

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成27年9月25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】	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】**（１）【ファンドの名称】**

全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型（以下「ファンド」といいます。）
・愛称として「ワールドクルーズ」という名称を用いることがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

（５）【申込手数料】

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社または「（８）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

- ・販売会社における申込手数料率は3.24%（税抜3%）が上限となっております。

（６）【申込単位】

販売会社または「（８）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

（７）【申込期間】

平成27年 9月26日から平成28年 9月27日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

（ 9 ） 【 払込期日 】

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

（ 1 0 ） 【 払込取扱場所 】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

（ 1 1 ） 【 振替機関に関する事項 】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

（ 1 2 ） 【 その他 】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

各地域のGDP比率をもとに株式および債券に投資を行ない、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざします。

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		
	日々			
不動産投信		中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
	その他 ()			
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)		
		エマージング		
資産複合 ()				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

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

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

年12回(毎月)

目論見書または投資信託約款において、年12回(毎月)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 日本、海外先進国および新興国の経済規模に応じた資産配分を行ないます。

- 日本、海外先進国および新興国への資産配分比率は、各地域のGDP比率に基づいて決定し、年に一度（原則として6月）見直しを行ないます。
 - 各地域の経済成長度合いを反映した資産配分により、世界経済全体の成長ペースにあわせた資産の長期的な成長をめざします。
- ※当ファンドでは海外先進国をIMFの定義する先進国から日本を除いたものと定義し、新興国を日本と海外先進国以外の国と定義しています。

2 資産の安定成長をめざすため、株式と債券に分散投資を行ないます。

- 分散投資効果を勘案し、「株式」と「債券」の資産配分は50%ずつを基本とします。
 - 各資産への投資は、各資産を主要投資対象とするマザーファンドを通じて行ないます。
- ※各マザーファンドは各市場全体の値動きを表す指数に連動する投資成果をめざす運用（インデックス運用）を行ないます。

3 毎月安定的な分配を行なうことをめざします。

- インカム収益などを原資として、毎月の決算時に、安定した分配を行なうことをめざします。
- 年4回（3月、6月、9月および12月）の決算時には、基準価額水準などを勘案し、上記安定分配相当額に加えて、キャピタル収益などを積極的に分配する場合があります。

※分配金額は収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により分配金額を変更する場合や分配を行なわない場合もあります。

※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。

1 日本・海外先進国・新興国の経済規模に応じた資産配分を行ないます。

各地域の資産配分比率は各地域のGDP比率に基づいて決定します。



【各地域のGDP比率】
 (IMFの2014年予想の値をもとに日興アセットマネジメントが作成。)
 ※端数処理の関係で合計が100%にならない場合があります。

2 資産の安定成長をめざすため、株式と債券に分散投資を行ないます。

分散投資効果を勘案し、「株式」と「債券」の資産配分比率は50%ずつを基本とします。

【株式部分:50%】

【債券部分:50%】



【ワールドクルーズの資産配分比率】

- 上記は2015年7月現在の目標とする資産配分比率であり、将来変更になる場合があります。
- 各マザーファンドへの実際の資産配分比率は時価の影響などにより、必ずしも上記数値とは一致しません。

投資対象国・地域

日本および、海外先進国、新興国など計48の国や地域にグローバル分散投資を行ないます。



日本

海外先進国

- 【欧州】 アイルランド、イギリス、イタリア、オーストリア、オランダ、スイス、スウェーデン、スペイン、デンマーク、ドイツ、ノルウェー、フィンランド、フランス、ベルギー、ポルトガル
 - 【中東】 イスラエル
 - 【北米】 アメリカ、カナダ
 - 【アジア】 シンガポール、香港
 - 【オセアニア】 オーストラリア、ニュージーランド
- (22の国と地域)

新興国

- 【欧州】 チェコ、ハンガリー、ポーランド、ルーマニア、ギリシャ
 - 【中東・ロシア】 トルク、ロシア、カタール、アラブ首長国連邦
 - 【北米・南米】 メキシコ、コロンビア、チリ、ブラジル、ペルー
 - 【アジア】 インド、インドネシア、タイ、フィリピン、マレーシア、韓国、台湾、中国
 - 【アフリカ】 エジプト、ナイジェリア、南アフリカ
- (25の国と地域)

- 上図は2015年7月末現在の当ファンドが連動をめざす各指数をもとに作成した投資対象国・地域であり、将来変更になる可能性があります。

(参考)グローバル分散投資の意義 ～ワールドクルーズのめざすもの～

世界の経済成長に伴なう

- ① 株価の長期的な上昇が期待できます。
- ② 相対的に高い利子収入が期待できます。
- ③ 通貨価値の上昇による為替差益の獲得が期待できます。

(参考)世界経済は力強い成長を続けており、新興国の比率も高まっています。

世界のGDPと日本・海外先進国・新興国の割合



- 上記比率は四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
- IMFの地域定義とデータをもとに日興アセットマネジメントが作成。
- 上記グラフデータは過去のものおよび予想値であり将来の運用成果等を約束するものではありません。

(参考)世界経済の成長を牽引していくのは、BRICsなどの新興国となることが予想されています。

新興国とは

経済が初期・中期の成長過程にあり、今後も高い経済成長が期待される国・地域をいいます。

BRICsとは

新興国の中でも経済発展が著しい、ブラジル・ロシア・インド・中国(Brazil, Russia, India, China)の頭文字を合わせた4カ国の総称です。

いずれの国も2050年までには、米国に並ぶ経済大国になることが予想されています。

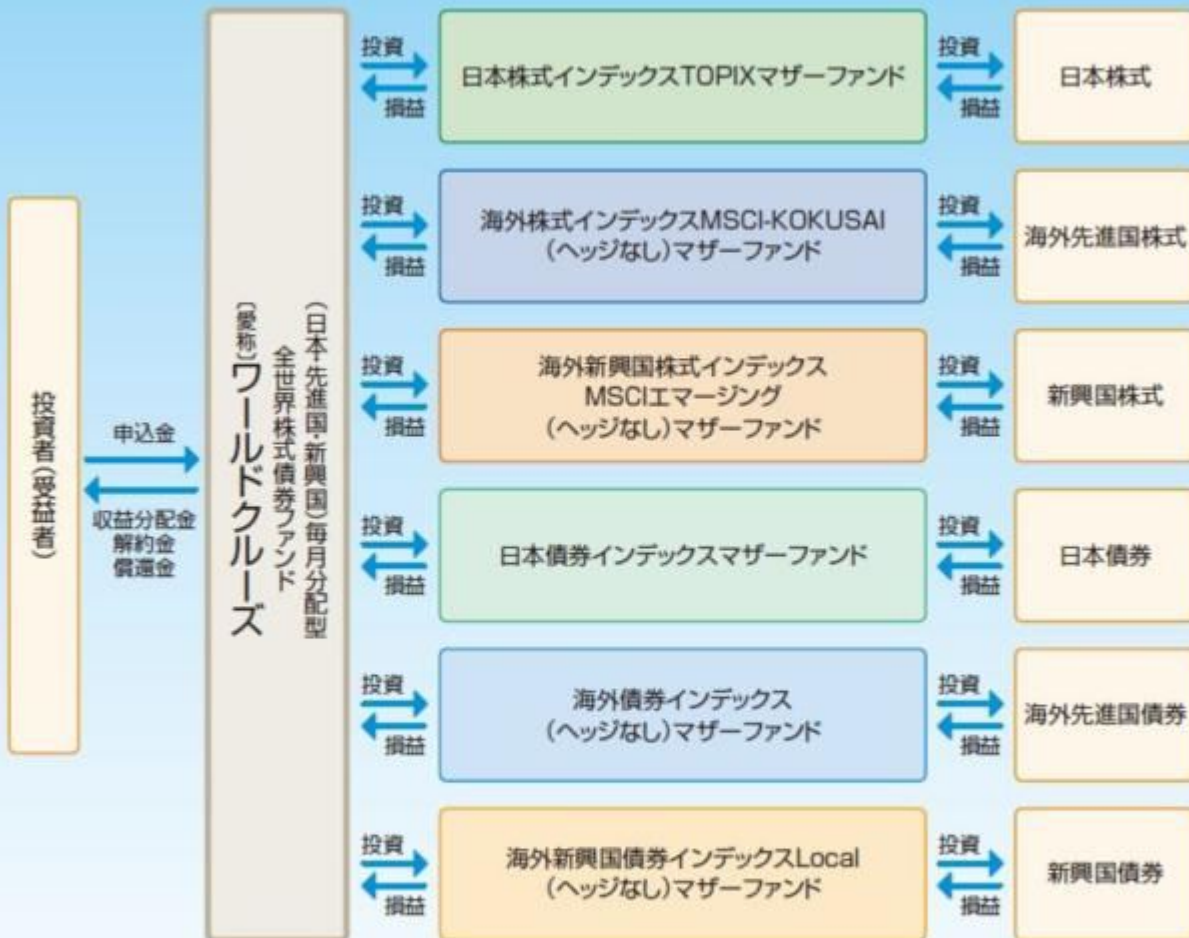
【各国GDP規模の順位】

	1位	2位	3位	4位	5位	6位
	アメリカ	日本	ドイツ	イギリス	フランス	中国
2000年						
2005年						
2010年						
2050年 ゴールドマン サックス予想						

- 上記はIMFの過去のデータおよびゴールドマンサックスグループ インクの予想であり将来の運用成果等を約束するものではありません。

ファンドの仕組み

当ファンドは、主にマザーファンドに投資するファミリーファンド方式で運用を行ないます。



(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には、制限を設けません。

(分配方針) ・毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として安定した分配を継続的に行なうことをめざします。ただし、基準価額水準などを勘案し、上記安定分配相当額のほか、委託会社が決定する金額を付加して分配を行なう場合があります。

※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。

収益分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

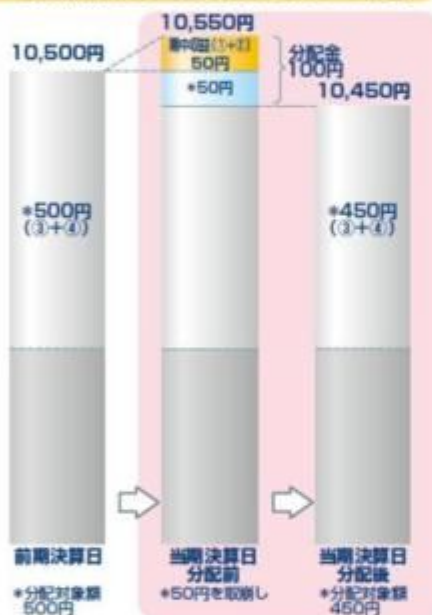
投資信託で分配金が支払われるイメージ



- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算から基準価額が上昇した場合



前期決算から基準価額が下落した場合



(注)分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※上記はイメージであり、将来の分配金の支払いおよび金額ならびに基準価額について示唆、保証するものではありません。

- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり率が小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



※元本払戻金(特別分配金)は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金(特別分配金)部分は非課税扱いとなります。

- ・普通分配金：個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。
- ・元本払戻金：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、(特別分配金)元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

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。

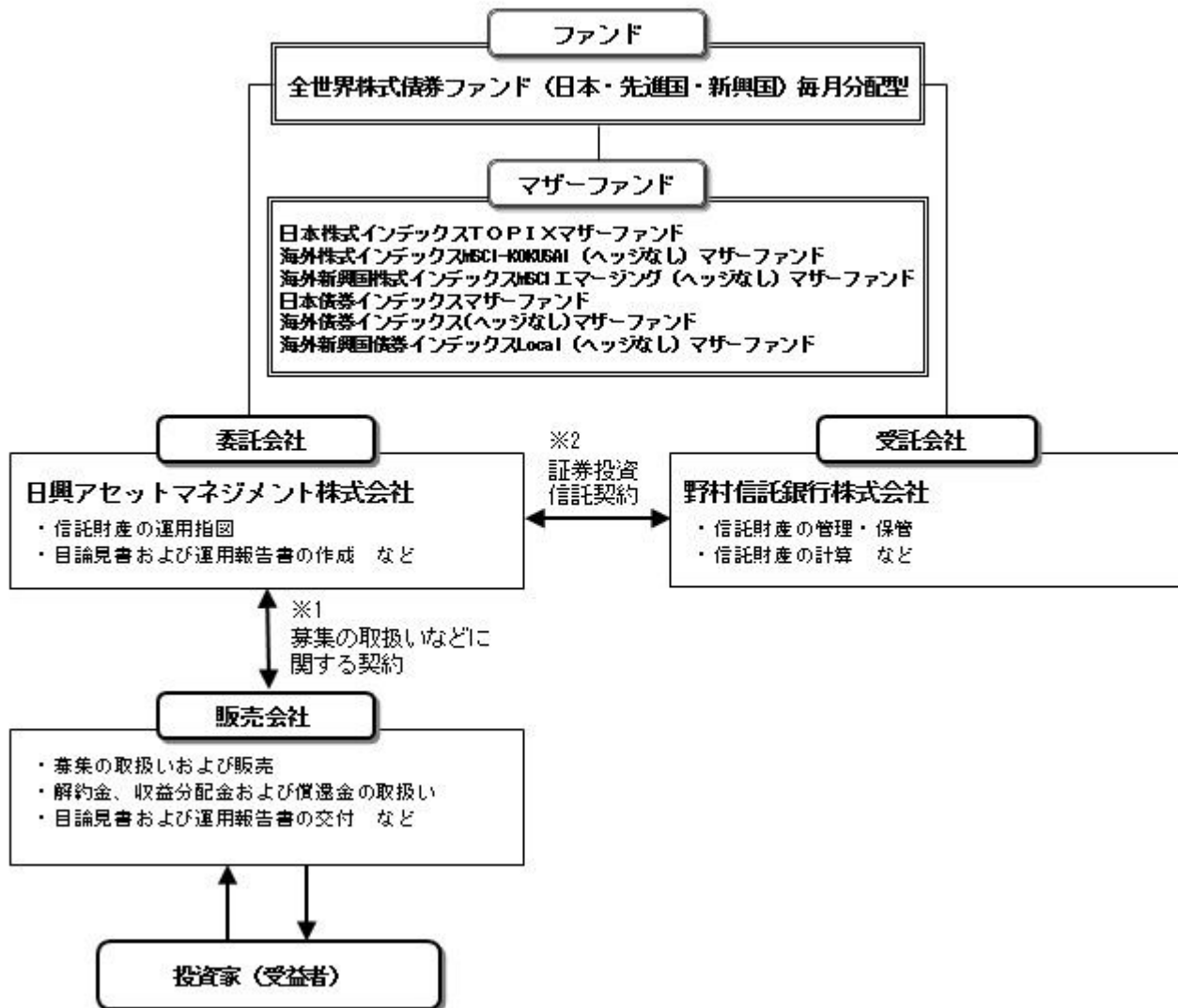
(2) 【ファンドの沿革】

平成20年3月31日

・ファンドの信託契約締結、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。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。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7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、「投資対象」に掲げる各マザーファンド受益証券に投資を行ない、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざします。各マザーファンド受益証券の合計組入比率は、高位を保つことを原則とします。
- ・各マザーファンド受益証券が実質的に保有する株式または債券の信託財産の純資産総額に対する割合は、50%を基本とします。
- ・各マザーファンド受益証券への投資比率は、日本、海外先進国、新興国のGDP比率をもとに決定します。なお、当該投資比率は各地域のGDP比率に基づいて、毎年見直すことを原則とします。
- ・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。

（２）【投資対象】

＜全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型＞

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 「海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（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」

証券投資信託 「海外新興国債券インデックスLocal（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。）
- 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」
- 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」
- 3) 証券投資信託「海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド」
- 4) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
- 5) 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」
- 6) 証券投資信託「海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド」
- 7) 株券または新株引受権証券
- 8) 国債証券
- 9) 地方債証券
- 10) 特別の法律により法人の発行する債券
- 11) 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。）
- 12) 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。）
- 13) コマーシャル・ペーパー
- 14) 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
- 15) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)～14)の証券または証書の性質を有するもの
- 16) 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。）
- 17) 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18)に定めるもの以外のもの

- 18) 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
- 19) 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。）
- 20) 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。
- 21) 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。）
- 22) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 23) 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。
- 24) 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
- 25) 外国の者に対する権利で24)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
- < 海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし)マザーファンド >
新興国の株式(DR(預託証券)およびカントリーファンドなどを含みます。)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17条、第18条および第19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。
- 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証券または証書で、1)～8)の証券または証書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

< 海外新興国債券インデックスLocal (ヘッジなし) マザーファンド >

新興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15条、第16条および第17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。

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人が発行する債券
- 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または証書で、1)～6)の証券または証書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	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成11年10月29日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

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

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカンントリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・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。

< 海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド >

運用の基本方針

基本方針	主として金融商品取引所に上場されている新興国の株式に投資し、MSCI エマージング・マーケット・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	新興国の株式（DR（預託証券）およびカントリーファンドなどを含みます。）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、新興国の株式（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 エマージング・マーケット・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、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。 ・ 投資信託証券への投資割合は、信託財産の総額の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18年5月17日設定）
決算日	毎年5月16日（休業日の場合は翌営業日）

* MSCI エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が発表している、世界の新興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。

< 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・マーケット・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。

< 海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル・ディバースファイド（円ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。
主な投資対象	新興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、新興国の現地通貨建債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル・ディバースファイド（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。なお、新興国の現地通貨建債券の騰落率に償還価額などが連動する債券を活用することもあります。 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いません。 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、新株予約権証券および新株引受権付社債券を含みます。）への投資は行いません。 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	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）

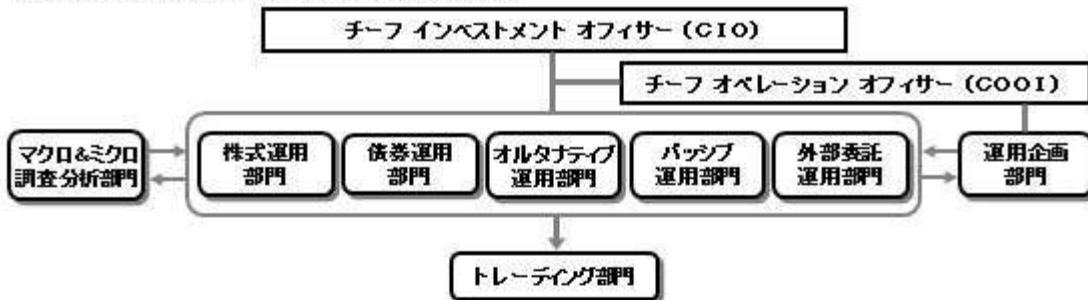
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
	受託会社	野村信託銀行株式会社
	信託期間	無期限(平成20年3月31日設定)
	決算日	毎年5月16日(休業日の場合は翌営業日)

* J P モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル・ディパーシファイドは、J P モルガンが発表している、エマージング・カントリーの債券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。

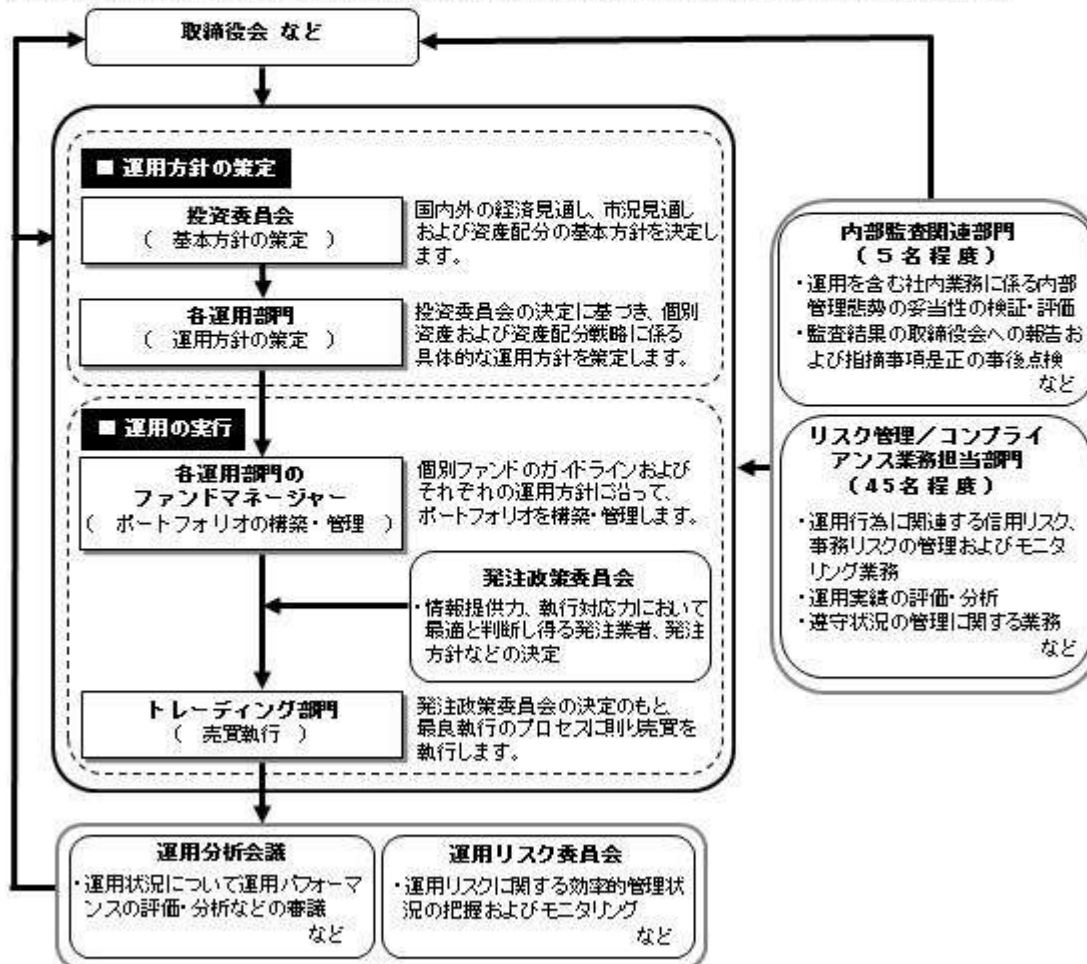
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はJPMorgan Chase & Co.に帰属します。また、JPMorgan Chase & Co.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

(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7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、委託会社が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。ただし、基準価額水準などを勘案し、上記安定分配相当額のほか、委託会社が決定する金額を付加して分配を行なう場合があります。

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ないます。

収益分配金の支払い

< 分配金再投資コース >

原則として、収益分配金は税金を差し引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。

< 分配金受取りコース >

毎計算期間終了日後 1 ヶ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して 5 営業日まで）から収益分配金を支払います。支払いは販売会社において行なわれます。

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

< 全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型 >

- 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。以下同じ。）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。また、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、投資することを指図することができます。
- 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には、制限を設けません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として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を超えないものとします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入

れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

- 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 15) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て(解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
 - イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
 - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
- ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の範囲内
 - ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
 - ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。
- 16) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

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

てはこの限りではありません。

- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
 - 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- < 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド >
- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。
 - 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
 - 3) 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
 - 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
 - 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
 - 7) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
 - 8) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
 - 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - 10) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
 - 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入

れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

- 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
 - 15) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- < 海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(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。以下同じ。)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。また、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、投資することを指図することができます。
 - 3) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。
 - 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
 - 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
 - 7) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
 - 8) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
 - 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - 10) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
 - 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属す

る外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

- 15) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

< 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。

< 海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド >

- 1) 株式（新株引受権証券、新株予約権証券および新株引受権付社債券を含みます。）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。基準価額変動リスクの大きいファンドですので、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。

- ・ 投資者の皆様の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)の皆様に帰属します。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。
- ・ 一般に新興国の株式および債券は、先進国の株式および債券に比べて価格変動が大きくなる傾向があり、基準価額にも大きな影響を与える場合があります。

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。
- ・ 一般に新興国の株式および債券は、先進国の株式および債券に比べて市場規模や取引量が少ないため、流動性リスクが高まる場合があります。

信用リスク

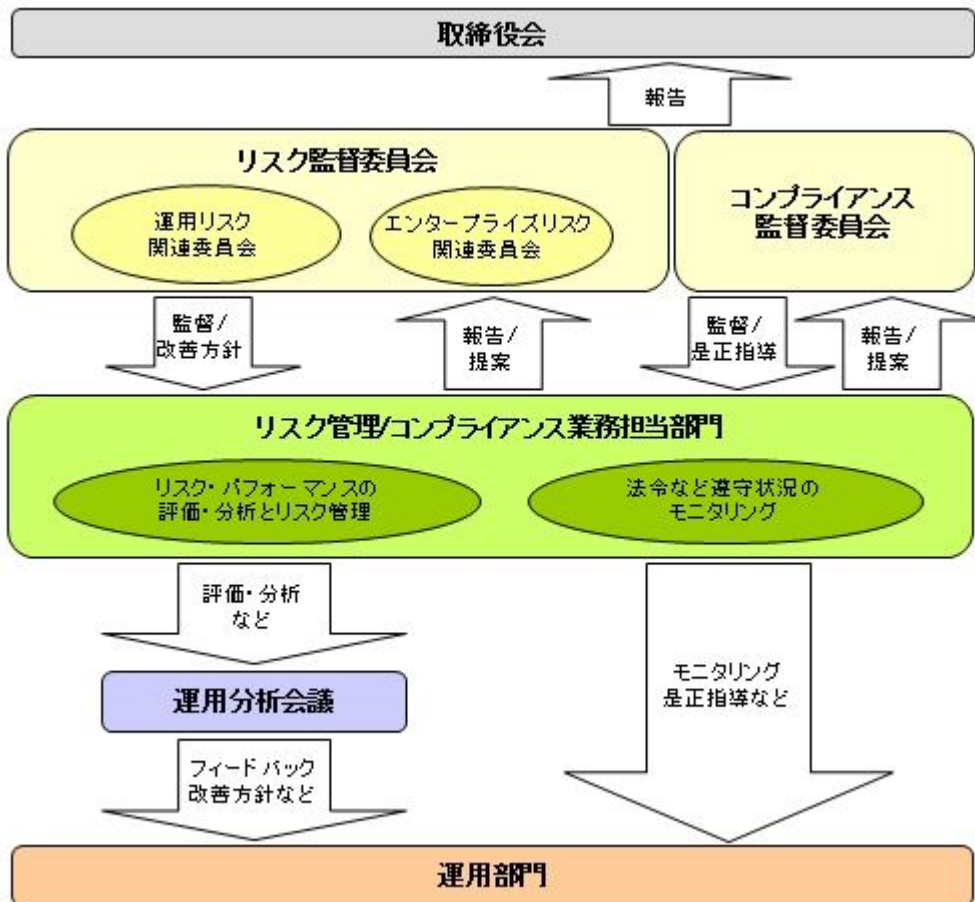
- ・ 一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト(債務不履行)や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落(価格がゼロになることもあります。)し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れや廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・ 一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト(債務不履行)が生じた場合またはそれが予想される場合には、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。
- ・ 一般に新興国の債券は、先進国の債券に比べて利回りが高い反面、価格変動が大きく、デフォルトが生じるリスクが高まる場合があります。

- ・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。
- ・一般に新興国の通貨は、先進国の通貨に比べて為替変動が大きくなる場合があります。
カントリー・リスク
- ・投資対象国における非常事態など(金融危機、財政上の理由による国自体のデフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など)を含む市況動向や資金動向などによっては、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあり、投資方針に従った運用ができない場合があります。
- ・一般に新興国は、情報の開示などが先進国に比べて充分でない、あるいは正確な情報の入手が遅延する場合があります。
- ・ファンドの投資対象資産が上場または取引されている諸国の税制は各国によって異なります。また、それらの諸国における税制が一時的に変更されたり、新たな税制が適用されたりすることもあります。以上のような要因は、ファンドの信託財産の価値に影響を与える可能性があります。

<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。

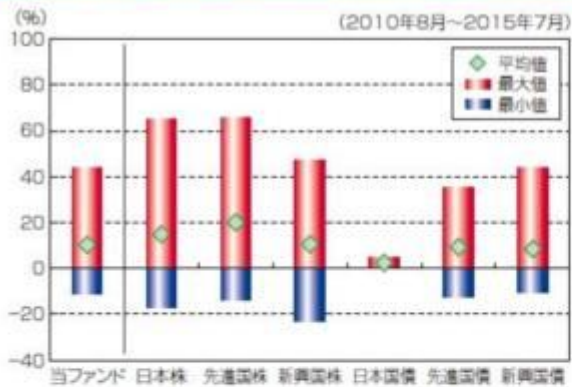
法令など遵守状況のモニタリング

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7月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	10.3%	14.9%	20.1%	10.6%	2.4%	9.3%	8.5%
最大値	43.6%	65.0%	65.7%	47.4%	4.5%	34.9%	43.7%
最小値	-11.4%	-17.0%	-13.6%	-22.8%	0.4%	-12.7%	-10.1%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2010年8月から2015年7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)を再投資したもとして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)

※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8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)を再投資したもとして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-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・ティパーシファイド(円ヘッジなし、円ベース)

Index LLC に帰属します。

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

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

4【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、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。

- ・販売会社における申込手数料率は3.24%（税抜3%）が上限となっております。
- ・申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
- ・＜分配金再投資コース＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
- ・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

（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

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.2%の率を乗じて得た額（1口当たり）が差し引かれます。

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

（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1.134%（税抜1.05%）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
1.05%	0.50%	0.50%	0.05%

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】

以下の諸費用およびそれに付随する消費税等相当額について、委託会社は、その支払いをファンドのために行ない、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、支払金額の支弁を信託財産から受けることができます。（以下「実費方式」といいます。）また、実際に支払う金額の支弁を受ける代わりに、その金額をあらかじめ合理的に見積もった上で、見積額に基づいて見積率を算出し、かかる見積率を信託財産の純資産総額に乗じて得た額をかかるとする諸費用の合計額とみなして、信託財産から支弁を受けることができます。（以下「見積方式」といいます。）ただし、委託会社は、信託財産の規模などを考慮して、信託の設定時または期中に、かかる諸費用の見積率を見直し、年率0.1%を上限として、これを変更することができます。委託会社は、実費方式または見積方式のいずれを用いるかについて、信託期間を通じて随時、見直すことができます。これら諸費用は、委託会社が定めた時期に、信託財産から支払います。

振替受益権に係る費用ならびにやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合における発行および管理事務に係る費用。

有価証券届出書、有価証券報告書および臨時報告書（これらの訂正に係る書類を含みます。）の作成、印刷および提出に係る費用。

目論見書および仮目論見書（これらの訂正事項分を含みます。）の作成、印刷および交付に係る費用（これらを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。

信託約款の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。

運用報告書の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。

ファンドの受益者に対して行なう公告に係る費用ならびに信託約款の変更または信託契約の解約に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用。

格付の取得に要する費用。

ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。

信託財産に関する以下の費用・報酬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。

有価証券の貸付を行なった場合に限り、その対価としての品貸料（マザーファンド（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるもの）に限り、）における品貸料については、他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）に0.54（税抜0.5）を乗じて得た貸付有価証券関連報酬。委託会社と受託会社の配分は4：1とし、信託報酬と同時期に支払います。

< 投資対象とするマザーファンドに係る費用 >

- ・ 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

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。

* 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。

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および上場株式等の配当等（申告分離課税を選択したものに限ります。）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）および普通分配金（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

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

<平成28年1月1日以降>

確定申告等により、解約時および償還時の差損（譲渡損失）については、上場株式等の譲渡益、上場株式等の配当等および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）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。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。

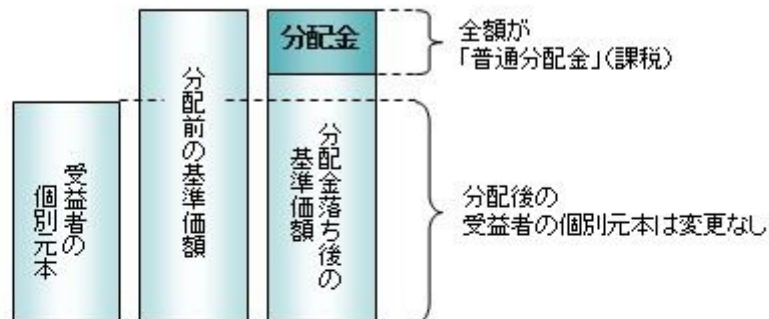
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

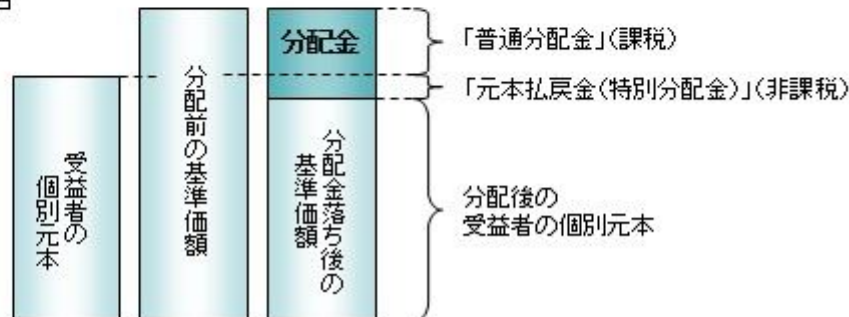
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
- イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
- ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
- ハ) 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27年 9月25日現在のものですので、税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】

【全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型】

以下の運用状況は2015年 7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	226,345,718	98.69

コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		3,007,496	1.31
合計（純資産総額）		229,353,214	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	海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	26,253,426	2.3664	62,126,107	2.3728	62,294,129	27.16
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOUSA I（ヘッジなし）マザーファンド	28,976,749	2.1040	60,967,079	2.1317	61,769,735	26.93
日本	親投資信託受益証券	海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド	34,194,338	1.3159	44,996,329	1.3124	44,876,649	19.57
日本	親投資信託受益証券	海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド	27,684,160	1.5971	44,214,371	1.5770	43,657,920	19.04
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	5,182,667	1.3276	6,880,508	1.3280	6,882,581	3.00
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	4,925,525	1.3754	6,774,567	1.3937	6,864,704	2.99

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	98.69
合計	98.69

【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1特定期間末（2008年6月25日）	71	72	1.0477	1.0577
第2特定期間末（2008年12月25日）	136	137	0.6665	0.6715

第3特定期間末	(2009年 6月25日)	207	208	0.7365	0.7395
第4特定期間末	(2009年12月25日)	245	246	0.7965	0.7995
第5特定期間末	(2010年 6月25日)	251	252	0.7402	0.7422
第6特定期間末	(2010年12月27日)	261	261	0.7528	0.7548
第7特定期間末	(2011年 6月27日)	268	269	0.7427	0.7447
第8特定期間末	(2011年12月26日)	254	254	0.6637	0.6657
第9特定期間末	(2012年 6月25日)	264	265	0.6832	0.6852
第10特定期間末	(2012年12月25日)	277	278	0.7710	0.7730
第11特定期間末	(2013年 6月25日)	290	291	0.8368	0.8388
第12特定期間末	(2013年12月25日)	254	255	0.9506	0.9526
第13特定期間末	(2014年 6月25日)	243	244	0.9635	0.9655
第14特定期間末	(2014年12月25日)	251	252	1.0636	1.0656
第15特定期間末	(2015年 6月25日)	241	241	1.0808	1.0828
	2014年 7月末日	244		0.9765	
	8月末日	247		0.9861	
	9月末日	249		0.9964	
	10月末日	248		0.9966	
	11月末日	258		1.0796	
	12月末日	253		1.0671	
	2015年 1月末日	246		1.0412	
	2月末日	251		1.0612	
	3月末日	244		1.0492	
	4月末日	248		1.0714	
	5月末日	252		1.0889	
	6月末日	234		1.0518	
	7月末日	229		1.0472	

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間末の分配金を加算した金額です。

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	2008年 3月31日～2008年 6月25日	0.0100
第2特定期間	2008年 6月26日～2008年12月25日	0.0300
第3特定期間	2008年12月26日～2009年 6月25日	0.0220
第4特定期間	2009年 6月26日～2009年12月25日	0.0180
第5特定期間	2009年12月26日～2010年 6月25日	0.0140
第6特定期間	2010年 6月26日～2010年12月27日	0.0120
第7特定期間	2010年12月28日～2011年 6月27日	0.0120
第8特定期間	2011年 6月28日～2011年12月26日	0.0120
第9特定期間	2011年12月27日～2012年 6月25日	0.0120
第10特定期間	2012年 6月26日～2012年12月25日	0.0120

第11特定期間	2012年12月26日～2013年 6月25日	0.0120
第12特定期間	2013年 6月26日～2013年12月25日	0.0120
第13特定期間	2013年12月26日～2014年 6月25日	0.0120
第14特定期間	2014年 6月26日～2014年12月25日	0.0120
第15特定期間	2014年12月26日～2015年 6月25日	0.0120

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1特定期間	2008年 3月31日～2008年 6月25日	5.77
第2特定期間	2008年 6月26日～2008年12月25日	33.52
第3特定期間	2008年12月26日～2009年 6月25日	13.80
第4特定期間	2009年 6月26日～2009年12月25日	10.59
第5特定期間	2009年12月26日～2010年 6月25日	5.31
第6特定期間	2010年 6月26日～2010年12月27日	3.32
第7特定期間	2010年12月28日～2011年 6月27日	0.25
第8特定期間	2011年 6月28日～2011年12月26日	9.02
第9特定期間	2011年12月27日～2012年 6月25日	4.75
第10特定期間	2012年 6月26日～2012年12月25日	14.61
第11特定期間	2012年12月26日～2013年 6月25日	10.09
第12特定期間	2013年 6月26日～2013年12月25日	15.03
第13特定期間	2013年12月26日～2014年 6月25日	2.62
第14特定期間	2014年 6月26日～2014年12月25日	11.63
第15特定期間	2014年12月26日～2015年 6月25日	2.75

(注)各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落ち）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（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1特定期間	2008年 3月31日～2008年 6月25日	68,627,181	492,248
第2特定期間	2008年 6月26日～2008年12月25日	150,398,994	13,045,092
第3特定期間	2008年12月26日～2009年 6月25日	79,936,680	3,811,962
第4特定期間	2009年 6月26日～2009年12月25日	41,895,256	15,332,859
第5特定期間	2009年12月26日～2010年 6月25日	48,450,268	16,434,622
第6特定期間	2010年 6月26日～2010年12月27日	27,295,398	20,486,733
第7特定期間	2010年12月28日～2011年 6月27日	28,082,441	13,729,140
第8特定期間	2011年 6月28日～2011年12月26日	49,606,430	28,118,385
第9特定期間	2011年12月27日～2012年 6月25日	30,543,945	26,331,654
第10特定期間	2012年 6月26日～2012年12月25日	22,027,047	48,957,699

第11特定期間	2012年12月26日～2013年 6月25日	28,054,964	40,966,320
第12特定期間	2013年 6月26日～2013年12月25日	14,911,733	94,240,960
第13特定期間	2013年12月26日～2014年 6月25日	11,094,896	26,074,445
第14特定期間	2014年 6月26日～2014年12月25日	9,306,266	25,282,765
第15特定期間	2014年12月26日～2015年 6月25日	9,511,934	23,402,537

(注)第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(参考)

日本株式インデックストップIXマザーファンド

以下の運用状況は2015年 7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	28,954,074,650	99.59
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		120,168,296	0.41
合計(純資産総額)		29,074,242,946	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	116,200,000	0.40

(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	164,100	6,202.21	1,017,782,661	8,253.00	1,354,317,300	4.66
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	941,800	588.60	554,343,480	900.00	847,620,000	2.92
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	88,800	4,021.80	357,135,840	5,544.00	492,307,200	1.69
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,644,800	190.62	313,541,570	267.90	440,641,920	1.52
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	91,900	3,228.41	296,690,879	4,763.50	437,765,650	1.51
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	62,100	7,438.02	461,901,042	6,881.00	427,310,100	1.47
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	107,000	3,332.70	356,598,900	3,979.50	425,806,500	1.46

日本	株式	日本たばこ産業	食料品	78,700	3,634.70	286,051,082	4,813.50	378,822,450	1.30
日本	株式	KDDI	情報・通信業	119,200	2,261.40	269,558,880	3,150.50	375,539,600	1.29
日本	株式	ソニー	電気機器	83,600	2,039.43	170,496,348	3,533.00	295,358,800	1.02
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	46,700	4,584.40	214,091,480	6,240.00	291,408,000	1.00
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	49,100	3,993.51	196,081,341	5,724.00	281,048,400	0.97
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	21,800	8,289.67	180,714,806	12,250.00	267,050,000	0.92
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	139,500	1,627.16	226,988,820	1,867.00	260,446,500	0.90
日本	株式	ファナック	電気機器	12,400	17,925.00	222,270,000	20,680.00	256,432,000	0.88
日本	株式	キヤノン	電気機器	64,000	3,278.81	209,843,840	3,972.00	254,208,000	0.87
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	47,500	3,260.36	154,867,100	5,165.00	245,337,500	0.84
日本	株式	三菱商事	卸売業	89,900	2,046.16	183,949,784	2,679.50	240,887,050	0.83
日本	株式	三菱地所	不動産業	87,000	2,333.29	202,996,230	2,755.00	239,685,000	0.82
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	90,500	1,741.54	157,609,370	2,614.50	236,612,250	0.81
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	10,700	14,970.00	160,179,000	21,720.00	232,404,000	0.80
日本	株式	村田製作所	電気機器	12,500	11,821.82	147,772,750	18,400.00	230,000,000	0.79
日本	株式	日立製作所	電気機器	285,000	804.85	229,382,250	804.40	229,254,000	0.79
日本	株式	三井不動産	不動産業	62,000	3,056.73	189,517,260	3,528.50	218,767,000	0.75
日本	株式	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	240,000	606.78	145,627,200	881.40	211,536,000	0.73
日本	株式	パナソニック	電気機器	144,900	1,222.85	177,190,965	1,457.00	211,119,300	0.73
日本	株式	花王	化学	33,500	4,170.60	139,715,100	6,291.00	210,748,500	0.72
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	166,900	946.52	157,974,188	1,198.50	200,029,650	0.69
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	42,000	3,615.05	151,832,340	4,678.00	196,476,000	0.68
日本	株式	第一生命保険	保険業	75,200	1,508.78	113,460,256	2,522.00	189,654,400	0.65

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	0.38
		建設業	2.61
		食料品	4.49
		繊維製品	0.73
		パルプ・紙	0.23
		化学	5.88
		医薬品	4.95
		石油・石炭製品	0.47
		ゴム製品	0.92
		ガラス・土石製品	0.94
		鉄鋼	1.28
		非鉄金属	0.91
		金属製品	0.58
機械	4.54		
電気機器	11.78		

	輸送用機器	10.97
	精密機器	1.42
	その他製品	1.59
	電気・ガス業	2.31
	陸運業	4.19
	海運業	0.27
	空運業	0.69
	倉庫・運輸関連業	0.21
	情報・通信業	7.01
	卸売業	4.04
	小売業	4.87
	銀行業	9.69
	証券、商品先物取引業	1.42
	保険業	2.77
	その他金融業	1.34
	不動産業	2.84
	サービス業	3.21
合 計		99.59

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2015年09月	買建		7日本円	114,638,780	116,200,000	0.40

(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 7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	48,479,900,024	57.87
	カナダ	2,979,796,306	3.56
	モーリシャス	3,758,144	0.00
	ドイツ	3,116,188,975	3.72
	イタリア	771,454,158	0.92

	フランス	3,141,815,071	3.75
	オランダ	1,357,803,088	1.62
	スペイン	1,235,726,112	1.48
	ベルギー	453,735,388	0.54
	オーストリア	60,797,022	0.07
	ルクセンブルク	118,657,705	0.14
	フィンランド	291,868,734	0.35
	アイルランド	1,415,071,903	1.69
	ポルトガル	53,132,256	0.06
	イギリス	6,566,567,489	7.84
	スイス	3,483,520,618	4.16
	スウェーデン	967,570,745	1.15
	ノルウェー	222,154,294	0.27
	デンマーク	605,390,694	0.72
	ケイマン	202,352,147	0.24
	オーストラリア	2,099,822,523	2.51
	バミューダ	166,291,999	0.20
	ニュージーランド	36,517,701	0.04
	香港	828,110,755	0.99
	シンガポール	531,978,664	0.64
	イスラエル	227,675,661	0.27
	ジャージー	427,200,352	0.51
	英ヴァージン諸島	23,719,524	0.03
	小計	79,868,578,052	95.34
投資証券	アメリカ	1,439,975,260	1.72
	カナダ	13,322,819	0.02
	フランス	108,650,033	0.13
	イギリス	119,880,000	0.14
	オーストラリア	225,476,916	0.27
	香港	37,398,400	0.04
	シンガポール	28,226,281	0.03
	小計	1,972,929,709	2.36
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,933,551,241	2.31
合計（純資産総額）		83,775,059,002	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	1,369,950,477	1.64
	買建	ドイツ	488,048,400	0.58

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		1,162,650,000	1.39

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	123,312	13,051.48	1,609,405,187	15,178.77	1,871,725,078	2.23
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	164,914	5,721.96	943,632,169	5,814.99	958,974,118	1.14
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	88,761	11,720.53	1,040,326,816	10,296.56	913,932,998	1.09
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	103,780	6,350.84	659,091,005	7,212.92	748,557,460	0.89
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	12,792.24	752,452,655	12,384.15	728,448,299	0.87
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	212,693	3,180.38	676,445,754	3,239.92	689,109,325	0.82
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	78,970	7,286.10	575,384,075	8,563.72	676,277,095	0.81
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	68,323	8,711.86	595,221,059	9,346.50	638,581,534	0.76
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	10,994.00	536,320,668	12,821.00	625,446,843	0.75
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	129,610	3,610.80	467,996,358	4,431.94	574,424,936	0.69
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	129,497	4,118.51	533,335,721	4,316.59	558,985,714	0.67
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	8,345	35,606.92	297,139,767	66,579.71	555,607,683	0.66
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	57,109	10,563.24	603,256,439	9,599.45	548,215,310	0.65
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	14,878	35,642.37	530,287,329	35,732.12	531,622,585	0.63
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	88,147	6,049.43	533,239,177	5,788.94	510,278,294	0.61
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	6,502	66,742.20	433,957,802	78,466.46	510,188,946	0.61
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	34,253	10,991.18	376,481,040	14,888.52	509,976,517	0.61
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	42,510	10,006.30	425,368,102	11,809.84	502,036,655	0.60
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	222,679	2,073.94	461,824,845	2,248.84	500,770,600	0.60

アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	6,040	68,085.55	411,236,758	82,432.02	497,889,415	0.59
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	64,377	6,425.27	413,639,736	7,303.47	470,175,823	0.56
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	13,732.46	432,490,360	14,624.31	460,578,208	0.55
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	39,751	14,377.47	571,519,064	11,539.44	458,704,327	0.55
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	406,751	1,216.73	494,909,235	1,116.34	454,073,322	0.54
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	87,642	5,088.12	445,933,083	5,031.06	440,932,371	0.53
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	60,153	7,145.94	429,849,994	7,258.82	436,639,848	0.52
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	24,480	17,311.02	423,773,829	17,719.11	433,763,911	0.52
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	27,980	11,782.55	329,676,017	14,445.69	404,190,641	0.48
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	19,932	20,104.40	400,720,964	19,965.47	397,951,915	0.48
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	41,492	6,620.01	274,677,654	9,474.17	393,102,477	0.47

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	7.26
		素材	4.55
		資本財	6.80
		商業・専門サービス	0.88
		運輸	1.88
		自動車・自動車部品	1.68
		耐久消費財・アパレル	1.79
		消費者サービス	1.76
		メディア	3.15
		小売	3.68
		食品・生活必需品小売り	2.14
		食品・飲料・タバコ	5.74
		家庭用品・パーソナル用品	2.07
		ヘルスケア機器・サービス	3.59
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10.48
		銀行	9.46
		各種金融	4.08
		保険	4.24
		不動産	0.65
ソフトウェア・サービス	7.51		
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.26		

		電気通信サービス	3.09
		公益事業	2.96
		半導体・半導体製造装置	1.63
投資証券			2.36
合計			97.69

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500 1509	買建	21	米ドル	10,868,675	1,348,150,447	11,044,425	1,369,950,477	1.64
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1509	買建	105	ユーロ	3,485,960	473,219,070	3,595,200	488,048,400	0.58

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	6,300,000.00	765,616,375	781,208,500	0.93
	ユーロ	買建	2,810,000.00	382,691,480	381,441,500	0.46

(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。

海外新興国株式インデックスMSCIEマージング(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2015年7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	メキシコ	442,829,247	4.35
	ブラジル	699,973,881	6.88
	チリ	120,311,751	1.18
	コロンビア	56,351,905	0.55
	ペルー	40,054,835	0.39
	トルコ	133,968,739	1.32
	チェコ	20,153,593	0.20
	ハンガリー	23,864,740	0.23
	ポーランド	146,972,768	1.45

