

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年9月27日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 柴田 拓美
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	森川 晃
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】**（１）【ファンドの名称】**

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

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

（５）【申込手数料】

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

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

（６）【申込単位】

販売会社または「（８）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

（７）【申込期間】

平成28年 9月28日から平成29年 9月26日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(9) 【払込期日】

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

(1 0) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(1 1) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

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

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

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

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

年12回(毎月)

目論見書または投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいいます。

グローバル(含む日本)

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジなし

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1 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ベ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。



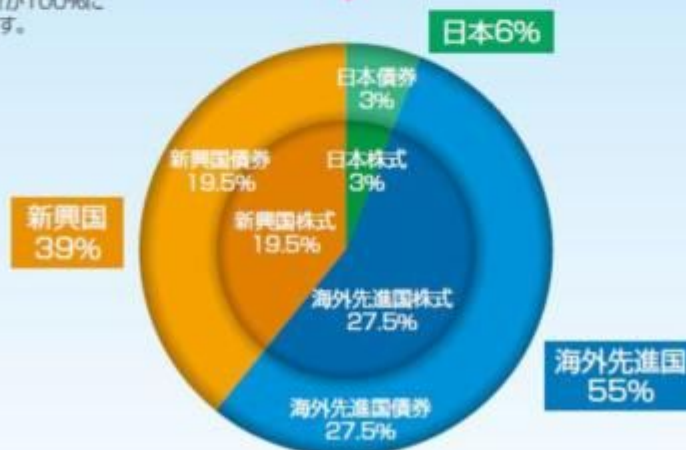
【各地域のGDP比率】
 (IMFの2016年予想の値をもとに日興アセットマネジメントが作成。)
 ※端数処理の関係で合計が100%にならない場合があります。

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2016年6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2016年6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。

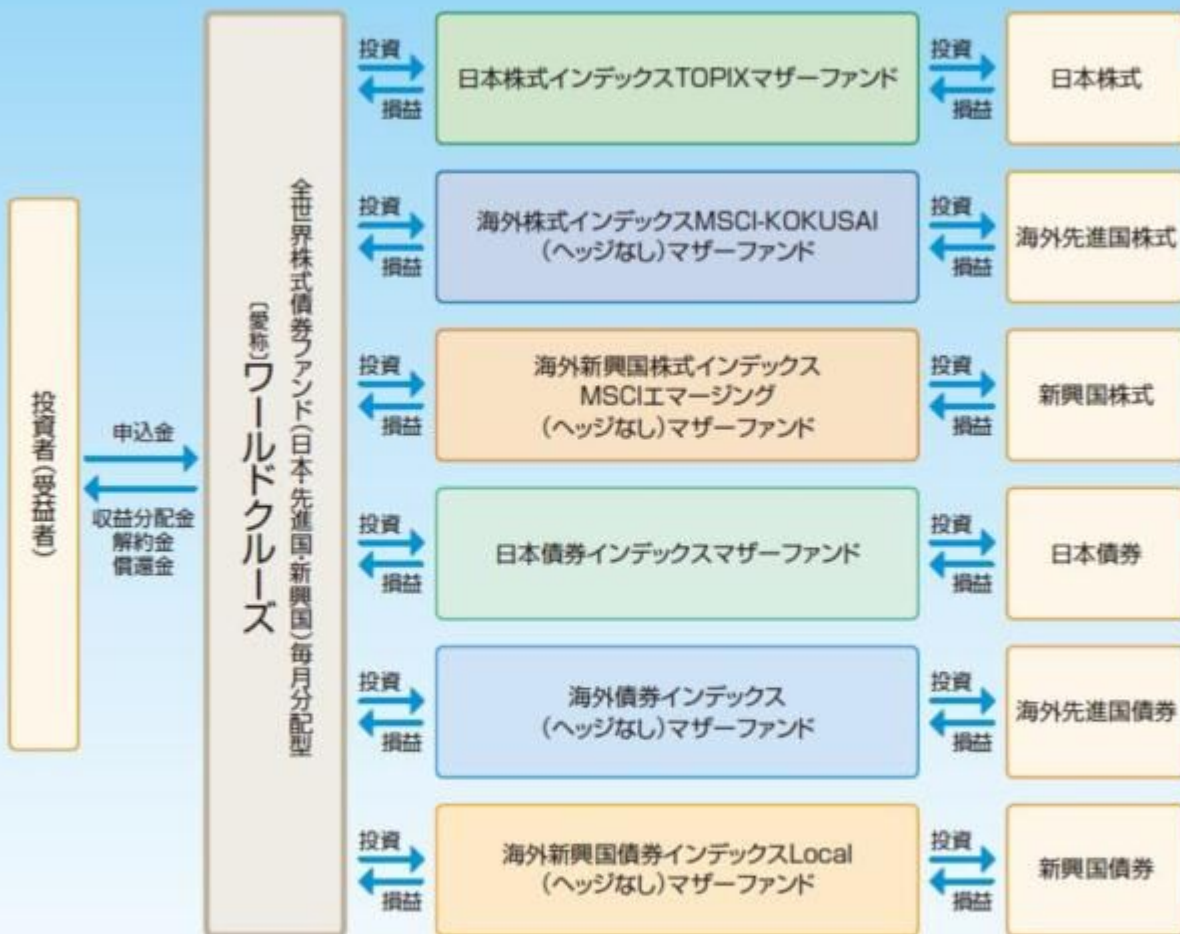
(参考)グローバル分散投資の意義 ～ワールドクルーズをめざすもの～

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。

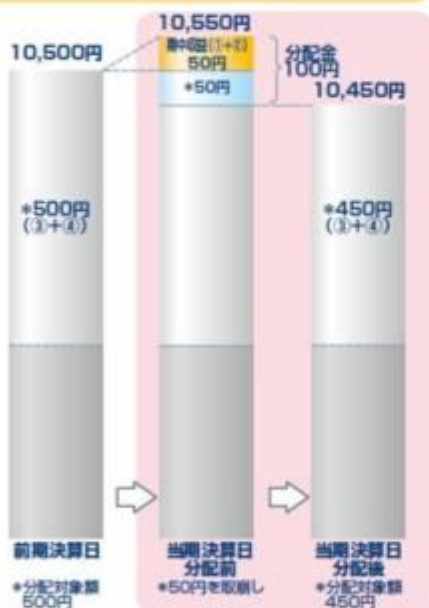
投資信託で分配金が支払われるイメージ



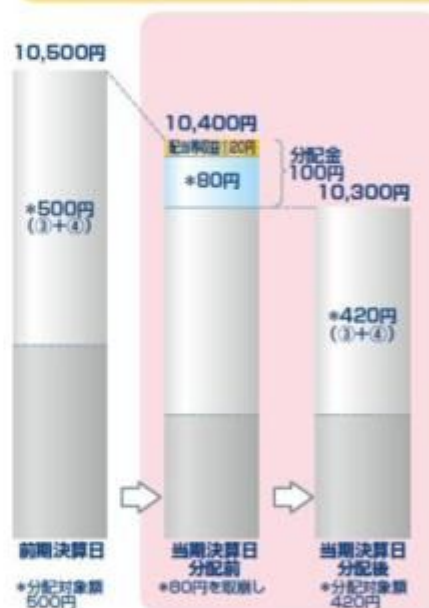
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

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率が小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

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

信託金限度額

- ・ 1兆円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ 委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

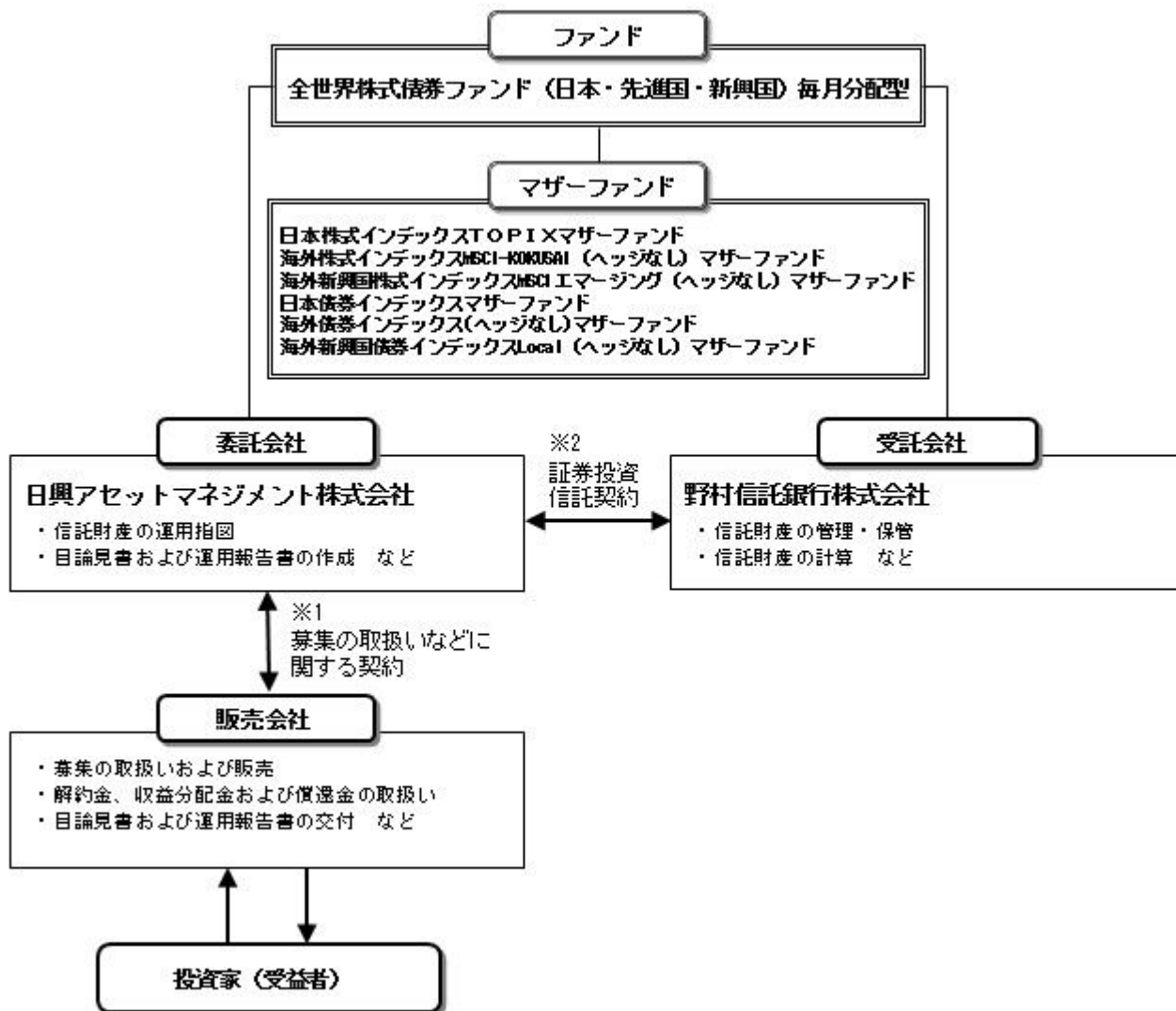
(2) 【ファンドの沿革】

平成20年 3月31日

- ・ ファンドの信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものの。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものの。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

委託会社の概況（平成28年6月末現在）

1) 資本金

17,363百万円

2) 沿革

昭和34年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

平成11年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更

3) 大株主の状況

名称	住所	所有株数	所有比率
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	179,869,100株	91.29%
DBS Bank Ltd.	6 Shenton Way, #46-00, DBS Building Tower One, Singapore 068809	14,283,400株	7.24%

2 【投資方針】

（１）【投資方針】

- ・主として、「投資対象」に掲げる各マザーファンド受益証券に投資を行ない、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざします。各マザーファンド受益証券の合計組入比率は、高位を保つことを原則とします。
- ・各マザーファンド受益証券が実質的に保有する株式または債券の信託財産の純資産総額に対する割合は、50%を基本とします。
- ・各マザーファンド受益証券への投資比率は、日本、海外先進国、新興国のGDP比率をもとに決定します。なお、当該投資比率は各地域のGDP比率に基づいて、毎年見直すことを原則とします。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

<全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型>

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

証券投資信託「海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド」

証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

証券投資信託「海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド」

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条、第21条および第22条に定めるものに限りません。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

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

同じ。)で18)に定めるもの以外のもの

- 18) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
- 19) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 20) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りま。
- 21) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 22) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 23) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りま。
- 24) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 25) 外国の者に対する権利で24)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。

- 1) 信用取引
- 2) 先物取引等
- 3) スワップ取引
- 4) 金利先渡取引
- 5) 為替先渡取引
- 6) 有価証券の貸付
- 7) 公社債の空売
- 8) 公社債の借入
- 9) 外国為替予約取引
- 10) 資金の借入

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

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

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

- 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)～7)の証券の性質を有するもの
 - 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
 - 11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)で12)に定めるもの以外のもの
 - 12) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 - 13) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 - 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
 - 15) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引
- < 海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし)マザーファンド >
新興国の株式(DR(預託証券)およびカンントリーファンドなどを含みます。)を主要投資対象とします。
- 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第17条、第18条および第19条に定めるものに限ります。)
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- 主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することができます。
- 1) 株券または新株引受権証書
 - 2) 国債証券
 - 3) 地方債証券
 - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)

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

ます。)を除きます。)には投資しません。

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限ります。）
- 5) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの
- 8) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
- 9) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 10) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

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

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの

(会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。) に限ります。)

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

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

新興国の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券(株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。)
- 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限ります。)
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。) に投資することができます。

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

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

投資対象とするマザーファンドの概要

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX(東証株価指数) [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主としてわが国の株式に投資し、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成11年10月29日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

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

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカントリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成12年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

* MSCI-KOKUSAI インデックスは、MSCI Inc. が発表している、日本を除く世界の主要国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（円ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。

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

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

運用の基本方針	
基本方針	主として金融商品取引所に上場されている新興国の株式に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	新興国の株式（DR（預託証券）およびカントリーファンドなどを含みます。）を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として、新興国の株式（DR（預託証券）およびカンントリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

その他

委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成18年5月17日設定）
決算日	毎年5月16日（休業日の場合は翌営業日）

* MSCI エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が発表している、世界の新興国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（円ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。

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

< 日本債券インデックスマザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、日興債券パフォーマンスインデックス（総合） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主としてわが国の公社債に投資し、日興債券パフォーマンスインデックス（総合）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。 ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用

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

その他

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

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

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

<平成29年1月1日以降>

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

<海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。

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

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

< 海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ グローバル・ディバーシファイド（円ヘッジなし・円ベース）*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。

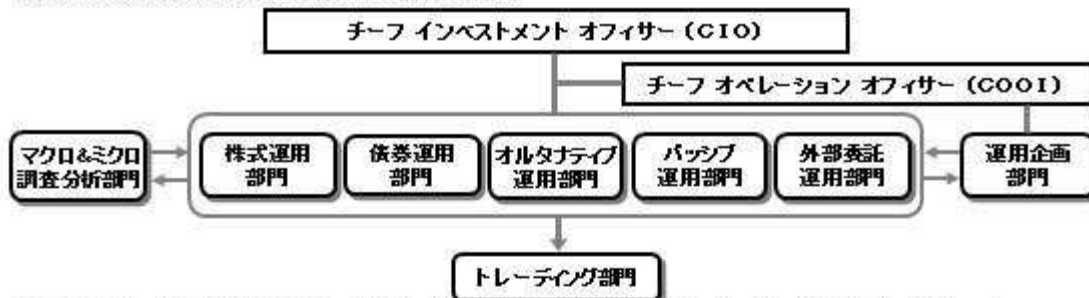
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として、新興国の現地通貨建債券に投資し、ＪＰモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル・ディバースファイド（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。なお、新興国の現地通貨建債券の騰落率に償還価額などが連動する債券を活用することもあります。 ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行いません。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券、新株予約権証券および新株引受権付社債券を含みます。）への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成20年3月31日設定）
決算日	毎年5月16日（休業日の場合は翌営業日）

* J Pモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル・ディバースファイドは、J Pモルガンが発表している、エマージング・カントリーの債券市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（円ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。

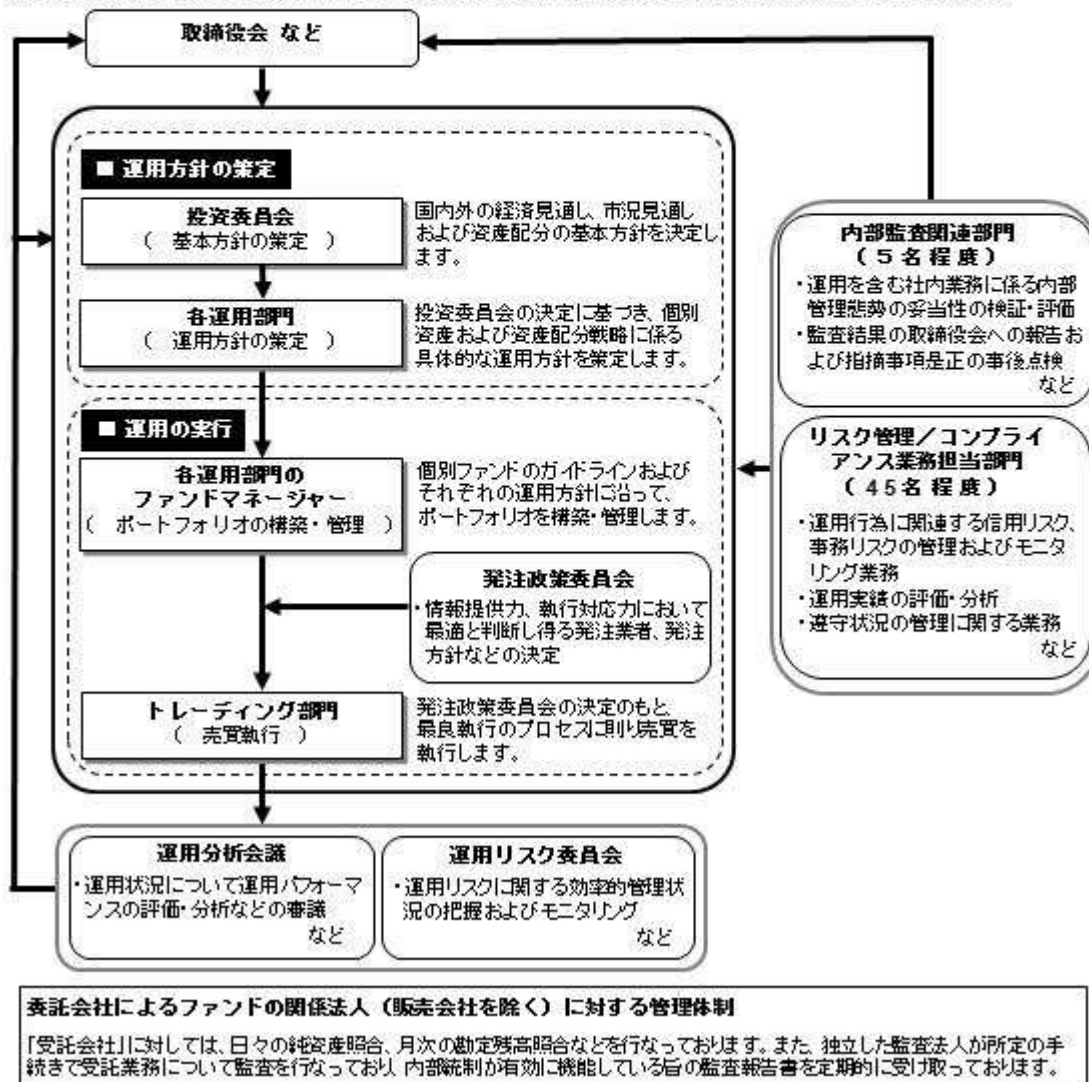
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はJPMorgan Chase & Co.に帰属します。また、JPMorgan Chase & Co.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

（３）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



上記体制は平成28年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行いません。

収益分配金の支払い

< 分配金再投資コース >

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

< 分配金受取りコース >

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

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

< 全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型 >

- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の 70% 未満とします。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。以下同じ。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。また、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、投資することを指図することができます。
- 3) 投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の 5% 以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入

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

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

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

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

てはこの限りではありません。

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

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

- 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 15) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 16) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

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

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

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 3) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 4) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 7) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 10) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

<海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

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

た受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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

< 海外新興国債券インデックスLocal(ヘッジなし)マザーファンド >

- 1) 株式(新株引受権証券、新株予約権証券および新株引受権付社債券を含みます。)への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 3) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 4) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 13) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

同一法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行なう投資信託全体で、当該株式の議決権の過半数を保有することとなる取引は行ないません。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

当ファンドの投資にあたっては、主に以下のリスクを伴います。基準価額変動リスクの大きいファンドですので、お申込みの際は、当ファンドのリスクを十分に認識・検討し、慎重に投資のご判断を行なっていただく必要があります。

- ・投資者の皆様は投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者（受益者）の皆様へ帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。
- ・当ファンドは、主に株式および債券を実質的な投資対象としますので、株式および債券の価格の下落や、株式および債券の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

- ・一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。
- ・一般に新興国の株式および債券は、先進国の株式および債券に比べて価格変動が大きくなる傾向があり、基準価額にも大きな影響を与える場合があります。

流動性リスク

- ・市場規模や取引量が少ない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは、価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。
- ・一般に新興国の株式および債券は、先進国の株式および債券に比べて市場規模や取引量が少ないため、流動性リスクが高まる場合があります。

信用リスク

- ・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体

の株式などの価格は大きく下落(価格がゼロになることもあります。)し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れや廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。

- ・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト(債務不履行)が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落(価格がゼロになることもあります。)し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。
- ・一般に新興国の債券は、先進国の債券に比べて利回りが高い反面、価格変動が大きく、デフォルトが生じるリスクが高まる場合があります。
- ・格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。
- ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

為替変動リスク

- ・外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。
 - ・一般に新興国の通貨は、先進国の通貨に比べて為替変動が大きくなる場合があります。
- #### カントリー・リスク
- ・投資対象国における非常事態など(金融危機、財政上の理由による国自体のデフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など)を含む市況動向や資金動向などによっては、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあり、投資方針に従った運用ができない場合があります。
 - ・一般に新興国は、情報の開示などが先進国に比べて充分でない、あるいは正確な情報の入手が遅延する場合があります。
 - ・ファンドの投資対象資産が上場または取引されている諸国の税制は各国によって異なります。また、それらの諸国における税制が一方的に変更されたり、新たな税制が適用されたりすることもあります。以上のような要因は、ファンドの信託財産の価値に影響を与える可能性があります。

<その他の留意事項>

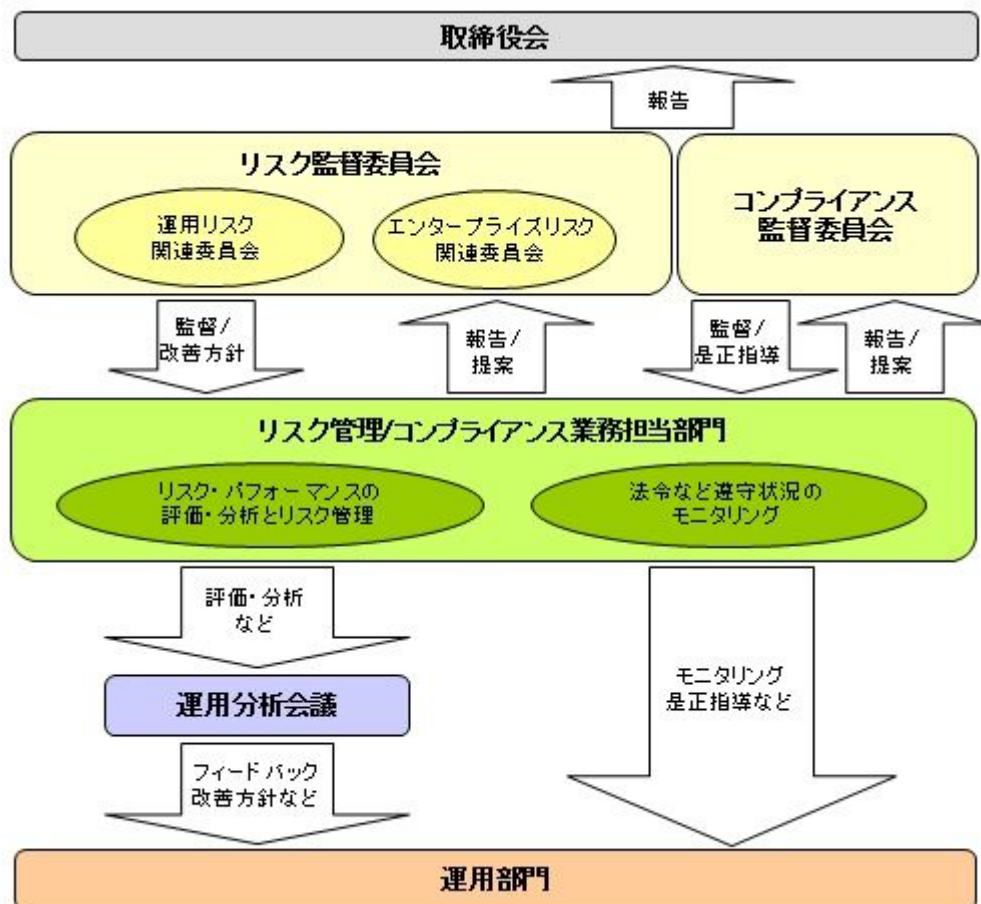
- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項
証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由により基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。
- ・投資対象とする投資信託証券に関する事項
ファンドが投資対象とする投資信託証券(マザーファンドを含みます。)と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴う資金流出などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。
- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項
一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。
- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限さ

れることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。

・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

(2) リスク管理体制



全社リスク管理

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

運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

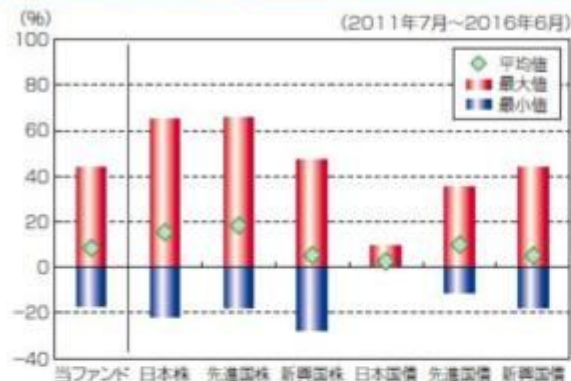
法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は平成28年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	8.5%	15.5%	18.4%	5.4%	2.7%	10.0%	5.2%
最大値	43.6%	65.0%	65.7%	47.4%	9.3%	34.9%	43.7%
最小値	-17.2%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	0.4%	-11.2%	-17.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2011年7月から2016年6月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

東証株価指数(TOPIX、配当込)

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

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

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

NOMURA-BPI国債

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

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

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7月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

Index LLC に帰属します。

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

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

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

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

（2）【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

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

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

（3）【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年1.134%（税抜1.05%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
1.05%	0.50%	0.50%	0.05%

委託会社	委託した資金の運用の対価
販売会社	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
受託会社	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

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

格付の取得に要する費用。

ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。

信託財産に関する以下の費用・報酬およびそれに付随する消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産から支払います。

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

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

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

< 投資対象とするマザーファンドに係る費用 >

- ・ 組入る有価証券の売買時の売買委託手数料
- ・ 信託事務の処理に要する諸費用
- ・ 信託財産に関する租税 など

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

* 売買委託手数料などは、保有期間や運用の状況などに応じて異なり、あらかじめ見積もることができないため、表示することができません。

投資家の皆様にご負担いただく手数料などの合計額については、保有期間や運用の状況などに応じて異

なりますので、表示することができません。

（５）【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

^{*}解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みません。）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ます。）と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益（譲渡益）、普通分配金および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、未成年者少額投資非課税制度（ジュニアNISA）をご利用の場合、20歳未満の居住者などを対象に、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。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

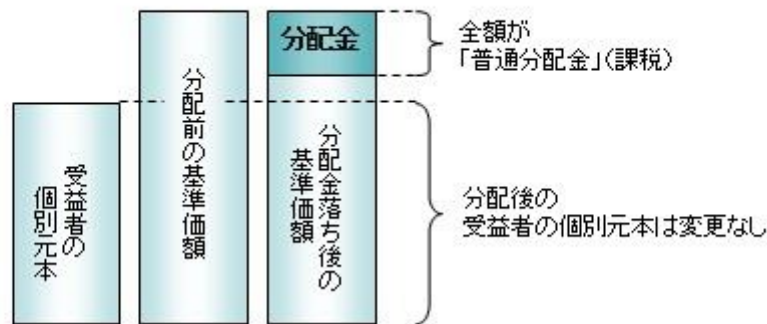
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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。

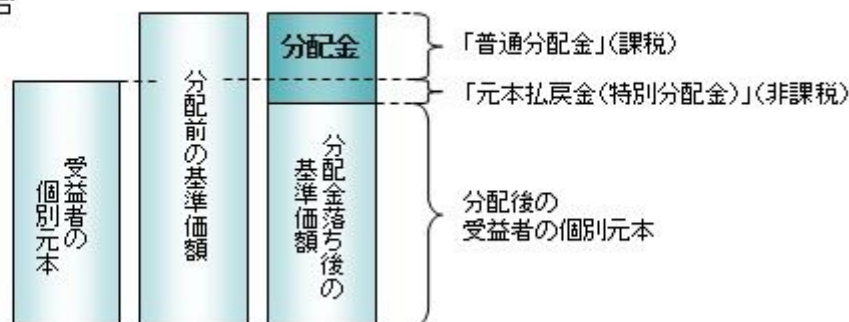
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<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 9月27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2016年 6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	194,635,040	98.64
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		2,684,850	1.36
合計(純資産総額)		197,319,890	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
------	----	-----	----------	---------	---------	---------	---------	---------

日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	25,666,344	2.0353	52,238,709	2.0803	53,393,695	27.06
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	31,051,743	1.6422	50,993,173	1.6856	52,340,818	26.53
日本	親投資信託受益証券	海外新興国債券インデックスLocal(ヘッジなし)マザーファンド	34,205,706	1.0892	37,256,855	1.1337	38,779,008	19.65
日本	親投資信託受益証券	海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし)マザーファンド	31,056,455	1.1923	37,028,612	1.2346	38,342,299	19.43
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	4,190,271	1.4307	5,995,021	1.4310	5,996,277	3.04
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	5,411,194	1.0501	5,682,294	1.0687	5,782,943	2.93

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.64
合計	98.64

【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
第17特定期間末 (2016年 6月27日)	191	192	0.8253	0.8273
2015年 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	
2016年 1月末日	206		0.9168	
2月末日	198		0.8755	
3月末日	215		0.9261	
4月末日	213		0.9115	
5月末日	211		0.9027	
6月末日	197		0.8486	

(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
第17特定期間	2015年12月26日～2016年 6月27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
第17特定期間	2015年12月26日～2016年 6月27日	12.54

(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

第17特定期間	2015年12月26日～2016年 6月27日	14,202,130	5,304,043
---------	-------------------------	------------	-----------

(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2016年 6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	24,197,095,500	98.90
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		268,742,473	1.10
合計(純資産総額)		24,465,837,973	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	261,555,000	1.07

(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	163,200	7,367.50	1,202,376,700	5,052.00	824,486,400	3.37
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	100,100	4,594.04	459,863,749	4,800.00	480,480,000	1.96
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,039,400	756.07	785,862,560	455.90	473,862,460	1.94
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	73,400	6,472.73	475,098,858	5,789.00	424,912,600	1.74
日本	株式	KDDI	情報・通信業	126,500	2,924.70	369,974,550	3,113.00	393,794,500	1.61
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	86,900	4,228.35	367,443,881	4,103.00	356,550,700	1.46
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	118,100	3,945.90	466,010,967	2,572.50	303,812,250	1.24
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	103,700	4,698.48	487,232,914	2,926.00	303,426,200	1.24
日本	株式	ソニー	電気機器	92,600	3,389.40	313,858,881	2,988.00	276,688,800	1.13
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,837,500	238.87	438,925,544	148.30	272,501,250	1.11

日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	96,800	2,366.20	229,048,926	2,766.50	267,797,200	1.09
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	153,900	1,669.38	256,918,980	1,600.00	246,240,000	1.01
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	54,800	5,706.57	312,720,470	4,424.00	242,435,200	0.99
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	54,200	5,284.08	286,397,620	4,281.00	232,030,200	0.95
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	24,000	11,239.13	269,739,352	9,433.00	226,392,000	0.93
日本	株式	ファナック	電気機器	13,400	19,926.58	267,016,180	16,535.00	221,569,000	0.91
日本	株式	花王	化学	37,000	5,889.79	217,922,492	5,929.00	219,373,000	0.90
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	11,700	21,365.95	249,981,700	18,125.00	212,062,500	0.87
日本	株式	キーエンス	電気機器	3,000	59,655.08	178,965,263	69,140.00	207,420,000	0.85
日本	株式	キヤノン	電気機器	70,700	3,726.82	263,486,338	2,912.50	205,913,750	0.84
日本	株式	三菱地所	不動産業	96,000	2,529.35	242,817,610	1,873.00	179,808,000	0.73
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	52,500	4,651.71	244,215,000	3,367.00	176,767,500	0.72
日本	株式	三菱商事	卸売業	97,200	2,204.54	214,281,583	1,788.00	173,793,600	0.71
日本	株式	三菱電機	電気機器	140,000	1,276.91	178,768,400	1,208.00	169,120,000	0.69
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	183,100	1,214.51	222,378,601	917.90	168,067,490	0.69
日本	株式	ダイキン工業	機械	19,100	8,005.36	152,902,490	8,514.00	162,617,400	0.66
日本	株式	三井不動産	不動産業	69,000	3,227.92	222,727,000	2,331.50	160,873,500	0.66
日本	株式	村田製作所	電気機器	13,800	16,614.20	229,276,002	11,380.00	157,044,000	0.64
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	46,400	4,336.44	201,210,944	3,269.00	151,681,600	0.62
日本	株式	信越化学工業	化学	24,600	6,867.14	168,931,742	5,962.00	146,665,200	0.60

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.29
		建設業	3.30
		食料品	5.34
		繊維製品	0.72
		パルプ・紙	0.26
		化学	6.17
		医薬品	5.97
		石油・石炭製品	0.50
		ゴム製品	0.83
		ガラス・土石製品	0.87
		鉄鋼	1.16
		非鉄金属	0.82
		金属製品	0.61
		機械	4.64
		電気機器	11.68
		輸送用機器	8.89
精密機器	1.57		
その他製品	1.61		
電気・ガス業	1.96		

	陸運業	4.71
	海運業	0.22
	空運業	0.63
	倉庫・運輸関連業	0.21
	情報・通信業	8.71
	卸売業	4.16
	小売業	5.07
	銀行業	7.04
	証券、商品先物取引業	0.90
	保険業	2.12
	その他金融業	1.20
	不動産業	2.71
	サービス業	3.93
合 計		98.90

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09月	買建	21	日本円	277,251,340	261,555,000	1.07

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

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

以下の運用状況は2016年 6月30日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
出資金	アメリカ	5,779,426	0.01
株式	アメリカ	39,112,992,091	59.15
	カナダ	2,522,975,906	3.82
	モーリシャス	3,327,656	0.01
	ドイツ	2,268,425,601	3.43
	イタリア	450,626,056	0.68
	フランス	2,271,752,523	3.44
	オランダ	1,047,787,933	1.58
	スペイン	773,498,875	1.17

	ベルギー	384,932,761	0.58
	オーストリア	44,949,721	0.07
	ルクセンブルク	67,398,714	0.10
	フィンランド	253,255,268	0.38
	アイルランド	1,109,596,849	1.68
	ポルトガル	36,436,197	0.06
	イギリス	4,700,845,219	7.11
	スイス	2,622,360,969	3.97
	スウェーデン	709,175,751	1.07
	ノルウェー	167,595,082	0.25
	デンマーク	505,870,610	0.76
	ケイマン	142,041,389	0.21
	オーストラリア	1,638,151,704	2.48
	バミューダ	102,814,933	0.16
	ニュージーランド	40,763,263	0.06
	香港	668,296,389	1.01
	シンガポール	464,873,706	0.70
	イスラエル	178,124,940	0.27
	ジャージー	330,585,074	0.50
	英ヴァージン諸島	19,931,609	0.03
	小計	62,639,386,789	94.73
投資証券	アメリカ	1,441,669,336	2.18
	カナダ	12,037,222	0.02
	フランス	98,808,332	0.15
	イギリス	68,202,694	0.10
	オーストラリア	210,770,375	0.32
	香港	34,338,096	0.05
	シンガポール	31,246,570	0.05
	小計	1,897,072,625	2.87
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,585,128,241	2.40
合計（純資産総額）		66,127,367,081	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	1,169,819,134	1.77
	買建	ドイツ	347,162,211	0.52

(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		525,882,000	0.80

(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	120,402	12,189.94	1,467,693,638	9,714.70	1,169,669,791	1.77
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	90,241	8,543.84	771,004,885	9,515.05	858,648,403	1.30
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	163,184	5,434.25	886,783,610	5,201.07	848,731,635	1.28
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	59,871	10,356.97	620,082,261	12,280.25	735,230,866	1.11
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	8,685	61,815.09	536,864,123	73,642.39	639,584,209	0.97
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	202,713	3,035.86	615,408,399	3,143.90	637,309,502	0.96
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	49,790	10,585.86	527,070,434	11,748.20	584,943,157	0.88
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	133,607	3,493.74	466,788,592	4,377.79	584,903,576	0.88
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	69,293	7,913.19	548,328,995	7,853.98	544,226,009	0.82
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	58,799	7,937.76	466,732,884	8,635.17	507,739,837	0.77
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	104,740	5,612.39	587,842,111	4,833.68	506,279,926	0.77
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	79,680	6,553.84	522,210,404	6,298.09	501,831,971	0.76
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	88,517	4,774.51	422,625,770	5,666.22	501,557,203	0.76
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	133,910	3,495.68	468,106,948	3,602.87	482,461,540	0.73
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	6,762	72,229.07	488,412,974	70,401.76	476,056,702	0.72
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	6,340	74,057.59	469,525,122	71,542.00	453,576,298	0.69
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	40,941	9,391.54	384,499,147	10,642.95	435,733,106	0.66
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	49,493	9,432.35	466,835,758	8,379.33	414,718,303	0.63
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	15,268	27,718.02	423,198,868	26,708.79	407,789,867	0.62
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	89,162	4,404.71	392,733,570	4,573.32	407,766,394	0.62

アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	25,870	14,158.16	366,271,771	14,625.56	378,363,475	0.57
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	27,480	12,823.40	352,387,147	13,107.64	360,198,131	0.54
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	60,223	5,443.79	327,841,407	5,871.01	353,570,166	0.53
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア	52,767	6,374.92	336,385,603	6,580.06	347,210,311	0.53
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	33,638	9,244.52	310,967,177	10,148.98	341,391,531	0.52
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	102,522	3,577.95	366,818,919	3,285.91	336,878,711	0.51
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	33,723	11,595.89	391,048,493	9,980.21	336,562,683	0.51
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	31,341	10,532.19	330,089,565	10,612.07	332,593,174	0.50
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	41,672	7,921.68	330,112,599	7,897.31	329,096,844	0.50
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	109,130	3,011.53	328,648,808	2,908.23	317,375,860	0.48

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
出資金			0.01
株式	国外	エネルギー	7.39
		素材	4.58
		資本財	7.02
		商業・専門サービス	0.91
		運輸	1.79
		自動車・自動車部品	1.41
		耐久消費財・アパレル	1.70
		消費者サービス	1.82
		メディア	2.77
		小売	3.90
		食品・生活必需品小売り	2.14
		食品・飲料・タバコ	6.61
		家庭用品・パーソナル用品	2.35
		ヘルスケア機器・サービス	3.92
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.52
		銀行	7.76
		各種金融	3.61
		保険	3.84
		不動産	0.63
		ソフトウェア・サービス	8.51
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.43		
電気通信サービス	3.35		

		公益事業	3.66
		半導体・半導体製造装置	2.10
投資証券			2.87
合計			97.60

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI1609	買建	110	米ドル	11,499,975	1,183,462,427	11,367,400	1,169,819,134	1.77
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1609	買建	110	ユーロ	2,988,300	341,831,637	3,034,900	347,162,211	0.52

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	2,500,000.00	257,201,600	257,070,000	0.39
	ユーロ	買建	2,350,000.00	283,318,695	268,812,000	0.41

(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MSCIエマージング(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2016年 6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	330,953,712	3.88
	ブラジル	596,177,092	6.99
	チリ	101,694,864	1.19
	コロンビア	39,702,881	0.47
	ペルー	33,615,572	0.39
	オランダ	36,124,584	0.42
	トルコ	105,928,145	1.24
	チェコ	13,993,646	0.16
	ハンガリー	22,526,230	0.26
	ポーランド	93,856,980	1.10

	ロシア	313,646,683	3.68
	ケイマン	496,560,609	5.82
	バミューダ	55,742,653	0.65
	香港	405,225,736	4.75
	マレーシア	245,771,250	2.88
	タイ	184,348,258	2.16
	フィリピン	131,580,619	1.54
	インドネシア	228,646,717	2.68
	韓国	1,212,102,335	14.21
	台湾	993,028,220	11.65
	中国	1,181,950,422	13.86
	インド	695,560,519	8.16
	カタール	76,133,330	0.89
	エジプト	13,992,180	0.16
	南アフリカ	534,013,841	6.26
	アラブ首長国連邦	74,624,231	0.88
	小計	8,217,501,309	96.37
投資信託受益証券	アメリカ	29,510,986	0.35
投資証券	メキシコ	9,959,271	0.12
	トルコ	5,846,666	0.07
	南アフリカ	28,188,980	0.33
	小計	43,994,917	0.52
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		236,407,770	2.77
合計（純資産総額）		8,527,414,982	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	212,431,967	2.49

(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 （％）
中国	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	123,400	2,074.05	255,938,561	2,286.02	282,095,362	3.31
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	2,185	112,268.80	245,307,328	125,081.60	273,303,296	3.20

台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	538,355	457.91	246,523,521	505.61	272,203,055	3.19
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP-ADR	ソフトウェア・サービス	21,740	8,143.94	177,049,453	8,031.09	174,596,036	2.05
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	133,700	1,113.17	148,831,764	1,162.90	155,479,997	1.82
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	9,410	14,115.09	132,823,040	15,271.27	143,702,651	1.69
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,836,920	61.26	112,531,924	66.69	122,518,523	1.44
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	ソフトウェア・サービス	5,800	17,527.50	101,659,541	16,919.43	98,132,712	1.15
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA - H	銀行	1,636,575	51.31	83,982,810	56.22	92,012,174	1.08
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	316,150	236.59	74,798,561	262.35	82,941,953	0.97
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	40,140	1,847.09	74,142,293	1,800.58	72,275,301	0.85
中国	株式	BANK OF CHINA LTD - H	銀行	1,784,000	39.51	70,494,403	40.17	71,677,195	0.84
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	32,575	1,783.98	58,113,149	1,910.28	62,227,420	0.73
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	102,000	599.19	61,117,829	607.49	61,964,878	0.73
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	銀行	64,033	1,002.91	64,219,720	945.74	60,558,787	0.71
ロシア	株式	GAZPROM PAO-SPON ADR	エネルギー	132,700	495.82	65,795,364	444.57	58,994,598	0.69
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	61,000	795.90	48,550,262	903.54	55,116,538	0.65
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	114,000	445.53	50,791,104	445.53	50,791,104	0.60
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PRF	銀行	60,442	841.93	50,888,441	799.77	48,340,158	0.57
香港	株式	CNOOC LTD	エネルギー	388,000	117.88	45,737,983	123.98	48,104,628	0.56
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	電気通信サービス	705,800	64.94	45,839,028	63.05	44,502,384	0.52
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	28,946	1,496.56	43,319,701	1,479.35	42,821,468	0.50
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	415	92,556.80	38,411,072	101,248.00	42,017,920	0.49
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON-ADR	エネルギー	9,535	4,217.25	40,211,496	4,270.76	40,721,744	0.48
韓国	株式	NAVER CORP	ソフトウェア・サービス	628	60,659.19	38,093,977	63,884.79	40,119,654	0.47
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	ソフトウェア・サービス	10,450	3,860.80	40,345,381	3,829.43	40,017,617	0.47
中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	539,300	67.49	36,399,190	72.39	39,045,104	0.46
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車部品	3,130	12,096.00	37,860,480	12,454.40	38,982,272	0.46
メキシコ	株式	FOMENTO ECONOMICO MEXICANO-UBD	食品・飲料・タバコ	38,900	918.21	35,718,544	938.87	36,522,401	0.43
南アフリカ	株式	MTN GROUP LTD	電気通信サービス	36,215	882.95	31,976,382	1,004.30	36,370,989	0.43

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	7.29

	素材	6.21
	資本財	4.10
	商業・専門サービス	0.15
	運輸	1.63
	自動車・自動車部品	3.51
	耐久消費財・アパレル	1.21
	消費者サービス	0.88
	メディア	2.35
	小売	2.12
	食品・生活必需品小売り	1.91
	食品・飲料・タバコ	4.70
	家庭用品・パーソナル用品	1.63
	ヘルスケア機器・サービス	0.70
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.90
	銀行	16.42
	各種金融	2.94
	保険	3.13
	不動産	2.32
	ソフトウェア・サービス	9.83
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.20
	電気通信サービス	6.46
	公益事業	3.03
	半導体・半導体製造装置	4.76
投資信託受益証券		0.35
投資証券		0.52
合 計		97.23

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	MINMSC1E1609	買建	50	米ドル	2,010,090	206,858,361	2,064,250	212,431,967	2.49

(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。

日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2016年 6月30日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	26,792,168,368	78.33
地方債証券	日本	2,198,949,398	6.43
特殊債券	日本	3,157,554,796	9.23
社債券	日本	1,707,559,000	4.99
	オーストラリア	302,839,797	0.89
	小計	2,010,398,797	5.88
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		46,016,492	0.13
合計（純資産総額）		34,205,087,851	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（％）	償還期限	投資比率（％）
日本	国債証券	第107回利付国債（5年）	705,000,000	100.39	707,791,800	100.74	710,231,100	0.200	2017/12/20	2.08
日本	国債証券	第303回利付国債（10年）	581,000,000	105.33	611,973,110	105.51	613,047,960	1.400	2019/9/20	1.79
日本	国債証券	第124回利付国債（5年）	560,000,000	100.25	561,422,400	101.64	569,206,400	0.100	2020/6/20	1.66
日本	国債証券	第123回利付国債（5年）	505,000,000	100.26	506,328,150	101.51	512,670,950	0.100	2020/3/20	1.50
日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	473,000,000	105.21	497,643,300	105.61	499,568,410	1.300	2019/12/20	1.46
日本	国債証券	第299回利付国債（10年）	410,000,000	104.33	427,753,000	104.35	427,859,600	1.300	2019/3/20	1.25
日本	国債証券	第29回利付国債（30年）	276,000,000	123.77	341,621,760	150.80	416,208,000	2.400	2038/9/20	1.22
日本	国債証券	第313回利付国債（10年）	370,000,000	106.63	394,531,000	107.64	398,279,100	1.300	2021/3/20	1.16
日本	国債証券	第88回利付国債（20年）	300,000,000	120.43	361,291,800	125.66	376,995,000	2.300	2026/6/20	1.10
日本	国債証券	第140回利付国債（20年）	280,000,000	113.39	317,506,000	128.71	360,390,800	1.700	2032/9/20	1.05
日本	国債証券	第120回利付国債（5年）	330,000,000	100.66	332,181,300	101.63	335,405,400	0.200	2019/9/20	0.98
日本	国債証券	第125回利付国債（5年）	325,000,000	100.27	325,877,850	101.77	330,759,000	0.100	2020/9/20	0.97
日本	国債証券	第60回利付国債（20年）	295,000,000	109.22	322,199,000	111.35	328,485,450	1.400	2022/12/20	0.96
日本	国債証券	第292回利付国債（10年）	306,000,000	104.02	318,325,680	103.42	316,486,620	1.700	2018/3/20	0.93
日本	国債証券	第91回利付国債（20年）	250,000,000	120.34	300,850,000	126.19	315,495,000	2.300	2026/9/20	0.92
日本	国債証券	第113回利付国債（20年）	240,000,000	119.77	287,464,800	129.98	311,954,400	2.100	2029/9/20	0.91

日本	国債証券	第106回利付国債(5年)	310,000,000	100.36	311,116,000	100.62	311,925,100	0.200	2017/9/20	0.91
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	300,000,000	100.26	300,807,000	101.41	304,251,000	0.100	2019/12/20	0.89
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	208,000,000	124.06	258,046,880	142.62	296,668,320	2.400	2034/3/20	0.87
日本	国債証券	第137回利付国債(20年)	220,000,000	113.55	249,814,400	128.36	282,400,800	1.700	2032/6/20	0.83
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	260,000,000	105.14	273,389,700	107.97	280,732,400	0.800	2023/6/20	0.82
日本	国債証券	第43回利付国債(30年)	195,000,000	108.68	211,943,550	143.52	279,865,950	1.700	2044/6/20	0.82
日本	国債証券	第2回利付国債(40年)	165,000,000	121.23	200,042,700	165.72	273,449,550	2.200	2049/3/20	0.80
日本	国債証券	第149回利付国債(20年)	215,000,000	108.62	233,543,750	126.94	272,925,300	1.500	2034/6/20	0.80
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	250,000,000	101.04	252,610,000	106.20	265,502,500	0.400	2025/6/20	0.78
日本	国債証券	第50回利付国債(20年)	237,000,000	109.89	260,458,260	110.49	261,873,150	1.900	2021/3/22	0.77
日本	国債証券	第141回利付国債(20年)	195,000,000	115.87	225,964,200	129.04	251,645,550	1.700	2032/12/20	0.74
日本	国債証券	第34回利付国債(30年)	160,000,000	120.16	192,260,800	150.82	241,312,000	2.200	2041/3/20	0.71
日本	国債証券	第301回利付国債(10年)	223,000,000	105.36	234,972,870	105.39	235,028,620	1.500	2019/6/20	0.69
日本	国債証券	第290回利付国債(10年)	226,000,000	103.31	233,482,860	102.91	232,581,120	1.400	2018/3/20	0.68

