

## 【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年3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。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

有価証券報告書を提出しましたので平成27年 9月25日付をもって提出しました有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出します。

## 2【訂正の内容】

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

<更新後>

ファンドの特色

#### **1 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12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47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】 トルコ、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、南アフリカ
- (24の国と地域)

●上図は2015年12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。

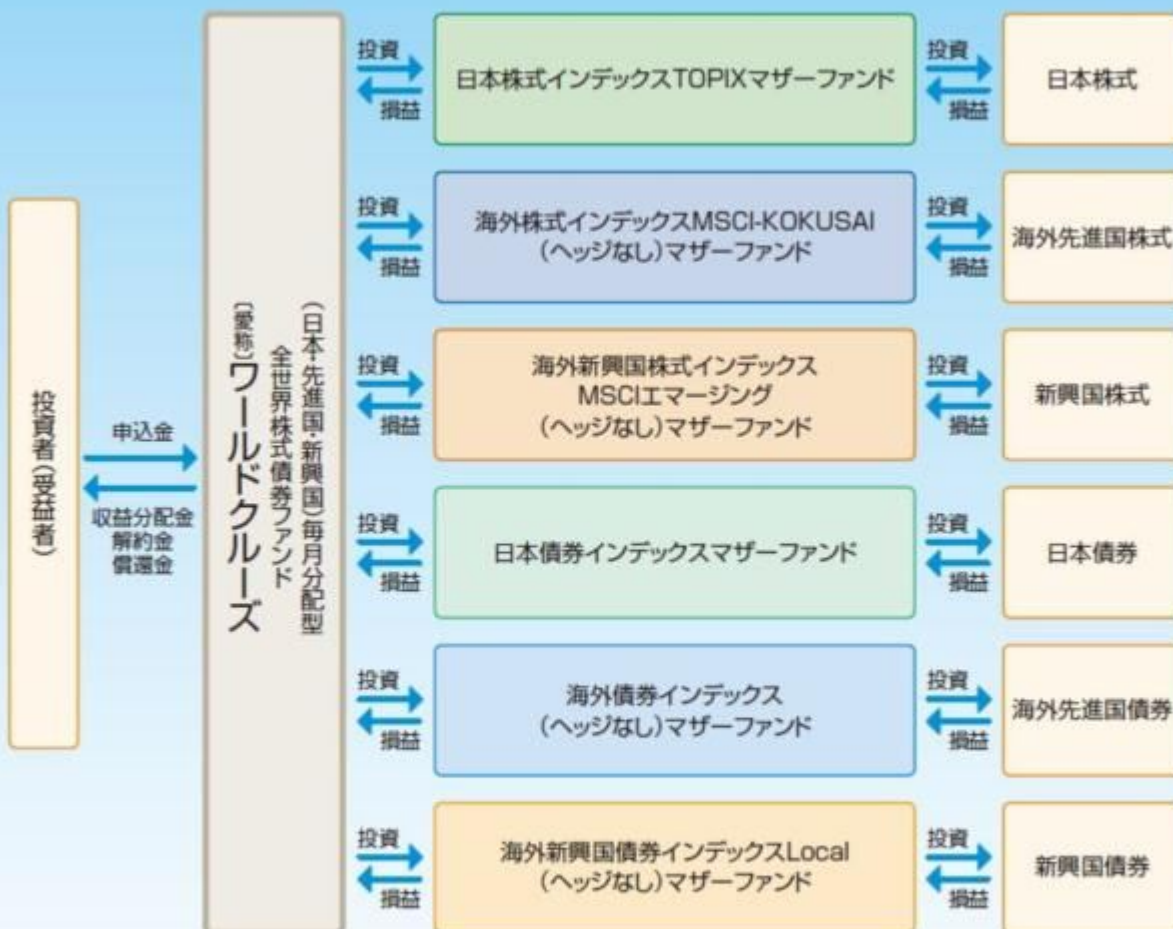
## (参考)グローバル分散投資の意義 ～ワールドクルーズをめざすもの～

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。

## 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。

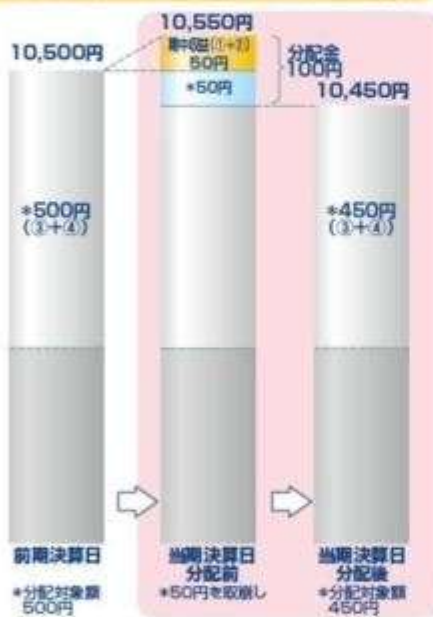
### 投資信託で分配金が支払われるイメージ



- 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。

## (3) 【ファンドの仕組み】

< 更新後 >

委託会社の概況（平成27年12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%

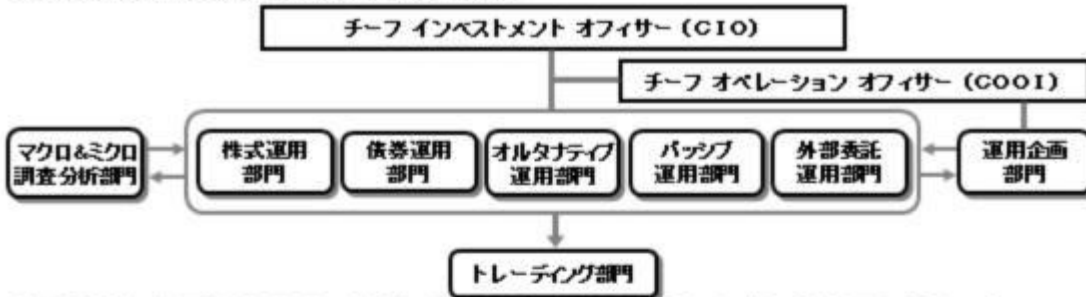
## 2 【投資方針】

## (3) 【運用体制】

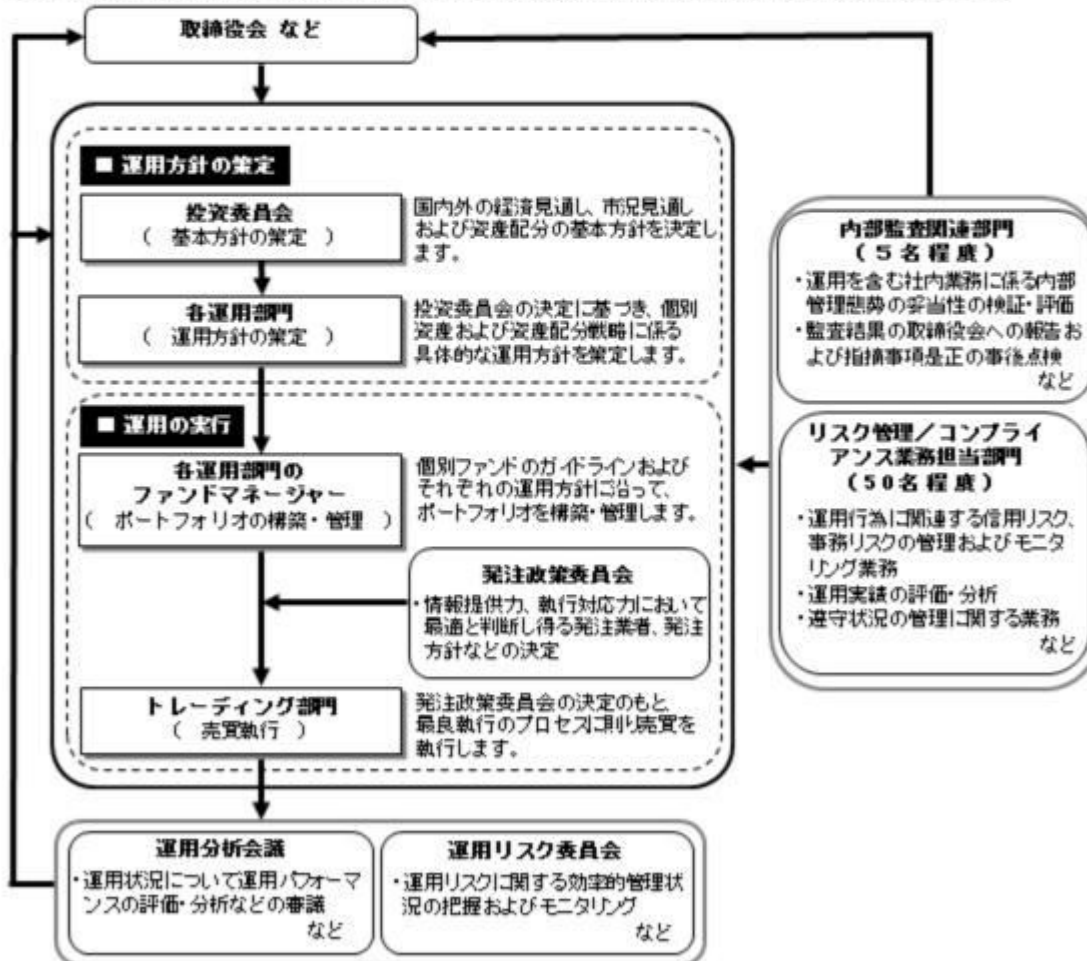
&lt;更新後&gt;



◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



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

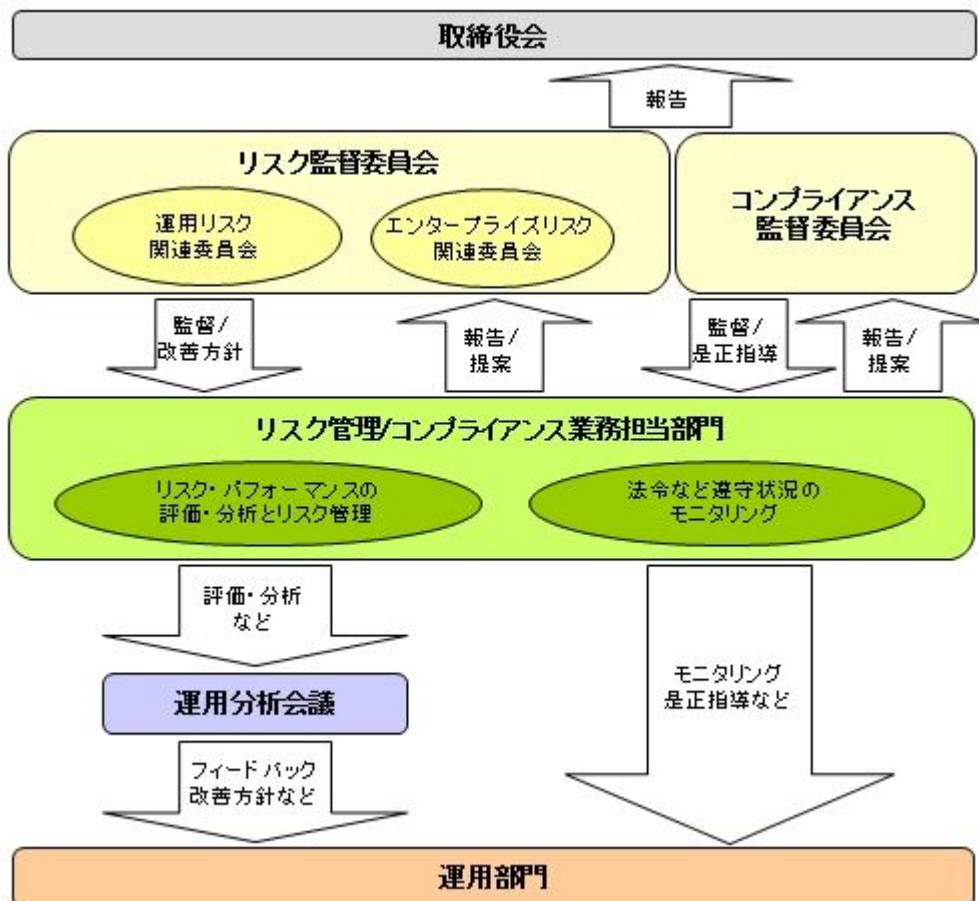
「受託会社」に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っております。また、独立した監査法人が所定の手続きで受託業務について監査を行っており、内部統制が有効に機能している旨の監査報告書を定期的に受け取っております。

上記体制は平成27年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

### 3【投資リスク】

<更新後>

#### (2) リスク管理体制



### 全社リスク管理

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

### 運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

### 法令など遵守状況のモニタリング

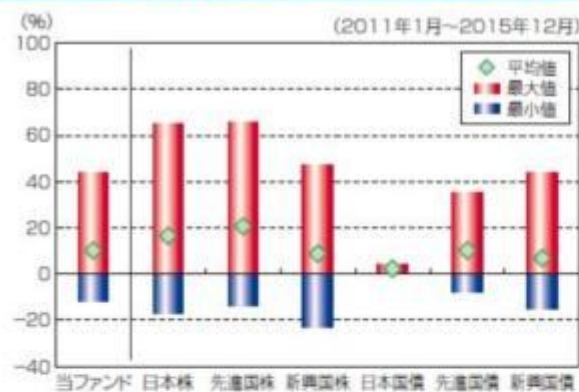
運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は平成27年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

< 更新後 >

## (参考情報)

## 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	10.2%	16.6%	20.7%	8.8%	2.3%	10.2%	6.9%
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%	-7.9%	-15.0%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2011年1月から2015年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

## &lt;各資産クラスの指数&gt;

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、2011年1月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

日本国債……NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス国債

先進国債……シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債……JPモルガンGBI-EMグローバル・レティバース・ファイブ(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】

#### （5）【課税上の取扱い】

##### <更新後>

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

個人受益者の場合

##### 1) 収益分配金に対する課税

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

##### 2) 解約金および償還金に対する課税

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

<sup>\*</sup>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せん。）を控除した利益

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、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

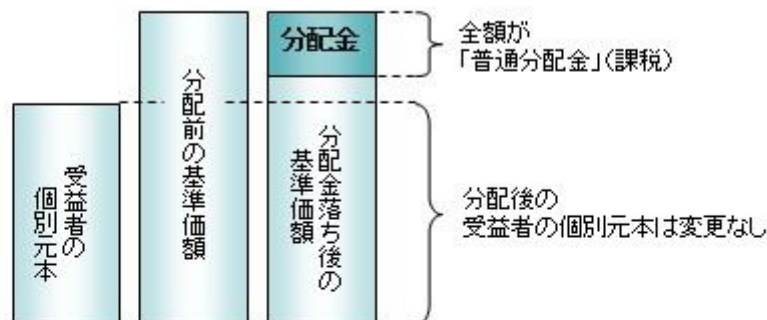
値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

#### 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

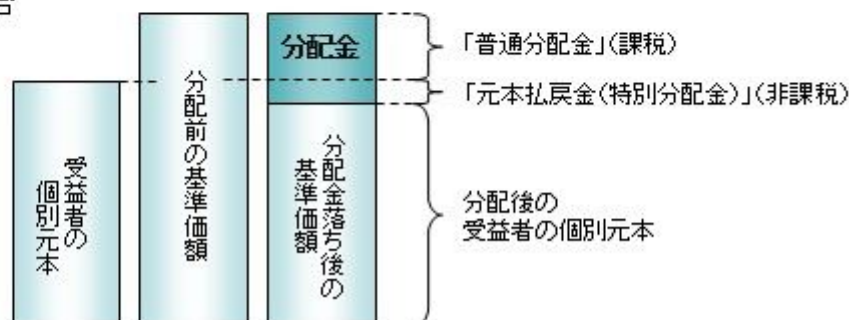
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
  - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
  - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
  - 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28年 3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12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### (1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	212,406,671	98.69
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		2,824,462	1.31
合計(純資産総額)		215,231,133	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	海外株式インデックスMSCI-K OKUSAI（ヘッジなし）マザー ファンド	29,624,898	1.9807	58,678,035	2.0034	59,350,520	27.58
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	24,381,671	2.2965	55,992,816	2.2984	56,038,832	26.04
日本	親投資信託受益証券	海外新興国株式インデックスMSC Iエマージング（ヘッジなし）マ ザーファンド	30,612,308	1.3867	42,450,087	1.3827	42,327,638	19.67
日本	親投資信託受益証券	海外新興国債券インデックスLoc al（ヘッジなし）マザーファンド	35,207,310	1.1765	41,421,693	1.1822	41,622,081	19.34
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	5,069,553	1.2839	6,508,799	1.3118	6,650,239	3.09
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	4,764,896	1.3459	6,413,073	1.3468	6,417,361	2.98

## 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
第16特定期間末	(2015年12月25日)	214	214	0.9573	0.9593
	2014年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	
	8月末日	215		0.9815	
	9月末日	207		0.9366	
	10月末日	221		0.9926	
	11月末日	221		0.9905	
	12月末日	215		0.9614	

(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
第16特定期間	2015年 6月26日～2015年12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
第16特定期間	2015年 6月26日～2015年12月25日	10.32

(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
第16特定期間	2015年6月26日～2015年12月25日	9,228,365	8,691,229

(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TOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2015年12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	27,252,364,520	99.56
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		120,554,384	0.44
合計(純資産総額)		27,372,918,904	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	108,325,000	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	147,800	7,560.00	1,117,368,000	7,488.00	1,106,726,400	4.04
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	943,900	789.80	745,492,220	757.10	714,626,690	2.61
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	90,900	4,575.00	415,867,500	4,836.00	439,592,400	1.61
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	94,200	4,893.35	460,953,570	4,606.00	433,885,200	1.59
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	107,300	4,087.00	438,535,100	3,910.00	419,543,000	1.53
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	66,700	6,663.48	444,454,116	6,139.00	409,471,300	1.50

日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,656,900	248.40	411,573,960	243.50	403,455,150	1.47
日本	株式	KDDI	情報・通信業	119,500	2,929.00	350,015,500	3,154.00	376,903,000	1.38
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	79,000	4,229.00	334,091,000	4,471.00	353,209,000	1.29
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	49,700	5,788.10	287,668,570	6,065.00	301,430,500	1.10
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	49,200	5,375.00	264,450,000	5,550.00	273,060,000	1.00
日本	株式	ファナック	電気機器	12,200	20,400.00	248,880,000	21,080.00	257,176,000	0.94
日本	株式	ソニー	電気機器	84,100	3,507.00	294,938,700	3,002.00	252,468,200	0.92
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	21,800	11,450.00	249,610,000	11,450.00	249,610,000	0.91
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	139,800	1,684.00	235,423,200	1,731.50	242,063,700	0.88
日本	株式	キヤノン	電気機器	64,200	3,812.00	244,730,400	3,675.00	235,935,000	0.86
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	10,700	21,560.00	230,692,000	21,600.00	231,120,000	0.84
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	90,700	2,337.50	212,011,250	2,484.00	225,298,800	0.82
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	47,700	4,793.00	228,626,100	4,712.00	224,762,400	0.82
日本	株式	村田製作所	電気機器	12,500	17,170.00	214,625,000	17,570.00	219,625,000	0.80
日本	株式	三菱地所	不動産業	87,000	2,596.50	225,895,500	2,523.50	219,544,500	0.80
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	167,300	1,244.50	208,204,850	1,279.50	214,060,350	0.78
日本	株式	日立製作所	電気機器	304,000	728.77	221,546,080	691.50	210,216,000	0.77
日本	株式	花王	化学	33,600	5,913.00	198,676,800	6,255.00	210,168,000	0.77
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	37,700	4,639.00	174,890,300	5,027.00	189,517,900	0.69
日本	株式	三井不動産	不動産業	62,000	3,339.00	207,018,000	3,056.00	189,472,000	0.69
日本	株式	キーエンス	電気機器	2,700	59,850.00	161,595,000	67,080.00	181,116,000	0.66
日本	株式	三菱商事	卸売業	88,300	2,269.00	200,352,700	2,028.00	179,072,400	0.65
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	42,100	4,420.00	186,082,000	4,174.00	175,725,400	0.64
日本	株式	デンソー	輸送用機器	29,500	5,858.00	172,811,000	5,818.00	171,631,000	0.63

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.35
		建設業	2.91
		食料品	4.57
		繊維製品	0.73
		パルプ・紙	0.23
		化学	6.02
		医薬品	5.36
		石油・石炭製品	0.48
		ゴム製品	0.88
		ガラス・土石製品	0.94
		鉄鋼	1.23
		非鉄金属	0.90
		金属製品	0.65
機械	4.55		

	電気機器	11.71
	輸送用機器	10.69
	精密機器	1.55
	その他製品	1.48
	電気・ガス業	2.11
	陸運業	4.41
	海運業	0.25
	空運業	0.65
	倉庫・運輸関連業	0.20
	情報・通信業	7.43
	卸売業	3.97
	小売業	4.78
	銀行業	9.09
	証券、商品先物取引業	1.16
	保険業	2.62
	その他金融業	1.33
	不動産業	2.72
	サービス業	3.52
合 計		99.56

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2016年03月	買建		7日本円	107,355,780	108,325,000	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12月30日現在です。

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

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	44,975,045,033	58.14
	カナダ	2,499,591,362	3.23
	モーリシャス	3,774,238	0.00
	ドイツ	2,876,146,807	3.72
	イタリア	672,983,646	0.87

	フランス	2,802,858,351	3.62
	オランダ	1,255,685,029	1.62
	スペイン	1,017,089,082	1.31
	ベルギー	463,410,707	0.60
	オーストリア	56,623,093	0.07
	ルクセンブルク	67,481,642	0.09
	フィンランド	289,389,368	0.37
	アイルランド	1,292,874,814	1.67
	ポルトガル	47,552,574	0.06
	イギリス	5,782,132,915	7.47
	スイス	3,147,148,352	4.07
	スウェーデン	879,656,802	1.14
	ノルウェー	168,967,203	0.22
	デンマーク	593,903,698	0.77
	ケイマン	167,919,493	0.22
	オーストラリア	1,879,536,205	2.43
	バミューダ	139,348,519	0.18
	ニュージーランド	37,787,194	0.05
	香港	734,943,983	0.95
	シンガポール	467,988,101	0.60
	イスラエル	216,504,853	0.28
	ジャージー	335,667,947	0.43
	英ヴァージン諸島	16,619,286	0.02
	小計	72,888,630,297	94.22
投資証券	アメリカ	1,455,128,121	1.88
	カナダ	11,275,826	0.01
	フランス	102,507,277	0.13
	イギリス	105,925,998	0.14
	オーストラリア	218,673,450	0.28
	香港	34,505,856	0.04
	シンガポール	25,081,980	0.03
	小計	1,953,098,508	2.52
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		2,520,272,482	3.26
合計（純資産総額）		77,362,001,287	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	1,812,502,958	2.34
	買建	ドイツ	594,216,815	0.77

(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		2,067,245,300	2.67
--------	----	--	---------------	------

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	118,492	14,362.23	1,701,810,400	13,115.13	1,554,038,150	2.01
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	157,814	6,376.65	1,006,324,754	6,820.49	1,076,369,677	1.39
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	86,581	10,008.21	866,521,505	9,547.48	826,631,024	1.07
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	196,273	3,559.20	698,575,078	3,772.68	740,475,379	0.96
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	57,501	12,098.38	695,669,471	12,547.05	721,468,399	0.93
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	8,275	72,249.00	597,860,544	83,699.72	692,615,197	0.90
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	101,810	6,603.39	672,291,900	6,668.52	678,922,724	0.88
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	77,180	7,703.36	594,545,379	8,089.31	624,333,154	0.81
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	66,193	9,174.76	607,304,889	9,132.22	604,489,568	0.78
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	6,442	84,668.21	545,432,673	93,665.72	603,394,607	0.78
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	44,680	12,325.13	550,687,072	12,936.62	578,008,566	0.75
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	6,020	86,834.37	522,742,941	95,759.51	576,472,284	0.75
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	56,029	9,290.58	520,542,372	9,692.21	543,045,372	0.70
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	127,267	4,069.38	517,897,962	4,212.90	536,164,073	0.69
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	127,670	4,106.77	524,311,390	3,959.62	505,525,490	0.65
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	47,223	10,985.40	518,763,922	10,633.00	502,122,159	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	14,578	32,117.73	468,212,355	33,843.32	493,367,919	0.64
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	84,457	5,567.35	470,202,321	5,693.99	480,897,998	0.62
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	85,752	5,160.90	442,557,660	5,271.86	452,072,805	0.58
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	216,609	1,992.47	431,588,494	2,084.14	451,443,655	0.58

アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	33,603	13,639.78	458,337,692	12,914.91	433,980,016	0.56
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	26,740	15,029.21	401,881,131	16,125.55	431,197,394	0.56
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	39,001	11,004.45	429,184,804	11,005.66	429,231,843	0.55
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	98,462	4,209.28	414,455,013	4,274.41	420,867,784	0.54
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	62,677	6,469.52	405,490,130	6,389.91	400,500,878	0.52
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	24,590	16,606.79	408,360,989	16,178.62	397,832,399	0.51
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	406,751	926.08	376,684,129	973.63	396,027,367	0.51
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	40,632	9,295.41	377,691,208	9,553.51	388,178,547	0.50
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	30,444	13,024.67	396,523,172	12,466.24	379,522,503	0.49
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	58,433	6,377.85	372,677,306	6,433.33	375,919,204	0.49

## ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	6.40
		素材	4.15
		資本財	6.85
		商業・専門サービス	0.91
		運輸	1.79
		自動車・自動車部品	1.68
		耐久消費財・アパレル	1.73
		消費者サービス	1.79
		メディア	2.91
		小売	3.95
		食品・生活必需品小売り	2.07
		食品・飲料・タバコ	6.11
		家庭用品・パーソナル用品	2.16
		ヘルスケア機器・サービス	3.55
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10.05
		銀行	8.93
		各種金融	3.98
		保険	4.24
		不動産	0.62
		ソフトウェア・サービス	8.42
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.00		
電気通信サービス	3.06		
公益事業	3.08		
半導体・半導体製造装置	1.80		
投資証券			2.52

合 計	96.74
-----	-------

## 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 1603	買建	29	米ドル	14,732,512.5	1,776,888,333	15,027,800	1,812,502,958	2.34
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1603	買建	145	ユーロ	4,416,220	581,925,309	4,509,500	594,216,815	0.77

(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	13,070,000.00	1,581,152,935	1,574,426,200	2.04
	ユーロ	買建	3,740,000.00	494,820,080	492,819,100	0.64

(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12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	メキシコ	395,153,677	4.23
	ブラジル	504,410,836	5.40
	チリ	107,567,851	1.15
	コロンビア	36,779,708	0.39
	ペルー	31,360,445	0.34
	オランダ	29,652,975	0.32
	トルコ	119,107,511	1.28
	チェコ	16,296,179	0.17
	ハンガリー	24,339,131	0.26
	ポーランド	120,647,029	1.29
	ロシア	308,558,409	3.30
	ケイマン	364,303,323	3.90
	バミューダ	78,064,519	0.84

	香港	523,803,906	5.61
	マレーシア	292,030,137	3.13
	タイ	178,873,282	1.92
	フィリピン	129,167,655	1.38
	インドネシア	230,045,728	2.46
	韓国	1,406,655,365	15.06
	台湾	1,076,264,217	11.53
	中国	1,444,225,216	15.47
	インド	779,169,365	8.34
	カタール	91,159,952	0.98
	エジプト	16,800,255	0.18
	南アフリカ	574,742,244	6.16
	アラブ首長国連邦	77,420,674	0.83
	小計	8,956,599,589	95.92
投資信託受益証券	アメリカ	30,925,610	0.33
投資証券	メキシコ	12,115,627	0.13
	トルコ	6,397,991	0.07
	南アフリカ	22,840,235	0.24
	小計	41,353,853	0.44
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		308,690,207	3.31
合計（純資産総額）		9,337,569,259	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	300,010,138	3.21

(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	売建		10,086,100	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	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	2,385	136,247.23	324,949,661	129,538.20	308,948,607	3.31



台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	533,355	535.30	285,508,239	521.14	277,952,625	2.98
中国	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	112,500	2,525.38	284,106,150	2,346.44	263,975,400	2.83
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	133,700	1,696.04	226,760,548	1,365.39	182,552,643	1.96
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,836,920	115.27	211,755,264	83.40	153,202,067	1.64
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	8,760	14,330.77	125,537,627	16,684.40	146,155,344	1.57
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA - H	銀行	1,636,575	101.75	166,536,862	73.59	120,449,956	1.29
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP-ADR	ソフトウェア・サービス	10,680	10,068.66	107,533,368	10,041.98	107,248,438	1.15
中国	株式	BANK OF CHINA LTD - H	銀行	1,699,000	80.28	136,412,030	54.61	92,791,904	0.99
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	306,150	325.10	99,532,165	296.16	90,672,139	0.97
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	40,140	1,785.19	71,657,627	2,010.55	80,703,638	0.86
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	114,000	852.12	97,142,747	681.52	77,694,192	0.83
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	32,575	2,246.42	73,177,327	2,246.42	73,177,327	0.78
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	ソフトウェア・サービス	3,000	25,596.47	76,789,422	23,480.35	70,441,064	0.75
中国	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	159,000	575.72	91,539,480	398.33	63,335,424	0.68
ロシア	株式	GAZPROM PAO-SPON ADR	エネルギー	132,700	726.55	96,413,894	455.12	60,394,667	0.65
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	電気通信サービス	670,800	105.25	70,605,913	87.65	58,798,706	0.63
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	102,000	610.50	62,271,449	567.47	57,882,552	0.62
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	28,946	1,590.58	46,041,189	1,848.02	53,493,018	0.57
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車部品	3,430	16,889.54	57,931,156	15,391.70	52,793,531	0.57
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	銀行	64,033	1,097.53	70,278,742	823.77	52,748,823	0.56
香港	株式	CNOOC LTD	エネルギー	388,000	195.74	75,948,982	128.83	49,988,678	0.54
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	435	107,122.09	46,598,113	110,840.89	48,215,791	0.52
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	ソフトウェア・サービス	10,450	4,570.29	47,759,562	4,469.55	46,706,860	0.50
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON-ADR	エネルギー	11,385	6,211.74	70,720,717	3,929.47	44,737,059	0.48
メキシコ	株式	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	食品・飲料・タバコ	38,900	1,012.50	39,386,308	1,136.43	44,207,290	0.47
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	61,000	710.05	43,313,351	722.45	44,069,688	0.47
韓国	株式	NAVER CORP	ソフトウェア・サービス	628	63,013.00	39,572,164	66,318.60	41,648,081	0.45
南アフリカ	株式	SASOL LTD	エネルギー	12,300	3,555.66	43,734,692	3,368.28	41,429,860	0.44
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	12,630	4,679.49	59,101,959	3,222.96	40,705,985	0.44

## ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	6.91
		素材	5.88
		資本財	4.91
		商業・専門サービス	0.18
		運輸	1.56
		自動車・自動車部品	3.55
		耐久消費財・アパレル	1.19
		消費者サービス	0.70
		メディア	2.28
		小売	1.80
		食品・生活必需品小売り	1.81
		食品・飲料・タバコ	4.60
		家庭用品・パーソナル用品	1.64
		ヘルスケア機器・サービス	0.80
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.07
		銀行	16.66
		各種金融	2.97
		保険	4.20
		不動産	2.55
		ソフトウェア・サービス	7.94
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.43		
電気通信サービス	6.55		
公益事業	3.05		
半導体・半導体製造装置	4.70		
投資信託受益証券			0.33
投資証券			0.44
合計			96.69

## 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	ニューヨーク証券取引所	MINMSCIE1603	買建	62	米ドル	2,442,835	294,630,329	2,487,440	300,010,138	3.21

(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	メキシコペソ	売建	1,445,000.00	10,068,037	10,086,100	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。

## 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12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	27,976,792,382	80.18
地方債証券	日本	2,225,018,000	6.38
特殊債券	日本	2,713,711,097	7.78
社債券	日本	1,785,878,000	5.12
	オーストラリア	101,222,000	0.29
	小計	1,887,100,000	5.41
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		90,056,145	0.26
合計(純資産総額)		34,892,677,624	100.00

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	750,000,000	104.33	782,535,000	104.18	781,350,000	1.300	2019/3/20	2.24
日本	国債証券	第107回利付国債(5年)	705,000,000	100.39	707,791,800	100.46	708,306,450	0.200	2017/12/20	2.03
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	581,000,000	105.33	611,973,110	105.17	611,037,700	1.400	2019/9/20	1.75
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	545,000,000	109.22	595,259,900	109.28	595,586,900	1.400	2022/12/20	1.71
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	563,000,000	105.21	592,354,820	105.10	591,718,630	1.300	2019/12/20	1.70
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	560,000,000	100.25	561,422,400	100.35	561,993,600	0.100	2020/6/20	1.61
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	505,000,000	100.26	506,328,150	100.35	506,802,850	0.100	2020/3/20	1.45
日本	国債証券	第117回利付国債(5年)	470,000,000	100.61	472,867,000	100.67	473,158,400	0.200	2019/3/20	1.36
日本	国債証券	第284回利付国債(10年)	462,000,000	101.68	469,800,147	101.68	469,800,147	1.700	2016/12/20	1.35
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	410,000,000	106.63	437,203,500	106.59	437,047,700	1.300	2021/3/20	1.25
日本	国債証券	第102回利付国債(5年)	400,000,000	100.33	401,334,466	100.33	401,334,466	0.300	2016/12/20	1.15
日本	国債証券	第29回利付国債(30年)	276,000,000	123.77	341,621,760	126.14	348,146,400	2.400	2038/9/20	1.00

日本	国債証券	第120回利付国債(5年)	330,000,000	100.66	332,181,300	100.74	332,445,300	0.200	2019/9/20	0.95
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	325,000,000	100.27	325,877,850	100.35	326,144,000	0.100	2020/9/20	0.93
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	280,000,000	113.39	317,506,000	115.21	322,604,800	1.700	2032/9/20	0.92
日本	国債証券	第292回利付国債(10年)	306,000,000	104.02	318,325,680	103.80	317,631,060	1.700	2018/3/20	0.91
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	260,000,000	120.34	312,884,000	120.93	314,431,000	2.300	2026/9/20	0.90
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	260,000,000	120.13	312,345,800	120.64	313,664,000	2.300	2026/6/20	0.90
日本	国債証券	第106回利付国債(5年)	310,000,000	100.36	311,116,000	100.43	311,348,500	0.200	2017/9/20	0.89
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	300,000,000	100.26	300,807,000	100.37	301,125,000	0.100	2019/12/20	0.86
日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	240,000,000	119.77	287,464,800	120.98	290,373,600	2.100	2029/9/20	0.83
日本	国債証券	第36回利付国債(30年)	230,000,000	115.91	266,611,400	118.06	271,549,500	2.000	2042/3/20	0.78
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	261,000,000	102.36	267,175,260	102.11	266,512,320	1.700	2017/3/20	0.76
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	208,000,000	124.06	258,046,880	126.02	262,127,840	2.400	2034/3/20	0.75
日本	国債証券	第50回利付国債(20年)	237,000,000	109.89	260,458,260	109.75	260,112,240	1.900	2021/3/22	0.75
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	250,000,000	101.04	252,610,000	101.62	254,050,000	0.400	2025/6/20	0.73
日本	国債証券	第137回利付国債(20年)	220,000,000	113.55	249,814,400	115.26	253,583,000	1.700	2032/6/20	0.73
日本	国債証券	第149回利付国債(20年)	215,000,000	108.62	233,543,750	110.63	237,860,950	1.500	2034/6/20	0.68
日本	国債証券	第301回利付国債(10年)	223,000,000	105.36	234,972,870	105.18	234,555,860	1.500	2019/6/20	0.67
日本	国債証券	第290回利付国債(10年)	226,000,000	103.31	233,482,860	103.14	233,096,400	1.400	2018/3/20	0.67

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	80.18
地方債証券	6.38
特殊債券	7.78
社債券	5.41
合計	99.74

### 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12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	75,586,135,254	42.50
	カナダ	3,508,057,239	1.97
	メキシコ	1,795,939,569	1.01
	ドイツ	13,237,485,674	7.44
	イタリア	17,317,510,792	9.74
	フランス	16,833,216,502	9.46
	オランダ	4,421,015,573	2.49
	スペイン	9,474,877,042	5.33
	ベルギー	4,452,222,864	2.50
	オーストリア	2,728,421,050	1.53
	フィンランド	1,070,526,914	0.60
	アイルランド	1,399,267,845	0.79
	イギリス	14,605,262,521	8.21
	スイス	520,829,583	0.29
	スウェーデン	825,456,378	0.46
	ノルウェー	493,222,239	0.28
	デンマーク	1,097,015,320	0.62
	ポーランド	992,079,385	0.56
	オーストラリア	3,175,014,790	1.79
	シンガポール	641,582,087	0.36
マレーシア	803,129,594	0.45	
南アフリカ	729,363,873	0.41	
	小計	175,707,632,088	98.79
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		2,152,193,198	1.21
合計（純資産総額）		177,859,825,286	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		70,378,720	0.04

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,680,000	16,471.70	1,923,895,459	16,083.53	1,878,556,532	8.000	2021/11/15	1.06
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,300,000	13,219.04	1,758,132,912	12,992.90	1,728,055,793	3.625	2020/2/15	0.97
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,140,000	13,347.90	1,753,915,204	13,091.83	1,720,267,591	3.625	2021/2/15	0.97
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,870,000	13,072.91	1,551,755,354	12,863.81	1,526,934,283	3.375	2019/11/15	0.86
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,950,000	16,185.29	1,286,731,082	15,792.37	1,255,493,564	8.750	2020/8/15	0.71
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,500,000	13,183.23	1,252,407,644	12,950.49	1,230,297,381	3.500	2020/5/15	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,400,000	13,075.82	1,229,127,086	12,893.96	1,212,032,504	3.750	2018/11/15	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,250,000	12,716.81	1,176,305,561	12,558.51	1,161,662,753	4.625	2017/2/15	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,850,000	13,109.74	1,160,212,135	12,929.76	1,144,284,548	4.000	2018/8/15	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,300,000	12,384.19	1,151,730,330	12,182.55	1,132,977,360	2.000	2020/7/31	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,300,000	12,187.26	1,133,415,514	11,964.88	1,112,734,668	2.000	2023/2/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,800,000	12,799.73	1,126,376,790	12,643.32	1,112,612,174	4.500	2017/5/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	12,472.77	1,122,549,307	12,354.98	1,111,948,819	3.125	2017/1/31	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,600,000	12,952.38	1,113,904,963	12,789.37	1,099,885,934	4.750	2017/8/15	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,800,000	12,526.47	1,102,330,171	12,408.69	1,091,965,249	3.250	2017/3/31	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,800,000	12,481.25	1,098,350,041	12,363.46	1,087,985,119	2.750	2017/5/31	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,950,000	12,238.14	1,095,314,061	12,098.69	1,082,832,811	1.500	2018/12/31	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,700,000	12,460.52	1,084,065,294	12,354.98	1,074,883,858	3.250	2016/12/31	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	13,585.58	1,086,846,863	13,351.90	1,068,152,313	8.750	2017/5/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,340,000	12,508.57	1,043,215,252	12,369.12	1,031,584,679	2.250	2018/7/31	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,950,000	12,811.98	1,018,552,863	12,654.62	1,006,042,874	3.500	2018/2/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,500,000	11,934.73	1,014,452,594	11,725.55	996,672,042	1.750	2023/5/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	12,294.98	983,598,672	12,125.07	970,005,925	1.750	2019/9/30	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,550,000	12,992.90	980,964,002	12,826.11	968,372,036	3.875	2018/5/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,400,000	12,611.28	933,234,951	12,470.88	922,845,530	2.750	2018/2/28	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	12,538.72	877,711,007	12,409.63	868,674,680	2.375	2018/6/30	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	12,539.67	877,776,965	12,408.69	868,608,720	3.125	2017/4/30	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,800,000	12,932.59	879,416,508	12,767.69	868,203,547	4.250	2017/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	12,369.12	865,838,459	12,276.77	859,374,517	2.750	2016/11/30	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	12,344.62	864,123,536	12,224.95	855,746,795	1.875	2017/9/30	0.48

## 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	300,000.00	36,183,000	36,177,000	0.02
	加ドル	売建	102,000.00	8,887,260	8,890,320	0.00
	豪ドル	売建	151,000.00	13,271,390	13,269,880	0.01
	南アフリカランド	売建	1,532,000.00	12,041,520	12,041,520	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

#### 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12月30日現在です。

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

#### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	メキシコ	188,259,775	9.52
	ブラジル	190,197,827	9.62
	コロンビア	119,432,550	6.04
	ペルー	33,782,172	1.71
	トルコ	185,877,462	9.40
	ハンガリー	110,125,904	5.57
	ポーランド	202,061,663	10.22
	ロシア	97,961,624	4.95
	ルーマニア	57,788,636	2.92
	マレーシア	189,702,109	9.59
	タイ	173,747,836	8.78
	フィリピン	12,864,000	0.65
	インドネシア	184,089,691	9.31
	南アフリカ	170,879,052	8.64
	小計	1,916,770,301	96.91
特殊債券	国際機関	1,699,660	0.09
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		59,344,547	3.00
合計(純資産総額)		1,977,814,508	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	買建		25,456,300	1.29
	売建		4,891,692	0.25

(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 (%)
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,600,000	930.92	33,513,121	835.96	30,094,588	10.500	2026/12/21	1.52
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	715,000,000	4.56	32,643,038	4.19	29,984,540	10.000	2024/7/24	1.52
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	8,320,000	355.89	29,610,335	359.53	29,913,548	3.650	2021/12/17	1.51
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	3,450,000,000	0.89	30,734,570	0.85	29,495,958	8.375	2024/3/15	1.49
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	7,850,000	356.53	27,988,284	357.28	28,046,713	3.875	2019/6/13	1.42
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	1,090,000	2,674.89	29,156,343	2,486.46	27,102,423	10.000	2021/1/1	1.37
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	1,190,000	2,018.22	24,016,836	1,969.32	23,435,013		2019/1/1	1.18
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,610,000	907.24	23,679,222	886.85	23,146,948	10.000	2024/12/5	1.17
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	700,000	2,998.29	20,988,091	3,021.32	21,149,255	1.500	2020/4/25	1.07
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	6,150,000	345.01	21,218,222	342.50	21,063,771	3.250	2017/6/16	1.07
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	2,350,000,000	0.93	21,872,074	0.88	20,711,524	9.000	2029/3/15	1.05
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	610,000	3,413.40	20,821,768	3,378.69	20,610,037	4.000	2023/10/25	1.04
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	890,000	2,275.33	20,250,463	2,303.57	20,501,846		2018/1/1	1.04
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	820,000	2,405.12	19,722,005	2,487.22	20,395,276		2017/7/1	1.03
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	680,000	2,972.07	20,210,128	2,966.94	20,175,224	10.000	2017/1/1	1.02
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	2,300,000,000	0.88	20,298,889	0.82	19,023,742	8.375	2034/3/15	0.96
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	445,000,000	4.59	20,438,429	4.26	18,975,557	11.000	2020/7/24	0.96
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,460,000	779.50	19,175,830	770.33	18,950,191	8.500	2018/12/13	0.96
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	510,000	3,758.23	19,166,990	3,707.58	18,908,673	5.750	2022/9/23	0.96
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	4,600,000	400.77	18,435,423	410.27	18,872,640	4.875	2029/6/22	0.95
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	700,000	2,555.59	17,889,158	2,690.21	18,831,471		2017/1/1	0.95
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	580,000	3,230.44	18,736,579	3,201.72	18,569,978	3.250	2025/7/25	0.94
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	5,000,000	354.27	17,713,521	361.28	18,064,016	3.625	2023/6/16	0.91
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	540,000	3,246.83	17,532,890	3,239.23	17,491,854	3.250	2019/7/25	0.88
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	540,000	3,161.15	17,070,244	3,167.63	17,105,219	2.500	2018/7/25	0.86
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,400,000	703.41	16,882,008	703.22	16,877,495	4.750	2018/6/14	0.85
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	500,000	3,357.04	16,785,221	3,310.20	16,551,043	5.250	2017/10/25	0.84
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,390,000	777.59	18,584,562	678.74	16,222,023	8.750	2048/2/28	0.82
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	4,320,000	363.39	15,698,822	371.72	16,058,451	3.850	2025/12/12	0.81



ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	430,000	3,571.99	15,359,589	3,536.21	15,205,713	5.250	2020/10/25	0.77
-------	------	------------------------	---------	----------	------------	----------	------------	-------	------------	------

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.91
特殊債券	0.09
合計	97.00

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	買建	85,000.00	10,241,800	10,250,150	0.52
	ブラジルリアル	買建	79,975.17	2,508,596	2,493,625	0.13
	トルコリラ	買建	88,000.00	3,647,676	3,640,560	0.18
	ハンガリーフォリント	買建	5,254,000.00	2,214,561	2,210,883	0.11
	タイバーツ	買建	348,656.51	1,165,140	1,164,512	0.06
	インドネシアルピア	買建	230,221,700.00	2,016,742	2,025,950	0.10
	南アフリカランド	買建	467,000.00	3,675,290	3,670,620	0.19
	米ドル	売建	20,826.87	2,508,596	2,511,512	0.13
	メキシコペソ	売建	341,000.00	2,383,590	2,380,180	0.12

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 参考情報

### 運用実績

2015年12月30日現在

### 基準価額・純資産の推移



基準価額.....9,614円

純資産総額.....2.15億円

※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8月	2015年9月	2015年10月	2015年11月	2015年12月	最近1年間累計	設定来累計
20円	20円	20円	20円	20円	240円	2,260円