	ロシア	375,785,448	3.70
	ケイマン	109,038,526	1.07
	バミューダ	80,756,480	0.79
	香港	591,783,867	5.82
	マレーシア	332,949,713	3.27
	タイ	220,372,792	2.17
	フィリピン	139,542,813	1.37
	インドネシア	234,426,983	2.31
	韓国	1,415,581,082	13.92
	台湾	1,222,953,138	12.03
	中国	1,601,927,431	15.75
	インド	826,647,229	8.13
	カタール	98,577,798	0.97
	エジプト	21,667,132	0.21
	南アフリカ	764,283,264	7.52
	アラブ首長国連邦	81,528,167	0.80
	小計	9,802,303,322	96.40
投資信託受益証券	アメリカ	24,798,076	0.24
投資証券	メキシコ	13,537,468	0.13
	トルコ	6,534,332	0.06
	南アフリカ	17,319,891	0.17
	小計	37,391,691	0.37
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		304,036,048	2.99
合計（純資産総額）		10,168,529,137	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	297,766,702	2.93

(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		2,436,750	0.02

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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 (%)
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2,360	140,820.56	332,336,528	129,154.50	304,804,620	3.00
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	529,355	575.11	304,440,635	544.30	288,130,573	2.83
中国	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	112,500	2,596.80	292,140,000	2,284.80	257,040,000	2.53
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	133,700	1,744.00	233,172,800	1,598.40	213,706,080	2.10
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,796,920	118.99	213,823,774	100.64	180,842,029	1.78
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	8,610	17,829.62	153,513,068	17,301.79	148,968,481	1.46
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA - H	銀行	1,584,575	105.76	167,584,652	85.76	135,893,152	1.34
中国	株式	BANK OF CHINA LTD - H	銀行	1,699,000	82.56	140,269,440	67.52	114,716,480	1.13
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	283,000	365.97	103,569,526	357.23	101,098,071	0.99
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	32,575	2,406.88	78,404,279	2,604.81	84,851,686	0.83
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	40,140	1,912.70	76,776,029	2,086.50	83,752,110	0.82
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	電気通信サービス	705,800	120.96	85,374,017	116.58	82,286,681	0.81
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	128,200	755.40	96,842,742	577.59	74,047,328	0.73
中国	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	159,000	592.00	94,128,000	462.40	73,521,600	0.72
南アフリカ	株式	MTN GROUP LTD	電気通信サービス	36,215	2,296.83	83,179,807	2,015.65	72,997,054	0.72
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	102,000	720.15	73,455,545	695.50	70,942,000	0.70
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	銀行	64,033	1,294.66	82,900,966	1,076.18	68,911,213	0.68
香港	株式	CNOOC LTD	エネルギー	388,000	201.28	78,096,640	155.52	60,341,760	0.59
中国	株式	PETROCHINA CO LTD-H	エネルギー	467,000	152.80	71,357,600	124.64	58,206,880	0.57
ロシア	株式	LUKOIL OAO-SPON ADR	エネルギー	11,385	6,388.39	72,731,927	5,050.90	57,504,597	0.57
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	28,946	1,704.20	49,329,846	1,950.29	56,453,167	0.56
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車部品	3,430	17,380.05	59,613,572	15,945.00	54,691,350	0.54
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	54,948	1,181.58	64,925,967	994.89	54,667,710	0.54
南アフリカ	株式	SASOL LTD	エネルギー	12,300	4,418.60	54,348,829	4,238.94	52,139,028	0.51
中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	539,300	110.88	59,797,584	94.24	50,823,632	0.50
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	ソフトウェア・サービス	10,450	4,896.74	51,170,959	4,837.26	50,549,445	0.50
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	12,630	4,815.38	60,818,375	3,667.34	46,318,630	0.46
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	460	110,233.10	50,707,226	98,433.80	45,279,548	0.45
メキシコ	株式	FOMENTO ECONOMICO MEXICANO-UBD	食品・飲料・タバコ	38,900	1,106.65	43,048,840	1,128.73	43,907,737	0.43
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	59,500	869.83	51,755,314	716.00	42,602,000	0.42

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	7.96
		素材	6.47
		資本財	4.82
		商業・専門サービス	0.20
		運輸	1.71
		自動車・自動車部品	3.06
		耐久消費財・アパレル	1.25
		消費者サービス	0.66
		メディア	2.24
		小売	1.45
		食品・生活必需品小売り	2.04
		食品・飲料・タバコ	4.68
		家庭用品・パーソナル用品	1.56
		ヘルスケア機器・サービス	0.75
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.76
		銀行	18.06
		各種金融	3.27
		保険	4.34
		不動産	2.47
		ソフトウェア・サービス	5.42
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.16		
電気通信サービス	7.23		
公益事業	3.23		
半導体・半導体製造装置	4.62		
投資信託受益証券			0.24
投資証券			0.37
合計			97.01

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	ニューヨーク証券取引所	MINMSCIE1509	買建	54	米ドル	2,591,185	321,410,587	2,400,570	297,766,702	2.93

(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	マレーシアリングット	買建	75,000.00	2,440,995	2,436,750	0.02

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2015年 7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	28,388,558,490	79.69
地方債証券	日本	2,322,067,000	6.52
特殊債証券	日本	2,592,447,000	7.28
社債券	日本	2,092,706,952	5.87
	オーストラリア	101,691,000	0.29
	小計	2,194,397,952	6.16
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		125,753,655	0.35
合計（純資産総額）		35,623,224,097	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（%）	償還期限	投資比率（%）
日本	国債証券	第299回利付国債（10年）	750,000,000	105.31	789,840,000	104.56	784,200,000	1.300	2019/3/20	2.20
日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	673,000,000	106.08	713,952,050	105.36	709,126,640	1.300	2019/12/20	1.99
日本	国債証券	第107回利付国債（5年）	705,000,000	100.51	708,644,850	100.46	708,264,150	0.200	2017/12/20	1.99
日本	国債証券	第303回利付国債（10年）	581,000,000	106.30	617,626,240	105.51	613,059,580	1.400	2019/9/20	1.72
日本	国債証券	第60回利付国債（20年）	545,000,000	108.65	592,175,200	108.76	592,763,800	1.400	2022/12/20	1.66
日本	国債証券	第124回利付国債（5年）	560,000,000	99.97	559,882,400	100.04	560,268,800	0.100	2020/6/20	1.57
日本	国債証券	第123回利付国債（5年）	505,000,000	99.89	504,449,300	100.09	505,464,600	0.100	2020/3/20	1.42
日本	国債証券	第102回利付国債（5年）	500,000,000	100.51	502,590,200	100.41	502,065,000	0.300	2016/12/20	1.41
日本	国債証券	第284回利付国債（10年）	462,000,000	103.59	478,618,140	102.34	472,820,040	1.700	2016/12/20	1.33

日本	国債証券	第117回利付国債(5年)	470,000,000	100.49	472,331,000	100.57	472,721,300	0.200	2019/3/20	1.33
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	410,000,000	107.14	439,312,200	106.65	437,273,200	1.300	2021/3/20	1.23
日本	国債証券	第106回利付国債(5年)	420,000,000	100.48	422,047,000	100.41	421,743,000	0.200	2017/9/20	1.18
日本	国債証券	第29回利付国債(30年)	276,000,000	118.22	326,289,960	122.16	337,180,920	2.400	2038/9/20	0.95
日本	国債証券	第120回利付国債(5年)	330,000,000	100.57	331,888,300	100.57	331,900,800	0.200	2019/9/20	0.93
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	330,000,000	100.28	330,945,700	100.13	330,429,000	0.100	2019/12/20	0.93
日本	国債証券	第292回利付国債(10年)	306,000,000	105.61	323,166,600	104.43	319,568,040	1.700	2018/3/20	0.90
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	280,000,000	108.88	304,886,400	111.70	312,776,800	1.700	2032/9/20	0.88
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	260,000,000	119.13	309,753,600	119.54	310,809,200	2.300	2026/9/20	0.87
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	260,000,000	119.01	309,439,000	119.30	310,195,600	2.300	2026/6/20	0.87
日本	国債証券	第291回利付国債(10年)	287,000,000	104.26	299,237,680	103.38	296,712,080	1.300	2018/3/20	0.83
日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	240,000,000	116.75	280,214,400	118.53	284,479,200	2.100	2029/9/20	0.80
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	275,000,000	102.12	280,830,000	102.77	282,623,000	0.600	2023/3/20	0.79
日本	国債証券	第79回利付国債(20年)	240,000,000	116.28	279,080,600	115.42	277,010,400	2.000	2025/6/20	0.78
日本	国債証券	第290回利付国債(10年)	266,000,000	104.60	278,236,000	103.64	275,701,020	1.400	2018/3/20	0.77
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	261,000,000	104.01	271,468,710	102.76	268,206,210	1.700	2017/3/20	0.75
日本	国債証券	第36回利付国債(30年)	230,000,000	109.28	251,344,000	114.18	262,620,900	2.000	2042/3/20	0.74
日本	国債証券	第50回利付国債(20年)	237,000,000	110.97	263,017,860	110.07	260,882,490	1.900	2021/3/22	0.73
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	208,000,000	119.25	248,040,000	122.46	254,718,880	2.400	2034/3/20	0.72
日本	国債証券	第137回利付国債(20年)	220,000,000	109.97	241,953,000	111.96	246,327,400	1.700	2032/6/20	0.69
日本	国債証券	第43回利付国債(30年)	225,000,000	105.35	237,049,450	106.82	240,363,000	1.700	2044/6/20	0.67

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	79.69
地方債証券	6.52
特殊債券	7.28
社債券	6.16
合計	99.65

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 7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	83,155,914,276	42.12
	カナダ	4,158,051,155	2.11
	メキシコ	1,930,606,923	0.98
	ドイツ	14,687,523,999	7.44
	イタリア	18,982,763,367	9.61
	フランス	18,723,622,642	9.48
	オランダ	5,008,123,725	2.54
	スペイン	10,306,165,007	5.22
	ベルギー	4,988,617,412	2.53
	オーストリア	3,121,501,139	1.58
	フィンランド	1,134,400,164	0.57
	アイルランド	1,538,876,925	0.78
	イギリス	16,849,478,229	8.53
	スイス	590,641,072	0.30
	スウェーデン	943,219,514	0.48
	ノルウェー	565,912,859	0.29
	デンマーク	1,347,744,517	0.68
	ポーランド	1,113,807,140	0.56
	オーストラリア	3,136,198,057	1.59
	シンガポール	741,363,944	0.38
マレーシア	1,022,280,807	0.52	
南アフリカ	1,015,549,154	0.51	
	小計	195,062,362,027	98.79
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		2,379,429,604	1.21
合計（純資産総額）		197,441,791,631	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		214,093,856	0.11

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	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	17,399.51	2,087,942,062	16,914.01	2,029,682,025	8.000	2021/11/15	1.03
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	14,250,000	13,721.30	1,955,285,933	13,622.11	1,941,150,897	3.625	2021/2/15	0.98
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,800,000	13,684.09	1,888,404,807	13,533.92	1,867,681,909	3.625	2020/2/15	0.95
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,000,000	13,510.66	1,756,387,019	13,375.00	1,738,750,081	3.375	2019/11/15	0.88
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	16,250.20	1,462,518,815	15,691.06	1,412,195,400	8.125	2019/8/15	0.72
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,950,000	17,255.12	1,371,782,586	16,665.93	1,324,941,981	8.750	2020/8/15	0.67
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,700,000	14,177.38	1,375,206,284	13,519.39	1,311,380,920	7.500	2016/11/15	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,800,000	13,662.81	1,338,955,594	13,365.31	1,309,800,380	4.250	2017/11/15	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,500,000	13,619.59	1,293,861,240	13,485.47	1,281,120,006	3.500	2020/5/15	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,000,000	13,001.91	1,300,191,156	12,751.89	1,275,189,344	3.000	2016/8/31	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,400,000	13,615.87	1,279,891,855	13,439.92	1,263,353,214	3.750	2018/11/15	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,250,000	13,555.24	1,253,860,277	13,167.62	1,218,004,965	4.625	2017/2/15	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,850,000	13,710.14	1,213,347,496	13,508.73	1,195,522,715	4.000	2018/8/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,300,000	12,598.74	1,171,683,080	12,613.31	1,173,038,527	2.000	2020/7/31	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,800,000	13,612.42	1,197,893,042	13,248.05	1,165,828,702	4.500	2017/5/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	13,122.07	1,180,986,777	12,878.84	1,159,095,656	3.125	2017/1/31	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,600,000	13,761.65	1,183,502,464	13,417.63	1,153,916,986	4.750	2017/8/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,050,000	13,008.07	1,177,230,770	12,733.48	1,152,380,053	3.250	2016/6/30	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,300,000	12,282.86	1,142,306,648	12,324.53	1,146,181,929	2.000	2023/2/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,150,000	12,487.10	1,142,570,273	12,511.56	1,144,808,283	1.500	2018/12/31	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,800,000	13,189.90	1,160,712,053	12,940.86	1,138,795,735	3.250	2017/3/31	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	14,941.00	1,195,280,450	14,184.16	1,134,733,425	8.750	2017/5/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,800,000	13,066.83	1,149,881,810	12,868.18	1,132,399,922	2.750	2017/5/31	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,700,000	13,134.67	1,142,716,561	12,874.96	1,120,121,900	3.250	2016/12/31	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,600,000	13,102.69	1,126,831,689	12,962.18	1,114,747,480	2.750	2017/12/31	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,500,000	12,886.51	1,095,353,826	12,834.26	1,090,912,419	2.250	2018/7/31	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,950,000	13,405.00	1,065,697,723	13,210.26	1,050,215,670	3.500	2018/2/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,300,000	12,563.63	1,042,782,077	12,549.35	1,041,596,828	1.750	2019/9/30	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	13,406.01	1,072,480,850	12,975.74	1,038,059,750	4.875	2016/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,500,000	12,000.87	1,020,073,950	12,063.85	1,025,428,020	1.750	2023/5/15	0.52

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.79
合計	98.79

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	280,000.00	34,741,056	34,728,400	0.02
	メキシコペソ	売建	1,200,000.00	9,135,600	9,156,000	0.00
	ユーロ	売建	1,194,002.33	162,098,668	162,085,816	0.08
	英ポンド	売建	42,000.00	8,128,470	8,123,640	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。

海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2015年 7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	メキシコ	204,203,305	9.82
	ブラジル	194,550,613	9.36
	コロンビア	126,597,230	6.09
	ペルー	36,382,091	1.75
	トルコ	195,611,455	9.41
	ハンガリー	97,475,444	4.69
	ポーランド	207,642,078	9.99
	ロシア	103,564,903	4.98
	ルーマニア	51,467,923	2.48
	マレーシア	207,037,084	9.96
	タイ	158,932,264	7.64
	インドネシア	184,085,006	8.85
	南アフリカ	203,533,942	9.79
	ナイジェリア	36,963,906	1.78
	小計	2,008,047,244	96.58
特殊債券	国際機関	9,389,668	0.45
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		61,754,947	2.97
合計（純資産総額）		2,079,191,859	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 (%)
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,000,000	1,163.73	34,912,106	1,138.60	34,158,097	10.500	2026/12/21	1.64
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	665,000,000	5.19	34,569,597	5.11	33,982,507	10.000	2024/7/24	1.63
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	830,000	3,506.21	29,101,569	3,519.51	29,212,004	10.000	2017/1/1	1.40
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	7,720,000	375.94	29,023,095	376.08	29,033,759	3.650	2021/12/17	1.40
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	7,450,000	376.82	28,073,281	378.20	28,175,945	3.875	2019/6/13	1.36
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	2,850,000,000	0.94	26,949,677	0.91	26,066,782	8.375	2024/3/15	1.25
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,610,000	991.61	25,881,152	978.18	25,530,619	10.000	2024/12/5	1.23
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	640,000	3,592.13	22,989,659	3,556.26	22,760,076	4.000	2023/10/25	1.09
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	2,300,000,000	0.93	21,452,234	0.89	20,493,538	8.375	2034/3/15	0.99
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	840,000	2,404.77	20,200,141	2,429.68	20,409,370		2019/1/1	0.98
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	5,550,000	364.93	20,253,894	364.36	20,222,213	3.250	2017/6/16	0.97
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,090,000	983.54	20,556,079	964.11	20,149,919	8.750	2048/2/28	0.97
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	2,100,000,000	0.98	20,783,992	0.94	19,833,847	9.000	2029/3/15	0.95
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	590,000	3,330.94	19,652,555	3,291.85	19,421,917	10.000	2021/1/1	0.93
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	630,000	3,003.34	18,921,057	3,071.13	19,348,119		2017/1/1	0.93
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	365,000,000	5.26	19,220,227	5.18	18,907,690	11.000	2020/7/24	0.91
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,960,000	971.80	19,047,429	958.55	18,787,656	7.250	2020/1/15	0.90
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	5,000,000	374.42	18,721,176	375.36	18,768,297	3.625	2023/6/16	0.90
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	530,000	3,541.68	18,770,923	3,517.27	18,641,570	5.250	2017/10/25	0.90
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,400,000	768.82	18,451,866	765.02	18,360,643	4.750	2018/6/14	0.88
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	520,000	3,410.31	17,733,643	3,401.47	17,687,648	3.250	2019/7/25	0.85
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	550,000	3,259.25	17,925,902	3,192.54	17,558,994	10.000	2023/1/1	0.84
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	510,000	3,416.21	17,422,685	3,396.39	17,321,604	4.750	2016/10/25	0.83
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	430,000	3,954.78	17,005,584	3,918.91	16,851,334	5.750	2022/9/23	0.81
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,700,000	1,002.49	17,042,490	990.17	16,833,046	8.000	2018/12/21	0.81
トルコ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	390,000	4,389.80	17,120,225	4,299.37	16,767,549	8.500	2019/7/10	0.81
トルコ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	430,000	4,021.05	17,290,552	3,894.14	16,744,838	7.100	2023/3/8	0.81
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	450,000	3,725.30	16,763,865	3,703.51	16,665,831	5.500	2019/10/25	0.80

タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	4,320,000	384.07	16,591,868	383.92	16,585,657	3.850	2025/12/12	0.80
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	570,000	2,826.54	16,111,293	2,897.89	16,518,007		2017/7/1	0.79

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.58
特殊債券	0.45
合 計	97.03

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

参考情報

運用実績

2015年7月31日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額..... 10,472円

純資産総額..... 2.29億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2015年3月	2015年4月	2015年5月	2015年6月	2015年7月	直近1年間累計	設定来累計
20円	20円	20円	20円	20円	240円	2,160円

主要な資産の状況

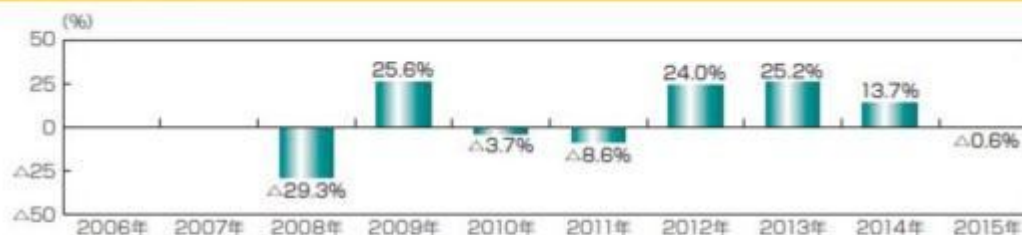
組入資産	投資対象	比率 ^{※1}	組入上位銘柄	国・地域名	比率 ^{※2}
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	日本株式	3.0%	トヨタ自動車	日本	4.7%
			三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	2.9%
			三井住友フィナンシャルグループ	日本	1.7%
			みずほフィナンシャルグループ	日本	1.5%
			日本電信電話	日本	1.5%
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI(ヘッジなし) マザーファンド	海外先進国株式	26.9%	アップル	アメリカ	2.2%
			マイクロソフト	アメリカ	1.1%
			エクソンモービル	アメリカ	1.1%
			ウェルズ・ファーゴ	アメリカ	0.9%
			ジョンソン&ジョンソン	アメリカ	0.9%
海外新興国株式インデックス MSCIエマージング(ヘッジなし) マザーファンド	新興国株式	19.0%	サムスン電子	韓国	3.0%
			台湾セミコンダクター	台湾	2.8%
			テンセント・ホールディングス	中国	2.5%
			チャイナ・モバイル	香港	2.1%
			中国建設銀行	中国	1.8%
日本債券インデックス マザーファンド	日本債券	3.0%	第299回利付国債(10年)	日本	2.2%
			第305回利付国債(10年)	日本	2.0%
			第107回利付国債(5年)	日本	2.0%
			第303回利付国債(10年)	日本	1.7%
			第60回利付国債(20年)	日本	1.7%
海外債券インデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外先進国債券	27.2%	アメリカ国債(クーポン8%)	アメリカ	1.0%
			アメリカ国債(クーポン3.625%)	アメリカ	1.0%
			アメリカ国債(クーポン3.625%)	アメリカ	0.9%
			アメリカ国債(クーポン3.375%)	アメリカ	0.9%
			アメリカ国債(クーポン8.125%)	アメリカ	0.7%
海外新興国債券インデックス Local(ヘッジなし) マザーファンド	新興国債券	19.6%	南アフリカ国債(クーポン10.5%)	南アフリカ	1.6%
			コロンビア国債(クーポン10%)	コロンビア	1.6%
			ブラジル国債(クーポン10%)	ブラジル	1.4%
			タイ国債(クーポン3.65%)	タイ	1.4%
			タイ国債(クーポン3.875%)	タイ	1.4%
現金その他		1.3%			

※1:当ファンドの純資産総額比率です。上記比率は四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。

※2:各マザーファンドの純資産総額比率です。

●組入上位銘柄は借用できると判断した情報をもとに日興アセットマネジメントが和訳しています。

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して計算しております。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

※2008年は、設定時から2008年末までの騰落率です。

※2015年は、2015年7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。

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

(2) コースの選択

収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース＞と＜分配金受取りコース＞の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。

＜分配金再投資コース＞

収益分配金を自動的に再投資するコースです。なお、販売会社によっては、収益分配金を定期的に受け取るための「定期引出契約」を結ぶことができる場合があります。

＜分配金受取りコース＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

(3) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(4) 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。

(5) 取得申込不可日

販売会社の営業日であっても、取得申込日が下記のいずれかに該当する場合は、取得の申込みの受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

(6) 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に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。

(7) 申込単位

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。

(8) 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。

(9) 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、投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少など、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。

(10) 償還乗換

・受益者は、証券投資信託の償還金額（手取額）の範囲内（単位型証券投資信託については、償還金額（手取額）とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する口数に係る申込手数料を徴収されない措置の適用を受けることができる場合があります。この償還乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

・この措置の適用を受ける受益者は、販売会社から、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求められることがあります。

(11) 乗換優遇

受益者は、信託期間終了日の1年前以内などの一定の要件を満たした証券投資信託を解約または買取請求により換金した際の代金をもって、換金を行なった販売会社において、取得申込みをする場合の手数料率が割引となる措置の適用を受けることができます。この乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会

社にお問い合わせください。

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) 解約請求不可日

販売会社の営業日であっても、解約請求日が下記のいずれかに該当する場合は、解約請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

(4) 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。

(5) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額（当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た額）を控除した価額とします。

・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。

(6) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額から所得税および地方税を差し引いた金額となります。

税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。

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(7) 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。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(8) 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。

(9) 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、投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少など、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（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

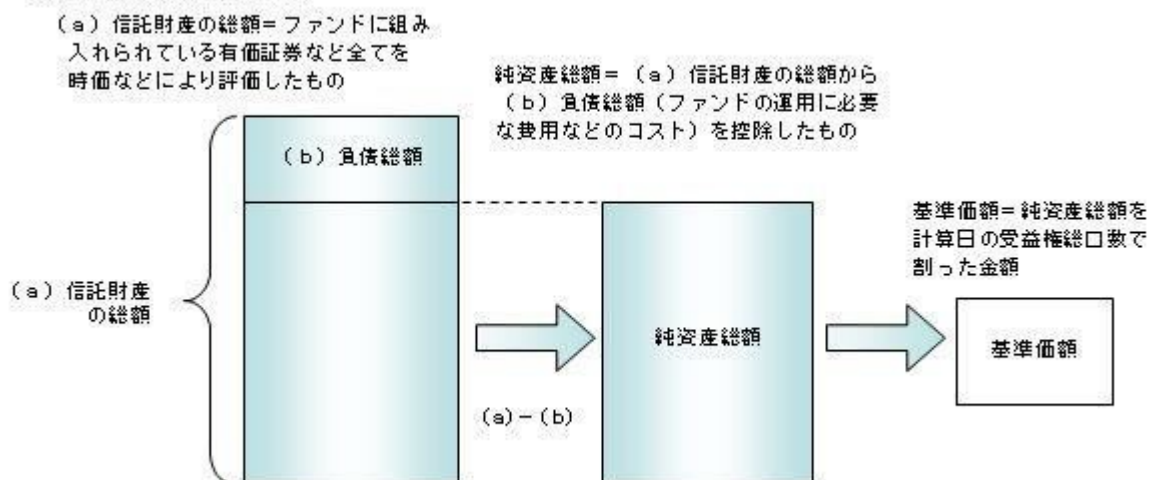
3【資産管理等の概要】

(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】

平成30年12月25日までとします（平成20年 3月31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】

毎月26日から翌月25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) 受益者の解約により純資産総額が10億円を下回ることとなった場合
 - ロ) 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
 - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、委託会社は書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）
- 3) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」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、書面決議が困難な場合
 - 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たときは、書面決議で可決された場合、存続します。）
 - 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
- 4) 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 ヶ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。

信託約款の変更など

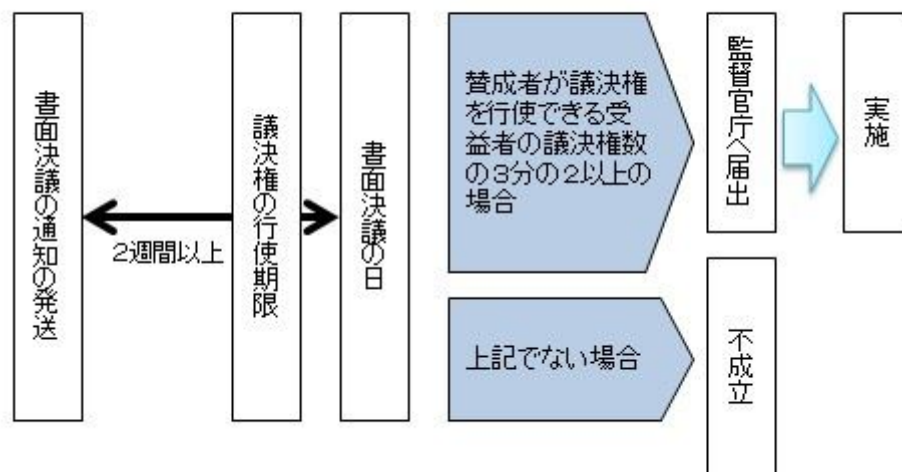
- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（以下「併合」といいます。）を行なうことができます。信託約款の変更または併合を行なう際には、委託会社は、その旨および内容をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものまたは併合（受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものを除きます。）については、書面決議を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）
- 3) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「書面決議」の規定を適用します。

書面決議

- 1) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に対して、委託会社は書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにその内容および理由などの事項を定め、決議の日の 2 週間前までに知れている受益者に対し書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- 2) 受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、書面決議について賛成するものとみなします。
- 3) 書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の 3 分の 2 以上にあたる多数をもって行ないます。

- 4) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に関する委託会社の提案に対して、すべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときは、書面決議を行いません。
- 5) 当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、併合にかかる他のファンドにおいて併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
- 6) 当ファンドは、受益者からの換金請求に対して、投資信託契約の一部を解約することにより応じることができるため、受益者の保護に欠けるおそれがないものとして、書面決議において反対した受益者からの買取請求は受け付けません。

<書面決議の主な流れ>



公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

なお、やむを得ない事由によって公告を電子公告によって行なうことができない場合には、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、年2回(6月、12月)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、原則として知れ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。

他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

受益者は、委託会社または受託会社に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行なうことはできません。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

す。

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は、6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。
- (3) 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、平成26年12月26日から平成27年6月25日までの特定期間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】

【全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 平成26年12月25日現在	当期 平成27年 6月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,749,969	3,863,836
親投資信託受益証券	249,178,765	238,007,819
未収入金	-	402,864
未収利息	6	6
流動資産合計	252,928,740	242,274,525
資産合計	252,928,740	242,274,525
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	473,853	446,072
未払解約金	-	405,946
未払受託者報酬	11,288	11,311
未払委託者報酬	225,958	226,430
その他未払費用	233,674	118,169
流動負債合計	944,773	1,207,928
負債合計	944,773	1,207,928
純資産の部		
元本等		
元本	236,926,615	223,036,012
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	15,057,352	18,030,585
（分配準備積立金）	63,862,602	59,320,624
元本等合計	251,983,967	241,066,597
純資産合計	251,983,967	241,066,597
負債純資産合計	252,928,740	242,274,525

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期		当期	
	自	平成26年 6月26日 至 平成26年12月25日	自	平成26年12月26日 至 平成27年 6月25日
営業収益				
受取利息		900		904
有価証券売買等損益		29,131,725		8,124,342
営業収益合計		29,132,625		8,125,246
営業費用				
受託者報酬		67,199		66,726
委託者報酬		1,345,225		1,335,793
その他費用		124,427		123,557
営業費用合計		1,536,851		1,526,076
営業利益又は営業損失（ ）		27,595,774		6,599,170
経常利益又は経常損失（ ）		27,595,774		6,599,170
当期純利益又は当期純損失（ ）		27,595,774		6,599,170
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（ ）		403,922		171,192
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		9,222,317		15,057,352
剰余金増加額又は欠損金減少額		584,308		557,477
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		467,778		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		116,530		557,477
剰余金減少額又は欠損金増加額		537,303		1,567,173
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		404,245		1,567,173
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		133,058		-
分配金		2,959,188		2,787,433
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		15,057,352		18,030,585

(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)

		前期 平成26年12月25日現在	当期 平成27年 6月25日現在
1.	期首元本額	252,903,114円	236,926,615円
	期中追加設定元本額	9,306,266円	9,511,934円
	期中一部解約元本額	25,282,765円	23,402,537円
2.	受益権の総数	236,926,615口	223,036,012口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 平成26年 6月26日 至 平成26年12月25日		当期 自 平成26年12月26日 至 平成27年 6月25日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
自 平成26年 6月26日 至 平成26年 7月25日		自 平成26年12月26日 至 平成27年 1月26日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	707,459円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 293,040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	2,322,992円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金	7,627,874円	C 信託約款に定める収益調整金 9,332,807円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	41,079,647円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 63,087,897円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	51,737,972円	E 分配対象収益 (A+B+C+D) 72,713,744円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,062円	F 分配対象収益(1万口当たり) 3,076円
G	分配金額	501,585円	G 分配金額 472,773円
H	分配金額(1万口当たり)	20円	H 分配金額(1万口当たり) 20円
自 平成26年 7月26日 至 平成26年 8月25日		自 平成27年 1月27日 至 平成27年 2月25日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	649,690円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 627,932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	2,781,134円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金	7,903,258円	C 信託約款に定める収益調整金 9,709,187円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	43,256,051円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 62,681,499円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	54,590,133円	E 分配対象収益 (A+B+C+D) 73,018,618円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,180円	F 分配対象収益(1万口当たり) 3,082円

G	分配金額	500,772円	G	分配金額	473,729円
H	分配金額(1万口当たり)	20円	H	分配金額(1万口当たり)	20円
	自 平成26年 8月26日			自 平成27年 2月26日	
	至 平成26年 9月25日			至 平成27年 3月25日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	673,312円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	391,576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	5,613,129円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	8,229,089円	C	信託約款に定める収益調整金	9,903,270円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	46,135,294円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	61,562,661円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	60,650,824円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	71,857,507円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,410円	F	分配対象収益(1万口当たり)	3,079円
G	分配金額	503,292円	G	分配金額	466,607円
H	分配金額(1万口当たり)	20円	H	分配金額(1万口当たり)	20円
	自 平成26年 9月26日			自 平成27年 3月26日	
	至 平成26年10月27日			至 平成27年 4月27日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	399,089円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	699,807円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	8,483,929円	C	信託約款に定める収益調整金	10,369,035円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	51,088,794円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	60,698,436円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	59,971,812円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	71,767,278円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,406円	F	分配対象収益(1万口当たり)	3,090円
G	分配金額	498,400円	G	分配金額	464,432円
H	分配金額(1万口当たり)	20円	H	分配金額(1万口当たり)	20円
	自 平成26年10月28日			自 平成27年 4月28日	
	至 平成26年11月25日			至 平成27年 5月25日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	611,777円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	691,239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	16,222,757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	1,205,636円
C	信託約款に定める収益調整金	8,469,964円	C	信託約款に定める収益調整金	10,687,321円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	48,977,430円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	60,527,014円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	74,281,928円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	73,111,210円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,086円	F	分配対象収益(1万口当たり)	3,152円
G	分配金額	481,286円	G	分配金額	463,820円
H	分配金額(1万口当たり)	20円	H	分配金額(1万口当たり)	20円
	自 平成26年11月26日			自 平成27年 5月26日	
	至 平成26年12月25日			至 平成27年 6月25日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	377,457円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	488,868円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	8,714,210円	C	信託約款に定める収益調整金	10,612,968円

D 信託約款に定める分配準備積立金	63,958,998円	D 信託約款に定める分配準備積立金	59,277,828円
E 分配対象収益(A+B+C+D)	73,050,665円	E 分配対象収益(A+B+C+D)	70,379,664円
F 分配対象収益(1万口当たり)	3,083円	F 分配対象収益(1万口当たり)	3,155円
G 分配金額	473,853円	G 分配金額	446,072円
H 分配金額(1万口当たり)	20円	H 分配金額(1万口当たり)	20円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	前期 自 平成26年 6月26日 至 平成26年12月25日	当期 自 平成26年12月26日 至 平成27年 6月25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

	前期 平成26年12月25日現在	当期 平成27年 6月25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	(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

（有価証券に関する注記）

前期（平成26年12月25日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	最終の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	2,347,902
合計	2,347,902

当期（平成27年 6月25日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	最終の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	419,627
合計	419,627

（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）

前期 平成26年12月25日現在		当期 平成27年 6月25日現在	
1口当たり純資産額	1.0636円	1口当たり純資産額	1.0808円
(1万口当たり純資産額)	(10,636円)	(1万口当たり純資産額)	(10,808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	29,877,322	64,379,653	
	日本債券インデックスマザーファンド	5,326,730	7,039,273	
	海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド	26,816,505	63,504,165	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	5,110,060	7,163,793	
	海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし) マザーファンド	27,801,295	48,363,132	
	海外新興国債券インデックスLocal(ヘッジなし) マザーファンド	34,956,122	47,557,803	
合計		129,888,034	238,007,819	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

当ファンドは、「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」「海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI (ヘッジなし) マザーファンド」「海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(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」「海外新興国債券インデックスLocal(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12月25日現在	平成27年 6月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	124,767,564	119,785,745
株式	28,934,094,700	29,322,054,430
派生商品評価勘定	1,167,803	2,407,140
未収入金	-	73,950,770
未収配当金	1,638,500	103,176,424
未収利息	199	193
流動資産合計	29,061,668,766	29,621,374,702
資産合計	29,061,668,766	29,621,374,702
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	34,911	-
前受金	1,427,000	3,132,000
未払解約金	64,602,751	67,297,809
流動負債合計	66,064,662	70,429,809
負債合計	66,064,662	70,429,809
純資産の部		
元本等		
元本	24,574,410,804	21,079,556,968
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,421,193,300	8,471,387,925
元本等合計	28,995,604,104	29,550,944,893
純資産合計	28,995,604,104	29,550,944,893
負債純資産合計	29,061,668,766	29,621,374,702

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</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	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。

(貸借対照表に関する注記)

		平成26年12月25日現在	平成27年 6月25日現在
1.	期首	平成26年 6月26日	平成26年12月26日
	期首元本額	26,591,793,348円	24,574,410,804円
	期首からの追加設定元本額	813,212,013円	345,782,416円
	期首からの一部解約元本額	2,830,594,557円	3,840,636,252円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス(株式20)	185,110,055円	169,495,688円
	DCインデックスバランス(株式40)	692,930,309円	657,900,940円
	DCインデックスバランス(株式60)	1,336,311,080円	1,289,585,749円
	DCインデックスバランス(株式80)	1,563,584,580円	1,557,759,841円
	インデックスファンド日本株式(DC専用)	1,070,863,771円	1,082,395,813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	7,335,756,640円	5,717,061,524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	6,396,799円	5,110,060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	24,953,097円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	78,049,737円	68,386,773円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	57,762,970円	51,274,978円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	94,265,968円	79,951,279円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	117,610,679円	93,218,404円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	8,327,131,836円	6,944,272,963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)	25,275,340円	19,274,567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)	50,201,884円	41,621,945円
	グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	49,883,536円	39,549,887円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	283,049,933円	249,557,303円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	848,143,129円	767,558,375円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	1,207,817,300円	1,104,938,172円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	1,211,802,821円	1,115,689,610円
	計	24,574,410,804円	21,079,556,968円
2.	受益権の総数	24,574,410,804口	21,079,556,968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	433,278,200円	539,870,000円
---	--------------	--------------

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 平成26年 6月26日 至 平成26年12月25日	自 平成26年12月26日 至 平成27年 6月25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12月25日現在	平成27年 6月25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

（有価証券に関する注記）

（平成26年12月25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	3,382,064,859
合計	3,382,064,859

（平成27年 6月25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	7,248,606,288
合計	7,248,606,288

(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12月25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	69,768,000	-	70,925,000	1,157,000

合計	69,768,000	-	70,925,000	1,157,000
----	------------	---	------------	-----------

(平成27年 6月25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	147,798,000	-	150,210,000	2,412,000
合計		147,798,000	-	150,210,000	2,412,000

(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12月25日現在		平成27年 6月25日現在	
1口当たり純資産額	1.1799円	1口当たり純資産額	1.4019円
(1万口当たり純資産額)	(11,799円)	(1万口当たり純資産額)	(14,019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	289.00	1,734,000	
日本水産	16,600	355.00	5,893,000	
マルハニチロ	2,800	1,964.00	5,499,200	

サカタのタネ	2,200	2,387.00	5,251,400
ホクト	1,500	2,572.00	3,858,000
住石ホールディングス	4,000	124.00	496,000
日鉄鉱業	4,000	623.00	2,492,000
三井松島産業	9,000	135.00	1,215,000
国際石油開発帝石	70,700	1,434.50	101,419,150
日本海洋掘削	400	3,640.00	1,456,000
石油資源開発	1,900	3,940.00	7,486,000
K & O エナジーグループ	900	1,808.00	1,627,200
ショーボンドホールディングス	1,300	5,240.00	6,812,000
ミライト・ホールディングス	4,100	1,456.00	5,969,600
タマホーム	1,100	543.00	597,300
サンヨーホームズ	200	652.00	130,400
ダイセキ環境ソリューション	200	1,960.00	392,000
安藤・間	9,000	679.00	6,111,000
東急建設	4,800	856.00	4,108,800
コムシスホールディングス	6,000	1,878.00	11,268,000
ミサワホーム	1,600	1,083.00	1,732,800
高松コンストラクショングループ	1,000	2,750.00	2,750,000
東建コーポレーション	500	7,780.00	3,890,000
ヤマウラ	700	500.00	350,000
大成建設	70,000	711.00	49,770,000
大林組	40,000	892.00	35,680,000
清水建設	41,000	1,019.00	41,779,000
飛鳥建設	9,300	217.00	2,018,100
長谷工コーポレーション	16,800	1,488.00	24,998,400
松井建設	1,000	663.00	663,000
銭高組	2,000	368.00	736,000
鹿島建設	59,000	582.00	34,338,000
不動テトラ	10,300	203.00	2,090,900
大末建設	500	797.00	398,500
鉄建建設	8,000	379.00	3,032,000
日鉄住金テックスエンジ	3,000	689.00	2,067,000
西松建設	14,000	468.00	6,552,000
三井住友建設	54,600	167.00	9,118,200
大豊建設	4,000	628.00	2,512,000

前田建設工業	9,000	872.00	7,848,000	
ナカノフドー建設	1,100	580.00	638,000	
奥村組	13,000	656.00	8,528,000	
大和小田急建設	800	1,165.00	932,000	
東鉄工業	1,600	2,612.00	4,179,200	
イチケン	1,000	283.00	283,000	
浅沼組	4,000	184.00	736,000	
戸田建設	17,000	547.00	9,299,000	
熊谷組	17,000	366.00	6,222,000	
青木あすなる建設	900	894.00	804,600	
北野建設	3,000	327.00	981,000	
植木組	2,000	245.00	490,000	
三井ホーム	2,000	571.00	1,142,000	
矢作建設工業	1,700	882.00	1,499,400	
ピーエス三菱	1,500	422.00	633,000	
日本ハウスホールディングス	2,300	583.00	1,340,900	
大東建託	5,000	12,845.00	64,225,000	
新日本建設	1,600	582.00	931,200	
N I P P O	3,000	2,118.00	6,354,000	
東亜道路工業	3,000	488.00	1,464,000	
前田道路	4,000	2,293.00	9,172,000	
日本道路	4,000	637.00	2,548,000	
東亜建設工業	10,000	202.00	2,020,000	
若築建設	8,000	180.00	1,440,000	
東洋建設	4,100	476.00	1,951,600	
五洋建設	15,000	505.00	7,575,000	
大林道路	2,000	671.00	1,342,000	
福田組	2,000	809.00	1,618,000	
住友林業	9,900	1,545.00	15,295,500	
日本基礎技術	1,600	426.00	681,600	
日成ビルド工業	4,000	387.00	1,548,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	7,000	99.00	693,000	
巴コーポレーション	1,800	424.00	763,200	
パナホーム	5,000	903.00	4,515,000	
大和ハウス工業	39,300	2,945.00	115,738,500	
ライト工業	2,200	1,009.00	2,219,800	

積水ハウス	42,200	2,011.00	84,864,200	
日特建設	1,800	484.00	871,200	
北陸電気工事	1,000	1,222.00	1,222,000	
ユアテック	2,000	923.00	1,846,000	
西部電気工業	1,000	459.00	459,000	
四電工	1,000	453.00	453,000	
中電工	2,000	2,480.00	4,960,000	
関電工	6,000	793.00	4,758,000	
きんでん	9,000	1,675.00	15,075,000	
東京エネシス	1,000	1,288.00	1,288,000	
トーエネック	2,000	777.00	1,554,000	
住友電設	1,100	1,720.00	1,892,000	
日本電設工業	2,200	2,196.00	4,831,200	
協和エクシオ	5,700	1,469.00	8,373,300	
新日本空調	1,100	1,135.00	1,248,500	
N D S	2,000	318.00	636,000	
九電工	2,000	2,118.00	4,236,000	
三機工業	2,800	1,000.00	2,800,000	
日揮	14,000	2,407.00	33,698,000	
中外炉工業	4,000	289.00	1,156,000	
ヤマト	1,000	417.00	417,000	
太平電業	2,000	1,202.00	2,404,000	
高砂熱学工業	3,700	1,505.00	5,568,500	
三晃金属工業	2,000	246.00	492,000	
朝日工業社	2,000	444.00	888,000	
明星工業	2,300	638.00	1,467,400	
大気社	1,900	3,055.00	5,804,500	
ダイダン	2,000	848.00	1,696,000	
日比谷総合設備	1,800	1,728.00	3,110,400	
東芝プラントシステム	2,200	1,501.00	3,302,200	
東洋エンジニアリング	7,000	297.00	2,079,000	
千代田化工建設	10,000	1,135.00	11,350,000	
新興プランテック	2,800	1,069.00	2,993,200	
日本製粉	8,000	739.00	5,912,000	
日清製粉グループ本社	14,700	1,641.00	24,122,700	
日東富士製粉	1,000	345.00	345,000	

昭和産業	6,000	505.00	3,030,000
鳥越製粉	1,100	714.00	785,400
中部飼料	1,300	940.00	1,222,000
フィード・ワンホールディングス	8,200	139.00	1,139,800
東洋精糖	2,000	109.00	218,000
日本甜菜製糖	7,000	200.00	1,400,000
三井製糖	5,000	500.00	2,500,000
塩水港精糖	1,500	262.00	393,000
森永製菓	12,000	513.00	6,156,000
中村屋	3,000	453.00	1,359,000
江崎グリコ	3,100	5,970.00	18,507,000
名糖産業	600	1,289.00	773,400
不二家	8,000	195.00	1,560,000
山崎製パン	10,000	2,035.00	20,350,000
第一屋製パン	2,000	125.00	250,000
モロゾフ	2,000	400.00	800,000
亀田製菓	700	4,770.00	3,339,000
寿スピリッツ	300	3,510.00	1,053,000
カルビー	5,000	5,260.00	26,300,000
森永乳業	12,000	452.00	5,424,000
六甲バター	600	1,437.00	862,200
ヤクルト本社	7,200	7,380.00	53,136,000
明治ホールディングス	4,000	15,880.00	63,520,000
雪印メグミルク	3,200	1,555.00	4,976,000
プリマハム	8,000	379.00	3,032,000
日本ハム	10,000	2,859.00	28,590,000
伊藤ハム	7,000	677.00	4,739,000
林兼産業	5,000	132.00	660,000
丸大食品	7,000	466.00	3,262,000
米久	400	2,193.00	877,200
S Foods	800	2,520.00	2,016,000
サッポロホールディングス	22,000	469.00	10,318,000
アサヒグループホールディングス	27,000	4,084.00	110,268,000
キリンホールディングス	54,400	1,748.50	95,118,400
宝ホールディングス	10,500	995.00	10,447,500
オエノンホールディングス	4,000	220.00	880,000

養命酒製造	1,000	1,021.00	1,021,000	
コカ・コーラウエスト	4,500	2,191.00	9,859,500	
コカ・コーライーストジャパン	4,100	2,303.00	9,442,300	
サントリー食品インターナショナル	8,100	5,000.00	40,500,000	
ダイドードリンコ	700	5,300.00	3,710,000	
伊藤園	4,000	2,627.00	10,508,000	
キーコーヒー	1,200	2,073.00	2,487,600	
ユニカフェ	400	919.00	367,600	
ジャパンフーズ	200	1,127.00	225,400	
日清オイリオグループ	7,000	538.00	3,766,000	
不二製油	3,600	2,150.00	7,740,000	
かどや製油	100	2,710.00	271,000	
J - オイルミルズ	6,000	434.00	2,604,000	
キッコーマン	11,000	3,815.00	41,965,000	
味の素	31,000	2,694.00	83,514,000	
キューピー	6,800	2,577.00	17,523,600	
ハウス食品グループ本社	5,000	2,379.00	11,895,000	
カゴメ	5,200	1,981.00	10,301,200	
焼津水産化学工業	700	1,010.00	707,000	
アリアケジャパン	1,200	4,825.00	5,790,000	
エバラ食品工業	200	2,031.00	406,200	
ニチレイ	14,000	841.00	11,774,000	
東洋水産	7,000	4,410.00	30,870,000	
イトアンド	200	2,002.00	400,400	
日清食品ホールディングス	5,700	5,420.00	30,894,000	
永谷園	1,000	1,114.00	1,114,000	
一正蒲鉾	500	1,141.00	570,500	
フジッコ	1,000	2,388.00	2,388,000	
ロック・フィールド	700	2,883.00	2,018,100	
日本たばこ産業	74,400	4,516.00	335,990,400	
ケンコーマヨネーズ	400	1,698.00	679,200	
わらべや日洋	800	2,887.00	2,309,600	
なとり	600	1,497.00	898,200	
ユーグレナ	4,500	1,858.00	8,361,000	
ミヨシ油脂	5,000	150.00	750,000	
理研ビタミン	400	3,975.00	1,590,000	

片倉工業	1,600	1,356.00	2,169,600	
ゲンゼ	10,000	342.00	3,420,000	
東洋紡	50,000	210.00	10,500,000	
ユニチカ	38,000	58.00	2,204,000	
富士紡ホールディングス	6,000	294.00	1,764,000	
日清紡ホールディングス	8,000	1,460.00	11,680,000	
倉敷紡績	13,000	266.00	3,458,000	
シキボウ	8,000	129.00	1,032,000	
日本毛織	4,000	945.00	3,780,000	
大東紡織	3,000	75.00	225,000	
トーア紡コーポレーション	7,000	75.00	525,000	
ダイドーリミテッド	1,500	508.00	762,000	
帝国繊維	1,300	1,754.00	2,280,200	
帝人	51,000	492.00	25,092,000	
東レ	97,000	1,004.00	97,388,000	
サカイオーベックス	3,000	218.00	654,000	
住江織物	3,000	346.00	1,038,000	
日本フェルト	600	537.00	322,200	
イチカワ	1,000	373.00	373,000	
日本バイリーン	2,000	811.00	1,622,000	
日東製網	1,000	165.00	165,000	
芦森工業	3,000	226.00	678,000	
アツギ	10,000	118.00	1,180,000	
ダイニック	2,000	190.00	380,000	
セーレン	3,100	1,315.00	4,076,500	
東海染工	2,000	137.00	274,000	
小松精練	2,100	576.00	1,209,600	
ワコールホールディングス	7,000	1,458.00	10,206,000	
ホギメディカル	800	6,270.00	5,016,000	
レナウン	3,100	205.00	635,500	
クラウディア	300	624.00	187,200	
T S Iホールディングス	5,600	860.00	4,816,000	
三陽商会	7,000	340.00	2,380,000	
ナイガイ	5,000	70.00	350,000	
オンワードホールディングス	9,000	853.00	7,677,000	
ルック	2,000	231.00	462,000	

