

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年3月24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】	新屋敷 昇
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

有価証券報告書を提出しましたので平成28年 9月27日付をもって提出しました有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出します。

2【訂正の内容】

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

<更新後>

ファンドの特色

1 日本、海外先進国および新興国の経済規模に応じた資産配分を行ないます。

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

2 資産の安定成長をめざすため、株式と債券に分散投資を行ないます。

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

3 毎月安定的な分配を行なうことをめざします。

- インカム収益などを原資として、毎月の決算時に、安定した分配を行なうことをめざします。
 - 年4回(3月、6月、9月および12月)の決算時には、基準価額水準などを勘案し、上記安定分配相当額に加えて、キャピタル収益などを積極的に分配する場合があります。
- ※分配金額は収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により分配金額を変更する場合や分配を行なわない場合もあります。

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

1 日本・海外先進国・新興国の経済規模に応じた資産配分を行ないます。

各地域の資産配分比率は各地域のGDP比率に基づいて決定します。



【各地域のGDP比率】
（IMFの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。



【ワールドクルーズの資産配分比率】

- 上記は2016年12月現在の目標とする資産配分比率であり、将来変更になる場合があります。
- 各マザーファンドへの実際の資産配分比率は時価の影響などにより、必ずしも上記数値とは一致しません。

投資対象国・地域

日本および、海外先進国、新興国など計47の国や地域にグローバル分散投資を行ないます。

日本

海外先進国

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

新興国

- 【欧州】 チェコ、ハンガリー、ポーランド、ルーマニア、ギリシャ
 - 【中東・ロシア】 トルコ、ロシア、カタール、アラブ首長国連邦
 - 【北米・南米】 メキシコ、コロンビア、チリ、ブラジル、ペルー
 - 【アジア】 インド、インドネシア、タイ、フィリピン、マレーシア、韓国、台湾、中国
 - 【アフリカ】 エジプト、南アフリカ
- (24の国と地域)

●上図は2016年12月末現在の当ファンドが連動をめざす各指数をもとに作成した投資対象国・地域であり、将来変更になる可能性があります。

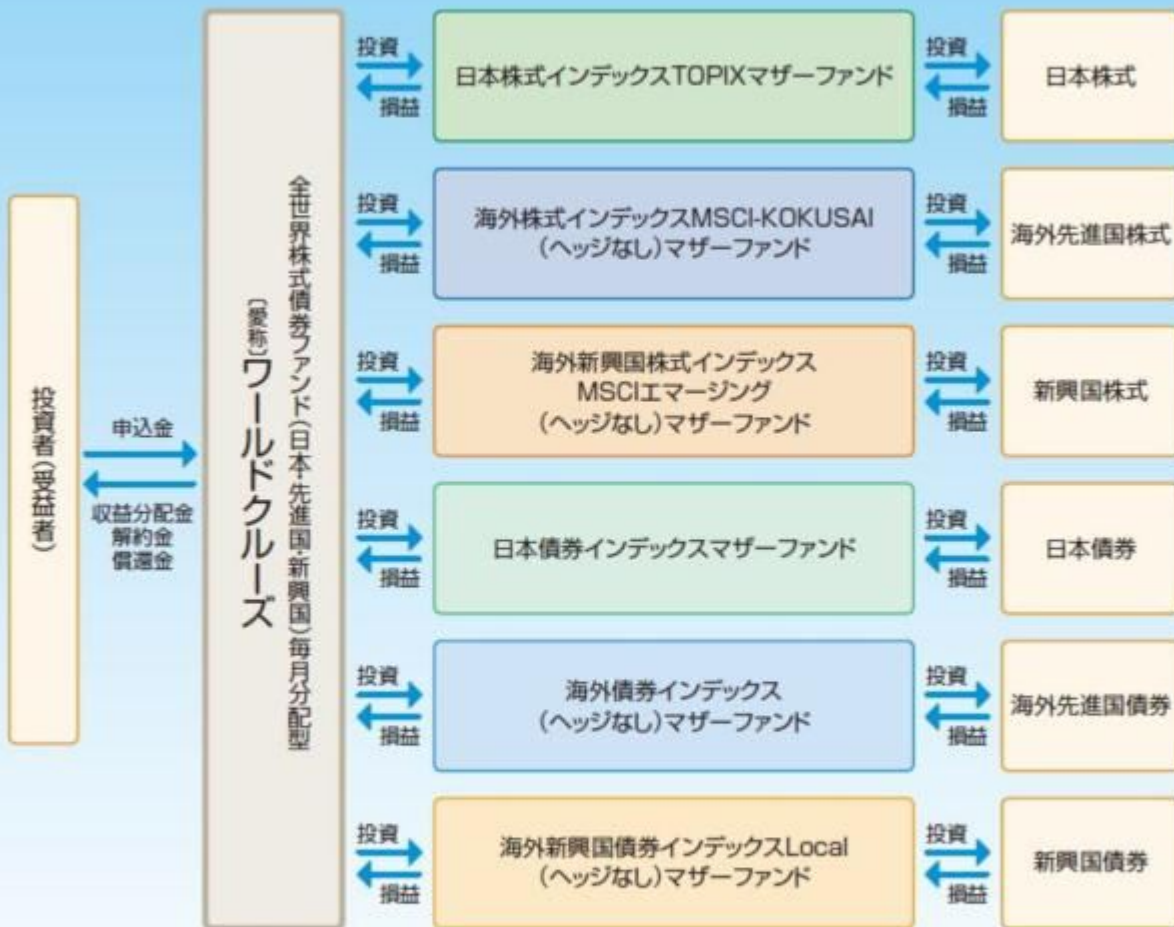
(参考)グローバル分散投資の意義 ～ワールドクルーズをめざすもの～

世界の経済成長に伴なう

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

ファンドの仕組み

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



(主な投資制限) ・株式への実質投資割合は、信託財産の総額の70%未満とします。
・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

