

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年8月5日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 柴田 拓美
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	森川 晃
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	DCインデックスバランス（株式80）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

半期報告書を提出しましたので平成28年 2月 5日付をもって提出しました有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出します。

2【訂正の内容】

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<更新後>

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。

*現在のベンチマーク指数の公表停止に伴ない、2017年1月1日付で「NOMURA-BPI総合」に変更する予定です。

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

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

<2017年1月1日以降>

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

※シティ世界国債インデックス(除く日本):同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はシティグループグローバルマーケティングに帰属します。また、シティグループグローバルマーケティングは同指数の内容を変更す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80%、債券などに20%投資します。

資産の標準実質組入比率は、株式80%、債券など20%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	60%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	20%
日本債券インデックスマザーファンド	5%
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には、制限を設けません。
- ・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の50%以下とします。

分配方針

- ・毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。
ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。
- ※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

(3) 【ファンドの仕組み】

<更新後>

委託会社の概況（平成28年5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】

(2)【投資対象】

<更新後>

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>

(略)

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

(略)

<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ないます。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主としてわが国の公社債に投資し、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。 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。

* 現在のベンチマーク指数の公表停止に伴ない、平成29年1月1日付で「NOMURA BPI総合」に変更する予定です。

<平成29年1月1日以降>

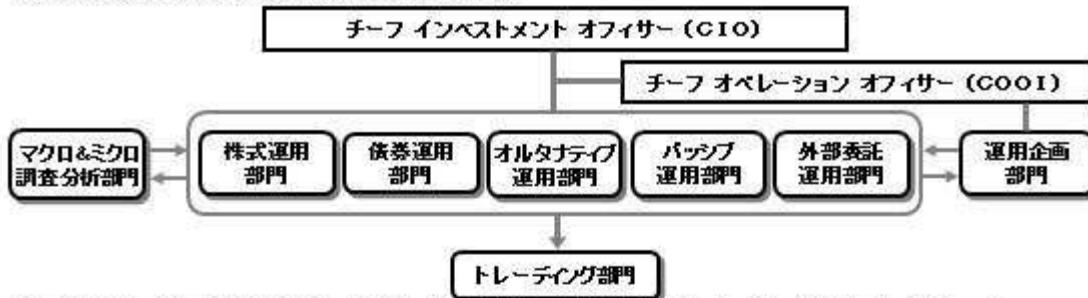
* NOMURA BPI総合は、野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

<海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド>
（略）

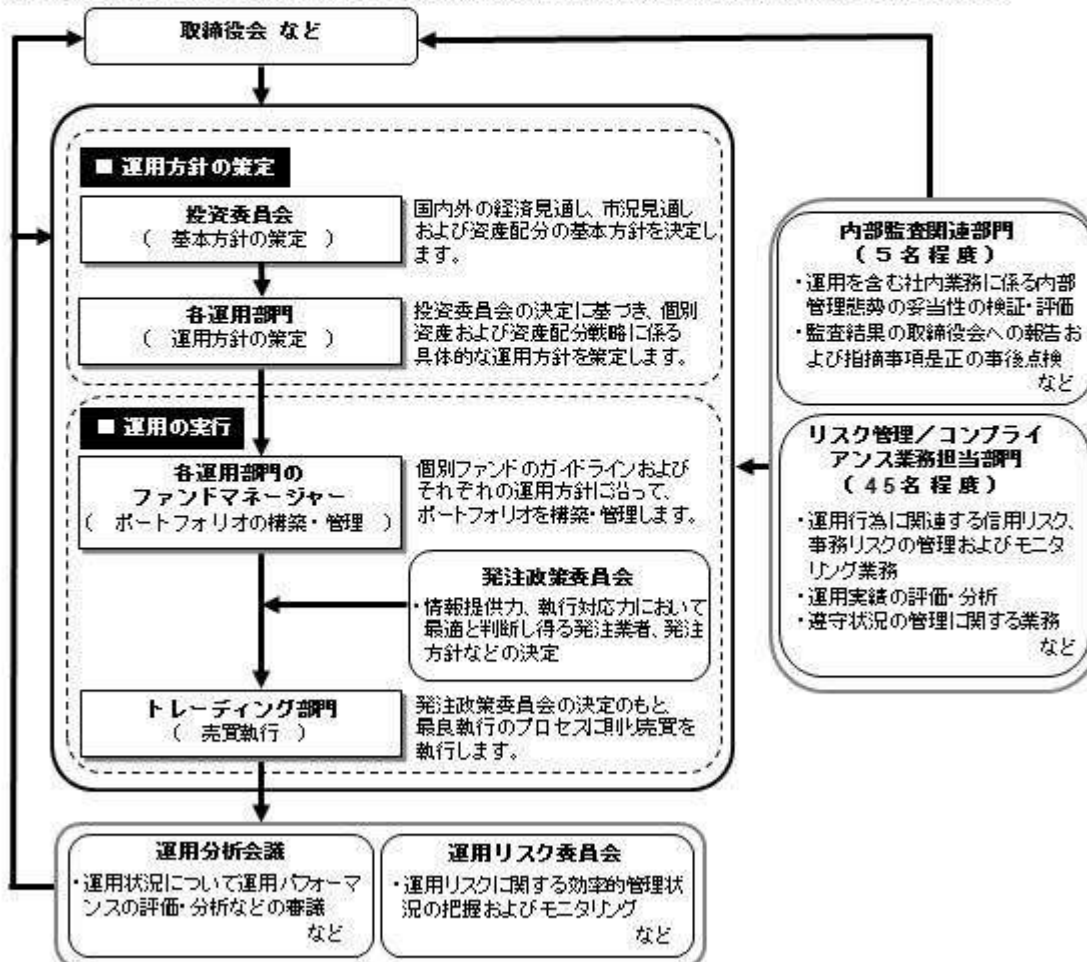
（3）【運用体制】

<更新後>

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

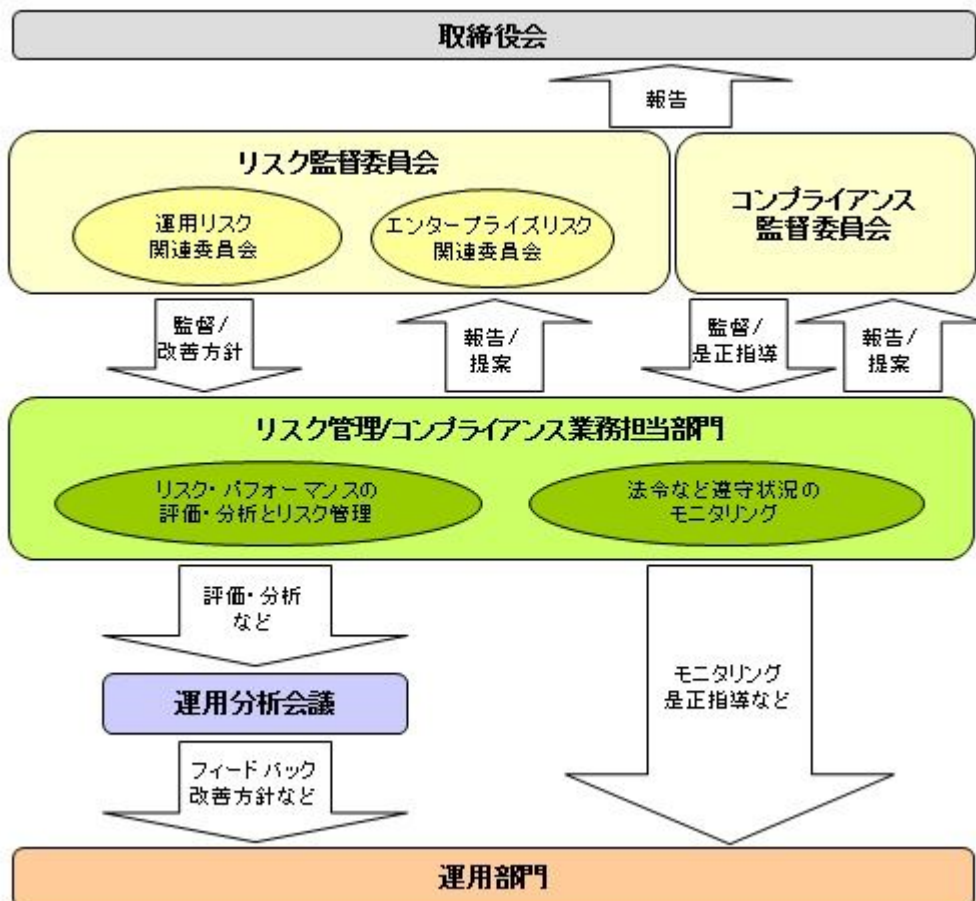
「受託会社」に対しては、日々の純資産照会、月次の勘定残高照会などを行っております。また、独立した監査法人が所定の手続きで受託業務について監査を行っており、内部統制が有効に機能している旨の監査報告書を定期的に受け取っております。