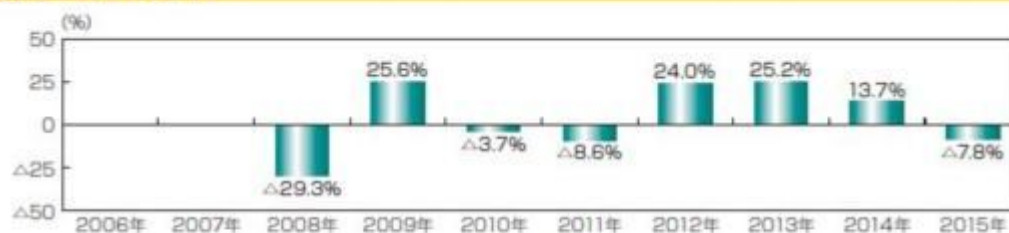
## 主要な資産の状況

組入資産	投資対象	比率 <sup>※1</sup>	組入上位銘柄	国・地域名	比率 <sup>※2</sup>
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	日本株式	3.1%	トヨタ自動車	日本	4.0%
			三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	2.6%
			日本電信電話	日本	1.6%
			三井住友フィナンシャルグループ	日本	1.6%
			本田技研工業	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	27.6%	APPLE INC	アメリカ	2.0%
			MICROSOFT CORP	アメリカ	1.4%
			EXXON MOBIL CORP	アメリカ	1.1%
			GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	1.0%
			JOHNSON & JOHNSON	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	19.7%	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	3.3%
			TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	3.0%
			TENCENT HOLDINGS LTD	中国	2.8%
			CHINA MOBILE LTD	香港	2.0%
			CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	1.6%
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107回利付国債(5年)	日本	2.0%
			第303回利付国債(10年)	日本	1.8%
			第60回利付国債(20年)	日本	1.7%
			第305回利付国債(10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	26.0%	US TREASURY N/B(クーポン8%)	アメリカ	1.1%
			US TREASURY N/B(クーポン3.625%)	アメリカ	1.0%
			US TREASURY N/B(クーポン3.625%)	アメリカ	1.0%
			US TREASURY N/B(クーポン3.375%)	アメリカ	0.9%
			US TREASURY N/B(クーポン8.75%)	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	19.3%	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA(クーポン10.5%)	南アフリカ	1.5%
			TITULOS DE TESORERIA B(クーポン10%)	コロンビア	1.5%
			THAILAND GOVERNMENT BOND(クーポン3.65%)	タイ	1.5%
			INDONESIA GOVERNMENT(クーポン8.375%)	インドネシア	1.5%
			THAILAND GOVERNMENT BOND(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。

## 年間収益率の推移



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

※当ファンドにはベンチマークはありません。

※2008年は、設定時から2008年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27年6月26日から平成27年12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27年 6月25日現在	当期 平成27年12月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	3,863,836	3,550,547
親投資信託受益証券	238,007,819	211,362,324
未収入金	402,864	143,327
未収利息	6	5
流動資産合計	242,274,525	215,056,203
資産合計	242,274,525	215,056,203
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	446,072	447,146
未払解約金	405,946	144,497
未払受託者報酬	11,311	9,697
未払委託者報酬	226,430	194,135
その他未払費用	118,169	223,453
流動負債合計	1,207,928	1,018,928
負債合計	1,207,928	1,018,928
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	223,036,012	223,573,148
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	18,030,585	9,535,873
（分配準備積立金）	59,320,624	57,004,119
元本等合計	241,066,597	214,037,275
純資産合計	241,066,597	214,037,275
負債純資産合計	242,274,525	215,056,203

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 平成26年12月26日 至 平成27年 6月25日	当期 自 平成27年 6月26日 至 平成27年12月25日
<b>営業収益</b>		
受取利息	904	873
有価証券売買等損益	8,124,342	23,260,508
営業収益合計	8,125,246	23,259,635

	前期		当期	
	自	平成26年12月26日 至 平成27年 6月25日	自	平成27年 6月26日 至 平成27年12月25日
<b>営業費用</b>				
受託者報酬		66,726		60,093
委託者報酬		1,335,793		1,203,150
その他費用		123,557		111,276
<b>営業費用合計</b>		<b>1,526,076</b>		<b>1,374,519</b>
営業利益又は営業損失（ ）		6,599,170		24,634,154
経常利益又は経常損失（ ）		6,599,170		24,634,154
当期純利益又は当期純損失（ ）		6,599,170		24,634,154
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（ ）		171,192		136,343
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		15,057,352		18,030,585
剰余金増加額又は欠損金減少額		557,477		210,303
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		34,457
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		557,477		175,846
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,567,173		620,401
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,567,173		488,131
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		132,270
分配金		2,787,433		2,658,549
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		18,030,585		9,535,873

## (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27年 6月25日現在	当期 平成27年12月25日現在
1.	期首元本額	236,926,615円	223,036,012円
	期中追加設定元本額	9,511,934円	9,228,365円
	期中一部解約元本額	23,402,537円	8,691,229円
2.	受益権の総数	223,036,012口	223,573,148口
3.	元本の欠損		
	純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	- 円	9,535,873円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 平成26年12月26日 至 平成27年 6月25日	当期 自 平成27年 6月26日 至 平成27年12月25日
分配金の計算過程	分配金の計算過程

自 平成26年12月26日		自 平成27年 6月26日	
至 平成27年 1月26日		至 平成27年 7月27日	
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	293,040円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	521,925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	9,332,807円	C 信託約款に定める収益調整金	10,761,195円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	63,087,897円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	57,841,229円
E 分配対象収益（A+B+C+D）	72,713,744円	E 分配対象収益（A+B+C+D）	69,124,349円
F 分配対象収益(1万口当たり)	3,076円	F 分配対象収益(1万口当たり)	3,160円
G 分配金額	472,773円	G 分配金額	437,490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27年 1月27日		自 平成27年 7月28日	
至 平成27年 2月25日		至 平成27年 8月25日	
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	627,932円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	392,162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	9,709,187円	C 信託約款に定める収益調整金	11,441,693円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	62,681,499円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	57,657,406円
E 分配対象収益（A+B+C+D）	73,018,618円	E 分配対象収益（A+B+C+D）	69,491,261円
F 分配対象収益(1万口当たり)	3,082円	F 分配対象収益(1万口当たり)	3,158円
G 分配金額	473,729円	G 分配金額	440,079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27年 2月26日		自 平成27年 8月26日	
至 平成27年 3月25日		至 平成27年 9月25日	
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	391,576円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	538,983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	9,903,270円	C 信託約款に定める収益調整金	11,869,368円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	61,562,661円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	57,504,337円
E 分配対象収益（A+B+C+D）	71,857,507円	E 分配対象収益（A+B+C+D）	69,912,688円
F 分配対象収益(1万口当たり)	3,079円	F 分配対象収益(1万口当たり)	3,162円
G 分配金額	466,607円	G 分配金額	442,115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27年 3月26日		自 平成27年 9月26日	
至 平成27年 4月27日		至 平成27年10月26日	
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	699,807円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	556,095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	10,369,035円	C 信託約款に定める収益調整金	12,313,462円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	60,698,436円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	57,589,021円
E 分配対象収益（A+B+C+D）	71,767,278円	E 分配対象収益（A+B+C+D）	70,458,578円

F	分配対象収益(1万口当たり)	3,090円	F	分配対象収益(1万口当たり)	3,167円
G	分配金額	464,432円	G	分配金額	444,851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27年 4月28日			自 平成27年10月27日	
	至 平成27年 5月25日			至 平成27年11月25日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	691,239円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	318,184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	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	10,687,321円	C	信託約款に定める収益調整金	12,722,986円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	60,527,014円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	57,609,877円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	73,111,210円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	70,651,047円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,152円	F	分配対象収益(1万口当たり)	3,162円
G	分配金額	463,820円	G	分配金額	446,868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27年 5月26日			自 平成27年11月26日	
	至 平成27年 6月25日			至 平成27年12月25日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	488,868円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	280,687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	10,612,968円	C	信託約款に定める収益調整金	13,081,264円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	59,277,828円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	57,170,578円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	70,379,664円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	70,532,529円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,155円	F	分配対象収益(1万口当たり)	3,154円
G	分配金額	446,072円	G	分配金額	447,146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12月26日 至 平成27年 6月25日	当期 自 平成27年 6月26日 至 平成27年12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27年 6月25日現在	当期 平成27年12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)

前期（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

当期（平成27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	7,769,670
合計	7,769,670

（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27年 6月25日現在		当期 平成27年12月25日現在	
1口当たり純資産額	1.0808円	1口当たり純資産額	0.9573円
(1万口当たり純資産額)	(10,808円)	(1万口当たり純資産額)	(9,573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	29,624,898	58,678,035	
	日本債券インデックスマザーファンド	4,764,896	6,413,073	



海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	24,357,275	55,936,482	
日本株式インデックスT O P I Xマザーファンド	5,069,553	6,508,799	
海外新興国株式インデックスM S C Iエマージング (ヘッジなし)マザーファンド	30,612,308	42,450,087	
海外新興国債券インデックスL o c a l (ヘッジなし) マザーファンド	35,168,592	41,375,848	
合計	129,597,522	211,362,324	

(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T O P I Xマザーファンド」「海外株式インデックスM S C I - K O K U S A I (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M S C I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L o c a l (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T O P I Xマザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

	平成27年 6月25日現在	平成27年12月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	119,785,745	77,083,675
株式	29,322,054,430	26,622,697,820
派生商品評価勘定	2,407,140	-
未収入金	73,950,770	-
未収配当金	103,176,424	1,559,475
未収利息	193	128
前払金	-	1,193,000
流動資産合計	29,621,374,702	26,702,534,098
資産合計	29,621,374,702	26,702,534,098
負債の部		
流動負債		

	平成27年 6月25日現在	平成27年12月25日現在
派生商品評価勘定	-	1,731,780
前受金	3,132,000	-
未払解約金	67,297,809	2,760,283
流動負債合計	70,429,809	4,492,063
負債合計	70,429,809	4,492,063
純資産の部		
元本等		
元本	21,079,556,968	20,794,371,054
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,471,387,925	5,903,670,981
元本等合計	29,550,944,893	26,698,042,035
純資産合計	29,550,944,893	26,698,042,035
負債純資産合計	29,621,374,702	26,702,534,098

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	平成27年 6月25日現在	平成27年12月25日現在
1. 期首	平成26年12月26日	平成27年 6月26日
期首元本額	24,574,410,804円	21,079,556,968円
期首からの追加設定元本額	345,782,416円	1,451,415,159円
期首からの一部解約元本額	3,840,636,252円	1,736,601,073円
元本の内訳		
DCインデックスバランス（株式20）	169,495,688円	186,197,827円
DCインデックスバランス（株式40）	657,900,940円	690,196,784円
DCインデックスバランス（株式60）	1,289,585,749円	1,331,104,201円
DCインデックスバランス（株式80）	1,557,759,841円	1,579,943,425円
インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,082,395,813円	1,171,430,380円

世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	5,717,061,524円	5,367,718,340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	5,110,060円	5,069,553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)	24,953,097円	23,674,244円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	68,386,773円	64,469,289円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	51,274,978円	50,535,892円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	79,951,279円	74,279,400円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	93,218,404円	94,738,805円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	6,944,272,963円	6,726,570,406円
世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け)	19,274,567円	18,048,820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)	41,621,945円	42,002,758円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	39,549,887円	40,249,776円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	249,557,303円	259,528,140円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	767,558,375円	798,737,101円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	1,104,938,172円	1,123,403,936円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	1,115,689,610円	1,146,471,977円
計	21,079,556,968円	20,794,371,054円
2. 受益権の総数	21,079,556,968口	20,794,371,054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	539,870,000円	477,285,000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12月26日 至 平成27年 6月25日	自 平成27年 6月26日 至 平成27年12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27年 6月25日現在	平成27年12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

(平成27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	746,136,530
合計	746,136,530

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成27年 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

(平成27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	107,638,000	-	105,910,000	1,728,000
合計		107,638,000	-	105,910,000	1,728,000

(注) 1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成27年 6月25日現在		平成27年12月25日現在	
1口当たり純資産額	1.4019円	1口当たり純資産額	1.2839円
(1万口当たり純資産額)	(14,019円)	(1万口当たり純資産額)	(12,839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	263.00	1,578,000	
日本水産	15,400	647.00	9,963,800	
マルハニチロ	2,800	2,066.00	5,784,800	
サカタのタネ	2,200	2,827.00	6,219,400	
ホクト	1,400	2,321.00	3,249,400	
住石ホールディングス	4,100	105.00	430,500	
日鉄鉱業	4,000	526.00	2,104,000	
三井松島産業	9,000	127.00	1,143,000	
国際石油開発帝石	70,300	1,161.00	81,618,300	
日本海洋掘削	400	2,473.00	989,200	
石油資源開発	2,100	3,145.00	6,604,500	
K & O エナジーグループ	900	1,686.00	1,517,400	
ショーボンドホールディングス	1,300	4,295.00	5,583,500	
ミライト・ホールディングス	4,100	958.00	3,927,800	
サンヨーホームズ	300	474.00	142,200	

ダイセキ環境ソリューション	300	1,301.00	390,300	
安藤・間	8,900	632.00	5,624,800	
東急建設	4,400	886.00	3,898,400	
コムシスホールディングス	6,000	1,690.00	10,140,000	
ミサワホーム	1,600	839.00	1,342,400	
高松コンストラクショングループ	1,000	2,527.00	2,527,000	
東建コーポレーション	500	9,130.00	4,565,000	
ヤマウラ	700	442.00	309,400	
大成建設	69,000	788.00	54,372,000	
大林組	40,000	1,097.00	43,880,000	
清水建設	41,000	979.00	40,139,000	
飛鳥建設	9,400	187.00	1,757,800	
長谷工コーポレーション	15,600	1,312.00	20,467,200	
松井建設	1,500	720.00	1,080,000	
銭高組	2,000	535.00	1,070,000	
鹿島建設	63,000	713.00	44,919,000	
不動テトラ	9,600	132.00	1,267,200	
大末建設	500	879.00	439,500	
鉄建建設	8,000	282.00	2,256,000	
西松建設	15,000	452.00	6,780,000	
三井住友建設	51,400	110.00	5,654,000	
大豊建設	5,000	561.00	2,805,000	
前田建設工業	8,000	817.00	6,536,000	
ナカノフドー建設	1,000	732.00	732,000	
奥村組	13,000	657.00	8,541,000	
東鉄工業	1,600	2,940.00	4,704,000	
イチケン	2,000	401.00	802,000	
浅沼組	4,000	304.00	1,216,000	
戸田建設	16,000	632.00	10,112,000	
熊谷組	17,000	320.00	5,440,000	
青木あすなる建設	900	786.00	707,400	
北野建設	3,000	301.00	903,000	
植木組	2,000	272.00	544,000	
三井ホーム	2,000	530.00	1,060,000	
矢作建設工業	1,800	788.00	1,418,400	
ピーエス三菱	1,700	368.00	625,600	

日本ハウスホールディングス	2,800	431.00	1,206,800	
大東建託	5,000	13,800.00	69,000,000	
新日本建設	1,600	652.00	1,043,200	
N I P P O	3,000	1,941.00	5,823,000	
東亜道路工業	3,000	416.00	1,248,000	
前田道路	4,000	1,997.00	7,988,000	
日本道路	4,000	581.00	2,324,000	
東亜建設工業	12,000	308.00	3,696,000	
若築建設	8,000	129.00	1,032,000	
東洋建設	4,200	532.00	2,234,400	
五洋建設	15,000	492.00	7,380,000	
大林道路	2,000	804.00	1,608,000	
福田組	2,000	1,255.00	2,510,000	
住友林業	9,200	1,611.00	14,821,200	
日本基礎技術	1,500	488.00	732,000	
日成ビルド工業	4,000	375.00	1,500,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	7,000	78.00	546,000	
巴コーポレーション	1,800	355.00	639,000	
パナホーム	5,000	898.00	4,490,000	
大和ハウス工業	39,500	3,466.00	136,907,000	
ライト工業	2,600	1,147.00	2,982,200	
積水ハウス	44,700	1,996.00	89,221,200	
日特建設	1,500	462.00	693,000	
北陸電気工事	500	998.00	499,000	
ユアテック	2,000	1,115.00	2,230,000	
西部電気工業	1,000	426.00	426,000	
四電工	1,000	421.00	421,000	
中電工	1,900	2,600.00	4,940,000	
関電工	5,000	787.00	3,935,000	
きんでん	8,100	1,532.00	12,409,200	
東京エネシス	1,000	1,035.00	1,035,000	
トーエネック	2,000	806.00	1,612,000	
住友電設	1,100	1,558.00	1,713,800	
日本電設工業	2,200	2,569.00	5,651,800	
協和エクシオ	5,300	1,205.00	6,386,500	
新日本空調	1,200	1,019.00	1,222,800	



N D S	2,000	342.00	684,000	
九電工	2,000	2,138.00	4,276,000	
三機工業	3,000	1,008.00	3,024,000	
日揮	13,000	1,835.00	23,855,000	
中外炉工業	4,000	219.00	876,000	
ヤマト	1,300	474.00	616,200	
太平電業	2,000	1,176.00	2,352,000	
高砂熱学工業	4,000	1,773.00	7,092,000	
三晃金属工業	2,000	257.00	514,000	
朝日工業社	2,000	480.00	960,000	
明星工業	2,500	492.00	1,230,000	
大気社	1,700	2,866.00	4,872,200	
ダイダン	2,000	820.00	1,640,000	
日比谷総合設備	1,600	1,616.00	2,585,600	
東芝プラントシステム	2,200	1,295.00	2,849,000	
東洋エンジニアリング	7,000	305.00	2,135,000	
千代田化工建設	10,000	907.00	9,070,000	
新興プランテック	2,700	975.00	2,632,500	
日本製粉	9,000	862.00	7,758,000	
日清製粉グループ本社	14,700	1,945.00	28,591,500	
日東富士製粉	1,000	372.00	372,000	
昭和産業	5,000	450.00	2,250,000	
鳥越製粉	1,100	775.00	852,500	
中部飼料	1,200	961.00	1,153,200	
フィード・ワン	8,200	127.00	1,041,400	
東洋精糖	2,000	104.00	208,000	
日本甜菜製糖	7,000	200.00	1,400,000	
三井製糖	5,000	535.00	2,675,000	
塩水港精糖	1,600	247.00	395,200	
森永製菓	12,000	626.00	7,512,000	
中村屋	3,000	457.00	1,371,000	
江崎グリコ	3,100	6,300.00	19,530,000	
名糖産業	600	1,318.00	790,800	
不二家	8,000	200.00	1,600,000	
山崎製パン	10,000	2,536.00	25,360,000	
第一屋製パン	3,000	119.00	357,000	

モロゾフ	2,000	422.00	844,000	
亀田製菓	700	4,610.00	3,227,000	
寿スピリッツ	300	4,945.00	1,483,500	
カルビー	5,000	5,020.00	25,100,000	
森永乳業	12,000	550.00	6,600,000	
六甲バター	600	1,679.00	1,007,400	
ヤクルト本社	7,200	5,800.00	41,760,000	
明治ホールディングス	7,900	9,810.00	77,499,000	
雪印メグミルク	3,100	3,060.00	9,486,000	
プリマハム	8,000	319.00	2,552,000	
日本ハム	10,000	2,302.00	23,020,000	
伊藤ハム	6,000	687.00	4,122,000	
林兼産業	5,000	110.00	550,000	
丸大食品	7,000	452.00	3,164,000	
米久	400	2,484.00	993,600	
S Foods	800	2,043.00	1,634,400	
サッポロホールディングス	20,000	529.00	10,580,000	
アサヒグループホールディングス	25,100	3,806.00	95,530,600	
キリンホールディングス	54,100	1,642.00	88,832,200	
宝ホールディングス	9,700	906.00	8,788,200	
オエノンホールディングス	4,000	235.00	940,000	
養命酒製造	400	2,003.00	801,200	
コカ・コーラウエスト	4,500	2,515.00	11,317,500	
コカ・コーライーストジャパン	4,700	1,919.00	9,019,300	
サントリー食品インターナショナル	9,100	5,280.00	48,048,000	
ダйдードリンコ	700	5,630.00	3,941,000	
伊藤園	4,000	3,095.00	12,380,000	
キーコーヒー	1,200	1,890.00	2,268,000	
ユニカフェ	400	936.00	374,400	
ジャパンフーズ	200	1,144.00	228,800	
日清オイリオグループ	7,000	483.00	3,381,000	
不二製油グループ本社	3,600	1,898.00	6,832,800	
かどや製油	100	2,777.00	277,700	
J - オイルミルズ	6,000	342.00	2,052,000	
キッコーマン	10,000	4,175.00	41,750,000	
味の素	29,000	2,841.50	82,403,500	

キューピー	6,800	2,979.00	20,257,200	
ハウス食品グループ本社	4,600	2,346.00	10,791,600	
カゴメ	4,800	2,115.00	10,152,000	
焼津水産化学工業	600	1,018.00	610,800	
アリアケジャパン	1,100	6,550.00	7,205,000	
エバラ食品工業	300	2,003.00	600,900	
ニチレイ	14,000	849.00	11,886,000	
東洋水産	6,600	4,165.00	27,489,000	
イトアンド	200	2,260.00	452,000	
日清食品ホールディングス	5,600	6,270.00	35,112,000	
永谷園ホールディングス	1,000	1,059.00	1,059,000	
一正蒲鉾	500	1,087.00	543,500	
フジッコ	1,300	2,088.00	2,714,400	
ロック・フィールド	700	2,829.00	1,980,300	
日本たばこ産業	79,000	4,493.00	354,947,000	
ケンコーマヨネーズ	400	2,205.00	882,000	
わらべや日洋	700	2,153.00	1,507,100	
なとり	700	1,702.00	1,191,400	
ユーグレナ	4,500	1,770.00	7,965,000	
ミヨシ油脂	5,000	138.00	690,000	
理研ビタミン	400	3,975.00	1,590,000	
片倉工業	1,600	1,283.00	2,052,800	
ゲンゼ	10,000	346.00	3,460,000	
東洋紡	50,000	164.00	8,200,000	
ユニチカ	37,000	54.00	1,998,000	
富士紡ホールディングス	6,000	216.00	1,296,000	
倉敷紡績	13,000	199.00	2,587,000	
シキボウ	8,000	113.00	904,000	
日本毛織	4,000	862.00	3,448,000	
大東紡織	3,000	62.00	186,000	
トーア紡コーポレーション	600	654.00	392,400	
ダイドーリミテッド	1,500	486.00	729,000	
帝国繊維	1,300	1,644.00	2,137,200	
帝人	51,000	410.00	20,910,000	
東レ	91,000	1,101.00	100,191,000	
サカイオーベックス	3,000	223.00	669,000	

住江織物	3,000	336.00	1,008,000	
日本フェルト	700	505.00	353,500	
イチカワ	1,000	326.00	326,000	
日東製網	1,000	142.00	142,000	
芦森工業	3,000	192.00	576,000	
アツギ	10,000	114.00	1,140,000	
ダイニック	3,000	168.00	504,000	
セーレン	3,100	1,322.00	4,098,200	
東海染工	2,000	133.00	266,000	
小松精練	1,900	674.00	1,280,600	
ワコールホールディングス	7,000	1,401.00	9,807,000	
ホギメディカル	800	5,940.00	4,752,000	
レナウン	3,500	113.00	395,500	
クラウディア	400	552.00	220,800	
T S Iホールディングス	5,600	805.00	4,508,000	
三陽商会	7,000	284.00	1,988,000	
ナイガイ	5,000	52.00	260,000	
オンワードホールディングス	8,000	718.00	5,744,000	
ルック	2,000	155.00	310,000	
キムラタン	56,000	7.00	392,000	
ゴールドウイン	500	5,810.00	2,905,000	
デサント	2,900	1,445.00	4,190,500	
キング	600	409.00	245,400	
ヤマトインターナショナル	800	411.00	328,800	
特種東海製紙	7,000	349.00	2,443,000	
王子ホールディングス	51,000	480.00	24,480,000	
日本製紙	6,400	1,842.00	11,788,800	
三菱製紙	19,000	82.00	1,558,000	
北越紀州製紙	7,800	700.00	5,460,000	
中越パルプ工業	5,000	197.00	985,000	
巴川製紙所	2,000	210.00	420,000	
大王製紙	5,500	996.00	5,478,000	
レンゴー	11,000	502.00	5,522,000	
トーモク	4,000	275.00	1,100,000	
ザ・パック	900	2,979.00	2,681,100	
クラレ	19,700	1,477.00	29,096,900	

旭化成	78,000	785.40	61,261,200	
共和レザー	800	898.00	718,400	
昭和電工	83,000	143.00	11,869,000	
住友化学	92,000	669.00	61,548,000	
日本化成	3,000	125.00	375,000	
住友精化	2,000	724.00	1,448,000	
日産化学工業	7,500	2,749.00	20,617,500	
ラサ工業	5,000	129.00	645,000	
クレハ	9,000	451.00	4,059,000	
多木化学	1,000	752.00	752,000	
テイカ	2,000	568.00	1,136,000	
石原産業	23,000	95.00	2,185,000	
片倉コープアグリ	1,000	232.00	232,000	
日東エフシー	700	872.00	610,400	
日本曹達	8,000	707.00	5,656,000	
東ソー	34,000	614.00	20,876,000	
トクヤマ	21,000	255.00	5,355,000	
セントラル硝子	13,000	547.00	7,111,000	
東亜合成	7,800	1,016.00	7,924,800	
大阪ソーダ	5,000	456.00	2,280,000	
関東電化工業	3,000	767.00	2,301,000	
デンカ	26,000	529.00	13,754,000	
信越化学工業	22,400	6,491.00	145,398,400	
日本カーバイド工業	4,000	154.00	616,000	
堺化学工業	5,000	404.00	2,020,000	
エア・ウォーター	10,000	1,903.00	19,030,000	
大陽日酸	9,600	1,072.00	10,291,200	
日本化学工業	5,000	262.00	1,310,000	
日本パーカラライジング	6,400	1,210.00	7,744,000	
高圧ガス工業	2,000	666.00	1,332,000	
四国化成工業	2,000	1,133.00	2,266,000	
戸田工業	2,000	297.00	594,000	
ステラ ケミファ	600	2,024.00	1,214,400	
保土谷化学工業	4,000	214.00	856,000	
日本触媒	1,800	8,540.00	15,372,000	
大日精化工業	5,000	544.00	2,720,000	

カネカ	17,000	1,242.00	21,114,000	
三菱瓦斯化学	21,000	583.00	12,243,000	
三井化学	53,000	521.00	27,613,000	
J S R	12,300	1,878.00	23,099,400	
東京応化工業	2,500	3,825.00	9,562,500	
大阪有機化学工業	900	600.00	540,000	
三菱ケミカルホールディングス	83,600	749.30	62,641,480	
日本合成化学工業	3,000	855.00	2,565,000	
ダイセル	17,600	1,782.00	31,363,200	
住友ベークライト	12,000	484.00	5,808,000	
積水化学工業	28,900	1,541.00	44,534,900	
日本ゼオン	11,000	930.00	10,230,000	
アイカ工業	3,800	2,334.00	8,869,200	
宇部興産	67,000	249.00	16,683,000	
積水樹脂	1,900	1,610.00	3,059,000	
タキロン	3,000	622.00	1,866,000	
旭有機材工業	4,000	214.00	856,000	
日立化成	6,200	1,889.00	11,711,800	
ニチバン	1,000	597.00	597,000	
リケンテクノス	2,000	405.00	810,000	
大倉工業	3,000	349.00	1,047,000	
積水化成品工業	3,000	402.00	1,206,000	
群栄化学工業	3,000	287.00	861,000	
タイガースポリマー	600	715.00	429,000	
ミライアル	400	1,005.00	402,000	
ダイキアクシス	300	955.00	286,500	
ダイキョーニシカワ	400	8,430.00	3,372,000	
日本化薬	8,000	1,265.00	10,120,000	
カーリットホールディングス	1,200	493.00	591,600	
日本精化	1,000	856.00	856,000	
A D E K A	6,100	1,687.00	10,290,700	
日油	9,000	908.00	8,172,000	
新日本理化	2,000	167.00	334,000	
ハリマ化成グループ	1,100	575.00	632,500	
花王	33,600	6,142.00	206,371,200	
第一工業製薬	3,000	345.00	1,035,000	

ニイタカ	200	1,381.00	276,200	
三洋化成工業	4,000	959.00	3,836,000	
大日本塗料	7,000	220.00	1,540,000	
日本ペイントホールディングス	9,600	2,917.00	28,003,200	
関西ペイント	14,100	1,805.00	25,450,500	
神東塗料	1,000	202.00	202,000	
中国塗料	4,000	837.00	3,348,000	
日本特殊塗料	900	1,053.00	947,700	
藤倉化成	1,700	561.00	953,700	
太陽ホールディングス	900	4,490.00	4,041,000	
D I C	50,000	331.00	16,550,000	
サカティクス	2,600	1,269.00	3,299,400	
東洋インキ S C ホールディングス	12,000	477.00	5,724,000	
T & K T O K A	400	2,309.00	923,600	
富士フィルムホールディングス	28,600	4,855.00	138,853,000	
資生堂	23,700	2,488.50	58,977,450	
ライオン	14,000	1,130.00	15,820,000	
高砂香料工業	800	2,848.00	2,278,400	
マンダム	1,200	4,950.00	5,940,000	
ミルボン	700	5,000.00	3,500,000	
ファンケル	2,900	1,624.00	4,709,600	
コーセー	2,000	11,160.00	22,320,000	
コタ	400	1,446.00	578,400	
シーズ・ホールディングス	1,700	2,017.00	3,428,900	
シーボン	100	2,529.00	252,900	
ポーラ・オルビスホールディングス	1,300	8,060.00	10,478,000	
ノエビアホールディングス	800	3,500.00	2,800,000	
アジュバンコスメジャパン	200	998.00	199,600	
エステー	800	1,118.00	894,400	
アグロ カネショウ	500	951.00	475,500	
コニシ	1,000	2,567.00	2,567,000	
長谷川香料	1,600	1,535.00	2,456,000	
星光 P M C	700	1,205.00	843,500	
小林製薬	1,900	9,730.00	18,487,000	
荒川化学工業	1,100	1,134.00	1,247,400	
メック	1,000	841.00	841,000	

日本高純度化学	300	2,208.00	662,400	
J C U	400	4,145.00	1,658,000	
新田ゼラチン	800	662.00	529,600	
デクセリアルズ	2,800	1,212.00	3,393,600	
アース製薬	900	5,070.00	4,563,000	
イハラケミカル工業	1,900	1,572.00	2,986,800	
北興化学工業	1,000	423.00	423,000	
大成ラミック	400	3,100.00	1,240,000	
クミアイ化学工業	2,600	1,297.00	3,372,200	
日本農薬	2,900	687.00	1,992,300	
アキレス	11,000	149.00	1,639,000	
有沢製作所	1,900	739.00	1,404,100	
日東電工	9,700	8,778.00	85,146,600	
レック	400	1,310.00	524,000	
きもと	2,100	253.00	531,300	
藤森工業	1,100	3,140.00	3,454,000	
前澤化成工業	900	1,102.00	991,800	
J S P	800	2,467.00	1,973,600	
エフピコ	1,100	4,420.00	4,862,000	
天馬	1,000	2,334.00	2,334,000	
信越ポリマー	2,400	645.00	1,548,000	
東リ	3,000	328.00	984,000	
ニフコ	2,400	5,540.00	13,296,000	
日本バルカー工業	5,000	301.00	1,505,000	
ユニ・チャーム	25,300	2,391.50	60,504,950	
協和発酵キリン	15,000	1,903.00	28,545,000	
武田薬品工業	49,700	5,895.00	292,981,500	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	139,800	1,681.00	235,003,800	
大日本住友製薬	8,800	1,448.00	12,742,400	
塩野義製薬	18,200	5,356.00	97,479,200	
田辺三菱製薬	14,500	2,029.00	29,420,500	
わかもと製薬	1,000	284.00	284,000	
あすか製薬	1,600	1,426.00	2,281,600	
日本新薬	3,000	4,430.00	13,290,000	
バイオフェルミン製薬	200	3,655.00	731,000	



中外製薬	12,400	4,235.00	52,514,000	
科研製薬	2,100	7,900.00	16,590,000	
エーザイ	15,400	7,947.00	122,383,800	
ロート製薬	6,100	2,332.00	14,225,200	
小野薬品工業	5,700	21,530.00	122,721,000	
久光製薬	3,900	5,010.00	19,539,000	
有機合成薬品工業	1,000	284.00	284,000	
持田製薬	900	8,440.00	7,596,000	
参天製薬	23,000	1,951.00	44,873,000	
扶桑薬品工業	4,000	270.00	1,080,000	
日本ケミファ	2,000	615.00	1,230,000	
ツムラ	3,900	3,340.00	13,026,000	
日医工	2,900	2,812.00	8,154,800	
キッセイ薬品工業	2,200	2,959.00	6,509,800	
生化学工業	2,400	1,821.00	4,370,400	
栄研化学	1,000	2,156.00	2,156,000	
日水製薬	500	1,425.00	712,500	
鳥居薬品	800	2,668.00	2,134,400	
JCRファーマ	1,000	2,560.00	2,560,000	
東和薬品	600	7,340.00	4,404,000	
富士製薬工業	300	2,110.00	633,000	
沢井製薬	2,100	8,210.00	17,241,000	
ゼリア新薬工業	2,600	1,518.00	3,946,800	
第一三共	42,000	2,461.00	103,362,000	
キョーリン製薬ホールディングス	3,300	2,433.00	8,028,900	
大幸薬品	600	1,651.00	990,600	
ダイト	500	3,260.00	1,630,000	
大塚ホールディングス	26,800	4,321.00	115,802,800	
大正製薬ホールディングス	3,000	8,350.00	25,050,000	
日本コークス工業	10,200	98.00	999,600	
昭和シェル石油	12,500	1,013.00	12,662,500	
ニチレキ	1,000	929.00	929,000	
東燃ゼネラル石油	19,000	1,039.00	19,741,000	
ユシロ化学工業	700	1,407.00	984,900	
ピーピー・カストロール	500	1,292.00	646,000	
富士石油	2,900	338.00	980,200	

MORESCO	400	1,609.00	643,600	
出光興産	6,500	1,921.00	12,486,500	
JXホールディングス	147,700	504.40	74,499,880	
コスモエネルギーホールディングス	3,800	1,631.00	6,197,800	
横浜ゴム	7,500	1,911.00	14,332,500	
東洋ゴム工業	5,700	2,370.00	13,509,000	
ブリヂストン	42,100	4,217.00	177,535,700	
住友ゴム工業	11,700	1,592.00	18,626,400	
藤倉ゴム工業	1,100	544.00	598,400	
オカモト	4,000	1,083.00	4,332,000	
フコク	500	1,017.00	508,500	
ニッタ	1,300	3,240.00	4,212,000	
住友理工	2,700	957.00	2,583,900	
三ツ星ベルト	3,000	935.00	2,805,000	
バンドー化学	4,000	494.00	1,976,000	
日東紡績	8,000	318.00	2,544,000	
旭硝子	66,000	700.00	46,200,000	
日本板硝子	61,000	94.00	5,734,000	
石塚硝子	2,000	213.00	426,000	
日本山村硝子	5,000	178.00	890,000	
日本電気硝子	26,000	607.00	15,782,000	
オハラ	500	574.00	287,000	
住友大阪セメント	25,000	441.00	11,025,000	
太平洋セメント	78,000	351.00	27,378,000	
デイ・シイ	1,200	294.00	352,800	
日本ヒューム	1,200	709.00	850,800	
日本コンクリート工業	2,600	331.00	860,600	
三谷セキサン	600	1,574.00	944,400	
アジアパイルホールディングス	1,600	534.00	854,400	
東海カーボン	11,000	336.00	3,696,000	
日本カーボン	6,000	307.00	1,842,000	
東洋炭素	700	1,805.00	1,263,500	
ノリタケカンパニーリミテド	7,000	262.00	1,834,000	
TOTO	9,200	4,205.00	38,686,000	
日本碍子	16,000	2,719.00	43,504,000	
日本特殊陶業	10,700	3,185.00	34,079,500	

ダントーホールディングス	2,000	178.00	356,000	
MARUWA	500	2,579.00	1,289,500	
品川リフラクトリーズ	3,000	245.00	735,000	
黒崎播磨	3,000	267.00	801,000	
ヨータイ	1,000	324.00	324,000	
イソライト工業	600	236.00	141,600	
東京窯業	2,000	183.00	366,000	
ニッカトー	400	399.00	159,600	
フジミインコーポレーテッド	1,100	1,654.00	1,819,400	
エーアンドエーマテリアル	3,000	81.00	243,000	
ニチアス	6,000	770.00	4,620,000	
ニチハ	1,700	1,827.00	3,105,900	
新日鐵住金	56,300	2,382.50	134,134,750	
神戸製鋼所	230,000	128.00	29,440,000	
合同製鐵	7,000	226.00	1,582,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	34,100	1,933.50	65,932,350	
日新製鋼	5,700	1,259.00	7,176,300	
東京製鐵	6,900	776.00	5,354,400	
共英製鋼	1,300	2,152.00	2,797,600	
大和工業	2,800	3,140.00	8,792,000	
東京鐵鋼	3,000	532.00	1,596,000	
大阪製鐵	800	2,162.00	1,729,600	
淀川製鋼所	1,900	2,420.00	4,598,000	
東洋鋼鋳	3,000	421.00	1,263,000	
丸一鋼管	4,200	3,525.00	14,805,000	
モリ工業	2,000	350.00	700,000	
大同特殊鋼	21,000	482.00	10,122,000	
日本高周波鋼業	5,000	94.00	470,000	
日本冶金工業	9,400	130.00	1,222,000	
山陽特殊製鋼	8,000	579.00	4,632,000	
愛知製鋼	7,000	555.00	3,885,000	
日立金属	14,300	1,474.00	21,078,200	
日本金属	3,000	127.00	381,000	
大平洋金属	9,000	329.00	2,961,000	
新日本電工	7,100	208.00	1,476,800	
栗本鐵工所	6,000	215.00	1,290,000	

虹技	2,000	180.00	360,000	
日本鑄鉄管	2,000	165.00	330,000	
三菱製鋼	9,000	220.00	1,980,000	
日亜鋼業	1,900	288.00	547,200	
日本精線	1,000	536.00	536,000	
シンニッタン	1,100	611.00	672,100	
新家工業	3,000	131.00	393,000	
大紀アルミニウム工業所	2,000	301.00	602,000	
日本軽金属ホールディングス	28,400	213.00	6,049,200	
三井金属鉱業	32,000	217.00	6,944,000	
東邦亜鉛	7,000	266.00	1,862,000	
三菱マテリアル	78,000	384.00	29,952,000	
住友金属鉱山	34,000	1,435.00	48,790,000	
DOWAホールディングス	16,000	836.00	13,376,000	
古河機械金属	19,000	233.00	4,427,000	
エス・サイエンス	6,100	40.00	244,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,200	2,434.00	2,920,800	
東邦チタニウム	2,100	979.00	2,055,900	
UACJ	18,000	277.00	4,986,000	
古河電気工業	39,000	252.00	9,828,000	
住友電気工業	50,000	1,687.50	84,375,000	
フジクラ	17,000	646.00	10,982,000	
昭和電線ホールディングス	16,000	65.00	1,040,000	
タツタ電線	2,600	419.00	1,089,400	
沖電線	1,000	275.00	275,000	
カナレ電気	200	2,002.00	400,400	
平河ビューテック	300	1,832.00	549,600	
リョービ	8,000	493.00	3,944,000	
アーレスティ	1,500	693.00	1,039,500	
アサヒホールディングス	1,900	1,819.00	3,456,100	
稲葉製作所	700	1,230.00	861,000	
宮地エンジニアリンググループ	4,000	176.00	704,000	
トーカロ	900	2,460.00	2,214,000	
アルファC o	400	1,302.00	520,800	
SUMCO	9,800	909.00	8,908,200	
川田テクノロジーズ	200	3,580.00	716,000	

東洋製罐グループホールディングス	8,900	2,262.00	20,131,800	
ホッカホホールディングス	3,000	310.00	930,000	
コロナ	700	1,152.00	806,400	
横河ブリッジホールディングス	2,400	1,323.00	3,175,200	
駒井ハルテック	2,000	236.00	472,000	
高田機工	1,000	213.00	213,000	
三和ホールディングス	12,600	935.00	11,781,000	
文化シャッター	3,500	989.00	3,461,500	
三協立山	1,600	1,543.00	2,468,800	
アルインコ	700	1,145.00	801,500	
東洋シャッター	300	693.00	207,900	
LIXILグループ	17,400	2,671.00	46,475,400	
日本フィルコン	900	496.00	446,400	
ノーリツ	2,500	1,813.00	4,532,500	
長府製作所	1,300	2,757.00	3,584,100	
リンナイ	2,300	10,630.00	24,449,000	
ダイニチ工業	700	709.00	496,300	
日東精工	2,000	316.00	632,000	
三洋工業	2,000	169.00	338,000	
岡部	2,600	905.00	2,353,000	
ジーテクト	1,300	1,668.00	2,168,400	
中国工業	200	710.00	142,000	
東プレ	2,400	2,738.00	6,571,200	
高周波熱錬	2,300	931.00	2,141,300	
東京製綱	9,000	195.00	1,755,000	
サンコール	700	573.00	401,100	
モリテック スチール	700	277.00	193,900	
パイオラックス	600	6,630.00	3,978,000	
日本発條	11,700	1,184.00	13,852,800	
中央発條	1,000	285.00	285,000	
アドバネクス	200	1,743.00	348,600	
立川ブラインド工業	500	745.00	372,500	
三益半導体工業	900	1,111.00	999,900	
日本ドライケミカル	200	2,226.00	445,200	
日本製鋼所	19,000	409.00	7,771,000	
三浦工業	5,600	1,700.00	9,520,000	

タクマ	5,000	988.00	4,940,000	
ツガミ	4,000	501.00	2,004,000	
オークマ	8,000	974.00	7,792,000	
東芝機械	7,000	399.00	2,793,000	
アマダホールディングス	18,600	1,131.00	21,036,600	
アイダエンジニアリング	3,300	1,207.00	3,983,100	
滝澤鉄工所	4,000	156.00	624,000	
富士機械製造	4,100	1,175.00	4,817,500	
牧野フライス製作所	6,000	893.00	5,358,000	
オーエスジー	5,700	2,231.00	12,716,700	
ダイジェット工業	2,000	158.00	316,000	
旭ダイヤモンド工業	3,400	1,301.00	4,423,400	
D M G 森精機	6,900	1,401.00	9,666,900	
ソディック	2,400	868.00	2,083,200	
ディスコ	1,600	11,130.00	17,808,000	
日東工器	700	2,546.00	1,782,200	
パンチ工業	500	849.00	424,500	
豊和工業	700	602.00	421,400	
O K K	5,000	141.00	705,000	
東洋機械金属	1,000	428.00	428,000	
津田駒工業	3,000	111.00	333,000	
島精機製作所	1,800	1,921.00	3,457,800	
日阪製作所	1,600	942.00	1,507,200	
やまびこ	2,300	982.00	2,258,600	
ペガサスミシン製造	1,300	445.00	578,500	
ナブテスコ	6,600	2,417.00	15,952,200	
三井海洋開発	1,500	1,627.00	2,440,500	
レオン自動機	1,100	794.00	873,400	
S M C	3,700	31,260.00	115,662,000	
新川	1,100	549.00	603,900	
ホソカワミクロン	2,000	602.00	1,204,000	
ユニオンツール	500	3,200.00	1,600,000	
オイレス工業	1,600	2,015.00	3,224,000	
日精エー・エス・ビー機械	500	2,010.00	1,005,000	
サトーホールディングス	1,700	2,358.00	4,008,600	
日本エアーテック	500	643.00	321,500	

日精樹脂工業	900	889.00	800,100	
ワイエイシイ	500	882.00	441,000	
小松製作所	61,100	1,967.50	120,214,250	
住友重機械工業	37,000	536.00	19,832,000	
日立建機	5,600	1,842.00	10,315,200	
日工	2,000	385.00	770,000	
巴工業	500	1,534.00	767,000	
井関農機	13,000	175.00	2,275,000	
T O W A	1,200	727.00	872,400	
丸山製作所	3,000	184.00	552,000	
北川鉄工所	6,000	264.00	1,584,000	
クボタ	60,000	1,857.50	111,450,000	
荏原実業	400	1,470.00	588,000	
三菱化工機	4,000	229.00	916,000	
月島機械	2,400	1,064.00	2,553,600	
帝国電機製作所	900	891.00	801,900	
新東工業	2,800	959.00	2,685,200	
澁谷工業	1,000	1,674.00	1,674,000	
アイチ コーポレーション	1,800	792.00	1,425,600	
小森コーポレーション	3,100	1,407.00	4,361,700	
鶴見製作所	900	1,936.00	1,742,400	
住友精密工業	2,000	418.00	836,000	
酒井重工業	2,000	207.00	414,000	
荏原製作所	28,000	559.00	15,652,000	
石井鐵工所	2,000	182.00	364,000	
西島製作所	1,300	974.00	1,266,200	
北越工業	1,400	811.00	1,135,400	
ダイキン工業	17,400	8,664.00	150,753,600	
オルガノ	2,000	453.00	906,000	
トーヨーカネツ	7,000	250.00	1,750,000	
栗田工業	7,500	2,483.00	18,622,500	
椿本チエイン	7,000	894.00	6,258,000	
大同工業	2,000	205.00	410,000	
日本コンベヤ	4,000	146.00	584,000	
木村化工機	1,100	419.00	460,900	
アネスト岩田	2,000	1,003.00	2,006,000	

ダイフク	5,900	1,967.00	11,605,300	
サムコ	200	948.00	189,600	
加藤製作所	3,000	491.00	1,473,000	
油研工業	2,000	245.00	490,000	
タダノ	6,000	1,425.00	8,550,000	
フジテック	3,500	1,183.00	4,140,500	
C K D	3,300	1,182.00	3,900,600	
キトー	1,500	1,049.00	1,573,500	
平和	3,700	2,181.00	8,069,700	
理想科学工業	1,300	1,872.00	2,433,600	
S A N K Y O	3,300	4,520.00	14,916,000	
日本金銭機械	1,100	1,077.00	1,184,700	
マースエンジニアリング	700	1,980.00	1,386,000	
福島工業	700	2,708.00	1,895,600	
オーイズミ	500	621.00	310,500	
ダイコク電機	500	1,469.00	734,500	
竹内製作所	1,800	2,411.00	4,339,800	
アマノ	3,700	1,563.00	5,783,100	
J U K I	1,800	1,020.00	1,836,000	
サンデンホールディングス	7,000	351.00	2,457,000	
蛇の目マシン工業	1,200	755.00	906,000	
マックス	2,000	1,203.00	2,406,000	
グローリー	4,100	3,600.00	14,760,000	
新晃工業	800	1,502.00	1,201,600	
大和冷機工業	1,900	914.00	1,736,600	
セガサミーホールディングス	12,800	1,092.00	13,977,600	
日本ピストンリング	500	1,931.00	965,500	
リケン	6,000	408.00	2,448,000	
T P R	1,500	3,370.00	5,055,000	
ホシザキ電機	2,600	7,620.00	19,812,000	
大豊工業	1,000	1,501.00	1,501,000	
日本精工	24,500	1,320.00	32,340,000	
N T N	29,000	503.00	14,587,000	
ジェイテクト	12,700	1,977.00	25,107,900	
不二越	11,000	535.00	5,885,000	
日本トムソン	4,000	507.00	2,028,000	