キムラタン	59,000	9.00	531,000	
ゴールドウイン	3,000	896.00	2,688,000	
デサント	2,900	1,859.00	5,391,100	
キング	500	444.00	222,000	
ヤマトインターナショナル	800	428.00	342,400	
特種東海製紙	7,000	310.00	2,170,000	
王子ホールディングス	51,000	540.00	27,540,000	
日本製紙	6,100	2,053.00	12,523,300	
三菱製紙	19,000	97.00	1,843,000	
北越紀州製紙	7,800	689.00	5,374,200	
中越パルプ工業	5,000	244.00	1,220,000	
巴川製紙所	2,000	252.00	504,000	
大王製紙	6,000	1,268.00	7,608,000	
レンゴー	11,000	526.00	5,786,000	
トーモク	4,000	287.00	1,148,000	
ザ・パック	900	2,547.00	2,292,300	
クラレ	21,400	1,558.00	33,341,200	
旭化成	78,000	1,018.50	79,443,000	
共和レザー	800	1,011.00	808,800	
コープケミカル	2,000	100.00	200,000	
昭和電工	84,000	166.00	13,944,000	
住友化学	93,000	752.00	69,936,000	
日本化成	3,000	158.00	474,000	
住友精化	3,000	810.00	2,430,000	
日産化学工業	8,200	2,774.00	22,746,800	
ラサ工業	5,000	156.00	780,000	
クレハ	9,000	493.00	4,437,000	
多木化学	1,000	735.00	735,000	
テイカ	2,000	509.00	1,018,000	
石原産業	21,000	130.00	2,730,000	
片倉チッカリン	1,000	299.00	299,000	
日本曹達	8,000	809.00	6,472,000	
東ソー	31,000	790.00	24,490,000	
トクヤマ	20,000	250.00	5,000,000	
セントラル硝子	13,000	540.00	7,020,000	
東亜合成	16,000	546.00	8,736,000	

ダイソー	5,000	466.00	2,330,000	
関東電化工業	3,000	862.00	2,586,000	
電気化学工業	26,000	558.00	14,508,000	
信越化学工業	22,500	7,633.00	171,742,500	
日本カーバイド工業	4,000	232.00	928,000	
堺化学工業	5,000	441.00	2,205,000	
エア・ウォーター	11,000	2,284.00	25,124,000	
大陽日酸	16,100	1,522.00	24,504,200	
日本化学工業	5,000	254.00	1,270,000	
日本パーカラライジング	5,900	1,280.00	7,552,000	
高压ガス工業	2,000	653.00	1,306,000	
四国化成工業	2,000	1,067.00	2,134,000	
戸田工業	3,000	354.00	1,062,000	
ステラ ケミファ	700	1,325.00	927,500	
保土谷化学工業	4,000	193.00	772,000	
日本触媒	10,000	1,695.00	16,950,000	
大日精化工業	5,000	638.00	3,190,000	
カネカ	17,000	916.00	15,572,000	
三菱瓦斯化学	22,000	703.00	15,466,000	
三井化学	57,000	466.00	26,562,000	
J S R	12,400	2,224.00	27,577,600	
東京応化工業	2,600	3,565.00	9,269,000	
大阪有機化学工業	900	612.00	550,800	
三菱ケミカルホールディングス	78,500	789.30	61,960,050	
日本合成化学工業	3,000	859.00	2,577,000	
ダイセル	17,600	1,596.00	28,089,600	
住友ベークライト	12,000	573.00	6,876,000	
積水化学工業	29,000	1,533.00	44,457,000	
日本ゼオン	11,000	1,138.00	12,518,000	
アイカ工業	3,800	2,805.00	10,659,000	
宇部興産	63,000	236.00	14,868,000	
積水樹脂	2,000	1,594.00	3,188,000	
タキロン	3,000	549.00	1,647,000	
旭有機材工業	4,000	267.00	1,068,000	
日立化成	6,200	2,241.00	13,894,200	
ニチバン	1,000	613.00	613,000	

リケンテクノス	2,000	500.00	1,000,000	
大倉工業	3,000	362.00	1,086,000	
積水化成成品工業	4,000	470.00	1,880,000	
群栄化学工業	3,000	337.00	1,011,000	
タイガースポリマー	600	846.00	507,600	
ミライアル	400	1,398.00	559,200	
ダイキアクシス	200	1,223.00	244,600	
ダイキョーニシカワ	400	3,990.00	1,596,000	
日本化薬	8,000	1,360.00	10,880,000	
カーリットホールディングス	1,000	633.00	633,000	
日本精化	1,100	984.00	1,082,400	
A D E K A	5,800	1,744.00	10,115,200	
日油	10,000	995.00	9,950,000	
新日本理化	2,100	247.00	518,700	
ハリマ化成グループ	1,100	516.00	567,600	
花王	33,800	5,858.00	198,000,400	
第一工業製薬	3,000	374.00	1,122,000	
ニイタカ	200	1,593.00	318,600	
三洋化成工業	4,000	896.00	3,584,000	
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	10,900	3,555.00	38,749,500	
関西ペイント	15,000	2,002.00	30,030,000	
神東塗料	1,000	225.00	225,000	
中国塗料	4,000	937.00	3,748,000	
日本特殊塗料	1,000	902.00	902,000	
藤倉化成	1,700	595.00	1,011,500	
太陽ホールディングス	1,000	5,210.00	5,210,000	
D I C	50,000	327.00	16,350,000	
サカタインクス	2,600	1,137.00	2,956,200	
東洋インキ S C ホールディングス	12,000	525.00	6,300,000	
T & K T O K A	400	2,312.00	924,800	
富士フイルムホールディングス	28,700	4,521.00	129,752,700	
資生堂	22,300	2,821.00	62,908,300	
ライオン	14,000	963.00	13,482,000	
高砂香料工業	4,000	537.00	2,148,000	
マンダム	1,300	5,670.00	7,371,000	

ミルボン	700	3,955.00	2,768,500
ファンケル	2,900	1,689.00	4,898,100
コーセー	2,000	9,760.00	19,520,000
コタ	400	1,415.00	566,000
ドクターシーラボ	800	4,220.00	3,376,000
シーボン	100	2,700.00	270,000
ポーラ・オルビスホールディングス	1,500	6,990.00	10,485,000
ノエビアホールディングス	800	2,578.00	2,062,400
アジュバンコスメジャパン	300	911.00	273,300
エステー	800	1,108.00	886,400
アグロ カネショウ	400	911.00	364,400
コニシ	1,000	2,426.00	2,426,000
長谷川香料	1,600	1,799.00	2,878,400
星光PMC	700	1,013.00	709,100
小林製薬	2,100	8,410.00	17,661,000
荒川化学工業	1,100	1,516.00	1,667,600
メック	1,000	962.00	962,000
日本高純度化学	400	2,530.00	1,012,000
JCU	300	5,150.00	1,545,000
新田ゼラチン	800	742.00	593,600
アース製薬	900	4,715.00	4,243,500
イハラケミカル工業	1,900	1,534.00	2,914,600
北興化学工業	1,000	521.00	521,000
大成ラミック	400	2,891.00	1,156,400
クミアイ化学工業	2,600	994.00	2,584,400
日本農薬	2,900	1,211.00	3,511,900
アキレス	11,000	159.00	1,749,000
有沢製作所	2,100	950.00	1,995,000
日東電工	9,700	10,060.00	97,582,000
レック	400	1,370.00	548,000
きもと	2,300	289.00	664,700
藤森工業	1,100	3,855.00	4,240,500
前澤化成工業	900	1,274.00	1,146,600
JSP	900	2,068.00	1,861,200
エフピコ	1,100	4,530.00	4,983,000
天馬	1,000	2,088.00	2,088,000

信越ポリマー	2,400	600.00	1,440,000	
東リ	3,000	329.00	987,000	
ニフコ	2,800	5,360.00	15,008,000	
日本バルカー工業	5,000	342.00	1,710,000	
ユニ・チャーム	25,400	2,899.00	73,634,600	
協和発酵キリン	15,000	1,684.00	25,260,000	
武田薬品工業	47,000	6,031.00	283,457,000	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	143,000	1,817.00	259,831,000	
大日本住友製薬	8,900	1,386.00	12,335,400	
塩野義製薬	19,600	4,640.00	90,944,000	
田辺三菱製薬	14,600	1,874.00	27,360,400	
わかもと製薬	1,000	287.00	287,000	
あすか製薬	1,500	1,353.00	2,029,500	
日本新薬	3,000	3,885.00	11,655,000	
ピオフェルミン製薬	200	2,867.00	573,400	
中外製薬	12,500	4,300.00	53,750,000	
科研製薬	4,000	4,425.00	17,700,000	
エーザイ	16,500	8,442.00	139,293,000	
ロート製薬	5,700	2,014.00	11,479,800	
小野薬品工業	5,700	13,570.00	77,349,000	
久光製薬	3,500	4,955.00	17,342,500	
有機合成薬品工業	1,000	280.00	280,000	
持田製薬	900	7,000.00	6,300,000	
参天製薬	23,100	1,759.00	40,632,900	
扶桑薬品工業	4,000	296.00	1,184,000	
日本ケミファ	2,000	638.00	1,276,000	
ツムラ	4,000	2,671.00	10,684,000	
日医工	2,900	3,375.00	9,787,500	
キッセイ薬品工業	2,300	3,125.00	7,187,500	
生化学工業	2,400	2,062.00	4,948,800	
栄研化学	1,100	2,558.00	2,813,800	
日水製薬	500	1,406.00	703,000	
鳥居薬品	900	3,355.00	3,019,500	
JCRファーマ	1,000	3,120.00	3,120,000	
東和薬品	600	7,650.00	4,590,000	

富士製薬工業	300	2,219.00	665,700	
沢井製薬	2,000	7,190.00	14,380,000	
ゼリア新薬工業	2,600	1,817.00	4,724,200	
第一三共	42,200	2,331.50	98,389,300	
キョーリン製薬ホールディングス	3,300	2,568.00	8,474,400	
大幸薬品	600	1,798.00	1,078,800	
ダイト	600	2,630.00	1,578,000	
大塚ホールディングス	24,900	4,020.00	100,098,000	
大正製薬ホールディングス	3,000	8,570.00	25,710,000	
日本コークス工業	11,400	120.00	1,368,000	
昭和シェル石油	11,200	1,178.00	13,193,600	
コスモ石油	35,000	213.00	7,455,000	
ニチレキ	1,000	1,050.00	1,050,000	
東燃ゼネラル石油	19,000	1,175.00	22,325,000	
ユシロ化学工業	700	1,501.00	1,050,700	
ピーピー・カストロール	500	1,411.00	705,500	
富士石油	2,900	494.00	1,432,600	
MORESCO	300	2,286.00	685,800	
出光興産	6,000	2,430.00	14,580,000	
JXホールディングス	139,300	539.10	75,096,630	
横浜ゴム	14,000	1,319.00	18,466,000	
東洋ゴム工業	5,700	2,728.00	15,549,600	
ブリヂストン	39,300	4,756.00	186,910,800	
住友ゴム工業	9,800	1,992.00	19,521,600	
藤倉ゴム工業	1,100	723.00	795,300	
オカモト	4,000	457.00	1,828,000	
フコク	500	1,250.00	625,000	
ニッタ	1,200	3,465.00	4,158,000	
住友理工	2,300	1,035.00	2,380,500	
三ツ星ベルト	3,000	990.00	2,970,000	
バンドー化学	4,000	523.00	2,092,000	
日東紡績	9,000	559.00	5,031,000	
旭硝子	62,000	770.00	47,740,000	
日本板硝子	61,000	135.00	8,235,000	
石塚硝子	2,000	244.00	488,000	
日本山村硝子	5,000	201.00	1,005,000	

日本電気硝子	24,000	628.00	15,072,000	
オハラ	500	638.00	319,000	
住友大阪セメント	23,000	468.00	10,764,000	
太平洋セメント	78,000	367.00	28,626,000	
デイ・シイ	1,300	450.00	585,000	
日本ヒューム	1,300	823.00	1,069,900	
日本コンクリート工業	2,200	508.00	1,117,600	
三谷セキサン	600	1,785.00	1,071,000	
ジャパンパイル	1,700	737.00	1,252,900	
東海カーボン	11,000	405.00	4,455,000	
日本カーボン	7,000	420.00	2,940,000	
東洋炭素	700	2,083.00	1,458,100	
ノリタケカンパニーリミテド	7,000	298.00	2,086,000	
TOTO	18,000	2,271.00	40,878,000	
日本碍子	16,000	3,275.00	52,400,000	
日本特殊陶業	10,800	3,545.00	38,286,000	
ダントーホールディングス	2,000	179.00	358,000	
MARUWA	400	2,625.00	1,050,000	
品川リフラクトリーズ	3,000	296.00	888,000	
黒崎播磨	3,000	278.00	834,000	
ヨータイ	1,000	376.00	376,000	
イソライト工業	700	241.00	168,700	
東京窯業	1,000	222.00	222,000	
ニッカトー	400	429.00	171,600	
フジミインコーポレーテッド	1,200	1,928.00	2,313,600	
エーアンドエーマテリアル	3,000	114.00	342,000	
ニチアス	6,000	761.00	4,566,000	
ニチハ	1,700	1,929.00	3,279,300	
新日鐵住金	530,000	330.50	175,165,000	
神戸製鋼所	217,000	215.00	46,655,000	
合同製鐵	6,000	233.00	1,398,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	32,000	2,952.00	94,464,000	
日新製鋼	5,300	1,610.00	8,533,000	
東京製鐵	6,400	917.00	5,868,800	
共英製鋼	1,300	2,330.00	3,029,000	
大和工業	2,900	3,120.00	9,048,000	

東京鐵鋼	2,000	628.00	1,256,000	
大阪製鐵	800	2,453.00	1,962,400	
淀川製鋼所	9,000	551.00	4,959,000	
東洋鋼鈹	3,000	609.00	1,827,000	
丸一鋼管	3,900	3,135.00	12,226,500	
モリ工業	2,000	401.00	802,000	
大同特殊鋼	21,000	543.00	11,403,000	
日本高周波鋼業	5,000	120.00	600,000	
日本冶金工業	9,900	236.00	2,336,400	
山陽特殊製鋼	8,000	603.00	4,824,000	
愛知製鋼	7,000	565.00	3,955,000	
日立金属	13,000	1,926.00	25,038,000	
日本金属	4,000	162.00	648,000	
大平洋金属	8,000	387.00	3,096,000	
新日本電工	7,700	299.00	2,302,300	
栗本鐵工所	7,000	258.00	1,806,000	
虹技	2,000	213.00	426,000	
日本鑄鉄管	1,000	229.00	229,000	
三菱製鋼	8,000	281.00	2,248,000	
日亜鋼業	1,800	314.00	565,200	
日本精線	1,000	617.00	617,000	
シンニッタン	1,300	602.00	782,600	
新家工業	3,000	189.00	567,000	
大紀アルミニウム工業所	2,000	409.00	818,000	
日本輕金属ホールディングス	30,600	217.00	6,640,200	
三井金属鉱業	34,000	339.00	11,526,000	
東邦亜鉛	7,000	399.00	2,793,000	
三菱マテリアル	78,000	493.00	38,454,000	
住友金属鉱山	35,000	1,979.00	69,265,000	
DOWAホールディングス	15,000	1,175.00	17,625,000	
古河機械金属	20,000	228.00	4,560,000	
エス・サイエンス	6,500	51.00	331,500	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,200	3,435.00	4,122,000	
東邦チタニウム	2,100	1,496.00	3,141,600	
UACJ	14,000	323.00	4,522,000	
古河電気工業	37,000	231.00	8,547,000	

住友電気工業	47,300	2,012.00	95,167,600
フジクラ	17,000	698.00	11,866,000
昭和電線ホールディングス	14,000	97.00	1,358,000
タツタ電線	2,400	513.00	1,231,200
沖電線	1,000	298.00	298,000
カナレ電気	200	2,251.00	450,200
平河ヒューテック	300	1,375.00	412,500
リョービ	7,000	477.00	3,339,000
アーレスティ	1,500	1,043.00	1,564,500
アサヒホールディングス	1,900	2,160.00	4,104,000
稲葉製作所	700	1,518.00	1,062,600
宮地エンジニアリンググループ	4,000	185.00	740,000
トーカロ	800	2,868.00	2,294,400
アルファC O	400	1,367.00	546,800
SUMCO	9,800	1,632.00	15,993,600
川田テクノロジーズ	200	4,490.00	898,000
東洋製罐グループホールディングス	8,900	2,059.00	18,325,100
ホッカンホールディングス	3,000	306.00	918,000
コロナ	700	1,209.00	846,300
横河ブリッジホールディングス	2,400	1,281.00	3,074,400
駒井ハルテック	3,000	261.00	783,000
高田機工	1,000	255.00	255,000
三和ホールディングス	11,800	1,097.00	12,944,600
文化シャッター	3,500	1,015.00	3,552,500
三協立山	1,700	2,088.00	3,549,600
アルインコ	600	1,140.00	684,000
東洋シャッター	300	1,020.00	306,000
LIXILグループ	18,600	2,487.00	46,258,200
日本フィルコン	900	539.00	485,100
ノーリツ	2,500	2,372.00	5,930,000
長府製作所	1,300	3,005.00	3,906,500
リンナイ	2,300	9,980.00	22,954,000
ダイニチ工業	700	768.00	537,600
日東精工	2,000	351.00	702,000
三洋工業	2,000	219.00	438,000
岡部	2,500	999.00	2,497,500

ジーテクト	1,100	1,259.00	1,384,900	
中国工業	200	823.00	164,600	
東プレ	2,400	2,267.00	5,440,800	
高周波熱錬	2,200	887.00	1,951,400	
東京製綱	9,000	223.00	2,007,000	
サンコール	1,000	719.00	719,000	
モリテック スチール	700	330.00	231,000	
パイオラックス	600	6,280.00	3,768,000	
日本発條	10,900	1,402.00	15,281,800	
中央発條	2,000	337.00	674,000	
アドバネクス	2,000	179.00	358,000	
三益半導体工業	900	1,238.00	1,114,200	
日本ドライケミカル	100	2,419.00	241,900	
日本製鋼所	18,000	524.00	9,432,000	
三浦工業	5,600	1,430.00	8,008,000	
タクマ	4,000	793.00	3,172,000	
ツガミ	4,000	692.00	2,768,000	
オークマ	8,000	1,430.00	11,440,000	
東芝機械	7,000	583.00	4,081,000	
アマダホールディングス	18,700	1,342.00	25,095,400	
アイダエンジニアリング	2,700	1,385.00	3,739,500	
滝澤鉄工所	4,000	248.00	992,000	
富士機械製造	4,100	1,316.00	5,395,600	
牧野フライス製作所	6,000	1,302.00	7,812,000	
オーエスジー	5,700	2,619.00	14,928,300	
ダイジェット工業	2,000	219.00	438,000	
旭ダイヤモンド工業	3,500	1,421.00	4,973,500	
D M G 森精機	7,900	2,413.00	19,062,700	
ソディック	2,400	1,032.00	2,476,800	
ディスコ	1,500	10,590.00	15,885,000	
日東工器	700	2,719.00	1,903,300	
パンチ工業	400	1,275.00	510,000	
豊和工業	700	750.00	525,000	
大阪機工	5,000	197.00	985,000	
東洋機械金属	900	543.00	488,700	
津田駒工業	3,000	148.00	444,000	

島精機製作所	1,800	2,057.00	3,702,600	
日阪製作所	1,600	1,150.00	1,840,000	
やまびこ	500	5,790.00	2,895,000	
ペガサスミシン製造	1,100	598.00	657,800	
ナブテスコ	7,700	3,140.00	24,178,000	
三井海洋開発	1,300	1,943.00	2,525,900	
レオン自動機	1,000	587.00	587,000	
S M C	3,800	38,190.00	145,122,000	
新川	1,100	1,097.00	1,206,700	
ホソカワミクロン	2,000	609.00	1,218,000	
ユニオンツール	600	4,255.00	2,553,000	
オイレス工業	1,500	2,312.00	3,468,000	
日精エー・エス・ビー機械	500	2,425.00	1,212,500	
サトーホールディングス	1,600	3,480.00	5,568,000	
日本エアータック	400	747.00	298,800	
日精樹脂工業	900	1,138.00	1,024,200	
ワイエイシイ	500	1,013.00	506,500	
小松製作所	61,500	2,524.00	155,226,000	
住友重機械工業	34,000	745.00	25,330,000	
日立建機	5,600	2,202.00	12,331,200	
日工	2,000	452.00	904,000	
巴工業	500	1,694.00	847,000	
井関農機	13,000	248.00	3,224,000	
T O W A	1,100	796.00	875,600	
丸山製作所	3,000	238.00	714,000	
北川鉄工所	6,000	325.00	1,950,000	
クボタ	60,000	1,987.00	119,220,000	
荏原実業	400	1,480.00	592,000	
三菱化工機	4,000	388.00	1,552,000	
月島機械	2,200	1,333.00	2,932,600	
帝国電機製作所	900	1,066.00	959,400	
新東工業	3,000	1,169.00	3,507,000	
澁谷工業	1,000	2,230.00	2,230,000	
アイチ コーポレーション	1,800	725.00	1,305,000	
小森コーポレーション	3,100	1,739.00	5,390,900	
鶴見製作所	900	1,904.00	1,713,600	

住友精密工業	2,000	471.00	942,000	
酒井重工業	2,000	269.00	538,000	
荏原製作所	26,000	602.00	15,652,000	
石井鐵工所	2,000	219.00	438,000	
西島製作所	1,200	994.00	1,192,800	
北越工業	1,200	915.00	1,098,000	
ダイキン工業	17,400	9,051.00	157,487,400	
オルガノ	2,000	538.00	1,076,000	
トーヨーカネツ	7,000	231.00	1,617,000	
栗田工業	7,100	2,953.00	20,966,300	
椿本チエイン	6,000	1,215.00	7,290,000	
大同工業	3,000	252.00	756,000	
日本コンベヤ	4,000	203.00	812,000	
木村化工機	1,200	502.00	602,400	
アネスト岩田	1,900	784.00	1,489,600	
ダイフク	5,900	1,993.00	11,758,700	
サムコ	200	1,195.00	239,000	
加藤製作所	3,000	748.00	2,244,000	
油研工業	2,000	277.00	554,000	
タダノ	6,000	1,899.00	11,394,000	
フジテック	3,500	1,530.00	5,355,000	
C K D	3,400	1,371.00	4,661,400	
キトー	1,300	1,216.00	1,580,800	
平和	2,600	2,467.00	6,414,200	
理想科学工業	1,500	2,414.00	3,621,000	
S A N K Y O	3,300	4,425.00	14,602,500	
日本金銭機械	1,100	1,714.00	1,885,400	
マースエンジニアリング	700	2,151.00	1,505,700	
福島工業	700	2,315.00	1,620,500	
オーイズミ	400	801.00	320,400	
ダイコク電機	500	1,722.00	861,000	
竹内製作所	500	7,080.00	3,540,000	
アマノ	4,000	1,709.00	6,836,000	
J U K I	9,000	344.00	3,096,000	
サンデンホールディングス	7,000	598.00	4,186,000	
蛇の目マシン工業	12,000	135.00	1,620,000	

マックス	2,000	1,295.00	2,590,000	
グローリー	3,800	3,705.00	14,079,000	
新晃工業	800	1,238.00	990,400	
大和冷機工業	1,700	822.00	1,397,400	
セガサミーホールディングス	12,900	1,658.00	21,388,200	
日本ピストンリング	5,000	236.00	1,180,000	
リケン	5,000	508.00	2,540,000	
T P R	1,300	3,730.00	4,849,000	
ホシザキ電機	2,600	7,290.00	18,954,000	
大豊工業	1,000	1,692.00	1,692,000	
日本精工	24,600	1,996.00	49,101,600	
N T N	28,000	798.00	22,344,000	
ジェイテクト	12,800	2,450.00	31,360,000	
不二越	11,000	744.00	8,184,000	
日本トムソン	4,000	714.00	2,856,000	
T H K	8,000	2,736.00	21,888,000	
ユーシン精機	500	2,996.00	1,498,000	
前澤給装工業	500	1,641.00	820,500	
イーグル工業	1,700	2,912.00	4,950,400	
前澤工業	900	524.00	471,600	
日本ピラー工業	1,300	1,134.00	1,474,200	
キッツ	5,400	599.00	3,234,600	
日立工機	3,200	1,034.00	3,308,800	
マキタ	7,800	6,970.00	54,366,000	
日立造船	9,400	711.00	6,683,400	
三菱重工業	201,000	761.80	153,121,800	
I H I	86,000	593.00	50,998,000	
イビデン	7,900	2,142.00	16,921,800	
コニカミノルタ	28,600	1,476.00	42,213,600	
ブラザー工業	15,500	1,827.00	28,318,500	
ミネベア	18,000	2,070.00	37,260,000	
日立製作所	288,000	836.60	240,940,800	
東芝	252,000	429.50	108,234,000	
三菱電機	120,000	1,633.00	195,960,000	
富士電機	33,000	549.00	18,117,000	
東洋電機製造	2,000	453.00	906,000	

安川電機	14,700	1,641.00	24,122,700
シンフォニアテクノロジー	8,000	251.00	2,008,000
明電舎	11,000	475.00	5,225,000
オリジン電気	2,000	447.00	894,000
山洋電気	3,000	1,025.00	3,075,000
デンヨー	1,000	2,007.00	2,007,000
東芝テック	8,000	696.00	5,568,000
芝浦メカトロニクス	2,000	295.00	590,000
マブチモーター	3,400	8,000.00	27,200,000
日本電産	13,100	9,145.00	119,799,500
東光高岳	600	1,656.00	993,600
ダイヘン	6,000	651.00	3,906,000
田淵電機	1,400	1,182.00	1,654,800
ヤーマン	200	1,586.00	317,200
JVCケンウッド	8,900	350.00	3,115,000
ミマキエンジニアリング	700	982.00	687,400
第一精工	400	2,095.00	838,000
日新電機	2,800	889.00	2,489,200
大崎電気工業	2,000	702.00	1,404,000
オムロン	13,000	5,530.00	71,890,000
日東工業	1,900	2,892.00	5,494,800
I D E C	1,400	1,145.00	1,603,000
不二電機工業	100	1,530.00	153,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	23,000	500.00	11,500,000
サクサホールディングス	3,000	246.00	738,000
メルコホールディングス	700	2,328.00	1,629,600
テクノメディカ	300	2,927.00	878,100
日本電気	155,000	385.00	59,675,000
富士通	115,000	728.60	83,789,000
沖電気工業	42,000	262.00	11,004,000
岩崎通信機	6,000	96.00	576,000
電気興業	3,000	601.00	1,803,000
サンケン電気	6,000	797.00	4,782,000
ナカヨ	1,000	366.00	366,000
アイホン	700	2,133.00	1,493,100
ルネサスエレクトロニクス	6,200	939.00	5,821,800

セイコーエプソン	16,300	2,264.00	36,903,200
ワコム	9,500	454.00	4,313,000
アルバック	2,000	1,998.00	3,996,000
アクセル	600	1,744.00	1,046,400
E I Z O	1,100	2,948.00	3,242,800
ジャパンディスプレイ	24,600	500.00	12,300,000
日本信号	3,300	1,362.00	4,494,600
京三製作所	3,000	387.00	1,161,000
能美防災	1,600	1,511.00	2,417,600
ホーチキ	900	883.00	794,700
エレコム	500	2,992.00	1,496,000
日本無線	3,000	432.00	1,296,000
パナソニック	146,100	1,774.00	259,181,400
シャープ	102,000	160.00	16,320,000
アンリツ	7,200	853.00	6,141,600
富士通ゼネラル	4,000	1,630.00	6,520,000
日立国際電気	3,000	1,950.00	5,850,000
ソニー	78,400	3,880.00	304,192,000
T D K	7,200	9,760.00	70,272,000
帝国通信工業	3,000	231.00	693,000
ミツミ電機	4,300	872.00	3,749,600
タムラ製作所	5,000	499.00	2,495,000
アルプス電気	9,500	3,915.00	37,192,500
池上通信機	4,000	183.00	732,000
パイオニア	18,100	229.00	4,144,900
日本電波工業	1,100	944.00	1,038,400
鈴木	100	1,578.00	157,800
日本トリム	300	3,340.00	1,002,000
ローランド ディー . ジー .	500	3,655.00	1,827,500
フォスター電機	1,400	2,846.00	3,984,400
クラリオン	6,000	376.00	2,256,000
S M K	3,000	520.00	1,560,000
ヨコオ	900	721.00	648,900
東光	3,000	345.00	1,035,000
ティアック	7,000	47.00	329,000
ホシデン	3,700	785.00	2,904,500

ヒロセ電機	2,000	17,640.00	35,280,000
日本航空電子工業	4,000	3,395.00	13,580,000
TOA	1,300	1,291.00	1,678,300
日立マクセル	2,400	2,063.00	4,951,200
古野電気	1,400	960.00	1,344,000
ユニデン	3,000	246.00	738,000
アルパイン	2,900	2,449.00	7,102,100
スミダコーポレーション	1,100	941.00	1,035,100
アイコム	700	3,100.00	2,170,000
リオン	400	1,758.00	703,200
船井電機	1,200	1,486.00	1,783,200
横河電機	12,000	1,617.00	19,404,000
新電元工業	5,000	642.00	3,210,000
アズビル	3,900	3,240.00	12,636,000
東亜ディーケーケー	500	590.00	295,000
日本光電工業	5,100	3,075.00	15,682,500
チノー	400	1,241.00	496,400
共和電業	1,500	517.00	775,500
日本電子材料	500	798.00	399,000
堀場製作所	2,200	4,925.00	10,835,000
アドバンテスト	8,200	1,330.00	10,906,000
小野測器	600	1,044.00	626,400
エスベック	1,300	1,431.00	1,860,300
パナソニック デバイスSUNX	1,100	882.00	970,200
キーエンス	2,700	68,330.00	184,491,000
日置電機	600	2,632.00	1,579,200
シスメックス	9,300	7,520.00	69,936,000
メガチップス	1,200	1,662.00	1,994,400
OBARA GROUP	800	6,780.00	5,424,000
澤藤電機	1,000	240.00	240,000
コーセル	1,700	1,523.00	2,589,100
新日本無線	1,000	766.00	766,000
オブテックス	800	2,666.00	2,132,800
千代田インテグレ	600	3,420.00	2,052,000
レーザーテック	1,200	1,774.00	2,128,800
スタンレー電気	8,600	2,644.00	22,738,400

岩崎電気	4,000	282.00	1,128,000
ウシオ電機	7,300	1,659.00	12,110,700
岡谷電機産業	700	425.00	297,500
ヘリオス テクノ ホールディング	1,200	431.00	517,200
日本セラミック	700	1,766.00	1,236,200
遠藤照明	600	1,372.00	823,200
日本デジタル研究所	1,000	1,700.00	1,700,000
古河電池	1,000	868.00	868,000
双信電機	600	407.00	244,200
山一電機	1,400	1,201.00	1,681,400
図研	900	1,227.00	1,104,300
日本電子	5,000	567.00	2,835,000
カシオ計算機	12,000	2,455.00	29,460,000
ファナック	12,500	25,645.00	320,562,500
日本シイエムケイ	3,100	339.00	1,050,900
エンプラス	500	5,080.00	2,540,000
大真空	2,000	311.00	622,000
ローム	5,900	8,500.00	50,150,000
浜松ホトニクス	9,400	3,725.00	35,015,000
三井ハイテック	1,600	892.00	1,427,200
新光電気工業	4,600	976.00	4,489,600
京セラ	19,700	6,647.00	130,945,900
太陽誘電	6,300	1,817.00	11,447,100
村田製作所	12,600	21,740.00	273,924,000
ユーシン	1,700	756.00	1,285,200
双葉電子工業	2,000	2,350.00	4,700,000
北陸電気工業	5,000	183.00	915,000
ニチコン	3,800	1,007.00	3,826,600
日本ケミコン	10,000	384.00	3,840,000
K O A	1,600	1,333.00	2,132,800
市光工業	3,000	322.00	966,000
小糸製作所	7,200	4,870.00	35,064,000
ミツバ	2,200	3,285.00	7,227,000
スター精密	2,300	2,131.00	4,901,300
S C R E E Nホールディングス	11,000	807.00	8,877,000
キヤノン電子	1,100	2,530.00	2,783,000

キヤノン	69,500	4,210.00	292,595,000	代用有価証券 10,000株
リコー	36,000	1,283.00	46,188,000	
MUTOHホールディングス	1,000	396.00	396,000	
東京エレクトロン	10,100	8,100.00	81,810,000	
トヨタ紡織	4,200	2,102.00	8,828,400	
鬼怒川ゴム工業	3,000	684.00	2,052,000	
ユニプレス	2,300	2,636.00	6,062,800	
豊田自動織機	10,900	7,260.00	79,134,000	
モリタホールディングス	2,100	1,121.00	2,354,100	
三櫻工業	1,500	850.00	1,275,000	
デンソー	29,600	6,310.00	186,776,000	
東海理化電機製作所	3,100	3,150.00	9,765,000	
三井造船	46,000	219.00	10,074,000	
川崎重工業	87,000	598.00	52,026,000	
名村造船所	3,400	1,087.00	3,695,800	
サノヤスホールディングス	1,500	266.00	399,000	
日本車輛製造	4,000	344.00	1,376,000	
ニチユ三菱フォークリフト	1,400	615.00	861,000	
近畿車輛	2,000	350.00	700,000	
日産自動車	168,200	1,257.50	211,511,500	
いすゞ自動車	37,900	1,645.00	62,345,500	
トヨタ自動車	165,400	8,338.00	1,379,105,200	代用有価証券 35,000株
日野自動車	17,100	1,580.00	27,018,000	
三菱自動車工業	43,900	1,064.00	46,709,600	
エフテック	700	1,283.00	898,100	
レシップホールディングス	400	867.00	346,800	
GMB	200	1,270.00	254,000	
ファルテック	100	1,596.00	159,600	
武蔵精密工業	1,300	2,508.00	3,260,400	
日産車体	5,300	1,709.00	9,057,700	
新明和工業	5,000	1,168.00	5,840,000	
極東開発工業	2,200	1,373.00	3,020,600	
日信工業	2,200	2,038.00	4,483,600	
トピー工業	10,000	324.00	3,240,000	
ティラド	5,000	250.00	1,250,000	

曙ブレーキ工業	5,100	403.00	2,055,300
タチエス	1,900	1,844.00	3,503,600
NOK	5,800	3,940.00	22,852,000
フタバ産業	3,700	604.00	2,234,800
カヤバ工業	13,000	453.00	5,889,000
シロキ工業	3,000	378.00	1,134,000
大同メタル工業	1,700	1,237.00	2,102,900
プレス工業	6,000	591.00	3,546,000
ミクニ	1,200	589.00	706,800
カルソニックカンセイ	9,000	906.00	8,154,000
太平洋工業	2,500	1,234.00	3,085,000
ケーヒン	2,800	1,852.00	5,185,600
河西工業	1,500	1,266.00	1,899,000
アイシン精機	11,000	5,310.00	58,410,000
富士機工	1,400	707.00	989,800
マツダ	35,700	2,507.50	89,517,750
ダイハツ工業	14,300	1,796.00	25,682,800
今仙電機製作所	1,000	1,366.00	1,366,000
本田技研工業	107,900	4,060.50	438,127,950
スズキ	25,100	4,122.00	103,462,200
富士重工業	40,800	4,500.50	183,620,400
安永	500	576.00	288,000
ヤマハ発動機	18,200	2,802.00	50,996,400
ショーワ	2,800	1,256.00	3,516,800
T B K	1,600	569.00	910,400
エクセディ	1,600	3,150.00	5,040,000
豊田合成	3,900	3,075.00	11,992,500
愛三工業	1,900	1,191.00	2,262,900
盟和産業	1,000	153.00	153,000
ヨロズ	1,100	2,748.00	3,022,800
エフ・シー・シー	1,800	1,916.00	3,448,800
シマノ	5,200	17,560.00	91,312,000
タカタ	2,200	1,342.00	2,952,400
テイ・エス テック	2,500	3,290.00	8,225,000
ジャムコ	500	4,065.00	2,032,500
テルモ	18,400	2,962.00	54,500,800

クリエートメディック	400	1,048.00	419,200
日機装	3,900	1,305.00	5,089,500
島津製作所	14,000	1,704.00	23,856,000
JMS	2,000	312.00	624,000
ショットモリテックス	300	255.00	76,500
長野計器	800	822.00	657,600
ブイ・テクノロジー	200	4,170.00	834,000
東京計器	4,000	267.00	1,068,000
愛知時計電機	1,000	360.00	360,000
オーバル	1,200	308.00	369,600
東京精密	2,200	2,771.00	6,096,200
マニー	400	8,230.00	3,292,000
ニコン	22,400	1,487.00	33,308,800
トプコン	3,600	2,913.00	10,486,800
オリンパス	17,900	4,345.00	77,775,500
理研計器	1,100	1,407.00	1,547,700
タムロン	900	2,814.00	2,532,600
HOYA	28,500	4,946.50	140,975,250
ノーリツ鋼機	1,100	711.00	782,100
エー・アンド・デイ	1,100	532.00	585,200
シチズンホールディングス	14,800	899.00	13,305,200
リズム時計工業	5,000	174.00	870,000
大研医器	800	1,254.00	1,003,200
松風	600	1,363.00	817,800
セイコーホールディングス	8,000	653.00	5,224,000
ニプロ	7,600	1,274.00	9,682,400
パラマウントベッドホールディングス	1,300	3,590.00	4,667,000
トランザクション	100	1,322.00	132,200
SHO-BI	400	411.00	164,400
前田工織	1,300	1,117.00	1,452,100
永大産業	2,000	468.00	936,000
アートネイチャー	900	1,168.00	1,051,200
ダンロップスポーツ	800	1,218.00	974,400
バンダイナムコホールディングス	13,200	2,459.00	32,458,800
共立印刷	2,200	301.00	662,200
フランスベッドホールディングス	8,000	195.00	1,560,000

パイロットコーポレーション	1,000	8,970.00	8,970,000	
萩原工業	300	2,073.00	621,900	
トッパン・フォームズ	2,100	1,707.00	3,584,700	
フジシールインターナショナル	1,500	3,745.00	5,617,500	
タカラトミー	4,400	682.00	3,000,800	
廣濟堂	1,100	641.00	705,100	
A s - m e エステール	400	790.00	316,000	
アーク	3,900	134.00	522,600	
タカノ	600	913.00	547,800	
プロネクサス	1,200	778.00	933,600	
ホクシン	1,100	155.00	170,500	
ウッドワン	2,000	289.00	578,000	
大建工業	5,000	316.00	1,580,000	
凸版印刷	34,000	1,062.00	36,108,000	
大日本印刷	36,000	1,297.00	46,692,000	
図書印刷	2,000	420.00	840,000	
共同印刷	4,000	366.00	1,464,000	
日本写真印刷	2,000	2,125.00	4,250,000	
光村印刷	1,000	274.00	274,000	
宝印刷	600	1,157.00	694,200	
アシックス	11,900	3,240.00	38,556,000	
ツツミ	600	2,910.00	1,746,000	
小松ウオール工業	400	2,488.00	995,200	
ヤマハ	8,800	2,569.00	22,607,200	
河合楽器製作所	400	2,353.00	941,200	
クリナップ	1,100	888.00	976,800	
ピジョン	6,800	3,900.00	26,520,000	
兼松日産農林	2,000	164.00	328,000	
キングジム	1,000	906.00	906,000	
リンテック	2,900	2,910.00	8,439,000	
T A S A K I	200	3,030.00	606,000	
イトーキ	2,500	727.00	1,817,500	
任天堂	7,400	21,420.00	158,508,000	
三菱鉛筆	1,000	5,950.00	5,950,000	
タカラスタンダード	5,000	882.00	4,410,000	
コクヨ	6,200	1,109.00	6,875,800	

ナカバヤシ	3,000	239.00	717,000	
岡村製作所	4,600	1,094.00	5,032,400	
美津濃	6,000	609.00	3,654,000	
アデランス	1,400	1,079.00	1,510,600	
東京電力	101,700	698.00	70,986,600	
中部電力	36,700	1,841.00	67,564,700	
関西電力	48,900	1,376.50	67,310,850	
中国電力	16,600	1,818.00	30,178,800	
北陸電力	11,800	1,861.00	21,959,800	
東北電力	29,900	1,702.00	50,889,800	
四国電力	10,800	1,835.00	19,818,000	
九州電力	26,500	1,431.00	37,921,500	
北海道電力	11,200	1,370.00	15,344,000	
沖縄電力	1,200	3,105.00	3,726,000	
電源開発	8,700	4,400.00	38,280,000	
東京瓦斯	146,000	673.30	98,301,800	
大阪瓦斯	124,000	497.40	61,677,600	
東邦瓦斯	31,000	749.00	23,219,000	
北海道瓦斯	2,000	289.00	578,000	
広島ガス	1,900	488.00	927,200	
西部瓦斯	14,000	294.00	4,116,000	
静岡ガス	3,400	884.00	3,005,600	
メタウォーター	700	3,205.00	2,243,500	
SBSホールディングス	1,200	986.00	1,183,200	
東武鉄道	64,000	542.00	34,688,000	
相鉄ホールディングス	21,000	623.00	13,083,000	
東京急行電鉄	65,000	840.00	54,600,000	
京浜急行電鉄	33,000	951.00	31,383,000	
小田急電鉄	38,000	1,203.00	45,714,000	
京王電鉄	33,000	907.00	29,931,000	
京成電鉄	18,000	1,524.00	27,432,000	
富士急行	3,000	1,096.00	3,288,000	
東日本旅客鉄道	22,000	11,275.00	248,050,000	
西日本旅客鉄道	11,600	7,895.00	91,582,000	
東海旅客鉄道	10,700	22,795.00	243,906,500	
西武ホールディングス	9,500	2,955.00	28,072,500	

鴻池運輸	1,500	1,477.00	2,215,500
西日本鉄道	15,000	562.00	8,430,000
ハマキョウレックス	400	5,220.00	2,088,000
サカイ引越センター	200	4,750.00	950,000
近鉄グループホールディングス	121,000	425.00	51,425,000
阪急阪神ホールディングス	80,000	744.00	59,520,000
南海電気鉄道	27,000	560.00	15,120,000
京阪電気鉄道	27,000	722.00	19,494,000
神戸電鉄	3,000	361.00	1,083,000
名糖運輸	500	752.00	376,000
名古屋鉄道	44,000	467.00	20,548,000
山陽電気鉄道	4,000	473.00	1,892,000
日本通運	46,000	637.00	29,302,000
ヤマトホールディングス	21,100	2,494.50	52,633,950
山九	14,000	658.00	9,212,000
丸運	800	273.00	218,400
丸全昭和運輸	4,000	441.00	1,764,000
センコー	5,000	775.00	3,875,000
トナミホールディングス	2,000	401.00	802,000
日本梱包運輸倉庫	3,900	2,207.00	8,607,300
日本石油輸送	2,000	247.00	494,000
福山通運	7,000	688.00	4,816,000
セイノーホールディングス	9,300	1,417.00	13,178,100
神奈川中央交通	1,000	586.00	586,000
日立物流	2,500	2,023.00	5,057,500
丸和運輸機関	100	3,335.00	333,500
日本郵船	101,000	353.00	35,653,000
商船三井	63,000	396.00	24,948,000
川崎汽船	52,000	293.00	15,236,000
N S ユナイテッド海運	5,000	281.00	1,405,000
明治海運	1,100	431.00	474,100
飯野海運	6,200	620.00	3,844,000
共栄タンカー	1,000	223.00	223,000
日本航空	23,000	4,230.00	97,290,000
A N A ホールディングス	236,000	329.70	77,809,200
パスコ	1,000	360.00	360,000

トランコム	300	6,370.00	1,911,000	
日新	5,000	375.00	1,875,000	
三菱倉庫	8,000	1,690.00	13,520,000	
三井倉庫ホールディングス	7,000	394.00	2,758,000	
住友倉庫	9,000	702.00	6,318,000	
澁澤倉庫	3,000	352.00	1,056,000	
東陽倉庫	2,000	291.00	582,000	
乾汽船	800	999.00	799,200	
日本トランスシティ	3,000	429.00	1,287,000	
ケイヒン	2,000	211.00	422,000	
中央倉庫	700	983.00	688,100	
安田倉庫	900	1,008.00	907,200	
東洋埠頭	4,000	218.00	872,000	
宇徳	1,000	556.00	556,000	
上組	14,000	1,145.00	16,030,000	
サンリツ	400	568.00	227,200	
キムラユニティー	300	1,177.00	353,100	
キューソー流通システム	400	1,953.00	781,200	
郵船ロジスティクス	1,100	1,468.00	1,614,800	
近鉄エクスプレス	1,100	5,510.00	6,061,000	
東海運	700	288.00	201,600	
エーアイティー	600	1,146.00	687,600	
内外トランスライン	200	2,597.00	519,400	
NEC ネットズエスアイ	1,500	2,754.00	4,131,000	
システナ	1,100	1,060.00	1,166,000	
デジタルーツ	600	1,512.00	907,200	
新日鉄住金ソリューションズ	1,000	4,035.00	4,035,000	
キューブシステム	500	693.00	346,500	
コア	500	890.00	445,000	
ソフトクリエイトホールディングス	400	952.00	380,800	
ITホールディングス	3,900	2,661.00	10,377,900	
ネオス	400	676.00	270,400	
電算システム	400	1,689.00	675,600	
グリー	7,200	749.00	5,392,800	
コーエーテクモホールディングス	2,700	2,164.00	5,842,800	
三菱総合研究所	500	2,938.00	1,469,000	

ボルテージ	200	2,485.00	497,000	
電算	100	2,265.00	226,500	
A G S	200	1,096.00	219,200	
ファインデックス	700	1,500.00	1,050,000	
ヒト・コミュニケーションズ	100	2,080.00	208,000	
ブレインパッド	200	1,068.00	213,600	
K L a b	1,300	1,808.00	2,350,400	
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	800	1,276.00	1,020,800	
イーブックイニシアティブジャパン	300	1,003.00	300,900	
ネクソン	11,300	1,782.00	20,136,600	
アイスタイル	500	1,105.00	552,500	
エムアップ	300	760.00	228,000	
エイチーム	400	2,481.00	992,400	
e n i s h	300	1,891.00	567,300	
コロプラ	3,200	2,529.00	8,092,800	
モバイルクリエイト	700	797.00	557,900	
オルトプラス	500	870.00	435,000	
ブロードリーフ	1,000	1,711.00	1,711,000	
ハーツユナイテッドグループ	400	1,901.00	760,400	
ベリサーブ	100	1,168.00	116,800	
ティーガイア	1,200	1,900.00	2,280,000	
豆蔵ホールディングス	900	654.00	588,600	
テクマトリックス	500	1,002.00	501,000	
GMOペイメントゲートウェイ	1,000	3,820.00	3,820,000	
ザッパラス	700	597.00	417,900	
インターネットイニシアティブ	1,900	2,124.00	4,035,600	
GMOクラウド	300	982.00	294,600	
ビットアイル	1,400	488.00	683,200	
S R Aホールディングス	600	2,352.00	1,411,200	
システムインテグレータ	200	609.00	121,800	
パイブドピッツ	200	1,838.00	367,600	
朝日ネット	1,200	529.00	634,800	
コムチュア	200	2,343.00	468,600	
g u m i	1,200	1,439.00	1,726,800	
パナソニック インフォメーションシステムズ	300	4,420.00	1,326,000	

フェイス	300	1,563.00	468,900
ハイマックス	200	1,175.00	235,000
野村総合研究所	6,700	4,855.00	32,528,500
サイバネットシステム	1,000	480.00	480,000
C Eホールディングス	200	1,264.00	252,800
インテージホールディングス	700	1,935.00	1,354,500
東邦システムサイエンス	400	638.00	255,200
ソースネクスト	600	760.00	456,000
ティー・ワイ・オー	1,800	204.00	367,200
クレスコ	300	1,908.00	572,400
フジ・メディア・ホールディングス	12,300	1,580.00	19,434,000
オービック	4,100	5,400.00	22,140,000
ジャストシステム	2,200	817.00	1,797,400
TDCソフトウェアエンジニアリング	300	1,312.00	393,600
ヤフー	84,800	514.00	43,587,200
トレンドマイクロ	6,300	4,325.00	27,247,500
インフォメーション・ディベロプメント	200	1,008.00	201,600
日本オラクル	1,900	5,470.00	10,393,000
アルファシステムズ	400	1,916.00	766,400
フューチャーアーキテクト	1,200	819.00	982,800
CAC Holdings	800	1,137.00	909,600
ソフトバンク・テクノロジー	300	1,454.00	436,200
トーセ	300	888.00	266,400
オービックビジネスコンサルタント	700	4,705.00	3,293,500
伊藤忠テクノソリューションズ	2,700	3,025.00	8,167,500
アイティフォー	1,400	489.00	684,600
東計電算	200	1,968.00	393,600
エクスネット	100	1,551.00	155,100
大塚商会	3,200	5,780.00	18,496,000
サイボウズ	1,600	342.00	547,200
ソフトブレーン	1,700	186.00	316,200
電通国際情報サービス	700	1,369.00	958,300
EMシステムズ	200	2,275.00	455,000
ウェザーニューズ	300	3,815.00	1,144,500
C I J	1,100	575.00	632,500
東洋ビジネスエンジニアリング	100	1,475.00	147,500

