.00	5,316,572.25	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	4,480,000.00	6,587,965.44	
スウェーデンクローナ小計			49,050,000.00	58,591,318.77	(679,073,384)
ノル ウェー クロー ネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	6,980,000.00	7,642,778.92	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	6,900,000.00	7,748,286.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	4,900,000.00	5,165,825.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	4,190,000.00	4,722,012.68	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	3,470,000.00	3,598,216.50	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	3,110,000.00	3,151,126.64	
ノルウェークローネ小計			29,550,000.00	32,028,245.74	(408,039,850)
デンマ ーク クロー ネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-4.0%-17/11/15	5,250,000.00	5,498,692.50	
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-18/11/15	3,340,000.00	3,395,600.98	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	9,050,000.00	10,291,388.50	
		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	7,570,000.00	8,823,168.08	
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	7,200,000.00	7,990,862.40	
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	2,900,000.00	4,531,154.30	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	6,500,000.00	7,392,807.50	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	11,660,000.00	20,964,668.34	
デンマーククローネ小計			53,470,000.00	68,888,342.60	(1,067,769,310)
ポーラ ンド ズロ チ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-18/04/25	1,800,000.00	1,854,270.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-18/07/25	2,480,000.00	2,511,372.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-18/10/25	1,710,000.00	1,651,347.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-19/07/25	2,190,000.00	2,263,584.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	1,850,000.00	2,034,167.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.5%-20/04/25	2,570,000.00	2,513,974.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	1,980,000.00	2,202,354.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25	2,410,000.00	2,373,006.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-21/07/25	2,030,000.00	1,966,765.50	

		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	1,610,000.00	1,854,639.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	2,220,000.00	2,591,295.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	2,670,000.00	2,870,383.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,580,000.00	2,631,600.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	3,210,000.00	3,065,229.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	830,000.00	1,038,745.00
ポーランドズロチ小計			32,140,000.00	33,422,732.50 (891,718,503)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-18/01/21	1,870,000.00	1,955,737.63
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-18/10/21	1,620,000.00	1,669,787.46
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	2,140,000.00	2,315,833.10
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-19/10/21	2,030,000.00	2,091,677.49
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	2,340,000.00	2,556,812.70
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-20/11/21	1,650,000.00	1,648,396.20
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	2,610,000.00	3,053,642.58
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	2,050,000.00	2,468,960.55
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	2,170,000.00	2,621,731.07
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	2,350,000.00	2,446,180.80
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	2,490,000.00	2,684,137.83
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	2,760,000.00	3,219,882.24
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	2,430,000.00	2,973,318.84
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	1,410,000.00	1,458,770.49
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	740,000.00	726,125.00
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,210,000.00	1,307,152.11
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,050,000.00	1,299,518.85
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	470,000.00	462,741.32
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	970,000.00	1,095,058.22
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	450,000.00	467,961.30
AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	750,000.00	713,782.50		
豪ドル小計			35,560,000.00	39,237,208.28 (3,130,344,476)
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-18/04/01	640,000.00	637,171.20
		SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	560,000.00	592,009.60
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01	640,000.00	664,768.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-19/10/01	350,000.00	355,950.00

		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-20/07/01	220,000.00	226,996.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	520,000.00	561,080.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	640,000.00	667,840.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-21/10/01	170,000.00	169,657.45	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	580,000.00	632,780.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	200,000.00	214,100.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	588,600.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	200,000.00	208,200.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	200,000.00	203,742.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	490,000.00	557,865.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	230,000.00	247,710.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	330,000.00	355,083.30	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	270,000.00	308,706.66	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	445,000.00	480,504.32	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	160,000.00	173,624.48	
		シンガポールドル小計	7,385,000.00	7,846,388.01 (588,400,636)	
マレーシア アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.759%-19/03/15	100,000.00	101,777.80	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.659%-20/10/15	1,010,000.00	1,021,163.53	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	460,000.00	472,795.82	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.62%-21/11/30	850,000.00	861,981.60	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	380,000.00	386,290.90	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	300,000.00	305,104.20	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	880,000.00	894,520.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	450,000.00	460,155.15	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	350,000.00	347,946.90	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	590,000.00	615,742.29	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	550,000.00	561,055.55	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.314%-17/10/31	350,000.00	353,130.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	2,420,000.00	2,472,777.78	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.26%-18/03/01	820,000.00	828,080.28	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.58%-18/09/28	700,000.00	710,928.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	1,220,000.00	1,301,979.12	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	3,500,000.00	3,621,387.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.492%-20/03/31	350,000.00	352,848.30	