THK	7,900	2,152.00	17,000,800
ユーシン精機	500	2,193.00	1,096,500
前澤給装工業	500	1,516.00	758,000
イーグル工業	1,500	2,192.00	3,288,000
前澤工業	900	336.00	302,400
日本ピラー工業	1,200	1,026.00	1,231,200
キット	5,800	518.00	3,004,400
日立工機	3,200	851.00	2,723,200
マキタ	7,800	6,800.00	53,040,000
日立造船	9,300	639.00	5,942,700
三菱重工業	212,000	517.50	109,710,000
IHI	92,000	322.00	29,624,000
日清紡ホールディングス	6,600	1,260.00	8,316,000
イビデン	7,800	1,700.00	13,260,000
コニカミノルタ	29,800	1,187.00	35,372,600
ブラザー工業	15,400	1,371.00	21,113,400
ミネベア	18,000	1,023.00	18,414,000
日立製作所	304,000	670.10	203,710,400
東芝	251,000	216.60	54,366,600
三菱電機	127,000	1,244.50	158,051,500
富士電機	36,000	502.00	18,072,000
東洋電機製造	2,000	400.00	800,000
安川電機	14,800	1,671.00	24,730,800
シンフォニアテクノロジー	8,000	188.00	1,504,000
明電舎	11,000	468.00	5,148,000
オリジン電気	2,000	306.00	612,000
山洋電気	3,000	738.00	2,214,000
デンヨー	1,100	1,863.00	2,049,300
東芝テック	9,000	416.00	3,744,000
芝浦メカトロニクス	2,000	210.00	420,000
マブチモーター	3,400	6,770.00	23,018,000
日本電産	14,400	8,622.00	124,156,800
東光高岳	700	1,494.00	1,045,800
ダイヘン	7,000	539.00	3,773,000
田淵電機	1,400	700.00	980,000
ヤーマン	100	1,788.00	178,800

JVCケンウッド	8,800	289.00	2,543,200	
ミマキエンジニアリング	800	445.00	356,000	
第一精工	500	1,495.00	747,500	
日新電機	2,800	965.00	2,702,000	
大崎電気工業	2,000	654.00	1,308,000	
オムロン	13,700	4,095.00	56,101,500	
日東工業	1,900	2,036.00	3,868,400	
I D E C	1,600	1,047.00	1,675,200	
不二電機工業	100	1,509.00	150,900	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	23,000	437.00	10,051,000	
サクサホールディングス	3,000	212.00	636,000	
メルコホールディングス	700	2,112.00	1,478,400	
テクノメディカ	300	2,835.00	850,500	
日本電気	164,000	369.00	60,516,000	
富士通	115,000	598.00	68,770,000	
沖電気工業	52,000	140.00	7,280,000	
岩崎通信機	6,000	68.00	408,000	
電気興業	3,000	513.00	1,539,000	
サンケン電気	6,000	407.00	2,442,000	
ナカヨ	1,000	351.00	351,000	
アイホン	700	1,894.00	1,325,800	
ルネサスエレクトロニクス	6,200	762.00	4,724,400	
セイコーエプソン	17,800	1,760.00	31,328,000	
ワコム	9,400	451.00	4,239,400	
アルバック	2,000	3,195.00	6,390,000	
アクセル	600	1,202.00	721,200	
E I Z O	1,200	2,810.00	3,372,000	
ジャパンディスプレイ	22,300	331.00	7,381,300	
日本信号	3,300	1,277.00	4,214,100	
京三製作所	3,000	356.00	1,068,000	
能美防災	1,300	1,473.00	1,914,900	
ホーチキ	900	1,053.00	947,700	
エレコム	1,000	1,503.00	1,503,000	
日本無線	3,000	353.00	1,059,000	
パナソニック	136,200	1,193.00	162,486,600	
シャープ	101,000	110.00	11,110,000	

アンリツ	7,200	765.00	5,508,000	
富士通ゼネラル	4,000	1,548.00	6,192,000	
日立国際電気	3,000	1,649.00	4,947,000	
ソニー	84,100	2,933.50	246,707,350	
T D K	7,200	7,660.00	55,152,000	
帝国通信工業	3,000	198.00	594,000	
ミツミ電機	4,600	684.00	3,146,400	
タムラ製作所	5,000	332.00	1,660,000	
アルプス電気	10,100	3,170.00	32,017,000	
池上通信機	4,000	174.00	696,000	
パイオニア	19,300	304.00	5,867,200	
日本電波工業	1,100	753.00	828,300	
鈴木	300	605.00	181,500	
日本トリム	300	4,130.00	1,239,000	
ローランド ディー . ジー .	600	2,553.00	1,531,800	
フォスター電機	1,500	2,535.00	3,802,500	
クラリオン	6,000	400.00	2,400,000	
S M K	3,000	566.00	1,698,000	
ヨコオ	900	544.00	489,600	
東光	2,000	381.00	762,000	
ティアック	9,000	50.00	450,000	
ホシデン	3,600	623.00	2,242,800	
ヒロセ電機	1,900	14,430.00	27,417,000	
日本航空電子工業	3,000	1,720.00	5,160,000	
T O A	1,400	1,223.00	1,712,200	
日立マクセル	2,000	2,115.00	4,230,000	
古野電気	1,400	817.00	1,143,800	
ユニデンホールディングス	4,000	131.00	524,000	
アルパイン	2,900	1,629.00	4,724,100	
スミダコーポレーション	1,000	758.00	758,000	
アイコム	600	2,408.00	1,444,800	
リオン	500	1,944.00	972,000	
船井電機	1,200	968.00	1,161,600	
横河電機	11,900	1,436.00	17,088,400	
新電元工業	4,000	441.00	1,764,000	
アズビル	3,900	3,055.00	11,914,500	

東亜ディーケーケー	500	546.00	273,000	
日本光電工業	5,000	2,900.00	14,500,000	
チノー	400	1,059.00	423,600	
共和電業	1,500	429.00	643,500	
日本電子材料	500	576.00	288,000	
堀場製作所	2,200	4,675.00	10,285,000	
アドバンテスト	8,200	997.00	8,175,400	
小野測器	600	889.00	533,400	
エスベック	1,200	1,445.00	1,734,000	
パナソニック デバイスSUNX	1,000	625.00	625,000	
キーエンス	2,700	65,430.00	176,661,000	
日置電機	600	2,195.00	1,317,000	
シスメックス	9,200	7,690.00	70,748,000	
メガチップス	1,300	1,013.00	1,316,900	
OBARA GROUP	800	4,255.00	3,404,000	
澤藤電機	1,000	212.00	212,000	
コーセル	1,600	1,044.00	1,670,400	
新日本無線	1,000	538.00	538,000	
オブテックス	900	2,862.00	2,575,800	
千代田インテグレ	600	2,771.00	1,662,600	
レーザーテック	1,200	1,276.00	1,531,200	
スタンレー電気	8,500	2,637.00	22,414,500	
岩崎電気	4,000	240.00	960,000	
ウシオ電機	7,200	1,664.00	11,980,800	
岡谷電機産業	600	391.00	234,600	
ヘリオス テクノ ホールディング	1,000	420.00	420,000	
日本セラミック	700	1,957.00	1,369,900	
遠藤照明	600	1,114.00	668,400	
日本デジタル研究所	1,000	1,609.00	1,609,000	
古河電池	1,000	770.00	770,000	
双信電機	600	304.00	182,400	
山一電機	1,100	862.00	948,200	
図研	900	1,161.00	1,044,900	
日本電子	5,000	779.00	3,895,000	
カシオ計算機	12,000	2,693.00	32,316,000	
ファナック	12,200	21,045.00	256,749,000	

日本シイエムケイ	2,600	339.00	881,400	
エンプラス	600	4,225.00	2,535,000	
大真空	2,000	209.00	418,000	
ローム	5,900	6,120.00	36,108,000	
浜松ホトニクス	9,300	3,280.00	30,504,000	
三井ハイテック	1,700	721.00	1,225,700	
新光電気工業	4,500	762.00	3,429,000	
京セラ	19,600	5,546.00	108,701,600	
太陽誘電	5,800	1,655.00	9,599,000	
村田製作所	12,500	17,240.00	215,500,000	
ユーシン	1,500	707.00	1,060,500	
双葉電子工業	2,100	1,560.00	3,276,000	
北陸電気工業	5,000	163.00	815,000	
ニチコン	3,800	934.00	3,549,200	
日本ケミコン	10,000	205.00	2,050,000	
K O A	1,700	983.00	1,671,100	
市光工業	3,000	225.00	675,000	
小糸製作所	7,200	4,910.00	35,352,000	
ミツバ	2,000	1,843.00	3,686,000	
スター精密	2,300	1,533.00	3,525,900	
S C R E E Nホールディングス	12,000	883.00	10,596,000	
キャノン電子	1,100	1,973.00	2,170,300	
キャノン	64,200	3,730.00	239,466,000	代用有価証券 10,000株
リコー	38,600	1,213.00	46,821,800	
M U T O Hホールディングス	1,000	244.00	244,000	
東京エレクトロン	10,700	7,281.00	77,906,700	
トヨタ紡織	4,200	2,456.00	10,315,200	
鬼怒川ゴム工業	3,000	627.00	1,881,000	
ユニプレス	2,500	2,676.00	6,690,000	
豊田自動織機	10,800	6,490.00	70,092,000	
モリタホールディングス	2,100	1,275.00	2,677,500	
三櫻工業	1,500	726.00	1,089,000	
デンソー	29,500	5,759.00	169,890,500	
東海理化電機製作所	3,500	2,962.00	10,367,000	
三井造船	46,000	191.00	8,786,000	

川崎重工業	93,000	439.00	40,827,000	
名村造船所	3,600	963.00	3,466,800	
サノヤスホールディングス	1,500	233.00	349,500	
日本車輛製造	5,000	266.00	1,330,000	
ニチュ三菱フォークリフト	1,400	467.00	653,800	
近畿車輛	2,000	382.00	764,000	
日産自動車	167,300	1,253.50	209,710,550	
いすゞ自動車	34,500	1,302.50	44,936,250	
トヨタ自動車	151,800	7,483.00	1,135,919,400	代用有価証券 35,000株
日野自動車	17,000	1,380.00	23,460,000	
三菱自動車工業	47,300	1,007.00	47,631,100	
エフテック	700	1,194.00	835,800	
レシップホールディングス	400	797.00	318,800	
G M B	200	994.00	198,800	
ファルテック	200	1,501.00	300,200	
武蔵精密工業	1,300	2,453.00	3,188,900	
日産車体	5,800	1,274.00	7,389,200	
新明和工業	5,000	1,065.00	5,325,000	
極東開発工業	2,400	1,309.00	3,141,600	
日信工業	2,700	1,737.00	4,689,900	
トピー工業	10,000	266.00	2,660,000	
ティラド	5,000	197.00	985,000	
曙ブレーキ工業	6,100	296.00	1,805,600	
タチエス	1,900	1,901.00	3,611,900	
N O K	5,800	2,814.00	16,321,200	
フタバ産業	3,700	518.00	1,916,600	
K Y B	13,000	354.00	4,602,000	
シロキ工業	3,000	382.00	1,146,000	
大同メタル工業	1,700	1,071.00	1,820,700	
プレス工業	6,300	510.00	3,213,000	
ミクニ	1,200	399.00	478,800	
カルソニックカンセイ	9,000	1,042.00	9,378,000	
太平洋工業	2,600	1,327.00	3,450,200	
ケーヒン	2,700	2,051.00	5,537,700	
河西工業	1,500	1,741.00	2,611,500	

アイシン精機	12,000	5,190.00	62,280,000
富士機工	1,400	469.00	656,600
マツダ	37,800	2,467.50	93,271,500
ダイハツ工業	14,200	1,618.00	22,975,600
今仙電機製作所	1,100	1,187.00	1,305,700
本田技研工業	107,300	3,858.00	413,963,400
スズキ	24,900	3,622.00	90,187,800
富士重工業	37,700	4,937.00	186,124,900
安永	400	558.00	223,200
ヤマハ発動機	16,800	2,696.00	45,292,800
ショーワ	3,100	1,124.00	3,484,400
T B K	1,400	466.00	652,400
エクセディ	1,600	2,831.00	4,529,600
豊田合成	4,300	2,766.00	11,893,800
愛三工業	2,100	1,224.00	2,570,400
盟和産業	200	1,050.00	210,000
ヨロズ	1,100	2,680.00	2,948,000
エフ・シー・シー	2,000	2,572.00	5,144,000
シマノ	4,800	18,490.00	88,752,000
タカタ	2,200	761.00	1,674,200
テイ・エス テック	2,800	3,050.00	8,540,000
ジャムコ	500	3,945.00	1,972,500
テルモ	18,300	3,715.00	67,984,500
クリエートメディック	400	956.00	382,400
日機装	4,500	937.00	4,216,500
島津製作所	15,000	1,971.00	29,565,000
J M S	2,000	298.00	596,000
モリテックス	300	206.00	61,800
長野計器	800	735.00	588,000
ブイ・テクノロジー	300	4,495.00	1,348,500
東京計器	4,000	211.00	844,000
愛知時計電機	1,000	316.00	316,000
オーバル	1,300	257.00	334,100
東京精密	2,300	2,658.00	6,113,400
マニー	1,100	2,263.00	2,489,300
ニコン	22,300	1,593.00	35,523,900

トプコン	4,000	2,000.00	8,000,000
オリンパス	17,800	4,630.00	82,414,000
理研計器	1,000	1,400.00	1,400,000
タムロン	1,000	2,231.00	2,231,000
H O Y A	27,700	4,873.00	134,982,100
ノーリツ鋼機	1,100	577.00	634,700
エー・アンド・デイ	1,100	412.00	453,200
シチズンホールディングス	14,700	855.00	12,568,500
リズム時計工業	5,000	151.00	755,000
大研医器	1,000	996.00	996,000
メニコン	600	3,490.00	2,094,000
松風	600	1,486.00	891,600
セイコーホールディングス	8,000	701.00	5,608,000
ニプロ	8,900	1,287.00	11,454,300
パラマウントベッドホールディングス	1,300	4,325.00	5,622,500
トランザクション	200	547.00	109,400
S H O - B I	500	397.00	198,500
ニホンフラッシュ	400	1,157.00	462,800
前田工織	1,300	1,036.00	1,346,800
永大産業	2,000	401.00	802,000
アートネイチャー	1,000	1,045.00	1,045,000
ダンロップスポーツ	800	847.00	677,600
バンダイナムコホールディングス	12,300	2,537.00	31,205,100
アイフィスジャパン	200	459.00	91,800
共立印刷	2,000	300.00	600,000
S H O E I	600	2,593.00	1,555,800
フランスベッドホールディングス	1,700	980.00	1,666,000
パイロットコーポレーション	2,100	4,845.00	10,174,500
萩原工業	200	2,018.00	403,600
トッパン・フォームズ	2,100	1,419.00	2,979,900
フジシールインターナショナル	1,400	3,610.00	5,054,000
タカラトミー	4,000	725.00	2,900,000
廣濟堂	1,200	414.00	496,800
A s - m e エステール	300	707.00	212,100
アーケ	5,200	101.00	525,200
タカノ	600	692.00	415,200



プロネクサス	1,100	957.00	1,052,700
ホクシン	1,200	116.00	139,200
ウッドワン	2,000	246.00	492,000
大建工業	5,000	332.00	1,660,000
凸版印刷	34,000	1,108.00	37,672,000
大日本印刷	35,000	1,186.00	41,510,000
図書印刷	2,000	532.00	1,064,000
共同印刷	4,000	313.00	1,252,000
日本写真印刷	2,000	2,309.00	4,618,000
光村印刷	1,000	237.00	237,000
宝印刷	600	1,339.00	803,400
アシックス	11,100	2,483.00	27,561,300
ツツミ	600	2,443.00	1,465,800
小松ウオール工業	400	1,984.00	793,600
ヤマハ	8,800	2,893.00	25,458,400
河合楽器製作所	500	2,219.00	1,109,500
クリナップ	1,400	724.00	1,013,600
ピジョン	6,700	2,873.00	19,249,100
兼松日産農林	2,000	158.00	316,000
キングジム	1,000	793.00	793,000
リンテック	2,800	2,520.00	7,056,000
T A S A K I	300	1,517.00	455,100
イトーキ	2,500	867.00	2,167,500
任天堂	7,400	16,220.00	120,028,000
三菱鉛筆	900	5,470.00	4,923,000
タカラスタANDARD	5,000	900.00	4,500,000
コクヨ	6,200	1,317.00	8,165,400
ナカバヤシ	3,000	291.00	873,000
岡村製作所	4,200	1,204.00	5,056,800
美津濃	6,000	559.00	3,354,000
アデランス	2,100	804.00	1,688,400
東京電力	101,100	673.00	68,040,300
中部電力	36,500	1,591.50	58,089,750
関西電力	48,600	1,382.00	67,165,200
中国電力	16,500	1,528.00	25,212,000
北陸電力	11,700	1,723.00	20,159,100

東北電力	29,800	1,460.00	43,508,000	
四国電力	10,700	1,809.00	19,356,300	
九州電力	26,300	1,238.00	32,559,400	
北海道電力	11,200	1,155.00	12,936,000	
沖縄電力	1,300	3,055.00	3,971,500	
電源開発	10,200	4,210.00	42,942,000	
東京瓦斯	133,000	545.50	72,551,500	
大阪瓦斯	123,000	422.60	51,979,800	
東邦瓦斯	30,000	749.00	22,470,000	
北海道瓦斯	3,000	276.00	828,000	
広島ガス	2,100	431.00	905,100	
西部瓦斯	14,000	274.00	3,836,000	
静岡ガス	3,400	757.00	2,573,800	
メタウォーター	800	2,917.00	2,333,600	
SBSホールディングス	1,200	940.00	1,128,000	
東武鉄道	64,000	582.00	37,248,000	
相鉄ホールディングス	20,000	686.00	13,720,000	
東京急行電鉄	69,000	945.00	65,205,000	
京浜急行電鉄	33,000	988.00	32,604,000	
小田急電鉄	38,000	1,274.00	48,412,000	
京王電鉄	33,000	1,028.00	33,924,000	
京成電鉄	18,000	1,515.00	27,270,000	
富士急行	3,000	1,120.00	3,360,000	
東日本旅客鉄道	21,800	11,300.00	246,340,000	
西日本旅客鉄道	11,500	8,212.00	94,438,000	
東海旅客鉄道	10,700	20,945.00	224,111,500	
西武ホールディングス	9,500	2,445.00	23,227,500	
鴻池運輸	1,700	1,562.00	2,655,400	
西日本鉄道	15,000	687.00	10,305,000	
ハマキョウレックス	900	2,183.00	1,964,700	
サカイ引越センター	200	6,390.00	1,278,000	
近鉄グループホールディングス	120,000	480.00	57,600,000	
阪急阪神ホールディングス	80,000	774.00	61,920,000	
南海電気鉄道	27,000	699.00	18,873,000	
京阪電気鉄道	27,000	796.00	21,492,000	
神戸電鉄	3,000	352.00	1,056,000	

名古屋鉄道	44,000	487.00	21,428,000	
山陽電気鉄道	4,000	458.00	1,832,000	
日本通運	46,000	564.00	25,944,000	
ヤマトホールディングス	22,000	2,564.50	56,419,000	
山九	16,000	603.00	9,648,000	
丸運	700	254.00	177,800	
丸全昭和運輸	4,000	425.00	1,700,000	
センコー	5,000	809.00	4,045,000	
トナミホールディングス	3,000	344.00	1,032,000	
ニッコンホールディングス	3,900	2,336.00	9,110,400	
日本石油輸送	2,000	239.00	478,000	
福山通運	7,000	593.00	4,151,000	
セイノーホールディングス	8,500	1,241.00	10,548,500	
神奈川中央交通	2,000	701.00	1,402,000	
日立物流	2,500	2,075.00	5,187,500	
丸和運輸機関	300	2,355.00	706,500	
C & F ロジホールディングス	1,200	929.00	1,114,800	
日本郵船	107,000	289.00	30,923,000	
商船三井	58,000	299.00	17,342,000	
川崎汽船	52,000	256.00	13,312,000	
N S ユナイテッド海運	5,000	200.00	1,000,000	
明治海運	1,100	494.00	543,400	
飯野海運	6,200	483.00	2,994,600	
共栄タンカー	1,000	203.00	203,000	
乾汽船	1,000	904.00	904,000	
日本航空	22,800	4,263.00	97,196,400	
A N A ホールディングス	221,000	341.60	75,493,600	
パスコ	1,000	410.00	410,000	
ランコム	300	6,330.00	1,899,000	
日新	5,000	349.00	1,745,000	
三菱倉庫	9,000	1,578.00	14,202,000	
三井倉庫ホールディングス	7,000	327.00	2,289,000	
住友倉庫	9,000	632.00	5,688,000	
澁澤倉庫	3,000	309.00	927,000	
東陽倉庫	2,000	252.00	504,000	
日本トランスシティ	3,000	440.00	1,320,000	

ケイヒン	2,000	169.00	338,000	
中央倉庫	700	986.00	690,200	
安田倉庫	900	894.00	804,600	
東洋埠頭	4,000	180.00	720,000	
宇徳	1,000	414.00	414,000	
上組	14,000	1,012.00	14,168,000	
サンリツ	300	531.00	159,300	
キムラユニティー	300	1,276.00	382,800	
キューソー流通システム	300	2,674.00	802,200	
郵船ロジスティクス	1,100	1,590.00	1,749,000	
近鉄エクスプレス	2,100	2,071.00	4,349,100	
東海運	700	286.00	200,200	
エーアイティー	600	1,145.00	687,000	
内外トランスライン	300	1,206.00	361,800	
N E C ネットズエスアイ	1,500	2,061.00	3,091,500	
システナ	1,200	1,338.00	1,605,600	
デジタルアーツ	600	2,015.00	1,209,000	
新日鉄住金ソリューションズ	1,000	5,510.00	5,510,000	
キューブシステム	500	578.00	289,000	
コア	500	1,195.00	597,500	
ソフトクリエイティブホールディングス	400	902.00	360,800	
I T ホールディングス	3,900	2,724.00	10,623,600	
ネオス	400	502.00	200,800	
電算システム	400	2,021.00	808,400	
グリー	7,200	549.00	3,952,800	
コーエーテクモホールディングス	2,800	1,714.00	4,799,200	
三菱総合研究所	500	3,340.00	1,670,000	
ボルテージ	200	1,063.00	212,600	
電算	100	2,311.00	231,100	
A G S	200	979.00	195,800	
ファインデックス	800	834.00	667,200	
ヒト・コミュニケーションズ	100	2,486.00	248,600	
ブレインパッド	200	639.00	127,800	
K L a b	1,800	767.00	1,380,600	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	800	1,072.00	857,600	

イーブックイニシアティブジャパン	300	724.00	217,200
ネクソン	11,200	1,895.00	21,224,000
アイスタイル	1,000	2,233.00	2,233,000
エムアップ	300	554.00	166,200
エイチーム	400	1,639.00	655,600
テクノスジャパン	100	3,035.00	303,500
コロブラ	3,200	2,366.00	7,571,200
モバイルクリエイト	700	430.00	301,000
オルトプラス	500	338.00	169,000
ブロードリーフ	1,200	1,065.00	1,278,000
ハーツユニテッドグループ	300	2,490.00	747,000
ブイキューブ	300	1,901.00	570,300
サイバーリンクス	100	1,322.00	132,200
VOYAGE GROUP	300	1,387.00	416,100
オブティム	100	4,045.00	404,500
ベリサーブ	200	1,719.00	343,800
ティーガイア	1,200	1,322.00	1,586,400
日本アジアグループ	1,000	590.00	590,000
豆蔵ホールディングス	900	623.00	560,700
テクマトリックス	500	1,565.00	782,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	20,600	319.00	6,571,400
GMOペイメントゲートウェイ	1,000	5,610.00	5,610,000
ザッパラス	700	434.00	303,800
インターネットイニシアティブ	1,900	2,340.00	4,446,000
GMOクラウド	300	763.00	228,900
SRAホールディングス	700	2,786.00	1,950,200
システムインテグレータ	200	750.00	150,000
朝日ネット	1,000	515.00	515,000
コムチュア	200	2,160.00	432,000
gumi	1,200	726.00	871,200
パイブドHD	100	1,460.00	146,000
フェイス	300	1,311.00	393,300
ハイマックス	100	1,181.00	118,100
野村総合研究所	8,200	4,540.00	37,228,000
サイバネットシステム	1,000	424.00	424,000
CEホールディングス	200	1,073.00	214,600

インテージホールディングス	600	1,597.00	958,200
東邦システムサイエンス	400	733.00	293,200
ソースネクスト	600	579.00	347,400
ティー・ワイ・オー	1,700	190.00	323,000
クレスコ	300	1,806.00	541,800
フジ・メディア・ホールディングス	12,200	1,401.00	17,092,200
オービック	4,100	6,300.00	25,830,000
ジャストシステム	2,100	897.00	1,883,700
TDCソフトウェアエンジニアリング	200	1,403.00	280,600
ヤフー	84,300	489.00	41,222,700
トレンドマイクロ	5,700	4,945.00	28,186,500
インフォメーション・ディベロプメント	200	903.00	180,600
日本オラクル	1,900	5,530.00	10,507,000
アルファシステムズ	400	1,900.00	760,000
フューチャーアーキテクト	1,400	742.00	1,038,800
CAC Holdings	900	940.00	846,000
ソフトバンク・テクノロジー	300	1,311.00	393,300
トーセ	400	749.00	299,600
オービックビジネスコンサルタント	600	6,650.00	3,990,000
伊藤忠テクノソリューションズ	2,700	2,352.00	6,350,400
アイティフォー	1,500	548.00	822,000
東計電算	200	2,239.00	447,800
エクスネット	100	1,516.00	151,600
大塚商会	3,200	5,900.00	18,880,000
サイボウズ	1,700	326.00	554,200
ソフトブレーン	1,800	165.00	297,000
電通国際情報サービス	700	2,245.00	1,571,500
EMシステムズ	200	2,441.00	488,200
ウェザーニューズ	300	4,335.00	1,300,500
C I J	1,100	497.00	546,700
東洋ビジネスエンジニアリング	100	1,420.00	142,000
日本エンタープライズ	1,100	215.00	236,500
WOWOW	600	2,965.00	1,779,000
フュージョンパートナー	700	518.00	362,600
日本コロムビア	500	447.00	223,500
イマジカ・ロボット ホールディングス	1,000	450.00	450,000

ネットワンシステムズ	5,100	755.00	3,850,500
アルゴグラフィックス	500	1,806.00	903,000
マーベラス	2,000	880.00	1,760,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	2,200	1,383.00	3,042,600
日本ユニシス	3,300	1,288.00	4,250,400
兼松エレクトロニクス	700	2,077.00	1,453,900
東京放送ホールディングス	7,000	1,891.00	13,237,000
日本テレビホールディングス	10,700	2,212.00	23,668,400
朝日放送	1,200	805.00	966,000
テレビ朝日ホールディングス	3,200	2,068.00	6,617,600
スカパーJ S A Tホールディングス	8,900	662.00	5,891,800
テレビ東京ホールディングス	1,100	2,236.00	2,459,600
日本BS放送	200	1,025.00	205,000
コネクシオ	1,000	1,124.00	1,124,000
日本通信	6,300	254.00	1,600,200
クロップス	200	533.00	106,600
日本電信電話	90,900	4,695.00	426,775,500
K D D I	119,500	3,116.00	372,362,000
光通信	1,400	8,030.00	11,242,000
N T T ドコモ	90,700	2,452.50	222,441,750
エムティーアイ	1,500	635.00	952,500
G M O インターネット	4,400	1,587.00	6,982,800
カドカワ	3,700	1,742.00	6,445,400
学研ホールディングス	4,000	262.00	1,048,000
ゼンリン	1,600	2,438.00	3,900,800
昭文社	700	694.00	485,800
インプレスホールディングス	1,100	139.00	152,900
アイネット	700	1,158.00	810,600
松竹	8,000	1,106.00	8,848,000
東宝	8,400	3,315.00	27,846,000
東映	4,000	1,142.00	4,568,000
A O I P r o .	600	998.00	598,800
エヌ・ティ・ティ・データ	7,300	5,770.00	42,121,000
ピー・シー・エー	100	1,489.00	148,900
ビジネスブレイン太田昭和	200	982.00	196,400
D T S	1,300	2,725.00	3,542,500

スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,000	2,830.00	14,150,000	
シーイーシー	800	1,161.00	928,800	
カブコン	3,000	2,859.00	8,577,000	
アイ・エス・ビー	100	769.00	76,900	
ジャステック	700	954.00	667,800	
S C S K	2,800	4,860.00	13,608,000	
日本システムウエア	500	878.00	439,000	
アイネス	1,700	1,067.00	1,813,900	
T K C	1,100	3,070.00	3,377,000	
富士ソフト	1,800	2,562.00	4,611,600	
N S D	2,500	1,687.00	4,217,500	
コナミホールディングス	5,300	2,776.00	14,712,800	
福井コンピュータホールディングス	300	1,151.00	345,300	
J B C Cホールディングス	1,000	730.00	730,000	
ミロク情報サービス	900	868.00	781,200	
ソフトバンクグループ	66,700	6,036.00	402,601,200	
ハウスイ	1,000	126.00	126,000	
高千穂交易	400	996.00	398,400	
伊藤忠食品	300	4,150.00	1,245,000	
エレマテック	500	2,840.00	1,420,000	
J A L U X	400	2,555.00	1,022,000	
あらた	500	2,580.00	1,290,000	
トーメンデバイス	200	1,937.00	387,400	
東京エレクトロン デバイス	400	1,540.00	616,000	
フィールズ	800	2,045.00	1,636,000	
双日	74,200	248.00	18,401,600	
アルフレッサ ホールディングス	14,800	2,334.00	34,543,200	
横浜冷凍	2,900	1,016.00	2,946,400	
神栄	2,000	151.00	302,000	
山下医科器械	100	1,749.00	174,900	
ラサ商事	600	597.00	358,200	
アルコニックス	700	1,521.00	1,064,700	
神戸物産	400	3,820.00	1,528,000	
あい ホールディングス	1,900	3,040.00	5,776,000	
ディービーエックス	300	1,111.00	333,300	
ダイワボウホールディングス	11,000	230.00	2,530,000	



マクニカ・富士エレホールディングス	2,100	1,541.00	3,236,100	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,000	958.00	1,916,000	
八洲電機	900	582.00	523,800	
U K Cホールディングス	700	2,718.00	1,902,600	
O C H Iホールディングス	400	1,002.00	400,800	
T O K A Iホールディングス	5,700	543.00	3,095,100	
三洋貿易	700	1,390.00	973,000	
ウイン・パートナーズ	400	1,710.00	684,000	
ミタチ産業	300	693.00	207,900	
シップヘルスケアホールディングス	2,400	2,939.00	7,053,600	
明治電機工業	400	1,185.00	474,000	
デリカフーズ	300	945.00	283,500	
スターティア	300	562.00	168,600	
富士興産	500	437.00	218,500	
協栄産業	2,000	153.00	306,000	
小野建	1,000	1,123.00	1,123,000	
佐島電機	900	692.00	622,800	
エコートレーディング	300	628.00	188,400	
伯東	900	1,173.00	1,055,700	
コンドーテック	900	749.00	674,100	
中山福	800	825.00	660,000	
ナガイレーベン	1,700	2,040.00	3,468,000	
三菱食品	1,300	2,917.00	3,792,100	
松田産業	900	1,386.00	1,247,400	
メディバルホールディングス	11,800	2,010.00	23,718,000	
アドヴァン	1,200	1,021.00	1,225,200	
S P K	300	2,169.00	650,700	
萩原電気	300	2,267.00	680,100	
アズワン	900	4,445.00	4,000,500	
スズデン	400	1,140.00	456,000	
シモジマ	800	1,065.00	852,000	
ドウシシャ	1,400	2,425.00	3,395,000	
小津産業	200	2,025.00	405,000	
高速	700	970.00	679,000	
たけびし	400	1,060.00	424,000	
黒田電気	2,200	2,218.00	4,879,600	

丸文	1,000	937.00	937,000	
ハピネット	1,100	1,086.00	1,194,600	
橋本総業	300	1,536.00	460,800	
エクセル	600	1,476.00	885,600	
マルカキカイ	400	1,688.00	675,200	
ガリバーインターナショナル	3,200	1,179.00	3,772,800	
日本エム・ディ・エム	1,000	672.00	672,000	
進和	700	1,668.00	1,167,600	
エスケイジャパン	300	426.00	127,800	
ダイトエレクトロン	500	788.00	394,000	
シークス	800	3,565.00	2,852,000	
田中商事	400	695.00	278,000	
オーハシテクニカ	700	1,303.00	912,100	
白銅	400	1,170.00	468,000	
伊藤忠商事	92,300	1,404.50	129,635,350	
丸紅	115,700	613.40	70,970,380	
高島	2,000	210.00	420,000	
長瀬産業	7,100	1,490.00	10,579,000	
蝶理	700	1,651.00	1,155,700	
豊田通商	13,100	2,790.00	36,549,000	
三共生興	1,700	462.00	785,400	
兼松	25,000	195.00	4,875,000	
ツカモトコーポレーション	3,000	118.00	354,000	
三井物産	106,400	1,405.00	149,492,000	
日本紙パルプ商事	6,000	325.00	1,950,000	
日立ハイテクノロジーズ	4,100	3,200.00	13,120,000	
カメイ	1,500	1,162.00	1,743,000	
東都水産	2,000	186.00	372,000	
OUGホールディングス	2,000	243.00	486,000	
スターゼン	400	3,300.00	1,320,000	
山善	4,500	1,088.00	4,896,000	
椿本興業	1,000	319.00	319,000	
住友商事	74,100	1,209.50	89,623,950	
内田洋行	3,000	452.00	1,356,000	
三菱商事	88,300	1,963.00	173,332,900	
第一実業	3,000	520.00	1,560,000	

キヤノンマーケティングジャパン	3,400	1,809.00	6,150,600	
西華産業	4,000	287.00	1,148,000	
佐藤商事	1,100	771.00	848,100	
菱洋エレクトロ	1,300	1,277.00	1,660,100	
東京産業	1,200	492.00	590,400	
ユアサ商事	1,100	2,894.00	3,183,400	
神鋼商事	3,000	233.00	699,000	
小林産業	800	203.00	162,400	
阪和興業	12,000	531.00	6,372,000	
カナデン	1,100	972.00	1,069,200	
菱電商事	2,000	790.00	1,580,000	
フルサト工業	700	1,775.00	1,242,500	
岩谷産業	14,000	603.00	8,442,000	
すてきナイスグループ	5,000	162.00	810,000	
昭光通商	5,000	73.00	365,000	
ニチモウ	2,000	191.00	382,000	
極東貿易	2,000	235.00	470,000	
イワキ	2,000	201.00	402,000	
三愛石油	3,000	975.00	2,925,000	
稲畑産業	2,800	1,193.00	3,340,400	
G S Iクレオス	3,000	113.00	339,000	
明和産業	1,100	400.00	440,000	
ワキタ	2,500	1,008.00	2,520,000	
東邦ホールディングス	3,800	2,848.00	10,822,400	
サンゲツ	4,300	2,168.00	9,322,400	
ミツウロコグループホールディングス	1,900	575.00	1,092,500	
シナネンホールディングス	3,000	464.00	1,392,000	
伊藤忠エネクス	3,000	911.00	2,733,000	
サンリオ	3,600	2,743.00	9,874,800	
サンワテクノス	800	945.00	756,000	
リョーサン	1,900	3,035.00	5,766,500	
新光商事	1,400	1,262.00	1,766,800	
トーヨー	500	2,441.00	1,220,500	
三信電気	1,600	1,219.00	1,950,400	
東陽テクニカ	1,700	1,060.00	1,802,000	
モスフードサービス	1,500	3,215.00	4,822,500	

加賀電子	1,100	1,786.00	1,964,600	
ソーダニッカ	1,200	501.00	601,200	
立花エレテック	900	1,309.00	1,178,100	
フォーバル	500	577.00	288,500	
PALTAC	1,900	2,158.00	4,100,200	
三谷産業	1,300	339.00	440,700	
太平洋興発	6,000	82.00	492,000	
ヤマタネ	6,000	181.00	1,086,000	
丸紅建材リース	1,000	210.00	210,000	
日鉄住金物産	8,000	400.00	3,200,000	
トラスコ中山	1,400	4,675.00	6,545,000	
オートバックスセブン	4,500	2,155.00	9,697,500	
加藤産業	1,800	2,755.00	4,959,000	
イノテック	1,100	550.00	605,000	
イエローハット	1,100	2,419.00	2,660,900	
J Kホールディングス	1,200	483.00	579,600	
日伝	500	2,956.00	1,478,000	
北沢産業	1,100	185.00	203,500	
杉本商事	700	1,379.00	965,300	
因幡電機産業	1,700	3,730.00	6,341,000	
バイテックホールディングス	400	1,181.00	472,400	
ミスミグループ本社	13,200	1,639.00	21,634,800	
アルテック	1,200	170.00	204,000	
タキヒヨー	2,000	494.00	988,000	
蔵王産業	200	1,377.00	275,400	
スズケン	5,400	4,470.00	24,138,000	
ジェコス	800	980.00	784,000	
ルネサスイーストン	700	409.00	286,300	
ローソン	4,400	9,640.00	42,416,000	
サンエー	800	5,280.00	4,224,000	
ダイユーエイト	300	862.00	258,600	
カワチ薬品	900	2,291.00	2,061,900	
エービーシー・マート	1,500	6,460.00	9,690,000	
ハードオフコーポレーション	600	1,486.00	891,600	
アスクル	1,200	4,745.00	5,694,000	
ゲオホールディングス	2,200	1,893.00	4,164,600	

アダストリア	1,100	5,850.00	6,435,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,000	98.00	196,000
くらコーポレーション	700	4,780.00	3,346,000
キャンドウ	600	1,562.00	937,200
パル	700	2,798.00	1,958,600
エディオン	5,000	890.00	4,450,000
サーラコーポレーション	1,000	624.00	624,000
ワッツ	500	852.00	426,000
ハローズ	400	3,695.00	1,478,000
あみやき亭	200	4,590.00	918,000
ひらまつ	1,600	711.00	1,137,600
ゲンキー	200	3,715.00	743,000
サッポロドラッグストアー	100	2,665.00	266,500
大黒天物産	300	4,455.00	1,336,500
ハニーズ	1,000	1,002.00	1,002,000
ファーマライズホールディングス	300	561.00	168,300
アルペン	1,000	1,981.00	1,981,000
クオール	1,200	1,730.00	2,076,000
ジェイアイエヌ	800	4,395.00	3,516,000
ピックカメラ	6,100	1,020.00	6,222,000
DCMホールディングス	5,800	780.00	4,524,000
Monotaro	4,100	3,440.00	14,104,000
東京一番フーズ	200	569.00	113,800
ダイヤモンドダイニング	200	1,188.00	237,600
きちり	300	719.00	215,700
アークランドサービス	200	5,690.00	1,138,000
J.フロント リテイリング	14,900	1,847.00	27,520,300
ドトール・日レスホールディングス	2,100	1,785.00	3,748,500
マツモトキヨシホールディングス	2,400	6,230.00	14,952,000
ブロンコビリー	500	2,427.00	1,213,500
スタートトゥデイ	3,700	3,845.00	14,226,500
トレジャー・ファクトリー	300	1,020.00	306,000
物語コーポレーション	300	5,600.00	1,680,000
ココカラファイン	1,200	5,210.00	6,252,000
三越伊勢丹ホールディングス	23,400	1,584.00	37,065,600
ウエルシアホールディングス	1,000	6,690.00	6,690,000

クリエイトSDホールディングス	1,800	2,856.00	5,140,800
丸善CHIホールディングス	1,400	347.00	485,800
ミサワ	100	604.00	60,400
エー・ピーカンパニー	200	1,500.00	300,000
チムニー	300	2,993.00	897,900
ネクステージ	200	774.00	154,800
ジョイフル本田	1,700	2,426.00	4,124,200
麒麟堂ホールディングス	400	1,264.00	505,600
ホットランド	300	1,470.00	441,000
すかいらーく	3,600	1,544.00	5,558,400
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	1,001.00	3,903,900
ブックオフコーポレーション	700	896.00	627,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	200	824.00	164,800
あさひ	900	1,260.00	1,134,000
日本調剤	300	4,790.00	1,437,000
コスモス薬品	600	18,520.00	11,112,000
トーエル	700	637.00	445,900
一六堂	300	383.00	114,900
セブン&アイ・ホールディングス	49,200	5,458.00	268,533,600
薬王堂	200	2,851.00	570,200
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	1,100	3,230.00	3,553,000
ツルハホールディングス	2,500	10,580.00	26,450,000
サンマルクホールディングス	900	3,260.00	2,934,000
フェリシモ	400	1,092.00	436,800
トリドール	1,400	2,129.00	2,980,600
クスリのアオキ	900	5,910.00	5,319,000
メディカルシステムネットワーク	1,400	643.00	900,200
総合メディカル	600	4,545.00	2,727,000
はるやま商事	500	748.00	374,000
カッパ・クリエイト	1,700	1,184.00	2,012,800
ライトオン	900	1,515.00	1,363,500
ジーンズメイト	500	220.00	110,000
良品計画	1,300	24,820.00	32,266,000
三城ホールディングス	1,500	456.00	684,000
アルビス	300	2,122.00	636,600

コナカ	1,400	667.00	933,800	
ハウス オブ ローゼ	200	1,450.00	290,000	
G - 7ホールディングス	400	1,516.00	606,400	
イオン北海道	800	536.00	428,800	
コジマ	1,800	271.00	487,800	
ヒマラヤ	400	1,052.00	420,800	
コーナン商事	1,700	1,594.00	2,709,800	
エコス	400	1,501.00	600,400	
マルシェ	400	844.00	337,600	
ドンキホーテホールディングス	7,600	4,385.00	33,326,000	
西松屋チェーン	2,300	1,027.00	2,362,100	
ゼンショーホールディングス	6,100	1,505.00	9,180,500	
幸楽苑ホールディングス	700	1,547.00	1,082,900	
ハークスレイ	400	1,408.00	563,200	
サイゼリヤ	1,900	3,015.00	5,728,500	
V Tホールディングス	4,000	696.00	2,784,000	
魚力	400	1,351.00	540,400	
ポプラ	400	524.00	209,600	
ユナイテッドアローズ	1,700	5,040.00	8,568,000	
ハイデイ日高	900	3,285.00	2,956,500	
京都きもの友禅	800	830.00	664,000	
コロワイド	3,900	1,807.00	7,047,300	
壱番屋	500	5,790.00	2,895,000	
トップカルチャー	500	489.00	244,500	
P L A N T	300	1,262.00	378,600	
スギホールディングス	2,100	6,640.00	13,944,000	
スクロール	1,800	411.00	739,800	
ヨンドシーホールディングス	900	2,683.00	2,414,700	
ファミリーマート	3,600	5,630.00	20,268,000	
木曽路	1,400	2,128.00	2,979,200	
サトレストランシステムズ	1,400	872.00	1,220,800	
千趣会	2,400	791.00	1,898,400	
タカキュー	1,000	194.00	194,000	
ケーヨー	2,000	493.00	986,000	
上新電機	3,000	1,071.00	3,213,000	
日本瓦斯	1,400	2,944.00	4,121,600	

ベスト電器	4,100	120.00	492,000	
ロイヤルホールディングス	2,000	2,375.00	4,750,000	
東天紅	1,000	145.00	145,000	
いなげや	1,300	1,266.00	1,645,800	
島忠	3,000	2,636.00	7,908,000	
チヨダ	1,400	3,705.00	5,187,000	
ライフコーポレーション	700	2,923.00	2,046,100	
リンガーハット	1,100	2,707.00	2,977,700	
さが美	1,000	111.00	111,000	
Mr Max	1,100	343.00	377,300	
テンアライド	1,200	393.00	471,600	
AOKIホールディングス	2,700	1,549.00	4,182,300	
オークワ	2,000	1,074.00	2,148,000	
コメリ	1,800	2,426.00	4,366,800	
青山商事	2,200	4,630.00	10,186,000	
しまむら	1,400	13,900.00	19,460,000	
はせがわ	500	453.00	226,500	
高島屋	17,000	1,049.00	17,833,000	
松屋	2,400	1,188.00	2,851,200	
エイチ・ツー・オー リテイリング	6,000	2,349.00	14,094,000	
近鉄百貨店	4,000	321.00	1,284,000	
丸栄	3,000	101.00	303,000	
ニッセンホールディングス	1,900	172.00	326,800	
パルコ	1,100	1,073.00	1,180,300	
丸井グループ	14,500	1,962.00	28,449,000	
アクシアル リテイリング	900	4,015.00	3,613,500	
イオン	48,400	1,836.00	88,862,400	
ユニグループ・ホールディングス	11,300	756.00	8,542,800	
イズミ	2,300	4,685.00	10,775,500	
東武ストア	2,000	301.00	602,000	
平和堂	2,400	2,655.00	6,372,000	
フジ	1,300	2,420.00	3,146,000	
ヤオコー	1,300	4,865.00	6,324,500	
ゼビオホールディングス	1,600	2,275.00	3,640,000	
ケーズホールディングス	2,500	4,080.00	10,200,000	
Olympicグループ	800	596.00	476,800	



日産東京販売ホールディングス	2,000	303.00	606,000	
アインホールディングス	1,400	5,830.00	8,162,000	
元気寿司	300	2,163.00	648,900	
ヤマダ電機	35,800	514.00	18,401,200	
アークランドサカモト	1,000	2,713.00	2,713,000	
ニトリホールディングス	5,100	10,040.00	51,204,000	
愛眼	1,100	236.00	259,600	
ケーユーホールディングス	600	802.00	481,200	
吉野家ホールディングス	4,400	1,508.00	6,635,200	
松屋フーズ	600	2,858.00	1,714,800	
サガミチェーン	1,600	1,236.00	1,977,600	
関西スーパーマーケット	1,000	805.00	805,000	
王将フードサービス	900	4,015.00	3,613,500	
プレナス	1,300	1,994.00	2,592,200	
ミニストップ	900	2,259.00	2,033,100	
アークス	2,200	2,600.00	5,720,000	
バローホールディングス	2,500	2,769.00	6,922,500	
藤久	100	1,756.00	175,600	
ベルク	600	4,450.00	2,670,000	
大庄	600	1,503.00	901,800	
ファーストリテイリング	2,400	43,140.00	103,536,000	
サンドラッグ	2,500	7,740.00	19,350,000	
サックスパー ホールディングス	1,100	1,742.00	1,916,200	
ヤマザワ	300	1,678.00	503,400	
やまや	200	2,082.00	416,400	
ベルーナ	2,900	652.00	1,890,800	
島根銀行	200	1,424.00	284,800	
じもとホールディングス	8,400	192.00	1,612,800	
足利ホールディングス	8,600	448.00	3,852,800	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	1,500	3,835.00	5,752,500	
九州フィナンシャルグループ	18,000	792.00	14,256,000	
新生銀行	102,000	217.00	22,134,000	
あおぞら銀行	75,000	418.00	31,350,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	943,900	742.10	700,468,190	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	137,600	572.10	78,720,960	