日本エンタープライズ	1,100	333.00	366,300
WOWOW	600	3,785.00	2,271,000
フュージョンパートナー	700	742.00	519,400
日本コロムビア	500	400.00	200,000
イマジカ・ロボット ホールディングス	900	593.00	533,700
ネットワンシステムズ	4,800	880.00	4,224,000
アルゴグラフィックス	500	2,037.00	1,018,500
マーベラス	2,000	1,595.00	3,190,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	2,300	2,262.00	5,202,600
日本ユニシス	3,300	1,211.00	3,996,300
兼松エレクトロニクス	700	2,053.00	1,437,100
東京放送ホールディングス	7,100	1,694.00	12,027,400
日本テレビホールディングス	10,800	2,118.00	22,874,400
朝日放送	1,200	1,008.00	1,209,600
テレビ朝日ホールディングス	3,200	2,063.00	6,601,600
スカパーJ S A Tホールディングス	9,000	673.00	6,057,000
テレビ東京ホールディングス	1,000	1,963.00	1,963,000
日本BS放送	200	1,162.00	232,400
コネクシオ	800	1,360.00	1,088,000
クロップス	200	520.00	104,000
日本電信電話	46,300	9,075.00	420,172,500
K D D I	120,200	2,958.00	355,551,600
光通信	1,100	8,420.00	9,262,000
N T T ドコモ	91,200	2,388.00	217,785,600
エムティーアイ	1,500	836.00	1,254,000
G M O インターネット	3,900	1,623.00	6,329,700
K A D O K A W A ・ D W A N G O	2,900	1,648.00	4,779,200
学研ホールディングス	4,000	254.00	1,016,000
ゼンリン	1,600	1,644.00	2,630,400
昭文社	700	857.00	599,900
インプレスホールディングス	900	224.00	201,600
アイネット	600	1,174.00	704,400
松竹	8,000	1,094.00	8,752,000
東宝	8,400	3,105.00	26,082,000
東映	4,000	885.00	3,540,000
A O I P r o .	500	1,105.00	552,500

エヌ・ティ・ティ・データ	7,300	5,440.00	39,712,000	
ピー・シー・エー	100	1,551.00	155,100	
D T S	1,200	2,760.00	3,312,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	4,600	2,770.00	12,742,000	
シーイーシー	800	1,172.00	937,600	
カプコン	3,000	2,423.00	7,269,000	
アイ・エス・ビー	100	914.00	91,400	
ジャステック	700	1,077.00	753,900	
S C S K	2,800	3,745.00	10,486,000	
日本システムウエア	500	1,038.00	519,000	
アイネス	1,600	1,288.00	2,060,800	
T K C	1,100	3,430.00	3,773,000	
富士ソフト	1,600	2,561.00	4,097,600	
N S D	2,800	1,657.00	4,639,600	
コナミ	4,800	2,335.00	11,208,000	
福井コンピュータホールディングス	300	837.00	251,100	
J B C Cホールディングス	1,000	808.00	808,000	
ミロク情報サービス	800	796.00	636,800	
ソフトバンク	62,500	7,485.00	467,812,500	
ハウスイ	1,000	151.00	151,000	
高千穂交易	400	1,092.00	436,800	
伊藤忠食品	300	4,260.00	1,278,000	
エレマテック	600	2,954.00	1,772,400	
J A L U X	300	2,420.00	726,000	
あらた	3,000	419.00	1,257,000	
トーメンデバイス	200	2,152.00	430,400	
東京エレクトロン デバイス	300	1,709.00	512,700	
フィールズ	800	2,074.00	1,659,200	
双日	79,300	308.00	24,424,400	
アルフレッサ ホールディングス	14,000	1,970.00	27,580,000	
横浜冷凍	2,900	989.00	2,868,100	
神栄	2,000	194.00	388,000	
山下医科器械	100	1,821.00	182,100	
ラサ商事	600	634.00	380,400	
アルコニックス	700	2,124.00	1,486,800	
神戸物産	400	6,520.00	2,608,000	

あい ホールディングス	1,900	2,265.00	4,303,500
ディーブイエックス	400	1,238.00	495,200
ダイワボウホールディングス	11,000	241.00	2,651,000
マクニカ・富士エレホールディングス	2,100	1,552.00	3,259,200
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,200	885.00	1,947,000
八洲電機	900	603.00	542,700
U K Cホールディングス	800	2,632.00	2,105,600
O C H Iホールディングス	300	1,343.00	402,900
T O K A Iホールディングス	5,800	507.00	2,940,600
三洋貿易	600	1,778.00	1,066,800
ウイン・パートナーズ	400	1,605.00	642,000
ミタチ産業	300	805.00	241,500
シップヘルスケアホールディングス	2,200	2,617.00	5,757,400
明治電機工業	400	1,342.00	536,800
デリカフーズ	200	1,036.00	207,200
スターティア	100	1,771.00	177,100
富士興産	500	569.00	284,500
協栄産業	2,000	213.00	426,000
小野建	1,000	1,242.00	1,242,000
佐鳥電機	900	878.00	790,200
エコートレーディング	300	682.00	204,600
伯東	800	1,515.00	1,212,000
コンドーテック	900	800.00	720,000
中山福	700	893.00	625,100
ナガイレーベン	1,700	2,452.00	4,168,400
三菱食品	1,300	2,776.00	3,608,800
松田産業	800	1,514.00	1,211,200
メディバルホールディングス	11,800	2,048.00	24,166,400
アドヴァン	600	1,645.00	987,000
S P K	300	2,400.00	720,000
萩原電気	300	2,038.00	611,400
アズワン	900	4,285.00	3,856,500
スズデン	400	926.00	370,400
シモジマ	700	1,079.00	755,300
ドウシシャ	1,500	2,198.00	3,297,000
小津産業	200	2,137.00	427,400

高速	700	892.00	624,400	
たけびし	400	1,092.00	436,800	
黒田電気	2,000	2,247.00	4,494,000	
丸文	1,000	993.00	993,000	
ハビネット	700	1,326.00	928,200	
橋本総業	200	1,487.00	297,400	
エクセル	600	1,450.00	870,000	
マルカキカイ	400	2,023.00	809,200	
ガリバーインターナショナル	3,600	1,149.00	4,136,400	
日本エム・ディ・エム	1,000	525.00	525,000	
進和	700	2,216.00	1,551,200	
エスケイジャパン	400	235.00	94,000	
ダイトエレクトロン	600	939.00	563,400	
シークス	700	3,190.00	2,233,000	
田中商事	400	782.00	312,800	
オーハシテクニカ	700	1,673.00	1,171,100	
白銅	400	1,514.00	605,600	
伊藤忠商事	99,000	1,691.50	167,458,500	
丸紅	103,400	719.90	74,437,660	
高島	2,000	279.00	558,000	
長瀬産業	6,600	1,707.00	11,266,200	
蝶理	700	1,932.00	1,352,400	
豊田通商	13,200	3,375.00	44,550,000	
三共生興	2,000	517.00	1,034,000	
兼松	24,000	227.00	5,448,000	
ツカモトコーポレーション	2,000	159.00	318,000	
三井物産	100,200	1,692.50	169,588,500	
日本紙パルプ商事	6,000	344.00	2,064,000	
日立ハイテクノロジーズ	4,100	3,535.00	14,493,500	
カメイ	1,500	1,128.00	1,692,000	
東都水産	2,000	205.00	410,000	
OUGホールディングス	2,000	253.00	506,000	
スターゼン	5,000	377.00	1,885,000	
山善	4,500	1,138.00	5,121,000	
椿本興業	1,000	385.00	385,000	
住友商事	69,800	1,454.00	101,489,200	

内田洋行	3,000	428.00	1,284,000
三菱商事	90,600	2,795.00	253,227,000
第一実業	3,000	648.00	1,944,000
キャノンマーケティングジャパン	3,400	2,161.00	7,347,400
西華産業	4,000	338.00	1,352,000
佐藤商事	1,100	828.00	910,800
菱洋エレクトロ	1,400	1,597.00	2,235,800
東京産業	1,200	501.00	601,200
ユアサ商事	1,000	2,941.00	2,941,000
神鋼商事	3,000	281.00	843,000
小林産業	900	248.00	223,200
阪和興業	12,000	594.00	7,128,000
カナデン	1,000	993.00	993,000
菱電商事	2,000	989.00	1,978,000
フルサト工業	600	1,774.00	1,064,400
岩谷産業	13,000	799.00	10,387,000
すてきナイスグループ	5,000	209.00	1,045,000
昭光通商	5,000	121.00	605,000
ニチモウ	2,000	200.00	400,000
極東貿易	2,000	337.00	674,000
イワキ	2,000	242.00	484,000
三愛石油	3,000	857.00	2,571,000
稲畑産業	2,800	1,370.00	3,836,000
G S Iクレオス	3,000	143.00	429,000
明和産業	1,000	434.00	434,000
ワキタ	2,500	1,274.00	3,185,000
東邦ホールディングス	4,100	2,915.00	11,951,500
サンゲツ	4,100	1,894.00	7,765,400
ミツウロコグループホールディングス	1,900	618.00	1,174,200
シナネン	2,000	492.00	984,000
伊藤忠エネクス	2,600	1,234.00	3,208,400
サンリオ	3,300	3,465.00	11,434,500
サンワテクノス	700	1,390.00	973,000
リョーサン	2,000	3,275.00	6,550,000
新光商事	1,400	1,301.00	1,821,400
トーヨー	3,000	497.00	1,491,000

三信電気	1,600	1,255.00	2,008,000
東陽テクニカ	1,700	1,061.00	1,803,700
モスフードサービス	1,600	2,562.00	4,099,200
加賀電子	1,100	1,587.00	1,745,700
ソーダニッカ	1,200	540.00	648,000
立花エレテック	900	1,444.00	1,299,600
フォーバル	200	1,648.00	329,600
P a l t a c	1,900	2,124.00	4,035,600
三谷産業	1,300	514.00	668,200
太平洋興発	5,000	98.00	490,000
ヤマタネ	6,000	215.00	1,290,000
丸紅建材リース	1,000	267.00	267,000
日鉄住金物産	8,000	461.00	3,688,000
トラスコ中山	1,500	4,295.00	6,442,500
オートバックスセブン	4,300	2,042.00	8,780,600
加藤産業	1,800	2,838.00	5,108,400
イノテック	1,100	488.00	536,800
イエローハット	1,100	2,367.00	2,603,700
J Kホールディングス	1,200	603.00	723,600
日伝	500	3,125.00	1,562,500
北沢産業	1,100	193.00	212,300
杉本商事	700	1,499.00	1,049,300
因幡電機産業	1,700	4,385.00	7,454,500
バイテック	400	1,357.00	542,800
ミスミグループ本社	4,400	5,350.00	23,540,000
アルテック	1,000	249.00	249,000
タキヒヨー	2,000	484.00	968,000
蔵王産業	200	1,468.00	293,600
スズケン	5,400	3,995.00	21,573,000
ジェコス	800	1,284.00	1,027,200
ルネサスイーストン	600	613.00	367,800
ローソン	4,500	8,220.00	36,990,000
サンエー	900	5,310.00	4,779,000
ダイユーエイト	300	814.00	244,200
カワチ薬品	900	1,879.00	1,691,100
エービーシー・マート	1,700	7,490.00	12,733,000

ハードオフコーポレーション	600	1,377.00	826,200
アスクル	1,200	3,905.00	4,686,000
ゲオホールディングス	2,200	1,482.00	3,260,400
アダストリア	1,000	4,285.00	4,285,000
シー・ヴィ・エス・バイエリア	2,000	121.00	242,000
くらコーポレーション	700	3,980.00	2,786,000
キャンドウ	600	1,568.00	940,800
パル	700	3,890.00	2,723,000
エディオン	5,400	897.00	4,843,800
サーラコーポレーション	1,000	613.00	613,000
ワッツ	500	1,023.00	511,500
あみやき亭	200	4,865.00	973,000
ひらまつ	1,600	850.00	1,360,000
ゲンキー	100	9,900.00	990,000
サッポロドラッグストアー	100	1,778.00	177,800
大黒天物産	300	4,800.00	1,440,000
ハニーズ	1,100	1,045.00	1,149,500
ファーマライズホールディングス	300	580.00	174,000
アルペン	1,000	1,994.00	1,994,000
クオール	1,200	1,520.00	1,824,000
ジェイアイエヌ	800	5,380.00	4,304,000
ビックカメラ	5,800	1,431.00	8,299,800
D C Mホールディングス	5,700	1,178.00	6,714,600
MonotaRO	2,300	5,420.00	12,466,000
きちり	300	716.00	214,800
アークランドサービス	200	5,300.00	1,060,000
J.フロント リテイリング	15,000	2,357.00	35,355,000
ドトール・日レスホールディングス	2,100	2,231.00	4,685,100
マツモトキヨシホールディングス	2,600	5,550.00	14,430,000
ブロンコビリー	200	5,170.00	1,034,000
スタートトゥデイ	3,700	3,505.00	12,968,500
トレジャー・ファクトリー	300	1,476.00	442,800
物語コーポレーション	300	3,975.00	1,192,500
ココカラファイン	1,200	4,200.00	5,040,000
三越伊勢丹ホールディングス	23,500	2,256.00	53,016,000
ウエルシアホールディングス	1,000	5,480.00	5,480,000

クリエイトSDホールディングス	600	5,490.00	3,294,000	
丸善CHIホールディングス	1,400	406.00	568,400	
ミサワ	100	665.00	66,500	
エー・ピーカンパニー	200	1,992.00	398,400	
チムニー	300	3,120.00	936,000	
ネクステージ	100	863.00	86,300	
ジョイフル本田	1,700	2,683.00	4,561,100	
キリン堂ホールディングス	400	1,471.00	588,400	
すかいらく	5,800	1,619.00	9,390,200	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3,900	1,055.00	4,114,500	
ブックオフコーポレーション	700	896.00	627,200	
あさひ	800	1,258.00	1,006,400	
日本調剤	200	6,020.00	1,204,000	
コスモス薬品	600	16,510.00	9,906,000	
トーエル	700	766.00	536,200	
一六堂	300	449.00	134,700	
セブン&アイ・ホールディングス	49,500	5,307.00	262,696,500	
薬王堂	200	3,400.00	680,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	800	2,789.00	2,231,200	
ツルハホールディングス	2,500	9,570.00	23,925,000	
サンマルクホールディングス	800	4,180.00	3,344,000	
フェリシモ	300	1,260.00	378,000	
トリドール	1,300	1,610.00	2,093,000	
クスリのアオキ	900	4,800.00	4,320,000	
メディカルシステムネットワーク	1,100	492.00	541,200	
総合メディカル	600	3,440.00	2,064,000	
はるやま商事	500	768.00	384,000	
カッパ・クリエイトホールディングス	1,900	1,158.00	2,200,200	
ライトオン	900	1,041.00	936,900	
ジーンズメイト	400	279.00	111,600	
良品計画	1,500	23,760.00	35,640,000	
三城ホールディングス	1,500	481.00	721,500	
アルビス	300	2,112.00	633,600	
コナカ	1,400	724.00	1,013,600	
ハウスオブローゼ	200	1,441.00	288,200	

G - 7ホールディングス	300	1,530.00	459,000
イオン北海道	800	657.00	525,600
コジマ	1,800	379.00	682,200
ヒマラヤ	400	1,045.00	418,000
コーナン商事	1,800	1,576.00	2,836,800
エコス	400	1,007.00	402,800
ワタミ	1,400	1,032.00	1,444,800
マルシェ	300	895.00	268,500
ドンキホーテホールディングス	3,800	10,500.00	39,900,000
西松屋チェーン	2,300	1,096.00	2,520,800
ゼンショーホールディングス	6,100	1,165.00	7,106,500
幸楽苑	800	1,571.00	1,256,800
ハークスレイ	400	984.00	393,600
サイゼリヤ	2,000	2,720.00	5,440,000
魚力	300	2,202.00	660,600
ポプラ	400	549.00	219,600
ユナイテッドアローズ	1,500	3,840.00	5,760,000
ハイデイ日高	900	3,040.00	2,736,000
京都きもの友禅	700	1,030.00	721,000
コロワイド	3,900	1,908.00	7,441,200
壱番屋	500	5,110.00	2,555,000
トップカルチャー	500	531.00	265,500
P L A N T	300	1,519.00	455,700
スギホールディングス	2,100	6,270.00	13,167,000
スクロール	1,600	302.00	483,200
ヨンドシーホールディングス	900	2,953.00	2,657,700
ファミリーマート	4,000	5,600.00	22,400,000
木曽路	1,400	2,025.00	2,835,000
サトレストランシステムズ	1,300	917.00	1,192,100
千趣会	2,100	866.00	1,818,600
タカキュー	900	226.00	203,400
ケーヨー	2,200	570.00	1,254,000
上新電機	3,000	935.00	2,805,000
日本瓦斯	1,900	3,500.00	6,650,000
ベスト電器	4,100	162.00	664,200
ロイヤルホールディングス	2,000	2,127.00	4,254,000

東天紅	1,000	188.00	188,000
いなげや	1,300	1,407.00	1,829,100
島忠	3,000	3,445.00	10,335,000
チヨダ	1,400	2,859.00	4,002,600
ライフコーポレーション	700	2,846.00	1,992,200
リンガーハット	1,200	2,600.00	3,120,000
さが美	1,000	250.00	250,000
MrMax	1,300	443.00	575,900
テンアライド	1,000	391.00	391,000
AOKIホールディングス	2,700	1,809.00	4,884,300
オークワ	2,000	1,103.00	2,206,000
コメリ	2,000	2,827.00	5,654,000
青山商事	3,000	4,920.00	14,760,000
しまむら	1,400	12,690.00	17,766,000
CFSコーポレーション	800	1,096.00	876,800
はせがわ	500	546.00	273,000
高島屋	17,000	1,192.00	20,264,000
松屋	2,400	2,294.00	5,505,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	5,600	2,563.00	14,352,800
近鉄百貨店	5,000	342.00	1,710,000
丸栄	2,000	140.00	280,000
ニッセンホールディングス	2,600	262.00	681,200
パルコ	1,100	1,185.00	1,303,500
丸井グループ	12,400	1,736.00	21,526,400
アクシアル リテイリング	900	3,580.00	3,222,000
イオン	48,800	1,664.00	81,203,200
ユニグループ・ホールディングス	11,400	767.00	8,743,800
イズミ	2,600	5,100.00	13,260,000
東武ストア	2,000	319.00	638,000
平和堂	2,400	3,045.00	7,308,000
フジ	1,300	2,380.00	3,094,000
ヤオコー	1,300	5,880.00	7,644,000
ゼビオ	1,600	2,373.00	3,796,800
ケーズホールディングス	2,700	4,410.00	11,907,000
Olympicグループ	700	790.00	553,000
日産東京販売ホールディングス	2,000	356.00	712,000

アインファーマシーズ	1,400	5,320.00	7,448,000	
元気寿司	400	2,480.00	992,000	
ヤマダ電機	46,800	507.00	23,727,600	
アークランドサカモト	800	2,744.00	2,195,200	
ニトリホールディングス	5,100	9,590.00	48,909,000	
愛眼	1,100	247.00	271,700	
ケーユーホールディングス	600	759.00	455,400	
吉野家ホールディングス	3,300	1,505.00	4,966,500	
松屋フーズ	600	2,367.00	1,420,200	
サガミチェーン	1,000	1,249.00	1,249,000	
関西スーパーマーケット	900	817.00	735,300	
王将フードサービス	900	4,285.00	3,856,500	
プレナス	1,300	2,245.00	2,918,500	
ミニストップ	900	2,075.00	1,867,500	
アークス	2,100	2,679.00	5,625,900	
パロー	2,500	2,994.00	7,485,000	
藤久	100	1,773.00	177,300	
ベルク	500	3,940.00	1,970,000	
大庄	600	1,589.00	953,400	
ファーストリテイリング	2,400	55,970.00	134,328,000	
サンドラッグ	2,500	7,170.00	17,925,000	
サクスパー ホールディングス	900	2,207.00	1,986,300	
ヤマザワ	300	1,747.00	524,100	
やまや	200	2,059.00	411,800	
ペルーナ	2,900	696.00	2,018,400	
島根銀行	300	1,581.00	474,300	
じもとホールディングス	8,500	223.00	1,895,500	
足利ホールディングス	7,400	532.00	3,936,800	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	1,500	4,320.00	6,480,000	
新生銀行	113,000	242.00	27,346,000	
あおぞら銀行	80,000	472.00	37,760,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	949,200	905.00	859,026,000	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	138,400	713.30	98,720,720	
三井住友トラスト・ホールディングス	259,000	564.60	146,231,400	
三井住友フィナンシャルグループ	89,500	5,513.00	493,413,500	代用有価証券 10,000株

第四銀行	15,000	526.00	7,890,000	
北越銀行	13,000	264.00	3,432,000	
西日本シティ銀行	41,000	359.00	14,719,000	
千葉銀行	46,000	961.00	44,206,000	
横浜銀行	79,000	775.20	61,240,800	
常陽銀行	43,000	686.00	29,498,000	
群馬銀行	28,000	924.00	25,872,000	
武蔵野銀行	1,900	4,860.00	9,234,000	
千葉興業銀行	2,500	958.00	2,395,000	
筑波銀行	4,900	422.00	2,067,800	
七十七銀行	20,000	766.00	15,320,000	
青森銀行	9,000	411.00	3,699,000	
秋田銀行	8,000	397.00	3,176,000	
山形銀行	7,000	540.00	3,780,000	
岩手銀行	800	5,670.00	4,536,000	
東邦銀行	10,000	558.00	5,580,000	
東北銀行	7,000	171.00	1,197,000	
みちのく銀行	6,000	217.00	1,302,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	48,000	655.00	31,440,000	
静岡銀行	35,000	1,320.00	46,200,000	
十六銀行	15,000	506.00	7,590,000	
スルガ銀行	12,500	2,643.00	33,037,500	
八十二銀行	21,000	957.00	20,097,000	
山梨中央銀行	7,000	595.00	4,165,000	
大垣共立銀行	15,000	454.00	6,810,000	
福井銀行	10,000	276.00	2,760,000	
北國銀行	13,000	451.00	5,863,000	
清水銀行	400	3,495.00	1,398,000	
滋賀銀行	12,000	664.00	7,968,000	
南都銀行	11,000	445.00	4,895,000	
百五銀行	11,000	612.00	6,732,000	
京都銀行	22,000	1,456.00	32,032,000	
紀陽銀行	4,600	1,913.00	8,799,800	
三重銀行	5,000	291.00	1,455,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	81,000	298.00	24,138,000	
広島銀行	35,000	753.00	26,355,000	

山陰合同銀行	7,000	1,189.00	8,323,000	
中国銀行	8,400	1,982.00	16,648,800	
鳥取銀行	4,000	233.00	932,000	
伊予銀行	12,700	1,562.00	19,837,400	
百十四銀行	13,000	446.00	5,798,000	
四国銀行	9,000	290.00	2,610,000	
阿波銀行	10,000	795.00	7,950,000	
鹿児島銀行	8,000	894.00	7,152,000	
大分銀行	7,000	531.00	3,717,000	
宮崎銀行	8,000	466.00	3,728,000	
肥後銀行	10,000	804.00	8,040,000	
佐賀銀行	7,000	326.00	2,282,000	
十八銀行	7,000	381.00	2,667,000	
沖縄銀行	900	5,330.00	4,797,000	
琉球銀行	2,400	1,846.00	4,430,400	
セブン銀行	39,900	582.00	23,221,800	
みずほフィナンシャルグループ	1,649,800	271.00	447,095,800	
高知銀行	5,000	172.00	860,000	
山口フィナンシャルグループ	12,000	1,561.00	18,732,000	
長野銀行	4,000	234.00	936,000	
名古屋銀行	11,000	488.00	5,368,000	
北洋銀行	17,800	516.00	9,184,800	
愛知銀行	400	6,800.00	2,720,000	
第三銀行	7,000	200.00	1,400,000	
中京銀行	5,000	241.00	1,205,000	
東日本銀行	5,000	452.00	2,260,000	
大光銀行	4,000	246.00	984,000	
愛媛銀行	7,000	275.00	1,925,000	
トマト銀行	5,000	203.00	1,015,000	
みなと銀行	11,000	324.00	3,564,000	
京葉銀行	10,000	665.00	6,650,000	
関西アーバン銀行	1,600	1,505.00	2,408,000	
栃木銀行	6,000	710.00	4,260,000	
北日本銀行	400	3,560.00	1,424,000	
東和銀行	17,000	122.00	2,074,000	
福島銀行	15,000	101.00	1,515,000	

大東銀行	8,000	180.00	1,440,000
トモニホールディングス	9,100	571.00	5,196,100
フィデアホールディングス	7,100	275.00	1,952,500
池田泉州ホールディングス	11,300	573.00	6,474,900
F P G	3,500	946.00	3,311,000
S B Iホールディングス	14,200	1,768.00	25,105,600
ジャフコ	1,600	4,880.00	7,808,000
大和証券グループ本社	111,000	962.40	106,826,400
野村ホールディングス	241,800	835.90	202,120,620
岡三証券グループ	10,000	890.00	8,900,000
丸三証券	3,800	1,313.00	4,989,400
東洋証券	5,000	394.00	1,970,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	13,600	922.00	12,539,200
光世証券	3,000	233.00	699,000
水戸証券	3,700	444.00	1,642,800
いちよし証券	2,500	1,222.00	3,055,000
松井証券	6,000	1,112.00	6,672,000
だいこう証券ビジネス	600	1,009.00	605,400
マネックスグループ	14,000	353.00	4,942,000
カブドットコム証券	5,300	854.00	4,526,200
極東証券	1,600	1,844.00	2,950,400
岩井コスモホールディングス	1,200	1,610.00	1,932,000
藍澤證券	1,700	838.00	1,424,600
マネースクウェアHD	500	1,382.00	691,000
マネーパートナーズグループ	1,300	401.00	521,300
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	26,300	4,584.00	120,559,200
アニコムホールディングス	700	2,370.00	1,659,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	37,700	3,863.50	145,653,950
ソニーフィナンシャルホールディングス	11,300	2,099.00	23,718,700
第一生命保険	75,800	2,424.00	183,739,200
東京海上ホールディングス	47,900	5,168.00	247,547,200
T & Dホールディングス	43,100	1,893.50	81,609,850
全国保証	3,100	4,225.00	13,097,500
クレディセゾン	9,700	2,708.00	26,267,600
芙蓉総合リース	1,200	5,130.00	6,156,000

興銀リース	2,200	2,790.00	6,138,000
東京センチュリーリース	2,800	3,855.00	10,794,000
日本証券金融	5,300	726.00	3,847,800
アイフル	19,900	397.00	7,900,300
ポケットカード	900	557.00	501,300
リコーリース	900	3,735.00	3,361,500
イオンフィナンシャルサービス	7,800	3,245.00	25,311,000
アコム	23,800	466.00	11,090,800
ジャックス	7,000	595.00	4,165,000
オリエントコーポレーション	27,500	223.00	6,132,500
日立キャピタル	2,300	3,220.00	7,406,000
アプラスフィナンシャル	5,900	135.00	796,500
オリックス	83,800	1,879.50	157,502,100
三菱UFJリース	30,100	673.00	20,257,300
日本取引所グループ	17,400	4,010.00	69,774,000
イー・ギャランティ	300	2,451.00	735,300
アサックス	200	1,606.00	321,200
NECキャピタルソリューション	500	1,896.00	948,000
日本駐車場開発	13,000	185.00	2,405,000
ヒューリック	21,900	1,168.00	25,579,200
東京建物不動産販売	700	545.00	381,500
三栄建築設計	500	1,053.00	526,500
野村不動産ホールディングス	7,100	2,635.00	18,708,500
三重交通グループホールディングス	2,200	479.00	1,053,800
プレサンスコーポレーション	400	4,260.00	1,704,000
常和ホールディングス	600	5,470.00	3,282,000
日本管理センター	800	1,751.00	1,400,800
サンセイランディック	200	855.00	171,000
エストラスト	200	627.00	125,400
フージャースホールディングス	1,800	525.00	945,000
オープンハウス	900	4,175.00	3,757,500
東急不動産ホールディングス	31,000	965.00	29,915,000
飯田グループホールディングス	7,700	1,971.00	15,176,700
エコナックホールディングス	5,000	98.00	490,000
パーク24	5,900	2,095.00	12,360,500
パラカ	400	1,504.00	601,600

三井不動産	63,000	3,538.50	222,925,500	
三菱地所	88,000	2,726.00	239,888,000	
平和不動産	2,300	1,723.00	3,962,900	
東京建物	26,000	892.00	23,192,000	
ダイビル	3,100	1,140.00	3,534,000	
京阪神ビルディング	2,000	767.00	1,534,000	
住友不動産	28,000	4,489.50	125,706,000	
大京	19,000	200.00	3,800,000	
テーオーシー	4,100	916.00	3,755,600	
東京楽天地	2,000	513.00	1,026,000	
レオパレス21	13,000	744.00	9,672,000	
スターツコーポレーション	1,300	1,965.00	2,554,500	
フジ住宅	1,500	692.00	1,038,000	
空港施設	1,500	674.00	1,011,000	
明和地所	700	657.00	459,900	
住友不動産販売	800	3,155.00	2,524,000	
ゴールドクレスト	1,100	2,514.00	2,765,400	
日本エスリード	500	1,267.00	633,500	
日神不動産	1,600	448.00	716,800	
タカラレーベン	5,300	756.00	4,006,800	
サンヨーハウジング名古屋	700	1,258.00	880,600	
イオンモール	7,600	2,296.00	17,449,600	
ファースト住建	400	1,424.00	569,600	
トーセイ	1,600	920.00	1,472,000	
穴吹興産	1,000	261.00	261,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	7,400	1,278.00	9,457,200	
サンフロンティア不動産	1,300	1,061.00	1,379,300	
エフ・ジェー・ネクスト	900	645.00	580,500	
ランドビジネス	800	404.00	323,200	
グランディハウス	1,000	372.00	372,000	
日本空港ビルディング	4,100	6,980.00	28,618,000	
日本工営	4,000	489.00	1,956,000	
ネクスト	3,000	872.00	2,616,000	
日本M&Aセンター	1,900	4,930.00	9,367,000	
ノバレーゼ	300	920.00	276,000	
アコーディア・ゴルフ	4,700	1,166.00	5,480,200	

タケエイ	1,200	1,247.00	1,496,400	
トラスト・テック	200	2,413.00	482,600	
パソナグループ	900	1,220.00	1,098,000	
C D S	300	1,031.00	309,300	
リンクアンドモチベーション	1,800	172.00	309,600	
G C A サヴィアン	1,000	1,546.00	1,546,000	
エス・エム・エス	1,400	1,676.00	2,346,400	
テンプホールディングス	2,500	4,385.00	10,962,500	
リニカル	300	1,261.00	378,300	
クックパッド	800	6,600.00	5,280,000	
エスクリ	400	1,141.00	456,400	
アイ・ケイ・ケイ	700	628.00	439,600	
学情	500	1,319.00	659,500	
スタジオアリス	600	2,102.00	1,261,200	
シミックホールディングス	600	1,705.00	1,023,000	
N J S	300	1,597.00	479,100	
総合警備保障	4,200	4,945.00	20,769,000	
カカクコム	8,300	1,802.00	14,956,600	
ルネサンス	600	1,318.00	790,800	
ディップ	300	11,900.00	3,570,000	
オプトホールディング	600	702.00	421,200	
新日本科学	1,200	749.00	898,800	
ツクイ	1,500	928.00	1,392,000	
総合臨床ホールディングス	700	499.00	349,300	
キャリアデザインセンター	400	1,323.00	529,200	
エムスリー	10,800	2,482.00	26,805,600	
ツカダ・グローバルホールディング	900	813.00	731,700	
アウトソーシング	500	2,185.00	1,092,500	
ウェルネット	400	2,913.00	1,165,200	
ディー・エヌ・エー	6,200	2,524.00	15,648,800	
博報堂D Yホールディングス	17,400	1,297.00	22,567,800	
ぐるなび	1,500	2,073.00	3,109,500	
エスアールジータカミヤ	1,000	735.00	735,000	
一休	1,000	2,638.00	2,638,000	
ジャパンベストレスキューシステム	1,500	256.00	384,000	
ファンコミュニケーションズ	2,900	1,007.00	2,920,300	

ジェイコムホールディングス	300	950.00	285,000	
P G Mホールディングス	1,800	1,324.00	2,383,200	
W D Bホールディングス	500	1,271.00	635,500	
ティア	500	667.00	333,500	
バリューコマース	1,100	587.00	645,700	
J Pホールディングス	3,100	345.00	1,069,500	
E P Sホールディングス	1,100	1,452.00	1,597,200	
プレステージ・インターナショナル	1,000	928.00	928,000	
アミューズ	400	4,320.00	1,728,000	
ドリームインキュベータ	400	2,622.00	1,048,800	
クイック	600	1,119.00	671,400	
T A C	700	214.00	149,800	
ケネディクス	17,900	496.00	8,878,400	
電通	13,900	6,550.00	91,045,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	800.00	400,000	
ぴあ	400	2,360.00	944,000	
イオンファンタジー	400	2,363.00	945,200	
みらかホールディングス	3,200	6,130.00	19,616,000	
アルプス技研	500	2,538.00	1,269,000	
サニックス	1,500	372.00	558,000	
ダイオーズ	300	1,228.00	368,400	
日本空調サービス	600	1,061.00	636,600	
オリエンタルランド	13,500	8,004.00	108,054,000	
ダスキン	3,500	2,120.00	7,420,000	
明光ネットワークジャパン	1,400	1,452.00	2,032,800	
ファルコホールディングス	500	1,516.00	758,000	
秀英予備校	300	655.00	196,500	
田谷	200	791.00	158,200	
ラウンドワン	3,600	609.00	2,192,400	
リゾートトラスト	4,700	3,045.00	14,311,500	
ビー・エム・エル	700	3,865.00	2,705,500	
ワタベウェディング	400	490.00	196,000	
もしもしホットライン	2,300	1,396.00	3,210,800	
リソー教育	2,000	323.00	646,000	
早稲田アカデミー	200	878.00	175,600	
ユー・エス・エス	15,200	2,247.00	34,154,400	

東京個別指導学院	600	647.00	388,200
サイバーエージェント	3,100	5,990.00	18,569,000
楽天	54,500	2,038.50	111,098,250
テー・オー・ダブリュー	400	1,173.00	469,200
セントラルスポーツ	400	2,321.00	928,400
フルキャストホールディングス	1,300	796.00	1,034,800
リゾートソリューション	1,000	337.00	337,000
テクノプロ・ホールディングス	1,800	3,230.00	5,814,000
リブセンス	800	603.00	482,400
ジャパンマテリアル	500	1,730.00	865,000
ベクトル	300	1,866.00	559,800
ウチヤマホールディングス	700	512.00	358,400
サクセスホールディングス	100	1,412.00	141,200
キャリアリンク	200	1,935.00	387,000
アサンテ	400	1,543.00	617,200
N・フィールド	300	1,960.00	588,000
M&Aキャピタルパートナーズ	100	3,200.00	320,000
E R Iホールディングス	400	975.00	390,000
アビスト	100	1,457.00	145,700
ウィルグループ	200	1,772.00	354,400
リクルートホールディングス	18,900	3,775.00	71,347,500
リロ・ホールディング	400	11,930.00	4,772,000
東祥	200	2,774.00	554,800
エイチ・アイ・エス	2,000	4,105.00	8,210,000
共立メンテナンス	800	7,570.00	6,056,000
イチネンホールディングス	1,300	1,180.00	1,534,000
建設技術研究所	800	1,227.00	981,600
スペース	700	1,285.00	899,500
燦ホールディングス	300	1,743.00	522,900
スバル興業	1,000	437.00	437,000
東京テアトル	5,000	142.00	710,000
よみうりランド	2,000	443.00	886,000
東京都競馬	9,000	300.00	2,700,000
常磐興産	5,000	156.00	780,000
カナモト	1,700	3,115.00	5,295,500
東京ドーム	9,000	521.00	4,689,000

西尾レントオール	1,000	3,095.00	3,095,000	
トランス・コスモス	1,600	3,410.00	5,456,000	
乃村工藝社	2,500	1,501.00	3,752,500	
藤田観光	5,000	418.00	2,090,000	
KNT - CTホールディングス	6,000	164.00	984,000	
日本管財	600	2,686.00	1,611,600	
トーカイ	500	4,400.00	2,200,000	
白洋舎	1,000	299.00	299,000	
セコム	12,200	8,236.00	100,479,200	
セントラル警備保障	500	1,388.00	694,000	
丹青社	1,400	1,315.00	1,841,000	
メイテック	1,700	4,635.00	7,879,500	
アサツー ディ・ケイ	2,400	2,966.00	7,118,400	
応用地質	1,300	1,680.00	2,184,000	
船井総研ホールディングス	1,400	1,436.00	2,010,400	
進学会	600	608.00	364,800	
ベネッセホールディングス	4,600	3,190.00	14,674,000	
イオンディライト	1,200	3,725.00	4,470,000	
ナック	800	1,030.00	824,000	
ニチイ学館	2,500	1,022.00	2,555,000	
ダイセキ	2,000	2,417.00	4,834,000	
ステップ	400	1,023.00	409,200	
合 計	20,073,000		29,322,054,430	

(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12月25日現在	平成27年 6月25日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,527,131,677	147,963,309
コール・ローン	744,280,926	611,276,463
株式	81,735,642,377	82,998,854,455
投資証券	2,026,303,364	1,998,281,641
派生商品評価勘定	117,066,515	34,969,591
未収入金	11,845,940	6,631,553
未収配当金	85,040,338	124,686,987
未収利息	1,191	987
差入委託証拠金	274,489,189	327,452,160
流動資産合計	86,521,801,517	86,250,117,146
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,139,272	1,300
未払金	6,755,391	8,581,565
未払解約金	179,406,437	167,375,523
流動負債合計	190,301,100	175,958,388
負債合計	190,301,100	175,958,388
純資産の部		
元本等		
元本	42,925,107,820	39,946,160,403
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	43,406,392,597	46,127,998,355
元本等合計	86,331,500,417	86,074,158,758
純資産合計	86,331,500,417	86,074,158,758
負債純資産合計	86,521,801,517	86,250,117,146

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</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	(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。 (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。
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12月25日現在	平成27年 6月25日現在
1.	期首	平成26年 6月26日	平成26年12月26日
	期首元本額	46,356,981,139円	42,925,107,820円
	期首からの追加設定元本額	1,204,418,500円	1,166,545,900円
	期首からの一部解約元本額	4,636,291,819円	4,145,493,317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）	14,336,098,607円	14,202,964,653円
	DCインデックスバランス（株式20）	36,817,683円	36,769,941円
	DCインデックスバランス（株式40）	136,551,355円	142,478,679円
	DCインデックスバランス（株式60）	264,745,249円	278,936,501円
	DCインデックスバランス（株式80）	309,915,048円	334,976,642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	4,337,764,054円	3,713,793,990円
	日興五大陸株式ファンド	8,961,238,399円	7,963,731,165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	35,082,367円	29,877,322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	13,584,935円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	7,691,954円	7,426,801円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	5,721,300円	5,536,639円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	9,539,596円	8,674,796円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	11,595,072円	10,095,961円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	8,213,545,903円	7,513,820,528円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	11,773,370円	10,346,023円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	27,985,301円	26,728,282円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	85,509,503円	82,634,536円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	120,566,814円	118,322,889円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	119,931,524円	119,952,748円

	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	5,878,059,316円	5,325,507,372円
	計	42,925,107,820円	39,946,160,403円
2.	受益権の総数	42,925,107,820口	39,946,160,403口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成26年 6月26日 至 平成26年12月25日	自 平成26年12月26日 至 平成27年 6月25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12月25日現在	平成27年 6月25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

（有価証券に関する注記）

（平成26年12月25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	3,898,371,273
投資証券	115,490,965
合計	4,013,862,238

（平成27年 6月25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	7,103,927,066
投資証券	46,745,144
合計	7,150,672,210

（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。

（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12月25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	2,443,883,585	-	2,532,687,855	88,804,270
合計		2,443,883,585	-	2,532,687,855	88,804,270

(平成27年 6月25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	957,660,366	-	976,628,422	18,968,056
合計		957,660,366	-	976,628,422	18,968,056

(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12月25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	1,305,972,519	-	1,333,947,700	27,975,181
	米ドル	834,386,260	-	860,558,900	26,172,640
	ユーロ	471,586,259	-	473,388,800	1,802,541
	売建	647,767,042	-	651,619,250	3,852,208
	米ドル	238,800,000	-	240,460,000	1,660,000
	加ドル	104,067,096	-	105,457,800	1,390,704
	ユーロ	153,606,900	-	153,888,000	281,100
	英ポンド	22,381,680	-	22,420,800	39,120

	スウェーデンク ローナ	48,950,189	-	48,754,600	195,589
	デンマーククローネ	13,439,015	-	13,494,500	55,485
	豪ドル	54,956,037	-	55,603,500	647,463
	香港ドル	11,566,125	-	11,540,050	26,075
	合計	1,953,739,561	-	1,985,566,950	24,122,973

（平成27年 6月25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	521,394,365	-	537,395,900	16,001,535	
	米ドル	374,565,065	-	387,485,900	12,920,835	
	ユーロ	146,829,300	-	149,910,000	3,080,700	
	売建	25,277,200	-	25,278,500	1,300	
	英ポンド	25,277,200	-	25,278,500	1,300	
	合計	546,671,565	-	562,674,400	16,000,235	

（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12月25日現在		平成27年 6月25日現在	
1口当たり純資産額	2.0112円	1口当たり純資産額	2.1548円
(1万口当たり純資産額)	(20,112円)	(1万口当たり純資産額)	(21,548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	81.45	894,565.35	
	ANTERO RESOURCES CORP	1,060	35.71	37,852.60	
	APACHE CORP	8,294	58.71	486,940.74	
	BAKER HUGHES INC	9,665	62.64	605,415.60	
	CABOT OIL & GAS CORP	9,030	32.32	291,849.60	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	4,221	54.24	228,947.04	
	CHENIERE ENERGY INC	5,020	71.90	360,938.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	11,290	11.55	130,399.50	
	CHEVRON CORP	40,731	99.27	4,043,366.37	
	CIMAREX ENERGY CO	2,005	116.80	234,184.00	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	5,890	10.44	61,491.60	
	CONCHO RESOURCES INC	2,395	120.90	289,555.50	
	CONOCOPHILLIPS	26,610	62.83	1,671,906.30	
	CONSOL ENERGY INC	5,288	23.42	123,844.96	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,960	44.13	86,494.80	
	CORE LABORATORIES N.V.	790	116.81	92,279.90	
	DEVON ENERGY CORPORATION	8,551	61.09	522,380.59	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	1,525	26.98	41,144.50	
	ENERGEN CORP	1,520	68.32	103,846.40	
	ENSCO PLC-CL A	4,530	22.54	102,106.20	
	EOG RESOURCES INC	11,902	88.34	1,051,422.68	
	EQT CORP	3,405	83.94	285,815.70	
	EXXON MOBIL CORP	90,931	84.68	7,700,037.08	
	FMC TECHNOLOGIES INC	5,645	42.31	238,839.95	
HALLIBURTON CO	18,517	44.25	819,377.25		
HELMERICH & PAYNE	2,120	70.95	150,414.00		

HESS CORP	5,530	69.17	382,510.10
HOLLYFRONTIER CORP	4,520	41.85	189,162.00
KINDER MORGAN INC	39,140	39.45	1,544,073.00
MARATHON OIL CORP	14,067	26.61	374,322.87
MARATHON PETROLEUM CORP	12,232	51.68	632,149.76
MURPHY OIL CORP	4,295	43.20	185,544.00
NABORS INDUSTRIES LTD	5,821	14.47	84,229.87
NATIONAL OILWELL VARCO INC	9,281	49.29	457,460.49
NOBLE ENERGY INC	8,662	44.73	387,451.26
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	16,631	79.32	1,319,170.92
OCEANEERING INTL INC	2,060	47.59	98,035.40
ONEOK INC	4,150	40.36	167,494.00
PHILLIPS 66	12,045	79.19	953,843.55
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,290	141.96	467,048.40
RANGE RESOURCES CORP	4,050	50.89	206,104.50
SCHLUMBERGER LTD	27,649	87.51	2,419,563.99
SOUTHWESTERN ENERGY CO	8,835	23.97	211,774.95
SPECTRA ENERGY CORP	14,814	33.23	492,269.22
TESORO CORP	2,820	85.79	241,927.80
VALERO ENERGY CORP	11,512	60.61	697,742.32
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	16,939	13.24	224,272.36
WHITING PETROLEUM CORP	3,115	35.45	110,426.75
WILLIAMS COS INC	15,814	57.37	907,249.18
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	4,645	143.72	667,579.40
AIRGAS INC	1,430	107.00	153,010.00
ALBEMARLE CORP	1,630	57.64	93,953.20
ALCOA INC	26,179	11.74	307,341.46
ASHLAND INC	1,610	125.96	202,795.60
AVERY DENNISON CORP	2,260	61.65	139,329.00
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	2,100	34.99	73,479.00
BALL CORP	3,133	72.24	226,327.92
CELANESE CORP-SERIES A	3,270	71.58	234,066.60
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,650	63.10	356,515.00
CROWN HOLDINGS INC	2,815	54.54	153,530.10
DOW CHEMICAL CO/THE	24,983	53.10	1,326,597.30

DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	19,548	66.20	1,294,077.60
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	2,915	82.33	239,991.95
ECOLAB INC	5,830	116.26	677,795.80
FMC CORP	3,270	53.54	175,075.80
FREEPORT-MCMORAN INC	22,998	20.56	472,838.88
INTERNATIONAL PAPER CO	9,250	49.09	454,082.50
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,664	112.65	187,449.60
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,690	104.81	910,798.90
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,045	145.91	152,475.95
MEADWESTVACO CORP	3,999	48.87	195,431.13
MONSANTO CO	10,471	106.32	1,113,276.72
MOSAIC CO/THE	6,650	45.24	300,846.00
NEWMONT MINING CORP	11,290	24.12	272,314.80
NUCOR CORP	6,309	47.43	299,235.87
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,950	65.89	128,485.50
PPG INDUSTRIES INC	5,874	117.97	692,955.78
PRAXAIR INC	6,190	122.49	758,213.10
ROCK-TENN COMPANY-CL A	2,840	62.69	178,039.60
SEALED AIR CORP	4,356	51.78	225,553.68
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,787	281.98	503,898.26
SIGMA-ALDRICH	2,705	139.32	376,860.60
VULCAN MATERIALS CO	2,893	87.74	253,831.82
WESTLAKE CHEMICAL CORP	960	71.64	68,774.40
3M CO	13,696	157.54	2,157,667.84
ACUITY BRANDS INC	870	181.03	157,496.10
AGCO CORP	1,670	54.75	91,432.50
AMETEK INC	5,073	54.07	274,297.11
B/E AEROSPACE INC	2,570	56.46	145,115.05
BOEING CO/THE	14,492	143.00	2,072,356.00
CATERPILLAR INC	12,416	88.17	1,094,718.72
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	2,410	53.00	127,730.00
CUMMINS INC	3,695	135.18	499,490.10
DANAHER CORP	13,699	85.42	1,170,168.58
DEERE & CO	6,670	94.00	626,980.00
DOVER CORP	3,640	72.10	262,444.00

EATON CORP PLC	9,756	69.59	678,920.04
EMERSON ELECTRIC CO	14,990	57.49	861,775.10
FASTENAL CO	6,153	43.04	264,855.88
FLOWSERVE CORP	3,325	53.68	178,486.00
FLUOR CORP	3,203	55.58	178,022.74
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,160	45.69	144,380.40
GENERAL DYNAMICS CORP	6,202	145.52	902,515.04
GENERAL ELECTRIC CO.	217,803	27.26	5,937,309.78
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	16,066	104.10	1,672,470.60
ILLINOIS TOOL WORKS	7,250	94.17	682,732.50
INGERSOLL-RAND PLC	5,866	68.57	402,231.62
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,200	43.03	94,666.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	2,051	115.73	237,362.23
LOCKHEED MARTIN CORP	5,841	190.17	1,110,782.97
MASCO CORP	8,569	27.33	234,190.77
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,994	163.21	651,860.74
PACCAR INC	7,684	64.90	498,691.60
PALL CORP	2,246	124.62	279,896.52
PARKER HANNIFIN CORP	3,260	119.54	389,700.40
PENTAIR PLC	4,018	63.80	256,348.40
PRECISION CASTPARTS CORP	3,060	206.35	631,431.00
QUANTA SERVICES INC	4,645	29.60	137,492.00
RAYTHEON COMPANY	6,782	99.31	673,520.42
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,943	125.17	368,375.31
ROCKWELL COLLINS INC.	2,605	95.63	249,116.15
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,310	175.69	405,843.90
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,100	54.39	168,609.00
SNAP-ON INC	1,250	160.57	200,712.50
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,116	106.36	331,417.76
TEXTRON INC	6,606	45.92	303,347.52
TRANSDIGM GROUP INC	1,190	227.62	270,867.80
UNITED RENTALS INC	2,250	92.32	207,720.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	17,655	113.97	2,012,140.35
WABCO HOLDINGS INC	1,110	124.13	137,784.30
WABTEC CORP	2,090	97.83	204,464.70