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	78.33
地方債証券	6.43
特殊債券	9.23
社債券	5.88
合計	99.87

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2016年6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	66,633,997,267	42.63
	カナダ	3,222,664,625	2.06
	メキシコ	1,414,525,803	0.90
	ドイツ	11,617,310,181	7.43
	イタリア	14,947,650,007	9.56
	フランス	15,401,064,145	9.85
	オランダ	3,728,793,483	2.39
	スペイン	8,380,154,519	5.36
	ベルギー	4,101,019,927	2.62
	オーストリア	2,395,155,737	1.53
	フィンランド	948,490,317	0.61
	アイルランド	1,248,732,924	0.80
	イギリス	12,189,013,630	7.80
	スイス	434,115,880	0.28
	スウェーデン	775,937,625	0.50
	ノルウェー	394,421,747	0.25
	デンマーク	1,068,632,891	0.68
	ポーランド	891,399,943	0.57
	オーストラリア	2,947,520,256	1.89
	シンガポール	568,914,088	0.36
マレーシア	738,812,099	0.47	
南アフリカ	709,100,474	0.45	
	小計	154,757,427,568	99.00
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,562,722,652	1.00
合計（純資産総額）		156,320,150,220	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		98,830,860	0.06
	売建		16,876,180	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	利率 （％）	償還期限	投資 比率 （％）
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,490,000	14,054.41	1,614,852,709	14,022.29	1,611,161,291	8.000	2021/11/15	1.03

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,030,000	11,278.93	1,356,856,001	11,321.70	1,362,001,468	3.625	2020/2/15	0.87
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,240,000	11,154.41	1,253,756,235	11,185.83	1,257,287,810	3.375	2019/11/15	0.80
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,950,000	13,810.03	1,097,898,148	13,569.64	1,078,787,038	8.750	2020/8/15	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,500,000	11,248.54	1,068,611,812	11,312.06	1,074,645,714	3.500	2020/5/15	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,400,000	11,156.89	1,048,747,770	11,040.31	1,037,789,463	3.750	2018/11/15	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,300,000	10,398.73	967,082,252	10,784.64	1,002,972,115	2.000	2023/2/15	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,300,000	10,566.76	982,709,297	10,731.58	998,037,260	2.000	2020/7/31	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,550,000	11,389.04	973,763,750	11,511.44	984,228,828	3.625	2021/2/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,850,000	11,185.83	989,946,363	11,037.90	976,854,281	4.000	2018/8/15	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,950,000	10,442.14	934,572,341	10,496.82	939,465,390	1.500	2018/12/31	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,600,000	11,051.56	950,434,953	10,774.19	926,580,736	4.750	2017/8/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,800,000	10,649.57	937,162,779	10,500.83	924,073,913	2.750	2017/5/31	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,340,000	10,672.89	890,119,240	10,633.49	886,833,678	2.250	2018/7/31	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,150,000	10,182.94	829,909,977	10,623.04	865,778,212	1.750	2023/5/15	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,950,000	10,931.77	869,076,155	10,770.17	856,228,887	3.500	2018/2/15	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	10,490.64	839,251,632	10,606.16	848,492,950	1.750	2019/9/30	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,550,000	11,086.14	837,003,610	10,932.57	825,409,754	3.875	2018/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,400,000	10,760.52	796,278,989	10,657.61	788,663,649	2.750	2018/2/28	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	10,698.62	748,903,405	10,647.16	745,301,555	2.375	2018/6/30	0.48
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,530,000	16,029.66	726,143,677	16,318.96	739,248,981	5.250	2029/11/1	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,800,000	11,034.68	750,358,617	10,809.56	735,050,755	4.250	2017/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	10,532.99	737,309,951	10,456.62	731,963,455	1.875	2017/9/30	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	10,746.85	634,064,689	12,163.47	717,645,296	3.125	2044/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,350,000	11,840.27	633,454,867	13,337.29	713,545,378	3.625	2043/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,400,000	10,584.45	677,405,075	10,834.49	693,407,580	2.125	2021/6/30	0.44
イギリス	国債証券	UK TREASURY	3,150,000	19,000.08	598,502,536	21,919.43	690,462,299	4.500	2042/12/7	0.44
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,650,000	12,323.19	696,260,304	12,006.75	678,381,804	4.250	2017/7/4	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	10,241.95	594,033,502	11,619.98	673,959,197	2.875	2043/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,170,000	10,740.42	662,684,361	10,619.02	655,193,881	2.750	2017/12/31	0.42

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.00
合計	99.00

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	買建	420,000.00	43,024,800	43,218,000	0.03
	メキシコペソ	買建	1,754,000.00	9,541,760	9,752,240	0.01

ユーロ	買建	251,000.00	28,445,830	28,711,890	0.02
英ポンド	買建	79,000.00	10,768,490	10,933,600	0.01
豪ドル	買建	81,000.00	6,135,750	6,215,130	0.00
米ドル	売建	80,000.00	8,230,400	8,231,200	0.01
ユーロ	売建	14,000.00	1,600,760	1,601,460	0.00
南アフリカランド	売建	1,012,000.00	7,033,400	7,043,520	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

海外新興国債券インデックスLocal(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2016年6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	204,305,879	9.51
	ブラジル	225,522,561	10.49
	コロンビア	149,852,835	6.97
	ペルー	40,310,634	1.88
	トルコ	208,083,979	9.68
	ハンガリー	108,995,968	5.07
	ポーランド	204,283,864	9.51
	ロシア	106,199,816	4.94
	ルーマニア	57,797,722	2.69
	マレーシア	202,083,934	9.40
	タイ	165,691,326	7.71
	フィリピン	11,388,000	0.53
	インドネシア	212,277,322	9.88
	南アフリカ	202,913,319	9.44
	小計	2,099,707,159	97.70
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		49,366,201	2.30
合計(純資産総額)		2,149,073,360	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		19,334,445	0.90
	売建		3,553,185	0.17

(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	4,850,000	758.03	36,764,902	779.70	37,815,609	10.500	2026/12/21	1.76
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	1,200,000	2,969.09	35,629,179	2,974.85	35,698,237	10.000	2021/1/1	1.66
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	815,000,000	4.00	32,650,299	4.11	33,509,276	10.000	2024/7/24	1.56
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	9,720,000	323.88	31,481,340	321.66	31,265,758	3.650	2021/12/17	1.45
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	3,450,000,000	0.81	28,208,925	0.82	28,624,782	8.375	2024/3/15	1.33
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	8,950,000	313.40	28,049,897	311.60	27,888,546	3.875	2019/6/13	1.30
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	1,160,000	2,350.46	27,265,390	2,385.91	27,676,649		2019/1/1	1.29
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,710,000	712.54	26,435,249	712.34	26,427,874	10.000	2024/12/5	1.23
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	6,380,000	385.02	24,564,476	381.29	24,326,609	4.875	2029/6/22	1.13
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	585,000,000	3.97	23,226,451	4.04	23,648,540	11.000	2020/7/24	1.10
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	770,000	2,897.79	22,313,016	2,906.50	22,380,060	10.000	2023/1/1	1.04
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,610,000	607.51	21,931,261	602.48	21,749,545	8.500	2018/12/13	1.01
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	810,000	2,629.30	21,297,338	2,665.39	21,589,684		2018/1/1	1.00
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	2,540,000,000	0.82	20,968,022	0.83	21,304,385	8.375	2026/9/15	0.99
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	2,350,000,000	0.85	20,133,743	0.87	20,514,856	9.000	2029/3/15	0.95
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	800,000	2,486.52	19,892,231	2,521.02	20,168,191		2018/7/1	0.94
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	690,000	2,829.52	19,523,692	2,861.78	19,746,320	10.000	2025/1/1	0.92
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	2,300,000,000	0.82	18,902,856	0.83	19,130,363	8.375	2034/3/15	0.89
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	5,800,000	330.00	19,140,272	326.91	18,961,078	3.625	2023/6/16	0.88
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,250,000	583.53	18,964,953	581.89	18,911,471	6.500	2021/6/10	0.88
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	530,000,000	3.42	18,153,336	3.52	18,676,071	7.500	2026/8/26	0.87
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	5,370,000	344.99	18,526,484	341.30	18,328,301	3.850	2025/12/12	0.85
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,790,000	617.61	17,231,554	643.15	17,943,983	8.750	2048/2/28	0.83
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	495,000,000	3.42	16,952,175	3.52	17,443,708	7.000	2022/5/4	0.81
トルコ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	480,000	3,455.06	16,584,330	3,540.62	16,995,014	8.500	2019/7/10	0.79
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	660,000	2,567.91	16,948,216	2,573.46	16,984,876	2.000	2021/4/25	0.79
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	620,000	2,664.99	16,522,998	2,674.82	16,583,917	3.250	2025/7/25	0.77

ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	650,000	2,544.98	16,542,415	2,545.89	16,548,305	1.500	2020/4/25	0.77
トルコ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	450,000	3,524.25	15,859,157	3,631.31	16,340,925	9.400	2020/7/8	0.76
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	750,000	2,085.89	15,644,195	2,127.20	15,954,030		2020/1/1	0.74

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.70
合計	97.70

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	53,000.00	5,438,120	5,453,500	0.25
	メキシコペソ	買建	162,000.00	901,319	900,720	0.04
	ブラジルレアル	買建	112,704.03	3,537,647	3,599,765	0.17
	トルコリラ	買建	49,000.00	1,745,527	1,744,400	0.08
	ポーランドズロチ	買建	218,000.00	5,648,380	5,639,660	0.26
	ロシアルーブル	買建	1,240,000.00	1,957,464	1,996,400	0.09
	米ドル	売建	34,530.48	3,537,647	3,553,185	0.17

(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

2016年6月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額.....8,486円

純資産総額.....1.97億円

※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)

2016年2月	2016年3月	2016年4月	2016年5月	2016年6月	直近1年間累計	設定来累計
20円	20円	20円	20円	20円	240円	2,380円

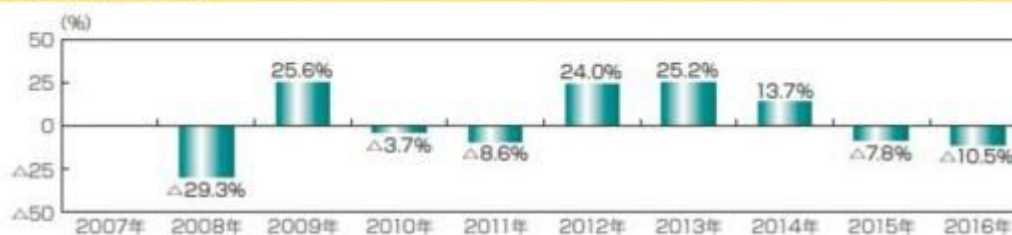
主要な資産の状況

組入資産	投資対象	比率 ^{※1}	組入上位銘柄	国・地域名	比率 ^{※2}
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	日本株式	2.9%	トヨタ自動車	日本	3.4%
			日本電信電話	日本	2.0%
			三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	1.9%
			ソフトバンクグループ	日本	1.7%
			KDDI	日本	1.6%
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI(ヘッジなし) マザーファンド	海外先進国株式	26.5%	APPLE INC	アメリカ	1.8%
			EXXON MOBIL CORP	アメリカ	1.3%
			MICROSOFT CORP	アメリカ	1.3%
			JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	1.1%
			AMAZON.COM INC	アメリカ	1.0%
海外新興国株式インデックス MSCI Emerging(ヘッジなし) マザーファンド	新興国株式	19.4%	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	3.3%
			SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	3.2%
			TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	3.2%
			ALIBABA GROUP HOLDING-SP-ADR	ケイマン諸島	2.0%
			CHINA MOBILE LTD	香港	1.8%
日本債券インデックス マザーファンド	日本債券	3.0%	第107回利付国債(5年)	日本	2.1%
			第303回利付国債(10年)	日本	1.8%
			第124回利付国債(5年)	日本	1.7%
			第123回利付国債(5年)	日本	1.5%
			第305回利付国債(10年)	日本	1.5%
海外債券インデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外先進国債券	27.1%	US TREASURY N/B(クーポン8%)	アメリカ	1.0%
			US TREASURY N/B(クーポン3.625%)	アメリカ	0.9%
			US TREASURY N/B(クーポン3.375%)	アメリカ	0.8%
			US TREASURY N/B(クーポン8.75%)	アメリカ	0.7%
			US TREASURY N/B(クーポン3.5%)	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	19.7%	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA(クーポン10.5%)	南アフリカ	1.8%
			NOTA DO TESOURO NACIONAL(クーポン10%)	ブラジル	1.7%
			TITULOS DE TESORERIA B(クーポン10%)	コロンビア	1.6%
			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	1.3%
現金その他		1.4%			

※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。

※2016年は、2016年6月末までの騰落率です。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

(2) コースの選択

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

＜分配金再投資コース＞

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

＜分配金受取りコース＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

(3) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(4) 取扱時間

原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

(5) 取得申込不可日

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

(6) 申込金額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。

(7) 申込単位

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

＜委託会社の照会先＞

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(8) 申込代金の支払い

取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。

(9) 受付の中止および取消

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少など、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。

(10) 償還乗換

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

(11) 乗換優遇

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

2【換金（解約）手続等】

<解約請求による換金>

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

(3) 解約請求不可日

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

(4) 解約制限

ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(5) 解約価額

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

・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(6) 手取額

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

税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(7) 解約単位

1口単位

販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(9) 受付の中止および取消

・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少など、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。

・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

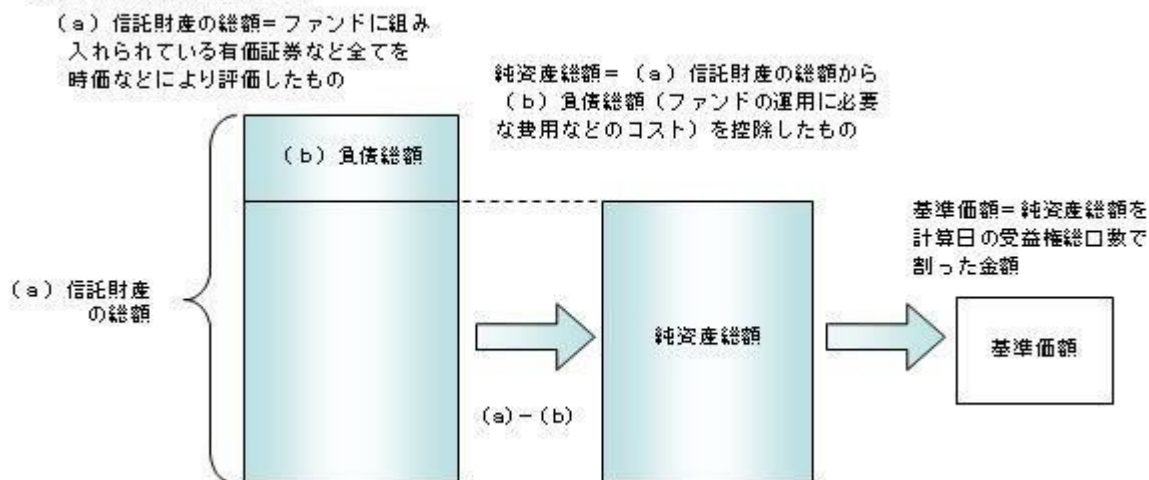
3【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

基準価額の算出

- ・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。
- ・基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

- ・信託財産に属する資産については、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価します。

<主な資産の評価方法>

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。

外国株式

原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場で評価します。

公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日^{*}における以下のいずれかの価額で評価します。

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

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

* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2)【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

平成30年12月25日までとします（平成20年 3月31日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

毎月26日から翌月25日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

（５）【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
 - イ) 受益者の解約により純資産総額が10億円を下回ることとなった場合
 - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
 - 2) この場合、委託会社は書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）
 - 3) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
 - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、書面決議が困難な場合
 - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。）
- 二) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき

- 4) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

- ・ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日まで）から受益者に支払います。
- ・ 償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

信託約款の変更など

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

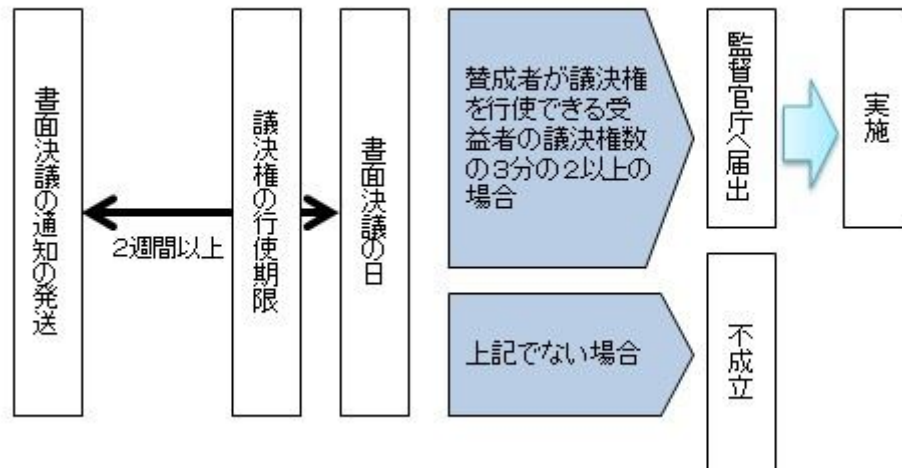
書面決議

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

面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときは、書面決議を行いません。

- 5) 当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、併合にかかる他のファンドにおいて併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
- 6) 当ファンドは、受益者からの換金請求に対して、投資信託契約の一部を解約することにより応じることができると、受益者の保護に欠けるおそれがないものとして、書面決議において反対した受益者からの買取請求は受け付けません。

<書面決議の主な流れ>



公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

なお、やむを得ない事由によって公告を電子公告によって行なうことができない場合には、公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

- ・委託会社は、年2回（6月、12月）および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。
- ・交付運用報告書は、原則として知れている受益者に対して交付されます。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

関係法人との契約について

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

他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は、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12月26日から平成28年6月27日までの特定期間の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【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12月25日現在	当期 平成28年 6月27日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,550,547	3,237,037
親投資信託受益証券	211,362,324	189,395,020
未収入金	143,327	-
未収利息	5	-
流動資産合計	215,056,203	192,632,057
資産合計	215,056,203	192,632,057
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	447,146	464,942
未払解約金	144,497	-
未払受託者報酬	9,697	9,975
未払委託者報酬	194,135	199,756
未払利息	-	5
その他未払費用	223,453	99,883
流動負債合計	1,018,928	774,561
負債合計	1,018,928	774,561
純資産の部		
元本等		
元本	223,573,148	232,471,235
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	9,535,873	40,613,739
（分配準備積立金）	57,004,119	55,540,985
元本等合計	214,037,275	191,857,496
純資産合計	214,037,275	191,857,496
負債純資産合計	215,056,203	192,632,057

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期		当期	
	自	平成27年 6月26日 至 平成27年12月25日	自	平成27年12月26日 至 平成28年 6月27日
営業収益				
受取利息		873		170
有価証券売買等損益		23,260,508		26,315,188
営業収益合計		23,259,635		26,315,018
営業費用				
支払利息		-		300
受託者報酬		60,093		56,383
委託者報酬		1,203,150		1,128,753
その他費用		111,276		104,389
営業費用合計		1,374,519		1,289,825
営業利益又は営業損失（ ）		24,634,154		27,604,843
経常利益又は経常損失（ ）		24,634,154		27,604,843
当期純利益又は当期純損失（ ）		24,634,154		27,604,843
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（ ）		136,343		174,623
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		18,030,585		9,535,873
剰余金増加額又は欠損金減少額		210,303		504,389
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		504,389
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		175,846		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		620,401		1,384,758
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		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		1,384,758
分配金		2,658,549		2,767,277
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		9,535,873		40,613,739

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎月26日から翌月25日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当特定期間は平成27年12月26日から平成28年 6月27日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

		前期 平成27年12月25日現在	当期 平成28年 6月27日現在
1.	期首元本額	223,036,012円	223,573,148円
	期中追加設定元本額	9,228,365円	14,202,130円
	期中一部解約元本額	8,691,229円	5,304,043円
2.	受益権の総数	223,573,148口	232,471,235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	9,535,873円	40,613,739円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 平成27年 6月26日 至 平成27年12月25日		当期 自 平成27年12月26日 至 平成28年 6月27日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
自 平成27年 6月26日 至 平成27年 7月27日		自 平成27年12月26日 至 平成28年 1月25日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	521,925円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 240,433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	10,761,195円	C 信託約款に定める収益調整金 13,532,644円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	57,841,229円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 56,912,607円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	69,124,349円	E 分配対象収益 (A+B+C+D) 70,685,684円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,160円	F 分配対象収益(1万口当たり) 3,145円
G	分配金額	437,490円	G 分配金額 449,427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 7月28日 至 平成27年 8月25日		自 平成28年 1月26日 至 平成28年 2月25日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	392,162円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 369,834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	11,441,693円	C	信託約款に定める収益調整金	13,974,852円
D	信託約款に定める分配準備積立金	57,657,406円	D	信託約款に定める分配準備積立金	56,648,490円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	69,491,261円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	70,993,176円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,158円	F	分配対象収益(1万口当たり)	3,142円
G	分配金額	440,079円	G	分配金額	451,890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 8月26日			自 平成28年 2月26日	
	至 平成27年 9月25日			至 平成28年 3月25日	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	538,983円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	575,748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	11,869,368円	C	信託約款に定める収益調整金	16,142,890円
D	信託約款に定める分配準備積立金	57,504,337円	D	信託約款に定める分配準備積立金	56,562,733円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	69,912,688円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	73,281,371円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,162円	F	分配対象収益(1万口当たり)	3,147円
G	分配金額	442,115円	G	分配金額	465,682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 9月26日			自 平成28年 3月26日	
	至 平成27年10月26日			至 平成28年 4月25日	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	556,095円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	548,814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	12,313,462円	C	信託約款に定める収益調整金	16,573,968円
D	信託約款に定める分配準備積立金	57,589,021円	D	信託約款に定める分配準備積立金	56,633,545円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	70,458,578円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	73,756,327円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,167円	F	分配対象収益(1万口当たり)	3,150円
G	分配金額	444,851円	G	分配金額	468,174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10月27日			自 平成28年 4月26日	
	至 平成27年11月25日			至 平成28年 5月25日	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	318,184円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	433,497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	12,722,986円	C	信託約款に定める収益調整金	16,887,434円
D	信託約款に定める分配準備積立金	57,609,877円	D	信託約款に定める分配準備積立金	56,247,646円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	70,651,047円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	73,568,577円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,162円	F	分配対象収益(1万口当たり)	3,149円
G	分配金額	446,868円	G	分配金額	467,162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11月26日 至 平成27年12月25日		自 平成28年 5月26日 至 平成28年 6月27日	
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	280,687円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	408,068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	13,081,264円	C 信託約款に定める収益調整金	17,162,803円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	57,170,578円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	55,597,859円
E 分配対象収益（A+B+C+D）	70,532,529円	E 分配対象収益（A+B+C+D）	73,168,730円
F 分配対象収益(1万口当たり)	3,154円	F 分配対象収益(1万口当たり)	3,147円
G 分配金額	447,146円	G 分配金額	464,942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27年 6月26日 至 平成27年12月25日	当期 自 平成27年12月26日 至 平成28年 6月27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12月25日現在	当期 平成28年 6月27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	(1)有価証券

	<p>売買目的有価証券</p> <p>重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品 同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>	<p>同左</p>

（有価証券に関する注記）

前期（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

当期（平成28年 6月27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	13,901,047
合計	13,901,047

（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12月25日現在		当期 平成28年 6月27日現在	
1口当たり純資産額	0.9573円	1口当たり純資産額	0.8253円
(1万口当たり純資産額)	(9,573円)	(1万口当たり純資産額)	(8,253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	31,054,706	50,998,038	
	日本債券インデックスマザーファンド	4,222,074	6,040,521	
	海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド	25,666,344	52,238,709	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	5,411,194	5,682,294	
	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	31,138,222	37,126,102	
	海外新興国債券インデックスLocal(ヘッジなし) マザーファンド	34,253,908	37,309,356	
合計		131,746,448	189,395,020	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

当ファンドは、「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」「海外株式インデックスMSCI - KOKUSA I（ヘッジなし）マザーファンド」「海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド」「日本債券インデックスマザーファンド」「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」「海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

（参考）

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

貸借対照表

	平成27年12月25日現在	平成28年 6月27日現在
（単位：円）		
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	77,083,675	150,782,868
株式	26,622,697,820	23,417,541,340
未収配当金	1,559,475	97,523,248
未収利息	128	-
前払金	1,193,000	26,515,000
流動資産合計	26,702,534,098	23,692,362,456
資産合計	26,702,534,098	23,692,362,456
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,731,780	18,334,720
未払金	-	2,502,160
未払解約金	2,760,283	8,444,541
未払利息	-	241
流動負債合計	4,492,063	29,281,662
負債合計	4,492,063	29,281,662
純資産の部		
元本等		
元本	20,794,371,054	22,534,437,913
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,903,670,981	1,128,642,881
元本等合計	26,698,042,035	23,663,080,794
純資産合計	26,698,042,035	23,663,080,794
負債純資産合計	26,702,534,098	23,692,362,456

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</p> <p>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られた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>デリバティブ取引</p> <p>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12月25日現在	平成28年 6月27日現在
1.	期首	平成27年 6月26日	平成27年12月26日
	期首元本額	21,079,556,968円	20,794,371,054円
	期首からの追加設定元本額	1,451,415,159円	3,035,797,717円
	期首からの一部解約元本額	1,736,601,073円	1,295,730,858円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	186,197,827円	233,880,475円
	DCインデックスバランス（株式40）	690,196,784円	832,600,883円
	DCインデックスバランス（株式60）	1,331,104,201円	1,510,872,965円
	DCインデックスバランス（株式80）	1,579,943,425円	1,654,317,998円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,171,430,380円	1,296,825,433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	5,367,718,340円	5,741,871,154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	5,069,553円	5,411,194円
	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産）	23,674,244円	4,150,364円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	64,469,289円	67,090,469円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	50,535,892円	56,561,448円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	74,279,400円	83,325,527円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	94,738,805円	107,845,703円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	6,726,570,406円	7,086,486,959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）	18,048,820円	18,158,754円
	世界アセットバランスファンド25（適格機関投資家向け）	42,002,758円	44,117,367円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	40,249,776円	41,541,362円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	259,528,140円	313,667,912円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	798,737,101円	946,775,402円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,123,403,936円	1,274,629,281円

	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,146,471,977円	1,214,307,263円
	計	20,794,371,054円	22,534,437,913円
2.	受益権の総数	20,794,371,054口	22,534,437,913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	477,285,000円	327,950,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成27年 6月26日 至 平成27年12月25日	自 平成27年12月26日 至 平成28年 6月27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12月25日現在	平成28年 6月27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	(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。	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

(平成28年 6月27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	5,814,062,717
合計	5,814,062,717

(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

（平成28年 6月27日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	240,085,000	-	221,760,000	18,325,000
合計		240,085,000	-	221,760,000	18,325,000

（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12月25日現在		平成28年 6月27日現在	
1口当たり純資産額	1.2839円	1口当たり純資産額	1.0501円
(1万口当たり純資産額)	(12,839円)	(1万口当たり純資産額)	(10,501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	260.00	1,560,000	
日本水産	16,700	539.00	9,001,300	
マルハニチロ	2,900	2,878.00	8,346,200	

サカタのタネ	2,100	2,202.00	4,624,200
ホクト	1,500	1,900.00	2,850,000
ホクリヨウ	100	820.00	82,000
住石ホールディングス	4,400	82.00	360,800
日鉄鉱業	4,000	332.00	1,328,000
三井松島産業	10,000	94.00	940,000
国際石油開発帝石	76,100	762.30	58,011,030
日本海洋掘削	400	2,156.00	862,400
石油資源開発	2,300	1,991.00	4,579,300
K&Oエナジーグループ	1,000	1,294.00	1,294,000
ショーボンドホールディングス	1,500	4,480.00	6,720,000
ミライト・ホールディングス	4,500	955.00	4,297,500
サンヨーホームズ	400	474.00	189,600
ダイセキ環境ソリューション	300	1,033.00	309,900
安藤・間	9,700	549.00	5,325,300
東急建設	4,700	907.00	4,262,900
コムシスホールディングス	6,200	1,607.00	9,963,400
ミサワホーム	1,700	685.00	1,164,500
高松コンストラクショングループ	1,100	2,359.00	2,594,900
東建コーポレーション	600	7,990.00	4,794,000
ソネック	200	559.00	111,800
ヤマウラ	700	507.00	354,900
大成建設	75,000	805.00	60,375,000
大林組	43,400	1,035.00	44,919,000
清水建設	44,000	923.00	40,612,000
飛島建設	11,800	166.00	1,958,800
長谷工コーポレーション	16,900	988.00	16,697,200
松井建設	1,600	1,077.00	1,723,200
銭高組	2,000	309.00	618,000
鹿島建設	68,000	679.00	46,172,000
不動テトラ	10,500	151.00	1,585,500
大末建設	600	927.00	556,200
鉄建建設	9,000	282.00	2,538,000
西松建設	17,000	452.00	7,684,000
三井住友建設	55,700	85.00	4,734,500
大豊建設	6,000	441.00	2,646,000
前田建設工業	9,000	739.00	6,651,000
ナカノフドー建設	1,100	411.00	452,100
奥村組	14,000	528.00	7,392,000
東鉄工業	1,700	2,647.00	4,499,900
イチケン	2,000	259.00	518,000
浅沼組	5,000	205.00	1,025,000

戸田建設	17,000	426.00	7,242,000
熊谷組	21,000	274.00	5,754,000
青木あすなろ建設	1,000	671.00	671,000
北野建設	3,000	247.00	741,000
植木組	2,000	193.00	386,000
三井ホーム	2,000	428.00	856,000
矢作建設工業	2,000	810.00	1,620,000
ピーエス三菱	1,700	357.00	606,900
日本ハウスホールディングス	3,000	308.00	924,000
大東建託	5,300	16,385.00	86,840,500
新日本建設	1,700	654.00	1,111,800
N I P P O	3,000	1,710.00	5,130,000
東亜道路工業	3,000	263.00	789,000
前田道路	5,000	1,718.00	8,590,000
日本道路	4,000	383.00	1,532,000
東亜建設工業	13,000	151.00	1,963,000
若築建設	8,000	138.00	1,104,000
東洋建設	4,600	430.00	1,978,000
五洋建設	16,100	518.00	8,339,800
大林道路	1,700	623.00	1,059,100
福田組	2,000	1,036.00	2,072,000
住友林業	10,000	1,417.00	14,170,000
日本基礎技術	1,600	335.00	536,000
日成ビルド工業	4,000	522.00	2,088,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	8,000	66.00	528,000
巴コーポレーション	1,900	316.00	600,400
パナホーム	5,000	789.00	3,945,000
大和ハウス工業	42,700	2,851.50	121,759,050
ライト工業	2,800	1,046.00	2,928,800
積水ハウス	48,300	1,732.50	83,679,750
日特建設	1,600	382.00	611,200
北陸電気工事	700	711.00	497,700
ユアテック	2,000	692.00	1,384,000
西部電気工業	1,000	399.00	399,000
四電工	1,000	379.00	379,000
中電工	2,100	2,015.00	4,231,500
関電工	6,000	828.00	4,968,000
きんでん	8,800	1,083.00	9,530,400
東京エネシス	2,000	1,025.00	2,050,000
トーエネック	2,000	495.00	990,000
住友電設	1,200	1,119.00	1,342,800
日本電設工業	2,400	1,655.00	3,972,000

協和エクシオ	5,700	1,239.00	7,062,300
新日本空調	1,300	961.00	1,249,300
N D S	2,000	251.00	502,000
九電工	2,600	3,060.00	7,956,000
三機工業	3,200	821.00	2,627,200
日揮	15,000	1,390.00	20,850,000
中外炉工業	5,000	201.00	1,005,000
ヤマト	1,300	520.00	676,000
太平電業	2,000	1,045.00	2,090,000
高砂熱学工業	4,300	1,183.00	5,086,900
三晃金属工業	2,000	283.00	566,000
朝日工業社	2,000	479.00	958,000
明星工業	2,700	441.00	1,190,700
大気社	1,800	2,457.00	4,422,600
ダイダン	2,000	751.00	1,502,000
日比谷総合設備	1,800	1,516.00	2,728,800
東芝プラントシステム	2,300	1,568.00	3,606,400
東洋エンジニアリング	8,000	327.00	2,616,000
千代田化工建設	10,000	669.00	6,690,000
新興プランテック	3,000	749.00	2,247,000
日本製粉	9,000	764.00	6,876,000
日清製粉グループ本社	15,900	1,630.00	25,917,000
日東富士製粉	1,000	338.00	338,000
昭和産業	6,000	443.00	2,658,000
鳥越製粉	1,200	640.00	768,000
中部飼料	1,400	693.00	970,200
フィード・ワン	8,800	115.00	1,012,000
東洋精糖	3,000	101.00	303,000
日本甜菜製糖	8,000	175.00	1,400,000
三井製糖	6,000	497.00	2,982,000
塩水港精糖	1,600	213.00	340,800
日新製糖	600	1,329.00	797,400
森永製菓	13,000	632.00	8,216,000
中村屋	3,000	446.00	1,338,000
江崎グリコ	3,300	5,960.00	19,668,000
名糖産業	700	1,274.00	891,800
不二家	8,000	190.00	1,520,000
山崎製パン	10,000	2,840.00	28,400,000
第一屋製パン	2,000	104.00	208,000
モロゾフ	2,000	426.00	852,000
亀田製菓	800	5,650.00	4,520,000
寿スピリッツ	1,000	3,120.00	3,120,000

カルビー	5,400	4,310.00	23,274,000
森永乳業	13,000	718.00	9,334,000
六甲バター	700	2,261.00	1,582,700
ヤクルト本社	7,800	5,200.00	40,560,000
明治ホールディングス	8,600	10,360.00	89,096,000
雪印メグミルク	3,400	3,550.00	12,070,000
プリマハム	9,000	314.00	2,826,000
日本ハム	11,000	2,354.00	25,894,000
林兼産業	5,000	84.00	420,000
丸大食品	7,000	469.00	3,283,000
S Foods	900	2,759.00	2,483,100
伊藤ハム米久ホールディングス	8,600	965.00	8,299,000
サッポロホールディングス	22,000	583.00	12,826,000
アサヒグループホールディングス	27,100	3,309.00	89,673,900
キリンホールディングス	58,600	1,678.00	98,330,800
宝ホールディングス	10,500	921.00	9,670,500
オエノンホールディングス	4,000	200.00	800,000
養命酒製造	500	1,711.00	855,500
コカ・コーラウエスト	4,900	2,840.00	13,916,000
コカ・コーライーストジャパン	5,100	1,916.00	9,771,600
サントリー食品インターナショナル	9,900	4,465.00	44,203,500
ダイトードリンコ	700	5,410.00	3,787,000
伊藤園	4,300	3,895.00	16,748,500
キーコーヒー	1,300	1,847.00	2,401,100
ユニカフェ	400	860.00	344,000
ジャパンフーズ	200	1,166.00	233,200
日清オイリオグループ	8,000	480.00	3,840,000
不二製油グループ本社	3,800	1,889.00	7,178,200
かどや製油	200	2,811.00	562,200
J - オイルミルズ	6,000	334.00	2,004,000
キッコーマン	11,000	3,690.00	40,590,000
味の素	30,400	2,461.50	74,829,600
キューピー	7,400	3,335.00	24,679,000
ハウス食品グループ本社	5,000	2,330.00	11,650,000
カゴメ	5,200	2,716.00	14,123,200
焼津水産化学工業	700	985.00	689,500
アリアケジャパン	1,200	6,400.00	7,680,000
ピエトロ	200	1,641.00	328,200
エバラ食品工業	400	1,862.00	744,800
ニチレイ	16,000	914.00	14,624,000
東洋水産	7,100	4,070.00	28,897,000
イトアンド	200	2,017.00	403,400

日清食品ホールディングス	6,100	5,460.00	33,306,000
永谷園ホールディングス	1,000	1,221.00	1,221,000
一正蒲鉾	500	1,026.00	513,000
フジッコ	1,400	2,897.00	4,055,800
ロック・フィールド	1,500	1,535.00	2,302,500
日本たばこ産業	85,400	4,137.00	353,299,800
ケンコーマヨネーズ	500	2,820.00	1,410,000
わらべや日洋	800	1,895.00	1,516,000
なとり	700	1,502.00	1,051,400
北の達人コーポレーション	300	457.00	137,100
ユーグレナ	4,600	1,375.00	6,325,000
ミヨシ油脂	5,000	114.00	570,000
理研ビタミン	400	4,625.00	1,850,000
片倉工業	1,700	1,128.00	1,917,600
グンゼ	11,000	280.00	3,080,000
東洋紡	54,000	192.00	10,368,000
ユニチカ	40,000	55.00	2,200,000
富士紡ホールディングス	7,000	258.00	1,806,000
倉敷紡績	14,000	178.00	2,492,000
シキボウ	9,000	100.00	900,000
日本毛織	4,100	695.00	2,849,500
大東紡織	3,000	63.00	189,000
トーア紡コーポレーション	600	444.00	266,400
ダイドーリミテッド	1,500	425.00	637,500
帝国繊維	1,400	1,240.00	1,736,000
帝人	55,000	353.00	19,415,000
東レ	98,000	880.40	86,279,200
サカイオーベックス	4,000	145.00	580,000
住江織物	4,000	219.00	876,000
日本フェルト	700	461.00	322,700
イチカワ	1,000	249.00	249,000
日東製網	2,000	139.00	278,000
芦森工業	3,000	160.00	480,000
アツギ	10,000	106.00	1,060,000
ダイニック	3,000	149.00	447,000
セーレン	3,400	957.00	3,253,800
東海染工	2,000	114.00	228,000
小松精練	2,100	586.00	1,230,600
ワコールホールディングス	8,000	995.00	7,960,000
ホギメディカル	800	6,940.00	5,552,000
レナウン	3,800	102.00	387,600
クラウディア	300	481.00	144,300

TSIホールディングス	6,000	550.00	3,300,000
三陽商会	8,000	190.00	1,520,000
ナイガイ	5,000	39.00	195,000
オンワードホールディングス	9,000	623.00	5,607,000
ルック	2,000	127.00	254,000
キムラタン	61,000	6.00	366,000
ゴールドウイン	600	4,325.00	2,595,000
デサント	3,100	1,085.00	3,363,500
キング	600	348.00	208,800
ヤマトインターナショナル	800	379.00	303,200
特種東海製紙	8,000	347.00	2,776,000
王子ホールディングス	55,000	394.00	21,670,000
日本製紙	7,000	1,881.00	13,167,000
三菱製紙	21,000	71.00	1,491,000
北越紀州製紙	8,400	695.00	5,838,000
中越パルプ工業	5,000	204.00	1,020,000
巴川製紙所	2,000	171.00	342,000
大王製紙	6,000	1,108.00	6,648,000
レンゴー	12,000	647.00	7,764,000
トモク	4,000	275.00	1,100,000
ザ・パック	900	2,657.00	2,391,300
クラレ	21,300	1,239.00	26,390,700
旭化成	84,000	683.40	57,405,600
共和レザー	900	752.00	676,800
昭和電工	90,000	99.00	8,910,000
住友化学	100,000	415.00	41,500,000
日本化成	3,000	101.00	303,000
住友精化	3,000	559.00	1,677,000
日産化学工業	8,100	2,929.00	23,724,900
ラサ工業	5,000	91.00	455,000
クレハ	10,000	362.00	3,620,000
多木化学	1,000	611.00	611,000
テイカ	2,000	482.00	964,000
石原産業	25,000	61.00	1,525,000
片倉コープアグリ	1,000	194.00	194,000
日東エフシー	800	797.00	637,600
日本曹達	9,000	415.00	3,735,000
東ソー	36,000	475.00	17,100,000
トクヤマ	22,000	290.00	6,380,000
セントラル硝子	15,000	447.00	6,705,000
東亜合成	8,500	941.00	7,998,500
大阪ソーダ	6,000	413.00	2,478,000

関東電化工業	3,000	860.00	2,580,000	
デンカ	28,000	403.00	11,284,000	
信越化学工業	24,200	5,818.00	140,795,600	
日本カーバイド工業	5,000	135.00	675,000	
堺化学工業	6,000	272.00	1,632,000	
エア・ウォーター	11,000	1,463.00	16,093,000	
大陽日酸	10,400	894.00	9,297,600	
日本化学工業	5,000	194.00	970,000	
日本パーカライジング	6,900	1,043.00	7,196,700	
高压ガス工業	2,000	606.00	1,212,000	
四国化成工業	2,000	798.00	1,596,000	
戸田工業	3,000	272.00	816,000	
ステラ ケミファ	700	2,957.00	2,069,900	
保土谷化学工業	4,000	284.00	1,136,000	
日本触媒	2,000	6,050.00	12,100,000	
大日精化工業	5,000	410.00	2,050,000	
カネカ	18,000	669.00	12,042,000	
三菱瓦斯化学	23,000	527.00	12,121,000	
三井化学	57,000	357.00	20,349,000	
J S R	12,700	1,336.00	16,967,200	
東京応化工業	2,700	2,577.00	6,957,900	
大阪有機化学工業	900	537.00	483,300	
三菱ケミカルホールディングス	90,500	458.10	41,458,050	
日本合成化学工業	3,000	529.00	1,587,000	
ダイセル	19,000	1,046.00	19,874,000	
住友ベークライト	12,000	485.00	5,820,000	
積水化学工業	30,700	1,262.00	38,743,400	
日本ゼオン	12,000	667.00	8,004,000	
アイカ工業	4,100	2,281.00	9,352,100	
宇部興産	72,000	172.00	12,384,000	
積水樹脂	2,100	1,427.00	2,996,700	
タキロン	3,000	459.00	1,377,000	
旭有機材	4,000	189.00	756,000	
日立化成	6,700	1,846.00	12,368,200	
ニチバン	1,000	775.00	775,000	
リケンテクノス	2,900	420.00	1,218,000	
大倉工業	3,000	271.00	813,000	
積水化成成品工業	4,000	309.00	1,236,000	
群栄化学工業	4,000	267.00	1,068,000	
タイガースポリマー	700	546.00	382,200	
ミライアル	500	702.00	351,000	
ダイキアクシス	300	826.00	247,800	

ダイキョーニシカワ	1,700	1,248.00	2,121,600
日本化薬	9,000	1,010.00	9,090,000
カーリットホールディングス	1,300	456.00	592,800
日本精化	1,100	706.00	776,600
扶桑化学工業	900	1,374.00	1,236,600
A D E K A	6,600	1,232.00	8,131,200
日油	10,000	810.00	8,100,000
新日本理化	2,200	136.00	299,200
ハリマ化成グループ	1,200	493.00	591,600
花王	36,300	6,065.00	220,159,500
第一工業製薬	3,000	307.00	921,000
ニイタカ	200	1,283.00	256,600
三洋化成工業	4,000	782.00	3,128,000
大日本塗料	8,000	185.00	1,480,000
日本ペイントホールディングス	10,400	2,424.00	25,209,600
関西ペイント	15,300	2,006.00	30,691,800
神東塗料	1,000	158.00	158,000
中国塗料	4,000	629.00	2,516,000
日本特殊塗料	1,000	1,086.00	1,086,000
藤倉化成	1,800	576.00	1,036,800
太陽ホールディングス	1,000	3,120.00	3,120,000
D I C	53,000	214.00	11,342,000
サカタインクス	2,700	1,214.00	3,277,800
東洋インキS Cホールディングス	13,000	422.00	5,486,000
T & K T O K A	1,000	721.00	721,000
富士フィルムホールディングス	30,900	3,902.00	120,571,800
資生堂	25,600	2,561.50	65,574,400
ライオン	16,000	1,666.00	26,656,000
高砂香料工業	900	2,593.00	2,333,700
マンダム	1,300	4,675.00	6,077,500
ミルボン	800	4,525.00	3,620,000
ファンケル	3,200	1,366.00	4,371,200
コーセー	2,200	8,050.00	17,710,000
コタ	400	1,069.00	427,600
シーズ・ホールディングス	1,700	2,186.00	3,716,200
シーボン	200	2,050.00	410,000
ポーラ・オルビスホールディングス	1,400	9,210.00	12,894,000
ノエビアホールディングス	800	3,035.00	2,428,000
アジュバンコスメジャパン	300	887.00	266,100
エステー	900	1,085.00	976,500
アグロ カネショウ	500	998.00	499,000
コニシ	2,100	1,306.00	2,742,600

長谷川香料	1,700	1,798.00	3,056,600	
星光PMC	800	985.00	788,000	
小林製薬	2,000	9,000.00	18,000,000	
荒川化学工業	1,200	948.00	1,137,600	
メック	1,100	868.00	954,800	
日本高純度化学	400	1,987.00	794,800	
タカラバイオ	2,900	1,261.00	3,656,900	
JCU	400	3,175.00	1,270,000	
新田ゼラチン	900	734.00	660,600	
OATアグリオ	200	1,221.00	244,200	
デクセリアルズ	4,000	722.00	2,888,000	
アース製薬	1,000	4,905.00	4,905,000	
イハラケミカル工業	2,100	969.00	2,034,900	
北興化学工業	1,000	280.00	280,000	
大成ラミック	400	2,827.00	1,130,800	
クミアイ化学工業	2,800	609.00	1,705,200	
日本農薬	3,100	447.00	1,385,700	
アキレス	11,000	125.00	1,375,000	
有沢製作所	2,000	500.00	1,000,000	
日東電工	10,400	6,067.00	63,096,800	
レック	400	1,639.00	655,600	
きもと	2,300	145.00	333,500	
藤森工業	1,200	1,943.00	2,331,600	
前澤化成工業	1,000	979.00	979,000	
JSP	900	2,013.00	1,811,700	
エフピコ	1,200	4,815.00	5,778,000	
天馬	1,000	1,507.00	1,507,000	
信越ポリマー	2,700	592.00	1,598,400	
東リ	4,000	279.00	1,116,000	
ニフコ	2,600	5,290.00	13,754,000	
日本バルカー工業	5,000	258.00	1,290,000	
ユニ・チャーム	27,300	2,232.00	60,933,600	
協和発酵キリン	16,200	1,694.00	27,442,800	
武田薬品工業	53,800	4,346.00	233,814,800	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	151,300	1,595.00	241,323,500	
大日本住友製薬	9,600	1,715.00	16,464,000	
塩野義製薬	19,700	5,484.00	108,034,800	
田辺三菱製薬	15,700	1,838.00	28,856,600	
わかもと製薬	1,000	237.00	237,000	
あすか製薬	1,700	1,725.00	2,932,500	
日本新薬	3,100	5,320.00	16,492,000	
ビオフェルミン製薬	200	2,711.00	542,200	

中外製薬	13,400	3,545.00	47,503,000
科研製薬	2,300	6,560.00	15,088,000
エーザイ	16,600	5,663.00	94,005,800
ロート製薬	6,600	1,536.00	10,137,600
小野薬品工業	30,700	4,235.00	130,014,500
久光製薬	4,200	6,020.00	25,284,000
有機合成薬品工業	1,000	221.00	221,000
持田製薬	900	8,090.00	7,281,000
参天製薬	24,900	1,530.00	38,097,000
扶桑薬品工業	5,000	266.00	1,330,000
日本ケミファ	2,000	472.00	944,000
ツムラ	4,300	2,768.00	11,902,400
日医工	3,200	2,093.00	6,697,600
キッセイ薬品工業	2,400	2,003.00	4,807,200
生化学工業	2,600	1,515.00	3,939,000
栄研化学	1,100	2,297.00	2,526,700
日水製薬	600	1,121.00	672,600
鳥居薬品	900	2,249.00	2,024,100
JCRファーマ	1,000	2,946.00	2,946,000
東和薬品	600	5,530.00	3,318,000
富士製薬工業	500	2,274.00	1,137,000
沢井製薬	2,300	7,590.00	17,457,000
ゼリア新薬工業	2,800	1,472.00	4,121,600
第一三共	45,500	2,486.50	113,135,750
キョーリン製薬ホールディングス	3,600	1,971.00	7,095,600
大幸薬品	700	1,511.00	1,057,700
ダイト	700	2,643.00	1,850,100
大塚ホールディングス	29,100	4,713.00	137,148,300
大正製薬ホールディングス	3,300	10,540.00	34,782,000
ペプチドリーム	2,200	5,670.00	12,474,000
日本コークス工業	11,200	60.00	672,000
昭和シェル石油	13,600	1,061.00	14,429,600
ニチレキ	1,700	636.00	1,081,200
東燃ゼネラル石油	20,000	912.00	18,240,000
ユシロ化学工業	700	1,318.00	922,600
ビーピー・カストロール	500	1,234.00	617,000
富士石油	3,100	340.00	1,054,000
MORESCO	400	1,061.00	424,400
出光興産	7,100	2,279.00	16,180,900
JXホールディングス	159,900	383.20	61,273,680
コスモエネルギーホールディングス	4,100	1,244.00	5,100,400
横浜ゴム	8,200	1,235.00	10,127,000

