

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年2月5日提出
【計算期間】	第13期(自 平成26年11月7日至 平成27年11月6日)
【ファンド名】	D C インデックスバランス(株式40)
【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
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

4つの異なる資産に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざします。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

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

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

年1回

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

グローバル(含む日本)

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジなし

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。

主として、国内株式、海外株式、国内債券、海外債券の4つの資産に投資を行ないます。国際分散投資によりリスク低減をはかりながら、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。

2. インデックスファンドで構成しています。

各資産の運用は資産全体の値動きを表す代表的な指数に連動することをめざすインデックス運用で行ないます。

<国内株式>

「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

主としてわが国の株式に投資し、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<海外株式>

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

主として日本を除く世界各国の株式(DR(預託証券)およびカントリーファンドなどを含みます。)に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス(円ヘッジなし円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<国内債券>

「日本債券インデックスマザーファンド」

主としてわが国の公社債に投資し、日興債券パフォーマンスインデックス(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。

※**日興債券パフォーマンスインデックス(総合)**: 同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はSMBC日興証券株式会社に帰属します。また、SMBC日興証券株式会社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。

※**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。

※基本投資比率から乖離した場合は、一定のルールに従い基本投資比率になるように調整を行ないます。

○市況動向および資金動向などにより、上記のような運用ができない場合があります。

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

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。

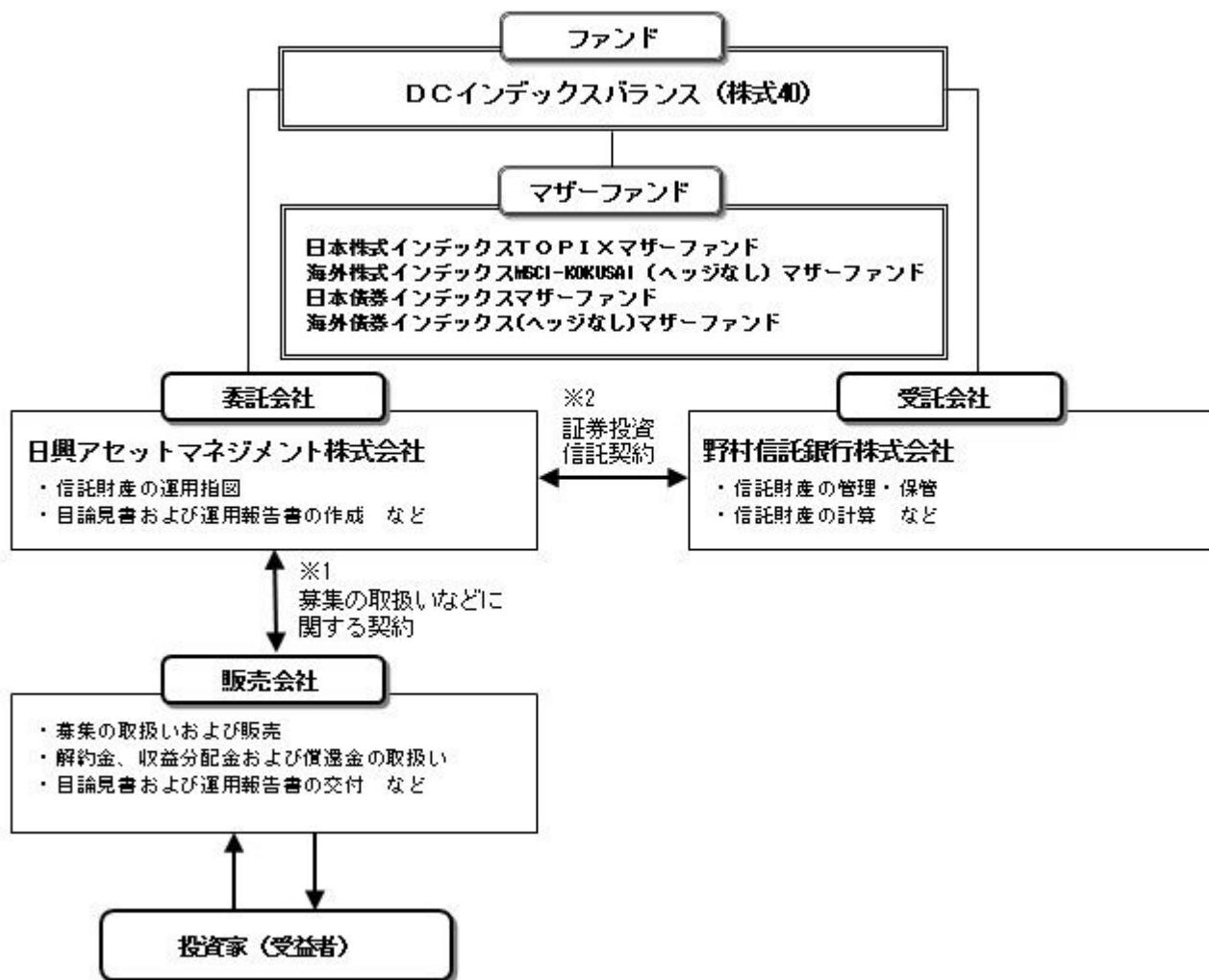
(2) 【ファンドの沿革】

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27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す。)

- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

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

同じ。)で16)に定めるもの以外のもの

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

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

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

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

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

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

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

<海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

投資対象とするマザーファンドの概要

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX(東証株価指数)*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・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ます。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成11年10月29日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

* T O P I X（東証株価指数）は、東京証券取引所第一部に上場されている普通株式全銘柄（算出対象除外後の整理ポスト割当銘柄および算出対象組入前の新規上場銘柄を除きます。）の浮動株調整後の時価総額を指数化したもので、市場全体の動向を反映するものです。
T O P I Xの指数値およびT O P I Xの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびT O P I Xの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

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

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカン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。 運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
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、日興債券パフォーマンスインデックス（総合） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。
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、日興債券パフォーマンスインデックス（総合）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。 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。
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）

* 日興債券パフォーマンスインデックス（総合）は、日興リサーチセンター株式会社が発表している、日本の債券市場の動きを表す指数です。国債、地方債、政府保証債、財投機関債、金融債、事業債などの円建て公募利付債で構成されています。対象となる債券は残存年数1年以上、残存額面10億円以上で、格付会社からBBB格相当以上の格付を取得している発行体に限られます。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はSMBC日興証券株式会社に帰属します。また、SMBC日興証券株式会社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

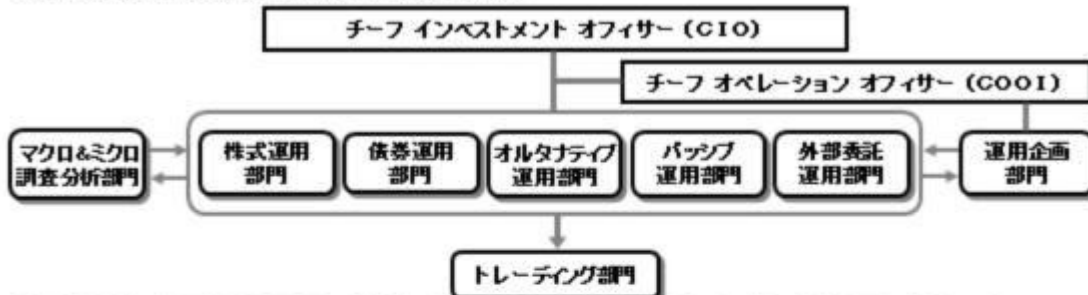
運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として世界各国の債券に投資し、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先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。
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）
-----	-----------------------

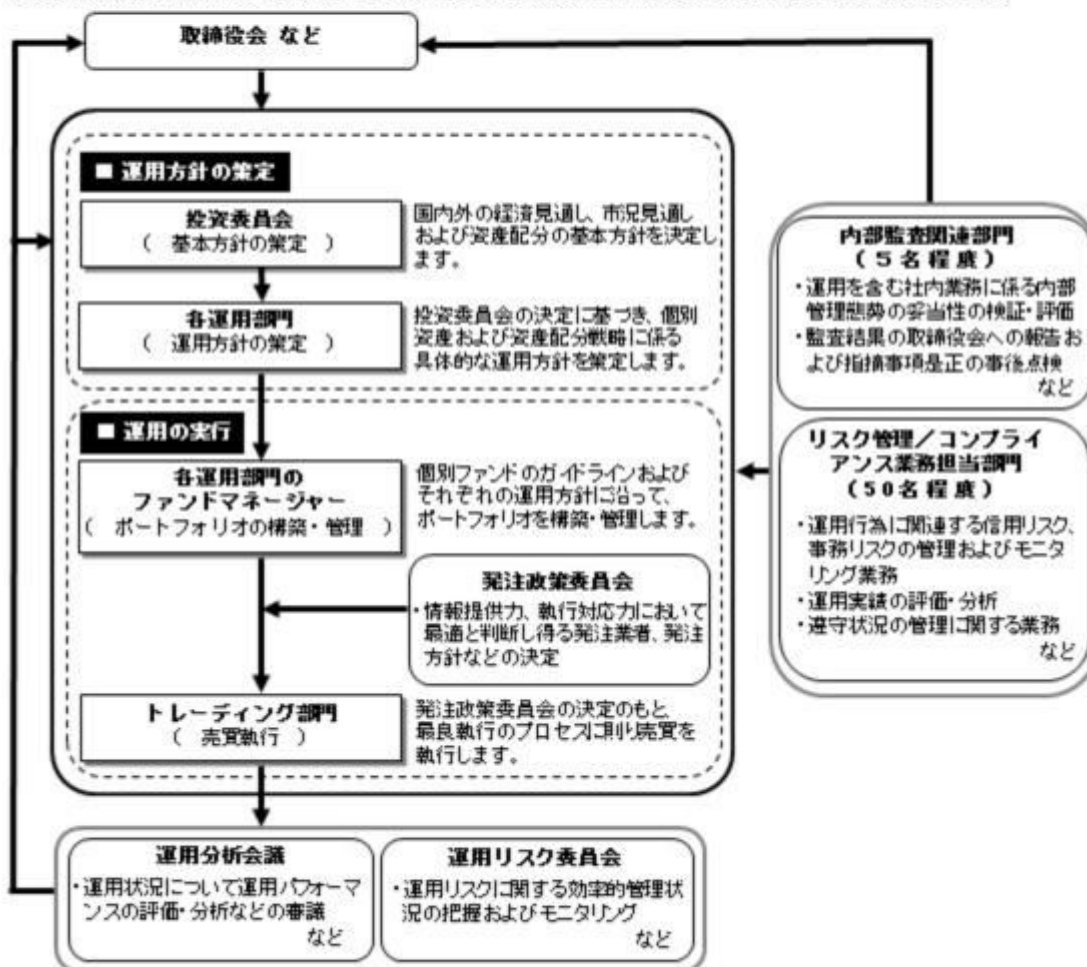
*シティ世界国債インデックス（除く日本）は、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが開発した、日本を除く世界の主要国の国債市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

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

上記体制は平成27年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

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

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

< DCインデックスバランス(株式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。資金借入れおよび借入期間は、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弁済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。
- <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。

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。

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

総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 15) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

<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。

<海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 3) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）、および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 4) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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す。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出入などがあり、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。

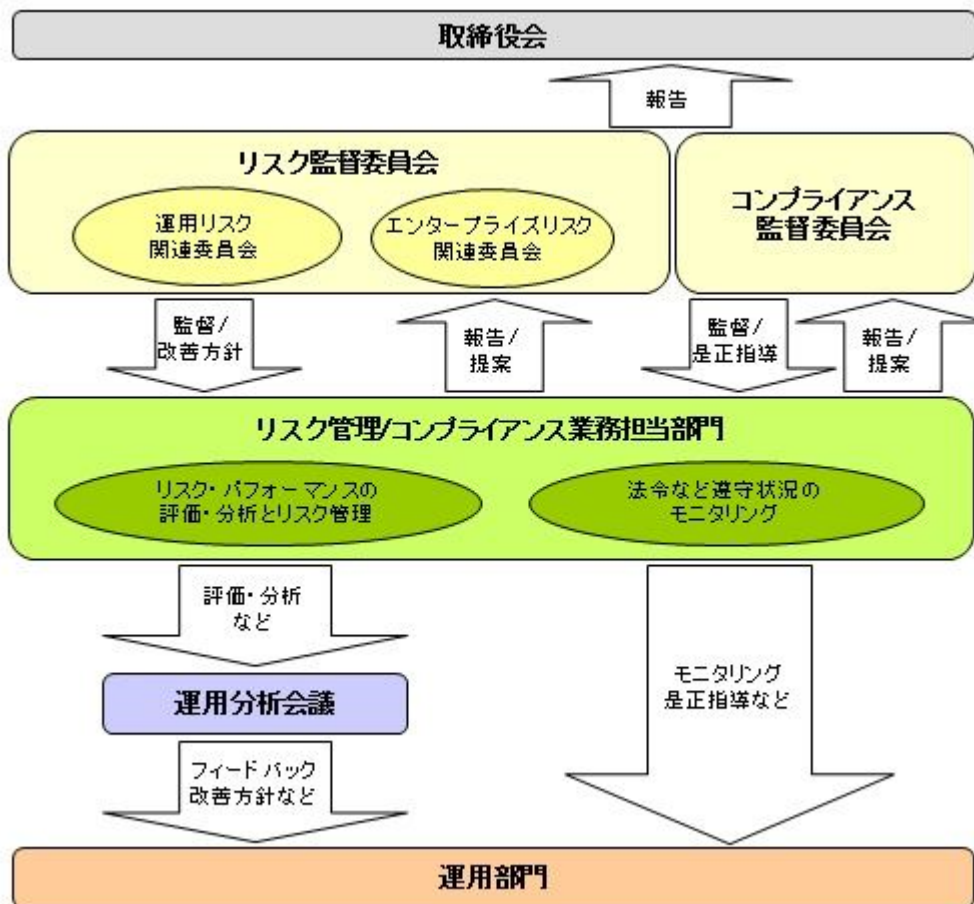
・ 運用制限や規制上の制限に関する事項

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

**全社リスク管理**

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

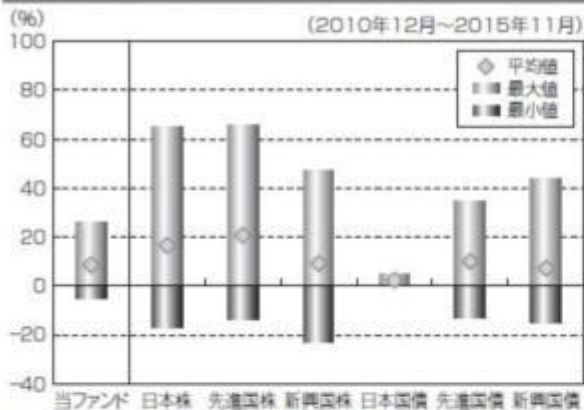
運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は平成27年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との平均騰落率、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	8.5%	16.4%	20.6%	9.1%	2.3%	10.0%	7.2%
最大値	26.0%	65.0%	65.7%	47.4%	4.5%	34.9%	43.7%
最小値	-4.8%	-17.0%	-13.6%	-22.8%	0.4%	-12.7%	-15.0%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2010年12月から2015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-ボンド・パフォーマンス・インデックス国債

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ィファイド(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-ボンド・パフォーマンス・インデックス国債

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

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2010年12月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

Index LLC に帰属します。

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド（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。

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

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

< 投資対象とするマザーファンドに係る費用 >

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

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

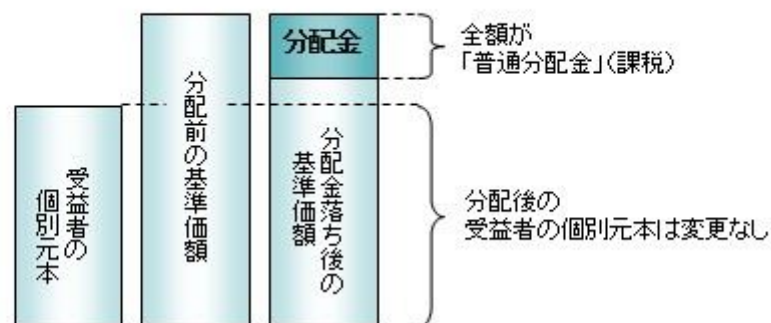
- 1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

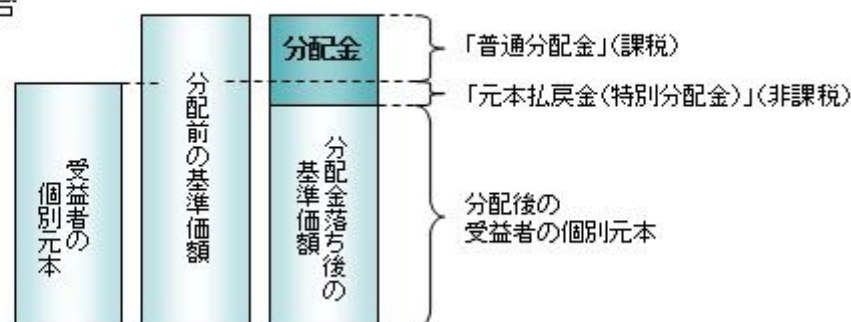
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
 - 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28年 2月 5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2015年11月30日現在です。

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

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,898,402,549	94.98
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		153,100,663	5.02
合計(純資産総額)		3,051,503,212	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	1,029,699,418	1.3371	1,376,815,069	1.3387	1,378,458,610	45.17
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	677,413,861	1.3238	896,783,857	1.3381	906,447,487	29.70
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	149,628,490	2.0478	306,414,810	2.0519	307,022,698	10.06
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	131,460,453	2.3246	305,601,107	2.3313	306,473,754	10.04

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	94.98
合計	94.98

【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4計算期間末	(2006年11月 6日)	804	805	1.3524	1.3534
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
	2014年11月末日	2,687		1.6600	
	12月末日	2,724		1.6709	
	2015年 1月末日	2,728		1.6614	
	2月末日	2,796		1.7057	
	3月末日	2,843		1.7156	
	4月末日	2,889		1.7360	
	5月末日	3,028		1.7698	
	6月末日	3,037		1.7460	
	7月末日	3,075		1.7646	
	8月末日	2,964		1.7135	
	9月末日	2,896		1.6634	
	10月末日	3,035		1.7351	
	11月末日	3,051		1.7435	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第4期	2005年11月 8日～2006年11月 6日	0.0010
第5期	2006年11月 7日～2007年11月 6日	0.0010
第6期	2007年11月 7日～2008年11月 6日	0.0010
第7期	2008年11月 7日～2009年11月 6日	0.0010
第8期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	0.0010
第9期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	0.0010
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	0.0010
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	0.0010
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	0.0010
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	0.0010

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
---	----	--------

第4期	2005年11月 8日～2006年11月 6日	5.74
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

(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4期	2005年11月 8日～2006年11月 6日	221,444,810	49,438,556
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

（参考）

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2015年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	27,746,545,690	99.16
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		234,118,313	0.84
合計（純資産総額）		27,980,664,003	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	189,840,000	0.68

(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	151,800	7,560.00	1,147,608,000	7,657.00	1,162,332,600	4.15
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	943,900	789.80	745,492,220	790.00	745,681,000	2.66
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	94,200	4,893.35	460,953,570	4,697.00	442,457,400	1.58
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	66,700	6,663.48	444,454,116	6,537.00	436,017,900	1.56
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	107,300	4,087.00	438,535,100	4,002.00	429,414,600	1.53
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	90,900	4,575.00	415,867,500	4,565.00	414,958,500	1.48
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,656,900	248.40	411,573,960	248.50	411,739,650	1.47
日本	株式	KDDI	情報・通信業	119,500	2,929.00	350,015,500	3,058.00	365,431,000	1.31
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	79,000	4,229.00	334,091,000	4,410.00	348,390,000	1.25
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	49,700	5,788.10	287,668,570	5,983.00	297,355,100	1.06
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	49,200	5,375.00	264,450,000	5,520.00	271,584,000	0.97
日本	株式	ファナック	電気機器	12,200	20,400.00	248,880,000	21,920.00	267,424,000	0.96
日本	株式	ソニー	電気機器	84,100	3,507.00	294,938,700	3,177.00	267,185,700	0.95
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	21,800	11,450.00	249,610,000	11,620.00	253,316,000	0.91
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	139,800	1,684.00	235,423,200	1,733.50	242,343,300	0.87
日本	株式	村田製作所	電気機器	12,500	17,170.00	214,625,000	19,100.00	238,750,000	0.85
日本	株式	キヤノン	電気機器	64,200	3,812.00	244,730,400	3,716.00	238,567,200	0.85
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	10,700	21,560.00	230,692,000	21,985.00	235,239,500	0.84
日本	株式	三菱地所	不動産業	87,000	2,596.50	225,895,500	2,589.50	225,286,500	0.81
日本	株式	日立製作所	電気機器	304,000	728.77	221,546,080	726.60	220,886,400	0.79
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	167,300	1,244.50	208,204,850	1,314.50	219,915,850	0.79
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	47,700	4,793.00	228,626,100	4,540.00	216,558,000	0.77
日本	株式	花王	化学	33,600	5,913.00	198,676,800	6,311.00	212,049,600	0.76
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	90,700	2,337.50	212,011,250	2,328.00	211,149,600	0.75
日本	株式	三井不動産	不動産業	62,000	3,339.00	207,018,000	3,104.00	192,448,000	0.69
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	37,700	4,639.00	174,890,300	5,088.00	191,817,600	0.69
日本	株式	パナソニック	電気機器	136,200	1,419.50	193,335,900	1,397.50	190,339,500	0.68
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	42,100	4,420.00	186,082,000	4,380.00	184,398,000	0.66
日本	株式	三菱商事	卸売業	88,300	2,269.00	200,352,700	2,072.00	182,957,600	0.65

日本	株式	キーエンス	電気機器	2,700	59,850.00	161,595,000	66,720.00	180,144,000	0.64
----	----	-------	------	-------	-----------	-------------	-----------	-------------	------

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.36
		建設業	2.84
		食料品	4.39
		繊維製品	0.73
		パルプ・紙	0.24
		化学	6.03
		医薬品	5.17
		石油・石炭製品	0.48
		ゴム製品	0.90
		ガラス・土石製品	0.95
		鉄鋼	1.23
		非鉄金属	0.90
		金属製品	0.67
		機械	4.69
		電気機器	12.05
		輸送用機器	10.80
		精密機器	1.55
		その他製品	1.55
		電気・ガス業	2.04
		陸運業	4.26
		海運業	0.26
		空運業	0.62
		倉庫・運輸関連業	0.21
		情報・通信業	7.21
		卸売業	4.02
		小売業	4.83
銀行業	8.98		
証券、商品先物取引業	1.20		
保険業	2.50		
その他金融業	1.33		
不動産業	2.75		
サービス業	3.32		
合 計			99.16

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2015年12月	買建	12	日本円	187,312,160	189,840,000	0.68

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

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2015年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	アメリカ	47,217,834,640	59.30
	カナダ	2,637,532,255	3.31
	モーリシャス	4,008,589	0.01
	ドイツ	2,986,869,974	3.75
	イタリア	706,408,333	0.89
	フランス	2,926,437,192	3.67
	オランダ	1,268,085,249	1.59
	スペイン	1,078,853,629	1.35
	ベルギー	469,607,096	0.59
	オーストリア	58,133,476	0.07
	ルクセンブルク	71,263,042	0.09
	フィンランド	290,894,054	0.37
	アイルランド	1,346,991,085	1.69
	ポルトガル	46,090,475	0.06
	イギリス	6,071,822,973	7.62
	スイス	3,183,546,080	4.00
	スウェーデン	897,612,756	1.13
	ノルウェー	185,362,330	0.23
	デンマーク	583,473,292	0.73
	ケイマン	167,344,599	0.21
	オーストラリア	1,844,748,699	2.32
	バミューダ	156,726,767	0.20
ニュージーランド	36,048,606	0.05	
香港	744,387,603	0.93	
シンガポール	462,790,263	0.58	
イスラエル	201,976,286	0.25	

	ジャージー	344,513,626	0.43
	英ヴァージン諸島	23,709,271	0.03
	小計	76,013,072,240	95.46
投資証券	アメリカ	1,469,852,071	1.85
	カナダ	12,423,611	0.02
	フランス	104,070,587	0.13
	イギリス	111,532,259	0.14
	オーストラリア	213,146,976	0.27
	香港	38,861,030	0.05
	シンガポール	25,240,647	0.03
	小計	1,975,127,181	2.48
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,643,138,163	2.06
合計（純資産総額）		79,631,337,584	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	1,155,066,831	1.45
	買建	ドイツ	383,756,436	0.48

(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		966,258,600	1.21
	売建		38,961,000	0.05

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	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	122,012	14,625.40	1,784,474,988	14,469.42	1,765,443,385	2.22
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	162,614	6,493.49	1,055,932,935	6,623.68	1,077,103,522	1.35
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	88,761	10,191.60	904,616,928	9,976.66	885,539,082	1.11
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	200,693	3,624.41	727,395,362	3,728.81	748,347,109	0.94
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	12,320.07	724,679,085	12,573.08	739,561,339	0.93

アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	103,780	6,724.39	697,857,713	6,802.99	706,015,319	0.89
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	8,345	73,572.86	613,965,555	82,689.79	690,046,324	0.87
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	78,970	7,844.51	619,481,223	8,249.81	651,488,238	0.82
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	68,323	8,997.33	614,724,919	9,104.58	622,052,766	0.78
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	6,502	86,219.64	560,600,100	92,146.93	599,139,360	0.75
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	45,230	12,550.97	567,680,636	12,951.36	585,790,420	0.74
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	6,040	88,348.11	533,622,588	94,813.35	572,672,667	0.72
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	129,497	4,143.94	536,628,679	4,123.06	533,924,859	0.67
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	57,109	9,460.82	540,298,232	9,297.47	530,969,443	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	129,610	4,182.02	542,031,742	4,027.26	521,974,180	0.66
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	48,783	10,772.96	525,537,698	10,576.33	515,945,472	0.65
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	14,878	31,496.63	468,606,876	32,831.33	488,464,602	0.61
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	34,253	13,889.71	475,764,367	14,140.26	484,346,552	0.61
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	86,147	5,669.37	488,399,320	5,555.14	478,559,386	0.60
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	222,679	2,028.98	451,812,663	2,146.89	478,068,120	0.60
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	87,642	5,255.46	460,599,708	5,299.68	464,474,817	0.58
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	27,980	15,304.60	428,222,714	16,548.76	463,034,495	0.58
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	39,751	11,206.09	445,453,554	11,099.24	441,206,024	0.55
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	64,377	6,588.06	424,119,848	6,658.07	428,626,714	0.54
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	100,232	4,286.41	429,636,249	4,232.37	424,219,632	0.53
アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	31,494	13,263.33	417,715,372	13,264.56	417,754,053	0.52
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	41,492	9,465.73	392,752,377	9,805.94	406,868,428	0.51
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	24,480	16,922.13	414,253,978	16,535.25	404,783,082	0.51
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	406,751	956.22	388,946,695	987.42	401,636,267	0.50
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	60,153	6,494.72	390,676,988	6,627.36	398,656,019	0.50

ロ.種類別及び業種別の投資比率

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

株式	国外	エネルギー	6.98
		素材	4.25
		資本財	7.02
		商業・専門サービス	0.89
		運輸	1.89
		自動車・自動車部品	1.71
		耐久消費財・アパレル	1.78
		消費者サービス	1.77
		メディア	3.07
		小売	4.03
		食品・生活必需品小売り	2.04
		食品・飲料・タバコ	6.15
		家庭用品・パーソナル用品	2.13
		ヘルスケア機器・サービス	3.50
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.97
		銀行	8.94
		各種金融	4.01
		保険	4.35
		不動産	0.61
		ソフトウェア・サービス	8.30
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.20		
電気通信サービス	3.05		
公益事業	2.98		
半導体・半導体製造装置	1.82		
投資証券		2.48	
合計		97.94	

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500 1512	買建	18	米ドル	9,297,000	1,141,857,540	9,404,550	1,155,066,831	1.45
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1512	買建	90	ユーロ	2,904,300	377,210,484	2,954,700	383,756,436	0.48

(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	5,950,000.00	720,455,200	729,901,000	0.92
	ユーロ	買建	1,820,000.00	241,387,460	236,357,600	0.30
	ユーロ	売建	300,000.00	39,027,000	38,961,000	0.05

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2015年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	27,944,891,440	80.02
地方債証券	日本	2,220,593,000	6.36
特殊債券	日本	2,709,581,000	7.76
社債券	日本	1,783,644,000	5.11
	オーストラリア	101,287,000	0.29
	小計	1,884,931,000	5.40
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		164,140,906	0.47
合計(純資産総額)		34,924,137,346	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	750,000,000	104.33	782,535,000	104.26	782,002,500	1.300	2019/3/20	2.24
日本	国債証券	第107回利付国債(5年)	705,000,000	100.39	707,791,800	100.43	708,031,500	0.200	2017/12/20	2.03
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	581,000,000	105.33	611,973,110	105.24	611,444,400	1.400	2019/9/20	1.75
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	545,000,000	109.22	595,259,900	109.21	595,216,300	1.400	2022/12/20	1.70
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	563,000,000	105.21	592,354,820	105.15	592,033,910	1.300	2019/12/20	1.70
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	560,000,000	100.25	561,422,400	100.31	561,775,200	0.100	2020/6/20	1.61
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	505,000,000	100.26	506,328,150	100.32	506,621,050	0.100	2020/3/20	1.45
日本	国債証券	第117回利付国債(5年)	470,000,000	100.61	472,867,000	100.64	473,017,400	0.200	2019/3/20	1.35

日本	国債証券	第284回利付国債(10年)	462,000,000	101.94	470,990,520	101.79	470,288,280	1.700	2016/12/20	1.35
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	410,000,000	106.63	437,203,500	106.63	437,183,000	1.300	2021/3/20	1.25
日本	国債証券	第102回利付国債(5年)	400,000,000	100.34	401,372,000	100.33	401,320,000	0.300	2016/12/20	1.15
日本	国債証券	第29回利付国債(30年)	276,000,000	123.77	341,621,760	123.58	341,091,840	2.400	2038/9/20	0.98
日本	国債証券	第120回利付国債(5年)	330,000,000	100.66	332,181,300	100.70	332,316,600	0.200	2019/9/20	0.95
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	325,000,000	100.27	325,877,850	100.31	326,010,750	0.100	2020/9/20	0.93
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	280,000,000	113.39	317,506,000	113.58	318,024,000	1.700	2032/9/20	0.91
日本	国債証券	第292回利付国債(10年)	306,000,000	104.02	318,325,680	103.91	317,976,840	1.700	2018/3/20	0.91
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	260,000,000	120.34	312,884,000	120.35	312,923,000	2.300	2026/9/20	0.90
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	260,000,000	120.13	312,345,800	120.08	312,208,000	2.300	2026/6/20	0.89
日本	国債証券	第106回利付国債(5年)	310,000,000	100.36	311,116,000	100.38	311,199,700	0.200	2017/9/20	0.89
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	300,000,000	100.26	300,807,000	100.32	300,969,000	0.100	2019/12/20	0.86
日本	国債証券	第291回利付国債(10年)	287,000,000	103.07	295,816,640	102.99	295,598,520	1.300	2018/3/20	0.85
日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	240,000,000	119.77	287,464,800	119.88	287,714,400	2.100	2029/9/20	0.82
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	261,000,000	102.36	267,175,260	102.21	266,783,760	1.700	2017/3/20	0.76
日本	国債証券	第36回利付国債(30年)	230,000,000	115.91	266,611,400	115.64	265,981,200	2.000	2042/3/20	0.76
日本	国債証券	第50回利付国債(20年)	237,000,000	109.89	260,458,260	109.83	260,318,430	1.900	2021/3/22	0.75
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	208,000,000	124.06	258,046,880	124.24	258,431,680	2.400	2034/3/20	0.74
日本	国債証券	第137回利付国債(20年)	220,000,000	113.55	249,814,400	113.73	250,212,600	1.700	2032/6/20	0.72
日本	国債証券	第301回利付国債(10年)	223,000,000	105.36	234,972,870	105.28	234,783,320	1.500	2019/6/20	0.67
日本	国債証券	第149回利付国債(20年)	215,000,000	108.62	233,543,750	108.93	234,199,500	1.500	2034/6/20	0.67
日本	国債証券	第290回利付国債(10年)	226,000,000	103.31	233,482,860	103.22	233,290,760	1.400	2018/3/20	0.67

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	80.02
地方債証券	6.36
特殊債券	7.76
社債券	5.40
合計	99.53

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2015年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	77,994,327,080	42.87
	カナダ	3,723,975,034	2.05
	メキシコ	1,870,960,668	1.03
	ドイツ	13,250,814,423	7.28
	イタリア	17,516,306,233	9.63
	フランス	17,084,056,302	9.39
	オランダ	4,411,421,992	2.42
	スペイン	9,801,650,410	5.39
	ベルギー	4,488,085,876	2.47
	オーストリア	2,748,571,527	1.51
	フィンランド	1,079,711,540	0.59
	アイルランド	1,417,014,042	0.78
	イギリス	15,253,961,323	8.39
	スイス	526,073,508	0.29
	スウェーデン	815,275,942	0.45
	ノルウェー	504,944,817	0.28
	デンマーク	1,208,607,820	0.66
	ポーランド	931,705,059	0.51
	オーストラリア	3,134,544,130	1.72
	シンガポール	660,765,221	0.36
マレーシア	814,437,370	0.45	
南アフリカ	853,126,281	0.47	
	小計	180,090,336,598	99.00
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,826,581,308	1.00
合計（純資産総額）		181,916,917,906	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		79,926,490	0.04

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,000,000	16,773.56	2,012,827,894	16,543.27	1,985,193,394	8.000	2021/11/15	1.09
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	14,250,000	13,592.71	1,936,962,554	13,430.55	1,913,854,643	3.625	2021/2/15	1.05
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,300,000	13,461.26	1,790,348,099	13,328.84	1,772,736,862	3.625	2020/2/15	0.97
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,000,000	13,312.53	1,730,629,753	13,182.99	1,713,789,979	3.375	2019/11/15	0.94
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,950,000	16,481.86	1,310,308,528	16,239.10	1,291,008,996	8.750	2020/8/15	0.71
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,500,000	13,424.80	1,275,356,163	13,280.87	1,261,682,842	3.500	2020/5/15	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,400,000	13,315.41	1,251,649,024	13,189.71	1,239,833,357	3.750	2018/11/15	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,250,000	12,949.83	1,197,859,621	12,857.71	1,189,338,984	4.625	2017/2/15	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,850,000	13,349.95	1,181,471,307	13,236.73	1,171,450,922	4.000	2018/8/15	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,300,000	12,611.11	1,172,834,087	12,483.50	1,160,965,645	2.000	2020/7/31	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,300,000	12,410.57	1,154,183,678	12,280.08	1,142,047,527	2.000	2023/2/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,800,000	13,034.27	1,147,015,980	12,941.19	1,138,825,421	4.500	2017/5/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	12,701.31	1,143,118,363	12,620.71	1,135,864,307	3.125	2017/1/31	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,600,000	13,189.71	1,134,315,625	13,100.48	1,126,641,293	4.750	2017/8/15	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,800,000	12,756.00	1,122,528,742	12,692.67	1,116,955,785	3.250	2017/3/31	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,800,000	12,709.95	1,118,475,683	12,640.86	1,112,396,093	2.750	2017/5/31	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,950,000	12,462.39	1,115,384,072	12,369.31	1,107,053,901	1.500	2018/12/31	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,700,000	12,688.84	1,103,929,188	12,616.87	1,097,668,246	3.250	2016/12/31	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	13,834.52	1,106,761,725	13,696.34	1,095,707,925	8.750	2017/5/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,340,000	12,737.77	1,062,330,629	12,646.62	1,054,728,264	2.250	2018/7/31	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,300,000	12,520.92	1,039,236,632	12,424.01	1,031,192,882	1.750	2019/9/30	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,950,000	13,046.74	1,037,216,338	12,946.95	1,029,282,934	3.500	2018/2/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,500,000	12,153.42	1,033,040,939	12,029.64	1,022,519,679	1.750	2023/5/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,550,000	13,230.97	998,938,718	13,120.63	990,607,588	3.875	2018/5/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,400,000	12,842.36	950,335,103	12,750.25	943,518,593	2.750	2018/2/28	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,810,000	13,193.32	898,465,391	13,075.53	890,443,752	7.500	2016/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,800,000	13,169.56	895,530,516	13,072.65	888,940,455	4.250	2017/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	12,769.44	893,860,931	12,686.92	888,084,553	3.125	2017/4/30	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	12,768.48	893,793,763	12,674.44	887,211,379	2.375	2018/6/30	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	12,595.76	881,703,669	12,532.43	877,270,635	2.750	2016/11/30	0.48

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.00
合計	99.00

投資不動産物件

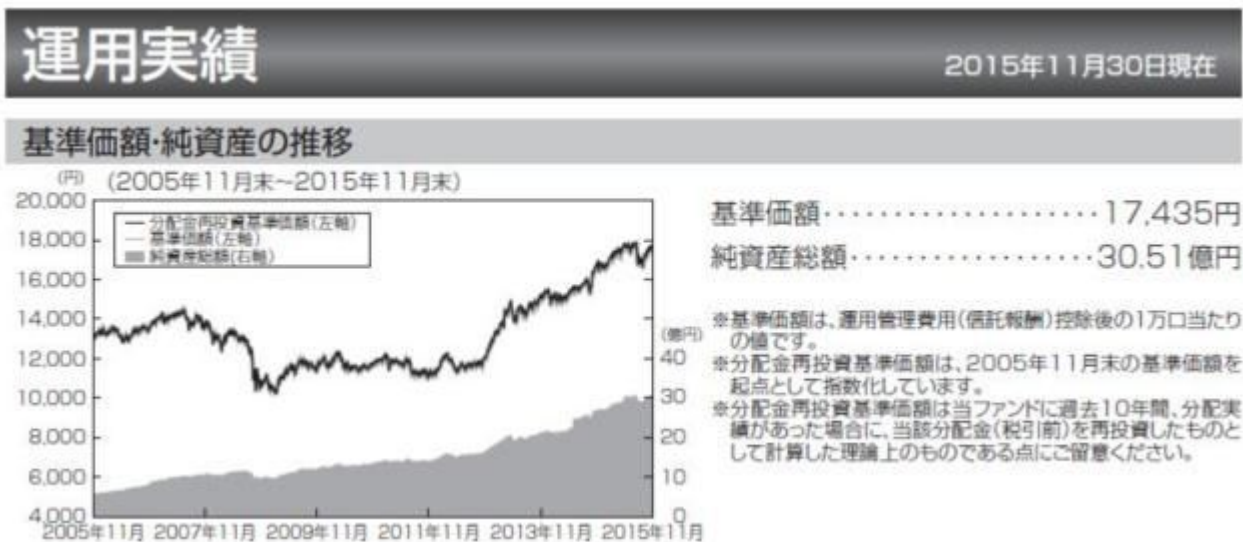
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	米ドル	売建	107,000.00	13,119,698	13,140,670	0.01
	加ドル	売建	114,000.00	10,507,140	10,462,920	0.01
	ユーロ	売建	338,000.00	44,020,951	43,896,060	0.02
	ポーランドズロチ	売建	171,000.00	5,213,499	5,201,820	0.00
	豪ドル	売建	82,000.00	7,261,387	7,225,020	0.00