WW GRAINGER INC	1,357	243.63	330,605.91
XYLEM INC	4,368	37.25	162,708.00
ADT CORP/THE	3,537	34.41	121,708.17
CINTAS CORP	2,037	86.56	176,322.72
DUN & BRADSTREET CORP	872	127.57	111,241.04
EQUIFAX INC	2,634	99.30	261,556.20
IHS INC-CLASS A	1,710	133.81	228,815.10
MANPOWERGROUP INC	1,937	91.00	176,267.00
NIELSEN NV	6,945	45.61	316,761.45
REPUBLIC SERVICES INC	5,100	39.83	203,133.00
ROBERT HALF INTL INC	3,425	56.32	192,896.00
STERICYCLE INC	1,705	135.71	231,385.55
TOWERS WATSON & CO-CL-A	1,630	140.23	228,574.90
TYCO INTERNATIONAL PLC	8,715	39.70	345,985.50
VERISK ANALYTICS INC	3,170	74.09	234,865.30
WASTE MANAGEMENT INC	9,924	47.17	468,115.08
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	4,080	42.24	172,339.20
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,250	62.60	203,450.00
CSX CORP	20,923	33.89	709,080.47
DELTA AIR LINES INC	4,285	42.66	182,798.10
EXPEDITORS INTL WASH INC	3,647	47.04	171,554.88
FEDEX CORP	5,758	173.42	998,552.36
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	9,780	20.26	198,142.80
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,310	84.97	196,280.70
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	97,000	0.63	61,595.00
KANSAS CITY SOUTHERN	2,390	92.81	221,815.90
NORFOLK SOUTHERN CORP	6,710	90.03	604,101.30
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,190	34.35	143,926.50
UNION PACIFIC CORP	19,056	98.25	1,872,252.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	1,915	54.46	104,290.90
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	15,167	99.39	1,507,448.13
AUTOLIV INC	2,020	119.36	241,107.20
BORGWARNER INC	5,230	59.73	312,387.90
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	6,290	87.92	553,016.80
FORD MOTOR COMPANY	78,435	15.50	1,215,742.50

GENERAL MOTORS CORP	31,275	35.16	1,099,629.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	5,430	31.33	170,121.90
HARLEY-DAVIDSON INC	4,829	57.85	279,357.65
JOHNSON CONTROLS INC	14,278	51.15	730,319.70
LEAR CORP	1,560	116.93	182,410.80
TESLA MOTORS INC	1,980	265.17	525,036.60
COACH INC	5,876	36.10	212,123.60
DR HORTON INC	6,906	27.92	192,815.52
GARMIN LTD	2,865	46.05	131,933.25
HANESBRANDS INC	8,800	34.11	300,168.00
HARMAN INTERNATIONAL	1,390	124.73	173,374.70
HASBRO INC	2,128	78.34	166,707.52
JARDEN CORP	3,510	53.16	186,591.60
LEGGETT & PLATT INC	2,648	49.21	130,308.08
LENNAR CORP-CL A	3,660	51.06	186,879.60
LULULEMON ATHLETICA INC	2,790	67.42	188,101.80
MATTEL INC	6,309	26.73	168,671.11
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	4,540	46.20	209,748.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,378	191.87	264,396.86
NEWELL RUBBERMAID INC	5,800	41.51	240,758.00
NIKE INC -CL B	15,034	106.22	1,596,911.48
POLARIS INDUSTRIES INC	1,250	150.33	187,912.50
PULTE GROUP INC	6,890	20.54	141,520.60
PVH CORP	2,030	113.69	230,790.70
RALPH LAUREN CORP	1,365	137.65	187,892.25
TOLL BROTHERS INC	3,111	38.22	118,902.42
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	3,560	84.34	300,250.40
VF CORP	7,950	70.26	558,567.00
WHIRLPOOL CORP	1,814	182.72	331,454.08
ARAMARK	3,180	31.53	100,265.40
CARNIVAL CORP	8,417	49.84	419,503.28
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	685	610.53	418,213.05
DARDEN RESTAURANTS INC	2,853	70.84	202,106.52
H&R BLOCK INC	5,610	30.50	171,105.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	11,130	27.98	311,417.40

LAS VEGAS SANDS CORP	9,050	51.90	469,695.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	4,826	76.37	368,561.62
MCDONALD'S CORP	20,921	96.64	2,021,805.44
MGM RESORTS INTERNATIONAL	9,790	18.63	182,387.70
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	2,930	56.64	165,955.20
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,538	79.93	282,792.34
STARBUCKS CORP	32,674	53.71	1,754,920.54
STARWOOD HOTELS & RESORTS	3,597	82.39	296,356.83
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,980	82.93	247,131.40
WYNN RESORTS LTD	1,660	98.21	163,028.60
YUM! BRANDS INC	9,214	91.51	843,173.14
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	4,265	23.85	101,720.25
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	9,798	56.77	556,232.46
CHARTER COMMUNICATION-A	1,780	168.48	299,894.40
COMCAST CORP-CLASS A	46,116	60.36	2,783,561.76
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	8,581	60.10	515,718.10
DIRECTV	10,714	93.16	998,116.24
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,320	33.75	112,050.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	6,530	31.76	207,392.80
DISH NETWORK CORP-A	4,769	69.34	330,682.46
GANNETT CO	4,330	37.01	160,253.30
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	8,736	19.64	171,575.04
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,355	56.51	302,611.05
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	13,541	52.97	717,266.77
LIBERTY MEDIA CORP-A	2,465	37.83	93,250.95
LIBERTY MEDIA CORP-C	4,930	37.28	183,790.40
NEWS CORP - CLASS A	7,570	14.83	112,263.10
OMNICOM GROUP	5,417	70.94	384,281.98
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	1,950	66.66	129,987.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	55,940	3.81	213,131.40
THE WALT DISNEY CO.	34,923	113.77	3,973,189.71
TIME WARNER CABLE	6,287	176.35	1,108,712.45
TIME WARNER INC	18,128	87.10	1,578,948.80
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	9,769	32.52	317,687.88
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	29,722	32.98	980,231.56

VIACOM INC-CLASS B	7,748	66.74	517,101.52
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,608	163.42	262,779.36
AMAZON.COM INC	8,545	440.84	3,766,977.80
AUTONATION INC	1,650	64.23	105,979.50
AUTOZONE INC	702	679.64	477,107.28
BED BATH & BEYOND INC	4,262	70.34	299,789.08
BEST BUY CO INC	6,504	33.93	220,680.72
CARMAX INC	4,859	68.12	330,995.08
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,110	52.15	110,036.50
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	6,860	78.38	537,686.80
DOLLAR TREE INC	4,364	80.57	351,607.48
EXPEDIA INC	2,232	108.98	243,243.36
FAMILY DOLLAR STORES	2,143	79.33	170,004.19
FOOT LOCKER INC	3,100	65.55	203,205.00
GAMESTOP CORP-CLASS A	2,480	44.55	110,484.00
GAP INC/THE	5,106	38.93	198,776.58
GENUINE PARTS CO	3,521	91.75	323,051.75
HOME DEPOT INC	28,660	112.35	3,219,951.00
KOHL'S CORP	4,402	63.99	281,683.98
L BRANDS INC	5,558	86.73	482,045.34
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	9,700	28.67	278,099.00
LKQ CORP	6,990	30.03	209,909.70
LOWE'S COS INC	21,492	70.08	1,506,159.36
MACY'S INC	7,889	69.90	551,441.10
NETFLIX INC	1,260	678.61	855,048.60
NORDSTROM INC	2,850	75.87	216,229.50
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,235	230.19	514,474.65
PRICELINE GROUP INC/THE	1,125	1,154.92	1,299,285.00
ROSS STORES INC	9,232	50.08	462,338.56
SIGNET JEWELERS LTD	1,660	130.16	216,065.60
STAPLES INC	13,744	15.85	217,842.40
TARGET CORP	13,430	84.34	1,132,686.20
TIFFANY & CO	2,980	93.52	278,689.60
TJX COMPANIES INC	14,993	67.58	1,013,226.94
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,960	91.87	271,950.00

TRIPADVISOR INC	2,830	88.98	251,813.40
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	1,320	155.59	205,378.80
URBAN OUTFITTERS INC	2,040	35.36	72,134.40
COSTCO WHOLESALE CORP	9,509	138.34	1,315,475.06
CVS HEALTH CORP	24,487	105.33	2,579,215.71
KROGER CO	10,525	72.94	767,693.50
RITE AID CORP	19,870	8.68	172,471.60
SYSCO CORP	13,076	38.75	506,695.00
WAL-MART STORES INC	34,882	72.38	2,524,759.16
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	18,912	86.15	1,629,268.80
WHOLE FOODS MARKET INC	7,790	41.03	319,623.70
ALTRIA GROUP INC	42,858	48.97	2,098,756.26
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	13,943	51.45	717,367.35
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2,867	100.24	287,388.08
BUNGE LTD	3,107	91.45	284,135.15
CAMPBELL SOUP CO	4,215	48.01	202,362.15
COCA-COLA CO/THE	89,052	40.19	3,578,999.88
COCA-COLA ENTERPRISES	4,480	44.50	199,360.00
CONAGRA FOODS INC	9,730	43.86	426,757.80
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,720	117.74	437,992.80
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	4,109	74.42	305,791.78
GENERAL MILLS INC	13,169	56.55	744,706.95
HERSHEY CO/THE	3,485	88.24	307,516.40
HORMEL FOODS CORP	2,800	58.06	162,568.00
JM SMUCKER CO/THE	2,160	111.70	241,272.00
KELLOGG CO	5,928	63.41	375,894.48
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	2,865	81.18	232,580.70
KRAFT FOODS GROUP INC	12,681	87.30	1,107,051.30
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,275	81.42	185,230.50
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	4,651	91.82	427,054.82
MOLSON COORS BREWING CO -B	3,120	72.57	226,418.40
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	35,615	41.08	1,463,064.20
MONSTER BEVERAGE CORP	3,280	132.95	436,092.40
PEPSICO INC	32,091	95.29	3,057,951.39
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	33,488	80.81	2,706,165.28

REYNOLDS AMERICAN INC	9,168	76.34	699,885.12
TYSON FOODS INC-CL A	6,456	45.01	290,584.56
WHITEWAVE FOODS CO	3,520	49.43	173,993.60
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,965	82.64	245,027.60
CLOROX COMPANY	2,736	105.94	289,851.84
COLGATE-PALMOLIVE CO	18,900	66.49	1,256,661.00
ENERGIZER HOLDINGS INC	1,311	136.08	178,400.88
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,740	87.48	414,655.20
KIMBERLY-CLARK CORP	7,923	108.28	857,902.44
PROCTER & GAMBLE CO	58,509	79.51	4,652,050.59
ABBOTT LABORATORIES	32,947	49.50	1,630,876.50
AETNA INC	7,649	127.51	975,323.99
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,714	109.60	516,654.40
ANTHEM INC	5,856	167.97	983,632.32
BAXTER INTERNATIONAL INC	11,519	71.64	825,221.16
BECTON DICKINSON AND CO	4,617	141.70	654,228.90
BOSTON SCIENTIFIC CORP	28,738	17.94	515,559.72
CARDINAL HEALTH INC	7,295	87.03	634,883.85
CENTENE CORP	2,260	78.32	177,003.20
CERNER CORP	6,590	69.12	455,500.80
CIGNA CORP	5,800	165.75	961,350.00
COOPER COS INC/THE	1,040	174.45	181,428.00
CR BARD INC	1,574	172.09	270,869.66
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	3,938	80.19	315,788.22
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	2,972	52.21	155,168.12
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,520	142.86	360,007.20
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	3,630	37.91	137,613.30
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	15,814	90.62	1,433,064.68
HCA HOLDINGS INC	7,315	83.37	609,851.55
HENRY SCHEIN INC	1,630	144.32	235,241.60
HOLOGIC INC	4,538	37.62	170,742.25
HUMANA INC	3,415	184.23	629,145.45
INTUITIVE SURGICAL INC	820	492.45	403,809.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,155	118.63	255,647.65
MCKESSON CORP	5,084	230.53	1,172,014.52

MEDTRONIC PLC	30,728	75.27	2,312,896.56
OMNICARE INC	1,810	94.45	170,954.50
PATTERSON COS INC	2,042	48.72	99,486.24
QUEST DIAGNOSTICS	3,116	71.70	223,417.20
RESMED INC	3,370	56.30	189,731.00
ST JUDE MEDICAL INC	6,120	74.43	455,511.60
STRYKER CORP	7,533	96.72	728,591.76
UNITEDHEALTH GROUP INC	20,810	119.17	2,479,927.70
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,250	130.68	294,030.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,474	86.02	212,813.48
ZIMMER HOLDINGS INC	3,572	113.52	405,493.44
ABBVIE INC	36,856	69.22	2,551,172.32
AGILENT TECHNOLOGIES INC	7,010	40.19	281,731.90
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	4,690	184.98	867,556.20
ALKERMES PLC	3,220	65.66	211,425.20
ALLERGAN PLC	8,175	308.66	2,523,295.50
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,530	123.66	189,199.80
AMGEN INC	16,521	159.89	2,641,542.69
BIOGEN INC	5,113	410.65	2,099,653.45
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,500	136.49	477,715.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	36,171	66.81	2,416,584.51
CELGENE CORP	17,434	119.10	2,076,389.40
ELI LILLY & CO	21,653	82.26	1,781,175.78
ENDO INTERNATIONAL PLC	4,160	82.26	342,201.60
GILEAD SCIENCES INC	32,354	122.01	3,947,511.54
HOSPIRA INC	3,921	88.47	346,890.87
ILLUMINA INC	3,195	220.17	703,443.15
INCYTE CORP	3,340	105.29	351,668.60
ISIS PHARMACEUTICALS INC	2,570	62.04	159,442.80
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,330	179.41	238,615.30
JOHNSON & JOHNSON	60,261	99.33	5,985,725.13
MALLINCKRODT PLC	2,400	120.59	289,416.00
MEDIVATION INC	1,660	113.71	188,758.60
MERCK & CO. INC.	61,463	58.24	3,579,605.12
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	600	342.45	205,470.00

MYLAN NV	9,285	70.86	657,935.10
PERRIGO CO PLC	3,039	189.16	574,857.24
PFIZER INC	132,780	34.23	4,545,059.40
PUMA BIOTECHNOLOGY INC	550	121.70	66,935.00
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	1,150	72.90	83,835.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,650	516.59	852,373.50
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	8,624	130.27	1,123,448.48
UNITED THERAPEUTICS CORP	940	177.35	166,709.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,320	129.59	689,418.80
WATERS CORP	1,886	134.22	253,138.92
ZOETIS INC	10,200	49.71	507,042.00
BANK OF AMERICA CORP	227,819	17.49	3,984,554.31
BB&T CORP	15,428	41.16	635,016.48
CIT GROUP INC	4,465	47.70	212,980.50
CITIGROUP INC	65,697	56.66	3,722,392.02
CITIZENS FINANCIAL GROUP	6,620	28.05	185,691.00
COMERICA INC	4,300	52.65	226,395.00
FIFTH THIRD BANCORP	16,559	21.52	356,349.68
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,330	63.85	148,770.50
HUDSON CITY BANCORP INC	12,310	10.10	124,331.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	17,700	11.58	204,966.00
JPMORGAN CHASE & CO	80,790	69.02	5,576,125.80
KEYCORP	17,678	15.43	272,771.54
M & T BANK CORP	2,453	127.51	312,782.03
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	9,654	18.45	178,116.30
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	6,370	16.26	103,576.20
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	11,340	97.89	1,110,072.60
REGIONS FINANCIAL CORP	29,784	10.67	317,795.28
SUNTRUST BANKS INC	11,067	44.13	488,386.71
US BANCORP	38,921	44.74	1,741,325.54
WELLS FARGO & CO	106,080	57.54	6,103,843.20
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,220	226.42	276,232.40
ALLY FINANCIAL INC	9,120	23.45	213,864.00
AMERICAN EXPRESS CO	19,814	80.74	1,599,782.36
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,090	128.38	525,074.20

BANK OF NEW YORK MELLON CORP	24,702	43.29	1,069,349.58	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	25,020	140.09	3,505,051.80	
BLACKROCK INC	2,705	355.57	961,816.85	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	11,835	89.09	1,054,380.15	
CME GROUP INC	7,170	93.66	671,542.20	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	9,370	59.32	555,828.40	
E*TRADE FINANCIAL CORP	5,840	30.80	179,872.00	
EATON VANCE CORP	2,880	40.88	117,734.40	
FRANKLIN RESOURCES INC	9,205	50.62	465,957.10	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8,468	214.43	1,815,793.24	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	2,456	228.06	560,115.36	
INVESCO LTD	10,087	38.85	391,879.95	
LEGG MASON INC	2,185	52.47	114,646.95	
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	24.33	177,730.65	
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	6,022	103.95	625,986.90	
MOODY'S CORP	3,917	109.95	430,674.15	
MORGAN STANLEY	32,075	39.64	1,271,453.00	
NASDAQ OMX GROUP/THE	3,055	49.74	151,955.70	
NAVIENT CORP	8,682	18.83	163,482.06	
NORTHERN TRUST CORP	4,690	77.71	364,459.90	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,380	60.67	205,064.60	
SCHWAB (CHARLES) CORP	26,204	33.07	866,566.28	
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,225	50.12	161,637.00	
STATE STREET CORP	8,707	79.76	694,470.32	
SYNCHRONY FINANCIAL	3,410	32.76	111,711.60	
T ROWE PRICE GROUP INC	5,735	78.73	451,516.55	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	5,050	37.61	189,930.50	
VOYA FINANCIAL INC	4,650	47.80	222,270.00	
ACE LTD	6,983	105.23	734,821.09	
AFLAC INC	9,482	62.48	592,435.36	
ALLEGHANY CORP	400	477.39	190,956.00	
ALLSTATE CORP	9,313	65.95	614,192.35	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	29,655	62.92	1,865,892.60	
AON PLC	6,287	103.54	650,955.98	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,115	66.98	208,642.70	

ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,300	48.67	160,611.00
ASSURANT INC	1,530	68.40	104,652.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,175	54.44	118,407.00
CHUBB CORP	5,033	96.71	486,741.43
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,940	50.96	200,782.40
EVEREST RE GROUP LTD	1,014	184.12	186,697.68
FNF GROUP	5,881	36.94	217,244.14
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	9,442	42.27	399,113.34
LINCOLN NATIONAL CORP	5,833	60.87	355,054.71
LOEWS CORP	6,865	39.14	268,696.10
MARSH & MCLENNAN COS	11,933	58.57	698,915.81
METLIFE INC	20,475	57.17	1,170,555.75
PARTNERRE LTD	1,052	129.30	136,023.60
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	5,820	53.03	308,634.60
PROGRESSIVE CORP	12,350	28.24	348,764.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	10,042	90.70	910,809.40
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	887	103.93	92,185.91
TORCHMARK CORP	3,106	58.71	182,353.26
TRAVELERS COS INC/THE	6,754	98.78	667,160.12
UNUM GROUP	4,788	36.77	176,054.76
WILLIS GROUP HOLDING	2,990	47.18	141,068.20
WR BERKLEY CORP	2,573	52.84	135,957.32
XL GROUP PLC	6,310	37.88	239,022.80
CBRE GROUP INC	6,610	37.29	246,486.90
JONES LANG LASALLE INC	890	172.27	153,320.30
REALOGY HOLDINGS CORP	3,160	47.09	148,804.40
ACCENTURE PLC-CL A	13,558	97.77	1,325,565.66
ACTIVISION BLIZZARD INC	10,200	25.44	259,488.00
ADOBE SYSTEMS INC	10,519	83.40	877,284.60
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	4,220	71.32	300,991.50
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,275	303.39	386,822.25
ANSYS INC	2,090	91.09	190,378.10
AUTODESK INC	5,210	53.91	280,871.10
AUTOMATIC DATA PROCESSING	10,606	83.63	886,979.78
CA INC	6,760	30.67	207,329.20

CDK GLOBAL INC	2,720	55.27	150,334.40
CITRIX SYSTEMS INC	3,628	71.67	260,036.90
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	13,558	63.02	854,425.16
COMPUTER SCIENCES CORP	3,453	66.69	230,280.57
EBAY INC	23,517	61.61	1,448,882.37
ELECTRONIC ARTS INC	6,984	67.68	472,677.12
FACEBOOK INC-A	43,540	88.86	3,868,964.40
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	6,105	63.30	386,446.50
FIREEYE INC	1,850	50.95	94,257.50
FISERV INC	5,278	85.00	448,630.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,740	159.98	278,365.20
GARTNER INC	1,750	87.74	153,545.00
GOOGLE INC-CL A	6,190	558.57	3,457,548.30
GOOGLE INC-CL C	6,632	537.84	3,566,954.88
INTL BUSINESS MACHINES CORP	20,332	166.97	3,394,834.04
INTUIT INC	5,956	103.05	613,765.80
LINKEDIN CORP - A	2,410	215.70	519,837.00
MASTERCARD INC-CLASS A	21,630	95.51	2,065,881.30
MICROSOFT CORP	168,954	45.63	7,710,215.79
NETSUITE INC	740	94.16	69,678.40
NUANCE COMMUNICATIONS INC	4,240	18.27	77,464.80
ORACLE CORP	76,073	41.20	3,134,207.60
PAYCHEX INC	6,712	48.14	323,149.24
RACKSPACE HOSTING INC	2,500	37.50	93,750.00
RED HAT INC	4,070	78.52	319,576.40
SALESFORCE.COM INC	13,190	73.50	969,465.00
SERVICENOW INC	3,030	77.47	234,734.10
SPLUNK INC	2,530	71.31	180,414.30
SYMANTEC CORP	15,945	24.23	386,427.07
SYNOPSIS INC	3,207	50.25	161,151.75
TERADATA CORP	3,025	37.60	113,740.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,636	42.35	153,984.60
TWITTER INC	10,380	35.17	365,064.60
VANTIV INC - CL-A	2,410	38.97	93,917.70
VERISIGN INC	2,720	63.33	172,257.60

VISA INC-CLASS A SHARES	42,512	68.86	2,927,376.32
VMWARE INC	1,835	90.36	165,810.60
WESTERN UNION CO	10,451	21.14	220,934.14
WORKDAY INC-CLASS A	2,070	79.20	163,944.00
XEROX CORP	22,644	10.99	248,857.56
YAHOO! INC	19,905	40.94	814,910.70
ZILLOW GROUP INC	1,000	91.51	91,510.00
AMPHENOL CORP-CL A	7,220	56.79	410,023.80
APPLE INC	126,332	128.11	16,184,392.52
ARROW ELECTRONICS INC	2,310	59.66	137,814.60
AVNET INC	3,460	43.00	148,780.00
CISCO SYSTEMS INC	110,530	28.51	3,151,210.30
CORNING INC	28,458	20.77	591,072.66
EMC CORP/MASS	42,879	27.45	1,177,028.55
F5 NETWORKS INC	1,775	126.04	223,721.00
FLEXTRONICS INTL LTD	14,686	11.89	174,616.54
FLIR SYSTEMS INC	3,195	30.87	98,629.65
HARRIS CORP	2,130	78.97	168,206.10
HEWLETT-PACKARD CO	39,445	31.54	1,244,095.30
JUNIPER NETWORKS INC	7,633	26.88	205,175.04
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4,975	58.29	289,992.75
NETAPP INC	7,006	33.18	232,459.08
PALO ALTO NETWORKS INC	1,450	179.14	259,753.00
QUALCOMM INC	35,692	65.35	2,332,472.20
SANDISK CORP	4,653	63.79	296,814.87
SEAGATE TECHNOLOGY	6,974	51.97	362,438.78
TE CONNECTIVITY LTD	9,215	68.11	627,633.65
TRIMBLE NAVIGATION LTD	6,050	23.43	141,751.50
WESTERN DIGITAL CORP	4,755	87.73	417,156.15
AT&T INC	112,416	35.78	4,022,244.48
CENTURYLINK INC	12,616	31.88	402,198.08
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	21,304	5.07	108,011.28
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	5,700	54.45	310,365.00
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	3,010	119.04	358,310.40
SPRINT CORP	21,150	4.62	97,713.00

T-MOBILE US INC	6,372	39.03	248,699.16
VERIZON COMMUNICATIONS INC	90,027	47.29	4,257,376.83
AES CORP	13,728	13.64	187,249.92
ALLIANT ENERGY CORP	2,160	57.68	124,588.80
AMEREN CORPORATION	5,782	37.78	218,443.96
AMERICAN ELECTRIC POWER	10,698	52.96	566,566.08
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,095	49.70	203,521.50
CALPINE CORP	8,060	18.98	152,978.80
CENTERPOINT ENERGY INC	8,142	19.17	156,082.14
CMS ENERGY CORP	5,290	31.63	167,322.70
CONSOLIDATED EDISON INC	6,306	57.84	364,739.04
DOMINION RESOURCES INC/VA	13,157	67.65	890,071.05
DTE ENERGY COMPANY	3,698	73.85	273,097.30
DUKE ENERGY CORP	15,546	70.93	1,102,677.78
EDISON INTERNATIONAL	7,059	56.07	395,798.13
ENTERGY CORP	4,147	70.51	292,404.97
EVERSOURCE ENERGY	6,900	45.57	314,433.00
EXELON CORP	18,576	32.78	608,921.28
FIRSTENERGY CORP	9,905	33.00	326,865.00
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	2,000	70.11	140,220.00
MDU RESOURCES GROUP INC	4,180	20.02	83,683.60
NEXTERA ENERGY INC	9,785	98.53	964,116.05
NISOURCE INC	6,385	47.00	300,095.00
NRG ENERGY INC	7,670	24.89	190,906.30
OGE ENERGY CORP	3,560	29.08	103,524.80
P G & E CORP	10,391	49.85	517,991.35
PINNACLE WEST CAPITAL	2,199	56.52	124,287.48
PPL CORP	13,608	29.72	404,429.76
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	11,758	39.61	465,734.38
SCANA CORP	3,443	50.64	174,353.52
SEMPRA ENERGY	5,407	100.99	546,052.93
SOUTHERN CO	19,585	41.70	816,694.50
WISCONSIN ENERGY CORP	4,604	45.78	210,771.12
XCEL ENERGY INC	11,814	31.99	377,929.86
ALTERA CORPORATION	5,946	51.22	304,554.12

	ANALOG DEVICES INC	6,481	66.84	433,190.04	
	APPLIED MATERIALS INC	27,563	20.10	554,016.30	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	5,780	139.97	809,026.60	
	BROADCOM CORP-CL A	11,716	53.14	622,588.24	
	FREESCALE SEMICONDUCTOR LTD	2,010	41.71	83,837.10	
	INTEL CORP	102,552	31.91	3,272,434.32	
	KLA-TENCOR CORPORATION	3,779	57.21	216,196.59	
	LAM RESEARCH CORP	3,247	83.21	270,182.87	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	5,594	46.23	258,610.62	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	9,254	14.35	132,794.90	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	5,850	35.34	206,739.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	3,794	49.47	187,708.15	
	MICRON TECHNOLOGY INC	23,297	24.06	560,525.82	
	NVIDIA CORP	11,505	21.01	241,720.05	
	QORVO INC	3,100	84.59	262,229.00	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	4,200	108.40	455,280.00	
	SUNEDISON INC	5,490	31.68	173,923.20	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	22,592	53.99	1,219,742.08	
	XILINX INC	6,125	45.75	280,218.75	
	米ドル小計	6,897,004		419,036,761.21 (51,910,273,978)	
加ドル	ALTAGAS LTD	3,050	39.45	120,322.50	
	ARC RESOURCES LTD	7,925	22.21	176,014.25	
	BAYTEX ENERGY CORP	3,375	20.95	70,706.25	
	CAMECO CORP	7,892	18.55	146,396.60	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	24,024	35.87	861,740.88	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	11,160	10.20	113,832.00	
	CENOVUS ENERGY INC	17,463	21.15	369,342.45	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	10,045	27.28	274,027.60	
	ENBRIDGE INC	17,995	60.47	1,088,157.65	
	ENCANA CORP	17,968	14.74	264,848.32	
	ENERPLUS CORP	4,690	11.61	54,450.90	
	HUSKY ENERGY INC	6,729	24.45	164,524.05	
	IMPERIAL OIL LTD	6,942	49.71	345,086.82	
	INTER PIPELINE LTD	7,180	30.58	219,564.40	

KEYERA CORP	4,120	43.26	178,231.20
MEG ENERGY CORP	2,710	20.72	56,151.20
PARAMOUNT RESOURCES LTD -A	1,010	30.07	30,370.70
PEMBINA PIPELINE CORP	8,085	42.05	339,974.25
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	3,680	32.33	118,974.40
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	2,590	32.45	84,045.50
SUNCOR ENERGY INC	31,435	35.70	1,122,229.50
TOURMALINE OIL CORP	4,005	39.13	156,715.65
TRANSCANADA CORP	15,873	54.00	857,142.00
VERESEN INC	5,360	18.16	97,337.60
VERMILION ENERGY INC	1,830	55.55	101,656.50
AGNICO EAGLE MINES LTD	4,695	37.19	174,607.05
AGRIUM INC	3,015	127.81	385,347.15
BARRICK GOLD CORP	26,114	13.77	359,589.78
ELDORADO GOLD CORP	14,630	5.16	75,490.80
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	12,590	18.14	228,382.60
FRANCO-NEVADA CORP	2,925	60.61	177,284.25
GOLDCORP INC	17,917	20.81	372,852.77
KINROSS GOLD CORP	25,015	2.88	72,043.20
METHANEX CORP	2,330	69.57	162,098.10
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	17,917	37.72	675,829.24
SILVER WHEATON CORP	8,645	22.21	192,005.45
TECK RESOURCES LTD-CLS B	13,885	13.92	193,279.20
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	13,419	4.90	65,753.10
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,460	68.29	99,703.40
YAMANA GOLD INC	19,626	3.93	77,130.18
BOMBARDIER INC 'B'	34,746	2.46	85,475.16
CAE INC	6,315	15.43	97,440.45
FINNING INTERNATIONAL INC	2,845	23.90	67,995.50
SNC-LAVALIN GROUP INC	3,195	44.01	140,611.95
CANADIAN NATL RAILWAY CO	17,438	74.22	1,294,248.36
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,335	201.84	673,136.40
MAGNA INTERNATIONAL INC	9,318	71.43	665,584.74
GILDAN ACTIVEWEAR INC	4,060	41.72	169,383.20
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	4,328	46.75	202,334.00

SHAW COMMUNICATIONS INC-B	8,325	27.68	230,436.00
THOMSON REUTERS CORP	8,044	48.14	387,238.16
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,560	136.81	213,423.60
DOLLARAMA INC	2,920	75.63	220,839.60
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	9,730	53.97	525,128.10
EMPIRE CO LTD 'A'	1,000	90.84	90,840.00
LOBLAW COMPANIES LTD	4,519	64.96	293,554.24
METRO INC	5,790	33.83	195,875.70
WESTON (GEORGE) LTD	942	102.50	96,555.00
SAPUTO INC	5,040	31.56	159,062.40
CATAMARAN CORP	4,320	75.91	327,931.20
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	6,934	283.97	1,969,047.98
BANK OF MONTREAL	13,731	75.17	1,032,159.27
BANK OF NOVA SCOTIA	26,239	66.35	1,740,957.65
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	8,295	95.92	795,656.40
NATIONAL BANK OF CANADA	7,340	48.13	353,274.20
ROYAL BANK OF CANADA	31,199	78.11	2,436,953.89
TORONTO-DOMINION BANK	39,950	54.28	2,168,486.00
CI FINANCIAL CORP	3,410	34.14	116,417.40
IGM FINANCIAL INC	2,535	41.93	106,292.55
ONEX CORPORATION	1,905	69.24	131,902.20
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	490	650.00	318,500.00
GREAT-WEST LIFECO INC	5,974	37.14	221,874.36
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	1,735	43.28	75,090.80
INTACT FINANCIAL CORP	3,045	87.33	265,919.85
MANULIFE FINANCIAL CORP	43,171	23.98	1,035,240.58
POWER CORP OF CANADA	7,800	33.06	257,868.00
POWER FINANCIAL CORP	5,715	37.11	212,083.65
SUN LIFE FINANCIAL INC	13,864	42.76	592,824.64
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	18,933	45.04	852,742.32
CGI GROUP INC - CL A	4,650	50.50	234,825.00
CONSTELLATION SOFTWARE INC	370	523.00	193,510.00
OPEN TEXT CORP	3,070	51.48	158,043.60
BLACKBERRY LTD	10,328	10.97	113,298.16
BCE INC	2,930	54.01	158,249.30

	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	8,355	43.35	362,189.25	
	TELUS CORP	4,366	42.86	187,126.76	
	ATCO LTD -CLASS I	1,920	39.84	76,492.80	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,590	35.91	93,006.90	
	FORTIS INC	4,785	36.86	176,375.10	
	TRANSALTA CORP	4,760	10.18	48,456.80	
加ドル小計		839,478		33,345,198.61	(3,333,852,957)
ユーロ	ENI SPA	55,546	16.86	936,505.56	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	9,315	11.16	104,001.97	
	NESTE OYJ	2,740	22.60	61,924.00	
	OMV AG	3,490	25.53	89,117.15	
	REPSOL SA	21,361	16.52	352,883.72	
	REPSOL SA-RTS	21,361	0.48	10,338.72	
	SAIPEM SPA	5,370	10.23	54,935.10	
	TECHNIP SA	2,468	59.00	145,612.00	
	TENARIS SA	9,355	12.68	118,621.40	
	TOTAL SA	46,317	46.51	2,154,203.67	
	VOPAK	1,890	46.54	87,970.05	
	AIR LIQUIDE SA	7,424	119.25	885,312.00	
	AKZO NOBEL	5,028	68.40	343,915.20	
	ARCELORMITTAL	22,911	9.48	217,196.28	
	ARKEMA	1,615	66.38	107,203.70	
	BASF SE	19,855	83.85	1,664,841.75	
	CRH PLC	16,080	26.68	429,014.40	
	EVONIK INDUSTRIES AG	1,820	35.08	63,854.70	
	FUCHS PETROLUB SE-PRF	1,720	38.20	65,704.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	3,245	74.12	240,519.40	
	IMERYS SA	910	71.00	64,610.00	
	K+S AG	3,880	28.61	111,026.20	
	KONINKLIJKE DSM NV	3,442	54.38	187,175.96	
	LAFARGE SA	4,158	61.47	255,592.26	
	LANXESS AG	1,935	54.67	105,786.45	
	LINDE AG	4,165	177.00	737,205.00	
	SOLVAY ET CIE SA -A	1,271	129.45	164,530.95	

STORA ENSO OYJ-R SHS	12,085	9.50	114,807.50
SYMRISE AG	2,640	56.96	150,374.40
THYSSENKRUPP AG	9,395	24.38	229,097.07
UMICORE	2,120	43.63	92,495.60
UPM-KYMMENE OYJ	12,618	16.15	203,780.70
VOESTALPINE AG	2,509	39.78	99,808.02
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4,176	29.90	124,862.40
AIRBUS GROUP SE	12,608	61.69	777,787.52
ALSTOM	4,490	26.48	118,895.20
ANDRITZ AG	1,980	52.35	103,653.00
BOSKALIS WESTMINSTER	1,695	45.25	76,707.22
BOUYGUES SA	4,210	34.50	145,245.00
BRENTAG AG	3,765	54.05	203,498.25
CNH INDUSTRIAL NV	22,370	8.31	185,894.70
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	9,246	42.79	395,636.34
FERROVIAL SA	9,975	19.99	199,450.12
FINMECCANICA SPA	9,630	11.72	112,863.60
GEA GROUP AG	4,480	42.10	188,630.40
KONE OYJ-B	6,434	37.76	242,947.84
KONINKLIJKE PHILIPS NV	19,861	23.73	471,301.53
LEGRAND SA	5,628	52.52	295,582.56
MAN SE	624	94.01	58,662.24
METSO OYJ	2,420	26.39	63,863.80
OSRAM LICHT AG	2,332	44.05	102,724.60
PRYSMIAN SPA	5,635	20.26	114,165.10
REXEL SA	7,240	15.34	111,061.60
SAFRAN SA	6,190	63.57	393,498.30
SCHNEIDER ELECTRIC SE	11,898	66.02	785,505.96
SIEMENS AG-REG	17,146	95.97	1,645,501.62
THALES SA	2,345	56.83	133,266.35
VALLOUREC	2,495	19.93	49,725.35
VINCI SA	10,490	54.82	575,061.80
WARTSILA OYJ ABP	3,660	42.98	157,306.80
ZARDOYA OTIS SA	4,249	10.35	43,977.15
ZARDOYA OTIS SA-RTS	4,249	0.41	1,742.09

ZODIAC AEROSPACE	4,550	31.50	143,347.75
BUREAU VERITAS SA	5,650	21.00	118,650.00
EDENRED	3,906	22.72	88,763.85
RANDSTAD HOLDING NV	2,865	58.20	166,743.00
SOCIETE BIC SA	735	148.50	109,147.50
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	10,531	15.31	161,229.61
ABERTIS INFRASTRUCTURAS-RTS	10,531	0.75	7,993.02
ADP	650	107.30	69,745.00
AENA SA	1,280	95.25	121,920.00
ATLANTIA SPA	9,360	22.95	214,812.00
BOLLORE	11,000	5.03	55,418.00
DEUTCHE LUFTHANSA	5,680	11.83	67,222.80
DEUTSCHE POST AG-REG	20,993	27.13	569,540.09
FRAPORT AG	980	58.48	57,310.40
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	8,760	13.79	120,800.40
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	16,992	7.26	123,497.85
TNT EXPRESS NV	9,060	7.63	69,209.34
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	7,245	103.25	748,046.25
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,190	80.26	95,509.40
CONTINENTAL AG	2,435	216.05	526,081.75
DAIMLER AG	20,822	85.85	1,787,568.70
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	19,647	13.95	274,075.65
MICHELIN (CGDE)-B	4,149	98.60	409,091.40
NOKIAN RENKAAT OYJ	2,915	29.26	85,292.90
PEUGEOT SA	7,500	19.08	143,137.50
PIRELLI & C.	5,506	15.36	84,572.16
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	3,490	79.79	278,467.10
RENAULT SA	4,117	96.69	398,072.73
VALEO SA	1,620	144.45	234,009.00
VOLKSWAGEN AG	771	215.75	166,343.25
VOLKSWAGEN AG-PFD	3,613	218.40	789,079.20
ADIDAS AG	4,421	70.97	313,758.37
CHRISTIAN DIOR SE	1,080	190.10	205,308.00
HERMES INTERNATIONAL	542	357.55	193,792.10
HUGO BOSS AG -ORD	900	104.30	93,870.00

KERING	1,547	162.20	250,923.40
LUXOTTICA GROUP SPA	3,976	61.50	244,524.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	6,094	170.85	1,041,159.90
ACCOR SA	4,976	47.80	237,852.80
SODEXO	2,330	90.85	211,680.50
TUI AG	5,500	16.27	89,512.50
ALTICE SA	1,940	123.75	240,075.00
AXEL SPRINGER SE	995	48.51	48,267.45
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	31.29	118,764.52
JC DECAUX SA .	1,140	38.70	44,123.70
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	460	123.50	56,810.00
LAGARDERE S.C.A.	2,980	26.64	79,387.20
NUMERICABLE-SFR	2,250	49.36	111,060.00
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-REG	4,805	45.19	217,161.97
PUBLICIS GROUPE	4,075	68.71	279,993.25
REED ELSEVIER NV	13,368	22.14	295,967.52
RTL GROUP	920	82.84	76,212.80
SES	6,700	32.25	216,075.00
TELENET GROUP HOLDING NV	1,440	49.78	71,683.20
VIVENDI	25,330	24.40	618,052.00
WOLTERS KLUWER	7,557	28.19	213,069.61
INDITEX	24,485	30.69	751,444.65
CARREFOUR SA	11,113	30.07	334,167.91
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,344	71.52	96,122.88
COLRUYT SA	1,375	40.66	55,907.50
DELHAIZE GROUP	2,426	81.29	197,209.54
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	16,598	7.14	118,559.51
JERONIMO MARTINS	5,075	12.11	61,458.25
KONINKLIJKE AHOLD NV	19,721	18.25	360,006.85
METRO AG	3,260	30.02	97,865.20
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	17,431	113.50	1,978,418.50
DANONE	13,144	60.47	794,817.68
HEINEKEN HOLDING NV	2,595	64.93	168,493.35
HEINEKEN NV	5,033	70.13	352,964.29
KERRY GROUP PLC-A	3,750	68.30	256,125.00

PERNOD-RICARD SA	4,796	108.00	517,968.00
REMY COINTREAU	470	68.03	31,974.10
UNILEVER NV-CVA	35,185	38.94	1,370,103.90
BEIERSDORF AG	2,015	79.04	159,265.60
HENKEL AG & CO KGAA	2,530	88.50	223,905.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	3,953	105.40	416,646.20
L'OREAL	5,496	169.00	928,824.00
ESSILOR INTERNATIONAL	4,465	112.05	500,303.25
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	4,683	77.57	363,260.31
FRESENIUS SE & CO KGAA	8,475	58.52	495,957.00
BAYER AG	17,900	133.90	2,396,810.00
GRIFOLS SA	3,810	36.87	140,493.75
MERCK KGAA	2,930	94.77	277,676.10
ORION OYJ-CLASS B	2,590	32.28	83,605.20
QIAGEN N.V.	5,145	22.27	114,604.87
SANOFI	25,836	92.60	2,392,413.60
UCB SA	2,798	66.19	185,199.62
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	52,861	1.91	101,281.67
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	133,873	9.32	1,248,767.34
BANCO COMERCIAL PORTUGUES	750,000	0.08	62,925.00
BANCO DE SABADELL SA	108,391	2.28	248,106.99
BANCO POPOLARE SC	5,500	15.48	85,140.00
BANCO POPULAR ESPANOL	39,339	4.64	182,572.29
BANCO SANTANDER SA	312,099	6.72	2,099,489.97
BANK OF IRELAND	558,550	0.36	203,870.75
BANKIA SA	95,000	1.18	112,385.00
BANKINTER SA	13,960	6.88	96,128.56
BNP PARIBAS	23,082	56.86	1,312,442.52
CAIXABANK S.A	42,940	4.29	184,470.24
COMMERZBANK AG	23,524	11.98	281,935.14
CREDIT AGRICOLE SA	21,992	14.05	308,987.60
ERSTE GROUP BANK AG	7,118	26.66	189,765.88
ING GROEP NV-CVA	83,295	15.29	1,273,997.02
INTESA SANPAOLO	275,093	3.38	932,015.08
KBC GROEP NV	5,519	61.51	339,473.69

NATIXIS	22,980	6.74	154,977.12
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	2,770	13.90	38,503.00
SOCIETE GENERALE	16,399	44.03	722,047.97
UBI BANCA SCPA	22,584	7.57	171,073.80
UNICREDIT SPA	98,103	6.36	623,935.08
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	30,445	28.08	855,047.82
DEUTSCHE BOERSE AG	3,830	76.04	291,233.20
EURAZEO	913	63.92	58,358.96
EXOR SPA	1,714	43.94	75,313.16
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,882	74.81	140,792.42
MEDIOBANCA SPA	11,670	9.23	107,772.45
WENDEL	750	114.70	86,025.00
AEGON NV	38,139	6.79	259,116.36
AGEAS	4,044	35.11	141,984.84
ALLIANZ SE-REG	9,878	146.05	1,442,681.90
ASSICURAZIONI GENERALI	25,718	16.85	433,348.30
AXA	40,412	23.45	947,863.46
CNP ASSURANCES	3,530	15.65	55,244.50
DELTA LLOYD NV	3,600	15.33	55,188.00
HANNOVER RUECK SE-REG	1,355	89.51	121,286.05
MAPFRE SA	20,814	3.18	66,334.21
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,776	165.20	623,795.20
NN GROUP NV	2,380	25.30	60,214.00
SAMPO OYJ-A SHS	9,639	43.36	417,947.04
SCOR SE	2,612	31.81	83,100.78
UNIPOLSAI SPA	23,000	2.29	52,808.00
DEUTSCHE ANNINGTON IMM-RTS	7,760	1.40	10,887.28
DEUTSCHE ANNINGTON IMMOBILIE	7,760	25.62	198,811.20
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	6,680	21.59	144,254.60
IMMOEAST AG-TEMPORARY	16,150	-	-
IMMOFINANZ AG-TEMPORARY	13,000	-	-
AMADEUS IT HOLDING SA	9,610	36.76	353,263.60
ATOS	1,650	70.25	115,912.50
CAP GEMINI SA	3,209	81.27	260,795.43
DASSAULT SYSTEMES SA	3,080	68.43	210,764.40

GEMALTO	1,850	83.68	154,808.00
SAP SE	20,712	66.08	1,368,648.96
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2,930	41.15	120,569.50
ALCATEL-LUCENT	70,000	3.48	244,020.00
NOKIA OYJ	79,936	6.51	520,783.04
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	68,626	16.27	1,116,888.15
ELISA OYJ	2,505	28.90	72,394.50
ILIAD SA	520	208.75	108,550.00
KONINKLIJKE KPN NV	61,096	3.37	206,382.28
ORANGE S.A.	41,284	14.45	596,760.22
PROXIMUS	3,780	32.49	122,831.10
TELECOM ITALIA SPA	242,623	1.17	285,809.89
TELECOM ITALIA-RSP	125,887	0.95	119,592.65
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	11,110	5.33	59,294.07
TELEFONICA SA	97,099	13.44	1,305,496.05
E.ON SE	43,689	12.62	551,573.62
EDF	6,075	21.13	128,364.75
ENAGAS	4,190	25.60	107,264.00
ENDESA SA	6,840	17.19	117,579.60
ENEL GREEN POWER SPA	43,650	1.82	79,443.00
ENEL SPA	145,874	4.19	611,795.55
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	49,221	3.56	175,226.76
FORTUM OYJ	9,825	16.89	165,944.25
GAS NATURAL SDG SA	7,722	21.31	164,594.43
GDF SUEZ	33,194	17.73	588,529.62
IBERDROLA SA	115,162	6.33	729,781.59
RED ELECTRICA CORPORACION SA	2,610	74.69	194,940.90
RWE AG	10,685	20.31	217,012.35
SNAM SPA	47,520	4.47	212,794.56
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	6,199	18.00	111,612.99
TERNA SPA	34,477	4.15	143,148.50
VEOLIA ENVIRONNEMENT	9,184	19.19	176,286.88
ASML HOLDING NV	7,582	98.92	750,011.44
INFINEON TECHNOLOGIES AG	24,715	11.83	292,502.02
STMICROELECTRONICS NV	16,783	7.46	125,234.74

ユーロ小計		5,578,778		79,296,243.65 (11,007,904,543)
英債券	AMEC FOSTER WHEELER PLC	8,850	8.51	75,357.75
	BG GROUP PLC	73,714	11.09	817,856.83
	BP PLC	394,858	4.42	1,745,667.21
	PETROFAC LTD	6,995	9.37	65,578.12
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	84,278	18.98	1,600,017.83
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	52,734	19.16	1,010,647.11
	TULLOW OIL PLC	19,950	3.67	73,256.40
	ANGLO AMERICAN PLC	31,724	10.08	319,777.92
	ANTOFAGASTA PLC	8,730	7.21	62,943.30
	BHP BILLITON PLC	45,961	13.73	631,274.33
	CRODA INTERNATIONAL PLC	2,850	28.32	80,712.00
	FRESNILLO PLC	5,160	7.14	36,868.20
	GLENCORE PLC	240,813	2.78	669,460.14
	JOHNSON MATTHEY PLC	4,447	31.94	142,037.18
	MONDI PLC	7,400	14.17	104,858.00
	RANDGOLD RESOURCES LTD	2,250	44.58	100,305.00
	REXAM PLC	11,772	5.68	66,864.96
	RIO TINTO PLC	27,885	27.80	775,342.42
	SOUTH32 LTD	46,811	0.94	44,002.34
	ASHTED GROUP PLC	10,920	11.57	126,344.40
	BAE SYSTEMS PLC ORD	71,015	4.80	341,156.06
	BUNZL PLC	7,276	18.38	133,732.88
	COBHAM PLC	23,225	2.79	64,983.55
	IMI PLC	6,116	11.88	72,658.08
	MEGGITT PLC	20,865	4.77	99,713.83
	MELROSE INDUSTRIES PLC	20,907	2.58	54,044.59
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	42,135	9.08	382,585.80
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENTITL-C	5,941,035	0.00	5,941.03
	SMITHS GROUP PLC	8,813	11.59	102,142.67
	TRAVIS PERKINS PLC	4,350	21.84	95,004.00
	WEIR GROUP PLC/THE	3,880	18.00	69,840.00
	WOLSELEY PLC	6,074	42.72	259,481.28
	AGGREKO PLC	6,006	14.84	89,129.04