		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.889%-20/07/31	500,000.00	510,043.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	2,500,000.00	2,583,437.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	650,000.00	646,678.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,750,000.00	1,748,724.25	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	970,327.22	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,270,000.00	1,330,706.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	450,477.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	850,000.00	819,935.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	430,000.00	418,948.14	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000.00	840,956.25	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	1,210,000.00	1,258,172.52	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	600,000.00	611,116.80	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	450,000.00	442,517.85	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	600,000.00	567,014.40	
		マレーシアリングット小計	28,230,000.00	28,868,719.95 (713,634,757)	
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 18/12/21	4,800,000.00	4,822,824.48	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	5,680,000.00	5,568,816.55	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	5,500,000.00	5,223,883.50	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	5,600,000.00	5,428,046.40	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	15,600,000.00	17,481,243.78	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	6,200,000.00	5,681,284.75	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	11,150,000.00	9,284,796.78	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	5,220,000.00	4,813,309.01	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	3,210,000.00	3,086,701.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	8,300,000.00	6,064,688.40	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	8,200,000.00	7,551,105.71	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%- 40/01/31	3,230,000.00	3,101,489.76	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	8,000,000.00	5,831,397.20	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	6,650,000.00	6,206,532.44	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	11,000,000.00	10,296,820.60	
南アフリカランド小計		108,340,000.00	100,442,940.36 (769,392,923)	
合計			151,120,639,275 (151,120,639,275)	

(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 159銘柄	100.0%	43.6%
加ドル	国債証券 32銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 17銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 276銘柄	100.0%	40.6%
英ポンド	国債証券 38銘柄	100.0%	7.1%
スイスフラン	国債証券 6銘柄	100.0%	0.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.7%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%
豪ドル	国債証券 21銘柄	100.0%	2.1%
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git	国債証券 32銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 15銘柄	100.0%	0.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2016年11月30日現在です。

【DCインデックスバランス(株式40)】

【純資産額計算書】

資産総額	3,340,085,178円
負債総額	2,258,306円
純資産総額(-)	3,337,826,872円
発行済口数	1,925,231,414口
1口当たり純資産額(/)	1.7337円

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	26,841,205,101円
負債総額	175,945,871円
純資産総額(-)	26,665,259,230円
発行済口数	20,960,937,808口
1口当たり純資産額(/)	1.2721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	74,397,001,492円
負債総額	230,731,159円
純資産総額(-)	74,166,270,333円
発行済口数	38,119,498,653口
1口当たり純資産額(/)	1.9456円

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	34,405,384,638円
負債総額	174,053,906円
純資産総額（ - ）	34,231,330,732円
発行済口数	24,550,342,221口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3943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	157,653,802,747円
負債総額	644,383,405円
純資産総額（ - ）	157,009,419,342円
発行済口数	73,150,419,816口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1464円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

該当事項はありません。

（2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

（4）受益証券の再発行

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

（5）受益権の再分割

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

（6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

平成28年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28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28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28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	676	124,426

株式投資信託	627	100,560
単位型	166	7,329
追加型	461	93,231
公社債投資信託	49	23,865
単位型	35	429
追加型	14	23,435

3【委託会社等の経理状況】

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第57期事業年度(平成27年4月1日から平成28年3月31日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第58期中間会計期間(平成28年4月1日から平成28年9月30日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

	(単位：百万円)			
	第56期 (平成27年3月31日)		第57期 (平成28年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	14,206	3	14,308
金銭の信託		-	3	153
有価証券		277		86
前払費用	3	509	3	489
未収入金		3		10
未収委託者報酬		8,441		9,374
未収収益	3	1,566	3	2,280
関係会社短期貸付金		436		5,333
立替金		666		2,960
繰延税金資産		1,446		819
その他	2	195	2,3	428
流動資産合計		27,750		36,243
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	56	1	146
器具備品	1	166	1	210
有形固定資産合計		222		356