(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)

2011年11月	2012年11月	2013年11月	2014年11月	2015年11月	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	100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	29.70%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	10.06%
日本債券インデックスマザーファンド	45.17%
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	5.02%

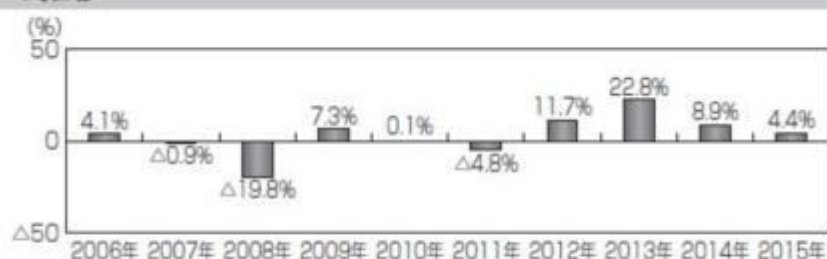
※当ファンドの対純資産総額比です。

<組入上位銘柄>

組入資産	銘柄	業種	比率	
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	1 トヨタ自動車	輸送用機器	4.15%	
	2 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.66%	
	3 三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.58%	
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.22%	
	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1.35%	
	3 EXXON MOBIL CORP	エネルギー	1.11%	
組入資産	銘柄	種類	償還期限	比率
日本債券インデックス マザーファンド	1 第299回利付国債(10年)	国債証券	2019/3/20	2.24%
	2 第107回利付国債(5年)	国債証券	2017/12/20	2.03%
	3 第303回利付国債(10年)	国債証券	2019/9/20	1.75%
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	1.09%
	2 US TREASURY N/B (クーポン3.625%)	国債証券	2021/2/15	1.05%
	3 US TREASURY N/B (クーポン3.625%)	国債証券	2020/2/15	0.97%

※各マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



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

※当ファンドにはベンチマークはありません。

※2015年は、2015年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。

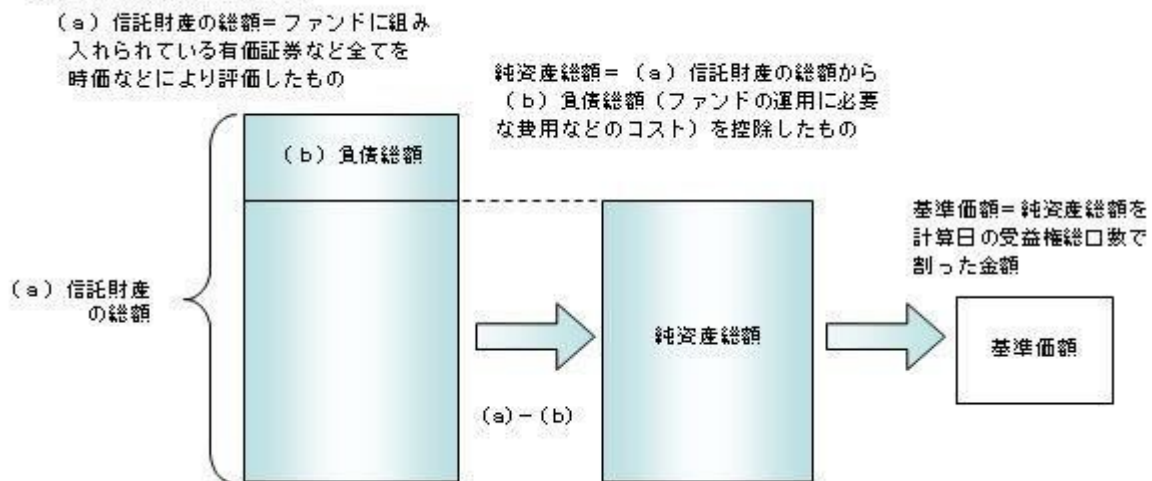
3【資産管理等の概要】

(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

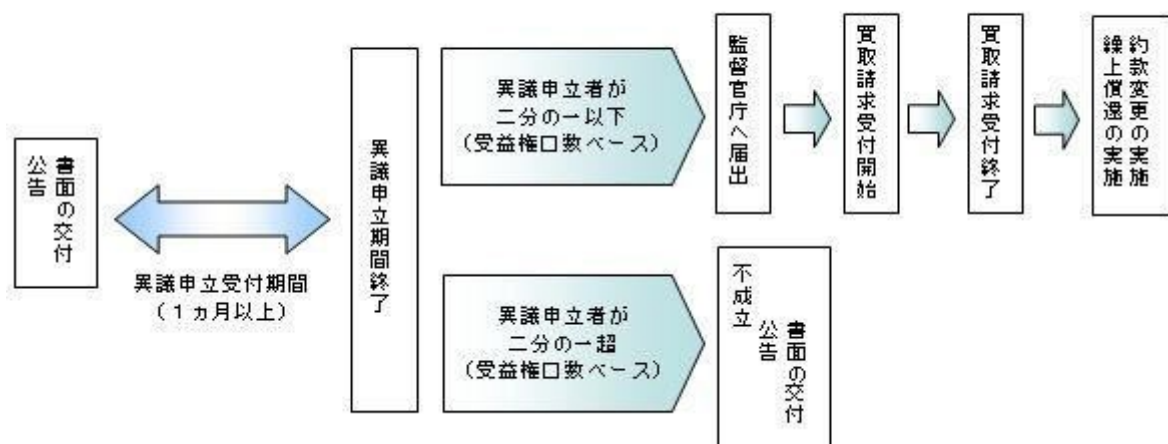
 - 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
 - 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。

- 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ことができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
- 4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

異議の申立て

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

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期計算期間(平成26年11月7日から平成27年11月6日まで)の財務諸表について、PwCあらた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12期 平成26年11月 6日現在	第13期 平成27年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	92,027,672	154,050,016
親投資信託受益証券	2,527,380,329	2,903,764,889
未収入金	45,923,548	-
未収利息	124	251
流動資産合計	2,665,331,673	3,057,815,156
資産合計	2,665,331,673	3,057,815,156
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,638,553	1,757,126
未払解約金	3,339,313	617,376
未払受託者報酬	394,183	485,882
未払委託者報酬	3,548,236	4,255,200
その他未払費用	64,333	79,307
流動負債合計	8,984,618	7,194,891
負債合計	8,984,618	7,194,891
純資産の部		
元本等		
元本	1,638,553,285	1,757,126,484
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,017,793,770	1,293,493,781
（分配準備積立金）	509,913,611	627,312,638
元本等合計	2,656,347,055	3,050,620,265
純資産合計	2,656,347,055	3,050,620,265
負債純資産合計	2,665,331,673	3,057,815,156

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自	平成25年11月 7日 至 平成26年11月 6日	自	平成26年11月 7日 至 平成27年11月 6日
営業収益				
受取利息		65,202		83,149
有価証券売買等損益		241,019,946		197,484,506
営業収益合計		241,085,148		197,567,655
営業費用				
受託者報酬		732,174		932,303
委託者報酬		6,590,683		8,273,485
その他費用		119,159		152,169
営業費用合計		7,442,016		9,357,957
営業利益又は営業損失（ ）		233,643,132		188,209,698
経常利益又は経常損失（ ）		233,643,132		188,209,698
当期純利益又は当期純損失（ ）		233,643,132		188,209,698
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（ ）		8,836,072		14,008,474
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		663,281,379		1,017,793,770
剰余金増加額又は欠損金減少額		214,168,895		224,475,190
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		214,168,895		224,475,190
剰余金減少額又は欠損金増加額		82,825,011		121,219,277
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		82,825,011		121,219,277
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		1,638,553		1,757,126
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,017,793,770		1,293,493,781

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		第12期 平成26年11月 6日現在	第13期 平成27年11月 6日現在
1.	期首元本額	1,411,406,764円	1,638,553,285円
	期中追加設定元本額	402,200,788円	312,108,595円
	期中一部解約元本額	175,054,267円	193,535,396円
2.	受益権の総数	1,638,553,285口	1,757,126,484口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第12期 自 平成25年11月 7日 至 平成26年11月 6日		第13期 自 平成26年11月 7日 至 平成27年11月 6日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	40,111,405円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 46,752,828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	184,695,655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
C	信託約款に定める収益調整金	507,880,159円	C 信託約款に定める収益調整金 666,181,143円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	286,745,104円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 454,868,540円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	1,019,432,323円	E 分配対象収益 (A+B+C+D) 1,295,250,907円
F	分配対象収益(1万口当たり)	6,221円	F 分配対象収益(1万口当たり) 7,371円
G	分配金額	1,638,553円	G 分配金額 1,757,126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12期 自 平成25年11月 7日 至 平成26年11月 6日	第13期 自 平成26年11月 7日 至 平成27年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	第12期 平成26年11月 6日現在	第13期 平成27年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第12期（平成26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	224,831,820
合計	224,831,820

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

（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12期 平成26年11月 6日現在		第13期 平成27年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	1.6212円	1口当たり純資産額	1.7361円
(1万口当たり純資産額)	(16,212円)	(1万口当たり純資産額)	(17,361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	155,402,482	318,248,742	
	日本債券インデックスマザーファンド	1,004,200,115	1,342,816,393	

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	128,006,703	297,577,182	
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	713,946,648	945,122,572	
合計	2,001,555,948	2,903,764,889	

(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-KOKUSA I（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26年11月 6日現在	平成27年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	100,313,408	68,621,670
株式	28,311,290,530	27,907,326,060
派生商品評価勘定	15,692,921	18,679,740
未収入金	403,573,540	77,357,070
未収配当金	210,218,346	207,525,785
未収利息	136	112
流動資産合計	29,041,088,881	28,279,510,437
資産合計	29,041,088,881	28,279,510,437
負債の部		
流動負債		
前受金	18,865,000	17,540,000
未払解約金	309,962,448	46,138,822
流動負債合計	328,827,448	63,678,822
負債合計	328,827,448	63,678,822
純資産の部		
元本等		

元本	25,502,591,555	21,313,752,367
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	3,209,669,878	6,902,079,248
元本等合計	28,712,261,433	28,215,831,615
純資産合計	28,712,261,433	28,215,831,615
負債純資産合計	29,041,088,881	28,279,510,437

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26年11月 6日現在	平成27年11月 6日現在
1.	期首	平成25年11月 7日	平成26年11月 7日
	期首元本額	28,560,407,434円	25,502,591,555円
	期首からの追加設定元本額	1,582,667,991円	1,825,029,839円
	期首からの一部解約元本額	4,640,483,870円	6,013,869,027円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	185,148,991円	182,944,304円
	DCインデックスバランス（株式40）	709,822,858円	713,946,648円
	DCインデックスバランス（株式60）	1,334,068,029円	1,348,998,781円
	DCインデックスバランス（株式80）	1,605,941,404円	1,605,725,499円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,064,255,787円	1,164,952,931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	7,682,541,246円	5,497,114,326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	6,688,312円	5,124,803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）	32,462,437円	23,674,244円

アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	86,247,925円	65,422,399円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	67,959,583円	52,091,722円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	100,058,810円	80,607,291円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	121,866,499円	95,992,107円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	8,728,480,826円	6,996,040,892円
世界アセットバランスファンド40（適格機関投資家向け）	35,383,791円	19,068,512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）	56,380,916円	42,455,918円
グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	50,019,327円	41,930,365円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	297,241,733円	266,671,393円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	867,382,378円	812,132,628円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,222,452,766円	1,143,415,021円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,248,187,937円	1,155,442,583円
計	25,502,591,555円	21,313,752,367円
2. 受益権の総数	25,502,591,555口	21,313,752,367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	405,935,000円	489,070,000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25年11月 7日 至 平成26年11月 6日	自 平成26年11月 7日 至 平成27年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	平成26年11月 6日現在	平成27年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	<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 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品 同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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26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	2,120,784,703
合計	2,120,784,703

(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

(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26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	283,305,000	-	299,090,000	15,785,000
合計		283,305,000	-	299,090,000	15,785,000

(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

(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26年11月 6日現在		平成27年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	1.1259円	1口当たり純資産額	1.3238円
(1万口当たり純資産額)	(11,259円)	(1万口当たり純資産額)	(13,238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	6,000	266.00	1,596,000	
日本水産	15,700	395.00	6,201,500	
マルハニチロ	2,800	1,950.00	5,460,000	
サカタのタネ	2,200	2,494.00	5,486,800	
ホクト	1,400	2,180.00	3,052,000	
住石ホールディングス	4,200	122.00	512,400	
日鉄鉱業	4,000	574.00	2,296,000	
三井松島産業	9,000	123.00	1,107,000	
国際石油開発帝石	71,500	1,180.50	84,405,750	
日本海洋掘削	400	2,579.00	1,031,600	
石油資源開発	2,200	3,650.00	8,030,000	
K & O エナジーグループ	900	1,538.00	1,384,200	
ショーボンドホールディングス	1,300	4,785.00	6,220,500	
ミライト・ホールディングス	4,200	1,021.00	4,288,200	
サンヨーホームズ	300	560.00	168,000	
ダイセキ環境ソリューション	300	1,207.00	362,100	
安藤・間	9,100	707.00	6,433,700	
東急建設	4,400	837.00	3,682,800	
コムシスホールディングス	6,100	1,561.00	9,522,100	
ミサワホーム	1,600	740.00	1,184,000	
高松コンストラクショングループ	1,000	2,540.00	2,540,000	
東建コーポレーション	500	9,460.00	4,730,000	
ヤマウラ	700	458.00	320,600	
大成建設	71,000	757.00	53,747,000	

大林組	41,000	1,007.00	41,287,000	
清水建設	42,000	990.00	41,580,000	
飛島建設	9,500	209.00	1,985,500	
長谷工コーポレーション	15,900	1,203.00	19,127,700	
松井建設	1,500	683.00	1,024,500	
銭高組	2,000	584.00	1,168,000	
鹿島建設	64,000	648.00	41,472,000	
不動テトラ	9,800	158.00	1,548,400	
大末建設	500	858.00	429,000	
鉄建建設	8,000	325.00	2,600,000	
西松建設	16,000	486.00	7,776,000	
三井住友建設	52,300	118.00	6,171,400	
大豊建設	5,000	558.00	2,790,000	
前田建設工業	8,000	838.00	6,704,000	
ナカノフドー建設	1,100	689.00	757,900	
奥村組	13,000	624.00	8,112,000	
東鉄工業	1,600	2,677.00	4,283,200	
イチケン	2,000	412.00	824,000	
浅沼組	4,000	316.00	1,264,000	
戸田建設	16,000	618.00	9,888,000	
熊谷組	17,000	348.00	5,916,000	
青木あすなる建設	900	853.00	767,700	
北野建設	3,000	322.00	966,000	
植木組	2,000	260.00	520,000	
三井ホーム	2,000	580.00	1,160,000	
矢作建設工業	1,900	909.00	1,727,100	
ピーエス三菱	1,700	404.00	686,800	
日本ハウスホールディングス	2,800	464.00	1,299,200	
大東建託	5,100	12,685.00	64,693,500	
新日本建設	1,600	548.00	876,800	
N I P P O	3,000	2,057.00	6,171,000	
東亜道路工業	3,000	470.00	1,410,000	
前田道路	4,000	2,198.00	8,792,000	
日本道路	4,000	654.00	2,616,000	
東亜建設工業	12,000	298.00	3,576,000	
若築建設	8,000	155.00	1,240,000	

東洋建設	4,300	550.00	2,365,000	
五洋建設	15,100	519.00	7,836,900	
大林道路	2,000	831.00	1,662,000	
福田組	2,000	1,197.00	2,394,000	
住友林業	9,300	1,571.00	14,610,300	
日本基礎技術	1,500	513.00	769,500	
日成ビルド工業	4,000	392.00	1,568,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	7,000	86.00	602,000	
巴コーポレーション	1,800	371.00	667,800	
パナホーム	5,000	907.00	4,535,000	
大和ハウス工業	40,100	3,232.00	129,603,200	
ライト工業	2,600	1,111.00	2,888,600	
積水ハウス	45,400	1,973.00	89,574,200	
日特建設	1,500	531.00	796,500	
北陸電気工事	500	1,064.00	532,000	
ユアテック	2,000	1,175.00	2,350,000	
西部電気工業	1,000	422.00	422,000	
四電工	1,000	420.00	420,000	
中電工	2,000	2,557.00	5,114,000	
関電工	5,000	831.00	4,155,000	
きんでん	8,200	1,630.00	13,366,000	
東京エネシス	1,000	1,155.00	1,155,000	
トーエネック	2,000	864.00	1,728,000	
住友電設	1,100	1,634.00	1,797,400	
日本電設工業	2,200	2,268.00	4,989,600	
協和エクシオ	5,400	1,200.00	6,480,000	
新日本空調	1,200	1,028.00	1,233,600	
N D S	3,000	315.00	945,000	
九電工	2,000	2,335.00	4,670,000	
三機工業	3,100	1,066.00	3,304,600	
日揮	14,000	1,925.00	26,950,000	
中外炉工業	4,000	232.00	928,000	
ヤマト	1,300	485.00	630,500	
太平電業	2,000	1,279.00	2,558,000	
高砂熱学工業	4,100	1,836.00	7,527,600	
三晃金属工業	2,000	289.00	578,000	

朝日工業社	2,000	455.00	910,000	
明星工業	2,500	573.00	1,432,500	
大気社	1,700	2,881.00	4,897,700	
ダイダン	2,000	874.00	1,748,000	
日比谷総合設備	1,700	1,540.00	2,618,000	
東芝プラントシステム	2,200	1,255.00	2,761,000	
東洋エンジニアリング	7,000	309.00	2,163,000	
千代田化工建設	10,000	919.00	9,190,000	
新興ブランテック	2,800	972.00	2,721,600	
日本製粉	9,000	726.00	6,534,000	
日清製粉グループ本社	14,900	1,866.00	27,803,400	
日東富士製粉	1,000	352.00	352,000	
昭和産業	6,000	464.00	2,784,000	
鳥越製粉	1,100	804.00	884,400	
中部飼料	1,300	1,035.00	1,345,500	
フィード・ワン	8,300	140.00	1,162,000	
東洋精糖	2,000	113.00	226,000	
日本甜菜製糖	7,000	194.00	1,358,000	
三井製糖	5,000	501.00	2,505,000	
塩水港精糖	1,600	254.00	406,400	
森永製菓	12,000	601.00	7,212,000	
中村屋	3,000	463.00	1,389,000	
江崎グリコ	3,100	6,350.00	19,685,000	
名糖産業	600	1,310.00	786,000	
不二家	8,000	197.00	1,576,000	
山崎製パン	10,000	2,291.00	22,910,000	
第一屋製パン	3,000	123.00	369,000	
モロゾフ	2,000	414.00	828,000	
亀田製菓	800	4,705.00	3,764,000	
寿スピリッツ	300	4,690.00	1,407,000	
カルビー	5,000	4,695.00	23,475,000	
森永乳業	12,000	539.00	6,468,000	
六甲バター	600	1,701.00	1,020,600	
ヤクルト本社	7,300	6,450.00	47,085,000	
明治ホールディングス	8,100	9,660.00	78,246,000	
雪印メグミルク	3,200	2,412.00	7,718,400	

プリマハム	9,000	354.00	3,186,000
日本ハム	10,000	2,372.00	23,720,000
伊藤ハム	7,000	637.00	4,459,000
林兼産業	5,000	118.00	590,000
丸大食品	7,000	454.00	3,178,000
米久	400	2,298.00	919,200
S Foods	800	2,092.00	1,673,600
サッポロホールディングス	21,000	499.00	10,479,000
アサヒグループホールディングス	25,500	3,840.00	97,920,000
キリンホールディングス	55,000	1,674.00	92,070,000
宝ホールディングス	9,900	882.00	8,731,800
オエノンホールディングス	4,000	225.00	900,000
養命酒製造	400	1,982.00	792,800
コカ・コーラウエスト	4,600	2,444.00	11,242,400
コカ・コーライーストジャパン	4,800	1,697.00	8,145,600
サントリー食品インターナショナル	9,300	4,865.00	45,244,500
ダイトードリンコ	700	5,260.00	3,682,000
伊藤園	4,000	2,564.00	10,256,000
キーコーヒー	1,200	1,919.00	2,302,800
ユニカフェ	400	913.00	365,200
ジャパンフーズ	200	1,141.00	228,200
日清オイリオグループ	7,000	480.00	3,360,000
不二製油グループ本社	3,600	1,700.00	6,120,000
かどや製油	100	2,713.00	271,300
J - オイルミルズ	6,000	344.00	2,064,000
キッコーマン	10,000	3,840.00	38,400,000
味の素	29,000	2,756.50	79,938,500
キュービー	6,900	2,760.00	19,044,000
ハウス食品グループ本社	4,600	2,085.00	9,591,000
カゴメ	4,900	1,960.00	9,604,000
焼津水産化学工業	700	986.00	690,200
アリアケジャパン	1,100	5,500.00	6,050,000
エバラ食品工業	300	2,029.00	608,700
ニチレイ	14,000	830.00	11,620,000
東洋水産	6,700	4,340.00	29,078,000
イトアンド	200	2,217.00	443,400

日清食品ホールディングス	5,800	5,550.00	32,190,000
永谷園ホールディングス	1,000	1,064.00	1,064,000
一正蒲鉾	500	1,085.00	542,500
フジッコ	1,300	2,239.00	2,910,700
ロック・フィールド	700	2,940.00	2,058,000
日本たばこ産業	80,300	4,400.00	353,320,000
ケンコーマヨネーズ	500	1,630.00	815,000
わらべや日洋	700	2,370.00	1,659,000
なとり	700	1,610.00	1,127,000
ユーグレナ	4,600	1,639.00	7,539,400
ミヨシ油脂	5,000	140.00	700,000
理研ビタミン	400	3,910.00	1,564,000
片倉工業	1,600	1,338.00	2,140,800
グンゼ	10,000	362.00	3,620,000
東洋紡	50,000	181.00	9,050,000
ユニチカ	38,000	59.00	2,242,000
富士紡ホールディングス	6,000	216.00	1,296,000
倉敷紡績	13,000	211.00	2,743,000
シキボウ	8,000	123.00	984,000
日本毛織	4,000	1,000.00	4,000,000
大東紡織	3,000	68.00	204,000
トーア紡コーポレーション	600	662.00	397,200
ダイドーリミテッド	1,500	497.00	745,500
帝国繊維	1,300	1,560.00	2,028,000
帝人	52,000	412.00	21,424,000
東レ	92,000	1,060.50	97,566,000
サカイオーベックス	3,000	208.00	624,000
住江織物	3,000	354.00	1,062,000
日本フェルト	700	503.00	352,100
イチカワ	1,000	343.00	343,000
日東製網	1,000	150.00	150,000
芦森工業	3,000	234.00	702,000
アツギ	11,000	118.00	1,298,000
ダイニック	3,000	167.00	501,000
セーレン	3,200	1,491.00	4,771,200
東海染工	2,000	123.00	246,000

小松精練	2,000	698.00	1,396,000	
ワコールホールディングス	8,000	1,487.00	11,896,000	
ホギメディカル	800	5,950.00	4,760,000	
レナウン	3,600	139.00	500,400	
クラウディア	400	580.00	232,000	
T S Iホールディングス	5,700	886.00	5,050,200	
三陽商会	7,000	319.00	2,233,000	
ナイガイ	5,000	61.00	305,000	
オンワードホールディングス	8,000	775.00	6,200,000	
ルック	2,000	180.00	360,000	
キムラタン	57,000	8.00	456,000	
ゴールドウイン	500	6,270.00	3,135,000	
デサント	2,900	1,528.00	4,431,200	
キング	600	428.00	256,800	
ヤマトインターナショナル	800	415.00	332,000	
特種東海製紙	7,000	398.00	2,786,000	
王子ホールディングス	52,000	590.00	30,680,000	
日本製紙	6,600	2,038.00	13,450,800	
三菱製紙	20,000	87.00	1,740,000	
北越紀州製紙	7,900	837.00	6,612,300	
中越パルプ工業	5,000	213.00	1,065,000	
巴川製紙所	2,000	236.00	472,000	
大王製紙	5,600	1,170.00	6,552,000	
レンゴー	11,000	545.00	5,995,000	
トーモク	4,000	279.00	1,116,000	
ザ・パック	900	2,934.00	2,640,600	
クラレ	20,000	1,513.00	30,260,000	
旭化成	79,000	734.40	58,017,600	
共和レザー	800	966.00	772,800	
昭和電工	85,000	152.00	12,920,000	
住友化学	94,000	676.00	63,544,000	
日本化成	3,000	131.00	393,000	
住友精化	3,000	745.00	2,235,000	
日産化学工業	7,600	3,050.00	23,180,000	
ラサ工業	5,000	136.00	680,000	
クレハ	10,000	473.00	4,730,000	

多木化学	1,000	718.00	718,000	
テイカ	2,000	521.00	1,042,000	
石原産業	23,000	116.00	2,668,000	
片倉コープアグリ	1,000	262.00	262,000	
日東エフシー	800	950.00	760,000	
日本曹達	8,000	922.00	7,376,000	
東ソー	34,000	647.00	21,998,000	
トクヤマ	21,000	269.00	5,649,000	
セントラル硝子	14,000	600.00	8,400,000	
東亜合成	7,900	1,048.00	8,279,200	
大阪ソーダ	5,000	435.00	2,175,000	
関東電化工業	3,000	975.00	2,925,000	
デンカ	26,000	550.00	14,300,000	
信越化学工業	22,800	7,103.00	161,948,400	
日本カーバイド工業	4,000	190.00	760,000	
堺化学工業	5,000	370.00	1,850,000	
エア・ウォーター	10,000	1,946.00	19,460,000	
大陽日酸	9,800	1,208.00	11,838,400	
日本化学工業	5,000	266.00	1,330,000	
日本パーカラライジング	6,500	1,078.00	7,007,000	
高圧ガス工業	2,000	629.00	1,258,000	
四国化成工業	2,000	1,188.00	2,376,000	
戸田工業	3,000	326.00	978,000	
ステラ ケミファ	700	1,318.00	922,600	
保土谷化学工業	4,000	170.00	680,000	
日本触媒	1,800	9,180.00	16,524,000	
大日精化工業	5,000	581.00	2,905,000	
カネカ	17,000	1,046.00	17,782,000	
三菱瓦斯化学	22,000	634.00	13,948,000	
三井化学	54,000	489.00	26,406,000	
J S R	12,500	1,859.00	23,237,500	
東京応化工業	2,600	3,660.00	9,516,000	
大阪有機化学工業	900	643.00	578,700	
三菱ケミカルホールディングス	85,000	785.10	66,733,500	
日本合成化学工業	3,000	899.00	2,697,000	
ダイセル	17,900	1,783.00	31,915,700	

住友ベークライト	12,000	505.00	6,060,000	
積水化学工業	29,400	1,460.00	42,924,000	
日本ゼオン	11,000	998.00	10,978,000	
アイカ工業	3,800	2,390.00	9,082,000	
宇部興産	68,000	248.00	16,864,000	
積水樹脂	2,000	1,636.00	3,272,000	
タキロン	3,000	520.00	1,560,000	
旭有機材工業	4,000	231.00	924,000	
日立化成	6,300	1,983.00	12,492,900	
ニチバン	1,000	574.00	574,000	
リケンテクノス	2,100	406.00	852,600	
大倉工業	3,000	354.00	1,062,000	
積水化成成品工業	3,000	376.00	1,128,000	
群栄化学工業	3,000	309.00	927,000	
タイガースポリマー	600	725.00	435,000	
ミライアル	500	1,189.00	594,500	
ダイキアクシス	300	1,002.00	300,600	
ダイキョーニシカワ	400	6,640.00	2,656,000	
日本化薬	8,000	1,336.00	10,688,000	
カーリットホールディングス	1,200	538.00	645,600	
日本精化	1,100	920.00	1,012,000	
A D E K A	6,200	1,735.00	10,757,000	
日油	10,000	906.00	9,060,000	
新日本理化	2,100	216.00	453,600	
ハリマ化成グループ	1,100	530.00	583,000	
花王	34,100	6,095.00	207,839,500	
第一工業製薬	3,000	381.00	1,143,000	
ニイタカ	200	1,565.00	313,000	
三洋化成工業	4,000	974.00	3,896,000	
大日本塗料	7,000	189.00	1,323,000	
日本ペイントホールディングス	9,800	2,647.00	25,940,600	
関西ペイント	14,400	1,838.00	26,467,200	
神東塗料	1,000	203.00	203,000	
中国塗料	4,000	908.00	3,632,000	
日本特殊塗料	900	1,036.00	932,400	
藤倉化成	1,700	573.00	974,100	

太陽ホールディングス	900	4,460.00	4,014,000	
D I C	51,000	320.00	16,320,000	
サカタインクス	2,600	1,130.00	2,938,000	
東洋インキＳＣホールディングス	13,000	496.00	6,448,000	
T & K T O K A	400	2,272.00	908,800	
富士フィルムホールディングス	29,100	4,919.00	143,142,900	
資生堂	24,100	2,706.00	65,214,600	
ライオン	15,000	1,203.00	18,045,000	
高砂香料工業	800	3,095.00	2,476,000	
マンダム	1,200	4,705.00	5,646,000	
ミルボン	800	4,580.00	3,664,000	
ファンケル	3,000	1,722.00	5,166,000	
コーセー	2,100	11,400.00	23,940,000	
コタ	400	1,218.00	487,200	
ドクターシーラボ	1,700	2,239.00	3,806,300	
シーボン	200	2,539.00	507,800	
ポーラ・オルビスホールディングス	1,300	7,820.00	10,166,000	
ノエビアホールディングス	800	3,175.00	2,540,000	
アジュバンコスメジャパン	200	934.00	186,800	
エステー	900	1,017.00	915,300	
アグロ カネショウ	500	982.00	491,000	
コニシ	1,000	2,418.00	2,418,000	
長谷川香料	1,600	1,621.00	2,593,600	
星光P M C	700	1,059.00	741,300	
小林製薬	1,900	9,320.00	17,708,000	
荒川化学工業	1,100	1,164.00	1,280,400	
メック	1,000	832.00	832,000	
日本高純度化学	400	2,317.00	926,800	
J C U	400	4,455.00	1,782,000	
新田ゼラチン	800	783.00	626,400	
デクセリアルズ	2,900	1,353.00	3,923,700	
アース製薬	900	4,980.00	4,482,000	
イハラケミカル工業	2,000	1,487.00	2,974,000	
北興化学工業	1,000	454.00	454,000	
大成ラミック	400	2,936.00	1,174,400	
クミアイ化学工業	2,600	973.00	2,529,800	

日本農薬	2,900	810.00	2,349,000	
アキレス	11,000	151.00	1,661,000	
有沢製作所	1,900	778.00	1,478,200	
日東電工	9,800	8,553.00	83,819,400	
レック	400	1,303.00	521,200	
きもと	2,100	267.00	560,700	
藤森工業	1,100	3,215.00	3,536,500	
前澤化成工業	900	1,060.00	954,000	
J S P	800	2,600.00	2,080,000	
エフピコ	1,100	4,655.00	5,120,500	
天馬	1,000	2,034.00	2,034,000	
信越ポリマー	2,500	647.00	1,617,500	
東リ	3,000	346.00	1,038,000	
ニフコ	2,400	4,895.00	11,748,000	
日本バルカー工業	5,000	309.00	1,545,000	
ユニ・チャーム	25,700	2,525.50	64,905,350	
協和発酵キリン	15,000	2,065.00	30,975,000	
武田薬品工業	50,500	6,116.00	308,858,000	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	142,200	1,786.50	254,040,300	
大日本住友製薬	9,000	1,369.00	12,321,000	
塩野義製薬	18,500	5,120.00	94,720,000	
田辺三菱製薬	14,800	2,110.00	31,228,000	
わかもと製薬	1,000	279.00	279,000	
あすか製薬	1,600	1,178.00	1,884,800	
日本新薬	3,000	4,990.00	14,970,000	
バイオフェルミン製薬	200	3,560.00	712,000	
中外製薬	12,600	3,975.00	50,085,000	
科研製薬	2,200	8,180.00	17,996,000	
エーザイ	15,600	7,551.00	117,795,600	
ロート製薬	6,200	2,076.00	12,871,200	
小野薬品工業	5,800	16,595.00	96,251,000	
久光製薬	3,900	4,920.00	19,188,000	
有機合成薬品工業	1,000	278.00	278,000	
持田製薬	900	7,420.00	6,678,000	
参天製薬	23,400	1,783.00	41,722,200	

扶桑薬品工業	4,000	281.00	1,124,000	
日本ケミファ	2,000	607.00	1,214,000	
ツムラ	4,000	3,270.00	13,080,000	
日医工	3,000	3,105.00	9,315,000	
キッセイ薬品工業	2,200	3,140.00	6,908,000	
生化学工業	2,400	1,546.00	3,710,400	
栄研化学	1,100	2,160.00	2,376,000	
日水製薬	500	1,373.00	686,500	
鳥居薬品	900	2,782.00	2,503,800	
JCRファーマ	1,000	2,733.00	2,733,000	
東和薬品	600	8,340.00	5,004,000	
富士製薬工業	300	2,159.00	647,700	
沢井製薬	2,200	7,690.00	16,918,000	
ゼリア新薬工業	2,600	1,740.00	4,524,000	
第一三共	42,700	2,407.00	102,778,900	
キョーリン製薬ホールディングス	3,400	2,200.00	7,480,000	
大幸薬品	600	1,848.00	1,108,800	
ダイト	600	2,824.00	1,694,400	
大塚ホールディングス	27,300	4,100.00	111,930,000	
大正製薬ホールディングス	3,100	7,830.00	24,273,000	
日本コークス工業	10,300	101.00	1,040,300	
昭和シェル石油	12,800	1,077.00	13,785,600	
ニチレキ	1,000	967.00	967,000	
東燃ゼネラル石油	19,000	1,267.00	24,073,000	
ユシロ化学工業	700	1,419.00	993,300	
ビービー・カストロール	500	1,271.00	635,500	
富士石油	3,000	384.00	1,152,000	
MORESCO	400	1,572.00	628,800	
出光興産	6,600	1,995.00	13,167,000	
JXホールディングス	150,300	473.50	71,167,050	
コスモエネルギーホールディングス	3,800	1,579.00	6,000,200	
横浜ゴム	7,700	2,289.00	17,625,300	
東洋ゴム工業	5,800	2,623.00	15,213,400	
ブリヂストン	42,800	4,549.00	194,697,200	
住友ゴム工業	11,900	1,700.00	20,230,000	
藤倉ゴム工業	1,100	598.00	657,800	

オカモト	4,000	962.00	3,848,000	
フコク	500	1,013.00	506,500	
ニッタ	1,400	3,370.00	4,718,000	
住友理工	2,700	978.00	2,640,600	
三ツ星ベルト	3,000	994.00	2,982,000	
バンドー化学	5,000	514.00	2,570,000	
日東紡績	9,000	367.00	3,303,000	
旭硝子	67,000	719.00	48,173,000	
日本板硝子	62,000	108.00	6,696,000	
石塚硝子	2,000	244.00	488,000	
日本山村硝子	5,000	182.00	910,000	
日本電気硝子	26,000	648.00	16,848,000	
オハラ	500	590.00	295,000	
住友大阪セメント	25,000	513.00	12,825,000	
太平洋セメント	79,000	400.00	31,600,000	
デイ・シイ	1,200	359.00	430,800	
日本ヒューム	1,200	774.00	928,800	
日本コンクリート工業	2,700	386.00	1,042,200	
三谷セキサン	700	1,581.00	1,106,700	
アジアパイルホールディングス	1,600	629.00	1,006,400	
東海カーボン	11,000	351.00	3,861,000	
日本カーボン	6,000	339.00	2,034,000	
東洋炭素	700	1,766.00	1,236,200	
ノリタケカンパニーリミテド	7,000	282.00	1,974,000	
TOTO	9,300	4,230.00	39,339,000	
日本碍子	16,000	2,803.00	44,848,000	
日本特殊陶業	10,900	3,170.00	34,553,000	
ダントーホールディングス	2,000	203.00	406,000	
MARUWA	500	2,896.00	1,448,000	
品川リフラクトリーズ	3,000	262.00	786,000	
黒崎播磨	3,000	259.00	777,000	
ヨータイ	1,000	345.00	345,000	
イソライト工業	600	220.00	132,000	
東京窯業	2,000	192.00	384,000	
ニッカトー	400	407.00	162,800	
フジミインコーポレーテッド	1,100	1,650.00	1,815,000	