三井住友トラスト・ホールディングス	244,000	448.60	109,458,400	
三井住友フィナンシャルグループ	94,200	4,492.00	423,146,400	代用有価証券 10,000株
第四銀行	15,000	513.00	7,695,000	
北越銀行	13,000	244.00	3,172,000	
西日本シティ銀行	38,000	304.00	11,552,000	
千葉銀行	45,000	833.00	37,485,000	
横浜銀行	79,000	717.00	56,643,000	
常陽銀行	43,000	544.00	23,392,000	
群馬銀行	26,000	685.00	17,810,000	
武蔵野銀行	1,900	4,250.00	8,075,000	
千葉興業銀行	3,200	637.00	2,038,400	
筑波銀行	4,900	386.00	1,891,400	
七十七銀行	18,000	621.00	11,178,000	
青森銀行	9,000	370.00	3,330,000	
秋田銀行	8,000	392.00	3,136,000	
山形銀行	7,000	450.00	3,150,000	
岩手銀行	800	4,790.00	3,832,000	
東邦銀行	10,000	408.00	4,080,000	
東北銀行	6,000	154.00	924,000	
みちのく銀行	6,000	200.00	1,200,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	51,000	580.00	29,580,000	
静岡銀行	35,000	1,147.00	40,145,000	
十六銀行	15,000	456.00	6,840,000	
スルガ銀行	12,400	2,424.00	30,057,600	
八十二銀行	21,000	715.00	15,015,000	
山梨中央銀行	7,000	583.00	4,081,000	
大垣共立銀行	16,000	469.00	7,504,000	
福井銀行	10,000	227.00	2,270,000	
北國銀行	13,000	385.00	5,005,000	
清水銀行	400	2,954.00	1,181,600	
富山銀行	200	4,320.00	864,000	
滋賀銀行	11,000	577.00	6,347,000	
南都銀行	11,000	364.00	4,004,000	
百五銀行	11,000	562.00	6,182,000	
京都銀行	23,000	1,086.00	24,978,000	

紀陽銀行	4,600	1,676.00	7,709,600	
三重銀行	5,000	259.00	1,295,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	80,000	237.00	18,960,000	
広島銀行	35,000	666.00	23,310,000	
山陰合同銀行	7,100	941.00	6,681,100	
中国銀行	8,300	1,558.00	12,931,400	
鳥取銀行	4,000	209.00	836,000	
伊予銀行	12,600	1,134.00	14,288,400	
百十四銀行	13,000	433.00	5,629,000	
四国銀行	9,000	266.00	2,394,000	
阿波銀行	10,000	683.00	6,830,000	
大分銀行	7,000	449.00	3,143,000	
宮崎銀行	8,000	371.00	2,968,000	
佐賀銀行	7,000	267.00	1,869,000	
十八銀行	7,000	342.00	2,394,000	
沖縄銀行	900	4,495.00	4,045,500	
琉球銀行	2,400	1,622.00	3,892,800	
セブン銀行	44,100	515.00	22,711,500	
みずほフィナンシャルグループ	1,656,900	238.00	394,342,200	
高知銀行	4,000	141.00	564,000	
山口フィナンシャルグループ	11,000	1,390.00	15,290,000	
長野銀行	4,000	202.00	808,000	
名古屋銀行	10,000	420.00	4,200,000	
北洋銀行	17,700	407.00	7,203,900	
愛知銀行	400	6,310.00	2,524,000	
第三銀行	7,000	175.00	1,225,000	
中京銀行	5,000	225.00	1,125,000	
東日本銀行	6,000	384.00	2,304,000	
大光銀行	4,000	242.00	968,000	
愛媛銀行	7,000	246.00	1,722,000	
トマト銀行	5,000	172.00	860,000	
みなと銀行	11,000	191.00	2,101,000	
京葉銀行	10,000	547.00	5,470,000	
関西アーバン銀行	1,600	1,290.00	2,064,000	
栃木銀行	6,000	660.00	3,960,000	
北日本銀行	400	3,245.00	1,298,000	

東和銀行	16,000	105.00	1,680,000	
福島銀行	15,000	95.00	1,425,000	
大東銀行	7,000	207.00	1,449,000	
トモニホールディングス	9,000	438.00	3,942,000	
フィデアホールディングス	7,200	258.00	1,857,600	
池田泉州ホールディングス	12,400	477.00	5,914,800	
F P G	3,500	923.00	3,230,500	
S B Iホールディングス	14,100	1,269.00	17,892,900	
ジャフコ	2,000	4,590.00	9,180,000	
大和証券グループ本社	110,000	730.50	80,355,000	
野村ホールディングス	226,400	670.20	151,733,280	
岡三証券グループ	10,000	677.00	6,770,000	
丸三証券	3,500	1,235.00	4,322,500	
東洋証券	5,000	367.00	1,835,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	13,500	712.00	9,612,000	
光世証券	3,000	167.00	501,000	
水戸証券	3,700	400.00	1,480,000	
いちよし証券	2,600	1,071.00	2,784,600	
松井証券	6,000	1,102.00	6,612,000	
だいこう証券ビジネス	600	1,054.00	632,400	
マネックスグループ	13,900	312.00	4,336,800	
カブドットコム証券	10,400	373.00	3,879,200	
極東証券	1,600	1,450.00	2,320,000	
岩井コスモホールディングス	1,100	1,320.00	1,452,000	
藍澤證券	1,700	663.00	1,127,100	
マネースクウェアHD	400	1,423.00	569,200	
マネーパートナーズグループ	1,200	407.00	488,400	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	26,100	3,975.00	103,747,500	
アニコムホールディングス	800	3,240.00	2,592,000	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	35,200	3,497.00	123,094,400	
ソニーフィナンシャルホールディングス	11,300	2,164.00	24,453,200	
第一生命保険	75,400	2,011.00	151,629,400	
東京海上ホールディングス	47,700	4,651.00	221,852,700	
T & Dホールディングス	42,900	1,592.50	68,318,250	
全国保証	3,100	4,000.00	12,400,000	

クレディセゾン	8,900	2,338.00	20,808,200	
芙蓉総合リース	1,400	5,560.00	7,784,000	
興銀リース	2,200	2,425.00	5,335,000	
東京センチュリーリース	2,800	4,270.00	11,956,000	
日本証券金融	5,300	607.00	3,217,100	
アイフル	19,800	368.00	7,286,400	
ポケットカード	1,200	523.00	627,600	
リコーリース	900	3,645.00	3,280,500	
イオンフィナンシャルサービス	7,700	2,663.00	20,505,100	
アコム	23,600	566.00	13,357,600	
ジャックス	6,000	414.00	2,484,000	
オリエントコーポレーション	51,000	246.00	12,546,000	
日立キャピタル	2,800	3,210.00	8,988,000	
アプラスフィナンシャル	5,900	104.00	613,600	
オリックス	83,300	1,680.00	139,944,000	
三菱UFJリース	29,900	609.00	18,209,100	
日本取引所グループ	34,600	1,891.00	65,428,600	
イー・ギャランティ	400	2,542.00	1,016,800	
アサックス	200	1,570.00	314,000	
NECキャピタルソリューション	500	1,574.00	787,000	
日本駐車場開発	13,000	136.00	1,768,000	
ヒューリック	24,500	1,064.00	26,068,000	
三栄建築設計	500	1,334.00	667,000	
野村不動産ホールディングス	7,800	2,192.00	17,097,600	
三重交通グループホールディングス	2,200	453.00	996,600	
サムティ	600	1,186.00	711,600	
ディア・ライフ	600	344.00	206,400	
エー・ディー・ワークス	8,100	49.00	396,900	
プレサンスコーポレーション	400	3,855.00	1,542,000	
ユニゾホールディングス	700	4,660.00	3,262,000	
日本管理センター	800	1,480.00	1,184,000	
サンセイランディック	300	833.00	249,900	
エストラスト	200	509.00	101,800	
フージャースホールディングス	1,700	514.00	873,800	
オープンハウス	1,700	2,242.00	3,811,400	
東急不動産ホールディングス	28,500	743.00	21,175,500	

飯田グループホールディングス	10,900	2,239.00	24,405,100	
エコナックホールディングス	4,000	51.00	204,000	
パーク24	5,900	2,833.00	16,714,700	
パラカ	400	1,538.00	615,200	
三井不動産	62,000	3,032.00	187,984,000	
三菱地所	87,000	2,486.50	216,325,500	
平和不動産	2,300	1,286.00	2,957,800	
東京建物	12,900	1,304.00	16,821,600	
ダイビル	3,100	972.00	3,013,200	
京阪神ビルディング	2,000	668.00	1,336,000	
住友不動産	28,000	3,468.00	97,104,000	
大京	22,000	188.00	4,136,000	
テオーシー	4,600	995.00	4,577,000	
東京楽天地	2,000	505.00	1,010,000	
レオパレス21	13,900	642.00	8,923,800	
スターツコーポレーション	1,400	2,309.00	3,232,600	
フジ住宅	1,500	757.00	1,135,500	
空港施設	1,500	545.00	817,500	
明和地所	700	498.00	348,600	
住友不動産販売	900	2,645.00	2,380,500	
ゴールドクレスト	900	2,178.00	1,960,200	
日本エスリード	500	1,104.00	552,000	
日神不動産	1,600	411.00	657,600	
タカラレーベン	5,200	674.00	3,504,800	
サンヨーハウジング名古屋	700	1,155.00	808,500	
イオンモール	7,600	2,046.00	15,549,600	
ファースト住建	400	1,298.00	519,200	
トーセイ	1,800	745.00	1,341,000	
穴吹興産	1,000	246.00	246,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	7,400	1,152.00	8,524,800	
サンフロンティア不動産	1,400	870.00	1,218,000	
エフ・ジェー・ネクスト	1,000	512.00	512,000	
ランドビジネス	900	305.00	274,500	
グランディハウス	1,100	391.00	430,100	
日本空港ビルデング	3,800	5,300.00	20,140,000	
日本工営	4,000	428.00	1,712,000	

ネクスト	3,500	1,483.00	5,190,500
ジェイエイシーリクルートメント	600	892.00	535,200
日本M&Aセンター	1,900	5,620.00	10,678,000
ノバレーゼ	300	942.00	282,600
アコーディア・ゴルフ	3,500	1,112.00	3,892,000
タケエイ	1,100	979.00	1,076,900
トラスト・テック	200	2,547.00	509,400
パソナグループ	900	843.00	758,700
CDS	300	954.00	286,200
リンクアンドモチベーション	2,600	123.00	319,800
GCAサヴィアン	1,100	1,187.00	1,305,700
エス・エム・エス	1,600	2,442.00	3,907,200
テンプホールディングス	8,900	1,841.00	16,384,900
リニカル	400	3,730.00	1,492,000
クックパッド	2,800	2,636.00	7,380,800
エスクリ	500	1,015.00	507,500
アイ・ケイ・ケイ	700	590.00	413,000
学情	500	1,207.00	603,500
スタジオアリス	600	2,139.00	1,283,400
シミックホールディングス	600	1,523.00	913,800
NJS	300	1,490.00	447,000
総合警備保障	4,200	5,640.00	23,688,000
カカクコム	9,000	2,304.00	20,736,000
ルネサンス	700	1,258.00	880,600
ディップ	1,400	2,466.00	3,452,400
オプトホールディング	800	578.00	462,400
新日本科学	1,200	376.00	451,200
ツクイ	1,500	1,331.00	1,996,500
総合臨床ホールディングス	700	479.00	335,300
キャリアデザインセンター	400	1,228.00	491,200
エムスリー	10,800	2,494.00	26,935,200
ツカダ・グローバルホールディング	900	783.00	704,700
アウトソーシング	600	3,055.00	1,833,000
ウェルネット	400	3,075.00	1,230,000
ディー・エヌ・エー	5,600	1,825.00	10,220,000
博報堂DYホールディングス	17,300	1,307.00	22,611,100

ぐるなび	1,500	2,516.00	3,774,000	
エスアールジータカミヤ	1,000	447.00	447,000	
一休	900	3,420.00	3,078,000	
ジャパンベストレスキューシステム	1,500	237.00	355,500	
ファンコミュニケーションズ	2,900	716.00	2,076,400	
ジェイコムホールディングス	300	1,480.00	444,000	
WDBホールディングス	400	1,127.00	450,800	
ティア	600	718.00	430,800	
バリューコマース	1,200	466.00	559,200	
インフォマート	1,800	1,186.00	2,134,800	
J Pホールディングス	3,100	321.00	995,100	
E P Sホールディングス	1,200	1,249.00	1,498,800	
レグス	200	785.00	157,000	
プレステージ・インターナショナル	1,100	1,104.00	1,214,400	
アミューズ	300	5,770.00	1,731,000	
ドリームインキュベータ	400	2,585.00	1,034,000	
クイック	600	967.00	580,200	
T A C	800	221.00	176,800	
ケネディクス	16,800	431.00	7,240,800	
電通	13,900	6,650.00	92,435,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	687.00	412,200	
ぴあ	400	2,274.00	909,600	
イオンファンタジー	400	2,048.00	819,200	
シーティーエス	300	736.00	220,800	
みらかホールディングス	3,200	5,190.00	16,608,000	
アルプス技研	500	2,450.00	1,225,000	
サニックス	2,000	196.00	392,000	
ダイオーズ	200	1,171.00	234,200	
日本空調サービス	600	1,211.00	726,600	
オリエンタルランド	13,400	7,045.00	94,403,000	
ダスキン	3,500	2,162.00	7,567,000	
明光ネットワークジャパン	1,400	1,361.00	1,905,400	
ファルコホールディングス	500	1,433.00	716,500	
秀英予備校	200	672.00	134,400	
田谷	300	677.00	203,100	
ラウンドワン	3,900	529.00	2,063,100	



リゾートトラスト	5,200	3,145.00	16,354,000	
ビー・エム・エル	700	3,505.00	2,453,500	
ワタベウェディング	400	438.00	175,200	
りらいあコミュニケーションズ	2,100	1,011.00	2,123,100	
リソー教育	2,400	348.00	835,200	
早稲田アカデミー	200	840.00	168,000	
ユー・エス・エス	15,100	1,814.00	27,391,400	
東京個別指導学院	600	626.00	375,600	
サイバーエージェント	3,000	4,915.00	14,745,000	
楽天	58,200	1,369.00	79,675,800	
テー・オー・ダブリュー	700	672.00	470,400	
セントラルスポーツ	400	2,306.00	922,400	
フルキャストホールディングス	1,200	713.00	855,600	
リゾートソリューション	1,000	330.00	330,000	
テクノプロ・ホールディングス	1,800	3,475.00	6,255,000	
リブセンス	900	325.00	292,500	
ジャパンマテリアル	500	2,434.00	1,217,000	
ベクトル	400	2,048.00	819,200	
ウチヤマホールディングス	700	475.00	332,500	
サクセスホールディングス	100	1,369.00	136,900	
キャリアリンク	200	1,527.00	305,400	
I B J	200	1,664.00	332,800	
アサンテ	500	1,471.00	735,500	
N・フィールド	400	1,341.00	536,400	
M&Aキャピタルパートナーズ	100	1,770.00	177,000	
E R Iホールディングス	400	821.00	328,400	
アビスト	100	2,086.00	208,600	
ウィルグループ	300	872.00	261,600	
日本ビューホテル	100	1,842.00	184,200	
リクルートホールディングス	25,100	3,505.00	87,975,500	
リロ・ホールディング	500	14,230.00	7,115,000	
東祥	400	3,040.00	1,216,000	
エイチ・アイ・エス	2,000	4,040.00	8,080,000	
ラックランド	200	1,727.00	345,400	
共立メンテナンス	900	10,130.00	9,117,000	
イチネンホールディングス	1,300	1,094.00	1,422,200	

建設技術研究所	700	1,227.00	858,900	
スペース	700	1,376.00	963,200	
燦ホールディングス	300	1,464.00	439,200	
スバル興業	1,000	435.00	435,000	
東京テアトル	5,000	133.00	665,000	
よみうりランド	2,000	385.00	770,000	
東京都競馬	9,000	263.00	2,367,000	
常盤興産	5,000	150.00	750,000	
カナモト	1,700	2,986.00	5,076,200	
東京ドーム	10,000	556.00	5,560,000	
西尾レントオール	1,000	3,100.00	3,100,000	
トランス・コスモス	1,400	3,035.00	4,249,000	
乃村工藝社	2,700	1,779.00	4,803,300	
藤田観光	4,000	598.00	2,392,000	
KNT - CTホールディングス	6,000	225.00	1,350,000	
日本管財	1,100	1,853.00	2,038,300	
トーカイ	500	3,340.00	1,670,000	
白洋舎	2,000	276.00	552,000	
セコム	12,900	8,137.00	104,967,300	
セントラル警備保障	600	1,777.00	1,066,200	
丹青社	2,300	976.00	2,244,800	
メイテック	1,600	4,040.00	6,464,000	
アサツー ディ・ケイ	2,200	3,250.00	7,150,000	
応用地質	1,300	1,338.00	1,739,400	
船井総研ホールディングス	1,400	2,032.00	2,844,800	
進学会	600	596.00	357,600	
オオバ	700	448.00	313,600	
ベネッセホールディングス	4,200	3,380.00	14,196,000	
イオンディライト	1,200	3,785.00	4,542,000	
ナック	800	967.00	773,600	
ニチイ学館	2,200	837.00	1,841,400	
ダイセキ	2,300	1,863.00	4,284,900	
ステップ	400	1,087.00	434,800	
合 計	19,675,000		26,622,697,820	

## (2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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

#### 貸借対照表

	（単位：円）	
	平成27年 6月25日現在	平成27年12月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	147,963,309	703,666,128
コール・ローン	611,276,463	1,220,741,445
株式	82,998,854,455	72,126,738,590
投資証券	1,998,281,641	1,924,665,278
派生商品評価勘定	34,969,591	27,248,718
未収入金	6,631,553	175,892
未収配当金	124,686,987	85,614,114
未収利息	987	2,037
差入委託証拠金	327,452,160	225,764,165
流動資産合計	86,250,117,146	76,314,616,367
資産合計	86,250,117,146	76,314,616,367
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,300	14,296,072
未払金	8,581,565	-
未払解約金	167,375,523	18,094,509
流動負債合計	175,958,388	32,390,581
負債合計	175,958,388	32,390,581
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	39,946,160,403	38,512,109,073
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	46,127,998,355	37,770,116,713
元本等合計	86,074,158,758	76,282,225,786
純資産合計	86,074,158,758	76,282,225,786
負債純資産合計	86,250,117,146	76,314,616,367

#### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## (貸借対照表に関する注記)

		平成27年 6月25日現在	平成27年12月25日現在
1.	期首	平成26年12月26日	平成27年 6月26日
	期首元本額	42,925,107,820円	39,946,160,403円
	期首からの追加設定元本額	1,166,545,900円	1,316,821,506円
	期首からの一部解約元本額	4,145,493,317円	2,750,872,836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）	14,202,964,653円	14,178,775,751円
	DCインデックスバランス（株式20）	36,769,941円	40,962,639円
	DCインデックスバランス（株式40）	142,478,679円	151,010,323円
	DCインデックスバランス（株式60）	278,936,501円	291,611,410円
	DCインデックスバランス（株式80）	334,976,642円	345,389,251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	3,713,793,990円	3,534,450,930円
	日興五大陸株式ファンド	7,963,731,165円	7,262,434,857円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	29,877,322円	29,624,898円
	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産）	13,584,935円	13,338,738円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	7,426,801円	7,099,348円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	5,536,639円	5,562,399円

アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	8,674,796円	8,242,573円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	10,095,961円	10,398,445円
国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	7,513,820,528円	7,358,558,472円
グローバルバランスファンド３５（適格機関投資家向け）	10,346,023円	10,403,301円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	26,728,282円	28,495,194円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	82,634,536円	86,927,165円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	118,322,889円	122,744,786円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	119,952,748円	125,663,054円
インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	5,325,507,372円	4,900,415,539円
計	39,946,160,403円	38,512,109,073円
2. 受益権の総数	39,946,160,403口	38,512,109,073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12月26日 至 平成27年 6月25日	自 平成27年 6月26日 至 平成27年12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27年 6月25日現在	平成27年12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

(平成27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	1,103,477,140
投資証券	15,727,875
合計	1,119,205,015

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成27年 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

(平成27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	2,187,696,654	-	2,211,557,634	23,860,980
合計		2,187,696,654	-	2,211,557,634	23,860,980

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(平成27年 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	為替予約取引				

の取引	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

(平成27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	1,917,381,602	-	1,904,283,700	13,097,902
	米ドル	1,458,606,785	-	1,448,382,300	10,224,485
	ユーロ	458,774,817	-	455,901,400	2,873,417
	売建	646,036,068	-	643,846,500	2,189,568
	米ドル	494,304,000	-	492,563,000	1,741,000
	加ドル	14,781,636	-	14,774,700	6,936
	ユーロ	52,755,400	-	52,616,000	139,400
	スウェーデンクローナ	3,174,999	-	3,172,380	2,619
	デンマーククローネ	21,696,480	-	21,496,400	200,080
	豪ドル	34,457,270	-	34,408,020	49,250
	香港ドル	12,298,483	-	12,237,100	61,383
	シンガポールドル	8,556,000	-	8,558,000	2,000
	イスラエルシケル	4,011,800	-	4,020,900	9,100
合計		2,563,417,670	-	2,548,130,200	10,908,334

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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



- ・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 1口当たり情報 )

平成27年 6月25日現在		平成27年12月25日現在	
1口当たり純資産額	2.1548円	1口当たり純資産額	1.9807円
(1万口当たり純資産額)	(21,548円)	(1万口当たり純資産額)	(19,807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	51.22	562,549.26	
	ANTERO RESOURCES CORP	1,060	22.78	24,146.80	
	APACHE CORP	8,294	45.80	379,865.20	
	BAKER HUGHES INC	9,665	47.72	461,213.80	
	CABOT OIL & GAS CORP	9,030	17.70	159,831.00	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	4,221	63.74	269,046.54	
	CHENIERE ENERGY INC	5,020	38.85	195,027.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	11,290	4.45	50,240.50	
	CHEVRON CORP	39,001	92.05	3,590,042.05	
	CIMAREX ENERGY CO	2,005	91.60	183,658.00	
	COLUMBIA PIPELINE GROUP	6,385	20.04	127,955.40	
	CONCHO RESOURCES INC	2,395	95.77	229,369.15	
	CONOCOPHILLIPS	25,710	48.59	1,249,248.90	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,960	23.83	46,706.80	
	CORE LABORATORIES N.V.	790	111.97	88,456.30	
DEVON ENERGY CORPORATION	8,551	32.70	279,617.70		

ENERGEN CORP	1,520	44.93	68,293.60
ENSCO PLC-CL A	4,530	15.96	72,298.80
EOG RESOURCES INC	11,362	73.42	834,198.04
EQT CORP	3,405	51.94	176,855.70
EXXON MOBIL CORP	86,581	79.33	6,868,470.73
FMC TECHNOLOGIES INC	4,415	29.25	129,138.75
HALLIBURTON CO	17,477	35.15	614,316.55
HELMERICH & PAYNE	2,120	56.04	118,804.80
HESS CORP	5,530	50.57	279,652.10
HOLLYFRONTIER CORP	3,740	41.69	155,920.60
KINDER MORGAN INC	38,340	16.08	616,507.20
MARATHON OIL CORP	14,067	13.93	195,953.31
MARATHON PETROLEUM CORP	11,412	52.64	600,727.68
MURPHY OIL CORP	2,655	23.35	61,994.25
NATIONAL OILWELL VARCO INC	8,231	34.80	286,438.80
NOBLE ENERGY INC	8,662	34.09	295,287.58
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	15,791	69.20	1,092,737.20
OCEANEERING INTL INC	2,060	39.08	80,504.80
ONEOK INC	4,150	24.12	100,098.00
PHILLIPS 66	11,245	84.36	948,628.20
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,290	125.02	411,315.80
RANGE RESOURCES CORP	4,050	24.40	98,820.00
SCHLUMBERGER LTD	26,229	70.53	1,849,931.37
SOUTHWESTERN ENERGY CO	8,835	6.71	59,282.85
SPECTRA ENERGY CORP	14,814	23.86	353,462.04
TESORO CORP	2,820	104.47	294,605.40
VALERO ENERGY CORP	10,332	71.93	743,180.76
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	16,939	8.89	150,587.71
WHITING PETROLEUM CORP	3,115	10.08	31,399.20
WILLIAMS COS INC	14,734	24.91	367,023.94
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	4,205	133.19	560,063.95
AIRGAS INC	1,430	138.48	198,026.40
ALBEMARLE CORP	1,630	55.95	91,198.50
ALCOA INC	26,179	10.12	264,931.48
ASHLAND INC	1,610	104.67	168,518.70

AVERY DENNISON CORP	2,260	64.06	144,775.60
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	2,100	27.14	56,994.00
BALL CORP	3,133	72.54	227,267.82
CELANESE CORP-SERIES A	3,270	67.62	221,117.40
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,850	43.25	209,762.50
CROWN HOLDINGS INC	2,815	50.63	142,523.45
DOW CHEMICAL CO/THE	23,253	52.31	1,216,364.43
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	18,718	66.40	1,242,875.20
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	2,915	68.91	200,872.65
ECOLAB INC	5,690	115.78	658,788.20
FMC CORP	3,270	40.58	132,696.60
FREEMONT-MCMORAN INC	22,998	7.57	174,094.86
INTERNATIONAL PAPER CO	7,910	38.52	304,693.20
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,664	119.97	199,630.08
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,140	88.17	717,703.80
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,045	142.33	148,734.85
MONSANTO CO	9,661	99.27	959,047.47
MOSAIC CO/THE	6,650	29.75	197,837.50
NEWMONT MINING CORP	11,290	18.54	209,316.60
NUCOR CORP	6,309	41.07	259,110.63
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,950	64.30	125,385.00
PPG INDUSTRIES INC	5,874	100.39	589,690.86
PRAXAIR INC	6,190	104.51	646,916.90
SEALED AIR CORP	4,356	43.81	190,836.36
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,687	265.17	447,341.79
VULCAN MATERIALS CO	2,893	96.82	280,100.26
WESTLAKE CHEMICAL CORP	960	55.60	53,376.00
WESTROCK CO	5,959	45.51	271,194.09
3M CO	13,006	151.19	1,966,377.14
ACUITY BRANDS INC	870	240.08	208,869.60
AERCAP HOLDINGS NV	1,570	43.15	67,745.50
AGCO CORP	1,670	46.05	76,903.50
AMETEK INC	5,073	54.29	275,413.17
B/E AEROSPACE INC	2,570	42.59	109,456.30
BOEING CO/THE	13,442	143.53	1,929,330.26

CATERPILLAR INC	11,446	69.38	794,123.48
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	2,410	40.48	97,556.80
CUMMINS INC	3,695	89.30	329,963.50
DANAHER CORP	12,949	93.40	1,209,436.60
DEERE & CO	6,110	78.79	481,406.90
DOVER CORP	3,640	62.40	227,136.00
EATON CORP PLC	9,756	53.25	519,507.00
EMERSON ELECTRIC CO	12,990	48.26	626,897.40
FASTENAL CO	6,153	41.51	255,411.03
FLOWSERVE CORP	2,425	42.89	104,008.25
FLUOR CORP	3,203	48.71	156,018.13
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,160	56.29	177,876.40
GENERAL DYNAMICS CORP	5,912	139.84	826,734.08
GENERAL ELECTRIC CO	196,273	30.83	6,051,096.59
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	15,496	104.65	1,621,656.40
ILLINOIS TOOL WORKS	6,900	94.13	649,497.00
INGERSOLL-RAND PLC	5,866	55.63	326,325.58
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,200	43.30	95,260.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	1,551	119.95	186,042.45
LOCKHEED MARTIN CORP	5,691	218.56	1,243,824.96
MASCO CORP	7,529	28.44	214,124.76
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,844	190.11	730,782.84
PACCAR INC	7,684	48.45	372,289.80
PARKER HANNIFIN CORP	2,740	99.85	273,589.00
PENTAIR PLC	4,018	50.28	202,025.04
PRECISION CASTPARTS CORP	2,830	231.19	654,267.70
QUANTA SERVICES INC	4,645	20.68	96,058.60
RAYTHEON COMPANY	6,432	126.29	812,297.28
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,943	103.82	305,542.26
ROCKWELL COLLINS INC.	2,605	92.33	240,519.65
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,970	189.84	373,984.80
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,100	45.62	141,422.00
SNAP-ON INC	1,250	171.86	214,825.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,116	106.95	333,256.20
TEXTRON INC	5,416	42.69	231,209.04

TRANSDIGM GROUP INC	1,190	226.79	269,880.10
UNITED RENTALS INC	2,250	74.60	167,850.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	17,275	96.30	1,663,582.50
WABCO HOLDINGS INC	1,110	101.93	113,142.30
WABTEC CORP	2,090	73.13	152,841.70
WW GRAINGER INC	1,137	205.45	233,596.65
XYLEM INC	4,368	37.07	161,921.76
ADT CORP/THE	3,537	33.57	118,737.09
CINTAS CORP	2,037	91.54	186,466.98
DUN & BRADSTREET CORP	872	106.06	92,484.32
EQUIFAX INC	2,634	112.75	296,983.50
IHS INC-CLASS A	1,300	116.37	151,281.00
MANPOWERGROUP INC	1,937	85.88	166,349.56
NIELSEN HOLDINGS PLC	6,945	46.47	322,734.15
REPUBLIC SERVICES INC	5,100	44.41	226,491.00
ROBERT HALF INTL INC	2,375	47.15	111,981.25
STERICYCLE INC	1,705	120.99	206,287.95
TOWERS WATSON & CO-CL-A	1,630	133.99	218,403.70
TYCO INTERNATIONAL PLC	8,715	32.10	279,751.50
VERISK ANALYTICS INC	3,170	76.96	243,963.20
WASTE MANAGEMENT INC	9,924	53.43	530,239.32
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	4,080	43.81	178,744.80
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,250	63.53	206,472.50
CSX CORP	20,923	26.13	546,717.99
DELTA AIR LINES INC	4,285	52.26	223,934.10
EXPEDITORS INTL WASH INC	3,647	45.92	167,470.24
FEDEX CORP	5,758	149.65	861,684.70
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	9,780	14.79	144,646.20
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,310	72.97	168,560.70
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	97,000	0.53	51,410.00
KANSAS CITY SOUTHERN	2,390	73.77	176,310.30
NORFOLK SOUTHERN CORP	6,120	86.78	531,093.60
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,400	43.90	149,260.00
UNION PACIFIC CORP	17,956	78.80	1,414,932.80
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	1,915	59.78	114,478.70

UNITED PARCEL SERVICE-CL B	14,517	97.34	1,413,084.78	
AUTOLIV INC	2,020	126.65	255,833.00	
BORGWARNER INC	4,330	43.51	188,398.30	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	6,090	86.84	528,855.60	
FORD MOTOR COMPANY	76,505	14.31	1,094,786.55	
GENERAL MOTORS CORP	29,455	34.60	1,019,143.00	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	5,430	32.79	178,076.85	
HARLEY-DAVIDSON INC	4,829	46.15	222,858.35	
JOHNSON CONTROLS INC	14,278	40.50	578,259.00	
LEAR CORP	1,560	124.78	194,656.80	
TESLA MOTORS INC	1,980	230.57	456,528.60	
COACH INC	5,876	32.65	191,851.40	
DR HORTON INC	6,906	32.16	222,096.96	
GARMIN LTD	2,865	36.98	105,947.70	
HANESBRANDS INC	8,800	28.96	254,848.00	
HARMAN INTERNATIONAL	1,390	93.53	130,006.70	
HASBRO INC	2,128	67.62	143,895.36	
JARDEN CORP	3,510	56.60	198,666.00	
LEGGETT & PLATT INC	2,648	42.81	113,360.88	
LENNAR CORP-CL A	3,660	48.88	178,900.80	
LULULEMON ATHLETICA INC	2,790	53.19	148,400.10	
MATTEL INC	6,309	27.69	174,696.21	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	3,360	40.86	137,289.60	
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,378	190.71	262,798.38	
NEWELL RUBBERMAID INC	5,800	43.61	252,938.00	
NIKE INC -CL B	14,114	63.18	891,722.52	
NIKE INC -CL B(N)	14,114	63.18	891,722.52	
POLARIS INDUSTRIES INC	1,250	86.14	107,675.00	
PULTE GROUP INC	6,890	18.22	125,535.80	
PVH CORP	2,030	72.79	147,763.70	
RALPH LAUREN CORP	1,365	113.38	154,763.70	
TOLL BROTHERS INC	3,111	34.08	106,022.88	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	3,560	81.20	289,072.00	
VF CORP	7,270	62.28	452,775.60	
WHIRLPOOL CORP	1,814	149.57	271,319.98	

ARAMARK	3,180	32.29	102,682.20
CARNIVAL CORP	8,417	54.12	455,528.04
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	685	495.10	339,143.50
DARDEN RESTAURANTS INC	2,333	64.56	150,618.48
H&R BLOCK INC	5,610	33.33	186,981.30
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	11,130	21.87	243,413.10
LAS VEGAS SANDS CORP	8,120	44.36	360,203.20
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	4,826	68.77	331,884.02
MCDONALD'S CORP	19,541	118.57	2,316,976.37
MGM RESORTS INTERNATIONAL	7,560	22.51	170,175.60
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	2,930	58.61	171,727.30
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,538	99.92	353,516.96
STARBUCKS CORP	31,204	60.32	1,882,225.28
STARWOOD HOTELS & RESORTS	3,597	69.84	251,214.48
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,540	73.29	186,156.60
WYNN RESORTS LTD	1,660	69.17	114,822.20
YUM! BRANDS INC	9,214	74.00	681,836.00
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	4,265	31.71	135,243.15
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	9,798	47.44	464,817.12
CHARTER COMMUNICATION-A	1,780	181.89	323,764.20
COMCAST CORP-CLASS A	51,927	57.30	2,975,417.10
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,320	27.09	89,938.80
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	6,530	25.55	166,841.50
DISH NETWORK CORP-A	4,769	58.31	278,080.39
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	8,736	23.55	205,732.80
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,355	39.74	212,807.70
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	12,731	38.32	487,851.92
LIBERTY MEDIA CORP-A	1,435	39.24	56,309.40
LIBERTY MEDIA CORP-C	4,930	38.03	187,487.90
NEWS CORP - CLASS A	7,570	13.62	103,103.40
OMNICOM GROUP	5,417	76.08	412,125.36
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	1,950	55.35	107,932.50
SIRIUS XM HOLDINGS INC	55,940	4.08	228,514.90
TEGNA INC	4,330	25.93	112,276.90
THE WALT DISNEY CO.	33,603	105.86	3,557,213.58

TIME WARNER CABLE	5,917	184.50	1,091,686.50
TIME WARNER INC	17,008	64.39	1,095,145.12
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	9,769	27.54	269,038.26
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	24,412	27.43	669,621.16
VIACOM INC-CLASS B	7,748	41.11	318,520.28
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,608	149.13	239,801.04
AMAZON.COM INC	8,275	662.79	5,484,587.25
AUTONATION INC	1,650	60.20	99,330.00
AUTOZONE INC	682	740.56	505,061.92
BED BATH & BEYOND INC	2,952	48.95	144,500.40
BEST BUY CO INC	6,504	30.50	198,372.00
CARMAX INC	4,269	53.23	227,238.87
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,110	36.91	77,880.10
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	6,280	72.22	453,541.60
DOLLAR TREE INC	4,896	76.68	375,425.28
EXPEDIA INC	2,232	126.47	282,281.04
FOOT LOCKER INC	3,100	64.99	201,469.00
GAMESTOP CORP-CLASS A	2,480	28.37	70,357.60
GAP INC/THE	5,106	25.36	129,488.16
GENUINE PARTS CO	3,201	86.10	275,606.10
HOME DEPOT INC	26,740	132.90	3,553,746.00
KOHL'S CORP	4,402	47.13	207,466.26
L BRANDS INC	5,308	96.82	513,920.56
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	9,700	27.02	262,094.00
LKQ CORP	6,990	29.49	206,135.10
LOWE'S COS INC	19,452	76.28	1,483,798.56
MACY'S INC	7,009	35.48	248,679.32
NETFLIX INC	8,420	117.33	987,918.60
NORDSTROM INC	2,850	50.95	145,207.50
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,145	253.42	543,585.90
PRICELINE GROUP INC/THE	1,045	1,273.07	1,330,358.15
ROSS STORES INC	8,572	54.33	465,716.76
SIGNET JEWELERS LTD	1,660	119.64	198,602.40
STAPLES INC	13,744	9.62	132,217.28
TARGET CORP	12,330	73.17	902,186.10



TIFFANY & CO	2,980	76.95	229,311.00
TJX COMPANIES INC	14,143	70.89	1,002,597.27
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,960	85.67	253,583.20
TRIPADVISOR INC	2,330	85.45	199,098.50
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	1,320	184.93	244,107.60
COSTCO WHOLESALE CORP	9,099	161.75	1,471,763.25
CVS HEALTH CORP	23,137	98.86	2,287,323.82
KROGER CO	19,670	42.46	835,188.20
RITE AID CORP	19,870	7.86	156,178.20
SYSCO CORP	12,076	41.30	498,738.80
WAL-MART STORES INC	33,372	60.83	2,030,018.76
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	18,192	86.46	1,572,880.32
WHOLE FOODS MARKET INC	7,790	34.49	268,677.10
ALTRIA GROUP INC	40,938	58.29	2,386,276.02
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	12,033	36.65	441,009.45
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2,227	101.90	226,931.30
BUNGE LTD	3,107	68.42	212,580.94
CAMPBELL SOUP CO	4,215	53.32	224,743.80
COCA-COLA CO/THE	85,752	43.54	3,733,642.08
COCA-COLA ENTERPRISES	4,480	50.02	224,089.60
CONAGRA FOODS INC	9,730	42.13	409,924.90
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,720	143.03	532,071.60
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	4,109	93.92	385,917.28
GENERAL MILLS INC	12,189	58.72	715,738.08
HERSHEY CO/THE	2,865	90.32	258,766.80
HORMEL FOODS CORP	2,800	79.82	223,496.00
JM SMUCKER CO/THE	2,160	124.78	269,524.80
KELLOGG CO	5,298	72.87	386,065.26
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	2,225	89.88	199,983.00
KRAFT HEINZ CO/THE	12,381	73.96	915,698.76
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,275	86.70	197,242.50
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	3,991	79.30	316,486.30
MOLSON COORS BREWING CO -B	3,120	93.98	293,217.60
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	33,355	45.35	1,512,649.25
MONSTER BEVERAGE CORP	2,930	148.82	436,042.60

PEPSICO INC	30,471	100.54	3,063,554.34
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	32,128	88.86	2,854,894.08
REYNOLDS AMERICAN INC	18,336	46.44	851,523.84
TYSON FOODS INC-CL A	6,456	53.94	348,236.64
WHITEWAVE FOODS CO	3,520	40.00	140,800.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,965	86.44	256,294.60
CLOROX COMPANY	2,736	127.86	349,824.96
COLGATE-PALMOLIVE CO	17,680	66.99	1,184,383.20
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	1,311	78.49	102,900.39
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,740	88.80	420,912.00
KIMBERLY-CLARK CORP	7,563	126.88	959,593.44
PROCTER & GAMBLE CO	56,029	79.79	4,470,553.91
ABBOTT LABORATORIES	30,847	45.10	1,391,199.70
AETNA INC	7,239	109.63	793,611.57
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,024	103.95	418,294.80
ANTHEM INC	5,356	140.56	752,839.36
BAXTER INTERNATIONAL INC	11,519	38.15	439,449.85
BECTON DICKINSON AND CO	4,397	155.91	685,536.27
BOSTON SCIENTIFIC CORP	28,738	18.72	537,975.36
CARDINAL HEALTH INC	6,575	89.71	589,843.25
CENTENE CORP	2,260	65.57	148,188.20
CERNER CORP	6,590	60.69	399,947.10
CIGNA CORP	5,420	146.46	793,813.20
COOPER COS INC/THE	1,040	136.34	141,793.60
CR BARD INC	1,574	189.87	298,855.38
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	3,938	70.14	276,211.32
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	2,972	60.91	181,024.52
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,320	79.18	342,057.60
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	3,630	25.28	91,766.40
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	13,974	88.25	1,233,205.50
HCA HOLDINGS INC	7,315	68.92	504,149.80
HENRY SCHEIN INC	1,630	157.09	256,056.70
HOLOGIC INC	4,538	39.08	177,345.04
HUMANA INC	3,115	178.30	555,404.50
IMS HEALTH HOLDINGS INC	3,020	25.66	77,493.20

INTUITIVE SURGICAL INC	750	547.45	410,587.50
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,155	124.70	268,728.50
MCKESSON CORP	4,804	199.41	957,965.64
MEDNAX INC	1,810	72.91	131,967.10
MEDTRONIC PLC	29,358	77.63	2,279,061.54
PATTERSON COS INC	2,042	45.07	92,032.94
QUEST DIAGNOSTICS	3,116	71.41	222,513.56
RESMED INC	3,370	53.92	181,710.40
ST JUDE MEDICAL INC	6,120	61.13	374,115.60
STRYKER CORP	7,123	94.36	672,126.28
UNITEDHEALTH GROUP INC	19,840	118.34	2,347,865.60
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,820	120.64	219,564.80
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,664	81.12	134,983.68
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	3,572	102.91	367,594.52
ABBVIE INC	34,336	58.46	2,007,282.56
AGILENT TECHNOLOGIES INC	7,010	42.14	295,401.40
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	4,690	189.41	888,332.90
ALKERMES PLC	3,220	79.11	254,734.20
ALLERGAN PLC	8,185	311.23	2,547,417.55
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,530	90.68	138,740.40
AMGEN INC	15,721	163.55	2,571,169.55
BAXALTA INC	11,519	39.27	452,351.13
BIOGEN INC	4,863	302.29	1,470,036.27
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,500	105.84	370,440.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	34,701	68.97	2,393,327.97
CELGENE CORP	16,424	122.14	2,006,027.36
ELI LILLY & CO	20,813	85.85	1,786,796.05
ENDO INTERNATIONAL PLC	4,160	62.62	260,499.20
GILEAD SCIENCES INC	30,444	103.58	3,153,389.52
ILLUMINA INC	2,985	189.00	564,165.00
INCYTE CORP	3,340	108.92	363,792.80
IONIS PHARMACEUTICALS INC	2,570	59.64	153,274.80
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,330	142.74	189,844.20
JOHNSON & JOHNSON	57,501	103.72	5,964,003.72
MALLINCKRODT PLC	2,400	76.40	183,360.00

MEDIVATION INC	3,320	47.96	159,227.20
MERCK & CO. INC.	58,433	52.85	3,088,184.05
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	600	341.86	205,116.00
MYLAN NV	8,585	54.82	470,629.70
PERRIGO CO PLC	3,039	147.54	448,374.06
PFIZER INC	127,670	32.62	4,164,595.40
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	1,950	69.63	135,778.50
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,600	537.63	860,208.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	8,294	141.32	1,172,108.08
UNITED THERAPEUTICS CORP	940	160.91	151,255.40
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,320	124.84	664,148.80
WATERS CORP	1,886	133.94	252,610.84
ZOETIS INC	10,200	48.13	490,926.00
BANK OF AMERICA CORP	216,609	17.27	3,740,837.43
BB&T CORP	15,428	38.27	590,429.56
CIT GROUP INC	3,435	40.82	140,216.70
CITIGROUP INC	62,677	52.71	3,303,704.67
CITIZENS FINANCIAL GROUP	9,120	26.60	242,592.00
COMERICA INC	3,360	42.31	142,161.60
FIFTH THIRD BANCORP	16,559	20.52	339,790.68
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,330	66.90	155,877.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	17,700	11.21	198,417.00
JPMORGAN CHASE & CO	77,180	66.60	5,140,188.00
KEYCORP	17,678	13.33	235,647.74
M & T BANK CORP	3,073	123.33	378,993.09
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	9,654	16.56	159,870.24
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	6,370	16.35	104,149.50
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	10,840	96.24	1,043,241.60
REGIONS FINANCIAL CORP	29,784	9.71	289,202.64
SIGNATURE BANK	990	153.62	152,083.80
SUNTRUST BANKS INC	11,067	43.36	479,865.12
US BANCORP	37,001	43.42	1,606,583.42
WELLS FARGO & CO	101,810	54.82	5,581,224.20
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,220	163.10	198,982.00
ALLY FINANCIAL INC	9,120	19.25	175,560.00

AMERICAN EXPRESS CO	18,644	70.16	1,308,063.04
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,660	107.94	395,060.40
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	23,122	41.23	953,320.06
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	24,590	133.89	3,292,355.10
BLACKROCK INC	2,625	337.40	885,675.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	11,045	73.52	812,028.40
CME GROUP INC	6,690	91.90	614,811.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	9,370	54.77	513,194.90
E*TRADE FINANCIAL CORP	5,840	29.71	173,506.40
EATON VANCE CORP	2,880	33.08	95,270.40
FRANKLIN RESOURCES INC	7,995	36.97	295,575.15
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8,068	182.47	1,472,167.96
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	2,396	251.92	603,600.32
INVESCO LTD	8,347	32.92	274,783.24
LEGG MASON INC	2,185	39.67	86,678.95
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	17.33	126,595.65
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	5,832	97.49	568,561.68
MOODY'S CORP	3,917	100.11	392,130.87
MORGAN STANLEY	30,265	32.48	983,007.20
NASDAQ INC	2,555	57.99	148,164.45
NAVIENT CORP	8,682	12.61	109,480.02
NORTHERN TRUST CORP	4,690	72.96	342,182.40
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,500	58.20	145,500.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	24,604	33.05	813,162.20
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,225	52.09	167,990.25
STATE STREET CORP	8,707	67.14	584,587.98
SYNCHRONY FINANCIAL	16,410	30.60	502,146.00
T ROWE PRICE GROUP INC	4,995	72.45	361,887.75
TD AMERITRADE HOLDING CORP	5,050	34.86	176,043.00
VOYA FINANCIAL INC	4,650	37.44	174,096.00
ACE LTD	6,473	118.19	765,043.87
AFLAC INC	8,452	60.18	508,641.36
ALLEGHANY CORP	400	482.92	193,168.00
ALLSTATE CORP	7,833	63.14	494,575.62
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	26,795	61.70	1,653,251.50