東洋ゴム工業	6,100	1,028.00	6,270,800
ブリヂストン	45,600	3,279.00	149,522,400
住友ゴム工業	12,600	1,391.00	17,526,600
藤倉ゴム工業	1,100	387.00	425,700
オカモト	4,000	1,092.00	4,368,000
フコク	500	718.00	359,000
ニッタ	1,400	2,266.00	3,172,400
住友理工	2,900	796.00	2,308,400
三ツ星ベルト	3,000	733.00	2,199,000
バンドー化学	5,000	474.00	2,370,000
日東紡績	9,000	331.00	2,979,000
旭硝子	71,000	556.00	39,476,000
日本板硝子	65,000	64.00	4,160,000
石塚硝子	2,000	150.00	300,000
日本山村硝子	5,000	153.00	765,000
日本電気硝子	28,000	427.00	11,956,000
オハラ	500	495.00	247,500
住友大阪セメント	27,000	425.00	11,475,000
太平洋セメント	84,000	236.00	19,824,000
デイ・シイ	1,300	319.00	414,700
日本ヒューム	1,300	526.00	683,800
日本コンクリート工業	2,900	281.00	814,900
三谷セキサン	700	1,997.00	1,397,900
アジアパイルホールディングス	1,700	354.00	601,800
東海カーボン	12,000	256.00	3,072,000
日本カーボン	7,000	195.00	1,365,000
東洋炭素	800	1,282.00	1,025,600
ノリタケカンパニーリミテド	8,000	232.00	1,856,000
TOTO	9,900	3,995.00	39,550,500
日本碍子	17,000	1,972.00	33,524,000
日本特殊陶業	11,600	1,478.00	17,144,800
ダントーホールディングス	2,000	188.00	376,000
MARUWA	500	2,992.00	1,496,000
品川リフラクトリーズ	3,000	190.00	570,000
黒崎播磨	3,000	237.00	711,000
ヨータイ	1,000	274.00	274,000
イソライト工業	700	194.00	135,800
東京窯業	1,600	149.00	238,400
ニッカトー	500	343.00	171,500
フジインコーポレーテッド	1,200	1,504.00	1,804,800
エーアンドエーマテリアル	3,000	76.00	228,000
ニチアス	7,000	768.00	5,376,000

ニチハ	1,800	1,453.00	2,615,400
新日鐵住金	60,900	1,846.00	112,421,400
神戸製鋼所	249,000	83.00	20,667,000
合同製鐵	8,000	146.00	1,168,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	36,900	1,239.50	45,737,550
日新製鋼	6,200	1,310.00	8,122,000
東京製鐵	7,500	564.00	4,230,000
共英製鋼	1,500	1,509.00	2,263,500
大和工業	3,000	2,302.00	6,906,000
東京鐵鋼	3,000	394.00	1,182,000
大阪製鐵	900	1,718.00	1,546,200
淀川製鋼所	2,000	2,491.00	4,982,000
東洋鋼鈹	3,300	248.00	818,400
丸一鋼管	4,500	3,540.00	15,930,000
モリ工業	2,000	281.00	562,000
大同特殊鋼	23,000	339.00	7,797,000
日本高周波鋼業	6,000	65.00	390,000
日本冶金工業	10,100	118.00	1,191,800
山陽特殊製鋼	8,000	452.00	3,616,000
愛知製鋼	8,000	429.00	3,432,000
日立金属	15,500	1,031.00	15,980,500
日本金属	4,000	90.00	360,000
大平洋金属	10,000	274.00	2,740,000
新日本電工	7,800	155.00	1,209,000
栗本鐵工所	7,000	160.00	1,120,000
虹技	2,000	143.00	286,000
日本鑄鉄管	2,000	127.00	254,000
三菱製鋼	10,000	151.00	1,510,000
日亜鋼業	2,000	209.00	418,000
日本精線	1,000	404.00	404,000
シンニッタン	1,200	539.00	646,800
新家工業	3,000	124.00	372,000
大紀アルミニウム工業所	2,000	286.00	572,000
日本軽金属ホールディングス	30,600	218.00	6,670,800
三井金属鉱業	34,000	169.00	5,746,000
東邦亜鉛	7,000	291.00	2,037,000
三菱マテリアル	84,000	245.00	20,580,000
住友金属鉱山	37,000	1,003.50	37,129,500
DOWAホールディングス	17,000	514.00	8,738,000
古河機械金属	21,000	139.00	2,919,000
エス・サイエンス	6,600	32.00	211,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,300	1,201.00	1,561,300

東邦チタニウム	2,300	652.00	1,499,600
U A C J	19,000	243.00	4,617,000
古河電気工業	43,000	234.00	10,062,000
住友電気工業	54,100	1,342.00	72,602,200
フジクラ	19,000	457.00	8,683,000
昭和電線ホールディングス	17,000	55.00	935,000
タツタ電線	2,900	291.00	843,900
沖電線	2,000	163.00	326,000
カナレ電気	200	1,920.00	384,000
平河ヒューテック	600	811.00	486,600
リョービ	8,000	435.00	3,480,000
アーレスティ	1,600	703.00	1,124,800
アサヒホールディングス	2,100	1,487.00	3,122,700
稲葉製作所	700	1,294.00	905,800
宮地エンジニアリンググループ	4,000	124.00	496,000
トーカロ	1,000	1,655.00	1,655,000
アルファC o	500	914.00	457,000
S U M C O	10,600	641.00	6,794,600
川田テクノロジーズ	300	3,245.00	973,500
東洋製罐グループホールディングス	9,600	1,925.00	18,480,000
ホッカンホールディングス	4,000	295.00	1,180,000
コロナ	700	1,005.00	703,500
横河ブリッジホールディングス	2,600	976.00	2,537,600
駒井ハルテック	2,000	187.00	374,000
高田機工	1,000	174.00	174,000
三和ホールディングス	13,400	891.00	11,939,400
文化シャッター	3,800	810.00	3,078,000
三協立山	1,800	1,423.00	2,561,400
アルインコ	1,000	944.00	944,000
東洋シャッター	300	521.00	156,300
L I X I L グループ	18,800	1,720.00	32,336,000
日本フィルコン	1,000	406.00	406,000
ノーリツ	2,600	1,841.00	4,786,600
長府製作所	1,400	2,470.00	3,458,000
リンナイ	2,500	8,790.00	21,975,000
ダイニチ工業	700	600.00	420,000
日東精工	2,000	276.00	552,000
三洋工業	2,000	160.00	320,000
岡部	2,800	762.00	2,133,600
ジーテクト	1,400	1,206.00	1,688,400
中国工業	200	638.00	127,600
東プレ	2,600	2,148.00	5,584,800

高周波熱錬	2,500	701.00	1,752,500
東京製綱	9,000	144.00	1,296,000
サンコール	700	444.00	310,800
モリテック スチール	700	241.00	168,700
パイオラックス	700	4,670.00	3,269,000
日本発條	12,700	809.00	10,274,300
中央発條	2,000	273.00	546,000
アドバネクス	300	1,160.00	348,000
立川ブラインド工業	600	715.00	429,000
三益半導体工業	1,000	904.00	904,000
日本ドライケミカル	200	2,050.00	410,000
日本製鋼所	22,000	457.00	10,054,000
三浦工業	6,000	2,278.00	13,668,000
タクマ	5,000	864.00	4,320,000
ツガミ	4,000	398.00	1,592,000
オークマ	9,000	663.00	5,967,000
東芝機械	7,000	323.00	2,261,000
アマダホールディングス	19,700	1,034.00	20,369,800
アイダエンジニアリング	3,500	850.00	2,975,000
滝澤鉄工所	4,000	119.00	476,000
富士機械製造	4,400	929.00	4,087,600
牧野フライス製作所	7,000	520.00	3,640,000
オーエスジー	6,200	1,668.00	10,341,600
ダイジェット工業	2,000	120.00	240,000
旭ダイヤモンド工業	3,600	757.00	2,725,200
D M G 森精機	7,500	960.00	7,200,000
ソディック	3,400	779.00	2,648,600
ディスコ	1,700	9,230.00	15,691,000
日東工器	800	2,120.00	1,696,000
パンチ工業	500	764.00	382,000
豊和工業	800	502.00	401,600
O K K	5,000	94.00	470,000
東洋機械金属	1,000	344.00	344,000
津田駒工業	3,000	101.00	303,000
島精機製作所	1,900	1,967.00	3,737,300
N C ホールディングス	400	835.00	334,000
フリーー	300	2,581.00	774,300
ヤマシンフィルタ	300	429.00	128,700
日阪製作所	1,700	758.00	1,288,600
やまびこ	2,500	744.00	1,860,000
ペガサスミシン製造	1,400	439.00	614,600
ナブテスコ	7,000	2,475.00	17,325,000

三井海洋開発	1,600	1,594.00	2,550,400
レオン自動機	1,100	535.00	588,500
S M C	4,000	24,450.00	97,800,000
新川	1,200	459.00	550,800
ホソカワミクロン	2,000	513.00	1,026,000
ユニオンツール	600	2,801.00	1,680,600
オイレス工業	1,700	1,605.00	2,728,500
日精エー・エス・ビー機械	400	1,813.00	725,200
サトーホールディングス	1,800	1,801.00	3,241,800
日本エアーテック	500	612.00	306,000
日精樹脂工業	1,000	622.00	622,000
オカダアイヨン	300	720.00	216,000
ワイエイシイ	500	943.00	471,500
小松製作所	66,200	1,715.00	113,533,000
住友重機械工業	40,000	445.00	17,800,000
日立建機	6,000	1,439.00	8,634,000
日工	2,000	288.00	576,000
巴工業	600	1,427.00	856,200
井関農機	14,000	221.00	3,094,000
T O W A	1,300	816.00	1,060,800
丸山製作所	3,000	160.00	480,000
北川鉄工所	6,000	172.00	1,032,000
タカキタ	500	498.00	249,000
クボタ	64,800	1,325.00	85,860,000
荏原実業	400	1,228.00	491,200
三菱化工機	5,000	178.00	890,000
月島機械	2,600	917.00	2,384,200
帝国電機製作所	1,000	760.00	760,000
新東工業	3,100	737.00	2,284,700
澁谷工業	1,100	1,643.00	1,807,300
アイチ コーポレーション	1,900	696.00	1,322,400
小森コーポレーション	3,300	1,133.00	3,738,900
鶴見製作所	1,000	1,257.00	1,257,000
住友精密工業	2,000	294.00	588,000
酒井重工業	2,000	163.00	326,000
荏原製作所	30,000	550.00	16,500,000
石井鐵工所	2,000	142.00	284,000
西島製作所	1,500	959.00	1,438,500
北越工業	1,500	561.00	841,500
ダイキン工業	18,800	8,134.00	152,919,200
オルガノ	2,000	383.00	766,000
トーヨーカネツ	7,000	196.00	1,372,000

栗田工業	8,100	2,291.00	18,557,100
椿本チエイン	8,000	638.00	5,104,000
大同工業	3,000	189.00	567,000
木村化工機	1,200	290.00	348,000
アネスト岩田	2,200	861.00	1,894,200
ダイフク	6,900	1,694.00	11,688,600
サムコ	300	782.00	234,600
加藤製作所	3,000	395.00	1,185,000
油研工業	2,000	162.00	324,000
タダノ	6,200	839.00	5,201,800
フジテック	3,700	866.00	3,204,200
C K D	3,600	770.00	2,772,000
キトー	1,600	782.00	1,251,200
平和	4,000	2,015.00	8,060,000
理想科学工業	1,400	1,396.00	1,954,400
SANKYO	3,600	3,745.00	13,482,000
日本金銭機械	1,200	777.00	932,400
マースエンジニアリング	700	2,009.00	1,406,300
福島工業	800	2,952.00	2,361,600
オーイズミ	600	377.00	226,200
ダイコク電機	600	1,438.00	862,800
竹内製作所	2,500	1,330.00	3,325,000
アマノ	4,000	1,748.00	6,992,000
JUKI	1,900	920.00	1,748,000
サンデンホールディングス	8,000	276.00	2,208,000
蛇の目マシン工業	1,300	575.00	747,500
マックス	2,000	1,129.00	2,258,000
グローリー	4,400	2,682.00	11,800,800
新晃工業	900	1,162.00	1,045,800
大和冷機工業	2,100	857.00	1,799,700
セガサミーホールディングス	13,900	1,119.00	15,554,100
日本ピストンリング	600	1,373.00	823,800
リケン	6,000	313.00	1,878,000
T P R	1,600	1,967.00	3,147,200
ツバキ・ナカシマ	1,600	1,260.00	2,016,000
ホシザキ電機	2,800	9,960.00	27,888,000
大豊工業	1,000	1,066.00	1,066,000
日本精工	26,500	719.00	19,053,500
NTN	32,000	271.00	8,672,000
ジェイテクト	13,800	1,115.00	15,387,000
不二越	12,000	310.00	3,720,000
日本トムソン	4,500	324.00	1,458,000

THK	8,600	1,709.00	14,697,400
ユーシン精機	500	1,786.00	893,000
前澤給装工業	500	1,317.00	658,500
イーグル工業	1,600	1,169.00	1,870,400
前澤工業	1,000	244.00	244,000
日本ピラー工業	1,300	912.00	1,185,600
キッツ	5,800	493.00	2,859,400
日立工機	3,400	602.00	2,046,800
マキタ	8,400	6,570.00	55,188,000
日立造船	10,300	498.00	5,129,400
三菱重工業	230,000	380.00	87,400,000
IHI	99,000	260.00	25,740,000
日清紡ホールディングス	7,100	910.00	6,461,000
イビデン	7,900	1,112.00	8,784,800
コニカミノルタ	32,200	740.00	23,828,000
ブラザー工業	16,700	1,093.00	18,253,100
ミネベア	21,000	666.00	13,986,000
日立製作所	329,000	419.20	137,916,800
東芝	272,000	265.50	72,216,000
三菱電機	138,000	1,165.00	160,770,000
富士電機	39,000	405.00	15,795,000
東洋電機製造	3,000	272.00	816,000
安川電機	16,000	1,259.00	20,144,000
シンフォニアテクノロジー	9,000	169.00	1,521,000
明電舎	12,000	328.00	3,936,000
オリジン電気	2,000	254.00	508,000
山洋電気	3,000	468.00	1,404,000
デンヨー	1,200	1,047.00	1,256,400
東芝テック	9,000	347.00	3,123,000
芝浦メカトロニクス	2,000	183.00	366,000
マブチモーター	3,700	4,135.00	15,299,500
日本電産	15,500	7,463.00	115,676,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	100	2,105.00	210,500
東光高岳	700	1,696.00	1,187,200
ダブル・スコープ	500	5,360.00	2,680,000
ダイヘン	8,000	441.00	3,528,000
田淵電機	1,500	341.00	511,500
ヤーマン	200	1,835.00	367,000
JVCケンウッド	9,500	208.00	1,976,000
ミマキエンジニアリング	1,200	444.00	532,800
第一精工	600	984.00	590,400
日新電機	3,000	1,584.00	4,752,000

大崎電気工業	3,000	736.00	2,208,000
オムロン	14,600	3,350.00	48,910,000
日東工業	2,100	1,238.00	2,599,800
I D E C	1,700	900.00	1,530,000
不二電機工業	100	1,357.00	135,700
ジーエス・ユアサ コーポレーション	25,000	375.00	9,375,000
サクサホールディングス	3,000	182.00	546,000
メルコホールディングス	700	2,061.00	1,442,700
テクノメディカ	300	1,520.00	456,000
日本電気	177,000	227.00	40,179,000
富士通	125,000	364.20	45,525,000
沖電気工業	56,000	134.00	7,504,000
岩崎通信機	6,000	60.00	360,000
電気興業	3,000	439.00	1,317,000
サンケン電気	7,000	310.00	2,170,000
ナカヨ	1,000	301.00	301,000
アイホン	700	1,608.00	1,125,600
ルネサスエレクトロニクス	6,700	577.00	3,865,900
セイコーエプソン	19,200	1,638.00	31,449,600
ワコム	10,100	383.00	3,868,300
アルバック	2,400	2,958.00	7,099,200
アクセル	600	688.00	412,800
E I Z O	1,300	2,678.00	3,481,400
ジャパンディスプレイ	24,100	160.00	3,856,000
日本信号	3,600	770.00	2,772,000
京三製作所	3,000	340.00	1,020,000
能美防災	1,500	1,362.00	2,043,000
ホーチキ	900	1,143.00	1,028,700
エレコム	1,100	1,985.00	2,183,500
日本無線	4,000	251.00	1,004,000
パナソニック	147,400	867.00	127,795,800
シャープ	109,000	95.00	10,355,000
アンリツ	7,800	589.00	4,594,200
富士通ゼネラル	4,000	2,172.00	8,688,000
日立国際電気	3,000	1,674.00	5,022,000
ソニー	91,000	2,782.00	253,162,000
T D K	7,800	5,630.00	43,914,000
帝国通信工業	3,000	140.00	420,000
ミツミ電機	4,900	399.00	1,955,100
タムラ製作所	5,000	285.00	1,425,000
アルプス電気	11,100	1,900.00	21,090,000
池上通信機	4,000	112.00	448,000

パイオニア	20,900	175.00	3,657,500
日本電波工業	1,200	792.00	950,400
鈴木	500	533.00	266,500
日本トリム	300	6,900.00	2,070,000
ローランド ディー・ジー	600	1,860.00	1,116,000
フォスター電機	1,600	1,631.00	2,609,600
クラリオン	7,000	241.00	1,687,000
S M K	4,000	338.00	1,352,000
ヨコオ	900	448.00	403,200
ホシデン	3,900	603.00	2,351,700
ヒロセ電機	2,100	12,450.00	26,145,000
日本航空電子工業	4,000	1,439.00	5,756,000
T O A	1,500	914.00	1,371,000
日立マクセル	2,100	1,379.00	2,895,900
古野電気	1,600	518.00	828,800
ユニデンホールディングス	4,000	116.00	464,000
アルパイン	3,100	949.00	2,941,900
スミダコーポレーション	1,100	663.00	729,300
アイコム	700	2,010.00	1,407,000
リオン	500	1,331.00	665,500
本多通信工業	300	724.00	217,200
船井電機	1,300	875.00	1,137,500
横河電機	12,900	1,098.00	14,164,200
新電元工業	5,000	314.00	1,570,000
アズビル	4,200	2,859.00	12,007,800
東亜ディーケーケー	700	441.00	308,700
日本光電工業	5,400	2,830.00	15,282,000
チノー	400	936.00	374,400
共和電業	1,600	319.00	510,400
日本電子材料	500	388.00	194,000
堀場製作所	2,400	4,580.00	10,992,000
アドバンテスト	8,800	1,146.00	10,084,800
小野測器	600	768.00	460,800
エスペック	1,300	1,187.00	1,543,100
パナソニック デバイス S U N X	1,100	589.00	647,900
キーエンス	2,900	67,600.00	196,040,000
日置電機	700	2,009.00	1,406,300
シスメックス	10,000	7,030.00	70,300,000
日本マイクロニクス	2,400	862.00	2,068,800
メガチップス	1,300	1,082.00	1,406,600
O B A R A G R O U P	700	3,735.00	2,614,500
澤藤電機	1,000	165.00	165,000

コーセル	1,800	990.00	1,782,000
新日本無線	1,000	360.00	360,000
オブテックス	1,000	2,588.00	2,588,000
千代田インテグレ	700	1,870.00	1,309,000
アイ・オー・データ機器	400	623.00	249,200
レーザーテック	1,500	1,245.00	1,867,500
スタンレー電気	9,200	2,196.00	20,203,200
岩崎電気	5,000	132.00	660,000
ウシオ電機	7,800	1,161.00	9,055,800
岡谷電機産業	700	357.00	249,900
ハリオス テクノ ホールディング	1,100	330.00	363,000
日本セラミック	700	1,953.00	1,367,100
遠藤照明	700	911.00	637,700
日本デジタル研究所	1,100	1,353.00	1,488,300
古河電池	1,000	618.00	618,000
双信電機	700	255.00	178,500
山一電機	1,100	548.00	602,800
図研	900	869.00	782,100
日本電子	5,000	394.00	1,970,000
カシオ計算機	12,900	1,396.00	18,008,400
ファナック	13,200	15,675.00	206,910,000
日本シイエムケイ	2,800	394.00	1,103,200
エンプラス	600	2,654.00	1,592,400
大真空	3,000	245.00	735,000
ローム	6,400	3,905.00	24,992,000
浜松ホトニクス	10,100	2,778.00	28,057,800
三井ハイテック	1,900	618.00	1,174,200
新光電気工業	4,900	495.00	2,425,500
京セラ	21,200	4,815.00	102,078,000
太陽誘電	6,300	875.00	5,512,500
村田製作所	13,600	10,920.00	148,512,000
ユーシン	1,700	621.00	1,055,700
双葉電子工業	2,100	1,890.00	3,969,000
北陸電気工業	5,000	106.00	530,000
ニチコン	4,100	652.00	2,673,200
日本ケミコン	11,000	120.00	1,320,000
K O A	1,800	710.00	1,278,000
市光工業	3,000	268.00	804,000
小糸製作所	7,700	4,630.00	35,651,000
ミツバ	2,200	1,136.00	2,499,200
スター精密	2,500	1,073.00	2,682,500
S C R E E Nホールディングス	13,000	1,049.00	13,637,000

キヤノン電子	1,200	1,464.00	1,756,800	
キヤノン	69,400	2,946.50	204,487,100	代用有価証券 10,000株
リコー	41,800	861.00	35,989,800	
MUTOHホールディングス	2,000	214.00	428,000	
東京エレクトロン	10,600	8,073.00	85,573,800	
トヨタ紡織	4,500	2,020.00	9,090,000	
鬼怒川ゴム工業	3,000	771.00	2,313,000	
ユニプレス	2,700	1,646.00	4,444,200	
豊田自動織機	11,700	4,010.00	46,917,000	
モリタホールディングス	2,200	1,316.00	2,895,200	
三櫻工業	1,700	540.00	918,000	
デンソー	31,900	3,452.00	110,118,800	
東海理化電機製作所	3,800	1,497.00	5,688,600	
三井造船	50,000	138.00	6,900,000	
川崎重工業	101,000	273.00	27,573,000	
名村造船所	3,900	591.00	2,304,900	
サノヤスホールディングス	1,600	154.00	246,400	
日本車輛製造	5,000	258.00	1,290,000	
ニチユ三菱フォークリフト	1,500	524.00	786,000	
近畿車輛	2,000	253.00	506,000	
日産自動車	180,000	919.90	165,582,000	
いすゞ自動車	37,400	1,218.50	45,571,900	
トヨタ自動車	160,500	5,151.00	826,735,500	代用有価証券 35,000株
日野自動車	18,400	1,004.00	18,473,600	
三菱自動車工業	51,300	481.00	24,675,300	
エフテック	700	966.00	676,200	
レシップホールディングス	400	794.00	317,600	
G M B	200	932.00	186,400	
ファルテック	200	1,121.00	224,200	
武蔵精密工業	1,400	1,990.00	2,786,000	
日産車体	6,300	973.00	6,129,900	
新明和工業	6,000	659.00	3,954,000	
極東開発工業	2,600	890.00	2,314,000	
日信工業	2,900	1,301.00	3,772,900	
トビー工業	11,000	208.00	2,288,000	
ティラド	5,000	175.00	875,000	
曙ブレーキ工業	6,600	215.00	1,419,000	
タチエス	2,100	1,444.00	3,032,400	
N O K	6,300	1,676.00	10,558,800	
フタバ産業	3,900	482.00	1,879,800	
K Y B	14,000	324.00	4,536,000	

大同メタル工業	1,800	950.00	1,710,000
プレス工業	6,900	325.00	2,242,500
ミクニ	1,600	275.00	440,000
カルソニックカンセイ	10,000	790.00	7,900,000
太平洋工業	2,900	968.00	2,807,200
ケーヒン	3,000	1,560.00	4,680,000
河西工業	1,600	919.00	1,470,400
アイシン精機	13,200	4,060.00	53,592,000
富士機工	1,500	320.00	480,000
マツダ	40,800	1,414.50	57,711,600
ダイハツ工業	15,400	1,348.00	20,759,200
今仙電機製作所	1,200	823.00	987,600
本田技研工業	116,100	2,549.00	295,938,900
スズキ	23,600	2,662.00	62,823,200
富士重工業	40,800	3,479.00	141,943,200
安永	500	459.00	229,500
ヤマハ発動機	18,200	1,642.00	29,884,400
ショーワ	3,300	590.00	1,947,000
T B K	1,600	341.00	545,600
エクセディ	1,700	2,202.00	3,743,400
豊田合成	4,700	1,767.00	8,304,900
愛三工業	2,300	662.00	1,522,600
盟和産業	200	960.00	192,000
ヨロズ	1,200	1,435.00	1,722,000
エフ・シー・シー	2,100	1,609.00	3,378,900
シマノ	5,200	14,910.00	77,532,000
タカタ	2,400	367.00	880,800
テイ・エス テック	3,000	2,494.00	7,482,000
ジャムコ	800	1,771.00	1,416,800
テルモ	19,800	4,315.00	85,437,000
クリエートメディック	400	821.00	328,400
日機装	4,700	652.00	3,064,400
島津製作所	17,000	1,516.00	25,772,000
J M S	3,000	264.00	792,000
長野計器	800	560.00	448,000
ブイ・テクノロジー	300	10,890.00	3,267,000
東京計器	4,000	146.00	584,000
愛知時計電機	2,000	294.00	588,000
オーバル	1,300	216.00	280,800
東京精密	2,500	2,398.00	5,995,000
マニー	1,700	1,720.00	2,924,000
ニコン	24,100	1,331.00	32,077,100

トプコン	4,300	987.00	4,244,100
オリンパス	19,200	3,710.00	71,232,000
理研計器	1,000	1,049.00	1,049,000
タムロン	1,100	1,382.00	1,520,200
H O Y A	29,200	3,562.00	104,010,400
ノーリツ鋼機	1,200	717.00	860,400
エー・アンド・デイ	1,200	357.00	428,400
シチズンホールディングス	15,900	492.00	7,822,800
リズム時計工業	6,000	166.00	996,000
大研医器	1,000	781.00	781,000
メニコン	900	2,845.00	2,560,500
松風	600	1,214.00	728,400
セイコーホールディングス	8,000	304.00	2,432,000
ニプロ	9,600	1,201.00	11,529,600
スノーピーク	200	4,075.00	815,000
パラマウントベッドホールディングス	1,300	4,930.00	6,409,000
トランザクション	300	888.00	266,400
S H O - B I	500	390.00	195,000
ニホンフラッシュ	500	1,119.00	559,500
前田工織	1,300	924.00	1,201,200
永大産業	2,000	400.00	800,000
アートネイチャー	1,400	776.00	1,086,400
ダンロップスポーツ	900	998.00	898,200
バンダイナムコホールディングス	13,400	2,508.00	33,607,200
アイフィスジャパン	300	363.00	108,900
共立印刷	2,200	283.00	622,600
S H O E I	600	1,508.00	904,800
フランスベッドホールディングス	1,800	896.00	1,612,800
パイロットコーポレーション	2,300	4,380.00	10,074,000
萩原工業	400	2,540.00	1,016,000
トッパン・フォームズ	2,300	1,042.00	2,396,600
フジシールインターナショナル	1,600	3,480.00	5,568,000
タカラトミー	4,300	815.00	3,504,500
廣済堂	1,200	295.00	354,000
A s - m e エステール	400	560.00	224,000
アーケ	5,600	68.00	380,800
タカノ	600	591.00	354,600
プロネクサス	1,200	1,002.00	1,202,400
ホクシン	1,200	107.00	128,400
ウッドワン	3,000	222.00	666,000
大建工業	5,000	294.00	1,470,000
凸版印刷	36,000	879.00	31,644,000

大日本印刷	38,000	1,082.00	41,116,000
図書印刷	3,000	485.00	1,455,000
共同印刷	4,000	308.00	1,232,000
日本写真印刷	2,200	1,940.00	4,268,000
光村印刷	1,000	178.00	178,000
宝印刷	600	1,295.00	777,000
アシックス	12,000	1,686.00	20,232,000
ツツミ	700	1,935.00	1,354,500
小松ウオール工業	500	1,525.00	762,500
ヤマハ	9,500	2,975.00	28,262,500
河合楽器製作所	500	1,811.00	905,500
クリナップ	1,500	714.00	1,071,000
ピジョン	7,300	3,005.00	21,936,500
兼松日産農林	2,000	132.00	264,000
キングジム	1,100	814.00	895,400
リンテック	3,100	1,908.00	5,914,800
T A S A K I	300	1,318.00	395,400
イトーキ	2,700	566.00	1,528,200
任天堂	8,000	13,865.00	110,920,000
三菱鉛筆	1,000	4,605.00	4,605,000
タカラスタンド	5,000	903.00	4,515,000
コクヨ	6,700	1,467.00	9,828,900
ナカバヤシ	3,000	244.00	732,000
岡村製作所	4,500	1,003.00	4,513,500
美津濃	7,000	490.00	3,430,000
アデランス	2,300	511.00	1,175,300
東京電力ホールディングス	109,500	415.00	45,442,500
中部電力	39,500	1,422.50	56,188,750
関西電力	52,600	971.50	51,100,900
中国電力	17,800	1,264.00	22,499,200
北陸電力	12,700	1,248.00	15,849,600
東北電力	32,200	1,264.00	40,700,800
四国電力	11,600	1,175.00	13,630,000
九州電力	28,500	977.00	27,844,500
北海道電力	12,100	819.00	9,909,900
沖縄電力	2,100	2,173.00	4,563,300
電源開発	11,000	2,362.00	25,982,000
ファーストエスコ	500	685.00	342,500
イーレックス	400	1,963.00	785,200
東京瓦斯	144,000	408.30	58,795,200
大阪瓦斯	133,000	386.40	51,391,200
東邦瓦斯	33,000	788.00	26,004,000

北海道瓦斯	3,000	277.00	831,000
広島ガス	2,300	302.00	694,600
西部瓦斯	14,000	249.00	3,486,000
静岡ガス	3,700	708.00	2,619,600
メタウォーター	800	2,639.00	2,111,200
SBSホールディングス	1,300	707.00	919,100
東武鉄道	69,000	546.00	37,674,000
相鉄ホールディングス	22,000	568.00	12,496,000
東京急行電鉄	75,000	868.00	65,100,000
京浜急行電鉄	35,000	1,000.00	35,000,000
小田急電鉄	41,000	1,156.00	47,396,000
京王電鉄	36,000	934.00	33,624,000
京成電鉄	19,000	1,295.00	24,605,000
富士急行	3,000	1,396.00	4,188,000
東日本旅客鉄道	23,600	9,293.00	219,314,800
西日本旅客鉄道	12,400	6,303.00	78,157,200
東海旅客鉄道	11,600	18,090.00	209,844,000
西武ホールディングス	13,700	1,679.00	23,002,300
鴻池運輸	1,800	1,046.00	1,882,800
西日本鉄道	17,000	514.00	8,738,000
ハマキョウレックス	1,000	1,819.00	1,819,000
サカイ引越センター	500	2,832.00	1,416,000
近鉄グループホールディングス	130,000	417.00	54,210,000
阪急阪神ホールディングス	87,000	737.00	64,119,000
南海電気鉄道	29,000	559.00	16,211,000
京阪ホールディングス	29,000	696.00	20,184,000
神戸電鉄	3,000	361.00	1,083,000
名古屋鉄道	47,000	554.00	26,038,000
山陽電気鉄道	5,000	496.00	2,480,000
日本通運	50,000	443.00	22,150,000
ヤマトホールディングス	23,100	2,235.50	51,640,050
山九	17,000	535.00	9,095,000
丸運	700	230.00	161,000
丸全昭和運輸	4,000	368.00	1,472,000
センコー	5,800	595.00	3,451,000
トナミホールディングス	3,000	252.00	756,000
ニッコンホールディングス	4,100	1,821.00	7,466,100
日本石油輸送	1,000	218.00	218,000
福山通運	8,000	533.00	4,264,000
セイノーホールディングス	9,200	897.00	8,252,400
神奈川中央交通	2,000	598.00	1,196,000
日立物流	2,700	1,625.00	4,387,500

丸和運輸機関	400	3,015.00	1,206,000
C & F ロジホールディングス	1,200	997.00	1,196,400
日本郵船	116,000	177.00	20,532,000
商船三井	63,000	208.00	13,104,000
川崎汽船	57,000	232.00	13,224,000
N S ユナイテッド海運	6,000	128.00	768,000
明治海運	1,200	292.00	350,400
飯野海運	6,700	370.00	2,479,000
共栄タンカー	1,000	162.00	162,000
乾汽船	1,000	894.00	894,000
日本航空	24,700	3,266.00	80,670,200
A N A ホールディングス	240,000	290.30	69,672,000
パスコ	1,000	300.00	300,000
トランコム	400	6,430.00	2,572,000
日新	5,000	290.00	1,450,000
三菱倉庫	9,000	1,351.00	12,159,000
三井倉庫ホールディングス	7,000	261.00	1,827,000
住友倉庫	9,000	488.00	4,392,000
澁澤倉庫	3,000	269.00	807,000
東陽倉庫	2,000	218.00	436,000
日本トランスシティ	3,000	336.00	1,008,000
ケイヒン	3,000	127.00	381,000
中央倉庫	700	878.00	614,600
安田倉庫	1,000	625.00	625,000
東洋埠頭	4,000	137.00	548,000
宇徳	1,000	293.00	293,000
上組	15,000	921.00	13,815,000
サンリツ	300	489.00	146,700
キムラユニティー	300	1,008.00	302,400
キューソー流通システム	400	2,564.00	1,025,600
郵船ロジスティクス	1,200	975.00	1,170,000
近鉄エクスプレス	2,300	1,206.00	2,773,800
東海運	700	253.00	177,100
エーアイティー	800	836.00	668,800
内外トランスライン	400	922.00	368,800
N E C ネットズエスアイ	1,600	1,799.00	2,878,400
システナ	1,200	1,345.00	1,614,000
デジタルアーツ	600	2,773.00	1,663,800
新日鉄住金ソリューションズ	2,100	1,606.00	3,372,600
キューブシステム	500	673.00	336,500
コア	600	910.00	546,000
ソフトクリエイイトホールディングス	600	939.00	563,400

I Tホールディングス	4,200	2,288.00	9,609,600
ネオス	400	556.00	222,400
電算システム	500	1,453.00	726,500
グリー	7,700	562.00	4,327,400
コーエーテックホールディングス	3,000	1,796.00	5,388,000
三菱総合研究所	500	3,030.00	1,515,000
ボルテージ	200	1,152.00	230,400
電算	100	1,798.00	179,800
A G S	300	986.00	295,800
ファインデックス	800	1,257.00	1,005,600
ヒト・コミュニケーションズ	300	1,976.00	592,800
ブレインパッド	200	1,079.00	215,800
K L a b	2,000	579.00	1,158,000
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	900	748.00	673,200
イーブックイニシアティブジャパン	300	832.00	249,600
ネクソン	12,200	1,518.00	18,519,600
アイスタイル	2,000	636.00	1,272,000
エムアップ	400	550.00	220,000
エイチーム	700	1,782.00	1,247,400
テクノスジャパン	400	2,098.00	839,200
コロブラ	3,600	1,937.00	6,973,200
モバイルクリエイト	800	343.00	274,400
ブロードリーフ	1,300	952.00	1,237,600
ハーツユナイテッドグループ	400	2,930.00	1,172,000
メディアドゥ	300	1,465.00	439,500
ブイキューブ	800	967.00	773,600
サイバーリンクス	200	971.00	194,200
ディー・エル・イー	400	822.00	328,800
VOYAGE GROUP	400	1,049.00	419,600
オブティム	100	4,370.00	437,000
ベリサーブ	200	3,185.00	637,000
ティーガイア	1,300	1,452.00	1,887,600
日本アジアグループ	1,500	420.00	630,000
豆蔵ホールディングス	1,000	928.00	928,000
テクマトリックス	600	2,078.00	1,246,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	29,700	276.00	8,197,200
GMOペイメントゲートウェイ	1,000	5,620.00	5,620,000
ザッパラス	700	359.00	251,300
インターネットイニシアティブ	2,000	1,997.00	3,994,000
さくらインターネット	800	864.00	691,200
GMOクラウド	300	1,044.00	313,200
SRAホールディングス	700	1,982.00	1,387,400

Minor iソリューションズ	300	831.00	249,300
システムインテグレータ	200	613.00	122,600
朝日ネット	1,100	441.00	485,100
コムチュア	200	3,135.00	627,000
サイバーコム	100	775.00	77,500
g u m i	1,300	810.00	1,053,000
パイプドHD	200	962.00	192,400
フェイス	300	1,071.00	321,300
ハイマックス	100	1,044.00	104,400
野村総合研究所	8,900	3,690.00	32,841,000
サイバネットシステム	1,000	682.00	682,000
C Eホールディングス	200	938.00	187,600
インテージホールディングス	700	1,556.00	1,089,200
東邦システムサイエンス	400	551.00	220,400
ソースネクスト	700	423.00	296,100
ティー・ワイ・オー	2,600	158.00	410,800
フォーカスシステムズ	500	452.00	226,000
クレスコ	300	2,050.00	615,000
フジ・メディア・ホールディングス	13,300	1,122.00	14,922,600
オービック	4,400	5,460.00	24,024,000
ジャストシステム	2,300	832.00	1,913,600
T D Cソフトウェアエンジニアリング	600	597.00	358,200
ヤフー	91,200	451.00	41,131,200
トレンドマイクロ	6,200	3,530.00	21,886,000
インフォメーション・ディベロプメント	200	987.00	197,400
日本オラクル	2,000	5,620.00	11,240,000
アルファシステムズ	400	1,620.00	648,000
フューチャー	1,500	726.00	1,089,000
C A C H o l d i n g s	1,000	808.00	808,000
ソフトバンク・テクノロジー	400	1,910.00	764,000
トーセ	400	639.00	255,600
オービックビジネスコンサルタント	700	4,565.00	3,195,500
伊藤忠テクノソリューションズ	2,900	2,157.00	6,255,300
アイティフォー	1,700	495.00	841,500
東計電算	200	1,724.00	344,800
エックスネット	100	1,506.00	150,600
大塚商会	3,400	4,785.00	16,269,000
サイボウズ	1,700	384.00	652,800
ソフトブレーン	1,900	237.00	450,300
電通国際情報サービス	800	1,547.00	1,237,600
E Mシステムズ	400	1,199.00	479,600
ウェザーニューズ	400	3,595.00	1,438,000

C I J	1,100	457.00	502,700
東洋ビジネスエンジニアリング	100	1,407.00	140,700
日本エンタープライズ	1,300	289.00	375,700
WOWOW	600	2,372.00	1,423,200
フュージョンパートナー	800	513.00	410,400
日本コロムビア	500	443.00	221,500
イマジカ・ロボット ホールディングス	1,100	434.00	477,400
ネットワンシステムズ	5,500	616.00	3,388,000
アルゴグラフィックス	600	1,570.00	942,000
マーベラス	2,100	775.00	1,627,500
エイベックス・グループ・ホールディングス	2,300	1,174.00	2,700,200
日本ユニシス	3,500	1,161.00	4,063,500
兼松エレクトロニクス	800	1,791.00	1,432,800
東京放送ホールディングス	7,600	1,324.00	10,062,400
日本テレビホールディングス	11,600	1,621.00	18,803,600
朝日放送	1,300	606.00	787,800
テレビ朝日ホールディングス	3,500	1,548.00	5,418,000
スカパーJ S A Tホールディングス	9,700	456.00	4,423,200
テレビ東京ホールディングス	1,200	1,958.00	2,349,600
日本BS放送	300	973.00	291,900
U - N E X T	400	816.00	326,400
ワイヤレスゲート	400	1,654.00	661,600
コネクシオ	1,100	1,281.00	1,409,100
日本通信	9,100	220.00	2,002,000
クロップス	300	498.00	149,400
日本電信電話	98,400	4,720.00	464,448,000
K D D I	129,400	3,043.00	393,764,200
光通信	1,500	8,510.00	12,765,000
N T T ドコモ	95,200	2,732.50	260,134,000
エムティーアイ	1,900	649.00	1,233,100
G M O インターネット	4,600	1,025.00	4,715,000
カドカワ	4,000	1,367.00	5,468,000
学研ホールディングス	4,000	246.00	984,000
ゼンリン	1,700	1,970.00	3,349,000
昭文社	700	545.00	381,500
インプレスホールディングス	1,100	127.00	139,700
アイネット	700	1,028.00	719,600
松竹	8,000	1,024.00	8,192,000
東宝	9,100	2,732.00	24,861,200
東映	5,000	941.00	4,705,000
A O I P r o .	600	827.00	496,200
エヌ・ティ・ティ・データ	7,900	4,785.00	37,801,500

ピー・シー・エー	200	1,122.00	224,400
ビジネスブレイン太田昭和	200	893.00	178,600
D T S	1,400	1,913.00	2,678,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,400	3,140.00	16,956,000
シーイーシー	800	1,336.00	1,068,800
カプコン	3,300	2,284.00	7,537,200
アイ・エス・ビー	200	790.00	158,000
ジャステック	800	921.00	736,800
S C S K	3,000	3,655.00	10,965,000
日本システムウエア	500	1,039.00	519,500
アイネス	1,800	975.00	1,755,000
T K C	1,200	2,536.00	3,043,200
富士ソフト	1,900	2,292.00	4,354,800
N S D	2,700	1,557.00	4,203,900
コナミホールディングス	5,700	3,785.00	21,574,500
福井コンピュータホールディングス	400	1,883.00	753,200
J B C Cホールディングス	1,100	644.00	708,400
ミロク情報サービス	1,000	1,367.00	1,367,000
ソフトバンクグループ	72,100	5,655.00	407,725,500
ハウスイ	1,000	105.00	105,000
高千穂交易	500	871.00	435,500
伊藤忠食品	300	4,050.00	1,215,000
エレマテック	600	1,948.00	1,168,800
J A L U X	400	1,629.00	651,600
あらた	600	2,128.00	1,276,800
トーメンデバイス	200	1,862.00	372,400
東京エレクトロン デバイス	500	1,477.00	738,500
フィールズ	1,100	1,246.00	1,370,600
双日	80,300	235.00	18,870,500
アルフレッサ ホールディングス	16,000	2,140.00	34,240,000
横浜冷凍	3,100	1,003.00	3,109,300
神栄	2,000	105.00	210,000
山下医科器械	100	1,632.00	163,200
ラサ商事	600	460.00	276,000
ラクーン	600	498.00	298,800
アルコニックス	700	1,425.00	997,500
神戸物産	800	2,101.00	1,680,800
あい ホールディングス	2,300	2,248.00	5,170,400
ディーブイエックス	400	1,107.00	442,800
ダイワボウホールディングス	12,000	213.00	2,556,000
マクニカ・富士エレホールディングス	2,300	1,052.00	2,419,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,200	999.00	2,197,800

八洲電機	1,000	502.00	502,000	
U K Cホールディングス	800	1,527.00	1,221,600	
O C H Iホールディングス	400	981.00	392,400	
T O K A Iホールディングス	5,600	650.00	3,640,000	
三洋貿易	700	1,152.00	806,400	
ウイン・パートナーズ	500	1,414.00	707,000	
ミタチ産業	300	557.00	167,100	
シップヘルスケアホールディングス	2,600	3,105.00	8,073,000	
明治電機工業	400	969.00	387,600	
デリカフーズ	300	942.00	282,600	
スターティア	300	460.00	138,000	
富士興産	500	377.00	188,500	
協栄産業	2,000	122.00	244,000	
小野建	1,100	1,145.00	1,259,500	
佐島電機	1,000	662.00	662,000	
エコートレーディング	300	567.00	170,100	
伯東	1,000	851.00	851,000	
コンドーテック	1,000	729.00	729,000	
中山福	800	765.00	612,000	
ナガイレーベン	1,800	2,363.00	4,253,400	
三菱食品	1,400	2,703.00	3,784,200	
松田産業	900	1,240.00	1,116,000	
第一興商	2,300	4,180.00	9,614,000	
メディバルホールディングス	12,700	1,657.00	21,043,900	
アドヴァン	1,300	1,056.00	1,372,800	
S P K	300	1,870.00	561,000	
萩原電気	400	1,862.00	744,800	
アズワン	1,000	3,965.00	3,965,000	
スズデン	400	868.00	347,200	
シモジマ	900	1,019.00	917,100	
ドウシシャ	1,500	1,992.00	2,988,000	
小津産業	300	1,994.00	598,200	
高速	800	816.00	652,800	
たけびし	500	996.00	498,000	
黒田電気	2,400	1,690.00	4,056,000	
丸文	1,100	574.00	631,400	
ハピネット	1,200	860.00	1,032,000	
橋本総業ホールディングス	300	1,447.00	434,100	
エクセル	600	1,275.00	765,000	
マルカキカイ	400	1,087.00	434,800	
ガリバーインターナショナル	3,400	869.00	2,954,600	
日本エム・ディ・エム	1,100	662.00	728,200	

進和	800	1,308.00	1,046,400
エスケイジャパン	400	203.00	81,200
ダイトエレクトロン	600	562.00	337,200
シークス	800	3,170.00	2,536,000
田中商事	400	625.00	250,000
オーハシテクニカ	700	1,179.00	825,300
白銅	400	1,042.00	416,800
伊藤忠商事	99,900	1,222.50	122,127,750
丸紅	125,300	445.60	55,833,680
高島	2,000	153.00	306,000
長瀬産業	7,600	1,092.00	8,299,200
蝶理	800	1,310.00	1,048,000
豊田通商	14,200	2,111.00	29,976,200
三共生興	1,900	319.00	606,100
兼松	27,000	161.00	4,347,000
ツカモトコーポレーション	3,000	98.00	294,000
三井物産	115,200	1,190.50	137,145,600
日本紙パルプ商事	6,000	331.00	1,986,000
日立ハイテクノロジーズ	4,400	2,738.00	12,047,200
カメイ	1,700	804.00	1,366,800
東都水産	2,000	155.00	310,000
OUGホールディングス	2,000	229.00	458,000
スターゼン	500	3,740.00	1,870,000
山善	4,900	824.00	4,037,600
椿本興業	1,000	257.00	257,000
住友商事	80,100	1,001.00	80,180,100
内田洋行	3,000	440.00	1,320,000
三菱商事	95,500	1,732.00	165,406,000
第一実業	3,000	435.00	1,305,000
キャノンマーケティングジャパン	3,600	1,912.00	6,883,200
西華産業	4,000	248.00	992,000
佐藤商事	1,100	596.00	655,600
菱洋エレクトロ	1,400	1,289.00	1,804,600
東京産業	1,300	341.00	443,300
ユアサ商事	1,200	2,070.00	2,484,000
神鋼商事	3,000	164.00	492,000
小林産業	900	229.00	206,100
阪和興業	13,000	522.00	6,786,000
カナデン	1,200	852.00	1,022,400
菱電商事	2,000	628.00	1,256,000
フルサト工業	700	1,217.00	851,900
岩谷産業	15,000	567.00	8,505,000

すてきナイスグループ	6,000	138.00	828,000	
昭光通商	5,000	70.00	350,000	
ニチモウ	2,000	157.00	314,000	
極東貿易	2,000	178.00	356,000	
イワキ	2,000	179.00	358,000	
三愛石油	3,100	642.00	1,990,200	
稲畑産業	3,000	927.00	2,781,000	
G S Iクレオス	3,000	91.00	273,000	
明和産業	1,200	288.00	345,600	
ワキタ	2,700	661.00	1,784,700	
東邦ホールディングス	4,100	2,505.00	10,270,500	
サンゲツ	4,400	1,844.00	8,113,600	
ミツウロコグループホールディングス	2,100	496.00	1,041,600	
シナネンホールディングス	3,000	391.00	1,173,000	
伊藤忠エネクス	3,300	924.00	3,049,200	
サンリオ	3,900	1,782.00	6,949,800	
サンワテクノス	800	683.00	546,400	
リョーサン	2,000	2,395.00	4,790,000	
新光商事	1,500	945.00	1,417,500	
トーホー	600	2,370.00	1,422,000	
三信電気	1,800	837.00	1,506,600	
東陽テクニカ	1,700	978.00	1,662,600	
モスフードサービス	1,700	2,914.00	4,953,800	
加賀電子	1,200	1,136.00	1,363,200	
ソーダニッカ	1,300	457.00	594,100	
立花エレテック	900	1,023.00	920,700	
フォーバル	700	710.00	497,000	
P A L T A C	2,000	2,070.00	4,140,000	
三谷産業	1,400	308.00	431,200	
太平洋興発	6,000	68.00	408,000	
ヤマタネ	6,000	136.00	816,000	
丸紅建材リース	1,000	168.00	168,000	
日鉄住金物産	11,000	325.00	3,575,000	
トラスコ中山	1,400	4,945.00	6,923,000	
オートバックスセブン	4,900	1,420.00	6,958,000	
加藤産業	2,000	2,438.00	4,876,000	
イノテック	1,100	408.00	448,800	
イエローハット	1,200	2,436.00	2,923,200	
J Kホールディングス	1,300	439.00	570,700	
日伝	500	3,020.00	1,510,000	
北沢産業	1,200	143.00	171,600	
杉本商事	700	1,099.00	769,300	