(分配方針) ・毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として安定した分配を継続的に行なうことをめざします。ただし、基準価額水準などを勘案し、上記安定分配相当額のほか、委託会社が決定する金額を付加して分配を行なう場合があります。
※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

収益分配金に関する留意事項

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

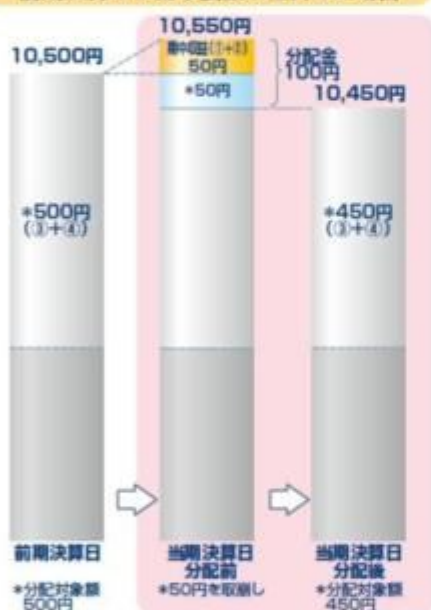
投資信託で分配金が支払われるイメージ



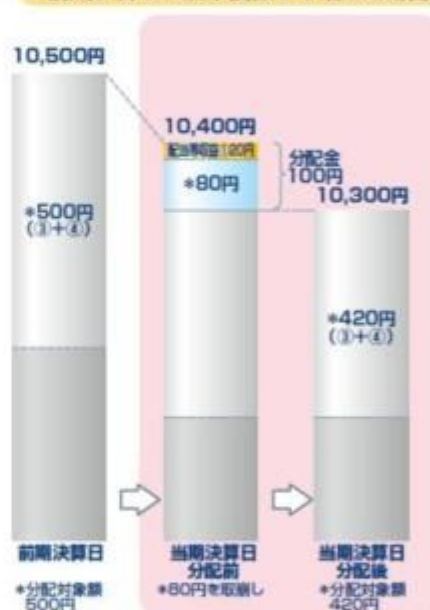
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算から基準価額が上昇した場合



前期決算から基準価額が下落した場合



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

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

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

(3)【ファンドの仕組み】

<更新後>

委託会社の概況（平成28年12月末現在）

1) 資本金

17,363百万円

2) 沿革

昭和34年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

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

3) 大株主の状況

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

2【投資方針】

(2)【投資対象】

<更新後>

投資対象とするマザーファンドの概要

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

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。 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 >
（略）

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

運用の基本方針	
基本方針	主として金融商品取引所に上場されている新興国の株式に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	新興国の株式（DR（預託証券）およびカントリーファンドなどを含みます。）を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として、新興国の株式（DR（預託証券）およびカントリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・ 投資信託証券への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 ・ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・ デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・ 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、NOMURA-BPI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、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・ 運用の効率化をはかるため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・ ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・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0.1%（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）

* NOMURA-BPI 総合は、野村証券株式会社が公表している、わが国の債券市場の動きを示す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債、MBS、ABSなど、国内で発行された円建公募利付債で構成されています。対象となる債券は残存期間1年以上、残存額面10億円以上で、事業債、円建外債、MBS、ABSについては、A格相当以上の格付を取得しているものに限られます。

同指数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な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ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として世界各国の債券に投資し、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。 ・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）

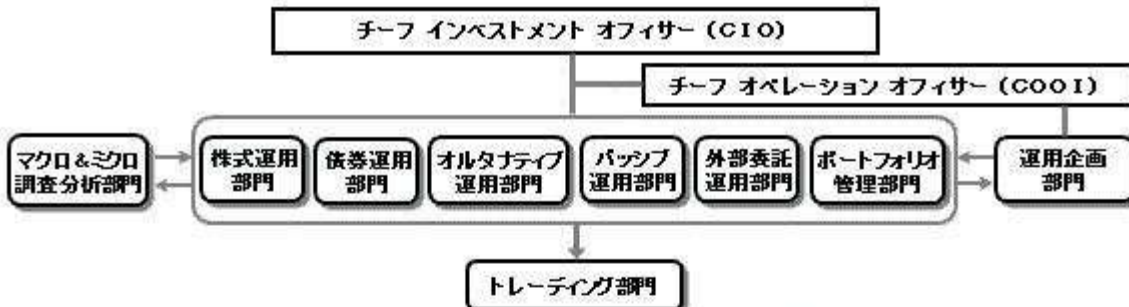
*シティ世界国債インデックス（除く日本）は、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが開発した、日本を除く世界の主要国の国債市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