エーアンドエーマテリアル	3,000	97.00	291,000	
ニチアス	6,000	759.00	4,554,000	
ニチハ	1,700	1,670.00	2,839,000	
新日鐵住金	57,200	2,444.00	139,796,800	
神戸製鋼所	233,000	143.00	33,319,000	
合同製鐵	7,000	230.00	1,610,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	34,700	1,875.00	65,062,500	
日新製鋼	5,800	1,292.00	7,493,600	
東京製鐵	7,100	816.00	5,793,600	
共英製鋼	1,400	2,063.00	2,888,200	
大和工業	2,800	3,230.00	9,044,000	
東京鐵鋼	3,000	584.00	1,752,000	
大阪製鐵	800	2,146.00	1,716,800	
淀川製鋼所	1,900	2,312.00	4,392,800	
東洋鋼鈑	3,100	377.00	1,168,700	
丸一鋼管	4,300	3,145.00	13,523,500	
モリ工業	2,000	352.00	704,000	
大同特殊鋼	21,000	486.00	10,206,000	
日本高周波鋼業	5,000	98.00	490,000	
日本冶金工業	9,500	161.00	1,529,500	
山陽特殊製鋼	8,000	503.00	4,024,000	
愛知製鋼	7,000	497.00	3,479,000	
日立金属	14,500	1,409.00	20,430,500	
日本金属	3,000	142.00	426,000	
大平洋金属	9,000	345.00	3,105,000	
新日本電工	7,200	247.00	1,778,400	
栗本鐵工所	6,000	217.00	1,302,000	
虹技	2,000	180.00	360,000	
日本鑄鉄管	2,000	194.00	388,000	
三菱製鋼	9,000	237.00	2,133,000	
日亜鋼業	1,900	266.00	505,400	
日本精線	1,000	534.00	534,000	
シンニッタン	1,200	580.00	696,000	
新家工業	3,000	142.00	426,000	
大紀アルミニウム工業所	2,000	329.00	658,000	
日本輕金属ホールディングス	28,900	213.00	6,155,700	

三井金属鉱業	33,000	236.00	7,788,000
東邦亜鉛	7,000	330.00	2,310,000
三菱マテリアル	79,000	424.00	33,496,000
住友金属鉱山	35,000	1,515.50	53,042,500
DOWAホールディングス	16,000	1,059.00	16,944,000
古河機械金属	20,000	271.00	5,420,000
エス・サイエンス	6,200	45.00	279,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,300	3,165.00	4,114,500
東邦チタニウム	2,200	1,549.00	3,407,800
UACJ	18,000	280.00	5,040,000
古河電気工業	40,000	245.00	9,800,000
住友電気工業	50,800	1,648.00	83,718,400
フジクラ	18,000	624.00	11,232,000
昭和電線ホールディングス	16,000	81.00	1,296,000
タツタ電線	2,700	476.00	1,285,200
沖電線	1,000	271.00	271,000
カナレ電気	200	1,975.00	395,000
平河ヒューテック	300	1,414.00	424,200
リョービ	8,000	419.00	3,352,000
アーレスティ	1,500	810.00	1,215,000
アサヒホールディングス	1,900	1,811.00	3,440,900
稲葉製作所	700	1,304.00	912,800
宮地エンジニアリンググループ	4,000	214.00	856,000
トーカロ	900	2,680.00	2,412,000
アルファC o	400	1,346.00	538,400
SUMCO	10,000	1,065.00	10,650,000
川田テクノロジーズ	200	4,415.00	883,000
東洋製罐グループホールディングス	9,000	2,193.00	19,737,000
ホッカンホールディングス	3,000	323.00	969,000
コロナ	700	1,148.00	803,600
横河ブリッジホールディングス	2,400	1,133.00	2,719,200
駒井ハルテック	2,000	229.00	458,000
高田機工	1,000	213.00	213,000
三和ホールディングス	12,900	994.00	12,822,600
文化シャッター	3,500	961.00	3,363,500
三協立山	1,700	1,764.00	2,998,800

アルインコ	700	1,150.00	805,000	
東洋シャッター	300	784.00	235,200	
LIXILグループ	17,700	2,757.00	48,798,900	
日本フィルコン	900	534.00	480,600	
ノーリツ	2,500	1,977.00	4,942,500	
長府製作所	1,400	2,535.00	3,549,000	
リンナイ	2,400	10,500.00	25,200,000	
ダイニチ工業	700	722.00	505,400	
日東精工	2,000	334.00	668,000	
三洋工業	2,000	172.00	344,000	
岡部	2,600	953.00	2,477,800	
ジーテクト	1,300	1,718.00	2,233,400	
中国工業	200	734.00	146,800	
東プレ	2,400	2,604.00	6,249,600	
高周波熱錬	2,400	897.00	2,152,800	
東京製網	9,000	193.00	1,737,000	
サンコール	700	585.00	409,500	
モリテック スチール	700	308.00	215,600	
パイオラックス	600	6,460.00	3,876,000	
日本発條	11,900	1,244.00	14,803,600	
中央発條	1,000	289.00	289,000	
アドバネクス	200	1,774.00	354,800	
立川ブラインド工業	500	841.00	420,500	
三益半導体工業	900	1,194.00	1,074,600	
日本ドライケミカル	200	2,200.00	440,000	
日本製鋼所	19,000	465.00	8,835,000	
三浦工業	5,700	1,553.00	8,852,100	
タクマ	5,000	980.00	4,900,000	
ツガミ	4,000	614.00	2,456,000	
オークマ	8,000	1,022.00	8,176,000	
東芝機械	7,000	437.00	3,059,000	
アマダホールディングス	18,900	1,109.00	20,960,100	
アイダエンジニアリング	3,300	1,200.00	3,960,000	
滝澤鉄工所	4,000	177.00	708,000	
富士機械製造	4,200	1,103.00	4,632,600	
牧野フライス製作所	6,000	982.00	5,892,000	

オーエスジー	5,800	2,307.00	13,380,600	
ダイジェット工業	2,000	176.00	352,000	
旭ダイヤモンド工業	3,500	1,344.00	4,704,000	
D M G 森精機	7,000	1,797.00	12,579,000	
ソディック	2,400	937.00	2,248,800	
ディスコ	1,600	10,790.00	17,264,000	
日東工器	700	2,627.00	1,838,900	
パンチ工業	500	990.00	495,000	
豊和工業	800	678.00	542,400	
O K K	5,000	143.00	715,000	
東洋機械金属	1,000	459.00	459,000	
津田駒工業	3,000	133.00	399,000	
島精機製作所	1,800	1,812.00	3,261,600	
日阪製作所	1,600	954.00	1,526,400	
やまびこ	2,300	1,147.00	2,638,100	
ペガサスミシン製造	1,300	493.00	640,900	
ナブテスコ	6,800	2,365.00	16,082,000	
三井海洋開発	1,500	1,776.00	2,664,000	
レオン自動機	1,100	657.00	722,700	
S M C	3,800	31,430.00	119,434,000	
新川	1,200	707.00	848,400	
ホソカワミクロン	2,000	599.00	1,198,000	
ユニオンツール	600	3,040.00	1,824,000	
オイレス工業	1,600	2,045.00	3,272,000	
日精エー・エス・ビー機械	500	2,533.00	1,266,500	
サトーホールディングス	1,700	2,637.00	4,482,900	
日本エアテック	500	712.00	356,000	
日精樹脂工業	900	1,038.00	934,200	
ワイエイシイ	500	942.00	471,000	
小松製作所	62,200	2,021.50	125,737,300	
住友重機械工業	37,000	554.00	20,498,000	
日立建機	5,700	1,933.00	11,018,100	
日工	2,000	414.00	828,000	
巴工業	500	1,542.00	771,000	
井関農機	13,000	198.00	2,574,000	
T O W A	1,200	685.00	822,000	

丸山製作所	3,000	200.00	600,000	
北川鉄工所	6,000	317.00	1,902,000	
クボタ	61,000	1,963.00	119,743,000	
荏原実業	400	1,486.00	594,400	
三菱化工機	4,000	298.00	1,192,000	
月島機械	2,400	1,173.00	2,815,200	
帝国電機製作所	900	834.00	750,600	
新東工業	2,900	1,076.00	3,120,400	
澁谷工業	1,100	1,845.00	2,029,500	
アイチ コーポレーション	1,800	802.00	1,443,600	
小森コーポレーション	3,100	1,502.00	4,656,200	
鶴見製作所	1,000	2,176.00	2,176,000	
住友精密工業	2,000	461.00	922,000	
酒井重工業	2,000	244.00	488,000	
荏原製作所	28,000	531.00	14,868,000	
石井鐵工所	2,000	203.00	406,000	
西島製作所	1,400	950.00	1,330,000	
北越工業	1,400	859.00	1,202,600	
ダイキン工業	17,700	8,038.00	142,272,600	
オルガノ	2,000	481.00	962,000	
トーヨーカネツ	7,000	198.00	1,386,000	
栗田工業	7,600	2,732.00	20,763,200	
樫本チエイン	7,000	903.00	6,321,000	
大同工業	2,000	226.00	452,000	
日本コンベヤ	4,000	178.00	712,000	
木村化工機	1,100	514.00	565,400	
アネスト岩田	2,100	935.00	1,963,500	
ダイフク	6,000	1,815.00	10,890,000	
サムコ	200	930.00	186,000	
加藤製作所	3,000	529.00	1,587,000	
油研工業	2,000	243.00	486,000	
タダノ	6,000	1,559.00	9,354,000	
フジテック	3,500	1,331.00	4,658,500	
C K D	3,400	1,131.00	3,845,400	
キトー	1,500	989.00	1,483,500	
平和	3,800	2,249.00	8,546,200	

理想科学工業	1,300	2,043.00	2,655,900	
SANKYO	3,400	4,600.00	15,640,000	
日本金銭機械	1,100	1,285.00	1,413,500	
マースエンジニアリング	700	2,133.00	1,493,100	
福島工業	700	2,560.00	1,792,000	
オーイズミ	600	642.00	385,200	
ダイコク電機	500	1,575.00	787,500	
竹内製作所	1,800	2,382.00	4,287,600	
アマノ	3,800	1,626.00	6,178,800	
JUKI	1,800	1,579.00	2,842,200	
サンデンホールディングス	8,000	439.00	3,512,000	
蛇の目マシン工業	1,200	878.00	1,053,600	
マックス	2,000	1,252.00	2,504,000	
グローリー	4,100	3,400.00	13,940,000	
新晃工業	900	1,345.00	1,210,500	
大和冷機工業	2,000	825.00	1,650,000	
セガサミーホールディングス	13,100	1,253.00	16,414,300	
日本ピストンリング	500	2,135.00	1,067,500	
リケン	6,000	456.00	2,736,000	
T P R	1,500	3,085.00	4,627,500	
ホシザキ電機	2,700	8,540.00	23,058,000	
大豊工業	1,000	1,343.00	1,343,000	
日本精工	24,900	1,410.00	35,109,000	
NTN	30,000	543.00	16,290,000	
ジェイテクト	12,900	2,182.00	28,147,800	
不二越	11,000	552.00	6,072,000	
日本トムソン	4,000	577.00	2,308,000	
THK	8,100	2,341.00	18,962,100	
ユーシン精機	500	2,398.00	1,199,000	
前澤給装工業	500	1,594.00	797,000	
イーグル工業	1,500	2,488.00	3,732,000	
前澤工業	900	415.00	373,500	
日本ピラー工業	1,200	1,000.00	1,200,000	
キッツ	5,900	567.00	3,345,300	
日立工機	3,300	912.00	3,009,600	
マキタ	7,900	6,530.00	51,587,000	

日立造船	9,500	646.00	6,137,000	
三菱重工業	216,000	598.60	129,297,600	
I H I	93,000	335.00	31,155,000	
日清紡ホールディングス	6,700	1,605.00	10,753,500	
イビデン	8,000	1,858.00	14,864,000	
コニカミノルタ	30,300	1,271.00	38,511,300	
ブラザー工業	15,700	1,541.00	24,193,700	
ミネベア	18,000	1,457.00	26,226,000	
日立製作所	309,000	717.10	221,583,900	
東芝	255,000	335.10	85,450,500	
三菱電機	129,000	1,279.00	164,991,000	
富士電機	37,000	539.00	19,943,000	
東洋電機製造	2,000	441.00	882,000	
安川電機	15,000	1,502.00	22,530,000	
シンフォニアテクノロジー	8,000	205.00	1,640,000	
明電舎	11,000	403.00	4,433,000	
オリジン電気	2,000	333.00	666,000	
山洋電気	3,000	796.00	2,388,000	
デンヨー	1,100	2,065.00	2,271,500	
東芝テック	9,000	403.00	3,627,000	
芝浦メカトロニクス	2,000	255.00	510,000	
マブチモーター	3,500	6,420.00	22,470,000	
日本電産	14,600	9,342.00	136,393,200	
東光高岳	700	1,422.00	995,400	
ダイヘン	7,000	594.00	4,158,000	
田淵電機	1,400	837.00	1,171,800	
ヤーマン	100	1,748.00	174,800	
J V C ケンウッド	9,000	293.00	2,637,000	
ミマキエンジニアリング	800	584.00	467,200	
第一精工	500	1,674.00	837,000	
日新電機	2,900	789.00	2,288,100	
大崎電気工業	2,000	652.00	1,304,000	
オムロン	13,900	4,265.00	59,283,500	
日東工業	1,900	2,150.00	4,085,000	
I D E C	1,600	1,031.00	1,649,600	
不二電機工業	100	1,486.00	148,600	

ジーエス・ユアサ コーポレーション	23,000	443.00	10,189,000	
サクサホールディングス	3,000	238.00	714,000	
メルコホールディングス	700	2,110.00	1,477,000	
テクノメディカ	300	2,806.00	841,800	
日本電気	167,000	386.00	64,462,000	
富士通	117,000	583.20	68,234,400	
沖電気工業	53,000	158.00	8,374,000	
岩崎通信機	6,000	82.00	492,000	
電気興業	3,000	528.00	1,584,000	
サンケン電気	7,000	503.00	3,521,000	
ナカヨ	1,000	348.00	348,000	
アイホン	700	1,965.00	1,375,500	
ルネサスエレクトロニクス	6,300	707.00	4,454,100	
セイコーエプソン	18,100	1,873.00	33,901,300	
ワコム	9,600	477.00	4,579,200	
アルバック	2,100	2,219.00	4,659,900	
アクセル	600	1,396.00	837,600	
E I Z O	1,200	2,759.00	3,310,800	
ジャパンディスプレイ	22,700	397.00	9,011,900	
日本信号	3,400	1,271.00	4,321,400	
京三製作所	3,000	340.00	1,020,000	
能美防災	1,400	1,478.00	2,069,200	
ホーチキ	900	1,244.00	1,119,600	
エレコム	1,000	1,547.00	1,547,000	
日本無線	3,000	442.00	1,326,000	
パナソニック	138,500	1,392.00	192,792,000	
シャープ	103,000	132.00	13,596,000	
アンリツ	7,300	772.00	5,635,600	
富士通ゼネラル	4,000	1,574.00	6,296,000	
日立国際電気	3,000	1,723.00	5,169,000	
ソニー	85,500	3,404.00	291,042,000	
T D K	7,300	8,570.00	62,561,000	
帝国通信工業	3,000	209.00	627,000	
ミツミ電機	4,700	629.00	2,956,300	
タムラ製作所	5,000	388.00	1,940,000	
アルプス電気	10,300	3,875.00	39,912,500	

池上通信機	4,000	156.00	624,000	
パイオニア	19,700	322.00	6,343,400	
日本電波工業	1,100	802.00	882,200	
鈴木	300	589.00	176,700	
日本トリム	300	4,545.00	1,363,500	
ローランド ディー . ジー .	600	2,908.00	1,744,800	
フォスター電機	1,500	3,015.00	4,522,500	
クラリオン	6,000	409.00	2,454,000	
S M K	4,000	620.00	2,480,000	
ヨコオ	900	688.00	619,200	
東光	2,000	364.00	728,000	
ティアック	9,000	43.00	387,000	
ホシデン	3,700	758.00	2,804,600	
ヒロセ電機	2,000	15,070.00	30,140,000	
日本航空電子工業	3,000	2,130.00	6,390,000	
T O A	1,400	1,161.00	1,625,400	
日立マクセル	2,000	2,075.00	4,150,000	
古野電気	1,500	840.00	1,260,000	
ユニデンホールディングス	4,000	194.00	776,000	
アルパイン	2,900	1,593.00	4,619,700	
スミダコーポレーション	1,000	775.00	775,000	
アイコム	700	2,510.00	1,757,000	
リオン	500	1,753.00	876,500	
船井電機	1,200	1,329.00	1,594,800	
横河電機	12,100	1,455.00	17,605,500	
新電元工業	4,000	474.00	1,896,000	
アズビル	4,000	3,180.00	12,720,000	
東亜ディーケーケー	500	499.00	249,500	
日本光電工業	5,100	2,507.00	12,785,700	
チノー	400	1,096.00	438,400	
共和電業	1,500	450.00	675,000	
日本電子材料	500	617.00	308,500	
堀場製作所	2,200	4,755.00	10,461,000	
アドバンテスト	8,300	955.00	7,926,500	
小野測器	600	951.00	570,600	
エスベック	1,300	1,258.00	1,635,400	

パナソニック デバイスSUNX	1,000	663.00	663,000	
キーエンス	2,700	65,310.00	176,337,000	
日置電機	600	2,232.00	1,339,200	
シスメックス	9,400	7,390.00	69,466,000	
メガチップス	1,300	1,179.00	1,532,700	
O B A R A G R O U P	800	5,240.00	4,192,000	
澤藤電機	1,000	228.00	228,000	
コーセル	1,700	1,186.00	2,016,200	
新日本無線	1,000	683.00	683,000	
オブテックス	900	2,320.00	2,088,000	
千代田インテグレ	600	2,965.00	1,779,000	
レーザーテック	1,200	1,296.00	1,555,200	
スタンレー電気	8,700	2,478.00	21,558,600	
岩崎電気	4,000	239.00	956,000	
ウシオ電機	7,400	1,780.00	13,172,000	
岡谷電機産業	600	395.00	237,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	1,000	455.00	455,000	
日本セラミック	700	1,798.00	1,258,600	
遠藤照明	600	1,142.00	685,200	
日本デジタル研究所	1,000	1,674.00	1,674,000	
古河電池	1,000	795.00	795,000	
双信電機	600	321.00	192,600	
山一電機	1,100	1,019.00	1,120,900	
図研	900	1,116.00	1,004,400	
日本電子	5,000	721.00	3,605,000	
カシオ計算機	12,200	2,429.00	29,633,800	
ファナック	12,400	21,670.00	268,708,000	
日本シイエムケイ	2,700	231.00	623,700	
エンプラス	600	4,910.00	2,946,000	
大真空	2,000	246.00	492,000	
ローム	6,000	6,660.00	39,960,000	
浜松ホトニクス	9,500	3,145.00	29,877,500	
三井ハイテック	1,800	733.00	1,319,400	
新光電気工業	4,600	769.00	3,537,400	
京セラ	19,900	5,718.00	113,788,200	
太陽誘電	5,900	1,824.00	10,761,600	

村田製作所	12,700	19,080.00	242,316,000	
ユーシン	1,600	745.00	1,192,000	
双葉電子工業	2,100	1,684.00	3,536,400	
北陸電気工業	5,000	166.00	830,000	
ニチコン	3,800	1,024.00	3,891,200	
日本ケミコン	10,000	244.00	2,440,000	
K O A	1,700	1,037.00	1,762,900	
市光工業	3,000	206.00	618,000	
小糸製作所	7,300	4,735.00	34,565,500	
ミツバ	2,100	2,090.00	4,389,000	
スター精密	2,300	1,656.00	3,808,800	
S C R E E Nホールディングス	12,000	732.00	8,784,000	
キヤノン電子	1,100	2,105.00	2,315,500	
キヤノン	65,300	3,727.00	243,373,100	代用有価証券 10,000株
リコー	39,300	1,332.00	52,347,600	
M U T O Hホールディングス	1,000	302.00	302,000	
東京エレクトロン	10,900	7,466.00	81,379,400	
トヨタ紡織	4,200	2,716.00	11,407,200	
鬼怒川ゴム工業	3,000	681.00	2,043,000	
ユニプレス	2,500	2,848.00	7,120,000	
豊田自動織機	11,000	6,580.00	72,380,000	
モリタホールディングス	2,100	1,232.00	2,587,200	
三櫻工業	1,600	784.00	1,254,400	
デンソー	29,900	5,711.00	170,758,900	
東海理化電機製作所	3,600	2,604.00	9,374,400	
三井造船	47,000	191.00	8,977,000	
川崎重工業	94,000	474.00	44,556,000	
名村造船所	3,700	988.00	3,655,600	
サノヤスホールディングス	1,600	259.00	414,400	
日本車輛製造	5,000	298.00	1,490,000	
ニチュ三菱フォークリフト	1,400	530.00	742,000	
近畿車輛	2,000	392.00	784,000	
日産自動車	170,100	1,259.50	214,240,950	
いすゞ自動車	35,100	1,430.50	50,210,550	
トヨタ自動車	154,400	7,502.00	1,158,308,800	代用有価証券 35,000株

日野自動車	17,300	1,431.00	24,756,300
三菱自動車工業	48,100	1,083.00	52,092,300
エフテック	700	1,139.00	797,300
レシップホールディングス	400	844.00	337,600
G M B	200	1,026.00	205,200
ファルテック	200	1,535.00	307,000
武蔵精密工業	1,300	2,595.00	3,373,500
日産車体	5,900	1,393.00	8,218,700
新明和工業	5,000	1,298.00	6,490,000
極東開発工業	2,400	1,408.00	3,379,200
日信工業	2,700	1,819.00	4,911,300
トピー工業	10,000	273.00	2,730,000
ティラド	5,000	199.00	995,000
曙ブレーキ工業	6,200	320.00	1,984,000
タチエス	1,900	1,732.00	3,290,800
N O K	5,900	2,908.00	17,157,200
フタバ産業	3,700	515.00	1,905,500
K Y B	14,000	363.00	5,082,000
シロキ工業	3,000	358.00	1,074,000
大同メタル工業	1,700	1,183.00	2,011,100
プレス工業	6,400	533.00	3,411,200
ミクニ	1,200	480.00	576,000
カルソニックカンセイ	9,000	1,008.00	9,072,000
太平洋工業	2,700	1,328.00	3,585,600
ケーヒン	2,800	1,967.00	5,507,600
河西工業	1,500	1,564.00	2,346,000
アイシン精機	12,200	4,885.00	59,597,000
富士機工	1,400	509.00	712,600
マツダ	38,400	2,447.00	93,964,800
ダイハツ工業	14,400	1,500.00	21,600,000
今仙電機製作所	1,100	1,128.00	1,240,800
本田技研工業	109,100	3,988.00	435,090,800
スズキ	25,300	3,939.00	99,656,700
富士重工業	38,300	4,856.00	185,984,800
安永	400	549.00	219,600
ヤマハ発動機	17,100	2,816.00	48,153,600

ショーワ	3,200	1,162.00	3,718,400
T B K	1,500	465.00	697,500
エクセディ	1,700	2,854.00	4,851,800
豊田合成	4,400	2,939.00	12,931,600
愛三工業	2,100	1,234.00	2,591,400
盟和産業	200	1,161.00	232,200
ヨロズ	1,100	2,553.00	2,808,300
エフ・シー・シー	2,000	2,400.00	4,800,000
シマノ	4,900	18,670.00	91,483,000
タカタ	2,200	834.00	1,834,800
テイ・エス テック	2,800	3,310.00	9,268,000
ジャムコ	500	4,415.00	2,207,500
テルモ	18,600	3,850.00	71,610,000
クリエートメディック	400	946.00	378,400
日機装	4,600	935.00	4,301,000
島津製作所	16,000	1,903.00	30,448,000
J M S	2,000	293.00	586,000
モリテックス	300	219.00	65,700
長野計器	800	838.00	670,400
ブイ・テクノロジー	300	4,095.00	1,228,500
東京計器	4,000	243.00	972,000
愛知時計電機	1,000	329.00	329,000
オーバル	1,300	268.00	348,400
東京精密	2,300	2,769.00	6,368,700
マニー	1,100	2,240.00	2,464,000
ニコン	22,600	1,615.00	36,499,000
トプコン	4,100	1,806.00	7,404,600
オリンパス	18,100	4,130.00	74,753,000
理研計器	1,000	1,510.00	1,510,000
タムロン	1,000	2,276.00	2,276,000
H O Y A	28,200	5,001.00	141,028,200
ノーリツ鋼機	1,100	596.00	655,600
エー・アンド・デイ	1,100	453.00	498,300
シチズンホールディングス	14,900	940.00	14,006,000
リズム時計工業	5,000	171.00	855,000
大研医器	1,000	1,111.00	1,111,000

メニコン	600	2,610.00	1,566,000	
松風	600	1,457.00	874,200	
セイコーホールディングス	8,000	775.00	6,200,000	
ニプロ	9,000	1,382.00	12,438,000	
パラマウントベッドホールディングス	1,300	4,030.00	5,239,000	
トランザクション	200	501.00	100,200	
S H O - B I	500	400.00	200,000	
ニホンフラッシュ	400	1,225.00	490,000	
前田工織	1,400	965.00	1,351,000	
永大産業	2,000	420.00	840,000	
アートネイチャー	1,000	1,165.00	1,165,000	
ダンロップスポーツ	800	1,183.00	946,400	
バンダイナムコホールディングス	12,500	2,772.00	34,650,000	
アイフィスジャパン	200	485.00	97,000	
共立印刷	2,000	313.00	626,000	
フランスベッドホールディングス	1,700	991.00	1,684,700	
パイロットコーポレーション	2,100	5,430.00	11,403,000	
萩原工業	200	2,098.00	419,600	
トッパン・フォームズ	2,200	1,580.00	3,476,000	
フジシールインターナショナル	1,500	4,145.00	6,217,500	
タカラトミー	4,100	605.00	2,480,500	
廣済堂	1,200	396.00	475,200	
A s - m e エステール	300	735.00	220,500	
アーク	5,200	124.00	644,800	
タカノ	600	693.00	415,800	
プロネクサス	1,200	890.00	1,068,000	
ホクシン	1,200	130.00	156,000	
ウッドワン	2,000	242.00	484,000	
大建工業	5,000	357.00	1,785,000	
凸版印刷	34,000	1,087.00	36,958,000	
大日本印刷	36,000	1,249.00	44,964,000	
図書印刷	2,000	525.00	1,050,000	
共同印刷	4,000	344.00	1,376,000	
日本写真印刷	2,000	2,508.00	5,016,000	
光村印刷	1,000	249.00	249,000	
宝印刷	600	1,359.00	815,400	

アシックス	11,300	3,320.00	37,516,000
ツツミ	600	2,457.00	1,474,200
小松ウオール工業	400	2,090.00	836,000
ヤマハ	8,900	3,085.00	27,456,500
河合楽器製作所	500	2,399.00	1,199,500
クリナップ	1,400	710.00	994,000
ピジョン	6,900	3,315.00	22,873,500
兼松日産農林	2,000	166.00	332,000
キングジム	1,000	846.00	846,000
リンテック	2,900	2,864.00	8,305,600
T A S A K I	300	2,017.00	605,100
イトーキ	2,600	900.00	2,340,000
任天堂	7,500	20,025.00	150,187,500
三菱鉛筆	900	5,670.00	5,103,000
タカラスタANDARD	5,000	936.00	4,680,000
コクヨ	6,300	1,324.00	8,341,200
ナカバヤシ	3,000	328.00	984,000
岡村製作所	4,200	1,120.00	4,704,000
美津濃	7,000	598.00	4,186,000
アデランス	2,100	884.00	1,856,400
東京電力	102,800	809.00	83,165,200
中部電力	37,100	1,815.50	67,355,050
関西電力	49,500	1,522.00	75,339,000
中国電力	16,800	1,716.00	28,828,800
北陸電力	11,900	1,828.00	21,753,200
東北電力	30,300	1,650.00	49,995,000
四国電力	10,900	1,968.00	21,451,200
九州電力	26,800	1,436.00	38,484,800
北海道電力	11,400	1,226.00	13,976,400
沖縄電力	1,300	3,065.00	3,984,500
電源開発	10,300	4,165.00	42,899,500
東京瓦斯	135,000	596.10	80,473,500
大阪瓦斯	125,000	462.10	57,762,500
東邦瓦斯	31,000	785.00	24,335,000
北海道瓦斯	3,000	279.00	837,000
広島ガス	2,100	466.00	978,600

西部瓦斯	14,000	269.00	3,766,000	
静岡ガス	3,400	834.00	2,835,600	
メタウォーター	800	2,734.00	2,187,200	
SBSホールディングス	1,200	1,094.00	1,312,800	
東武鉄道	65,000	588.00	38,220,000	
相鉄ホールディングス	21,000	661.00	13,881,000	
東京急行電鉄	71,000	965.00	68,515,000	
京浜急行電鉄	33,000	988.00	32,604,000	
小田急電鉄	39,000	1,140.00	44,460,000	
京王電鉄	34,000	957.00	32,538,000	
京成電鉄	18,000	1,502.00	27,036,000	
富士急行	3,000	1,154.00	3,462,000	
東日本旅客鉄道	22,200	11,560.00	256,632,000	
西日本旅客鉄道	11,700	8,147.00	95,319,900	
東海旅客鉄道	10,800	21,985.00	237,438,000	
西武ホールディングス	9,700	2,470.00	23,959,000	
鴻池運輸	1,700	1,528.00	2,597,600	
西日本鉄道	16,000	618.00	9,888,000	
ハマキョウレックス	900	2,329.00	2,096,100	
サカイ引越センター	200	6,080.00	1,216,000	
近鉄グループホールディングス	122,000	463.00	56,486,000	
阪急阪神ホールディングス	81,000	774.00	62,694,000	
南海電気鉄道	27,000	595.00	16,065,000	
京阪電気鉄道	27,000	838.00	22,626,000	
神戸電鉄	3,000	358.00	1,074,000	
名古屋鉄道	44,000	493.00	21,692,000	
山陽電気鉄道	4,000	472.00	1,888,000	
日本通運	47,000	563.00	26,461,000	
ヤマトホールディングス	22,400	2,333.50	52,270,400	
山九	16,000	647.00	10,352,000	
丸運	700	260.00	182,000	
丸全昭和運輸	4,000	437.00	1,748,000	
センコー	6,000	821.00	4,926,000	
トナミホールディングス	3,000	370.00	1,110,000	
ニッコンホールディングス	4,000	2,237.00	8,948,000	
日本石油輸送	2,000	234.00	468,000	

福山通運	7,000	635.00	4,445,000
セイノーホールディングス	8,600	1,373.00	11,807,800
神奈川中央交通	2,000	676.00	1,352,000
日立物流	2,500	2,129.00	5,322,500
丸和運輸機関	300	2,198.00	659,400
C & F ロジホールディングス	1,200	920.00	1,104,000
日本郵船	109,000	332.00	36,188,000
商船三井	59,000	325.00	19,175,000
川崎汽船	53,000	252.00	13,356,000
N S ユナイテッド海運	5,000	232.00	1,160,000
明治海運	1,100	502.00	552,200
飯野海運	6,300	539.00	3,395,700
共栄タンカー	1,000	188.00	188,000
乾汽船	1,000	991.00	991,000
日本航空	23,200	4,597.00	106,650,400
A N A ホールディングス	225,000	371.10	83,497,500
パスコ	1,000	316.00	316,000
トランコム	300	5,870.00	1,761,000
日新	5,000	363.00	1,815,000
三菱倉庫	9,000	1,676.00	15,084,000
三井倉庫ホールディングス	7,000	371.00	2,597,000
住友倉庫	9,000	653.00	5,877,000
澁澤倉庫	3,000	311.00	933,000
東陽倉庫	2,000	253.00	506,000
日本トランスシティ	3,000	457.00	1,371,000
ケイヒン	3,000	189.00	567,000
中央倉庫	700	992.00	694,400
安田倉庫	1,000	941.00	941,000
東洋埠頭	4,000	192.00	768,000
宇徳	1,000	422.00	422,000
上組	14,000	1,045.00	14,630,000
サンリツ	300	544.00	163,200
キムラユニティー	300	1,228.00	368,400
キューソー流通システム	300	2,553.00	765,900
郵船ロジスティクス	1,100	1,402.00	1,542,200
近鉄エクスプレス	2,200	2,250.00	4,950,000

東海運	700	286.00	200,200
エーアイティー	600	1,114.00	668,400
内外トランスライン	300	1,171.00	351,300
NEC ネットエスアイ	1,500	2,107.00	3,160,500
システナ	1,200	1,171.00	1,405,200
デジタルアーツ	600	2,032.00	1,219,200
新日鉄住金ソリューションズ	1,000	5,730.00	5,730,000
キューブシステム	500	575.00	287,500
コア	500	835.00	417,500
ソフトクリエイティブホールディングス	400	938.00	375,200
ITホールディングス	4,000	2,974.00	11,896,000
ネオス	400	555.00	222,000
電算システム	400	1,883.00	753,200
グリー	7,300	574.00	4,190,200
コーエーテクモホールディングス	2,900	1,810.00	5,249,000
三菱総合研究所	500	2,988.00	1,494,000
ボルテージ	200	1,453.00	290,600
電算	100	2,286.00	228,600
AGS	200	988.00	197,600
ファインデックス	800	740.00	592,000
ヒト・コミュニケーションズ	100	2,567.00	256,700
ブレインパッド	200	485.00	97,000
KLab	1,900	1,178.00	2,238,200
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	800	1,054.00	843,200
イーブックイニシアティブジャパン	300	784.00	235,200
ネクソン	11,400	1,693.00	19,300,200
アイスタイル	1,000	1,282.00	1,282,000
エムアップ	300	639.00	191,700
エイチーム	400	1,821.00	728,400
テクノスジャパン	100	2,316.00	231,600
コロプラ	3,300	2,060.00	6,798,000
モバイルクリエイティブ	700	451.00	315,700
オルトプラス	500	488.00	244,000
ブロードリーフ	1,300	1,219.00	1,584,700
ハーツユナイテッドグループ	300	1,945.00	583,500

ブイキューブ	300	2,244.00	673,200
VOYAGE GROUP	300	1,610.00	483,000
ベリサーブ	200	1,444.00	288,800
ティーガイア	1,200	1,850.00	2,220,000
日本アジアグループ	1,000	471.00	471,000
豆蔵ホールディングス	1,000	587.00	587,000
テクマトリックス	500	1,255.00	627,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	20,900	399.00	8,339,100
GMOペイメントゲートウェイ	1,000	4,485.00	4,485,000
ザッパラス	700	486.00	340,200
インターネットイニシアティブ	1,900	2,225.00	4,227,500
GMOクラウド	300	753.00	225,900
SRAホールディングス	700	2,546.00	1,782,200
システムインテグレータ	200	697.00	139,400
朝日ネット	1,100	533.00	586,300
コムチュア	200	2,009.00	401,800
gumi	1,200	1,246.00	1,495,200
パイブドHD	100	1,444.00	144,400
フェイス	300	1,402.00	420,600
ハイマックス	100	1,170.00	117,000
野村総合研究所	8,300	4,815.00	39,964,500
サイバネットシステム	1,000	406.00	406,000
CEホールディングス	200	948.00	189,600
インテージホールディングス	600	1,744.00	1,046,400
東邦システムサイエンス	400	705.00	282,000
ソースネクスト	600	497.00	298,200
ティー・ワイ・オー	1,700	203.00	345,100
クレスコ	300	1,966.00	589,800
フジ・メディア・ホールディングス	12,500	1,425.00	17,812,500
オービック	4,100	6,120.00	25,092,000
ジャストシステム	2,200	948.00	2,085,600
TDCソフトウェアエンジニアリング	200	1,301.00	260,200
ヤフー	85,700	489.00	41,907,300
トレンドマイクロ	5,800	4,680.00	27,144,000
インフォメーション・ディベロプメント	200	898.00	179,600
日本オラクル	1,900	5,620.00	10,678,000

アルファシステムズ	400	2,047.00	818,800
フューチャーアーキテクト	1,400	670.00	938,000
C A C Holdings	900	1,003.00	902,700
ソフトバンク・テクノロジー	300	1,236.00	370,800
トーセ	400	813.00	325,200
オービックビジネスコンサルタント	600	7,230.00	4,338,000
伊藤忠テクノソリューションズ	2,700	2,555.00	6,898,500
アイティフォー	1,600	514.00	822,400
東計電算	200	2,202.00	440,400
エクスネット	100	1,513.00	151,300
大塚商会	3,200	5,660.00	18,112,000
サイボウズ	1,700	317.00	538,900
ソフトブレーン	1,800	173.00	311,400
電通国際情報サービス	700	1,777.00	1,243,900
E Mシステムズ	200	2,234.00	446,800
ウェザーニューズ	400	4,030.00	1,612,000
C I J	1,100	496.00	545,600
東洋ビジネスエンジニアリング	100	1,375.00	137,500
日本エンタープライズ	1,100	258.00	283,800
WOWOW	600	3,285.00	1,971,000
フュージョンパートナー	700	536.00	375,200
日本コロムビア	500	518.00	259,000
イマジカ・ロボット ホールディングス	1,000	504.00	504,000
ネットワンシステムズ	5,200	716.00	3,723,200
アルゴグラフィックス	500	1,809.00	904,500
マーベラス	2,000	982.00	1,964,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	2,200	1,463.00	3,218,600
日本ユニシス	3,300	1,365.00	4,504,500
兼松エレクトロニクス	700	1,921.00	1,344,700
東京放送ホールディングス	7,200	1,753.00	12,621,600
日本テレビホールディングス	10,900	2,183.00	23,794,700
朝日放送	1,200	817.00	980,400
テレビ朝日ホールディングス	3,300	1,983.00	6,543,900
スカパーJ S A Tホールディングス	9,100	618.00	5,623,800
テレビ東京ホールディングス	1,100	2,237.00	2,460,700
日本BS放送	200	990.00	198,000

コネクシオ	1,100	1,241.00	1,365,100	
日本通信	6,400	273.00	1,747,200	
クロップス	200	517.00	103,400	
日本電信電話	92,500	4,619.00	427,257,500	
K D D I	121,500	2,940.00	357,210,000	
光通信	1,400	9,490.00	13,286,000	
N T T ドコモ	92,300	2,454.00	226,504,200	
エムティーアイ	1,600	783.00	1,252,800	
G M O インターネット	4,400	1,711.00	7,528,400	
カドカワ	3,700	1,567.00	5,797,900	
学研ホールディングス	4,000	233.00	932,000	
ゼンリン	1,600	1,755.00	2,808,000	
昭文社	700	705.00	493,500	
インプレスホールディングス	1,100	156.00	171,600	
アイネット	700	1,169.00	818,300	
松竹	8,000	1,102.00	8,816,000	
東宝	8,500	3,165.00	26,902,500	
東映	4,000	1,064.00	4,256,000	
A O I P r o .	600	930.00	558,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	7,400	5,880.00	43,512,000	
ピー・シー・エー	100	1,486.00	148,600	
ビジネスブレイン太田昭和	200	1,013.00	202,600	
D T S	1,300	2,641.00	3,433,300	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,100	3,175.00	16,192,500	
シーイーシー	800	1,055.00	844,000	
カブコン	3,100	2,593.00	8,038,300	
アイ・エス・ビー	100	780.00	78,000	
ジャステック	800	1,135.00	908,000	
S C S K	2,900	4,655.00	13,499,500	
日本システムウエア	500	953.00	476,500	
アイネス	1,700	1,061.00	1,803,700	
T K C	1,100	2,841.00	3,125,100	
富士ソフト	1,800	2,315.00	4,167,000	
N S D	2,500	1,691.00	4,227,500	
コナミホールディングス	5,400	2,847.00	15,373,800	
福井コンピュータホールディングス	300	914.00	274,200	