AON PLC	5,617	92.05	517,044.85
ARCH CAPITAL GROUP LTD	2,775	70.56	195,804.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,300	41.15	135,795.00
ASSURANT INC	1,530	80.88	123,746.40
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,175	56.83	123,605.25
CHUBB CORP	4,673	133.02	621,602.46
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,690	59.63	160,404.70
EVEREST RE GROUP LTD	1,014	185.07	187,660.98
FNF GROUP	5,881	34.43	202,482.83
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	8,312	43.66	362,901.92
LINCOLN NATIONAL CORP	4,733	50.65	239,726.45
LOEWS CORP	5,225	38.47	201,005.75
MARKEL CORP	280	889.26	248,992.80
MARSH & MCLENNAN COS	10,903	55.54	605,552.62
METLIFE INC	19,605	48.27	946,333.35
PARTNERRE LTD	1,052	139.63	146,890.76
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	5,820	45.66	265,741.20
PROGRESSIVE CORP	12,350	32.00	395,200.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	9,492	82.55	783,564.60
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	887	114.69	101,730.03
TORCHMARK CORP	2,216	57.27	126,910.32
TRAVELERS COS INC/THE	6,234	113.27	706,125.18
UNUM GROUP	4,788	33.43	160,062.84
WILLIS GROUP HOLDING	2,990	46.92	140,290.80
WR BERKLEY CORP	2,063	55.37	114,228.31
XL GROUP PLC	6,310	39.84	251,390.40
CBRE GROUP INC	6,610	34.74	229,631.40
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	10,700	6.96	74,472.00
JONES LANG LASALLE INC	890	157.31	140,005.90
REALOGY HOLDINGS CORP	3,160	37.85	119,606.00
ACCENTURE PLC-CL A	12,948	104.23	1,349,570.04
ACTIVISION BLIZZARD INC	10,200	38.92	396,984.00
ADOBE SYSTEMS INC	10,369	94.30	977,796.70
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	4,220	53.04	223,828.80
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,275	278.20	354,705.00

ALPHABET INC-CL A	6,020	765.84	4,610,356.80
ALPHABET INC-CL C	6,442	748.40	4,821,192.80
ANSYS INC	2,090	93.35	195,101.50
AUTODESK INC	4,420	61.85	273,377.00
AUTOMATIC DATA PROCESSING	9,896	85.94	850,462.24
CA INC	6,760	28.97	195,837.20
CDK GLOBAL INC	2,720	48.10	130,832.00
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,280	82.60	105,728.00
CITRIX SYSTEMS INC	3,628	76.21	276,489.88
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	12,648	60.73	768,113.04
EBAY INC	22,957	27.66	634,990.62
ELECTRONIC ARTS INC	6,504	68.95	448,450.80
FACEBOOK INC-A	44,680	105.02	4,692,293.60
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	6,105	61.11	373,076.55
FIREEYE INC	1,850	21.58	39,923.00
FISERV INC	4,948	93.06	460,460.88
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,740	145.34	252,891.60
FORTINET INC	2,700	31.77	85,779.00
GARTNER INC	1,750	91.15	159,512.50
GLOBAL PAYMENTS INC	2,550	65.50	167,025.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	19,302	138.25	2,668,501.50
INTUIT INC	5,366	97.59	523,667.94
LINKEDIN CORP - A	2,410	229.03	551,962.30
MASTERCARD INC-CLASS A	20,760	98.59	2,046,728.40
MICROSOFT CORP	157,814	55.67	8,785,505.38
MOBILEYE NV	1,430	42.35	60,560.50
NETSUITE INC	740	83.93	62,108.20
NUANCE COMMUNICATIONS INC	4,240	20.28	85,987.20
ORACLE CORP	71,943	37.01	2,662,610.43
PAYCHEX INC	6,712	53.82	361,239.84
PAYPAL HOLDINGS INC	22,957	37.07	851,015.99
RED HAT INC	4,070	81.74	332,681.80
SABRE CORP	3,320	28.00	92,960.00
SALESFORCE.COM INC	12,500	77.83	972,875.00
SERVICENOW INC	3,030	86.96	263,488.80

SPLUNK INC	2,530	56.78	143,653.40
SYMANTEC CORP	13,905	20.86	290,058.30
SYNOPSYS INC	3,207	45.77	146,784.39
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	1,000	95.48	95,480.00
TERADATA CORP	3,025	27.22	82,340.50
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,636	50.96	185,290.56
TWITTER INC	10,380	22.97	238,428.60
VANTIV INC - CL-A	2,410	47.43	114,306.30
VERISIGN INC	2,220	87.78	194,871.60
VISA INC-CLASS A SHARES	40,632	78.26	3,179,860.32
VMWARE INC	1,835	57.36	105,255.60
WESTERN UNION CO	10,451	18.50	193,343.50
WORKDAY INC-CLASS A	2,070	79.68	164,937.60
XEROX CORP	22,644	10.88	246,366.72
YAHOO! INC	18,265	34.11	623,019.15
ZILLOW GROUP INC - C	2,000	24.41	48,820.00
AMPHENOL CORP-CL A	5,990	53.42	319,985.80
APPLE INC	118,492	108.03	12,800,690.76
ARROW ELECTRONICS INC	2,310	56.13	129,660.30
AVNET INC	3,460	44.40	153,624.00
CDW CORP/DE	2,750	42.96	118,140.00
CISCO SYSTEMS INC	106,080	27.38	2,904,470.40
CORNING INC	25,868	18.56	480,110.08
EMC CORP/MASS	39,769	26.01	1,034,391.69
F5 NETWORKS INC	1,445	97.44	140,800.80
FLEXTRONICS INTL LTD	12,536	11.42	143,161.12
FLIR SYSTEMS INC	3,195	28.67	91,600.65
HARRIS CORP	2,130	89.48	190,592.40
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	38,615	15.02	579,997.30
HP INC	38,615	11.73	452,953.95
JUNIPER NETWORKS INC	7,633	27.62	210,823.46
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3,395	69.06	234,458.70
NETAPP INC	7,006	26.52	185,799.12
PALO ALTO NETWORKS INC	1,450	178.73	259,158.50
QUALCOMM INC	32,532	49.55	1,611,960.60



SANDISK CORP	4,163	75.28	313,390.64
SEAGATE TECHNOLOGY	6,974	36.65	255,597.10
TE CONNECTIVITY LTD	8,365	65.29	546,150.85
TRIMBLE NAVIGATION LTD	6,050	22.19	134,249.50
WESTERN DIGITAL CORP	4,755	61.22	291,101.10
AT&T INC	127,267	34.66	4,411,074.22
CENTURYLINK INC	12,616	25.87	326,375.92
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	21,304	4.86	103,537.44
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	5,700	54.40	310,080.00
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	2,580	104.04	268,423.20
SPRINT CORP	15,130	3.81	57,645.30
T-MOBILE US INC	6,372	39.67	252,777.24
VERIZON COMMUNICATIONS INC	84,457	46.71	3,944,986.47
AES CORP	13,728	9.58	131,514.24
AGL RESOURCES INC	2,340	63.26	148,028.40
ALLIANT ENERGY CORP	2,160	62.69	135,410.40
AMEREN CORPORATION	5,182	43.68	226,349.76
AMERICAN ELECTRIC POWER	10,698	58.40	624,763.20
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,095	59.83	245,003.85
CALPINE CORP	8,060	14.46	116,547.60
CENTERPOINT ENERGY INC	8,142	18.11	147,451.62
CMS ENERGY CORP	5,290	36.01	190,492.90
CONSOLIDATED EDISON INC	6,306	64.75	408,313.50
DOMINION RESOURCES INC/VA	12,177	67.77	825,235.29
DTE ENERGY COMPANY	3,698	79.88	295,396.24
DUKE ENERGY CORP	14,216	72.04	1,024,120.64
EDISON INTERNATIONAL	7,059	60.36	426,081.24
ENTERGY CORP	3,427	68.69	235,400.63
EVERSOURCE ENERGY	6,900	51.74	357,006.00
EXELON CORP	18,576	27.75	515,484.00
FIRSTENERGY CORP	8,255	32.60	269,113.00
NEXTERA ENERGY INC	9,225	103.93	958,754.25
NRG ENERGY INC	7,670	11.50	88,205.00
OGE ENERGY CORP	3,560	26.70	95,052.00
P G & E CORP	10,391	53.94	560,490.54

	PEPCO HOLDINGS INC	4,500	26.20	117,900.00	
	PINNACLE WEST CAPITAL	2,199	64.29	141,373.71	
	PPL CORP	13,608	34.26	466,210.08	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	10,168	38.60	392,484.80	
	SCANA CORP	2,473	60.94	150,704.62	
	SEMPRA ENERGY	4,687	96.02	450,045.74	
	SOUTHERN CO	18,855	47.10	888,070.50	
	WEC ENERGY GROUP INC	6,860	51.57	353,770.20	
	XCEL ENERGY INC	9,704	35.74	346,820.96	
	ALTERA CORPORATION	5,946	53.96	320,846.16	
	ANALOG DEVICES INC	6,481	56.80	368,120.80	
	APPLIED MATERIALS INC	24,833	19.11	474,558.63	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	5,350	146.32	782,812.00	
	BROADCOM CORP-CL A	11,716	57.82	677,419.12	
	INTEL CORP	98,462	34.98	3,444,200.76	
	KLA-TENCOR CORPORATION	3,199	69.51	222,362.49	
	LAM RESEARCH CORP	3,247	80.39	261,026.33	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	4,344	43.59	189,354.96	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	9,254	9.02	83,471.08	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	5,850	37.87	221,539.50	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	3,794	47.26	179,304.44	
	MICRON TECHNOLOGY INC	23,297	14.48	337,340.56	
	NVIDIA CORP	11,505	33.17	381,620.85	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	3,077	86.42	265,914.34	
	QORVO INC	3,100	54.21	168,051.00	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	4,200	79.32	333,144.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	21,232	56.75	1,204,916.00	
	XILINX INC	5,075	47.85	242,838.75	
	米ドル小計	6,701,092		386,467,240.18 (46,434,038,907)	
加ドル	ALTAGAS LTD	3,050	31.70	96,685.00	
	ARC RESOURCES LTD	7,925	17.35	137,498.75	
	CAMECO CORP	7,892	17.38	137,162.96	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	24,024	31.06	746,185.44	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	11,160	8.60	95,976.00	

CENOVUS ENERGY INC	17,463	17.99	314,159.37
CRESCENT POINT ENERGY CORP	7,395	16.87	124,753.65
ENBRIDGE INC	17,995	46.42	835,327.90
ENCANA CORP	17,968	6.98	125,416.64
HUSKY ENERGY INC	6,729	14.80	99,589.20
IMPERIAL OIL LTD	6,942	45.43	315,375.06
INTER PIPELINE LTD	7,180	22.65	162,627.00
KEYERA CORP	4,120	40.65	167,478.00
MEG ENERGY CORP	2,710	8.59	23,278.90
PEMBINA PIPELINE CORP	6,245	31.00	193,595.00
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	3,680	25.19	92,699.20
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	2,590	22.84	59,155.60
SUNCOR ENERGY INC	29,675	36.89	1,094,710.75
TOURMALINE OIL CORP	4,005	22.25	89,111.25
TRANSCANADA CORP	14,523	46.72	678,514.56
VERESEN INC	5,360	8.88	47,596.80
VERMILION ENERGY INC	1,830	38.44	70,345.20
AGNICO EAGLE MINES LTD	4,695	37.73	177,142.35
AGRIUM INC	3,015	128.26	386,703.90
BARRICK GOLD CORP	26,114	10.85	283,336.90
CCL INDUSTRIES INC - CL B	500	221.20	110,600.00
ELDORADO GOLD CORP	14,630	4.48	65,542.40
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	12,590	5.81	73,147.90
FRANCO-NEVADA CORP	2,925	66.34	194,044.50
GOLDCORP INC	17,917	16.89	302,618.13
KINROSS GOLD CORP	25,015	2.71	67,790.65
METHANEX CORP	2,330	48.65	113,354.50
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	17,917	25.09	449,537.53
SILVER WHEATON CORP	8,645	17.91	154,831.95
TECK RESOURCES LTD-CLS B	13,885	5.62	78,033.70
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	13,419	3.55	47,637.45
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,460	54.31	79,292.60
YAMANA GOLD INC	19,626	2.75	53,971.50
BOMBARDIER INC 'B'	34,746	1.31	45,517.26
CAE INC	6,315	15.48	97,756.20

FINNING INTERNATIONAL INC	2,845	19.20	54,624.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	3,195	42.28	135,084.60
CANADIAN NATL RAILWAY CO	16,608	78.78	1,308,378.24
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,335	176.88	589,894.80
MAGNA INTERNATIONAL INC	8,378	57.98	485,756.44
GILDAN ACTIVEWEAR INC	4,060	40.16	163,049.60
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	4,328	51.56	223,151.68
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	8,325	23.85	198,551.25
THOMSON REUTERS CORP	8,044	52.81	424,803.64
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,560	118.84	185,390.40
DOLLARAMA INC	2,920	80.14	234,008.80
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	8,650	62.26	538,549.00
EMPIRE CO LTD 'A'	3,000	25.95	77,850.00
LOBLAW COMPANIES LTD	4,519	65.87	297,666.53
METRO INC	5,790	39.37	227,952.30
WESTON (GEORGE) LTD	942	107.31	101,086.02
SAPUTO INC	5,040	34.04	171,561.60
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	6,734	157.68	1,061,817.12
BANK OF MONTREAL	13,731	78.71	1,080,767.01
BANK OF NOVA SCOTIA	25,109	57.95	1,455,066.55
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	8,295	93.04	771,766.80
NATIONAL BANK OF CANADA	7,340	40.87	299,985.80
ROYAL BANK OF CANADA	30,449	75.64	2,303,162.36
TORONTO-DOMINION BANK	38,510	55.03	2,119,205.30
CI FINANCIAL CORP	3,410	30.90	105,369.00
ELEMENT FINANCIAL CORP	7,180	17.00	122,060.00
IGM FINANCIAL INC	2,535	36.06	91,412.10
ONEX CORPORATION	1,905	85.68	163,220.40
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	490	651.01	318,994.90
GREAT-WEST LIFECO INC	5,974	34.77	207,715.98
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	1,735	44.69	77,537.15
INTACT FINANCIAL CORP	2,485	88.09	218,903.65
MANULIFE FINANCIAL CORP	39,991	21.24	849,408.84
POWER CORP OF CANADA	7,800	29.74	231,972.00
POWER FINANCIAL CORP	5,715	32.89	187,966.35

	SUN LIFE FINANCIAL INC	11,984	44.07	528,134.88	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	18,933	44.50	842,518.50	
	CGI GROUP INC - CL A	4,650	56.08	260,772.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	370	580.87	214,921.90	
	OPEN TEXT CORP	3,070	67.91	208,483.70	
	BLACKBERRY LTD	10,328	12.61	130,236.08	
	BCE INC	2,930	54.03	158,307.90	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	8,355	48.50	405,217.50	
	TELUS CORP	4,366	39.07	170,579.62	
	ATCO LTD -CLASS I	1,920	36.30	69,696.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,590	32.61	84,459.90	
	FORTIS INC	4,785	38.02	181,925.70	
加ドル小計		811,413		28,827,045.54 (2,505,646,798)	
ユーロ	ENI SPA	52,336	13.96	730,610.56	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	9,315	11.07	103,163.62	
	NESTE OYJ	2,740	27.49	75,322.60	
	OMV AG	3,490	26.46	92,345.40	
	REPSOL SA	21,989	10.94	240,559.66	
	REPSOL SA-RTS	21,989	0.49	10,906.54	
	SAIPEM SPA	5,370	7.76	41,671.20	
	TECHNIP SA	2,468	46.79	115,477.72	
	TENARIS SA	9,355	11.27	105,430.85	
	TOTAL SA	45,197	42.10	1,903,019.68	
	VOPAK	1,270	40.62	51,587.40	
	AIR LIQUIDE SA	7,064	104.00	734,656.00	
	AKZO NOBEL	5,028	62.44	313,948.32	
	ARCELORMITTAL	22,911	4.20	96,226.20	
	ARKEMA	1,615	64.68	104,458.20	
	BASF SE	19,015	70.95	1,349,114.25	
	CRH PLC	16,080	26.44	425,235.60	
	EVONIK INDUSTRIES AG	1,820	30.44	55,400.80	
	FUCHS PETROLUB SE-PRF	1,720	43.42	74,682.40	
	HEIDELBERGCEMENT AG	3,245	75.52	245,062.40	
	IMERYS SA	540	62.60	33,804.00	

K+S AG	3,880	23.14	89,802.60
KONINKLIJKE DSM NV	3,442	46.80	161,085.60
LANXESS AG	1,935	43.27	83,737.12
LINDE AG	3,845	132.55	509,654.75
OCI NV	2,000	22.61	45,230.00
SOLVAY SA	1,581	98.31	155,428.11
STORA ENSO OYJ-R SHS	12,085	8.49	102,601.65
SYMRISE AG	2,640	61.29	161,805.60
THYSSENKRUPP AG	7,415	18.79	139,364.92
UMICORE	2,120	39.05	82,786.00
UPM-KYMMENE OYJ	12,618	17.21	217,155.78
VOESTALPINE AG	2,509	28.11	70,540.53
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4,176	27.30	114,004.80
AIRBUS GROUP SE	12,608	62.15	783,587.20
ALSTOM	4,490	27.20	122,128.00
ANDRITZ AG	1,980	46.00	91,089.90
BOSKALIS WESTMINSTER	1,695	37.31	63,240.45
BOUYGUES SA	4,210	36.48	153,580.80
BRENTAG AG	3,765	48.68	183,299.02
CNH INDUSTRIAL NV	22,370	6.48	144,957.60
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	9,246	39.86	368,591.79
FERROVIAL SA	9,975	21.06	210,073.50
FINMECCANICA SPA	9,630	12.86	123,841.80
GEA GROUP AG	3,230	37.47	121,044.25
KONE OYJ-B	6,434	38.98	250,797.32
KONINKLIJKE PHILIPS NV	19,861	23.78	472,294.58
LEGRAND SA	5,628	52.05	292,937.40
MAN SE	624	91.83	57,301.92
METSO OYJ	2,420	20.95	50,699.00
OSRAM LICHT AG	1,962	39.73	77,950.26
PRYSMIAN SPA	3,095	20.02	61,961.90
REXEL SA	7,240	12.29	89,015.80
SAFRAN SA	6,190	62.96	389,722.40
SCHNEIDER ELECTRIC SE	11,088	53.57	593,984.16
SIEMENS AG-REG	16,406	89.64	1,470,633.84

THALES SA	2,345	68.64	160,960.80
VINCI SA	9,900	59.28	586,872.00
WARTSILA OYJ ABP	2,460	41.99	103,295.40
ZARDOYA OTIS SA	4,249	10.71	45,506.79
ZODIAC AEROSPACE	4,550	22.37	101,783.50
BUREAU VERITAS SA	5,650	18.60	105,118.25
EDENRED	3,906	17.50	68,355.00
RANDSTAD HOLDING NV	2,865	58.10	166,456.50
SOCIETE BIC SA	735	151.35	111,242.25
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	10,531	14.27	150,277.37
ADP	650	106.45	69,192.50
AENA SA	1,280	104.50	133,760.00
ATLANTIA SPA	9,360	24.54	229,694.40
BOLLORE	11,000	4.25	46,750.00
DEUTCHE LUFTHANSA	5,680	14.48	82,246.40
DEUTSCHE POST AG-REG	20,993	26.04	546,762.68
FRAPORT AG	980	59.49	58,300.20
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	8,760	11.10	97,236.00
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	16,992	8.22	139,674.24
TNT EXPRESS NV	9,060	7.80	70,704.24
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	6,755	98.55	665,705.25
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,190	77.18	91,844.20
CONTINENTAL AG	2,345	225.50	528,797.50
DAIMLER AG	19,932	77.84	1,551,506.88
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	19,647	13.02	255,803.94
MICHELIN (CGDE)-B	4,149	88.45	366,979.05
NOKIAN RENKAAT OYJ	2,915	33.24	96,894.60
PEUGEOT SA	7,500	16.37	122,812.50
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	3,490	51.27	178,932.30
RENAULT SA	4,117	95.25	392,144.25
VALEO SA	1,620	143.45	232,389.00
VOLKSWAGEN AG	771	143.20	110,407.20
VOLKSWAGEN AG-PFD	3,433	135.05	463,626.65
ADIDAS AG	4,421	90.18	398,685.78
CHRISTIAN DIOR SE	1,080	157.85	170,478.00

HERMES INTERNATIONAL	542	309.05	167,505.10
HUGO BOSS AG -ORD	1,490	77.44	115,385.60
KERING	1,547	160.85	248,834.95
LUXOTTICA GROUP SPA	3,976	60.10	238,957.60
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	5,764	146.05	841,832.20
ACCOR SA	4,976	39.95	198,791.20
SODEXO	1,970	90.07	177,437.90
TUI AG	5,500	16.84	92,620.00
ALTICE NV -A	5,820	12.86	74,845.20
ALTICE NV -B	1,940	13.00	25,229.70
AXEL SPRINGER SE	995	50.76	50,506.20
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	28.17	106,924.12
JC DECAUX SA	1,140	34.97	39,871.50
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	460	114.90	52,854.00
LAGARDERE S.C.A.	2,980	27.24	81,190.10
NUMERICABLE-SFR	2,250	33.70	75,825.00
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	4,805	46.84	225,090.22
PUBLICIS GROUPE	4,075	61.18	249,308.50
RELX NV	20,559	15.28	314,141.52
RTL GROUP	920	77.21	71,033.20
SES	6,700	25.34	169,778.00
TELENET GROUP HOLDING NV	840	48.99	41,151.60
VIVENDI	25,330	19.60	496,594.65
WOLTERS KLUWER	5,647	30.99	175,000.53
INDITEX	22,755	31.79	723,381.45
CARREFOUR SA	11,113	27.04	300,495.52
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,344	43.30	58,195.20
COLRUYT SA	1,375	48.13	66,185.62
DELHAIZE GROUP	2,426	90.66	219,941.16
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	11,008	5.61	61,842.94
JERONIMO MARTINS	5,075	11.96	60,722.37
KONINKLIJKE AHOLD NV	17,771	19.75	351,066.10
METRO AG	3,260	29.53	96,267.80
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	16,661	114.95	1,915,181.95
DANONE	11,924	62.47	744,892.28



HEINEKEN HOLDING NV	2,595	71.25	184,893.75
HEINEKEN NV	5,033	79.38	399,519.54
KERRY GROUP PLC-A	3,380	74.56	252,012.80
PERNOD-RICARD SA	4,276	105.00	448,980.00
REMY COINTREAU	470	65.90	30,973.00
BEIERSDORF AG	2,015	83.37	167,990.55
HENKEL AG & CO KGAA	2,030	88.75	180,162.50
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	3,953	102.85	406,566.05
L'OREAL	5,166	156.70	809,512.20
UNILEVER NV-CVA	34,005	39.94	1,358,329.72
ESSILOR INTERNATIONAL	4,465	114.50	511,242.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	4,683	77.11	361,106.13
FRESENIUS SE & CO KGAA	8,295	64.79	537,433.05
BAYER AG	17,140	116.10	1,989,954.00
GRIFOLS SA	3,410	42.47	144,822.70
MERCK KGAA	2,930	88.91	260,506.30
ORION OYJ-CLASS B	2,590	31.25	80,937.50
QIAGEN N.V.	5,145	24.84	127,801.80
SANOFI	24,476	79.09	1,935,806.84
UCB SA	2,798	81.57	228,232.86
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	52,861	1.24	65,917.66
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	133,873	6.94	929,212.49
BANCO COMERCIAL PORTUGUES	750,000	0.05	38,925.00
BANCO DE SABADELL SA	108,391	1.67	181,446.53
BANCO POPOLARE SC	5,500	12.90	70,950.00
BANCO POPULAR ESPANOL	39,339	3.09	121,872.22
BANCO SANTANDER SA	297,849	4.69	1,397,209.65
BANK OF IRELAND	558,550	0.34	192,141.20
BANKIA SA	95,000	1.08	102,600.00
BANKINTER SA	13,960	6.75	94,341.68
BNP PARIBAS	21,912	53.30	1,167,909.60
CAIXABANK S.A	54,940	3.28	180,477.90
COMMERZBANK AG	23,524	9.66	227,265.36
CREDIT AGRICOLE SA	21,992	10.89	239,492.88
ERSTE GROUP BANK AG	4,878	28.65	139,754.70

ING GROEP NV-CVA	81,305	12.55	1,020,377.75
INTESA SANPAOLO	275,093	3.09	850,037.37
KBC GROEP NV	5,519	57.65	318,170.35
NATIXIS	22,980	5.29	121,587.18
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	2,770	14.15	39,195.50
SOCIETE GENERALE	15,039	43.26	650,662.33
UBI BANCA SCPA	22,584	6.32	142,730.88
UNICREDIT SPA	98,103	5.16	506,211.48
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	28,835	22.31	643,453.02
DEUTSCHE BOERSE AG	3,830	79.08	302,876.40
EURAZEO	913	62.62	57,172.06
EXOR SPA	1,714	41.37	70,908.18
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,882	77.50	145,855.00
MEDIOBANCA SPA	11,670	8.83	103,104.45
WENDEL	750	109.20	81,900.00
AEGON NV	38,139	5.25	200,420.44
AGEAS	4,044	42.75	172,901.22
ALLIANZ SE-REG	9,458	163.00	1,541,654.00
ASSICURAZIONI GENERALI	22,998	16.92	389,126.16
AXA	40,412	25.09	1,013,937.08
CNP ASSURANCES	3,530	12.55	44,301.50
HANNOVER RUECK SE-REG	1,355	106.25	143,968.75
MAPFRE SA	20,814	2.38	49,537.32
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,316	184.20	610,807.20
NN GROUP NV	4,480	32.30	144,704.00
SAMPO OYJ-A SHS	9,639	46.80	451,105.20
SCOR SE	2,612	34.41	89,878.92
UNIPOLSAI SPA	12,650	2.34	29,702.20
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	6,680	25.29	168,970.60
IMMOEAST AG-TEMPORARY	16,150	-	-
IMMOFINANZ AG-TEMPORARY	13,000	-	-
VONOVIA SE	10,088	28.17	284,178.96
AMADEUS IT HOLDING SA	9,610	40.30	387,283.00
ATOS SE	1,650	76.20	125,730.00
CAP GEMINI SA	3,209	84.03	269,652.27

DASSAULT SYSTEMES SA	2,790	73.27	204,423.30
GEMALTO	1,850	56.02	103,637.00
SAP SE	20,322	73.00	1,483,506.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2,930	50.01	146,529.30
ALCATEL-LUCENT	55,970	3.55	198,693.50
INGENICO GROUP	1,160	114.60	132,936.00
NOKIA OYJ	79,936	6.60	527,977.28
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	67,336	16.61	1,118,787.64
ELISA OYJ	2,505	34.53	86,497.65
ILIAD SA	520	216.00	112,320.00
KONINKLIJKE KPN NV	61,096	3.42	209,437.08
ORANGE S.A.	41,284	15.35	633,915.82
PROXIMUS	3,780	29.40	111,150.90
TELECOM ITALIA SPA	207,723	1.16	242,620.46
TELECOM ITALIA-RSP	125,887	0.92	116,634.30
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	11,110	4.92	54,705.64
TELEFONICA SA	93,429	10.53	984,274.51
E.ON SE	40,559	8.95	363,043.60
EDF	6,075	13.67	83,075.62
ENAGAS	4,190	25.87	108,395.30
ENDESA SA	6,840	18.24	124,761.60
ENEL GREEN POWER SPA	43,650	1.88	82,323.90
ENEL SPA	145,874	3.90	568,908.60
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	49,221	3.22	158,786.94
ENGIE	30,044	16.47	494,974.90
FORTUM OYJ	9,825	13.96	137,157.00
GAS NATURAL SDG SA	7,722	19.05	147,104.10
IBERDROLA SA	115,162	6.49	748,437.83
RED ELECTRICA CORPORACION SA	2,610	76.97	200,891.70
RWE AG	10,685	11.98	128,059.72
SNAM SPA	47,520	4.74	225,339.84
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	6,199	16.99	105,321.01
TERNA SPA	34,477	4.70	162,248.76
VEOLIA ENVIRONNEMENT	9,184	21.38	196,353.92
ASML HOLDING NV	7,192	83.07	597,439.44

	INFINEON TECHNOLOGIES AG	24,715	13.47	333,034.62	
	STMICROELECTRONICS NV	12,733	6.16	78,473.47	
ユーロ小計		5,435,344		70,889,270.03	(9,324,774,579)
英債券	AMEC FOSTER WHEELER PLC	8,850	4.40	38,993.10	
	BG GROUP PLC	70,604	9.86	696,508.46	
	BP PLC	378,618	3.65	1,385,552.57	
	PETROFAC LTD	5,025	8.08	40,627.12	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	80,898	15.57	1,259,581.86	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	50,444	15.71	792,475.24	
	ANGLO AMERICAN PLC	29,014	3.28	95,180.42	
	ANTOFAGASTA PLC	8,730	4.62	40,384.98	
	BHP BILLITON PLC	45,961	7.76	356,887.16	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	2,850	30.42	86,697.00	
	FRESNILLO PLC	5,160	7.15	36,919.80	
	GLENCORE PLC	240,813	0.92	222,511.21	
	JOHNSON MATTHEY PLC	4,447	27.03	120,202.41	
	MONDI PLC	7,400	13.59	100,566.00	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	2,250	42.35	95,287.50	
	REXAM PLC	11,772	6.02	70,926.30	
	RIO TINTO PLC	27,025	20.06	542,256.62	
	SOUTH32 LTD	46,811	0.52	24,575.77	
	ASHTED GROUP PLC	10,920	11.12	121,430.40	
	BAE SYSTEMS PLC ORD	63,705	4.97	316,804.96	
	BUNZL PLC	7,276	18.70	136,061.20	
	COBHAM PLC	23,225	2.81	65,262.25	
	IMI PLC	6,116	8.81	53,912.54	
	MEGGITT PLC	13,905	3.70	51,573.64	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	20,907	2.94	61,529.30	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	38,295	5.95	227,855.25	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENTITL-C	3,549,946	0.00	3,549.94	
	SMITHS GROUP PLC	8,813	9.58	84,472.60	
	TRAVIS PERKINS PLC	4,350	19.75	85,912.50	
	WEIR GROUP PLC/THE	3,880	9.89	38,392.60	
	WOLSELEY PLC	5,004	36.82	184,247.28	

AGGREKO PLC	6,006	9.57	57,477.42
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,275	10.23	64,193.25
CAPITA PLC	15,309	12.23	187,229.07
EXPERIAN PLC	20,558	12.04	247,518.32
G4S PLC	34,639	2.29	79,427.22
INTERTEK GROUP PLC	3,545	27.90	98,905.50
EASYJET PLC	3,840	17.21	66,086.40
ROYAL MAIL PLC	14,990	4.50	67,455.00
GKN PLC	33,065	3.05	100,914.38
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	20,100	6.16	123,816.00
BURBERRY GROUP PLC	9,334	12.09	112,848.06
PERSIMMON PLC	5,870	19.73	115,815.10
TAYLOR WIMPEY PLC	66,170	1.97	130,487.24
CARNIVAL PLC	3,660	38.00	139,080.00
COMPASS GROUP PLC	34,397	11.60	399,005.20
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	4,838	26.36	127,529.68
MERLIN ENTERTAINME	15,550	4.50	69,975.00
TUI AG-DI	3,393	12.30	41,733.90
WHITBREAD PLC	4,140	44.40	183,816.00
WILLIAM HILL PLC	18,010	3.90	70,401.09
ITV PLC	77,235	2.75	212,396.25
PEARSON PLC	17,749	7.68	136,312.32
REED ELSEVIER PLC	23,666	11.80	279,258.80
SKY PLC	23,224	10.99	255,231.76
WPP PLC	27,154	15.38	417,628.52
DIXONS CARPHONE PLC	22,000	4.97	109,494.00
KINGFISHER PLC	50,397	3.29	166,158.90
MARKS & SPENCER GROUP PLC	34,970	4.53	158,553.98
NEXT PLC	2,987	71.80	214,466.60
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	5,460	5.64	30,821.70
SAINSBURY (J) PLC	23,451	2.66	62,473.46
TESCO PLC	177,834	1.50	268,351.50
WM MORRISON SUPERMARKETS	37,925	1.55	58,783.75
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	7,795	33.39	260,275.05
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	38,767	37.81	1,465,780.27

COCA-COLA HBC AG-CDI	5,000	14.75	73,750.00
DIAGEO PLC	52,022	18.56	965,788.43
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	19,722	35.43	698,849.07
SABMILLER PLC	20,161	40.75	821,560.75
TATE & LYLE PLC	7,830	5.95	46,588.50
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	13,295	62.26	827,746.70
UNILEVER PLC	26,517	28.91	766,606.47
SMITH & NEPHEW PLC	19,376	11.73	227,280.48
ASTRAZENECA PLC	26,173	45.40	1,188,254.20
GLAXOSMITHKLINE PLC	100,771	13.76	1,386,608.96
SHIRE PLC	12,425	46.09	572,668.25
BARCLAYS PLC	348,481	2.21	772,582.37
HSBC HOLDINGS PLC	406,751	5.41	2,201,743.16
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,181,036	0.73	868,061.46
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	71,010	3.04	216,438.48
STANDARD CHARTERED PLC	69,440	5.89	409,001.60
3I GROUP PLC	20,499	4.79	98,354.20
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	22,730	2.90	65,917.00
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,720	14.82	84,770.40
ICAP PLC	12,270	5.10	62,638.35
INVESTEC PLC	13,185	4.93	65,094.34
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	6,577	27.02	177,710.54
PROVIDENT FINANCIAL PLC	2,880	32.99	95,011.20
SCHRODERS PLC	2,231	29.61	66,059.91
ADMIRAL GROUP PLC	4,925	16.39	80,720.75
AVIVA PLC	83,965	5.19	435,778.35
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	29,333	4.10	120,470.63
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	127,081	2.69	342,229.13
OLD MUTUAL PLC	104,159	1.81	189,256.90
PRUDENTIAL PLC	53,202	15.40	819,310.80
RSA INSURANCE GROUP PLC	24,738	4.30	106,596.04
ST JAMES'S PLACE PLC	11,000	9.96	109,560.00
STANDARD LIFE PLC	40,716	3.95	160,909.63
AUTO TRADER GROUP PLC	13,700	4.25	58,320.90
SAGE GROUP PLC/THE	22,090	5.96	131,656.40

	BT GROUP PLC	174,842	4.67	816,599.56	
	INMARSAT PLC	10,010	11.30	113,113.00	
	VODAFONE GROUP PLC	549,558	2.16	1,190,617.40	
	CENTRICA PLC	100,135	2.18	218,494.57	
	NATIONAL GRID PLC	78,695	9.35	735,798.25	
	SEVERN TRENT PLC	5,493	21.75	119,472.75	
	SSE PLC	21,427	15.33	328,475.91	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	16,215	9.36	151,853.47	
	ARM HOLDINGS PLC	30,650	10.38	318,147.00	
英bond小計		9,645,353		33,323,304.93 (5,973,202,408)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	7,955	12.90	102,619.50	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	140	432.50	60,550.00	
	GIVAUDAN-REG	203	1,804.00	366,212.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	8,999	50.40	453,549.60	
	SIKA AG-BR	47	3,603.00	169,341.00	
	SYNGENTA AG-REG	1,978	393.70	778,738.60	
	ABB LTD-REG	46,245	17.84	825,010.80	
	GEBERIT AG-REG	805	334.50	269,272.50	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	360	165.50	59,580.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,090	166.90	181,921.00	
	SULZER AG-REG	150	95.90	14,385.00	
	ADECCO SA-REG	3,557	68.80	244,721.60	
	SGS SA-REG	103	1,891.00	194,773.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,020	135.50	138,210.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	10,699	71.95	769,793.05	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	610	345.50	210,755.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	930	66.45	61,798.50	
	DUFREY AG-REG	800	118.10	94,480.00	
	ARYZTA AG	2,110	50.70	106,977.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	25	6,095.00	152,375.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	2	73,650.00	147,300.00	
	NESTLE SA-REG	66,193	73.35	4,855,256.55	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,160	125.70	145,812.00	
	ACTELION LTD-REG	2,000	137.00	274,000.00	

	GALENICA AG-REG	70	1,499.00	104,930.00	
	LONZA GROUP AG-REG	1,250	159.30	199,125.00	
	NOVARTIS AG-REG	47,223	85.05	4,016,316.15	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	14,578	272.50	3,972,505.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	36,798	21.73	799,620.54	
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,210	45.87	238,982.70	
	PARGESA HOLDING SA-BR	655	63.05	41,297.75	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	370	358.00	132,460.00	
	UBS GROUP AG-REG	76,322	19.31	1,473,777.82	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,080	127.00	137,160.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	640	265.30	169,792.00	
	SWISS RE AG	7,009	98.45	690,036.05	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,131	255.70	800,596.70	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,370	78.05	106,928.50	
	SWISSCOM AG-REG	494	497.30	245,666.20	
	スイスフラン小計	353,381		23,806,626.11 (2,897,742,530)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	4,320	125.60	542,592.00	
	BOLIDEN AB	4,510	148.10	667,931.00	
	ALFA LAVAL AB	4,660	155.00	722,300.00	
	ASSA ABLOY AB-B	20,910	177.30	3,707,343.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	13,095	210.60	2,757,807.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	8,620	197.70	1,704,174.00	
	SANDVIK AB	21,690	74.55	1,616,989.50	
	SKANSKA AB-B SHS	7,170	164.60	1,180,182.00	
	SKF AB-B SHARES-B	7,459	140.90	1,050,973.10	
	VOLVO AB-B SHS-B	31,320	80.05	2,507,166.00	
	SECURITAS AB-B SHS	7,249	128.50	931,496.50	
	ELECTROLUX AB - B	4,595	203.60	935,542.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	8,480	56.30	477,424.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	19,758	300.00	5,927,400.00	
	ICA GRUPPEN AB	1,450	305.30	442,685.00	
	SWEDISH MATCH AB	4,860	295.50	1,436,130.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	13,015	242.50	3,156,137.50	
	GETINGE AB-B SHS	4,450	219.60	977,220.00	



	NORDEA BANK AB	64,688	93.30	6,035,390.40	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	31,870	89.05	2,838,023.50	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	31,030	113.40	3,518,802.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	18,520	187.80	3,478,056.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,630	146.00	383,980.00	
	INVESTOR AB-B SHS	9,045	312.50	2,826,562.50	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	5,505	259.50	1,428,547.50	
	ERICSSON LM-B SHS	64,235	82.20	5,280,117.00	
	HEXAGON AB-B SHS	4,880	316.10	1,542,568.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,370	497.20	681,164.00	
	TELE2 AB-B SHS	6,255	84.30	527,296.50	
	TELIASONERA AB	53,480	42.28	2,261,134.40	
スウェーデンクローナ小計		481,119		61,543,134.40	(879,451,390)
ノルウェークローネ	STATOIL ASA	24,664	124.90	3,080,533.60	
	NORSK HYDRO A S	30,900	33.12	1,023,408.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	3,780	380.90	1,439,802.00	
	ORKLA ASA	19,380	69.30	1,343,034.00	
	DNB ASA	22,215	109.70	2,436,985.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,200	140.80	591,360.00	
	TELENOR ASA	15,275	147.20	2,248,480.00	
ノルウェークローネ小計		120,414		12,163,603.10	(167,857,722)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,890	418.90	791,721.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	4,865	327.80	1,594,747.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	4,690	479.00	2,246,510.00	
	ISS A/S	3,100	243.10	753,610.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	90	8,815.00	793,350.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	138	8,955.00	1,235,790.00	
	DSV A/S	3,680	265.70	977,776.00	
	PANDORA A/S	2,240	843.50	1,889,440.00	
	CARLSBERG AS-B	2,390	610.00	1,457,900.00	
	COLOPLAST-B	2,545	543.50	1,383,207.50	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	600	656.00	393,600.00	
NOVO NORDISK A/S-B	40,685	393.80	16,021,753.00		

	DANSKE BANK A/S	14,975	183.80	2,752,405.00	
	TRYG A/S	2,575	130.00	334,750.00	
	TDC A/S	14,545	33.98	494,239.10	
デンマーククローネ小計		99,008		33,120,798.60 (583,588,471)	
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	5,335	37.00	197,395.00	
	OIL SEARCH LTD	26,710	6.62	176,820.20	
	ORIGIN ENERGY LTD	41,910	4.79	200,748.90	
	SANTOS LTD	37,665	3.80	143,127.00	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	16,528	28.18	465,759.04	
	ALUMINA LTD	46,512	1.18	54,884.16	
	AMCOR LIMITED	26,490	13.32	352,846.80	
	BHP BILLITON LTD	67,716	18.34	1,241,911.44	
	BORAL LTD	17,115	5.75	98,411.25	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	29,665	1.88	55,770.20	
	ILUKA RESOURCES LTD	8,735	5.96	52,060.60	
	INCITEC PIVOT LTD	31,550	3.87	122,098.50	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	10,985	16.97	186,415.45	
	NEWCREST MINING LTD	14,929	12.96	193,479.84	
	ORICA LIMITED	6,935	15.37	106,590.95	
	RIO TINTO LTD	8,238	45.95	378,536.10	
	SOUTH32 LTD	70,856	1.10	78,295.88	
	CIMIC GROUP LTD	1,867	23.69	44,229.23	
	BRAMBLES LTD	29,708	11.16	331,541.28	
	SEEK LTD	8,040	14.82	119,152.80	
	ASCIANO LTD	14,833	8.74	129,640.42	
	AURIZON HOLDINGS LTD	46,150	4.20	193,830.00	
	QANTAS AIRWAYS LTD	13,113	4.00	52,452.00	
	SYDNEY AIRPORT	13,366	6.38	85,275.08	
	TRANSURBAN GROUP	43,195	10.46	451,819.70	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	10,000	10.04	100,400.00	
CROWN RESORTS LTD	6,745	12.46	84,042.70		
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	970	38.52	37,364.40		
TABCORP HOLDINGS LTD	15,336	4.59	70,392.24		
TATTS GROUP LTD	37,700	4.33	163,241.00		

	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	8,720	4.03	35,141.60	
	WESFARMERS LTD	23,695	40.68	963,912.60	
	WOOLWORTHS LTD	26,272	24.27	637,621.44	
	COCA-COLA AMATIL LTD	10,650	9.28	98,832.00	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	15,946	8.18	130,438.28	
	COCHLEAR LTD	1,277	93.51	119,412.27	
	HEALTHSCOPE LTD	19,970	2.61	52,121.70	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,935	65.28	191,596.80	
	SONIC HEALTHCARE LTD	9,830	17.80	174,974.00	
	CSL LTD	9,742	103.25	1,005,861.50	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	58,319	27.25	1,589,192.75	
	BANK OF QUEENSLAND LIMITED	8,120	13.61	110,513.20	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	10,478	11.51	120,601.78	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	35,387	83.32	2,948,444.84	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	54,653	29.39	1,606,251.67	
	WESTPAC BANKING CORP	68,661	32.54	2,234,228.94	
	ASX LTD	4,995	40.96	204,595.20	
	CHALLENGER LTD	9,950	8.37	83,281.50	
	MACQUARIE GROUP LTD	6,404	80.74	517,058.96	
	AMP LTD	62,647	5.68	355,834.96	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	50,298	5.43	273,118.14	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	62,000	2.12	131,440.00	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	27,200	12.26	333,472.00	
	SUNCORP GROUP LTD	29,020	11.83	343,306.60	
	COMPUTERSHARE LTD	11,490	11.54	132,594.60	
	TELSTRA CORPORATION LTD	93,164	5.46	508,675.44	
	AGL ENERGY LTD	15,301	17.51	267,920.51	
	AUSNET SERVICES	29,110	1.45	42,355.05	
	DUET GROUP	41,590	2.35	97,736.50	
	豪ドル小計	1,516,721		21,279,066.99 (1,858,939,292)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	17,130	7.15	122,479.50	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	24,545	5.45	133,770.25	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	45,157	3.29	148,566.53	
	CONTACT ENERGY LIMITED	9,430	4.72	44,509.60	

ニュージーランドドル小計		96,262		449,325.88 (36,943,573)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	56,708	104.70	5,937,327.60	
	NWS HOLDINGS LTD	28,500	11.68	332,880.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	25,000	13.44	336,000.00	
	MTR CORP	34,000	37.15	1,263,100.00	
	LI & FUNG LTD	138,000	5.17	713,460.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	29,000	31.15	903,350.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	14,500	25.70	372,650.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	50,000	24.80	1,240,000.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	16,800	9.80	164,640.00	
	SANDS CHINA LTD	49,800	26.75	1,332,150.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	28,000	7.47	209,160.00	
	SJM HOLDINGS LTD	48,000	5.55	266,400.00	
	WYNN MACAU LTD	35,800	9.17	328,286.00	
	WH GROUP LTD	63,500	4.29	272,415.00	
	BANK OF EAST ASIA	21,640	28.05	607,002.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	77,000	24.00	1,848,000.00	
	HANG SENG BANK LTD	16,300	146.80	2,392,840.00	
	FIRST PACIFIC CO	44,250	5.09	225,232.50	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	23,500	203.20	4,775,200.00	
	AIA GROUP LTD	250,400	47.00	11,768,800.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	54,208	51.10	2,770,028.80	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	57,000	18.16	1,035,120.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	24,402	48.15	1,174,956.30	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	15,000	32.05	480,750.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	11,450	21.40	245,030.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	134,666	7.61	1,024,808.26	
	SINO LAND CO	63,050	11.64	733,902.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	36,480	95.00	3,465,600.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	13,017	86.90	1,131,177.30	
	SWIRE PROPERTIES LTD	23,200	22.30	517,360.00	
WHARF HOLDINGS LTD	27,800	43.65	1,213,470.00		
WHEELLOCK & CO LTD	19,600	33.45	655,620.00		
HKT TRUST AND HKT LTD	67,000	9.87	661,290.00		

	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	15,000	70.45	1,056,750.00	
	CLP HOLDINGS LTD	42,500	65.30	2,775,250.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	135,569	15.00	2,033,535.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS	27,500	70.35	1,934,625.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	4,200	59.00	247,800.00	
香港ドル小計		1,822,340		58,445,965.76 (905,912,469)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	34,660	6.53	226,329.80	
	NOBLE GROUP LTD	82,854	0.45	37,698.57	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	21,000	3.11	65,310.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	16,000	1.83	29,360.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,000	3.03	99,990.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	42,010	1.10	46,421.05	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,000	3.00	138,000.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	12,800	11.05	141,440.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	102,000	0.77	78,540.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	32,550	3.94	128,247.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,000	34.48	68,960.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	130,000	0.35	45,500.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	44,700	2.93	130,971.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	36,715	16.64	610,937.60	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	62,240	8.85	550,824.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	29,200	19.40	566,480.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	20,000	7.62	152,400.00	
	CAPITALAND LTD	46,100	3.33	153,513.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	10,000	7.69	76,900.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	60,000	2.12	127,200.00	
	UOL GROUP LTD	12,250	6.20	75,950.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	164,980	3.66	603,826.80	
シンガポールドル小計		1,041,059		4,154,798.82 (355,692,326)	
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	9,770	17.05	166,578.50	
	TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	18,340	258.40	4,739,056.00	
	BANK HAPAOALIM BM	27,725	19.68	545,628.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	29,355	13.27	389,540.85	