BABCOCK INTL GROUP PLC	6,275	11.20	70,280.00
CAPITA PLC	15,309	12.61	193,046.49
EXPERIAN PLC	20,558	12.10	248,751.80
G4S PLC	34,639	2.83	98,063.00
INTERTEK GROUP PLC	3,545	24.52	86,923.40
EASYJET PLC	3,840	16.07	61,708.80
ROYAL MAIL PLC	14,990	5.24	78,547.60
GKN PLC	33,065	3.52	116,487.99
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	20,100	6.18	124,218.00
BURBERRY GROUP PLC	9,334	16.77	156,531.18
PERSIMMON PLC	5,870	19.90	116,813.00
TAYLOR WIMPEY PLC	66,170	1.89	125,325.98
CARNIVAL PLC	3,660	33.44	122,390.40
COMPASS GROUP PLC	36,157	11.13	402,427.41
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	5,768	27.31	157,524.08
MERLIN ENTERTAINME	19,250	4.48	86,240.00
TUI AG-DI	3,393	11.61	39,392.73
WHITBREAD PLC	4,140	51.85	214,659.00
WILLIAM HILL PLC	23,300	4.11	95,879.50
ITV PLC	89,555	2.73	244,753.81
PEARSON PLC	17,749	12.73	225,944.77
REED ELSEVIER PLC	23,666	10.75	254,409.50
SKY PLC	23,224	10.69	248,264.56
WPP PLC	29,634	14.84	439,768.56
DIXONS CARPHONE PLC	22,000	4.66	102,520.00
KINGFISHER PLC	50,397	3.70	186,771.28
MARKS & SPENCER GROUP PLC	34,970	5.69	199,154.15
NEXT PLC	3,407	75.60	257,569.20
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	5,460	7.26	39,666.90
SAINSBURY (J) PLC	23,451	2.75	64,607.50
TESCO PLC	177,834	2.15	383,765.77
WM MORRISON SUPERMARKETS	37,925	1.84	69,971.62
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	7,795	30.35	236,578.25
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	40,327	35.91	1,448,142.57
COCA-COLA HBC AG-CDI	5,000	14.36	71,800.00

DIAGEO PLC	54,332	19.26	1,046,434.32
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	20,772	32.35	671,974.20
SABMILLER PLC	21,141	34.29	725,030.59
TATE & LYLE PLC	12,180	5.42	66,076.50
UNILEVER PLC	27,797	28.51	792,492.47
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	14,145	57.43	812,347.35
SMITH & NEPHEW PLC	19,376	11.15	216,042.40
ASTRAZENECA PLC	27,323	42.50	1,161,227.50
GLAXOSMITHKLINE PLC	105,241	13.83	1,455,483.03
SHIRE PLC	12,805	54.00	691,470.00
BARCLAYS PLC	356,591	2.74	978,663.99
HSBC HOLDINGS PLC	416,301	6.02	2,506,964.62
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,249,036	0.87	1,088,285.06
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	57,230	3.62	207,515.98
STANDARD CHARTERED PLC	54,009	10.66	575,735.94
3I GROUP PLC	20,499	5.39	110,592.10
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	22,730	4.18	95,170.51
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,720	12.23	69,955.60
ICAP PLC	12,270	5.34	65,521.80
INVESTEC PLC	13,185	5.82	76,736.70
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	5,177	24.51	126,888.27
SCHRODERS PLC	2,231	33.30	74,292.30
ADMIRAL GROUP PLC	4,925	14.31	70,476.75
AVIVA PLC	83,965	5.15	432,839.57
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	32,000	3.39	108,576.00
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	127,081	2.60	330,664.76
OLD MUTUAL PLC	104,159	2.09	217,900.62
PRUDENTIAL PLC	55,912	16.01	895,430.68
RSA INSURANCE GROUP PLC	24,738	4.16	103,107.98
STANDARD LIFE PLC	40,716	4.78	194,622.48
SAGE GROUP PLC/THE	22,090	5.16	113,984.40
BT GROUP PLC	180,562	4.63	836,724.30
INMARSAT PLC	10,010	9.48	94,944.85
VODAFONE GROUP PLC	573,348	2.39	1,374,601.83
CENTRICA PLC	114,215	2.79	319,573.57

	NATIONAL GRID PLC	81,615	8.54	697,073.71	
	SEVERN TRENT PLC	5,493	21.93	120,461.49	
	SSE PLC	21,427	16.22	347,545.94	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	16,215	9.91	160,771.72	
	ARM HOLDINGS PLC	30,650	11.25	344,812.50	
英債券小計		12,230,768		37,767,497.43 (7,344,645,225)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	7,955	15.63	124,336.65	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	140	397.00	55,580.00	
	GIVAUDAN-REG	213	1,664.00	354,432.00	
	HOLCIM LTD-REG	5,133	72.00	369,576.00	
	SIKA AG-BR	47	3,287.00	154,489.00	
	SYNGENTA AG-REG	1,978	398.10	787,441.80	
	ABB LTD-REG	48,015	20.50	984,307.50	
	GEBERIT AG-REG	895	324.00	289,980.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	360	161.10	57,996.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,090	161.80	176,362.00	
	SULZER AG-REG	520	102.30	53,196.00	
	ADECCO SA-REG	3,557	78.30	278,513.10	
	SGS SA-REG	133	1,737.00	231,021.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,020	127.20	129,744.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	11,339	78.55	890,678.45	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	740	381.80	282,532.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	930	74.25	69,052.50	
	DUFREY AG-REG	800	137.00	109,600.00	
	ARYZTA AG	2,110	48.63	102,609.30	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	25	4,991.00	124,775.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	2	59,125.00	118,250.00	
	NESTLE SA-REG	70,053	70.05	4,907,212.65	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,160	131.00	151,960.00	
	ACTELION LTD-REG	2,000	139.60	279,200.00	
	LONZA GROUP AG-REG	1,250	129.00	161,250.00	
	NOVARTIS AG-REG	49,943	95.40	4,764,562.20	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	15,248	270.60	4,126,108.80	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	34,268	26.26	899,877.68	

	JULIUS BAER GROUP LTD	5,210	53.25	277,432.50	
	PARGESA HOLDING SA-BR	655	65.80	43,099.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	430	287.25	123,517.50	
	UBS GROUP AG	79,572	20.38	1,621,677.36	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,080	116.90	126,252.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	640	219.40	140,416.00	
	SWISS RE AG	7,729	84.75	655,032.75	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,311	293.80	972,771.80	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,370	73.00	100,010.00	
	SWISSCOM AG-REG	494	539.00	266,266.00	
	スイスフラン小計	361,415		25,361,118.54	(3,364,913,207)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	4,320	142.80	616,896.00	
	BOLIDEN AB	4,510	160.60	724,306.00	
	ALFA LAVAL AB	7,470	150.40	1,123,488.00	
	ASSA ABLOY AB-B	20,910	160.70	3,360,237.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	15,265	240.60	3,672,759.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	8,620	213.10	1,836,922.00	
	SANDVIK AB	21,690	95.70	2,075,733.00	
	SKANSKA AB-B SHS	7,170	175.80	1,260,486.00	
	SKF AB-B SHARES-B	7,459	197.50	1,473,152.50	
	VOLVO AB-B SHS-B	35,630	110.70	3,944,241.00	
	SECURITAS AB-B SHS	7,249	113.90	825,661.10	
	ELECTROLUX AB - B	4,595	268.30	1,232,838.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	8,480	62.00	525,760.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	20,978	339.90	7,130,422.20	
	ICA GRUPPEN AB	1,450	298.10	432,245.00	
	SWEDISH MATCH AB	4,860	245.50	1,193,130.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	13,015	220.50	2,869,807.50	
	ELEKTA AB-B SHS	6,160	52.10	320,936.00	
	GETINGE AB-B SHS	4,450	204.00	907,800.00	
	NORDEA BANK AB	66,368	107.90	7,161,107.20	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	31,870	109.40	3,486,578.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	34,080	127.10	4,331,568.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	20,930	197.90	4,142,047.00	

	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,630	162.30	426,849.00	
	INVESTOR AB-B SHS	10,765	319.80	3,442,647.00	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	5,505	272.10	1,497,910.50	
	ERICSSON LM-B SHS	67,985	90.75	6,169,638.75	
	HEXAGON AB-B SHS	4,880	307.00	1,498,160.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,370	635.50	870,635.00	
	TELE2 AB-B SHS	6,255	104.40	653,022.00	
	TELIASONERA AB	53,480	50.80	2,716,784.00	
スウェーデンクローナ小計		510,399		71,923,767.25 (1,081,733,459)	
ノルウェークローネ	SEADRILL LTD	9,735	85.65	833,802.75	
	STATOIL ASA	24,664	146.00	3,600,944.00	
	SUBSEA 7 SA	4,325	80.35	347,513.75	
	NORSK HYDRO A S	30,900	35.60	1,100,040.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	3,780	403.60	1,525,608.00	
	ORKLA ASA	19,380	62.50	1,211,250.00	
	DNB ASA	22,215	135.30	3,005,689.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,200	123.80	519,960.00	
	TELENOR ASA	17,535	178.40	3,128,244.00	
ノルウェークローネ小計		136,734		15,273,052.00 (241,314,221)	
デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,645	325.20	1,835,754.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	5,260	334.00	1,756,840.00	
	ISS A/S	3,100	224.10	694,710.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	90	11,890.00	1,070,100.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	138	12,340.00	1,702,920.00	
	DSV A/S	3,680	224.70	826,896.00	
	PANDORA A/S	2,660	724.00	1,925,840.00	
	CARLSBERG AS-B	2,390	614.00	1,467,460.00	
	COLOPLAST-B	2,545	444.00	1,129,980.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	600	527.00	316,200.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	41,135	377.30	15,520,235.50	
	DANSKE BANK A/S	14,975	199.00	2,980,025.00	
	TRYG A/S	2,575	138.20	355,865.00	
TDC A/S	14,545	51.15	743,976.75		

デンマーククローネ小計		99,338		32,326,802.25 (601,601,789)
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	5,335	33.85	180,589.75
	ORIGIN ENERGY LTD	26,670	12.85	342,709.50
	SANTOS LTD	23,715	8.39	198,968.85
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	16,528	36.03	595,503.84
	WORLEYPARSONS LTD	4,340	10.86	47,132.40
	ALUMINA LTD	68,742	1.62	111,362.04
	AMCOR LIMITED	26,490	14.55	385,429.50
	BHP BILLITON LTD	70,016	28.55	1,998,956.80
	BORAL LTD	17,115	6.15	105,257.25
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	29,665	2.20	65,263.00
	ILUKA RESOURCES LTD	8,735	8.32	72,675.20
	INCITEC PIVOT LTD	31,550	4.05	127,777.50
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	10,985	18.24	200,366.40
	NEWCREST MINING LTD	14,929	13.20	197,062.80
	ORICA LIMITED	6,935	22.52	156,176.20
	RIO TINTO LTD	9,928	55.67	552,691.76
	SOUTH32 LTD	70,856	1.94	137,460.64
	CIMIC GROUP LTD	1,867	22.86	42,679.62
	BRAMBLES LTD	37,828	10.90	412,325.20
	SEEK LTD	8,040	14.08	113,203.20
	ASCIANO LTD	24,833	6.80	168,864.40
	AURIZON HOLDINGS LTD	46,150	5.35	246,902.50
	QANTAS AIRWAYS LTD	13,965	3.25	45,386.25
	SYDNEY AIRPORT	13,366	5.32	71,107.12
	TRANSURBAN GROUP	43,195	10.04	433,677.80
	CROWN RESORTS LTD	6,745	12.61	85,054.45
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	970	34.21	33,183.70
TABCORP HOLDINGS LTD	15,336	4.71	72,232.56	
TATTS GROUP LTD	37,700	3.86	145,522.00	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	8,720	4.89	42,640.80	
WESFARMERS LTD	23,695	40.45	958,462.75	
WOOLWORTHS LTD	26,272	26.70	701,462.40	
COCA-COLA AMATIL LTD	15,150	9.44	143,016.00	

	TREASURY WINE ESTATES LTD	14,070	5.30	74,571.00
	COCHLEAR LTD	1,277	82.18	104,943.86
	HEALTHSCOPE LTD	19,970	2.76	55,117.20
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,935	62.70	184,024.50
	SONIC HEALTHCARE LTD	9,830	21.85	214,785.50
	CSL LTD	10,362	89.93	931,854.66
	AUST AND NZ BANKING GROUP	60,279	33.64	2,027,785.56
	BANK OF QUEENSLAND LIMITED	8,120	13.17	106,940.40
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	10,478	12.77	133,804.06
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	35,077	87.19	3,058,363.63
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	55,493	34.52	1,915,618.36
	WESTPAC BANKING CORP	67,411	33.67	2,269,728.37
	ASX LTD	4,995	40.20	200,799.00
	MACQUARIE GROUP LTD	6,404	83.05	531,852.20
	AMP LTD	62,647	6.25	391,543.75
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	50,298	5.79	291,225.42
	MEDIBANK PRIVATE LTD	62,000	2.06	127,720.00
	QBE INSURANCE GROUP LTD	31,820	14.15	450,253.00
	SUNCORP GROUP LTD	29,020	13.75	399,025.00
	COMPUTERSHARE LTD	11,490	12.47	143,280.30
	TELSTRA CORPORATION LTD	93,164	6.34	590,659.76
	AGL ENERGY LTD	15,301	16.70	255,526.70
	AUSNET SERVICES	29,110	1.46	42,646.15
豪ドル小計		1,457,917		23,693,172.56 (2,265,304,228)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	19,060	8.28	157,816.80
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	24,545	4.96	121,743.20
	SPARK NEW ZEALAND LTD	45,157	2.79	125,988.03
	CONTACT ENERGY LIMITED	9,430	5.14	48,470.20
ニュージーランドドル小計		98,192		454,018.23 (38,818,558)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	61,208	117.80	7,210,302.40
	NWS HOLDINGS LTD	28,500	11.88	338,580.00
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	25,000	20.00	500,000.00
	MTR CORP	34,000	37.10	1,261,400.00

LI & FUNG LTD	138,000	6.50	897,000.00
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	29,000	26.30	762,700.00
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	14,500	26.65	386,425.00
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	50,000	33.95	1,697,500.00
MGM CHINA HOLDINGS LTD	16,800	14.14	237,552.00
SANDS CHINA LTD	49,800	28.60	1,424,280.00
SHANGRI-LA ASIA LTD	28,000	11.30	316,400.00
SJM HOLDINGS LTD	48,000	9.18	440,640.00
WYNN MACAU LTD	35,800	13.98	500,484.00
WH GROUP LTD	63,500	5.30	336,550.00
BANK OF EAST ASIA	21,640	35.45	767,138.00
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	77,000	32.80	2,525,600.00
HANG SENG BANK LTD	16,300	154.10	2,511,830.00
FIRST PACIFIC CO	44,250	6.82	301,785.00
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	23,500	286.80	6,739,800.00
AIA GROUP LTD	260,400	52.30	13,618,920.00
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	61,208	65.50	4,009,124.00
HANG LUNG PROPERTIES LTD	57,000	23.85	1,359,450.00
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	22,184	54.25	1,203,482.00
HENDERSON LAND DEVELOPMENT(N)	2,218	54.25	120,326.50
HYSAN DEVELOPMENT CO	15,000	34.25	513,750.00
KERRY PROPERTIES LTD	16,950	30.20	511,890.00
NEW WORLD DEVELOPMENT	134,666	10.42	1,403,219.72
SINO LAND CO	63,050	13.36	842,348.00
SUN HUNG KAI PROPERTIES	36,480	129.30	4,716,864.00
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	13,017	99.05	1,289,333.85
SWIRE PROPERTIES LTD	23,200	24.90	577,680.00
WHARF HOLDINGS LTD	27,800	52.75	1,466,450.00
WHEELOCK & CO LTD	19,600	41.80	819,280.00
HKT TRUST AND HKT LTD	67,000	9.12	611,040.00
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	15,000	61.20	918,000.00
CLP HOLDINGS LTD	42,500	66.05	2,807,125.00
HONG KONG & CHINA GAS	161,569	16.18	2,614,186.42
POWER ASSETS HOLDINGS	32,500	71.85	2,335,125.00
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	79.80	518,700.00

香港ドル小計		1,882,640		71,412,260.89 (1,141,167,929)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	34,660	8.40	291,144.00
	NOBLE GROUP LTD	82,854	0.71	59,240.61
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	21,000	3.96	83,160.00
	SEMBCORP MARINE LTD	16,000	2.87	45,920.00
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,000	3.38	111,540.00
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	42,010	1.41	59,444.15
	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,000	3.23	148,580.00
	SINGAPORE AIRLINES LTD	12,800	10.79	138,112.00
	GENTING SINGAPORE PLC	102,000	0.91	93,330.00
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	32,550	4.15	135,082.50
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,000	35.12	70,240.00
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE-RTS(N)	222	9.12	2,024.64
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	130,000	0.41	53,300.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	53,000	3.30	174,900.00
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	39,215	20.80	815,672.00
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	62,240	10.32	642,316.80
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	29,200	23.39	682,988.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	20,000	7.84	156,800.00
	CAPITALAND LTD	46,100	3.46	159,506.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	10,000	9.78	97,800.00
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	60,000	2.59	155,400.00	
UOL GROUP LTD	12,250	7.03	86,117.50	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	164,980	4.24	699,515.20	
シンガポールドル小計		1,052,081		4,962,133.40 (457,558,320)
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	9,770	26.65	260,370.50
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	78	1,360.00	106,080.00
	TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	18,800	224.30	4,216,840.00
	BANK HAPOALIM BM	27,725	21.28	589,988.00
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	29,355	16.62	487,880.10
	NICE SYSTEMS LTD	1,385	249.90	346,111.50
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	48,790	6.88	335,821.57
		135,903		6,343,091.67

イスラエルシュケル小計			(209,766,041)
合 計	31,280,647		82,998,854,455 (82,998,854,455)

(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	137,746.50	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	18,644	156,050.28	
		AMERICAN TOWER CORP	9,309	885,099.72	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	20,020	197,397.20	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,005	487,771.60	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,417	426,680.79	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	3,340	78,089.20	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,200	165,088.00	
		COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	3,071	84,206.82	
		CROWN CASTLE INTL CORP	7,300	600,133.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,235	214,933.40	
		DUKE REALTY CORPORATION	6,875	131,106.25	
		EQUINIX INC	1,177	301,441.47	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	7,970	568,659.50	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,400	301,070.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	2,220	147,075.00	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,415	185,152.75	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	12,545	330,811.65	
		HCP INC	10,125	372,903.75	
		HEALTH CARE REIT INC	6,990	464,974.80	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	17,919	371,460.87	
		IRON MOUNTAIN INC	3,285	103,970.25	
		KIMCO REALTY CORPORATION	8,795	204,483.75	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	105,468.44	
MACERICH CO/THE	3,250	250,542.50			
PLUM CREEK TIMBER CO	4,548	187,150.20			

		PROLOGIS INC	10,732	414,469.84	
		PUBLIC STORAGE	3,329	615,731.84	
		REALTY INCOME CORP	5,400	241,812.00	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	2,355	142,524.60	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	6,794	1,181,476.60	
		SL GREEN REALTY CORP	2,260	256,532.60	
		UDR INC	5,820	189,441.00	
		VENTAS INC	6,675	420,191.25	
		VORNADO REALTY TRUST	3,941	383,183.43	
		WEYERHAEUSER CO	11,876	383,001.00	
米ドル小計			231,360	11,687,831.85	(1,447,888,609)
加ドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2,340	52,884.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,380	91,057.20	
加ドル小計			5,720	143,941.20	(14,391,241)
ユーロ	投資証券	FONCIERE DES REGIONS	595	46,862.20	
		GECINA SA	580	66,700.00	
		ICADE	685	46,107.35	
		KLEPIERRE	3,142	124,643.14	
		UNIBAIL-RODAMCO SE-NA	2,070	489,865.50	
ユーロ小計			7,072	774,178.19	(107,471,416)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	21,701	178,056.70	
		HAMMERSON PLC	15,295	97,123.25	
		INTU PROPERTIES PLC	19,860	63,115.08	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	16,229	202,051.05	
		SEGRO PLC	20,223	84,370.35	
英ポンド小計			93,308	624,716.43	(121,488,604)
豪ドル	投資証券	APA GROUP	26,406	237,125.88	
		DEXUS PROPERTY GROUP	18,487	142,349.90	
		FEDERATION CENTRES	72,862	224,414.96	
		GOODMAN GROUP	43,442	287,151.62	
		GPT GROUP	33,165	149,242.50	

		LEND LEASE GROUP	12,197	191,005.02	
		MIRVAC GROUP	86,525	169,589.00	
		SCENTRE GROUP	116,381	459,704.95	
		STOCKLAND	55,310	240,598.50	
		WESTFIELD CORP	41,745	391,568.10	
豪ドル小計			506,520	2,492,750.43 (238,331,868)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	52,000	2,428,400.00	
香港ドル小計			52,000	2,428,400.00 (38,805,832)	
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	39,000	94,770.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	40,000	62,200.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	41,800	89,034.00	
		SUNTEC REIT	45,000	78,300.00	
シンガポールドル小計			165,800	324,304.00 (29,904,071)	
合計				1,998,281,641 (1,998,281,641)	

(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 605銘柄	97.3%		61.3%
	投資証券 36銘柄		2.7%	1.7%
加ドル	株式 90銘柄	99.6%		3.9%
	投資証券 2銘柄		0.4%	0.0%
ユーロ	株式 237銘柄	99.0%		13.0%
	投資証券 5銘柄		1.0%	0.1%
英ポンド	株式 108銘柄	98.4%		8.6%
	投資証券 5銘柄		1.6%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%		4.0%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	100.0%		1.3%

ノルウェークロネ	株式	9銘柄	100.0%		0.3%
デンマーククロネ	株式	14銘柄	100.0%		0.7%
豪ドル	株式	56銘柄	90.5%		2.7%
	投資証券	10銘柄		9.5%	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	39銘柄	96.7%		1.3%
	投資証券	1銘柄		3.3%	0.0%
シンガポールドル	株式	23銘柄	93.9%		0.5%
	投資証券	4銘柄		6.1%	0.0%
イスラエルシケル	株式	7銘柄	100.0%		0.2%

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。

海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成26年12月25日現在	平成27年 6月25日現在
資産の部		
流動資産		
預金	128,490,233	136,894,168
コール・ローン	93,359,061	130,821,667
株式	10,131,843,783	10,700,429,069
投資信託受益証券	-	30,749,493
投資証券	45,242,355	37,733,799
派生商品評価勘定	6,572,446	4,687,619
未収入金	6,646,200	-
未収配当金	10,980,413	38,638,328
未収利息	149	211
差入委託証拠金	24,597,377	15,137,393
流動資産合計	10,447,732,017	11,095,091,747
資産合計	10,447,732,017	11,095,091,747
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	33,569	6,813
未払金	14,316,895	-
未払解約金	-	7,921,000

	平成26年12月25日現在	平成27年 6月25日現在
流動負債合計	14,350,464	7,927,813
負債合計	14,350,464	7,927,813
純資産の部		
元本等		
元本	6,513,234,225	6,373,238,852
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	3,920,147,328	4,713,925,082
元本等合計	10,433,381,553	11,087,163,934
純資産合計	10,433,381,553	11,087,163,934
負債純資産合計	10,447,732,017	11,095,091,747

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、投資信託受益証券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26年12月25日現在	平成27年 6月25日現在
1. 期首	平成26年 6月26日	平成26年12月26日
期首元本額	6,377,526,952円	6,513,234,225円
期首からの追加設定元本額	701,517,053円	440,308,311円
期首からの一部解約元本額	565,809,780円	580,303,684円
元本の内訳		

日興五大陸株式ファンド	2,772,644,002円	2,459,866,842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	30,003,994円	27,801,295円
インデックスファンド海外新興国（エマージング）株式	3,703,762,419円	3,876,567,116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）	6,823,810円	9,003,599円
計	6,513,234,225円	6,373,238,852円
2. 受益権の総数	6,513,234,225口	6,373,238,852口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成26年 6月26日 至 平成26年12月25日	自 平成26年12月26日 至 平成27年 6月25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12月25日現在	平成27年 6月25日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。	(1)有価証券 同左

	(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。	(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12月25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	70,655,922
投資証券	1,344,727
合計	69,311,195

（平成27年 6月25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	336,535,325
投資信託受益証券	2,992,482
投資証券	2,661,725
合計	336,204,568

（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12月25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	239,461,566	-	245,797,012	6,335,446
	合計	239,461,566	-	245,797,012	6,335,446

（平成27年 6月25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	299,134,894	-	303,815,700	4,680,806
	合計	299,134,894	-	303,815,700	4,680,806

（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12月25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	40,260,959	-	40,464,390	203,431
	米ドル	35,832,000	-	36,069,000	237,000
	タイパーツ	4,428,959	-	4,395,390	33,569

合計	40,260,959	-	40,464,390	203,431
----	------------	---	------------	---------

(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 6月25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12月25日現在		平成27年 6月25日現在	
1口当たり純資産額	1.6019円	1口当たり純資産額	1.7396円
(1万口当たり純資産額)	(16,019円)	(1万口当たり純資産額)	(17,396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	ECOPEXROL SA-SPONSORED ADR	2,440	13.47	32,866.80	
	GAZPROM OAO-SPON ADR	128,200	5.35	686,511.00	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	26,400	1.60	42,424.80	
	LUKOIL OAO-SPON ADR	10,985	44.96	493,885.60	

NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	2,226	101.00	224,826.00	
ROSNEFT OJSC-REG S GDR	26,540	4.53	120,305.82	
SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	32,700	6.30	206,010.00	
TATNEFT-SPONSORED-ADR	5,449	32.72	178,291.28	
BRASKEM SA-SPON ADR	1,780	8.47	15,076.60	
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	4,650	10.48	48,732.00	
CIA SIDERURGICA NAACL-SP ADR	10,170	1.78	18,102.60	
GERDAU SA -SPON ADR	3,600	2.46	8,856.00	
MMC NORILSK NICKEL JSC-ADR	13,394	17.34	232,251.96	
QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	1,100	16.28	17,908.00	
SEVERSTAL - GDR REG S	5,670	10.67	60,498.90	
SOUTHERN COPPER CORP(US)	3,680	31.06	114,300.80	
URALKALI-SPON GDR-REG S	3,620	13.08	47,349.60	
EMBRAER SA ADR	800	30.19	24,152.00	
DP WORLD LTD	4,470	21.50	96,105.00	
LATAM AIRLINES GROUP-SP -ADR	2,280	7.22	16,461.60	
GRUPO TELEVISIA SA-SPONS ADR	2,040	39.47	80,518.80	
CIA BRASILEIRA-SP ADR PRAF	2,380	25.42	60,499.60	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	5,500	54.75	301,125.00	
BRF SA-ADR	4,980	21.99	109,510.20	
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	2,000	21.88	43,760.00	
BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	983	20.33	19,984.39	
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	1,850	42.96	79,476.00	
CREDICORP LTD	1,430	142.36	203,574.80	
GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORE-ADR	1,850	9.89	18,296.50	
GRUPO FIN SANTANDER B-ADR	2,600	9.34	24,284.00	
SBERBANK-SPONSORED ADR	57,250	5.30	303,425.00	
VTB BANK OJSC-GDR-REG S	69,030	2.78	191,972.43	
MEGAFON-REG S-GDR	2,600	14.50	37,700.00	
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	12,562	9.83	123,484.46	
ROSTELECOM-SPONSORED-ADR	2,641	9.89	26,119.49	
TELEF BRASIL-ADR	3,924	13.87	54,425.88	
CEMIG SA -SPONS ADR	4,397	3.89	17,104.33	
CIA SANEAMENTO BASICO DE-ADR	6,180	5.09	31,456.20	
RUSHYDRO MANAGEMENT CO-ADR	28,000	1.06	29,820.00	
米ドル小計	502,351		4,441,453.44 (550,207,252)	
メキシコペソ				
CEMEX SAB-CPO	263,409	14.71	3,874,746.39	
GRUPO MEXICO SA-SER B	82,078	48.25	3,960,263.50	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	3,700	265.72	983,164.00	
MEXICHEM SAB DE CV-*	23,185	46.13	1,069,524.05	
ALFA S.A.B.-A	61,000	31.21	1,903,810.00	

	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	11,000	65.09	715,990.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	5,000	172.25	861,250.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	6,600	108.54	716,364.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	5,300	220.65	1,169,445.00	
	OHL MEXICO SAB DE CV	12,000	21.25	255,000.00	
	GRUPO TELEVISA SAB	43,100	122.26	5,269,406.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	2,900	182.51	529,279.00	
	CONTROLADORA COML MEXIC-UBC	13,000	49.81	647,530.00	
	WALMART DE MEXICO -SER V	120,200	38.70	4,651,740.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	9,300	91.95	855,135.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	8,100	127.82	1,035,342.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	38,900	139.86	5,440,554.00	
	GRUMA S.A.B. -B	3,000	203.60	610,800.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	43,500	41.22	1,793,070.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	41,670	33.88	1,411,779.60	
	GRUPO FIN SANTANDER-B	32,000	29.10	931,200.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	52,100	87.41	4,554,061.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	45,000	35.43	1,594,350.00	
	GENEREA SAB DE CV	30,000	27.81	834,300.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	680,800	16.54	11,260,432.00	
	メキシコペソ小計	1,636,842		56,928,535.54 (454,858,998)	
ブラジルリアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	2,600	26.17	68,042.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	59,860	14.62	875,153.20	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	85,100	13.20	1,123,320.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	8,100	67.00	542,700.00	
	BRASKEM SA-PREF A	1,000	13.13	13,130.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL	7,800	5.59	43,602.00	
	DURATEX SA	7,260	7.53	54,667.80	
	FIBRIA CELULOSE SA	3,629	43.69	158,551.01	
	GERDAU SA-PREF	16,000	7.56	120,960.00	
	KLABIN SA - UNIT	7,300	18.80	137,240.00	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	9,000	16.45	148,050.00	
	USINAS SIDER MINAS GER-PF A	8,600	4.40	37,840.00	
	VALE SA	25,760	19.80	510,048.00	
	VALE SA-PREF A	46,150	17.05	786,857.50	
	EMBRAER SA	10,500	23.45	246,225.00	
	WEG SA	9,820	18.80	184,616.00	
	CCR SA	20,600	14.76	304,056.00	
	ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	7,000	7.80	54,600.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	2,940	31.55	92,757.00	
	CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP	6,700	10.04	67,268.00	

ESTACIO PARTICIPACOES SA	7,500	19.60	147,000.00
KROTON EDUCACIONAL SA	29,448	12.80	376,934.40
B2W CIA DIGITAL	3,300	20.90	68,970.00
LOJAS AMERICANAS SA-PRF	10,910	16.95	184,924.50
LOJAS RENNER S.A.	2,800	111.53	312,284.00
VIA VAREJO SA	3,200	12.19	39,008.00
CIA BRASILEIRA DE DIS-PRF	850	78.89	67,056.50
RAIA DROGASIL SA	5,500	38.81	213,455.00
AMBEV SA	102,000	18.95	1,932,900.00
BRF SA	8,400	68.25	573,300.00
JBS SA	14,100	15.96	225,036.00
M DIAS BRANCO SA	950	82.40	78,280.00
SOUZA CRUZ SA	8,000	24.35	194,800.00
HYPERMARCAS SA	8,000	23.09	184,720.00
NATURA COSMETICOS SA	3,300	27.84	91,872.00
ODONTOPREV S.A.	4,700	10.95	51,465.00
QUALICORP SA	5,000	19.60	98,000.00
BANCO BRADESCO S.A.	14,360	27.82	399,495.20
BANCO BRADESCO SA-PREF	51,948	28.80	1,496,102.40
BANCO DO BRASIL S.A.	19,200	23.88	458,496.00
BANCO ESTADO RIO GRANDE SUL-PRF-B	6,500	9.37	60,905.00
BANCO SAN. BRASIL-UNIT	7,700	16.87	129,899.00
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	58,212	34.95	2,034,509.40
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PRF	75,836	8.95	678,732.20
BM&FBOVESPA SA	37,573	11.41	428,707.93
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	4,700	33.30	156,510.00
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	14,000	34.38	481,320.00
PORTO SEGURO SA	3,200	37.90	121,280.00
SUL AMERICA SA - UNITS	5,500	13.82	76,010.00
BR MALLS PARTICIPACOES SA	10,500	14.70	154,350.00
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	1,500	48.11	72,165.00
CIELO SA	17,409	41.74	726,651.66
TOTVS SA	3,250	39.00	126,750.00
OI SA-PRF	7,700	6.24	48,048.00
TELEFONICA BRASIL S.A. -PREF	2,830	43.10	121,973.00
TIM PARTICIPACOES SA	16,905	10.44	176,488.20
AES TIETE SA-PREF	3,500	17.46	61,110.00
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	2,300	8.94	20,562.00
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	2,800	20.12	56,336.00
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	14,399	12.04	173,363.96
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PRF-B	3,000	34.13	102,390.00
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	2,160	15.87	34,279.20

	CPFL ENERGIA SA	7,017	19.08	133,884.36	
	TRACTEBEL ENERGIA SA ORD	3,700	34.00	125,800.00	
ブラジルリアル小計		961,376		19,065,807.42	(762,250,980)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	11,490	6,872.90	78,969,621.00	
	EMPRESAS CMPC SA	20,000	1,762.50	35,250,000.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B-PRF	1,400	10,311.00	14,435,400.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	5,300	4,629.60	24,536,880.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	10,800	4,562.30	49,272,840.00	
	CENCOSUD SA	30,150	1,539.00	46,400,850.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PRF B	9,000	2,098.70	18,888,300.00	
	VINA CONCHA Y TORO S.A.	9,000	1,146.40	10,317,600.00	
	BANCO DE CHILE	414,854	70.23	29,135,196.42	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	844	28,209.00	23,808,396.00	
	BANCO SANTANDER CHILE SA	747,000	32.19	24,045,930.00	
	CORPBANCA	2,600,000	7.87	20,462,000.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	2,700	7,039.60	19,006,920.00	
	AES GENER SA	80,000	362.54	29,003,200.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	56,000	351.68	19,694,080.00	
	COLBUN SA	208,000	181.05	37,658,400.00	
EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	57,700	885.65	51,102,005.00		
ENERSIS SA	419,500	199.54	83,707,030.00		
チリペソ小計		4,683,738		615,694,648.42	(120,553,012)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	50,000	1,725.00	86,250,000.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	8,890	9,500.00	84,455,000.00	
	GRUPO ARGOS SA	5,760	17,380.00	100,108,800.00	
	ALMACENES EXITO SA	4,500	22,060.00	99,270,000.00	
	BANCO DAVIVIENDA SA-PRF	2,200	26,140.00	57,508,000.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES-PRF	47,000	1,260.00	59,220,000.00	
	CORP FINANCIERA COLOMBIANA	2,500	36,640.00	91,600,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	8,300	36,740.00	304,942,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	13,000	7,580.00	98,540,000.00	
コロンビアペソ小計		142,150		981,893,800.00	(47,523,659)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	1,770	69.00	122,130.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	46,017	4.50	207,076.50	
	ENKA INSAAT VE SANAYI AS	21,994	5.20	114,368.80	
	KOC HOLDING AS	12,124	12.55	152,156.20	
	TURK HAVA YOLLARI AO	19,550	9.11	178,100.50	
	ARCELIK A.S.	6,500	14.30	92,950.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	4,400	48.30	212,520.00	

	ANADOLU EFES BIRACILIK	5,581	24.45	136,455.45	
	COCA-COLA ICECEK URETIM AS	2,000	44.60	89,200.00	
	AKBANK T.A.S.	49,259	8.12	399,983.08	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	52,740	8.68	457,783.20	
	TURKIYE HALK BANKASI	14,660	12.75	186,915.00	
	TURKIYE IS BANKASI-C	39,904	5.78	230,645.12	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	19,682	4.46	87,781.72	
	YAPI VE KREDI BANKASI	18,033	4.09	73,754.97	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	27,753	10.45	290,018.85	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	17,056	12.65	215,758.40	
トルコリラ小計		359,023		3,247,597.79	(150,266,349)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	360	5,159.00	1,857,240.00	
	CEZ AS	3,530	572.10	2,019,513.00	
チェココルナ小計		3,890		3,876,753.00	(19,771,440)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	1,060	14,450.00	15,317,000.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	2,750	4,230.00	11,632,500.00	
	OTP BANK PLC	4,585	5,550.00	25,446,750.00	
ハンガリーフォリント小計		8,395		52,396,250.00	(23,373,967)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	3,000	29.79	89,370.00	
	POLISH OIL & GAS	37,985	6.84	259,817.40	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	6,130	72.50	444,425.00	
	GRUPA AZOTY SA	1,400	82.90	116,060.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	3,710	111.00	411,810.00	
	LPP SA	20	7,030.50	140,610.00	
	CYFROWY POLSAT SA	4,500	24.88	111,960.00	
	EUROCASH SA	2,100	38.40	80,640.00	
	ALIOR BANK SA	1,500	91.50	137,250.00	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	850	101.00	85,850.00	
	BANK MILLENNIUM SA	13,000	6.71	87,230.00	
	BANK PEKAO SA	3,152	174.20	549,078.40	
	BANK ZACHODNI WBK SA	550	334.00	183,700.00	
	GETIN NOBLE BANK SA	33,000	1.47	48,510.00	
	MBANK	230	425.00	97,750.00	
	PKO BANK POLSKI SA	18,445	32.00	590,240.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	1,200	437.80	525,360.00	
	ORANGE POLSKA SA	14,105	8.47	119,469.35	
	ENERGA SA	5,000	23.32	116,600.00	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	18,400	18.76	345,184.00	
TAURON POLSKA ENERGIA SA	37,000	4.46	165,020.00		

ポーランドズロチ小計		205,277		4,705,934.15 (156,566,429)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	85,000	5.13	436,050.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	46,000	13.82	635,720.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	539,300	6.83	3,683,419.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	73,000	18.34	1,338,820.00
	CNOOC LTD	388,000	11.46	4,446,480.00
	KUNLUN ENERGY CO LTD	66,000	8.04	530,640.00
	PETROCHINA CO LTD-H	467,000	9.10	4,249,700.00
	YANZHOU COAL MINING CO-H	50,000	6.77	338,500.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	89,000	4.07	362,230.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	33,000	30.15	994,950.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	74,000	7.68	568,320.00
	CHINA RESOURCES CEMENT	64,000	4.65	297,600.00
	FOSUN INTERNATIONAL	29,000	20.40	591,600.00
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	31,000	13.80	427,800.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	42,000	7.15	300,300.00
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	64,500	4.38	282,510.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD	147,750	2.80	413,700.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	52,000	8.76	455,520.00
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	12,000	60.80	729,600.00
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	96,000	12.24	1,175,040.00
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	12,000	19.54	234,480.00
	CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	11,876	21.85	259,490.60
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	46,000	12.76	586,960.00
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	100,000	8.80	880,000.00
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	52,000	14.34	745,680.00
	CITIC LTD	57,000	14.40	820,800.00
	CRRC CORP LTD- H	79,000	12.08	954,320.00
	SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	70,000	6.82	477,400.00
	SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	13,000	27.50	357,500.00
	WEICHAJ POWER CO LTD-H	9,600	25.30	242,880.00
	ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	9,000	59.35	534,150.00
	CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	55,000	14.20	781,000.00
	AIR CHINA LTD-H	58,000	9.45	548,100.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	40,000	9.13	365,200.00	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	65,825	5.26	346,239.50	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	21,000	33.20	697,200.00	
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	100,750	3.18	320,385.00	
COSCO PACIFIC LTD	32,000	10.80	345,600.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	24,000	10.40	249,600.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	43,000	11.16	479,880.00	

BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	64,000	11.68	747,520.00
BYD CO LTD-H	10,000	50.90	509,000.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B	28,000	20.15	564,200.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	60,000	11.20	672,000.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	100,000	4.17	417,000.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	25,000	38.00	950,000.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	76,318	7.58	578,490.44
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	25,000	18.58	464,500.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	17,000	21.50	365,500.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	13,000	37.10	482,300.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	180,000	3.31	595,800.00
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	103,000	9.42	970,260.00
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	191,160	1.89	361,292.40
CHINA RESOURCES ENTERPRISES	37,000	25.70	950,900.00
SUN ART RETAIL GROUP	43,000	6.83	293,690.00
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	48,000	4.96	238,080.00
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	160,000	1.77	283,200.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	29,000	39.35	1,141,150.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	38,000	16.08	611,040.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	6,000	49.05	294,300.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	132,000	8.70	1,148,400.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	15,500	93.75	1,453,125.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	32,000	6.02	192,640.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	13,000	22.90	297,700.00
SINOPHARM GROUP CO-H	26,400	36.80	971,520.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	24,000	11.86	284,640.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	78,000	7.74	603,720.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	11,000	31.30	344,300.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	76,000	4.41	335,160.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	68,000	8.97	609,960.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	485,000	4.23	2,051,550.00
BANK OF CHINA LTD - H	1,699,000	5.44	9,242,560.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	216,245	8.09	1,749,422.05
CHINA CITIC BANK - H	206,000	6.49	1,336,940.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,746,920	7.37	12,874,800.40
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	90,000	4.70	423,000.00
CHINA MERCHANTS BANK - H	98,150	23.40	2,296,710.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	131,200	10.48	1,374,976.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	75,000	6.17	462,750.00
IND & COMM BK OF CHINA - H	1,584,575	6.72	10,648,344.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	171,000	4.73	808,830.00
CHINA EVERBRIGHT LTD	18,000	28.80	518,400.00

CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	63,000	10.80	680,400.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	28,000	29.50	826,000.00
FAR EAST HORIZON LTD	40,000	7.36	294,400.00
GF SECURITIES CO LTD-H	15,600	21.60	336,960.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	48,800	22.60	1,102,880.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	16,000	23.25	372,000.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	159,000	35.00	5,565,000.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	54,600	39.25	2,143,050.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	27,940	30.95	864,743.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO-H	14,000	49.05	686,700.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	163,000	5.04	821,520.00
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	65,334	18.44	1,204,758.96
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	54,500	111.80	6,093,100.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	86,320	28.15	2,429,908.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	53,777	25.75	1,384,757.75
CHINA VANKE CO LTD-H	23,360	19.48	455,052.80
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	100,713	3.58	360,552.54
DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H	4,700	63.65	299,155.00
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	146,000	4.87	711,020.00
FRANSHION PROPERTIES	110,000	2.95	324,500.00
GOLDIN PROPERTIES HOLDINGS	26,000	8.91	231,660.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	26,400	9.70	256,080.00
LONGFOR PROPERTIES	15,000	12.74	191,100.00
NEW WORLD CHINA LAND LTD	72,000	4.63	333,360.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	37,500	16.10	603,750.00
SHUI ON LAND LTD	42,900	2.34	100,386.00
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	65,000	5.91	384,150.00
SOHO CHINA LTD	65,000	5.26	341,900.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	212,800	1.76	374,528.00
KINGSOFT CORP LTD	16,000	28.45	455,200.00
TENCENT HOLDINGS LTD	112,500	163.70	18,416,250.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	18,000	46.50	837,000.00
LENOVO GROUP LTD	130,000	11.32	1,471,600.00
ZTE CORP-H	18,000	21.30	383,400.00
ZTE CORP-H(N)	3,600	21.30	76,680.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	50,000	9.08	454,000.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	60,000	3.98	238,800.00
CHINA MOBILE LTD	133,700	103.20	13,797,840.00
CHINA TELECOM CORP LTD	315,000	4.78	1,505,700.00
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	97,882	12.56	1,229,397.92
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	90,000	6.71	603,900.00
CGN POWER CO LTD-H	100,000	4.40	440,000.00

	CHINA GAS HOLDINGS LTD	54,000	13.12	708,480.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	48,000	9.09	436,320.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	55,000	6.00	330,000.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	30,000	24.55	736,500.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	47,000	22.35	1,050,450.00	
	DATANG INTL POWER GEN CO-H	23,000	4.25	97,750.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	12,000	50.35	604,200.00	
	GUANGDONG INVEST	62,000	11.06	685,720.00	
	HUADIAN POWER INTL CORP-H	26,000	8.73	226,980.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	106,000	10.84	1,149,040.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	64,000	3.30	211,200.00	
	GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	198,000	1.94	384,120.00	
	HANERGY THIN FILM POWER GROU	240,000	3.91	938,400.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	500,000	0.95	475,000.00	
香港ドル小計		16,044,995		171,722,334.36 (2,744,122,903)	
マレーシアリン ギット	BUMI ARMADA BERHAD	60,000	1.19	71,400.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	5,000	20.54	102,700.00	
	SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	70,000	2.43	170,100.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	71,000	6.32	448,720.00	
	GAMUDA BHD	56,000	4.96	277,760.00	
	IJM CORP BHD	35,000	6.94	242,900.00	
	SIME DARBY BERHAD	64,720	8.56	554,003.20	
	AIRASIA BHD	47,000	1.61	75,670.00	
	MISC BHD	30,000	8.16	244,800.00	
	UMW HOLDINGS BHD	11,700	10.40	121,680.00	
	BERJAYA SPORTS TOTO BERHAD	27,457	3.28	90,058.96	
	GENTING BHD	45,300	8.24	373,272.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	72,500	4.26	308,850.00	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	30,000	3.08	92,400.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	2,500	61.18	152,950.00	
	FELDA GLOBAL VENTURES	43,000	1.75	75,250.00	
	IOI CORPORATION BERHAD	69,675	4.05	282,183.75	
	KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	12,000	21.52	258,240.00	
	PPB GROUP BERHAD	11,700	15.20	177,840.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	34,000	5.80	197,200.00	
	ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	37,000	4.40	162,800.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	32,600	6.07	197,882.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	109,800	5.60	614,880.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	12,300	13.54	166,542.00	
	MALAYAN BANKING BHD	103,150	9.29	958,263.50	
	PUBLIC BANK BERHAD	55,370	18.94	1,048,707.80	

	RHB CAPITAL BHD	14,000	7.35	102,900.00	
	IOI PROPERTIES GROUP BHD	53,476	1.93	103,208.68	
	AXIATA GROUP BERHAD	51,900	6.48	336,312.00	
	DIGI.COM BHD	74,000	5.49	406,260.00	
	MAXIS BHD	44,000	6.50	286,000.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	25,000	6.90	172,500.00	
	PETRONAS GAS BERHAD	14,000	21.54	301,560.00	
	TENAGA NASIONAL BERHAD	66,125	12.78	845,077.50	
	YTL CORPORATION BERHAD	144,704	1.56	225,738.24	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	73,500	1.59	116,865.00	
マレーシアリングット小計		1,709,477		10,363,474.63	(341,061,950)
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	35,000	26.00	910,000.00	
	IRPC PCL - NVDR	191,800	4.50	863,100.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	28,710	113.50	3,258,585.00	
	PTT PCL-NVDR	21,600	362.00	7,819,200.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	28,000	56.50	1,582,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	39,000	28.50	1,111,500.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	20,045	71.00	1,423,195.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	2,600	524.00	1,362,400.00	
	SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	7,300	524.00	3,825,200.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	8,000	305.00	2,440,000.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	160,000	10.10	1,616,000.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	55,000	29.75	1,636,250.00	
	BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	31,000	38.00	1,178,000.00	
	CP ALL PCL-NVDR	98,800	46.00	4,544,800.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	70,000	23.40	1,638,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	110,000	19.20	2,112,000.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	8,000	178.00	1,424,000.00	
	BANGKOK BANK-FOREIGN REG	13,140	179.00	2,352,060.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	24,200	199.50	4,827,900.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	17,000	199.00	3,383,000.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	75,125	17.90	1,344,737.50	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	36,300	162.00	5,880,600.00		
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	31,000	46.75	1,449,250.00		
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	20,800	234.00	4,867,200.00		
TRUE CORP PCL-NVDR	180,000	11.60	2,088,000.00		
GLOW ENERGY PCL - NVDR	10,000	86.00	860,000.00		
タイバーツ小計		1,322,420		65,796,977.50	(240,816,937)
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	52,000	58.30	3,031,600.00	
	DMCI HOLDINGS INC	115,000	13.48	1,550,200.00	