上記体制は平成28年5月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

3【投資リスク】

<更新後>

(2) リスク管理体制



全社リスク管理

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

運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

法令など遵守状況のモニタリング

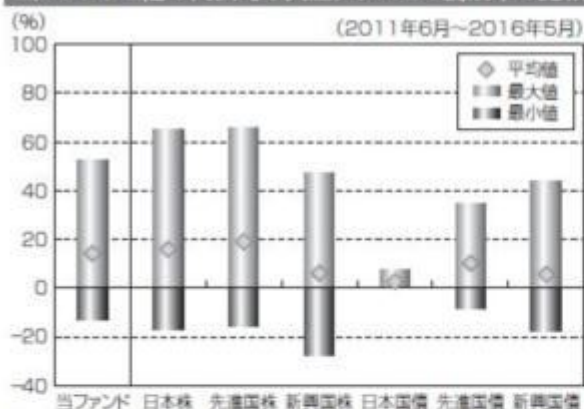
運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は平成28年5月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

< 更新後 >

（参考情報）

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	14.2%	15.9%	19.0%	6.1%	2.6%	10.2%	5.6%
最大値	52.4%	65.0%	65.7%	47.4%	7.7%	34.9%	43.7%
最小値	-12.7%	-17.0%	-15.6%	-27.4%	0.4%	-8.6%	-17.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2011年6月から2016年5月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債……JPモルガンGBI-EMグローバルレディパーシファイド(円ヘッジなし、円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

東証株価指数(TOPIX、配当込)

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

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

当指数は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

NOMURA-BPI国債

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

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

当指数は、Citigroup Index LLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で

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、2011年6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。

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債……JPモルガンGBI-EMグローバルレディパーシファイド(円ヘッジなし、円ベース)

加重平均した指数です。なお、当指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、Citigroup Index LLC に帰属します。

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(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】

(5)【課税上の取扱い】

<更新後>

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

確定拠出年金の場合

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

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

確定拠出年金でない場合

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315% (所得税15.315%および地方税5%)の税率による源泉徴収(原則として、確定申告は不要です。)が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税(配当控除の適用があります。)のいずれかを選択することもできます。

2) 解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益(譲渡益)^{*}については譲渡所得として、20.315% (所得税15.315%および地方税5%)の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座(源泉徴収選択口座)を選択している場合は、20.315% (所得税15.315%および地方税5%)の税率による源泉徴収(原則として、確定申告は不要です。)が行なわれます。

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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、未成年者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)をご利用の場合、20歳未満の居住者などを対象に、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。なお、確定拠出年金制度を通じて公募株式投資信託などを購入する場合は、NISAをご利用になれません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、15.315% (所得税のみ)の税率による源泉徴収が行なわれます。源泉徴収された

税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

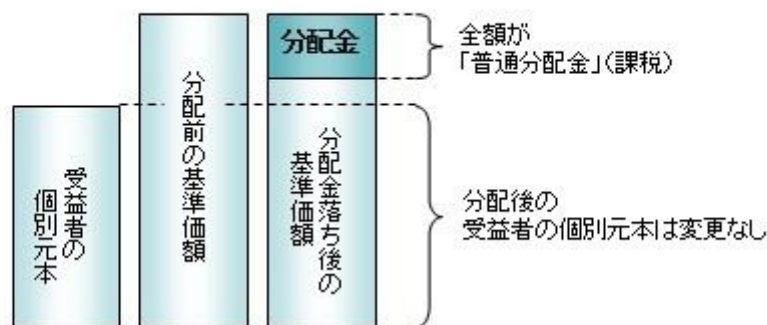
- 1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

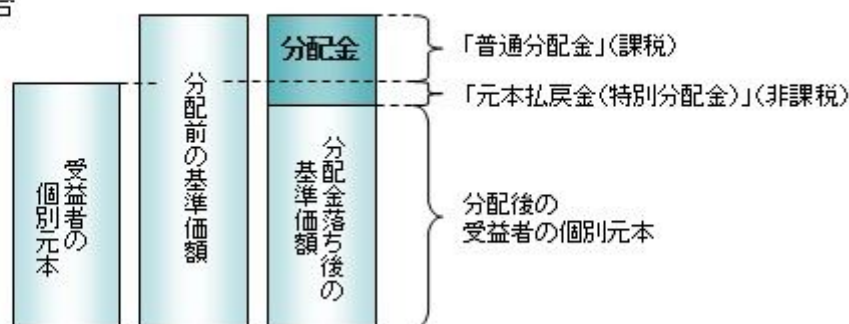
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
 -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

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は平成28年 8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80)】

以下の運用状況は2016年 5月31日現在です。

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

(1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	3,086,928,753	95.11
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		158,879,395	4.89
合計(純資産総額)		3,245,808,148	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	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	1,655,716,618	1.3102	2,169,437,046	1.1819	1,956,891,470	60.29
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	348,636,058	2.0291	707,419,767	1.8640	649,857,612	20.02
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	145,803,527	2.3101	336,824,952	2.2018	321,030,205	9.89
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	112,520,833	1.3429	151,115,081	1.4144	159,149,466	4.90

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.11
合計	95.11

【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)	922	922	1.7403	1.7413
第5計算期間末	(2007年11月 6日)	1,349	1,350	1.7955	1.7965
第6計算期間末	(2008年11月 6日)	1,025	1,026	1.1323	1.1333
第7計算期間末	(2009年11月 6日)	1,282	1,283	1.1564	1.1574
第8計算期間末	(2010年11月 8日)	1,417	1,418	1.1448	1.1458
第9計算期間末	(2011年11月 7日)	1,457	1,459	1.0736	1.0746
第10計算期間末	(2012年11月 6日)	1,612	1,614	1.1223	1.1233
第11計算期間末	(2013年11月 6日)	2,382	2,383	1.6841	1.6851
第12計算期間末	(2014年11月 6日)	2,987	2,989	1.9687	1.9697
第13計算期間末	(2015年11月 6日)	3,522	3,524	2.2109	2.2119
	2015年 5月末日	3,612		2.3181	
	6月末日	3,582		2.2611	
	7月末日	3,667		2.3014	
	8月末日	3,408		2.1623	
	9月末日	3,236		2.0339	
	10月末日	3,504		2.2040	
	11月末日	3,539		2.2267	
	12月末日	3,476		2.1871	
	2016年 1月末日	3,241		2.0547	
	2月末日	2,991		1.9141	
	3月末日	3,159		1.9952	
	4月末日	3,120		1.9821	
	5月末日	3,245		2.0239	

【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
当中間期	2015年11月 7日～2016年 5月 6日	

【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	10.07
第5期	2006年11月 7日～2007年11月 6日	3.23
第6期	2007年11月 7日～2008年11月 6日	36.88
第7期	2008年11月 7日～2009年11月 6日	2.22
第8期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	0.92
第9期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	6.13
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	4.63
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	50.15
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	16.96
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	12.35
当中間期	2015年11月 7日～2016年 5月 6日	12.97

(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	250,110,880	52,794,209
第5期	2006年11月 7日～2007年11月 6日	313,218,680	91,788,074
第6期	2007年11月 7日～2008年11月 6日	271,064,509	116,976,852
第7期	2008年11月 7日～2009年11月 6日	338,383,067	134,750,016
第8期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	253,592,584	125,002,772
第9期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	231,238,595	111,194,193
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	239,405,768	160,145,471
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	337,947,290	360,574,596
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	382,949,221	279,756,877
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	498,795,450	423,102,531
当中間期	2015年11月 7日～2016年 5月 6日	176,213,285	197,074,785