無形固定資産		
ソフトウェア	113	140
無形固定資産合計	113	140
投資その他の資産		
投資有価証券	14,184	12,195
関係会社株式	21,702	21,702
関係会社長期貸付金	60	60
長期差入保証金	740	781
長期前払費用	0	0
繰延税金資産	248	425
投資その他の資産合計	36,936	35,165
固定資産合計	37,273	35,662
資産合計	65,023	71,905

(単位：百万円)

	第56期 (平成27年3月31日)		第57期 (平成28年3月31日)
負債の部			
流動負債			
預り金	387		410
未払金	5,545		3,841
未払収益分配金	6		6
未払償還金	112		112
未払手数料	3	3,145	3
その他未払金		2,282	
未払費用	3	4,636	3
未払法人税等		814	
未払消費税等	4	1,070	4
関係会社短期借入金		-	
賞与引当金		1,990	
役員賞与引当金		120	
その他	3	82	3
流動負債合計		14,646	
固定負債			
退職給付引当金		1,111	
固定負債合計		1,111	
負債合計		15,758	
純資産の部			
株主資本			
資本金		17,363	
資本剰余金			
資本準備金		5,220	
資本剰余金合計		5,220	
利益剰余金			
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金		25,836	
利益剰余金合計		25,836	

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

(2)【損益計算書】

(単位：百万円)

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

一般管理費計	13,380	14,577
営業利益	6,146	5,817

(単位：百万円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余 金合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余 金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	22,694	22,694	68	45,209
会計方針の変更による 累積的影響額				41	41		41
会計方針の変更を反映した 当期首残高	17,363	5,220	5,220	22,735	22,735	68	45,250
当期変動額							
当期純利益				3,101	3,101		3,101
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	3,101	3,101	-	3,101
当期末残高	17,363	5,220	5,220	25,836	25,836	68	48,351

	評価・換算差額等			純資産 合計
	その他有 価証券評 価差額金	繰延ヘッ ジ損益	評価・換 算差額等 合計	
当期首残高	321	-	321	45,531
会計方針の変更によ る 累積的影響額				41
会計方針の変更を反映した 当期首残高	321	-	321	45,572
当期変動額				
当期純利益				3,101
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	680	88	591	591
当期変動額合計	680	88	591	3,692
当期末残高	1,002	88	913	49,265

第57期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

(単位：百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余 金合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余 金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	25,836	25,836	68	48,351

会計方針の変更による 累積的影響額							-
会計方針の変更を反映した 当期首残高	17,363	5,220	5,220	25,836	25,836	68	48,351
当期変動額							
剰余金の配当				850	850		850
当期純利益				4,962	4,962		4,962
自己株式の取得						434	434
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	4,111	4,111	434	3,676
当期末残高	17,363	5,220	5,220	29,948	29,948	502	52,028

	評価・換算差額等			純資産 合計
	その他有 価証券評 価差額金	繰延ヘッ ジ損益	評価・換 算差額等 合計	
当期首残高	1,002	88	913	49,265
会計方針の変更による 累積的影響額				-
会計方針の変更を反映した 当期首残高	1,002	88	913	49,265
当期変動額				
剰余金の配当				850
当期純利益				4,962
自己株式の取得				434
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	851	347	503	503
当期変動額合計	851	347	503	3,173
当期末残高	151	258	410	52,438

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1 資産の評価基準及び 評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産 直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法

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

(会計方針の変更)

第57期
(自 平成27年 4月 1日
至 平成28年 3月31日)

（企業結合に関する会計基準等の適用）

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

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

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

（未適用の会計基準等）

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

（1）概要

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

（分類1）から（分類5）に係る分類の要件をいずれも満たさない企業の取扱い

（分類2）及び（分類3）に係る分類の要件

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

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

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

（2）適用予定日

平成29年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

（貸借対照表関係）

第56期 (平成27年3月31日)	第57期 (平成28年3月31日)
1 有形固定資産の減価償却累計額	1 有形固定資産の減価償却累計額
建物 1,122百万円	建物 1,170百万円
器具備品 679百万円	器具備品 653百万円
2 信託資産	2 信託資産
流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。	流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。	3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。
(流動資産)	(流動資産)
現金・預金 4,256百万円	現金・預金 4,072百万円
前払費用 2百万円	金銭の信託 153百万円
未収収益 110百万円	前払費用 2百万円
(流動負債)	未収収益 147百万円
未払手数料 108百万円	その他 193百万円
未払費用 500百万円	(流動負債)
その他 57百万円	未払手数料 93百万円
	未払費用 722百万円
	その他 266百万円