	JG SUMMIT HOLDINGS INC	50,000	69.55	3,477,500.00	
	SM INVESTMENTS CORP	3,312	875.00	2,898,000.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	10,000	114.00	1,140,000.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	10,000	200.00	2,000,000.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	21,000	193.00	4,053,000.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	17,741	97.70	1,733,295.70	
	BDO UNIBANK INC	31,000	110.00	3,410,000.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	18,827	92.95	1,749,969.65	
	AYALA CORPORATION	4,942	798.00	3,943,716.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	320,000	4.91	1,571,200.00	
	AYALA LAND INC	177,960	38.00	6,762,480.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	217,710	20.20	4,397,742.00	
	GLOBE TELECOM INC	630	2,590.00	1,631,700.00	
	PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	2,110	2,880.00	6,076,800.00	
	ABOITIZ POWER CORP	46,000	45.00	2,070,000.00	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	175,000	7.71	1,349,250.00	
	フィリピンペソ小計	1,273,232		52,846,453.35 (145,327,746)	
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY TBK PT	270,000	790.00	213,300,000.00	
	TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	25,000	9,025.00	225,625,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	32,000	21,000.00	672,000,000.00	
	SEMEN GRESIK (PERSERO) PT	66,000	12,300.00	811,800,000.00	
	PT UNITED TRACTORS	53,500	20,225.00	1,082,037,500.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	495,000	6,950.00	3,440,250,000.00	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	100,000	1,950.00	195,000,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	100,000	2,890.00	289,000,000.00	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	32,000	16,975.00	543,200,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	200,000	3,040.00	608,000,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	15,000	45,300.00	679,500,000.00	
	PT INDOFOOD SUKSES MAK TBK	136,000	6,900.00	938,400,000.00	
	PT UNILEVER INDONESIA TBK	30,000	41,400.00	1,242,000,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	550,000	1,695.00	932,250,000.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	48,000	4,390.00	210,720,000.00	
	BANK MANDIRI TBK	209,000	9,900.00	2,069,100,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	248,000	10,300.00	2,554,400,000.00	
	PT BANK CENTRAL ASIA	270,000	13,625.00	3,678,750,000.00	
	PT BANK NEGARA INDONESIA	180,000	5,500.00	990,000,000.00	
	LIPPO KARAWACI TBK/PT	450,000	1,180.00	531,000,000.00	
	SUMMARECON AGUNG TBK PT	185,000	1,675.00	309,875,000.00	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	1,115,000	2,880.00	3,211,200,000.00		
XL AXIATA TBK PT	78,000	3,850.00	300,300,000.00		
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	213,500	4,360.00	930,860,000.00		

インドネシアルピア小計		5,101,000		26,658,567,500.00 (250,590,534)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	1,270	51,000.00	64,770,000.00	
	S-OIL CORPORATION	825	70,700.00	58,327,500.00	
	SK INNOVATION CO LTD	1,482	126,000.00	186,732,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	2,000	19,550.00	39,100,000.00	
	HANWHA CORPORATION	1,160	48,050.00	55,738,000.00	
	HYOSUNG CORPORATION	550	140,000.00	77,000,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	1,130	68,000.00	76,840,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	155	527,000.00	81,685,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	460	72,600.00	33,396,000.00	
	LG CHEM LTD	1,002	275,000.00	275,550,000.00	
	LG CHEM LTD-PRF	230	187,000.00	43,010,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	370	282,500.00	104,525,000.00	
	OCI CO LTD	320	91,100.00	29,152,000.00	
	POSCO	1,470	230,000.00	338,100,000.00	
	CHEIL INDUSTRIES INC	320	174,500.00	55,840,000.00	
	CJ CORP	400	275,000.00	110,000,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	610	79,400.00	48,434,000.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	3,686	6,740.00	24,843,640.00	
	DAEWOO INTERNATIONAL CORP	1,431	25,300.00	36,204,300.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,340	14,350.00	33,579,000.00	
	DOOSAN CORP	230	112,500.00	25,875,000.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	800	25,600.00	20,480,000.00	
	DOOSAN INFRACORE CO LTD	2,030	10,500.00	21,315,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,203	27,950.00	33,623,850.00	
	HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	1,595	67,900.00	108,300,500.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	1,310	42,750.00	56,002,500.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	895	122,000.00	109,190,000.00	
	HYUNDAI MIPO DOCKYARD	245	69,200.00	16,954,000.00	
	KCC CORP	120	491,500.00	58,980,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,000	73,400.00	73,400,000.00	
	LG CORP	2,000	60,900.00	121,800,000.00	
	LS CORP	650	43,750.00	28,437,500.00	
SAMSUNG C&T CORP	3,250	69,700.00	226,525,000.00		
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	3,690	17,500.00	64,575,000.00		
SK HOLDINGS CO LTD	450	194,500.00	87,525,000.00		
SK NETWORKS CO LTD	1,950	9,220.00	17,979,000.00		
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	450	109,000.00	49,050,000.00		
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	400	212,500.00	85,000,000.00		
KOREAN AIR LINES CO LTD	864	39,950.00	34,516,800.00		
HALLA VISTEON CLIMATE CONTRO	1,080	39,300.00	42,444,000.00		

HANKOOK TIRE CO LTD	1,482	42,650.00	63,207,300.00
HYUNDAI MOBIS	1,500	210,000.00	315,000,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	3,430	133,000.00	456,190,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	850	103,000.00	87,550,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	480	101,500.00	48,720,000.00
HYUNDAI WIA CORP	320	108,000.00	34,560,000.00
KIA MOTORS CORPORATION	6,140	46,450.00	285,203,000.00
COWAY CO LTD	1,090	89,500.00	97,555,000.00
LG ELECTRONICS INC	2,085	50,800.00	105,918,000.00
KANGWON LAND INC	2,770	37,500.00	103,875,000.00
PARADISE CO LTD	1,050	25,100.00	26,355,000.00
CHEIL WORLDWIDE INC	2,350	17,550.00	41,242,500.00
HOTEL SHILLA CO LTD	830	118,000.00	97,940,000.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	380	151,000.00	57,380,000.00
LOTTE SHOPPING CO	215	225,500.00	48,482,500.00
SHINSEGAE CO LTD	167	272,500.00	45,507,500.00
E-MART CO LTD	472	238,000.00	112,336,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	194	417,000.00	80,898,000.00
KT&G CORP	2,295	93,100.00	213,664,500.00
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	25	1,951,000.00	48,775,000.00
ORION CORP	80	1,161,000.00	92,880,000.00
AMOREPACIFIC CORP	600	403,500.00	242,100,000.00
AMOREPACIFIC GROUP	750	192,500.00	144,375,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	200	748,000.00	149,600,000.00
CELLTRION INC	1,364	83,000.00	113,212,000.00
YUHAN CORPORATION	240	265,500.00	63,720,000.00
BNK FINANCIAL GROUP INC	5,320	14,500.00	77,140,000.00
DGB FINANCIAL GROUP INC	2,586	12,000.00	31,032,000.00
HANA FINANCIAL GROUP	6,008	27,850.00	167,322,800.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	4,640	14,100.00	65,424,000.00
KB FINANCIAL GROUP INC	8,005	37,850.00	302,989,250.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	9,400	41,450.00	389,630,000.00
WOORI BANK	5,411	10,250.00	55,462,750.00
DAEWOO SECURITIES CO.	4,575	15,350.00	70,226,250.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	955	63,800.00	60,929,000.00
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	598	53,200.00	31,813,600.00
NH INVESTMENT & SECURITIES C	3,171	12,750.00	40,430,250.00
SAMSUNG CARD CO	690	38,250.00	26,392,500.00
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,517	57,800.00	87,682,600.00
DONGBU INSURANCE CO LTD	800	57,000.00	45,600,000.00
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	6,000	7,970.00	47,820,000.00
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	2,000	29,400.00	58,800,000.00

	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	660	300,000.00	198,000,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	1,300	107,500.00	139,750,000.00	
	DAUM KAKAO CORP	460	114,300.00	52,578,000.00	
	NAVER CORP	628	649,000.00	407,572,000.00	
	NCSOFT CORPORATION	250	199,000.00	49,750,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	500	258,500.00	129,250,000.00	
	SK C&C CO LTD	500	269,000.00	134,500,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	5,560	25,450.00	141,502,000.00	
	LG INNOTEK CO LTD	280	107,500.00	30,100,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,330	53,900.00	71,687,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	2,325	1,302,000.00	3,027,150,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	460	1,019,000.00	468,740,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	1,228	119,500.00	146,746,000.00	
	KT CORP	1,027	28,850.00	29,628,950.00	
	LG UPLUS CORP.	5,000	9,690.00	48,450,000.00	
	SK TELECOM	230	257,500.00	59,225,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	5,290	45,450.00	240,430,500.00	
	KOREA GAS CORPORATION	828	44,900.00	37,177,200.00	
	SK HYNIX INC	12,630	43,350.00	547,510,500.00	
韓国ウォン小計		178,944		13,749,488,040.00 (1,537,192,762)	
台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	21,080	77.50	1,633,700.00	
	ASIA CEMENT CORP	57,978	36.80	2,133,590.40	
	CHINA STEEL CORP	269,181	24.50	6,594,934.50	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	66,047	73.60	4,861,059.20	
	FORMOSA PLASTICS CORP	85,424	73.30	6,261,579.20	
	NAN YA PLASTICS CORP	103,145	72.40	7,467,698.00	
	TAIWAN CEMENT	57,170	38.90	2,223,913.00	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	20,000	50.40	1,008,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	74,468	32.20	2,397,869.60	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	6,683	214.00	1,430,162.00	
	TECO ELECTRIC & MACHINERY	52,000	24.55	1,276,600.00	
	EVA AIRWAYS CORP	71,131	20.30	1,443,959.30	
	EVERGREEN MARINE	44,769	15.30	684,965.70	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	52,443	10.80	566,384.40	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	45,947	66.60	3,060,070.20	
	YULON MOTOR COMPANY	35,020	36.00	1,260,720.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	3,120	478.00	1,491,360.00	
	GIANT MANUFACTURING	5,000	254.50	1,272,500.00	
	MERIDA INDUSTRY CO LTD	5,250	200.00	1,050,000.00	
	POU CHEN	38,145	44.00	1,678,380.00	
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	12,000	71.00	852,000.00	

HOTAI MOTOR COMPANY LTD	7,000	435.00	3,045,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	12,448	212.00	2,638,976.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	105,484	52.60	5,548,458.40
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	82,744	17.70	1,464,568.80
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	350,715	12.15	4,261,187.25
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	303,857	24.00	7,292,568.00
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	107,921	20.65	2,228,568.65
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	164,127	18.95	3,110,206.65
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	161,334	17.90	2,887,878.60
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	205,660	28.10	5,779,046.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	115,131	13.75	1,583,051.25
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	169,618	13.00	2,205,034.00
TAIWAN BUSINESS BANK	119,600	9.53	1,139,788.00
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	170,377	16.15	2,751,588.55
CHAILEASE HOLDING CO LTD	14,740	74.00	1,090,760.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	137,743	64.50	8,884,423.50
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	211,705	16.80	3,556,644.00
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	185,538	54.30	10,074,713.40
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	68,454	31.55	2,159,723.70
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	116,578	9.41	1,096,998.98
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	11,500	73.60	846,400.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	25,000	48.25	1,206,250.00
ACER INC	64,812	15.45	1,001,345.40
ADVANTECH CO LTD	6,561	217.50	1,427,017.50
ASUSTEK COMPUTER INC	15,797	305.00	4,818,085.00
AU OPTRONICS CORP	173,994	14.00	2,435,916.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	13,405	378.50	5,073,792.50
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	13,065	84.30	1,101,379.50
COMPAL ELECTRONICS	86,955	23.75	2,065,181.25
DELTA ELECTRONICS INC	40,419	165.00	6,669,135.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	23,319	109.50	2,553,430.50
HON HAI PRECISION INDUSTRY	273,000	97.60	26,644,800.00
HTC CORP	17,011	75.00	1,275,825.00
INNOLUX CORP	143,282	15.60	2,235,199.20
INVENTEC CORP	62,162	21.10	1,311,618.20
LARGAN PRECISION CO LTD	2,236	3,580.00	8,004,880.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	45,334	35.95	1,629,757.30
PEGATRON CORP	34,854	88.70	3,091,549.80
QUANTA COMPUTER INC	63,416	71.90	4,559,610.40
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	6,000	141.00	846,000.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	30,591	44.30	1,355,181.30
TPK HOLDING CO LTD	6,721	187.50	1,260,187.50

	WISTRON CORP	46,946	22.70	1,065,674.20	
	WPG HOLDINGS LTD	40,000	37.90	1,516,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	92,371	97.20	8,978,461.20	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	42,000	72.50	3,045,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	33,188	107.00	3,551,116.00	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	127,784	42.40	5,418,041.60	
	EPISTAR CORP	10,292	39.10	402,417.20	
	HERMES MICROVISION INC	1,000	2,210.00	2,210,000.00	
	INOTERA MEMORIES INC	45,000	26.40	1,188,000.00	
	MEDIATEK INC	31,132	421.50	13,122,138.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	12,522	151.00	1,890,822.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	3,000	293.00	879,000.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	19,635	65.00	1,276,275.00	
	RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	7,791	119.00	927,129.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	11,815	79.60	940,474.00	
	SILICONWARE PRECISION INDS	57,082	48.10	2,745,644.20	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	520,355	145.00	75,451,475.00	
	TRANSCEND INFORMATION INC	7,346	118.00	866,828.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	238,592	13.25	3,161,344.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	22,000	50.00	1,100,000.00	
台湾ドル小計		6,466,060		334,597,009.98 (1,341,734,010)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	6,400	848.40	5,429,760.00	
	CAIRN INDIA LTD	9,100	181.95	1,655,745.00	
	COAL INDIA LTD	9,000	412.30	3,710,700.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	15,460	317.90	4,914,734.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	28,946	990.90	28,682,591.40	
	ACC LIMITED	1,330	1,410.65	1,876,164.50	
	AMBUJA CEMENTS LIMITED	10,970	227.00	2,490,190.00	
	ASIAN PAINTS LTD	5,000	753.65	3,768,250.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	29,280	117.25	3,433,080.00	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	7,000	90.45	633,150.00	
	JSW STEEL LIMITED	2,000	893.15	1,786,300.00	
	TATA STEEL LIMITED	5,416	304.55	1,649,442.80	
	ULTRATECH CEMENT LTD	1,150	2,852.35	3,280,202.50	
	UPL LTD	5,900	541.45	3,194,555.00	
	VEDANTA LTD	23,260	176.10	4,096,086.00	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	13,150	254.10	3,341,415.00	
	EICHER MOTORS LTD	180	19,123.50	3,442,230.00	
	LARSEN & TOUBRO LTD	6,980	1,753.25	12,237,685.00	
	SIEMENS INDIA LIMITED	1,890	1,358.00	2,566,620.00	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	15,000	311.55	4,673,250.00	

CONTAINER CORP OF INDIA LTD	1,400	1,668.75	2,336,250.00
BAJAJ AUTO LTD	2,400	2,392.60	5,742,240.00
BHARAT FORGE LIMITED	1,800	1,121.00	2,017,800.00
BOSCH LTD	160	21,990.65	3,518,504.00
HERO MOTOCORP LTD	1,400	2,521.00	3,529,400.00
MAHINDRA & MAHINDRA LIMITED	7,000	1,302.35	9,116,450.00
TATA MOTORS LTD	21,628	430.60	9,313,016.80
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	9,630	355.20	3,420,576.00
ITC LTD	50,510	313.65	15,842,461.50
NESTLE INDIA LIMITED	560	6,004.10	3,362,296.00
UNITED SPIRITS LIMITED	1,330	3,331.70	4,431,161.00
DABUR INDIA LTD	9,500	273.50	2,598,250.00
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	3,700	1,162.60	4,301,620.00
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	15,520	896.55	13,914,456.00
MARICO LTD	4,300	459.60	1,976,280.00
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	2,300	1,284.05	2,953,315.00
AUROBINDO PHARMA LTD	3,750	1,443.25	5,412,187.50
CIPLA LTD	7,650	621.75	4,756,387.50
DIVI'S LABORATORIES LTD	950	1,814.90	1,724,155.00
DR. REDDY'S LABORATORIES	2,190	3,434.55	7,521,664.50
LUPIN LTD	4,130	1,805.20	7,455,476.00
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	17,804	871.10	15,509,064.40
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	32,575	1,283.90	41,823,042.50
ICICI BANK LTD	19,325	317.75	6,140,518.75
LIC HOUSING FINANCE LTD	7,000	455.90	3,191,300.00
STATE BANK OF INDIA	34,000	262.35	8,919,900.00
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	7,400	278.55	2,061,270.00
RURAL ELECTRIFICATION CORP	11,000	288.20	3,170,200.00
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	4,000	891.80	3,567,200.00
DLF LTD	4,900	114.45	560,805.00
HCL TECHNOLOGIES LTD	10,400	938.10	9,756,240.00
INFOSYS LTD	40,140	995.10	39,943,314.00
TATA CONSULTANCY SVS LTD	10,450	2,570.30	26,859,635.00
TECH MAHINDRA LTD	5,200	545.30	2,835,560.00
WIPRO LTD	13,640	565.40	7,712,056.00
BHARTI AIRTEL LTD	26,000	424.95	11,048,700.00
BHARTI INFRATEL LTD	7,890	463.35	3,655,831.50
IDEA CELLULAR LTD	26,000	174.40	4,534,400.00
RELIANCE COMMUNICATION LTD	9,055	58.00	525,190.00
GAIL INDIA LTD	10,875	399.25	4,341,843.75
NTPC LIMITED	20,000	136.80	2,736,000.00
TATA POWER CO LTD	29,640	73.80	2,187,432.00

インドルピー小計		696,514		413,185,600.90 (809,843,777)
カタールリアル	GULF INTERNATIONAL SERVICES	1,000	82.00	82,000.00
	INDUSTRIES QATAR	3,390	141.50	479,685.00
	DOHA BANK QSC	2,300	53.30	122,590.00
	MASRAF AL RAYAN	9,240	46.80	432,432.00
	QATAR ISLAMIC BANK	1,670	107.00	178,690.00
	QATAR NATIONAL BANK	3,930	186.00	730,980.00
	QATAR INSURANCE CO	1,400	96.50	135,100.00
	BARWA REAL ESTATE CO	3,000	52.70	158,100.00
	EZDAN HOLDING GROUP	11,500	18.50	212,750.00
	OORED00 QSC	2,160	85.80	185,328.00
	VODAFONE QATAR	10,500	16.85	176,925.00
カタールリアル小計		50,090		2,894,580.00 (98,647,286)
エジプトポンド	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	18,150	57.98	1,052,337.00
	T M G HOLDING	23,000	8.94	205,620.00
	GLOBAL TELECOM HOLDING	60,000	2.54	152,400.00
エジプトポンド小計		101,150		1,410,357.00 (22,904,197)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	3,510	89.48	314,074.80
	SASOL LTD	12,300	439.00	5,399,700.00
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	1,800	88.23	158,814.00
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	1,660	286.57	475,706.20
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	8,520	107.93	919,563.60
	GOLD FIELDS LTD	16,590	38.22	634,069.80
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	11,430	58.90	673,227.00
	KUMBA IRON ORE LTD	1,680	154.54	259,627.20
	MONDI LTD	1,880	271.10	509,668.00
	NAMPAK LTD	13,000	34.48	448,240.00
	SAPPI LIMITED	8,415	43.27	364,117.05
	BARLOWORLD LTD	6,500	95.80	622,700.00
	BIDVEST GROUP LTD	6,372	305.80	1,948,557.60
	STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	47,460	76.22	3,617,401.20
	TSOGO SUN HOLDINGS LTD	10,000	24.13	241,300.00
	NASPERS LTD-N SHS	8,610	1,944.96	16,746,105.60
	FOSCHINI GROUP LTD/THE	4,175	158.17	660,359.75
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	3,655	184.03	672,629.65
	MR PRICE GROUP LTD	4,300	247.82	1,065,626.00
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	8,420	84.50	711,490.00
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	21,405	98.50	2,108,392.50	
MASSMART HOLDINGS LTD	2,739	152.40	417,423.60	

PICK'N PAY STORES LTD	7,000	56.82	397,740.00	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	9,710	164.80	1,600,208.00	
SPAR GROUP LIMITED/THE	3,360	178.95	601,272.00	
TIGER BRANDS LTD	3,490	281.00	980,690.00	
LIFE HEALTHCARE GROUP	20,000	37.45	749,000.00	
MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD	9,000	102.00	918,000.00	
NETCARE LTD	16,150	37.50	605,625.00	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	7,341	370.00	2,716,170.00	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	6,900	180.00	1,242,000.00	
NEDBANK GROUP LTD	5,250	241.05	1,265,512.50	
STANDARD BANK GROUP LTD	27,916	160.04	4,467,676.64	
BRAIT SE	7,000	112.19	785,330.00	
CORONATION FUND MANAGERS LTD	3,200	82.30	263,360.00	
FIRSTSTRAND LTD	70,870	53.44	3,787,292.80	
INVESTEC LTD	6,500	109.95	714,675.00	
REMGRO LTD	10,240	253.14	2,592,153.60	
RMB HOLDINGS LTD	17,530	65.70	1,151,721.00	
DISCOVERY LTD	5,907	125.55	741,623.85	
LIBERTY HOLDINGS LTD	4,000	142.99	571,960.00	
MMI HOLDINGS LTD	24,429	29.54	721,632.66	
RMI HOLDINGS LTD	19,830	42.35	839,800.50	
SANLAM LTD	41,835	68.92	2,883,268.20	
HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	3,800	119.44	453,872.00	
RESILIENT PROPERTY INCOME	5,400	93.93	507,222.00	
MTN GROUP LTD	36,215	228.49	8,274,765.35	
VODACOM GROUP LTD	9,035	133.90	1,209,786.50	
南アフリカランド小計	586,329		80,011,151.15 (816,113,741)	
アラブディルハム	ARABTEC HOLDING CO PJSC	28,350	2.77	78,529.50
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	32,250	7.99	257,677.50
	DUBAI ISLAMIC BANK	18,000	6.88	123,840.00
	FIRST GULF BANK	20,192	15.15	305,908.80
	NATIONAL BANK OF ABU DHABI	19,635	10.85	213,039.75
	ALDAR PROPERTIES PJSC	84,600	2.80	236,880.00
	EMAAR MALLS GROUP PJSC	36,000	3.34	120,240.00
	EMAAR PROPERTIES PJSC	78,750	8.10	637,875.00
アラブディルハム小計	317,777		1,973,990.55 (66,701,140)	
合計	42,351,030		10,700,429,069 (10,700,429,069)	

(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	投資信託受益証券	GLOBAL X FTSE GREECE 20-ETF	21,000	248,220.00	
米ドル小計			21,000	248,220.00 (30,749,493)	
メキシコペソ	投資証券	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	46,000	1,679,460.00	
メキシコペソ小計			46,000	1,679,460.00 (13,418,885)	
トルコリラ	投資証券	EMLAK KONUT GAYRIMEN	58,000	164,720.00	
トルコリラ小計			58,000	164,720.00 (7,621,594)	
南アフリカランド	投資証券	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	41,000	1,070,100.00	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	55,000	566,500.00	
南アフリカランド小計			96,000	1,636,600.00 (16,693,320)	
合計				68,483,292 (68,483,292)	

(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	組入投資信託 受益証券時価比率	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 39銘柄	94.7%			5.1%
	投資信託受益証券 1銘柄		5.3%		0.3%
メキシコペソ	株式 25銘柄	97.1%			4.2%
	投資証券 1銘柄			2.9%	0.1%
ブラジルリアル	株式 64銘柄	100.0%			7.1%
チリペソ	株式 18銘柄	100.0%			1.1%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	100.0%			0.4%
トルコリラ	株式 17銘柄	95.2%			1.4%
	投資証券 1銘柄			4.8%	0.1%
チェココルナ	株式 2銘柄	100.0%			0.2%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%			0.2%
ポーランドズロチ	株式 21銘柄	100.0%			1.5%
香港ドル	株式 138銘柄	100.0%			25.5%
マレーシアリングギット	株式 36銘柄	100.0%			3.2%
タイバーツ	株式 26銘柄	100.0%			2.2%

フィリピンペソ	株式	18銘柄	100.0%			1.3%
インドネシアルピア	株式	24銘柄	100.0%			2.3%
韓国ウォン	株式	101銘柄	100.0%			14.3%
台湾ドル	株式	83銘柄	100.0%			12.5%
インドルピー	株式	62銘柄	100.0%			7.5%
カタールリアル	株式	11銘柄	100.0%			0.9%
エジプトポンド	株式	3銘柄	100.0%			0.2%
南アフリカランド	株式	48銘柄	98.0%			7.6%
	投資証券	2銘柄			2.0%	0.2%
アラブディルハム	株式	8銘柄	100.0%			0.6%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成26年12月25日現在	平成27年 6月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	49,859,524	25,993,387
国債証券	28,467,496,283	28,543,593,462
地方債証券	2,344,272,000	2,316,808,764
特殊債券	2,614,064,000	2,586,532,094
社債券	1,996,688,711	2,082,480,000
未収入金	-	23,586,000
未収利息	78,567,382	79,325,536
前払費用	2,147,843	2,057,635
流動資産合計	35,553,095,743	35,660,376,878
資産合計	35,553,095,743	35,660,376,878
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,462,126	35,550,689
流動負債合計	1,462,126	35,550,689
負債合計	1,462,126	35,550,689
純資産の部		
元本等		
元本	26,674,346,559	26,957,841,393
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,877,287,058	8,666,984,796
元本等合計	35,551,633,617	35,624,826,189
純資産合計	35,551,633,617	35,624,826,189
負債純資産合計	35,553,095,743	35,660,376,878

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12月25日現在	平成27年 6月25日現在
1.	期首	平成26年 6月26日	平成26年12月26日
	期首元本額	26,089,936,145円	26,674,346,559円
	期首からの追加設定元本額	1,535,047,238円	1,061,838,465円
	期首からの一部解約元本額	950,636,824円	778,343,631円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	700,554,378円	767,844,931円
	DCインデックスバランス（株式40）	915,203,101円	1,039,762,307円
	DCインデックスバランス（株式60）	649,624,353円	753,197,397円
	DCインデックスバランス（株式80）	113,096,896円	134,935,317円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	1,349,020,871円	1,405,361,839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	6,329,218,581円	5,985,533,911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	5,487,418円	5,326,730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）	50,929,438円	49,382,817円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	5,763,371円	5,937,978円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	28,225,962円	29,527,993円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	125,278,083円	125,033,346円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	449,788,750円	420,995,855円	
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	7,245,793,622円	7,191,438,738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）	56,073,413円	51,071,530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)	156,079,748円	154,398,875円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	35,677,086円	32,894,752円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	1,083,913,779円	1,123,443,581円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	1,112,539,745円	1,181,013,631円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	579,139,975円	634,107,760円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	89,006,096円	96,577,642円
インデックスファンド日本債券(1年決算型)	5,398,896,663円	5,579,202,830円
日本債券インデックスファンド(個人型年金向け)	195,035,230円	190,851,633円
計	26,674,346,559円	26,957,841,393円
2. 受益権の総数	26,674,346,559口	26,957,841,393口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 平成26年 6月26日 至 平成26年12月25日	自 平成26年12月26日 至 平成27年 6月25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12月25日現在	平成27年 6月25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12月25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	495,867,433
地方債証券	15,827,000
特殊債券	12,944,000
社債券	7,587,711
合計	532,226,144

（平成27年 6月25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	23,543,142
地方債証券	11,636,236

特殊債券		12,471,906
社債券		10,250,000
合計		10,815,000

(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12月25日現在		平成27年 6月25日現在	
1口当たり純資産額	1.3328円	1口当たり純資産額	1.3215円
(1万口当たり純資産額)	(13,328円)	(1万口当たり純資産額)	(13,215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341回利付国債(2年)	165,000,000	165,167,100	
	第97回利付国債(5年)	350,000,000	351,374,753	
	第98回利付国債(5年)	100,000,000	100,294,612	
	第99回利付国債(5年)	60,000,000	60,294,000	
	第100回利付国債(5年)	60,000,000	60,220,800	
	第101回利付国債(5年)	170,000,000	171,003,000	
	第102回利付国債(5年)	280,000,000	281,240,400	
	第103回利付国債(5年)	90,000,000	90,464,400	
	第104回利付国債(5年)	50,000,000	50,172,000	
	第105回利付国債(5年)	110,000,000	110,434,500	
	第106回利付国債(5年)	420,000,000	421,822,800	
	第107回利付国債(5年)	705,000,000	708,313,500	
	第109回利付国債(5年)	180,000,000	180,415,800	
第111回利付国債(5年)	40,000,000	40,419,200		

第112回利付国債(5年)	160,000,000	161,856,000	
第114回利付国債(5年)	90,000,000	90,827,100	
第116回利付国債(5年)	110,000,000	110,667,700	
第117回利付国債(5年)	370,000,000	372,268,100	
第118回利付国債(5年)	200,000,000	201,150,000	
第119回利付国債(5年)	100,000,000	100,178,000	
第120回利付国債(5年)	330,000,000	331,805,100	
第121回利付国債(5年)	100,000,000	100,126,000	
第122回利付国債(5年)	330,000,000	330,217,800	
第123回利付国債(5年)	465,000,000	465,000,000	
第1回利付国債(40年)	25,000,000	30,644,750	
第2回利付国債(40年)	165,000,000	193,904,700	
第3回利付国債(40年)	50,000,000	58,728,500	
第4回利付国債(40年)	95,000,000	111,635,450	
第5回利付国債(40年)	35,000,000	39,190,200	
第6回利付国債(40年)	55,000,000	60,010,500	
第7回利付国債(40年)	80,000,000	82,604,000	
第280回利付国債(10年)	156,000,000	158,914,869	
第281回利付国債(10年)	142,000,000	144,792,688	
第282回利付国債(10年)	24,000,000	24,500,640	
第283回利付国債(10年)	25,000,000	25,552,250	
第284回利付国債(10年)	462,000,000	473,596,200	
第285回利付国債(10年)	261,000,000	268,644,690	
第286回利付国債(10年)	186,000,000	192,612,300	
第287回利付国債(10年)	35,000,000	36,313,550	
第288回利付国債(10年)	18,000,000	18,679,500	
第289回利付国債(10年)	199,000,000	206,366,980	
第290回利付国債(10年)	266,000,000	276,028,200	
第291回利付国債(10年)	287,000,000	297,036,390	
第292回利付国債(10年)	306,000,000	320,033,160	
第293回利付国債(10年)	96,000,000	101,095,680	
第294回利付国債(10年)	32,000,000	33,603,520	
第295回利付国債(10年)	13,000,000	13,574,080	
第296回利付国債(10年)	74,000,000	77,544,600	
第297回利付国債(10年)	148,000,000	155,068,480	
第298回利付国債(10年)	221,000,000	230,785,880	
第299回利付国債(10年)	750,000,000	785,272,500	
第300回利付国債(10年)	36,000,000	37,960,920	
第301回利付国債(10年)	223,000,000	235,826,960	
第302回利付国債(10年)	94,000,000	99,034,640	
第303回利付国債(10年)	581,000,000	613,565,050	
第304回利付国債(10年)	60,000,000	63,110,400	

第305回利付国債(10年)	673,000,000	709,463,140
第306回利付国債(10年)	93,000,000	98,683,230
第308回利付国債(10年)	140,000,000	148,206,800
第309回利付国債(10年)	134,000,000	140,528,480
第310回利付国債(10年)	148,000,000	154,765,080
第311回利付国債(10年)	23,000,000	23,812,360
第312回利付国債(10年)	205,000,000	216,926,900
第313回利付国債(10年)	410,000,000	436,875,500
第315回利付国債(10年)	65,000,000	69,020,900
第316回利付国債(10年)	35,000,000	36,957,900
第317回利付国債(10年)	105,000,000	111,051,150
第318回利付国債(10年)	155,000,000	162,976,300
第319回利付国債(10年)	5,000,000	5,294,450
第320回利付国債(10年)	110,000,000	115,773,900
第321回利付国債(10年)	175,000,000	184,287,250
第322回利付国債(10年)	75,000,000	78,482,250
第323回利付国債(10年)	45,000,000	47,101,950
第324回利付国債(10年)	75,000,000	77,961,000
第325回利付国債(10年)	230,000,000	238,894,100
第326回利付国債(10年)	30,000,000	30,922,500
第327回利付国債(10年)	65,000,000	67,475,200
第328回利付国債(10年)	275,000,000	281,226,000
第329回利付国債(10年)	210,000,000	217,837,200
第330回利付国債(10年)	210,000,000	217,730,100
第331回利付国債(10年)	80,000,000	81,664,000
第333回利付国債(10年)	110,000,000	112,042,700
第334回利付国債(10年)	220,000,000	223,810,400
第335回利付国債(10年)	130,000,000	130,923,000
第337回利付国債(10年)	30,000,000	29,631,300
第338回利付国債(10年)	130,000,000	129,333,100
第14回利付国債(30年)	208,000,000	251,738,240
第15回利付国債(30年)	147,000,000	180,439,560
第16回利付国債(30年)	35,000,000	42,912,800
第18回利付国債(30年)	170,000,000	202,079,000
第23回利付国債(30年)	55,000,000	67,206,700
第24回利付国債(30年)	158,000,000	193,076,000
第25回利付国債(30年)	20,000,000	23,696,000
第26回利付国債(30年)	30,000,000	36,109,800
第27回利付国債(30年)	29,000,000	35,490,490
第28回利付国債(30年)	14,000,000	17,157,560
第29回利付国債(30年)	276,000,000	333,134,760
第30回利付国債(30年)	147,000,000	174,760,950

第3 1 回利付国債(30年)	140,000,000	163,667,000	
第3 2 回利付国債(30年)	40,000,000	47,617,200	
第3 3 回利付国債(30年)	50,000,000	56,434,500	
第3 4 回利付国債(30年)	160,000,000	187,396,800	
第3 5 回利付国債(30年)	120,000,000	135,369,600	
第3 6 回利付国債(30年)	230,000,000	259,357,200	
第3 7 回利付国債(30年)	70,000,000	77,357,000	
第3 8 回利付国債(30年)	30,000,000	32,461,200	
第3 9 回利付国債(30年)	75,000,000	82,871,250	
第4 0 回利付国債(30年)	90,000,000	97,282,800	
第4 1 回利付国債(30年)	30,000,000	31,703,100	
第4 2 回利付国債(30年)	65,000,000	68,642,600	
第4 3 回利付国債(30年)	225,000,000	237,444,750	
第4 4 回利付国債(30年)	40,000,000	42,182,400	
第4 5 回利付国債(30年)	15,000,000	15,092,400	
第4 6 回利付国債(30年)	135,000,000	135,696,600	
第3 3 回利付国債(20年)	200,000,000	209,328,000	
第3 4 回利付国債(20年)	85,000,000	90,126,350	
第3 7 回利付国債(20年)	63,000,000	67,342,590	
第3 9 回利付国債(20年)	86,000,000	92,063,860	
第4 1 回利付国債(20年)	27,000,000	28,470,690	
第4 2 回利付国債(20年)	178,000,000	194,975,860	
第4 3 回利付国債(20年)	73,000,000	81,724,230	
第4 4 回利付国債(20年)	51,000,000	56,767,080	
第4 7 回利付国債(20年)	21,000,000	23,270,100	
第4 8 回利付国債(20年)	99,000,000	111,765,060	
第4 9 回利付国債(20年)	57,000,000	63,349,230	
第5 0 回利付国債(20年)	237,000,000	260,704,740	
第5 1 回利付国債(20年)	39,000,000	43,274,790	
第5 4 回利付国債(20年)	15,000,000	16,945,200	
第5 5 回利付国債(20年)	66,000,000	73,908,780	
第5 7 回利付国債(20年)	137,000,000	152,811,170	
第5 8 回利付国債(20年)	135,000,000	150,866,550	
第5 9 回利付国債(20年)	33,000,000	36,458,400	
第6 0 回利付国債(20年)	545,000,000	589,913,450	
第6 1 回利付国債(20年)	27,000,000	28,437,210	
第6 3 回利付国債(20年)	31,000,000	34,594,760	
第6 4 回利付国債(20年)	54,000,000	60,814,800	
第6 5 回利付国債(20年)	100,000,000	112,899,000	
第6 6 回利付国債(20年)	34,000,000	38,105,500	
第6 7 回利付国債(20年)	34,000,000	38,428,160	
第6 8 回利付国債(20年)	78,000,000	90,176,580	

第70回利付国債(20年)	104,000,000	122,286,320	
第72回利付国債(20年)	112,000,000	129,000,480	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	129,389,520	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	136,253,420	
第75回利付国債(20年)	50,000,000	57,847,000	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	23,892,120	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	45,882,400	
第79回利付国債(20年)	240,000,000	275,908,800	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	69,645,000	
第87回利付国債(20年)	170,000,000	199,717,700	
第88回利付国債(20年)	260,000,000	308,851,400	
第90回利付国債(20年)	156,000,000	183,899,040	
第91回利付国債(20年)	260,000,000	309,420,800	
第92回利付国債(20年)	110,000,000	128,614,200	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	58,502,500	
第95回利付国債(20年)	32,000,000	38,227,200	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	114,807,980	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	53,293,050	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	110,249,780	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	137,370,870	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	35,589,600	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	79,900,920	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	98,196,300	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	13,195,490	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	38,772,030	
第105回利付国債(20年)	127,000,000	149,338,030	
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,377,580	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	152,977,500	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	154,276,880	
第109回利付国債(20年)	27,000,000	31,075,920	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	115,322,480	
第111回利付国債(20年)	25,000,000	29,754,750	
第113回利付国債(20年)	240,000,000	282,376,800	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	61,167,080	
第115回利付国債(20年)	20,000,000	23,787,000	
第116回利付国債(20年)	145,000,000	172,534,050	
第117回利付国債(20年)	30,000,000	35,276,400	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	11,620,300	
第119回利付国債(20年)	50,000,000	56,724,500	
第120回利付国債(20年)	70,000,000	77,436,800	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	25,233,340	
第122回利付国債(20年)	160,000,000	181,225,600	

第123回利付国債(20年)	85,000,000	99,873,300	
第124回利付国債(20年)	50,000,000	58,023,000	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	59,444,000	
第126回利付国債(20年)	25,000,000	29,007,500	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	74,337,900	
第129回利付国債(20年)	115,000,000	129,908,600	
第130回利付国債(20年)	80,000,000	90,194,400	
第131回利付国債(20年)	55,000,000	61,186,400	
第132回利付国債(20年)	90,000,000	100,044,000	
第133回利付国債(20年)	30,000,000	33,801,300	
第134回利付国債(20年)	30,000,000	33,752,700	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	33,294,900	
第136回利付国債(20年)	180,000,000	196,882,200	
第137回利付国債(20年)	140,000,000	155,121,400	
第138回利付国債(20年)	50,000,000	53,823,000	
第140回利付国債(20年)	280,000,000	309,713,600	
第141回利付国債(20年)	195,000,000	215,305,350	
第142回利付国債(20年)	25,000,000	27,996,000	
第143回利付国債(20年)	115,000,000	124,823,300	
第144回利付国債(20年)	40,000,000	42,785,200	
第145回利付国債(20年)	125,000,000	137,493,750	
第146回利付国債(20年)	75,000,000	82,332,000	
第147回利付国債(20年)	110,000,000	118,718,600	
第148回利付国債(20年)	120,000,000	127,155,600	
第149回利付国債(20年)	215,000,000	227,250,700	
第150回利付国債(20年)	90,000,000	93,321,900	
第151回利付国債(20年)	130,000,000	129,897,300	
第152回利付国債(20年)	160,000,000	159,363,200	
国債証券 合計	26,503,000,000	28,543,593,462	
地方債証券			
第636回東京都公募公債	100,000,000	101,956,764	
第682回東京都公募公債	100,000,000	105,472,000	
第708回東京都公募公債	100,000,000	104,198,000	
第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	118,249,000	
平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	208,526,000	
平成19年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	103,633,000	
平成19年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	103,274,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	105,189,000	
平成18年度第1回広島県公募公債	100,000,000	102,361,000	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	105,207,000	
平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	103,473,000	
平成23年度第4回福岡県公募公債	100,000,000	100,352,000	
平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	102,628,000	

	第10回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	101,990,000	
	第55回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,148,000	
	第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,980,000	
	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	103,474,000	
	第4回京都市公募公債(20年)	100,000,000	120,294,000	
	平成23年度第14回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	111,068,000	
	平成18年度第1回鹿児島県公募公債(10年)	100,000,000	102,455,000	
	平成23年度第2回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	104,881,000	
地方債証券 合計		2,200,000,000	2,316,808,764	
特殊債券	第1回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	103,598,000	
	第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	104,062,000	
	第5回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,363,000	
	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,634,000	
	第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,988,000	
	第6回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,785,000	
	第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,366,000	
	第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,714,000	
	第21回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,123,000	
	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,445,000	
	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,606,000	
	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	102,933,000	
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	116,963,000	
	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	108,890,000	
	第135回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,718,000	
	第139回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,600,000	
	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	199,740,000	
	第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,390,000	
	第20回公営企業債券	100,000,000	101,921,094	
	第29回国際協力銀行債券	200,000,000	207,480,000	
	い第745号農林債	100,000,000	100,350,000	
	第267回信金中金債(5年)	100,000,000	100,526,000	
	第272回信金中金債(5年)	100,000,000	100,337,000	
特殊債券 合計		2,500,000,000	2,586,532,094	
社債券	第324回東京交通債券	100,000,000	105,335,000	
	第9回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債(2012)	100,000,000	101,771,000	
	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	105,434,000	
	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	103,656,000	
	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	100,540,000	

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	101,290,000	
第15回ダイキン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	101,418,000	
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	102,456,000	
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	102,134,000	
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	200,522,000	
第26回三井不動産株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	102,313,000	
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	111,964,000	
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	106,994,000	
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	116,386,000	
第523回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,594,000	
第306回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,559,000	
第299回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,621,000	
第281回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,731,000	
第19回沖縄電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,762,000	
社債券 合計	2,000,000,000	2,082,480,000	
合計	33,203,000,000	35,529,414,320	

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12月25日現在	平成27年 6月25日現在
資産の部		
流動資産		
預金	464,303,136	98,383,079
コール・ローン	58,112,566	226,032,172
国債証券	211,586,550,266	197,188,569,199
派生商品評価勘定	444,504	758,248
未収入金	-	262,020,131
未収利息	2,399,228,929	2,173,623,403
前払費用	48,303,516	42,471,746

	平成26年12月25日現在	平成27年 6月25日現在
流動資産合計	214,556,942,917	199,991,857,978
資産合計	214,556,942,917	199,991,857,978
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	256,375	482,053
未払解約金	285,066,906	495,410,485
流動負債合計	285,323,281	495,892,538
負債合計	285,323,281	495,892,538
純資産の部		
元本等		
元本	89,403,370,318	84,243,222,131
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	124,868,249,318	115,252,743,309
元本等合計	214,271,619,636	199,495,965,440
純資産合計	214,271,619,636	199,495,965,440
負債純資産合計	214,556,942,917	199,991,857,978

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12月25日現在	平成27年 6月25日現在
1. 期首	平成26年 6月26日	平成26年12月26日
期首元本額	99,238,392,277円	89,403,370,318円
期首からの追加設定元本額	843,756,563円	783,906,834円

期首からの一部解約元本額	10,678,778,522円	5,944,055,021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)	10,616,116,307円	10,643,658,653円
DCインデックスバランス(株式20)	60,005,394円	65,973,309円
DCインデックスバランス(株式40)	113,368,165円	128,565,653円
DCインデックスバランス(株式60)	145,420,128円	167,700,926円
DCインデックスバランス(株式80)	125,840,110円	150,708,288円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	27,171,864,251円	27,020,165,302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	3,572,351,923円	3,344,409,935円
日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	35,758,675,320円	32,384,808,220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	28,425,129円	26,816,505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)	1,055,449,473円	1,047,412,737円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	73,573,642円	129,506,303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)	23,026,635円	19,015,096円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	3,201,513円	3,330,153円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	3,141,919円	3,306,878円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	7,834,815円	7,770,441円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	19,237,369円	18,098,352円
世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	823,277,238円	865,919,404円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	1,365,270,690円	1,342,938,834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)	43,529,618円	39,865,143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)	98,879,812円	98,384,123円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	44,281,753円	41,964,866円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	46,313,401円	48,173,396円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	70,211,711円	73,887,764円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	65,472,129円	70,962,504円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	49,557,946円	53,875,802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	7,775,013,273円	6,201,878,828円
海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	244,030,654円	244,124,716円
計	89,403,370,318円	84,243,222,131円
2. 受益権の総数	89,403,370,318口	84,243,222,131口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 平成26年 6月26日 至 平成26年12月25日	自 平成26年12月26日 至 平成27年 6月25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12月25日現在	平成27年 6月25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12月25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	2,274,939,302
合計	2,274,939,302

(平成27年 6月25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	1,609,212,292
合計	1,609,212,292

(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12月25日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	315,105,089	-	314,916,960	188,129
	米ドル	89,920,125	-	90,172,500	252,375
	メキシコペソ	42,104,004	-	42,102,460	1,544
	ユーロ	117,542,480	-	117,248,000	294,480
	英ポンド	65,538,480	-	65,394,000	144,480
合計		315,105,089	-	314,916,960	188,129

(平成27年 6月25日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	302,729,121	-	302,452,926	276,195
	米ドル	132,971,717	-	133,160,250	188,533
	ユーロ	169,757,404	-	169,292,676	464,728
	合計	302,729,121	-	302,452,926	276,195

(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12月25日現在		平成27年 6月25日現在	
1口当たり純資産額	2.3967円	1口当たり純資産額	2.3681円
(1万口当たり純資産額)	(23,967円)	(1万口当たり純資産額)	(23,681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-3.25%-16/05/31	8,650,000.00	8,883,820.31	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/06/30	10,000,000.00	10,291,406.25	
		US TREASURY N/B-1.5%-16/06/30	5,000,000.00	5,057,812.50	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/07/31	4,200,000.00	4,331,578.12	
		US TREASURY N/B-4.875%-16/08/15	8,000,000.00	8,403,750.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-16/08/31	10,000,000.00	10,303,125.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-16/09/30	5,200,000.00	5,366,156.25	
		US TREASURY N/B-3.125%-16/10/31	6,900,000.00	7,144,195.31	
		US TREASURY N/B-4.625%-16/11/15	6,000,000.00	6,342,187.50	
		US TREASURY N/B-7.5%-16/11/15	9,700,000.00	10,642,718.75	
		US TREASURY N/B-2.75%-16/11/30	7,000,000.00	7,223,671.87	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/12/31	8,700,000.00	9,057,515.62	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/01/31	9,000,000.00	9,364,921.87	
		US TREASURY N/B-4.625%-17/02/15	9,250,000.00	9,864,980.46	
		US TREASURY N/B-3.0%-17/02/28	5,400,000.00	5,619,375.00	
		US TREASURY N/B-3.25%-17/03/31	8,800,000.00	9,208,375.00	
		US TREASURY N/B-1.0%-17/03/31	5,500,000.00	5,538,886.72	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/04/30	7,000,000.00	7,320,468.75	
		US TREASURY N/B-4.5%-17/05/15	8,800,000.00	9,433,875.00	
		US TREASURY N/B-8.75%-17/05/15	8,000,000.00	9,213,125.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-17/05/31	8,800,000.00	9,153,375.00	
		US TREASURY N/B-0.625%-17/05/31	5,000,000.00	4,995,312.50	
		US TREASURY N/B-2.5%-17/06/30	4,000,000.00	4,145,312.50	
		US TREASURY N/B-0.75%-17/06/30	5,000,000.00	5,006,640.62	
		US TREASURY N/B-0.875%-17/07/15	2,200,000.00	2,206,875.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-17/07/31	1,020,000.00	1,054,823.43	
		US TREASURY N/B-4.75%-17/08/15	8,600,000.00	9,331,000.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-17/08/31	2,000,000.00	2,048,437.50	
		US TREASURY N/B-1.0%-17/09/15	4,900,000.00	4,922,203.12	
		US TREASURY N/B-1.875%-17/09/30	7,000,000.00	7,170,078.12	
		US TREASURY N/B-1.875%-17/10/31	2,500,000.00	2,560,742.18	
		US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	9,800,000.00	10,580,937.50	
US TREASURY N/B-2.25%-17/11/30	3,500,000.00	3,617,578.12			