因幡電機産業	1,800	3,440.00	6,192,000
バイテックホールディングス	500	1,002.00	501,000
ミスミグループ本社	14,300	1,771.00	25,325,300
アルテック	1,300	126.00	163,800
タキヒヨー	2,000	420.00	840,000
蔵王産業	200	1,281.00	256,200
スズケン	5,800	3,225.00	18,705,000
ジェコス	900	984.00	885,600
ルネサスイーストン	1,100	367.00	403,700
ローソン	4,800	8,320.00	39,936,000
サンエー	900	4,960.00	4,464,000
ダイユーエイト	400	636.00	254,400
カワチ薬品	1,000	2,484.00	2,484,000
エービーシー・マート	1,700	6,880.00	11,696,000
ハードオフコーポレーション	600	1,157.00	694,200
アスクル	1,500	3,350.00	5,025,000
ゲオホールディングス	2,100	1,377.00	2,891,700
アダストリア	2,300	3,875.00	8,912,500
ジーフット	800	709.00	567,200
シー・ヴィ・エス・バイエリア	2,000	71.00	142,000
くらコーポレーション	700	5,950.00	4,165,000
キャンドウ	700	1,638.00	1,146,600
パル	700	2,287.00	1,600,900
エディオン	5,400	843.00	4,552,200
サーラコーポレーション	1,100	536.00	589,600
ワッツ	600	1,004.00	602,400
ハローズ	400	2,035.00	814,000
あみやき亭	300	4,420.00	1,326,000
ひらまつ	1,800	623.00	1,121,400
ゲンキー	300	3,245.00	973,500
サッポロドラッグストアー	200	1,940.00	388,000
大黒天物産	300	4,695.00	1,408,500
ハニーズ	1,100	994.00	1,093,400
ファーマライズホールディングス	300	507.00	152,100
アルペン	1,100	1,710.00	1,881,000
クオール	1,300	1,333.00	1,732,900
ジェイアイエヌ	900	3,910.00	3,519,000
ビックカメラ	7,300	938.00	6,847,400
D C Mホールディングス	6,300	767.00	4,832,100
Monotaro	4,500	3,345.00	15,052,500
東京一番フーズ	400	532.00	212,800
ダイヤモンドダイニング	300	983.00	294,900

きちり	400	609.00	243,600
アークランドサービス	400	2,939.00	1,175,600
J. フロント リテイリング	16,100	1,124.00	18,096,400
ドトール・日レスホールディングス	2,200	1,806.00	3,973,200
マツモトキヨシホールディングス	2,600	5,080.00	13,208,000
ブロンコピリー	700	3,235.00	2,264,500
スタートトゥデイ	3,900	5,480.00	21,372,000
トレジャー・ファクトリー	400	1,019.00	407,600
物語コーポレーション	300	5,250.00	1,575,000
ココカラファイン	1,300	5,180.00	6,734,000
三越伊勢丹ホールディングス	25,300	920.00	23,276,000
ウエルシアホールディングス	1,100	6,170.00	6,787,000
クリエイティブSDホールディングス	1,900	2,921.00	5,549,900
丸善CHIホールディングス	1,500	374.00	561,000
ミサワ	300	488.00	146,400
エー・ピーカンパニー	200	828.00	165,600
チムニー	300	2,833.00	849,900
シュッピン	500	1,196.00	598,000
ネクステージ	200	627.00	125,400
ジョイフル本田	2,100	2,301.00	4,832,100
鳥貴族	300	1,946.00	583,800
麒麟堂ホールディングス	400	892.00	356,800
ホットランド	500	988.00	494,000
すかいらーく	3,900	1,294.00	5,046,600
綿半ホールディングス	500	1,497.00	748,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,200	1,028.00	4,317,600
ブックオフコーポレーション	800	836.00	668,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	400	902.00	360,800
あさひ	1,000	1,563.00	1,563,000
日本調剤	300	4,820.00	1,446,000
コスモス薬品	600	20,080.00	12,048,000
トーエル	600	734.00	440,400
一六堂	400	307.00	122,800
セブン&アイ・ホールディングス	53,300	4,351.00	231,908,300
薬王堂	200	4,175.00	835,000
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	3,400	916.00	3,114,400
ツルハホールディングス	2,900	12,540.00	36,366,000
サンマルクホールディングス	1,000	2,943.00	2,943,000
フェリシモ	400	1,014.00	405,600
トリドール	1,600	2,730.00	4,368,000
クスリのアオキ	1,100	6,420.00	7,062,000

メディカルシステムネットワーク	1,500	465.00	697,500
総合メディカル	600	3,880.00	2,328,000
はるやま商事	600	716.00	429,600
カッパ・クリエイト	1,800	1,251.00	2,251,800
ライトオン	1,000	1,325.00	1,325,000
ジーンズメイト	500	163.00	81,500
良品計画	1,500	24,940.00	37,410,000
三城ホールディングス	1,600	411.00	657,600
アルビス	400	2,090.00	836,000
コナカ	1,600	472.00	755,200
ハウス オブ ローゼ	200	1,408.00	281,600
G - 7ホールディングス	400	1,170.00	468,000
イオン北海道	900	504.00	453,600
コジマ	2,000	233.00	466,000
ヒマラヤ	400	910.00	364,000
コーナン商事	1,800	1,891.00	3,403,800
エコス	500	1,169.00	584,500
マルシェ	400	817.00	326,800
ドンキホーテホールディングス	8,200	3,860.00	31,652,000
西松屋チェーン	2,500	1,471.00	3,677,500
ゼンショーホールディングス	6,600	1,461.00	9,642,600
幸楽苑ホールディングス	800	1,519.00	1,215,200
ハークスレイ	400	946.00	378,400
サイゼリヤ	2,100	1,838.00	3,859,800
V Tホールディングス	4,300	477.00	2,051,100
魚力	400	1,296.00	518,400
ポブラ	400	493.00	197,200
ユナイテッドアローズ	1,800	2,934.00	5,281,200
ハイデイ日高	1,200	2,495.00	2,994,000
京都きもの友禅	900	804.00	723,600
コロワイド	4,200	1,811.00	7,606,200
ピーシーデポコーポレーション	1,400	1,432.00	2,004,800
壱番屋	1,200	3,540.00	4,248,000
トップカルチャー	500	440.00	220,000
P L A N T	300	1,126.00	337,800
スギホールディングス	2,300	5,610.00	12,903,000
スクロール	2,000	374.00	748,000
ヨンドシーホールディングス	1,000	2,048.00	2,048,000
ファミリーマート	3,900	6,250.00	24,375,000
木曽路	1,600	2,210.00	3,536,000
サトレストランシステムズ	1,500	803.00	1,204,500
千趣会	2,500	660.00	1,650,000

タカキュー	1,100	169.00	185,900
ケーヨー	2,200	517.00	1,137,400
上新電機	3,000	853.00	2,559,000
日本瓦斯	2,000	2,202.00	4,404,000
ベスト電器	4,400	100.00	440,000
ロイヤルホールディングス	2,100	1,840.00	3,864,000
東天紅	1,000	128.00	128,000
いなげや	1,400	1,325.00	1,855,000
島忠	3,300	2,177.00	7,184,100
チヨダ	1,500	2,164.00	3,246,000
ライフコーポレーション	800	2,759.00	2,207,200
リンガーハット	1,100	2,290.00	2,519,000
さが美	1,000	77.00	77,000
MrMax	1,200	266.00	319,200
テンアライド	1,300	358.00	465,400
AOKIホールディングス	2,900	1,056.00	3,062,400
オークワ	2,000	1,109.00	2,218,000
コメリ	2,000	2,604.00	5,208,000
青山商事	2,400	3,595.00	8,628,000
しまむら	1,500	14,550.00	21,825,000
はせがわ	700	413.00	289,100
高島屋	19,000	688.00	13,072,000
松屋	2,600	689.00	1,791,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	6,500	1,403.00	9,119,500
近鉄百貨店	5,000	340.00	1,700,000
丸栄	3,000	81.00	243,000
ニッセンホールディングス	2,100	84.00	176,400
パルコ	1,200	822.00	986,400
丸井グループ	15,600	1,354.00	21,122,400
アクシアル リテイリング	1,000	3,410.00	3,410,000
イオン	52,400	1,545.00	80,958,000
ユニグループ・ホールディングス	12,200	861.00	10,504,200
イズミ	2,500	3,950.00	9,875,000
東武ストア	2,000	292.00	584,000
平和堂	2,600	2,250.00	5,850,000
フジ	1,400	2,388.00	3,343,200
ヤオコー	1,500	4,410.00	6,615,000
ゼビオホールディングス	1,700	1,419.00	2,412,300
ケーズホールディングス	5,400	1,847.00	9,973,800
Olympicグループ	800	480.00	384,000
日産東京販売ホールディングス	2,200	209.00	459,800
アインホールディングス	1,500	7,460.00	11,190,000

元気寿司	400	2,017.00	806,800	
ヤマダ電機	38,700	538.00	20,820,600	
アークランドサカモト	2,200	1,132.00	2,490,400	
ニトリホールディングス	5,500	12,870.00	70,785,000	
愛眼	1,200	193.00	231,600	
ケーユーホールディングス	700	690.00	483,000	
吉野家ホールディングス	4,700	1,364.00	6,410,800	
松屋フーズ	600	2,723.00	1,633,800	
サガミチェーン	1,700	1,197.00	2,034,900	
関西スーパーマーケット	1,100	1,014.00	1,115,400	
王将フードサービス	900	3,685.00	3,316,500	
プレナス	1,400	1,707.00	2,389,800	
ミニストップ	1,000	1,665.00	1,665,000	
アークス	2,400	2,381.00	5,714,400	
パローホールディングス	2,700	2,716.00	7,333,200	
藤久	100	1,727.00	172,700	
ベルク	600	4,165.00	2,499,000	
大庄	700	1,489.00	1,042,300	
ファーストリテイリング	2,100	27,385.00	57,508,500	
サンドラッグ	2,700	9,390.00	25,353,000	
サックスパー ホールディングス	1,200	1,033.00	1,239,600	
ヤマザワ	300	1,702.00	510,600	
やまや	300	1,659.00	497,700	
ペルーナ	3,200	591.00	1,891,200	
島根銀行	300	1,161.00	348,300	
じもとホールディングス	9,100	140.00	1,274,000	
足利ホールディングス	9,400	318.00	2,989,200	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	1,800	2,360.00	4,248,000	
九州フィナンシャルグループ	19,500	488.00	9,516,000	
ゆうちょ銀行	32,600	1,169.00	38,109,400	
富山第一銀行	3,300	467.00	1,541,100	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	88,700	400.40	35,515,480	
新生銀行	110,000	145.00	15,950,000	
あおぞら銀行	81,000	353.00	28,593,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,021,700	455.90	465,793,030	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	149,000	374.90	55,860,100	
三井住友トラスト・ホールディングス	269,000	326.30	87,774,700	
三井住友フィナンシャルグループ	102,000	2,915.00	297,330,000	代用有価証券 10,000株
第四銀行	16,000	320.00	5,120,000	
北越銀行	14,000	174.00	2,436,000	
西日本シティ銀行	41,000	178.00	7,298,000	

千葉銀行	49,000	478.00	23,422,000
常陽銀行	46,000	374.00	17,204,000
群馬銀行	28,000	372.00	10,416,000
武蔵野銀行	2,000	2,287.00	4,574,000
千葉興業銀行	3,500	378.00	1,323,000
筑波銀行	5,300	268.00	1,420,400
七十七銀行	20,000	361.00	7,220,000
青森銀行	9,000	276.00	2,484,000
秋田銀行	8,000	285.00	2,280,000
山形銀行	7,000	392.00	2,744,000
岩手銀行	900	3,895.00	3,505,500
東邦銀行	11,000	320.00	3,520,000
東北銀行	7,000	136.00	952,000
みちのく銀行	6,000	180.00	1,080,000
ふくおかフィナンシャルグループ	55,000	340.00	18,700,000
静岡銀行	37,000	707.00	26,159,000
十六銀行	16,000	259.00	4,144,000
スルガ銀行	12,100	2,258.00	27,321,800
八十二銀行	23,100	436.00	10,071,600
山梨中央銀行	8,000	354.00	2,832,000
大垣共立銀行	17,000	280.00	4,760,000
福井銀行	11,000	223.00	2,453,000
北國銀行	13,000	274.00	3,562,000
清水銀行	400	2,202.00	880,800
富山銀行	300	3,555.00	1,066,500
滋賀銀行	12,000	434.00	5,208,000
南都銀行	12,000	317.00	3,804,000
百五銀行	12,000	351.00	4,212,000
京都銀行	24,000	618.00	14,832,000
紀陽銀行	5,000	1,258.00	6,290,000
三重銀行	6,000	176.00	1,056,000
ほくほくフィナンシャルグループ	87,000	113.00	9,831,000
広島銀行	38,000	332.00	12,616,000
山陰合同銀行	7,700	667.00	5,135,900
中国銀行	9,000	1,026.00	9,234,000
鳥取銀行	4,000	162.00	648,000
伊予銀行	13,600	611.00	8,309,600
百十四銀行	14,000	294.00	4,116,000
四国銀行	10,000	197.00	1,970,000
阿波銀行	10,000	527.00	5,270,000
大分銀行	7,000	290.00	2,030,000
宮崎銀行	8,000	252.00	2,016,000

佐賀銀行	8,000	211.00	1,688,000
十八銀行	8,000	239.00	1,912,000
沖縄銀行	1,000	3,530.00	3,530,000
琉球銀行	2,600	998.00	2,594,800
セブン銀行	47,700	314.00	14,977,800
みずほフィナンシャルグループ	1,805,200	149.30	269,516,360
高知銀行	5,000	96.00	480,000
山口フィナンシャルグループ	12,000	945.00	11,340,000
長野銀行	4,000	190.00	760,000
名古屋銀行	11,000	310.00	3,410,000
北洋銀行	19,200	273.00	5,241,600
愛知銀行	400	4,270.00	1,708,000
第三銀行	7,000	152.00	1,064,000
中京銀行	5,000	236.00	1,180,000
大光銀行	5,000	175.00	875,000
愛媛銀行	7,000	234.00	1,638,000
トマト銀行	5,000	136.00	680,000
みなと銀行	12,000	150.00	1,800,000
京葉銀行	10,000	384.00	3,840,000
関西アーバン銀行	1,800	901.00	1,621,800
栃木銀行	7,000	357.00	2,499,000
北日本銀行	400	2,404.00	961,600
東和銀行	24,000	79.00	1,896,000
福島銀行	16,000	86.00	1,376,000
大東銀行	8,000	179.00	1,432,000
トモニホールディングス	9,800	300.00	2,940,000
フィデアホールディングス	10,400	137.00	1,424,800
池田泉州ホールディングス	13,500	378.00	5,103,000
F P G	4,600	1,031.00	4,742,600
S B I ホールディングス	15,300	971.00	14,856,300
ジャフコ	2,100	2,504.00	5,258,400
大和証券グループ本社	119,000	533.00	63,427,000
野村ホールディングス	245,100	358.30	87,819,330
岡三証券グループ	11,000	453.00	4,983,000
丸三証券	3,800	861.00	3,271,800
東洋証券	5,000	184.00	920,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	14,600	429.00	6,263,400
光世証券	3,000	103.00	309,000
水戸証券	4,000	222.00	888,000
いちよし証券	2,900	704.00	2,041,600
松井証券	6,200	833.00	5,164,600
だいこう証券ビジネス	600	565.00	339,000

マネックスグループ	14,800	229.00	3,389,200
カブドットコム証券	10,800	317.00	3,423,600
極東証券	1,700	1,046.00	1,778,200
岩井コスモホールディングス	1,200	828.00	993,600
藍澤証券	2,400	508.00	1,219,200
マネースクウェアHD	400	759.00	303,600
マネーパートナーズグループ	1,200	491.00	589,200
かんぽ生命保険	5,200	2,037.00	10,592,400
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	28,300	2,643.50	74,811,050
アニコムホールディングス	900	2,570.00	2,313,000
MS & A Dインシュアランスグループホールディングス	38,000	2,550.00	96,900,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	12,200	1,124.00	13,712,800
第一生命保険	81,600	1,080.50	88,168,800
東京海上ホールディングス	51,600	3,197.00	164,965,200
T & Dホールディングス	46,400	847.00	39,300,800
全国保証	3,300	3,675.00	12,127,500
クレディセゾン	9,700	1,719.00	16,674,300
芙蓉総合リース	1,500	4,005.00	6,007,500
興銀リース	2,400	1,720.00	4,128,000
東京センチュリーリース	3,000	3,380.00	10,140,000
日本証券金融	5,700	384.00	2,188,800
アイフル	21,400	288.00	6,163,200
ポケットカード	1,300	528.00	686,400
リコーリース	1,000	2,591.00	2,591,000
イオンフィナンシャルサービス	8,400	2,163.00	18,169,200
アコム	25,600	471.00	12,057,600
ジャックス	7,000	470.00	3,290,000
オリエントコーポレーション	55,100	184.00	10,138,400
日立キャピタル	3,000	1,852.00	5,556,000
アプラスフィナンシャル	6,300	92.00	579,600
オリックス	90,200	1,281.00	115,546,200
三菱UFJリース	32,400	383.00	12,409,200
日本取引所グループ	37,400	1,132.00	42,336,800
イー・ギャランティ	400	2,992.00	1,196,800
アサックス	200	1,302.00	260,400
NECキャピタルソリューション	500	1,367.00	683,500
いちごグループホールディングス	14,100	383.00	5,400,300
日本駐車場開発	15,300	118.00	1,805,400
ヒューリック	26,600	1,008.00	26,812,800
三栄建築設計	500	1,093.00	546,500
野村不動産ホールディングス	8,400	1,711.00	14,372,400
三重交通グループホールディングス	2,300	358.00	823,400

サムティ	900	925.00	832,500
ディア・ライフ	900	306.00	275,400
エー・ディー・ワークス	12,100	36.00	435,600
日本商業開発	600	1,410.00	846,000
プレサンスコーポレーション	400	3,645.00	1,458,000
ユニゾホールディングス	800	3,885.00	3,108,000
日本管理センター	800	1,353.00	1,082,400
サンセイランディック	300	756.00	226,800
エストラスト	200	511.00	102,200
フージャースホールディングス	1,800	514.00	925,200
オープンハウス	1,800	2,716.00	4,888,800
東急不動産ホールディングス	30,800	615.00	18,942,000
飯田グループホールディングス	11,800	2,074.00	24,473,200
ムゲンエステート	200	1,905.00	381,000
エコナックホールディングス	4,000	38.00	152,000
パーク24	6,400	3,365.00	21,536,000
パラカ	400	1,428.00	571,200
三井不動産	67,000	2,268.50	151,989,500
三菱地所	95,000	1,822.00	173,090,000
平和不動産	2,400	1,288.00	3,091,200
東京建物	13,900	1,179.00	16,388,100
ダイビル	3,300	886.00	2,923,800
京阪神ビルディング	2,100	509.00	1,068,900
住友不動産	31,000	2,615.50	81,080,500
大京	24,000	144.00	3,456,000
テーオーシー	4,900	804.00	3,939,600
東京楽天地	2,000	475.00	950,000
レオパレス21	15,000	671.00	10,065,000
スターツコーポレーション	1,500	1,995.00	2,992,500
フジ住宅	1,600	648.00	1,036,800
空港施設	1,600	489.00	782,400
明和地所	700	536.00	375,200
住友不動産販売	900	1,918.00	1,726,200
ゴールドクレスト	1,000	1,588.00	1,588,000
日本エスリード	500	985.00	492,500
日神不動産	1,700	356.00	605,200
タカラレーベン	5,500	727.00	3,998,500
サンヨーハウジング名古屋	700	890.00	623,000
イオンモール	8,200	1,289.00	10,569,800
ファースト住建	500	1,174.00	587,000
トーセイ	2,000	716.00	1,432,000
穴吹興産	1,000	245.00	245,000

エヌ・ティ・ティ都市開発	7,900	1,060.00	8,374,000
サンフロンティア不動産	1,600	1,005.00	1,608,000
エフ・ジェー・ネクスト	1,100	485.00	533,500
ランドビジネス	800	248.00	198,400
グランディハウス	1,100	311.00	342,100
日本空港ビルデング	4,100	3,435.00	14,083,500
日本工営	5,000	335.00	1,675,000
ネクスト	3,800	893.00	3,393,400
ジェイエイシーリクルートメント	800	1,618.00	1,294,400
日本M&Aセンター	2,100	6,590.00	13,839,000
ノバレーゼ	300	838.00	251,400
アコーディア・ゴルフ	3,700	1,020.00	3,774,000
中広	100	608.00	60,800
タケエイ	1,200	876.00	1,051,200
トラスト・テック	600	1,368.00	820,800
パソナグループ	1,200	657.00	788,400
CDS	300	792.00	237,600
リンクアンドモチベーション	2,700	181.00	488,700
GCAサヴィアン	1,200	873.00	1,047,600
エス・エム・エス	1,700	2,250.00	3,825,000
テンプホールディングス	9,400	1,716.00	16,130,400
リニカル	800	1,642.00	1,313,600
クックパッド	3,000	1,198.00	3,594,000
エスクリ	600	544.00	326,400
アイ・ケイ・ケイ	700	537.00	375,900
学情	500	1,339.00	669,500
スタジオアリス	600	2,755.00	1,653,000
シミックホールディングス	700	1,495.00	1,046,500
NJS	300	1,137.00	341,100
総合警備保障	4,500	4,800.00	21,600,000
カカクコム	9,700	1,940.00	18,818,000
ルネサンス	700	1,109.00	776,300
ディップ	1,500	2,536.00	3,804,000
オプトホールディング	800	716.00	572,800
新日本科学	1,300	560.00	728,000
ツクイ	1,600	1,732.00	2,771,200
キャリアデザインセンター	300	903.00	270,900
エムスリー	11,700	3,430.00	40,131,000
ツカダ・グローバルホールディング	1,000	681.00	681,000
アウトソーシング	600	4,265.00	2,559,000
ウェルネット	500	3,900.00	1,950,000
ディー・エヌ・エー	6,100	2,215.00	13,511,500

博報堂D Yホールディングス	18,700	1,214.00	22,701,800
ぐるなび	1,500	2,875.00	4,312,500
エスアールジータカミヤ	1,500	437.00	655,500
ジャパンベストレスキューシステム	1,700	216.00	367,200
ファンコミュニケーションズ	3,100	734.00	2,275,400
ジェイコムホールディングス	300	2,168.00	650,400
WDBホールディングス	500	753.00	376,500
ティア	700	620.00	434,000
バリューコマース	1,300	333.00	432,900
インフォマート	2,600	877.00	2,280,200
J Pホールディングス	3,400	271.00	921,400
E P Sホールディングス	1,700	1,343.00	2,283,100
レグス	300	698.00	209,400
プレステージ・インターナショナル	1,100	1,465.00	1,611,500
アミューズ	800	1,879.00	1,503,200
ドリームインキュベータ	500	1,923.00	961,500
クイック	700	750.00	525,000
T A C	800	183.00	146,400
ケネディクス	18,100	376.00	6,805,600
電通	15,000	4,750.00	71,250,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	390.00	234,000
ぴあ	400	2,031.00	812,400
イオンファンタジー	500	2,585.00	1,292,500
シーティーエス	400	706.00	282,400
みらかホールディングス	3,400	4,300.00	14,620,000
アルプス技研	500	2,055.00	1,027,500
ダイオーズ	300	954.00	286,200
日本空調サービス	1,200	511.00	613,200
オリエンタルランド	14,600	6,349.00	92,695,400
ダスキン	3,400	1,717.00	5,837,800
明光ネットワークジャパン	1,700	1,227.00	2,085,900
ファルコホールディングス	600	1,335.00	801,000
秀英予備校	200	361.00	72,200
田谷	200	682.00	136,400
ラウンドワン	4,200	803.00	3,372,600
リゾートトラスト	5,700	2,103.00	11,987,100
ビー・エム・エル	800	4,785.00	3,828,000
ワタベウェディング	400	402.00	160,800
りらいあコミュニケーションズ	2,200	1,084.00	2,384,800
リソー教育	2,500	370.00	925,000
早稲田アカデミー	200	838.00	167,600
ユー・エス・エス	16,300	1,691.00	27,563,300

東京個別指導学院	600	668.00	400,800
サイバーエージェント	3,500	6,120.00	21,420,000
楽天	63,100	1,044.00	65,876,400
テー・オー・ダブリュー	1,100	603.00	663,300
セントラルスポーツ	500	2,322.00	1,161,000
フルキャストホールディングス	1,300	776.00	1,008,800
リゾートソリューション	2,000	287.00	574,000
テクノプロ・ホールディングス	2,200	3,230.00	7,106,000
インターワークス	200	1,142.00	228,400
K e e P e r 技研	200	1,608.00	321,600
ファーストロジック	100	1,870.00	187,000
リブセンス	900	408.00	367,200
ジャパンマテリアル	600	3,685.00	2,211,000
ベクトル	400	2,797.00	1,118,800
ウチヤマホールディングス	700	433.00	303,100
サクセスホールディングス	100	1,190.00	119,000
キャリアリンク	400	736.00	294,400
I B J	1,000	539.00	539,000
アサンテ	500	1,417.00	708,500
N・フィールド	600	1,705.00	1,023,000
M&Aキャピタルパートナーズ	200	2,173.00	434,600
ライドオン・エクスプレス	300	1,223.00	366,900
E R Iホールディングス	400	780.00	312,000
アビスト	200	2,012.00	402,400
ウィルグループ	300	984.00	295,200
日本ビューホテル	200	1,271.00	254,200
リクルートホールディングス	27,200	3,765.00	102,408,000
エラン	100	1,125.00	112,500
日本郵政	39,600	1,224.00	48,470,400
ベルシステム24ホールディングス	2,700	785.00	2,119,500
リロ・ホールディング	500	17,570.00	8,785,000
東祥	400	4,355.00	1,742,000
エイチ・アイ・エス	2,200	3,285.00	7,227,000
ラックランド	200	1,625.00	325,000
共立メンテナンス	1,000	6,730.00	6,730,000
イチネンホールディングス	1,400	904.00	1,265,600
建設技術研究所	800	776.00	620,800
スペース	700	1,183.00	828,100
燦ホールディングス	300	1,345.00	403,500
スバル興業	1,000	378.00	378,000
東京テアトル	5,000	114.00	570,000
ナガワ	300	3,380.00	1,014,000

よみうりランド	3,000	403.00	1,209,000	
東京都競馬	9,000	200.00	1,800,000	
常磐興産	5,000	147.00	735,000	
カナモト	1,900	1,979.00	3,760,100	
東京ドーム	11,000	441.00	4,851,000	
西尾レントオール	1,100	2,091.00	2,300,100	
トランス・コスモス	1,600	2,818.00	4,508,800	
乃村工藝社	2,900	1,491.00	4,323,900	
藤田観光	5,000	389.00	1,945,000	
KNT - CTホールディングス	7,000	137.00	959,000	
日本管財	1,200	1,544.00	1,852,800	
トーカイ	600	3,170.00	1,902,000	
白洋舎	2,000	253.00	506,000	
セコム	14,000	7,527.00	105,378,000	
セントラル警備保障	600	1,968.00	1,180,800	
丹青社	2,500	735.00	1,837,500	
メイテック	1,600	3,380.00	5,408,000	
アサツー ディ・ケイ	2,400	2,401.00	5,762,400	
応用地質	1,300	1,086.00	1,411,800	
船井総研ホールディングス	1,900	1,329.00	2,525,100	
進学会	600	506.00	303,600	
オオバ	1,000	385.00	385,000	
学究社	200	1,127.00	225,400	
ベネッセホールディングス	4,500	2,367.00	10,651,500	
イオンディライト	1,300	2,834.00	3,684,200	
ナック	800	828.00	662,400	
ニチイ学館	2,400	674.00	1,617,600	
ダイセキ	2,500	1,952.00	4,880,000	
ステップ	400	1,035.00	414,000	
合 計	21,474,000		23,417,541,340	

(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12月25日現在	平成28年 6月27日現在
資産の部		
流動資産		
預金	703,666,128	1,018,017,609
コール・ローン	1,220,741,445	258,252,167
株式	72,126,738,590	60,263,865,073
投資証券	1,924,665,278	1,797,145,408
派生商品評価勘定	27,248,718	-
未収入金	175,892	2,309,007
未収配当金	85,614,114	103,367,198
未収利息	2,037	-
差入委託証拠金	225,764,165	234,542,987
流動資産合計	76,314,616,367	63,677,499,449
資産合計		
76,314,616,367		
63,677,499,449		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	14,296,072	74,855,038
未払解約金	18,094,509	49,840,927
未払利息	-	412
流動負債合計	32,390,581	124,696,377
負債合計		
32,390,581		
124,696,377		
純資産の部		
元本等		
元本	38,512,109,073	38,699,928,355
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	37,770,116,713	24,852,874,717
元本等合計	76,282,225,786	63,552,803,072
純資産合計		
76,282,225,786		
63,552,803,072		
負債純資産合計		
76,314,616,367		
63,677,499,449		

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>（1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>（2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>（3）時価が入手できなかった有価証券</p>
--------------------	---

	適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1) デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 (2) 為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

		平成27年12月25日現在	平成28年 6月27日現在
1.	期首	平成27年 6月26日	平成27年12月26日
	期首元本額	39,946,160,403円	38,512,109,073円
	期首からの追加設定元本額	1,316,821,506円	1,826,922,613円
	期首からの一部解約元本額	2,750,872,836円	1,639,103,331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）	14,178,775,751円	14,480,711,934円
	DCインデックスバランス（株式20）	40,962,639円	49,381,602円
	DCインデックスバランス（株式40）	151,010,323円	170,813,413円
	DCインデックスバランス（株式60）	291,611,410円	310,574,069円
	DCインデックスバランス（株式80）	345,389,251円	349,107,576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	3,534,450,930円	3,644,464,969円
	日興五大陸株式ファンド	7,262,434,857円	6,954,834,498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	29,624,898円	31,054,706円
	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産）	13,338,738円	1,837,557円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	7,099,348円	7,070,597円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	5,562,399円	5,809,840円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	8,242,573円	8,831,229円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	10,398,445円	11,331,022円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	7,358,558,472円	7,476,439,018円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	10,403,301円	10,215,961円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	28,495,194円	32,809,443円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	86,927,165円	97,076,286円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	122,744,786円	130,900,460円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	125,663,054円	128,355,534円

	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,900,415,539円	4,798,308,641円
	計	38,512,109,073円	38,699,928,355円
2.	受益権の総数	38,512,109,073口	38,699,928,355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27年 6月26日 至 平成27年12月25日	自 平成27年12月26日 至 平成28年 6月27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12月25日現在	平成28年 6月27日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品

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

（有価証券に関する注記）

（平成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

（平成28年 6月27日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	3,056,235,312
投資証券	59,787,825
合計	2,996,447,487

（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

(平成28年 6月27日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,513,541,058	-	1,467,473,865	46,067,193
合計		1,513,541,058	-	1,467,473,865	46,067,193

(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12月25日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	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

（平成28年 6月27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	322,756,845	-	293,969,000	28,787,845
	米ドル	43,559,400	-	40,848,000	2,711,400
	ユーロ	279,197,445	-	253,121,000	26,076,445
	合計	322,756,845	-	293,969,000	28,787,845

（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12月25日現在		平成28年 6月27日現在	
1口当たり純資産額	1.9807円	1口当たり純資産額	1.6422円
(1万口当たり純資産額)	(19,807円)	(1万口当たり純資産額)	(16,422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	52.83	580,231.89	
	ANTERO RESOURCES CORP	3,670	27.38	100,484.60	
	APACHE CORP	8,294	54.86	455,008.84	
	BAKER HUGHES INC	9,665	45.22	437,051.30	
	CABOT OIL & GAS CORP	9,030	24.74	223,402.20	
	CHENIERE ENERGY INC	5,020	34.80	174,696.00	
	CHEVRON CORP	40,321	101.90	4,108,709.90	
	CIMAREX ENERGY CO	2,005	113.90	228,369.50	
	COLUMBIA PIPELINE GROUP	8,745	25.47	222,735.15	
	CONCHO RESOURCES INC	3,055	121.06	369,838.30	
	CONOCOPHILLIPS	26,420	43.17	1,140,551.40	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,960	43.50	85,260.00	
	CORE LABORATORIES N.V.	1,080	121.10	130,788.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	9,911	35.85	355,309.35	
	EOG RESOURCES INC	11,842	81.06	959,912.52	
	EQT CORP	3,885	76.68	297,901.80	
	EXXON MOBIL CORP	88,921	89.39	7,948,648.19	
	FMC TECHNOLOGIES INC	4,415	25.90	114,348.50	
	HALLIBURTON CO	18,607	43.92	817,219.44	
	HELMERICH & PAYNE	2,120	66.09	140,110.80	
HESS CORP	6,000	55.83	334,980.00		
HOLLYFRONTIER CORP	3,740	24.16	90,358.40		
KINDER MORGAN INC	40,330	17.99	725,536.70		
MARATHON OIL CORP	17,867	14.59	260,679.53		

MARATHON PETROLEUM CORP	11,412	35.33	403,185.96
MURPHY OIL CORP	2,655	30.51	81,004.05
NATIONAL OILWELL VARCO INC	8,231	34.06	280,347.86
NEWFIELD EXPLORATION CO	4,040	41.80	168,872.00
NOBLE ENERGY INC	8,662	35.09	303,949.58
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	16,321	75.27	1,228,481.67
ONEOK INC	4,150	45.82	190,153.00
PHILLIPS 66	10,115	78.62	795,241.30
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,490	152.92	533,690.80
RANGE RESOURCES CORP	4,050	43.32	175,446.00
SCHLUMBERGER LTD	29,941	76.66	2,295,277.06
SOUTHWESTERN ENERGY CO	8,835	12.62	111,497.70
SPECTRA ENERGY CORP	14,814	34.37	509,157.18
TESORO CORP	2,820	75.28	212,289.60
VALERO ENERGY CORP	10,332	52.56	543,049.92
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	16,939	5.91	100,109.49
WILLIAMS COS INC	14,734	21.31	313,981.54
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	4,205	140.12	589,204.60
ALBEMARLE CORP	2,540	78.98	200,609.20
ALCOA INC	26,179	9.38	245,559.02
ASHLAND INC	1,610	112.80	181,608.00
AVERY DENNISON CORP	2,260	73.62	166,381.20
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	3,130	26.09	81,661.70
BALL CORP	3,133	69.41	217,461.53
CELANESE CORP-SERIES A	3,270	65.47	214,086.90
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,850	25.43	123,335.50
CROWN HOLDINGS INC	2,815	49.81	140,215.15
DOW CHEMICAL CO/THE	24,023	51.57	1,238,866.11
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	19,108	66.00	1,261,128.00
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	2,915	68.41	199,415.15
ECOLAB INC	5,690	116.37	662,145.30
FMC CORP	3,270	45.12	147,542.40
FREEMPORT-MCMORAN INC	25,748	10.58	272,413.84
INTERNATIONAL PAPER CO	7,910	41.37	327,236.70
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,664	122.14	203,240.96

LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,140	74.91	609,767.40
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,325	187.92	248,994.00
MONSANTO CO	9,851	104.07	1,025,193.57
MOSAIC CO/THE	6,650	26.91	178,951.50
NEWMONT MINING CORP	11,290	37.19	419,875.10
NUCOR CORP	7,169	47.87	343,180.03
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,950	66.03	128,758.50
PPG INDUSTRIES INC	5,874	102.73	603,436.02
PRAXAIR INC	6,190	110.29	682,695.10
SEALED AIR CORP	4,356	45.56	198,459.36
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,687	283.75	478,686.25
VALSPAR CORP/THE	1,530	107.60	164,628.00
VULCAN MATERIALS CO	2,893	118.60	343,109.80
WESTROCK CO	5,959	38.59	229,957.81
WR GRACE & CO	1,400	74.16	103,824.00
3M CO	13,086	169.12	2,213,104.32
ACUITY BRANDS INC	870	246.67	214,602.90
AERCAP HOLDINGS NV	3,450	34.56	119,232.00
AGCO CORP	1,670	48.33	80,711.10
AMETEK INC	5,073	44.70	226,763.10
B/E AEROSPACE INC	2,570	45.97	118,142.90
BOEING CO/THE	13,522	126.52	1,710,803.44
CATERPILLAR INC	12,076	73.03	881,910.28
CUMMINS INC	3,695	110.50	408,297.50
DANAHER CORP	13,269	98.21	1,303,148.49
DEERE & CO	5,710	81.72	466,621.20
DOVER CORP	3,640	67.46	245,554.40
EATON CORP PLC	9,756	58.03	566,140.68
EMERSON ELECTRIC CO	13,830	50.83	702,978.90
FASTENAL CO	6,153	43.75	269,193.75
FLOWSERVE CORP	2,425	45.50	110,337.50
FLUOR CORP	3,203	48.78	156,242.34
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,160	55.74	176,138.40
GENERAL DYNAMICS CORP	5,722	136.14	778,993.08
GENERAL ELECTRIC CO	200,233	29.82	5,970,948.06

HONEYWELL INTERNATIONAL INC	15,636	112.98	1,766,555.28
ILLINOIS TOOL WORKS	6,900	101.69	701,661.00
INGERSOLL-RAND PLC	5,866	62.87	368,795.42
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,200	49.67	109,274.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	5,000	54.30	271,500.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	1,551	141.39	219,295.89
LOCKHEED MARTIN CORP	5,861	239.70	1,404,881.70
MASCO CORP	7,529	30.18	227,225.22
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,844	212.71	817,657.24
PACCAR INC	7,684	51.97	399,337.48
PARKER HANNIFIN CORP	2,740	105.91	290,193.40
PENTAIR PLC	4,018	57.83	232,360.94
RAYTHEON COMPANY	6,432	135.75	873,144.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,943	112.37	330,704.91
ROCKWELL COLLINS INC.	2,605	84.21	219,367.05
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,150	167.37	359,845.50
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,100	34.41	106,671.00
SMITH (A.O.) CORP	1,510	83.77	126,492.70
SNAP-ON INC	1,250	150.13	187,662.50
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,116	107.23	334,128.68
TEXTRON INC	5,416	35.91	194,488.56
TRANSDIGM GROUP INC	1,190	257.65	306,603.50
UNITED RENTALS INC	2,250	66.25	149,062.50
UNITED TECHNOLOGIES CORP	16,955	98.89	1,676,679.95
WABCO HOLDINGS INC	1,110	95.00	105,450.00
WABTEC CORP	2,090	70.25	146,822.50
WW GRAINGER INC	1,137	217.37	247,149.69
XYLEM INC	4,368	44.14	192,803.52
CINTAS CORP	2,037	93.33	190,113.21
DUN & BRADSTREET CORP	872	121.69	106,113.68
EQUIFAX INC	2,634	122.09	321,585.06
IHS INC-CLASS A	1,300	111.28	144,664.00
MANPOWERGROUP INC	1,937	66.53	128,868.61
NIELSEN HOLDINGS PLC	7,835	51.10	400,368.50
REPUBLIC SERVICES INC	5,100	49.68	253,368.00

ROBERT HALF INTL INC	2,375	36.92	87,685.00
STERICYCLE INC	1,705	100.72	171,727.60
TYCO INTERNATIONAL PLC	8,715	41.60	362,544.00
VERISK ANALYTICS INC	3,170	77.96	247,133.20
WASTE CONNECTIONS INC	3,461	69.33	239,951.13
WASTE MANAGEMENT INC	9,924	63.70	632,158.80
AMERCO	155	364.80	56,544.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,290	27.05	88,994.50
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,250	71.64	232,830.00
CSX CORP	20,923	25.70	537,721.10
DELTA AIR LINES INC	4,285	35.18	150,746.30
EXPEDITORS INTL WASH INC	3,647	47.50	173,232.50
FEDEX CORP	5,758	150.57	866,982.06
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,310	78.25	180,757.50
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	97,000	0.42	41,225.00
KANSAS CITY SOUTHERN	2,390	87.10	208,169.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	6,120	82.64	505,756.80
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,400	38.31	130,254.00
UNION PACIFIC CORP	18,216	85.25	1,552,914.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	1,915	41.06	78,629.90
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	14,657	104.41	1,530,337.37
AUTOLIV INC	2,020	113.50	229,270.00
BORGWARNER INC	4,330	30.50	132,065.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	6,090	62.07	378,006.30
FORD MOTOR COMPANY	78,565	12.52	983,633.80
GENERAL MOTORS CORP	30,275	28.35	858,296.25
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	5,430	25.57	138,845.10
HARLEY-DAVIDSON INC	4,079	43.55	177,640.45
JOHNSON CONTROLS INC	14,278	42.73	610,098.94
LEAR CORP	1,560	104.78	163,456.80
TESLA MOTORS INC	1,980	193.15	382,437.00
COACH INC	5,876	38.48	226,108.48
DR HORTON INC	6,906	30.36	209,666.16
GARMIN LTD	2,865	40.77	116,806.05
HANESBRANDS INC	8,800	25.62	225,456.00

HARMAN INTERNATIONAL	1,390	70.65	98,203.50
HASBRO INC	2,128	82.37	175,283.36
LEGGETT & PLATT INC	2,648	48.74	129,063.52
LENNAR CORP-CL A	3,660	44.73	163,711.80
LULULEMON ATHLETICA INC	2,790	69.62	194,239.80
MATTEL INC	7,349	29.76	218,706.24
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	4,000	47.61	190,440.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,378	185.48	255,591.44
NEWELL BRANDS INC	9,566	46.51	444,914.66
NIKE INC -CL B	28,928	52.59	1,521,323.52
POLARIS INDUSTRIES INC	1,250	80.45	100,562.50
PULTE GROUP INC	6,890	18.40	126,776.00
PVH CORP	2,030	93.55	189,906.50
RALPH LAUREN CORP	1,365	89.60	122,304.00
TOLL BROTHERS INC	3,111	26.56	82,628.16
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	3,560	37.38	133,072.80
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	4,620	33.50	154,770.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C(N)	32	33.50	1,072.00
VF CORP	7,270	61.31	445,723.70
WHIRLPOOL CORP	1,814	162.57	294,901.98
ARAMARK	4,960	32.40	160,704.00
CARNIVAL CORP	8,417	45.65	384,236.05
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	685	400.73	274,500.05
DARDEN RESTAURANTS INC	2,333	66.84	155,937.72
DOMINO'S PIZZA INC	1,020	124.97	127,469.40
H&R BLOCK INC	5,610	22.23	124,710.30
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	11,130	21.85	243,190.50
LAS VEGAS SANDS CORP	9,260	43.31	401,050.60
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	4,826	63.91	308,429.66
MCDONALD'S CORP	19,511	119.44	2,330,393.84
MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	4,100	12.73	52,193.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	9,760	22.91	223,601.60
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	2,930	40.38	118,313.40
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,538	70.08	247,943.04
STARBUCKS CORP	31,664	54.68	1,731,387.52

STARWOOD HOTELS & RESORTS	3,597	71.80	258,264.60
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,540	67.29	170,916.60
WYNN RESORTS LTD	1,660	92.29	153,201.40
YUM! BRANDS INC	9,214	82.15	756,930.10
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	9,798	51.65	506,066.70
CHARTER COMMUNICATION-A	4,561	216.80	988,824.80
COMCAST CORP-CLASS A	52,767	61.65	3,253,085.55
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,320	24.46	81,207.20
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	6,530	23.35	152,475.50
DISH NETWORK CORP-A	4,769	50.59	241,263.71
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	8,736	23.55	205,732.80
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - A(N)	668	33.44	22,337.92
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,355	28.80	154,224.00
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	13,641	28.66	390,951.06
LIBERTY LILAC GROUP-C(N)	1,701	33.87	57,612.87
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	4,930	30.39	149,822.70
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	1,975	30.56	60,356.00
NEWS CORP - CLASS A	7,570	11.13	84,254.10
OMNICOM GROUP	5,417	80.69	437,097.73
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	1,950	60.13	117,253.50
SIRIUS XM HOLDINGS INC	42,510	3.88	164,938.80
TEGNA INC	4,330	21.98	95,173.40
THE WALT DISNEY CO.	33,143	95.72	3,172,447.96
TIME WARNER INC	17,148	70.72	1,212,706.56
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	9,769	26.76	261,418.44
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	25,332	26.94	682,444.08
VIACOM INC-CLASS B	7,748	40.97	317,435.56
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,608	154.52	248,468.16
AMAZON.COM INC	8,545	698.96	5,972,613.20
AUTONATION INC	1,650	47.03	77,599.50
AUTOZONE INC	682	769.92	525,085.44
BED BATH & BEYOND INC	3,512	43.31	152,104.72
BEST BUY CO INC	6,504	30.15	196,095.60
CARMAX INC	4,269	46.32	197,740.08
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,110	41.30	87,143.00

DOLLAR GENERAL CORP/OLD	6,280	92.13	578,576.40
DOLLAR TREE INC	4,896	91.89	449,893.44
EXPEDIA INC	2,682	101.76	272,920.32
FOOT LOCKER INC	3,100	53.11	164,641.00
GAP INC/THE	5,106	20.40	104,162.40
GENUINE PARTS CO	3,201	96.85	310,016.85
HOME DEPOT INC	27,110	126.40	3,426,704.00
KOHL'S CORP	4,402	36.16	159,176.32
L BRANDS INC	5,308	67.48	358,183.84
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	9,700	24.21	234,837.00
LKQ CORP	6,990	31.04	216,969.60
LOWE'S COS INC	19,452	77.06	1,498,971.12
MACY'S INC	7,009	32.08	224,848.72
NETFLIX INC	9,060	88.44	801,266.40
NORDSTROM INC	2,850	37.13	105,820.50
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,145	267.66	574,130.70
PRICELINE GROUP INC/THE	1,065	1,232.14	1,312,229.10
ROSS STORES INC	8,572	54.42	466,488.24
SIGNET JEWELERS LTD	1,660	82.02	136,153.20
STAPLES INC	13,744	8.71	119,710.24
TARGET CORP	12,330	69.35	855,085.50
TIFFANY & CO	2,980	60.09	179,068.20
TJX COMPANIES INC	14,143	74.66	1,055,916.38
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,960	91.81	271,757.60
TRIPADVISOR INC	2,330	61.87	144,157.10
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	1,320	239.16	315,691.20
COSTCO WHOLESALE CORP	9,349	155.56	1,454,330.44
CVS HEALTH CORP	23,487	93.54	2,196,973.98
KROGER CO	19,670	35.14	691,203.80
RITE AID CORP	19,870	7.71	153,197.70
SYSCO CORP	12,076	49.92	602,833.92
WAL-MART STORES INC	34,202	71.96	2,461,175.92
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	19,662	81.78	1,607,958.36
WHOLE FOODS MARKET INC	7,790	30.76	239,620.40
ALTRIA GROUP INC	41,848	67.02	2,804,652.96

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	12,033	40.50	487,336.50
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2,507	93.90	235,407.30
BUNGE LTD	3,107	58.76	182,567.32
CAMPBELL SOUP CO	4,215	62.40	263,016.00
COCA-COLA CO/THE	87,962	43.93	3,864,170.66
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	4,480	35.07	157,113.60
CONAGRA FOODS INC	9,730	46.95	456,823.50
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,720	152.53	567,411.60
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	4,109	92.18	378,767.62
GENERAL MILLS INC	12,569	66.14	831,313.66
HERSHEY CO/THE	3,395	97.97	332,608.15
HORMEL FOODS CORP	6,600	35.34	233,244.00
INGREDION INC	1,470	123.81	182,000.70
JM SMUCKER CO/THE	2,530	145.33	367,684.90
KELLOGG CO	5,298	77.19	408,952.62
KRAFT HEINZ CO/THE	12,931	83.73	1,082,712.63
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,275	101.57	231,071.75
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	3,991	87.55	349,412.05
MOLSON COORS BREWING CO -B	3,760	98.08	368,780.80
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	34,005	42.27	1,437,391.35
MONSTER BEVERAGE CORP	2,930	153.44	449,579.20
PEPSICO INC	30,861	101.98	3,147,204.78
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	33,048	97.71	3,229,120.08
REYNOLDS AMERICAN INC	18,336	51.29	940,453.44
TYSON FOODS INC-CL A	6,456	63.57	410,407.92
WHITEWAVE FOODS CO	3,520	44.23	155,689.60
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,965	98.18	291,103.70
CLOROX COMPANY	2,736	134.88	369,031.68
COLGATE-PALMOLIVE CO	18,200	70.58	1,284,556.00
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	1,311	80.00	104,880.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,740	89.73	425,320.20
KIMBERLY-CLARK CORP	7,703	131.08	1,009,709.24
PROCTER & GAMBLE CO	57,939	82.26	4,766,062.14
ABBOTT LABORATORIES	31,867	37.91	1,208,077.97
AETNA INC	7,239	117.66	851,740.74