（参考）

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2016年 5月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	25,954,721,000	98.25
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		462,042,965	1.75

合計(純資産総額)	26,416,763,965	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	454,410,000	1.72

(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	158,000	7,436.55	1,174,974,900	5,783.00	913,714,000	3.46
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,006,000	765.28	769,871,680	553.80	557,122,800	2.11
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	96,900	4,591.21	444,888,249	4,855.00	470,449,500	1.78
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	71,100	6,496.78	461,921,058	6,228.00	442,810,800	1.68
日本	株式	KDDI	情報・通信業	127,400	2,921.99	372,261,526	3,237.00	412,393,800	1.56
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	84,100	4,230.41	355,777,481	4,402.00	370,208,200	1.40
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	100,400	4,752.16	477,116,864	3,617.00	363,146,800	1.37
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	114,300	3,988.19	455,850,117	3,151.00	360,159,300	1.36
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,777,400	241.71	429,619,204	174.40	309,978,560	1.17
日本	株式	ソニー	電気機器	89,700	3,405.73	305,493,981	3,100.00	278,070,000	1.05
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	93,700	2,354.98	220,661,626	2,779.00	260,392,300	0.99
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	53,000	5,751.39	304,823,670	4,797.00	254,241,000	0.96
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	52,400	5,313.55	278,430,020	4,744.00	248,585,600	0.94
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	23,200	11,302.11	262,208,952	10,135.00	235,132,000	0.89
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	149,000	1,673.02	249,279,980	1,517.00	226,033,000	0.86
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	11,400	21,460.50	244,649,700	19,630.00	223,782,000	0.85
日本	株式	ファナック	電気機器	13,000	20,046.36	260,602,680	16,980.00	220,740,000	0.84
日本	株式	キヤノン	電気機器	68,400	3,752.57	256,675,788	3,212.00	219,700,800	0.83
日本	株式	花王	化学	35,800	5,887.24	210,763,192	6,101.00	218,415,800	0.83
日本	株式	キーエンス	電気機器	2,900	59,381.47	172,206,263	70,400.00	204,160,000	0.77
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	177,300	1,222.67	216,779,391	1,125.00	199,462,500	0.76
日本	株式	三菱地所	不動産業	93,000	2,548.77	237,035,610	2,139.50	198,973,500	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	50,800	4,695.25	238,518,700	3,839.00	195,021,200	0.74
日本	株式	三菱商事	卸売業	94,100	2,218.63	208,773,083	1,967.00	185,094,700	0.70
日本	株式	三井不動産	不動産業	67,000	3,256.50	218,185,500	2,721.50	182,340,500	0.69
日本	株式	三菱電機	電気機器	135,000	1,278.24	172,562,400	1,339.50	180,832,500	0.68

日本	株式	ダイキン工業	機械	18,500	7,992.54	147,861,990	9,496.00	175,676,000	0.67
日本	株式	村田製作所	電気機器	13,400	16,764.03	224,638,002	12,950.00	173,530,000	0.66
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	44,900	4,368.56	196,148,344	3,826.00	171,787,400	0.65
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	40,100	4,573.31	183,389,731	4,150.00	166,415,000	0.63

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.30
		建設業	3.16
		食料品	5.01
		繊維製品	0.72
		パルプ・紙	0.26
		化学	6.14
		医薬品	5.60
		石油・石炭製品	0.50
		ゴム製品	0.87
		ガラス・土石製品	0.92
		鉄鋼	1.19
		非鉄金属	0.86
		金属製品	0.63
		機械	4.73
		電気機器	11.55
		輸送用機器	9.36
		精密機器	1.57
		その他製品	1.61
		電気・ガス業	1.92
		陸運業	4.45
		海運業	0.22
		空運業	0.64
		倉庫・運輸関連業	0.20
		情報・通信業	8.28
		卸売業	4.11
		小売業	4.76
銀行業	7.51		
証券、商品先物取引業	1.01		
保険業	2.27		
その他金融業	1.28		
不動産業	2.73		
サービス業	3.77		
合 計			98.25

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2016年06月	買建	33	日本円	443,942,820	454,410,000	1.72

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

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

以下の運用状況は2016年 5月31日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	42,091,390,714	58.09
	カナダ	2,625,573,706	3.62
	モーリシャス	3,974,230	0.01
	ドイツ	2,558,478,378	3.53
	イタリア	544,075,375	0.75
	フランス	2,583,371,685	3.57
	オランダ	1,152,957,299	1.59
	スペイン	904,088,799	1.25
	ベルギー	425,457,234	0.59
	オーストリア	53,376,353	0.07
	ルクセンブルク	69,658,238	0.10
	フィンランド	279,681,238	0.39
	アイルランド	1,200,254,504	1.66
	ポルトガル	43,957,047	0.06
	イギリス	5,269,411,230	7.27
	スイス	2,848,124,269	3.93
	スウェーデン	787,680,739	1.09
	ノルウェー	170,251,899	0.23
	デンマーク	573,105,474	0.79
	ケイマン	153,549,650	0.21
オーストラリア	1,765,145,715	2.44	
パミューダ	115,816,566	0.16	
ニュージーランド	43,282,609	0.06	
香港	706,513,419	0.98	

	シンガポール	476,154,881	0.66
	イスラエル	181,391,962	0.25
	ジャージー	315,013,585	0.43
	英ヴァージン諸島	18,544,730	0.03
	小計	67,960,281,528	93.80
投資証券	アメリカ	1,423,298,288	1.96
	カナダ	12,399,070	0.02
	フランス	105,598,742	0.15
	イギリス	93,439,451	0.13
	オーストラリア	216,004,940	0.30
	香港	32,318,496	0.04
	シンガポール	24,609,815	0.03
	小計	1,907,668,802	2.63
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		2,586,365,034	3.57
合計（純資産総額）		72,454,315,364	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	1,919,564,311	2.65
	買建	ドイツ	599,214,082	0.83

(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		657,664,800	0.91

(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	118,522	13,186.32	1,562,870,015	11,132.82	1,319,485,159	1.82
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	161,434	5,863.54	946,574,903	5,804.38	937,024,410	1.29
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	88,501	9,197.66	814,002,970	9,985.70	883,745,268	1.22
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	58,671	11,131.76	653,111,514	12,542.87	735,903,101	1.02
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	8,485	66,376.44	563,204,130	79,015.90	670,449,959	0.93

アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	200,233	3,272.98	655,360,256	3,341.51	669,081,132	0.92
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	48,320	11,374.05	549,594,528	13,244.01	639,950,911	0.88
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	103,100	6,065.40	625,343,324	5,641.29	581,617,927	0.80
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	78,320	7,074.75	554,094,833	7,258.80	568,509,545	0.78
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	130,607	3,747.88	489,499,516	4,325.55	564,947,187	0.78
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	67,863	8,434.01	572,357,899	8,295.90	562,984,797	0.78
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	6,622	77,887.16	515,768,803	81,281.30	538,244,771	0.74
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	57,529	8,547.23	491,714,090	9,033.84	519,708,023	0.72
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	6,200	79,883.99	495,280,764	82,938.74	514,220,213	0.71
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	130,810	3,768.19	492,917,324	3,839.63	502,262,445	0.69
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	86,157	5,124.55	441,516,212	5,615.78	483,838,999	0.67
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	40,081	10,102.23	404,907,860	11,318.09	453,640,718	0.63
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	14,958	29,557.10	442,115,179	29,312.55	438,457,272	0.61
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	87,652	4,746.21	416,015,101	4,967.89	435,445,775	0.60
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	48,453	10,075.28	488,177,760	8,900.05	431,234,316	0.60
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	25,260	15,257.80	385,412,176	15,903.24	401,716,070	0.55
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	26,970	13,819.55	372,713,270	14,859.30	400,755,418	0.55
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	33,803	12,537.05	423,790,053	11,126.17	376,098,012	0.52
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	59,273	5,864.26	347,592,497	6,265.89	371,398,169	0.51
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア	52,767	6,872.35	362,633,552	6,975.90	368,097,695	0.51
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	221,629	1,825.64	404,615,673	1,650.78	365,862,316	0.50
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	41,342	8,543.02	353,185,674	8,837.48	365,359,115	0.50
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	32,828	9,942.56	326,394,458	11,003.02	361,207,443	0.50
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	99,832	3,868.57	386,207,923	3,502.37	349,649,181	0.48
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	30,861	11,354.35	350,406,878	11,311.44	349,082,424	0.48