	NICE SYSTEMS LTD	1,385	224.70	311,209.50	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	48,790	8.35	407,396.50	
イスラエルシュケル小計		135,365		6,559,409.35 (202,948,125)	
合 計		28,258,871		72,126,738,590 (72,126,738,590)	

(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	124,637.80	
		AMERICAN TOWER CORP	8,759	859,608.26	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	20,020	195,195.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,745	501,593.85	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,417	440,827.17	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	3,340	85,504.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,200	167,970.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	6,970	605,971.80	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,235	244,436.60	
		DUKE REALTY CORPORATION	6,875	143,962.50	
		EQUINIX INC	1,208	359,005.52	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	7,760	627,551.20	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,400	333,718.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	2,220	195,870.60	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,415	209,066.25	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	12,545	339,091.35	
		HCP INC	10,125	382,927.50	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	14,569	232,375.55	
		IRON MOUNTAIN INC	3,285	89,811.90	
		KIMCO REALTY CORPORATION	8,795	232,891.60	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	98,308.54	
MACERICH CO/THE	2,870	230,087.90			
PLUM CREEK TIMBER CO	3,408	165,219.84			

		PROLOGIS INC	10,732	455,680.72	
		PUBLIC STORAGE	3,089	766,844.25	
		REALTY INCOME CORP	5,400	277,020.00	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	2,355	160,587.45	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	6,544	1,271,826.40	
		SL GREEN REALTY CORP	2,260	255,493.00	
		UDR INC	5,820	214,932.60	
		VENTAS INC	6,675	370,596.00	
		VEREIT INC	18,644	151,762.16	
		VORNADO REALTY TRUST	3,321	331,469.01	
		WELLTOWER INC	6,990	468,539.70	
		WEYERHAEUSER CO	10,286	315,985.92	
米ドル小計			219,400	11,906,369.94	(1,430,550,348)
加ドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2,340	47,455.20	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,380	82,167.80	
加ドル小計			5,720	129,623.00	(11,266,831)
ユーロ	投資証券	FONCIERE DES REGIONS	595	49,051.80	
		GECINA SA	580	65,424.00	
		ICADE	685	42,312.45	
		KLEPIERRE	3,142	127,910.82	
		UNIBAIL-RODAMCO SE-NA	2,070	488,830.50	
ユーロ小計			7,072	773,529.57	(101,750,079)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	21,701	172,197.43	
		HAMMERSON PLC	15,295	92,534.75	
		INTU PROPERTIES PLC	19,860	64,008.78	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	16,229	192,475.94	
		SEGRO PLC	15,053	64,983.80	
英ポンド小計			88,138	586,200.70	(105,076,475)
豪ドル	投資証券	APA GROUP	26,406	228,940.02	
		DEXUS PROPERTY GROUP	18,487	141,795.29	
		GOODMAN GROUP	43,442	276,725.54	

		GPT GROUP	33,165	160,850.25	
		LENDLEASE GROUP	12,197	171,001.94	
		MIRVAC GROUP	86,525	174,780.50	
		SCENTRE GROUP	116,381	484,144.96	
		STOCKLAND	55,310	233,408.20	
		VICINITY CENTRES	72,862	206,199.46	
		WESTFIELD CORP	41,745	399,499.65	
豪ドル小計			506,520	2,477,345.81	(216,420,929)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	48,000	2,222,400.00	
香港ドル小計			48,000	2,222,400.00	(34,447,200)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	39,000	88,920.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	40,000	53,200.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	41,800	81,719.00	
		SUNTEC REIT	45,000	69,975.00	
シンガポールドル小計			165,800	293,814.00	(25,153,416)
合計				1,924,665,278	(1,924,665,278)

(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 604銘柄	97.0%		62.9%
	投資証券 35銘柄		3.0%	1.9%
加ドル	株式 87銘柄	99.6%		3.4%
	投資証券 2銘柄		0.4%	0.0%
ユーロ	株式 233銘柄	98.9%		12.6%
	投資証券 5銘柄		1.1%	0.1%
英ポンド	株式 110銘柄	98.3%		8.1%
	投資証券 5銘柄		1.7%	0.1%



スイスフラン	株式	39銘柄	100.0%		3.9%
スウェーデンクローナ	株式	30銘柄	100.0%		1.2%
ノルウェークローネ	株式	7銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式	15銘柄	100.0%		0.8%
豪ドル	株式	59銘柄	89.6%		2.5%
	投資証券	10銘柄		10.4%	0.3%
ニュージーランドドル	株式	4銘柄	100.0%		0.0%
香港ドル	株式	38銘柄	96.3%		1.2%
	投資証券	1銘柄		3.7%	0.0%
シンガポールドル	株式	22銘柄	93.4%		0.5%
	投資証券	4銘柄		6.6%	0.0%
イスラエルシケル	株式	6銘柄	100.0%		0.3%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

## 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

### 貸借対照表

（単位：円）

	平成27年 6月25日現在	平成27年12月25日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
預金	136,894,168	113,449,660
コール・ローン	130,821,667	104,079,560
株式	10,700,429,069	8,976,747,237
投資信託受益証券	30,749,493	30,996,897
投資証券	37,733,799	41,347,695
派生商品評価勘定	4,687,619	6,765,020
未収配当金	38,638,328	7,231,774
未収利息	211	173
差入委託証拠金	15,137,393	32,768,510
流動資産合計	11,095,091,747	9,313,386,526
資産合計	11,095,091,747	9,313,386,526
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	6,813	77,026

	平成27年 6月25日現在	平成27年12月25日現在
未払解約金	7,921,000	9,027,551
流動負債合計	7,927,813	9,104,577
負債合計	7,927,813	9,104,577
純資産の部		
元本等		
元本	6,373,238,852	6,709,790,933
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,713,925,082	2,594,491,016
元本等合計	11,087,163,934	9,304,281,949
純資産合計	11,087,163,934	9,304,281,949
負債純資産合計	11,095,091,747	9,313,386,526

## 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27年 6月25日現在	平成27年12月25日現在
1. 期首	平成26年12月26日	平成27年 6月26日
期首元本額	6,513,234,225円	6,373,238,852円
期首からの追加設定元本額	440,308,311円	599,333,993円
期首からの一部解約元本額	580,303,684円	262,781,912円

元本の内訳		
日興五大陸株式ファンド	2,459,866,842円	2,567,584,970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	27,801,295円	30,612,308円
インデックスファンド海外新興国（エマージング）株式	3,876,567,116円	4,101,803,199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）	9,003,599円	9,790,456円
計	6,373,238,852円	6,709,790,933円
2. 受益権の総数	6,373,238,852口	6,709,790,933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12月26日 至 平成27年 6月25日	自 平成27年 6月26日 至 平成27年12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27年 6月25日現在	平成27年12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。	(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

(平成27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	1,575,088,660
投資信託受益証券	6,375,369
投資証券	2,993,790
合計	1,584,457,819

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成27年 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

(平成27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	235,710,269	-	242,432,662	6,722,393
合計		235,710,269	-	242,432,662	6,722,393

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (通貨関連)

(平成27年 6月25日現在)

該当事項はありません。

(平成27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	48,088,000	-	48,052,000	36,000
	米ドル	48,088,000	-	48,052,000	36,000
	売建	10,779,549	-	10,777,948	1,601
	ポーランドズロチ	3,862,500	-	3,882,500	20,000
	タイバーツ	6,917,049	-	6,895,448	21,601
合計		58,867,549	-	58,829,948	34,399

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

平成27年 6月25日現在		平成27年12月25日現在	
1口当たり純資産額	1.7396円	1口当たり純資産額	1.3867円
(1万口当たり純資産額)	(17,396円)	(1万口当たり純資産額)	(13,867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	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	2,440	7.40	18,056.00	
	GAZPROM PAO-SPON ADR	132,700	3.86	512,686.45	

LUKOIL PJSC-SPON-ADR	11,385	33.40	380,259.00
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	1,926	85.20	164,095.20
PETROLEO BRASILEIRO S.A.-ADR	3,750	4.53	16,987.50
ROSNEFT OJSC-REG S GDR	26,540	3.54	94,084.30
SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	38,500	4.81	185,377.50
TATNEFT-SPONSORED-ADR	5,449	26.85	146,305.65
BRASKEM SA-SPON ADR	1,780	14.69	26,148.20
CEMEX SAB-SPONS ADR PART CER	2,500	5.64	14,100.00
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	4,650	4.35	20,227.50
CIA SIDERURGICA NAACL-SP ADR	10,170	1.05	10,678.50
GERDAU SA -SPON ADR	3,600	1.20	4,320.00
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	13,394	13.36	178,943.84
QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	1,100	18.84	20,724.00
SEVERSTAL - GDR REG S	5,670	8.50	48,195.00
SOUTHERN COPPER CORP(US)	3,680	26.91	99,028.80
EMBRAER SA ADR	800	29.35	23,480.00
DP WORLD LTD	4,470	20.00	89,400.00
LATAM AIRLINES GROUP-SP -ADR	2,280	5.46	12,448.80
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP-ADR	1,400	32.76	45,864.00
GRUPO TELEVISA SA-SPONS ADR	2,040	27.99	57,099.60
CTRIIP.COM INTERNATIONAL-ADR	3,160	48.74	154,018.40
JD.COM INC-ADR	3,600	32.58	117,288.00
QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	600	53.56	32,136.00
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	4,200	16.46	69,132.00
CIA BRASILEIRA-SP ADR PREF	2,380	10.66	25,370.80
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	5,500	39.14	215,270.00
BRF SA-ADR	5,980	14.93	89,281.40
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	2,000	21.84	43,680.00
BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	1,983	18.24	36,169.92
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	1,850	28.22	52,207.00
CREDICORP LTD	1,430	99.98	142,971.40
GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORE-ADR	1,850	6.94	12,839.00
GRUPO FIN SANTANDER B-ADR	2,600	8.64	22,464.00
ITAU UNIBANCO HLDNG-PREF ADR	2,000	6.71	13,420.00
SBERBANK-SPONSORED ADR	61,000	6.08	370,880.00

	VTB BANK OJSC-GDR-REG S	61,030	2.15	131,336.56	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	9,500	4.14	39,415.50	
	58.COM INC-ADR	800	66.18	52,944.00	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP-ADR	10,680	83.71	894,022.80	
	BAIDU INC - SPON ADR	3,000	193.93	581,790.00	
	NETEASE INC-ADR	850	183.85	156,272.50	
	QIHOO 360 TECHNOLOGY CO-ADR	670	73.00	48,910.00	
	MEGAFON-REG S-GDR	2,600	11.50	29,900.00	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	12,562	6.41	80,522.42	
	ROSTELECOM-SPONSORED-ADR	2,641	7.62	20,124.42	
	SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR	2,800	6.41	17,948.00	
	TELEF BRASIL-ADR	3,924	9.48	37,199.52	
	CEMIG SA -SPONS ADR	4,397	1.58	6,947.26	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE-ADR	6,180	4.78	29,540.40	
	RUSHYDRO PJSC-ADR	28,000	0.98	27,496.00	
米ドル小計		529,991		5,720,007.14 (687,258,857)	
メキシコペソ	TELESITES SAB	33,540	11.68	391,747.20	
	CEMEX SAB-CPO	263,409	9.72	2,560,335.48	
	GRUPO MEXICO SA-SER B	82,078	37.93	3,113,218.54	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	3,700	180.25	666,925.00	
	MEXICHEM SAB DE CV-*	23,185	39.27	910,474.95	
	ALFA S.A.B.-A	61,000	34.48	2,103,280.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	13,700	73.18	1,002,566.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	5,000	205.44	1,027,200.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	6,600	158.25	1,044,450.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	4,000	249.54	998,160.00	
	OHL MEXICO SAB DE CV	21,000	18.38	385,980.00	
	GRUPO TELEVISA SAB	43,100	96.97	4,179,407.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	4,400	213.18	937,992.00	
	CONTROLADORA COML MEXIC-UBC	13,000	50.68	658,840.00	
	WALMART DE MEXICO -SER V	120,200	43.80	5,264,760.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	9,300	104.01	967,293.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	8,100	125.52	1,016,712.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	38,900	163.52	6,360,928.00	



	GRUMA S.A.B. -B	3,000	240.51	721,530.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	36,500	46.41	1,693,965.00	
	GRUPO LALA SAB DE CV	13,000	41.27	536,510.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	41,670	39.81	1,658,882.70	
	GRUPO FIN SANTANDER-B	32,000	29.88	956,160.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	52,100	93.12	4,851,552.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	54,000	31.46	1,698,840.00	
	GENTERA SAB DE CV	30,000	33.24	997,200.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	670,800	12.46	8,358,168.00	
	メキシコペソ小計	1,687,282		55,063,076.87 (383,789,645)	
ブラジルリアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	2,600	24.78	64,428.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	53,360	8.88	473,836.80	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	85,100	6.93	589,743.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	8,100	63.15	511,515.00	
	BRASKEM SA-PREF A	1,000	28.95	28,950.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL	7,800	4.33	33,774.00	
	DURATEX SA	7,260	6.02	43,705.20	
	FIBRIA CELULOSE SA	3,629	51.84	188,127.36	
	GERDAU SA-PREF	16,000	4.83	77,280.00	
	KLABIN SA - UNIT	13,300	22.72	302,176.00	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	9,000	18.39	165,510.00	
	VALE SA	25,760	13.22	340,547.20	
	VALE SA-PREF A	46,150	10.52	485,498.00	
	EMBRAER SA	10,500	29.08	305,340.00	
	WEG SA	12,820	15.55	199,351.00	
	CCR SA	20,600	13.00	267,800.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	2,940	25.70	75,558.00	
	ESTACIO PARTICIPACOES SA	7,500	13.61	102,075.00	
	KROTON EDUCACIONAL SA	29,448	9.82	289,179.36	
	B2W CIA DIGITAL	3,300	14.60	48,180.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PRF	10,910	17.96	195,943.60	
	LOJAS RENNER S.A.	14,000	17.00	238,000.00	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PRF	850	41.19	35,011.50	
	RAIA DROGASIL SA	2,800	36.14	101,192.00	

AMBEV SA	102,000	18.20	1,856,400.00	
BRF SA	8,400	59.11	496,524.00	
JBS SA	18,100	12.53	226,793.00	
M DIAS BRANCO SA	950	66.94	63,593.00	
HYPERMARCAS SA	8,000	21.53	172,240.00	
NATURA COSMETICOS SA	3,300	24.85	82,005.00	
ODONTOPREV S.A.	4,700	9.59	45,073.00	
QUALICORP SA	5,000	14.03	70,150.00	
BANCO BRADESCO S.A-RTS	470	2.07	972.90	
BANCO BRADESCO S.A.	14,360	21.27	305,437.20	
BANCO BRADESCO SA-PRF	54,948	19.40	1,065,991.20	
BANCO BRADESCO SA-RTS	1,799	2.19	3,939.81	
BANCO DO BRASIL S.A.	19,200	14.85	285,120.00	
BANCO SAN. BRASIL-UNIT	7,700	15.90	122,430.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	64,033	26.50	1,696,874.50	
ITAUSA- INVESTIMENTOS ITAU-PRF	75,836	7.00	530,852.00	
BM&FBOVESPA SA	37,573	11.05	415,181.65	
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	4,700	38.00	178,600.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	14,000	24.83	347,620.00	
PORTO SEGURO SA	3,200	30.33	97,056.00	
SUL AMERICA SA - UNITS	5,500	19.35	106,425.00	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	10,500	11.52	120,960.00	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	1,500	40.64	60,960.00	
CIELO SA	17,409	34.42	599,217.78	
TOTVS SA	3,250	32.00	104,000.00	
TELEFONICA BRASIL S.A. -PREF	5,330	37.40	199,342.00	
TIM PARTICIPACOES SA	16,905	7.01	118,504.05	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	2,300	10.05	23,115.00	
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	2,800	12.86	36,008.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	14,399	6.18	88,985.82	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PRF-B	3,000	24.50	73,500.00	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	2,160	19.30	41,688.00	
CPFL ENERGIA SA	3,517	15.39	54,126.63	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	7,300	12.10	88,330.00	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	3,800	35.33	134,254.00	

	TRACTEBEL ENERGIA SA ORD	3,700	33.55	124,135.00	
ブラジルリアル小計		946,366		15,199,125.56	(463,117,355)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	11,490	6,076.50	69,818,985.00	
	EMPRESAS CMPC SA	20,000	1,527.80	30,556,000.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B-PRF	1,400	13,152.00	18,412,800.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	5,300	3,679.60	19,501,880.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	10,800	4,525.00	48,870,000.00	
	CENCOSUD SA	30,150	1,409.20	42,487,380.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PRF B	5,600	2,107.10	11,799,760.00	
	BANCO DE CHILE	424,189	69.90	29,650,811.10	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	860	26,900.00	23,134,000.00	
	BANCO SANTANDER CHILE SA	747,000	31.81	23,762,070.00	
	CORPBANCA	2,600,000	5.72	14,879,800.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	2,700	6,450.00	17,415,000.00	
	AES GENER SA	80,000	313.99	25,119,200.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	56,000	361.24	20,229,440.00	
	COLBUN SA	208,000	161.83	33,660,640.00	
	EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	57,700	876.06	50,548,662.00	
ENERSIS SA	419,500	172.58	72,397,310.00		
チリペソ小計		4,680,689		552,243,738.10	(94,709,801)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	50,000	1,170.00	58,500,000.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	8,890	9,720.00	86,410,800.00	
	GRUPO ARGOS SA	5,760	16,120.00	92,851,200.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES-PRF	47,000	1,110.00	52,170,000.00	
	CORP FIN COLOMBIANA-CD	2,500	38,300.00	95,750,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	6,600	35,200.00	232,320,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	13,000	7,060.00	91,780,000.00	
コロンビアペソ小計		133,750		709,782,000.00	(26,758,781)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	1,770	72.85	128,944.50	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	46,017	3.22	148,174.74	
	ENKA INSAAT VE SANAYI AS	21,994	4.55	100,072.70	
	KOC HOLDING AS	12,124	11.52	139,668.48	

	TURK HAVA YOLLARI AO	19,550	7.42	145,061.00	
	ARCELIK A.S.	6,500	14.67	95,355.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	4,400	53.45	235,180.00	
	ANADOLU EFES BIRACILIK	5,581	19.25	107,434.25	
	COCA-COLA ICECEK URETIM AS	2,000	40.06	80,120.00	
	AKBANK T.A.S.	49,259	7.12	350,724.08	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	52,740	7.35	387,639.00	
	TURKIYE HALK BANKASI	14,660	10.73	157,301.80	
	TURKIYE IS BANKASI-C	39,904	4.68	186,750.72	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	19,682	3.91	76,956.62	
	YAPI VE KREDI BANKASI	18,033	3.37	60,771.21	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	27,753	8.36	232,015.08	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	12,000	5.49	65,880.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	17,056	10.18	173,630.08	
	トルコリラ小計	371,023		2,871,679.26	(118,370,619)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	360	4,969.00	1,788,840.00	
	CEZ AS	3,530	424.00	1,496,720.00	
	チェココルナ小計	3,890		3,285,560.00	(16,000,677)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	1,060	13,960.00	14,797,600.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	2,750	5,407.00	14,869,250.00	
	OTP BANK PLC	4,585	5,904.00	27,069,840.00	
	ハンガリーフォリント小計	8,395		56,736,690.00	(23,619,484)
ポーランドズ チ	GRUPA LOTOS SA	3,000	27.65	82,950.00	
	POLISH OIL & GAS	37,985	5.35	203,219.75	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	6,130	67.37	412,978.10	
	GRUPA AZOTY SA	1,400	98.97	138,558.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	3,710	62.80	232,988.00	
	CCC SA	650	137.00	89,050.00	
	LPP SA	20	5,686.90	113,738.00	
	CYFROWY POLSAT SA	4,500	22.29	100,305.00	
	EUROCASH SA	2,100	51.30	107,730.00	
	ALIOR BANK SA	1,500	65.61	98,415.00	

	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	850	72.06	61,251.00	
	BANK MILLENNIUM SA	13,000	5.55	72,150.00	
	BANK PEKAO SA	3,152	145.85	459,719.20	
	BANK ZACHODNI WBK SA	550	283.00	155,650.00	
	MBANK	230	326.95	75,198.50	
	PKO BANK POLSKI SA	18,445	27.16	500,966.20	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	12,000	34.15	409,800.00	
	ORANGE POLSKA SA	14,105	6.74	95,067.70	
	ENEA SA	5,500	11.46	63,030.00	
	ENERGA SA	5,000	12.81	64,050.00	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	18,400	13.39	246,376.00	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	22,000	2.98	65,560.00	
	ポーランドズロチ小計	174,227		3,848,750.45	(119,580,676)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	85,000	3.12	265,200.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	46,000	7.07	325,220.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	539,300	4.95	2,669,535.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	73,000	12.50	912,500.00	
	CNOOC LTD	388,000	8.41	3,263,080.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	66,000	6.58	434,280.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	467,000	5.38	2,512,460.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	50,000	3.73	186,500.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	89,000	2.59	230,510.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	33,000	21.30	702,900.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	74,000	3.94	291,560.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	31,000	8.99	278,690.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	42,000	4.66	195,720.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	64,500	3.08	198,660.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD	147,750	1.99	294,022.50	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	52,000	6.18	321,360.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	12,000	46.45	557,400.00	
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	96,000	8.10	777,600.00	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	31,000	16.12	499,720.00	
	CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	11,876	14.56	172,914.56	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	46,000	10.16	467,360.00	

CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	100,000	6.06	606,000.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	52,000	13.36	694,720.00	
CITIC LTD	94,000	13.76	1,293,440.00	
CRRC CORP LTD- H	79,000	9.84	777,360.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	29,000	12.12	351,480.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	12,000	11.40	136,800.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	70,000	4.18	292,600.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	13,000	20.25	263,250.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	19,200	8.38	160,896.00	
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	9,000	47.15	424,350.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	55,000	9.60	528,000.00	
AIR CHINA LTD-H	58,000	6.46	374,680.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	40,000	8.13	325,200.00	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	65,825	3.38	222,488.50	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	21,000	24.70	518,700.00	
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	100,750	2.22	223,665.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	38,000	5.91	224,580.00	
COSCO PACIFIC LTD	32,000	8.75	280,000.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	24,000	10.28	246,720.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	43,000	9.37	402,910.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	64,000	9.98	638,720.00	
BYD CO LTD-H	10,000	43.25	432,500.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B	28,000	17.14	479,920.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	60,000	10.94	656,400.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	100,000	4.25	425,000.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	75,000	9.34	700,500.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	76,318	6.91	527,357.38	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	25,000	21.65	541,250.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	17,000	15.36	261,120.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	13,000	43.95	571,350.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	180,000	1.86	334,800.00	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	103,000	5.88	605,640.00	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	191,160	1.31	250,419.60	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	37,000	15.92	589,040.00	
SUN ART RETAIL GROUP	43,000	5.73	246,390.00	

CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	160,000	2.91	465,600.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	58,000	12.72	737,760.00
IMPERIAL PACIFIC INTERNATIONAL	1,100,000	0.17	192,500.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	38,000	10.96	416,480.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	6,000	34.85	209,100.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	132,000	5.75	759,000.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	15,500	72.85	1,129,175.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	32,000	5.37	171,840.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	13,000	16.56	215,280.00
SINOPHARM GROUP CO-H	26,400	32.20	850,080.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	24,000	11.10	266,400.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	78,000	7.79	607,620.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	32,000	7.93	253,760.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	11,000	22.40	246,400.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	76,000	3.97	301,720.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	102,000	7.00	714,000.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	485,000	3.34	1,619,900.00
BANK OF CHINA LTD - H	1,699,000	3.50	5,946,500.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	216,245	5.61	1,213,134.45
CHINA CITIC BANK - H	206,000	5.08	1,046,480.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,836,920	5.43	9,974,475.60
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	90,000	3.75	337,500.00
CHINA MERCHANTS BANK - H	98,150	18.52	1,817,738.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	131,200	7.84	1,028,608.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	75,000	4.87	365,250.00
IND & COMM BK OF CHINA - H	1,636,575	4.80	7,855,560.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	171,000	2.92	499,320.00
CHINA EVERBRIGHT LTD	18,000	18.08	325,440.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	63,000	7.34	462,420.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	46,000	18.84	866,640.00
FAR EAST HORIZON LTD	40,000	7.09	283,600.00
GF SECURITIES CO LTD-H	15,600	20.05	312,780.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	67,600	14.06	950,456.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	16,000	18.98	303,680.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	159,000	25.95	4,126,050.00

CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	54,600	33.20	1,812,720.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	34,940	24.45	854,283.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO-H	14,000	33.85	473,900.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	163,000	3.99	650,370.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	79,334	16.72	1,326,464.48	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	114,000	44.20	5,038,800.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	110,000	2.62	288,200.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	86,320	26.70	2,304,744.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	53,777	22.00	1,183,094.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	23,360	22.90	534,944.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	100,713	3.12	314,224.56	
DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H	10,700	45.20	483,640.00	
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	96,000	6.50	624,000.00	
GOLDIN PROPERTIES HOLDINGS	26,000	11.98	311,480.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	26,400	9.61	253,704.00	
LONGFOR PROPERTIES	31,000	11.14	345,340.00	
NEW WORLD CHINA LAND LTD	72,000	6.05	435,600.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	37,500	13.92	522,000.00	
SHUI ON LAND LTD	42,900	2.17	93,093.00	
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	65,000	5.08	330,200.00	
SOHO CHINA LTD	65,000	3.73	242,450.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	40,000	5.87	234,800.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	212,800	1.34	285,152.00	
KINGSOFT CORP LTD	16,000	18.40	294,400.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	112,500	151.80	17,077,500.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	20,000	12.08	241,600.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	18,000	50.30	905,400.00	
LENOVO GROUP LTD	154,000	8.13	1,252,020.00	
ZTE CORP-H	21,600	16.74	361,584.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	50,000	5.36	268,000.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	60,000	2.90	174,000.00	
CHINA MOBILE LTD	133,700	88.55	11,839,135.00	
CHINA TELECOM CORP LTD	315,000	3.73	1,174,950.00	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	123,882	9.57	1,185,550.74	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	90,000	5.46	491,400.00	



	CGN POWER CO LTD-H	186,000	2.88	535,680.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	54,000	11.00	594,000.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	48,000	6.03	289,440.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	55,000	4.39	241,450.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	30,000	22.35	670,500.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	47,000	15.30	719,100.00	
	DATANG INTL POWER GEN CO-H	23,000	2.47	56,810.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	12,000	41.15	493,800.00	
	GUANGDONG INVEST	62,000	10.80	669,600.00	
	HUADIAN POWER INTL CORP-H	26,000	5.23	135,980.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	106,000	6.89	730,340.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	64,000	2.31	147,840.00	
	GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	198,000	1.17	231,660.00	
	HANERGY THIN FILM POWER GROU	240,000	3.05	732,000.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	500,000	0.80	400,000.00	
香港ドル小計		17,720,895		138,894,628.37 (2,152,866,739)	
マレーシアリン ギット	BUMI ARMADA BERHAD	60,000	1.04	62,400.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	5,000	24.00	120,000.00	
	SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	70,000	1.81	126,700.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	71,000	7.19	510,490.00	
	DIALOG GROUP BHD	70,000	1.57	109,900.00	
	GAMUDA BHD	56,000	4.63	259,280.00	
	IJM CORP BHD	70,000	3.42	239,400.00	
	SIME DARBY BERHAD	64,720	7.54	487,988.80	
	AIRASIA BHD	47,000	1.29	60,630.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	18,000	5.45	98,100.00	
	MISC BHD	30,000	9.22	276,600.00	
	UMW HOLDINGS BHD	11,700	7.66	89,622.00	
	BERJAYA SPORTS TOTO BERHAD	27,653	3.02	83,512.06	
	GENTING BHD	45,300	7.19	325,707.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	72,500	4.39	318,275.00	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	30,000	2.66	79,800.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	2,500	53.46	133,650.00	
	FELDA GLOBAL VENTURES	43,000	1.72	73,960.00	

	IOI CORPORATION BERHAD	69,675	4.30	299,602.50	
	KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	12,000	23.00	276,000.00	
	PPB GROUP BERHAD	11,700	15.70	183,690.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	54,000	6.40	345,600.00	
	ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	37,000	3.56	131,720.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	32,600	4.35	141,810.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	109,800	4.50	494,100.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	12,300	13.24	162,852.00	
	MALAYAN BANKING BHD	103,150	8.30	856,145.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	55,370	18.38	1,017,700.60	
	RHB CAPITAL BHD	14,000	5.74	80,360.00	
	IOI PROPERTIES GROUP BHD	53,476	2.18	116,577.68	
	AXIATA GROUP BERHAD	51,900	6.30	326,970.00	
	DIGI.COM BHD	74,000	5.30	392,200.00	
	MAXIS BHD	44,000	6.75	297,000.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	25,000	6.71	167,750.00	
	PETRONAS GAS BERHAD	14,000	21.80	305,200.00	
	TENAGA NASIONAL BERHAD	66,125	13.20	872,850.00	
	YTL CORPORATION BERHAD	144,704	1.54	222,844.16	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	73,500	1.48	108,780.00	
	マレーシアリングット小計	1,852,673		10,255,766.80 (286,546,124)	
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	35,000	15.80	553,000.00	
	IRPC PCL - NVDR	191,800	4.40	843,920.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	28,710	61.50	1,765,665.00	
	PTT PCL-NVDR	21,600	250.00	5,400,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	28,000	64.00	1,792,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	39,000	21.30	830,700.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	20,045	52.50	1,052,362.50	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	2,600	452.00	1,175,200.00	
	SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	7,300	456.00	3,328,800.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	8,000	348.00	2,784,000.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	160,000	8.85	1,416,000.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	55,000	35.00	1,925,000.00	
	BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	31,000	30.50	945,500.00	

	CP ALL PCL-NVDR	98,800	41.00	4,050,800.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	70,000	17.60	1,232,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	110,000	21.90	2,409,000.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	8,000	198.00	1,584,000.00	
	BANGKOK BANK-FOREIGN REG	6,640	154.00	1,022,560.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	24,200	152.00	3,678,400.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	13,200	151.50	1,999,800.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	75,125	16.80	1,262,100.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	36,300	120.00	4,356,000.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	400,000	2.44	976,000.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	31,000	45.00	1,395,000.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	12,000	79.75	957,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	20,800	153.50	3,192,800.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	180,000	6.90	1,242,000.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	10,000	76.50	765,000.00	
タイパーツ小計		1,724,120		53,934,607.50 (179,602,242)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	52,000	57.90	3,010,800.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	54,000	16.72	902,880.00	
	DMCI HOLDINGS INC	115,000	14.00	1,610,000.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	50,000	73.50	3,675,000.00	
	SM INVESTMENTS CORP	3,312	865.00	2,864,880.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	10,000	69.75	697,500.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	10,000	220.00	2,200,000.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	21,000	185.90	3,903,900.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	17,741	85.40	1,515,081.40	
	BDO UNIBANK INC	31,000	105.00	3,255,000.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	18,827	79.50	1,496,746.50	
	AYALA CORPORATION	4,942	759.00	3,750,978.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,700	1,345.00	2,286,500.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	320,000	5.24	1,676,800.00	
	AYALA LAND INC	156,960	35.70	5,603,472.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	176,710	22.40	3,958,304.00	
	GLOBE TELECOM INC	630	1,900.00	1,197,000.00	
	PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	2,110	2,076.00	4,380,360.00	

	ABOITIZ POWER CORP	46,000	41.35	1,902,100.00	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	175,000	6.07	1,062,250.00	
フィリピンペソ小計		1,266,932		50,949,551.90	(129,921,357)
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	270,000	500.00	135,000,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	32,000	22,450.00	718,400,000.00	
	SEMEN GRESIK (PERSERO) PT	66,000	11,200.00	739,200,000.00	
	PT UNITED TRACTORS	53,500	15,300.00	818,550,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	495,000	6,000.00	2,970,000,000.00	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	100,000	1,740.00	174,000,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	100,000	3,050.00	305,000,000.00	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	52,000	17,125.00	890,500,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	200,000	2,770.00	554,000,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	15,000	54,150.00	812,250,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	7,600	96,625.00	734,350,000.00	
	PT INDOFOOD SUKSES MAK TBK	136,000	4,955.00	673,880,000.00	
	PT UNILEVER INDONESIA TBK	30,000	36,650.00	1,099,500,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	550,000	1,245.00	684,750,000.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	48,000	3,200.00	153,600,000.00	
	BANK MANDIRI TBK	209,000	8,875.00	1,854,875,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	248,000	11,100.00	2,752,800,000.00	
	PT BANK CENTRAL ASIA	270,000	13,175.00	3,557,250,000.00	
	PT BANK NEGARA INDONESIA	180,000	4,880.00	878,400,000.00	
	LIPPO KARAWACI TBK/PT	450,000	1,035.00	465,750,000.00	
	SUMMARECON AGUNG TBK PT	185,000	1,580.00	292,300,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	1,115,000	3,110.00	3,467,650,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	36,000	5,925.00	213,300,000.00	
XL AXIATA TBK PT	78,000	3,765.00	293,670,000.00		
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	213,500	2,855.00	609,542,500.00		
インドネシアルピア小計		5,139,600		25,848,517,500.00	(227,466,954)
韓国ウォン	GS HOLDINGS	1,270	51,700.00	65,659,000.00	
	S-OIL CORPORATION	825	81,800.00	67,485,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	1,482	135,000.00	200,070,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	2,000	26,950.00	53,900,000.00	

HYOSUNG CORPORATION	550	121,000.00	66,550,000.00	
HYUNDAI STEEL CO	1,830	53,800.00	98,454,000.00	
KOREA ZINC CO LTD	155	477,500.00	74,012,500.00	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	460	54,700.00	25,162,000.00	
LG CHEM LTD	1,002	338,000.00	338,676,000.00	
LG CHEM LTD-PRF	230	250,500.00	57,615,000.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	370	243,500.00	90,095,000.00	
OCI CO LTD	320	79,100.00	25,312,000.00	
POSCO	1,470	177,500.00	260,925,000.00	
CJ CORP	280	249,500.00	69,860,000.00	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	610	68,300.00	41,663,000.00	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	3,686	5,830.00	21,489,380.00	
DAEWOO INTERNATIONAL CORP	1,431	17,350.00	24,827,850.00	
DOOSAN CORP	230	95,700.00	22,011,000.00	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	800	22,850.00	18,280,000.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,203	20,200.00	24,300,600.00	
HANWHA CORPORATION	1,160	40,200.00	46,632,000.00	
HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	1,595	40,250.00	64,198,750.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	1,310	29,650.00	38,841,500.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	895	93,000.00	83,235,000.00	
KCC CORP	120	425,500.00	51,060,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,000	84,000.00	84,000,000.00	
LG CORP	2,000	73,200.00	146,400,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	1,657	145,500.00	241,093,500.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	3,690	10,800.00	39,852,000.00	
SK HOLDINGS CO LTD	831	260,500.00	216,475,500.00	
SK NETWORKS CO LTD	1,950	5,680.00	11,076,000.00	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	450	90,100.00	40,545,000.00	
S1 CORPORATION	420	102,000.00	42,840,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	400	196,000.00	78,400,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	864	28,250.00	24,408,000.00	
HANKOOK TIRE CO LTD	1,482	48,300.00	71,580,600.00	
HANON SYSTEMS	1,080	51,700.00	55,836,000.00	
HYUNDAI MOBIS	1,500	252,500.00	378,750,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	3,430	151,500.00	519,645,000.00	

HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	850	110,000.00	93,500,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	480	108,000.00	51,840,000.00	
HYUNDAI WIA CORP	320	118,500.00	37,920,000.00	
KIA MOTORS CORPORATION	5,640	53,800.00	303,432,000.00	
COWAY CO LTD	1,090	89,700.00	97,773,000.00	
HANSSEM CO LTD	170	225,000.00	38,250,000.00	
LG ELECTRONICS INC	2,085	53,300.00	111,130,500.00	
KANGWON LAND INC	2,770	40,400.00	111,908,000.00	
PARADISE CO LTD	1,050	17,950.00	18,847,500.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	2,350	21,150.00	49,702,500.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	830	82,000.00	68,060,000.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	380	129,500.00	49,210,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	215	244,000.00	52,460,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	167	240,500.00	40,163,500.00	
BGF RETAIL CO LTD	190	164,000.00	31,160,000.00	
E-MART CO LTD	472	198,500.00	93,692,000.00	
GS RETAIL CO LTD	600	52,500.00	31,500,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	194	363,000.00	70,422,000.00	
KT&G CORP	2,295	111,500.00	255,892,500.00	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	25	2,227,000.00	55,675,000.00	
ORION CORP	80	1,167,000.00	93,360,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	730	412,000.00	300,760,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	750	150,000.00	112,500,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	200	1,034,000.00	206,800,000.00	
CELLTRION INC	1,364	78,700.00	107,346,800.00	
HANMI PHARM CO LTD	105	666,000.00	69,930,000.00	
HANMI SCIENCE CO LTD	250	125,000.00	31,250,000.00	
YUHAN CORPORATION	240	267,500.00	64,200,000.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	5,320	8,230.00	43,783,600.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC-RTS	1,164	1,240.00	1,443,360.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	2,586	10,300.00	26,635,800.00	
HANA FINANCIAL GROUP	6,008	24,650.00	148,097,200.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	4,640	13,300.00	61,712,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	8,005	34,050.00	272,570,250.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	9,400	41,150.00	386,810,000.00	

	WOORI BANK	5,411	9,180.00	49,672,980.00	
	DAEWOO SECURITIES CO.	4,575	10,200.00	46,665,000.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	955	52,500.00	50,137,500.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	778	19,650.00	15,287,700.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	3,171	10,700.00	33,929,700.00	
	SAMSUNG CARD CO	690	32,750.00	22,597,500.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,517	43,100.00	65,382,700.00	
	DONGBU INSURANCE CO LTD	800	71,300.00	57,040,000.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	6,000	7,760.00	46,560,000.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	2,000	35,950.00	71,900,000.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	780	318,000.00	248,040,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	1,700	110,000.00	187,000,000.00	
	KAKAO CORP	660	110,600.00	72,996,000.00	
	NAVER CORP	628	647,000.00	406,316,000.00	
	NCSOFT CORPORATION	350	214,000.00	74,900,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	650	252,000.00	163,800,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	5,560	25,200.00	140,112,000.00	
	LG INNOTEK CO LTD	280	99,700.00	27,916,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,330	64,400.00	85,652,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	2,385	1,285,000.00	3,064,725,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	435	1,095,000.00	476,325,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	1,228	114,500.00	140,606,000.00	
	KT CORP	1,027	28,900.00	29,680,300.00	
	LG UPLUS CORP.	5,000	10,600.00	53,000,000.00	
	SK TELECOM	230	233,500.00	53,705,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	5,290	50,300.00	266,087,000.00	
	KOREA GAS CORPORATION	828	38,350.00	31,753,800.00	
	SK HYNIX INC	12,630	31,700.00	400,371,000.00	
	韓国ウォン小計	175,941		13,853,111,870.00 (1,428,255,833)	
台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	21,080	79.90	1,684,292.00	
	ASIA CEMENT CORP	57,978	27.75	1,608,889.50	
	CHINA STEEL CORP	269,181	18.20	4,899,094.20	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	66,047	70.00	4,623,290.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	85,424	73.40	6,270,121.60	

NAN YA PLASTICS CORP	103,145	58.00	5,982,410.00	
TAIWAN CEMENT	76,170	27.95	2,128,951.50	
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	20,000	42.45	849,000.00	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	75,957	26.00	1,974,882.00	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	6,883	130.00	894,790.00	
TECO ELECTRIC & MACHINERY	52,000	26.35	1,370,200.00	
EVA AIRWAYS CORP	41,131	18.50	760,923.50	
EVERGREEN MARINE CORP LTD	45,216	13.25	599,112.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	45,947	53.60	2,462,759.20	
YULON MOTOR COMPANY	35,020	30.75	1,076,865.00	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	3,120	444.00	1,385,280.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	6,180	170.00	1,050,600.00	
GIANT MANUFACTURING	5,000	216.50	1,082,500.00	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	5,250	174.00	913,500.00	
POU CHEN	38,145	43.05	1,642,142.25	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	12,000	63.00	756,000.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	7,000	384.00	2,688,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	12,448	202.00	2,514,496.00	
STANDARD FOODS CORP	7,000	78.90	552,300.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	109,703	55.20	6,055,605.60	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	88,536	15.80	1,398,868.80	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	350,715	8.34	2,924,963.10	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	328,469	16.95	5,567,549.55	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	117,303	19.10	2,240,487.30	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	196,065	15.35	3,009,597.75	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	122,336	15.35	1,877,857.60	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	222,356	21.40	4,758,418.40	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	213,604	9.54	2,037,782.16	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	169,618	11.70	1,984,530.60	
TAIWAN BUSINESS BANK	128,330	8.19	1,051,022.70	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	178,895	13.85	2,477,695.75	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	15,329	56.60	867,621.40	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	137,743	46.95	6,467,033.85	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	217,257	12.05	2,617,946.85	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	185,538	43.70	8,108,010.60	



CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	75,299	26.30	1,980,363.70
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	121,337	7.12	863,919.44
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	14,950	37.00	553,150.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	28,353	43.70	1,239,026.10
ACER INC	64,812	12.15	787,465.80
ADVANTECH CO LTD	6,561	213.00	1,397,493.00
ASUSTEK COMPUTER INC	15,797	278.00	4,391,566.00
AU OPTRONICS CORP	173,994	9.95	1,731,240.30
CASETEK HOLDINGS LTD	3,000	152.00	456,000.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	13,405	290.00	3,887,450.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	13,130	73.30	962,429.00
COMPAL ELECTRONICS	86,955	18.90	1,643,449.50
DELTA ELECTRONICS INC	40,419	156.50	6,325,573.50
DELTA ELECTRONICS INC-RTS(N)	2,122	6.50	13,793.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	23,552	70.50	1,660,416.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	306,150	81.60	24,981,840.00
HTC CORP	17,011	74.20	1,262,216.20
INNOLUX CORP	189,282	10.50	1,987,461.00
INVENTEC CORP	62,162	22.20	1,379,996.40
LARGAN PRECISION CO LTD	2,236	2,270.00	5,075,720.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	45,560	32.40	1,476,144.00
PEGATRON CORP	34,854	77.60	2,704,670.40
QUANTA COMPUTER INC	63,416	53.00	3,361,048.00
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	6,000	109.00	654,000.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	30,591	32.10	981,971.10
WISTRON CORP	48,389	19.20	929,068.80
WPG HOLDINGS LTD	40,000	32.10	1,284,000.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	7,000	78.10	546,700.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	83,371	99.40	8,287,077.40
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	42,000	67.10	2,818,200.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	33,188	98.50	3,269,018.00
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	127,784	38.00	4,855,792.00
HERMES MICROVISION INC	1,000	1,175.00	1,175,000.00
INOTERA MEMORIES INC	45,000	27.30	1,228,500.00
MEDIATEK INC	33,132	254.50	8,432,094.00

	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	12,522	135.50	1,696,731.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	3,000	237.00	711,000.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	11,635	67.60	786,526.00	
	RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	7,791	77.50	603,802.50	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	11,815	79.60	940,474.00	
	SILICONWARE PRECISION INDS	42,082	52.30	2,200,888.60	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	533,355	142.00	75,736,410.00	
	TRANSCEND INFORMATION INC	7,346	86.10	632,490.60	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	238,592	12.30	2,934,681.60	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	22,000	42.80	941,600.00	
台湾ドル小計		6,671,069		294,983,847.70 (1,079,640,882)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	4,400	904.10	3,978,040.00	
	CAIRN INDIA LTD	9,100	138.65	1,261,715.00	
	COAL INDIA LTD	14,000	322.30	4,512,200.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	15,460	233.85	3,615,321.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	28,946	1,000.55	28,961,920.30	
	ACC LIMITED	1,330	1,344.15	1,787,719.50	
	AMBUJA CEMENTS LIMITED	10,970	203.30	2,230,201.00	
	ASIAN PAINTS LTD	5,000	881.80	4,409,000.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	29,280	85.25	2,496,120.00	
	JSW STEEL LIMITED	2,000	1,065.30	2,130,600.00	
	SHREE CEMENT LTD	200	10,926.20	2,185,240.00	
	TATA STEEL LIMITED	5,416	263.35	1,426,303.60	
	ULTRATECH CEMENT LTD	1,150	2,813.25	3,235,237.50	
	UPL LTD	5,900	433.05	2,554,995.00	
	VEDANTA LTD	23,260	91.95	2,138,757.00	
	ADITYA BIRLA NUVO LTD	810	2,040.10	1,652,481.00	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	13,150	172.70	2,271,005.00	
	EICHER MOTORS LTD	280	16,172.15	4,528,202.00	
	LARSEN & TOUBRO LTD	6,980	1,294.50	9,035,610.00	
	SIEMENS INDIA LIMITED	1,890	1,192.80	2,254,392.00	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	15,000	258.10	3,871,500.00	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	1,400	1,306.90	1,829,660.00	
	BAJAJ AUTO LTD	2,400	2,482.90	5,958,960.00	

BHARAT FORGE LIMITED	1,800	860.25	1,548,450.00	
BOSCH LTD	160	18,205.25	2,912,840.00	
HERO MOTOCORP LTD	1,400	2,696.40	3,774,960.00	
MAHINDRA & MAHINDRA LIMITED	7,000	1,257.75	8,804,250.00	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,900	4,598.40	8,736,960.00	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	6,000	292.60	1,755,600.00	
TATA MOTORS LTD	21,628	382.40	8,270,547.20	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	9,630	410.75	3,955,522.50	
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEA	260	6,691.45	1,739,777.00	
ITC LTD	50,510	323.70	16,350,087.00	
NESTLE INDIA LIMITED	560	5,775.90	3,234,504.00	
UNITED BREWERIES LTD	1,800	935.10	1,683,180.00	
UNITED SPIRITS LIMITED	1,330	3,033.20	4,034,156.00	
DABUR INDIA LTD	9,500	276.70	2,628,650.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	3,700	1,278.80	4,731,560.00	
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	15,520	864.25	13,413,160.00	
MARICO LTD	4,300	226.10	972,230.00	
MARICO LTD (N)	4,300	226.10	972,230.00	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	2,300	1,436.85	3,304,755.00	
AUROBINDO PHARMA LTD	7,500	871.50	6,536,250.00	
CIPLA LTD	7,650	648.20	4,958,730.00	
DIVI'S LABORATORIES LTD	1,900	1,166.65	2,216,635.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	2,190	3,010.00	6,591,900.00	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	2,900	927.25	2,689,025.00	
LUPIN LTD	4,130	1,803.90	7,450,107.00	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	2,000	968.90	1,937,800.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	20,804	790.85	16,452,843.40	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	32,575	1,229.55	40,052,591.25	
ICICI BANK LTD	19,325	257.95	4,984,883.75	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	5,800	707.20	4,101,760.00	
LIC HOUSING FINANCE LTD	7,000	485.50	3,398,500.00	
STATE BANK OF INDIA	34,000	228.30	7,762,200.00	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	7,400	241.25	1,785,250.00	
RURAL ELECTRIFICATION CORP	11,000	223.20	2,455,200.00	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	4,000	853.45	3,413,800.00	