AMERISOURCEBERGEN CORP	4,024	75.44	303,570.56
ANTHEM INC	5,606	126.38	708,486.28
BAXTER INTERNATIONAL INC	11,519	43.85	505,108.15
BECTON DICKINSON AND CO	4,607	166.71	768,032.97
BOSTON SCIENTIFIC CORP	28,738	22.37	642,869.06
CARDINAL HEALTH INC	7,115	75.23	535,261.45
CENTENE CORP	3,260	69.21	225,624.60
CERNER CORP	6,590	55.13	363,306.70
CIGNA CORP	5,420	127.71	692,188.20
COOPER COS INC/THE	1,040	166.80	173,472.00
CR BARD INC	1,574	226.16	355,975.84
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	3,938	75.70	298,106.60
DENTSPLY SIRONA INC	4,772	61.30	292,523.60
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,320	96.04	414,892.80
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	3,630	25.99	94,343.70
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	14,464	75.40	1,090,585.60
HCA HOLDINGS INC	6,905	76.72	529,751.60
HENRY SCHEIN INC	1,630	170.87	278,518.10
HOLOGIC INC	5,708	34.11	194,699.88
HUMANA INC	3,115	182.90	569,733.50
IDEXX LABORATORIES INC	1,830	87.76	160,600.80
IMS HEALTH HOLDINGS INC	4,410	24.59	108,441.90
INTUITIVE SURGICAL INC	780	644.82	502,959.60
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,155	129.62	279,331.10
MCKESSON CORP	4,914	177.07	870,121.98
MEDNAX INC	1,810	69.97	126,645.70
MEDTRONIC PLC	30,128	83.26	2,508,457.28
PATTERSON COS INC	2,042	46.35	94,646.70
QUEST DIAGNOSTICS	3,116	78.90	245,852.40
RESMED INC	3,370	60.52	203,952.40
ST JUDE MEDICAL INC	6,120	76.88	470,505.60
STRYKER CORP	7,123	116.59	830,470.57
UNITEDHEALTH GROUP INC	20,310	137.29	2,788,359.90
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,820	136.30	248,066.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,344	80.11	187,777.84

ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	4,102	116.69	478,662.38
ABBVIE INC	34,796	59.86	2,082,888.56
AGILENT TECHNOLOGIES INC	7,010	44.12	309,281.20
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	4,690	112.99	529,923.10
ALKERMES PLC	3,220	42.28	136,141.60
ALLERGAN PLC	8,445	225.72	1,906,205.40
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,530	54.31	83,094.30
AMGEN INC	16,111	146.45	2,359,455.95
BIOGEN INC	4,753	229.02	1,088,532.06
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,500	77.01	269,535.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	35,851	70.61	2,531,439.11
CELGENE CORP	16,784	96.29	1,616,131.36
ELI LILLY & CO	21,403	74.33	1,590,884.99
ENDO INTERNATIONAL PLC	4,160	14.85	61,776.00
GILEAD SCIENCES INC	29,314	80.47	2,358,897.58
ILLUMINA INC	2,985	138.91	414,646.35
INCYTE CORP	3,340	76.98	257,113.20
IONIS PHARMACEUTICALS INC	2,570	21.97	56,462.90
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,330	137.90	183,407.00
JOHNSON & JOHNSON	59,051	115.63	6,828,067.13
MALLINCKRODT PLC	2,400	55.97	134,328.00
MEDIVATION INC	3,320	56.95	189,074.00
MERCK & CO. INC.	59,273	55.88	3,312,175.24
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	600	361.60	216,960.00
MYLAN NV	8,585	43.56	373,962.60
PERRIGO CO PLC	3,039	91.01	276,579.39
PFIZER INC	131,710	33.97	4,474,188.70
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	1,950	63.32	123,474.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,600	339.48	543,168.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	8,474	145.35	1,231,695.90
UNITED THERAPEUTICS CORP	940	102.11	95,983.40
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,320	81.90	435,708.00
WATERS CORP	1,886	135.53	255,609.58
ZOETIS INC	10,200	46.51	474,402.00
BANK OF AMERICA CORP	221,629	13.00	2,881,177.00

BB&T CORP	17,528	34.52	605,066.56
CIT GROUP INC	3,435	30.15	103,565.25
CITIGROUP INC	63,557	40.30	2,561,347.10
CITIZENS FINANCIAL GROUP	11,210	19.95	223,639.50
COMERICA INC	3,360	40.02	134,467.20
FIFTH THIRD BANCORP	16,559	17.50	289,782.50
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,070	68.12	209,128.40
HUNTINGTON BANCSHARES INC	17,700	8.61	152,397.00
JPMORGAN CHASE & CO	78,520	59.60	4,679,792.00
KEYCORP	17,678	11.07	195,695.46
M & T BANK CORP	3,073	112.64	346,142.72
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	9,654	14.77	142,589.58
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	6,370	15.08	96,059.60
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	10,840	81.08	878,907.20
REGIONS FINANCIAL CORP	29,784	8.53	254,057.52
SIGNATURE BANK	990	122.49	121,265.10
SUNTRUST BANKS INC	11,067	40.54	448,656.18
US BANCORP	37,331	39.86	1,488,013.66
WELLS FARGO & CO	103,380	45.71	4,725,499.80
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,220	141.10	172,142.00
ALLY FINANCIAL INC	9,120	15.83	144,369.60
AMERICAN EXPRESS CO	17,914	60.06	1,075,914.84
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,660	91.32	334,231.20
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	23,122	37.99	878,404.78
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	25,550	139.71	3,569,590.50
BLACKROCK INC	2,625	332.51	872,838.75
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	11,045	61.88	683,464.60
CME GROUP INC	7,500	96.92	726,900.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	9,370	51.79	485,272.30
E*TRADE FINANCIAL CORP	5,840	23.11	134,962.40
EATON VANCE CORP	2,880	35.06	100,972.80
FRANKLIN RESOURCES INC	7,995	32.05	256,239.75
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8,158	141.86	1,157,293.88
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	2,636	246.40	649,510.40
INVESCO LTD	8,347	25.57	213,432.79

LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	16.28	118,925.40
MOODY'S CORP	3,917	93.66	366,866.22
MORGAN STANLEY	31,715	24.52	777,651.80
MSCI INC	2,000	73.73	147,460.00
NASDAQ INC	2,555	63.00	160,965.00
NAVIENT CORP	8,682	11.67	101,318.94
NORTHERN TRUST CORP	4,690	65.50	307,195.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,500	48.89	122,225.00
S&P GLOBAL INC	5,832	104.14	607,344.48
SCHWAB (CHARLES) CORP	24,604	26.15	643,394.60
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,225	46.76	150,801.00
STATE STREET CORP	8,707	54.99	478,797.93
SYNCHRONY FINANCIAL	17,640	24.64	434,649.60
T ROWE PRICE GROUP INC	4,995	69.60	347,652.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	5,050	28.17	142,258.50
VOYA FINANCIAL INC	4,650	26.43	122,899.50
AFLAC INC	9,412	69.26	651,875.12
ALLEGHANY CORP	330	528.06	174,259.80
ALLSTATE CORP	8,613	66.26	570,697.38
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	24,515	50.72	1,243,400.80
AON PLC	5,617	104.01	584,224.17
ARCH CAPITAL GROUP LTD	2,775	69.01	191,502.75
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,300	45.35	149,655.00
ASSURANT INC	1,530	83.21	127,311.30
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,175	52.51	114,209.25
CHUBB LTD	9,795	123.94	1,213,992.30
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,400	70.21	238,714.00
EVEREST RE GROUP LTD	1,014	172.51	174,925.14
FNF GROUP	5,881	34.67	203,894.27
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	8,312	42.40	352,428.80
LINCOLN NATIONAL CORP	4,733	38.47	182,078.51
LOEWS CORP	6,485	39.37	255,314.45
MARKEL CORP	280	920.40	257,712.00
MARSH & MCLENNAN COS	10,903	64.88	707,386.64
METLIFE INC	20,085	39.44	792,152.40

PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	5,820	39.96	232,567.20
PROGRESSIVE CORP	12,350	31.68	391,248.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	9,492	70.91	673,077.72
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	887	113.69	100,843.03
TORCHMARK CORP	2,216	59.61	132,095.76
TRAVELERS COS INC/THE	6,664	111.02	739,837.28
UNUM GROUP	4,788	32.06	153,503.28
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,758	117.01	322,713.58
MR BERKLEY CORP	2,063	55.87	115,259.81
XL GROUP PLC	6,310	31.25	197,187.50
CBRE GROUP INC	6,610	27.31	180,519.10
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	23,700	6.03	142,911.00
JONES LANG LASALLE INC	890	103.30	91,937.00
REALOGY HOLDINGS CORP	3,160	28.86	91,197.60
ACCENTURE PLC-CL A	13,478	111.45	1,502,123.10
ACTIVISION BLIZZARD INC	12,280	36.98	454,114.40
ADOBE SYSTEMS INC	10,679	92.20	984,603.80
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	4,220	53.35	225,137.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,275	193.14	246,253.50
ALPHABET INC-CL A	6,240	685.20	4,275,648.00
ALPHABET INC-CL C	6,672	675.22	4,505,067.84
ANSYS INC	2,090	87.67	183,230.30
AUTODESK INC	4,420	54.04	238,856.80
AUTOMATIC DATA PROCESSING	9,896	86.72	858,181.12
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	2,420	62.73	151,806.60
CA INC	6,760	32.00	216,320.00
CADENCE DESIGN SYS INC	6,170	23.78	146,722.60
CDK GLOBAL INC	2,720	54.57	148,430.40
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2,720	78.17	212,622.40
CITRIX SYSTEMS INC	3,628	80.55	292,235.40
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	13,218	58.01	766,776.18
EBAY INC	22,957	23.13	530,995.41
ELECTRONIC ARTS INC	6,504	73.21	476,157.84
FACEBOOK INC-A	49,080	112.08	5,500,886.40
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	6,925	70.67	489,389.75

FISERV INC	4,948	103.25	510,881.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,110	141.49	298,543.90
FORTINET INC	2,700	31.91	86,157.00
GARTNER INC	1,750	96.09	168,157.50
GLOBAL PAYMENTS INC	3,200	70.27	224,864.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	19,512	146.59	2,860,264.08
INTUIT INC	5,366	105.33	565,200.78
LINKEDIN CORP - A	2,410	190.11	458,165.10
MASTERCARD INC-CLASS A	20,980	91.47	1,919,040.60
MICROSOFT CORP	161,434	49.83	8,044,256.22
MOBILEYE NV	3,560	41.70	148,452.00
NETSUITE INC	740	72.42	53,590.80
NUANCE COMMUNICATIONS INC	4,240	15.25	64,660.00
ORACLE CORP	67,843	39.23	2,661,480.89
PAYCHEX INC	6,712	54.64	366,743.68
PAYPAL HOLDINGS INC	23,537	35.08	825,677.96
RED HAT INC	4,070	73.62	299,633.40
SABRE CORP	4,520	25.45	115,034.00
SALESFORCE.COM INC	13,480	78.46	1,057,640.80
SERVICENOW INC	3,630	70.33	255,297.90
SPLUNK INC	2,530	54.82	138,694.60
SYMANTEC CORP	13,905	20.43	284,079.15
SYNOPSYS INC	3,207	52.08	167,020.56
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,636	50.47	183,508.92
TWITTER INC	12,260	16.44	201,554.40
VANTIV INC - CL-A	3,730	52.70	196,571.00
VERISIGN INC	2,220	84.18	186,879.60
VISA INC-CLASS A SHARES	41,342	75.05	3,102,717.10
VMWARE INC	1,835	58.54	107,420.90
WESTERN UNION CO	10,451	18.61	194,493.11
WORKDAY INC-CLASS A	2,520	74.03	186,555.60
XEROX CORP	22,644	9.45	213,985.80
YAHOO! INC	18,855	36.24	683,305.20
ZILLOW GROUP INC - C	2,000	34.58	69,160.00
AMPHENOL CORP-CL A	6,450	57.25	369,262.50

APPLE INC	118,692	93.40	11,085,832.80
ARROW ELECTRONICS INC	2,310	63.07	145,691.70
AVNET INC	3,460	40.89	141,479.40
CDW CORP/DE	2,750	39.69	109,147.50
CISCO SYSTEMS INC	107,860	27.75	2,993,115.00
CORNING INC	25,868	19.69	509,340.92
EMC CORP/MASS	41,159	27.29	1,123,229.11
F5 NETWORKS INC	1,445	113.40	163,863.00
FLEXTRONICS INTL LTD	12,536	12.35	154,819.60
FLIR SYSTEMS INC	3,195	29.83	95,306.85
HARRIS CORP	2,830	80.98	229,173.40
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	38,615	18.16	701,248.40
HP INC	38,615	12.26	473,419.90
JUNIPER NETWORKS INC	7,633	22.45	171,360.85
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3,395	64.73	219,758.35
NETAPP INC	7,006	24.72	173,188.32
PALO ALTO NETWORKS INC	1,780	121.78	216,768.40
SEAGATE TECHNOLOGY	6,974	23.16	161,517.84
TE CONNECTIVITY LTD	8,365	57.32	479,481.80
TRIMBLE NAVIGATION LTD	6,050	26.02	157,421.00
WESTERN DIGITAL CORP	5,748	47.84	274,984.32
AT&T INC	131,477	41.52	5,458,925.04
CENTURYLINK INC	12,616	27.93	352,364.88
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	21,304	4.87	103,750.48
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	6,500	49.09	319,085.00
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	2,580	103.31	266,539.80
SPRINT CORP	15,130	4.12	62,335.60
T-MOBILE US INC	6,372	41.10	261,889.20
VERIZON COMMUNICATIONS INC	86,737	54.43	4,721,094.91
AES CORP	13,728	11.89	163,225.92
AGL RESOURCES INC	2,340	65.90	154,206.00
ALLIANT ENERGY CORP	4,320	39.28	169,689.60
AMEREN CORPORATION	5,182	51.79	268,375.78
AMERICAN ELECTRIC POWER	10,698	67.26	719,547.48
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,095	79.93	327,313.35

ATMOS ENERGY CORP	2,000	77.05	154,100.00
CALPINE CORP	8,060	13.70	110,422.00
CENTERPOINT ENERGY INC	8,142	23.34	190,034.28
CMS ENERGY CORP	6,140	44.36	272,370.40
CONSOLIDATED EDISON INC	6,306	78.41	494,453.46
DOMINION RESOURCES INC/VA	12,827	74.17	951,378.59
DTE ENERGY COMPANY	3,698	95.58	353,454.84
DUKE ENERGY CORP	14,556	82.43	1,199,851.08
EDISON INTERNATIONAL	7,059	74.59	526,530.81
ENTERGY CORP	3,847	77.99	300,027.53
EVERSOURCE ENERGY	6,900	57.22	394,818.00
EXELON CORP	19,686	34.39	677,001.54
FIRSTENERGY CORP	8,995	32.88	295,755.60
NEXTERA ENERGY INC	9,845	123.80	1,218,811.00
NISOURCE INC	6,540	25.31	165,527.40
NRG ENERGY INC	7,670	13.99	107,303.30
OGE ENERGY CORP	3,560	31.46	111,997.60
P G & E CORP	10,391	62.66	651,100.06
PINNACLE WEST CAPITAL	2,199	77.95	171,412.05
PPL CORP	14,578	37.18	542,010.04
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	10,978	44.09	484,020.02
SCANA CORP	3,153	72.24	227,772.72
SEMPRA ENERGY	5,067	110.34	559,092.78
SOUTHERN CO	19,445	51.19	995,389.55
TECO ENERGY INC	4,700	27.66	130,002.00
UGI CORP	3,500	44.03	154,105.00
WEC ENERGY GROUP INC	6,860	63.32	434,375.20
WESTAR ENERGY INC	2,880	55.72	160,473.60
XCEL ENERGY INC	11,524	43.30	498,989.20
ANALOG DEVICES INC	6,481	55.04	356,714.24
APPLIED MATERIALS INC	24,833	23.23	576,870.59
BROADCOM LTD	8,300	148.72	1,234,376.00
INTEL CORP	100,502	31.55	3,170,838.10
KLA-TENCOR CORPORATION	3,199	72.55	232,087.45
LAM RESEARCH CORP	3,247	82.28	267,163.16

	LINEAR TECHNOLOGY CORP	4,954	45.52	225,506.08	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	9,254	9.78	90,504.12	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	5,850	35.10	205,335.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	4,184	50.47	211,166.48	
	MICRON TECHNOLOGY INC	23,297	13.21	307,753.37	
	NVIDIA CORP	11,505	45.73	526,123.65	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	6,187	80.07	495,393.09	
	QORVO INC	3,100	54.94	170,314.00	
	QUALCOMM INC	31,962	52.12	1,665,859.44	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	4,200	61.61	258,762.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	21,642	60.54	1,310,206.68	
	XILINX INC	5,075	45.31	229,948.25	
米ドル小計		6,815,037		387,048,353.60	(39,548,600,770)
加ドル	ALTAGAS LTD	3,050	30.56	93,208.00	
	ARC RESOURCES LTD	7,925	20.72	164,206.00	
	CAMECO CORP	7,892	14.11	111,356.12	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	24,024	38.84	933,092.16	
	CENOVUS ENERGY INC	17,463	17.86	311,889.18	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	11,475	19.87	228,008.25	
	ENBRIDGE INC	19,065	53.99	1,029,319.35	
	ENCANA CORP	17,968	10.21	183,453.28	
	HUSKY ENERGY INC	6,873	15.08	103,644.84	
	IMPERIAL OIL LTD	6,942	39.53	274,417.26	
	INTER PIPELINE LTD	7,180	26.36	189,264.80	
	KEYERA CORP	4,120	36.79	151,574.80	
	PEMBINA PIPELINE CORP	7,915	38.30	303,144.50	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	3,680	33.50	123,280.00	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	5,320	23.92	127,254.40	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY -A	3,780	24.59	92,950.20	
	SUNCOR ENERGY INC	34,159	34.85	1,190,441.15	
	TOURMALINE OIL CORP	4,005	32.05	128,360.25	
	TRANSCANADA CORP	14,523	57.28	831,877.44	
	VERESEN INC	5,360	10.82	57,995.20	
	VERMILION ENERGY INC	1,830	40.64	74,371.20	

AGNICO EAGLE MINES LTD	4,695	67.51	316,959.45
AGRIUM INC	3,015	119.58	360,533.70
BARRICK GOLD CORP	26,114	26.65	695,938.10
CCL INDUSTRIES INC - CL B	500	228.50	114,250.00
ELDORADO GOLD CORP	14,630	5.73	83,829.90
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	12,590	8.85	111,421.50
FRANCO-NEVADA CORP	3,565	94.05	335,288.25
GOLDCORP INC	17,917	23.89	428,037.13
KINROSS GOLD CORP	25,015	6.66	166,599.90
METHANEX CORP	2,330	38.25	89,122.50
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	17,917	21.94	393,098.98
SILVER WHEATON CORP	8,645	27.69	239,380.05
TECK RESOURCES LTD-CLS B	13,885	15.32	212,718.20
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	23,419	4.20	98,359.80
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,460	37.58	54,866.80
YAMANA GOLD INC	19,626	6.64	130,316.64
BOMBARDIER INC 'B'	34,746	1.95	67,754.70
BROOKFIELD BUSINESS PART	378	25.82	9,759.96
CAE INC	6,315	15.79	99,713.85
FINNING INTERNATIONAL INC	2,845	22.01	62,618.45
SNC-LAVALIN GROUP INC	3,195	52.40	167,418.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	16,888	74.08	1,251,063.04
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,125	160.98	503,062.50
MAGNA INTERNATIONAL INC	8,378	47.03	394,017.34
GILDAN ACTIVEWEAR INC	4,060	35.82	145,429.20
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	4,328	53.83	232,976.24
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	8,325	24.86	206,959.50
THOMSON REUTERS CORP	8,044	52.02	418,448.88
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,560	137.70	214,812.00
DOLLARAMA INC	2,920	89.34	260,872.80
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	8,650	52.30	452,395.00
EMPIRE CO LTD 'A'	3,000	21.16	63,480.00
LOBLAW COMPANIES LTD	4,519	68.27	308,512.13
METRO INC	5,790	44.15	255,628.50
WESTON (GEORGE) LTD	942	110.02	103,638.84

	SAPUTO INC	5,040	37.72	190,108.80
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	6,734	26.36	177,508.24
	BANK OF MONTREAL	13,731	81.46	1,118,527.26
	BANK OF NOVA SCOTIA	25,379	64.03	1,625,017.37
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	8,295	100.22	831,324.90
	NATIONAL BANK OF CANADA	7,340	44.05	323,327.00
	ROYAL BANK OF CANADA	31,519	77.21	2,433,581.99
	TORONTO-DOMINION BANK	39,300	55.24	2,170,932.00
	CI FINANCIAL CORP	5,550	26.76	148,518.00
	ELEMENT FINANCIAL CORP	7,180	13.80	99,084.00
	IGM FINANCIAL INC	2,535	36.01	91,285.35
	ONEX CORPORATION	1,905	80.00	152,400.00
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	490	665.21	325,952.90
	GREAT-WEST LIFECO INC	5,974	34.05	203,414.70
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	1,735	40.66	70,545.10
	INTACT FINANCIAL CORP	2,485	88.60	220,171.00
	MANULIFE FINANCIAL CORP	39,991	17.35	693,843.85
	POWER CORP OF CANADA	7,800	27.66	215,748.00
	POWER FINANCIAL CORP	5,715	30.20	172,593.00
	SUN LIFE FINANCIAL INC	13,374	42.02	561,975.48
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	18,933	42.92	812,604.36
	CGI GROUP INC - CL A	4,650	56.25	261,562.50
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	370	500.84	185,310.80
	OPEN TEXT CORP	3,070	76.16	233,811.20
	BLACKBERRY LTD	10,328	8.65	89,337.20
	BCE INC	2,930	59.89	175,477.70
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	8,355	50.37	420,841.35
	TELUS CORP	4,366	40.94	178,744.04
	ATCO LTD -CLASS I	1,920	44.58	85,593.60
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,590	36.92	95,622.80
	FORTIS INC	5,995	42.56	255,147.20
	HYDRO ONE LTD	3,450	24.90	85,905.00
加ドル小計		836,909		30,458,206.90 (2,383,659,271)
ユーロ	ENI SPA	54,006	13.24	715,039.44

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	9,315	11.95	111,360.82
NESTE OYJ	2,740	31.40	86,036.00
OMV AG	3,490	24.44	85,295.60
REPSOL SA	21,989	10.42	229,125.38
REPSOL SA-RTS	21,989	0.26	5,827.08
SAIPEM SPA	123,510	0.36	44,722.97
TECHNIP SA	2,468	47.78	117,921.04
TENARIS SA	9,355	12.44	116,376.20
TOTAL SA	47,097	40.62	1,913,080.14
VOPAK	1,270	43.41	55,137.05
AIR LIQUIDE SA	7,474	90.87	679,162.38
AKZO NOBEL	5,028	56.01	281,618.28
ARCELORMITTAL	38,948	4.19	163,231.06
ARKEMA	1,615	68.34	110,369.10
BASF SE	19,575	67.07	1,312,895.25
COVESTRO AG	1,350	39.28	53,034.75
CRH PLC	17,600	25.60	450,648.00
EVONIK INDUSTRIES AG	3,080	26.27	80,911.60
FUCHS PETROLUB SE-PRF	1,720	35.72	61,438.40
HEIDELBERGCEMENT AG	3,245	71.73	232,763.85
IMERYS SA	830	58.14	48,256.20
K+S AG	3,880	21.15	82,062.00
KONINKLIJKE DSM NV	3,842	51.74	198,785.08
LANXESS AG	1,935	40.20	77,787.00
LINDE AG	3,845	124.45	478,510.25
OCI NV	2,000	12.15	24,300.00
SOLVAY SA	1,581	83.05	131,302.05
STORA ENSO OYJ-R SHS	12,085	7.66	92,571.10
SYMRISE AG	2,640	57.65	152,196.00
THYSSENKRUPP AG	7,415	17.42	129,206.37
UMICORE	2,120	46.54	98,675.40
UPM-KYMMENE OYJ	12,618	17.75	223,969.50
VOESTALPINE AG	2,509	30.90	77,528.10
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4,176	25.02	104,483.52
AIRBUS GROUP SE	12,608	52.11	657,002.88

ALSTOM	4,490	20.32	91,259.25	
ANDRITZ AG	1,980	41.55	82,269.00	
BOSKALIS WESTMINSTER	1,695	30.53	51,756.82	
BOUYGUES SA	4,210	26.38	111,059.80	
BRENTAG AG	3,765	43.31	163,062.15	
CNH INDUSTRIAL NV	22,370	6.38	142,832.45	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	10,566	35.58	375,938.28	
EIFFAGE	1,130	61.22	69,178.60	
FERROVIAL SA	9,975	17.13	170,871.75	
GEA GROUP AG	3,940	41.82	164,790.50	
HOCHTIEF AG	440	111.05	48,862.00	
KONE OYJ-B	7,424	41.30	306,611.20	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	19,861	22.10	438,928.10	
LEGRAND SA	5,628	45.72	257,340.30	
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	9,630	8.96	86,332.95	
MAN SE	624	91.53	57,114.72	
METSO OYJ	2,420	22.25	53,845.00	
OSRAM LICHT AG	1,962	44.51	87,328.62	
PRYSMIAN SPA	5,185	18.95	98,255.75	
REXEL SA	7,240	11.90	86,192.20	
SAFRAN SA	6,790	58.28	395,721.20	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	11,908	52.12	620,644.96	
SIEMENS AG-REG	16,826	90.52	1,523,089.52	
THALES SA	2,345	72.29	169,520.05	
VINCI SA	10,250	59.99	614,897.50	
WARTSILA OYJ ABP	3,290	38.49	126,632.10	
ZARDOYA OTIS SA	4,249	8.22	34,926.78	
ZODIAC AEROSPACE	4,550	20.78	94,571.75	
BUREAU VERITAS SA	5,650	18.59	105,061.75	
EDENRED	3,906	16.62	64,937.25	
RANDSTAD HOLDING NV	2,865	40.96	117,364.72	
SOCIETE BIC SA	735	123.25	90,588.75	
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	10,531	12.84	135,270.69	
ADP	650	99.53	64,694.50	
AENA SA	1,280	110.00	140,800.00	

ATLANTIA SPA	9,360	21.49	201,146.40
BOLLORE	20,400	3.04	62,199.60
DEUTCHE LUFTHANSA	5,680	10.95	62,224.40
DEUTSCHE POST AG-REG	20,993	24.55	515,483.11
FRAPORT AG	980	47.00	46,060.00
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	8,760	10.00	87,600.00
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	16,992	5.01	85,265.85
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	7,155	68.66	491,262.30
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,190	60.03	71,435.70
CONTINENTAL AG	2,345	181.25	425,031.25
DAIMLER AG	20,552	55.06	1,131,593.12
FERRARI NV	3,164	36.72	116,182.08
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	19,647	5.71	112,184.37
MICHELIN (CGDE)-B	4,149	85.72	355,652.28
NOKIAN RENKAAT OYJ	2,915	33.20	96,778.00
PEUGEOT SA	9,800	11.71	114,758.00
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	3,490	44.30	154,624.45
RENAULT SA	4,117	70.49	290,207.33
SCHAEFFLER AG-PRF	3,550	12.93	45,901.50
VALEO SA	4,860	42.62	207,157.50
VOLKSWAGEN AG	771	127.60	98,379.60
VOLKSWAGEN AG-PFD	3,783	114.25	432,207.75
ADIDAS AG	4,421	119.85	529,856.85
CHRISTIAN DIOR SE	1,080	142.40	153,792.00
HERMES INTERNATIONAL	542	325.20	176,258.40
HUGO BOSS AG -ORD	1,490	50.09	74,634.10
KERING	1,547	142.15	219,906.05
LUXOTTICA GROUP SPA	3,976	45.30	180,112.80
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	5,914	135.15	799,277.10
ACCOR SA	4,976	36.24	180,355.12
PADDY POWER BETFAIR PLC	1,800	108.50	195,300.00
SODEXO	1,970	94.00	185,180.00
ALTICE NV -A	8,340	13.95	116,343.00
ALTICE NV -B	1,940	14.00	27,169.70
AXEL SPRINGER SE	995	48.51	48,272.42

EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	16.86	64,002.67
JC DECAUX SA	1,950	32.59	63,550.50
LAGARDERE S.C.A.	2,980	19.50	58,124.90
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	4,805	39.30	188,860.52
PUBLICIS GROUPE	4,075	60.66	247,189.50
RELX NV	20,559	14.91	306,637.48
RTL GROUP	920	76.44	70,324.80
SES	6,700	18.92	126,764.00
TELENET GROUP HOLDING NV	1,240	39.75	49,290.00
VIVENDI	25,330	15.59	395,021.35
WOLTERS KLUWER	6,927	34.00	235,518.00
INDITEX	24,265	28.90	701,258.50
ZALANDO SE	1,700	25.12	42,712.50
CARREFOUR SA	11,113	22.15	246,152.95
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,344	47.47	63,799.68
COLRUYT SA	1,375	49.44	67,986.87
DELHAIZE GROUP	2,426	91.23	221,323.98
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	11,008	4.81	53,047.55
JERONIMO MARTINS	5,075	13.50	68,512.50
KONINKLIJKE AHOLD NV	17,771	19.38	344,401.98
METRO AG	3,260	27.29	88,965.40
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	17,261	110.35	1,904,751.35
DANONE	12,724	60.83	774,000.92
HEINEKEN HOLDING NV	2,595	70.06	181,805.70
HEINEKEN NV	5,033	79.70	401,130.10
KERRY GROUP PLC-A	3,380	79.47	268,608.60
PERNOD-RICARD SA	4,276	95.17	406,946.92
REMY COINTREAU	470	74.32	34,930.40
BEIERSDORF AG	2,015	80.11	161,421.65
HENKEL AG & CO KGAA	2,030	93.30	189,399.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	3,953	104.70	413,879.10
L'OREAL	5,426	164.30	891,491.80
UNILEVER NV-CVA	35,035	39.40	1,380,379.00
ESSILOR INTERNATIONAL	4,465	115.00	513,475.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	4,683	73.66	344,949.78

FRESENIUS SE & CO KGAA	8,615	63.64	548,258.60
BAYER AG	17,690	87.64	1,550,351.60
GRIFOLS SA	6,820	18.86	128,625.20
MERCK KGAA	2,930	87.60	256,668.00
ORION OYJ-CLASS B	2,590	34.88	90,339.20
QIAGEN N.V.	5,145	19.00	97,780.72
SANOFI	25,106	69.37	1,741,603.22
UCB SA	2,798	64.72	181,086.56
ABN AMRO GROUP NV-CVA	4,670	16.61	77,568.70
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	142,393	4.84	689,751.69
BANCO DE SABADELL SA	109,692	1.20	132,617.62
BANCO POPULAR ESPANOL	75,856	1.18	89,510.08
BANCO SANTANDER SA	308,349	3.38	1,043,453.01
BANK OF IRELAND	558,550	0.21	120,088.25
BANKIA SA	95,000	0.56	53,960.00
BANKINTER SA	13,960	5.85	81,721.84
BNP PARIBAS	22,652	39.40	892,488.80
CAIXABANK S.A	68,530	1.92	131,851.72
COMMERZBANK AG	23,524	6.20	145,872.32
CREDIT AGRICOLE SA	21,992	7.65	168,260.79
ERSTE GROUP BANK AG	5,918	19.89	117,738.61
ING GROEP NV-CVA	82,765	9.33	772,611.27
INTESA SANPAOLO	275,093	1.74	478,661.82
KBC GROEP NV	5,519	45.30	250,010.70
NATIXIS	22,980	3.43	79,028.22
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	2,770	11.27	31,217.90
SOCIETE GENERALE	16,089	28.80	463,363.20
UBI BANCA SCPA	22,584	2.58	58,357.05
UNICREDIT SPA	110,353	2.07	229,092.82
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	28,835	13.36	385,379.77
DEUTSCHE BOERSE AG	3,830	74.09	283,764.70
EURAZEO	958	53.59	51,339.22
EXOR SPA	2,944	31.81	93,648.64
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,882	72.38	136,219.16
MEDIOBANCA SPA	11,670	5.31	61,967.70

WENDEL	750	94.44	70,830.00
AEGON NV	38,139	3.86	147,254.67
AGEAS	4,044	32.56	131,692.86
ALLIANZ SE-REG	9,728	126.80	1,233,510.40
ASSICURAZIONI GENERALI	25,868	10.92	282,478.56
AXA	42,162	18.18	766,505.16
CNP ASSURANCES	3,530	13.46	47,531.45
HANNOVER RUECK SE-REG	1,355	92.92	125,906.60
MAPFRE SA	20,814	1.94	40,379.16
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,486	149.35	520,634.10
NN GROUP NV	7,180	25.02	179,679.50
POSTE ITALIANE SPA	10,260	6.17	63,304.20
SAMPO OYJ-A SHS	9,639	37.99	366,185.61
SCOR SE	3,152	26.79	84,442.08
UNIPOLSAI SPA	18,580	1.46	27,275.44
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	6,680	29.10	194,421.40
IMMOEAST AG-TEMPORARY	16,150	-	-
IMMOFINANZ AG-TEMPORARY	13,000	-	-
VONOVIA SE	10,088	31.50	317,772.00
AMADEUS IT HOLDING SA	9,610	39.08	375,606.85
ATOS SE	1,650	76.18	125,697.00
CAP GEMINI SA	3,209	80.10	257,040.90
DASSAULT SYSTEMES SA	2,790	68.06	189,887.40
GEMALTO	1,850	52.54	97,199.00
SAP SE	20,932	67.11	1,404,746.52
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2,930	38.05	111,501.15
INGENICO GROUP	1,160	101.30	117,508.00
NOKIA OYJ	118,436	5.03	596,325.26
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	68,896	14.05	968,333.28
ELISA OYJ	2,505	33.66	84,318.30
ILIAD SA	520	175.45	91,234.00
KONINKLIJKE KPN NV	68,556	3.01	206,764.89
NUMERICABLE-SFR	2,250	23.50	52,875.00
ORANGE S.A.	41,284	13.66	564,145.86
PROXIMUS	3,780	27.24	102,986.10

	TELECOM ITALIA SPA	239,753	0.69	165,429.57
	TELECOM ITALIA-RSP	125,887	0.55	69,678.45
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16,000	3.67	58,832.00
	TELEFONICA SA	96,369	7.73	745,125.10
	E.ON SE	40,559	8.47	343,778.08
	EDF	6,075	10.10	61,357.50
	ENAGAS	4,190	25.11	105,210.90
	ENDESA SA	6,840	16.16	110,568.60
	ENEL SPA	167,087	3.60	601,513.20
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	49,221	2.63	129,697.33
	ENGIE	30,044	13.47	404,842.90
	FORTUM OYJ	9,825	14.19	139,416.75
	GAS NATURAL SDG SA	7,722	16.01	123,629.22
	IBERDROLA SA	115,162	5.38	620,492.85
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	2,610	72.85	190,138.50
	RWE AG	10,685	12.49	133,509.07
	SNAM SPA	47,520	4.80	228,286.08
	SUEZ	6,199	13.63	84,492.37
	TERNA SPA	34,477	4.52	155,973.94
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	9,184	18.46	169,536.64
	ASML HOLDING NV	7,962	85.48	680,591.76
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	24,715	12.99	321,171.42
	STMICROELECTRONICS NV	12,733	5.12	65,256.62
ユーロ小計		4,933,750		63,754,348.13 (7,173,001,708)
英ボンド	BP PLC	393,178	3.93	1,547,745.19
	PETROFAC LTD	5,025	7.40	37,210.12
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	89,908	18.72	1,683,077.76
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	79,979	18.83	1,506,404.46
	ANGLO AMERICAN PLC	29,014	6.59	191,202.26
	ANTOFAGASTA PLC	8,730	4.30	37,565.19
	BHP BILLITON PLC	45,961	8.56	393,564.04
	CRODA INTERNATIONAL PLC	2,751	28.77	79,146.27
	FRESNILLO PLC	5,160	13.86	71,517.60
	GLENCORE PLC	266,823	1.39	372,084.67

JOHNSON MATTHEY PLC	4,199	29.14	122,358.86
MONDI PLC	7,400	13.31	98,494.00
RANDGOLD RESOURCES LTD	2,250	73.70	165,825.00
REXAM PLC	11,772	6.41	75,458.52
RIO TINTO PLC	27,025	20.77	561,444.37
SOUTH32 LTD	46,811	0.87	40,725.57
ASHTED GROUP PLC	10,920	10.33	112,803.60
BAE SYSTEMS PLC ORD	63,705	4.80	306,293.64
BUNZL PLC	7,276	20.64	150,176.64
COBHAM PLC	34,837	1.51	52,603.87
DCC PLC	1,810	61.80	111,858.00
IMI PLC	6,116	9.64	58,988.82
MEGGITT PLC	13,905	3.79	52,797.28
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	38,295	6.49	248,534.55
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENTITL	2,718,945	0.00	2,718.94
SMITHS GROUP PLC	8,813	10.86	95,709.18
TRAVIS PERKINS PLC	4,350	16.20	70,470.00
WEIR GROUP PLC/THE	3,880	13.56	52,612.80
WOLSELEY PLC	5,004	37.42	187,249.68
AGGREKO PLC	6,006	11.72	70,390.32
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,275	9.33	58,577.12
CAPITA PLC	15,309	9.89	151,482.55
EXPERIAN PLC	20,558	13.35	274,449.30
G4S PLC	34,639	1.73	60,098.66
INTERTEK GROUP PLC	3,545	31.95	113,262.75
EASYJET PLC	3,840	13.13	50,419.20
ROYAL MAIL PLC	14,990	5.08	76,149.20
GKN PLC	33,065	2.78	91,920.70
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	20,100	4.39	88,399.80
BERKELEY GROUP HOLDINGS	2,600	25.93	67,418.00
BURBERRY GROUP PLC	9,334	11.26	105,100.84
PERSIMMON PLC	5,870	15.20	89,224.00
TAYLOR WIMPEY PLC	66,170	1.36	90,057.37
CARNIVAL PLC	3,660	34.65	126,819.00
COMPASS GROUP PLC	34,397	13.50	464,359.50

INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	4,031	27.57	111,134.67
MERLIN ENTERTAINME	15,550	4.30	66,989.40
TUI AG-DI	11,263	9.54	107,449.02
WHITBREAD PLC	4,140	38.30	158,562.00
WILLIAM HILL PLC	18,010	2.76	49,761.63
ITV PLC	77,235	1.74	134,697.84
PEARSON PLC	17,749	9.14	162,225.86
REED ELSEVIER PLC	23,666	12.83	303,634.78
SKY PLC	23,224	8.34	193,804.28
WPP PLC	27,154	15.25	414,098.50
DIXONS CARPHONE PLC	22,000	3.71	81,620.00
KINGFISHER PLC	50,397	3.41	172,055.35
MARKS & SPENCER GROUP PLC	34,970	3.26	114,142.08
NEXT PLC	2,987	48.48	144,809.76
SAINSBURY (J) PLC	23,451	2.27	53,280.67
TESCO PLC	177,834	1.62	288,624.58
WM MORRISON SUPERMARKETS	49,255	1.82	90,087.39
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	7,795	27.75	216,311.25
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	39,827	43.85	1,746,413.95
COCA-COLA HBC AG-CDI	5,000	13.66	68,300.00
DIAGEO PLC	54,132	18.78	1,016,598.96
IMPERIAL BRANDS PLC	20,492	36.93	756,872.02
SABMILLER PLC	20,691	42.79	885,471.34
TATE & LYLE PLC	7,830	6.28	49,172.40
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	13,605	68.93	937,792.65
UNILEVER PLC	27,417	32.65	895,302.13
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	7,000	9.86	69,020.00
SMITH & NEPHEW PLC	19,376	11.82	229,024.32
ASTRAZENECA PLC	26,943	40.31	1,086,207.04
GLAXOSMITHKLINE PLC	103,461	14.82	1,533,292.02
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2,860	22.71	64,950.60
SHIRE PLC	19,125	41.06	785,272.50
BARCLAYS PLC	364,051	1.53	560,274.48
HSBC HOLDINGS PLC	418,601	4.47	1,875,123.17
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,369,186	0.57	780,436.02

	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	71,010	2.05	145,783.53	
	STANDARD CHARTERED PLC	69,440	5.63	391,155.52	
	3I GROUP PLC	20,499	5.12	105,057.37	
	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	22,730	2.77	63,121.21	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,720	11.75	67,210.00	
	ICAP PLC	12,270	4.20	51,607.62	
	INVESTEC PLC	13,185	4.53	59,741.23	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	6,577	25.00	164,425.00	
	PROVIDENT FINANCIAL PLC	2,880	24.51	70,588.80	
	SCHRODERS PLC	2,231	23.82	53,142.42	
	ADMIRAL GROUP PLC	4,925	19.50	96,037.50	
	AVIVA PLC	83,965	3.74	314,700.82	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	29,333	3.51	103,017.49	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	127,081	1.88	239,547.68	
	OLD MUTUAL PLC	104,159	1.86	194,464.85	
	PRUDENTIAL PLC	55,002	12.35	679,274.70	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	24,738	4.60	113,992.70	
	ST JAMES'S PLACE PLC	11,000	7.74	85,195.00	
	STANDARD LIFE PLC	40,716	2.83	115,592.72	
	AUTO TRADER GROUP PLC	23,390	3.79	88,671.49	
	SAGE GROUP PLC/THE	22,090	6.03	133,313.15	
	WORLDPAY GROUP PLC	33,990	2.80	95,273.97	
	BT GROUP PLC	181,012	3.83	694,814.56	
	INMARSAT PLC	10,010	7.53	75,425.35	
	VODAFONE GROUP PLC	566,418	2.19	1,242,154.67	
	CENTRICA PLC	111,935	2.05	230,026.42	
	NATIONAL GRID PLC	80,005	9.84	787,569.22	
	SEVERN TRENT PLC	5,493	22.21	121,999.53	
	SSE PLC	21,427	14.20	304,263.40	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	16,215	9.28	150,475.20	
	ARM HOLDINGS PLC	30,650	10.80	331,020.00	
英債券小計		9,144,604		34,036,244.97	(4,657,519,761)
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	220	478.75	105,325.00	
	GIVAUDAN-REG	203	1,861.00	377,783.00	

LAFARGEHOLCIM LTD	9,939	39.74	394,975.86
SIKA AG-BR	47	3,946.00	185,462.00
SYNGENTA AG-REG	1,978	373.50	738,783.00
ABB LTD-REG	41,925	19.60	821,730.00
GEBERIT AG-REG	805	367.50	295,837.50
SCHINDLER HOLDING AG-REG	360	174.50	62,820.00
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,090	173.70	189,333.00
ADECCO GROUP AG-REG	3,557	52.90	188,165.30
SGS SA-REG	133	2,115.00	281,295.00
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,020	134.20	136,884.00
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	11,459	56.15	643,422.85
SWATCH GROUP AG/THE-BR	610	279.80	170,678.00
SWATCH GROUP AG/THE-REG	930	54.65	50,824.50
DUFREY AG-REG	1,050	119.90	125,895.00
ARYZTA AG	2,110	36.48	76,972.80
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	25	5,685.00	142,125.00
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	68,700.00	137,400.00
NESTLE SA-REG	68,383	71.50	4,889,384.50
SONOVA HOLDING AG-REG	1,160	121.70	141,172.00
ACTELION LTD-REG	2,310	151.50	349,965.00
GALENICA AG-REG	70	1,287.00	90,090.00
LONZA GROUP AG-REG	1,250	158.90	198,625.00
NOVARTIS AG-REG	48,823	75.75	3,698,342.25
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	15,028	241.00	3,621,748.00
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	41,158	11.24	462,615.92
JULIUS BAER GROUP LTD	5,210	40.59	211,473.90
PARGESA HOLDING SA-BR	655	62.10	40,675.50
PARTNERS GROUP HOLDING AG	370	418.00	154,660.00
UBS GROUP AG-REG	78,132	13.60	1,062,595.20
BALOISE HOLDING AG - REG	1,080	108.00	116,640.00
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	640	226.50	144,960.00
SWISS RE AG	7,719	80.80	623,695.20
ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,131	227.00	710,737.00
SWISS PRIME SITE-REG	1,370	86.15	118,025.50
SWISSCOM AG-REG	584	450.60	263,150.40

スイスフラン小計		354,536		22,024,267.18 (2,308,583,685)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	4,320	153.90	664,848.00
	BOLIDEN AB	7,260	158.80	1,152,888.00
	ALFA LAVAL AB	6,930	135.00	935,550.00
	ASSA ABLOY AB-B	20,910	171.60	3,588,156.00
	ATLAS COPCO AB-A SHS	15,185	224.20	3,404,477.00
	ATLAS COPCO AB-B SHS	8,620	203.70	1,755,894.00
	SANDVIK AB	21,690	88.00	1,908,720.00
	SKANSKA AB-B SHS	7,170	182.50	1,308,525.00
	SKF AB-B SHARES-B	7,459	149.20	1,112,882.80
	VOLVO AB-B SHS-B	31,320	92.90	2,909,628.00
	SECURITAS AB-B SHS	7,249	127.50	924,247.50
	ELECTROLUX AB - B	4,595	234.20	1,076,149.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	8,480	65.95	559,256.00
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	19,758	256.70	5,071,878.60
	ICA GRUPPEN AB	1,450	272.00	394,400.00
	SWEDISH MATCH AB	4,860	278.70	1,354,482.00
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	13,015	263.90	3,434,658.50
	GETINGE AB-B SHS	4,450	173.80	773,410.00
	NORDEA BANK AB	64,688	73.80	4,773,974.40
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	31,870	78.80	2,511,356.00
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	31,030	106.90	3,317,107.00
	SWEDBANK AB - A SHARES	18,520	181.40	3,359,528.00
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,400	137.50	605,000.00
	INVESTOR AB-B SHS	9,045	286.60	2,592,297.00
KINNEVIK AB - B	5,505	204.60	1,126,323.00	
ERICSSON LM-B SHS	64,235	65.60	4,213,816.00	
HEXAGON AB-B SHS	5,930	320.00	1,897,600.00	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,370	507.00	694,590.00	
TELE2 AB-B SHS	6,255	71.75	448,796.25	
TELIA CO AB	53,480	38.26	2,046,144.80	
スウェーデンクローナ小計		491,049		59,916,582.85 (717,201,496)
ノルウェーク	STATOIL ASA	24,664	138.60	3,418,430.40

ローネ	NORSK HYDRO A S	30,900	30.79	951,411.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	3,780	266.70	1,008,126.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	2,400	232.00	556,800.00	
	MARINE HARVEST	7,720	141.00	1,088,520.00	
	ORKLA ASA	19,380	72.05	1,396,329.00	
	DNB ASA	22,215	100.50	2,232,607.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,200	137.30	576,660.00	
	TELENOR ASA	17,305	127.80	2,211,579.00	
ノルウェークローネ小計		132,564		13,440,462.90	(159,807,103)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,890	417.00	788,130.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	4,865	306.00	1,488,690.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	4,690	436.40	2,046,716.00	
	ISS A/S	3,100	246.70	764,770.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	90	8,540.00	768,600.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	138	8,860.00	1,222,680.00	
	DSV A/S	3,680	274.50	1,010,160.00	
	PANDORA A/S	2,500	884.50	2,211,250.00	
	CARLSBERG AS-B	2,390	604.00	1,443,560.00	
	COLOPLAST-B	2,545	486.90	1,239,160.50	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	3,000	125.50	376,500.00	
	GENMAB A/S	1,280	1,127.00	1,442,560.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	39,875	345.10	13,760,862.50	
	DANSKE BANK A/S	14,975	175.00	2,620,625.00	
	TRYG A/S	2,575	116.50	299,987.50	
TDC A/S	14,545	31.20	453,804.00		
デンマーククローネ小計		102,138		31,938,055.50	(483,222,779)
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	5,335	31.47	167,892.45	
	OIL SEARCH LTD	26,710	6.43	171,745.30	
	ORIGIN ENERGY LTD	41,910	5.61	235,115.10	
	SANTOS LTD	37,665	4.68	176,272.20	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	16,528	25.77	425,926.56	
	ALUMINA LTD	46,512	1.30	60,698.16	
	AMCOR LIMITED	26,490	14.36	380,396.40	

BHP BILLITON LTD	69,266	17.54	1,214,925.64
BORAL LTD	17,115	5.92	101,320.80
FORTESCUE METALS GROUP LTD	29,665	3.27	97,004.55
INCITEC PIVOT LTD	31,550	3.06	96,543.00
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	10,985	19.46	213,768.10
NEWCREST MINING LTD	17,209	23.55	405,271.95
ORICA LIMITED	6,935	12.47	86,479.45
RIO TINTO LTD	9,978	42.83	427,357.74
SOUTH32 LTD	70,856	1.58	112,306.76
CIMIC GROUP LTD	1,867	34.93	65,214.31
BRAMBLES LTD	35,548	12.20	433,685.60
SEEK LTD	8,040	14.88	119,635.20
AURIZON HOLDINGS LTD	46,150	4.76	219,674.00
QANTAS AIRWAYS LTD	13,113	2.75	36,060.75
SYDNEY AIRPORT	24,156	7.10	171,507.60
TRANSURBAN GROUP	43,195	11.60	501,062.00
ARISTOCRAT LEISURE LTD	10,000	12.87	128,700.00
CROWN RESORTS LTD	6,745	12.25	82,626.25
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,180	66.49	78,458.20
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	970	31.02	30,089.40
TABCORP HOLDINGS LTD	15,336	4.28	65,638.08
TATTS GROUP LTD	37,700	3.86	145,522.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	14,370	4.46	64,090.20
WESFARMERS LTD	23,695	39.26	930,265.70
WOOLWORTHS LTD	26,272	20.56	540,152.32
COCA-COLA AMATIL LTD	10,650	8.31	88,501.50
TREASURY WINE ESTATES LTD	15,946	9.44	150,530.24
COCHLEAR LTD	1,277	119.95	153,176.15
HEALTHSCOPE LTD	44,380	2.72	120,713.60
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,935	68.93	202,309.55
SONIC HEALTHCARE LTD	9,830	20.89	205,348.70
CSL LTD	9,742	106.75	1,039,958.50
AUST AND NZ BANKING GROUP	62,149	23.44	1,456,772.56
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	8,120	10.36	84,123.20
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	10,478	9.15	95,873.70