< 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 >
（略）

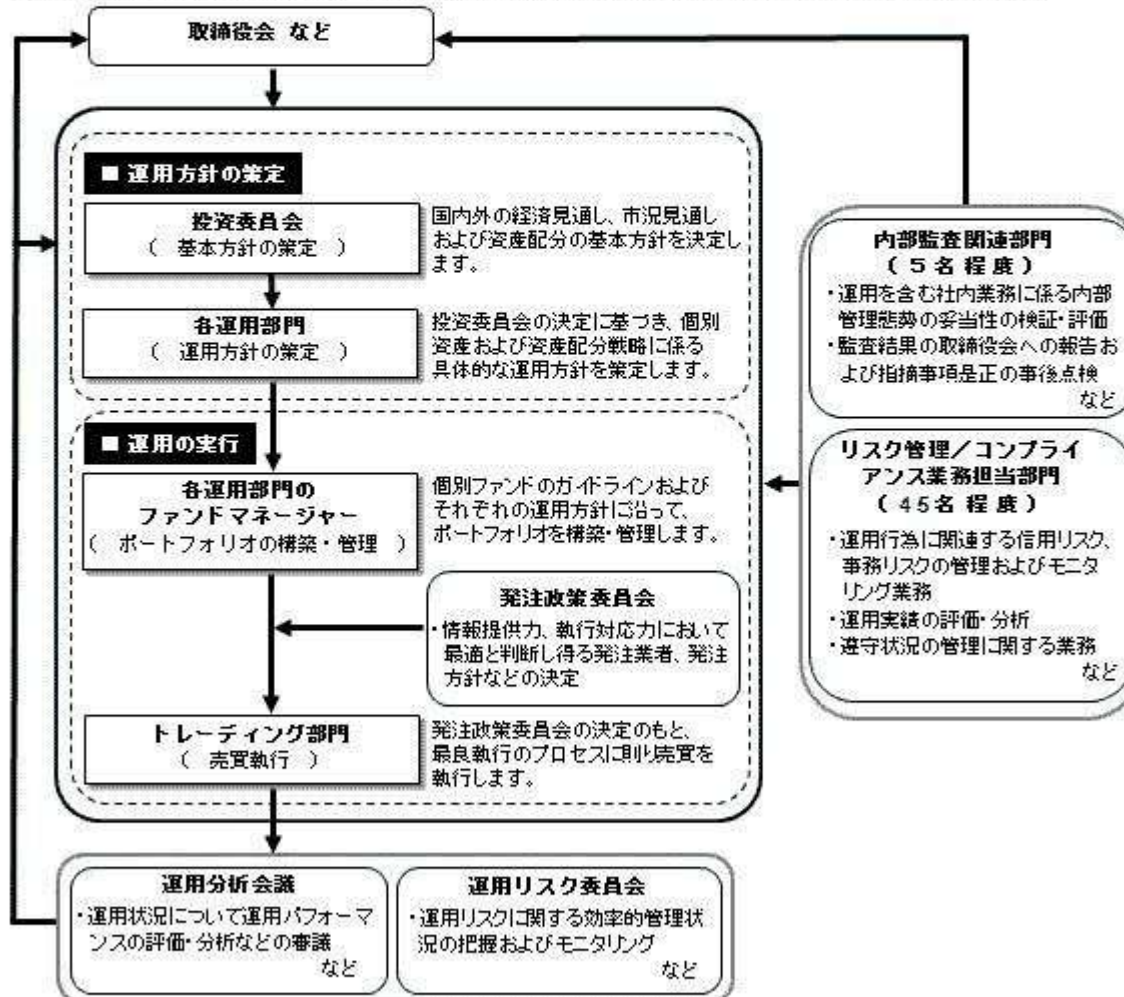
（3）【運用体制】

< 更新後 >

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

上記体制は平成28年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(5) 【投資制限】

< 訂正前 >

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) ~ 16) (略)

< 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド >

1) ~ 12) (略)

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

1)～16) (略)

<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)～15) (略)

<日本債券インデックスマザーファンド>

1)～10) (略)

<海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

1)～12) (略)

<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)～13) (略)

<訂正後>

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)～16) (略)

17) 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。

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

1)～12) (略)

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。

<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)～16) (略)

<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)～15) (略)

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。

<日本債券インデックスマザーファンド>

1)～10) (略)

11) 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。

<海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

1)～12) (略)

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。

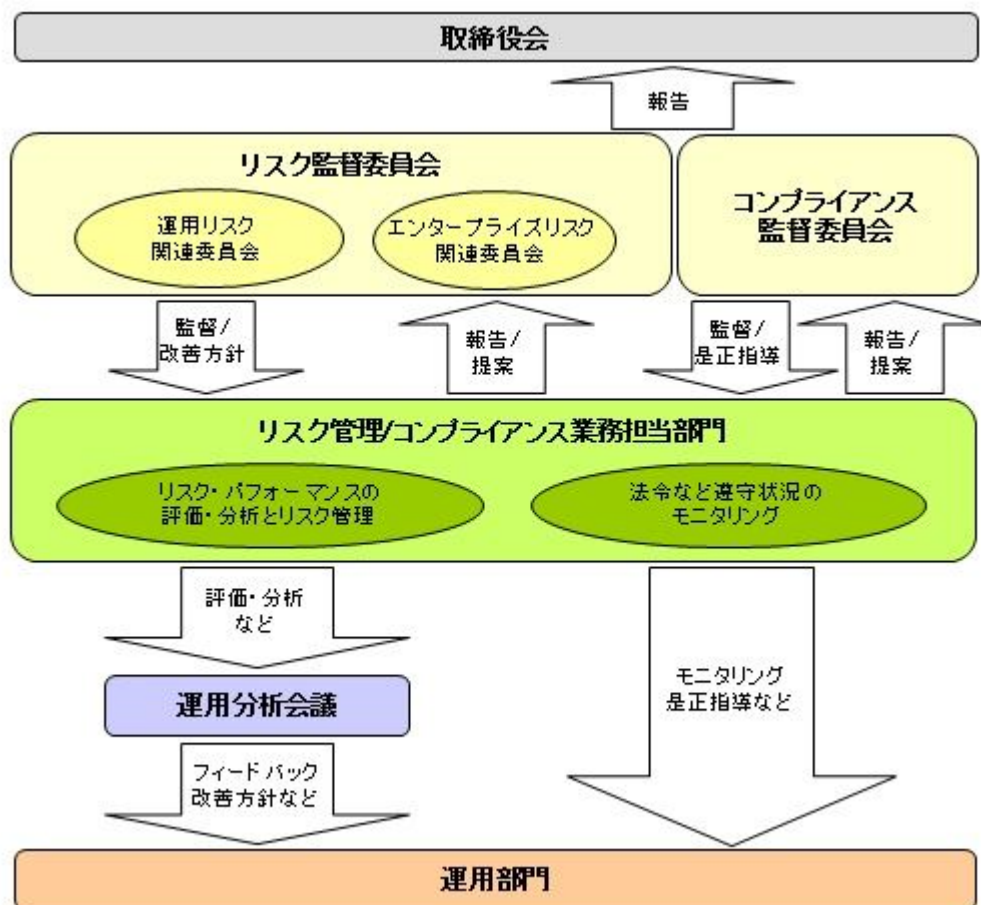
<海外新興国債券インデックスLocal(ヘッジなし)マザーファンド>

1)～13) (略)