US TREASURY N/B-2.75%-17/12/31	8,600,000.00	8,999,765.62	
US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	7,950,000.00	8,479,171.87	
US TREASURY N/B-2.75%-18/02/28	7,400,000.00	7,751,500.00	
US TREASURY N/B-2.875%-18/03/31	2,500,000.00	2,628,906.25	
US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	7,550,000.00	8,166,386.71	
US TREASURY N/B-2.375%-18/06/30	7,000,000.00	7,271,250.00	
US TREASURY N/B-2.25%-18/07/31	8,500,000.00	8,799,492.18	
US TREASURY N/B-1.375%-18/07/31	2,500,000.00	2,520,507.81	
US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	8,850,000.00	9,654,796.87	
US TREASURY N/B-1.75%-18/10/31	3,000,000.00	3,055,078.12	
US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	11,480,000.00	12,453,109.37	
US TREASURY N/B-1.5%-18/12/31	9,150,000.00	9,223,628.90	
US TREASURY N/B-8.875%-19/02/15	5,000,000.00	6,356,640.62	
US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	5,600,000.00	5,887,437.50	
US TREASURY N/B-1.375%-19/02/28	3,000,000.00	3,005,390.62	
US TREASURY N/B-1.5%-19/02/28	4,000,000.00	4,025,000.00	
US TREASURY N/B-1.625%-19/03/31	2,000,000.00	2,019,531.25	
US TREASURY N/B-1.625%-19/04/30	5,000,000.00	5,044,140.62	
US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	4,400,000.00	4,688,406.25	
US TREASURY N/B-1.5%-19/05/31	4,100,000.00	4,114,093.75	
US TREASURY N/B-1.625%-19/06/30	1,090,000.00	1,097,834.37	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	4,320,000.00	4,695,975.00	
US TREASURY N/B-8.125%-19/08/15	9,000,000.00	11,418,046.87	
US TREASURY N/B-1.0%-19/08/31	3,300,000.00	3,235,031.25	
US TREASURY N/B-1.625%-19/08/31	3,600,000.00	3,621,656.25	
US TREASURY N/B-1.75%-19/09/30	8,300,000.00	8,379,109.37	
US TREASURY N/B-1.5%-19/10/31	4,100,000.00	4,092,953.12	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	13,000,000.00	14,010,546.87	
US TREASURY N/B-1.625%-19/12/31	1,800,000.00	1,802,812.50	
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	13,800,000.00	15,046,312.50	
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	9,500,000.00	10,311,210.93	
US TREASURY N/B-1.375%-20/05/31	300,000.00	295,664.06	
US TREASURY N/B-2.0%-20/07/31	9,300,000.00	9,431,507.81	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	7,950,000.00	10,709,519.53	
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	5,000,000.00	5,217,187.50	

US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	3,500,000.00	3,644,648.43	
US TREASURY N/B-2.375%-20/12/31	3,000,000.00	3,084,375.00	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	14,250,000.00	15,592,617.18	
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	5,320,000.00	5,674,943.75	
US TREASURY N/B-2.25%-21/07/31	3,000,000.00	3,045,703.12	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	3,900,000.00	3,931,382.81	
US TREASURY N/B-2.125%-21/09/30	500,000.00	503,281.25	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	12,000,000.00	16,349,062.50	
US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	4,000,000.00	3,993,750.00	
US TREASURY N/B-2.125%-21/12/31	4,800,000.00	4,820,625.00	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,500,000.00	2,491,210.93	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	9,300,000.00	9,169,218.75	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	8,500,000.00	8,191,875.00	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,500,000.00	5,601,406.25	
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	2,000,000.00	2,073,125.00	
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	1,200,000.00	1,242,281.25	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	4,000,000.00	4,055,937.50	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,630,828.12	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	3,250,000.00	3,219,531.25	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	3,050,000.00	2,952,542.96	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	2,800,000.00	2,739,406.25	
US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,700,000.00	3,788,437.50	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	3,100,000.00	4,293,257.81	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,000,000.00	1,302,109.37	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	3,600,000.00	5,191,312.50	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	3,500,000.00	4,701,757.81	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	2,900,000.00	3,860,625.00	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	2,700,000.00	3,297,796.87	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	3,200,000.00	3,974,500.00	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	2,900,000.00	3,475,921.87	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	3,850,000.00	4,787,234.37	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	2,750,000.00	3,360,800.78	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	3,850,000.00	4,877,468.75	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	4,270,000.00	5,221,742.96	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	4,050,000.00	4,592,636.71	

		US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	4,000,000.00	4,807,187.50	
		US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,600,000.00	2,071,000.00	
		US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	4,000,000.00	4,911,250.00	
		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	4,400,000.00	4,909,093.75	
		US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	1,986,718.75	
		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	5,800,000.00	5,479,187.50	
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	5,350,000.00	5,838,187.50	
		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	4,500,000.00	5,021,367.18	
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	3,000,000.00	3,271,171.87	
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,500,000.00	2,603,125.00	
		US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	5,900,000.00	5,858,976.56	
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	3,300,000.00	3,199,195.31	
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	2,878,992.18	
	米ドル小計		622,370,000.00	669,483,670.81 (82,935,637,139)	
加ドル	国債証券	CANADA GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	370,000.00	411,277.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-16/06/01	3,700,000.00	3,815,255.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-16/06/01	1,050,000.00	1,063,198.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-16/08/01	880,000.00	883,537.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-16/09/01	1,100,000.00	1,127,522.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-16/11/01	480,000.00	482,548.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-17/02/01	370,000.00	375,368.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-17/03/01	2,000,000.00	2,031,120.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-17/05/01	400,000.00	397,540.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-17/06/01	2,130,000.00	2,269,919.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-17/08/01	380,000.00	385,111.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-17/09/01	1,000,000.00	1,019,780.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/02/01	350,000.00	355,848.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/03/01	1,570,000.00	1,598,024.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	1,520,000.00	1,680,451.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/09/01	650,000.00	663,422.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/03/01	1,350,000.00	1,400,638.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	2,600,000.00	2,900,170.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/09/01	650,000.00	675,298.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-20/03/01	670,000.00	686,683.00	

		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	1,630,000.00	1,822,470.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	1,300,000.00	1,453,673.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	1,400,000.00	1,524,278.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,480,000.00	1,472,067.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,520,000.00	1,622,326.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	1,020,000.00	1,064,166.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	610,000.00	1,003,364.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	1,300,000.00	1,875,289.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	1,360,000.00	2,060,468.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	1,530,000.00	2,220,886.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	1,760,000.00	2,301,992.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,760,000.00	2,183,280.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	610,000.00	659,330.70	
	加ドル小計		40,500,000.00	45,486,306.80	(4,547,720,953)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-6.25%- 16/06/16	12,000,000.00	12,295,777.20	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%- 16/12/15	21,600,000.00	22,647,278.16	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-17/06/15	12,000,000.00	12,202,449.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 17/12/14	17,000,000.00	18,370,278.20	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-4.75%- 18/06/14	18,000,000.00	18,064,365.30	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-18/12/13	12,700,000.00	14,190,532.96	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11	2,000,000.00	1,981,575.20	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	24,700,000.00	27,588,782.32	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	6,200,000.00	6,483,310.24	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	5,000,000.00	5,186,154.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	5,000,000.00	5,646,667.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	25,500,000.00	32,648,334.67	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	6,000,000.00	6,577,292.70	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	19,700,000.00	23,401,474.37	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	11,200,000.00	12,484,204.32	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	2,200,000.00	2,448,736.51	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	10,900,000.00	14,926,516.68
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	15,400,000.00	18,408,489.33
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	9,600,000.00	10,691,423.52
メキシコペソ小計			236,700,000.00	266,243,642.43 (2,127,286,703)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-3.25%-16/09/28	1,570,000.00	1,637,400.10
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-17/03/28	1,640,000.00	1,760,244.80
		BELGIUM KINGDOM-3.5%-17/06/28	410,000.00	439,826.14
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-17/09/28	1,640,000.00	1,848,064.83
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-18/03/28	2,150,000.00	2,390,187.25
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-18/06/22	170,000.00	176,233.33
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	1,950,000.00	2,232,252.75
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-19/09/28	270,000.00	301,657.50
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	2,260,000.00	2,656,155.40
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	1,990,000.00	2,438,837.93
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	2,050,000.00	2,498,668.12
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,500,000.00	1,866,715.05
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	700,000.00	770,023.31
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	1,100,000.00	1,242,072.26
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	430,000.00	411,865.35
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	1,220,000.00	1,610,774.17
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	2,090,000.00	3,056,050.25
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	500,000.00	446,370.00
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	960,000.00	1,272,840.00
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	760,000.00	901,200.40
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	2,110,000.00	3,202,199.30
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,650,000.00	2,395,293.94
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	740,000.00	1,006,829.20
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.25%-16/10/31	3,790,000.00	3,998,616.00
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%-17/01/31	2,550,000.00	2,696,159.62
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.1%-17/04/30	1,900,000.00	1,964,486.19

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 17/07/30	3,050,000.00	3,379,987.73
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%- 17/10/31	1,400,000.00	1,403,691.38
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.5%- 18/01/31	1,900,000.00	2,096,270.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%- 18/07/30	3,180,000.00	3,522,486.63
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.75%- 18/10/31	1,600,000.00	1,757,374.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 19/04/30	1,760,000.00	1,889,776.58
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%- 19/07/30	2,900,000.00	3,335,397.59
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%- 19/10/31	2,880,000.00	3,291,321.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 20/01/31	600,000.00	610,920.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%- 20/04/30	2,900,000.00	3,295,914.96
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%- 20/10/31	2,110,000.00	2,502,059.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	2,850,000.00	3,503,866.09
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	1,830,000.00	2,316,078.56
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%- 23/01/31	2,000,000.00	2,505,464.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	1,310,000.00	1,554,581.31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	2,550,000.00	3,111,279.48
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	2,500,000.00	2,850,100.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	2,000,000.00	2,105,804.99
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	1,480,000.00	1,411,757.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,500,000.00	1,831,976.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,700,000.00	2,286,510.88

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,320,000.00	1,695,962.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	2,320,000.00	3,201,919.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	750,000.00	682,511.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	2,000,000.00	2,787,085.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,890,000.00	2,222,941.83	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,430,000.00	1,858,263.55	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,450,000.00	1,837,733.62	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	1,040,000.00	1,412,343.08	
BUNDESobligation-1.25%-16/10/14	200,000.00	203,864.16	
BUNDESobligation-1.0%-18/10/12	2,100,000.00	2,175,510.75	
BUNDESobligation-1.0%-19/02/22	2,860,000.00	2,968,556.16	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.0%- 16/06/20	1,900,000.00	2,016,546.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 16/07/04	4,160,000.00	4,340,207.45	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 17/01/04	5,450,000.00	5,782,526.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 17/07/04	5,650,000.00	6,158,967.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 18/01/04	4,750,000.00	5,250,305.62	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 18/07/04	3,200,000.00	3,623,955.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 19/01/04	3,550,000.00	4,026,268.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%- 19/07/04	4,200,000.00	4,789,249.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 20/01/04	3,700,000.00	4,227,745.06	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%- 20/07/04	3,900,000.00	4,450,893.72	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 20/09/04	250,000.00	276,526.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-	1,400,000.00	1,573,463.50	

21/01/04			
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	4,900,000.00	5,761,485.17	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 21/09/04	1,200,000.00	1,340,586.48	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	2,000,000.00	2,207,954.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 22/07/04	2,250,000.00	2,451,375.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	1,950,000.00	2,088,632.32	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	2,050,000.00	2,194,546.52	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	2,000,000.00	2,139,755.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	1,450,000.00	1,607,959.37	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	1,950,000.00	2,854,105.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	900,000.00	979,215.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	850,000.00	904,914.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	500,000.00	509,015.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	1,000,000.00	967,776.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,680,000.00	2,712,574.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,600,000.00	2,444,915.84	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	1,340,000.00	1,923,216.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	1,240,000.00	2,067,303.69	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	2,270,000.00	3,598,895.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	2,530,000.00	3,911,683.09	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	2,390,000.00	3,474,996.18	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-	1,690,000.00	2,601,125.47	

39/07/04			
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,940,000.00	3,219,701.79	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	1,500,000.00	2,050,185.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,450,000.00	1,756,569.87	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	850,000.00	1,032,624.62	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 16/08/01	5,590,000.00	5,808,546.64	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 16/09/15	1,200,000.00	1,266,120.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.75%- 16/11/15	1,100,000.00	1,138,125.67	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 17/02/01	3,960,000.00	4,195,338.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 17/05/01	1,700,000.00	1,839,094.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 17/06/01	1,700,000.00	1,845,436.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 17/08/01	3,750,000.00	4,135,775.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 17/11/01	1,700,000.00	1,821,979.76	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/02/01	4,090,000.00	4,513,277.37	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/06/01	1,000,000.00	1,085,680.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/08/01	3,110,000.00	3,484,568.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/12/01	2,500,000.00	2,741,720.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/02/01	2,860,000.00	3,217,210.85	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 19/03/01	2,870,000.00	3,260,363.05	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 19/05/01	1,400,000.00	1,489,782.56	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 19/08/01	730,000.00	748,570.03	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-	3,590,000.00	4,082,415.88	

19/09/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.05%- 19/12/01	1,100,000.00	1,104,092.88	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 20/02/01	2,800,000.00	3,241,067.76	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 20/03/01	3,000,000.00	3,442,192.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	3,050,000.00	3,486,127.12	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	2,100,000.00	2,381,410.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/05/01	1,000,000.00	1,132,752.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	4,890,000.00	5,541,572.94	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 21/09/01	3,980,000.00	4,744,425.46	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 21/12/15	130,000.00	134,864.36	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	2,400,000.00	2,919,887.28	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,900,000.00	2,376,146.27	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	2,000,000.00	2,504,572.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	500,000.00	595,966.65	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,000,000.00	1,209,062.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	4,090,000.00	6,253,504.47	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,650,000.00	1,966,896.19	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,500,000.00	1,701,143.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,300,000.00	1,342,659.63	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	3,400,000.00	4,220,828.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	400,000.00	482,235.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-	2,630,000.00	3,875,242.14	

26/11/01		
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	4,090,000.00	5,773,165.88
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	200,000.00	247,724.76
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	4,530,000.00	5,902,458.63
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	500,000.00	554,799.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	3,950,000.00	5,578,901.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,950,000.00	2,719,348.12
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	2,520,000.00	3,271,572.36
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	3,100,000.00	3,540,060.81
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	2,470,000.00	3,225,851.12
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	2,950,000.00	3,848,301.84
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,300,000.00	1,663,937.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,010,000.00	1,029,794.27
FINNISH GOVERNMENT-1.875%-17/04/15	50,000.00	51,862.83
FINNISH GOVERNMENT-3.875%-17/09/15	1,070,000.00	1,165,817.96
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-18/09/15	210,000.00	217,763.54
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	800,000.00	936,302.00
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	1,030,000.00	1,182,239.15
FINNISH GOVERNMENT-0.375%-20/09/15	60,000.00	60,170.40
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	900,000.00	1,058,481.99
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	300,000.00	319,504.44
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	620,000.00	652,624.40
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	550,000.00	598,938.39
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	650,000.00	831,184.83
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	500,000.00	583,441.25
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	260,000.00	231,423.40
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	410,000.00	497,779.97
	4,720,000.00	5,044,771.40

FRANCE (GOVT OF) -5.0%-16/10/25			
FRANCE (GOVT OF) -3.75%-17/04/25	5,770,000.00	6,182,252.07	
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-17/10/25	4,650,000.00	5,122,672.50	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-18/04/25	4,770,000.00	5,314,602.82	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-18/05/25	3,700,000.00	3,809,199.21	
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-18/10/25	2,300,000.00	2,622,718.75	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-18/11/25	600,000.00	619,350.00	
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-19/04/25	4,900,000.00	5,672,174.83	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-19/05/25	1,370,000.00	1,414,958.87	
FRANCE (GOVT OF) -8.5%-19/10/25	1,050,000.00	1,425,330.37	
FRANCE (GOVT OF) -3.75%-19/10/25	4,500,000.00	5,183,622.00	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-19/11/25	700,000.00	707,651.00	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-20/04/25	5,270,000.00	6,072,594.65	
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-20/10/25	4,820,000.00	5,350,942.28	
FRANCE (GOVT OF) -3.75%-21/04/25	3,840,000.00	4,557,552.00	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-21/10/25	4,520,000.00	5,267,065.60	
FRANCE (GOVT OF) -3.0%-22/04/25	4,350,000.00	5,021,944.50	
FRANCE (GOVT OF) -2.25%-22/10/25	2,280,000.00	2,518,185.90	
FRANCE (GOVT OF) -8.5%-23/04/25	2,450,000.00	3,881,467.62	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-23/05/25	3,010,000.00	3,209,763.76	
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-23/10/25	4,050,000.00	5,125,218.30	
FRANCE (GOVT OF) -2.25%-24/05/25	2,430,000.00	2,677,374.00	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-24/11/25	1,900,000.00	2,004,072.50	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-25/05/25	1,110,000.00	1,035,105.52	
FRANCE (GOVT OF) -6.0%-25/10/25	2,300,000.00	3,368,758.25	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-26/04/25	3,920,000.00	4,778,538.80	
FRANCE (GOVT OF) -2.75%-27/10/25	3,380,000.00	3,853,324.04	
FRANCE (GOVT OF) -5.5%-29/04/25	3,220,000.00	4,784,211.60	
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-30/05/25	630,000.00	698,289.48	
FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	3,990,000.00	6,371,800.57	
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	2,470,000.00	3,649,127.61	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	2,710,000.00	3,722,835.40	
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	2,740,000.00	4,091,443.35	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	1,500,000.00	1,859,040.00	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	1,820,000.00	2,652,478.92	

FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	1,150,000.00	1,695,867.62
FRENCH TREASURY NOTE-2.5%-16/07/25	4,100,000.00	4,217,547.00
FRENCH TREASURY NOTE-1.75%-17/02/25	400,000.00	412,661.24
FRENCH TREASURY NOTE-1.0%-17/07/25	300,000.00	307,071.00
IRISH TREASURY-5.5%-17/10/18	730,000.00	819,471.20
IRISH TREASURY-4.5%-18/10/18	820,000.00	934,048.30
IRISH TREASURY-4.4%-19/06/18	900,000.00	1,042,949.25
IRISH TREASURY-5.9%-19/10/18	730,000.00	896,325.02
IRISH TREASURY-4.5%-20/04/18	1,350,000.00	1,595,079.00
IRISH TREASURY-5.0%-20/10/18	1,010,000.00	1,232,548.45
IRISH TREASURY-0.8%-22/03/15	160,000.00	157,905.07
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	650,000.00	774,093.64
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	870,000.00	1,006,379.02
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	1,300,000.00	1,736,769.71
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	540,000.00	565,497.01
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	550,000.00	490,525.75
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-16/07/15	2,150,000.00	2,244,755.87
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-17/01/15	2,000,000.00	2,083,620.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.5%-17/07/15	3,160,000.00	3,463,008.29
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-18/01/15	620,000.00	641,383.80
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	2,580,000.00	2,897,307.75
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-19/01/15	800,000.00	834,117.36
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	2,180,000.00	2,522,486.72
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-20/01/15	630,000.00	631,485.22
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	1,890,000.00	2,194,606.57
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	2,100,000.00	2,449,988.94
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	500,000.00	555,510.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	1,980,000.00	2,421,154.49
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	970,000.00	1,454,760.89
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	1,000,000.00	1,072,600.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	830,000.00	905,857.85
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	1,920,000.00	2,860,315.20
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	560,000.00	645,276.35
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,700,000.00	2,455,412.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	2,050,000.00	2,984,130.26

		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	820,000.00	1,018,636.80
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.0%-16/09/15	1,330,000.00	1,397,510.80
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.2%-17/02/20	1,100,000.00	1,160,846.50
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-17/09/15	960,000.00	1,053,889.92
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	1,440,000.00	1,614,518.78
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.15%-18/10/19	660,000.00	684,934.80
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	1,720,000.00	1,991,613.80
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.95%-19/06/18	320,000.00	343,142.17
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-19/10/18	350,000.00	350,616.87
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	1,460,000.00	1,722,596.91
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	1,610,000.00	1,904,022.22
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	1,000,000.00	1,200,850.00
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	1,100,000.00	1,310,155.00
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	890,000.00	950,030.50
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	400,000.00	420,986.00
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	810,000.00	1,106,262.36
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	850,000.00	1,316,216.50
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	500,000.00	561,092.50
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,360,000.00	1,963,676.80
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	630,000.00	817,643.92
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	430,000.00	675,671.90
		ユーロ小計	481,360,000.00	573,660,075.83 (79,635,491,726)
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-4.0%-16/09/07	2,740,000.00	2,853,142.27
		UK TREASURY-1.75%-17/01/22	2,050,000.00	2,084,930.77
		UK TREASURY-8.75%-17/08/25	2,060,000.00	2,418,846.85
		UK TREASURY-1.0%-17/09/07	1,150,000.00	1,154,945.00
		UK TREASURY-5.0%-18/03/07	2,760,000.00	3,062,682.30
		UK TREASURY-1.25%-18/07/22	2,750,000.00	2,762,879.07
		UK TREASURY-4.5%-19/03/07	2,970,000.00	3,323,749.27
		UK TREASURY-1.75%-19/07/22	1,700,000.00	1,724,412.00
		UK TREASURY-3.75%-19/09/07	2,150,000.00	2,359,157.37
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	3,160,000.00	3,631,493.17
		UK TREASURY-2.0%-20/07/22	1,300,000.00	1,325,124.71
		UK TREASURY-3.75%-20/09/07	2,200,000.00	2,439,462.74

		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	1,460,000.00	1,980,460.80	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	2,300,000.00	2,573,684.59	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	1,840,000.00	2,097,356.20	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	1,500,000.00	1,483,600.05	
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	2,850,000.00	2,894,901.75	
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	1,500,000.00	1,574,944.95	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	2,280,000.00	2,848,799.12	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	1,590,000.00	1,910,836.24	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	1,250,000.00	1,771,187.50	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	2,090,000.00	2,680,489.79	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	2,330,000.00	2,849,024.04	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	2,350,000.00	2,985,235.78	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,900,000.00	2,352,713.00	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,850,000.00	2,481,910.60	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,810,000.00	2,273,255.92	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	2,530,000.00	3,189,786.05	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	3,150,000.00	4,173,387.75	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,290,000.00	1,390,052.40	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	410,000.00	463,454.72	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	2,070,000.00	2,689,654.50	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	1,830,000.00	2,429,206.05	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,670,000.00	2,043,946.40	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	2,080,000.00	2,846,521.60	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,700,000.00	2,253,430.75	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	1,020,000.00	1,236,175.43	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	110,000.00	107,461.98	
英債券小計			73,750,000.00	86,722,303.48	(16,864,886,357)
スイス ラン	国債証券	SWITZERLAND-4.25%-17/06/05	770,000.00	848,694.00	
		SWITZERLAND-3.0%-18/01/08	400,000.00	439,900.00	
		SWITZERLAND-3.0%-19/05/12	400,000.00	458,080.00	
		SWITZERLAND-2.25%-20/07/06	400,000.00	455,940.00	
		SWITZERLAND-2.0%-21/04/28	100,000.00	113,970.00	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	1,620,000.00	2,132,163.00	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	230,000.00	336,191.92	

スイスフラン小計			3,920,000.00	4,784,938.92 (634,865,695)	
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-3.0%-16/07/12	6,350,000.00	6,574,155.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.75%-17/08/12	7,300,000.00	7,928,457.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	9,050,000.00	10,460,397.25	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	9,000,000.00	11,221,605.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	8,200,000.00	9,761,107.80	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	5,550,000.00	5,821,700.25	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	6,050,000.00	6,891,803.05	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	5,150,000.00	6,796,738.25	
スウェーデンクローナ小計			56,650,000.00	65,455,963.60 (984,457,692)	
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-4.25%-17/05/19	7,000,000.00	7,458,045.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	6,950,000.00	7,872,577.75	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	7,550,000.00	8,556,120.55	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	5,250,000.00	5,392,007.25	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	4,720,000.00	5,210,129.52	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	2,300,000.00	2,290,227.30	
ノルウェークローネ小計			33,770,000.00	36,779,107.37 (581,109,896)	
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	1,248,468.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-17/11/15	9,100,000.00	10,026,380.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	13,850,000.00	16,225,275.00	
		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	5,600,000.00	6,501,040.00	
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	8,000,000.00	8,477,592.00	
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	4,050,000.00	6,287,633.10	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	4,650,000.00	4,972,240.35	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	12,880,000.00	20,255,229.68	
デンマーククローネ小計			59,330,000.00	73,993,858.13 (1,377,025,699)	
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-16/07/25	850,000.00	834,615.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-16/10/25	2,800,000.00	2,908,920.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-17/04/25	2,100,000.00	2,207,310.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-17/07/25	800,000.00	768,720.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	2,720,000.00	2,920,192.00	

		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-18/04/25	1,800,000.00	1,878,480.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-18/07/25	2,700,000.00	2,720,925.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-19/07/25	2,600,000.00	2,677,870.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	2,400,000.00	2,693,280.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.5%-20/04/25	650,000.00	615,810.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	2,200,000.00	2,479,510.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	1,970,000.00	2,298,990.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	2,600,000.00	3,061,110.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	3,150,000.00	3,354,435.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	1,700,000.00	1,709,265.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	1,140,000.00	1,443,582.00	
ポーランドズロチ小計			32,180,000.00	34,573,014.00	(1,150,244,175)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-16/06/15	2,400,000.00	2,464,368.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.0%-17/02/15	2,330,000.00	2,480,280.34	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-17/07/21	2,100,000.00	2,194,649.10	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-18/01/21	2,200,000.00	2,391,094.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-18/10/21	1,080,000.00	1,120,373.64	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	2,220,000.00	2,468,422.44	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-19/10/21	1,060,000.00	1,082,307.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	2,450,000.00	2,693,973.45	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-20/11/21	200,000.00	192,741.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	2,530,000.00	2,977,759.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	2,000,000.00	2,389,580.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	2,370,000.00	2,814,941.43	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	2,250,000.00	2,213,487.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	1,760,000.00	1,789,638.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	1,770,000.00	1,949,026.65	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,610,000.00	1,856,410.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,110,000.00	1,098,975.48	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,040,000.00	1,174,047.68	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	470,000.00	410,554.40	
AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	790,000.00	798,366.10			
豪ドル小計			33,740,000.00	36,560,996.91	(3,495,596,914)

シンガ ポールド ル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.75%-16/09/01	800,000.00	826,538.40	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-17/04/01	830,000.00	850,662.93	
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-18/04/01	400,000.00	392,749.12	
		SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	510,000.00	552,564.39	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01	640,000.00	661,932.54	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-19/10/01	200,000.00	199,280.40	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	870,000.00	923,108.97	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	220,000.00	221,211.49	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	580,000.00	610,077.17	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	200,000.00	204,317.78	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	558,539.55	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	670,000.00	719,174.24	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	280,000.00	280,560.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	330,000.00	326,050.69	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	300,000.00	316,260.00	
SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	510,000.00	481,354.47			
シンガポールドル小計			7,880,000.00	8,124,382.14	(749,149,277)
マレーシ アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	300,000.00	302,490.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	460,000.00	457,769.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	510,000.00	527,436.90	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.172%-16/07/15	920,000.00	922,474.80	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.262%-16/09/15	2,150,000.00	2,184,593.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.814%-17/02/15	1,900,000.00	1,923,807.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.012%-17/09/15	2,900,000.00	2,950,634.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	3,100,000.00	3,166,960.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.26%-18/03/01	200,000.00	199,980.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.58%-18/09/28	700,000.00	702,688.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	1,700,000.00	1,834,844.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	3,500,000.00	3,608,290.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.492%-20/03/31	350,000.00	346,535.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.889%-20/07/31	500,000.00	503,645.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	2,700,000.00	2,745,171.00	
MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	650,000.00	627,640.00			
MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,750,000.00	1,685,775.00			

		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	650,000.00	656,175.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,270,000.00	1,297,724.10	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	439,002.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	850,000.00	794,495.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	430,000.00	411,123.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000.00	824,062.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	860,000.00	889,738.80	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	950,000.00	928,273.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	600,000.00	560,724.00	
		マレーシアリングット小計	31,100,000.00	31,492,051.10 (1,036,403,401)	
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 17/09/15	6,700,000.00	6,843,802.10	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 18/12/21	7,300,000.00	7,406,365.38	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	8,700,000.00	8,537,897.68	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	8,100,000.00	7,681,323.15	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	6,500,000.00	6,376,629.35	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	16,600,000.00	19,377,092.85	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	2,000,000.00	1,899,233.20	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	11,150,000.00	9,579,062.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	3,700,000.00	3,548,845.93	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	11,300,000.00	8,597,479.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	6,100,000.00	5,911,113.18	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	8,800,000.00	6,741,993.28	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	2,850,000.00	2,804,651.37	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	9,600,000.00	9,468,391.19	
			109,400,000.00	104,773,879.66	

南アフリカランド小計		(1,068,693,572)	
合計		197,188,569,199	(197,188,569,199)

(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 116銘柄	100.0%	42.0%
加ドル	国債証券 33銘柄	100.0%	2.3%
メキシコペソ	国債証券 19銘柄	100.0%	1.1%
ユーロ	国債証券 250銘柄	100.0%	40.4%
英ポンド	国債証券 38銘柄	100.0%	8.6%
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 8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 16銘柄	100.0%	0.6%
豪ドル	国債証券 20銘柄	100.0%	1.8%
シンガポールドル	国債証券 16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%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 14銘柄	100.0%	0.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

海外新興国債券インデックスLocal(ヘッジなし)マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	平成26年12月25日現在	平成27年 6月25日現在
資産の部		
流動資産		
預金	24,177,257	18,978,105
コール・ローン	13,321,236	17,978,405
国債証券	1,903,760,312	2,036,817,774
特殊債券	9,553,082	9,613,302
派生商品評価勘定	-	545
未収利息	32,827,297	33,839,796
前払費用	6,764,473	6,223,118
流動資産合計	1,990,403,657	2,123,451,045
資産合計	1,990,403,657	2,123,451,045
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	40,048
未払金	-	10,081,686
未払解約金	593,209	1,613,318
流動負債合計	593,209	11,735,052
負債合計	593,209	11,735,052
純資産の部		
元本等		
元本	1,435,455,462	1,552,174,295
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	554,354,986	559,541,698
元本等合計	1,989,810,448	2,111,715,993
純資産合計	1,989,810,448	2,111,715,993
負債純資産合計	1,990,403,657	2,123,451,045

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>国債証券及び特殊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>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価	為替予約取引

方法	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26年12月25日現在	平成27年 6月25日現在
1.	期首	平成26年 6月26日	平成26年12月26日
	期首元本額	1,322,757,271円	1,435,455,462円
	期首からの追加設定元本額	194,339,833円	202,347,907円
	期首からの一部解約元本額	81,641,642円	85,629,074円
	元本の内訳		
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	34,316,833円	34,956,122円
	インデックスファンド海外新興国（エマージング）債券（1年決算型）	1,401,138,629円	1,517,218,173円
	計	1,435,455,462円	1,552,174,295円
2.	受益権の総数	1,435,455,462口	1,552,174,295口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成26年 6月26日 至 平成26年12月25日	自 平成26年12月26日 至 平成27年 6月25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12月25日現在	平成27年 6月25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 「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 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12月25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	6,213,278
特殊債券	188,336
合計	6,401,614

(平成27年 6月25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	22,178,841
特殊債券	23,661

合計	22,202,502
----	------------

(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12月25日現在)

該当事項はありません。

(平成27年 6月25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	10,557,791	-	10,518,626	39,165
	米ドル	2,683,091	-	2,683,102	11
	ブラジルレアル	4,880,975	-	4,850,968	30,007
	マレーシアリング	2,993,725	-	2,984,556	9,169
	売建	5,086,526	-	5,086,864	338
	米ドル	4,880,975	-	4,880,581	394
	ルーマニアレイ	205,551	-	206,283	732
合計		15,644,317	-	15,605,490	39,503

(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12月25日現在		平成27年 6月25日現在	
1口当たり純資産額	1.3862円	1口当たり純資産額	1.3605円
(1万口当たり純資産額)	(13,862円)	(1万口当たり純資産額)	(13,605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
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%- 16/12/15	1,300,000.00	1,363,030.63	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-17/06/15	1,250,000.00	1,271,088.43	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 17/12/14	1,730,000.00	1,869,445.95	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-4.75%- 18/06/14	2,400,000.00	2,408,582.04	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-18/12/13	1,460,000.00	1,631,352.60	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11	800,000.00	792,630.08	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	970,000.00	1,083,446.10	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	1,350,000.00	1,411,688.52	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	1,050,000.00	1,089,092.39	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	930,000.00	1,050,280.15	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	2,310,000.00	2,957,555.02	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	930,000.00	1,019,480.36	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	1,060,000.00	1,259,165.62	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	1,400,000.00	1,560,525.54	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	580,000.00	645,575.98	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	680,000.00	931,195.53	
MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	1,000,000.00	1,195,356.45			

		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	1,570,000.00	1,748,493.22	
メキシコペソ小計			22,770,000.00	25,287,984.61 (202,050,997)	
ブラジル リアル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL-10.25%-28/01/10	250,000.00	265,000.00	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-16/07/01	630,000.00	549,801.00	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-16/10/01	380,000.00	320,796.00	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-17/01/01	550,000.00	450,835.00	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-17/07/01	570,000.00	440,553.00	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-18/01/01	560,000.00	409,248.00	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-18/07/01	450,000.00	310,545.00	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-19/01/01	260,000.00	169,442.00	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL-10.0%-17/01/01	830,000.00	787,828.89	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL-10.0%-18/01/01	200,000.00	187,098.28	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL-10.0%-19/01/01	100,000.00	92,339.14	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL-10.0%-21/01/01	590,000.00	531,289.94	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL-10.0%-23/01/01	460,000.00	406,682.05	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL-10.0%-25/01/01	490,000.00	425,756.79	
ブラジルリアル小計			6,320,000.00	5,347,215.09 (213,781,659)	
チリペソ	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP-4.25%-16/02/05	10,000,000.00	10,047,000.00	
チリペソ小計			10,000,000.00	10,047,000.00 (1,967,202)	
コロンビア ペソ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA-7.75%-21/04/14	60,000,000.00	66,144,897.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA-4.375%-23/03/21	30,000,000.00	27,258,600.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA-9.85%-27/06/28	47,000,000.00	58,402,435.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-5.0%-18/11/21	250,000,000.00	246,953,750.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-19/09/11	337,000,000.00	351,388,215.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-11.0%-20/07/24	315,000,000.00	381,166,206.75	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-22/05/04	300,000,000.00	302,478,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-10.0%-24/07/24	625,000,000.00	739,531,250.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.5%-26/08/26	220,000,000.00	217,650,400.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-6.0%-28/04/28	330,000,000.00	283,247,250.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.75%-30/09/18	130,000,000.00	127,569,000.00	
コロンビアペソ小計			2,644,000,000.00	2,801,790,003.75 (135,606,636)	
ペルーヌ エボソル	国債証券	BONOS DE TESORERIA-5.2%-23/09/12	60,000.00	55,810.83	
		BONOS DE TESORERIA-5.7%-24/08/12	40,000.00	38,110.76	

		PERU BONO SOBERANO-8.6%-17/08/12	60,000.00	65,625.27
		PERU BONO SOBERANO-7.84%-20/08/12	230,000.00	256,082.57
		PERU BONO SOBERANO-8.2%-26/08/12	130,000.00	145,746.05
		PERU BONO SOBERANO-6.95%-31/08/12	260,000.00	256,695.40
		PERU BONO SOBERANO-6.9%-37/08/12	130,000.00	125,834.21
ペルーヌエボソル小計			910,000.00	943,905.09 (36,859,493)
トルコリラ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND-8.2%-16/07/13	140,000.00	137,613.00
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.2%-16/11/16	240,000.00	235,439.97
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.0%-17/03/08	300,000.00	297,000.00
		TURKEY GOVERNMENT BOND-6.3%-18/02/14	320,000.00	296,960.00
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.3%-18/06/20	330,000.00	320,430.00
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.8%-18/11/14	360,000.00	353,516.40
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.4%-19/03/27	230,000.00	237,130.00
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.5%-19/07/10	390,000.00	379,860.00
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.5%-20/01/15	295,000.00	309,602.50
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.5%-22/01/12	230,000.00	230,859.97
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.5%-22/09/14	240,000.00	230,520.00
		TURKEY GOVERNMENT BOND-7.1%-23/03/08	430,000.00	380,120.00
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.8%-23/09/27	350,000.00	341,425.00
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.4%-24/03/20	190,000.00	203,490.00
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.0%-24/07/24	320,000.00	316,000.00
トルコリラ小計			4,365,000.00	4,269,966.84 (197,571,365)
ハンガリーフォリント	国債証券	HUNGARY GOVERNMENT BOND-5.5%-16/12/22	12,000,000.00	12,795,960.00
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.75%-17/02/24	13,800,000.00	15,008,259.00
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.75%-17/11/24	21,200,000.00	23,811,098.00
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-4.0%-18/04/25	7,000,000.00	7,383,180.00
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-5.5%-18/12/20	20,000,000.00	22,195,100.00
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.5%-19/06/24	25,300,000.00	28,998,101.00
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.5%-20/06/24	11,000,000.00	11,277,145.00
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-7.5%-20/11/12	26,200,000.00	31,913,696.00
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-7.0%-22/06/24	22,300,000.00	26,915,542.50
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.0%-23/11/24	22,500,000.00	26,089,987.50
HUNGARY GOVERNMENT BOND-5.5%-25/06/24	14,000,000.00	15,886,850.00		
ハンガリーフォリント小計			195,300,000.00	222,274,919.00 (99,156,841)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-16/07/25	170,000.00	166,923.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-16/10/25	510,000.00	529,839.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-17/04/25	320,000.00	336,352.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	530,000.00	569,008.00

		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-18/04/25	430,000.00	448,748.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-18/07/25	490,000.00	493,797.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-19/07/25	520,000.00	535,574.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	450,000.00	504,990.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.5%-20/04/25	310,000.00	293,694.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	330,000.00	371,926.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	400,000.00	466,800.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	430,000.00	506,260.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	640,000.00	681,536.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	370,000.00	372,016.50	
ポーランドズロチ小計			5,900,000.00	6,277,465.00	(208,851,260)
ロシア ルーブル	国債証券	RUSSIA FOREIGN BOND-7.85%-18/03/10	5,000,000.00	4,622,525.00	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-6.9%-16/08/03	3,500,000.00	3,375,750.00	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-7.4%-17/04/19	3,800,000.00	3,607,587.00	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-7.4%-17/06/14	3,000,000.00	2,838,000.00	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-6.2%-18/01/31	3,000,000.00	2,700,015.00	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-7.5%-18/03/15	3,500,000.00	3,234,000.00	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-7.5%-19/02/27	4,000,000.00	3,612,900.00	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-6.7%-19/05/15	2,200,000.00	1,922,811.00	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-6.8%-19/12/11	4,000,000.00	3,458,020.00	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-7.6%-21/04/14	3,900,000.00	3,381,319.50	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-7.6%-22/07/20	3,000,000.00	2,550,015.00	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-7.0%-23/01/25	2,700,000.00	2,195,113.50	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-7.0%-23/08/16	3,800,000.00	3,053,300.00	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-8.15%-27/02/03	3,500,000.00	2,952,250.00	
RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-7.05%-28/01/19	5,000,000.00	3,812,975.00			
ロシアルーブル小計			53,900,000.00	47,316,581.00	(107,881,804)
ルーマニ アレイ	国債証券	ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.75%-16/08/29	100,000.00	103,633.50	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-6.75%-17/06/11	140,000.00	152,962.60	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.9%-17/07/26	400,000.00	432,348.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.6%-18/11/28	100,000.00	110,699.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.75%-19/06/24	140,000.00	151,060.70	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.75%-20/04/29	110,000.00	123,802.25	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.95%-21/06/11	220,000.00	251,197.10	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.85%-23/04/26	190,000.00	215,666.15	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.75%-25/02/24	120,000.00	127,666.20	

ルーマニアレイ小計			1,520,000.00	1,669,035.50 (51,790,171)	
マレーシア アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.394%-17/03/15	260,000.00	261,302.05	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.654%-19/10/31	310,000.00	310,303.80	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.659%-20/10/15	150,000.00	150,295.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	250,000.00	252,075.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	50,000.00	49,522.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	120,000.00	119,418.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.172%-16/07/15	260,000.00	260,699.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.262%-16/09/15	270,000.00	274,344.30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.012%-17/09/15	330,000.00	335,761.80	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.314%-17/10/31	270,000.00	270,866.70	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	380,000.00	388,208.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.26%-18/03/01	220,000.00	219,978.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.58%-18/09/28	250,000.00	250,960.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	220,000.00	237,450.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	380,000.00	391,757.20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.492%-20/03/31	310,000.00	306,931.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.889%-20/07/31	180,000.00	181,312.20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	310,000.00	315,186.30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	260,000.00	251,056.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	250,000.00	240,825.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	280,000.00	282,660.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	210,000.00	214,584.30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	130,000.00	126,822.80	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	110,000.00	105,171.00	
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	220,000.00	227,607.60			
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	130,000.00	127,026.90			
MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	110,000.00	102,799.40			
マレーシアアリンギット小計			6,220,000.00	6,254,925.15 (205,849,586)	
タイバー ツ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND-4.125%- 16/11/18	1,400,000.00	1,451,126.04	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.25%- 17/06/16	5,550,000.00	5,737,309.17	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.8%- 17/10/10	1,800,000.00	1,848,111.12	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-5.125%- 18/03/13	2,200,000.00	2,395,544.14	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.45%- 19/03/08	1,600,000.00	1,678,723.52	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.875%- 19/06/13	7,450,000.00	7,926,206.23	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.65%- 21/12/17	6,220,000.00	6,577,567.27	

		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.625%- 23/06/16	4,500,000.00	4,737,663.90	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-4.75%- 24/12/20	960,000.00	1,099,655.04	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.85%- 25/12/12	4,320,000.00	4,648,987.87	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.58%- 27/12/17	1,550,000.00	1,601,590.97	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-4.875%- 29/06/22	2,500,000.00	2,908,859.50	
タイバーツ小計			40,050,000.00	42,611,344.77 (155,957,521)	
フィリピン	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK-5.0%- 15/08/03	2,800,000.00	2,780,400.00	
フィリピン小計			2,800,000.00	2,780,400.00 (7,646,100)	
インドネシアルピア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT-7.375%-16/09/15	400,000,000.00	399,925,800.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.25%-17/04/15	300,000,000.00	292,182,960.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-10.0%-17/07/15	250,000,000.00	259,388,575.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-5.25%-18/05/15	500,000,000.00	464,768,950.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.875%-19/04/15	1,100,000,000.00	1,092,595,460.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-20/11/15	500,000,000.00	560,385,550.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-12.8%-21/06/15	500,000,000.00	606,528,850.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-21/07/15	600,000,000.00	600,929,100.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-22/05/15	850,000,000.00	795,540,755.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-5.625%-23/05/15	1,100,000,000.00	935,310,420.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-24/03/15	2,350,000,000.00	2,372,191,285.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-25/09/15	760,000,000.00	903,173,816.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-26/09/15	580,000,000.00	584,121,596.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-27/05/15	600,000,000.00	541,707,600.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.125%-28/05/15	800,000,000.00	661,616,560.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.0%-29/03/15	2,100,000,000.00	2,220,299,760.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-10.5%-30/08/15	550,000,000.00	646,440,465.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.5%-31/07/15	820,000,000.00	894,642,714.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-32/06/15	1,350,000,000.00	1,322,384,535.00	
INDONESIA GOVERNMENT-6.625%-33/05/15	1,000,000,000.00	828,628,900.00			
INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-34/03/15	1,950,000,000.00	1,947,092,550.00			
インドネシアルピア小計			18,960,000,000.00	18,929,856,201.00 (177,940,648)	
南アフリカランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 17/09/15	1,410,000.00	1,440,262.83	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 18/12/21	1,700,000.00	1,724,770.02	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	1,960,000.00	1,923,480.39	

		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	1,610,000.00	1,526,781.51	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	1,200,000.00	1,177,223.88	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	3,000,000.00	3,501,884.25	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	1,020,000.00	968,608.93	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	1,840,000.00	1,580,760.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	800,000.00	767,318.04	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	1,790,000.00	1,361,901.54	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	1,200,000.00	1,162,841.93	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	1,640,000.00	1,256,462.38	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	1,790,000.00	1,765,460.43	
南アフリカランド小計			20,960,000.00	20,157,756.13 (205,609,112)	
ナイジェリアナイラ	国債証券	NIGERIA GOVERNMENT BOND-13.05%- 16/08/16	10,500,000.00	10,425,450.00	
		NIGERIA GOVERNMENT BOND-15.1%- 17/04/27	9,500,000.00	9,681,450.00	
		NIGERIA GOVERNMENT BOND-16.0%- 19/06/29	9,000,000.00	9,524,250.00	
		NIGERIA GOVERNMENT BOND-14.2%- 24/03/14	8,000,000.00	8,130,400.00	
		NIGERIA TREASURY BOND-7.0%-19/10/23	7,000,000.00	5,400,500.00	
		NIGERIA TREASURY BOND-16.39%-22/01/27	16,100,000.00	17,699,535.00	
ナイジェリアナイラ小計			60,100,000.00	60,861,585.00 (37,910,681)	
合計				2,046,431,076 (2,046,431,076)	

(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
メキシコペソ	国債証券 18銘柄	100.0%	9.9%
ブラジルレアル	国債証券 14銘柄	100.0%	10.4%
チリペソ	特殊債券 1銘柄	100.0%	0.1%
コロンビアペソ	国債証券 11銘柄	100.0%	6.6%
ペルーヌエボソル	国債証券 7銘柄	100.0%	1.8%

トルコリラ	国債証券	15銘柄	100.0%	9.7%
ハンガリーフォリント	国債証券	11銘柄	100.0%	4.8%
ポーランドズロチ	国債証券	14銘柄	100.0%	10.2%
ロシアルーブル	国債証券	15銘柄	100.0%	5.3%
ルーマニアレイ	国債証券	9銘柄	100.0%	2.5%
マレーシアリングット	国債証券	27銘柄	100.0%	10.1%
タイバーツ	国債証券	12銘柄	100.0%	7.6%
フィリピンペソ	特殊債券	1銘柄	100.0%	0.4%
インドネシアルピア	国債証券	21銘柄	100.0%	8.7%
南アフリカランド	国債証券	13銘柄	100.0%	10.0%
ナイジェリアナイラ	国債証券	6銘柄	100.0%	1.9%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2015年 7月31日現在です。

【全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型】

【純資産額計算書】

資産総額	229,520,687円
負債総額	167,473円
純資産総額(-)	229,353,214円
発行済口数	219,012,086口
1口当たり純資産額(/)	1.0472円

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	29,162,366,049円
負債総額	88,123,103円
純資産総額(-)	29,074,242,946円
発行済口数	20,861,779,563口
1口当たり純資産額(/)	1.3937円

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	83,842,284,784円
負債総額	67,225,782円
純資産総額(-)	83,775,059,002円
発行済口数	39,300,294,093口
1口当たり純資産額(/)	2.1317円

海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし)マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	10,246,317,107円
負債総額	77,787,970円
純資産総額（ - ）	10,168,529,137円
発行済口数	6,448,057,599口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5770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	36,016,505,914円
負債総額	393,281,817円
純資産総額（ - ）	35,623,224,097円
発行済口数	26,825,670,517口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3280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	197,603,086,090円
負債総額	161,294,459円
純資産総額（ - ）	197,441,791,631円
発行済口数	83,210,208,735口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3728円

海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	2,094,994,277円
負債総額	15,802,418円
純資産総額（ - ）	2,079,191,859円
発行済口数	1,584,208,398口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3124円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

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、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求を行なわな

いものとしてします。

(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てします。
- ・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てします。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てします。
- ・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てします。

(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てします。

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解約請求の受付、解約金および償還金の支払いなどについては、約款の規定によるほか、民法その他の法令などにしたがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

平成27年7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7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7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7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	576	120,318

株式投資信託	520	93,325
単位型	96	2,861
追加型	424	90,464
公社債投資信託	56	26,992
単位型	40	395
追加型	16	26,597
投資法人合計	1	12

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。
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。

（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
有価証券		234
前払費用	3	419
未収入金		37
未収委託者報酬		7,162
未収収益	3	608
関係会社短期貸付金		240
立替金		303
繰延税金資産		984
その他	2	30
流動資産合計		27,826
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	47
器具備品	1	134
有形固定資産合計		181
無形固定資産		
ソフトウェア		91
無形固定資産合計		91
投資その他の資産		
投資有価証券		7,290
関係会社株式		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
その他未払金		542	
未払費用	3	3,239	3
未払法人税等		2,286	
未払消費税等	4	356	4
賞与引当金		1,935	
役員賞与引当金		150	
その他		-	3
流動負債合計		11,702	
固定負債			
退職給付引当金		1,081	
その他		55	
固定負債合計		1,137	
負債合計		12,840	
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		22,694	
利益剰余金合計		22,694	
自己株式		68	
株主資本合計		45,209	
評価・換算差額等			
その他有価証券評価差額金		321	
繰延ヘッジ損益		-	
評価・換算差額等合計		321	

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

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

（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>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>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>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>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 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>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-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。

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	1,101
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%		

<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。</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>
--	--

(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。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (平成27年3月末現在)	事業の内容
農林中央金庫	3,425,909百万円	全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
日興アセットマネジメント株式会社	17,363百万円	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。

2 【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

(2) 販売会社

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

3 【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3 【その他】

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

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

委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日
 ファンドの基本的性格など
 委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など
 委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など
 目論見書の使用開始日

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

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

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。

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

「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。

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

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

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

「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

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

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。

有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。

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

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

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

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

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

独立監査人の監査報告書

平成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7月29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」に掲げられている全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型の平成26年12月26日から平成27年6月25日までの特定期間の財務諸表、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、全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型の平成27年6月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定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。