口.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	6.89

	素材	4.47
	資本財	7.01
	商業・専門サービス	0.92
	運輸	1.79
	自動車・自動車部品	1.53
	耐久消費財・アパレル	1.70
	消費者サービス	1.76
	メディア	2.84
	小売	3.89
	食品・生活必需品小売り	2.05
	食品・飲料・タバコ	6.35
	家庭用品・パーソナル用品	2.24
	ヘルスケア機器・サービス	3.66
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.36
	銀行	8.31
	各種金融	3.79
	保険	4.12
	不動産	0.59
	ソフトウェア・サービス	8.44
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.49
	電気通信サービス	3.21
	公益事業	3.37
	半導体・半導体製造装置	2.01
投資証券		2.63
合計		96.43

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI 1606	買建	165	米ドル	16,606,725.93	1,842,350,174	17,302,725	1,919,564,311	2.65
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1606	買建	165	ユーロ	4,633,820	572,971,842	4,846,050	599,214,082	0.83

(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	2,420,000.00	271,766,325	268,192,800	0.37

ユーロ	買建	3,150,000.00	393,164,240	389,472,000	0.54
-----	----	--------------	-------------	-------------	------

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2016年 5月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	26,713,983,695	77.42
地方債証券	日本	2,652,621,233	7.69
特殊債券	日本	3,054,184,000	8.85
社債券	日本	1,700,686,000	4.93
	オーストラリア	302,682,727	0.88
	小計	2,003,368,727	5.81
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		82,808,135	0.24
合計(純資産総額)		34,506,965,790	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第107回利付国債(5年)	705,000,000	100.39	707,791,800	100.71	710,047,800	0.200	2017/12/20	2.06
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	581,000,000	105.33	611,973,110	105.47	612,809,750	1.400	2019/9/20	1.78
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	560,000,000	100.25	561,422,400	101.39	567,784,000	0.100	2020/6/20	1.65
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	505,000,000	100.26	506,328,150	101.30	511,575,100	0.100	2020/3/20	1.48
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	473,000,000	105.21	497,643,300	105.49	498,996,080	1.300	2019/12/20	1.45
日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	410,000,000	104.33	427,753,000	104.33	427,777,600	1.300	2019/3/20	1.24
日本	国債証券	第29回利付国債(30年)	276,000,000	123.77	341,621,760	145.87	402,623,280	2.400	2038/9/20	1.17
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	370,000,000	106.63	394,531,000	107.42	397,457,700	1.300	2021/3/20	1.15
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	300,000,000	120.43	361,291,800	124.36	373,089,000	2.300	2026/6/20	1.08
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	280,000,000	113.39	317,506,000	125.86	352,422,000	1.700	2032/9/20	1.02
日本	国債証券	第120回利付国債(5年)	330,000,000	100.66	332,181,300	101.49	334,940,100	0.200	2019/9/20	0.97
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	325,000,000	100.27	325,877,850	101.47	329,800,250	0.100	2020/9/20	0.96

日本	国債証券	第60回利付国債 (20年)	295,000,000	109.22	322,199,000	110.87	327,087,150	1.400	2022/12/20	0.95
日本	国債証券	第292回利付国債 (10年)	306,000,000	104.02	318,325,680	103.51	316,743,660	1.700	2018/3/20	0.92
日本	国債証券	第91回利付国債 (20年)	250,000,000	120.34	300,850,000	124.85	312,125,000	2.300	2026/9/20	0.90
日本	国債証券	第106回利付国債 (5年)	310,000,000	100.36	311,116,000	100.59	311,841,400	0.200	2017/9/20	0.90
日本	国債証券	第113回利付国債 (20年)	240,000,000	119.77	287,464,800	128.10	307,447,200	2.100	2029/9/20	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	101.23	303,705,000	0.100	2019/12/20	0.88
日本	国債証券	第14回利付国債 (30年)	208,000,000	124.06	258,046,880	139.24	289,625,440	2.400	2034/3/20	0.84
日本	国債証券	第329回利付国債 (10年)	260,000,000	105.14	273,389,700	107.41	279,286,800	0.800	2023/6/20	0.81
日本	国債証券	第137回利付国債 (20年)	220,000,000	113.55	249,814,400	125.67	276,474,000	1.700	2032/6/20	0.80
日本	国債証券	第43回利付国債 (30年)	195,000,000	108.68	211,943,550	137.64	268,407,750	1.700	2044/6/20	0.78
日本	国債証券	第149回利付国債 (20年)	215,000,000	108.62	233,543,750	123.61	265,772,250	1.500	2034/6/20	0.77
日本	国債証券	第339回利付国債 (10年)	250,000,000	101.04	252,610,000	105.09	262,732,500	0.400	2025/6/20	0.76
日本	国債証券	第50回利付国債 (20年)	237,000,000	109.89	260,458,260	110.31	261,451,290	1.900	2021/3/22	0.76
日本	国債証券	第2回利付国債 (40年)	165,000,000	121.23	200,042,700	158.38	261,340,200	2.200	2049/3/20	0.76
日本	国債証券	第141回利付国債 (20年)	195,000,000	115.87	225,964,200	126.15	245,996,400	1.700	2032/12/20	0.71
日本	国債証券	第301回利付国債 (10年)	223,000,000	105.36	234,972,870	105.37	234,990,710	1.500	2019/6/20	0.68
日本	国債証券	第34回利付国債 (30年)	160,000,000	120.16	192,260,800	145.70	233,123,200	2.200	2041/3/20	0.68
日本	国債証券	第290回利付国債 (10年)	226,000,000	103.31	233,482,860	102.96	232,709,940	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	77.42
地方債証券	7.69
特殊債券	8.85
社債券	5.81
合計	99.76

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2016年 5月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	70,523,829,998	42.39
	カナダ	3,427,259,004	2.06
	メキシコ	1,529,555,475	0.92
	ドイツ	12,178,864,882	7.32
	イタリア	16,376,256,779	9.84
	フランス	16,158,824,917	9.71
	オランダ	3,930,706,128	2.36
	スペイン	9,099,874,276	5.47
	ベルギー	4,267,920,416	2.57
	オーストリア	2,545,828,935	1.53
	フィンランド	1,013,890,977	0.61
	アイルランド	1,348,361,982	0.81
	イギリス	13,471,795,838	8.10
	スイス	464,429,463	0.28
	スウェーデン	823,076,715	0.49
	ノルウェー	505,788,230	0.30
	デンマーク	1,123,918,053	0.68
	ポーランド	966,696,310	0.58
	オーストラリア	2,957,640,721	1.78
	シンガポール	587,578,198	0.35
マレーシア	759,840,179	0.46	
南アフリカ	679,278,366	0.41	
	小計	164,741,215,842	99.03
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,620,039,478	0.97
合計（純資産総額）		166,361,255,320	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		23,559,020	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,490,000	15,151.07	1,740,858,610	14,906.69	1,712,779,345	8.000	2021/11/15	1.03
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,300,000	12,159.19	1,617,173,246	12,065.59	1,604,723,698	3.625	2020/2/15	0.96
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,870,000	12,024.78	1,427,342,169	11,926.91	1,415,725,014	3.375	2019/11/15	0.85
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,950,000	14,887.62	1,183,566,423	14,478.53	1,151,043,669	8.750	2020/8/15	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,500,000	12,126.26	1,151,994,892	12,049.12	1,144,666,785	3.500	2020/5/15	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,400,000	12,027.45	1,130,580,872	11,841.97	1,113,145,958	3.750	2018/11/15	0.67
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,300,000	11,391.28	1,059,389,461	11,407.75	1,060,920,953	2.000	2020/7/31	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,300,000	11,210.14	1,042,543,049	11,350.54	1,055,601,034	2.000	2023/2/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,850,000	12,058.65	1,067,191,229	11,859.31	1,049,549,169	4.000	2018/8/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,550,000	12,277.72	1,049,745,898	12,231.13	1,045,762,043	3.625	2021/2/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,800,000	11,773.50	1,036,068,660	11,492.69	1,011,356,775	4.500	2017/5/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,950,000	11,256.94	1,007,496,410	11,232.67	1,005,324,413	1.500	2018/12/31	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,600,000	11,913.91	1,024,596,771	11,623.56	999,626,603	4.750	2017/8/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,800,000	11,480.55	1,010,288,978	11,315.01	995,721,169	2.750	2017/5/31	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	12,496.35	999,708,075	11,948.58	955,886,775	8.750	2017/5/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,340,000	11,505.69	959,574,663	11,414.68	951,984,807	2.250	2018/7/31	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,950,000	11,784.77	936,889,599	11,581.09	920,697,126	3.500	2018/2/15	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,150,000	10,977.51	894,667,309	11,154.67	909,105,630	1.750	2023/5/15	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	11,309.22	904,737,888	11,315.88	905,270,400	1.750	2019/9/30	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,550,000	11,951.18	902,314,454	11,748.37	887,002,135	3.875	2018/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,400,000	11,600.16	858,412,118	11,451.95	847,444,658	2.750	2018/2/28	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	11,533.42	807,339,848	11,430.28	800,120,081	2.375	2018/6/30	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	11,534.29	807,400,519	11,338.41	793,689,028	3.125	2017/4/30	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,800,000	11,895.71	808,908,609	11,646.09	791,934,789	4.250	2017/11/15	0.48
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,530,000	17,327.28	784,925,829	17,439.80	790,023,053	5.250	2029/11/1	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	11,354.88	794,841,763	11,250.00	787,500,656	1.875	2017/9/30	0.47
イギリス	国債証券	UK TREASURY	3,150,000	22,334.46	703,535,601	23,689.32	746,213,788	4.500	2042/12/7	0.45
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,650,000	13,320.76	752,623,364	13,010.43	735,089,406	4.250	2017/7/4	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,400,000	11,410.35	730,262,550	11,468.42	733,979,040	2.125	2021/6/30	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	11,585.42	683,540,342	12,202.53	719,949,463	3.125	2044/8/15	0.43