3【投資リスク】

< 更新後 >

(2) リスク管理体制

**全社的リスク管理**

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

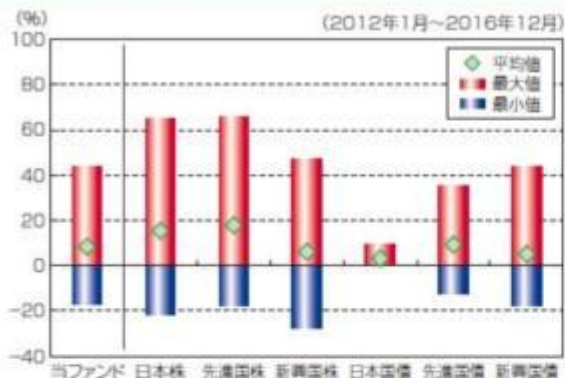
運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は平成28年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

< 更新後 >

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	8.4%	15.4%	17.9%	6.2%	3.2%	9.3%	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%	0.5%	-12.3%	-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2012年1月から2016年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<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。

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、2012年1月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

日本国債 …… NOMURA-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・レティバース・ファイブ (円ヘッジなし, 円ベース)

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

Index LLC に帰属します。

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

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

4【手数料等及び税金】

（5）【課税上の取扱い】

<更新後>

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

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

2) 解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益（譲渡益）^{*}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せん。）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せん。）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

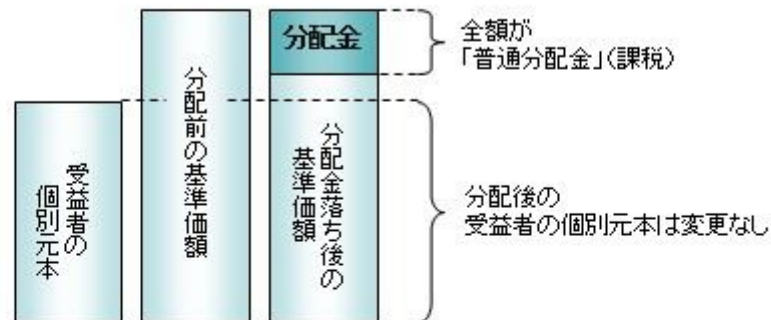
が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

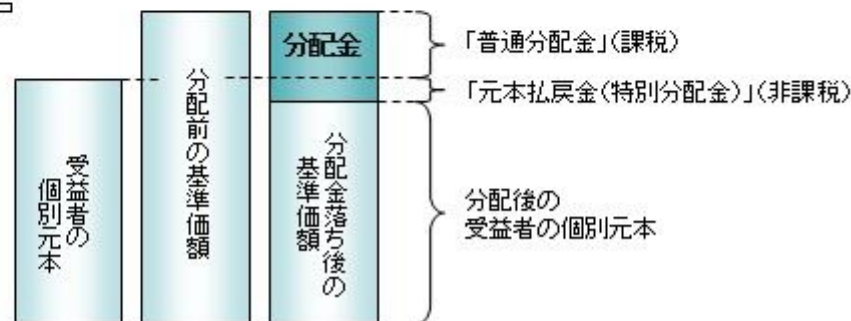
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
 - 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29年 3月24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12月30日現在です。

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

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	216,617,965	98.80
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		2,624,020	1.20
合計(純資産総額)		219,241,985	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	27,007,606	2.2070	59,605,787	2.2133	59,775,934	27.26
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	28,598,719	2.0807	59,505,355	2.0685	59,156,450	26.98
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	34,342,883	1.2333	42,355,078	1.2359	42,444,369	19.36
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	28,884,849	1.4451	41,741,795	1.4678	42,397,181	19.34
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックSTOPIXマザーファンド	4,892,207	1.3316	6,514,463	1.3164	6,440,101	2.94
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	4,618,441	1.3855	6,399,305	1.3866	6,403,930	2.92

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.80
合計	98.80

【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
第18特定期間末	(2016年12月26日)	218	219	0.9447	0.9467
	2015年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	
	7月末日	204		0.8805	
	8月末日	203		0.8778	
	9月末日	201		0.8630	
	10月末日	204		0.8751	
	11月末日	213		0.9092	
	12月末日	219		0.9467	

(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
第18特定期間	2016年 6月28日～2016年12月26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
第18特定期間	2016年 6月28日～2016年12月26日	15.92

(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
第18特定期間	2016年 6月28日～2016年12月26日	8,626,944	9,691,734

(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12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	26,573,541,830	99.61
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		103,763,791	0.39
合計(純資産総額)		26,677,305,621	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	91,080,000	0.34

(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	145,900	6,025.00	879,047,500	6,878.00	1,003,500,200	3.76