<p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務27百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務842百万円に対して保証を行っております。</p>	<p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務728百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務689百万円に対して保証を行っております。</p>
--	---

(損益計算書関係)

第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p style="text-align: right;">受取配当金 719百万円</p> <p>2 外国税関連費用1,650百万円は、中国税務当局等が平成26年10月31日付に発した「通達79号」に基づき、平成21年11月17日から平成26年11月16日までのQFII(Qualified Foreign Institutional Investors)口座を通じて取得した中国A株の譲渡所得に対して税率10%で遡及課税される金額を合理的に計算したものであります。中国A株に投資している当社の対象ファンドは「中国A株マザーファンド」及び「中国A株CSI300インデックスマザーファンド」の2ファンドであり、ファンドの当時の受益者に負担を求めることが事実上不可能であるため、当社が負担しております。</p>	<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p style="text-align: right;">受取配当金 1,193百万円 支払利息 123百万円 デリバティブ費用 889百万円</p>

(株主資本等変動計算書関係)

第56期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

	新株予約権の目的となる株式の数(株)	当事業

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

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

該当事項はありません。

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

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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	109,600	704,500	-	814,100

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
平成21年度 ストックオプション (1)	普通株式	15,902,700	-	14,140,500	1,762,200	-
平成21年度 ストックオプション (2)	普通株式	1,567,500	-	1,392,600	174,900	-

平成22年度 ストックオプション (1)	普通株式	2,310,000	-	2,310,000	-	-
平成23年度 ストックオプション (1)	普通株式	5,029,200	-	290,400	4,738,800	-
合計		24,809,400	-	18,133,500	6,675,900	-

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

2 平成21年度ストックオプション(1)1,762,200株、平成21年度ストックオプション(2) 174,900株及び平成23年度ストックオプション(1)4,738,800株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年5月30日 取締役会	普通株式	利益 剰余金	1,495	7.62	平成28年3月31日	平成28年6月22日

(リース取引関係)

第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料		オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	841百万円	1年内	865百万円
1年超	3,420百万円	1年超	2,653百万円
合計	4,261百万円	合計	3,518百万円

(金融商品関係)

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシ - ドマネ - の投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計(繰延ヘッジ)を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針」4「ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

平成27年3月31日(当事業年度の決算日)における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	14,206	14,206	-
(2) 未収委託者報酬	8,441	8,441	-
(3) 未収収益	1,566	1,566	-
(4) 有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	14,431	14,431	-
(5) 未払金	(5,545)	(5,545)	-
(6) 未払費用	(4,636)	(4,636)	-
(7) デリバティブ取引(2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(25)	(25)	-

ヘッジ会計が適用されているもの	(57)	(57)	-
デリバティブ取引計	(82)	(82)	-

(1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(5) 未払金及び(6) 未払費用

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

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、上記金額は貸借対照表上、流動負債のその他に含まれております。

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシ・ドマネ・の投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計(繰延ヘッジ)を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針」4「ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	14,308	14,308	-
(2) 未収委託者報酬	9,374	9,374	-
(3) 未収収益	2,280	2,280	-
(4) 関係会社短期貸付金	5,333	5,333	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	12,265	12,265	-

(6) 未払金	(3,841)	(3,841)	-
(7) 未払費用	(4,920)	(4,920)	-
(8) 関係会社短期借入金	(5,631)	(5,631)	-
(9) デリバティブ取引(2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(254)	(254)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	170	170	-
デリバティブ取引計	(84)	(84)	-

(1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金、(7) 未払費用並びに(8) 関係会社短期借入金

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

(9) デリバティブ取引

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

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

(有価証券関係)

第56期(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	18,809

関連会社株式	2,892
--------	-------

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

2 非上場株式等（貸借対照表計上額 30百万円）については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	3,661	270	22
合計	3,661	270	22

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	18,809
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	投資信託	5,593	4,872	720
	小計	5,593	4,872	720
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	6,672	7,175	502
	小計	6,672	7,175	502