	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	36,467	72.57	2,646,410.19	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	56,693	24.61	1,395,214.73	
	WESTPAC BANKING CORP	71,341	28.34	2,021,803.94	
	AMP LTD	62,647	5.16	323,258.52	
	ASX LTD	4,995	44.15	220,529.25	
	CHALLENGER LTD	9,950	8.70	86,565.00	
	MACQUARIE GROUP LTD	6,404	71.20	455,964.80	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	50,298	5.49	276,136.02	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	62,000	2.90	179,800.00	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	27,200	10.97	298,384.00	
	SUNCORP GROUP LTD	29,020	11.84	343,596.80	
	COMPUTERSHARE LTD	11,490	9.89	113,636.10	
	TELSTRA CORPORATION LTD	93,164	5.35	498,427.40	
	TPG TELECOM LTD	7,200	11.40	82,080.00	
	VOCUS COMMUNICATIONS LTD	12,010	8.68	104,246.80	
	AGL ENERGY LTD	15,301	18.39	281,385.39	
	AUSNET SERVICES	29,110	1.57	45,848.25	
	DUET GROUP	41,590	2.52	104,806.80	
豪ドル小計		1,575,433		21,060,807.46	(1,595,987,989)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	17,130	8.09	138,581.70	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	24,545	6.15	150,951.75	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	45,157	3.37	152,179.09	
	CONTACT ENERGY LIMITED	19,340	5.13	99,214.20	
ニュージーランドドル小計		106,172		540,926.74	(39,098,184)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	56,708	87.00	4,933,596.00	
	NWS HOLDINGS LTD	28,500	11.68	332,880.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	25,000	11.58	289,500.00	
	MTR CORP	34,000	37.45	1,273,300.00	
	LI & FUNG LTD	138,000	3.49	481,620.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	29,000	30.25	877,250.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	14,500	30.80	446,600.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	50,000	23.10	1,155,000.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	16,800	10.54	177,072.00	

	SANDS CHINA LTD	49,800	26.00	1,294,800.00	
	SJM HOLDINGS LTD	48,000	4.51	216,480.00	
	WYNN MACAU LTD	35,800	11.42	408,836.00	
	WH GROUP LTD	153,500	5.85	897,975.00	
	BANK OF EAST ASIA	21,640	28.45	615,658.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	77,000	22.80	1,755,600.00	
	HANG SENG BANK LTD	16,300	129.80	2,115,740.00	
	FIRST PACIFIC CO	44,250	5.25	232,312.50	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	23,500	182.70	4,293,450.00	
	AIA GROUP LTD	257,200	44.75	11,509,700.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	54,208	46.75	2,534,224.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	57,000	15.08	859,560.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	26,842	41.15	1,104,548.30	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	15,000	33.25	498,750.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	11,450	18.46	211,367.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	134,666	7.45	1,003,261.70	
	SINO LAND CO	63,050	11.92	751,556.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	36,480	88.55	3,230,304.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	13,017	84.45	1,099,285.65	
	SWIRE PROPERTIES LTD	23,200	20.20	468,640.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	27,800	45.30	1,259,340.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	19,600	34.70	680,120.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	67,000	11.04	739,680.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	15,000	69.90	1,048,500.00	
	CLP HOLDINGS LTD	42,500	76.10	3,234,250.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	56,000	6.90	386,400.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	179,925	13.42	2,414,593.50	
	POWER ASSETS HOLDINGS	32,500	70.00	2,275,000.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	4,200	56.60	237,720.00	
	香港ドル小計	1,998,936		57,344,469.65	(755,226,665)
シンガポール	KEPPEL CORP LTD	34,660	5.30	183,698.00	
ドル	NOBLE GROUP LTD	82,854	0.21	17,813.61	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	21,000	2.76	57,960.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	16,000	1.55	24,880.00	

	SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,000	3.04	100,320.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,000	2.67	122,820.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	12,800	10.40	133,120.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	102,000	0.70	71,400.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	32,550	3.71	120,760.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,000	32.90	65,800.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	130,000	0.34	44,200.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	44,700	3.23	144,381.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	36,715	15.51	569,449.65	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	62,240	8.38	521,571.20	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	29,200	17.85	521,220.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	20,000	7.30	146,000.00	
	CAPITALAND LTD	68,600	2.89	198,254.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	10,000	8.31	83,100.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	60,000	1.78	106,800.00	
	UOL GROUP LTD	12,250	5.31	65,047.50	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	164,980	3.82	630,223.60	
シンガポールドドル小計		1,021,549		3,928,819.06	(295,054,311)
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	9,770	15.45	150,946.50	
	TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	19,810	193.20	3,827,292.00	
	BANK HAPOALIM BM	27,725	19.05	528,161.25	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	29,355	13.70	402,163.50	
	NICE LTD	1,385	229.90	318,411.50	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	48,790	7.22	352,263.80	
イスラエルシュケル小計		136,835		5,579,238.55	(146,901,351)
合 計		27,649,512		60,263,865,073	(60,263,865,073)

(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	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	1,490	148,046.40	
		AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	7,010	136,624.90	
		AMERICAN TOWER CORP	9,139	989,479.53	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	20,020	218,017.80	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,085	532,378.45	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,417	437,478.51	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	5,120	131,020.80	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,200	185,878.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	6,970	672,186.80	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,235	335,113.65	
		DUKE REALTY CORPORATION	6,875	174,556.25	
		EQUINIX INC	1,378	518,059.10	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	7,760	508,280.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,400	303,660.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	2,800	243,236.00	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,415	221,872.00	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	12,545	358,159.75	
		HCP INC	10,125	346,578.75	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	14,569	228,733.30	
		IRON MOUNTAIN INC	4,735	178,651.55	
		KIMCO REALTY CORPORATION	8,795	259,980.20	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	120,192.93	
		MACERICH CO/THE	2,870	232,211.70	
		MID AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	1,500	151,665.00	
		PROLOGIS INC	10,732	516,638.48	
		PUBLIC STORAGE	3,089	745,437.48	
		REALTY INCOME CORP	5,400	355,050.00	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	2,355	184,867.50	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	6,604	1,363,726.00	
		SL GREEN REALTY CORP	2,260	230,881.60	
		UDR INC	5,820	202,245.00	
		VENTAS INC	6,945	484,552.65	
		VEREIT INC	18,644	182,524.76	
VORNADO REALTY TRUST	3,811	369,628.89			
WELLTOWER INC	7,680	556,723.20			

		WEYERHAEUSER CO	16,498	457,489.54
米ドル小計			231,404	13,281,826.47 (1,357,137,028)
加ドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2,340	50,871.60
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,380	96,431.40
加ドル小計			5,720	147,303.00 (11,527,932)
ユーロ	投資証券	FONCIERE DES REGIONS	595	46,070.85
		GECINA SA	970	117,515.50
		ICADE	685	42,607.00
		KLEPIERRE	4,342	165,820.98
		UNIBAIL-RODAMCO SE-NA	2,070	476,824.50
ユーロ小計			8,662	848,838.83 (95,502,856)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	21,701	133,135.63
		HAMMERSON PLC	15,295	78,463.35
		INTU PROPERTIES PLC	19,860	55,051.92
		LAND SECURITIES GROUP PLC	16,229	163,101.45
		SEGRO PLC	15,053	59,700.19
英ポンド小計			88,138	489,452.54 (66,976,685)
豪ドル	投資証券	APA GROUP	26,406	229,996.26
		DEXUS PROPERTY GROUP	18,487	166,198.13
		GOODMAN GROUP	43,442	310,175.88
		GPT GROUP	44,885	240,583.60
		LENDLEASE GROUP	12,197	157,829.18
		MIRVAC GROUP	86,525	174,780.50
		SCENTRE GROUP	116,381	543,499.27
		STOCKLAND	55,310	258,297.70
		VICINITY CENTRES	72,862	233,158.40
		WESTFIELD CORP	41,745	431,643.30
豪ドル小計			518,240	2,746,162.22 (208,104,173)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	48,000	2,385,600.00
香港ドル小計			48,000	2,385,600.00 (31,418,352)

シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	39,000	89,700.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	40,000	55,800.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	66,300	132,600.00	
		SUNTEC REIT	45,000	74,475.00	
シンガポールドル小計			190,300	352,575.00 (26,478,382)	
合計				1,797,145,408 (1,797,145,408)	

(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 596銘柄	96.7%		63.6%
	投資証券 36銘柄		3.3%	2.2%
加ドル	株式 88銘柄	99.5%		3.8%
	投資証券 2銘柄		0.5%	0.0%
ユーロ	株式 234銘柄	98.7%		11.6%
	投資証券 5銘柄		1.3%	0.2%
英ポンド	株式 111銘柄	98.6%		7.5%
	投資証券 5銘柄		1.4%	0.1%
スイスフラン	株式 37銘柄	100.0%		3.7%
スウェーデンクローナ	株式 30銘柄	100.0%		1.2%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%		0.3%
デンマーククローネ	株式 16銘柄	100.0%		0.8%
豪ドル	株式 60銘柄	88.5%		2.6%
	投資証券 10銘柄		11.5%	0.3%
ニュージーランドドル	株式 4銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式 38銘柄	96.0%		1.2%
	投資証券 1銘柄		4.0%	0.1%
シンガポールドル	株式 21銘柄	91.8%		0.5%
	投資証券 4銘柄		8.2%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 6銘柄	100.0%		0.2%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

海外新興国株式インデックス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12月25日現在	平成28年 6月27日現在
資産の部		
流動資産		
預金	113,449,660	83,494,590
コール・ローン	104,079,560	48,265,986
株式	8,976,747,237	7,957,760,346
投資信託受益証券	30,996,897	29,386,457
投資証券	41,347,695	41,490,510
派生商品評価勘定	6,765,020	75,614
未収入金	-	169,746
未収配当金	7,231,774	30,558,098
未収利息	173	-
差入委託証拠金	32,768,510	16,243,146
流動資産合計	9,313,386,526	8,207,444,493
資産合計	9,313,386,526	8,207,444,493
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	77,026	3,236,552
未払解約金	9,027,551	8,348,600
未払利息	-	77
流動負債合計	9,104,577	11,585,229
負債合計	9,104,577	11,585,229
純資産の部		
元本等		
元本	6,709,790,933	6,874,168,506
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,594,491,016	1,321,690,758
元本等合計	9,304,281,949	8,195,859,264
純資産合計	9,304,281,949	8,195,859,264
負債純資産合計	9,313,386,526	8,207,444,493

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、新株予約権証券、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12月25日現在	平成28年 6月27日現在
1.	期首	平成27年 6月26日	平成27年12月26日
	期首元本額	6,373,238,852円	6,709,790,933円
	期首からの追加設定元本額	599,333,993円	609,016,303円
	期首からの一部解約元本額	262,781,912円	444,638,730円
	元本の内訳		
	日興五大陸株式ファンド	2,567,584,970円	2,442,754,966円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	30,612,308円	31,138,222円
	インデックスファンド海外新興国（エマージング）株式	4,101,803,199円	4,398,609,119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）	9,790,456円	1,666,199円
	計	6,709,790,933円	6,874,168,506円
2.	受益権の総数	6,709,790,933口	6,874,168,506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27年 6月26日 至 平成27年12月25日	自 平成27年12月26日 至 平成28年 6月27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12月25日現在	平成28年 6月27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

（平成28年 6月27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	97,342,925
投資信託受益証券	5,639,825
投資証券	252,247
合計	91,450,853

（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

（平成28年 6月27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	161,246,681	-	158,085,743	3,160,938
合計		161,246,681	-	158,085,743	3,160,938

(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。

(平成28年 6月27日現在)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成27年12月25日現在		平成28年 6月27日現在	
1口当たり純資産額	1.3867円	1口当たり純資産額	1.1923円
(1万口当たり純資産額)	(13,867円)	(1万口当たり純資産額)	(11,923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	9.37	22,862.80	
	GAZPROM PAO-SPON ADR	132,700	4.26	565,965.50	
	LUKOIL PJSC-SPON-ADR	9,535	41.16	392,508.27	
	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	2,326	99.45	231,320.70	
	PETROLEO BRASILEIRO S.A.-ADR	3,750	6.74	25,275.00	
	ROSNEFT OJSC-REG S GDR	26,540	5.12	136,017.50	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	38,500	5.05	194,617.50	
	TATNEFT-SPONSORED-ADR	5,449	29.70	161,835.30	
	BRASKEM SA-SPON ADR	1,780	11.39	20,274.20	
	CEMEX SAB-SPONS ADR PART CER	2,600	5.88	15,288.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	4,650	11.32	52,638.00	
	CIA SIDERURGICA NAACL-SP ADR	10,170	2.19	22,272.30	

GERDAU SA -SPON ADR	3,600	1.70	6,120.00
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	13,394	12.79	171,309.26
PHOSAGRO OAO REG S-GDR	2,400	14.50	34,800.00
QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	1,100	24.00	26,400.00
SEVERSTAL - GDR REG S	5,670	10.42	59,081.40
SOUTHERN COPPER CORP(US)	2,080	25.56	53,164.80
EMBRAER SA ADR	800	21.34	17,072.00
DP WORLD LTD	4,470	16.75	74,872.50
LATAM AIRLINES GROUP-SP -ADR	2,280	6.38	14,546.40
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP-ADR	2,600	41.04	106,704.00
TAL EDUCATION GROUP- ADR	1,000	57.65	57,650.00
GRUPO TELEVISA SA-SPONS ADR	2,040	25.10	51,204.00
CTRIIP.COM INTERNATIONAL-ADR	7,600	39.60	300,960.00
JD.COM INC-ADR	15,400	20.64	317,856.00
QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	600	30.17	18,102.00
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	7,700	11.02	84,854.00
CIA BRASILEIRA-SP ADR PREF	2,380	13.32	31,701.60
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	6,000	29.85	179,100.00
BRF SA-ADR	5,980	12.83	76,723.40
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	1,450	21.59	31,305.50
BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	1,983	18.34	36,368.22
BANCOLOMBIA S.A. -SPONS ADR	1,850	34.38	63,603.00
CREDICORP LTD	1,430	146.35	209,280.50
GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORE-ADR	1,850	7.81	14,448.50
GRUPO FIN SANTANDER B-ADR	2,600	8.35	21,710.00
ITAU UNIBANCO HLDNG-PREF ADR	2,000	8.53	17,060.00
SBERBANK-SPONSORED ADR	61,000	8.48	517,402.00
VTB BANK OJSC-GDR-REG S	66,030	2.06	136,021.80
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	17,100	1.53	26,214.30
58.COM INC-ADR	1,600	46.08	73,728.00
ALIBABA GROUP HOLDING-SP-ADR	21,740	76.29	1,658,544.60
BAIDU INC - SPON ADR	5,800	159.12	922,896.00
NETEASE INC-ADR	1,770	172.09	304,599.30
QIHOO 360 TECHNOLOGY CO-ADR	670	75.27	50,430.90
SOUFUN HOLDINGS LTD-ADR	3,000	5.11	15,330.00

	YY INC-ADR	350	33.43	11,700.50	
	MEGAFON-REG S-GDR	2,600	10.20	26,520.00	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	12,562	7.94	99,742.28	
	ROSTELECOM-SPONSORED-ADR	2,641	8.48	22,395.68	
	SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR	2,800	7.40	20,720.00	
	TELEF BRASIL-ADR	3,924	12.12	47,558.88	
	CEMIG SA -SPONS ADR	4,397	1.87	8,222.39	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE-ADR	6,180	8.28	51,170.40	
	RUSHYDRO PJSC-ADR	28,000	0.86	24,136.00	
米ドル小計		582,861		7,934,205.18 (810,717,085)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	273,945	11.24	3,079,141.80	
	GRUPO MEXICO SA-SER B	82,078	40.55	3,328,262.90	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	3,700	383.25	1,418,025.00	
	MEXICHEM SAB DE CV-*	23,185	38.55	893,781.75	
	ALFA S.A.B. -A	61,000	30.91	1,885,510.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	13,700	77.79	1,065,723.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	6,600	186.02	1,227,732.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	4,000	287.30	1,149,200.00	
	OHL MEXICO SAB DE CV	21,000	22.59	474,390.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	5,000	215.01	1,075,050.00	
	GRUPO TELEVISA SAB	43,100	95.21	4,103,551.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	4,400	194.85	857,340.00	
	GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	8,500	43.01	365,585.00	
	WALMART DE MEXICO -SER V	120,200	43.11	5,181,822.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	9,300	126.71	1,178,403.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	10,900	149.03	1,624,427.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	38,900	167.23	6,505,247.00	
	GRUMA S.A.B. -B	3,000	253.50	760,500.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	36,500	55.56	2,027,940.00	
	GRUPO LALA SAB DE CV	13,000	41.19	535,470.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	41,670	42.05	1,752,223.50	
	GRUPO FIN SANTANDER-B	32,000	31.60	1,011,200.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	52,100	96.49	5,027,129.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	54,000	30.54	1,649,160.00	

	GENTERA SAB DE CV	30,000	32.54	976,200.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	705,800	11.02	7,777,916.00	
メキシコペソ小計		1,697,578		56,930,929.95	(306,288,403)
ブラジルリアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	2,600	31.75	82,550.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	53,360	11.43	609,904.80	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	85,100	9.25	787,175.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	8,100	71.40	578,340.00	
	BRASKEM SA-PREF A	1,000	19.26	19,260.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL	7,800	7.37	57,486.00	
	DURATEX SA	7,260	8.43	61,201.80	
	FIBRIA CELULOSE SA	5,929	24.47	145,082.63	
	GERDAU SA-PREF	16,000	5.86	93,760.00	
	KLABIN SA - UNIT	13,300	15.72	209,076.00	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	9,000	11.90	107,100.00	
	VALE SA	25,760	15.21	391,809.60	
	VALE SA-PREF A	46,150	12.20	563,030.00	
	EMBRAER SA	10,500	18.15	190,575.00	
	WEG SA	12,820	14.16	181,531.20	
	CCR SA	20,600	16.36	337,016.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	2,940	34.43	101,224.20	
	KROTON EDUCACIONAL SA	29,448	13.92	409,916.16	
	LOJAS AMERICANAS SA	6,000	11.11	66,660.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PRF	13,092	15.49	202,795.08	
	LOJAS RENNER S.A.	14,000	22.97	321,580.00	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PRF	850	45.22	38,437.00	
	RAIA DROGASIL SA	4,700	59.70	280,590.00	
	AMBEV SA	102,000	18.48	1,884,960.00	
	BRF SA	8,400	43.80	367,920.00	
	JBS SA	18,100	9.28	167,968.00	
	M DIAS BRANCO SA	950	97.50	92,625.00	
	HYPERMARCAS SA	8,000	28.32	226,560.00	
	NATURA COSMETICOS SA	3,300	25.74	84,942.00	
	ODONTOPREV S.A.	4,700	12.30	57,810.00	
	QUALICORP SA	5,000	18.35	91,750.00	

	BANCO BRADESCO S.A.	18,876	26.31	496,627.56	
	BANCO BRADESCO SA-PRF	60,442	24.84	1,501,379.28	
	BANCO DO BRASIL S.A.	19,200	15.89	305,088.00	
	BANCO SAN. BRASIL-UNIT	7,700	17.59	135,443.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	64,033	28.95	1,853,755.35	
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PRF	83,419	7.21	601,450.99	
	BM&FBOVESPA SA	37,573	16.91	635,359.43	
	CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	4,700	42.80	201,160.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	14,000	26.73	374,220.00	
	PORTO SEGURO SA	3,200	26.94	86,208.00	
	SUL AMERICA SA - UNITS	5,500	15.85	87,175.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	13,650	12.00	163,800.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	1,500	58.16	87,240.00	
	CIELO SA	20,890	33.49	699,606.10	
	TOTVS SA	3,250	29.77	96,752.50	
	TELEFONICA BRASIL S.A. -PREF	5,330	41.30	220,129.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	16,905	6.58	111,234.90	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	2,300	16.97	39,031.00	
	CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	2,800	11.20	31,360.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	14,399	6.44	92,729.56	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PRF-B	3,000	29.13	87,390.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	2,160	27.98	60,436.80	
	CPFL ENERGIA SA	3,605	20.15	72,640.75	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	7,300	13.03	95,119.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	3,800	46.60	177,080.00	
	TRACTEBEL ENERGIA SA ORD	3,700	36.39	134,643.00	
	ブラジルリアル小計	969,991		17,257,694.69	(522,562,995)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	9,890	5,812.80	57,488,592.00	
	EMPRESAS CMPC SA	20,000	1,389.10	27,782,000.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B-PRF	1,400	16,380.00	22,932,000.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	5,300	4,381.90	23,224,070.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	10,800	5,003.20	54,034,560.00	
	CENCOSUD SA	30,150	1,888.40	56,935,260.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PRF B	5,600	2,337.70	13,091,120.00	

	BANCO DE CHILE	424,189	70.16	29,761,100.24	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	943	28,551.00	26,923,593.00	
	BANCO SANTANDER CHILE SA	747,000	31.27	23,358,690.00	
	ITAU CORPBANCA	2,600,000	5.58	14,528,800.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM-OSA-RTS	740	624.93	462,448.20	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	2,700	6,100.00	16,470,000.00	
	AES GENER SA	80,000	318.76	25,500,800.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	56,000	376.82	21,101,920.00	
	COLBUN SA	208,000	162.82	33,866,560.00	
	EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	57,700	600.61	34,655,197.00	
	ENDESA AMERICAS SA	57,700	301.43	17,392,511.00	
	ENERSIS AMERICAS SA	419,500	112.56	47,218,920.00	
	ENERSIS CHILE SA	419,500	77.97	32,708,415.00	
チリペソ小計		5,157,112		579,436,556.44	(87,147,258)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	50,000	1,400.00	70,000,000.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	8,890	11,980.00	106,502,200.00	
	GRUPO ARGOS SA	5,760	18,640.00	107,366,400.00	
	BANCOLOMBIA SA-PRF	2,000	25,680.00	51,360,000.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES-PRF	47,000	1,175.00	55,225,000.00	
	CORP FINANCIERA COLOMBIANA	1,824	37,700.00	68,764,800.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	6,600	38,200.00	252,120,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	13,000	8,900.00	115,700,000.00	
コロンビアペソ小計		135,074		827,038,400.00	(28,450,120)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	1,770	61.45	108,766.50	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	46,017	3.94	181,306.98	
	KOC HOLDING AS	12,124	12.53	151,913.72	
	TURK HAVA YOLLARI AO	19,550	5.67	110,848.50	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	3,300	22.60	74,580.00	
	ARCELIK A.S.	6,500	18.79	122,135.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	4,400	55.45	243,980.00	
	ANADOLU EFES BIRACILIK	5,581	17.66	98,560.46	
	COCA-COLA ICECEK URETIM AS	2,000	35.70	71,400.00	
	AKBANK T.A.S.	49,259	8.17	402,446.03	

	TURKIYE GARANTI BANKASI	52,740	7.53	397,132.20	
	TURKIYE HALK BANKASI	14,660	8.69	127,395.40	
	TURKIYE IS BANKASI-C	39,904	4.42	176,375.68	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	19,682	4.53	89,159.46	
	YAPI VE KREDI BANKASI	18,033	3.94	71,050.02	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	27,753	9.25	256,715.25	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	12,000	5.87	70,440.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	17,056	10.32	176,017.92	
トルコリラ小計		352,329		2,930,223.12	(101,590,835)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,800	904.00	1,627,200.00	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	1,300	222.00	288,600.00	
	CEZ AS	3,530	414.40	1,462,832.00	
チェココルナ小計		6,630		3,378,632.00	(14,055,109)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	1,060	16,180.00	17,150,800.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	2,750	5,331.00	14,660,250.00	
	OTP BANK PLC	4,585	6,325.00	29,000,125.00	
ハンガリーフォリント小計		8,395		60,811,175.00	(21,557,561)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	3,000	30.25	90,750.00	
	POLISH OIL & GAS	37,985	5.22	198,281.70	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	6,130	69.05	423,276.50	
	GRUPA AZOTY SA	1,400	70.76	99,064.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	3,710	61.79	229,240.90	
	CCC SA	650	164.05	106,632.50	
	LPP SA	20	5,000.00	100,000.00	
	CYFROWY POLSAT SA	4,500	21.25	95,625.00	
	EUROCASH SA	2,100	45.38	95,298.00	
	ALIOR BANK SA	1,500	50.89	76,335.00	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	850	69.30	58,905.00	
	BANK MILLENNIUM SA	13,000	4.50	58,500.00	
	BANK PEKAO SA	3,152	136.90	431,508.80	
	BANK ZACHODNI WBK SA	810	273.85	221,818.50	
MBANK	230	304.30	69,989.00		

	PKO BANK POLSKI SA	18,445	24.68	455,222.60	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	12,000	29.45	353,400.00	
	ORANGE POLSKA SA	14,105	5.16	72,781.80	
	ENEA SA	5,500	10.16	55,880.00	
	ENERGA SA	5,000	9.78	48,900.00	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	18,400	13.32	245,088.00	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	22,000	2.69	59,180.00	
	ポーランドズロチ小計	174,487		3,645,677.30	(93,037,684)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	85,000	3.83	325,550.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	46,000	5.88	270,480.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	539,300	5.29	2,852,897.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	73,000	13.34	973,820.00	
	CNOOC LTD	388,000	9.29	3,604,520.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	66,000	6.18	407,880.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	467,000	5.18	2,419,060.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	50,000	4.79	239,500.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	89,000	2.37	210,930.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	23,000	17.64	405,720.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	74,000	3.33	246,420.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	31,000	8.39	260,090.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	42,000	5.63	236,460.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	64,500	3.37	217,365.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD	147,750	2.45	361,987.50	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	52,000	5.14	267,280.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	12,000	40.40	484,800.00	
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	96,000	8.15	782,400.00	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	31,000	14.98	464,380.00	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	46,000	9.32	428,720.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	100,000	5.70	570,000.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	52,000	9.84	511,680.00	
	CITIC LTD	94,000	11.00	1,034,000.00	
	CRRC CORP LTD- H	79,000	6.63	523,770.00	
	FOSUN INTERNATIONAL LTD	49,000	9.80	480,200.00	
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	12,000	12.82	153,840.00	

SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	70,000	3.29	230,300.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	13,000	16.96	220,480.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	32,000	6.88	220,160.00	
WEICHAJ POWER CO LTD-H	19,200	8.32	159,744.00	
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	9,000	42.15	379,350.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	55,000	8.39	461,450.00	
AIR CHINA LTD-H	58,000	5.19	301,020.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	40,000	8.20	328,000.00	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	65,825	2.69	177,069.25	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	21,000	20.45	429,450.00	
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	100,750	1.52	153,140.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	38,000	4.28	162,640.00	
COSCO PACIFIC LTD	32,000	7.55	241,600.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	24,000	10.28	246,720.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	43,000	6.89	296,270.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	64,000	7.49	479,360.00	
BYD CO LTD-H	14,500	44.80	649,600.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B	28,000	10.78	301,840.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	60,000	8.11	486,600.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	100,000	4.10	410,000.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	75,000	6.24	468,000.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	76,318	9.13	696,783.34	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	25,000	14.38	359,500.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	17,000	11.12	189,040.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	13,000	36.65	476,450.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	180,000	1.78	320,400.00	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	103,000	4.20	432,600.00	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	191,160	0.91	173,955.60	
SUN ART RETAIL GROUP	43,000	5.17	222,310.00	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	90,000	3.15	283,500.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	58,000	12.82	743,560.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	37,000	16.72	618,640.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	38,000	6.77	257,260.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	6,000	26.00	156,000.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	132,000	5.26	694,320.00	

HENGAN INTL GROUP CO LTD	15,500	68.30	1,058,650.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	32,000	4.47	143,040.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	13,000	16.88	219,440.00
SINOPHARM GROUP CO-H	26,400	34.80	918,720.00
3SBIO INC	25,000	7.63	190,750.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	24,000	11.24	269,760.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	78,000	6.52	508,560.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	32,000	4.56	145,920.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	11,000	18.40	202,400.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	102,000	4.79	488,580.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	485,000	2.90	1,406,500.00
BANK OF CHINA LTD - H	1,784,000	2.98	5,316,320.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	216,245	4.99	1,079,062.55
CHINA CITIC BANK - H	206,000	4.59	945,540.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,836,920	4.88	8,964,169.60
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	90,000	3.37	303,300.00
CHINA MERCHANTS BANK - H	81,150	16.26	1,319,499.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	131,200	7.20	944,640.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	75,000	3.76	282,000.00
IND & COMM BK OF CHINA - H	1,636,575	4.31	7,053,638.25
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	171,000	2.54	434,340.00
CHINA EVERBRIGHT LTD	18,000	14.58	262,440.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	63,000	6.63	417,690.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	46,000	16.84	774,640.00
FAR EAST HORIZON LTD	40,000	5.89	235,600.00
GF SECURITIES CO LTD-H	30,600	17.46	534,276.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	67,600	12.60	851,760.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	32,000	16.18	517,760.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	159,000	16.46	2,617,140.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	54,600	25.15	1,373,190.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	34,940	13.98	488,461.20
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO-H	14,000	27.10	379,400.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	163,000	2.99	487,370.00
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	79,334	12.86	1,020,235.24
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	114,000	33.60	3,830,400.00

CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	110,000	2.07	227,700.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	86,320	23.05	1,989,676.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	61,777	17.30	1,068,742.10	
CHINA VANKE CO LTD-H	30,360	16.70	507,012.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	100,713	3.15	317,245.95	
DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H	10,700	49.45	529,115.00	
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	96,000	4.74	455,040.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	26,400	10.60	279,840.00	
LONGFOR PROPERTIES	31,000	9.98	309,380.00	
NEW WORLD CHINA LAND LTD	72,000	7.75	558,000.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	37,500	9.61	360,375.00	
SHUI ON LAND LTD	42,900	1.92	82,368.00	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	65,000	3.22	209,300.00	
SOHO CHINA LTD	65,000	3.57	232,050.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	40,000	4.71	188,400.00	
KINGSOFT CORP LTD	16,000	14.52	232,320.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	123,400	173.80	21,446,920.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	20,000	15.02	300,400.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	18,000	66.10	1,189,800.00	
LENOVO GROUP LTD	154,000	4.71	725,340.00	
ZTE CORP-H	21,600	9.83	212,328.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	76,000	5.54	421,040.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	60,000	3.87	232,200.00	
CHINA MOBILE LTD	133,700	83.75	11,197,375.00	
CHINA TELECOM CORP LTD	315,000	3.36	1,058,400.00	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	123,882	7.89	977,428.98	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	90,000	4.46	401,400.00	
CGN POWER CO LTD-H	186,000	2.07	385,020.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	54,000	10.92	589,680.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	48,000	6.06	290,880.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	55,000	2.81	154,550.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	30,000	22.00	660,000.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	47,000	11.14	523,580.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	12,000	36.50	438,000.00	
GUANGDONG INVEST	62,000	10.98	680,760.00	

	HUADIAN POWER INTL CORP-H	26,000	3.61	93,860.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	106,000	5.35	567,100.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	64,000	2.42	154,880.00	
	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	298,000	1.00	298,000.00	
	HANERGY THIN FILM POWER GROU	240,000	2.75	660,000.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	500,000	0.61	305,000.00	
香港ドル小計		16,523,619		128,656,559.56 (1,694,406,889)	
マレーシアリン ギット	PETRONAS DAGANGAN BHD	5,000	23.44	117,200.00	
	SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	70,000	1.35	94,500.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	53,000	6.44	341,320.00	
	DIALOG GROUP BHD	70,000	1.55	108,500.00	
	GAMUDA BHD	30,000	4.82	144,600.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	10,000	7.75	77,500.00	
	IJM CORP BHD	70,000	3.44	240,800.00	
	SIME DARBY BERHAD	64,720	7.49	484,752.80	
	AIRASIA BHD	47,000	2.61	122,670.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	18,000	6.37	114,660.00	
	MISC BHD	30,000	7.40	222,000.00	
	UMW HOLDINGS BHD	11,700	5.58	65,286.00	
	BERJAYA SPORTS TOTO BERHAD	27,653	2.94	81,299.82	
	GENTING BHD	45,300	7.88	356,964.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	72,500	4.35	315,375.00	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	30,000	2.78	83,400.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	2,500	51.00	127,500.00	
	FELDA GLOBAL VENTURES	43,000	1.50	64,500.00	
	IOI CORPORATION BERHAD	41,675	4.34	180,869.50	
	KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	12,000	23.00	276,000.00	
	PPB GROUP BERHAD	11,700	16.26	190,242.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	17,000	4.18	71,060.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	54,000	6.70	361,800.00	
	ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	37,000	4.09	151,330.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	32,600	4.37	142,462.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	75,600	4.31	325,836.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	12,300	13.26	163,098.00	

	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,000	13.98	69,900.00	
	MALAYAN BANKING BHD	67,850	8.20	556,370.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	55,370	19.20	1,063,104.00	
	RHB CAPITAL BHD	14,000	6.10	85,400.00	
	IOI PROPERTIES GROUP BHD	53,476	2.33	124,599.08	
	AXIATA GROUP BERHAD	51,900	5.50	285,450.00	
	DIGI.COM BHD	74,000	4.80	355,200.00	
	MAXIS BHD	44,000	5.80	255,200.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	25,000	6.82	170,500.00	
	PETRONAS GAS BERHAD	14,000	21.60	302,400.00	
	TENAGA NASIONAL BERHAD	66,125	14.00	925,750.00	
	YTL CORPORATION BERHAD	144,704	1.60	231,526.40	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	73,500	1.39	102,165.00	
	マレーシアリングット小計	1,683,173		9,553,089.60 (236,725,560)	
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	52,500	14.10	740,250.00	
	IRPC PCL - NVDR	191,800	4.68	897,624.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	28,710	79.75	2,289,622.50	
	PTT PCL-NVDR	21,600	308.00	6,652,800.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	28,000	57.50	1,610,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	39,000	30.00	1,170,000.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	39,045	57.25	2,235,326.25	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	2,600	470.00	1,222,000.00	
	SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	7,300	478.00	3,489,400.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	8,000	383.00	3,064,000.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-NVDR	174,000	6.70	1,165,800.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	160,000	9.00	1,440,000.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	55,000	38.50	2,117,500.00	
	BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	31,000	22.70	703,700.00	
	CP ALL PCL-NVDR	98,800	49.00	4,841,200.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	70,000	27.75	1,942,500.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	110,000	23.60	2,596,000.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	8,000	182.50	1,460,000.00	
	BANGKOK BANK-FOREIGN REG	6,640	159.00	1,055,760.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	24,200	168.00	4,065,600.00	

	KASIKORNBANK PCL-NVDR	13,200	166.00	2,191,200.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	75,125	16.30	1,224,537.50	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	36,300	132.00	4,791,600.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	400,000	2.08	832,000.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	31,000	58.25	1,805,750.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	12,000	67.75	813,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	20,800	158.00	3,286,400.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	182,700	7.00	1,278,900.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	10,000	82.25	822,500.00	
タイパーツ小計		1,937,320		61,804,970.25 (177,998,314)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	52,000	74.35	3,866,200.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	54,000	15.60	842,400.00	
	DMCI HOLDINGS INC	115,000	12.42	1,428,300.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	65,000	83.70	5,440,500.00	
	SM INVESTMENTS CORP	3,312	965.00	3,196,080.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	10,000	61.75	617,500.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	10,000	235.00	2,350,000.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	21,000	204.00	4,284,000.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	17,741	97.05	1,721,764.05	
	BDO UNIBANK INC	31,000	107.00	3,317,000.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	18,827	87.25	1,642,655.75	
	SECURITY BANK CORP	10,000	198.80	1,988,000.00	
	AYALA CORPORATION	4,942	850.00	4,200,700.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,700	1,467.00	2,493,900.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	320,000	6.60	2,112,000.00	
	AYALA LAND INC	156,960	38.20	5,995,872.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	176,710	25.65	4,532,611.50	
	GLOBE TELECOM INC	630	2,360.00	1,486,800.00	
	PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	2,110	2,050.00	4,325,500.00	
	ABOITIZ POWER CORP	46,000	46.20	2,125,200.00	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	175,000	5.60	980,000.00	
フィリピンペソ小計		1,291,932		58,946,983.30 (128,504,423)	
インドネシアル	ADARO ENERGY TBK PT	270,000	840.00	226,800,000.00	

ピア

UNITED TRACTORS TBK PT	33,500	14,075.00	471,512,500.00	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	32,000	15,850.00	507,200,000.00	
SEMEN GRESIK (PERSERO) PT	66,000	8,850.00	584,100,000.00	
AKR CORPORINDO TBK PT	45,000	6,250.00	281,250,000.00	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	495,000	6,700.00	3,316,500,000.00	
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	100,000	2,160.00	216,000,000.00	
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	100,000	3,260.00	326,000,000.00	
MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	52,000	20,000.00	1,040,000,000.00	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	200,000	3,680.00	736,000,000.00	
GUDANG GARAM TBK PT	15,000	66,000.00	990,000,000.00	
HM SAMPOERNA TBK PT	190,000	3,670.00	697,300,000.00	
PT INDOFOOD SUKSES MAK TBK	136,000	7,050.00	958,800,000.00	
PT UNILEVER INDONESIA TBK	30,000	43,500.00	1,305,000,000.00	
KALBE FARMA TBK PT	550,000	1,385.00	761,750,000.00	
BANK DANAMON INDONESIA TBK	48,000	3,500.00	168,000,000.00	
BANK MANDIRI TBK	209,000	9,050.00	1,891,450,000.00	
BANK RAKYAT INDONESIA	248,000	10,300.00	2,554,400,000.00	
PT BANK CENTRAL ASIA	270,000	12,775.00	3,449,250,000.00	
PT BANK NEGARA INDONESIA	180,000	4,890.00	880,200,000.00	
BUMI SERPONG DAMAI PT	170,000	2,040.00	346,800,000.00	
LIPPO KARAWACI TBK/PT	450,000	1,070.00	481,500,000.00	
SUMMARECON AGUNG TBK PT	185,000	1,725.00	319,125,000.00	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	1,115,000	3,820.00	4,259,300,000.00	
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	36,000	6,625.00	238,500,000.00	
XL AXIATA TBK PT	78,000	3,700.00	288,600,000.00	
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	213,500	2,380.00	508,130,000.00	
インドネシアルピア小計	5,517,000		27,803,467,500.00 (214,086,699)	
韓国ウォン				
GS HOLDINGS	1,270	47,500.00	60,325,000.00	
S-OIL CORPORATION	825	75,700.00	62,452,500.00	
SK INNOVATION CO LTD	1,482	138,500.00	205,257,000.00	
HANWHA CHEMICAL CORP	2,000	23,000.00	46,000,000.00	
HYOSUNG CORPORATION	550	119,000.00	65,450,000.00	
HYUNDAI STEEL CO	1,830	45,250.00	82,807,500.00	
KOREA ZINC CO LTD	155	495,000.00	76,725,000.00	

KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	460	59,600.00	27,416,000.00	
LG CHEM LTD	1,002	240,000.00	240,480,000.00	
LG CHEM LTD-PRF	230	178,000.00	40,940,000.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	370	268,500.00	99,345,000.00	
OCI CO LTD	320	90,500.00	28,960,000.00	
POSCO	1,470	194,000.00	285,180,000.00	
CJ CORP	280	202,500.00	56,700,000.00	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	610	76,000.00	46,360,000.00	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	3,686	5,670.00	20,899,620.00	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	800	20,250.00	16,200,000.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,203	27,450.00	33,022,350.00	
HANWHA CORPORATION	1,160	34,900.00	40,484,000.00	
HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	1,595	38,100.00	60,769,500.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	1,310	32,400.00	42,444,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	895	103,500.00	92,632,500.00	
KCC CORP	120	363,500.00	43,620,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,000	67,900.00	67,900,000.00	
LG CORP	2,000	61,600.00	123,200,000.00	
POSCO DAEWOO CORP	1,431	23,350.00	33,413,850.00	
SAMSUNG C&T CORP	1,657	116,000.00	192,212,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	3,690	8,890.00	32,804,100.00	
SK HOLDINGS CO LTD	831	205,500.00	170,770,500.00	
SK NETWORKS CO LTD	1,950	5,850.00	11,407,500.00	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	450	63,400.00	28,530,000.00	
S1 CORPORATION	420	107,500.00	45,150,000.00	
CJ KOREA EXPRESS CORP	130	210,000.00	27,300,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	400	170,000.00	68,000,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	864	25,800.00	22,291,200.00	
HANKOOK TIRE CO LTD	1,482	48,350.00	71,654,700.00	
HANON SYSTEMS	5,400	10,800.00	58,320,000.00	
HYUNDAI MOBIS	1,500	258,500.00	387,750,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	3,130	139,500.00	436,635,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	850	99,100.00	84,235,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	480	96,000.00	46,080,000.00	
HYUNDAI WIA CORP	320	88,800.00	28,416,000.00	

KIA MOTORS CORPORATION	5,640	43,850.00	247,314,000.00	
COWAY CO LTD	1,090	102,000.00	111,180,000.00	
HANSSEM CO LTD	170	150,000.00	25,500,000.00	
LG ELECTRONICS INC	2,085	52,300.00	109,045,500.00	
KANGWON LAND INC	2,770	41,900.00	116,063,000.00	
PARADISE CO LTD	1,050	14,500.00	15,225,000.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	2,350	16,300.00	38,305,000.00	
CJ E&M CORP	470	66,200.00	31,114,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	830	62,500.00	51,875,000.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	380	125,000.00	47,500,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	215	203,000.00	43,645,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	167	186,000.00	31,062,000.00	
BGF RETAIL CO LTD	190	207,500.00	39,425,000.00	
DONGSUH COMPANIES INC	850	32,950.00	28,007,500.00	
E-MART CO LTD	472	175,500.00	82,836,000.00	
GS RETAIL CO LTD	600	51,600.00	30,960,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	194	385,000.00	74,690,000.00	
KT&G CORP	2,295	124,500.00	285,727,500.00	
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO	15	1,770,000.00	26,550,000.00	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	150	195,500.00	29,325,000.00	
ORION CORP	80	897,000.00	71,760,000.00	
OTTOGI CORPORATION	30	790,000.00	23,700,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	730	414,000.00	302,220,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	750	159,500.00	119,625,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	200	1,064,000.00	212,800,000.00	
CELLTRION INC	1,404	91,100.00	127,904,400.00	
HANMI PHARM CO LTD	107	680,000.00	72,760,000.00	
HANMI SCIENCE CO LTD	255	146,500.00	37,357,500.00	
YUHAN CORPORATION	240	303,500.00	72,840,000.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	6,484	8,130.00	52,714,920.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	2,586	8,820.00	22,808,520.00	
HANA FINANCIAL GROUP	6,008	23,350.00	140,286,800.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	6,440	11,250.00	72,450,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	8,005	33,150.00	265,365,750.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	9,400	37,050.00	348,270,000.00	

	WOORI BANK	8,411	9,780.00	82,259,580.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	955	42,350.00	40,444,250.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	4,575	7,780.00	35,593,500.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	1,778	22,800.00	40,538,400.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	3,171	9,050.00	28,697,550.00	
	SAMSUNG CARD CO	690	41,200.00	28,428,000.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,517	35,000.00	53,095,000.00	
	DONGBU INSURANCE CO LTD	800	69,700.00	55,760,000.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	6,000	5,960.00	35,760,000.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	1,200	29,850.00	35,820,000.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	780	263,500.00	205,530,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	1,400	100,500.00	140,700,000.00	
	KAKAO CORP	660	91,200.00	60,192,000.00	
	NAVER CORP	628	739,000.00	464,092,000.00	
	NCSOFT CORPORATION	350	223,500.00	78,225,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	650	138,500.00	90,025,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	5,560	24,600.00	136,776,000.00	
	LG INNOTEK CO LTD	280	77,300.00	21,644,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,330	49,650.00	66,034,500.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	2,185	1,400,000.00	3,059,000,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	415	1,138,000.00	472,270,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	1,228	105,500.00	129,554,000.00	
	KT CORP	1,027	29,150.00	29,937,050.00	
	LG UPLUS CORP.	5,000	10,450.00	52,250,000.00	
	SK TELECOM	400	208,500.00	83,400,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	5,640	57,400.00	323,736,000.00	
	KOREA GAS CORPORATION	828	38,100.00	31,546,800.00	
	SK HYNIX INC	12,630	31,800.00	401,634,000.00	
	韓国ウォン小計	186,398		13,401,694,840.00 (1,156,566,264)	
台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	27,080	86.60	2,345,128.00	
	ASIA CEMENT CORP	57,978	27.40	1,588,597.20	
	CHINA STEEL CORP	269,181	20.50	5,518,210.50	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	66,047	79.50	5,250,736.50	
	FORMOSA PLASTICS CORP	85,424	75.70	6,466,596.80	

NAN YA PLASTICS CORP	103,145	60.00	6,188,700.00	
TAIWAN CEMENT	76,170	31.50	2,399,355.00	
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	20,000	42.05	841,000.00	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	75,957	23.20	1,762,202.40	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	3,883	140.50	545,561.50	
TECO ELECTRIC & MACHINERY	36,000	26.15	941,400.00	
CHINA AIRLINES LTD	67,000	10.10	676,700.00	
EVA AIRWAYS CORP	41,131	14.95	614,908.45	
EVERGREEN MARINE CORP LTD	45,216	11.75	531,288.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	45,947	66.90	3,073,854.30	
YULON MOTOR COMPANY	35,020	27.25	954,295.00	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	3,191	284.50	907,839.50	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	6,180	125.00	772,500.00	
GIANT MANUFACTURING	5,000	203.00	1,015,000.00	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	5,250	132.00	693,000.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	3,000	281.00	843,000.00	
POU CHEN	38,145	41.30	1,575,388.50	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	12,000	46.35	556,200.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	7,000	315.00	2,205,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	12,448	246.00	3,062,208.00	
STANDARD FOODS CORP	7,000	77.90	545,300.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	109,703	62.30	6,834,496.90	
OBI PHARMA INC	2,000	521.00	1,042,000.00	
TAI MED BIOLOGICS INC	3,000	213.00	639,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	88,536	16.40	1,451,990.40	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	350,715	7.65	2,682,969.75	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	328,469	16.35	5,370,468.15	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	161,303	19.00	3,064,757.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	196,065	16.55	3,244,875.75	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	122,336	16.45	2,012,427.20	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	222,356	23.80	5,292,072.80	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	213,604	9.37	2,001,469.48	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	169,618	12.15	2,060,858.70	
TAIWAN BUSINESS BANK	128,330	8.10	1,039,473.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	178,895	14.00	2,504,530.00	

CHAILEASE HOLDING CO LTD	15,329	50.10	767,982.90	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	137,743	38.20	5,261,782.60	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	217,257	10.20	2,216,021.40	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	185,538	36.40	6,753,583.20	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	75,299	24.20	1,822,235.80	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	121,337	6.30	764,423.10	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	14,950	50.80	759,460.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	28,353	36.90	1,046,225.70	
ACER INC	64,812	14.55	943,014.60	
ADVANTECH CO LTD	6,561	236.00	1,548,396.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	15,797	275.00	4,344,175.00	
AU OPTRONICS CORP	173,994	9.35	1,626,843.90	
CASETEK HOLDINGS LTD	3,000	108.50	325,500.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	13,405	239.00	3,203,795.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	13,130	74.30	975,559.00	
COMPAL ELECTRONICS	86,955	19.50	1,695,622.50	
DELTA ELECTRONICS INC	42,541	152.50	6,487,502.50	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	23,552	73.00	1,719,296.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	316,150	81.50	25,766,225.00	
HTC CORP	17,011	90.80	1,544,598.80	
INNOLUX CORP	189,282	9.37	1,773,572.34	
INVENTEC CORP	62,162	22.30	1,386,212.60	
LARGAN PRECISION CO LTD	2,236	2,900.00	6,484,400.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	45,560	44.20	2,013,752.00	
PEGATRON CORP	34,854	66.50	2,317,791.00	
QUANTA COMPUTER INC	63,416	59.20	3,754,227.20	
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	6,000	110.00	660,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	30,591	32.85	1,004,914.35	
TRANSCEND INFORMATION INC	7,346	93.50	686,851.00	
WISTRON CORP	48,389	21.50	1,040,363.50	
WPG HOLDINGS LTD	40,000	36.55	1,462,000.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	7,000	54.70	382,900.00	
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	50,000	10.50	525,000.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	83,371	112.50	9,379,237.50	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	42,000	74.80	3,141,600.00	