日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	897,400	532.90	478,224,460	720.20	646,307,480	2.42
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	95,100	4,721.67	449,030,817	4,912.00	467,131,200	1.75
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	94,800	3,547.87	336,338,076	4,460.00	422,808,000	1.58
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	53,300	6,585.00	350,980,500	7,765.00	413,874,500	1.55
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	108,000	3,144.17	339,570,360	3,415.00	368,820,000	1.38
日本	株式	KDDI	情報・通信業	117,100	3,111.46	364,351,966	2,959.50	346,557,450	1.30
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,607,700	171.50	275,720,550	209.80	337,295,460	1.26
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	74,500	3,965.44	295,425,280	3,844.00	286,378,000	1.07
日本	株式	ソニー	電気機器	84,700	3,324.68	281,600,396	3,275.00	277,392,500	1.04
日本	株式	ファナック	電気機器	12,200	19,717.70	240,555,940	19,815.00	241,743,000	0.91
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	88,500	2,600.60	230,153,100	2,663.00	235,675,500	0.88
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	23,200	9,404.76	218,190,432	10,100.00	234,320,000	0.88
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	48,000	4,056.39	194,706,720	4,796.00	230,208,000	0.86
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	47,100	4,804.00	226,268,400	4,835.00	227,728,500	0.85
日本	株式	三菱商事	卸売業	88,800	2,361.49	209,700,312	2,490.00	221,112,000	0.83
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	49,500	4,492.78	222,392,610	4,453.00	220,423,500	0.83
日本	株式	キーエンス	電気機器	2,700	77,230.00	208,521,000	80,200.00	216,540,000	0.81
日本	株式	キヤノン	電気機器	64,600	3,052.26	197,175,996	3,295.00	212,857,000	0.80
日本	株式	三菱電機	電気機器	128,000	1,399.27	179,106,560	1,629.50	208,576,000	0.78
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	128,400	1,557.00	199,918,800	1,623.50	208,457,400	0.78
日本	株式	三菱地所	不動産業	88,000	2,041.13	179,619,440	2,327.50	204,820,000	0.77
日本	株式	信越化学工業	化学	22,500	7,693.30	173,099,250	9,067.00	204,007,500	0.76
日本	株式	村田製作所	電気機器	12,600	14,447.35	182,036,610	15,650.00	197,190,000	0.74
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	10,000	17,520.00	175,200,000	19,230.00	192,300,000	0.72
日本	株式	日立製作所	電気機器	288,000	525.10	151,228,800	632.00	182,016,000	0.68
日本	株式	任天堂	その他製品	7,400	24,534.34	181,554,116	24,540.00	181,596,000	0.68
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	42,400	3,960.73	167,934,952	4,214.00	178,673,600	0.67
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	37,300	4,025.27	150,142,571	4,772.00	177,995,600	0.67
日本	株式	花王	化学	31,900	5,747.17	183,334,723	5,541.00	176,757,900	0.66

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	0.36
		建設業	3.03
		食料品	4.45
		繊維製品	0.70
		パルプ・紙	0.23
		化学	6.48
		医薬品	4.76
		石油・石炭製品	0.51

	ゴム製品	0.91
	ガラス・土石製品	0.96
	鉄鋼	1.26
	非鉄金属	0.91
	金属製品	0.70
	機械	4.96
	電気機器	12.28
	輸送用機器	9.75
	精密機器	1.55
	その他製品	1.79
	電気・ガス業	1.90
	陸運業	4.30
	海運業	0.23
	空運業	0.54
	倉庫・運輸関連業	0.20
	情報・通信業	7.69
	卸売業	4.39
	小売業	4.75
	銀行業	8.49
	証券、商品先物取引業	1.22
	保険業	2.61
	その他金融業	1.31
	不動産業	2.62
	サービス業	3.66
合 計		99.61

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 2017年03月	買建		6日本円	91,273,240	91,080,000	0.34

(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12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
出資金	アメリカ	8,143,959	0.01
株式	アメリカ	46,527,585,661	60.41
	カナダ	3,026,586,204	3.93
	モーリシャス	4,454,807	0.01
	ドイツ	2,800,637,677	3.64
	イタリア	526,235,373	0.68
	フランス	2,760,920,825	3.58
	オランダ	1,305,994,059	1.70
	スペイン	946,672,927	1.23
	ベルギー	347,381,805	0.45
	オーストリア	63,119,122	0.08
	ルクセンブルク	95,960,036	0.12
	フィンランド	284,292,981	0.37
	アイルランド	1,218,535,413	1.58
	ポルトガル	45,025,837	0.06
	イギリス	5,083,769,401	6.60
	スイス	2,854,146,838	3.71
	スウェーデン	834,594,403	1.08
	ノルウェー	201,699,507	0.26
	デンマーク	491,687,315	0.64
	ケイマン	176,323,936	0.23
	オーストラリア	2,000,548,292	2.60
	パミューダ	185,000,191	0.24
	ニュージーランド	59,115,669	0.08
	香港	751,754,169	0.98
	シンガポール	529,516,890	0.69
	イスラエル	173,557,713	0.23
	ジャージー	395,949,887	0.51
英ヴァージン諸島	17,616,224	0.02	
	小計	73,708,683,162	95.70
投資証券	アメリカ	1,499,086,087	1.95
	カナダ	12,272,288	0.02
	フランス	105,264,252	0.14
	イギリス	73,810,342	0.10
	オーストラリア	215,876,307	0.28
	香港	35,903,808	0.05
	シンガポール	27,452,055	0.04
	小計	1,969,665,139	2.56
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		1,334,518,874	1.73
合計(純資産総額)		77,021,011,134	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	980,743,871	1.27
	買建	ドイツ	273,314,250	0.35