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

(デリバティブ取引関係)

第56期(平成27年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等のうち 1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	2,337	-	25	25
	買建	-	-	-	-
合計		2,337	-	25	25

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	投資有価証券	2,586	-	68
	豪ドル		276	-	8
	シンガポールドル		878	-	4
	ユーロ		219	-	1
合計			3,961	-	57

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第57期(平成28年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等のうち 1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	1,093	-	11	11
	買建	-	-	-	-
合計		1,093	-	11	11

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

2 時価の算定方法
金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

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

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

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ会計 の方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ 対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	投資有価証券	3,943	-	179
	豪ドル		767	-	18
	シンガポールドル		75	-	4
	香港ドル		151	-	5
	人民元		1,948	-	8
ユーロ	173		-	0	
合計			7,060	-	170

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

(持分法損益等)

第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額 3,078	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,037
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 9,396	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 9,686
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,720	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,901

(退職給付関係)

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,174
会計方針の変更による累積的影響額	63
会計方針の変更を反映した期首残高	1,110
勤務費用	126
利息費用	7
数理計算上の差異の発生額	47
退職給付の支払額	59
退職給付債務の期末残高	1,233

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.6%

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、196百万円でありました。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,233
会計方針の変更による累積的影響額	-
会計方針の変更を反映した期首残高	1,233
勤務費用	145
利息費用	7
数理計算上の差異の発生額	33
退職給付の支払額	119
退職給付債務の期末残高	1,299

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.2%

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、209百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株

付与日	平成22年 2月 8日	平成22年 8月20日
権利確定条件	平成24年 1月22日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	同左
権利行使期間	平成24年 1月22日から 平成32年 1月21日まで	同左

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

（注） 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション（新株予約権）の数

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

権利未確定残	15,902,700	1,567,500
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

2 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 - 百万円

3 株式公開価格が737円(割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するよう調整される。)を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション（新株予約権）の数

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

(税効果会計関係)

第56期 (平成27年3月31日)		第57期 (平成28年3月31日)	
1	繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 の主な原因別の内訳 (単位：百万円)	1	繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 の主な原因別の内訳 (単位：百万円)
	繰延税金資産(流動)		繰延税金資産(流動)
	賞与引当金		賞与引当金
	658		642
	その他		その他
	813		177
	小計		小計
	1,472		819
	繰延税金資産(固定)		繰延税金資産(固定)
	投資有価証券評価損		投資有価証券評価損
	134		96
	関係会社株式評価損		関係会社株式評価損
	1,510		1,430
	退職給付引当金		退職給付引当金
	360		353
	固定資産減価償却費		固定資産減価償却費
	133		122
	その他		その他
	73		65
	小計		小計
	2,213		2,068
	繰延税金資産小計		繰延税金資産小計
	3,685		2,888
	評価性引当金		評価性引当金
	1,510		1,430
	繰延税金資産合計		繰延税金資産合計
	2,174		1,457
	繰延税金負債(流動)		繰延税金負債(流動)
	その他有価証券評価差額金		その他有価証券評価差額金
	25		71
	小計		繰延ヘッジ利益
	25		114
	繰延税金負債(固定)		その他
	その他有価証券評価差額金		26
	454		小計
	454		213
	繰延税金負債合計		繰延税金負債合計
	480		213
	繰延税金資産の純額		繰延税金資産の純額
	1,694		1,244
2	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等 の負担率との間に重要な差異があるときの、 当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	2	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等 の負担率との間に重要な差異があるときの、 当該差異の原因となった主要な項目別の内訳
	法定実効税率		法定実効税率
	35.6%		33.1%
	(調整)		(調整)
	交際費等永久に損金に算入され ない項目		交際費等永久に損金に算入され ない項目
	1.3%		1.4%
	受取配当金等永久に益金に算入 されない項目		受取配当金等永久に益金に算入 されない項目
	4.3%		4.8%
	税率変更による期末繰延税金資 産の減額修正		税率変更による期末繰延税金資 産の減額修正
	3.6%		1.3%
	海外子会社の留保利益の影響額 等		所得拡大促進税制
	1.7%		2.2%
	税効果会計適用後の法人税等の 負担率		海外子会社の留保利益の影響額 等
	37.9%		0.6%
			税効果会計適用後の法人税等の 負担率
			29.4%