	TAIWAN MOBILE CO LTD	33,188	112.50	3,733,650.00	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	127,784	34.95	4,466,050.80	
	HERMES MICROVISION INC	1,000	1,320.00	1,320,000.00	
	INOTERA MEMORIES INC	45,000	25.20	1,134,000.00	
	MEDIATEK INC	33,132	223.50	7,405,002.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	12,522	111.50	1,396,203.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	3,000	266.50	799,500.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	11,635	67.00	779,545.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	11,815	92.80	1,096,432.00	
	SILICONWARE PRECISION INDS	42,082	48.15	2,026,248.30	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	538,355	159.00	85,598,445.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	238,592	12.00	2,863,104.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	22,000	52.90	1,163,800.00	
台湾ドル小計		6,834,349		310,482,403.37 (981,124,394)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	2,200	1,013.45	2,229,590.00	
	CAIRN INDIA LTD	9,100	133.05	1,210,755.00	
	COAL INDIA LTD	14,000	312.25	4,371,500.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	15,460	209.40	3,237,324.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	28,946	951.45	27,540,671.70	
	ACC LIMITED	1,330	1,568.10	2,085,573.00	
	AMBUJA CEMENTS LIMITED	10,970	248.10	2,721,657.00	
	ASIAN PAINTS LTD	5,000	989.55	4,947,750.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	29,280	117.30	3,434,544.00	
	JSW STEEL LIMITED	2,000	1,383.20	2,766,400.00	
	SHREE CEMENT LTD	200	14,245.95	2,849,190.00	
	TATA STEEL LIMITED	5,416	312.65	1,693,312.40	
	ULTRATECH CEMENT LTD	1,150	3,289.95	3,783,442.50	
	UPL LTD	5,900	540.20	3,187,180.00	
	VEDANTA LTD	23,260	117.85	2,741,191.00	
	ASHOK LEYLAND LTD	27,000	96.25	2,598,750.00	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	13,150	118.25	1,554,987.50	
	EICHER MOTORS LTD	280	18,662.20	5,225,416.00	
	LARSEN & TOUBRO LTD	6,980	1,430.60	9,985,588.00	
	SIEMENS INDIA LIMITED	1,890	1,257.40	2,376,486.00	

ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	15,000	201.90	3,028,500.00	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	1,400	1,359.05	1,902,670.00	
BAJAJ AUTO LTD	2,400	2,678.80	6,429,120.00	
BHARAT FORGE LIMITED	1,800	751.95	1,353,510.00	
BOSCH LTD	160	21,159.75	3,385,560.00	
HERO MOTOCORP LTD	1,400	3,058.75	4,282,250.00	
MAHINDRA & MAHINDRA LIMITED	8,600	1,388.90	11,944,540.00	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,300	4,070.05	9,361,115.00	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	6,000	275.50	1,653,000.00	
TATA MOTORS LTD	33,528	449.40	15,067,483.20	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	5,700	298.25	1,700,025.00	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	9,630	448.40	4,318,092.00	
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEA	260	5,991.00	1,557,660.00	
ITC LTD	50,510	354.10	17,885,591.00	
NESTLE INDIA LIMITED	560	6,496.50	3,638,040.00	
UNITED SPIRITS LIMITED	1,330	2,359.35	3,137,935.50	
DABUR INDIA LTD	9,500	310.85	2,953,075.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	3,700	1,511.50	5,592,550.00	
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	15,520	859.10	13,333,232.00	
MARICO LTD	8,600	256.50	2,205,900.00	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	2,300	1,306.05	3,003,915.00	
AUROBINDO PHARMA LTD	7,500	700.90	5,256,750.00	
CADILA HEALTHCARE LTD	5,300	312.20	1,654,660.00	
CIPLA LTD	7,650	476.55	3,645,607.50	
DIVI'S LABORATORIES LTD	1,900	1,100.00	2,090,000.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	2,190	3,153.25	6,905,617.50	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	2,900	765.40	2,219,660.00	
LUPIN LTD	4,130	1,462.90	6,041,777.00	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	2,000	1,421.45	2,842,900.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	20,804	754.75	15,701,819.00	
AXIS BANK LTD	11,000	510.50	5,615,500.00	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	32,575	1,222.75	39,831,081.25	
ICICI BANK LTD	19,325	230.95	4,463,108.75	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	5,800	656.00	3,804,800.00	
LIC HOUSING FINANCE LTD	7,000	478.00	3,346,000.00	

	STATE BANK OF INDIA	34,000	211.25	7,182,500.00	
	YES BANK LTD	1,800	1,080.50	1,944,900.00	
	BAJAJ FINANCE LTD	320	7,588.10	2,428,192.00	
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	7,400	308.35	2,281,790.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	4,000	1,146.90	4,587,600.00	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	11,900	741.85	8,828,015.00	
	INFOSYS LTD	40,140	1,194.55	47,949,237.00	
	TATA CONSULTANCY SVS LTD	10,450	2,573.95	26,897,777.50	
	TECH MAHINDRA LTD	5,200	507.05	2,636,660.00	
	WIPRO LTD	13,640	555.15	7,572,246.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	26,000	355.85	9,252,100.00	
	BHARTI INFRATEL LTD	11,390	324.75	3,698,902.50	
	IDEA CELLULAR LTD	26,000	99.55	2,588,300.00	
	GAIL INDIA LTD	10,875	377.15	4,101,506.25	
	NTPC LIMITED	20,000	149.20	2,984,000.00	
	TATA POWER CO LTD	29,640	72.70	2,154,828.00	
インドルピー小計		766,539		448,782,907.05 (682,150,018)	
カタールリアル	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	5,200	23.07	119,964.00	
	INDUSTRIES QATAR	3,390	100.00	339,000.00	
	COMMERCIAL BANK QSC	3,000	36.85	110,550.00	
	DOHA BANK QSC	2,300	35.15	80,845.00	
	MASRAF AL RAYAN	9,240	34.05	314,622.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	1,670	94.90	158,483.00	
	QATAR NATIONAL BANK	4,716	139.00	655,524.00	
	QATAR INSURANCE CO	1,848	71.90	132,871.20	
	BARWA REAL ESTATE CO	3,000	32.85	98,550.00	
	EZDAN HOLDING GROUP	15,900	17.90	284,610.00	
	OORED00 QSC	2,160	88.90	192,024.00	
	VODAFONE QATAR	10,500	10.30	108,150.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	430	203.60	87,548.00	
カタールリアル小計		63,354		2,682,741.20 (75,438,682)	
エジプトポンド	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	22,687	39.81	903,169.47	
	T M G HOLDING	23,000	4.97	114,310.00	

	GLOBAL TELECOM HOLDING	60,000	3.09	185,400.00	
エジプト債券小計		105,687		1,202,879.47	(13,857,171)
南アフリカ ド	EXXARO RESOURCES LTD	3,510	64.50	226,395.00	
	SASOL LTD	12,300	396.47	4,876,581.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	1,660	353.00	585,980.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	8,520	255.49	2,176,774.80	
	GOLD FIELDS LTD	16,590	68.34	1,133,760.60	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	11,430	44.55	509,206.50	
	MONDI LTD	2,730	274.00	748,020.00	
	SAPPI LIMITED	14,415	67.33	970,561.95	
	SIBANYE GOLD LTD	13,000	49.45	642,850.00	
	BIDVEST GROUP LTD	6,372	138.50	882,522.00	
	STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	62,960	85.15	5,361,044.00	
	TSOGO SUN HOLDINGS LTD	10,000	25.94	259,400.00	
	NASPERS LTD-N SHS	9,410	2,165.00	20,372,650.00	
	FOSCHINI GROUP LTD/THE	4,175	141.45	590,553.75	
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	3,655	146.21	534,397.55	
	MR PRICE GROUP LTD	5,300	202.30	1,072,190.00	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	10,620	87.69	931,267.80	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	21,405	83.64	1,790,314.20	
	BID CORP LTD(N)	6,372	262.50	1,672,650.00	
	MASSMART HOLDINGS LTD	2,739	127.00	347,853.00	
	PICK'N PAY STORES LTD	7,000	70.53	493,710.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	9,710	165.87	1,610,597.70	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	3,360	201.90	678,384.00	
	PIONEER FOODS LTD	2,700	171.51	463,077.00	
	TIGER BRANDS LTD	3,490	358.04	1,249,559.60	
	LIFE HEALTHCARE GROUP	20,000	35.49	709,800.00	
	NETCARE LTD	22,150	30.60	677,790.00	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	7,341	356.00	2,613,396.00		
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	6,900	146.07	1,007,883.00		
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	800	580.00	464,000.00		
NEDBANK GROUP LTD	5,250	186.00	976,500.00		
STANDARD BANK GROUP LTD	26,116	126.05	3,291,921.80		

	BRAIT SE	7,000	149.00	1,043,000.00	
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	3,200	66.56	212,992.00	
	FIRSTRAND LTD	70,870	44.34	3,142,375.80	
	INVESTEC LTD	6,500	93.60	608,400.00	
	PSG GROUP LTD	2,100	186.84	392,364.00	
	REMGRO LTD	10,240	251.50	2,575,360.00	
	RMB HOLDINGS LTD	17,530	55.00	964,150.00	
	DISCOVERY LTD	8,507	119.38	1,015,565.66	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	4,000	122.00	488,000.00	
	MMI HOLDINGS LTD	24,429	21.96	536,460.84	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	19,830	40.00	793,200.00	
	SANLAM LTD	28,635	60.56	1,734,135.60	
	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	3,800	122.66	466,108.00	
	NEW EUROPE PROPERTY INVEST	4,700	170.00	799,000.00	
	MTN GROUP LTD	36,215	139.20	5,041,128.00	
	TELKOM SA SOC LTD	3,700	68.00	251,600.00	
	VODACOM GROUP LTD	9,035	164.33	1,484,721.55	
	南アフリカランド小計	602,271		81,470,152.70	(545,035,321)
アラブディルハム	ARABTEC HOLDING CO PJSC	28,350	1.32	37,422.00	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	44,250	6.14	271,695.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	18,000	5.02	90,360.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK(N)	4,500	5.02	22,590.00	
	FIRST GULF BANK	20,192	12.15	245,332.80	
	NATIONAL BANK OF ABU DHABI	19,635	9.27	182,016.45	
	DUBAI FINANCIAL MARKET PJSC	40,000	1.26	50,400.00	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	84,600	2.66	225,036.00	
	EMAAR MALLS GROUP PJSC	36,000	2.80	100,800.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	78,750	6.10	480,375.00	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	36,000	18.85	678,600.00	
	アラブディルハム小計	410,277		2,384,627.25	(66,459,561)
	合 計	45,006,376		7,957,760,346	(7,957,760,346)

(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 MSCI GREECE-ETF	41,500	287,595.00	
米ドル小計			41,500	287,595.00 (29,386,457)	
メキシコペソ	投資証券	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	46,000	1,790,780.00	
メキシコペソ小計			46,000	1,790,780.00 (9,634,396)	
トルコリラ	投資証券	EMLAK KONUT GAYRIMEN	58,000	158,340.00	
トルコリラ小計			58,000	158,340.00 (5,489,647)	
南アフリカランド	投資証券	FORTRESS INCOME FUND LTD-A	24,000	373,920.00	
		FORTRESS INCOME FUND LTD-B	12,000	418,680.00	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	60,000	1,471,200.00	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	91,000	991,900.00	
		RESILIENT REIT LTD	5,400	685,476.00	
南アフリカランド小計			192,400	3,941,176.00 (26,366,467)	
合計				70,876,967 (70,876,967)	

(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 56銘柄	96.5%			10.1%
	投資信託受益証券 1銘柄		3.5%		0.4%
メキシコペソ	株式 26銘柄	97.0%			3.8%

	投資証券	1銘柄			3.0%	0.1%
ブラジルリアル	株式	57銘柄	100.0%			6.5%
チリペソ	株式	20銘柄	100.0%			1.1%
コロンビアペソ	株式	8銘柄	100.0%			0.4%
トルコリラ	株式	18銘柄	94.9%			1.3%
	投資証券	1銘柄			5.1%	0.1%
チェココルナ	株式	3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%			1.2%
香港ドル	株式	137銘柄	100.0%			21.0%
マレーシアリングギット	株式	40銘柄	100.0%			2.9%
タイバーツ	株式	29銘柄	100.0%			2.2%
フィリピンペソ	株式	21銘柄	100.0%			1.6%
インドネシアルピア	株式	27銘柄	100.0%			2.7%
韓国ウォン	株式	105銘柄	100.0%			14.4%
台湾ドル	株式	88銘柄	100.0%			12.2%
インドルピー	株式	71銘柄	100.0%			8.5%
カタールリアル	株式	13銘柄	100.0%			0.9%
エジプトポンド	株式	3銘柄	100.0%			0.2%
南アフリカランド	株式	49銘柄	95.4%			6.8%
	投資証券	5銘柄			4.6%	0.3%
アラブディルハム	株式	11銘柄	100.0%			0.8%

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12月25日現在	平成28年 6月27日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	63,618,267	7,658,730
国債証券	27,962,289,012	26,805,844,873
地方債証券	2,223,902,000	2,449,406,932
特殊債券	2,712,571,932	3,162,949,000
社債券	1,886,387,000	2,009,260,590
未収入金	23,374,400	73,483,200
未収利息	73,345,777	70,003,385
前払費用	383,625	1,220,614
流動資産合計	34,945,872,013	34,579,827,324
資産合計	34,945,872,013	34,579,827,324
負債の部		
流動負債		
未払解約金	73,923,682	39,069,276
未払利息	-	12
流動負債合計	73,923,682	39,069,288
負債合計	73,923,682	39,069,288
純資産の部		
元本等		
元本	25,910,721,706	24,142,587,930
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,961,226,625	10,398,170,106
元本等合計	34,871,948,331	34,540,758,036
純資産合計	34,871,948,331	34,540,758,036
負債純資産合計	34,945,872,013	34,579,827,324

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12月25日現在	平成28年 6月27日現在
1.	期首	平成27年 6月26日	平成27年12月26日
	期首元本額	26,957,841,393円	25,910,721,706円
	期首からの追加設定元本額	973,306,422円	1,077,600,636円
	期首からの一部解約元本額	2,020,426,109円	2,845,734,412円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	793,068,909円	791,969,158円
	DCインデックスバランス（株式40）	1,025,516,036円	931,403,085円
	DCインデックスバランス（株式60）	724,756,688円	627,632,647円
	DCインデックスバランス（株式80）	130,264,552円	107,801,282円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	1,475,972,061円	1,557,600,732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	5,282,447,409円	4,595,333,210円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	4,764,896円	4,222,074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）	48,086,515円	- 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	5,195,490円	4,505,266円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	27,656,918円	23,467,085円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	107,302,846円	99,201,199円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	401,713,927円	371,583,055円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	6,586,088,606円	5,739,135,332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）	45,149,223円	37,947,798円
	世界アセットバランスファンド25（適格機関投資家向け）	146,926,685円	129,073,874円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	31,600,926円	24,745,907円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	1,124,195,245円	1,086,239,601円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,175,868,980円	1,058,562,162円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	613,915,533円	528,562,403円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	94,243,799円	79,274,327円
	インデックスファンド日本債券（1年決算型）	5,865,607,035円	6,133,643,638円
	日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	200,379,427円	210,684,095円
	計	25,910,721,706円	24,142,587,930円
2.	受益権の総数	25,910,721,706口	24,142,587,930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27年 6月26日 至 平成27年12月25日	自 平成27年12月26日 至 平成28年 6月27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12月25日現在	平成28年 6月27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
特殊債証券	1,600,931
社債証券	509,000
合計	149,210,097

（平成28年 6月27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	1,879,484,804
地方債証券	28,062,932
特殊債証券	38,416,000
社債証券	26,075,590
合計	1,972,039,326

(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12月25日現在		平成28年 6月27日現在	
1口当たり純資産額	1.3459円	1口当たり純資産額	1.4307円
(1万口当たり純資産額)	(13,459円)	(1万口当たり純資産額)	(14,307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	60,312,000	
	第105回利付国債(5年)	110,000,000	110,499,598	
	第106回利付国債(5年)	310,000,000	311,887,900	
	第107回利付国債(5年)	705,000,000	710,118,300	
	第109回利付国債(5年)	180,000,000	181,198,800	
	第111回利付国債(5年)	40,000,000	40,474,400	
	第112回利付国債(5年)	70,000,000	70,952,000	
	第114回利付国債(5年)	90,000,000	91,169,100	
	第116回利付国債(5年)	110,000,000	111,329,900	
	第117回利付国債(5年)	90,000,000	91,210,500	
	第118回利付国債(5年)	100,000,000	101,470,000	
	第119回利付国債(5年)	74,000,000	74,865,800	
	第120回利付国債(5年)	330,000,000	335,210,700	
	第121回利付国債(5年)	100,000,000	101,254,000	
	第122回利付国債(5年)	300,000,000	304,053,000	
	第123回利付国債(5年)	505,000,000	512,312,400	
	第124回利付国債(5年)	560,000,000	568,668,800	
	第125回利付国債(5年)	325,000,000	330,352,750	
	第126回利付国債(5年)	220,000,000	223,839,000	
	第1回利付国債(40年)	40,000,000	68,816,800	
	第2回利付国債(40年)	165,000,000	276,544,950	
	第3回利付国債(40年)	50,000,000	84,947,000	
	第4回利付国債(40年)	95,000,000	163,318,300	
	第5回利付国債(40年)	35,000,000	58,339,050	
	第6回利付国債(40年)	55,000,000	90,549,250	
	第7回利付国債(40年)	50,000,000	79,370,000	
第8回利付国債(40年)	75,000,000	111,555,000		

第286回利付国債(10年)	114,000,000	116,302,800	
第287回利付国債(10年)	13,000,000	13,276,587	
第288回利付国債(10年)	18,000,000	18,444,600	
第289回利付国債(10年)	199,000,000	204,281,460	
第290回利付国債(10年)	226,000,000	232,574,340	
第291回利付国債(10年)	187,000,000	192,114,450	
第292回利付国債(10年)	306,000,000	316,489,680	
第293回利付国債(10年)	56,000,000	58,313,360	
第294回利付国債(10年)	32,000,000	33,258,240	
第295回利付国債(10年)	13,000,000	13,459,550	
第296回利付国債(10年)	14,000,000	14,553,560	
第297回利付国債(10年)	28,000,000	29,165,640	
第298回利付国債(10年)	11,000,000	11,430,540	
第299回利付国債(10年)	410,000,000	427,716,100	
第300回利付国債(10年)	36,000,000	37,753,200	
第301回利付国債(10年)	223,000,000	234,943,880	
第302回利付国債(10年)	94,000,000	98,752,640	
第303回利付国債(10年)	581,000,000	612,786,510	
第304回利付国債(10年)	60,000,000	63,087,000	
第305回利付国債(10年)	473,000,000	499,237,310	
第306回利付国債(10年)	93,000,000	98,897,130	
第308回利付国債(10年)	140,000,000	148,862,000	
第309回利付国債(10年)	134,000,000	141,432,980	
第310回利付国債(10年)	78,000,000	82,270,500	
第311回利付国債(10年)	23,000,000	24,062,600	
第312回利付国債(10年)	205,000,000	218,753,450	
第313回利付国債(10年)	370,000,000	397,790,700	
第315回利付国債(10年)	65,000,000	69,836,000	
第316回利付国債(10年)	35,000,000	37,427,250	
第317回利付国債(10年)	105,000,000	112,686,000	
第318回利付国債(10年)	185,000,000	197,561,500	
第319回利付国債(10年)	5,000,000	5,386,750	
第320回利付国債(10年)	190,000,000	203,638,200	
第321回利付国債(10年)	175,000,000	188,191,500	
第322回利付国債(10年)	75,000,000	80,217,000	
第323回利付国債(10年)	45,000,000	48,270,600	

第324回利付国債(10年)	25,000,000	26,665,000	
第325回利付国債(10年)	210,000,000	224,586,600	
第326回利付国債(10年)	30,000,000	31,970,700	
第327回利付国債(10年)	65,000,000	69,699,500	
第328回利付国債(10年)	115,000,000	122,059,850	
第329回利付国債(10年)	260,000,000	280,274,800	
第330回利付国債(10年)	210,000,000	226,896,600	
第331回利付国債(10年)	80,000,000	85,256,000	
第333回利付国債(10年)	110,000,000	117,594,400	
第334回利付国債(10年)	120,000,000	128,509,200	
第335回利付国債(10年)	130,000,000	138,305,700	
第337回利付国債(10年)	30,000,000	31,442,400	
第338回利付国債(10年)	90,000,000	95,216,400	
第339回利付国債(10年)	250,000,000	264,675,000	
第340回利付国債(10年)	80,000,000	84,751,200	
第341回利付国債(10年)	110,000,000	115,535,200	
第14回利付国債(30年)	208,000,000	296,210,720	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	212,676,660	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	50,763,650	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	156,345,200	
第21回利付国債(30年)	20,000,000	28,652,200	
第22回利付国債(30年)	40,000,000	59,082,000	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	81,489,100	
第24回利付国債(30年)	68,000,000	101,057,520	
第25回利付国債(30年)	20,000,000	29,032,800	
第26回利付国債(30年)	30,000,000	44,323,500	
第27回利付国債(30年)	29,000,000	43,785,650	
第28回利付国債(30年)	14,000,000	21,279,440	
第29回利付国債(30年)	276,000,000	416,293,560	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	219,831,150	
第31回利付国債(30年)	120,000,000	177,808,800	
第32回利付国債(30年)	40,000,000	60,673,600	
第33回利付国債(30年)	85,000,000	123,787,200	
第34回利付国債(30年)	160,000,000	242,528,000	
第35回利付国債(30年)	100,000,000	147,478,000	
第36回利付国債(30年)	135,000,000	200,329,200	

第37回利付国債(30年)	46,000,000	67,505,920	
第38回利付国債(30年)	30,000,000	43,500,300	
第39回利付国債(30年)	75,000,000	111,043,500	
第40回利付国債(30年)	90,000,000	131,248,800	
第42回利付国債(30年)	65,000,000	93,559,050	
第43回利付国債(30年)	195,000,000	281,437,650	
第44回利付国債(30年)	70,000,000	101,302,600	
第45回利付国債(30年)	15,000,000	20,930,400	
第46回利付国債(30年)	100,000,000	139,674,000	
第47回利付国債(30年)	115,000,000	164,268,300	
第48回利付国債(30年)	105,000,000	144,377,100	
第49回利付国債(30年)	90,000,000	124,032,600	
第50回利付国債(30年)	25,000,000	30,138,250	
第34回利付国債(20年)	2,000,000	2,052,808	
第37回利付国債(20年)	63,000,000	65,638,440	
第39回利付国債(20年)	86,000,000	90,296,560	
第41回利付国債(20年)	27,000,000	28,330,290	
第42回利付国債(20年)	168,000,000	181,325,760	
第43回利付国債(20年)	73,000,000	80,559,880	
第44回利付国債(20年)	51,000,000	56,323,890	
第47回利付国債(20年)	21,000,000	23,224,320	
第48回利付国債(20年)	99,000,000	111,459,150	
第49回利付国債(20年)	57,000,000	63,470,640	
第50回利付国債(20年)	237,000,000	261,633,780	
第51回利付国債(20年)	39,000,000	43,477,980	
第54回利付国債(20年)	15,000,000	17,078,550	
第55回利付国債(20年)	66,000,000	74,800,440	
第57回利付国債(20年)	52,000,000	58,942,520	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	153,847,350	
第59回利付国債(20年)	33,000,000	37,334,550	
第60回利付国債(20年)	295,000,000	328,013,450	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	29,398,140	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	35,612,490	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	62,706,420	
第65回利付国債(20年)	100,000,000	116,558,000	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	39,370,300	

第67回利付国債(20年)	34,000,000	39,803,800	
第68回利付国債(20年)	78,000,000	93,159,300	
第70回利付国債(20年)	104,000,000	126,529,520	
第72回利付国債(20年)	112,000,000	134,108,800	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	134,959,290	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	141,952,820	
第75回利付国債(20年)	10,000,000	12,079,500	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	24,992,940	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	47,961,600	
第79回利付国債(20年)	160,000,000	192,697,600	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	73,110,600	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	160,858,100	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	375,762,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	19,967,520	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	314,597,500	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	74,527,800	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	62,362,500	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	104,534,420	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	122,742,060	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	57,108,600	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	118,220,040	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	147,740,580	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	38,389,800	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	86,031,660	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	105,993,360	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	14,260,290	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	41,977,320	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	98,334,390	
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,579,000	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	166,660,000	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	168,391,100	
第109回利付国債(20年)	27,000,000	34,046,730	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	126,109,340	
第111回利付国債(20年)	25,000,000	32,623,000	
第113回利付国債(20年)	240,000,000	311,193,600	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	67,673,840	

第115回利付国債(20年)	20,000,000	26,301,800	
第116回利付国債(20年)	55,000,000	72,601,100	
第117回利付国債(20年)	93,000,000	121,468,230	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	12,967,200	
第119回利付国債(20年)	30,000,000	38,051,700	
第120回利付国債(20年)	70,000,000	86,804,200	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	28,309,380	
第122回利付国債(20年)	17,000,000	21,630,460	
第123回利付国債(20年)	65,000,000	85,816,250	
第124回利付国債(20年)	80,000,000	104,447,200	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	66,934,500	
第126回利付国債(20年)	25,000,000	32,722,750	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	84,314,750	
第129回利付国債(20年)	50,000,000	64,101,500	
第130回利付国債(20年)	60,000,000	77,150,400	
第131回利付国債(20年)	12,000,000	15,245,640	
第132回利付国債(20年)	35,000,000	44,587,900	
第133回利付国債(20年)	30,000,000	38,686,500	
第134回利付国債(20年)	30,000,000	38,795,400	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	38,319,900	
第136回利付国債(20年)	140,000,000	176,607,200	
第137回利付国債(20年)	220,000,000	281,771,600	
第138回利付国債(20年)	90,000,000	112,374,000	
第140回利付国債(20年)	280,000,000	359,576,000	
第141回利付国債(20年)	195,000,000	251,066,400	
第142回利付国債(20年)	55,000,000	71,725,500	
第143回利付国債(20年)	54,000,000	68,736,060	
第144回利付国債(20年)	40,000,000	50,244,000	
第145回利付国債(20年)	125,000,000	161,621,250	
第146回利付国債(20年)	75,000,000	97,131,750	
第147回利付国債(20年)	60,000,000	76,777,200	
第148回利付国債(20年)	120,000,000	151,766,400	
第149回利付国債(20年)	215,000,000	272,480,250	
第150回利付国債(20年)	90,000,000	112,555,800	
第151回利付国債(20年)	150,000,000	182,415,000	
第152回利付国債(20年)	90,000,000	109,503,000	

	第153回利付国債(20年)	120,000,000	148,334,400	
	第154回利付国債(20年)	120,000,000	146,280,000	
	第155回利付国債(20年)	140,000,000	165,334,400	
	第156回利付国債(20年)	110,000,000	117,062,000	
国債証券 合計		22,837,000,000	26,805,844,873	
地方債証券	第660回東京都公募公債	100,000,000	103,271,000	
	第708回東京都公募公債	100,000,000	105,293,000	
	第731回東京都公募公債	100,000,000	104,745,000	
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	120,067,000	
	平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	210,634,000	
	平成19年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	101,867,932	
	平成26年度第3回広島県公募公債	100,000,000	104,193,000	
	平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	105,997,000	
	平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	105,364,000	
	平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	104,445,000	
	第10回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	104,772,000	
	第55回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,478,000	
	第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,440,000	
	第64回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,490,000	
	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	104,965,000	
	平成25年度第1回島根県公募公債	200,000,000	201,258,000	
	平成26年度第1回栃木県公募公債	100,000,000	103,835,000	
	第4回京都市公募公債(20年)	100,000,000	124,523,000	
	平成23年度第14回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	126,079,000	
	平成23年度第2回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	105,690,000	
地方債証券 合計		2,300,000,000	2,449,406,932	
特殊債券	第1回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	105,009,000	
	第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	106,286,000	
	第5回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	106,729,000	
	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,501,000	
	第6回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,254,000	
	第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	105,198,000	
	第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	105,171,000	
	第21回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,671,000	
	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	105,103,000	

第31回株式会社日本政策投資銀行無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	105,097,000	
第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	123,678,000	
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	108,170,000	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,190,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,059,000	
第135回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,624,000	
第139回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,116,000	
第146回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,861,000	
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,539,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,706,000	
第271回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,106,000	
第1回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	124,210,000	
第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	103,397,000	
第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,606,000	
第29回国際協力銀行債券	200,000,000	204,578,000	
い第745号農林債	100,000,000	100,390,000	
第272回信金中金債(5年)	100,000,000	100,368,000	
第316回信金中金債(5年)	100,000,000	100,332,000	
特殊債券 合計	3,000,000,000	3,162,949,000	
社債券			
第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債(2014)	100,000,000	101,062,000	
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	100,755,590	
第11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	100,000,000	101,016,000	
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	105,423,000	
第10回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,268,000	
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	105,130,000	
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	101,723,000	

第11回パナソニック株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	101,739,000	
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	101,557,000	
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	200,668,000	
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	125,410,000	
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	115,978,000	
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	106,028,000	
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	120,656,000	
第540回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,494,000	
第299回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	106,694,000	
第281回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	106,966,000	
第19回沖縄電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,693,000	
社債券 合計	1,900,000,000	2,009,260,590	
合計	30,037,000,000	34,427,461,395	

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12月25日現在	平成28年 6月27日現在
資産の部		
流動資産		
預金	225,597,605	31,923,798

	平成27年12月25日現在	平成28年 6月27日現在
コール・ローン	105,408,926	22,947,339
国債証券	175,645,985,869	151,133,633,468
派生商品評価勘定	1,149,728	2,739,512
未収入金	82,536,461	41,175,360
未収利息	1,831,244,824	1,440,707,107
前払費用	34,224,406	40,233,943
流動資産合計	177,926,147,819	152,713,360,527
資産合計	177,926,147,819	152,713,360,527
負債の部		
流動負債		
未払解約金	165,497,517	48,620,599
未払利息	-	36
流動負債合計	165,497,517	48,620,635
負債合計	165,497,517	48,620,635
純資産の部		
元本等		
元本	77,403,768,367	75,008,369,772
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	100,356,881,935	77,656,370,120
元本等合計	177,760,650,302	152,664,739,892
純資産合計	177,760,650,302	152,664,739,892
負債純資産合計	177,926,147,819	152,713,360,527

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12月25日現在	平成28年 6月27日現在
1.	期首	平成27年 6月26日	平成27年12月26日
	期首元本額	84,243,222,131円	77,403,768,367円
	期首からの追加設定元本額	712,448,091円	1,828,615,980円
	期首からの一部解約元本額	7,551,901,855円	4,224,014,575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)	10,795,115,102円	11,039,683,651円
	DCインデックスバランス(株式20)	70,327,310円	81,721,256円
	DCインデックスバランス(株式40)	130,692,981円	138,606,050円
	DCインデックスバランス(株式60)	166,137,422円	168,125,385円
	DCインデックスバランス(株式80)	149,621,451円	143,999,187円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	24,036,096,448円	24,154,635,227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	3,034,168,879円	2,914,350,112円
	日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	29,650,065,091円	27,687,246,381円
	全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	24,357,275円	25,666,344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)	1,005,537,340円	975,270,199円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	159,937,721円	186,389,835円
	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(債券資産)	18,727,506円	-円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	2,999,151円	2,944,409円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	3,185,679円	3,142,643円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	6,919,884円	7,119,538円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	17,770,286円	18,963,067円
	世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	856,624,652円	546,260,511円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	1,261,022,867円	1,222,259,589円
	世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け)	36,294,675円	34,127,450円
	世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け)	96,422,061円	94,759,044円
	グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	40,923,772円	37,279,521円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	49,535,844円	54,477,547円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	74,781,080円	78,753,254円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	70,267,843円	70,779,740円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	54,176,464円	53,080,737円
	インデックスファンド海外債券(ヘッジなし)1年決算型	5,354,843,920円	5,026,362,624円
	海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	237,215,663円	242,366,471円
	計	77,403,768,367円	75,008,369,772円
2.	受益権の総数	77,403,768,367口	75,008,369,772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27年 6月26日 至 平成27年12月25日	自 平成27年12月26日 至 平成28年 6月27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12月25日現在	平成28年 6月27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

（平成28年 6月27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	3,213,775,818
合計	3,213,775,818

（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
----	-------------	---	-------------	-----------

(平成28年 6月27日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	46,389,512	-	43,650,000	2,739,512
	ユーロ	46,389,512	-	43,650,000	2,739,512
合計		46,389,512	-	43,650,000	2,739,512

(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12月25日現在		平成28年 6月27日現在	
1口当たり純資産額	2.2965円	1口当たり純資産額	2.0353円
(1万口当たり純資産額)	(22,965円)	(1万口当たり純資産額)	(20,353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%-17/05/31	8,800,000.00	8,974,625.00	
		US TREASURY N/B-0.625%-17/05/31	5,000,000.00	5,004,296.87	
		US TREASURY N/B-2.5%-17/06/30	4,000,000.00	4,078,750.00	
		US TREASURY N/B-0.75%-17/06/30	5,000,000.00	5,010,937.50	
		US TREASURY N/B-0.875%-17/07/15	2,200,000.00	2,208,421.87	
		US TREASURY N/B-2.375%-17/07/31	1,020,000.00	1,040,240.62	
		US TREASURY N/B-4.75%-17/08/15	8,600,000.00	9,005,812.50	
		US TREASURY N/B-1.875%-17/08/31	2,000,000.00	2,030,625.00	
		US TREASURY N/B-1.0%-17/09/15	4,900,000.00	4,924,500.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-17/09/30	7,000,000.00	7,113,203.12	
		US TREASURY N/B-1.875%-17/10/31	2,500,000.00	2,544,335.93	
		US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	6,800,000.00	7,143,718.75	
		US TREASURY N/B-0.625%-17/11/30	3,000,000.00	3,000,234.37	
		US TREASURY N/B-2.25%-17/11/30	3,500,000.00	3,581,210.93	
		US TREASURY N/B-1.0%-17/12/15	5,200,000.00	5,227,625.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-17/12/31	6,170,000.00	6,364,740.62	
		US TREASURY N/B-2.625%-18/01/31	4,000,000.00	4,124,687.50	
		US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	7,950,000.00	8,321,414.06	
		US TREASURY N/B-2.75%-18/02/28	7,400,000.00	7,656,687.50	
		US TREASURY N/B-0.75%-18/02/28	5,100,000.00	5,109,562.50	
		US TREASURY N/B-1.0%-18/03/15	1,000,000.00	1,005,781.25	
		US TREASURY N/B-0.75%-18/03/31	3,000,000.00	3,006,562.50	
		US TREASURY N/B-2.875%-18/03/31	2,500,000.00	2,598,828.12	
		US TREASURY N/B-0.625%-18/04/30	3,000,000.00	2,998,359.37	
		US TREASURY N/B-0.75%-18/04/30	3,000,000.00	3,005,390.62	
		US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	7,550,000.00	8,017,746.09	
		US TREASURY N/B-1.0%-18/05/31	3,000,000.00	3,019,687.50	
		US TREASURY N/B-2.375%-18/06/30	7,000,000.00	7,237,890.62	
		US TREASURY N/B-2.25%-18/07/31	8,340,000.00	8,616,914.06	
		US TREASURY N/B-1.375%-18/07/31	2,500,000.00	2,536,328.12	

US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	8,850,000.00	9,490,933.59	
US TREASURY N/B-1.375%-18/09/30	970,000.00	984,928.90	
US TREASURY N/B-1.75%-18/10/31	3,000,000.00	3,073,125.00	
US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	9,400,000.00	10,085,906.25	
US TREASURY N/B-1.25%-18/11/30	3,100,000.00	3,139,476.56	
US TREASURY N/B-1.5%-18/12/31	8,950,000.00	9,120,609.37	
US TREASURY N/B-1.125%-19/01/15	500,000.00	505,039.06	
US TREASURY N/B-1.5%-19/01/31	3,000,000.00	3,058,125.00	
US TREASURY N/B-8.875%-19/02/15	4,550,000.00	5,524,695.31	
US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	5,400,000.00	5,686,453.12	
US TREASURY N/B-1.375%-19/02/28	3,000,000.00	3,050,156.25	
US TREASURY N/B-1.5%-19/02/28	4,000,000.00	4,079,687.50	
US TREASURY N/B-1.625%-19/03/31	2,000,000.00	2,046,718.75	
US TREASURY N/B-1.625%-19/04/30	5,000,000.00	5,119,140.62	
US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	4,400,000.00	4,698,718.75	
US TREASURY N/B-1.5%-19/05/31	4,100,000.00	4,185,523.43	
US TREASURY N/B-1.625%-19/06/30	1,090,000.00	1,117,164.84	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	4,320,000.00	4,700,025.00	
US TREASURY N/B-8.125%-19/08/15	3,210,000.00	3,940,776.56	
US TREASURY N/B-1.0%-19/08/31	3,300,000.00	3,320,109.37	
US TREASURY N/B-1.625%-19/08/31	3,600,000.00	3,693,093.75	
US TREASURY N/B-1.75%-19/09/30	8,000,000.00	8,236,250.00	
US TREASURY N/B-1.5%-19/10/31	4,100,000.00	4,188,406.25	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	11,240,000.00	12,198,034.37	
US TREASURY N/B-1.625%-19/12/31	1,800,000.00	1,845,843.75	
US TREASURY N/B-1.25%-20/01/31	4,000,000.00	4,049,375.00	
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	12,030,000.00	13,213,263.28	
US TREASURY N/B-1.375%-20/03/31	1,100,000.00	1,118,046.87	
US TREASURY N/B-1.375%-20/04/30	1,930,000.00	1,961,664.06	
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	9,500,000.00	10,418,828.12	
US TREASURY N/B-1.375%-20/05/31	2,440,000.00	2,479,840.62	
US TREASURY N/B-1.5%-20/05/31	5,100,000.00	5,205,585.93	
US TREASURY N/B-1.875%-20/06/30	380,000.00	393,685.93	
US TREASURY N/B-1.625%-20/06/30	4,000,000.00	4,101,250.00	
US TREASURY N/B-2.0%-20/07/31	9,300,000.00	9,680,718.75	

US TREASURY N/B-1.625%-20/07/31	4,000,000.00	4,101,250.00	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	7,950,000.00	10,462,324.21	
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	5,000,000.00	5,333,984.37	
US TREASURY N/B-2.125%-20/08/31	1,450,000.00	1,516,496.09	
US TREASURY N/B-1.375%-20/08/31	2,300,000.00	2,335,039.06	
US TREASURY N/B-1.375%-20/09/30	4,000,000.00	4,060,312.50	
US TREASURY N/B-1.75%-20/10/31	2,000,000.00	2,060,781.25	
US TREASURY N/B-1.375%-20/10/31	1,460,000.00	1,481,557.81	
US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	3,500,000.00	3,738,984.37	
US TREASURY N/B-1.625%-20/11/30	1,120,000.00	1,149,225.00	
US TREASURY N/B-2.375%-20/12/31	3,000,000.00	3,177,187.50	
US TREASURY N/B-1.75%-20/12/31	2,000,000.00	2,061,875.00	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	8,550,000.00	9,537,925.78	
US TREASURY N/B-2.25%-21/04/30	4,800,000.00	5,063,625.00	
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	5,170,000.00	5,670,439.84	
US TREASURY N/B-2.125%-21/06/30	6,400,000.00	6,718,500.00	
US TREASURY N/B-2.25%-21/07/31	3,000,000.00	3,168,515.62	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	3,900,000.00	4,093,476.56	
US TREASURY N/B-2.125%-21/09/30	500,000.00	525,078.12	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	11,490,000.00	15,612,037.50	
US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	4,000,000.00	4,174,375.00	
US TREASURY N/B-2.125%-21/12/31	4,800,000.00	5,041,500.00	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,500,000.00	2,608,789.06	
US TREASURY N/B-1.75%-22/02/28	2,900,000.00	2,984,281.25	
US TREASURY N/B-1.75%-22/04/30	3,000,000.00	3,085,546.87	
US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	2,000,000.00	2,056,875.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/05/31	2,000,000.00	2,070,937.50	
US TREASURY N/B-2.125%-22/06/30	2,500,000.00	2,624,609.37	
US TREASURY N/B-2.0%-22/07/31	5,300,000.00	5,523,593.75	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	2,000,000.00	2,041,718.75	
US TREASURY N/B-1.875%-22/08/31	1,900,000.00	1,965,460.93	
US TREASURY N/B-1.75%-22/09/30	4,000,000.00	4,107,812.50	
US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	3,000,000.00	3,102,656.25	
US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	1,000,000.00	1,018,906.25	
US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	1,000,000.00	1,041,484.37	

US TREASURY N/B-2.125%-22/12/31	4,000,000.00	4,196,875.00	
US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	2,000,000.00	2,051,718.74	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	9,300,000.00	9,699,609.37	
US TREASURY N/B-1.5%-23/02/28	1,000,000.00	1,009,843.75	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	8,150,000.00	8,367,121.09	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,500,000.00	5,931,406.25	
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	4,387,187.50	
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	2,900,000.00	3,184,562.50	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	4,000,000.00	4,319,062.50	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,940,873.43	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	3,510,000.00	3,719,777.34	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	3,850,000.00	3,998,886.71	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	5,034,000.00	
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	3,750,000.00	3,890,625.00	
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	2,750,000.00	2,911,992.18	
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,370,000.00	3,381,321.08	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	1,200,000.00	1,204,968.75	
US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,450,000.00	3,602,265.62	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	2,920,000.00	4,275,518.75	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,000,000.00	1,395,468.75	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	2,600,000.00	4,047,875.00	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	3,500,000.00	5,137,070.31	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	1,900,000.00	2,876,867.18	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	1,370,000.00	1,920,889.84	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	1,800,000.00	2,566,125.00	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	2,300,000.00	3,158,007.81	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,820,000.00	2,583,831.25	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	1,750,000.00	2,442,207.03	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	3,050,000.00	4,401,531.25	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	2,810,000.00	3,921,267.18	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	2,440,000.00	3,174,668.75	
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	2,860,000.00	3,926,467.18	
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,600,000.00	2,353,500.00	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	2,650,000.00	3,706,687.50	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	3,800,000.00	4,853,312.50	

		US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	500,000.00	537,109.37	
		US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	2,304,843.75	
		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	5,800,000.00	6,365,953.12	
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	5,350,000.00	6,746,433.59	
		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	4,500,000.00	5,802,539.06	
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	3,000,000.00	3,779,296.87	
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	3,400,000.00	4,093,281.25	
		US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	5,900,000.00	6,775,320.31	
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	3,300,000.00	3,702,703.12	
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	3,348,468.75	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	3,200,000.00	3,587,000.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	5,300,000.00	5,798,117.18	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	3,900,000.00	4,371,656.25	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	2,800,000.00	2,839,375.00	
米ドル小計			588,750,000.00	642,162,969.94 (65,616,212,268)	
加ドル	国債証券	CANADA GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	439,047.65	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-17/06/01	1,800,000.00	1,857,492.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-17/08/01	1,530,000.00	1,541,673.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-17/09/01	1,000,000.00	1,011,110.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-17/11/01	860,000.00	856,413.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/02/01	1,180,000.00	1,192,909.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/03/01	1,340,000.00	1,355,731.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-18/05/01	1,180,000.00	1,173,510.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	1,400,000.00	1,498,938.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-18/08/01	80,000.00	79,903.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/09/01	650,000.00	659,977.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/03/01	1,050,000.00	1,083,390.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	1,900,000.00	2,074,705.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/09/01	650,000.00	673,725.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-20/03/01	1,170,000.00	1,207,638.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	1,630,000.00	1,811,272.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-20/09/01	850,000.00	854,054.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/03/01	1,210,000.00	1,215,445.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	1,150,000.00	1,293,807.50	

		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/09/01	290,000.00	290,675.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	1,200,000.00	1,337,244.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,380,000.00	1,438,387.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,420,000.00	1,586,580.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	1,290,000.00	1,419,451.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	610,000.00	628,056.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	430,000.00	724,111.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	1,070,000.00	1,603,063.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	1,200,000.00	1,912,224.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	1,310,000.00	2,036,801.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	1,490,000.00	2,134,559.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,540,000.00	2,130,590.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	870,000.00	1,068,333.90	
			35,065,000.00	40,190,823.05	
				(3,145,333,811)	
加ドル小計					
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-17/06/15	9,500,000.00	9,558,900.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 17/12/14	14,400,000.00	15,106,551.84	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-4.75%- 18/06/14	18,000,000.00	17,971,675.20	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-18/12/13	23,900,000.00	25,832,791.80	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11	8,100,000.00	8,038,123.29	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	19,900,000.00	21,766,095.63	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	17,300,000.00	18,043,534.10	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	7,300,000.00	7,589,124.89	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	8,200,000.00	9,261,133.30	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	25,500,000.00	32,423,025.60	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	1,000,000.00	980,306.55	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	6,700,000.00	7,390,158.96	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	15,200,000.00	18,038,944.28	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	11,900,000.00	13,314,968.90	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	5,000,000.00	5,611,824.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	8,400,000.00	11,542,842.36	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	12,100,000.00	14,681,052.21	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	11,940,000.00	13,525,730.50	
メキシコペソ小計			224,340,000.00	250,676,783.41 (1,348,641,094)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-3.5%-17/06/28	410,000.00	426,590.73	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-17/09/28	1,450,000.00	1,559,826.77	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-18/03/28	1,780,000.00	1,921,560.01	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-18/06/22	320,000.00	331,374.59	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	1,700,000.00	1,912,811.44	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-19/09/28	860,000.00	957,574.12	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	1,980,000.00	2,334,024.00	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	1,590,000.00	1,972,828.27	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	1,510,000.00	1,881,473.13	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,500,000.00	1,919,234.55	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	1,110,000.00	1,291,566.36	
		BELGIUM KINGDOM-0.2%-23/10/22	110,000.00	111,582.68	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	1,300,000.00	1,559,656.93	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,080,000.00	1,132,050.60	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	1,140,000.00	1,603,807.17	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	610,000.00	644,907.25	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,870,000.00	2,946,362.65	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	450,000.00	467,328.73	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	810,000.00	1,207,315.77	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	650,000.00	887,729.37	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,860,000.00	3,208,397.70	
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	400,000.00	468,789.32	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,560,000.00	2,660,716.50	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	820,000.00	1,349,449.40	
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	290,000.00	315,587.42	
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	280,000.00	328,468.67	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-17/07/30	2,220,000.00	2,352,508.47	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%-17/10/31	1,400,000.00	1,408,771.56	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.5%-18/01/31	1,900,000.00	2,033,969.00	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%- 18/04/30	650,000.00	652,059.39
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%- 18/07/30	3,080,000.00	3,337,703.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.75%- 18/10/31	1,600,000.00	1,733,763.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%- 19/01/31	360,000.00	360,578.01
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 19/04/30	1,860,000.00	1,992,841.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%- 19/07/30	2,240,000.00	2,538,935.39
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%- 19/10/31	2,200,000.00	2,493,810.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 20/01/31	1,480,000.00	1,537,186.15
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%- 20/04/30	2,430,000.00	2,766,676.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.15%- 20/07/30	1,180,000.00	1,216,598.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%- 20/10/31	1,890,000.00	2,246,493.87
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	2,440,000.00	3,019,364.82
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.75%- 21/07/30	360,000.00	362,768.79
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	2,060,000.00	2,644,486.27
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%- 23/01/31	2,040,000.00	2,621,410.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	1,690,000.00	2,078,978.85
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	1,680,000.00	2,117,732.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	2,120,000.00	2,512,104.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	2,200,000.00	2,433,772.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	1,860,000.00	1,882,124.70
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,850,000.00	2,343,869.88

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	1,980,000.00	2,081,815.95
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 26/04/30	1,310,000.00	1,347,289.15
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,440,000.00	2,001,909.31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,320,000.00	1,793,291.28
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	1,910,000.00	2,791,596.98
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,350,000.00	1,347,370.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,850,000.00	2,777,186.88
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,690,000.00	2,181,798.78
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,370,000.00	1,950,256.65
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,340,000.00	1,864,803.22
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	1,140,000.00	1,705,253.04
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%- 46/10/31	590,000.00	610,953.79
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%- 66/07/30	210,000.00	221,083.80
BUNDESobligation-1.0%-18/10/12	2,100,000.00	2,180,115.00
BUNDESobligation-1.0%-19/02/22	1,320,000.00	1,378,268.10
BUNDESobligation-0.25%-20/10/16	1,000,000.00	1,036,790.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 17/07/04	5,650,000.00	5,932,259.87
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 18/01/04	4,240,000.00	4,542,206.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 18/07/04	2,750,000.00	3,023,439.37
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 19/01/04	2,770,000.00	3,080,004.55
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%- 19/07/04	3,770,000.00	4,244,888.05
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 20/01/04	3,220,000.00	3,666,565.70
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%-	3,380,000.00	3,876,595.34

20/07/04			
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 20/09/04	2,150,000.00	2,412,497.15	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 21/01/04	1,800,000.00	2,055,105.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	1,730,000.00	2,065,028.34	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 21/09/04	1,700,000.00	1,950,183.39	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	2,000,000.00	2,280,585.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 22/07/04	2,470,000.00	2,805,072.79	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	1,950,000.00	2,189,513.62	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	1,900,000.00	2,144,257.73	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	1,820,000.00	2,060,943.79	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	1,780,000.00	2,087,135.97	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	1,910,000.00	2,870,166.55	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	3,400,000.00	3,944,994.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	1,400,000.00	1,599,656.38	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	1,830,000.00	2,018,319.26	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	1,520,000.00	1,611,507.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	2,440,000.00	2,692,276.48	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	1,400,000.00	1,475,483.36	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,200,000.00	2,075,199.12	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,450,000.00	2,402,285.47	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	1,140,000.00	1,796,287.39	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-	930,000.00	1,712,902.92	