(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		789,203,000	1.02

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
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	113,642	13,774.94	1,565,412,016	13,597.87	1,545,290,018	2.01
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	156,324	7,104.72	1,110,639,047	7,327.22	1,145,420,496	1.49
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	87,431	10,102.01	883,229,081	10,524.87	920,200,040	1.19
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	57,681	13,275.20	765,726,835	13,453.43	776,007,302	1.01
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	76,140	8,014.51	610,224,943	10,005.32	761,805,529	0.99
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	8,495	97,290.11	826,479,554	89,132.32	757,179,088	0.98
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	189,293	3,337.43	631,753,746	3,693.89	699,229,015	0.91
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	48,970	15,410.46	754,650,329	13,553.61	663,720,355	0.86
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	101,030	5,325.92	538,077,981	6,388.31	645,411,121	0.84
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	129,737	4,275.18	554,649,417	4,969.46	644,723,273	0.84
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	6,532	94,085.47	614,566,344	91,187.20	595,634,837	0.77
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	6,200	96,517.78	598,410,294	93,527.49	579,870,445	0.75
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	215,039	1,947.71	418,834,212	2,562.77	551,097,648	0.72
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	65,633	8,234.54	540,457,629	8,365.88	549,077,966	0.71
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	39,781	11,738.69	466,977,117	13,724.85	545,988,329	0.71
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	86,057	5,572.88	479,585,471	6,260.17	538,731,673	0.70
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	53,959	10,131.13	546,665,930	9,825.93	530,197,438	0.69
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	25,670	16,743.10	429,795,575	18,993.69	487,568,138	0.63

アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	127,850	3,760.29	480,753,997	3,784.76	483,881,579	0.63
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	99,592	4,088.79	407,211,670	4,270.52	425,309,966	0.55
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	61,197	5,776.73	353,519,103	6,917.17	423,310,432	0.55
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	86,362	4,955.48	427,965,561	4,845.98	418,508,870	0.54
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア	50,597	7,515.93	380,283,753	8,164.78	413,113,581	0.54
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	26,090	14,367.87	374,857,901	15,737.79	410,599,176	0.53
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	47,173	8,285.93	390,872,435	8,502.93	401,108,929	0.52
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	58,273	7,216.55	420,530,338	6,877.56	400,776,613	0.52
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	14,848	26,062.72	386,979,296	26,725.14	396,814,879	0.52
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	32,153	10,804.44	347,395,401	12,180.19	391,629,791	0.51
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	417,621	895.18	373,845,967	929.78	388,298,159	0.50
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	20,060	16,748.93	335,983,580	18,759.54	376,316,565	0.49

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
出資金			0.01
株式	国外	エネルギー	7.75
		素材	4.83
		資本財	7.31
		商業・専門サービス	0.96
		運輸	1.95
		自動車・自動車部品	1.44
		耐久消費財・アパレル	1.67
		消費者サービス	1.73
		メディア	2.61
		小売	3.86
		食品・生活必需品小売り	1.97
		食品・飲料・タバコ	5.75
		家庭用品・パーソナル用品	2.08
		ヘルスケア機器・サービス	3.79
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.48
		銀行	9.42
各種金融	4.27		
保険	4.21		

	不動産	0.50
	ソフトウェア・サービス	8.86
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.58
	電気通信サービス	3.06
	公益事業	3.20
	半導体・半導体製造装置	2.45
投資証券		2.56
合計		98.27

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 EMINI1703	買建	75	米ドル	8,496,387.5	989,744,180	8,419,125	980,743,871	1.27
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1703	買建	75	ユーロ	2,227,750	273,344,925	2,227,500	273,314,250	0.35

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	5,000,000.00	570,361,030	580,696,000	0.75
	ユーロ	買建	1,700,000.00	206,493,500	208,507,000	0.27

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

海外新興国株式インデックスMSCIEマージング(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2016年12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	26,350,038	0.25
	メキシコ	345,240,415	3.33
	ブラジル	769,995,765	7.42
	チリ	121,264,315	1.17
	コロンビア	44,986,522	0.43
	ペルー	40,435,763	0.39

	トルコ	98,830,630	0.95
	チェコ	18,575,037	0.18
	ハンガリー	30,401,850	0.29
	ポーランド	113,512,661	1.09
	ロシア	448,685,225	4.32
	ケイマン	662,398,470	6.38
	バミューダ	66,631,724	0.64
	香港	453,092,059	4.37
	マレーシア	251,221,670	2.42
	タイ	231,494,249	2.23
	フィリピン	120,723,643	1.16
	インドネシア	263,932,248	2.54
	韓国	1,451,795,889	13.99
	台湾	1,209,663,296	11.66
	中国	1,448,678,812	13.96
	インド	826,624,211	7.97
	カタール	89,830,587	0.87
	エジプト	14,807,852	0.14
	南アフリカ	689,317,369	6.64
	アラブ首長国連邦	86,704,577	0.84
	小計	9,925,194,877	95.65
投資信託受益証券	アメリカ	37,224,379	0.36
投資証券	メキシコ	10,143,965	0.10
	トルコ	5,708,696	0.06
	南アフリカ	33,849,026	0.33
	小計	49,701,687	0.48
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		364,115,759	3.51
合計（純資産総額）		10,376,236,702	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	352,551,160	3.40