J B C Cホールディングス	1,000	777.00	777,000	
ミロク情報サービス	900	832.00	748,800	
ソフトバンクグループ	67,800	6,934.00	470,125,200	
ハウスイ	1,000	130.00	130,000	
高千穂交易	500	998.00	499,000	
伊藤忠食品	300	4,140.00	1,242,000	
エレマテック	500	2,804.00	1,402,000	
J A L U X	400	2,502.00	1,000,800	
あらた	500	2,605.00	1,302,500	
トーメンデバイス	200	2,032.00	406,400	
東京エレクトロン デバイス	400	1,592.00	636,800	
フィールズ	800	1,930.00	1,544,000	
双日	75,500	272.00	20,536,000	
アルフレッサ ホールディングス	15,000	2,358.00	35,370,000	
横浜冷凍	3,000	978.00	2,934,000	
神栄	2,000	137.00	274,000	
山下医科器械	100	1,757.00	175,700	
ラサ商事	600	601.00	360,600	
アルコニックス	700	1,687.00	1,180,900	
神戸物産	400	4,880.00	1,952,000	
あい ホールディングス	1,900	2,963.00	5,629,700	
ディービーエックス	300	1,131.00	339,300	
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	2,100	1,481.00	3,110,100	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,100	921.00	1,934,100	
八洲電機	900	585.00	526,500	
U K Cホールディングス	800	2,635.00	2,108,000	
O C H Iホールディングス	400	1,034.00	413,600	
T O K A Iホールディングス	5,900	530.00	3,127,000	
三洋貿易	700	1,639.00	1,147,300	
ウイン・パートナーズ	400	1,731.00	692,400	
ミタチ産業	300	733.00	219,900	
シップヘルスケアホールディングス	2,400	2,842.00	6,820,800	
明治電機工業	400	1,185.00	474,000	
デリカフーズ	300	1,003.00	300,900	
スターティア	300	633.00	189,900	

富士興産	500	491.00	245,500
協栄産業	2,000	177.00	354,000
小野建	1,100	1,039.00	1,142,900
佐島電機	900	853.00	767,700
エコートレーディング	300	643.00	192,900
伯東	900	1,384.00	1,245,600
コンドーテック	900	773.00	695,700
中山福	800	863.00	690,400
ナガイレーベン	1,700	2,117.00	3,598,900
三菱食品	1,300	3,030.00	3,939,000
松田産業	900	1,411.00	1,269,900
メディパルホールディングス	12,000	2,174.00	26,088,000
アドヴァン	1,200	1,076.00	1,291,200
S P K	300	2,335.00	700,500
萩原電気	300	1,945.00	583,500
アズワン	900	4,385.00	3,946,500
スズデン	400	915.00	366,000
シモジマ	800	1,106.00	884,800
ドウシシャ	1,400	2,334.00	3,267,600
小津産業	200	2,140.00	428,000
高速	700	928.00	649,600
たけびし	400	1,065.00	426,000
黒田電気	2,200	2,463.00	5,418,600
丸文	1,000	909.00	909,000
ハピネット	1,100	1,309.00	1,439,900
橋本総業	300	1,412.00	423,600
エクセル	600	1,631.00	978,600
マルカキカイ	400	1,868.00	747,200
ガリバーインターナショナル	3,200	1,248.00	3,993,600
日本エム・ディ・エム	1,000	671.00	671,000
進和	700	1,707.00	1,194,900
エスケイジャパン	300	357.00	107,100
ダイトエレクトロン	500	851.00	425,500
シークス	800	3,385.00	2,708,000
田中商事	400	695.00	278,000
オーハシテクニカ	700	1,404.00	982,800

白銅	400	1,372.00	548,800	
伊藤忠商事	93,900	1,546.50	145,216,350	
丸紅	117,700	700.90	82,495,930	
高島	2,000	261.00	522,000	
長瀬産業	7,200	1,526.00	10,987,200	
蝶理	800	1,700.00	1,360,000	
豊田通商	13,300	2,786.00	37,053,800	
三共生興	1,700	464.00	788,800	
兼松	26,000	199.00	5,174,000	
ツカモトコーポレーション	3,000	133.00	399,000	
三井物産	108,200	1,506.00	162,949,200	
日本紙パルプ商事	6,000	336.00	2,016,000	
日立ハイテクノロジーズ	4,200	3,240.00	13,608,000	
カメイ	1,600	1,258.00	2,012,800	
東都水産	2,000	192.00	384,000	
OUGホールディングス	2,000	248.00	496,000	
スターゼン	400	3,200.00	1,280,000	
山善	4,600	1,098.00	5,050,800	
椿本興業	2,000	330.00	660,000	
住友商事	75,300	1,326.50	99,885,450	
内田洋行	3,000	401.00	1,203,000	
三菱商事	89,800	2,025.00	181,845,000	
第一実業	3,000	500.00	1,500,000	
キヤノンマーケティングジャパン	3,400	1,865.00	6,341,000	
西華産業	4,000	276.00	1,104,000	
佐藤商事	1,100	743.00	817,300	
菱洋エレクトロ	1,400	1,520.00	2,128,000	
東京産業	1,200	530.00	636,000	
ユアサ商事	1,100	2,879.00	3,166,900	
神鋼商事	3,000	252.00	756,000	
小林産業	800	227.00	181,600	
阪和興業	12,000	504.00	6,048,000	
カナデン	1,100	959.00	1,054,900	
菱電商事	2,000	803.00	1,606,000	
フルサト工業	700	1,730.00	1,211,000	
岩谷産業	14,000	672.00	9,408,000	

すてきナイスグループ	5,000	164.00	820,000	
昭光通商	5,000	87.00	435,000	
ニチモウ	2,000	246.00	492,000	
極東貿易	2,000	251.00	502,000	
イワキ	2,000	223.00	446,000	
三愛石油	3,000	928.00	2,784,000	
稲畑産業	2,900	1,412.00	4,094,800	
G S I クレオス	3,000	117.00	351,000	
明和産業	1,100	438.00	481,800	
ワキタ	2,500	963.00	2,407,500	
東邦ホールディングス	3,800	2,764.00	10,503,200	
サンゲツ	4,400	2,205.00	9,702,000	
ミツウロコグループホールディングス	1,900	570.00	1,083,000	
シナネンホールディングス	3,000	454.00	1,362,000	
伊藤忠エネクス	3,100	960.00	2,976,000	
サンリオ	3,700	2,917.00	10,792,900	
サンワテクノス	800	1,051.00	840,800	
リョーサン	1,900	2,984.00	5,669,600	
新光商事	1,400	1,292.00	1,808,800	
トーホー	600	2,277.00	1,366,200	
三信電気	1,700	1,393.00	2,368,100	
東陽テクニカ	1,800	979.00	1,762,200	
モスフードサービス	1,600	2,763.00	4,420,800	
加賀電子	1,100	1,781.00	1,959,100	
ソーダニッカ	1,200	509.00	610,800	
立花エレテック	900	1,395.00	1,255,500	
フォーバル	500	695.00	347,500	
P A L T A C	1,900	2,237.00	4,250,300	
三谷産業	1,300	389.00	505,700	
太平洋興発	6,000	89.00	534,000	
ヤマタネ	6,000	186.00	1,116,000	
丸紅建材リース	1,000	225.00	225,000	
日鉄住金物産	8,000	410.00	3,280,000	
トラスコ中山	1,400	4,200.00	5,880,000	
オートバックスセブン	4,600	2,266.00	10,423,600	
加藤産業	1,900	2,938.00	5,582,200	

イノテック	1,100	487.00	535,700	
イエローハット	1,100	2,764.00	3,040,400	
J Kホールディングス	1,200	507.00	608,400	
日伝	500	2,991.00	1,495,500	
北沢産業	1,200	203.00	243,600	
杉本商事	700	1,473.00	1,031,100	
因幡電機産業	1,700	3,845.00	6,536,500	
バイテックホールディングス	400	1,483.00	593,200	
ミスミグループ本社	13,400	1,642.00	22,002,800	
アルテック	1,200	186.00	223,200	
タキヒヨー	2,000	454.00	908,000	
蔵王産業	200	1,442.00	288,400	
スズケン	5,500	4,730.00	26,015,000	
ジェコス	800	1,044.00	835,200	
ルネサスイーストン	800	474.00	379,200	
ローソン	4,500	9,060.00	40,770,000	
サンエー	800	5,100.00	4,080,000	
ダイユーエイト	300	816.00	244,800	
カワチ薬品	900	2,238.00	2,014,200	
エービーシー・マート	1,500	6,960.00	10,440,000	
ハードオフコーポレーション	600	1,549.00	929,400	
アスクル	1,200	4,525.00	5,430,000	
ゲオホールディングス	2,300	1,886.00	4,337,800	
アダストリア	1,100	7,220.00	7,942,000	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	2,000	111.00	222,000	
くらコーポレーション	700	3,805.00	2,663,500	
キャンドゥ	600	1,579.00	947,400	
パル	700	2,840.00	1,988,000	
エディオン	5,100	887.00	4,523,700	
サーラコーポレーション	1,000	619.00	619,000	
ワッツ	500	881.00	440,500	
あみやき亭	200	4,420.00	884,000	
ひらまつ	1,700	675.00	1,147,500	
ゲンキー	300	4,205.00	1,261,500	
サッポロドラッグストアー	100	2,391.00	239,100	
大黒天物産	300	4,190.00	1,257,000	

ハニーズ	1,100	1,012.00	1,113,200
ファーマライズホールディングス	300	590.00	177,000
アルペン	1,100	1,956.00	2,151,600
クオール	1,200	1,438.00	1,725,600
ジェイアイエヌ	800	4,795.00	3,836,000
ビックカメラ	6,200	1,012.00	6,274,400
D C Mホールディングス	5,900	827.00	4,879,300
Monotaro	4,200	3,055.00	12,831,000
東京一番フーズ	200	672.00	134,400
ダイヤモンドダイニング	200	1,132.00	226,400
きちり	400	721.00	288,400
アークランドサービス	200	4,795.00	959,000
J.フロント リテイリング	15,100	1,995.00	30,124,500
ドトール・日レスホールディングス	2,100	1,795.00	3,769,500
マツモトキヨシホールディングス	2,500	5,370.00	13,425,000
ブロンコピラー	500	2,242.00	1,121,000
スタートトゥデイ	3,700	4,005.00	14,818,500
トレジャー・ファクトリー	300	1,160.00	348,000
物語コーポレーション	300	5,110.00	1,533,000
ココカラファイン	1,300	4,590.00	5,967,000
三越伊勢丹ホールディングス	23,800	2,018.00	48,028,400
ウエルシアホールディングス	1,000	5,760.00	5,760,000
クリエイティブSDホールディングス	600	7,300.00	4,380,000
丸善CHIホールディングス	1,500	350.00	525,000
ミサワ	100	720.00	72,000
エー・ピーカンパニー	200	1,514.00	302,800
チムニー	300	3,140.00	942,000
ネクステージ	200	827.00	165,400
ジョイフル本田	1,700	2,350.00	3,995,000
キリン堂ホールディングス	400	1,404.00	561,600
ホットランド	300	1,654.00	496,200
すかいらーく	3,700	1,641.00	6,071,700
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,000	1,061.00	4,244,000
ブックオフコーポレーション	700	924.00	646,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	200	972.00	194,400

あさひ	900	1,212.00	1,090,800
日本調剤	300	4,970.00	1,491,000
コスモス薬品	600	15,650.00	9,390,000
トーエル	700	631.00	441,700
一六堂	300	408.00	122,400
セブン&アイ・ホールディングス	50,000	5,692.00	284,600,000
薬王堂	200	3,050.00	610,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	1,100	2,963.00	3,259,300
ツルハホールディングス	2,600	9,890.00	25,714,000
サンマルクホールディングス	900	3,655.00	3,289,500
フェリシモ	400	1,121.00	448,400
トリドール	1,500	1,830.00	2,745,000
クスリのアオキ	1,000	5,820.00	5,820,000
メディカルシステムネットワーク	1,400	751.00	1,051,400
総合メディカル	600	4,355.00	2,613,000
はるやま商事	500	736.00	368,000
カップ・クリエイト	1,700	1,204.00	2,046,800
ライトオン	900	1,382.00	1,243,800
ジーンズメイト	500	254.00	127,000
良品計画	1,400	25,520.00	35,728,000
三城ホールディングス	1,500	464.00	696,000
アルビス	300	2,258.00	677,400
コナカ	1,400	646.00	904,400
ハウス オブ ローゼ	200	1,440.00	288,000
G-7ホールディングス	400	1,686.00	674,400
イオン北海道	900	546.00	491,400
コジマ	1,900	286.00	543,400
ヒマラヤ	400	1,120.00	448,000
コーナン商事	1,700	1,772.00	3,012,400
エコス	400	1,657.00	662,800
マルシェ	400	859.00	343,600
ドンキホーテホールディングス	7,700	4,515.00	34,765,500
西松屋チェーン	2,400	1,115.00	2,676,000
ゼンショーホールディングス	6,200	1,248.00	7,737,600
幸楽苑ホールディングス	800	1,554.00	1,243,200

ハークスレイ	400	1,369.00	547,600
サイゼリヤ	2,000	2,840.00	5,680,000
V Tホールディングス	4,100	743.00	3,046,300
魚力	400	1,703.00	681,200
ポブラ	400	525.00	210,000
ユニテッドアローズ	1,700	5,570.00	9,469,000
ハイデイ日高	900	3,030.00	2,727,000
京都きもの友禅	800	976.00	780,800
コロワイド	4,000	1,755.00	7,020,000
壱番屋	500	5,840.00	2,920,000
トップカルチャー	500	477.00	238,500
P L A N T	300	1,273.00	381,900
スギホールディングス	2,100	5,860.00	12,306,000
スクロール	1,900	424.00	805,600
ヨンドシーホールディングス	900	2,593.00	2,333,700
ファミリーマート	3,700	5,110.00	18,907,000
木曽路	1,500	2,038.00	3,057,000
サトレストランシステムズ	1,400	889.00	1,244,600
千趣会	2,400	825.00	1,980,000
タカキュー	1,000	197.00	197,000
ケーヨー	2,100	495.00	1,039,500
上新電機	3,000	956.00	2,868,000
日本瓦斯	1,400	3,165.00	4,431,000
ベスト電器	4,200	137.00	575,400
ロイヤルホールディングス	2,000	2,191.00	4,382,000
東天紅	1,000	167.00	167,000
いなげや	1,300	1,287.00	1,673,100
島忠	3,100	2,830.00	8,773,000
チヨダ	1,400	3,765.00	5,271,000
ライフコーポレーション	800	3,095.00	2,476,000
リンガーハット	1,100	2,455.00	2,700,500
さが美	1,000	131.00	131,000
M r M a x	1,200	356.00	427,200
テンアライド	1,200	391.00	469,200
A O K Iホールディングス	2,700	1,558.00	4,206,600
オークワ	2,000	1,032.00	2,064,000

コメリ	1,900	2,696.00	5,122,400
青山商事	2,300	4,560.00	10,488,000
しまむら	1,400	14,020.00	19,628,000
はせがわ	500	478.00	239,000
高島屋	17,000	1,111.00	18,887,000
松屋	2,400	1,502.00	3,604,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	6,100	2,490.00	15,189,000
近鉄百貨店	5,000	335.00	1,675,000
丸栄	3,000	115.00	345,000
ニッセンホールディングス	1,900	181.00	343,900
パルコ	1,200	1,071.00	1,285,200
丸井グループ	14,700	1,600.00	23,520,000
アクシアル リテイリング	900	4,565.00	4,108,500
イオン	49,200	1,820.50	89,568,600
ユニーグループ・ホールディングス	11,500	692.00	7,958,000
イズミ	2,400	4,555.00	10,932,000
東武ストア	2,000	303.00	606,000
平和堂	2,400	2,750.00	6,600,000
フジ	1,300	2,568.00	3,338,400
ヤオコー	1,300	5,570.00	7,241,000
ゼビオホールディングス	1,600	2,193.00	3,508,800
ケーズホールディングス	2,500	4,485.00	11,212,500
O l y m p i c グループ	800	609.00	487,200
日産東京販売ホールディングス	2,000	328.00	656,000
アインホールディングス	1,400	5,710.00	7,994,000
元気寿司	400	2,295.00	918,000
ヤマダ電機	36,400	586.00	21,330,400
アークランドサカモト	1,000	2,648.00	2,648,000
ニトリホールディングス	5,200	10,030.00	52,156,000
愛眼	1,100	244.00	268,400
ケーユーホールディングス	600	825.00	495,000
吉野家ホールディングス	4,400	1,483.00	6,525,200
松屋フーズ	600	2,467.00	1,480,200
サガミチェーン	1,600	1,287.00	2,059,200
関西スーパーマーケット	1,000	829.00	829,000
王将フードサービス	900	4,140.00	3,726,000

プレナス	1,300	1,967.00	2,557,100	
ミニストップ	900	2,210.00	1,989,000	
アークス	2,200	2,487.00	5,471,400	
パローホールディングス	2,600	2,640.00	6,864,000	
藤久	100	1,756.00	175,600	
ベルク	600	4,600.00	2,760,000	
大庄	600	1,451.00	870,600	
ファーストリテイリング	2,400	45,400.00	108,960,000	
サンドラッグ	2,500	6,730.00	16,825,000	
サクスパー ホールディングス	1,100	1,841.00	2,025,100	
ヤマザワ	300	1,706.00	511,800	
やまや	200	2,501.00	500,200	
ペルーナ	3,000	664.00	1,992,000	
島根銀行	300	1,425.00	427,500	
じもとホールディングス	8,600	208.00	1,788,800	
足利ホールディングス	8,800	497.00	4,373,600	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	1,500	4,005.00	6,007,500	
九州フィナンシャルグループ	18,300	916.00	16,762,800	
新生銀行	104,000	238.00	24,752,000	
あおぞら銀行	76,000	436.00	33,136,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	959,800	788.60	756,898,280	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	139,900	642.90	89,941,710	
三井住友トラスト・ホールディングス	251,000	482.80	121,182,800	
三井住友フィナンシャルグループ	95,800	4,921.00	471,431,800	代用有価証券 10,000株
第四銀行	15,000	555.00	8,325,000	
北越銀行	13,000	255.00	3,315,000	
西日本シティ銀行	39,000	336.00	13,104,000	
千葉銀行	46,000	867.00	39,882,000	
横浜銀行	80,000	748.50	59,880,000	
常陽銀行	43,000	590.00	25,370,000	
群馬銀行	27,000	762.00	20,574,000	
武蔵野銀行	1,900	4,640.00	8,816,000	
千葉興業銀行	3,300	737.00	2,432,100	
筑波銀行	5,000	418.00	2,090,000	
七十七銀行	19,000	657.00	12,483,000	

青森銀行	9,000	389.00	3,501,000	
秋田銀行	8,000	392.00	3,136,000	
山形銀行	7,000	471.00	3,297,000	
岩手銀行	800	5,420.00	4,336,000	
東邦銀行	11,000	446.00	4,906,000	
東北銀行	6,000	151.00	906,000	
みちのく銀行	6,000	208.00	1,248,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	52,000	639.00	33,228,000	
静岡銀行	35,000	1,197.00	41,895,000	
十六銀行	15,000	528.00	7,920,000	
スルガ銀行	12,600	2,334.00	29,408,400	
八十二銀行	22,000	812.00	17,864,000	
山梨中央銀行	7,000	572.00	4,004,000	
大垣共立銀行	16,000	471.00	7,536,000	
福井銀行	10,000	250.00	2,500,000	
北國銀行	13,000	436.00	5,668,000	
清水銀行	400	3,000.00	1,200,000	
滋賀銀行	11,000	658.00	7,238,000	
南都銀行	12,000	384.00	4,608,000	
百五銀行	11,000	607.00	6,677,000	
京都銀行	23,000	1,221.00	28,083,000	
紀陽銀行	4,700	1,821.00	8,558,700	
三重銀行	5,000	262.00	1,310,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	81,000	265.00	21,465,000	
広島銀行	35,000	668.00	23,380,000	
山陰合同銀行	7,300	1,090.00	7,957,000	
中国銀行	8,500	1,698.00	14,433,000	
鳥取銀行	4,000	212.00	848,000	
伊予銀行	12,800	1,290.00	16,512,000	
百十四銀行	13,000	446.00	5,798,000	
四国銀行	9,000	259.00	2,331,000	
阿波銀行	10,000	667.00	6,670,000	
大分銀行	7,000	511.00	3,577,000	
宮崎銀行	8,000	439.00	3,512,000	
佐賀銀行	7,000	272.00	1,904,000	
十八銀行	7,000	373.00	2,611,000	

沖縄銀行	900	4,800.00	4,320,000
琉球銀行	2,500	1,712.00	4,280,000
セブン銀行	44,800	545.00	24,416,000
みずほフィナンシャルグループ	1,684,800	248.80	419,178,240
高知銀行	5,000	147.00	735,000
山口フィナンシャルグループ	11,000	1,458.00	16,038,000
長野銀行	4,000	202.00	808,000
名古屋銀行	10,000	448.00	4,480,000
北洋銀行	18,000	463.00	8,334,000
愛知銀行	400	6,640.00	2,656,000
第三銀行	7,000	180.00	1,260,000
中京銀行	5,000	242.00	1,210,000
東日本銀行	6,000	407.00	2,442,000
大光銀行	4,000	234.00	936,000
愛媛銀行	7,000	248.00	1,736,000
トマト銀行	5,000	170.00	850,000
みなと銀行	11,000	208.00	2,288,000
京葉銀行	10,000	590.00	5,900,000
関西アーバン銀行	1,600	1,394.00	2,230,400
栃木銀行	7,000	705.00	4,935,000
北日本銀行	400	3,290.00	1,316,000
東和銀行	17,000	107.00	1,819,000
福島銀行	15,000	95.00	1,425,000
大東銀行	7,000	193.00	1,351,000
トモニホールディングス	9,200	467.00	4,296,400
フィデアホールディングス	7,300	266.00	1,941,800
池田泉州ホールディングス	12,600	522.00	6,577,200
F P G	3,600	862.00	3,103,200
S B Iホールディングス	14,400	1,383.00	19,915,200
ジャフコ	2,000	4,635.00	9,270,000
大和証券グループ本社	112,000	858.30	96,129,600
野村ホールディングス	230,200	778.50	179,210,700
岡三証券グループ	10,000	722.00	7,220,000
丸三証券	3,600	1,174.00	4,226,400
東洋証券	5,000	387.00	1,935,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	13,700	734.00	10,055,800

光世証券	3,000	183.00	549,000
水戸証券	3,800	422.00	1,603,600
いちよし証券	2,700	1,120.00	3,024,000
松井証券	6,100	1,085.00	6,618,500
だいこう証券ビジネス	600	1,091.00	654,600
マネックスグループ	14,200	351.00	4,984,200
カブドットコム証券	10,600	394.00	4,176,400
極東証券	1,600	1,604.00	2,566,400
岩井コスモホールディングス	1,100	1,379.00	1,516,900
藍澤証券	1,700	713.00	1,212,100
マネースクウェアHD	400	1,626.00	650,400
マネーパートナーズグループ	1,200	422.00	506,400
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	26,600	3,883.00	103,287,800
アニコムホールディングス	800	2,874.00	2,299,200
MS & ADインシュアランスグループホールディングス	35,800	3,621.00	129,631,800
ソニーフィナンシャルホールディングス	11,500	2,177.00	25,035,500
第一生命保険	76,700	2,228.00	170,887,600
東京海上ホールディングス	48,500	4,815.00	233,527,500
T & Dホールディングス	43,600	1,735.50	75,667,800
全国保証	3,100	4,040.00	12,524,000
クレディセゾン	9,100	2,485.00	22,613,500
芙蓉総合リース	1,400	5,630.00	7,882,000
興銀リース	2,300	2,632.00	6,053,600
東京センチュリーリース	2,800	4,160.00	11,648,000
日本証券金融	5,400	652.00	3,520,800
アイフル	20,100	461.00	9,266,100
ポケットカード	1,200	591.00	709,200
リコーリース	900	3,695.00	3,325,500
イオンフィナンシャルサービス	7,900	2,921.00	23,075,900
アコム	24,100	616.00	14,845,600
ジャックス	7,000	500.00	3,500,000
オリエントコーポレーション	51,800	239.00	12,380,200
日立キャピタル	2,800	3,440.00	9,632,000
アプラスフィナンシャル	6,000	120.00	720,000
オリックス	84,700	1,792.00	151,782,400

三菱UFJリース	30,400	635.00	19,304,000
日本取引所グループ	35,200	1,867.00	65,718,400
イー・ギャランティ	400	2,367.00	946,800
アサックス	200	1,608.00	321,600
NECキャピタルソリューション	500	1,731.00	865,500
日本駐車場開発	13,200	140.00	1,848,000
ヒューリック	24,900	1,058.00	26,344,200
三栄建築設計	500	1,347.00	673,500
野村不動産ホールディングス	7,900	2,446.00	19,323,400
三重交通グループホールディングス	2,200	470.00	1,034,000
ディア・ライフ	600	421.00	252,600
プレサンスコーポレーション	400	4,245.00	1,698,000
ユニゾホールディングス	700	4,845.00	3,391,500
日本管理センター	800	1,202.00	961,600
サンセイランディック	300	981.00	294,300
エストラスト	200	525.00	105,000
フージャースホールディングス	1,700	465.00	790,500
オープンハウス	1,700	1,978.00	3,362,600
東急不動産ホールディングス	29,000	802.00	23,258,000
飯田グループホールディングス	11,100	2,274.00	25,241,400
エコナックホールディングス	4,000	63.00	252,000
パーク24	6,000	2,475.00	14,850,000
パラカ	400	1,584.00	633,600
三井不動産	63,000	3,161.00	199,143,000
三菱地所	89,000	2,520.50	224,324,500
平和不動産	2,300	1,501.00	3,452,300
東京建物	13,100	1,429.00	18,719,900
ダイビル	3,100	1,028.00	3,186,800
京阪神ビルディング	2,000	691.00	1,382,000
住友不動産	29,000	3,781.00	109,649,000
大京	22,000	204.00	4,488,000
テーオーシー	4,700	919.00	4,319,300
東京楽天地	2,000	502.00	1,004,000
レオパレス21	14,100	675.00	9,517,500
スターツコーポレーション	1,400	1,898.00	2,657,200
フジ住宅	1,600	720.00	1,152,000

空港施設	1,500	567.00	850,500
明和地所	700	529.00	370,300
住友不動産販売	900	2,721.00	2,448,900
ゴールドクレスト	900	2,195.00	1,975,500
日本エスリード	500	1,152.00	576,000
日神不動産	1,600	437.00	699,200
タカラレーベン	5,300	605.00	3,206,500
サンヨーハウジング名古屋	700	1,177.00	823,900
イオンモール	7,700	1,997.00	15,376,900
ファースト住建	400	1,275.00	510,000
トーセイ	1,800	741.00	1,333,800
穴吹興産	1,000	247.00	247,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	7,500	1,204.00	9,030,000
サンフロンティア不動産	1,500	919.00	1,378,500
エフ・ジェー・ネクスト	1,000	508.00	508,000
ランドビジネス	900	368.00	331,200
グランディハウス	1,100	416.00	457,600
日本空港ビルデング	3,800	6,580.00	25,004,000
日本工営	4,000	498.00	1,992,000
ネクスト	3,600	851.00	3,063,600
ジェイエイシーリクルートメント	600	801.00	480,600
日本M&Aセンター	2,000	4,850.00	9,700,000
ノバレーゼ	300	903.00	270,900
アコーディア・ゴルフ	3,500	1,092.00	3,822,000
タケエイ	1,100	995.00	1,094,500
トラスト・テック	200	2,400.00	480,000
パソナグループ	900	916.00	824,400
CDS	300	954.00	286,200
リンクアンドモチベーション	2,600	132.00	343,200
GCAサヴィアン	1,100	1,395.00	1,534,500
エス・エム・エス	1,600	2,169.00	3,470,400
テンプホールディングス	8,900	1,939.00	17,257,100
リニカル	400	1,695.00	678,000
クックパッド	2,800	2,361.00	6,610,800
エスクリ	500	925.00	462,500
アイ・ケイ・ケイ	700	546.00	382,200

学情	500	1,022.00	511,000
スタジオアリス	600	2,191.00	1,314,600
シミックホールディングス	600	1,716.00	1,029,600
N J S	300	1,445.00	433,500
総合警備保障	4,200	5,790.00	24,318,000
カカクコム	9,200	2,139.00	19,678,800
ルネサンス	700	1,308.00	915,600
ディップ	1,400	2,383.00	3,336,200
オプトホールディング	800	651.00	520,800
新日本科学	1,200	605.00	726,000
ツクイ	1,500	1,411.00	2,116,500
総合臨床ホールディングス	700	470.00	329,000
キャリアデザインセンター	400	1,182.00	472,800
エムスリー	11,000	2,308.00	25,388,000
ツカダ・グローバルホールディング	900	770.00	693,000
アウトソーシング	600	2,681.00	1,608,600
ウェルネット	400	2,599.00	1,039,600
ディー・エヌ・エー	5,700	1,911.00	10,892,700
博報堂D Yホールディングス	17,500	1,262.00	22,085,000
ぐるなび	1,500	2,307.00	3,460,500
エスアールジータカミヤ	1,000	574.00	574,000
一休	900	2,222.00	1,999,800
ジャパンベストレスキューシステム	1,500	230.00	345,000
ファンコミュニケーションズ	2,900	865.00	2,508,500
ジェイコムホールディングス	300	1,235.00	370,500
W D Bホールディングス	400	1,264.00	505,600
ティア	600	717.00	430,200
バリューコマース	1,200	511.00	613,200
J Pホールディングス	3,200	302.00	966,400
E P Sホールディングス	1,200	1,212.00	1,454,400
レッグス	200	748.00	149,600
プレステージ・インターナショナル	1,100	1,147.00	1,261,700
アミューズ	300	4,950.00	1,485,000
ドリームインキュベータ	400	1,990.00	796,000
クイック	600	994.00	596,400
T A C	800	227.00	181,600

ケネディクス	17,100	433.00	7,404,300	
電通	14,100	6,800.00	95,880,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	707.00	424,200	
ぴあ	400	2,206.00	882,400	
イオンファンタジー	400	2,087.00	834,800	
シーティーエス	300	782.00	234,600	
みらかホールディングス	3,200	5,210.00	16,672,000	
アルプス技研	500	2,278.00	1,139,000	
サニックス	2,000	272.00	544,000	
ダイオーズ	200	1,216.00	243,200	
日本空調サービス	600	1,137.00	682,200	
オリエンタルランド	13,700	7,487.00	102,571,900	
ダスキン	3,600	2,096.00	7,545,600	
明光ネットワークジャパン	1,500	1,449.00	2,173,500	
ファルコホールディングス	500	1,482.00	741,000	
秀英予備校	200	638.00	127,600	
田谷	300	696.00	208,800	
ラウンドワン	4,000	545.00	2,180,000	
リゾートトラスト	5,300	3,225.00	17,092,500	
ピー・エム・エル	700	3,645.00	2,551,500	
ワタベウェディング	400	498.00	199,200	
りらいあコミュニケーションズ	2,100	1,126.00	2,364,600	
リソー教育	2,400	300.00	720,000	
早稲田アカデミー	200	836.00	167,200	
ユー・エス・エス	15,300	2,159.00	33,032,700	
東京個別指導学院	600	594.00	356,400	
サイバーエージェント	3,100	4,580.00	14,198,000	
楽天	59,200	1,562.00	92,470,400	
テー・オー・ダブリュー	800	816.00	652,800	
セントラルスポーツ	400	2,246.00	898,400	
フルキャストホールディングス	1,200	803.00	963,600	
リゾートソリューション	2,000	297.00	594,000	
テクノプロ・ホールディングス	1,800	3,555.00	6,399,000	
リブセンス	900	419.00	377,100	
ジャパンマテリアル	500	2,058.00	1,029,000	
ベクトル	400	1,713.00	685,200	

ウチヤマホールディングス	700	475.00	332,500
サクセスホールディングス	100	1,313.00	131,300
キャリアリンク	200	1,628.00	325,600
I B J	200	1,271.00	254,200
アサンテ	500	1,497.00	748,500
N・フィールド	400	1,412.00	564,800
M&Aキャピタルパートナーズ	100	1,485.00	148,500
E R Iホールディングス	400	853.00	341,200
アピスト	100	1,619.00	161,900
ウィルグループ	300	888.00	266,400
日本ビューホテル	100	2,249.00	224,900
リクルートホールディングス	25,500	3,900.00	99,450,000
リロ・ホールディング	500	12,780.00	6,390,000
東祥	400	3,010.00	1,204,000
エイチ・アイ・エス	2,100	4,080.00	8,568,000
共立メンテナンス	1,000	8,050.00	8,050,000
イチネンホールディングス	1,300	1,080.00	1,404,000
建設技術研究所	700	1,207.00	844,900
スペース	700	1,350.00	945,000
燦ホールディングス	300	1,544.00	463,200
スバル興業	1,000	421.00	421,000
東京テアトル	5,000	134.00	670,000
よみうりランド	2,000	429.00	858,000
東京都競馬	9,000	286.00	2,574,000
常磐興産	5,000	151.00	755,000
カナモト	1,800	2,569.00	4,624,200
東京ドーム	10,000	559.00	5,590,000
西尾レントオール	1,000	2,904.00	2,904,000
トランス・コスモス	1,500	3,230.00	4,845,000
乃村工藝社	2,700	1,675.00	4,522,500
藤田観光	5,000	462.00	2,310,000
K N T - C Tホールディングス	6,000	284.00	1,704,000
日本管財	1,100	1,866.00	2,052,600
トーカイ	600	3,970.00	2,382,000
白洋舎	2,000	276.00	552,000
セコム	13,200	8,122.00	107,210,400

セントラル警備保障	600	1,587.00	952,200	
丹青社	2,400	911.00	2,186,400	
メイテック	1,600	4,210.00	6,736,000	
アサツー ディ・ケイ	2,200	2,989.00	6,575,800	
応用地質	1,300	1,540.00	2,002,000	
船井総研ホールディングス	1,500	1,915.00	2,872,500	
進学会	600	736.00	441,600	
オオバ	700	491.00	343,700	
ベネッセホールディングス	4,300	3,255.00	13,996,500	
イオンディライト	1,200	3,570.00	4,284,000	
ナック	800	833.00	666,400	
ニチイ学館	2,200	886.00	1,949,200	
ダイセキ	2,400	1,990.00	4,776,000	
ステップ	400	1,043.00	417,200	
合 計	19,995,500		27,907,326,060	

(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26年11月 6日現在	平成27年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
預金	222,697,424	134,025,829

	平成26年11月 6日現在	平成27年11月 6日現在
コール・ローン	1,363,573,011	1,516,004,646
株式	81,244,724,484	76,137,853,498
投資証券	1,945,936,630	1,981,283,255
派生商品評価勘定	86,127,802	148,332,453
未収入金	21,413,215	3,193,364
未収配当金	63,824,238	85,311,594
未収利息	1,851	2,474
差入委託証拠金	275,970,959	258,162,445
流動資産合計	85,224,269,614	80,264,169,558
資産合計	85,224,269,614	80,264,169,558
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	9,571,368	3,211,600
未払金	29,730,285	596,660
未払解約金	213,624,968	178,586,814
流動負債合計	252,926,621	182,395,074
負債合計	252,926,621	182,395,074
純資産の部		
元本等		
元本	45,063,157,199	39,104,730,095
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	39,908,185,794	40,977,044,389
元本等合計	84,971,342,993	80,081,774,484
純資産合計	84,971,342,993	80,081,774,484
負債純資産合計	85,224,269,614	80,264,169,558

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 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>(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	外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。
----------------------------	---

（貸借対照表に関する注記）

		平成26年11月 6日現在	平成27年11月 6日現在
1.	期首	平成25年11月 7日	平成26年11月 7日
	期首元本額	52,890,133,012円	45,063,157,199円
	期首からの追加設定元本額	2,115,048,715円	2,553,715,826円
	期首からの一部解約元本額	9,942,024,528円	8,512,142,930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）	14,486,530,809円	14,228,655,621円
	DCインデックスバランス（株式20）	38,378,525円	39,671,130円
	DCインデックスバランス（株式40）	146,819,018円	155,402,482円
	DCインデックスバランス（株式60）	275,932,015円	290,756,638円
	DCインデックスバランス（株式80）	322,007,153円	345,428,532円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	4,684,069,671円	3,603,552,397円
	日興五大陸株式ファンド	9,774,819,063円	7,495,776,901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	37,408,481円	29,801,029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）	14,975,405円	13,338,738円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	8,648,697円	7,085,288円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	7,037,149円	5,650,402円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	10,361,713円	8,642,901円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	12,356,965円	10,342,211円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	8,863,891,626円	7,520,445,780円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	12,427,867円	10,775,646円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	30,699,577円	28,538,861円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	89,654,539円	87,252,162円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	126,022,414円	123,067,808円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	126,036,614円	124,828,054円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	5,995,079,898円	4,975,717,514円
	計	45,063,157,199円	39,104,730,095円
2.	受益権の総数	45,063,157,199口	39,104,730,095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25年11月 7日 至 平成26年11月 6日	自 平成26年11月 7日 至 平成27年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成26年11月 6日現在	平成27年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

（平成26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	2,059,643,121
投資証券	49,816,493
合計	2,109,459,614