30/01/04			
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,590,000.00	2,822,529.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,740,000.00	3,128,617.44	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	2,090,000.00	3,617,550.48	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,240,000.00	2,300,645.53	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,480,000.00	2,959,116.87	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	1,320,000.00	2,234,871.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,540,000.00	2,364,770.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	1,400,000.00	2,187,191.01	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 17/06/01	1,700,000.00	1,775,736.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 17/08/01	3,100,000.00	3,278,141.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 17/11/01	1,700,000.00	1,779,064.96	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.75%- 18/01/15	850,000.00	859,253.86	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/02/01	2,510,000.00	2,687,626.92	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%- 18/05/15	950,000.00	953,219.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/06/01	1,000,000.00	1,065,757.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/08/01	2,880,000.00	3,144,475.29	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.3%- 18/10/15	700,000.00	702,925.58	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/12/01	2,150,000.00	2,325,905.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/02/01	2,660,000.00	2,942,758.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 19/03/01	2,720,000.00	3,036,207.34	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-	1,400,000.00	1,491,723.38	

19/05/01		
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 19/08/01	730,000.00	759,173.64
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/09/01	3,390,000.00	3,822,440.94
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.05%- 19/12/01	1,100,000.00	1,130,780.64
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 20/02/01	2,800,000.00	3,226,445.32
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 20/03/01	2,920,000.00	3,347,882.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.7%- 20/05/01	650,000.00	660,091.25
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	2,950,000.00	3,398,827.75
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 20/11/01	460,000.00	465,241.70
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	2,100,000.00	2,420,054.07
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/05/01	1,200,000.00	1,385,676.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	3,670,000.00	4,264,772.31
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 21/09/01	3,350,000.00	4,067,000.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 21/12/15	230,000.00	248,787.55
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	2,400,000.00	2,973,360.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 22/04/15	770,000.00	797,427.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,900,000.00	2,438,069.74
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 22/09/15	500,000.00	519,540.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	2,000,000.00	2,571,402.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	500,000.00	617,520.35
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,300,000.00	1,636,290.76
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%-	3,110,000.00	4,842,101.43

23/11/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,650,000.00	2,050,743.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,500,000.00	1,785,210.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,300,000.00	1,422,310.89	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	3,400,000.00	4,406,021.58	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	730,000.00	736,794.98	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	2,060,000.00	2,153,997.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,030,000.00	1,303,774.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	200,000.00	200,750.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	2,090,000.00	3,210,566.66	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	3,530,000.00	5,253,415.54	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	850,000.00	1,124,836.11	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	4,530,000.00	6,341,028.31	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	940,000.00	1,129,121.42	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	3,410,000.00	5,192,480.99	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	550,000.00	532,510.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,900,000.00	2,880,602.73	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	2,080,000.00	2,956,196.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	100,000.00	101,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	2,710,000.00	3,474,737.88	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,770,000.00	2,587,238.55	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-	2,280,000.00	3,330,246.66	

40/09/01		
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,720,000.00	2,488,329.16
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,240,000.00	1,426,335.79
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	1,000,000.00	1,029,386.20
FINNISH GOVERNMENT-3.875%-17/09/15	680,000.00	717,233.53
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-18/09/15	210,000.00	217,855.02
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	620,000.00	712,418.31
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	740,000.00	847,877.20
FINNISH GOVERNMENT-0.375%-20/09/15	130,000.00	134,403.10
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	760,000.00	902,439.20
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	300,000.00	334,655.94
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	550,000.00	611,711.37
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	550,000.00	635,474.12
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	590,000.00	795,508.85
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	330,000.00	349,724.92
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	410,000.00	418,390.65
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	500,000.00	641,439.55
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	310,000.00	320,199.83
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	410,000.00	600,133.31
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-17/10/25	4,120,000.00	4,382,142.00
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-18/04/25	3,850,000.00	4,168,651.41
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-18/05/25	3,000,000.00	3,086,235.00
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-18/10/25	2,300,000.00	2,554,893.59
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-18/11/25	1,100,000.00	1,139,416.62
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25	4,140,000.00	4,693,621.50
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-19/05/25	1,470,000.00	1,531,943.30
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-19/10/25	1,050,000.00	1,363,239.88
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	4,400,000.00	5,014,217.12
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-19/11/25	1,000,000.00	1,031,107.60
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	3,180,000.00	3,656,636.52
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-20/05/25	1,600,000.00	1,623,216.00
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	3,990,000.00	4,484,743.64
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-20/11/25	2,550,000.00	2,614,275.81
	3,900,000.00	4,667,596.05

FRANCE (GOVT OF) -3.75%-21/04/25			
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-21/10/25	4,120,000.00	4,890,687.20	
FRANCE (GOVT OF) -3.0%-22/04/25	3,770,000.00	4,474,631.85	
FRANCE (GOVT OF) -2.25%-22/10/25	2,950,000.00	3,395,631.42	
FRANCE (GOVT OF) -8.5%-23/04/25	1,150,000.00	1,826,361.00	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-23/05/25	3,230,000.00	3,636,189.94	
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-23/10/25	3,990,000.00	5,244,347.87	
FRANCE (GOVT OF) -2.25%-24/05/25	3,370,000.00	3,950,853.20	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-24/11/25	4,660,000.00	5,281,426.36	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-25/05/25	3,110,000.00	3,182,004.27	
FRANCE (GOVT OF) -6.0%-25/10/25	2,930,000.00	4,486,835.86	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-25/11/25	3,670,000.00	3,906,421.76	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-26/04/25	3,320,000.00	4,342,209.40	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-26/05/25	370,000.00	374,477.92	
FRANCE (GOVT OF) -2.75%-27/10/25	3,380,000.00	4,229,233.45	
FRANCE (GOVT OF) -5.5%-29/04/25	3,220,000.00	5,217,709.57	
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-30/05/25	1,940,000.00	2,430,131.30	
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-31/05/25	400,000.00	445,642.00	
FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	2,870,000.00	5,119,309.97	
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	2,470,000.00	4,163,872.40	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	2,520,000.00	4,056,047.09	
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	2,660,000.00	4,692,337.62	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	1,670,000.00	2,536,750.87	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	1,370,000.00	2,487,824.10	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	1,160,000.00	2,156,005.00	
FRENCH TREASURY NOTE -1.0%-17/07/25	300,000.00	304,959.00	
IRISH TREASURY -5.5%-17/10/18	640,000.00	688,329.53	
IRISH TREASURY -4.5%-18/10/18	820,000.00	910,025.09	
IRISH TREASURY -4.4%-19/06/18	730,000.00	829,298.98	
IRISH TREASURY -5.9%-19/10/18	670,000.00	801,723.13	
IRISH TREASURY -4.5%-20/04/18	1,010,000.00	1,183,016.33	
IRISH TREASURY -5.0%-20/10/18	790,000.00	958,967.80	
IRISH TREASURY -0.8%-22/03/15	360,000.00	372,200.57	
IRISH TREASURY -3.9%-23/03/20	510,000.00	628,078.46	
IRISH TREASURY -3.4%-24/03/18	800,000.00	968,068.72	

IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	1,120,000.00	1,555,200.30
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	430,000.00	436,647.53
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	780,000.00	901,122.53
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	505,000.00	550,986.10
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.5%-17/07/15	2,430,000.00	2,560,141.80
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-18/01/15	1,030,000.00	1,059,805.62
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-18/04/15	390,000.00	394,115.16
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	2,080,000.00	2,276,306.86
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-19/01/15	800,000.00	837,370.64
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	1,780,000.00	2,028,615.62
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-20/01/15	690,000.00	709,480.42
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	1,530,000.00	1,781,275.72
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	1,750,000.00	2,077,127.50
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	1,500,000.00	1,733,237.55
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	870,000.00	1,101,330.04
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	970,000.00	1,466,643.20
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	1,100,000.00	1,251,483.74
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	880,000.00	1,026,967.82
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	700,000.00	710,449.24
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	150,000.00	154,323.66
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	1,680,000.00	2,698,351.65
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	1,250,000.00	1,670,699.85
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,440,000.00	2,442,056.40
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,590,000.00	2,811,714.66
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	990,000.00	1,568,875.27
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-17/09/15	850,000.00	900,303.00
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	1,110,000.00	1,199,712.53
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.15%-18/10/19	660,000.00	685,393.50
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	1,290,000.00	1,460,342.95
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.95%-19/06/18	430,000.00	461,142.75
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-19/10/18	510,000.00	522,138.00
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	1,400,000.00	1,647,569.00
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	1,490,000.00	1,789,067.88
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	900,000.00	1,106,230.50
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	1,040,000.00	1,281,820.80

		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	890,000.00	1,013,244.97
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	790,000.00	896,249.07
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	680,000.00	744,248.09
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	750,000.00	1,087,541.25
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	310,000.00	322,866.55
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	850,000.00	1,398,891.75
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	500,000.00	642,306.40
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,180,000.00	1,946,138.12
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	650,000.00	1,018,095.00
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	360,000.00	695,430.90
ユーロ小計			437,915,000.00	541,389,346.67 (60,911,715,393)
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-8.75%-17/08/25	1,510,000.00	1,659,500.11
		UK TREASURY-1.0%-17/09/07	1,490,000.00	1,502,358.06
		UK TREASURY-5.0%-18/03/07	2,000,000.00	2,162,890.00
		UK TREASURY-1.25%-18/07/22	2,930,000.00	2,988,314.32
		UK TREASURY-4.5%-19/03/07	2,190,000.00	2,443,399.42
		UK TREASURY-1.75%-19/07/22	1,700,000.00	1,771,983.61
		UK TREASURY-3.75%-19/09/07	1,950,000.00	2,164,956.49
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	2,550,000.00	2,958,140.25
		UK TREASURY-2.0%-20/07/22	1,910,000.00	2,025,700.91
		UK TREASURY-3.75%-20/09/07	1,920,000.00	2,184,313.53
		UK TREASURY-1.5%-21/01/22	1,150,000.00	1,197,523.75
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	1,270,000.00	1,732,405.60
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	1,950,000.00	2,266,446.00
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	1,520,000.00	1,808,698.00
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	2,000,000.00	2,123,253.80
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	2,580,000.00	2,825,762.28
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	1,500,000.00	1,705,387.50
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	2,280,000.00	3,038,796.31
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	90,000.00	92,335.14
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	1,420,000.00	1,867,898.95
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	1,000,000.00	1,537,579.70
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,980,000.00	2,797,587.14
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	2,110,000.00	2,874,706.20

		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	2,100,000.00	2,991,414.93	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,900,000.00	2,660,468.73	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,700,000.00	2,591,208.00	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,460,000.00	2,100,488.56	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	2,070,000.00	3,014,865.36	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	3,150,000.00	4,837,507.60	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,320,000.00	1,686,084.44	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,540,000.00	2,064,601.00	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,560,000.00	2,396,265.30	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	1,460,000.00	2,332,959.55	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,530,000.00	2,316,792.24	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,650,000.00	2,827,481.25	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,440,000.00	2,436,945.55	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	1,590,000.00	2,541,852.86	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	820,000.00	884,510.77	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	610,000.00	760,548.00	
英債券小計			66,900,000.00	86,173,931.21	(11,792,040,746)
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-4.25%-17/06/05	510,000.00	535,356.18	
		SWITZERLAND-3.0%-18/01/08	435,000.00	462,559.86	
		SWITZERLAND-3.0%-19/05/12	400,000.00	447,698.00	
		SWITZERLAND-2.25%-20/07/06	400,000.00	454,135.20	
		SWITZERLAND-2.0%-21/04/28	220,000.00	252,436.14	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	1,220,000.00	1,622,617.08	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	230,000.00	352,638.30	
スイスフラン小計			3,415,000.00	4,127,440.76	(432,638,340)
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-3.75%-17/08/12	6,100,000.00	6,404,841.40	
		SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	8,600,000.00	9,732,491.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	8,700,000.00	10,763,822.70	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	9,200,000.00	11,132,340.40	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	7,020,000.00	7,709,174.46	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	5,700,000.00	6,768,630.30	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	3,950,000.00	4,114,505.65	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	4,480,000.00	6,196,422.40	

スウェーデンクローナ小計			53,750,000.00	62,822,228.31 (751,982,072)
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	6,900,000.00	7,680,390.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	6,900,000.00	7,890,488.10
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	4,900,000.00	5,236,394.80
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	4,190,000.00	4,802,779.12
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	3,470,000.00	3,644,023.97
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	2,560,000.00	2,627,456.00
ノルウェークローネ小計			28,920,000.00	31,881,531.99 (379,071,415)
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-4.0%-17/11/15	5,250,000.00	5,591,607.00
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-18/11/15	2,550,000.00	2,603,407.20
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	9,050,000.00	10,453,564.50
		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	7,350,000.00	8,694,182.70
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	7,200,000.00	8,073,172.80
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	2,900,000.00	4,642,795.60
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	6,500,000.00	7,486,472.50
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	11,530,000.00	21,398,861.37
デンマーククローネ小計			52,330,000.00	68,944,063.67 (1,043,123,683)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-17/07/25	800,000.00	786,080.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	2,370,000.00	2,480,205.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-18/04/25	1,800,000.00	1,865,340.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-18/07/25	2,600,000.00	2,639,390.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-18/10/25	1,100,000.00	1,055,670.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-19/07/25	2,190,000.00	2,273,001.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	1,850,000.00	2,056,367.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.5%-20/04/25	2,570,000.00	2,509,605.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	1,980,000.00	2,223,342.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25	2,010,000.00	1,978,543.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-21/07/25	1,200,000.00	1,159,441.20
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	1,610,000.00	1,871,544.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	2,300,000.00	2,706,640.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	2,790,000.00	3,001,203.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,580,000.00	2,617,539.00

		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	1,990,000.00	1,876,968.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	830,000.00	1,031,769.68	
ポーランドズロチ小計			32,570,000.00	34,132,649.38	(871,065,212)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-17/07/21	1,800,000.00	1,851,946.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-18/01/21	1,970,000.00	2,090,524.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-18/10/21	1,720,000.00	1,786,498.64	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	2,140,000.00	2,353,477.84	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-19/10/21	1,940,000.00	2,017,706.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	2,170,000.00	2,409,231.65	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-20/11/21	1,300,000.00	1,310,475.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	2,100,000.00	2,506,230.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	2,050,000.00	2,521,987.90	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	1,970,000.00	2,434,689.51	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	2,350,000.00	2,492,811.85	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	2,360,000.00	2,603,563.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	2,640,000.00	3,164,800.32	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	2,210,000.00	2,784,142.53	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	810,000.00	862,305.75	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	740,000.00	745,399.78	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,040,000.00	1,157,736.32	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,050,000.00	1,352,034.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	470,000.00	481,845.88	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	770,000.00	910,313.25	
AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	450,000.00	491,377.50			
豪ドル小計			34,050,000.00	38,329,100.32	(2,904,579,222)
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-1.375%-17/10/01	150,000.00	151,049.85	
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-18/04/01	640,000.00	634,775.93	
		SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	410,000.00	435,934.75	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01	640,000.00	664,621.18	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-19/10/01	200,000.00	202,702.54	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-20/07/01	220,000.00	226,048.68	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	620,000.00	668,405.13	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	590,000.00	611,847.11	

		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	580,000.00	632,022.98	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	200,000.00	213,543.04	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	589,091.07	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	200,000.00	209,333.60	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	550,000.00	629,784.76	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	230,000.00	249,564.21	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	330,000.00	357,325.51	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	270,000.00	312,421.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	445,000.00	480,657.85	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	160,000.00	172,784.67	
シンガポールドル小計			6,975,000.00	7,441,914.36	(558,887,768)
マレーシア アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.759%-19/03/15	100,000.00	101,347.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.659%-20/10/15	1,010,000.00	1,017,968.90	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	460,000.00	472,324.78	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	280,000.00	280,406.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	300,000.00	300,540.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	880,000.00	880,774.40	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	450,000.00	450,164.25	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	350,000.00	347,291.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	590,000.00	607,269.30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.012%-17/09/15	1,800,000.00	1,825,830.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.314%-17/10/31	350,000.00	352,380.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	2,420,000.00	2,474,667.80	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.26%-18/03/01	620,000.00	624,615.90	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.58%-18/09/28	700,000.00	708,372.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	1,220,000.00	1,305,875.80	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	3,500,000.00	3,612,595.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.492%-20/03/31	350,000.00	350,458.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.889%-20/07/31	500,000.00	508,040.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	2,500,000.00	2,571,125.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	650,000.00	637,786.50	
MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,750,000.00	1,716,139.25			
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	957,625.00			
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,270,000.00	1,312,468.80			

		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	441,220.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	850,000.00	803,114.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	430,000.00	411,114.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000.00	821,992.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	1,210,000.00	1,238,035.70	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	600,000.00	602,448.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	450,000.00	439,051.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	600,000.00	562,122.00	
		マレーシアリングット小計	28,330,000.00	28,735,163.78 (712,057,358)	
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	5,329,263.15	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 18/12/21	4,800,000.00	4,787,120.88	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	6,000,000.00	5,796,836.10	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	6,000,000.00	5,587,218.30	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	5,600,000.00	5,309,047.80	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	15,600,000.00	17,087,741.58	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	6,200,000.00	5,526,196.71	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	11,150,000.00	8,977,134.27	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	5,220,000.00	4,665,496.10	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	2,350,000.00	2,191,306.72	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	8,300,000.00	5,858,967.92	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	7,000,000.00	6,245,554.35	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%- 40/01/31	1,500,000.00	1,389,643.50	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	8,000,000.00	5,603,765.20	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	5,950,000.00	5,357,711.71	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	11,000,000.00	9,881,179.00	
南アフリカランド小計		109,970,000.00	99,594,183.29 (666,285,086)	
	合計		151,133,633,468 (151,133,633,468)	

(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 149銘柄	100.0%	43.3%
加ドル	国債証券 32銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 18銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 269銘柄	100.0%	40.3%
英ポンド	国債証券 39銘柄	100.0%	7.8%
スイスフラン	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.7%
ポーランドズロチ	国債証券 17銘柄	100.0%	0.6%
豪ドル	国債証券 21銘柄	100.0%	1.9%
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 31銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 16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12月25日現在	平成28年 6月27日現在
資産の部		
流動資産		
預金	14,001,247	10,299,931
コール・ローン	28,397,597	10,372,487
国債証券	1,885,852,701	1,988,676,842
特殊債券	1,714,657	-
派生商品評価勘定	23,620	7,081
未収利息	29,445,901	33,881,849
前払費用	2,332,327	4,540,962
流動資産合計	1,961,768,050	2,047,779,152
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	80,392	-
未払金	9,281,928	-
未払解約金	-	1,678,037
未払利息	-	16
流動負債合計	9,362,320	1,678,053
負債合計	9,362,320	1,678,053
純資産の部		
元本等		
元本	1,659,465,714	1,878,450,995
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	292,940,016	167,650,104
元本等合計	1,952,405,730	2,046,101,099
純資産合計	1,952,405,730	2,046,101,099
負債純資産合計	1,961,768,050	2,047,779,152

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券及び特殊債券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>（1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>（2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>（3）時価が入手できなかった有価証券</p>
--------------------	---

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

（貸借対照表に関する注記）

		平成27年12月25日現在	平成28年 6月27日現在
1.	期首	平成27年 6月26日	平成27年12月26日
	期首元本額	1,552,174,295円	1,659,465,714円
	期首からの追加設定元本額	180,855,901円	249,487,071円
	期首からの一部解約元本額	73,564,482円	30,501,790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	35,168,592円	34,253,908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）	1,624,297,122円	1,844,197,087円
	計	1,659,465,714円	1,878,450,995円
2.	受益権の総数	1,659,465,714口	1,878,450,995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27年 6月26日 至 平成27年12月25日	自 平成27年12月26日 至 平成28年 6月27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12月25日現在	平成28年 6月27日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品 同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成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

(平成28年 6月27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	1,879,922
合計	1,879,922

(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

(平成28年 6月27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	312,949	-	314,349	1,400
	米ドル	312,949	-	314,349	1,400
	売建	312,949	-	307,268	5,681
	ルーマニアレイ	312,949	-	307,268	5,681
合計		625,898	-	621,617	7,081

(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12月25日現在		平成28年 6月27日現在	
1口当たり純資産額	1.1765円	1口当たり純資産額	1.0892円
(1万口当たり純資産額)	(11,765円)	(1万口当たり純資産額)	(10,892円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-17/12/14	2,030,000.00	2,129,604.18	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-4.75%-18/06/14	2,720,000.00	2,715,719.80	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-18/12/13	3,610,000.00	3,901,940.51	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11	2,170,000.00	2,153,423.15	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	1,430,000.00	1,564,096.31	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	3,250,000.00	3,389,681.26	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	1,350,000.00	1,403,468.30	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	1,230,000.00	1,389,169.99	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	3,410,000.00	4,335,784.99	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%-26/03/05	1,100,000.00	1,078,337.20	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	1,230,000.00	1,356,700.82	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	1,260,000.00	1,495,333.53	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	1,650,000.00	1,846,193.16	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-34/11/23	1,100,000.00	1,234,601.28	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	1,180,000.00	1,621,494.52	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	1,340,000.00	1,625,835.52	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	2,130,000.00	2,412,881.57	
メキシコペソ小計			32,190,000.00	35,654,266.09	(191,819,951)
ブラジル リアル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL-10.25%-28/01/10	250,000.00	233,750.00	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-17/10/01	440,000.00	377,607.98	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-18/01/01	810,000.00	676,593.00	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-18/04/01	420,000.00	341,250.00	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-18/07/01	800,000.00	631,840.00	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-19/01/01	1,160,000.00	865,592.00	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-19/07/01	700,000.00	493,150.00	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-20/01/01	750,000.00	497,100.00	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-18/01/01	200,000.00	193,375.68	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-19/01/01	200,000.00	191,195.68	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-21/01/01	1,200,000.00	1,111,174.10	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-23/01/01	700,000.00	629,494.89	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-25/01/01	690,000.00	608,082.11	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-27/01/01	150,000.00	130,089.84	
ブラジルリアル小計			8,470,000.00	6,980,295.28	(211,363,341)
コロンビア アペソ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA-7.75%-21/04/14	60,000,000.00	60,795,798.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA-4.375%-23/03/21	30,000,000.00	25,243,657.50	
		REPUBLIC OF COLOMBIA-9.85%-27/06/28	47,000,000.00	54,227,164.15	
		TITULOS DE TESORERIA B-5.0%-18/11/21	300,000,000.00	286,846,500.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-19/09/11	437,000,000.00	434,991,985.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-11.0%-20/07/24	585,000,000.00	662,211,225.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-22/05/04	495,000,000.00	483,894,675.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-10.0%-24/07/24	815,000,000.00	921,422,700.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.5%-26/08/26	470,000,000.00	451,195,300.00	

		TITULOS DE TESORERIA B-6.0%-28/04/28	410,000,000.00	345,562,350.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.75%-30/09/18	365,000,000.00	353,936,850.00	
コロンビアペソ小計			4,014,000,000.00	4,080,328,204.65	(140,363,290)
ペルーヌエボソル	国債証券	BONOS DE TESORERIA-5.2%-23/09/12	130,000.00	127,278.45	
		BONOS DE TESORERIA-5.7%-24/08/12	220,000.00	220,766.80	
		PERU BONO SOBERANO-7.84%-20/08/12	230,000.00	251,351.93	
		PERU BONO SOBERANO-8.2%-26/08/12	190,000.00	220,420.71	
		PERU BONO SOBERANO-6.95%-31/08/12	260,000.00	275,651.87	
		PERU BONO SOBERANO-6.9%-37/08/12	180,000.00	188,768.52	
ペルーヌエボソル小計			1,210,000.00	1,284,238.28	(39,631,593)
トルコリラ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND-6.3%-18/02/14	320,000.00	308,160.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.3%-18/06/20	360,000.00	355,860.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.8%-18/11/14	360,000.00	358,200.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.4%-19/03/27	180,000.00	185,850.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.5%-19/07/10	480,000.00	473,414.40	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.5%-20/01/15	295,000.00	307,537.50	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-7.4%-20/02/05	380,000.00	359,115.20	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.4%-20/07/08	450,000.00	452,925.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.7%-21/02/17	300,000.00	315,900.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.5%-22/01/12	330,000.00	331,650.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.5%-22/09/14	290,000.00	277,820.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-7.1%-23/03/08	490,000.00	433,650.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.8%-23/09/27	350,000.00	337,925.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.4%-24/03/20	270,000.00	283,230.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.0%-24/07/24	320,000.00	310,880.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.0%-25/03/12	470,000.00	427,700.00	
TURKEY GOVERNMENT BOND-10.6%-26/02/11	160,000.00	170,960.00			
トルコリラ小計			5,805,000.00	5,690,777.10	(197,299,242)
ハンガリーフォリント	国債証券	HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.75%-17/11/24	15,200,000.00	16,411,683.20	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-4.0%-18/04/25	15,000,000.00	15,722,287.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.5%-18/06/22	20,500,000.00	20,889,592.25	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-5.5%-18/12/20	15,000,000.00	16,389,382.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.5%-19/06/24	34,300,000.00	38,907,330.35	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.0%-19/10/30	12,000,000.00	12,042,120.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.5%-20/06/24	28,000,000.00	29,506,960.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-7.5%-20/11/12	26,200,000.00	31,963,253.30	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-7.0%-22/06/24	22,300,000.00	27,649,335.15	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.0%-23/11/24	31,000,000.00	37,203,208.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-24/06/26	14,000,000.00	13,853,805.00	

		HUNGARY GOVERNMENT BOND-5.5%-25/06/24	29,000,000.00	34,115,150.50	
ハンガリーフォリント小計			262,500,000.00	294,654,108.25	(104,454,881)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-17/07/25	270,000.00	265,302.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	530,000.00	554,645.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-18/04/25	460,000.00	476,698.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-18/07/25	540,000.00	548,181.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-18/10/25	270,000.00	259,119.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-19/07/25	500,000.00	518,950.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	430,000.00	477,966.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.5%-20/04/25	650,000.00	634,725.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	410,000.00	460,389.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25	560,000.00	551,236.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	350,000.00	406,857.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	510,000.00	600,168.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	560,000.00	602,392.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	620,000.00	629,021.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	560,000.00	528,192.00	
ポーランドズロチ小計			7,220,000.00	7,513,842.00	(191,753,247)
ロシアルーブル	国債証券	RUSSIA FOREIGN BOND-7.85%-18/03/10	5,000,000.00	4,882,500.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.2%-18/01/31	4,100,000.00	3,909,370.50	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.5%-18/03/15	3,500,000.00	3,407,267.50	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.5%-19/02/27	5,300,000.00	5,111,876.50	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.7%-19/05/15	5,200,000.00	4,903,600.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.8%-19/12/11	4,000,000.00	3,760,020.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.4%-20/05/27	5,100,000.00	4,707,325.50	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.6%-21/04/14	3,900,000.00	3,749,869.50	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.6%-22/07/20	4,500,000.00	4,288,522.50	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.0%-23/01/25	3,800,000.00	3,509,338.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.0%-23/08/16	6,800,000.00	6,256,068.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-8.15%-27/02/03	9,000,000.00	8,827,245.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.05%-28/01/19	7,200,000.00	6,471,432.00	
ロシアルーブル小計			67,400,000.00	63,784,435.00	(99,503,718)
ルーマニアレイ	国債証券	ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.9%-17/07/26	400,000.00	421,504.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.25%-18/01/17	90,000.00	92,934.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.6%-18/11/28	200,000.00	219,260.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-2.5%-19/04/29	100,000.00	101,658.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.75%-19/06/24	260,000.00	281,255.00	

		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.75%-20/04/29	300,000.00	336,502.50	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.95%-21/06/11	270,000.00	308,824.65	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.85%-23/04/26	230,000.00	266,369.90	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.75%-25/02/24	230,000.00	248,454.05	
ルーマニアレイ小計			2,080,000.00	2,276,762.10 (56,668,608)	
マレーシア アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.759%-19/03/15	190,000.00	192,559.30	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.654%-19/10/31	310,000.00	313,007.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.659%-20/10/15	400,000.00	403,156.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	350,000.00	359,377.55	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	360,000.00	360,522.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	250,000.00	250,450.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	340,000.00	340,299.20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.012%-17/09/15	330,000.00	334,735.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.314%-17/10/31	370,000.00	372,516.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	380,000.00	388,584.20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.26%-18/03/01	270,000.00	272,010.15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.58%-18/09/28	350,000.00	354,186.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	220,000.00	235,485.80	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	470,000.00	485,119.90	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.492%-20/03/31	310,000.00	310,406.10	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.889%-20/07/31	280,000.00	284,502.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	410,000.00	421,664.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	360,000.00	353,235.60	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	300,000.00	294,195.30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	280,000.00	285,250.00	
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	330,000.00	341,035.20			
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	360,000.00	368,341.20			
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	210,000.00	210,856.80			
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	130,000.00	126,837.10			
MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	110,000.00	103,055.70			
マレーシアアリンギット小計			7,670,000.00	7,761,388.50 (192,327,207)	
タイパー ツ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND-2.8%-17/10/10	2,300,000.00	2,337,147.62	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-5.125%-18/03/13	2,900,000.00	3,074,531.48	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.45%-19/03/08	2,100,000.00	2,201,276.99	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.875%-19/06/13	8,950,000.00	9,542,856.32	

		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.55%-20/06/26	4,900,000.00	5,054,854.70	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.65%-21/12/17	9,720,000.00	10,659,096.04	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.625%-23/06/16	5,800,000.00	6,430,527.16	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.85%-25/12/12	5,370,000.00	6,207,505.57	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.58%-27/12/17	2,350,000.00	2,662,750.40	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-4.875%-29/06/22	6,380,000.00	8,190,478.24	
タイバーツ小計			50,770,000.00	56,361,024.52	(162,319,750)
フィリピン	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES-4.95%-21/01/15	5,000,000.00	5,175,000.00	
フィリピン小計			5,000,000.00	5,175,000.00	(11,281,500)
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT-10.0%-17/07/15	250,000,000.00	257,505,850.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-5.25%-18/05/15	500,000,000.00	481,754,550.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.875%-19/04/15	1,600,000,000.00	1,614,693,280.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-20/11/15	500,000,000.00	563,949,800.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-12.8%-21/06/15	500,000,000.00	605,843,900.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-21/07/15	1,830,000,000.00	1,878,685,137.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-22/05/15	850,000,000.00	825,443,075.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-5.625%-23/05/15	1,100,000,000.00	982,276,570.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-24/03/15	3,450,000,000.00	3,573,681,810.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-25/09/15	760,000,000.00	922,639,164.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-26/09/15	2,280,000,000.00	2,371,771,824.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-27/05/15	600,000,000.00	564,021,300.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.125%-28/05/15	800,000,000.00	692,971,760.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.0%-29/03/15	2,350,000,000.00	2,523,195,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-10.5%-30/08/15	810,000,000.00	979,902,036.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.75%-31/05/15	800,000,000.00	849,240,160.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.5%-31/07/15	820,000,000.00	923,478,752.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-32/06/15	1,350,000,000.00	1,374,980,670.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.625%-33/05/15	1,280,000,000.00	1,113,640,576.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-34/03/15	2,300,000,000.00	2,346,920,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-36/05/15	700,000,000.00	713,333,390.00	
インドネシア小計			25,430,000,000.00	26,159,928,604.00	(201,431,450)
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%-17/09/15	1,410,000.00	1,417,785.10	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%-18/12/21	1,200,000.00	1,196,780.22	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	1,610,000.00	1,555,484.35	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	1,810,000.00	1,685,477.51	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	1,750,000.00	1,659,077.43	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	4,550,000.00	4,983,924.62	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	2,330,000.00	2,076,780.37	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	2,540,000.00	2,045,015.34	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	1,850,000.00	1,653,480.42	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	1,200,000.00	1,118,965.14	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	2,190,000.00	1,545,920.45	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	2,100,000.00	1,873,666.30	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	2,040,000.00	1,428,960.12	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	1,580,000.00	1,422,720.08	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	2,790,000.00	2,506,226.31	
南アフリカランド小計		30,950,000.00	28,170,263.76 (188,459,064)	
	合計		1,988,676,842 (1,988,676,842)	

(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 17銘柄	100.0%	9.6%
ブラジルリアル	国債証券 14銘柄	100.0%	10.6%
コロンビアペソ	国債証券 11銘柄	100.0%	7.1%
ペルーヌエボソル	国債証券 6銘柄	100.0%	2.0%
トルコリラ	国債証券 17銘柄	100.0%	9.9%
ハンガリーフォリント	国債証券 12銘柄	100.0%	5.3%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	9.6%
ロシアルーブル	国債証券 13銘柄	100.0%	5.0%
ルーマニアレイ	国債証券 9銘柄	100.0%	2.8%
マレーシアリングット	国債証券 25銘柄	100.0%	9.7%
タイバーツ	国債証券 10銘柄	100.0%	8.2%

フィリピンペソ	国債証券	1銘柄	100.0%	0.6%
インドネシアルピア	国債証券	21銘柄	100.0%	10.1%
南アフリカランド	国債証券	15銘柄	100.0%	9.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2016年 6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	197,438,203円
負債総額	118,313円
純資産総額(-)	197,319,890円
発行済口数	232,521,482口
1口当たり純資産額(/)	0.8486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	24,887,101,043円
負債総額	421,263,070円
純資産総額(-)	24,465,837,973円
発行済口数	22,893,046,514口
1口当たり純資産額(/)	1.0687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	66,855,088,244円
負債総額	727,721,163円
純資産総額(-)	66,127,367,081円
発行済口数	39,231,264,340口
1口当たり純資産額(/)	1.6856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	8,559,623,150円
負債総額	32,208,168円
純資産総額（ - ）	8,527,414,982円
発行済口数	6,906,933,130口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2346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	34,263,345,693円
負債総額	58,257,842円
純資産総額（ - ）	34,205,087,851円
発行済口数	23,902,971,509口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4310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	156,640,172,846円
負債総額	320,022,626円
純資産総額（ - ）	156,320,150,220円
発行済口数	75,141,497,110口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0803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	2,180,866,372円
負債総額	31,793,012円
純資産総額（ - ）	2,149,073,360円
発行済口数	1,895,661,201口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1337円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求を行なわな

いものとしてします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

平成28年6月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（平成28年6月末現在）

・株主総会

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

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

・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。

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

・監査役会

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

(3) 運用の意思決定プロセス（平成28年6月末現在）

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

2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、平成28年6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	628	108,357

株式投資信託	576	86,652
単位型	126	4,586
追加型	450	82,065
公社債投資信託	52	21,705
単位型	38	456
追加型	14	21,249

3【委託会社等の経理状況】

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

(1)【貸借対照表】

	(単位：百万円)	
	第56期 (平成27年3月31日)	第57期 (平成28年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	3	14,206
金銭の信託		3
有価証券		277
前払費用	3	509
未収入金		3
未収委託者報酬		8,441
未収収益	3	1,566
関係会社短期貸付金		436
立替金		666
繰延税金資産		1,446
その他	2	195
流動資産合計	27,750	36,243
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	56
器具備品	1	166
有形固定資産合計	222	356
無形固定資産		
ソフトウェア		113
無形固定資産合計	113	140
投資その他の資産		
投資有価証券		14,184
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	740	781
長期前払費用	0	0
繰延税金資産	248	425
投資その他の資産合計	36,936	35,165
固定資産合計	37,273	35,662
資産合計	65,023	71,905

(単位：百万円)

	第56期 (平成27年3月31日)	第57期 (平成28年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	387	410
未払金	5,545	3,841
未払収益分配金	6	6
未払償還金	112	112
未払手数料	3 3,145	3 3,269
その他未払金	2,282	453
未払費用	3 4,636	3 4,920
未払法人税等	814	354
未払消費税等	4 1,070	4 649
関係会社短期借入金	-	5,631
賞与引当金	1,990	2,080
役員賞与引当金	120	145
その他	3 82	3 278
流動負債合計	14,646	18,312
固定負債		
退職給付引当金	1,111	1,154
固定負債合計	1,111	1,154
負債合計	15,758	19,466
純資産の部		
株主資本		
資本金	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金	5,220	5,220
資本剰余金合計	5,220	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	25,836	29,948
利益剰余金合計	25,836	29,948
自己株式	68	502
株主資本合計	48,351	52,028
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,002	151
繰延ヘッジ損益	88	258
評価・換算差額等合計	913	410
純資産合計	49,265	52,438

負債純資産合計	65,023	71,905
---------	--------	--------

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	63,990	66,339
その他営業収益	3,729	4,382
営業収益合計	67,719	70,722
営業費用		
支払手数料	30,408	30,529
広告宣伝費	1,045	1,098
公告費	5	3
調査費	15,571	17,470
調査費	747	821
委託調査費	14,782	16,600
図書費	41	48
委託計算費	502	505
営業雑経費	660	718
通信費	199	195
印刷費	263	321
協会費	64	65
諸会費	27	22
その他	106	113
営業費用計	48,193	50,327
一般管理費		
給料	7,585	8,138
役員報酬	289	365
役員賞与引当金繰入額	120	145
給料・手当	5,127	5,495
賞与	59	51
賞与引当金繰入額	1,990	2,080
交際費	163	185
寄付金	36	27
旅費交通費	503	503
租税公課	208	258
不動産賃借料	785	875
退職給付費用	349	372
退職金	16	113
固定資産減価償却費	148	196
福利費	908	952
諸経費	2,673	2,952
一般管理費計	13,380	14,577
営業利益	6,146	5,817

(単位：百万円)

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

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

第56期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

(単位：百万円)

	株主資本					株主資本
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本剰余	その他利益剰余金	利益剰余	自己株式	

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

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

第57期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						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
会計方針の変更による 累積的影響額							-
会計方針の変更を反映した 当期首残高	17,363	5,220	5,220	25,836	25,836	68	48,351
当期変動額							
剰余金の配当				850	850		850
当期純利益				4,962	4,962		4,962

自己株式の取得						434	434
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	4,111	4,111	434	3,676
当期末残高	17,363	5,220	5,220	29,948	29,948	502	52,028

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

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1 資産の評価基準及び 評価方法	<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) 金銭の信託 時価法</p> <p>(3) デリバティブ 時価法</p>
2 固定資産の減価償却 の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <p>建物 3年～15年 器具備品 5年～20年</p>

<p>3 引当金の計上基準</p>	<p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p> <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>
<p>4 ヘッジ会計の方法</p>	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
<p>5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。</p>

(会計方針の変更)

<p style="text-align: center;">第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)</p> <p>(企業結合に関する会計基準等の適用) 「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13日。以下「企業結合会計基準」という。)及び「事業分離等に関する会計基準」(企業会計基準第7号 平成25年9月13日。以下「事業分離等会計基準」という。)等を当事業年度から適用し、取得関連費用を発生した事業年度の費用として計上する方法に変更いたしました。また、当事業年度の期首以後実施される企業結合については、暫定的な会計処理の確定による取得原価の配分額の見直しを企業結合日の属する事業年度の財務諸表に反映させる方法に変更いたします。</p> <p>企業結合会計基準等の適用については、企業結合会計基準第58 - 2項(4)及び事業分離等会計基準第57 - 4項(4)に定める経過的な取扱いに従っており、当事業年度の期首時点から将来にわたって適用しております。</p> <p>なお、当事業年度において、財務諸表及び1株当たり情報に与える影響額はありません。</p>

(未適用の会計基準等)

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

(1) 概要

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

(分類1)から(分類5)に係る分類の要件をいずれも満たさない企業の取扱い

(分類2)及び(分類3)に係る分類の要件

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

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

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

(2) 適用予定日

平成29年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

(貸借対照表関係)

第56期 (平成27年3月31日)	第57期 (平成28年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,122百万円</p> <p>器具備品 679百万円</p> <p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 4,256百万円</p> <p>前払費用 2百万円</p> <p>未収収益 110百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 108百万円</p> <p>未払費用 500百万円</p> <p>その他 57百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務27百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務842百万円に対して保証を行っております。</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,170百万円</p> <p>器具備品 653百万円</p> <p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 4,072百万円</p> <p>金銭の信託 153百万円</p> <p>前払費用 2百万円</p> <p>未収収益 147百万円</p> <p>その他 193百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 93百万円</p> <p>未払費用 722百万円</p> <p>その他 266百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務728百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務689百万円に対して保証を行っております。</p>

（損益計算書関係）

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

（株主資本等変動計算書関係）

第56期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	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

第57期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業 年度末 残高 (百万円)
		当事業年度 期首	当事業 年度 増加	当事業 年度 減少	当事業 年度末	
平成21年度 ストックオプション (1)	普通株式	15,902,700	-	14,140,500	1,762,200	-
平成21年度 ストックオプション (2)	普通株式	1,567,500	-	1,392,600	174,900	-
平成22年度 ストックオプション (1)	普通株式	2,310,000	-	2,310,000	-	-
平成23年度 ストックオプション (1)	普通株式	5,029,200	-	290,400	4,738,800	-
合計		24,809,400	-	18,133,500	6,675,900	-

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(リース取引関係)

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

(金融商品関係)

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されており、また一部外貨建て預金を保有しているため為替変動リスクにも晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシ・ドマネ・の投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針」4「ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	14,206	14,206	-
(2) 未収委託者報酬	8,441	8,441	-
(3) 未収収益	1,566	1,566	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	14,431	14,431	-
(5) 未払金	(5,545)	(5,545)	-
(6) 未払費用	(4,636)	(4,636)	-
(7) デリバティブ取引(2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(25)	(25)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(57)	(57)	-
デリバティブ取引計	(82)	(82)	-

(1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(5) 未払金及び(6) 未払費用

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

(7) デリバティブ取引

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

- 2 非上場株式等（貸借対照表計上額30百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。
- 3 子会社株式（貸借対照表計上額18,809百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。
- 4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されており、また一部外貨建て預金を保有しているため為替変動リスクにも晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシ・ドマネ・の投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針」4 ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	14,308	14,308	-
(2) 未収委託者報酬	9,374	9,374	-
(3) 未収収益	2,280	2,280	-
(4) 関係会社短期貸付金	5,333	5,333	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	12,265	12,265	-
(6) 未払金	(3,841)	(3,841)	-
(7) 未払費用	(4,920)	(4,920)	-
(8) 関係会社短期借入金	(5,631)	(5,631)	-
(9) デリバティブ取引(2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(254)	(254)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	170	170	-
デリバティブ取引計	(84)	(84)	-

(1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金、(7) 未払費用並びに(8) 関係会社短期借入金

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

(9) デリバティブ取引

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

2 非上場株式等（貸借対照表計上額16百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 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	14,308			
未収委託者報酬	9,374			
未収収益	2,280			
有価証券及び投資有価証券 投資信託	86	714	1,766	963
合計	26,049	714	1,766	963

(有価証券関係)

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	18,809
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

（単位：百万円）

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

合計	14,431	12,949	1,482
----	--------	--------	-------

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	18,809
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	投資信託	5,593	4,872	720
	小計	5,593	4,872	720
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	6,672	7,175	502
	小計	6,672	7,175	502
合計		12,265	12,047	218

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
株式	30	17	-

投資信託	5,442	703	100
合計	5,473	720	100

(デリバティブ取引関係)

第56期(平成27年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第57期(平成28年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

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

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

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

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

(持分法損益等)

第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)		関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	
(1) 関連会社に対する投資の金額	3,078	(1) 関連会社に対する投資の金額	3,037
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	9,396	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	9,686
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,720	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	2,901

(退職給付関係)

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバラン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
<u>退職給付債務の期末残高</u>	<u>1,233</u>

(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
<u>貸借対照表に計上された負債の額</u>	<u>1,111</u>
退職給付引当金	1,111
<u>貸借対照表に計上された負債の額</u>	<u>1,111</u>

(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
<u>確定給付制度に係る退職給付費用</u>	<u>152</u>

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.6%
-----	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、196百万円でありました。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

退職給付債務の期末残高	1,299
-------------	-------

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%
-----	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、209百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) スtockオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション(新株予約権)の数

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

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

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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 ス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	14,140,500	1,392,600
権利確定	0	0

権利未確定残	1,762,200	174,900
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

2 ス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56期 (平成27年 3月31日)	第57期 (平成28年 3月31日)
-----------------------	-----------------------

第56期 (平成27年3月31日)	第57期 (平成28年3月31日)																																																																								
<p>1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 of 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%;"></td> <td style="text-align: right;">3,685</td> </tr> <tr> <td>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;">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; border-bottom: 3px double 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		3,685	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>1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 of 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;">642</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">177</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">819</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;">96</td> </tr> <tr> <td>関係会社株式評価損</td> <td style="text-align: right;">1,430</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">353</td> </tr> <tr> <td>固定資産減価償却費</td> <td style="text-align: right;">122</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">65</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,068</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%;"></td> <td style="text-align: right;">2,888</td> </tr> <tr> <td>評価性引当金</td> <td style="text-align: right;">1,430</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,457</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;">71</td> </tr> <tr> <td>繰延ヘッジ利益</td> <td style="text-align: right;">114</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">26</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">213</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;">213</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; border-bottom: 3px double black;">1,244</td> </tr> </table>	賞与引当金	642	その他	177	小計	819	投資有価証券評価損	96	関係会社株式評価損	1,430	退職給付引当金	353	固定資産減価償却費	122	その他	65	小計	2,068		2,888	評価性引当金	1,430	繰延税金資産合計	1,457	その他有価証券評価差額金	71	繰延ヘッジ利益	114	その他	26	小計	213		213		1,244
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																																																																								
	3,685																																																																								
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	642																																																																								
その他	177																																																																								
小計	819																																																																								
投資有価証券評価損	96																																																																								
関係会社株式評価損	1,430																																																																								
退職給付引当金	353																																																																								
固定資産減価償却費	122																																																																								
その他	65																																																																								
小計	2,068																																																																								
	2,888																																																																								
評価性引当金	1,430																																																																								
繰延税金資産合計	1,457																																																																								
その他有価証券評価差額金	71																																																																								
繰延ヘッジ利益	114																																																																								
その他	26																																																																								
小計	213																																																																								
	213																																																																								
	1,244																																																																								
<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%	<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;">33.1%</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;">1.4%</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;">4.8%</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;">1.3%</td> </tr> <tr> <td>所得拡大促進税制</td> <td style="text-align: right;">2.2%</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;">0.6%</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;">29.4%</td> </tr> </table>	法定実効税率	33.1%	(調整)		交際費等永久に損金に算入されない項目	1.4%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.8%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.3%	所得拡大促進税制	2.2%	海外子会社の留保利益の影響額等	0.6%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.4%																																										
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	33.1%																																																																								
(調整)																																																																									
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.4%																																																																								
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.8%																																																																								
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.3%																																																																								
所得拡大促進税制	2.2%																																																																								
海外子会社の留保利益の影響額等	0.6%																																																																								
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.4%																																																																								

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

(関連当事者情報)

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	292,000(千SGD)	アセットマネジメント業	直接100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貨建)(注1)	90(千SGD1,000)(注2)	関係会社短期貸付金	333(千SGD4,000)
							貸付金利息(シンガポールドル貨建)(注1)	18(千SGD215)	未収収益	6(千SGD74)
							資金の貸付(円貨建)(注3)	5,000	関係会社短期貸付金	5,000
							貸付金利息(円貨建)(注3)	70	未収収益	70
子会社	Nikko Asset Management Americas, Inc.	アメリカ合衆国	181,542(千USD)(注4)	アセットマネジメント業	直接100.00	資金の借入	資金の借入(米ドル貨建)(注5)	6,176(千USD50,000)	関係会社短期借入金	5,631(千USD50,000)
							借入金利息(米ドル貨建)(注5)	113(千USD949)	未払費用	106(千USD949)

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

(セグメント情報等)

セグメント情報

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

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

関連情報

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

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

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

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

て、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (平成28年3月末現在)	事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (平成28年3月末現在)	事業の内容
農林中央金庫	3,480,488百万円	全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
日興アセットマネジメント株式会社	17,363百万円	証券投資信託の設定を行なうとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また金融商品取引法に定める投資助言業務を行なっています。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

- (1) 受託会社
該当事項はありません。
- (2) 販売会社
該当事項はありません。

第3【その他】

- (1) 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を使用します。
- (2) 目論見書の表紙、表紙裏または裏表紙に、以下を記載することがあります。
 - 委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日
 - ファンドの基本的性格など
 - 委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など
 - 委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など
 - 目論見書の使用開始日
- (3) 目論見書の表紙または表紙裏に、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。
 - 投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。
 - 投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。
 - 投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託を購入されたお客様が負う旨の記載。
 - 「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。
 - 「ご購入に際しては、目論見書の内容を十分にお読みください。」という趣旨の記載。
 - 請求目論見書の入手方法（ホームページで閲覧、ダウンロードできるなど）についての記載。
 - 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨の記載。
 - 「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。
 - 商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認する旨の記載。
 - 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。
 - 有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。
 - 委託会社の情報として記載することが望ましい事項と判断する事項がある場合は、当該事項の記載。
- (4) 有価証券届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部 ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。
- (7) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (8) 交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。
 - ファンドの取引に関して、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用がない旨の記載。
 - 投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。
 - 分配金は、投資信託の純資産から支払われるので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がる旨。分配金は、計算期間中に発生した運用収益を超えて支払われる場合がある旨。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合がある旨の記載。

独立監査人の監査報告書

平成28年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明
業務執行社員

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成28年7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

P w Cあらた有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている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26日から平成28年6月27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28年6月27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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。