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

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		46,568,000	0.45

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2,185	121,290.40	265,019,524	174,433.60	381,137,416	3.67
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	538,355	519.83	279,858,463	649.80	349,823,079	3.37
中国	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	123,400	2,349.34	289,909,290	2,817.75	347,710,597	3.35
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP-ADR	ソフトウェア・サービス	24,450	9,452.64	231,117,219	10,173.07	248,731,603	2.40
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	9,580	17,409.70	166,785,021	17,588.91	168,501,798	1.62
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	133,700	1,260.92	168,586,207	1,223.37	163,565,772	1.58
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,836,920	69.39	127,468,287	88.46	162,508,271	1.57
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	ソフトウェア・サービス	6,020	19,890.43	119,740,420	19,395.58	116,761,422	1.13
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA - H	銀行	1,636,575	58.12	95,129,850	68.79	112,582,613	1.09
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	347,765	244.16	84,912,832	301.79	104,954,086	1.01
中国	株式	BANK OF CHINA LTD - H	銀行	1,784,000	44.75	79,851,126	51.06	91,105,312	0.88
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	銀行	70,436	1,019.64	71,819,925	1,209.12	85,165,717	0.82
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	61,000	900.93	54,956,953	1,346.04	82,108,559	0.79
ロシア	株式	GAZPROM PAO-SPON ADR	エネルギー	132,700	561.24	74,477,719	585.47	77,693,029	0.75
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	32,575	2,005.52	65,329,814	2,162.38	70,439,659	0.68
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	40,140	2,076.47	83,349,506	1,706.84	68,512,638	0.66
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	114,000	504.67	57,532,608	581.27	66,265,236	0.64
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PRF	銀行	60,442	941.57	56,910,930	1,035.88	62,610,659	0.60
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON-ADR	エネルギー	9,535	4,773.76	45,517,803	6,556.05	62,512,005	0.60
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	102,000	670.10	68,350,934	585.80	59,752,416	0.58
香港	株式	CNOOC LTD	エネルギー	388,000	133.52	51,808,786	144.49	56,063,051	0.54
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	12,630	2,526.48	31,909,443	4,326.96	54,649,505	0.53
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	28,946	1,682.41	48,699,271	1,832.57	53,045,687	0.51
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	電気通信サービス	705,800	65.64	46,332,806	73.92	52,174,077	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	375	99,994.40	37,497,900	138,714.40	52,017,900	0.50
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車部品	3,430	13,166.07	45,159,639	14,132.80	48,475,504	0.47
中国	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	159,000	246.92	39,261,679	301.15	47,883,009	0.46
韓国	株式	NAVER CORP	ソフトウェア・サービス	628	65,533.60	41,155,101	75,020.00	47,112,560	0.45

ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	15,400	2,796.87	43,071,845	2,986.80	45,996,775	0.44
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	ソフトウェア・サービス	1,770	19,322.91	34,201,557	25,977.27	45,979,768	0.44

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	7.57
		素材	7.09
		資本財	3.99
		商業・専門サービス	0.12
		運輸	1.42
		自動車・自動車部品	3.36
		耐久消費財・アパレル	1.24
		消費者サービス	1.01
		メディア	2.18
		小売	2.11
		食品・生活必需品小売り	1.84
		食品・飲料・タバコ	3.92
		家庭用品・パーソナル用品	1.20
		ヘルスケア機器・サービス	0.66
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.76
		銀行	17.23
		各種金融	2.81
		保険	3.37
		不動産	2.00
		ソフトウェア・サービス	9.82
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.80		
電気通信サービス	5.58		
公益事業	2.69		
半導体・半導体製造装置	4.88		
投資信託受益証券			0.36
投資証券			0.48
合計			96.49

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	MINMSCIE1703	買建	70	米ドル	3,079,425	358,722,218	3,026,450	352,551,160	3.40
----------	------	-------------	--------------	----	----	-----	-----------	-------------	-----------	-------------	------

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

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	400,000.00	46,732,000	46,568,000	0.45

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2016年12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	26,427,019,774	76.90
地方債証券	日本	2,098,645,000	6.11
特殊債券	日本	3,932,339,000	11.44
社債券	日本	1,480,002,000	4.31
	オーストラリア	300,736,424	0.88
	小計	1,780,738,424	5.18
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		125,442,652	0.37
合計(純資産総額)		34,364,184,850	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	100.48	708,416,270	100.48	708,416,270	0.200	2017/12/20	2.06
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	581,000,000	104.75	608,603,310	104.26	605,802,890	1.400	2019/9/20	1.76
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	560,000,000	101.19	566,686,400	100.81	564,564,000	0.100	2020/6/20	1.64
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	505,000,000	101.11	510,605,500	100.78	508,979,400	0.100	2020/3/20	1.48
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	473,000,000	104.83	495,845,900	104.33	493,509,280	1.300	2019/12/20	1.44
日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	410,000,000	103.70	425,186,400	103.28	423,464,400	1.300	2019/3/20	1.23
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	370,000,000	106.66	394,675,300	105.99	392,192,600	1.300	2021/3/20	1.14

日本	国債証券	第29回利付国債 (30年)	276,000,000	141.98	391,864,800	136.27	376,107,960	2.400	2038/9/20	1.09
日本	国債証券	第88回利付国債 (20年)	300,000,000	123.07	369,210,000	121.57	364,719,000	2.300	2026/6/20	1.06
日本	国債証券	第113回利付国債 (20年)	290,000,000	126.67	367,348,800	124.39	360,736,800	2.100	2029/9/20	1.05
日本	国債証券	第140回利付国債 (20年)	280,000,000	124.35	348,191,200	121.18	339,306,800	1.700	2032/9/20	0.99
日本	国債証券	第120回利付国債 (5年)	330,000,000	101.26	334,184,400	101.01	333,362,700	0.200	2019/9/20	0.97
日本	国債証券	第125回利付国債 (5年)	325,000,000	101.25	329,085,250	100.85	327,782,000	0.100	2020/9/20	0.95
日本	国債証券	第60回利付国債 (20年)	295,000,000	109.92	324,264,000	108.92	321,319,900	1.400	2022/12/20	0.94
日本	国債証券	第292回利付国債 (10年)	306,000,000	102.75	314,442,540	102.36	313,233,840	1.700	2018/3/20	0.91
日本	国債証券	第339回利付国債 (10年)	300,000,000	104.42	313,262,000	103.42	310,275,000	0.400	2025/6/20	0.90
日本	国債証券	第91回利付国債 (20年)	250,000,000	123.55	308,887,500	122.02	305,072,500	2.300	2026/9/20	0.89
日本	国債証券	第122回利付国債 (5年)	300,000,000	101.04	303,135,000	100.75	302,271,000	0.100	2019/12/20	0.88
日本	特殊債券	第45回日本学生 支援債券	300,000,000	99.99	299,970,000	99.99	299,973,000	0.001	2018/11/20	0.87
日本	国債証券	第14回利付国債 (30年)	208,000,000	137.09	285,147,200	133.04	276,735,680	2.400	2034/3/20	0.81
日本	国債証券	第34回利付国債 (30年)	200,000,000	139.96	279,923,200	134.95	269,908,000	2.200	2041/3/20	0.79
日本	国債証券	第137回利付国債 (20年)	220,000,000	124.16	273,165,200	121.12	266,475,000	1.700	2032/6/20	0.78
日本	国債証券	第50回利付国債 (20年)	237,000,000	109.34	259,135,800	108.54	257,246,910	1.900	2021/3/22	0.75
日本	国債証券	第341回利付国債 (10年)	250,000,000	103.13	257,849,100	102.64	256,600,000	0.300	2025/12/20	0.75
日本	国債証券	第149回利付国債 (20年)	215,000,000	121.63	261,517,400	118.04	253,792,450	1.500	2034/6/20	0.74
日本	国債証券	第43回利付国債 (30年)	195,000,000	132.35	258,098,100	125.63	244,982,400	1.700	2044/6/20	0.71
日本	国債証券	第329回利付国債 (10年)	230,000,000	106.69	245,403,100	105.67	243,052,500	0.800	2023/6/20	0.71
日本	国債証券	第141回利付国債 (20年)	195,000,000	124.53	242,835,450	121.22	236,388,750	1.700	2032/12/20	0.69
日本	国債証券	第2回利付国債 (40年)	165,000,000	150.96	249,095,550	142.41	234,979,800	2.200	2049/3/20	0.68
日本	国債証券	第290回利付国債 (10年)	226,000,000	102.34	231,288,400	102.00	230,524,520	1.400	2018/3/20	0.67