（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

(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26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	1,569,662,912	-	1,583,340,315	13,677,403
	合計	1,569,662,912	-	1,583,340,315	13,677,403

（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

(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26年11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,173,563,369	-	1,236,522,400	62,959,031
	米ドル	864,314,012	-	914,258,250	49,944,238
	ユーロ	309,249,357	-	322,264,150	13,014,793
	売建	91,664,000	-	91,744,000	80,000
	米ドル	91,664,000	-	91,744,000	80,000
	合計	1,265,227,369	-	1,328,266,400	62,879,031

(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

(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26年11月 6日現在		平成27年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	1.8856円	1口当たり純資産額	2.0479円
(1万口当たり純資産額)	(18,856円)	(1万口当たり純資産額)	(20,479円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	10,983	70.10	769,908.30	
	ANTERO RESOURCES CORP	1,060	25.03	26,531.80	
	APACHE CORP	8,294	49.27	408,645.38	
	BAKER HUGHES INC	9,665	49.88	482,090.20	
	CABOT OIL & GAS CORP	9,030	22.64	204,439.20	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	4,221	68.53	289,265.13	
	CHENIERE ENERGY INC	5,020	45.60	228,912.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	11,290	7.52	84,900.80	

CHEVRON CORP	39,751	94.55	3,758,457.05
CIMAREX ENERGY CO	2,005	115.94	232,459.70
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	5,890	8.92	52,538.80
COLUMBIA PIPELINE GROUP	6,385	20.98	133,957.30
CONCHO RESOURCES INC	2,395	113.20	271,114.00
CONOCOPHILLIPS	25,980	56.28	1,462,154.40
CONSOL ENERGY INC	5,288	8.45	44,683.60
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,960	35.06	68,717.60
CORE LABORATORIES N.V.	790	120.68	95,337.20
DEVON ENERGY CORPORATION	8,551	47.51	406,258.01
ENERGEN CORP	1,520	59.76	90,835.20
ENSCO PLC-CL A	4,530	18.30	82,899.00
EOG RESOURCES INC	11,362	86.47	982,472.14
EQT CORP	3,405	67.49	229,803.45
EXXON MOBIL CORP	88,761	84.81	7,527,820.41
FMC TECHNOLOGIES INC	4,415	35.02	154,613.30
HALLIBURTON CO	18,517	38.41	711,237.97
HELMERICH & PAYNE	2,120	58.97	125,016.40
HESS CORP	5,530	62.19	343,910.70
HOLLYFRONTIER CORP	4,520	50.34	227,536.80
KINDER MORGAN INC	38,340	25.91	993,389.40
MARATHON OIL CORP	14,067	19.00	267,273.00
MARATHON PETROLEUM CORP	11,412	55.65	635,077.80
MURPHY OIL CORP	4,295	31.00	133,145.00
NABORS INDUSTRIES LTD	5,821	10.61	61,760.81
NATIONAL OILWELL VARCO INC	8,231	39.50	325,124.50
NOBLE ENERGY INC	8,662	37.65	326,124.30
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	16,231	75.71	1,228,849.01
OCEANEERING INTL INC	2,060	44.34	91,340.40
ONEOK INC	4,150	31.37	130,185.50
PHILLIPS 66	11,405	93.68	1,068,420.40
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,290	145.42	478,431.80
RANGE RESOURCES CORP	4,050	35.38	143,289.00
SCHLUMBERGER LTD	27,079	78.80	2,133,825.20
SOUTHWESTERN ENERGY CO	8,835	12.28	108,493.80

SPECTRA ENERGY CORP	14,814	28.36	420,125.04
TESORO CORP	2,820	115.40	325,428.00
VALERO ENERGY CORP	10,782	71.93	775,549.26
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	16,939	11.06	187,345.34
WHITING PETROLEUM CORP	3,115	18.81	58,593.15
WILLIAMS COS INC	14,734	38.25	563,575.50
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	4,205	137.30	577,346.50
AIRGAS INC	1,430	96.28	137,680.40
ALBEMARLE CORP	1,630	49.43	80,570.90
ALCOA INC	26,179	9.20	240,846.80
ASHLAND INC	1,610	111.11	178,887.10
AVERY DENNISON CORP	2,260	64.83	146,515.80
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	2,100	28.61	60,081.00
BALL CORP	3,133	67.79	212,386.07
CELANESE CORP-SERIES A	3,270	70.73	231,287.10
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,850	46.84	227,174.00
CROWN HOLDINGS INC	2,815	52.58	148,012.70
DOW CHEMICAL CO/THE	24,383	51.61	1,258,406.63
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	19,078	64.81	1,236,445.18
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	2,915	70.66	205,973.90
ECOLAB INC	5,830	117.64	685,841.20
FMC CORP	3,270	41.47	135,606.90
FREEPORT-MCMORAN INC	22,998	11.48	264,017.04
INTERNATIONAL PAPER CO	7,910	42.04	332,536.40
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,664	115.97	192,974.08
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,690	94.99	825,463.10
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,045	155.33	162,319.85
MONSANTO CO	10,181	93.96	956,606.76
MOSAIC CO/THE	6,650	32.67	217,255.50
NEWMONT MINING CORP	11,290	17.50	197,575.00
NUCOR CORP	6,309	42.28	266,744.52
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,950	67.20	131,040.00
PPG INDUSTRIES INC	5,874	103.21	606,255.54
PRAXAIR INC	6,190	113.38	701,822.20
SEALED AIR CORP	4,356	48.12	209,610.72

SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,787	268.11	479,112.57
SIGMA-ALDRICH	2,705	139.50	377,347.50
VULCAN MATERIALS CO	2,893	101.59	293,899.87
WESTLAKE CHEMICAL CORP	960	60.18	57,772.80
WESTROCK CO	5,959	51.38	306,173.42
3M CO	13,366	158.99	2,125,060.34
ACUITY BRANDS INC	870	215.10	187,137.00
AGCO CORP	1,670	48.65	81,245.50
AMETEK INC	5,073	56.48	286,523.04
B/E AEROSPACE INC	2,570	47.12	121,098.40
BOEING CO/THE	14,162	147.97	2,095,551.14
CATERPILLAR INC	12,116	74.22	899,249.52
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	2,410	44.81	107,992.10
CUMMINS INC	3,695	106.50	393,517.50
DANAHER CORP	13,369	95.64	1,278,611.16
DEERE & CO	6,670	77.93	519,793.10
DOVER CORP	3,640	64.50	234,780.00
EATON CORP PLC	9,756	57.11	557,165.16
EMERSON ELECTRIC CO	14,140	49.15	694,981.00
FASTENAL CO	6,153	41.23	253,688.19
FLOWSERVE CORP	2,425	47.58	115,381.50
FLUOR CORP	3,203	50.47	161,655.41
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,160	52.86	167,037.60
GENERAL DYNAMICS CORP	5,912	147.07	869,477.84
GENERAL ELECTRIC CO.	212,693	29.64	6,304,220.52
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	15,726	103.60	1,629,213.60
ILLINOIS TOOL WORKS	7,250	93.10	674,975.00
INGERSOLL-RAND PLC	5,866	59.91	351,432.06
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,200	41.84	92,048.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	1,551	122.93	190,664.43
LOCKHEED MARTIN CORP	5,691	218.60	1,244,052.60
MASCO CORP	8,569	29.25	250,643.25
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,994	186.42	744,561.48
PACCAR INC	7,684	53.48	410,940.32
PARKER HANNIFIN CORP	2,740	106.19	290,960.60

PENTAIR PLC	4,018	59.40	238,669.20
PRECISION CASTPARTS CORP	3,060	230.90	706,554.00
QUANTA SERVICES INC	4,645	20.73	96,290.85
RAYTHEON COMPANY	6,782	119.15	808,075.30
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,943	108.95	320,639.85
ROCKWELL COLLINS INC.	2,605	88.61	230,829.05
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,970	187.91	370,182.70
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,100	48.68	150,908.00
SNAP-ON INC	1,250	169.45	211,812.50
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,116	107.11	333,754.76
TEXTRON INC	5,416	41.97	227,309.52
TRANSDIGM GROUP INC	1,190	227.41	270,617.90
UNITED RENTALS INC	2,250	78.34	176,265.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	17,275	100.80	1,741,320.00
WABCO HOLDINGS INC	1,110	112.91	125,330.10
WABTEC CORP	2,090	77.44	161,849.60
WW GRAINGER INC	1,357	209.78	284,671.46
XYLEM INC	4,368	36.79	160,698.72
ADT CORP/THE	3,537	33.95	120,081.15
CINTAS CORP	2,037	90.81	184,979.97
DUN & BRADSTREET CORP	872	111.60	97,315.20
EQUIFAX INC	2,634	106.09	279,441.06
IHS INC-CLASS A	1,300	119.96	155,948.00
MANPOWERGROUP INC	1,937	90.91	176,092.67
NIELSEN HOLDINGS PLC	6,945	47.84	332,248.80
REPUBLIC SERVICES INC	5,100	43.82	223,482.00
ROBERT HALF INTL INC	2,375	52.21	123,998.75
STERICYCLE INC	1,705	124.09	211,573.45
TOWERS WATSON & CO-CL-A	1,630	129.21	210,612.30
TYCO INTERNATIONAL PLC	8,715	36.92	321,757.80
VERISK ANALYTICS INC	3,170	69.03	218,825.10
WASTE MANAGEMENT INC	9,924	54.43	540,163.32
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	4,080	45.60	186,048.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,250	68.30	221,975.00
CSX CORP	20,923	27.25	570,151.75

DELTA AIR LINES INC	4,285	50.54	216,563.90
EXPEDITORS INTL WASH INC	3,647	49.15	179,250.05
FEDEX CORP	5,758	160.27	922,834.66
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	9,780	18.04	176,431.20
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,310	74.91	173,042.10
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	97,000	0.55	53,350.00
KANSAS CITY SOUTHERN	2,390	88.54	211,610.60
NORFOLK SOUTHERN CORP	6,710	80.15	537,806.50
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,190	46.67	195,547.30
UNION PACIFIC CORP	18,596	87.21	1,621,757.16
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	1,915	60.30	115,474.50
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	14,917	104.23	1,554,798.91
AUTOLIV INC	2,020	126.14	254,802.80
BORGWARNER INC	4,330	42.30	183,159.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	6,290	83.28	523,831.20
FORD MOTOR COMPANY	78,435	14.57	1,142,797.95
GENERAL MOTORS CORP	30,675	35.44	1,087,122.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	5,430	32.71	177,615.30
HARLEY-DAVIDSON INC	4,829	49.51	239,083.79
JOHNSON CONTROLS INC	14,278	45.19	645,222.82
LEAR CORP	1,560	123.38	192,472.80
TESLA MOTORS INC	1,980	231.77	458,904.60
COACH INC	5,876	32.72	192,262.72
DR HORTON INC	6,906	29.40	203,036.40
GARMIN LTD	2,865	37.20	106,578.00
HANESBRANDS INC	8,800	32.84	288,992.00
HARMAN INTERNATIONAL	1,390	110.38	153,428.20
HASBRO INC	2,128	77.06	163,983.68
JARDEN CORP	3,510	48.41	169,919.10
LEGGETT & PLATT INC	2,648	46.32	122,655.36
LENNAR CORP-CL A	3,660	49.07	179,596.20
LULULEMON ATHLETICA INC	2,790	52.08	145,303.20
MATTEL INC	6,309	24.79	156,400.11
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	4,540	43.49	197,444.60
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,378	197.46	272,099.88

NEWELL RUBBERMAID INC	5,800	43.85	254,330.00
NIKE INC -CL B	14,594	131.86	1,924,364.84
POLARIS INDUSTRIES INC	1,250	114.34	142,925.00
PULTE GROUP INC	6,890	18.15	125,053.50
PVH CORP	2,030	94.91	192,667.30
RALPH LAUREN CORP	1,365	130.50	178,132.50
TOLL BROTHERS INC	3,111	35.40	110,129.40
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	3,560	96.03	341,866.80
VF CORP	7,270	69.21	503,156.70
WHIRLPOOL CORP	1,814	158.66	287,809.24
ARAMARK	3,180	30.50	96,990.00
CARNIVAL CORP	8,417	52.90	445,259.30
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	685	617.23	422,802.55
DARDEN RESTAURANTS INC	2,333	61.78	144,132.74
H&R BLOCK INC	5,610	37.33	209,421.30
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	11,130	25.67	285,707.10
LAS VEGAS SANDS CORP	9,050	49.55	448,427.50
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	4,826	76.72	370,250.72
MCDONALD'S CORP	20,421	112.85	2,304,509.85
MGM RESORTS INTERNATIONAL	7,560	23.91	180,759.60
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	2,930	59.71	174,950.30
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,538	99.24	351,111.12
STARBUCKS CORP	31,894	62.28	1,986,358.32
STARWOOD HOTELS & RESORTS	3,597	77.75	279,666.75
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,540	81.55	207,137.00
WYNN RESORTS LTD	1,660	72.98	121,146.80
YUM! BRANDS INC	9,214	71.17	655,760.38
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	4,265	31.95	136,266.75
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	9,798	47.77	468,050.46
CHARTER COMMUNICATION-A	1,780	189.23	336,829.40
COMCAST CORP-CLASS A	45,106	61.81	2,788,001.86
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	8,581	61.99	531,936.19
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,320	29.51	97,973.20
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	6,530	27.94	182,448.20
DISH NETWORK CORP-A	4,769	63.35	302,116.15

INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	8,736	22.76	198,831.36
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,355	45.68	244,616.40
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	13,541	44.02	596,074.82
LIBERTY MEDIA CORP-A	2,465	40.69	100,300.85
LIBERTY MEDIA CORP-C	4,930	39.22	193,354.60
NEWS CORP - CLASS A	7,570	15.35	116,199.50
OMNICOM GROUP	5,417	73.25	396,795.25
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	1,950	58.26	113,607.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	55,940	4.12	230,472.80
TEGNA INC	4,330	27.19	117,732.70
THE WALT DISNEY CO.	34,253	113.00	3,870,589.00
TIME WARNER CABLE	5,917	187.68	1,110,502.56
TIME WARNER INC	17,698	69.43	1,228,772.14
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	9,769	29.88	291,897.72
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	27,572	29.59	815,855.48
VIACOM INC-CLASS B	7,748	46.78	362,451.44
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,608	200.34	322,146.72
AMAZON.COM INC	8,345	655.65	5,471,399.25
AUTONATION INC	1,650	64.41	106,276.50
AUTOZONE INC	702	795.39	558,363.78
BED BATH & BEYOND INC	4,262	60.94	259,726.28
BEST BUY CO INC	6,504	35.02	227,770.08
CARMAX INC	4,859	57.06	277,254.54
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,110	44.20	93,262.00
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	6,280	68.23	428,484.40
DOLLAR TREE INC	4,896	67.71	331,508.16
EXPEDIA INC	2,232	137.31	306,475.92
FOOT LOCKER INC	3,100	68.96	213,776.00
GAMESTOP CORP-CLASS A	2,480	46.94	116,411.20
GAP INC/THE	5,106	28.37	144,857.22
GENUINE PARTS CO	3,521	91.95	323,755.95
HOME DEPOT INC	27,980	125.72	3,517,645.60
KOHL'S CORP	4,402	46.66	205,397.32
L BRANDS INC	5,558	99.12	550,908.96
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	9,700	26.65	258,505.00

LKQ CORP	6,990	30.09	210,329.10
LOWE'S COS INC	20,642	73.58	1,518,838.36
MACY'S INC	7,009	50.45	353,604.05
NETFLIX INC	8,820	113.50	1,001,070.00
NORDSTROM INC	2,850	66.68	190,038.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,235	273.48	611,227.80
PRICELINE GROUP INC/THE	1,095	1,462.64	1,601,590.80
ROSS STORES INC	9,232	51.54	475,817.28
SIGNET JEWELERS LTD	1,660	147.76	245,281.60
STAPLES INC	13,744	13.31	182,932.64
TARGET CORP	12,870	78.15	1,005,790.50
TIFFANY & CO	2,980	83.99	250,290.20
TJX COMPANIES INC	14,413	74.32	1,071,174.16
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,960	93.65	277,204.00
TRIPADVISOR INC	2,330	83.11	193,646.30
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	1,320	172.53	227,739.60
URBAN OUTFITTERS INC	2,040	29.44	60,057.60
COSTCO WHOLESALE CORP	9,339	156.27	1,459,405.53
CVS HEALTH CORP	23,907	99.54	2,379,702.78
KROGER CO	19,670	37.07	729,166.90
RITE AID CORP	19,870	7.83	155,582.10
SYSCO CORP	13,076	41.06	536,900.56
WAL-MART STORES INC	34,222	58.61	2,005,751.42
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	18,502	85.95	1,590,246.90
WHOLE FOODS MARKET INC	7,790	30.11	234,556.90
ALTRIA GROUP INC	41,728	58.05	2,422,310.40
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	13,943	43.07	600,525.01
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2,227	106.88	238,021.76
BUNGE LTD	3,107	73.32	227,805.24
CAMPBELL SOUP CO	4,215	50.40	212,436.00
COCA-COLA CO/THE	87,642	42.33	3,709,885.86
COCA-COLA ENTERPRISES	4,480	51.73	231,750.40
CONAGRA FOODS INC	9,730	41.26	401,459.80
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,720	133.26	495,727.20
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	4,109	87.70	360,359.30

GENERAL MILLS INC	13,169	57.62	758,797.78
HERSHEY CO/THE	3,485	87.71	305,669.35
HORMEL FOODS CORP	2,800	67.60	189,280.00
JM SMUCKER CO/THE	2,160	117.97	254,815.20
KELLOGG CO	5,928	69.37	411,225.36
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	2,865	52.58	150,641.70
KRAFT HEINZ CO/THE	12,381	75.42	933,775.02
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,275	85.86	195,331.50
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	3,991	83.32	332,530.12
MOLSON COORS BREWING CO -B	3,120	87.82	273,998.40
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	34,765	45.88	1,595,018.20
MONSTER BEVERAGE CORP	2,930	132.24	387,463.20
PEPSICO INC	31,411	100.61	3,160,260.71
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	32,788	88.16	2,890,590.08
REYNOLDS AMERICAN INC	18,336	46.16	846,389.76
TYSON FOODS INC-CL A	6,456	45.60	294,393.60
WHITEWAVE FOODS CO	3,520	41.87	147,382.40
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,965	83.01	246,124.65
CLOROX COMPANY	2,736	124.22	339,865.92
COLGATE-PALMOLIVE CO	18,150	67.60	1,226,940.00
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	1,311	83.89	109,979.79
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,740	86.73	411,100.20
KIMBERLY-CLARK CORP	7,923	119.88	949,809.24
PROCTER & GAMBLE CO	57,109	76.39	4,362,556.51
ABBOTT LABORATORIES	31,957	45.18	1,443,817.26
AETNA INC	7,649	111.27	851,104.23
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,714	97.89	461,453.46
ANTHEM INC	5,656	136.04	769,442.24
BAXTER INTERNATIONAL INC	11,519	37.55	432,538.45
BECTON DICKINSON AND CO	4,617	152.24	702,892.08
BOSTON SCIENTIFIC CORP	28,738	18.94	544,297.72
CARDINAL HEALTH INC	7,295	88.20	643,419.00
CENTENE CORP	2,260	61.74	139,532.40
CERNER CORP	6,590	61.28	403,835.20
CIGNA CORP	5,420	132.40	717,608.00

COOPER COS INC/THE	1,040	153.51	159,650.40
CR BARD INC	1,574	185.70	292,291.80
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	3,938	77.75	306,179.50
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	2,972	61.55	182,926.60
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,160	158.65	342,684.00
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	3,630	29.14	105,778.20
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	15,364	88.60	1,361,250.40
HCA HOLDINGS INC	7,315	68.59	501,735.85
HENRY SCHEIN INC	1,630	154.21	251,362.30
HOLOGIC INC	4,538	39.96	181,338.48
HUMANA INC	3,115	179.05	557,740.75
INTUITIVE SURGICAL INC	820	499.35	409,467.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,155	121.93	262,759.15
MCKESSON CORP	4,964	185.94	923,006.16
MEDTRONIC PLC	30,038	76.17	2,287,994.46
PATTERSON COS INC	2,042	48.12	98,261.04
QUEST DIAGNOSTICS	3,116	68.65	213,913.40
RESMED INC	3,370	58.48	197,077.60
ST JUDE MEDICAL INC	6,120	64.60	395,352.00
STRYKER CORP	7,533	97.59	735,145.47
UNITEDHEALTH GROUP INC	20,280	116.23	2,357,144.40
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,820	122.91	223,696.20
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,474	80.34	198,761.16
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	3,572	107.85	385,240.20
ABBVIE INC	36,316	62.77	2,279,555.32
AGILENT TECHNOLOGIES INC	7,010	38.30	268,483.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	4,690	173.44	813,433.60
ALKERMES PLC	3,220	71.22	229,328.40
ALLERGAN PLC	8,305	309.43	2,569,816.15
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,530	98.77	151,118.10
AMGEN INC	16,031	161.22	2,584,517.82
BAXALTA INC	11,519	34.27	394,756.13
BIOGEN INC	4,953	293.03	1,451,377.59
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,500	112.32	393,120.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	35,151	65.55	2,304,148.05

CELGENE CORP	16,904	120.46	2,036,255.84
ELI LILLY & CO	21,163	80.61	1,705,949.43
ENDO INTERNATIONAL PLC	4,160	51.70	215,072.00
GILEAD SCIENCES INC	31,494	107.83	3,395,998.02
ILLUMINA INC	2,985	154.75	461,928.75
INCYTE CORP	3,340	116.76	389,978.40
ISIS PHARMACEUTICALS INC	2,570	53.95	138,651.50
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,330	140.56	186,944.80
JOHNSON & JOHNSON	58,821	102.33	6,019,152.93
MALLINCKRODT PLC	2,400	66.51	159,624.00
MEDIVATION INC	3,320	43.55	144,586.00
MERCK & CO. INC.	60,153	55.05	3,311,422.65
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	600	312.36	187,416.00
MYLAN NV	8,585	44.79	384,522.15
PERRIGO CO PLC	3,039	160.50	487,759.50
PFIZER INC	129,610	34.15	4,426,181.50
PUMA BIOTECHNOLOGY INC	550	89.92	49,456.00
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	1,950	65.89	128,485.50
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,650	564.16	930,864.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	8,374	134.95	1,130,071.30
UNITED THERAPEUTICS CORP	940	152.06	142,936.40
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,320	121.91	648,561.20
WATERS CORP	1,886	131.74	248,461.64
ZOETIS INC	10,200	45.46	463,692.00
BANK OF AMERICA CORP	222,679	17.31	3,854,573.49
BB&T CORP	15,428	38.15	588,578.20
CIT GROUP INC	3,435	42.53	146,090.55
CITIGROUP INC	64,377	54.15	3,486,014.55
CITIZENS FINANCIAL GROUP	9,120	24.61	224,443.20
COMERICA INC	3,360	45.43	152,644.80
FIFTH THIRD BANCORP	16,559	19.82	328,199.38
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,330	67.01	156,133.30
HUDSON CITY BANCORP INC	12,310	10.12	124,577.20
HUNTINGTON BANCSHARES INC	17,700	11.33	200,541.00
JPMORGAN CHASE & CO	78,970	66.44	5,246,766.80

KEYCORP	17,678	12.99	229,637.22
M & T BANK CORP	2,453	120.60	295,831.80
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	9,654	16.05	154,946.70
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	6,370	16.43	104,659.10
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	11,100	92.64	1,028,304.00
REGIONS FINANCIAL CORP	29,784	9.73	289,798.32
SUNTRUST BANKS INC	11,067	43.39	480,197.13
US BANCORP	37,991	42.63	1,619,556.33
WELLS FARGO & CO	103,780	54.86	5,693,370.80
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,220	187.31	228,518.20
ALLY FINANCIAL INC	9,120	19.89	181,396.80
AMERICAN EXPRESS CO	19,344	73.93	1,430,101.92
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,090	117.05	478,734.50
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	23,662	43.29	1,024,327.98
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	24,480	136.57	3,343,233.60
BLACKROCK INC	2,705	357.30	966,496.50
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	11,835	79.55	941,474.25
CME GROUP INC	6,690	95.51	638,961.90
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	9,370	56.91	533,246.70
E*TRADE FINANCIAL CORP	5,840	28.98	169,243.20
EATON VANCE CORP	2,880	36.89	106,243.20
FRANKLIN RESOURCES INC	7,995	41.57	332,352.15
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8,338	192.02	1,601,062.76
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	2,456	261.50	642,244.00
INVESCO LTD	8,347	33.89	282,879.83
LEGG MASON INC	2,185	45.81	100,094.85
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	19.34	141,278.70
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	6,022	97.59	587,686.98
MOODY'S CORP	3,917	101.60	397,967.20
MORGAN STANLEY	31,145	33.88	1,055,192.60
NASDAQ INC	3,055	58.62	179,084.10
NAVIENT CORP	8,682	13.23	114,862.86
NORTHERN TRUST CORP	4,690	73.28	343,683.20
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,500	56.81	142,025.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	24,604	31.57	776,748.28

SEI INVESTMENTS COMPANY	3,225	53.46	172,408.50
STATE STREET CORP	8,707	72.46	630,909.22
SYNCHRONY FINANCIAL	3,410	32.61	111,200.10
T ROWE PRICE GROUP INC	5,735	76.67	439,702.45
TD AMERITRADE HOLDING CORP	5,050	36.21	182,860.50
VOYA FINANCIAL INC	4,650	40.03	186,139.50
ACE LTD	6,983	113.53	792,779.99
AFLAC INC	9,482	64.17	608,459.94
ALLEGHANY CORP	400	499.81	199,924.00
ALLSTATE CORP	9,313	63.55	591,841.15
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	29,045	62.00	1,800,790.00
AON PLC	5,617	94.80	532,491.60
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,115	74.53	232,160.95
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,300	44.09	145,497.00
ASSURANT INC	1,530	83.83	128,259.90
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,175	55.00	119,625.00
CHUBB CORP	5,033	129.40	651,270.20
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,690	60.58	162,960.20
EVEREST RE GROUP LTD	1,014	179.97	182,489.58
FNF GROUP	5,881	35.76	210,304.56
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	9,442	46.90	442,829.80
LINCOLN NATIONAL CORP	5,833	55.11	321,456.63
LOEWS CORP	6,865	37.24	255,652.60
MARSH & MCLENNAN COS	10,903	56.30	613,838.90
METLIFE INC	19,985	49.90	997,251.50
PARTNERRE LTD	1,052	138.33	145,523.16
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	5,820	50.93	296,412.60
PROGRESSIVE CORP	12,350	32.38	399,893.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	9,492	84.35	800,650.20
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	887	110.96	98,421.52
TORCHMARK CORP	3,106	58.56	181,887.36
TRAVELERS COS INC/THE	6,754	113.97	769,753.38
UNUM GROUP	4,788	34.49	165,138.12
WILLIS GROUP HOLDING	2,990	45.28	135,387.20
WR BERKLEY CORP	2,573	55.39	142,518.47

XL GROUP PLC	6,310	37.57	237,066.70
CBRE GROUP INC	6,610	36.75	242,917.50
JONES LANG LASALLE INC	890	165.42	147,223.80
REALOGY HOLDINGS CORP	3,160	42.53	134,394.80
ACCENTURE PLC-CL A	13,288	106.09	1,409,723.92
ACTIVISION BLIZZARD INC	10,200	37.36	381,072.00
ADOBE SYSTEMS INC	10,519	90.55	952,495.45
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	4,220	61.70	260,374.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,275	299.11	381,365.25
ALPHABET INC-CL A	6,040	760.67	4,594,446.80
ALPHABET INC-CL C	6,502	731.25	4,754,587.50
ANSYS INC	2,090	93.39	195,185.10
AUTODESK INC	5,210	63.49	330,782.90
AUTOMATIC DATA PROCESSING	9,896	86.98	860,754.08
CA INC	6,760	27.44	185,494.40
CDK GLOBAL INC	2,720	50.08	136,217.60
CITRIX SYSTEMS INC	3,628	82.12	297,931.36
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	12,648	67.17	849,566.16
COMPUTER SCIENCES CORP	3,453	67.00	231,351.00
EBAY INC	22,957	29.30	672,640.10
ELECTRONIC ARTS INC	6,984	74.06	517,235.04
FACEBOOK INC-A	45,230	108.76	4,919,214.80
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	6,105	66.18	404,028.90
FIREEYE INC	1,850	22.46	41,551.00
FISERV INC	5,278	95.94	506,371.32
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,740	154.59	268,986.60
GARTNER INC	1,750	86.46	151,305.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	19,932	139.89	2,788,287.48
INTUIT INC	5,366	97.78	524,687.48
LINKEDIN CORP - A	2,410	249.74	601,873.40
MASTERCARD INC-CLASS A	21,170	100.69	2,131,607.30
MICROSOFT CORP	162,614	54.38	8,842,949.32
NETSUITE INC	740	86.11	63,721.40
NUANCE COMMUNICATIONS INC	4,240	17.54	74,369.60
ORACLE CORP	74,413	40.35	3,002,564.55

PAYCHEX INC	6,712	52.54	352,648.48
PAYPAL HOLDINGS INC	22,957	36.71	842,751.47
RACKSPACE HOSTING INC	2,500	27.31	68,275.00
RED HAT INC	4,070	81.57	331,989.90
SALESFORCE.COM INC	12,500	78.71	983,875.00
SERVICENOW INC	3,030	83.91	254,247.30
SPLUNK INC	2,530	55.35	140,035.50
SYMANTEC CORP	13,905	20.88	290,336.40
SYNOPSYS INC	3,207	50.84	163,043.88
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	1,000	84.39	84,390.00
TERADATA CORP	3,025	25.58	77,379.50
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,636	52.43	190,635.48
TWITTER INC	10,380	28.66	297,490.80
VANTIV INC - CL-A	2,410	50.79	122,403.90
VERISIGN INC	2,720	81.30	221,136.00
VISA INC-CLASS A SHARES	41,492	79.26	3,288,655.92
VMWARE INC	1,835	59.08	108,411.80
WESTERN UNION CO	10,451	19.57	204,526.07
WORKDAY INC-CLASS A	2,070	78.57	162,639.90
XEROX CORP	22,644	9.63	218,061.72
YAHOO! INC	18,265	35.12	641,466.80
ZILLOW GROUP INC - A	1,000	28.26	28,260.00
ZILLOW GROUP INC - C	2,000	25.79	51,580.00
AMPHENOL CORP-CL A	5,990	54.70	327,653.00
APPLE INC	122,012	120.92	14,753,691.04
ARROW ELECTRONICS INC	2,310	59.63	137,745.30
AVNET INC	3,460	46.31	160,232.60
CISCO SYSTEMS INC	108,340	28.43	3,080,106.20
CORNING INC	25,868	19.06	493,044.08
EMC CORP/MASS	41,859	26.04	1,090,008.36
F5 NETWORKS INC	1,445	109.60	158,372.00
FLEXTRONICS INTL LTD	14,686	11.72	172,119.92
FLIR SYSTEMS INC	3,195	27.34	87,351.30
HARRIS CORP	2,130	79.49	169,313.70
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	38,615	13.28	512,807.20

HP INC	38,615	14.05	542,540.75
JUNIPER NETWORKS INC	7,633	31.40	239,676.20
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4,135	67.40	278,699.00
NETAPP INC	7,006	34.20	239,605.20
PALO ALTO NETWORKS INC	1,450	159.93	231,898.50
QUALCOMM INC	35,032	51.07	1,789,084.24
SANDISK CORP	4,653	76.75	357,117.75
SEAGATE TECHNOLOGY	6,974	38.87	271,079.38
TE CONNECTIVITY LTD	8,365	66.69	557,861.85
TRIMBLE NAVIGATION LTD	6,050	22.68	137,214.00
WESTERN DIGITAL CORP	4,755	67.85	322,626.75
AT&T INC	129,497	33.34	4,317,429.98
CENTURYLINK INC	12,616	28.71	362,205.36
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	21,304	4.71	100,341.84
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	5,700	50.83	289,731.00
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	2,580	109.75	283,155.00
SPRINT CORP	15,130	4.68	70,808.40
T-MOBILE US INC	6,372	39.44	251,311.68
VERIZON COMMUNICATIONS INC	86,147	46.20	3,979,991.40
AES CORP	13,728	9.88	135,632.64
ALLIANT ENERGY CORP	2,160	60.03	129,664.80
AMEREN CORPORATION	5,782	44.02	254,523.64
AMERICAN ELECTRIC POWER	10,698	56.49	604,330.02
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,095	58.19	238,288.05
CALPINE CORP	8,060	14.88	119,932.80
CENTERPOINT ENERGY INC	8,142	18.51	150,708.42
CMS ENERGY CORP	5,290	35.83	189,540.70
CONSOLIDATED EDISON INC	6,306	65.35	412,097.10
DOMINION RESOURCES INC/VA	12,177	70.24	855,312.48
DTE ENERGY COMPANY	3,698	83.00	306,934.00
DUKE ENERGY CORP	14,986	71.45	1,070,749.70
EDISON INTERNATIONAL	7,059	60.18	424,810.62
ENTERGY CORP	3,427	68.06	233,241.62
EVERSOURCE ENERGY	6,900	51.50	355,350.00
EXELON CORP	18,576	28.74	533,874.24

FIRSTENERGY CORP	8,255	30.40	250,952.00
MDU RESOURCES GROUP INC	4,180	19.39	81,050.20
NEXTERA ENERGY INC	9,225	102.10	941,872.50
NRG ENERGY INC	7,670	13.58	104,158.60
OGE ENERGY CORP	3,560	27.48	97,828.80
P G & E CORP	10,391	53.72	558,204.52
PEPCO HOLDINGS INC	4,500	26.67	120,015.00
PINNACLE WEST CAPITAL	2,199	64.71	142,297.29
PPL CORP	13,608	34.22	465,665.76
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	10,168	40.69	413,735.92
SCANA CORP	2,473	59.33	146,723.09
SEMPRA ENERGY	4,687	104.12	488,010.44
SOUTHERN CO	19,585	45.63	893,663.55
WEC ENERGY GROUP INC	6,860	51.68	354,524.80
XCEL ENERGY INC	9,704	36.11	350,411.44
ALTERA CORPORATION	5,946	52.73	313,532.58
ANALOG DEVICES INC	6,481	60.36	391,193.16
APPLIED MATERIALS INC	24,833	16.81	417,442.73
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	5,350	121.06	647,671.00
BROADCOM CORP-CL A	11,716	52.19	611,458.04
FREESCALE SEMICONDUCTOR LTD	2,010	33.95	68,239.50
INTEL CORP	100,232	34.00	3,407,888.00
KLA-TENCOR CORPORATION	3,779	67.00	253,193.00
LAM RESEARCH CORP	3,247	77.07	250,246.29
LINEAR TECHNOLOGY CORP	5,594	44.32	247,926.08
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	9,254	8.70	80,509.80
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	5,850	40.71	238,153.50
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	3,794	47.91	181,770.54
MICRON TECHNOLOGY INC	23,297	16.51	384,633.47
NVIDIA CORP	11,505	27.71	318,803.55
QORVO INC	3,100	45.08	139,748.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	4,200	80.28	337,176.00
SUNEDISON INC	5,490	7.48	41,065.20
TEXAS INSTRUMENTS INC	22,052	57.40	1,265,784.80
XILINX INC	6,125	47.21	289,161.25

米ドル小計		6,846,398		403,325,476.72 (49,096,810,281)
加ドル	ALTAGAS LTD	3,050	33.73	102,876.50
	ARC RESOURCES LTD	7,925	19.31	153,031.75
	BAYTEX ENERGY CORP	3,375	5.95	20,081.25
	CAMECO CORP	7,892	17.08	134,795.36
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	24,024	33.71	809,849.04
	CANADIAN OIL SANDS LTD	11,160	10.00	111,600.00
	CENOVUS ENERGY INC	17,463	21.21	370,390.23
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	7,395	18.58	137,399.10
	ENBRIDGE INC	17,995	52.88	951,575.60
	ENCANA CORP	17,968	10.52	189,023.36
	ENERPLUS CORP	4,690	6.78	31,798.20
	HUSKY ENERGY INC	6,729	19.36	130,273.44
	IMPERIAL OIL LTD	6,942	44.50	308,919.00
	INTER PIPELINE LTD	7,180	24.95	179,141.00
	KEYERA CORP	4,120	42.92	176,830.40
	MEG ENERGY CORP	2,710	11.87	32,167.70
	PARAMOUNT RESOURCES LTD -A	1,010	10.98	11,089.80
	PEMBINA PIPELINE CORP	6,245	32.54	203,212.30
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	3,680	28.68	105,542.40
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	2,590	26.40	68,376.00
	SUNCOR ENERGY INC	29,675	39.33	1,167,117.75
	TOURMALINE OIL CORP	4,005	27.71	110,978.55
	TRANSCANADA CORP	14,523	45.25	657,165.75
	VERESEN INC	5,360	10.83	58,048.80
	VERMILION ENERGY INC	1,830	44.02	80,556.60
	AGNICO EAGLE MINES LTD	4,695	34.76	163,198.20
	AGRIUM INC	3,015	126.83	382,392.45
	BARRICK GOLD CORP	26,114	9.70	253,305.80
	ELDORADO GOLD CORP	14,630	4.38	64,079.40
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	12,590	7.13	89,766.70
FRANCO-NEVADA CORP	2,925	63.81	186,644.25	
GOLDCORP INC	17,917	16.02	287,030.34	
KINROSS GOLD CORP	25,015	2.47	61,787.05	