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.03
合計	99.03

投資不動産物件

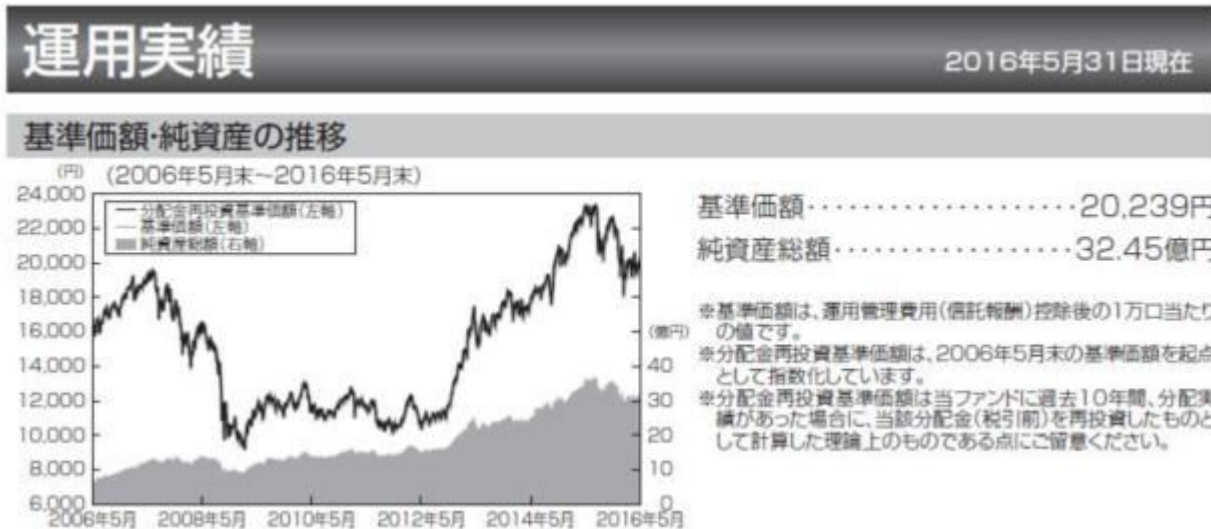
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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	100,000.00	11,072,400	11,093,000	0.01
	ノルウェークロネ	売建	938,000.00	12,419,120	12,466,020	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

参考情報



分配の推移(税引前、1万口当たり)

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	60.29%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	20.02%
日本債券インデックスマザーファンド	4.90%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	9.89%
現金その他	4.89%

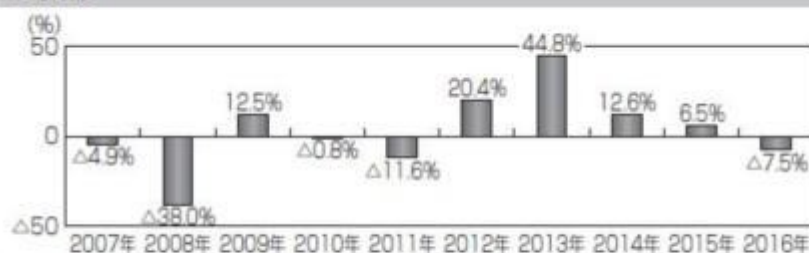
*当ファンドの対純資産総額比です。

<組入上位銘柄>

組入資産	銘柄	業種	比率	
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.46%	
	2 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.11%	
	3 日本電信電話	情報・通信業	1.78%	
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.82%	
	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1.29%	
	3 EXXON MOBIL CORP	エネルギー	1.22%	
組入資産	銘柄	種類	償還期限	比率
日本債券インデックス マザーファンド	1 第107回利付国債(5年)	国債証券	2017/12/20	2.06%
	2 第303回利付国債(10年)	国債証券	2019/9/20	1.78%
	3 第124回利付国債(5年)	国債証券	2020/6/20	1.65%
海外債券インデックス (ヘッジなし)マザーファンド	1 US TREASURY N/B (クーポン8.000%)	国債証券	2021/11/15	1.03%
	2 US TREASURY N/B (クーポン3.625%)	国債証券	2020/2/15	0.96%
	3 US TREASURY N/B (クーポン3.375%)	国債証券	2019/11/15	0.85%

*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。

*2016年は、2016年5月末までの騰落率です。

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成27年11月7日から平成28年5月6日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【DCインデックスバランス（株式80）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前計算期間末 平成27年11月6日現在	当中間計算期間末 平成28年5月6日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	192,060,421	165,507,998
親投資信託受益証券	3,351,106,490	2,867,576,325
未収入金	1,095,411	11,322,524
未収利息	313	-
流動資産合計	3,544,262,635	3,044,406,847
資産合計	3,544,262,635	3,044,406,847
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,593,326	-
未払解約金	13,687,104	15,186,937
未払受託者報酬	567,043	521,361
未払委託者報酬	5,701,306	2,954,728
未払利息	-	357
その他未払費用	92,564	85,107
流動負債合計	21,641,343	18,748,490
負債合計	21,641,343	18,748,490
純資産の部		
元本等		
元本	1,593,326,643	1,572,465,143
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,929,294,649	1,453,193,214
（分配準備積立金）	870,931,431	768,695,473
元本等合計	3,522,621,292	3,025,658,357
純資産合計	3,522,621,292	3,025,658,357
負債純資産合計	3,544,262,635	3,044,406,847

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自 平成26年11月7日 至 平成27年5月6日	当中間計算期間 自 平成27年11月7日 至 平成28年5月6日
営業収益		
受取利息	43,301	27,373
有価証券売買等損益	380,770,628	453,776,438

	前中間計算期間		当中間計算期間	
	自	平成26年11月 7日 至 平成27年 5月 6日	自	平成27年11月 7日 至 平成28年 5月 6日
営業収益合計		380,813,929		453,749,065
営業費用				
支払利息		-		5,861
受託者報酬		489,062		521,361
委託者報酬		5,054,310		2,954,728
その他費用		79,827		85,107
営業費用合計		5,623,199		3,567,057
営業利益又は営業損失（ ）		375,190,730		457,316,122
経常利益又は経常損失（ ）		375,190,730		457,316,122
中間純利益又は中間純損失（ ）		375,190,730		457,316,122
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）		23,116,892		34,638,742
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,470,207,357		1,929,294,649
剰余金増加額又は欠損金減少額		262,726,629		184,075,917
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		262,726,629		184,075,917
剰余金減少額又は欠損金増加額		231,644,210		237,499,972
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		231,644,210		237,499,972
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		1,853,363,614		1,453,193,214