第56期 (平成27年3月31日)	第57期 (平成28年3月31日)
<p>3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」(平成27年法律第9号)の施行に伴い平成26年4月1日に開始する事業年度から、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.1%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.3%となります。この結果、繰延税金資産の金額(繰延税金負債の金額を控除した金額)は135百万円、繰延ヘッジ損益が4百万円、それぞれ減少し、その他有価証券評価差額金が48百万円、法人税等調整額が179百万円、それぞれ増加しております。</p>	<p>3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」(平成28年法律第15号)及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」(平成28年法律第13号)が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日に開始する事業年度から、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.9%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.6%となります。この税率変更により、繰延税金資産の純額(繰延税金負債の金額を控除した金額)が59百万円減少し、その他有価証券評価差額金が3百万円、繰延ヘッジ損益が6百万円、法人税等調整額が69百万円、それぞれ増加しております。</p>

(関連当事者情報)

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千SGD)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	292,000	アセットマネジメント業	直接100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貨建)(注1)	184 (千SGD 2,059) (注2)	関係会社短期貸付金	436 (千SGD 5,000)
							貸付金利息(シンガポールドル貨建)(注1)	7 (千SGD 92)	未収収益	7 (千SGD 82)

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠SGD11,000千、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。
- 資金の貸付に係る取引金額184百万円(2,059千SGD)の内訳は、貸付424百万円(5,000千SGD)及び返済240百万円(2,940千SGD)であります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

三井住友信託銀行株式会社（非上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成26年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計 23,832百万円

負債合計 6,549百万円

純資産合計 17,283百万円

営業収益 15,406百万円

税引前当期純利益 4,977百万円

当期純利益 3,441百万円

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	292,000 (千SGD)	アセットマネジメント業	直接 100.00	資金の貸付	資金の貸付 (シンガポールドル貨建) (注1)	90 (千 SGD 1,000) (注2)	関係会社 短期貸付 金	333 (千 SGD 4,000)
							貸付金利息 (シンガポールドル貨建) (注1)	18 (千 SGD 215)	未収収益	6 (千 SGD 74)
							資金の貸付 (円貨建) (注3)	5,000	関係会社 短期貸付 金	5,000
							貸付金利息 (円貨建) (注3)	70	未収収益	70
	Nikko Asset	アメリカ	181,542	アセット	直接	資金の借入	資金の借入 (米ドル貨建) (注5)	6,176 (千 USD 50,000)	関係会社 短期借入 金	5,631 (千 USD 50,000)

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成27年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

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

(セグメント情報等)

セグメント情報

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

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

関連情報

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

(1 株当たり情報)

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

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
当期純利益（百万円）	3,101	4,962
普通株主に帰属しない金額（百万円）	-	-
普通株式に係る当期純利益（百万円）	3,101	4,962
普通株式の期中平均株式数（千株）	196,903	196,464
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1)15,902,700株、平成21年度ストックオプション(2)1,567,500株、平成22年度ストックオプション(1)2,310,000株、平成23年度ストックオプション(1)5,029,200株	平成21年度ストックオプション(1)1,762,200株、平成21年度ストックオプション(2)174,900株、平成23年度ストックオプション(1)4,738,800株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第56期 (平成27年3月31日)	第57期 (平成28年3月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	49,265	52,438
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	-	-
普通株式に係る期末の純資産額（百万円）	49,265	52,438
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数（千株）	196,903	196,198

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第58期中間会計期間
(平成28年9月30日)

資産の部

流動資産

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

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

(単位：百万円)

第58期中間会計期間
(平成28年9月30日)

負債の部

流動負債

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

固定負債

退職給付引当金		1,203
固定負債合計		1,203

負債合計

12,404

純資産の部

株主資本

資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220

利益剰余金

その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		31,627
利益剰余金合計		31,627

自己株式 672

株主資本合計 53,537

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

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第58期中間会計期間
(自 平成28年4月1日
至 平成28年9月30日)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第58期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

(単位：百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	29,948	29,948	502	52,028
当中間期変動額							
剰余金の配当				1,495	1,495		1,495
中間純利益				3,174	3,174		3,174
自己株式の取得						170	170
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）							
当中間期変動額合計				1,679	1,679	170	1,508
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	31,627	31,627	672	53,537