METHANEX CORP	2,330	54.96	128,056.80
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	17,917	27.47	492,179.99
SILVER WHEATON CORP	8,645	17.08	147,656.60
TECK RESOURCES LTD-CLS B	13,885	7.32	101,638.20
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	13,419	3.74	50,187.06
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,460	47.31	69,072.60
YAMANA GOLD INC	19,626	2.55	50,046.30
BOMBARDIER INC 'B'	34,746	1.53	53,161.38
CAE INC	6,315	15.04	94,977.60
FINNING INTERNATIONAL INC	2,845	20.91	59,488.95
SNC-LAVALIN GROUP INC	3,195	41.88	133,806.60
CANADIAN NATL RAILWAY CO	17,018	78.78	1,340,678.04
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,335	179.09	597,265.15
MAGNA INTERNATIONAL INC	8,378	62.42	522,954.76
GILDAN ACTIVEWEAR INC	4,060	37.97	154,158.20
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	4,328	48.73	210,903.44
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	8,325	27.49	228,854.25
THOMSON REUTERS CORP	8,044	53.49	430,273.56
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,560	116.54	181,802.40
DOLLARAMA INC	2,920	92.33	269,603.60
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	8,650	60.11	519,951.50
EMPIRE CO LTD 'A'	3,000	27.60	82,800.00
LOBLAW COMPANIES LTD	4,519	69.67	314,838.73
METRO INC	5,790	37.75	218,572.50
WESTON (GEORGE) LTD	942	111.29	104,835.18
SAPUTO INC	5,040	31.91	160,826.40
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	6,734	103.37	696,093.58
BANK OF MONTREAL	13,731	76.40	1,049,048.40
BANK OF NOVA SCOTIA	25,609	61.51	1,575,209.59
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	8,295	100.33	832,237.35
NATIONAL BANK OF CANADA	7,340	44.02	323,106.80
ROYAL BANK OF CANADA	30,449	76.53	2,330,261.97
TORONTO-DOMINION BANK	39,000	54.06	2,108,340.00
CI FINANCIAL CORP	3,410	31.21	106,426.10
IGM FINANCIAL INC	2,535	38.19	96,811.65

	ONEX CORPORATION	1,905	81.73	155,695.65	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	490	639.98	313,590.20	
	GREAT-WEST LIFECO INC	5,974	34.85	208,193.90	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	1,735	42.76	74,188.60	
	INTACT FINANCIAL CORP	3,045	90.90	276,790.50	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	39,991	21.57	862,605.87	
	POWER CORP OF CANADA	7,800	29.88	233,064.00	
	POWER FINANCIAL CORP	5,715	32.63	186,480.45	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	11,984	43.86	525,618.24	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	18,933	45.75	866,184.75	
	CGI GROUP INC - CL A	4,650	53.23	247,519.50	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	370	570.00	210,900.00	
	OPEN TEXT CORP	3,070	62.25	191,107.50	
	BLACKBERRY LTD	10,328	10.00	103,280.00	
	BCE INC	2,930	56.45	165,398.50	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	8,355	53.01	442,898.55	
	TELUS CORP	4,366	41.91	182,979.06	
	ATCO LTD -CLASS I	1,920	38.12	73,190.40	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,590	35.20	91,168.00	
	FORTIS INC	4,785	37.96	181,638.60	
	TRANSALTA CORP	4,760	6.14	29,226.40	
加ドル小計		819,528		29,247,887.97	(2,705,137,158)
ユーロ	ENI SPA	55,546	14.73	818,192.58	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	9,315	10.07	93,802.05	
	NESTE OYJ	2,740	23.94	65,595.60	
	OMV AG	3,490	25.43	88,750.70	
	REPSOL SA	21,989	12.29	270,244.81	
	SAIPEM SPA	5,370	8.43	45,295.95	
	TECHNIP SA	2,468	50.01	123,424.68	
	TENARIS SA	9,355	11.69	109,359.95	
	TOTAL SA	45,197	46.13	2,084,937.61	
	VOPAK	1,270	37.75	47,942.50	
	AIR LIQUIDE SA	7,424	121.55	902,387.20	
	AKZO NOBEL	5,028	64.66	325,110.48	

ARCELORMITTAL	22,911	4.97	114,050.95
ARKEMA	1,615	67.66	109,270.90
BASF SE	19,385	75.81	1,469,576.85
CRH PLC	16,080	25.14	404,251.20
EVONIK INDUSTRIES AG	1,820	32.99	60,041.80
FUCHS PETROLUB SE-PRF	1,720	42.58	73,246.20
HEIDELBERGCEMENT AG	3,245	70.05	227,312.25
IMERYS SA	540	62.31	33,647.40
K+S AG	3,880	24.28	94,206.40
KONINKLIJKE DSM NV	3,442	48.39	166,558.38
LANXESS AG	1,935	50.11	96,962.85
LINDE AG	3,845	162.25	623,851.25
OCI NV	2,000	24.86	49,720.00
SOLVAY ET CIE SA -A	1,271	102.65	130,468.15
STORA ENSO OYJ-R SHS	12,085	8.80	106,348.00
SYMRISE AG	2,640	61.48	162,307.20
THYSSENKRUPP AG	7,415	18.17	134,767.62
UMICORE	2,120	39.76	84,301.80
UPM-KYMMENE OYJ	12,618	17.49	220,688.82
VOESTALPINE AG	2,509	32.86	82,458.28
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4,176	31.00	129,476.88
AIRBUS GROUP SE	12,608	64.60	814,476.80
ALSTOM	4,490	29.18	131,018.20
ANDRITZ AG	1,980	45.79	90,674.10
BOSKALIS WESTMINSTER	1,695	44.24	74,995.27
BOUYGUES SA	4,210	34.83	146,655.35
BRENTAG AG	3,765	49.90	187,873.50
CNH INDUSTRIAL NV	22,370	6.38	142,832.45
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	9,246	39.21	362,581.89
FERROVIAL SA	9,975	22.27	222,193.12
FERROVIAL SA -RTS	9,975	0.38	3,870.30
FINMECCANICA SPA	9,630	11.88	114,404.40
GEA GROUP AG	3,230	36.98	119,461.55
KONE OYJ-B	6,434	40.06	257,746.04
KONINKLIJKE PHILIPS NV	19,861	24.88	494,240.98

LEGRAND SA	5,628	52.55	295,751.40
MAN SE	624	94.30	58,843.20
METSO OYJ	2,420	23.22	56,192.40
OSRAM LICHT AG	2,332	53.80	125,461.60
PRYSMIAN SPA	3,095	19.51	60,383.45
REXEL SA	7,240	12.67	91,767.00
SAFRAN SA	6,190	67.74	419,310.60
SCHNEIDER ELECTRIC SE	11,898	56.78	675,568.44
SIEMENS AG-REG	16,726	92.67	1,549,998.42
THALES SA	2,345	66.52	155,989.40
VINCI SA	10,490	60.83	638,106.70
WARTSILA OYJ ABP	2,460	40.22	98,941.20
ZARDOYA OTIS SA	4,249	11.25	47,801.25
ZODIAC AEROSPACE	4,550	24.72	112,498.75
BUREAU VERITAS SA	5,650	19.35	109,327.50
EDENRED	3,906	17.31	67,632.39
RANDSTAD HOLDING NV	2,865	53.09	152,102.85
SOCIETE BIC SA	735	148.60	109,221.00
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	10,531	14.42	151,909.67
ADP	650	113.65	73,872.50
AENA SA	1,280	100.20	128,256.00
ATLANTIA SPA	9,360	25.19	235,778.40
BOLLORE	11,000	4.48	49,280.00
DEUTCHE LUFTHANSA	5,680	13.51	76,736.80
DEUTSCHE POST AG-REG	20,993	27.08	568,595.40
FRAPORT AG	980	58.52	57,349.60
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	8,760	12.79	112,040.40
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	16,992	8.15	138,484.80
TNT EXPRESS NV	9,060	7.66	69,463.02
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	7,245	92.78	672,191.10
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,190	73.52	87,488.80
CONTINENTAL AG	2,435	221.35	538,987.25
DAIMLER AG	20,322	78.09	1,586,944.98
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	19,647	13.18	258,947.46
MICHELIN (CGDE)-B	4,149	91.94	381,459.06

NOKIAN RENKAAT OYJ	2,915	33.85	98,672.75
PEUGEOT SA	7,500	16.05	120,412.50
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	3,490	39.13	136,563.70
RENAULT SA	4,117	92.88	382,386.96
VALEO SA	1,620	140.60	227,772.00
VOLKSWAGEN AG	771	120.10	92,597.10
VOLKSWAGEN AG-PFD	3,433	97.50	334,717.50
ADIDAS AG	4,421	89.21	394,397.41
CHRISTIAN DIOR SE	1,080	186.90	201,852.00
HERMES INTERNATIONAL	542	355.60	192,735.20
HUGO BOSS AG -ORD	1,490	92.97	138,525.30
KERING	1,547	172.15	266,316.05
LUXOTTICA GROUP SPA	3,976	63.25	251,482.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	5,874	173.50	1,019,139.00
ACCOR SA	4,976	43.33	215,610.08
SODEXO	1,970	77.98	153,620.60
TUI AG	5,500	16.09	88,522.50
ALTICE NV -A	5,820	15.95	92,829.00
ALTICE NV -B	1,940	16.27	31,573.50
AXEL SPRINGER SE	995	51.67	51,411.65
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	30.75	116,696.25
JC DECAUX SA	1,140	37.65	42,921.00
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	460	115.00	52,900.00
LAGARDERE S.C.A.	2,980	26.53	79,074.30
NUMERICABLE-SFR	2,250	41.62	93,656.25
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	4,805	48.22	231,721.12
PUBLICIS GROUPE	4,075	58.97	240,302.75
RELX NV	20,559	15.74	323,598.66
RTL GROUP	920	78.40	72,128.00
SES	6,700	26.67	178,689.00
TELENET GROUP HOLDING NV	840	50.44	42,369.60
VIVENDI	25,330	21.68	549,154.40
WOLTERS KLUWER	5,647	31.81	179,631.07
INDITEX	22,755	34.35	781,634.25
CARREFOUR SA	11,113	30.00	333,390.00

CASINO GUICHARD PERRACHON	1,344	55.24	74,242.56
COLRUYT SA	1,375	44.94	61,799.37
DELHAIZE GROUP	2,426	86.71	210,358.46
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	11,008	5.86	64,594.94
JERONIMO MARTINS	5,075	13.14	66,710.87
KONINKLIJKE AHOLD NV	19,721	18.84	371,642.24
METRO AG	3,260	28.12	91,687.50
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	16,981	110.20	1,871,306.20
DANONE	11,924	64.81	772,794.44
HEINEKEN HOLDING NV	2,595	73.53	190,810.35
HEINEKEN NV	5,033	84.00	422,772.00
KERRY GROUP PLC-A	3,750	72.77	272,887.50
PERNOD-RICARD SA	4,276	108.90	465,656.40
REMY COINTREAU	470	64.04	30,098.80
BEIERSDORF AG	2,015	88.45	178,226.75
HENKEL AG & CO KGAA	2,030	84.10	170,723.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	3,953	99.42	393,007.26
L'OREAL	5,496	168.90	928,274.40
UNILEVER NV-CVA	34,345	41.65	1,430,469.25
ESSILOR INTERNATIONAL	4,465	120.95	540,041.75
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	4,683	81.30	380,727.90
FRESENIUS SE & CO KGAA	8,475	66.55	564,011.25
BAYER AG	17,470	122.40	2,138,328.00
GRIFOLS SA	3,810	43.60	166,116.00
MERCK KGAA	2,930	89.08	261,004.40
ORION OYJ-CLASS B	2,590	32.79	84,926.10
QIAGEN N.V.	5,145	23.01	118,386.45
SANOFI	25,086	93.28	2,340,022.08
UCB SA	2,798	80.66	225,686.68
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	52,861	1.58	83,731.82
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	133,873	7.76	1,039,657.71
BANCO COMERCIAL PORTUGUES	750,000	0.05	39,750.00
BANCO DE SABADELL SA	108,391	1.74	189,142.29
BANCO POPOLARE SC	5,500	12.69	69,795.00
BANCO POPULAR ESPANOL	39,339	3.44	135,365.49

BANCO SANTANDER SA	303,609	5.20	1,580,892.06
BANK OF IRELAND	558,550	0.32	179,294.55
BANKIA SA	95,000	1.15	110,010.00
BANKINTER SA	13,960	6.60	92,136.00
BNP PARIBAS	22,352	55.87	1,248,806.24
CAIXABANK S.A	54,940	3.41	187,729.98
COMMERZBANK AG	23,524	10.48	246,531.52
CREDIT AGRICOLE SA	21,992	10.79	237,403.64
ERSTE GROUP BANK AG	4,878	25.89	126,291.42
ING GROEP NV-CVA	81,305	13.22	1,075,258.62
INTESA SANPAOLO	275,093	3.09	850,587.55
KBC GROEP NV	5,519	53.33	294,328.27
NATIXIS	22,980	5.79	133,123.14
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	2,770	13.88	38,447.60
SOCIETE GENERALE	15,039	44.14	663,896.65
UBI BANCA SCPA	22,584	6.58	148,602.72
UNICREDIT SPA	98,103	5.83	572,431.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	28,835	25.25	728,083.75
DEUTSCHE BOERSE AG	3,830	80.70	309,081.00
EURAZEO	913	64.11	58,532.43
EXOR SPA	1,714	44.65	76,530.10
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,882	75.01	141,168.82
MEDIOBANCA SPA	11,670	9.14	106,722.15
WENDEL	750	109.15	81,862.50
AEGON NV	38,139	5.64	215,447.21
AGEAS	4,044	39.22	158,625.90
ALLIANZ SE-REG	9,638	159.05	1,532,923.90
ASSICURAZIONI GENERALI	25,718	17.20	442,349.60
AXA	40,412	24.36	984,638.38
CNP ASSURANCES	3,530	12.71	44,883.95
DELTA LLOYD NV	3,600	7.08	25,488.00
HANNOVER RUECK SE-REG	1,355	103.35	140,039.25
MAPFRE SA	20,814	2.49	51,889.30
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,776	180.40	681,190.40
NN GROUP NV	4,480	29.62	132,720.00

SAMPO OYJ-A SHS	9,639	45.55	439,056.45
SCOR SE	2,612	35.11	91,707.32
UNIPOLSAI SPA	12,650	2.25	28,563.70
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	6,680	25.00	167,000.00
IMMOEAST AG-TEMPORARY	16,150	-	-
IMMOFINANZ AG-TEMPORARY	13,000	-	-
VONOVIA SE	10,088	29.94	302,085.16
AMADEUS IT HOLDING SA	9,610	38.50	369,985.00
ATOS SE	1,650	77.35	127,627.50
CAP GEMINI SA	3,209	81.92	262,881.28
DASSAULT SYSTEMES SA	3,080	74.02	227,981.60
GEMALTO	1,850	59.80	110,630.00
SAP SE	20,712	73.75	1,527,510.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2,930	47.52	139,248.25
ALCATEL-LUCENT	55,970	3.79	212,238.24
INGENICO GROUP	1,160	110.20	127,832.00
NOKIA OYJ	79,936	6.93	554,356.16
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	67,336	16.55	1,114,410.80
ELISA OYJ	2,505	34.47	86,347.35
ILIAD SA	520	193.50	100,620.00
KONINKLIJKE KPN NV	61,096	3.28	200,639.26
ORANGE S.A.	41,284	16.06	663,227.46
PROXIMUS	3,780	30.92	116,877.60
TELECOM ITALIA SPA	207,723	1.19	248,021.26
TELECOM ITALIA-RSP	125,887	0.98	123,369.26
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	11,110	5.61	62,349.32
TELEFONICA SA	94,689	12.35	1,169,882.59
E.ON SE	40,559	9.67	392,448.88
EDF	6,075	16.05	97,503.75
ENAGAS	4,190	27.81	116,523.90
ENDESA SA	6,840	20.33	139,057.20
ENEL GREEN POWER SPA	43,650	1.94	84,681.00
ENEL SPA	145,874	4.14	603,918.36
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	49,221	3.43	168,975.69
ENGIE	30,044	16.23	487,764.34

	FORTUM OYJ	9,825	14.17	139,220.25	
	GAS NATURAL SDG SA	7,722	20.14	155,521.08	
	IBERDROLA SA	115,162	6.51	750,741.07	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	2,610	80.50	210,105.00	
	RWE AG	10,685	13.25	141,576.25	
	SNAM SPA	47,520	4.87	231,517.44	
	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	6,199	17.89	110,931.10	
	TERNA SPA	34,477	4.65	160,524.91	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	9,184	22.56	207,236.96	
	ASML HOLDING NV	7,582	87.44	662,970.08	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	24,715	11.11	274,583.65	
	STMICROELECTRONICS NV	16,783	6.49	108,972.01	
ユーロ小計		5,454,500		74,495,190.77	(9,868,377,921)
英債券	AMEC FOSTER WHEELER PLC	8,850	5.74	50,799.00	
	BG GROUP PLC	71,924	10.30	741,176.82	
	BP PLC	385,938	3.90	1,506,894.92	
	PETROFAC LTD	5,025	7.99	40,174.87	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	82,458	17.19	1,417,453.02	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	51,464	17.24	887,239.36	
	TULLOW OIL PLC	19,950	2.22	44,308.95	
	ANGLO AMERICAN PLC	29,014	5.34	155,108.84	
	ANTOFAGASTA PLC	8,730	5.16	45,046.80	
	BHP BILLITON PLC	45,961	10.34	475,236.74	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	2,850	28.54	81,339.00	
	FRESNILLO PLC	5,160	7.27	37,513.20	
	GLENCORE PLC	240,813	1.21	292,587.79	
	JOHNSON MATTHEY PLC	4,447	26.01	115,666.47	
	MONDI PLC	7,400	15.05	111,370.00	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	2,250	41.21	92,722.50	
	REXAM PLC	11,772	5.47	64,392.84	
	RIO TINTO PLC	27,025	22.99	621,304.75	
	SOUTH32 LTD	46,811	0.68	32,065.53	
	ASHTREAD GROUP PLC	10,920	10.17	111,056.40	
	BAE SYSTEMS PLC ORD	71,015	4.37	310,974.68	

BUNZL PLC	7,276	18.69	135,988.44
COBHAM PLC	23,225	2.81	65,262.25
IMI PLC	6,116	9.78	59,814.48
MEGGITT PLC	20,865	3.79	79,266.13
MELROSE INDUSTRIES PLC	20,907	2.70	56,637.06
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	38,295	7.00	268,065.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENTITL-C	3,549,946	0.00	3,549.94
SMITHS GROUP PLC	8,813	9.88	87,072.44
TRAVIS PERKINS PLC	4,350	19.48	84,738.00
WEIR GROUP PLC/THE	3,880	11.57	44,891.60
WOLSELEY PLC	5,004	38.01	190,202.04
AGGREKO PLC	6,006	9.53	57,237.18
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,275	9.69	60,836.12
CAPITA PLC	15,309	12.96	198,404.64
EXPERIAN PLC	20,558	11.13	228,810.54
G4S PLC	34,639	2.48	86,147.19
INTERTEK GROUP PLC	3,545	26.04	92,311.80
EASYJET PLC	3,840	17.72	68,044.80
ROYAL MAIL PLC	14,990	4.38	65,656.20
GKN PLC	33,065	2.90	96,119.95
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	20,100	5.84	117,484.50
BURBERRY GROUP PLC	9,334	13.85	129,275.90
PERSIMMON PLC	5,870	19.00	111,530.00
TAYLOR WIMPEY PLC	66,170	1.83	121,355.78
CARNIVAL PLC	3,660	35.36	129,417.60
COMPASS GROUP PLC	36,157	10.69	386,518.33
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	5,768	26.12	150,660.16
MERLIN ENTERTAINME	15,550	4.08	63,552.85
TUI AG-DI	3,393	11.52	39,087.36
WHITBREAD PLC	4,140	47.41	196,277.40
WILLIAM HILL PLC	18,010	3.30	59,487.03
ITV PLC	77,235	2.54	196,563.07
PEARSON PLC	17,749	8.47	150,422.77
REED ELSEVIER PLC	23,666	11.70	276,892.20
SKY PLC	23,224	10.84	251,748.16

WPP PLC	27,154	14.88	404,051.52
DIXONS CARPHONE PLC	22,000	4.65	102,388.00
KINGFISHER PLC	50,397	3.51	177,246.24
MARKS & SPENCER GROUP PLC	34,970	5.40	188,838.00
NEXT PLC	2,987	79.55	237,615.85
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	5,460	6.93	37,837.80
SAINSBURY (J) PLC	23,451	2.75	64,490.25
TESCO PLC	177,834	1.84	327,214.56
WM MORRISON SUPERMARKETS	37,925	1.67	63,524.37
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	7,795	34.82	271,421.90
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	39,367	38.60	1,519,566.20
COCA-COLA HBC AG-CDI	5,000	15.43	77,150.00
DIAGEO PLC	53,032	18.97	1,006,017.04
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	20,012	35.03	701,020.36
SABMILLER PLC	20,411	39.89	814,296.84
TATE & LYLE PLC	12,180	6.08	74,115.30
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	13,605	63.50	863,917.50
UNILEVER PLC	27,027	28.80	778,377.60
SMITH & NEPHEW PLC	19,376	11.02	213,523.52
ASTRAZENECA PLC	26,693	42.47	1,133,651.71
GLAXOSMITHKLINE PLC	102,721	13.86	1,423,713.06
SHIRE PLC	12,425	47.38	588,696.50
BARCLAYS PLC	348,481	2.28	795,059.40
HSBC HOLDINGS PLC	406,751	5.16	2,102,495.91
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,208,196	0.72	880,774.88
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	57,230	3.12	178,557.60
STANDARD CHARTERED PLC	54,009	6.27	338,636.43
3I GROUP PLC	20,499	5.00	102,597.49
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	22,730	3.49	79,441.35
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,720	14.67	83,912.40
ICAP PLC	12,270	4.43	54,429.72
INVESTEC PLC	13,185	5.35	70,605.67
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	6,577	25.60	168,371.20
SCHRODERS PLC	2,231	30.01	66,952.31
ADMIRAL GROUP PLC	4,925	16.33	80,425.25

	AVIVA PLC	83,965	4.85	407,901.97
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	29,333	3.91	114,750.69
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	127,081	2.68	341,212.48
	OLD MUTUAL PLC	104,159	2.06	215,192.49
	PRUDENTIAL PLC	54,122	15.40	833,749.41
	RSA INSURANCE GROUP PLC	24,738	4.29	106,200.23
	ST JAMES'S PLACE PLC	11,000	9.51	104,665.00
	STANDARD LIFE PLC	40,716	4.15	169,337.84
	SAGE GROUP PLC/THE	22,090	5.45	120,390.50
	BT GROUP PLC	177,832	4.66	829,408.44
	INMARSAT PLC	10,010	9.73	97,447.35
	VODAFONE GROUP PLC	559,658	2.16	1,211,939.39
	CENTRICA PLC	100,135	2.28	228,407.93
	NATIONAL GRID PLC	78,695	9.27	729,738.73
	SEVERN TRENT PLC	5,493	22.19	121,889.67
	SSE PLC	21,427	15.34	328,690.18
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	16,215	9.76	158,258.40
	ARM HOLDINGS PLC	30,650	10.47	320,905.50
英債券小計		9,698,652		34,154,781.32 (6,328,539,430)
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	7,955	15.64	124,416.20
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	140	414.75	58,065.00
	GIVAUDAN-REG	213	1,830.00	389,790.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	10,389	57.30	595,289.70
	SIKA AG-BR	47	3,328.00	156,416.00
	SYNGENTA AG-REG	1,978	337.90	668,366.20
	ABB LTD-REG	46,245	19.03	880,042.35
	GEBERIT AG-REG	895	325.00	290,875.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	360	164.10	59,076.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,090	165.80	180,722.00
	SULZER AG-REG	520	103.80	53,976.00
	ADECCO SA-REG	3,557	66.00	234,762.00
	SGS SA-REG	103	1,924.00	198,172.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,020	139.00	141,780.00
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	11,339	86.60	981,957.40

	SWATCH GROUP AG/THE-BR	610	398.00	242,780.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	930	74.75	69,517.50	
	DUFREY AG-REG	800	129.50	103,600.00	
	ARYZTA AG	2,110	46.73	98,600.30	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	25	6,075.00	151,875.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	2	74,035.00	148,070.00	
	NESTLE SA-REG	68,323	76.20	5,206,212.60	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,160	135.30	156,948.00	
	ACTELION LTD-REG	2,000	138.60	277,200.00	
	LONZA GROUP AG-REG	1,250	147.80	184,750.00	
	NOVARTIS AG-REG	48,783	89.80	4,380,713.40	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	14,878	272.60	4,055,742.80	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	31,898	24.04	766,827.92	
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,210	48.17	250,965.70	
	PARGESA HOLDING SA-BR	655	63.55	41,625.25	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	370	361.00	133,570.00	
	UBS GROUP AG-REG	77,032	19.25	1,482,866.00	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,080	119.10	128,628.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	640	238.70	152,768.00	
	SWISS RE AG	7,729	94.05	726,912.45	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,131	263.60	825,331.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,370	76.00	104,120.00	
	SWISSCOM AG-REG	494	514.00	253,916.00	
	スイスフラン小計	356,331		24,957,246.37	(3,052,021,658)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	4,320	123.60	533,952.00	
	BOLIDEN AB	4,510	163.10	735,581.00	
	ALFA LAVAL AB	4,660	157.30	733,018.00	
	ASSA ABLOY AB-B	20,910	174.60	3,650,886.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	13,095	232.20	3,040,659.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	8,620	213.20	1,837,784.00	
	SANDVIK AB	21,690	83.15	1,803,523.50	
	SKANSKA AB-B SHS	7,170	169.90	1,218,183.00	
	SKF AB-B SHARES-B	7,459	155.20	1,157,636.80	
	VOLVO AB-B SHS-B	31,320	92.70	2,903,364.00	

	SECURITAS AB-B SHS	7,249	123.90	898,151.10	
	ELECTROLUX AB - B	4,595	235.50	1,082,122.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	8,480	57.10	484,208.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	19,758	338.40	6,686,107.20	
	ICA GRUPPEN AB	1,450	299.70	434,565.00	
	SWEDISH MATCH AB	4,860	281.90	1,370,034.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	13,015	256.20	3,334,443.00	
	GETINGE AB-B SHS	4,450	217.00	965,650.00	
	NORDEA BANK AB	66,368	95.20	6,318,233.60	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	31,870	90.65	2,889,015.50	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	31,030	117.50	3,646,025.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	18,520	193.90	3,591,028.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,630	156.90	412,647.00	
	INVESTOR AB-B SHS	9,045	320.50	2,898,922.50	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	5,505	266.90	1,469,284.50	
	ERICSSON LM-B SHS	64,235	85.60	5,498,516.00	
	HEXAGON AB-B SHS	4,880	310.00	1,512,800.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,370	473.70	648,969.00	
	TELE2 AB-B SHS	6,255	86.70	542,308.50	
	TELIASONERA AB	53,480	43.12	2,306,057.60	
スウェーデンクローナ小計		482,799		64,603,675.30	(911,557,858)
ノルウェーク ローネ	SEADRILL LTD	9,735	57.70	561,709.50	
	STATOIL ASA	24,664	141.60	3,492,422.40	
	SUBSEA 7 SA	4,325	70.70	305,777.50	
	NORSK HYDRO A S	30,900	32.29	997,761.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	3,780	395.60	1,495,368.00	
	ORKLA ASA	19,380	70.20	1,360,476.00	
	DNB ASA	22,215	111.50	2,476,972.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,200	133.00	558,600.00	
	TELENOR ASA	15,275	157.30	2,402,757.50	
ノルウェークローネ小計		134,474		13,651,844.40	(194,265,745)
デンマークク ローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,645	321.30	1,813,738.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	5,260	414.10	2,178,166.00	

	ISS A/S	3,100	245.00	759,500.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	90	10,000.00	900,000.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	138	10,260.00	1,415,880.00	
	DSV A/S	3,680	282.50	1,039,600.00	
	PANDORA A/S	2,660	796.00	2,117,360.00	
	CARLSBERG AS-B	2,390	565.50	1,351,545.00	
	COLOPLAST-B	2,545	535.50	1,362,847.50	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	600	635.00	381,000.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	41,505	378.50	15,709,642.50	
	DANSKE BANK A/S	14,975	184.60	2,764,385.00	
	TRYG A/S	2,575	127.50	328,312.50	
	TDC A/S	14,545	38.53	560,418.85	
	デンマーククローネ小計	99,708		32,682,395.85 (580,439,350)	
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	5,335	32.23	171,947.05	
	ORIGIN ENERGY LTD	41,910	5.45	228,409.50	
	SANTOS LTD	23,715	6.01	142,527.15	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	16,528	30.63	506,252.64	
	WORLEYPARSONS LTD	4,340	6.77	29,381.80	
	ALUMINA LTD	46,512	1.19	55,349.28	
	AMCOR LIMITED	26,490	13.32	352,846.80	
	BHP BILLITON LTD	67,716	23.28	1,576,428.48	
	BORAL LTD	17,115	5.45	93,276.75	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	29,665	2.13	63,186.45	
	ILUKA RESOURCES LTD	8,735	6.53	57,039.55	
	INCITEC PIVOT LTD	31,550	3.84	121,152.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	10,985	17.70	194,434.50	
	NEWCREST MINING LTD	14,929	11.89	177,505.81	
	ORICA LIMITED	6,935	16.64	115,398.40	
	RIO TINTO LTD	9,928	50.15	497,889.20	
	SOUTH32 LTD	70,856	1.49	105,929.72	
	CIMIC GROUP LTD	1,867	27.09	50,577.03	
	BRAMBLES LTD	29,708	10.57	314,013.56	
	SEEK LTD	8,040	13.35	107,334.00	
	ASCIANO LTD	24,833	8.28	205,617.24	

AURIZON HOLDINGS LTD	46,150	5.14	237,211.00
QANTAS AIRWAYS LTD	13,113	3.75	49,173.75
SYDNEY AIRPORT	13,366	6.31	84,339.46
TRANSURBAN GROUP	43,195	10.35	447,068.25
ARISTOCRAT LEISURE LTD	10,000	9.48	94,800.00
CROWN RESORTS LTD	6,745	11.70	78,916.50
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	970	37.48	36,355.60
TABCORP HOLDINGS LTD	15,336	4.56	69,932.16
TATTS GROUP LTD	37,700	3.85	145,145.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	8,720	3.89	33,920.80
WESFARMERS LTD	23,695	38.87	921,024.65
WOOLWORTHS LTD	26,272	23.78	624,748.16
COCA-COLA AMATIL LTD	15,150	9.07	137,410.50
TREASURY WINE ESTATES LTD	14,070	7.13	100,319.10
TREASURY WINE ESTATES LTD(N)	1,876	7.13	13,375.88
COCHLEAR LTD	1,277	88.31	112,771.87
HEALTHSCOPE LTD	19,970	2.68	53,519.60
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,935	61.98	181,911.30
SONIC HEALTHCARE LTD	9,830	19.20	188,736.00
CSL LTD	10,362	94.18	975,893.16
AUST AND NZ BANKING GROUP	58,319	26.65	1,554,201.35
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	8,120	13.17	106,940.40
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	10,478	10.61	111,171.58
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	35,387	75.85	2,684,103.95
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	55,493	28.56	1,584,880.08
WESTPAC BANKING CORP	65,801	31.11	2,047,069.11
WESTPAC BANKING CORP-RTS	2,860	4.79	13,699.40
ASX LTD	4,995	40.67	203,146.65
MACQUARIE GROUP LTD	6,404	82.19	526,344.76
AMP LTD	62,647	5.83	365,232.01
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	50,298	5.52	277,644.96
MEDIBANK PRIVATE LTD	62,000	2.36	146,320.00
QBE INSURANCE GROUP LTD	27,200	13.35	363,120.00
SUNCORP GROUP LTD	29,020	12.95	375,809.00
COMPUTERSHARE LTD	11,490	10.95	125,815.50

	TELSTRA CORPORATION LTD	93,164	5.32	495,632.48	
	AGL ENERGY LTD	15,301	16.60	253,996.60	
	AUSNET SERVICES	29,110	1.46	42,646.15	
豪ドル小計		1,446,511		21,030,843.63	(1,829,893,704)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	17,130	7.58	129,845.40	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	24,545	5.45	133,892.97	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	45,157	3.44	155,340.08	
	CONTACT ENERGY LIMITED	9,430	5.15	48,564.50	
ニュージーランドドル小計		96,262		467,642.95	(37,612,522)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	56,708	104.80	5,942,998.40	
	NWS HOLDINGS LTD	28,500	11.58	330,030.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	25,000	15.42	385,500.00	
	MTR CORP	34,000	35.55	1,208,700.00	
	LI & FUNG LTD	138,000	6.23	859,740.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	29,000	30.35	880,150.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	14,500	29.10	421,950.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	50,000	26.75	1,337,500.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	16,800	11.96	200,928.00	
	SANDS CHINA LTD	49,800	29.20	1,454,160.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	28,000	7.45	208,600.00	
	SJM HOLDINGS LTD	48,000	6.31	302,880.00	
	WYNN MACAU LTD	35,800	11.30	404,540.00	
	WH GROUP LTD	63,500	4.21	267,335.00	
	BANK OF EAST ASIA	21,640	29.15	630,806.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	77,000	25.40	1,955,800.00	
	HANG SENG BANK LTD	16,300	143.40	2,337,420.00	
	FIRST PACIFIC CO	44,250	5.33	235,852.50	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	23,500	209.80	4,930,300.00	
	AIA GROUP LTD	254,200	47.75	12,138,050.00	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	54,208	53.65	2,908,259.20		
HANG LUNG PROPERTIES LTD	57,000	18.88	1,076,160.00		
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	24,402	50.15	1,223,760.30		
HYSAN DEVELOPMENT CO	15,000	33.70	505,500.00		

	KERRY PROPERTIES LTD	16,950	22.95	389,002.50	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	134,666	8.22	1,106,954.52	
	SINO LAND CO	63,050	11.72	738,946.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	36,480	100.70	3,673,536.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	13,017	89.50	1,165,021.50	
	SWIRE PROPERTIES LTD	23,200	23.00	533,600.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	27,800	47.90	1,331,620.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	19,600	36.55	716,380.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	67,000	9.48	635,160.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	15,000	70.65	1,059,750.00	
	CLP HOLDINGS LTD	42,500	67.30	2,860,250.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	135,569	15.84	2,147,412.96	
	POWER ASSETS HOLDINGS	27,500	76.10	2,092,750.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	4,200	58.60	246,120.00	
	香港ドル小計	1,831,640		60,843,422.88	(955,850,173)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	34,660	7.16	248,165.60	
	NOBLE GROUP LTD	82,854	0.51	42,669.81	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	21,000	3.53	74,130.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	16,000	2.32	37,120.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,000	3.30	108,900.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	42,010	1.22	51,252.20	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,000	3.13	143,980.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	12,800	11.15	142,720.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	102,000	0.85	87,210.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	32,550	4.04	131,502.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,000	33.40	66,800.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	130,000	0.38	50,050.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	44,700	3.09	138,123.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	36,715	17.51	642,879.65	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	62,240	9.11	567,006.40	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	29,200	20.62	602,104.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	20,000	7.61	152,200.00	
	CAPITALAND LTD	46,100	3.20	147,520.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	10,000	8.06	80,600.00	

	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	60,000	2.23	133,800.00	
	UOL GROUP LTD	12,250	6.65	81,462.50	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	164,980	3.95	651,671.00	
シンガポールドル小計		1,041,059		4,381,866.16 (379,425,790)	
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	9,770	21.04	205,560.80	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	78	1,009.00	78,702.00	
	TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	18,340	234.00	4,291,560.00	
	BANK HAPOALIM BM	27,725	20.57	570,303.25	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	29,355	14.79	434,160.45	
	NICE SYSTEMS LTD	1,385	244.00	337,940.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	48,790	8.18	399,102.20	
イスラエルシュケル小計		135,443		6,317,328.70 (197,921,908)	
合 計		28,443,305		76,137,853,498 (76,137,853,498)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	7,010	125,058.40	
		AMERICAN TOWER CORP	8,759	883,520.33	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	20,020	192,392.20	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,745	487,017.90	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,417	437,068.47	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	3,340	87,107.20	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,200	167,948.00	
		COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	3,071	62,894.08	
		CROWN CASTLE INTL CORP	7,300	631,742.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,235	239,034.15	
		DUKE REALTY CORPORATION	6,875	144,581.25	
		EQUINIX INC	1,177	348,156.60	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	7,970	630,905.20	

		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,400	313,012.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	2,220	175,668.60	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,415	209,872.80	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	12,545	361,797.80	
		HCP INC	10,125	362,576.25	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	14,569	259,765.27	
		IRON MOUNTAIN INC	3,285	103,280.40	
		KIMCO REALTY CORPORATION	8,795	236,937.30	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	108,021.10	
		MACERICH CO/THE	3,250	279,305.00	
		PLUM CREEK TIMBER CO	3,408	139,966.56	
		PROLOGIS INC	10,732	463,085.80	
		PUBLIC STORAGE	3,089	716,956.90	
		REALTY INCOME CORP	5,400	270,000.00	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	2,355	160,846.50	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	6,674	1,354,822.00	
		SL GREEN REALTY CORP	2,260	271,516.40	
		UDR INC	5,820	205,271.40	
		VENTAS INC	6,675	361,718.25	
		VEREIT INC	18,644	159,779.08	
		VORNADO REALTY TRUST	3,321	331,369.38	
		WELLTOWER INC	6,990	453,790.80	
		WEYERHAEUSER CO	10,286	319,688.88	
米ドル小計			223,490	12,056,474.25	(1,467,634,610)
加ドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2,340	50,427.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,380	87,271.60	
加ドル小計			5,720	137,698.60	(12,735,743)
ユーロ	投資証券	FONCIERE DES REGIONS	595	50,188.25	
		GECINA SA	580	67,570.00	
		ICADE	685	45,627.85	
		KLEPIERRE	3,142	133,519.29	
		UNIBAIL-RODAMCO SE-NA	2,070	517,086.00	
			7,072	813,991.39	