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

		前計算期間末 平成27年11月 6日現在	当中間計算期間末 平成28年 5月 6日現在
1.	期首元本額	1,517,633,724円	1,593,326,643円
	期中追加設定元本額	498,795,450円	176,213,285円
	期中一部解約元本額	423,102,531円	197,074,785円
2.	受益権の総数	1,593,326,643口	1,572,465,143口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間 自 平成26年11月 7日 至 平成27年 5月 6日	当中間計算期間 自 平成27年11月 7日 至 平成28年 5月 6日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	前計算期間末 平成27年11月 6日現在	当中間計算期間末 平成28年 5月 6日現在
中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	中間貸借対照表計上額は中間計算期間末日の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(1口当たり情報)

前計算期間末 平成27年11月 6日現在	当中間計算期間末 平成28年 5月 6日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)
2,2109円 (22,109円)	1,9241円 (19,241円)

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

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成27年11月 6日現在	平成28年 5月 6日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	68,621,670	173,407,910
株式	27,907,326,060	24,422,217,545
派生商品評価勘定	18,679,740	-
未収入金	77,357,070	47,544,484
未収配当金	207,525,785	256,194,801
未収利息	112	-
前払金	-	14,830,000
流動資産合計	28,279,510,437	24,914,194,740
資産合計	28,279,510,437	24,914,194,740
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	15,419,580
前受金	17,540,000	-
未払金	-	84,044,581
未払解約金	46,138,822	31,180,789
未払利息	-	374
流動負債合計	63,678,822	130,645,324
負債合計	63,678,822	130,645,324
純資産の部		
元本等		
元本	21,313,752,367	22,293,797,568
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	6,902,079,248	2,489,751,848
元本等合計	28,215,831,615	24,783,549,416
純資産合計	28,215,831,615	24,783,549,416
負債純資産合計	28,279,510,437	24,914,194,740

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	デリバティブ取引

方法	個別法に基づき原則として時価で評価しております。
----	--------------------------

(貸借対照表に関する注記)

		平成27年11月 6日現在	平成28年 5月 6日現在
1.	期首	平成26年11月 7日	平成27年11月 7日
	期首元本額	25,502,591,555円	21,313,752,367円
	期首からの追加設定元本額	1,825,029,839円	2,749,654,208円
	期首からの一部解約元本額	6,013,869,027円	1,769,609,007円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス(株式20)	182,944,304円	221,104,952円
	DCインデックスバランス(株式40)	713,946,648円	783,697,085円
	DCインデックスバランス(株式60)	1,348,998,781円	1,451,307,670円
	DCインデックスバランス(株式80)	1,605,725,499円	1,618,650,912円
	インデックスファンド日本株式(DC専用)	1,164,952,931円	1,255,997,724円
	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	5,497,114,326円	5,769,033,551円
	全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	5,124,803円	5,533,160円
	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(株式資産)	23,674,244円	4,150,364円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	65,422,399円	67,412,593円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	52,091,722円	54,093,572円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	80,607,291円	83,000,409円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	95,992,107円	109,627,801円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	6,996,040,892円	7,106,261,066円
	世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け)	19,068,512円	18,555,356円
	世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け)	42,455,918円	45,367,353円
	グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	41,930,365円	39,687,438円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	266,671,393円	309,606,172円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	812,132,628円	901,830,776円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	1,143,415,021円	1,234,772,731円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	1,155,442,583円	1,214,106,883円
	計	21,313,752,367円	22,293,797,568円
2.	受益権の総数	21,313,752,367口	22,293,797,568口
3.	担保資産		
	デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。		
	株式	489,070,000円	354,950,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成27年11月 6日現在	平成28年 5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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（平成27年11月 6日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	278,755,000	-	297,445,000	18,690,000
合計		278,755,000	-	297,445,000	18,690,000

（平成28年 5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	365,190,000	-	349,785,000	15,405,000
合計		365,190,000	-	349,785,000	15,405,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

平成27年11月 6日現在		平成28年 5月 6日現在	
1口当たり純資産額	1.3238円	1口当たり純資産額	1.1117円
(1万口当たり純資産額)	(13,238円)	(1万口当たり純資産額)	(11,117円)

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

貸借対照表

(単位：円)

	平成27年11月 6日現在	平成28年 5月 6日現在
資産の部		
流動資産		
預金	134,025,829	1,169,466,928
コール・ローン	1,516,004,646	694,008,282
株式	76,137,853,498	64,368,931,557
投資証券	1,981,283,255	1,867,071,906
派生商品評価勘定	148,332,453	30,482,059
未収入金	3,193,364	2,919,265
未収配当金	85,311,594	119,017,469
未収利息	2,474	-
差入委託証拠金	258,162,445	416,095,649
流動資産合計	80,264,169,558	68,667,993,115
資産合計	80,264,169,558	68,667,993,115
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,211,600	40,747,432
未払金	596,660	-
未払解約金	178,586,814	41,006,987
未払利息	-	1,499
流動負債合計	182,395,074	81,755,918
負債合計	182,395,074	81,755,918

純資産の部

純資産の部		
元本等		
元本	39,104,730,095	39,026,784,390
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	40,977,044,389	29,559,452,807
元本等合計	80,081,774,484	68,586,237,197
純資産合計	80,081,774,484	68,586,237,197
負債純資産合計	80,264,169,558	68,667,993,115

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	<p>外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		平成27年11月 6日現在	平成28年 5月 6日現在
1.	期首	平成26年11月 7日	平成27年11月 7日
	期首元本額	45,063,157,199円	39,104,730,095円
	期首からの追加設定元本額	2,553,715,826円	1,765,695,072円
	期首からの一部解約元本額	8,512,142,930円	1,843,640,777円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外株式ヘッジなし（DC専用）	14,228,655,621円	14,496,027,615円
	DCインデックスバランス（株式20）	39,671,130円	46,580,478円

DCインデックスバランス(株式40)	155,402,482円	165,702,699円
DCインデックスバランス(株式60)	290,756,638円	305,747,657円
DCインデックスバランス(株式80)	345,428,532円	341,575,742円
世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	3,603,552,397円	3,689,648,688円
日興五大陸株式ファンド	7,495,776,901円	7,127,295,193円
全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	29,801,029円	31,247,187円
日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(株式資産)	13,338,738円	1,837,557円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	7,085,288円	7,112,169円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	5,650,402円	5,724,379円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	8,642,901円	8,850,362円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	10,342,211円	11,447,591円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	7,520,445,780円	7,565,948,369円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	10,775,646円	10,224,367円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	28,538,861円	32,407,451円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	87,252,162円	94,892,835円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	123,067,808円	131,300,757円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	124,828,054円	127,800,638円
インデックスファンド海外株式(ヘッジなし)	4,975,717,514円	4,825,412,656円
計	39,104,730,095円	39,026,784,390円
2. 受益権の総数	39,104,730,095口	39,026,784,390口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	平成27年11月 6日現在	平成28年 5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	(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

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（平成27年11月 6日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,739,040,038	-	1,874,524,641	135,484,603
	合計	1,739,040,038	-	1,874,524,641	135,484,603

（平成28年 5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	2,205,316,548	-	2,221,418,250	16,101,702
	合計	2,205,316,548	-	2,221,418,250	16,101,702

（注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(平成27年11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,369,787,750	-	1,379,424,000	9,636,250
	米ドル	1,081,800,650	-	1,094,648,500	12,847,850
	ユーロ	287,987,100	-	284,775,500	3,211,600
合計		1,369,787,750	-	1,379,424,000	9,636,250

(平成28年 5月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	750,453,175	-	723,918,900	26,534,275
	米ドル	349,546,345	-	333,602,400	15,943,945
	ユーロ	400,906,830	-	390,316,500	10,590,330
	売建	9,340,100	-	9,172,900	167,200
	加ドル	9,340,100	-	9,172,900	167,200
合計		759,793,275	-	733,091,800	26,367,075