	HCL TECHNOLOGIES LTD	11,900	860.30	10,237,570.00	
	INFOSYS LTD	40,140	1,096.35	44,007,489.00	
	TATA CONSULTANCY SVS LTD	10,450	2,434.25	25,437,912.50	
	TECH MAHINDRA LTD	5,200	516.95	2,688,140.00	
	WIPRO LTD	13,640	557.20	7,600,208.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	26,000	338.45	8,799,700.00	
	BHARTI INFRATEL LTD	11,390	414.35	4,719,446.50	
	IDEA CELLULAR LTD	26,000	141.20	3,671,200.00	
	RELIANCE COMMUNICATION LTD	9,055	86.30	781,446.50	
	GAIL INDIA LTD	10,875	362.20	3,938,925.00	
	NTPC LIMITED	20,000	139.30	2,786,000.00	
	TATA POWER CO LTD	29,640	66.40	1,968,096.00	
インドルピー小計		726,384		424,572,207.50	(776,967,139)
カタールリアル	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	5,200	23.25	120,900.00	
	INDUSTRIES QATAR	3,390	104.30	353,577.00	
	COMMERCIAL BANK QSC	3,000	44.50	133,500.00	
	DOHA BANK QSC	2,300	44.10	101,430.00	
	MASRAF AL RAYAN	9,240	37.20	343,728.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	1,670	109.20	182,364.00	
	QATAR NATIONAL BANK	3,930	170.10	668,493.00	
	QATAR INSURANCE CO	1,400	85.40	119,560.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	3,000	39.60	118,800.00	
	EZDAN HOLDING GROUP	11,500	16.20	186,300.00	
	OOREDOO QSC	2,160	71.70	154,872.00	
	VODAFONE QATAR	10,500	12.37	129,885.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	430	209.00	89,870.00	
カタールリアル小計		57,720		2,703,279.00	(89,316,338)
エジプトポンド	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	22,687	36.38	825,353.06	
	T M G HOLDING	23,000	6.45	148,350.00	
	GLOBAL TELECOM HOLDING	60,000	2.12	127,200.00	
エジプトポンド小計		105,687		1,100,903.06	(16,898,861)
南アフリカラン	EXXARO RESOURCES LTD	3,510	45.51	159,740.10	

SASOL LTD	12,300	426.00	5,239,800.00
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	1,660	199.86	331,767.60
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	8,520	112.09	955,006.80
GOLD FIELDS LTD	16,590	44.30	734,937.00
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	11,430	28.83	329,526.90
MONDI LTD	2,730	310.00	846,300.00
SAPPI LIMITED	14,415	65.50	944,182.50
BARLOWORLD LTD	6,500	63.54	413,010.00
BIDVEST GROUP LTD	6,372	342.23	2,180,689.56
STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	47,460	79.01	3,749,814.60
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	10,000	22.97	229,700.00
NASPERS LTD-N SHS	8,760	2,149.00	18,825,240.00
FOSCHINI GROUP LTD/THE	4,175	123.00	513,525.00
IMPERIAL HOLDINGS LTD	3,655	122.61	448,139.55
MR PRICE GROUP LTD	5,300	203.42	1,078,126.00
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	10,620	94.90	1,007,838.00
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	21,405	101.00	2,161,905.00
MASSMART HOLDINGS LTD	2,739	103.20	282,664.80
PICK'N PAY STORES LTD	7,000	66.80	467,600.00
SHOPRITE HOLDINGS LTD	9,710	146.27	1,420,281.70
SPAR GROUP LIMITED/THE	3,360	188.51	633,393.60
PIONEER FOODS LTD	2,700	160.50	433,350.00
TIGER BRANDS LTD	3,490	321.99	1,123,745.10
LIFE HEALTHCARE GROUP	20,000	35.67	713,400.00
MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD	11,600	121.00	1,403,600.00
NETCARE LTD	22,150	34.70	768,605.00
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	7,341	308.00	2,261,028.00
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	6,900	149.00	1,028,100.00
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	800	557.32	445,856.00
NEDBANK GROUP LTD	5,250	194.00	1,018,500.00
STANDARD BANK GROUP LTD	26,116	117.93	3,079,859.88
BRAIT SE	7,000	170.08	1,190,560.00
CORONATION FUND MANAGERS LTD	3,200	54.16	173,312.00
FIRSTRAND LTD	70,870	44.46	3,150,880.20
INVESTEC LTD	6,500	112.98	734,370.00

	PSG GROUP LTD	2,100	228.00	478,800.00	
	REMGRO LTD	10,240	256.98	2,631,475.20	
	RMB HOLDINGS LTD	17,530	59.16	1,037,074.80	
	DISCOVERY LTD	5,907	136.50	806,305.50	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	4,000	114.58	458,320.00	
	MMI HOLDINGS LTD	24,429	22.60	552,095.40	
	RMI HOLDINGS LTD	19,830	39.53	783,879.90	
	SANLAM LTD	37,335	61.30	2,288,635.50	
	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	3,800	101.85	387,030.00	
	NEW EUROPE PROPERTY INVEST	4,700	178.44	838,668.00	
	MTN GROUP LTD	36,215	139.00	5,033,885.00	
	TELKOM SA SOC LTD	3,700	66.30	245,310.00	
	VODACOM GROUP LTD	9,035	153.55	1,387,324.25	
南アフリカランド小計		590,949		77,407,158.44 (609,194,336)	
アラブディルハム	ARABTEC HOLDING CO PJSC	28,350	1.24	35,154.00	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	32,250	6.35	204,787.50	
	DUBAI ISLAMIC BANK	18,000	6.03	108,540.00	
	FIRST GULF BANK	20,192	12.70	256,438.40	
	NATIONAL BANK OF ABU DHABI	19,635	7.90	155,116.50	
	DUBAI FINANCIAL MARKET PJSC	40,000	1.22	48,800.00	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	84,600	2.30	194,580.00	
	EMAAR MALLS GROUP PJSC	36,000	2.75	99,000.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	78,750	5.70	448,875.00	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	31,000	16.00	496,000.00	
アラブディルハム小計		388,777		2,047,291.40 (66,864,537)	
合 計		44,956,360		8,976,747,237 (8,976,747,237)	

(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	31,500	257,985.00	
米ドル小計			31,500	257,985.00 (30,996,897)	
メキシコペソ	投資証券	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	46,000	1,745,700.00	
メキシコペソ小計			46,000	1,745,700.00 (12,167,529)	
トルコリラ	投資証券	EMLAK KONUT GAYRIMEN	58,000	156,020.00	
トルコリラ小計			58,000	156,020.00 (6,431,144)	
南アフリカランド	投資証券	FORTRESS INCOME FUND LTD	12,000	408,600.00	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	41,000	973,750.00	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	91,000	887,250.00	
		RESILIENT REIT LTD	5,400	621,000.00	
南アフリカランド小計			149,400	2,890,600.00 (22,749,022)	
合計				72,344,592 (72,344,592)	

(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 52銘柄	95.7%			7.6%
	投資信託受益証券 1銘柄		4.3%		0.3%
メキシコペソ	株式 27銘柄	96.9%			4.2%
	投資証券 1銘柄			3.1%	0.1%
ブラジルリアル	株式 60銘柄	100.0%			5.1%
チリペソ	株式 17銘柄	100.0%			1.0%
コロンビアペソ	株式 7銘柄	100.0%			0.3%
トルコリラ	株式 18銘柄	94.8%			1.3%
	投資証券 1銘柄			5.2%	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%			0.3%
ポーランドズロチ	株式	22銘柄	100.0%			1.3%
香港ドル	株式	141銘柄	100.0%			23.9%
マレーシアリングギット	株式	38銘柄	100.0%			3.2%
タイバーツ	株式	28銘柄	100.0%			2.0%
フィリピンペソ	株式	20銘柄	100.0%			1.4%
インドネシアルピア	株式	25銘柄	100.0%			2.5%
韓国ウォン	株式	102銘柄	100.0%			15.8%
台湾ドル	株式	85銘柄	100.0%			11.9%
インドルピー	株式	70銘柄	100.0%			8.6%
カタールリアル	株式	13銘柄	100.0%			1.0%
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	49銘柄	96.4%			6.7%
	投資証券	4銘柄			3.6%	0.3%
アラブディルハム	株式	10銘柄	100.0%			0.7%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

## 日本債券インデックスマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

	平成27年 6月25日現在	平成27年12月25日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	25,993,387	63,618,267
国債証券	28,543,593,462	27,962,289,012
地方債証券	2,316,808,764	2,223,902,000
特殊債券	2,586,532,094	2,712,571,932
社債券	2,082,480,000	1,886,387,000



	平成27年 6月25日現在	平成27年12月25日現在
未収入金	23,586,000	23,374,400
未収利息	79,325,536	73,345,777
前払費用	2,057,635	383,625
流動資産合計	35,660,376,878	34,945,872,013
資産合計	35,660,376,878	34,945,872,013
負債の部		
流動負債		
未払解約金	35,550,689	73,923,682
流動負債合計	35,550,689	73,923,682
負債合計	35,550,689	73,923,682
純資産の部		
元本等		
元本	26,957,841,393	25,910,721,706
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,666,984,796	8,961,226,625
元本等合計	35,624,826,189	34,871,948,331
純資産合計	35,624,826,189	34,871,948,331
負債純資産合計	35,660,376,878	34,945,872,013

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	平成27年 6月25日現在	平成27年12月25日現在
1. 期首	平成26年12月26日	平成27年 6月26日
期首元本額	26,674,346,559円	26,957,841,393円
期首からの追加設定元本額	1,061,838,465円	973,306,422円
期首からの一部解約元本額	778,343,631円	2,020,426,109円
元本の内訳		
DCインデックスバランス（株式20）	767,844,931円	793,068,909円

DCインデックスバランス(株式40)	1,039,762,307円	1,025,516,036円
DCインデックスバランス(株式60)	753,197,397円	724,756,688円
DCインデックスバランス(株式80)	134,935,317円	130,264,552円
インデックスファンド日本債券(DC専用)	1,405,361,839円	1,475,972,061円
世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	5,985,533,911円	5,282,447,409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	5,326,730円	4,764,896円
日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(債券資産)	49,382,817円	48,086,515円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	5,937,978円	5,195,490円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	29,527,993円	27,656,918円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	125,033,346円	107,302,846円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	420,995,855円	401,713,927円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	7,191,438,738円	6,586,088,606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)	51,071,530円	45,149,223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)	154,398,875円	146,926,685円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	32,894,752円	31,600,926円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	1,123,443,581円	1,124,195,245円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	1,181,013,631円	1,175,868,980円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	634,107,760円	613,915,533円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	96,577,642円	94,243,799円
インデックスファンド日本債券(1年決算型)	5,579,202,830円	5,865,607,035円
日本債券インデックスファンド(個人型年金向け)	190,851,633円	200,379,427円
計	26,957,841,393円	25,910,721,706円
2. 受益権の総数	26,957,841,393口	25,910,721,706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12月26日 至 平成27年 6月25日	自 平成27年 6月26日 至 平成27年12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27年 6月25日現在	平成27年12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

(平成27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	144,541,166
地方債証券	2,559,000
特殊債券	1,600,931
社債券	509,000
合計	149,210,097

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成27年 6月25日現在		平成27年12月25日現在	
1口当たり純資産額	1.3215円	1口当たり純資産額	1.3459円
(1万口当たり純資産額)	(13,215円)	(1万口当たり純資産額)	(13,459円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第357回利付国債(2年)	60,000,000	60,172,200	
	第101回利付国債(5年)	170,000,000	170,741,504	
	第102回利付国債(5年)	400,000,000	401,353,096	
	第103回利付国債(5年)	90,000,000	90,396,000	
	第104回利付国債(5年)	50,000,000	50,158,500	
	第105回利付国債(5年)	110,000,000	110,421,300	
	第106回利付国債(5年)	310,000,000	311,364,000	
	第107回利付国債(5年)	705,000,000	708,341,700	
	第109回利付国債(5年)	180,000,000	180,498,600	
	第111回利付国債(5年)	40,000,000	40,377,600	
	第112回利付国債(5年)	70,000,000	70,727,300	
	第114回利付国債(5年)	90,000,000	90,784,800	
	第116回利付国債(5年)	110,000,000	110,702,900	
	第117回利付国債(5年)	470,000,000	473,177,200	
	第118回利付国債(5年)	200,000,000	201,388,000	
	第119回利付国債(5年)	100,000,000	100,347,000	
	第120回利付国債(5年)	330,000,000	332,458,500	
	第121回利付国債(5年)	100,000,000	100,372,000	
	第122回利付国債(5年)	300,000,000	301,071,000	
	第123回利付国債(5年)	505,000,000	506,701,850	
	第124回利付国債(5年)	560,000,000	561,876,000	
	第125回利付国債(5年)	325,000,000	326,072,500	
	第1回利付国債(40年)	25,000,000	32,271,000	
	第2回利付国債(40年)	165,000,000	204,433,350	
	第3回利付国債(40年)	50,000,000	61,979,000	
	第4回利付国債(40年)	95,000,000	117,935,850	
	第5回利付国債(40年)	35,000,000	41,492,850	
	第6回利付国債(40年)	55,000,000	63,596,500	
	第7回利付国債(40年)	60,000,000	65,791,800	
	第8回利付国債(40年)	55,000,000	55,209,550	
	第284回利付国債(10年)	462,000,000	469,909,632	
	第285回利付国債(10年)	261,000,000	266,598,450	

第286回利付国債(10年)	186,000,000	191,103,840	
第287回利付国債(10年)	35,000,000	36,011,850	
第288回利付国債(10年)	18,000,000	18,545,760	
第289回利付国債(10年)	199,000,000	205,037,660	
第290回利付国債(10年)	226,000,000	233,157,420	
第291回利付国債(10年)	187,000,000	192,507,150	
第292回利付国債(10年)	306,000,000	317,732,040	
第293回利付国債(10年)	56,000,000	58,514,960	
第294回利付国債(10年)	32,000,000	33,358,080	
第295回利付国債(10年)	13,000,000	13,487,370	
第296回利付国債(10年)	14,000,000	14,578,340	
第297回利付国債(10年)	28,000,000	29,174,880	
第298回利付国債(10年)	191,000,000	198,445,180	
第299回利付国債(10年)	750,000,000	781,537,500	
第300回利付国債(10年)	36,000,000	37,745,640	
第301回利付国債(10年)	223,000,000	234,618,300	
第302回利付国債(10年)	94,000,000	98,571,220	
第303回利付国債(10年)	581,000,000	611,188,760	
第304回利付国債(10年)	60,000,000	62,894,400	
第305回利付国債(10年)	563,000,000	591,741,150	
第306回利付国債(10年)	93,000,000	98,393,070	
第308回利付国債(10年)	140,000,000	147,943,600	
第309回利付国債(10年)	134,000,000	140,405,200	
第310回利付国債(10年)	78,000,000	81,551,340	
第311回利付国債(10年)	23,000,000	23,830,070	
第312回利付国債(10年)	205,000,000	216,805,950	
第313回利付国債(10年)	410,000,000	436,916,500	
第315回利付国債(10年)	65,000,000	69,117,750	
第316回利付国債(10年)	35,000,000	37,026,150	
第317回利付国債(10年)	105,000,000	111,357,750	
第318回利付国債(10年)	185,000,000	195,145,400	
第319回利付国債(10年)	5,000,000	5,314,350	
第320回利付国債(10年)	190,000,000	200,812,900	
第321回利付国債(10年)	175,000,000	185,368,750	
第322回利付国債(10年)	75,000,000	78,978,000	
第323回利付国債(10年)	45,000,000	47,468,250	

第324回利付国債(10年)	25,000,000	26,209,750	
第325回利付国債(10年)	160,000,000	167,931,200	
第326回利付国債(10年)	30,000,000	31,311,900	
第327回利付国債(10年)	65,000,000	68,293,550	
第328回利付国債(10年)	115,000,000	119,250,400	
第329回利付国債(10年)	210,000,000	220,903,200	
第330回利付国債(10年)	210,000,000	221,014,500	
第331回利付国債(10年)	80,000,000	82,971,200	
第333回利付国債(10年)	110,000,000	114,065,600	
第334回利付国債(10年)	120,000,000	124,362,000	
第335回利付国債(10年)	130,000,000	133,573,700	
第337回利付国債(10年)	30,000,000	30,277,800	
第338回利付国債(10年)	90,000,000	91,504,800	
第339回利付国債(10年)	250,000,000	253,822,500	
第340回利付国債(10年)	80,000,000	81,100,800	
第14回利付国債(30年)	208,000,000	261,549,600	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	187,220,670	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	44,581,250	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	136,016,100	
第21回利付国債(30年)	20,000,000	24,657,200	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	69,851,100	
第24回利付国債(30年)	158,000,000	200,754,800	
第25回利付国債(30年)	20,000,000	24,679,000	
第26回利付国債(30年)	30,000,000	37,582,800	
第27回利付国債(30年)	29,000,000	36,928,600	
第28回利付国債(30年)	14,000,000	17,883,040	
第29回利付国債(30年)	276,000,000	347,873,160	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	182,669,550	
第31回利付国債(30年)	120,000,000	146,768,400	
第32回利付国債(30年)	40,000,000	49,799,200	
第33回利付国債(30年)	50,000,000	59,092,000	
第34回利付国債(30年)	160,000,000	196,104,000	
第35回利付国債(30年)	120,000,000	141,796,800	
第36回利付国債(30年)	230,000,000	271,574,800	
第37回利付国債(30年)	70,000,000	81,063,500	
第38回利付国債(30年)	30,000,000	34,007,400	

第39回利付国債(30年)	75,000,000	86,743,500	
第40回利付国債(30年)	90,000,000	101,869,200	
第42回利付国債(30年)	65,000,000	72,003,100	
第43回利付国債(30年)	195,000,000	215,919,600	
第44回利付国債(30年)	40,000,000	44,272,400	
第45回利付国債(30年)	15,000,000	15,865,050	
第46回利付国債(30年)	135,000,000	142,527,600	
第47回利付国債(30年)	115,000,000	124,203,450	
第48回利付国債(30年)	105,000,000	108,178,350	
第34回利付国債(20年)	85,000,000	88,689,000	
第37回利付国債(20年)	63,000,000	66,422,160	
第39回利付国債(20年)	86,000,000	91,028,420	
第41回利付国債(20年)	27,000,000	28,318,410	
第42回利付国債(20年)	178,000,000	193,003,620	
第43回利付国債(20年)	73,000,000	80,887,650	
第44回利付国債(20年)	51,000,000	56,335,110	
第47回利付国債(20年)	21,000,000	23,151,660	
第48回利付国債(20年)	99,000,000	111,126,510	
第49回利付国債(20年)	57,000,000	63,157,710	
第50回利付国債(20年)	237,000,000	260,128,830	
第51回利付国債(20年)	39,000,000	43,188,990	
第54回利付国債(20年)	15,000,000	16,931,250	
第55回利付国債(20年)	66,000,000	74,009,100	
第57回利付国債(20年)	52,000,000	58,207,760	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	151,690,050	
第59回利付国債(20年)	33,000,000	36,733,620	
第60回利付国債(20年)	545,000,000	595,314,400	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	28,783,350	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	34,935,450	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	61,405,020	
第65回利付国債(20年)	100,000,000	114,016,000	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	38,496,840	
第67回利付国債(20年)	34,000,000	38,863,700	
第68回利付国債(20年)	78,000,000	91,060,320	
第70回利付国債(20年)	104,000,000	123,528,080	
第72回利付国債(20年)	112,000,000	130,586,400	



第73回利付国債（20年）	113,000,000	131,164,750	
第74回利付国債（20年）	118,000,000	138,010,440	
第75回利付国債（20年）	50,000,000	58,602,000	
第76回利付国債（20年）	21,000,000	24,232,530	
第77回利付国債（20年）	40,000,000	46,519,200	
第79回利付国債（20年）	160,000,000	186,430,400	
第82回利付国債（20年）	60,000,000	70,639,800	
第87回利付国債（20年）	170,000,000	202,736,900	
第88回利付国債（20年）	260,000,000	313,440,400	
第90回利付国債（20年）	156,000,000	186,897,360	
第91回利付国債（20年）	260,000,000	314,199,600	
第92回利付国債（20年）	60,000,000	71,399,400	
第94回利付国債（20年）	50,000,000	59,608,500	
第95回利付国債（20年）	32,000,000	38,947,520	
第96回利付国債（20年）	98,000,000	117,046,300	
第97回利付国債（20年）	45,000,000	54,346,050	
第98回利付国債（20年）	94,000,000	112,465,360	
第99回利付国債（20年）	117,000,000	140,210,460	
第100回利付国債（20年）	30,000,000	36,355,500	
第101回利付国債（20年）	66,000,000	81,570,720	
第102回利付国債（20年）	81,000,000	100,306,350	
第103回利付国債（20年）	11,000,000	13,483,140	
第104回利付国債（20年）	33,000,000	39,665,010	
第105回利付国債（20年）	77,000,000	92,626,380	
第106回利付国債（20年）	2,000,000	2,431,520	
第107回利付国債（20年）	130,000,000	156,679,900	
第108回利付国債（20年）	134,000,000	158,110,620	
第109回利付国債（20年）	27,000,000	31,885,650	
第110回利付国債（20年）	98,000,000	118,252,680	
第111回利付国債（20年）	25,000,000	30,519,000	
第113回利付国債（20年）	240,000,000	290,066,400	
第114回利付国債（20年）	52,000,000	62,909,080	
第115回利付国債（20年）	20,000,000	24,457,200	
第116回利付国債（20年）	145,000,000	177,375,600	
第117回利付国債（20年）	30,000,000	36,300,900	
第118回利付国債（20年）	10,000,000	11,968,000	

第119回利付国債(20年)	30,000,000	35,074,500	
第120回利付国債(20年)	70,000,000	79,853,900	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	26,028,200	
第122回利付国債(20年)	50,000,000	58,434,500	
第123回利付国債(20年)	25,000,000	30,298,250	
第124回利付国債(20年)	80,000,000	95,784,000	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	61,372,000	
第126回利付国債(20年)	25,000,000	29,944,250	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	76,909,950	
第129回利付国債(20年)	115,000,000	134,348,750	
第130回利付国債(20年)	80,000,000	93,459,200	
第131回利付国債(20年)	55,000,000	63,420,500	
第132回利付国債(20年)	90,000,000	103,676,400	
第133回利付国債(20年)	30,000,000	35,018,100	
第134回利付国債(20年)	30,000,000	34,985,700	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	34,521,000	
第136回利付国債(20年)	180,000,000	204,492,600	
第137回利付国債(20年)	220,000,000	253,055,000	
第138回利付国債(20年)	50,000,000	55,949,500	
第140回利付国債(20年)	280,000,000	321,921,600	
第141回利付国債(20年)	155,000,000	177,977,200	
第142回利付国債(20年)	55,000,000	64,033,200	
第143回利付国債(20年)	115,000,000	130,007,500	
第144回利付国債(20年)	40,000,000	44,575,200	
第145回利付国債(20年)	125,000,000	143,123,750	
第146回利付国債(20年)	75,000,000	85,745,250	
第147回利付国債(20年)	60,000,000	67,489,800	
第148回利付国債(20年)	120,000,000	132,724,800	
第149回利付国債(20年)	215,000,000	237,312,700	
第150回利付国債(20年)	90,000,000	97,602,300	
第151回利付国債(20年)	150,000,000	157,038,000	
第152回利付国債(20年)	160,000,000	167,043,200	
第153回利付国債(20年)	120,000,000	127,005,600	
第154回利付国債(20年)	120,000,000	124,466,400	
国債証券 合計	25,636,000,000	27,962,289,012	
地方債証券	第682回東京都公募公債	100,000,000	105,227,000

	第708回東京都公募公債	100,000,000	104,921,000	
	第731回東京都公募公債	100,000,000	102,980,000	
	第1回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	118,666,000	
	平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	209,964,000	
	平成19年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	102,689,000	
	平成19年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	102,427,000	
	平成21年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	104,848,000	
	平成26年度第3回広島県公募公債	100,000,000	101,827,000	
	平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	105,779,000	
	平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	104,569,000	
	平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	103,737,000	
	第10回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	103,381,000	
	第55回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,236,000	
	第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,125,000	
	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	104,378,000	
	平成26年度第1回栃木県公募公債	100,000,000	101,255,000	
	第4回京都市公募公債（20年）	100,000,000	121,337,000	
	平成23年度第14回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	114,125,000	
	平成23年度第2回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	105,431,000	
	地方債証券 合計	2,100,000,000	2,223,902,000	
特殊債券	第1回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	104,337,000	
	第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	105,159,000	
	第5回新関西国際空港株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,414,000	
	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,894,000	
	第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,306,000	
	第6回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,355,000	
	第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,748,000	
	第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,496,000	
	第21回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,232,000	
	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,750,000	
	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,728,932	
	第31回株式会社日本政策投資銀行無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	103,793,000	
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	118,500,000	
	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	108,330,000	
	第135回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,691,000	

	第139回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,143,000	
	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	203,178,000	
	第1回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	117,356,000	
	第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	103,722,000	
	第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,851,000	
	第29回国際協力銀行債券	200,000,000	205,810,000	
	い第745号農林債	100,000,000	100,233,000	
	第267回信金中金債(5年)	100,000,000	100,336,000	
	第272回信金中金債(5年)	100,000,000	100,209,000	
特殊債券 合計		2,600,000,000	2,712,571,932	
社債券	第324回東京交通債券	100,000,000	103,686,000	
	第9回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債(2012)	100,000,000	101,212,000	
	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	105,326,000	
	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	103,958,000	
	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	100,462,000	
	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	101,252,000	
	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	102,040,000	
	第18回株式会社ニコン無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,741,000	
	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	200,364,000	
	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	115,036,000	
	第83回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	111,225,000	
	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	106,469,000	
	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	116,675,000	
	第540回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,260,000	
	第299回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,047,000	
第281回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,329,000		
第19回沖縄電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,305,000		

社債券 合計	1,800,000,000	1,886,387,000	
合計	32,136,000,000	34,785,149,944	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

	平成27年 6月25日現在	平成27年12月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	98,383,079	225,597,605
コール・ローン	226,032,172	105,408,926
国債証券	197,188,569,199	175,645,985,869
派生商品評価勘定	758,248	1,149,728
未収入金	262,020,131	82,536,461
未収利息	2,173,623,403	1,831,244,824
前払費用	42,471,746	34,224,406
流動資産合計	199,991,857,978	177,926,147,819
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	482,053	-
未払解約金	495,410,485	165,497,517
流動負債合計	495,892,538	165,497,517
<b>負債合計</b>		
495,892,538		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	84,243,222,131	77,403,768,367
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	115,252,743,309	100,356,881,935
元本等合計	199,495,965,440	177,760,650,302
<b>純資産合計</b>		
199,495,965,440		
<b>負債純資産合計</b>		
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27年 6月25日現在	平成27年12月25日現在
1.	期首	平成26年12月26日	平成27年 6月26日
	期首元本額	89,403,370,318円	84,243,222,131円
	期首からの追加設定元本額	783,906,834円	712,448,091円
	期首からの一部解約元本額	5,944,055,021円	7,551,901,855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）	10,643,658,653円	10,795,115,102円
	DCインデックスバランス（株式20）	65,973,309円	70,327,310円
	DCインデックスバランス（株式40）	128,565,653円	130,692,981円
	DCインデックスバランス（株式60）	167,700,926円	166,137,422円
	DCインデックスバランス（株式80）	150,708,288円	149,621,451円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	27,020,165,302円	24,036,096,448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	3,344,409,935円	3,034,168,879円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	32,384,808,220円	29,650,065,091円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	26,816,505円	24,357,275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）	1,047,412,737円	1,005,537,340円
財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	129,506,303円	159,937,721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）	19,015,096円	18,727,506円	

アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	3,330,153円	2,999,151円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	3,306,878円	3,185,679円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	7,770,441円	6,919,884円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	18,098,352円	17,770,286円
世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	865,919,404円	856,624,652円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,342,938,834円	1,261,022,867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）	39,865,143円	36,294,675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）	98,384,123円	96,422,061円
グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	41,964,866円	40,923,772円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	48,173,396円	49,535,844円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	73,887,764円	74,781,080円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	70,962,504円	70,267,843円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	53,875,802円	54,176,464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	6,201,878,828円	5,354,843,920円
海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	244,124,716円	237,215,663円
計	84,243,222,131円	77,403,768,367円
2. 受益権の総数	84,243,222,131口	77,403,768,367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12月26日 至 平成27年 6月25日	自 平成27年 6月26日 至 平成27年12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27年 6月25日現在	平成27年12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

(平成27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	2,006,158,031
合計	2,006,158,031

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(平成27年 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

(平成27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	158,237,248	-	157,087,520	1,149,728
	米ドル	48,480,000	-	48,056,000	424,000
	メキシコペソ	74,838,760	-	74,304,960	533,800
	ユーロ	34,918,488	-	34,726,560	191,928
合計		158,237,248	-	157,087,520	1,149,728

(注) 1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成27年 6月25日現在		平成27年12月25日現在	
1口当たり純資産額	2.3681円	1口当たり純資産額	2.2965円
(1万口当たり純資産額)	(23,681円)	(1万口当たり純資産額)	(22,965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-2.75%-16/11/30	7,000,000.00	7,129,062.50	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/12/31	8,700,000.00	8,916,820.31	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/01/31	9,000,000.00	9,227,109.37	
		US TREASURY N/B-4.625%-17/02/15	9,250,000.00	9,640,957.03	
		US TREASURY N/B-3.0%-17/02/28	5,400,000.00	5,534,156.25	
		US TREASURY N/B-3.25%-17/03/31	8,800,000.00	9,057,125.00	
		US TREASURY N/B-1.0%-17/03/31	5,500,000.00	5,509,023.43	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/04/30	7,000,000.00	7,206,171.87	
		US TREASURY N/B-4.5%-17/05/15	8,800,000.00	9,232,437.50	
		US TREASURY N/B-8.75%-17/05/15	8,000,000.00	8,864,375.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-17/05/31	8,800,000.00	9,026,875.00	

US TREASURY N/B-0.625%-17/05/31	5,000,000.00	4,978,515.62	
US TREASURY N/B-2.5%-17/06/30	4,000,000.00	4,090,937.50	
US TREASURY N/B-0.75%-17/06/30	5,000,000.00	4,984,375.00	
US TREASURY N/B-0.875%-17/07/15	2,200,000.00	2,196,734.37	
US TREASURY N/B-2.375%-17/07/31	1,020,000.00	1,042,471.87	
US TREASURY N/B-4.75%-17/08/15	8,600,000.00	9,133,468.75	
US TREASURY N/B-1.875%-17/08/31	2,000,000.00	2,028,750.00	
US TREASURY N/B-1.0%-17/09/15	4,900,000.00	4,898,468.75	
US TREASURY N/B-1.875%-17/09/30	7,000,000.00	7,100,625.00	
US TREASURY N/B-1.875%-17/10/31	2,500,000.00	2,538,085.93	
US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	6,800,000.00	7,204,812.50	
US TREASURY N/B-2.25%-17/11/30	3,500,000.00	3,579,296.87	
US TREASURY N/B-1.0%-17/12/15	5,200,000.00	5,194,312.50	
US TREASURY N/B-2.75%-17/12/31	6,170,000.00	6,374,863.28	
US TREASURY N/B-2.625%-18/01/31	4,000,000.00	4,124,375.00	
US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	7,950,000.00	8,353,710.93	
US TREASURY N/B-2.75%-18/02/28	7,400,000.00	7,657,843.75	
US TREASURY N/B-2.875%-18/03/31	2,500,000.00	2,596,289.06	
US TREASURY N/B-0.625%-18/04/30	3,000,000.00	2,961,796.87	
US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	7,550,000.00	8,040,750.00	
US TREASURY N/B-2.375%-18/06/30	7,000,000.00	7,208,906.25	
US TREASURY N/B-2.25%-18/07/31	8,340,000.00	8,562,182.81	
US TREASURY N/B-1.375%-18/07/31	2,500,000.00	2,510,351.56	
US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	8,850,000.00	9,505,453.12	
US TREASURY N/B-1.75%-18/10/31	3,000,000.00	3,040,312.50	
US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	9,400,000.00	10,066,078.12	
US TREASURY N/B-1.5%-18/12/31	8,950,000.00	8,987,757.81	
US TREASURY N/B-8.875%-19/02/15	4,850,000.00	5,976,867.18	
US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	5,400,000.00	5,631,609.37	
US TREASURY N/B-1.375%-19/02/28	3,000,000.00	2,997,421.87	
US TREASURY N/B-1.5%-19/02/28	4,000,000.00	4,012,187.50	
US TREASURY N/B-1.625%-19/03/31	2,000,000.00	2,012,656.25	
US TREASURY N/B-1.625%-19/04/30	5,000,000.00	5,029,296.87	
US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	4,400,000.00	4,647,500.00	
US TREASURY N/B-1.5%-19/05/31	4,100,000.00	4,104,484.37	

US TREASURY N/B-1.625%-19/06/30	1,090,000.00	1,095,279.68	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	4,320,000.00	4,644,675.00	
US TREASURY N/B-8.125%-19/08/15	4,260,000.00	5,262,431.25	
US TREASURY N/B-1.0%-19/08/31	3,300,000.00	3,237,867.18	
US TREASURY N/B-1.625%-19/08/31	3,600,000.00	3,614,062.50	
US TREASURY N/B-1.75%-19/09/30	8,000,000.00	8,060,000.00	
US TREASURY N/B-1.5%-19/10/31	4,100,000.00	4,090,390.62	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	11,870,000.00	12,696,263.28	
US TREASURY N/B-1.625%-19/12/31	1,800,000.00	1,802,390.62	
US TREASURY N/B-1.25%-20/01/31	4,000,000.00	3,942,500.00	
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	13,300,000.00	14,373,351.56	
US TREASURY N/B-1.375%-20/03/31	1,100,000.00	1,087,367.18	
US TREASURY N/B-1.375%-20/04/30	1,750,000.00	1,728,945.31	
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	9,500,000.00	10,232,539.06	
US TREASURY N/B-1.375%-20/05/31	440,000.00	434,293.75	
US TREASURY N/B-1.625%-20/06/30	4,000,000.00	3,988,125.00	
US TREASURY N/B-2.0%-20/07/31	9,300,000.00	9,421,335.93	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	7,950,000.00	10,439,343.75	
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	5,000,000.00	5,202,343.75	
US TREASURY N/B-1.375%-20/08/31	300,000.00	295,734.37	
US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	3,500,000.00	3,641,367.18	
US TREASURY N/B-2.375%-20/12/31	3,000,000.00	3,089,296.87	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	13,140,000.00	14,306,175.00	
US TREASURY N/B-2.25%-21/04/30	4,800,000.00	4,903,875.00	
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	5,320,000.00	5,666,215.62	
US TREASURY N/B-2.125%-21/06/30	6,400,000.00	6,491,000.00	
US TREASURY N/B-2.25%-21/07/31	3,000,000.00	3,060,937.50	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	3,900,000.00	3,952,406.25	
US TREASURY N/B-2.125%-21/09/30	500,000.00	506,171.87	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	11,680,000.00	15,632,950.00	
US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	4,000,000.00	4,017,500.00	
US TREASURY N/B-2.125%-21/12/31	4,800,000.00	4,848,000.00	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,500,000.00	2,507,812.50	
US TREASURY N/B-1.75%-22/02/28	2,900,000.00	2,862,164.06	
US TREASURY N/B-1.75%-22/04/30	3,000,000.00	2,956,406.25	

US TREASURY N/B-1.875%-22/05/31	2,000,000.00	1,984,218.75
US TREASURY N/B-2.125%-22/06/30	2,500,000.00	2,517,773.43
US TREASURY N/B-2.0%-22/07/31	5,300,000.00	5,294,617.18
US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	3,000,000.00	2,966,953.12
US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	1,000,000.00	972,578.12
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	9,300,000.00	9,264,398.43
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	8,500,000.00	8,295,468.75
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,500,000.00	5,652,968.75
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	2,000,000.00	2,091,406.25
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	2,900,000.00	3,028,460.93
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	4,000,000.00	4,097,500.00
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,679,915.62
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	3,250,000.00	3,256,093.75
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	3,850,000.00	3,771,195.31
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	4,744,875.00
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	600,000.00	586,406.25
US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,700,000.00	3,790,335.93
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	2,920,000.00	4,056,062.50
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,000,000.00	1,311,093.75
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	2,600,000.00	3,789,093.75
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	3,500,000.00	4,772,031.25
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	1,900,000.00	2,626,007.81
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	1,370,000.00	1,743,432.03
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	2,200,000.00	2,850,890.62
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	2,800,000.00	3,488,406.25
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,820,000.00	2,348,937.50
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	2,750,000.00	3,487,558.59
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	3,470,000.00	4,557,357.03
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	3,170,000.00	4,020,451.56
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	3,180,000.00	3,749,667.18
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	3,000,000.00	3,740,625.00
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,600,000.00	2,145,000.00
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	4,000,000.00	5,088,125.00
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	4,400,000.00	5,100,562.50
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	500,000.00	481,093.75

		US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	2,069,531.25	
		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	5,800,000.00	5,712,546.87	
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	5,350,000.00	6,084,789.06	
		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	4,500,000.00	5,234,414.06	
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	3,000,000.00	3,408,984.37	
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,500,000.00	2,709,570.31	
		US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	5,900,000.00	6,089,445.31	
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	3,300,000.00	3,321,140.62	
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	2,991,914.06	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	3,200,000.00	3,217,500.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	5,300,000.00	5,201,453.12	
米ドル小計			590,900,000.00	629,202,030.95	(75,598,624,018)
加ドル	国債証券	CANADA GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	280,000.00	333,981.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-17/02/01	1,570,000.00	1,587,364.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-17/03/01	1,380,000.00	1,396,284.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-17/05/01	800,000.00	797,464.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-17/06/01	2,130,000.00	2,235,626.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-17/08/01	1,530,000.00	1,548,375.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-17/09/01	1,000,000.00	1,016,770.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-17/11/01	560,000.00	557,536.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/02/01	350,000.00	355,547.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/03/01	1,420,000.00	1,443,373.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	1,520,000.00	1,656,724.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/09/01	650,000.00	662,798.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/03/01	1,050,000.00	1,089,910.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	2,000,000.00	2,215,140.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/09/01	650,000.00	677,306.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-20/03/01	1,170,000.00	1,211,991.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	1,630,000.00	1,831,973.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-20/09/01	600,000.00	600,900.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/03/01	200,000.00	199,200.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	1,150,000.00	1,296,349.00	
CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	1,300,000.00	1,439,516.00			
CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,380,000.00	1,413,175.20			

		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,420,000.00	1,559,770.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	1,220,000.00	1,313,574.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	400,000.00	399,472.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	530,000.00	883,234.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	1,120,000.00	1,650,017.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	1,310,000.00	2,028,613.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	1,350,000.00	2,016,967.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	1,550,000.00	2,109,813.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,620,000.00	2,106,000.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	610,000.00	693,618.80	
	加ドル小計		35,450,000.00	40,328,388.40 (3,505,343,519)	
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%- 16/12/15	13,300,000.00	13,774,012.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-17/06/15	11,500,000.00	11,677,215.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 17/12/14	17,000,000.00	18,204,110.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-4.75%- 18/06/14	18,000,000.00	18,102,060.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-18/12/13	21,400,000.00	23,594,463.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11	2,000,000.00	1,985,890.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	23,800,000.00	26,272,106.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	14,100,000.00	14,648,631.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	5,000,000.00	5,173,825.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	8,200,000.00	9,222,786.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	25,500,000.00	32,403,360.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	1,000,000.00	963,400.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	6,000,000.00	6,546,600.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	15,900,000.00	18,744,192.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	11,200,000.00	12,398,848.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	2,800,000.00	3,086,846.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	9,400,000.00	12,707,719.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	13,100,000.00	15,554,088.50	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	11,000,000.00	12,105,005.00	
メキシコペソ小計			230,200,000.00	257,165,156.50 (1,792,441,140)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.0%-17/03/28	1,250,000.00	1,321,903.00	
		BELGIUM KINGDOM-3.5%-17/06/28	410,000.00	434,574.41	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-17/09/28	1,590,000.00	1,752,291.30	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-18/03/28	1,830,000.00	2,014,647.00	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-18/06/22	320,000.00	332,176.00	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	1,700,000.00	1,937,915.00	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-19/09/28	630,000.00	704,749.50	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	2,140,000.00	2,522,739.00	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	1,760,000.00	2,173,248.00	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	1,580,000.00	1,948,061.00	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,500,000.00	1,890,675.00	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	1,040,000.00	1,170,832.00	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	1,100,000.00	1,270,500.00	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	880,000.00	869,220.00	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	1,220,000.00	1,637,237.43	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,870,000.00	2,764,020.82	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	450,000.00	412,295.89	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	860,000.00	1,153,892.53	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	650,000.00	780,475.34	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,900,000.00	2,913,440.24	
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	460,000.00	458,185.52	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,650,000.00	2,427,843.49	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	740,000.00	1,026,582.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 17/01/31	2,250,000.00	2,348,933.85	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.1%- 17/04/30	1,900,000.00	1,953,772.85	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 17/07/30	2,310,000.00	2,508,009.96	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%- 17/10/31	1,400,000.00	1,409,382.38	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.5%- 18/01/31	1,900,000.00	2,078,125.00	



BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%- 18/04/30	400,000.00	399,380.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%- 18/07/30	3,180,000.00	3,503,724.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.75%- 18/10/31	1,600,000.00	1,757,884.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 19/04/30	1,760,000.00	1,895,608.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%- 19/07/30	2,620,000.00	3,008,939.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%- 19/10/31	2,630,000.00	3,008,851.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 20/01/31	1,020,000.00	1,049,325.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%- 20/04/30	2,900,000.00	3,308,175.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.15%- 20/07/30	1,100,000.00	1,115,785.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%- 20/10/31	1,890,000.00	2,252,785.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	2,440,000.00	3,022,062.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	2,060,000.00	2,636,180.96	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%- 23/01/31	1,840,000.00	2,336,984.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	1,310,000.00	1,585,296.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	1,940,000.00	2,410,450.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	2,240,000.00	2,606,464.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	2,000,000.00	2,159,100.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	1,860,000.00	1,827,171.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,650,000.00	2,058,870.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	1,600,000.00	1,637,600.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,560,000.00	2,151,240.00	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,320,000.00	1,743,786.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	2,220,000.00	3,157,173.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,050,000.00	991,777.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,710,000.00	2,476,422.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,690,000.00	2,062,729.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,430,000.00	1,942,147.06	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,400,000.00	1,848,035.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	1,040,000.00	1,480,668.38	
BUNDESobligation-1.0%-18/10/12	2,100,000.00	2,176,614.93	
BUNDESobligation-1.0%-19/02/22	1,320,000.00	1,372,579.95	
BUNDESobligation-0.25%-20/10/16	1,000,000.00	1,013,233.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 17/01/04	5,450,000.00	5,679,578.52	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 17/07/04	5,650,000.00	6,039,316.64	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 18/01/04	4,240,000.00	4,610,470.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 18/07/04	3,200,000.00	3,567,360.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 19/01/04	2,770,000.00	3,105,931.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%- 19/07/04	4,100,000.00	4,646,735.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 20/01/04	3,700,000.00	4,215,040.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%- 20/07/04	3,630,000.00	4,144,371.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 20/09/04	2,150,000.00	2,387,360.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 21/01/04	1,800,000.00	2,030,819.94	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	3,700,000.00	4,353,697.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%-	1,700,000.00	1,913,860.00	

21/09/04			
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	2,000,000.00	2,231,133.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 22/07/04	2,470,000.00	2,727,013.38	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	1,950,000.00	2,122,444.93	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	1,900,000.00	2,070,113.26	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	1,820,000.00	1,984,012.39	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	1,850,000.00	2,088,804.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	1,910,000.00	2,796,096.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	1,100,000.00	1,221,916.62	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	1,400,000.00	1,526,536.61	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	1,100,000.00	1,150,325.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	1,000,000.00	994,900.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	440,000.00	455,730.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,350,000.00	2,202,963.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,540,000.00	2,385,499.11	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	1,190,000.00	1,735,317.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	1,070,000.00	1,812,312.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,590,000.00	2,566,379.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	2,130,000.00	3,373,121.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	2,090,000.00	3,112,428.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,540,000.00	2,433,700.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-	1,650,000.00	2,809,001.25	

40/07/04			
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	1,500,000.00	2,116,312.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,450,000.00	1,820,402.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	1,300,000.00	1,633,807.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 17/02/01	3,730,000.00	3,893,522.08	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 17/05/01	1,700,000.00	1,807,554.58	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 17/06/01	1,700,000.00	1,814,841.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 17/08/01	3,600,000.00	3,906,552.96	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 17/11/01	1,700,000.00	1,812,030.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.75%- 18/01/15	850,000.00	860,965.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/02/01	4,090,000.00	4,483,049.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%- 18/05/15	950,000.00	950,665.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/06/01	1,000,000.00	1,083,250.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/08/01	2,880,000.00	3,212,784.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/12/01	2,150,000.00	2,359,517.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/02/01	2,660,000.00	2,991,702.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 19/03/01	2,720,000.00	3,087,744.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 19/05/01	1,400,000.00	1,500,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 19/08/01	730,000.00	757,229.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/09/01	3,490,000.00	3,982,264.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.05%- 19/12/01	1,100,000.00	1,121,395.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-	2,800,000.00	3,257,520.00	