評価・換算差額等

	その他 有価証券 評価差額金	繰延 ヘッジ 損益	評価・ 換算差額 等合計	純資産 合計
当期首残高	151	258	410	52,438
当中間期変動額				
剰余金の配当				1,495
中間純利益				3,174
自己株式の取得				170
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	491	521	29	29
当中間期変動額合計	491	521	29	1,538
当中間期末残高	340	780	439	53,977

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第58期中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 中間決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(2) 金銭の信託 時価法</p> <p>(3) デリバティブ 時価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、平成28年 4月 1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p>

<p>4 ヘッジ会計の方法</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>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <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、当中間会計期間の費用として処理しております。</p>
--	---

(会計方針の変更)

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

(追加情報)

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

(中間貸借対照表関係)

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

2 信託資産

流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。

3 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

4 保証債務

当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務582百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務558百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第58期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	814,100	305,000	-	1,119,100

(注) 自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会計期間末残高(百万円)
		当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末	
平成21年度ストックオプション(1)	普通株式	1,762,200	-	19,800	1,742,400	-
平成21年度ストックオプション(2)	普通株式	174,900	-	-	174,900	-
平成23年度ストックオプション(1)	普通株式	4,738,800	-	-	4,738,800	-
平成28年度ストックオプション(1)	普通株式	-	4,437,000	-	4,437,000	-
合計		6,675,900	4,437,000	19,800	11,093,100	-

- (注) 1 平成21年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。
 2 平成28年度ストックオプション(1)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。
 3 平成21年度ストックオプション(1)1,742,400株、平成21年度ストックオプション(2) 174,900株及び平成23年度ストックオプション(1)4,738,800株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年5月30日取締役会	普通株式	1,495	7.62	平成28年3月31日	平成28年6月22日

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

該当事項はありません。

(リース取引関係)

第58期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
オペレーティング・リース取引	
解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	865百万円
1年超	2,220百万円
合計	3,085百万円

(金融商品関係)

第58期中間会計期間(平成28年9月30日)

1 金融商品の時価等に関する事項

平成28年9月30日(当中間決算日)における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額(1)	時価(1)	差額

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

(1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益並びに(5) 関係会社短期貸付金

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

(4) 金銭の信託

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

(6) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(7) 未払金及び(8) 未払費用

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

(9) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、上記金額は貸借対照表上、流動資産のその他に含まれております。

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

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

(有価証券関係)

第58期中間会計期間(平成28年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	20,310

関連会社株式	2,892
--------	-------

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	3,215	2,649	565
	小計	3,215	2,649	565
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	8,199	9,255	1,056
	小計	8,199	9,255	1,056
合計		11,414	11,905	490

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

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

(デリバティブ取引関係)

第58期中間会計期間(平成28年9月30日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	3,386	-	24	24
合計		3,386	-	24	24

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		3,575	-	156
	豪ドル		67	-	1
	シンガポールドル		685	-	38

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第58期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	3,017百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	8,257百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,144百万円

(ストックオプション等関係)

第58期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第58期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

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

[関連情報]

第58期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第58期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第58期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第58期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第58期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
1株当たり純資産額	275円54銭
1株当たり中間純利益金額	16円18銭

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

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第58期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
中間純利益(百万円)	3,174
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式に係る中間純利益(百万円)	3,174
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,123
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1) 1,742,400株、 平成21年度ストックオプション(2) 174,900株、 平成23年度ストックオプション(1) 4,738,800株、 平成28年度ストックオプション(1) 4,437,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第58期中間会計期間 (平成28年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円)	53,977
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額(百万円)	53,977
1株当たり純資産額の算定に用いられた 中間会計期間末の普通株式の数(千株)	195,893

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

禁止されています。

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

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (平成28年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28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	47,937百万円	
損保ジャパン日本興亜 D C 証券株式会社	3,000百万円	
株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
住友生命保険相互会社	170,000百万円 (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。
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・計算事務などを行ないます。

(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ないます。

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28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・使用することがあります。
- (7) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (8) 交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

平成28年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第57期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成28年12月15日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

P w Cあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 鶴田 光夫
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCインデックスバランス（株式40）の平成27年11月7日から平成28年11月7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40）の平成28年11月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月5日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第58期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。