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

平成27年11月 6日現在		平成28年 5月 6日現在	
1口当たり純資産額	2.0479円	1口当たり純資産額	1.7574円
(1万口当たり純資産額)	(20,479円)	(1万口当たり純資産額)	(17,574円)

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	平成27年11月 6日現在	平成28年 5月 6日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	24,187,688	56,002,062
国債証券	27,814,501,380	26,909,266,230
地方債証券	2,220,325,000	2,656,356,000
特殊債証券	2,709,076,000	3,056,200,000
社債券	1,885,695,000	2,003,776,002
未収入金	-	254,860,940
未収利息	97,015,981	90,913,495
前払費用	2,206,124	1,881,957
流動資産合計	34,753,007,173	35,029,256,686
資産合計	34,753,007,173	35,029,256,686
負債の部		
流動負債		
未払金	-	295,331,450
未払解約金	11,984,692	7,421,905
未払利息	-	120
流動負債合計	11,984,692	302,753,475
負債合計	11,984,692	302,753,475
純資産の部		
元本等		
元本	25,981,130,487	24,527,968,243
剰余金		
剰余金又は欠損金()	8,759,891,994	10,198,534,968
元本等合計	34,741,022,481	34,726,503,211
純資産合計	34,741,022,481	34,726,503,211
負債純資産合計	34,753,007,173	35,029,256,686

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

（貸借対照表に関する注記）

		平成27年11月 6日現在	平成28年 5月 6日現在
1.	期首	平成26年11月 7日	平成27年11月 7日
	期首元本額	26,334,764,871円	25,981,130,487円
	期首からの追加設定元本額	2,296,184,953円	1,068,670,222円
	期首からの一部解約元本額	2,649,819,337円	2,521,832,466円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	774,362,827円	780,411,307円
	DCインデックスバランス（株式40）	1,004,200,115円	964,437,201円
	DCインデックスバランス（株式60）	711,422,777円	663,882,448円
	DCインデックスバランス（株式80）	129,493,345円	112,131,322円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	1,453,229,784円	1,539,390,893円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	5,425,859,764円	4,732,587,853円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	4,785,949円	4,484,770円
	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（債券資産）	49,382,817円	- 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	5,194,004円	4,457,615円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	28,565,870円	24,415,465円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	113,561,274円	100,105,866円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	399,836,338円	388,141,755円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	6,647,988,644円	5,897,493,130円
	世界アセットバランスファンド40（適格機関投資家向け）	47,033,167円	37,774,109円
	世界アセットバランスファンド25（適格機関投資家向け）	146,657,163円	129,307,670円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	31,066,594円	26,830,551円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 20）	1,125,261,839円	1,094,336,109円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 40）	1,161,341,148円	1,099,669,084円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 60）	604,250,232円	557,503,236円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 80）	92,713,905円	81,618,634円
インデックスファンド日本債券（1年決算型）	5,828,941,399円	6,083,247,952円
日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	195,981,532円	205,741,273円
計	25,981,130,487円	24,527,968,243円
2. 受益権の総数	25,981,130,487口	24,527,968,243口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成27年11月 6日現在	平成28年 5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

（1口当たり情報）

平成27年11月 6日現在	平成28年 5月 6日現在
---------------	---------------

1口当たり純資産額	1.3372円	1口当たり純資産額	1.4158円
(1万口当たり純資産額)	(13,372円)	(1万口当たり純資産額)	(14,158円)

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成27年11月 6日現在	平成28年 5月 6日現在
資産の部		
流動資産		
預金	63,615,687	211,481,903
コール・ローン	281,866,261	103,191,887
国債証券	179,970,237,594	161,319,220,368
派生商品評価勘定	-	731,695
未収入金	-	2,669,156,870
未収利息	1,901,055,289	1,582,672,975
前払費用	37,793,735	40,384,646
流動資産合計	182,254,568,566	165,926,840,344
資産合計	182,254,568,566	165,926,840,344
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	3,796,353
未払金	-	2,611,292,904
未払解約金	118,043,382	61,108,519
未払利息	-	222
流動負債合計	118,043,382	2,676,197,998
負債合計	118,043,382	2,676,197,998
純資産の部		
元本等		
元本	78,349,209,668	75,827,259,653
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	103,787,315,516	87,423,382,693
元本等合計	182,136,525,184	163,250,642,346
純資産合計	182,136,525,184	163,250,642,346
負債純資産合計	182,254,568,566	165,926,840,344

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) 金融商品取引所等の上場されている有価証券 金融商品取引所等の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) 金融商品取引所等の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</p>
--------------------	--

	適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

		平成27年11月 6日現在	平成28年 5月 6日現在
1.	期首	平成26年11月 7日	平成27年11月 7日
	期首元本額	94,218,596,068円	78,349,209,668円
	期首からの追加設定元本額	1,399,091,607円	1,844,215,653円
	期首からの一部解約元本額	17,268,478,007円	4,366,165,668円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外債券ヘッジなし（DC専用）	10,717,455,388円	11,011,068,929円
	DCインデックスバランス（株式20）	68,269,726円	77,492,945円
	DCインデックスバランス（株式40）	128,006,703円	136,976,504円
	DCインデックスバランス（株式60）	162,708,003円	169,724,347円
	DCインデックスバランス（株式80）	148,356,986円	143,565,133円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	24,031,777,382円	24,148,845,264円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	3,090,679,030円	2,903,768,118円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	30,458,219,011円	28,422,515,606円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	24,372,969円	25,515,300円
	日興外国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,006,770,053円	999,552,958円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	151,321,244円	180,064,525円
	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（債券資産）	18,308,969円	- 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	2,967,711円	2,812,221円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	3,257,531円	3,065,842円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	7,176,948円	6,919,704円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	17,570,570円	18,911,706円
	世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	864,356,054円	551,482,598円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,261,792,428円	1,222,259,589円
	世界アセットバランスファンド40（適格機関投資家向け）	37,804,015円	34,172,540円
	世界アセットバランスファンド25（適格機関投資家向け）	96,229,066円	95,483,976円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	40,477,070円	38,726,734円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	49,540,456円	54,276,448円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	73,772,934円	78,028,922円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	69,086,349円	70,696,430円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	53,051,962円	51,755,282円
インデックスファンド海外債券（ヘッジなし）1年決算型	5,526,425,452円	5,139,625,972円
海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	239,455,658円	239,952,060円
計	78,349,209,668円	75,827,259,653円
2. 受益権の総数	78,349,209,668口	75,827,259,653口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成27年11月 6日現在	平成28年 5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 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（平成27年11月 6日現在）

該当事項はありません。

（平成28年 5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	347,121,623	-	344,614,903	2,506,720	
	米ドル	64,533,941	-	65,127,962	594,021	
	加ドル	95,342,700	-	93,646,970	1,695,730	
	メキシコペソ	16,515,005	-	15,963,350	551,655	
	英ポンド	69,215,300	-	69,175,250	40,050	
	スウェーデンクローナ	9,945,750	-	9,930,000	15,750	
	ノルウェークローネ	6,411,700	-	6,358,350	53,350	
	デンマーククローネ	8,202,000	-	8,220,000	18,000	
	豪ドル	45,382,400	-	44,878,400	504,000	
	マレーシアリングット	25,471,737	-	25,471,071	666	
	南アフリカランド	6,101,090	-	5,843,550	257,540	
	売建	371,843,023	-	372,400,961	557,938	
	米ドル	37,583,000	-	37,579,500	3,500	
	ユーロ	295,996,900	-	296,674,500	677,600	
	スウェーデンクローナ	44,465	-	44,465	-	
	デンマーククローネ	43,776	-	43,776	-	
	シンガポールドル	38,174,882	-	38,058,720	116,162	
	合計		718,964,646	-	717,015,864	3,064,658

（注）1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

平成27年11月 6日現在		平成28年 5月 6日現在	
1口当たり純資産額	2.3247円	1口当たり純資産額	2.1529円
(1万口当たり純資産額)	(23,247円)	(1万口当たり純資産額)	(21,529円)

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2016年 5月31日現在です。

【DCインデックスバランス(株式80)】

【純資産額計算書】

資産総額	3,248,279,377円
負債総額	2,471,229円
純資産総額(-)	3,245,808,148円
発行済口数	1,603,725,647口
1口当たり純資産額(/)	2.0239円