20/02/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 20/03/01	3,000,000.00	3,466,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	2,950,000.00	3,408,577.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	2,100,000.00	2,416,890.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/05/01	1,200,000.00	1,383,180.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	3,670,000.00	4,239,767.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 21/09/01	3,740,000.00	4,532,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 21/12/15	230,000.00	244,892.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	2,400,000.00	2,971,320.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 22/04/15	220,000.00	223,201.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,900,000.00	2,431,335.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 22/09/15	500,000.00	507,650.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	2,000,000.00	2,563,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	500,000.00	611,875.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,300,000.00	1,620,255.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	3,660,000.00	5,739,246.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,650,000.00	2,032,965.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,500,000.00	1,764,225.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,300,000.00	1,395,355.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	3,400,000.00	4,381,920.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	400,000.00	502,940.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-	2,400,000.00	3,687,120.00	

26/11/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	3,590,000.00	5,338,689.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	400,000.00	521,080.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	4,530,000.00	6,233,053.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	620,000.00	728,337.56	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	3,790,000.00	5,705,769.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	250,000.00	232,571.42	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,900,000.00	2,844,314.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	2,080,000.00	2,911,893.08	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	2,990,000.00	3,729,383.04	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,770,000.00	2,531,373.64	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	2,510,000.00	3,585,401.71	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,720,000.00	2,433,965.12	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,240,000.00	1,390,689.38	
FINNISH GOVERNMENT-1.875%-17/04/15	50,000.00	51,523.62	
FINNISH GOVERNMENT-3.875%-17/09/15	880,000.00	943,624.00	
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-18/09/15	210,000.00	217,906.50	
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	760,000.00	881,153.34	
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	920,000.00	1,056,896.00	
FINNISH GOVERNMENT-0.375%-20/09/15	130,000.00	131,969.50	
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	840,000.00	992,376.00	
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	300,000.00	325,395.00	
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	620,000.00	665,198.00	
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	510,000.00	566,100.00	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	590,000.00	760,348.87	
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	160,000.00	159,688.00	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	500,000.00	595,358.45	

FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	310,000.00	284,373.50	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	410,000.00	508,296.59	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-17/04/25	5,770,000.00	6,097,678.87	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-17/10/25	4,120,000.00	4,474,819.34	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-18/04/25	3,850,000.00	4,245,972.50	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-18/05/25	3,000,000.00	3,088,650.00	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-18/10/25	2,300,000.00	2,598,655.00	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-18/11/25	850,000.00	879,155.00	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25	4,740,000.00	5,443,810.84	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-19/05/25	1,370,000.00	1,421,512.00	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-19/10/25	1,050,000.00	1,393,845.70	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	4,400,000.00	5,054,940.00	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-19/11/25	1,000,000.00	1,020,000.00	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	4,180,000.00	4,819,958.00	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-20/05/25	1,600,000.00	1,593,840.00	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	4,190,000.00	4,678,763.50	
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-20/11/25	2,850,000.00	2,863,395.00	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	4,170,000.00	4,972,725.00	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	4,340,000.00	5,101,019.00	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	3,770,000.00	4,406,564.50	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	2,280,000.00	2,562,606.00	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	1,440,000.00	2,269,566.14	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	3,010,000.00	3,276,535.50	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	4,050,000.00	5,201,617.50	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	2,800,000.00	3,157,420.00	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	2,470,000.00	2,674,516.00	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	2,610,000.00	2,515,648.50	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	2,300,000.00	3,408,818.04	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	1,000,000.00	1,002,300.00	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	3,590,000.00	4,469,909.00	
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,380,000.00	3,957,473.00	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	3,220,000.00	4,867,515.25	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	1,280,000.00	1,451,942.40	
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	100,000.00	99,345.24	
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	3,080,000.00	4,983,175.73	

FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	2,470,000.00	3,727,371.03	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	2,410,000.00	3,386,262.80	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	2,660,000.00	4,083,128.19	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	1,500,000.00	1,918,972.95	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	1,520,000.00	2,283,040.00	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	1,300,000.00	2,016,093.16	
FRENCH TREASURY NOTE-1.75%-17/02/25	400,000.00	410,084.44	
FRENCH TREASURY NOTE-1.0%-17/07/25	300,000.00	306,148.71	
IRISH TREASURY-5.5%-17/10/18	690,000.00	765,796.50	
IRISH TREASURY-4.5%-18/10/18	820,000.00	927,256.00	
IRISH TREASURY-4.4%-19/06/18	840,000.00	970,116.00	
IRISH TREASURY-5.9%-19/10/18	730,000.00	893,033.30	
IRISH TREASURY-4.5%-20/04/18	1,070,000.00	1,270,667.80	
IRISH TREASURY-5.0%-20/10/18	890,000.00	1,093,869.36	
IRISH TREASURY-0.8%-22/03/15	160,000.00	162,481.60	
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	580,000.00	708,408.10	
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	800,000.00	952,525.36	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	1,120,000.00	1,533,836.30	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	780,000.00	847,844.40	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	530,000.00	506,897.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-17/01/15	1,800,000.00	1,857,827.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.5%-17/07/15	2,430,000.00	2,612,161.06	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-18/01/15	700,000.00	722,680.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-18/04/15	390,000.00	391,969.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	2,580,000.00	2,860,811.84	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-19/01/15	800,000.00	835,680.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	2,080,000.00	2,395,224.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-20/01/15	630,000.00	637,749.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	1,890,000.00	2,197,881.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	1,820,000.00	2,138,773.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	1,500,000.00	1,693,950.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	1,710,000.00	2,119,288.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	970,000.00	1,453,169.31	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	1,000,000.00	1,097,250.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	830,000.00	927,566.50	



		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	220,000.00	209,165.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	1,820,000.00	2,761,313.10	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	660,000.00	784,098.28	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,490,000.00	2,208,760.95	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,680,000.00	2,517,463.87	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	960,000.00	1,240,603.75	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.2%-17/02/20	920,000.00	959,282.71	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-17/09/15	850,000.00	916,812.89	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	1,260,000.00	1,386,728.53	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.15%-18/10/19	660,000.00	685,905.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	1,620,000.00	1,863,891.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.95%-19/06/18	370,000.00	397,454.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-19/10/18	510,000.00	516,655.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	1,400,000.00	1,653,960.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	1,490,000.00	1,777,272.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	900,000.00	1,093,725.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	1,100,000.00	1,329,900.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	890,000.00	974,238.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	520,000.00	561,808.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	350,000.00	360,395.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	810,000.00	1,120,831.74	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	850,000.00	1,330,852.90	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	500,000.00	570,335.35	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,220,000.00	1,782,706.94	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	650,000.00	859,738.15	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	390,000.00	627,874.65	
		ユーロ小計	447,400,000.00	538,863,573.95 (70,882,114,517)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.75%-17/01/22	1,770,000.00	1,794,470.25	
		UK TREASURY-8.75%-17/08/25	1,510,000.00	1,717,221.37	
		UK TREASURY-1.0%-17/09/07	1,490,000.00	1,499,683.51	
		UK TREASURY-5.0%-18/03/07	2,360,000.00	2,584,334.75	
		UK TREASURY-1.25%-18/07/22	2,930,000.00	2,960,704.93	
		UK TREASURY-4.5%-19/03/07	2,630,000.00	2,926,976.97	
		UK TREASURY-1.75%-19/07/22	1,700,000.00	1,738,639.13	

		UK TREASURY-3.75%-19/09/07	2,040,000.00	2,238,532.80	
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	2,960,000.00	3,398,302.00	
		UK TREASURY-2.0%-20/07/22	1,300,000.00	1,340,508.00	
		UK TREASURY-3.75%-20/09/07	1,920,000.00	2,140,112.25	
		UK TREASURY-1.5%-21/01/22	310,000.00	311,179.55	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	1,460,000.00	1,967,656.60	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	2,050,000.00	2,312,881.75	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	1,580,000.00	1,819,439.20	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	2,000,000.00	2,021,385.60	
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	2,670,000.00	2,771,965.16	
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	1,500,000.00	1,610,004.45	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	2,280,000.00	2,895,693.48	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	1,480,000.00	1,821,027.81	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	1,000,000.00	1,443,270.00	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	2,090,000.00	2,745,643.45	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	2,110,000.00	2,646,397.23	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	2,100,000.00	2,733,986.85	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,900,000.00	2,410,316.44	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,740,000.00	2,389,487.53	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,460,000.00	1,880,455.61	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	2,530,000.00	3,284,351.63	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	3,150,000.00	4,292,757.00	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,320,000.00	1,477,723.36	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	540,000.00	632,835.01	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,650,000.00	2,226,207.55	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	1,460,000.00	2,018,406.20	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,530,000.00	1,969,641.51	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,730,000.00	2,493,472.00	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,700,000.00	2,383,544.50	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	1,520,000.00	1,963,392.05	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	260,000.00	261,777.90	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	500,000.00	497,645.00	
英ポンド小計			68,230,000.00	81,622,030.38	(14,630,748,945)
スイスフ	国債証券	SWITZERLAND-4.25%-17/06/05	620,000.00	666,485.74	

ラン		SWITZERLAND-3.0%-18/01/08	400,000.00	432,203.60	
		SWITZERLAND-3.0%-19/05/12	400,000.00	452,299.20	
		SWITZERLAND-2.25%-20/07/06	400,000.00	453,720.40	
		SWITZERLAND-2.0%-21/04/28	220,000.00	250,591.00	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	1,290,000.00	1,694,978.73	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	230,000.00	339,345.45	
スイスフラン小計			3,560,000.00	4,289,624.12	(522,133,047)
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-3.75%-17/08/12	6,650,000.00	7,105,012.95	
		SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	8,900,000.00	10,147,246.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	8,700,000.00	10,687,532.40	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	8,200,000.00	9,679,362.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	7,220,000.00	7,570,350.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	5,700,000.00	6,441,723.90	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	4,630,000.00	5,771,359.82	
スウェーデンクローナ小計			50,000,000.00	57,402,587.57	(820,282,976)
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-4.25%-17/05/19	6,500,000.00	6,822,582.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	6,400,000.00	7,208,640.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	7,100,000.00	8,110,330.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	5,250,000.00	5,512,510.50	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	4,370,000.00	4,916,874.91	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	2,990,000.00	3,059,693.91	
ノルウェークローネ小計			32,610,000.00	35,630,631.32	(491,702,712)
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-4.0%-17/11/15	5,550,000.00	6,011,943.15	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	9,050,000.00	10,487,737.30	
		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	6,600,000.00	7,655,069.40	
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	8,000,000.00	8,582,720.00	
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	3,150,000.00	4,895,837.10	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	5,350,000.00	5,782,488.65	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	11,820,000.00	18,973,452.18	
デンマーククローネ小計			49,520,000.00	62,389,247.78	(1,099,298,545)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-17/04/25	1,880,000.00	1,954,918.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-17/07/25	800,000.00	778,560.00	

		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	2,370,000.00	2,515,399.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-18/04/25	1,800,000.00	1,876,050.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-18/07/25	2,700,000.00	2,741,040.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-19/07/25	2,490,000.00	2,585,367.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	2,050,000.00	2,300,202.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.5%-20/04/25	1,380,000.00	1,334,322.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	1,980,000.00	2,242,548.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25	1,000,000.00	976,448.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	1,810,000.00	2,128,107.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	2,400,000.00	2,851,440.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	2,890,000.00	3,127,991.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,480,000.00	2,542,868.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	700,000.00	660,947.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	930,000.00	1,176,941.04	
		ポーランドズロチ小計	29,660,000.00	31,793,150.04 (987,813,171)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.0%-17/02/15	2,130,000.00	2,225,328.15	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-17/07/21	1,850,000.00	1,913,656.65	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-18/01/21	2,070,000.00	2,215,703.16	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-18/10/21	1,570,000.00	1,622,302.98	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	2,220,000.00	2,439,815.52	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-19/10/21	1,630,000.00	1,666,311.51	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	2,270,000.00	2,489,320.59	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-20/11/21	750,000.00	732,039.75	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	2,300,000.00	2,700,225.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	1,900,000.00	2,277,782.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	2,070,000.00	2,472,532.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	2,350,000.00	2,358,659.75	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	2,240,000.00	2,329,642.56	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	1,970,000.00	2,213,407.29	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,840,000.00	2,168,469.44	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,040,000.00	1,061,461.44	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,090,000.00	1,274,116.26	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	470,000.00	428,076.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	890,000.00	939,793.72	

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	450,000.00	436,635.90	
豪ドル小計			33,100,000.00	35,965,280.87 (3,141,926,936)	
シンガ ポールド ル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-17/04/01	780,000.00	794,943.08	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.375%-17/10/01	150,000.00	151,171.80	
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-18/04/01	400,000.00	394,782.48	
		SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	410,000.00	440,057.63	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01	640,000.00	662,710.14	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-19/10/01	200,000.00	200,572.14	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-20/07/01	220,000.00	221,784.20	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	750,000.00	796,101.82	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	320,000.00	323,232.89	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	580,000.00	612,582.48	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	200,000.00	206,020.60	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	565,128.68	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	150,000.00	148,876.80	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	580,000.00	631,661.64	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	230,000.00	234,487.57	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	330,000.00	334,393.62	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	300,000.00	324,101.37	
SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	480,000.00	470,480.68			
シンガポールドル小計			7,260,000.00	7,513,089.62 (643,195,602)	
マレーシ アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	460,000.00	461,732.36	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	80,000.00	78,649.60	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	760,000.00	742,618.80	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	700,000.00	712,684.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.814%-17/02/15	1,670,000.00	1,691,142.20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.012%-17/09/15	2,900,000.00	2,962,234.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.314%-17/10/31	350,000.00	353,346.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	2,420,000.00	2,475,877.80	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.26%-18/03/01	400,000.00	402,025.60	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.58%-18/09/28	700,000.00	706,104.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	1,520,000.00	1,634,121.60	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	3,500,000.00	3,607,555.00	

		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.492%-20/03/31	350,000.00	347,889.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.889%-20/07/31	500,000.00	504,570.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	2,500,000.00	2,527,825.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	650,000.00	624,409.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,750,000.00	1,669,993.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	934,809.32	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,270,000.00	1,269,098.30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	426,663.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	850,000.00	774,163.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	430,000.00	397,483.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000.00	796,965.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	1,210,000.00	1,197,791.10	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	750,000.00	704,160.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	600,000.00	540,054.00	
		マレーシアリングット小計	28,460,000.00	28,543,965.58 (797,518,398)	
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 17/09/15	5,300,000.00	5,296,785.28	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 18/12/21	5,000,000.00	4,909,732.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	7,000,000.00	6,596,748.20	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	7,000,000.00	6,310,045.70	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	5,600,000.00	5,127,441.48	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	15,600,000.00	16,648,302.06	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	5,200,000.00	4,457,517.74	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	11,150,000.00	8,627,590.13	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	4,520,000.00	3,896,080.89	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	1,000,000.00	904,056.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	9,000,000.00	6,113,857.50	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	7,000,000.00	6,037,732.40	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	8,000,000.00	5,403,273.20	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	5,150,000.00	4,454,476.53	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	9,600,000.00	8,334,828.96	
南アフリカランド小計		106,120,000.00	93,118,468.07 (732,842,343)	
合計			175,645,985,869 (175,645,985,869)	

(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 127銘柄	100.0%	42.9%
加ドル	国債証券 32銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 19銘柄	100.0%	1.0%
ユーロ	国債証券 257銘柄	100.0%	40.4%
英ポンド	国債証券 39銘柄	100.0%	8.3%
スイスフラン	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.6%
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 18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 26銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 15銘柄	100.0%	0.4%

## 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27年 6月25日現在	平成27年12月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	18,978,105	14,001,247
コール・ローン	17,978,405	28,397,597
国債証券	2,036,817,774	1,885,852,701
特殊債券	9,613,302	1,714,657
派生商品評価勘定	545	23,620
未収利息	33,839,796	29,445,901
前払費用	6,223,118	2,332,327
流動資産合計	2,123,451,045	1,961,768,050
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	40,048	80,392
未払金	10,081,686	9,281,928
未払解約金	1,613,318	-
流動負債合計	11,735,052	9,362,320
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,552,174,295	1,659,465,714
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	559,541,698	292,940,016
元本等合計	2,111,715,993	1,952,405,730
純資産合計	2,111,715,993	1,952,405,730
負債純資産合計	2,123,451,045	1,961,768,050

## 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</p>
--------------------	---



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

## （貸借対照表に関する注記）

		平成27年 6月25日現在	平成27年12月25日現在
1.	期首	平成26年12月26日	平成27年 6月26日
	期首元本額	1,435,455,462円	1,552,174,295円
	期首からの追加設定元本額	202,347,907円	180,855,901円
	期首からの一部解約元本額	85,629,074円	73,564,482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	34,956,122円	35,168,592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）	1,517,218,173円	1,624,297,122円	
計	1,552,174,295円	1,659,465,714円	
2.	受益権の総数	1,552,174,295口	1,659,465,714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12月26日 至 平成27年 6月25日	自 平成27年 6月26日 至 平成27年12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27年 6月25日現在	平成27年12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

(平成27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	65,789,639
特殊債券	7,546
合計	65,797,185

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(平成27年 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
	ブラジルリアル	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

(平成27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	10,888,507	-	10,808,115	80,392
	米ドル	6,167,889	-	6,126,630	41,259
	ルーマニアレイ	3,442,278	-	3,416,025	26,253
	南アフリカランド	1,278,340	-	1,265,460	12,880
	売建	3,442,278	-	3,418,658	23,620
	米ドル	3,442,278	-	3,418,658	23,620
合計		14,330,785	-	14,226,773	56,772

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

平成27年 6月25日現在		平成27年12月25日現在	
1口当たり純資産額	1.3605円	1口当たり純資産額	1.1765円
(1万口当たり純資産額)	(13,605円)	(1万口当たり純資産額)	(11,765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-5.0%-17/06/15	1,050,000.00	1,066,180.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 17/12/14	1,730,000.00	1,852,535.90	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-4.75%- 18/06/14	2,400,000.00	2,413,608.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-18/12/13	2,460,000.00	2,712,260.70	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11	800,000.00	794,356.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	1,150,000.00	1,269,450.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	1,650,000.00	1,714,201.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	1,350,000.00	1,396,932.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	1,230,000.00	1,383,417.90	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	2,610,000.00	3,316,579.20	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	300,000.00	289,020.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	930,000.00	1,014,723.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	1,060,000.00	1,249,612.80	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	1,650,000.00	1,826,616.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	580,000.00	639,418.10	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	680,000.00	919,281.80	
MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	960,000.00	1,139,841.60			
MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	1,270,000.00	1,397,577.85			
メキシコペソ小計			23,860,000.00	26,395,614.10 (183,977,430)	
ブラジル レアル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL-10.25%- 28/01/10	250,000.00	216,875.00	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-17/01/01	700,000.00	603,050.00	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-17/07/01	820,000.00	652,966.00	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-17/10/01	310,000.00	237,057.00	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-18/01/01	890,000.00	655,485.00	

		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-18/07/01	600,000.00	408,540.00	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-19/01/01	1,190,000.00	750,176.00	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-19/07/01	200,000.00	117,039.98	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-17/01/01	680,000.00	646,406.47	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-18/01/01	200,000.00	180,259.55	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-19/01/01	200,000.00	171,739.54	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-21/01/01	990,000.00	790,314.74	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-23/01/01	550,000.00	414,478.75	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-25/01/01	540,000.00	389,824.77	
ブラジルリアル小計			8,120,000.00	6,234,212.80	(189,956,464)
チリペソ	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP-4.25%-16/02/05	10,000,000.00	9,998,000.00	
チリペソ小計			10,000,000.00	9,998,000.00	(1,714,657)
コロンビアペソ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA-7.75%-21/04/14	60,000,000.00	61,117,500.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA-4.375%-23/03/21	30,000,000.00	25,048,650.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA-9.85%-27/06/28	47,000,000.00	53,718,180.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-5.0%-18/11/21	250,000,000.00	236,390,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-19/09/11	387,000,000.00	379,993,365.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-11.0%-20/07/24	445,000,000.00	499,528,075.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-22/05/04	300,000,000.00	283,332,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-10.0%-24/07/24	715,000,000.00	784,605,250.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.5%-26/08/26	300,000,000.00	274,440,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-6.0%-28/04/28	370,000,000.00	289,469,500.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.75%-30/09/18	175,000,000.00	156,631,125.00	
コロンビアペソ小計			3,079,000,000.00	3,044,273,645.00	(114,769,116)
ペルーヌエボソル	国債証券	BONOS DE TESORERIA-5.2%-23/09/12	60,000.00	54,450.45	
		BONOS DE TESORERIA-5.7%-24/08/12	40,000.00	36,845.22	
		PERU BONO SOBERANO-7.84%-20/08/12	230,000.00	244,933.90	
		PERU BONO SOBERANO-8.2%-26/08/12	130,000.00	139,107.15	

		PERU BONO SOBERANO-6.95%-31/08/12	260,000.00	244,771.93	
		PERU BONO SOBERANO-6.9%-37/08/12	180,000.00	165,557.52	
ペルーヌエボソル小計			900,000.00	885,666.17	(31,370,295)
トルコ リラ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND-9.0%-17/03/08	300,000.00	294,446.70	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-6.3%-18/02/14	320,000.00	293,661.53	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.3%-18/06/20	280,000.00	265,423.78	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.8%-18/11/14	360,000.00	342,352.80	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.4%-19/03/27	180,000.00	178,018.19	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.5%-19/07/10	390,000.00	364,260.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.5%-20/01/15	295,000.00	294,097.97	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-7.4%-20/02/05	380,000.00	338,390.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.4%-20/07/08	170,000.00	161,839.99	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.5%-22/01/12	280,000.00	265,312.28	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.5%-22/09/14	290,000.00	260,119.58	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-7.1%-23/03/08	430,000.00	353,795.48	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.8%-23/09/27	250,000.00	225,616.76	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.4%-24/03/20	190,000.00	186,959.99	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.0%-24/07/24	320,000.00	289,919.98	
TURKEY GOVERNMENT BOND-8.0%-25/03/12	300,000.00	256,050.00			
トルコリラ小計			4,735,000.00	4,370,265.03	(180,142,324)
ハンガ リー フォ リント	国債証券	HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.75%- 17/02/24	13,800,000.00	14,685,201.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.75%- 17/11/24	21,200,000.00	23,230,960.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-4.0%-18/04/25	12,000,000.00	12,527,220.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.5%-18/06/22	20,500,000.00	20,694,852.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-5.5%-18/12/20	20,000,000.00	21,814,100.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.5%-19/06/24	25,300,000.00	28,688,682.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.5%-20/06/24	16,000,000.00	16,634,960.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-7.5%-20/11/12	26,200,000.00	31,906,884.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-7.0%-22/06/24	22,300,000.00	27,422,644.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.0%-23/11/24	25,000,000.00	29,685,250.00	
HUNGARY GOVERNMENT BOND-5.5%-25/06/24	24,000,000.00	28,151,040.00			
			226,300,000.00	255,441,794.00	

ハンガリーフォリント小計				(106,340,418)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-17/04/25	320,000.00	332,752.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-17/07/25	270,000.00	262,764.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	500,000.00	530,675.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-18/04/25	430,000.00	448,167.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-18/07/25	540,000.00	548,208.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-19/07/25	540,000.00	560,682.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	370,000.00	415,158.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.5%-20/04/25	700,000.00	676,830.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	430,000.00	487,018.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	300,000.00	352,725.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	510,000.00	605,931.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	610,000.00	660,233.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	580,000.00	594,703.00
		ポーランドズロチ小計		
ロシア ルーブル	国債証券	RUSSIA FOREIGN BOND-7.85%-18/03/10	5,000,000.00	4,782,500.00
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.4%-17/04/19	3,800,000.00	3,662,440.00
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.4%-17/06/14	3,000,000.00	2,886,000.00
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.2%-18/01/31	3,000,000.00	2,779,515.00
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.5%-18/03/15	3,500,000.00	3,328,500.00
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.5%-19/02/27	5,300,000.00	4,958,176.50
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.7%-19/05/15	3,700,000.00	3,367,000.00
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.8%-19/12/11	4,000,000.00	3,611,900.00
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.4%-20/05/27	3,600,000.00	3,172,554.00
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.6%-21/04/14	3,900,000.00	3,555,318.00
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.6%-22/07/20	4,500,000.00	4,044,082.50
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.0%-23/01/25	3,800,000.00	3,292,073.00
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.0%-23/08/16	6,800,000.00	5,841,200.00
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-8.15%-27/02/03	4,500,000.00	4,108,522.50
RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.05%-28/01/19	6,000,000.00	4,996,500.00		
ロシアルーブル小計			64,400,000.00	58,386,281.50 (99,840,541)
ルーマニ アレイ	国債証券	ROMANIA GOVERNMENT BOND-6.75%- 17/06/11	140,000.00	150,987.90
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.9%-17/07/26	400,000.00	428,774.00



		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.25%-18/01/17	90,000.00	93,232.80	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.6%-18/11/28	100,000.00	110,786.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.75%-19/06/24	200,000.00	218,322.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.75%-20/04/29	300,000.00	340,587.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.95%-21/06/11	220,000.00	254,422.30	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.85%-23/04/26	230,000.00	264,670.20	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.75%-25/02/24	120,000.00	129,528.00	
		ルーマニアレイ小計	1,800,000.00	1,991,310.20 (57,867,474)	
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	261,789.13	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.654%-19/10/31	310,000.00	311,447.70	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.659%-20/10/15	300,000.00	301,449.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	350,000.00	351,318.10	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	260,000.00	255,611.20	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	220,000.00	214,968.60	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.012%-17/09/15	330,000.00	337,081.80	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.314%-17/10/31	370,000.00	373,537.20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	380,000.00	388,774.20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.26%-18/03/01	220,000.00	221,114.08	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.58%-18/09/28	290,000.00	292,528.80	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	220,000.00	236,517.60	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	380,000.00	391,677.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.492%-20/03/31	310,000.00	308,130.70	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.889%-20/07/31	280,000.00	282,559.20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	310,000.00	313,450.30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	260,000.00	249,763.80	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	250,000.00	238,570.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	280,000.00	278,453.84	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	330,000.00	329,765.70	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	130,000.00	123,258.20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	110,000.00	101,681.80	

		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	360,000.00	356,367.60	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	130,000.00	122,054.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	110,000.00	99,009.90	
マレーシアリングット小計			6,750,000.00	6,740,880.75	(188,340,208)
タイバーツ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND-3.25%-17/06/16	5,550,000.00	5,691,220.30	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.8%-17/10/10	1,800,000.00	1,840,324.14	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-5.125%-18/03/13	2,600,000.00	2,798,799.12	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.45%-19/03/08	2,100,000.00	2,208,254.58	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.875%-19/06/13	7,850,000.00	8,390,873.63	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.55%-20/06/26	2,200,000.00	2,246,164.80	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.65%-21/12/17	8,320,000.00	8,931,584.06	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.625%-23/06/16	5,000,000.00	5,390,860.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-4.75%-24/12/20	1,460,000.00	1,712,211.64	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.85%-25/12/12	4,320,000.00	4,786,847.28	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.58%-27/12/17	1,550,000.00	1,678,762.06	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-4.875%-29/06/22	4,200,000.00	5,159,528.22	
タイバーツ小計			46,950,000.00	50,835,429.83	(169,281,981)
フィリピンペソ	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES-4.95%-21/01/15	5,000,000.00	5,034,237.00	
フィリピンペソ小計			5,000,000.00	5,034,237.00	(12,837,304)
インドネシアルピア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT-6.25%-17/04/15	300,000,000.00	292,078,350.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-10.0%-17/07/15	250,000,000.00	255,359,525.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-5.25%-18/05/15	500,000,000.00	463,823,300.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.875%-19/04/15	1,350,000,000.00	1,314,238,365.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-20/11/15	500,000,000.00	542,532,400.00	

		INDONESIA GOVERNMENT-12.8%-21/06/15	500,000,000.00	585,096,200.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-21/07/15	1,330,000,000.00	1,298,163,391.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-22/05/15	850,000,000.00	775,453,385.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-5.625%-23/05/15	1,100,000,000.00	909,693,290.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-24/03/15	3,450,000,000.00	3,368,221,545.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-25/09/15	760,000,000.00	863,933,420.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-26/09/15	830,000,000.00	802,480,520.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-27/05/15	600,000,000.00	519,898,740.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.125%-28/05/15	800,000,000.00	633,783,120.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.0%-29/03/15	2,350,000,000.00	2,357,426,470.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-10.5%-30/08/15	550,000,000.00	614,812,110.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.5%-31/07/15	820,000,000.00	851,483,490.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-32/06/15	1,350,000,000.00	1,262,341,800.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.625%-33/05/15	1,000,000,000.00	793,652,200.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-34/03/15	2,300,000,000.00	2,161,160,500.00	
インドネシアルピア小計			21,490,000,000.00	20,665,632,121.00	(181,857,562)
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	1,409,144.76	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 18/12/21	1,200,000.00	1,178,335.68	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	1,960,000.00	1,847,089.49	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	1,810,000.00	1,631,597.53	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	1,200,000.00	1,098,737.46	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	3,600,000.00	3,841,915.86	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	1,930,000.00	1,654,424.83	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	2,140,000.00	1,655,878.28	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	1,450,000.00	1,249,848.96	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	1,790,000.00	1,215,978.32	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	1,600,000.00	1,380,053.12	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	2,040,000.00	1,377,834.66	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	2,090,000.00	1,814,561.72	
南アフリカランド小計		24,220,000.00	21,355,400.67 (168,067,003)	
合計			1,887,567,358 (1,887,567,358)	

(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%	9.7%
ブラジルリアル	国債証券 14銘柄	100.0%	10.1%
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%	6.1%
ペルーヌエボソル	国債証券 6銘柄	100.0%	1.7%
トルコリラ	国債証券 16銘柄	100.0%	9.5%
ハンガリーフォリント	国債証券 11銘柄	100.0%	5.6%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	100.0%	10.6%
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%	3.1%
マレーシアリングット	国債証券 25銘柄	100.0%	10.0%
タイバーツ	国債証券 12銘柄	100.0%	9.0%
フィリピンペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.7%
インドネシアルピア	国債証券 20銘柄	100.0%	9.6%
南アフリカランド	国債証券 13銘柄	100.0%	8.9%

## 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12月30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	215,267,372円
負債総額	36,239円
純資産総額（ - ）	215,231,133円
発行済口数	223,873,683口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9614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	27,492,068,952円
負債総額	119,150,048円
純資産総額（ - ）	27,372,918,904円
発行済口数	20,866,300,672口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3118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	77,376,703,002円
負債総額	14,701,715円
純資産総額（ - ）	77,362,001,287円
発行済口数	38,616,272,655口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0034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	9,337,893,459円
負債総額	324,200円
純資産総額（ - ）	9,337,569,259円
発行済口数	6,753,333,301口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3827円

## 日本債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	34,949,605,576円
負債総額	56,927,952円
純資産総額（ - ）	34,892,677,624円
発行済口数	25,908,736,270口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3468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	177,959,760,527円
負債総額	99,935,241円
純資産総額（ - ）	177,859,825,286円
発行済口数	77,385,243,046口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2984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	2,015,022,456円
負債総額	37,207,948円
純資産総額（ - ）	1,977,814,508円
発行済口数	1,672,958,737口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1822円

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

<更新後>

###### (1) 資本金の額

平成27年12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12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12月末現在）

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

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

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

・委託会社の運用する、平成27年12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	607	116,884
株式投資信託	552	91,700
単位型	105	2,983
追加型	447	88,716
公社債投資信託	55	25,184
単位型	39	381
追加型	16	24,803
投資法人合計	1	11

### 3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第56期事業年度（平成26年4月1日から平成27年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第57期中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

#### (1)【貸借対照表】

<更新後>

	(単位：百万円)			
	第55期 (平成26年3月31日)		第56期 (平成27年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	17,805	3	14,206
有価証券		234		277
前払費用	3	419	3	509
未収入金		37		3
未収委託者報酬		7,162		8,441
未収収益	3	608	3	1,566
関係会社短期貸付金		240		436
立替金		303		666
繰延税金資産		984		1,446
その他	2	30	2	195



流動資産合計		27,826		27,750
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	47	1	56
器具備品	1	134	1	166
有形固定資産合計		181		222
無形固定資産				
ソフトウェア		91		113
無形固定資産合計		91		113
投資その他の資産				
投資有価証券		7,290		14,184
関係会社株式		21,702		21,702
関係会社長期貸付金		60		60
長期差入保証金		692		740
長期前払費用		-		0
繰延税金資産		525		248
投資その他の資産合計		30,271		36,936
固定資産合計		30,544		37,273
資産合計		58,371		65,023

(単位：百万円)

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

資本準備金	5,220	5,220
資本剰余金合計	5,220	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	22,694	25,836
利益剰余金合計	22,694	25,836
自己株式	68	68
株主資本合計	45,209	48,351
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	321	1,002
繰延ヘッジ損益	-	88
評価・換算差額等合計	321	913
純資産合計	45,531	49,265
負債純資産合計	58,371	65,023

## (2) 【損益計算書】

&lt;更新後&gt;

	(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】

&lt; 更新後 &gt;

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	
	資本剰余金	利益剰余金

	資本金	資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金	利益剰余金合計	自己株式	株主資本合計
				繰越利益剰余金			
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。</p> <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>3年～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4年～20年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	3年～15年	器具備品	4年～20年
建物	3年～15年				
器具備品	4年～20年				
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p>				
4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>				
5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。</p>				

(会計方針の変更)

第56期  
(自 平成26年4月1日  
至 平成27年3月31日)

「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。

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。

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。

(表示方法の変更)

第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
(損益計算書関係)	
前事業年度において、「一般管理費」の「諸経費」に含めていた「福利費」は、重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。	
この結果、前事業年度の損益計算書において、「一般管理費」の「諸経費」に表示していた3,364百万円は、「福利費」847百万円、「諸経費」2,517百万円として組み替えております。	

(貸借対照表関係)

第55期 (平成26年3月31日)	第56期 (平成27年3月31日)
1 有形固定資産の減価償却累計額	1 有形固定資産の減価償却累計額
建物 1,091百万円	建物 1,122百万円
器具備品 625百万円	器具備品 679百万円
2 信託資産	2 信託資産
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。	流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。	3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。
(流動資産)	(流動資産)
現金・預金 6,249百万円	現金・預金 4,256百万円
前払費用 2百万円	前払費用 2百万円
未収収益 74百万円	未収収益 110百万円
(流動負債)	(流動負債)
未払手数料 98百万円	未払手数料 108百万円
未払費用 274百万円	未払費用 500百万円
	その他 57百万円
4 消費税等の取扱い	4 消費税等の取扱い
仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。	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>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務65百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務159百万円に対して保証を行っております。</p>	<p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務27百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務842百万円に対して保証を行っております。</p>
---	---

## ( 損益計算書関係 )

第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p style="text-align: right;">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 style="text-align: right;">受取配当金 719百万円</p> <p>2 外国税関連費用1,650百万円は、中国税務当局等が平成26年10月31日付に発した「通達79号」に基づき、平成21年11月17日から平成26年11月16日までのQFII(Qualified Foreign Institutional Investors)口座を通じて取得した中国A株の譲渡所得に対して税率10%で遡及課税される金額を合理的に計算したものであります。中国A株に投資している当社の対象ファンドは「中国A株マザーファンド」及び「中国A株CSI300インデックスマザーファンド」の2ファンドであり、ファンドの当時の受益者に負担を求めることが事実上不可能であるため、当社が負担しております。</p>

## ( 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	1年内
751百万円	841百万円
1年超	1年超
77百万円	3,420百万円
合計	合計
828百万円	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せぬ。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、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、月次ベースで為替変動リスクを測定

し、モニタリングを実施しております。また、有価証券及び投資有価証券に関しては、一部について、為替変動リスクや価格変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益(ヘッジ対象の有価証券及び投資有価証券は、ヘッジ損益考慮後の評価損益)を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュ-・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベ-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 デリバティブ取引計	(57) (82)	(57) (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 うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理方 法	為替予約取引 売建				
	米ドル	投資有価	2,586	-	68
	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tockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額  
当事業年度末における本源的価値の合計額 - 百万円
- 3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するよう調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第56期(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

#### 1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

##### (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

（注） 株式数に換算して記載しております。

## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

### ストックオプション（新株予約権）の数

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

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日
権利確定前(株)		
期首	2,310,000	5,388,900
付与	0	0

失効	0	359,700
権利確定	0	0
権利未確定残	2,310,000	5,029,200
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

#### 単価情報

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

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

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

(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)
----------------------	----------------------

<p>1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <p>繰延税金資産(流動)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">賞与引当金</td> <td style="text-align: right;">689</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">294</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">984</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">投資有価証券評価損</td> <td style="text-align: right;">148</td> </tr> <tr> <td>関係会社株式評価損</td> <td style="text-align: right;">1,665</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">385</td> </tr> <tr> <td>固定資産減価償却費</td> <td style="text-align: right;">158</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">34</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,391</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産小計</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">評価性引当金</td> <td style="text-align: right;">1,665</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,710</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">200</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">200</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産の純額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;"></td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,510</td> </tr> </table>	賞与引当金	689	その他	294	小計	984	投資有価証券評価損	148	関係会社株式評価損	1,665	退職給付引当金	385	固定資産減価償却費	158	その他	34	小計	2,391	評価性引当金	1,665	繰延税金資産合計	1,710	その他有価証券評価差額金	200	繰延税金負債合計	200		1,510	<p>1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <p>繰延税金資産(流動)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">賞与引当金</td> <td style="text-align: right;">658</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">813</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,472</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">投資有価証券評価損</td> <td style="text-align: right;">134</td> </tr> <tr> <td>関係会社株式評価損</td> <td style="text-align: right;">1,510</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">360</td> </tr> <tr> <td>固定資産減価償却費</td> <td style="text-align: right;">133</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">73</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,213</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産小計</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">評価性引当金</td> <td style="text-align: right;">1,510</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,174</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債(流動)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">25</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">25</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">454</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">454</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債合計</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;"></td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">480</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産の純額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;"></td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,694</td> </tr> </table>	賞与引当金	658	その他	813	小計	1,472	投資有価証券評価損	134	関係会社株式評価損	1,510	退職給付引当金	360	固定資産減価償却費	133	その他	73	小計	2,213	評価性引当金	1,510	繰延税金資産合計	2,174	その他有価証券評価差額金	25	小計	25	その他有価証券評価差額金	454	小計	454		480		1,694
賞与引当金	689																																																														
その他	294																																																														
小計	984																																																														
投資有価証券評価損	148																																																														
関係会社株式評価損	1,665																																																														
退職給付引当金	385																																																														
固定資産減価償却費	158																																																														
その他	34																																																														
小計	2,391																																																														
評価性引当金	1,665																																																														
繰延税金資産合計	1,710																																																														
その他有価証券評価差額金	200																																																														
繰延税金負債合計	200																																																														
	1,510																																																														
賞与引当金	658																																																														
その他	813																																																														
小計	1,472																																																														
投資有価証券評価損	134																																																														
関係会社株式評価損	1,510																																																														
退職給付引当金	360																																																														
固定資産減価償却費	133																																																														
その他	73																																																														
小計	2,213																																																														
評価性引当金	1,510																																																														
繰延税金資産合計	2,174																																																														
その他有価証券評価差額金	25																																																														
小計	25																																																														
その他有価証券評価差額金	454																																																														
小計	454																																																														
	480																																																														
	1,694																																																														
<p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">法定実効税率</td> <td style="text-align: right;">38.0%</td> </tr> <tr> <td>(調整)</td> <td></td> </tr> <tr> <td>評価性引当金の増減</td> <td style="text-align: right;">46.6%</td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">3.7%</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">12.9%</td> </tr> <tr> <td>税率変更による期末繰延税金資産の減額修正</td> <td style="text-align: right;">1.9%</td> </tr> <tr> <td>海外子会社の留保利益の影響額等</td> <td style="text-align: right;">6.9%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">84.2%</td> </tr> </table>	法定実効税率	38.0%	(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	3.7%	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	1.9%	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	84.2%	<p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">法定実効税率</td> <td style="text-align: right;">35.6%</td> </tr> <tr> <td>(調整)</td> <td></td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">1.3%</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">4.3%</td> </tr> <tr> <td>税率変更による期末繰延税金資産の減額修正</td> <td style="text-align: right;">3.6%</td> </tr> <tr> <td>海外子会社の留保利益の影響額等</td> <td style="text-align: right;">1.7%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">37.9%</td> </tr> </table>	法定実効税率	35.6%	(調整)		交際費等永久に損金に算入されない項目	1.3%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.3%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	3.6%	海外子会社の留保利益の影響額等	1.7%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	37.9%																																
法定実効税率	38.0%																																																														
(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	3.7%																																																														
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	1.9%																																																														
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	84.2%																																																														
法定実効税率	35.6%																																																														
(調整)																																																															
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.3%																																																														
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.3%																																																														
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	3.6%																																																														
海外子会社の留保利益の影響額等	1.7%																																																														
税効果会計適用後の法人税等の負担率	37.9%																																																														

<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(シンガポールドル貸建)(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(シンガポールドル貸建)(注1)	7 (千SGD 92)	未収収益	7 (千SGD 82)

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

## (セグメント情報等)

## セグメント情報

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

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

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

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

## 関連情報

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

## 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

### 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

該当事項はありません。

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

該当事項はありません。

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

該当事項はありません。

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

( 1株当たり情報 )

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

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

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

項目	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益(百万円)	544	3,101
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(百万円)	544	3,101
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,903	196,903
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1) 15,902,700株、 平成21年度ストックオプション(2) 1,567,500株、 平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株、 第1回新株予約権2,955,200株、 平成23年度ストックオプション(1) 5,388,900株	平成21年度ストックオプション(1) 15,902,700株、 平成21年度ストックオプション(2) 1,567,500株、 平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株、 平成23年度ストックオプション(1) 5,029,200株

### 3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第55期 (平成26年3月31日)	第56期 (平成27年3月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	45,531	49,265
純資産の部の合計額から控除する金額 （百万円）	-	-
普通株式に係る期末の純資産額（百万円）	45,531	49,265
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末 の普通株式の数（千株）	196,903	196,903

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。

## 中間財務諸表等

## （1）中間貸借対照表

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

未払費用		4,163
未払法人税等		52
未払消費税等	3	457
関係会社短期借入金		5,997
賞与引当金		976
役員賞与引当金		115
その他		708
流動負債合計		16,521
固定負債		
退職給付引当金		1,130
固定負債合計		1,130
負債合計		17,652
純資産の部		
株主資本		
資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		28,043
利益剰余金合計		28,043
自己株式		502
株主資本合計		50,124
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		310
繰延ヘッジ損益		53
評価・換算差額等合計		257
純資産合計		50,381
負債純資産合計		68,033

## ( 2 ) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第57期中間会計期間  
(自 平成27年4月1日  
至 平成27年9月30日)

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

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

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第57期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

(単位：百万円)

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

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

## 注記事項

(重要な会計方針)

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

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

(会計方針の変更)

第57期中間会計期間  
(自 平成27年4月1日  
至 平成27年9月30日)

## （企業結合に関する会計基準等の適用）

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

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

なお、これによる損益及び1株当たり情報に与える影響はありません。

## （中間貸借対照表関係）

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

## （中間損益計算書関係）

第57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	



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

（中間株主資本等変動計算書関係）

第57期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	109,600	704,500	-	814,100

（注）自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会計期間末残高(百万円)
		当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末	
平成21年度ストックオプション(1)	普通株式	15,902,700	-	10,282,800	5,619,900	-
平成21年度ストックオプション(2)	普通株式	1,567,500	-	587,400	980,100	-
平成22年度ストックオプション(1)	普通株式	2,310,000	-	2,310,000	-	-
平成23年度ストックオプション(1)	普通株式	5,029,200	-	290,400	4,738,800	-
合計		24,809,400	-	13,470,600	11,338,800	-

（注）1 平成21年度ストックオプション(1)、平成21年度ストックオプション(2)、平成22年度ストックオプション(1)及び平成23年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

- 2 平成21年度ストックオプション(1)5,619,900株、平成21年度ストックオプション(2)980,100株及び平成23年度ストックオプション(1)4,075,500株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

#### 4 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額

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

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

該当事項はありません。

##### (リース取引関係)

第57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	
オペレーティング・リース取引	
解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	853百万円
1年超	3,047百万円
合計	3,900百万円

##### (金融商品関係)

第57期中間会計期間(平成27年9月30日)

##### 1 金融商品の時価等に関する事項

平成27年9月30日(当中間決算日)における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

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

(1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

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

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

(4) 金銭の信託

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

(6) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(7) 未払金、(8) 未払費用並びに(9) 関係会社短期借入金

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

(10) デリバティブ取引

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

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

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

（有価証券関係）

第57期中間会計期間(平成27年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	18,809
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

（単位：百万円）

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	7,923	7,062	860
	小計	7,923	7,062	860
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	5,896	6,298	402
	小計	5,896	6,298	402
合計		13,819	13,361	458

- (注) 1 減損処理にあたっては、中間期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%~50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当中間会計期間については、該当ございません。
- 2 非上場株式等(中間貸借対照表計上額16百万円)については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## (デリバティブ取引関係)

第57期中間会計期間(平成27年9月30日)

## 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	4,686	-	49	49
合計		4,686	-	49	49

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

- 2 時価の算定方法  
金融商品取引所が定める清算指数によっております。

## (2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	為替予約取引 買建 米ドル	5,997	-	170	170
合計		5,997	-	170	170

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

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ 対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		4,550	-	148
	豪ドル		219	-	21
	シンガポールドル		738	-	57
	ユーロ		194	-	0
	香港ドル		178	-	5
	人民元		2,155	-	63
合計			8,035	-	169

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

## (持分法損益等)

第57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	3,071百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	9,269百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,461百万円

## (ストックオプション等関係)

第57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

該当事項はありません。

## (セグメント情報等)

## [セグメント情報]

第57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

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

## [関連情報]

第57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 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57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

該当事項はありません。

## （ 1 株当たり情報 ）

項目	第57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
1株当たり純資産額	256円79銭
1株当たり中間純利益金額	15円54銭

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

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

項目	第57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
中間純利益（百万円）	3,058
普通株主に帰属しない金額（百万円）	-
普通株式に係る中間純利益（百万円）	3,058
普通株式の期中平均株式数（千株）	196,730
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1) 5,619,900株、平成21年度ストックオプション(2) 980,100株、平成23年度ストックオプション(1) 4,738,800株

## 3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第57期中間会計期間 (平成27年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額（百万円）	50,381
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額（百万円）	50,381
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数（千株）	196,198

## （ 重要な後発事象 ）

該当事項はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

< 更新後 >

## ( 1 ) 受託会社

名 称	資本金の額 (平成27年9月末現在)	事業の内容

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

&lt;更新後&gt;

## (2) 販売会社

名 称	資本金の額 (平成27年9月末現在)	事業の内容
農林中央金庫	3,471,460百万円	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。

## 独立監査人の監査報告書

平成28年1月27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27年6月26日から平成27年12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12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。

[次へ](#)



## 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。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成27年12月4日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

### 有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第57期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成27年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。