ユーロ小計				(107,829,439)	
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	21,701	184,892.52	
		HAMMERSON PLC	15,295	94,905.47	
		INTU PROPERTIES PLC	19,860	67,206.24	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	16,229	214,709.67	
		SEGRO PLC	15,053	66,007.40	
英ポンド小計			88,138	627,721.30	(116,310,479)
豪ドル	投資証券	APA GROUP	26,406	238,182.12	
		DEXUS PROPERTY GROUP	18,487	141,240.68	
		GOODMAN GROUP	43,442	262,389.68	
		GPT GROUP	33,165	156,538.80	
		LEND LEASE GROUP	12,197	153,316.29	
		MIRVAC GROUP	86,525	156,177.62	
		SCENTRE GROUP	116,381	477,162.10	
		STOCKLAND	55,310	219,580.70	
		VICINITY CENTRES	72,862	211,299.80	
		WESTFIELD CORP	41,745	421,624.50	
豪ドル小計			506,520	2,437,512.29	(212,087,944)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	52,000	2,449,200.00	
香港ドル小計			52,000	2,449,200.00	(38,476,932)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	39,000	90,480.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	40,000	55,400.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	41,800	82,764.00	
		SUNTEC REIT	45,000	74,025.00	
シンガポールドル小計			165,800	302,669.00	(26,208,108)
合計				1,981,283,255	(1,981,283,255)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 603銘柄	97.1%		63.1%
	投資証券 36銘柄		2.9%	1.9%
加ドル	株式 89銘柄	99.5%		3.5%
	投資証券 2銘柄		0.5%	0.0%
ユーロ	株式 234銘柄	98.9%		12.6%
	投資証券 5銘柄		1.1%	0.1%
英ポンド	株式 109銘柄	98.2%		8.1%
	投資証券 5銘柄		1.8%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%		3.9%
スウェーデンクローナ	株式 30銘柄	100.0%		1.2%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式 14銘柄	100.0%		0.7%
豪ドル	株式 59銘柄	89.6%		2.3%
	投資証券 10銘柄		10.4%	0.3%
ニュージーランドドル	株式 4銘柄	100.0%		0.0%
香港ドル	株式 38銘柄	96.1%		1.2%
	投資証券 1銘柄		3.9%	0.0%
シンガポールドル	株式 22銘柄	93.5%		0.5%
	投資証券 4銘柄		6.5%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 7銘柄	100.0%		0.3%

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

	平成26年11月 6日現在	平成27年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	220,838,438	24,187,688
国債証券	27,740,474,560	27,814,501,380
地方債証券	2,327,953,000	2,220,325,000
特殊債券	2,400,040,000	2,709,076,000
社債券	1,989,276,000	1,885,695,000
未収利息	102,490,254	97,015,981
前払費用	2,395,902	2,206,124
流動資産合計	34,783,468,154	34,753,007,173
資産合計	34,783,468,154	34,753,007,173
負債の部		
流動負債		
未払金	181,193,450	-
未払解約金	23,227,044	11,984,692
流動負債合計	204,420,494	11,984,692
負債合計	204,420,494	11,984,692
純資産の部		
元本等		
元本	26,334,764,871	25,981,130,487
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,244,282,789	8,759,891,994
元本等合計	34,579,047,660	34,741,022,481
純資産合計	34,579,047,660	34,741,022,481
負債純資産合計	34,783,468,154	34,753,007,173

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26年11月 6日現在	平成27年11月 6日現在
1. 期首	平成25年11月 7日	平成26年11月 7日

期首元本額	26,748,043,185円	26,334,764,871円
期首からの追加設定元本額	1,985,138,999円	2,296,184,953円
期首からの一部解約元本額	2,398,417,313円	2,649,819,337円
元本の内訳		
DCインデックスバランス(株式20)	675,827,589円	774,362,827円
DCインデックスバランス(株式40)	897,888,395円	1,004,200,115円
DCインデックスバランス(株式60)	625,014,738円	711,422,777円
DCインデックスバランス(株式80)	107,010,121円	129,493,345円
インデックスファンド日本債券(DC専用)	1,288,608,000円	1,453,229,784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	6,342,386,330円	5,425,859,764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	5,537,922円	4,785,949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)	49,251,969円	49,382,817円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	5,685,583円	5,194,004円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	31,824,994円	28,565,870円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	126,483,603円	113,561,274円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	455,383,965円	399,836,338円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	7,115,585,801円	6,647,988,644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)	74,641,991円	47,033,167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)	166,512,029円	146,657,163円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	33,729,967円	31,066,594円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	1,087,568,396円	1,125,261,839円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	1,097,914,737円	1,161,341,148円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	573,660,625円	604,250,232円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	85,246,317円	92,713,905円
インデックスファンド日本債券(1年決算型)	5,306,486,255円	5,828,941,399円
日本債券インデックスファンド(個人型年金向け)	182,515,544円	195,981,532円
計	26,334,764,871円	25,981,130,487円
2. 受益権の総数	26,334,764,871口	25,981,130,487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25年11月 7日 至 平成26年11月 6日	自 平成26年11月 7日 至 平成27年11月 6日
--	--------------------------------	--------------------------------

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

金融商品の時価等に関する事項

	平成26年11月 6日現在	平成27年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成26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	70,799,160
地方債証券	492,000
特殊債券	1,331,000
社債券	66,000
合計	69,042,160

(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
特殊債券	1,895,000
社債券	183,000
合計	19,185,210

(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26年11月 6日現在		平成27年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	1.3131円	1口当たり純資産額	1.3372円
(1万口当たり純資産額)	(13,131円)	(1万口当たり純資産額)	(13,372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)	60,000,000	60,121,200	
	第101回利付国債(5年)	170,000,000	170,763,300	
	第102回利付国債(5年)	400,000,000	401,352,000	
	第103回利付国債(5年)	90,000,000	90,371,700	
	第104回利付国債(5年)	50,000,000	50,139,000	
	第105回利付国債(5年)	110,000,000	110,361,900	
	第106回利付国債(5年)	310,000,000	311,181,100	
	第107回利付国債(5年)	705,000,000	707,897,550	
	第109回利付国債(5年)	180,000,000	180,401,400	
	第111回利付国債(5年)	40,000,000	40,372,000	
	第112回利付国債(5年)	160,000,000	161,648,000	
	第114回利付国債(5年)	90,000,000	90,746,100	
	第116回利付国債(5年)	110,000,000	110,649,000	
	第117回利付国債(5年)	470,000,000	472,993,900	
	第118回利付国債(5年)	200,000,000	201,334,000	
	第119回利付国債(5年)	100,000,000	100,306,000	
	第120回利付国債(5年)	330,000,000	332,290,200	
	第121回利付国債(5年)	100,000,000	100,308,000	
	第122回利付国債(5年)	300,000,000	300,921,000	
	第123回利付国債(5年)	505,000,000	506,535,200	
	第124回利付国債(5年)	560,000,000	561,674,400	
	第125回利付国債(5年)	325,000,000	325,945,750	
	第1回利付国債(40年)	25,000,000	31,442,250	
	第2回利付国債(40年)	165,000,000	199,087,350	
	第3回利付国債(40年)	50,000,000	60,328,500	
	第4回利付国債(40年)	95,000,000	114,737,200	
	第5回利付国債(40年)	35,000,000	40,302,150	
	第6回利付国債(40年)	55,000,000	61,745,200	
	第7回利付国債(40年)	60,000,000	63,775,200	
	第8回利付国債(40年)	55,000,000	53,440,200	

第284回利付国債(10年)	462,000,000	470,736,420	
第285回利付国債(10年)	261,000,000	267,034,320	
第286回利付国債(10年)	186,000,000	191,399,580	
第287回利付国債(10年)	35,000,000	36,072,050	
第288回利付国債(10年)	18,000,000	18,570,960	
第289回利付国債(10年)	199,000,000	205,274,470	
第290回利付国債(10年)	226,000,000	233,426,360	
第291回利付国債(10年)	287,000,000	295,753,500	
第292回利付国債(10年)	306,000,000	318,218,580	
第293回利付国債(10年)	56,000,000	58,621,360	
第294回利付国債(10年)	32,000,000	33,414,400	
第295回利付国債(10年)	13,000,000	13,506,740	
第296回利付国債(10年)	14,000,000	14,596,400	
第297回利付国債(10年)	28,000,000	29,209,600	
第298回利付国債(10年)	221,000,000	229,862,100	
第299回利付国債(10年)	750,000,000	782,452,500	
第300回利付国債(10年)	36,000,000	37,799,640	
第301回利付国債(10年)	223,000,000	234,941,650	
第302回利付国債(10年)	94,000,000	98,694,360	
第303回利付国債(10年)	581,000,000	611,804,620	
第304回利付国債(10年)	60,000,000	62,950,200	
第305回利付国債(10年)	563,000,000	592,343,560	
第306回利付国債(10年)	93,000,000	98,521,410	
第308回利付国債(10年)	140,000,000	148,113,000	
第309回利付国債(10年)	134,000,000	140,532,500	
第310回利付国債(10年)	78,000,000	81,631,680	
第311回利付国債(10年)	23,000,000	23,847,780	
第312回利付国債(10年)	205,000,000	217,015,050	
第313回利付国債(10年)	410,000,000	437,256,800	
第315回利付国債(10年)	65,000,000	69,141,150	
第316回利付国債(10年)	35,000,000	37,034,200	
第317回利付国債(10年)	105,000,000	111,344,100	
第318回利付国債(10年)	185,000,000	195,097,300	
第319回利付国債(10年)	5,000,000	5,313,300	
第320回利付国債(10年)	110,000,000	116,222,700	
第321回利付国債(10年)	175,000,000	185,239,250	

第322回利付国債(10年)	75,000,000	78,913,500	
第323回利付国債(10年)	45,000,000	47,425,500	
第324回利付国債(10年)	25,000,000	26,183,000	
第325回利付国債(10年)	160,000,000	167,744,000	
第326回利付国債(10年)	30,000,000	31,259,400	
第327回利付国債(10年)	65,000,000	68,187,600	
第328回利付国債(10年)	115,000,000	118,937,600	
第329回利付国債(10年)	210,000,000	220,350,900	
第330回利付国債(10年)	210,000,000	220,432,800	
第331回利付国債(10年)	80,000,000	82,732,000	
第333回利付国債(10年)	110,000,000	113,615,700	
第334回利付国債(10年)	120,000,000	123,852,000	
第335回利付国債(10年)	130,000,000	132,990,000	
第337回利付国債(10年)	30,000,000	30,120,000	
第338回利付国債(10年)	90,000,000	91,026,000	
第339回利付国債(10年)	200,000,000	201,962,000	
第340回利付国債(10年)	80,000,000	80,649,600	
第14回利付国債(30年)	208,000,000	257,963,680	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	184,634,940	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	43,958,250	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	134,059,200	
第21回利付国債(30年)	20,000,000	24,312,200	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	68,743,950	
第24回利付国債(30年)	158,000,000	197,372,020	
第25回利付国債(30年)	20,000,000	24,257,000	
第26回利付国債(30年)	30,000,000	36,936,000	
第27回利付国債(30年)	29,000,000	36,282,480	
第28回利付国債(30年)	14,000,000	17,548,300	
第29回利付国債(30年)	276,000,000	340,917,960	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	178,781,400	
第31回利付国債(30年)	120,000,000	143,725,200	
第32回利付国債(30年)	40,000,000	48,752,000	
第33回利付国債(30年)	50,000,000	57,769,500	
第34回利付国債(30年)	160,000,000	191,851,200	
第35回利付国債(30年)	120,000,000	138,672,000	
第36回利付国債(30年)	230,000,000	265,776,500	

第37回利付国債(30年)	70,000,000	79,308,600	
第38回利付国債(30年)	30,000,000	33,295,500	
第39回利付国債(30年)	75,000,000	84,918,750	
第40回利付国債(30年)	90,000,000	99,712,800	
第42回利付国債(30年)	65,000,000	70,459,350	
第43回利付国債(30年)	195,000,000	211,264,950	
第44回利付国債(30年)	40,000,000	43,266,800	
第45回利付国債(30年)	15,000,000	15,502,500	
第46回利付国債(30年)	135,000,000	139,403,700	
第47回利付国債(30年)	115,000,000	121,466,450	
第48回利付国債(30年)	70,000,000	70,444,500	
第34回利付国債(20年)	85,000,000	89,034,100	
第37回利付国債(20年)	63,000,000	66,626,910	
第39回利付国債(20年)	86,000,000	91,246,860	
第41回利付国債(20年)	27,000,000	28,349,730	
第42回利付国債(20年)	178,000,000	193,466,420	
第43回利付国債(20年)	73,000,000	81,109,570	
第44回利付国債(20年)	51,000,000	56,479,950	
第47回利付国債(20年)	21,000,000	23,201,430	
第48回利付国債(20年)	99,000,000	111,395,790	
第49回利付国債(20年)	57,000,000	63,247,770	
第50回利付国債(20年)	237,000,000	260,444,040	
第51回利付国債(20年)	39,000,000	43,242,810	
第54回利付国債(20年)	15,000,000	16,948,800	
第55回利付国債(20年)	66,000,000	74,063,880	
第57回利付国債(20年)	52,000,000	58,240,000	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	151,711,650	
第59回利付国債(20年)	33,000,000	36,727,350	
第60回利付国債(20年)	545,000,000	595,014,650	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	28,732,320	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	34,873,760	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	61,317,540	
第65回利付国債(20年)	100,000,000	113,793,000	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	38,417,620	
第67回利付国債(20年)	34,000,000	38,782,100	
第68回利付国債(20年)	78,000,000	90,933,180	

第70回利付国債(20年)	104,000,000	123,309,680	
第72回利付国債(20年)	112,000,000	130,242,560	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	130,787,330	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	137,626,940	
第75回利付国債(20年)	50,000,000	58,429,500	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	24,156,720	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	46,378,400	
第79回利付国債(20年)	160,000,000	185,835,200	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	70,376,400	
第87回利付国債(20年)	170,000,000	201,834,200	
第88回利付国債(20年)	260,000,000	312,015,600	
第90回利付国債(20年)	156,000,000	185,902,080	
第91回利付国債(20年)	260,000,000	312,553,800	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	70,962,600	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	59,233,000	
第95回利付国債(20年)	32,000,000	38,701,440	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	116,286,800	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	53,957,700	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	111,651,320	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	139,169,160	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	36,060,600	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	80,922,600	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	99,489,060	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	13,380,070	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	39,332,040	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	91,886,410	
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,410,820	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	155,208,300	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	156,597,760	
第109回利付国債(20年)	27,000,000	31,554,630	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	117,117,840	
第111回利付国債(20年)	25,000,000	30,222,500	
第113回利付国債(20年)	240,000,000	286,982,400	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	62,227,360	
第115回利付国債(20年)	20,000,000	24,194,000	
第116回利付国債(20年)	145,000,000	175,548,600	

第117回利付国債(20年)	30,000,000	35,900,400	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	11,832,600	
第119回利付国債(20年)	30,000,000	34,671,900	
第120回利付国債(20年)	70,000,000	78,976,800	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	25,743,960	
第122回利付国債(20年)	70,000,000	80,908,800	
第123回利付国債(20年)	25,000,000	29,966,750	
第124回利付国債(20年)	80,000,000	94,728,000	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	60,651,500	
第126回利付国債(20年)	25,000,000	29,608,750	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	75,975,250	
第129回利付国債(20年)	115,000,000	132,705,400	
第130回利付国債(20年)	80,000,000	92,298,400	
第131回利付国債(20年)	55,000,000	62,672,500	
第132回利付国債(20年)	90,000,000	102,435,300	
第133回利付国債(20年)	30,000,000	34,602,000	
第134回利付国債(20年)	30,000,000	34,563,900	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	34,102,200	
第136回利付国債(20年)	180,000,000	201,848,400	
第137回利付国債(20年)	220,000,000	249,759,400	
第138回利付国債(20年)	50,000,000	55,212,000	
第140回利付国債(20年)	280,000,000	317,436,000	
第141回利付国債(20年)	155,000,000	175,464,650	
第142回利付国債(20年)	25,000,000	28,697,500	
第143回利付国債(20年)	115,000,000	128,141,050	
第144回利付国債(20年)	40,000,000	43,932,400	
第145回利付国債(20年)	125,000,000	141,056,250	
第146回利付国債(20年)	75,000,000	84,492,000	
第147回利付国債(20年)	60,000,000	66,487,800	
第148回利付国債(20年)	120,000,000	130,724,400	
第149回利付国債(20年)	215,000,000	233,698,550	
第150回利付国債(20年)	90,000,000	96,016,500	
第151回利付国債(20年)	150,000,000	154,440,000	
第152回利付国債(20年)	160,000,000	164,256,000	
第153回利付国債(20年)	120,000,000	124,878,000	
第154回利付国債(20年)	90,000,000	91,765,800	

国債証券 合計		25,651,000,000	27,814,501,380	
地方債証券	第682回東京都公募公債	100,000,000	105,349,000	
	第708回東京都公募公債	100,000,000	104,819,000	
	第731回東京都公募公債	100,000,000	102,599,000	
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	118,459,000	
	平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	209,762,000	
	平成19年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	102,947,000	
	平成19年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	102,653,000	
	平成21年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	104,956,000	
	平成26年度第3回広島県公募公債	100,000,000	101,373,000	
	平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	105,697,000	
	平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	104,351,000	
	平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	103,549,000	
	第10回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	103,070,000	
	第55回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,470,000	
	第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,352,000	
	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	104,247,000	
	平成26年度第1回栃木県公募公債	100,000,000	100,785,000	
	第4回京都市公募公債(20年)	100,000,000	120,775,000	
	平成23年度第14回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	112,768,000	
	平成23年度第2回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	105,344,000	
地方債証券 合計		2,100,000,000	2,220,325,000	
特殊債券	第1回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	104,284,000	
	第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	104,973,000	
	第5回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,126,000	
	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,081,000	
	第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,508,000	
	第6回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,480,000	
	第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,715,000	
	第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,443,000	
	第21回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,470,000	
	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,523,000	
	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,965,000	
	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	103,656,000	
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	118,129,000	

	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	108,554,000	
	第135回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,510,000	
	第139回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,683,000	
	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	202,322,000	
	第1回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	116,256,000	
	第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	103,890,000	
	第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,421,000	
	第29回国際協力銀行債券	200,000,000	206,238,000	
	い第745号農林債	100,000,000	100,253,000	
	第267回信金中金債(5年)	100,000,000	100,373,000	
	第272回信金中金債(5年)	100,000,000	100,223,000	
特殊債券 合計		2,600,000,000	2,709,076,000	
社債券	第324回東京交通債券	100,000,000	104,130,000	
	第9回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債(2012)	100,000,000	101,353,000	
	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	105,460,000	
	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	103,835,000	
	第12回武田薬品工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,432,000	
	第2回富士フイルム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	101,253,000	
	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	102,095,000	
	第18回株式会社ニコン無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,768,000	
	第137回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	200,000,000	200,390,000	
	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	113,908,000	
	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	110,833,000	
	第16回東海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	106,639,000	
	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	116,823,000	
	第540回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,278,000	

	第299回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,939,000	
	第281回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,043,000	
	第19回沖縄電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,516,000	
社債券 合計		1,800,000,000	1,885,695,000	
	合計	32,151,000,000	34,629,597,380	

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26年11月 6日現在	平成27年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
預金	708,337,234	63,615,687
コール・ローン	67,334,368	281,866,261
国債証券	212,090,079,103	179,970,237,594
派生商品評価勘定	1,853,417	-
未収入金	2,034,704,146	-
未収利息	2,490,694,871	1,901,055,289
前払費用	42,859,200	37,793,735
流動資産合計	217,435,862,339	182,254,568,566
資産合計	217,435,862,339	182,254,568,566
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,671,352	-
未払金	1,854,235,435	-
未払解約金	204,791,429	118,043,382
流動負債合計	2,061,698,216	118,043,382
負債合計	2,061,698,216	118,043,382
純資産の部		
元本等		
元本	94,218,596,068	78,349,209,668
剰余金		
剰余金又は欠損金()	121,155,568,055	103,787,315,516
元本等合計	215,374,164,123	182,136,525,184

純資産合計	215,374,164,123	182,136,525,184
負債純資産合計	217,435,862,339	182,254,568,566

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26年11月 6日現在	平成27年11月 6日現在
1.	期首	平成25年11月 7日	平成26年11月 7日
	期首元本額	116,345,973,411円	94,218,596,068円
	期首からの追加設定元本額	1,456,387,187円	1,399,091,607円
	期首からの一部解約元本額	23,583,764,530円	17,268,478,007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）	10,642,802,419円	10,717,455,388円
	DCインデックスバランス（株式20）	62,159,333円	68,269,726円
	DCインデックスバランス（株式40）	119,135,388円	128,006,703円
	DCインデックスバランス（株式60）	149,300,125円	162,708,003円
	DCインデックスバランス（株式80）	128,919,197円	148,356,986円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	29,189,560,112円	24,031,777,382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	3,813,424,019円	3,090,679,030円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	37,690,590,172円	30,458,219,011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	30,627,453円	24,372,969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)	1,088,902,819円	1,006,770,053円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	68,869,190円	151,321,244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)	23,801,229円	18,308,969円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	3,422,636円	2,967,711円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	3,802,152円	3,257,531円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	8,400,442円	7,176,948円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	20,334,817円	17,570,570円
世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	830,417,717円	864,356,054円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	1,431,073,374円	1,261,792,428円
世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け)	62,487,280円	37,804,015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)	113,790,990円	96,229,066円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	45,360,390円	40,477,070円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	49,843,469円	49,540,456円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	72,773,610円	73,772,934円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	68,321,865円	69,086,349円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	51,278,223円	53,051,962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	8,203,115,070円	5,526,425,452円
海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	246,082,577円	239,455,658円
計	94,218,596,068円	78,349,209,668円
2. 受益権の総数	94,218,596,068口	78,349,209,668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25年11月 7日 至 平成26年11月 6日	自 平成26年11月 7日 至 平成27年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	平成26年11月 6日現在	平成27年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (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26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	104,863,885
合計	104,863,885

(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

(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26年11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	263,989,567	-	265,447,960	1,458,393
	加ドル	76,185,460	-	76,518,550	333,090
	メキシコペソ	38,093,636	-	38,386,780	293,144
	ユーロ	16,349,366	-	16,450,750	101,384
	英ポンド	7,450,220	-	7,503,820	53,600
	スウェーデンクローナ	28,120,498	-	28,453,740	333,242
	ノルウェークローネ	13,847,803	-	13,885,560	37,757
	デンマーククローネ	24,888,733	-	25,056,690	167,957
	シンガポールドル	33,052,237	-	33,213,750	161,513
	南アフリカランド	26,001,614	-	25,978,320	23,294
	売建	1,145,909,209	-	1,148,185,537	2,276,328
	米ドル	564,578,550	-	566,519,200	1,940,650
	ユーロ	308,964,240	-	308,988,000	23,760
	デンマーククローネ	11,457,504	-	11,461,080	3,576

	ポーランドズロチ	130,419,738	-	131,071,410	651,672
	豪ドル	59,892,325	-	59,607,400	284,925
	マレーシアリン ギット	70,596,852	-	70,538,447	58,405
	合計	1,409,898,776	-	1,413,633,497	817,935

(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。

(平成27年11月 6日現在)

該当事項はありません。

(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26年11月 6日現在		平成27年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	2.2859円	1口当たり純資産額	2.3247円
(1万口当たり純資産額)	(22,859円)	(1万口当たり純資産額)	(23,247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-3.125%-16/10/31	3,400,000.00	3,486,859.37	
		US TREASURY N/B-4.625%-16/11/15	6,000,000.00	6,248,437.50	
		US TREASURY N/B-7.5%-16/11/15	7,390,000.00	7,913,650.78	
		US TREASURY N/B-2.75%-16/11/30	7,000,000.00	7,158,046.87	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/12/31	8,700,000.00	8,963,039.06	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/01/31	9,000,000.00	9,277,734.37	
		US TREASURY N/B-4.625%-17/02/15	9,250,000.00	9,720,449.21	
		US TREASURY N/B-3.0%-17/02/28	5,400,000.00	5,564,531.25	
		US TREASURY N/B-3.25%-17/03/31	8,800,000.00	9,116,937.50	
		US TREASURY N/B-1.0%-17/03/31	5,500,000.00	5,524,921.87	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/04/30	7,000,000.00	7,250,468.75	
		US TREASURY N/B-4.5%-17/05/15	8,800,000.00	9,304,625.00	
		US TREASURY N/B-8.75%-17/05/15	8,000,000.00	8,973,125.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-17/05/31	8,800,000.00	9,078,437.50	
		US TREASURY N/B-0.625%-17/05/31	5,000,000.00	4,991,406.25	
		US TREASURY N/B-2.5%-17/06/30	4,000,000.00	4,114,375.00	
		US TREASURY N/B-0.75%-17/06/30	5,000,000.00	5,000,000.00	
		US TREASURY N/B-0.875%-17/07/15	2,200,000.00	2,204,125.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-17/07/31	1,020,000.00	1,048,050.00	
		US TREASURY N/B-4.75%-17/08/15	8,600,000.00	9,200,656.25	
		US TREASURY N/B-1.875%-17/08/31	2,000,000.00	2,038,593.75	
		US TREASURY N/B-1.0%-17/09/15	4,900,000.00	4,916,078.12	
		US TREASURY N/B-1.875%-17/09/30	7,000,000.00	7,138,359.37	
		US TREASURY N/B-1.875%-17/10/31	2,500,000.00	2,550,000.00	
		US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	6,800,000.00	7,262,187.50	
		US TREASURY N/B-2.25%-17/11/30	3,500,000.00	3,597,617.18	
		US TREASURY N/B-1.0%-17/12/15	5,200,000.00	5,210,968.75	
		US TREASURY N/B-2.75%-17/12/31	6,170,000.00	6,411,979.68	
		US TREASURY N/B-2.625%-18/01/31	4,000,000.00	4,147,812.50	
		US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	7,950,000.00	8,404,640.62	
		US TREASURY N/B-2.75%-18/02/28	7,400,000.00	7,698,312.50	
		US TREASURY N/B-2.875%-18/03/31	2,500,000.00	2,610,742.18	
		US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	7,550,000.00	8,090,296.87	
		US TREASURY N/B-2.375%-18/06/30	7,000,000.00	7,238,437.50	
		US TREASURY N/B-2.25%-18/07/31	8,340,000.00	8,605,185.93	
		US TREASURY N/B-1.375%-18/07/31	2,500,000.00	2,518,750.00	
		US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	8,850,000.00	9,567,679.68	
		US TREASURY N/B-1.75%-18/10/31	3,000,000.00	3,053,906.25	
		US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	9,400,000.00	10,127,765.62	
		US TREASURY N/B-1.5%-18/12/31	8,950,000.00	9,022,718.75	
US TREASURY N/B-8.875%-19/02/15	4,850,000.00	6,045,070.31			

US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	5,400,000.00	5,660,296.87
US TREASURY N/B-1.375%-19/02/28	3,000,000.00	3,008,203.12
US TREASURY N/B-1.5%-19/02/28	4,000,000.00	4,027,187.50
US TREASURY N/B-1.625%-19/03/31	2,000,000.00	2,020,625.00
US TREASURY N/B-1.625%-19/04/30	5,000,000.00	5,046,875.00
US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	4,400,000.00	4,668,468.75
US TREASURY N/B-1.5%-19/05/31	4,100,000.00	4,119,539.06
US TREASURY N/B-1.625%-19/06/30	1,090,000.00	1,099,111.71
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	4,320,000.00	4,669,650.00
US TREASURY N/B-8.125%-19/08/15	5,030,000.00	6,278,461.71
US TREASURY N/B-1.0%-19/08/31	3,300,000.00	3,246,890.62
US TREASURY N/B-1.625%-19/08/31	3,600,000.00	3,626,156.25
US TREASURY N/B-1.75%-19/09/30	8,300,000.00	8,390,781.25
US TREASURY N/B-1.5%-19/10/31	4,100,000.00	4,101,921.87
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	13,000,000.00	13,964,843.75
US TREASURY N/B-1.625%-19/12/31	1,800,000.00	1,807,031.25
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	13,300,000.00	14,448,164.06
US TREASURY N/B-1.375%-20/03/31	1,100,000.00	1,090,117.18
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	9,500,000.00	10,280,039.06
US TREASURY N/B-1.375%-20/05/31	440,000.00	435,290.62
US TREASURY N/B-2.0%-20/07/31	9,300,000.00	9,448,218.75
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	7,950,000.00	10,550,519.53
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	5,000,000.00	5,221,875.00
US TREASURY N/B-1.375%-20/08/31	300,000.00	296,437.50
US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	3,500,000.00	3,652,304.68
US TREASURY N/B-2.375%-20/12/31	3,000,000.00	3,096,562.50
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	14,250,000.00	15,585,937.50
US TREASURY N/B-2.25%-21/04/30	4,800,000.00	4,916,625.00
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	5,320,000.00	5,688,243.75
US TREASURY N/B-2.125%-21/06/30	6,400,000.00	6,501,000.00
US TREASURY N/B-2.25%-21/07/31	3,000,000.00	3,067,500.00
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	3,900,000.00	3,959,109.37
US TREASURY N/B-2.125%-21/09/30	500,000.00	507,148.43
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	12,000,000.00	16,199,062.50
US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	4,000,000.00	4,026,250.00
US TREASURY N/B-2.125%-21/12/31	4,800,000.00	4,858,875.00
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,500,000.00	2,512,890.62
US TREASURY N/B-1.75%-22/02/28	2,900,000.00	2,866,468.75
US TREASURY N/B-1.875%-22/05/31	2,000,000.00	1,987,968.75
US TREASURY N/B-2.125%-22/06/30	2,500,000.00	2,523,632.81
US TREASURY N/B-2.0%-22/07/31	5,300,000.00	5,304,554.68
US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	1,000,000.00	974,609.37

US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	9,300,000.00	9,282,562.50
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	8,500,000.00	8,300,781.25
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,500,000.00	5,664,140.62
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	2,000,000.00	2,095,937.50
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	2,900,000.00	3,035,484.37
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	4,000,000.00	4,103,125.00
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,686,412.50
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	3,250,000.00	3,259,902.34
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	3,850,000.00	3,774,804.68
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	4,752,000.00
US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,700,000.00	3,802,781.25
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	2,920,000.00	4,064,959.37
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,000,000.00	1,309,765.62
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	2,600,000.00	3,778,328.12
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	3,500,000.00	4,753,984.37
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	1,900,000.00	2,598,695.31
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	1,370,000.00	1,726,949.21
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	2,200,000.00	2,821,843.75
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	2,800,000.00	3,456,031.25
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,820,000.00	2,329,742.18
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	2,750,000.00	3,456,621.09
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	3,850,000.00	5,013,722.65
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	3,470,000.00	4,361,356.25
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	3,380,000.00	3,942,981.25
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	3,000,000.00	3,705,937.50
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,600,000.00	2,125,375.00
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	4,000,000.00	5,050,000.00
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	4,400,000.00	5,052,781.25
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	500,000.00	476,015.62
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	2,049,218.75
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	5,800,000.00	5,650,921.87
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	5,350,000.00	6,026,691.40
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	4,500,000.00	5,184,492.18
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	3,000,000.00	3,377,109.37
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,500,000.00	2,684,765.62
US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	5,900,000.00	6,034,593.75
US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	3,300,000.00	3,290,203.12
US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	2,961,492.18
US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	3,200,000.00	3,188,749.99
US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	5,300,000.00	5,155,906.25
米ドル小計	592,850,000.00	634,519,594.99 (77,240,070,298)

加ドル	国債証券	CANADA GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	280,000.00	311,281.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-16/11/01	480,000.00	481,996.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-17/02/01	1,570,000.00	1,587,332.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-17/03/01	1,380,000.00	1,396,173.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-17/05/01	800,000.00	795,728.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-17/06/01	2,130,000.00	2,241,548.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-17/08/01	1,530,000.00	1,546,294.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-17/09/01	1,000,000.00	1,015,680.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-17/11/01	560,000.00	555,828.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/02/01	350,000.00	354,704.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/03/01	1,420,000.00	1,439,780.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	1,520,000.00	1,658,396.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/09/01	650,000.00	660,484.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/03/01	1,050,000.00	1,085,059.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	2,000,000.00	2,210,480.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/09/01	650,000.00	672,789.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-20/03/01	1,170,000.00	1,201,590.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	1,630,000.00	1,818,884.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-20/09/01	600,000.00	593,700.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/03/01	200,000.00	196,472.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	1,150,000.00	1,283,388.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	1,400,000.00	1,529,318.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,480,000.00	1,485,550.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,420,000.00	1,526,855.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	1,220,000.00	1,283,440.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	400,000.00	388,344.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	610,000.00	996,227.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	1,120,000.00	1,607,278.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	1,310,000.00	1,973,436.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	1,350,000.00	1,947,442.50	
CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	1,510,000.00	1,968,496.40			
CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,620,000.00	2,005,560.00			
CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	610,000.00	656,774.80			
加ドル小計		36,170,000.00	40,476,315.00	(3,743,654,374)	
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%- 16/12/15	14,300,000.00	14,864,707.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-17/06/15	11,500,000.00	11,687,272.32	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 17/12/14	17,000,000.00	18,260,533.85	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-4.75%- 18/06/14	18,000,000.00	18,101,330.10	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-18/12/13	16,400,000.00	18,156,221.88	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11	2,000,000.00	1,991,768.70	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	23,800,000.00	26,458,607.56	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	12,100,000.00	12,680,740.71	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	5,000,000.00	5,199,507.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	8,200,000.00	9,277,444.33	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	25,500,000.00	32,568,206.02	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	1,000,000.00	968,919.45	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	6,000,000.00	6,576,127.20	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	17,400,000.00	20,632,609.41	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	11,200,000.00	12,519,011.68	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	2,800,000.00	3,131,614.08	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	9,400,000.00	12,882,966.02	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	13,100,000.00	15,712,821.85	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	11,000,000.00	12,258,560.05	
		メキシコペソ小計	225,700,000.00	253,928,969.71 (1,861,299,347)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.0%-17/03/28	1,250,000.00	1,324,005.62	
		BELGIUM KINGDOM-3.5%-17/06/28	410,000.00	435,283.96	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-17/09/28	1,590,000.00	1,763,520.67	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-18/03/28	1,830,000.00	2,016,265.45	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-18/06/22	320,000.00	332,410.65	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	1,700,000.00	1,939,460.98	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-19/09/28	630,000.00	705,410.30	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	2,260,000.00	2,667,425.34	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	1,760,000.00	2,177,148.16	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	1,580,000.00	1,950,635.13	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,500,000.00	1,894,537.50	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	1,040,000.00	1,173,878.05	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	1,100,000.00	1,273,394.10	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	880,000.00	871,591.60	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	1,220,000.00	1,647,831.67	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,870,000.00	2,794,358.20	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	500,000.00	464,315.00	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	860,000.00	1,169,891.19	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	650,000.00	792,860.25	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,900,000.00	2,957,065.38	
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	460,000.00	466,687.10	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,650,000.00	2,469,249.75	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	740,000.00	1,044,739.40	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.25%-16/10/31	2,340,000.00	2,437,812.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%-17/01/31	2,250,000.00	2,354,483.92	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.1%-17/04/30	1,900,000.00	1,957,997.88	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-17/07/30	2,310,000.00	2,526,784.72	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%-17/10/31	1,400,000.00	1,411,312.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.5%-18/01/31	1,900,000.00	2,083,660.27	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%-18/04/30	400,000.00	400,515.87	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%-18/07/30	3,180,000.00	3,513,942.29	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.75%-18/10/31	1,600,000.00	1,766,401.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%-19/04/30	1,760,000.00	1,902,812.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%-19/07/30	2,900,000.00	3,344,410.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%-19/10/31	2,630,000.00	3,023,521.11	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-20/01/31	1,020,000.00	1,054,850.54	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%-20/04/30	2,900,000.00	3,326,445.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.15%-20/07/30	600,000.00	612,486.66	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%-20/10/31	1,890,000.00	2,267,938.57	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-21/04/30	2,440,000.00	3,040,976.14	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%-22/01/31	2,060,000.00	2,653,456.32	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%-23/01/31	1,840,000.00	2,353,139.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%-23/10/31	1,310,000.00	1,595,643.53	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%-24/01/31	1,940,000.00	2,423,956.08	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%-24/04/30	2,400,000.00	2,810,015.28	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%-24/10/31	2,000,000.00	2,173,206.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%-25/04/30	1,860,000.00	1,838,857.92	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%-25/07/30	1,650,000.00	2,069,433.13	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%-25/10/31	1,400,000.00	1,443,919.96	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,700,000.00	2,348,574.82
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,320,000.00	1,753,151.66
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	2,220,000.00	3,174,348.47
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,050,000.00	997,165.78
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,710,000.00	2,476,878.05
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,690,000.00	2,081,629.27
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,430,000.00	1,949,304.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,400,000.00	1,858,628.38
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	1,040,000.00	1,482,665.18
BUNDESobligation-1.0%-18/10/12	2,100,000.00	2,178,357.93
BUNDESobligation-1.0%-19/02/22	1,320,000.00	1,374,049.64
BUNDESobligation-0.25%-20/10/16	1,000,000.00	1,014,980.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 17/01/04	5,450,000.00	5,708,248.25
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 17/07/04	5,650,000.00	6,077,612.34
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 18/01/04	4,240,000.00	4,635,817.99
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 18/07/04	3,200,000.00	3,586,816.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 19/01/04	2,770,000.00	3,121,097.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%- 19/07/04	4,100,000.00	4,657,340.47
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 20/01/04	3,700,000.00	4,225,693.04
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%- 20/07/04	3,800,000.00	4,349,759.30
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 20/09/04	2,150,000.00	2,393,522.33
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 21/01/04	1,800,000.00	2,036,687.94
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	3,840,000.00	4,544,563.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 21/09/04	1,700,000.00	1,919,923.22
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	2,000,000.00	2,238,200.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 22/07/04	2,540,000.00	2,814,320.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	1,950,000.00	2,128,835.67
	2,050,000.00	2,240,092.40

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15			
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	2,000,000.00	2,185,524.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	1,450,000.00	1,640,312.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	1,910,000.00	2,820,373.23	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	1,100,000.00	1,223,612.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	1,000,000.00	1,091,557.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	1,100,000.00	1,151,387.27	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	1,000,000.00	996,111.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	140,000.00	145,224.26	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,350,000.00	2,225,699.64	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,600,000.00	2,502,858.56	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	1,190,000.00	1,753,850.91	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	1,070,000.00	1,829,491.77	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,590,000.00	2,589,956.08	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	2,130,000.00	3,401,451.31	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	2,390,000.00	3,590,296.24	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,540,000.00	2,452,450.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,650,000.00	2,830,688.52	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	1,500,000.00	2,132,071.35	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,450,000.00	1,834,514.62	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	1,300,000.00	1,645,477.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.75%- 16/11/15	990,000.00	1,017,766.43	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 17/02/01	3,960,000.00	4,154,604.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 17/05/01	1,700,000.00	1,818,108.86	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 17/06/01	1,700,000.00	1,824,270.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 17/08/01	3,750,000.00	4,086,113.25	

BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 17/11/01	1,700,000.00	1,814,736.74
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.75%- 18/01/15	850,000.00	861,589.32
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/02/01	4,090,000.00	4,487,404.85
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%- 18/05/15	950,000.00	951,838.25
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/06/01	1,000,000.00	1,084,777.10
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/08/01	2,880,000.00	3,217,766.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/12/01	2,150,000.00	2,364,348.33
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/02/01	2,660,000.00	2,999,492.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 19/03/01	2,720,000.00	3,097,217.48
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 19/05/01	1,400,000.00	1,505,150.22
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 19/08/01	730,000.00	759,863.93
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/09/01	3,490,000.00	3,997,624.68
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.05%- 19/12/01	1,100,000.00	1,125,487.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 20/02/01	2,800,000.00	3,267,880.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 20/03/01	3,000,000.00	3,477,746.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	2,950,000.00	3,421,142.73
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	2,100,000.00	2,424,910.32
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/05/01	1,200,000.00	1,387,818.96
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	3,760,000.00	4,357,602.74
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 21/09/01	3,880,000.00	4,719,536.55
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 21/12/15	130,000.00	138,904.77
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	2,400,000.00	2,981,724.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 22/04/15	220,000.00	223,869.91
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,900,000.00	2,443,460.04
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 22/09/15	500,000.00	509,450.25
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	2,000,000.00	2,575,592.60

BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	500,000.00	614,341.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,300,000.00	1,627,522.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	3,740,000.00	5,894,285.25
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,650,000.00	2,042,059.96
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,500,000.00	1,771,369.65
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,300,000.00	1,400,620.52
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	3,400,000.00	4,396,970.78
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	400,000.00	504,500.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	2,630,000.00	4,052,885.49
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	3,590,000.00	5,319,665.59
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	200,000.00	261,106.46
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	4,530,000.00	6,251,266.81
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	500,000.00	584,175.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	3,790,000.00	5,660,681.08
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	250,000.00	233,423.92
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,900,000.00	2,822,666.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	2,080,000.00	2,888,226.22
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	3,050,000.00	3,779,753.37
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,770,000.00	2,513,046.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	2,510,000.00	3,559,324.32
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,720,000.00	2,416,254.28
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,240,000.00	1,371,858.74
FINNISH GOVERNMENT-1.875%-17/04/15	50,000.00	51,568.02
FINNISH GOVERNMENT-3.875%-17/09/15	880,000.00	948,037.55
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-18/09/15	210,000.00	217,975.80
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	760,000.00	884,902.35
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	920,000.00	1,058,448.31
FINNISH GOVERNMENT-0.375%-20/09/15	130,000.00	132,147.60
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	900,000.00	1,065,179.97

FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	300,000.00	326,011.83
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	620,000.00	666,870.07
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	510,000.00	566,884.02
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	590,000.00	765,807.43
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	160,000.00	160,150.40
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	500,000.00	598,211.25
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	310,000.00	286,068.00
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	410,000.00	511,179.05
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-17/04/25	5,770,000.00	6,108,147.96
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-17/10/25	4,120,000.00	4,484,276.80
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-18/04/25	3,850,000.00	4,254,057.50
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-18/05/25	3,000,000.00	3,091,770.00
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-18/10/25	2,300,000.00	2,602,489.79
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-18/11/25	850,000.00	879,962.50
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25	4,900,000.00	5,642,279.93
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-19/05/25	1,370,000.00	1,423,212.71
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-19/10/25	1,050,000.00	1,406,597.74
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	4,400,000.00	5,062,581.48
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-19/11/25	1,000,000.00	1,021,658.80
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	5,270,000.00	6,087,227.33
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-20/05/25	1,600,000.00	1,596,897.28
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	4,190,000.00	4,688,000.77
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-20/11/25	2,950,000.00	2,968,756.39
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	4,240,000.00	5,065,740.00
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	4,340,000.00	5,111,895.90
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	3,770,000.00	4,415,214.76
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	2,280,000.00	2,568,824.24
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	1,600,000.00	2,546,123.68
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	3,010,000.00	3,284,645.94
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	4,050,000.00	5,214,216.24
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	2,800,000.00	3,166,660.00
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	2,470,000.00	2,681,374.44
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	2,610,000.00	2,522,976.59
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	2,300,000.00	3,430,158.59
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	1,000,000.00	1,004,677.50
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	3,780,000.00	4,729,283.87
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,380,000.00	3,970,450.51
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	3,220,000.00	4,901,363.89
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	1,280,000.00	1,465,856.00
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	3,080,000.00	5,039,273.31
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	2,470,000.00	3,755,241.03
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	2,410,000.00	3,426,442.80

FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	2,740,000.00	4,246,407.61
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	1,500,000.00	1,950,060.00
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	1,520,000.00	2,318,076.00
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	1,060,000.00	1,637,885.50
FRENCH TREASURY NOTE-1.75%-17/02/25	400,000.00	410,417.92
FRENCH TREASURY NOTE-1.0%-17/07/25	300,000.00	306,470.61
IRISH TREASURY-5.5%-17/10/18	690,000.00	766,217.40
IRISH TREASURY-4.5%-18/10/18	820,000.00	930,451.37
IRISH TREASURY-4.4%-19/06/18	840,000.00	971,909.23
IRISH TREASURY-5.9%-19/10/18	730,000.00	896,639.50
IRISH TREASURY-4.5%-20/04/18	1,070,000.00	1,273,979.45
IRISH TREASURY-5.0%-20/10/18	950,000.00	1,169,043.87
IRISH TREASURY-0.8%-22/03/15	160,000.00	162,486.80
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	580,000.00	708,372.85
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	800,000.00	952,605.12
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	1,180,000.00	1,618,093.99
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	780,000.00	849,751.88
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	530,000.00	505,212.74
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-17/01/15	1,800,000.00	1,859,968.62
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.5%-17/07/15	2,430,000.00	2,626,473.27
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-18/01/15	700,000.00	723,184.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-18/04/15	190,000.00	191,032.32
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	2,580,000.00	2,872,905.59
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-19/01/15	800,000.00	836,384.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	2,080,000.00	2,397,652.81
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-20/01/15	630,000.00	638,540.72
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	1,890,000.00	2,201,541.36
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	1,870,000.00	2,202,266.64
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	1,500,000.00	1,697,580.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	1,880,000.00	2,335,143.48
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	970,000.00	1,465,059.67
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	1,000,000.00	1,098,910.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	830,000.00	928,184.60
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	140,000.00	133,233.50
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	1,820,000.00	2,763,433.40
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	660,000.00	784,596.12
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,490,000.00	2,207,105.26
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,680,000.00	2,519,163.19
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	960,000.00	1,238,924.81
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.2%-17/02/20	1,020,000.00	1,065,449.97
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-17/09/15	850,000.00	921,842.00
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	1,260,000.00	1,395,508.84
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.15%-18/10/19	660,000.00	686,545.53

		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	1,620,000.00	1,865,678.34
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.95%-19/06/18	370,000.00	397,892.45
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-19/10/18	510,000.00	516,898.10
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	1,460,000.00	1,726,853.98
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	1,490,000.00	1,778,677.51
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	900,000.00	1,093,996.08
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	1,100,000.00	1,331,588.61
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	890,000.00	974,940.88
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	520,000.00	562,631.73
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	300,000.00	309,428.07
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	810,000.00	1,127,541.62
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	850,000.00	1,340,430.19
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	500,000.00	576,070.45
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,220,000.00	1,795,997.74
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	650,000.00	867,518.98
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	390,000.00	637,279.50
	ユーロ小計		453,050,000.00	547,420,833.77 (72,516,837,849)
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.75%-17/01/22	1,770,000.00	1,795,629.60
		UK TREASURY-8.75%-17/08/25	1,510,000.00	1,732,312.31
		UK TREASURY-1.0%-17/09/07	1,250,000.00	1,257,250.00
		UK TREASURY-5.0%-18/03/07	2,510,000.00	2,761,217.61
		UK TREASURY-1.25%-18/07/22	2,930,000.00	2,959,612.62
		UK TREASURY-4.5%-19/03/07	2,680,000.00	2,993,372.40
		UK TREASURY-1.75%-19/07/22	1,700,000.00	1,738,204.61
		UK TREASURY-3.75%-19/09/07	2,040,000.00	2,243,189.10
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	2,960,000.00	3,405,198.80
		UK TREASURY-2.0%-20/07/22	1,300,000.00	1,339,620.88
		UK TREASURY-3.75%-20/09/07	1,920,000.00	2,141,218.94
		UK TREASURY-1.5%-21/01/22	150,000.00	150,425.05
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	1,460,000.00	1,974,828.55
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	2,050,000.00	2,312,312.87
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	1,580,000.00	1,817,892.70
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	2,000,000.00	2,014,361.40
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	2,670,000.00	2,763,772.00
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	1,500,000.00	1,605,980.70
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	2,280,000.00	2,893,314.98
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	1,590,000.00	1,954,098.55
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	1,000,000.00	1,444,610.10
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	2,090,000.00	2,739,404.59
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	2,110,000.00	2,640,700.23
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	2,100,000.00	2,724,173.76

		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,900,000.00	2,402,266.90	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,800,000.00	2,464,806.24	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,460,000.00	1,874,562.32	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	2,530,000.00	3,272,248.36	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	3,150,000.00	4,273,251.57	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,320,000.00	1,470,856.20	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	540,000.00	629,891.79	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,650,000.00	2,210,770.98	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	1,620,000.00	2,220,363.90	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,420,000.00	1,807,314.51	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,730,000.00	2,459,223.19	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,700,000.00	2,347,116.39	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	1,520,000.00	1,931,394.68	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	260,000.00	260,715.00	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	500,000.00	489,111.65	
英債券小計			68,250,000.00	81,516,596.03 (15,104,210,078)	
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-4.25%-17/06/05	620,000.00	671,429.00	
		SWITZERLAND-3.0%-18/01/08	400,000.00	435,340.00	
		SWITZERLAND-3.0%-19/05/12	400,000.00	457,120.00	
		SWITZERLAND-2.25%-20/07/06	400,000.00	459,860.00	
		SWITZERLAND-2.0%-21/04/28	220,000.00	254,386.00	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	1,330,000.00	1,780,205.00	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	230,000.00	347,195.81	
スイスフラン小計			3,600,000.00	4,405,535.81 (538,752,974)	
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-3.75%-17/08/12	6,650,000.00	7,146,223.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	8,900,000.00	10,252,355.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	8,700,000.00	10,864,908.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	8,200,000.00	9,882,845.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	6,790,000.00	7,291,950.75	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	5,700,000.00	6,617,700.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	4,630,000.00	6,026,963.60	
スウェーデンクローナ小計			49,570,000.00	58,082,945.35 (819,550,358)	
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-4.25%-17/05/19	6,500,000.00	6,858,475.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	6,650,000.00	7,509,858.30	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	7,100,000.00	8,113,162.90	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	5,250,000.00	5,487,273.75	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	4,570,000.00	5,102,432.42	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	2,490,000.00	2,525,355.51	
			32,560,000.00	35,596,557.88	

ノルウェークローネ小計				(506,539,018)
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-2.5%-16/11/15	1,200,000.00	1,237,344.00
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-17/11/15	8,300,000.00	9,047,000.00
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	12,050,000.00	14,014,150.00
		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	5,600,000.00	6,503,845.60
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	8,000,000.00	8,572,800.00
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	3,150,000.00	4,908,008.70
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	4,950,000.00	5,353,187.40
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	11,700,000.00	19,039,410.00
デンマーククローネ小計			54,950,000.00	68,675,745.70 (1,219,681,243)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-17/04/25	1,880,000.00	1,965,352.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-17/07/25	800,000.00	778,760.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	2,370,000.00	2,535,781.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-18/04/25	1,800,000.00	1,887,390.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-18/07/25	2,700,000.00	2,753,595.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-19/07/25	2,490,000.00	2,606,034.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	2,400,000.00	2,722,800.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.5%-20/04/25	1,030,000.00	1,003,683.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	1,980,000.00	2,265,417.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	1,810,000.00	2,147,022.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	2,400,000.00	2,885,760.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	3,010,000.00	3,292,940.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,480,000.00	2,574,240.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	930,000.00	1,208,943.27
ポーランドズロチ小計			28,080,000.00	30,627,718.27 (954,053,424)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.0%-17/02/15	2,130,000.00	2,240,715.27
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-17/07/21	1,850,000.00	1,923,049.10
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-18/01/21	2,070,000.00	2,230,414.65
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-18/10/21	1,570,000.00	1,628,399.29
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	2,220,000.00	2,456,319.00
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-19/10/21	1,710,000.00	1,755,999.00
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	2,350,000.00	2,589,063.15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-20/11/21	400,000.00	391,020.80
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	2,400,000.00	2,830,164.00
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	1,900,000.00	2,283,501.70
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	2,070,000.00	2,479,272.12
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	2,350,000.00	2,357,045.30
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	2,240,000.00	2,327,017.28
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	1,970,000.00	2,217,632.94
AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,740,000.00	2,048,195.76		

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,110,000.00	1,129,425.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,090,000.00	1,267,254.71	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	470,000.00	425,750.91	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	790,000.00	827,762.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	500,000.00	478,998.00	
豪ドル小計			32,930,000.00	35,886,999.98 (3,122,527,868)	
シンガ ポールド ル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-17/04/01	780,000.00	792,588.73	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.375%-17/10/01	150,000.00	150,519.45	
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-18/04/01	400,000.00	392,313.28	
		SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	410,000.00	439,142.67	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01	640,000.00	659,881.47	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-19/10/01	200,000.00	199,524.46	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-20/07/01	220,000.00	220,330.44	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	810,000.00	856,862.95	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	320,000.00	321,919.87	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	580,000.00	611,108.70	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	200,000.00	205,133.64	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	561,115.78	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	150,000.00	147,420.45	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	620,000.00	669,280.82	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	230,000.00	231,716.14	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	330,000.00	330,090.22	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	300,000.00	319,819.38	
SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	480,000.00	463,286.68			
シンガポールドル小計			7,360,000.00	7,572,055.13 (655,664,253)	
マレーシ アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	460,000.00	460,345.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	80,000.00	78,620.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	460,000.00	452,966.60	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	700,000.00	722,596.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.814%-17/02/15	1,900,000.00	1,921,033.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.012%-17/09/15	2,900,000.00	2,955,332.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.314%-17/10/31	350,000.00	352,373.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	2,420,000.00	2,466,587.42	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.26%-18/03/01	400,000.00	399,440.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.58%-18/09/28	700,000.00	702,604.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	1,520,000.00	1,625,366.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	3,500,000.00	3,583,020.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.492%-20/03/31	350,000.00	345,775.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.889%-20/07/31	500,000.00	500,535.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	2,500,000.00	2,518,325.00	

		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	650,000.00	624,390.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,750,000.00	1,676,762.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	940,142.88	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,270,000.00	1,277,785.10	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	430,092.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	850,000.00	781,388.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	430,000.00	400,949.20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000.00	808,035.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	1,110,000.00	1,123,353.30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	750,000.00	713,917.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	600,000.00	548,010.00	
		マレーシアリングット小計	28,290,000.00	28,409,744.40 (805,132,156)	
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 17/09/15	5,300,000.00	5,400,377.49	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 18/12/21	5,500,000.00	5,575,427.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	7,000,000.00	6,869,740.14	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	7,000,000.00	6,638,120.65	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	5,600,000.00	5,464,711.28	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	15,600,000.00	17,883,379.80	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	5,200,000.00	4,852,175.38	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	11,150,000.00	9,409,084.15	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	4,520,000.00	4,251,692.34	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	1,000,000.00	981,843.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	9,000,000.00	6,675,715.80	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	7,000,000.00	6,577,300.44	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	8,000,000.00	5,944,938.40	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	5,150,000.00	4,906,308.18	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	9,600,000.00	9,169,454.40	
		南アフリカランド小計	106,620,000.00	100,600,268.45 (882,264,354)	
		合計		179,970,237,594 (179,970,237,594)	

(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 123銘柄	100.0%	42.9%
加ドル	国債証券 33銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 19銘柄	100.0%	1.0%
ユーロ	国債証券 258銘柄	100.0%	40.3%
英ポンド	国債証券 39銘柄	100.0%	8.4%
スイスフラン	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.7%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.5%
豪ドル	国債証券 20銘柄	100.0%	1.7%
シンガポールドル	国債証券 18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 26銘柄	100.0%	0.4%
南アフリカランド	国債証券 15銘柄	100.0%	0.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2015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	3,055,611,317円
負債総額	4,108,105円
純資産総額(-)	3,051,503,212円
発行済口数	1,750,230,053口
1口当たり純資産額(/)	1.7435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	28,070,350,093円
負債総額	89,686,090円
純資産総額(-)	27,980,664,003円
発行済口数	20,910,934,276口
1口当たり純資産額(/)	1.3381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	79,707,033,560円
負債総額	75,695,976円
純資産総額(-)	79,631,337,584円
発行済口数	38,809,327,001口
1口当たり純資産額(/)	2.0519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	34,926,980,628円
負債総額	2,843,282円
純資産総額（ - ）	34,924,137,346円
発行済口数	26,088,531,942口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3387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	182,002,994,903円
負債総額	86,076,997円
純資産総額（ - ）	181,916,917,906円
発行済口数	78,031,892,268口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3313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。

第二部【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27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27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27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27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	603	117,025

株式投資信託	548	91,804
単位型	105	2,988
追加型	443	88,815
公社債投資信託	55	25,221
単位型	39	383
追加型	16	24,837
投資法人合計	1	11

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56期事業年度（平成26年4月1日から平成27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、第57期中間会計期間（平成27年4月1日から平成27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55期 (平成26年3月31日)		第56期 (平成27年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	17,805	3	14,206
有価証券		234		277
前払費用	3	419	3	509
未収入金		37		3
未収委託者報酬		7,162		8,441
未収収益	3	608	3	1,566
関係会社短期貸付金		240		436
立替金		303		666
繰延税金資産		984		1,446
その他	2	30	2	195
流動資産合計		27,826		27,750
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	47	1	56
器具備品	1	134	1	166
有形固定資産合計		181		222
無形固定資産				

ソフトウェア	91	113
無形固定資産合計	91	113
投資その他の資産		
投資有価証券	7,290	14,184
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	692	740
長期前払費用	-	0
繰延税金資産	525	248
投資その他の資産合計	30,271	36,936
固定資産合計	30,544	37,273
資産合計	58,371	65,023

(単位：百万円)

	第55期 (平成26年3月31日)	第56期 (平成27年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	329	387
未払金	3,404	5,545
未払収益分配金	6	6
未払償還金	112	112
未払手数料	3 2,743	3 3,145
その他未払金	542	2,282
未払費用	3 3,239	3 4,636
未払法人税等	2,286	814
未払消費税等	4 356	4 1,070
賞与引当金	1,935	1,990
役員賞与引当金	150	120
その他	-	3 82
流動負債合計	11,702	14,646
固定負債		
退職給付引当金	1,081	1,111
その他	55	-
固定負債合計	1,137	1,111
負債合計	12,840	15,758
純資産の部		
株主資本		
資本金	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金	5,220	5,220
資本剰余金合計	5,220	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	22,694	25,836
利益剰余金合計	22,694	25,836

自己株式	68	68
株主資本合計	45,209	48,351
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	321	1,002
繰延ヘッジ損益	-	88
評価・換算差額等合計	321	913
純資産合計	45,531	49,265
負債純資産合計	58,371	65,023

(2)【損益計算書】

	(単位:百万円)	
	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	63,120	63,990
その他営業収益	2,557	3,729
営業収益合計	65,678	67,719
営業費用		
支払手数料	31,207	30,408
広告宣伝費	1,081	1,045
公告費	2	5
調査費	13,405	15,571
調査費	712	747
委託調査費	12,669	14,782
図書費	23	41
委託計算費	465	502
営業雑経費	558	660
通信費	186	199
印刷費	252	263
協会費	43	64
諸会費	11	27
その他	65	106
営業費用計	46,721	48,193
一般管理費		
給料	7,171	7,585
役員報酬	316	289
役員賞与引当金繰入額	150	120
給料・手当	4,719	5,127
賞与	50	59
賞与引当金繰入額	1,935	1,990
交際費	108	163
寄付金	54	36
旅費交通費	448	503
租税公課	209	208
不動産賃借料	755	785
退職給付費用	313	349
退職金	32	16
固定資産減価償却費	109	148
福利費	847	908

諸経費	2,517	2,673
一般管理費計	12,568	13,380
営業利益	6,388	6,146

(単位：百万円)

	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		17		10
受取配当金	1	1,774	1	1,152
有価証券償還益		-		13
時効成立分配金・償還金		4		1
為替差益		26		-
その他		19		107
営業外収益合計		1,842		1,285
営業外費用				
支払利息		19		28
有価証券償還損		-		81
デリバティブ費用		-		269
時効成立後支払分配金・償還金		22		295
支払源泉所得税		57		71
為替差損		-		26
その他		13		21
営業外費用合計		114		795
経常利益		8,116		6,636
特別利益				
投資有価証券売却益		135		270
特別利益合計		135		270
特別損失				
投資有価証券売却損		12		22
関係会社株式評価損		4,500		-
固定資産処分損		0		0
割増退職金		59		243
役員退職一時金		235		-
外国税関連費用		-	2	1,650
特別損失合計		4,807		1,916
税引前当期純利益		3,445		4,991
法人税、住民税及び事業税		3,020		2,356
法人税等調整額		119		466
法人税等合計		2,900		1,890
当期純利益		544		3,101

(3) 【株主資本等変動計算書】

第55期（自 平成25年4月1日 至 平成26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	23,530	23,530	68	46,045
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	23,530	23,530	68	46,045
当期変動額							
剰余金の配当				1,380	1,380		1,380
当期純利益				544	544		544
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	836	836	-	836
当期末残高	17,363	5,220	5,220	22,694	22,694	68	45,209

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	362	362	46,408
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	362	362	46,408
当期変動額			
剰余金の配当			1,380
当期純利益			544
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	40	40	40
当期変動額合計	40	40	876
当期末残高	321	321	45,531

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

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27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) デリバティブ 時価法
2 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。 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 4年～20年 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(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。
3 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。

<p>4 ヘッジ会計の方法</p> <p>5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>(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> <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。 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。</p>
--	--

（会計方針の変更）

<p style="text-align: center;">第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)</p> <p>「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日。以下「退職給付適用指針」という。）を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めについて当事業年度より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更するとともに、割引率の決定方法を平均残存勤務年数に対応した高格付社債の流通利回りを基礎とする方法から退職給付の支払見込期間及び期間毎の金額を反映した単一の加重平均割引率を使用する方法へ変更いたしました。</p> <p>退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従い、当事業年度の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。</p> <p>この結果、当事業年度の期首の退職給付引当金が63百万円減少、繰延税金資産が22百万円減少、繰越利益剰余金が41百万円増加しております。また、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益への影響は軽微であります。なお、1株当たり純資産額及び1株当たり当期純利益金額に対する影響額は、軽微であります。</p>

（表示方法の変更）

<p style="text-align: center;">第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)</p>
--

（損益計算書関係）

前事業年度において、「一般管理費」の「諸経費」に含めていた「福利費」は、重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「一般管理費」の「諸経費」に表示していた3,364百万円は、「福利費」847百万円、「諸経費」2,517百万円として組み替えております。

（貸借対照表関係）

第55期 (平成26年3月31日)	第56期 (平成27年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,091百万円</p> <p>器具備品 625百万円</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,122百万円</p> <p>器具備品 679百万円</p>
<p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>	<p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>
<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 6,249百万円</p> <p>前払費用 2百万円</p> <p>未収収益 74百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 98百万円</p> <p>未払費用 274百万円</p>	<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 4,256百万円</p> <p>前払費用 2百万円</p> <p>未収収益 110百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 108百万円</p> <p>未払費用 500百万円</p> <p>その他 57百万円</p>
<p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p>	<p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p>
<p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務65百万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159百万円に対して保証を行っております。</p>	<p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務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>

（損益計算書関係）

第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27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>受取配当金 1,290百万円</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>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>
--	--

(株主資本等変動計算書関係)

第55期(自平成25年4月1日至平成26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	16,978,500	-	1,075,800	15,902,700	-
平成21年度ストックオプション(2)	普通株式	1,626,900	-	59,400	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	5,930,100	-	541,200	5,388,900	-
合計		29,800,700	-	1,676,400	28,124,300	-

- (注) 1 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)及び平成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。
- 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、第1回新株予約権2,955,200株及び平成23年度ストックオプション(1)2,887,500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

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25年5月27日 取締役会	普通株式	1,380	7.01	平成25年3月31日	平成25年6月18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
該当事項はありません。

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	-	-	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

(リース取引関係)

第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27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 751百万円	1年内 841百万円
1年超 77百万円	1年超 3,420百万円
合計 828百万円	合計 4,261百万円

(金融商品関係)

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26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、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、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また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。投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されております。

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、預金を預入れる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、また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。また既に取り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、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。また投資有価証券に関しては、毎月末にそれぞれの時価を算出し、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、バリュエーション・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。これらの結果、当社の財政状態、経営成績に与える影響が著しいと判断される場合には、必要に応じて、ヘッジ取引規程に則り、それを回避する目的で、ヘッジ取引を行うことが可能であります。

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・維持することなどにより、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26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()	時価()	差額
(1) 現金・預金	17,805	17,805	-
(2) 未収委託者報酬	7,162	7,162	-
(3) 未収収益	608	608	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	7,457	7,457	-
(5) 未払金	(3,404)	(3,404)	-
(6) 未払費用	(3,239)	(3,239)	-

()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。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(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。

2 非上場株式等(貸借対照表計上額66百万円)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	17,805	-	-	-
未収委託者報酬	7,162	-	-	-
未収収益	608	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	234	315	1,166	973
合計	25,811	315	1,166	973

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、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

(有価証券関係)

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26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	3,819	3,188	631
	小計	3,819	3,188	631
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	3,637	3,768	130
	小計	3,637	3,768	130
合計		7,457	6,957	500

(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 66百万円）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	23	11	-
投資信託	1,734	124	12
合計	1,758	135	12

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

（デリバティブ取引関係）

第55期(平成26年3月31日)

該当事項はありません。

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	為替予約取引 売建 米ドル	投資有価	2,586	-	68

法	豪ドル	証券	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。

(持分法損益等)

第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27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	3,065	(1) 関連会社に対する投資の金額	3,078
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	7,660	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	9,396
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,379	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,720

(退職給付関係)

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26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	1,101
勤務費用	110
利息費用	9
数理計算上の差異の発生額	9
退職給付の支払額	56
退職給付債務の期末残高	1,174

(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	1,174
未積立退職給付債務	1,174
未認識数理計算上の差異	92
貸借対照表に計上された負債の額	1,081
退職給付引当金	1,081
貸借対照表に計上された負債の額	1,081

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	110
利息費用	9
数理計算上の差異の費用処理額	16
確定給付制度に係る退職給付費用	137

(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 0.8%

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、176百万円でありました。

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。

（ストックオプション等関係）

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26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	16,978,500	1,626,900
付与	0	0
失効	1,075,800	59,400
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	5,930,100
付与	0	0
失効	0	541,200
権利確定	0	0
権利未確定残	2,310,000	5,388,900
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(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56期(自 平成26年4月1日 至 平成27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	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tockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 - 百万円
- 3 株式公開価格が737円(割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するよう調整される。)を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

(税効果会計関係)

第55期 (平成26年 3 月31日)	第56期 (平成27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	689	賞与引当金	658
その他	294	その他	813
小計	984	小計	1,472
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	148	投資有価証券評価損	134
関係会社株式評価損	1,665	関係会社株式評価損	1,510
退職給付引当金	385	退職給付引当金	360
固定資産減価償却費	158	固定資産減価償却費	133
その他	34	その他	73
小計	2,391	小計	2,213
繰延税金資産小計	3,375	繰延税金資産小計	3,685
評価性引当金	1,665	評価性引当金	1,510
繰延税金資産合計	1,710	繰延税金資産合計	2,174
繰延税金負債(固定)		繰延税金負債(流動)	
その他有価証券評価差額金	200	その他有価証券評価差額金	25
繰延税金負債合計	200	小計	25
繰延税金資産の純額	1,510	繰延税金負債(固定)	
		その他有価証券評価差額金	454
		小計	454
		繰延税金負債合計	480
		繰延税金資産の純額	1,694
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	38.0%	法定実効税率	35.6%
(調整)		(調整)	
評価性引当金の増減	46.6%	交際費等永久に損金に算入されない項目	1.3%
交際費等永久に損金に算入されない項目	3.7%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.3%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	12.9%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	3.6%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.9%	海外子会社の留保利益の影響額等	1.7%
海外子会社の留保利益の影響額等	6.9%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	37.9%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	84.2%		

3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」(平成26年法律第10号)の施行に伴い、「復興特別法人税に関する政令の一部を改正する政令」(平成26年政令第151号)が平成26年3月31日に公布されたことにより、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、平成26年4月1日に開始する事業年度において解消が見込まれる一時差異について、当社が使用した法定実効税率は38.0%から35.6%に変更されております。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65百万円減少し、その他有価証券評価差額金の金額が1百万円、法人税等調整額の金額が63百万円、それぞれ増加しております。

3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」(平成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。

(関連当事者情報)

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社
重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金 又は 出資金 (千SGD)	事業の 内容	議決権 等の所有(被所有) 割合 (%)	関連 当事 者との 関係	取引の 内容	取引金額 (百万円)	科目	期末 残高 (百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	292,000	アセットマネジメント業	直接 100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	398 (千SGD 5,059) (注2)	関係会社短期貸付金	240 (千SGD 2,940)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	15 (千SGD 192)	未収収益	5 (千SGD 64)
							増資の引受(注3)	3,266 (千SGD 40,000)	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠SGD11百万、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 398百万円(5,059千SGD)の内訳は、貸付240百万円(2,940千SGD)及び返済638百万円(8,000千SGD)であります。
- Nikko Asset Management International Limitedの行った40,000,000株の新株発行増資を、1株につき1シンガポールドルで当社が引受けたものであります。

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25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	15,790百万円
負債合計	1,713百万円
純資産合計	14,076百万円
営業収益	11,350百万円
税引前当期純利益	4,212百万円
当期純利益	3,096百万円

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SGD11百万、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

(セグメント情報等)

セグメント情報

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26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。

関連情報

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26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。

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55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

該当事項はありません。

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。

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55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

該当事項はありません。

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。

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55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

該当事項はありません。

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。

(1株当たり情報)

項目	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
1株当たり純資産額	231円23銭	250円20銭
1株当たり当期純利益金額	2円76銭	15円74銭

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益(百万円)	544	3,101
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)	544	3,101
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,903	196,903
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、 第1回新株予約権2,955,200株、 平成23年度ストックオプション(1) 5,388,900株	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

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55期 (平成26年3月31日)	第56期 (平成27年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	45,531	49,265
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)	45,531	49,265
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	196,903

(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57期中間会計期間 (平成27年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		13,390
金銭の信託		99
有価証券		87
未収委託者報酬		7,326
未収収益		1,121
関係会社短期貸付金		5,925
繰延税金資産		436
その他	2	2,325
流動資産合計		30,712
固定資産		
有形固定資産	1	364
無形固定資産		122
投資その他の資産		
投資有価証券		13,748
関係会社株式		21,702
関係会社長期貸付金		60
長期差入保証金		775
繰延税金資産		546
その他		0
投資その他の資産合計		36,834
固定資産合計		37,321
資産合計		68,033

(単位:百万円)

		第57期中間会計期間 (平成27年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		4,051

未払費用		4,163
未払法人税等		52
未払消費税等	3	457
関係会社短期借入金		5,997
賞与引当金		976
役員賞与引当金		115
その他		708
流動負債合計		16,521
固定負債		
退職給付引当金		1,130
固定負債合計		1,130
負債合計		17,652
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		28,043
利益剰余金合計		28,043
自己株式		502
株主資本合計		50,124
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		310
繰延ヘッジ損益		53
評価・換算差額等合計		257
純資産合計		50,381
負債純資産合計		68,033

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第57期中間会計期間
(自 平成27年4月1日
至 平成27年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		33,707
その他営業収益		1,944
営業収益合計		35,652
営業費用及び一般管理費	1	32,417
営業利益		3,235
営業外収益	2	2,115
営業外費用	3	1,200
経常利益		4,150
特別利益	4	504

特別損失	5	510
税引前中間純利益		4,145
法人税、住民税及び事業税		60
法人税等調整額		1,026
中間純利益		3,058

(3) 中間株主資本等変動計算書

第57期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

(単位：百万円)

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益 剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	25,836	25,836	68	48,351
当中間期変動額							
剰余金の配当				850	850		850
中間純利益				3,058	3,058		3,058
自己株式の取得						434	434
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)							
当中間期変動額合計				2,207	2,207	434	1,772
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	28,043	28,043	502	50,124

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有 価証券評 価差額金	繰延 ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,002	88	913	49,265
当中間期変動額				
剰余金の配当				850
中間純利益				3,058
自己株式の取得				434
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	692	35	656	656
当中間期変動額合計	692	35	656	1,116
当中間期末残高	310	53	257	50,381

注記事項

(重要な会計方針)

項目	第57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法

	<p>その他有価証券 時価のあるもの 中間決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(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。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p>
4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
5 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理してあります。</p>

(会計方針の変更)

第57期中間会計期間
(自 平成27年4月1日
至 平成27年9月30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。)等を当中間会計期間から適用し、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しております。また、当中間会計期間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中間会計期間の中間財務諸表に反映させる方法に変更しております。

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、当中間会計期間の期首時点から将来にわたって適用しております。

なお、これによる損益及び1株当たり情報に与える影響はありません。

(中間貸借対照表関係)

第57期中間会計期間 (平成27年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 1,748百万円
2	信託資産 流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
3	消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
4	保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務6百万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779百万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57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	

1	減価償却実施額	
	有形固定資産	59百万円
	無形固定資産	22百万円
2	営業外収益のうち主要なもの	
	受取利息	25百万円
	受取配当金	1,271百万円
	デリバティブ収益	816百万円
3	営業外費用のうち主要なもの	
	支払利息	63百万円
	デリバティブ費用	907百万円
	支払源泉所得税	119百万円
4	特別利益のうち主要なもの	
	投資有価証券売却益	504百万円
5	特別損失のうち主要なもの	
	特別賞与	348百万円
	割増退職金	91百万円
	役員退職一時金	64百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第57期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27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）	109,600	704,500	-	814,100

（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	15,902,700	-	10,282,800	5,619,900	-
平成21年度ストックオプション(2)	普通株式	1,567,500	-	587,400	980,100	-
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	-	13,470,600	11,338,800	-

（注）1 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)、平成22年度ストックオプション(1)及び平成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 平成21年度ストックオプション(1)5,619,900株、平成21年度ストックオプション(2)980,100株及び平成23年度ストックオプション(1)4,075,500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57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27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	853百万円
1年超	3,047百万円
合計	3,900百万円

(金融商品関係)

第57期中間会計期間(平成27年9月30日)

1 金融商品の時価等に関する事項

平成27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・預金	13,390	13,390	-
(2) 未収委託者報酬	7,326	7,326	-
(3) 未収収益	1,121	1,121	-
(4) 金銭の信託	99	99	-
(5) 関係会社短期貸付金	5,925	5,925	-
(6) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	13,819	13,819	-
(7) 未払金	(4,051)	(4,051)	-
(8) 未払費用	(4,163)	(4,163)	-
(9) 関係会社短期借入金	(5,997)	(5,997)	-
(10) 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	(120)	(120)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	169	169	-
デリバティブ取引計	48	48	-

(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(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、(8) 未払費用並びに(9) 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。

(10) 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、流動資産のその他及び流動負債のその他に含まれております。

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

3 子会社株式（中間貸借対照表計上額18,809百万円）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57期中間会計期間(平成27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	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	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	7,923	7,062	860
	小計	7,923	7,062	860
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	5,896	6,298	402
	小計	5,896	6,298	402
合計		13,819	13,361	458

(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57期中間会計期間(平成27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	4,686	-	49	49
合計		4,686	-	49	49

(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	為替予約取引 買建 米ドル	5,997	-	170	170
合計		5,997	-	170	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。

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		4,550	-	148
	豪ドル		219	-	21
	シンガポールドル		738	-	57
	ユーロ		194	-	0
	香港ドル		178	-	5
	人民元		2,155	-	63
合計			8,035	-	169

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27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	3,071百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	9,269百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,461百万円

(ストックオプション等関係)

第57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27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、記載していません。

[関連情報]

第57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27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、記載していません。

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、記載していません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27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57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27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57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27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57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
1株当たり純資産額	256円79銭
1株当たり中間純利益金額	15円54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57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
中間純利益（百万円）	3,058
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）	3,058
普通株式の期中平均株式数（千株）	196,730
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) 5,619,900株、平成21年度ストックオプション(2) 980,100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57期中間会計期間 (平成27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）	50,381
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）	50,381
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）	196,198

（ 重要な後発事象 ）

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)、(5)に

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27年9月末現在)	事業の内容
野村信託銀行株式会社	30,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (平成27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。
日本生命保険相互会社	200,000百万円 (基金の総額)	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
東京海上日動火災保険株式会社	101,994百万円	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

- (1) 受託会社
ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。
- (2) 販売会社
日本におけるファンドの募集、解約、収益分配金および償還金の取扱いなどを行いません。

3【資本関係】

- (1) 受託会社
該当事項はありません。
- (2) 販売会社
三井住友信託銀行株式会社は、日興アセットマネジメント株式会社の発行済株式総数の91.29%を保有しております。(平成27年9月末現在)

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
平成27年 2月 6日	有価証券届出書
平成27年 2月 6日	有価証券報告書
平成27年 7月22日	有価証券届出書の訂正届出書
平成27年 7月22日	半期報告書
平成27年10月26日	有価証券届出書の訂正届出書

独立監査人の監査報告書

平成27年6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

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 秋 宗 勝 彦
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26年4月1日から平成27年3月31日までの第56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27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27年12月17日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PWCあらた監査法人

指定社員 公認会計士 鶴田 光夫
業務執行社員

指定社員 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26年11月7日から平成27年11月6日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCインデックスバランス（株式40）の平成27年11月6日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR 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27年12月4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期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27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27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27年4月1日から平成27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。