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	26,427,135,117円
負債総額	10,371,152円
純資産総額(-)	26,416,763,965円
発行済口数	22,351,503,231口
1口当たり純資産額(/)	1.1819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	72,535,387,959円
負債総額	81,072,595円
純資産総額（ - ）	72,454,315,364円
発行済口数	38,870,246,203口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8640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	34,622,187,583円
負債総額	115,221,793円
純資産総額（ - ）	34,506,965,790円
発行済口数	24,396,565,669口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4144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	166,519,332,198円
負債総額	158,076,878円
純資産総額（ - ）	166,361,255,320円
発行済口数	75,555,579,067口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2018円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

<更新後>

(1) 資本金の額

平成28年5月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（平成28年5月末現在）

・株主総会

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

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

・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。

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

・監査役会

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

(3) 運用の意思決定プロセス（平成28年5月末現在）

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

2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

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

・委託会社の運用する、平成28年5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	617	112,951
株式投資信託	565	91,186
単位型	120	4,334
追加型	445	86,851
公社債投資信託	52	21,765
単位型	38	505
追加型	14	21,260

3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第57期事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

<更新後>

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

有形固定資産合計	222	356
無形固定資産		
ソフトウェア	113	140
無形固定資産合計	113	140
投資その他の資産		
投資有価証券	14,184	12,195
関係会社株式	21,702	21,702
関係会社長期貸付金	60	60
長期差入保証金	740	781
長期前払費用	0	0
繰延税金資産	248	425
投資その他の資産合計	36,936	35,165
固定資産合計	37,273	35,662
資産合計	65,023	71,905

(単位：百万円)

	第56期 (平成27年3月31日)	第57期 (平成28年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	387	410
未払金	5,545	3,841
未払収益分配金	6	6
未払償還金	112	112
未払手数料	3 3,145	3 3,269
その他未払金	2,282	453
未払費用	3 4,636	3 4,920
未払法人税等	814	354
未払消費税等	4 1,070	4 649
関係会社短期借入金	-	5,631
賞与引当金	1,990	2,080
役員賞与引当金	120	145
その他	3 82	3 278
流動負債合計	14,646	18,312
固定負債		
退職給付引当金	1,111	1,154
固定負債合計	1,111	1,154
負債合計	15,758	19,466
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	25,836	29,948

利益剰余金合計	25,836	29,948
自己株式	68	502
株主資本合計	48,351	52,028
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,002	151
繰延ヘッジ損益	88	258
評価・換算差額等合計	913	410
純資産合計	49,265	52,438
負債純資産合計	65,023	71,905

(2) 【損益計算書】

< 更新後 >

	(単位：百万円)	
	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	63,990	66,339
その他営業収益	3,729	4,382
営業収益合計	67,719	70,722
営業費用		
支払手数料	30,408	30,529
広告宣伝費	1,045	1,098
公告費	5	3
調査費	15,571	17,470
調査費	747	821
委託調査費	14,782	16,600
図書費	41	48
委託計算費	502	505
営業雑経費	660	718
通信費	199	195
印刷費	263	321
協会費	64	65
諸会費	27	22
その他	106	113
営業費用計	48,193	50,327
一般管理費		
給料	7,585	8,138
役員報酬	289	365
役員賞与引当金繰入額	120	145
給料・手当	5,127	5,495
賞与	59	51
賞与引当金繰入額	1,990	2,080
交際費	163	185
寄付金	36	27
旅費交通費	503	503
租税公課	208	258
不動産賃借料	785	875
退職給付費用	349	372

退職金	16	113
固定資産減価償却費	148	196
福利費	908	952
諸経費	2,673	2,952
一般管理費計	13,380	14,577
営業利益	6,146	5,817

(単位：百万円)

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

（３）【株主資本等変動計算書】

< 更新後 >

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						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	22,694	22,694	68	45,209
会計方針の変更による 累積的影響額				41	41		41
会計方針の変更を反映した 当期首残高	17,363	5,220	5,220	22,735	22,735	68	45,250
当期変動額							
当期純利益				3,101	3,101		3,101
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	3,101	3,101	-	3,101
当期末残高	17,363	5,220	5,220	25,836	25,836	68	48,351

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

第57期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本剰余金	利益剰余金	

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

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

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1 資産の評価基準及び 評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法

	<p>その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p>				
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(2) 金銭の信託 時価法</p> <p>(3) デリバティブ 時価法</p> <p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>3年～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>5年～20年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	3年～15年	器具備品	5年～20年
建物	3年～15年				
器具備品	5年～20年				
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>				
4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>				
5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。</p>				

(会計方針の変更)

第57期
(自 平成27年4月1日
至 平成28年3月31日)

（企業結合に関する会計基準等の適用）

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

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

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

（未適用の会計基準等）

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

（1）概要

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

（分類1）から（分類5）に係る分類の要件をいずれも満たさない企業の取扱い

（分類2）及び（分類3）に係る分類の要件

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

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

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

（2）適用予定日

平成29年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

（貸借対照表関係）

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

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

(損益計算書関係)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第56期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

	新株予約権の目的となる株式の数(株)	当事業
--	--------------------	-----

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

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

該当事項はありません。

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

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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

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

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

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(リース取引関係)

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

(金融商品関係)

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

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

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

- (1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。
(2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

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

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(5) 未払金及び(6) 未払費用

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

(7) デリバティブ取引

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

当社は、原則、有価証券及び投資有価証券以外の為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベ - 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 - スで実施しております。さらに、外貨建ての関係会社短期借入金に関しては、為替変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。

流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

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

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

(1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金、(7) 未払費用並びに(8) 関係会社短期借入金

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

(9) デリバティブ取引

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

(有価証券関係)

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	18,809

関連会社株式	2,892
--------	-------

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	18,809
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

(デリバティブ取引関係)

第56期(平成27年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第57期(平成28年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

- (注) 1 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。
2 時価の算定方法
金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

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

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

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

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

(持分法損益等)

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

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

(退職給付関係)

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.6%

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、196百万円でありました。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.2%

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、209百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

（注） 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション（新株予約権）の数

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

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

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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション（新株予約権）の数

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

(税効果会計関係)

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

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

(関連当事者情報)

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 資金の貸付に係る取引金額184百万円(2,059千SGD)の内訳は、貸付424百万円(5,000千SGD)及び返済240百万円(2,940千SGD)であります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

資産合計	23,832百万円
負債合計	6,549百万円
純資産合計	17,283百万円
営業収益	15,406百万円
税引前当期純利益	4,977百万円
当期純利益	3,441百万円

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	292,000(千SGD)	アセットマネジメント業	直接100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貨建)(注1)	90(千SGD1,000)(注2)	関係会社短期貸付金	333(千SGD4,000)
							貸付金利息(シンガポールドル貨建)(注1)	18(千SGD215)	未収収益	6(千SGD74)
							資金の貸付(円貨建)(注3)	5,000	関係会社短期貸付金	5,000
							貸付金利息(円貨建)(注3)	70	未収収益	70
	Nikko Asset	アメリカ	181,542	アセット	直接	資金の借入	資金の借入(米ドル貨建)(注5)	6,176(千USD50,000)	関係会社短期借入金	5,631(千USD50,000)

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

(セグメント情報等)

セグメント情報

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

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

関連情報

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<更新後>

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (平成28年3月末現在)	事業の内容

野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
------------	-----------	---

<更新後>

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (平成28年3月末現在)	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社 S B I 証券	47,937百万円	
損保ジャパン日本興亜 D C 証券株式会社	3,000百万円	
株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
日本生命保険相互会社	200,000百万円 (基金の総額)	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

3【資本関係】

<更新後>

(2) 販売会社

三井住友信託銀行株式会社は、日興アセットマネジメント株式会社の発行済株式総数の91.29%を保有しております。(平成28年3月末現在)

独立監査人の中間監査報告書

平成28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

P w C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80）の平成27年11月7日から平成28年5月6日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCインデックスバランス（株式80）の平成28年5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中間計算期間（平成27年11月7日から平成28年5月6日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. 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。

独立監査人の監査報告書

平成28年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。