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	76.90
地方債証券	6.11
特殊債券	11.44
社債券	5.18
合計	99.63

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12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	70,133,585,833	43.77
	カナダ	3,324,807,122	2.08
	メキシコ	1,282,347,773	0.80
	ドイツ	11,752,410,743	7.34
	イタリア	15,109,102,778	9.43
	フランス	15,646,077,756	9.77
	オランダ	3,730,376,758	2.33
	スペイン	8,685,304,558	5.42
	ベルギー	4,012,216,044	2.50
	オーストリア	2,443,618,275	1.53
	フィンランド	941,775,322	0.59
	アイルランド	1,224,880,607	0.76
	イギリス	11,498,515,660	7.18
	スイス	380,993,377	0.24
	スウェーデン	726,394,670	0.45
	ノルウェー	427,885,916	0.27
	デンマーク	1,029,358,312	0.64
	ポーランド	936,608,174	0.58
	オーストラリア	3,245,448,068	2.03
	シンガポール	605,188,025	0.38
マレーシア	682,657,626	0.43	
南アフリカ	836,789,139	0.52	
	小計	158,656,342,536	99.03
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,559,974,337	0.97
合計（純資産総額）		160,216,316,873	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		78,072,240	0.05

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,490,000	15,460.86	1,776,453,655	14,906.85	1,712,797,356	8.000	2021/11/15	1.07
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,780,000	12,469.66	1,344,229,391	12,280.81	1,323,872,230	3.375	2019/11/15	0.83
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,270,000	12,612.37	1,295,290,636	12,392.53	1,272,713,075	3.625	2020/2/15	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,100,000	12,324.64	1,121,542,422	12,205.50	1,110,701,199	3.750	2018/11/15	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,850,000	12,316.31	1,089,993,697	12,197.31	1,079,462,681	4.000	2018/8/15	0.67
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,300,000	12,007.80	1,116,725,479	11,523.17	1,071,655,661	2.000	2023/2/15	0.67
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,550,000	12,820.03	1,096,113,337	12,491.28	1,068,004,521	3.625	2021/2/15	0.67
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,830,000	11,793.47	1,041,363,480	11,715.43	1,034,472,844	1.500	2018/12/31	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,860,000	14,956.15	1,025,991,965	14,545.32	997,809,351	8.750	2020/8/15	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,030,000	12,612.37	1,012,773,496	12,372.50	993,512,372	3.500	2020/5/15	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,340,000	11,934.54	995,340,660	11,858.77	989,021,851	2.250	2018/7/31	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,950,000	12,055.80	958,436,607	11,975.48	952,051,179	3.500	2018/2/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,150,000	11,818.27	963,189,137	11,315.23	922,191,477	1.750	2023/5/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,550,000	12,210.06	921,859,714	12,106.53	914,043,602	3.875	2018/5/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,400,000	11,952.96	884,519,707	11,885.84	879,552,713	2.750	2018/2/28	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,450,000	11,898.28	886,422,501	11,756.61	875,867,703	1.750	2019/9/30	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	11,946.36	836,245,481	11,869.01	830,831,026	2.375	2018/6/30	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,400,000	12,097.67	774,251,064	11,757.97	752,510,489	2.125	2021/6/30	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,170,000	11,921.34	735,546,799	11,861.50	731,854,615	2.750	2017/12/31	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	13,174.97	777,323,371	11,722.71	691,640,177	3.125	2044/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,350,000	14,385.37	769,617,477	12,846.88	687,308,613	3.625	2043/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,930,000	12,174.34	721,938,754	11,538.88	684,255,703	2.250	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	12,401.17	719,268,204	11,788.92	683,757,812	2.500	2024/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,940,000	12,156.13	722,074,669	11,457.88	680,598,458	2.250	2025/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,770,000	12,012.44	693,118,296	11,787.09	680,115,606	2.000	2020/7/31	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	12,377.97	680,788,412	11,823.50	650,292,611	2.500	2023/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	12,567.95	728,941,370	11,187.36	648,866,983	2.875	2043/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,520,000	11,680.17	644,745,534	11,643.31	642,711,004	1.000	2018/5/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,170,000	12,607.53	651,809,713	12,261.25	633,907,131	3.125	2021/5/15	0.40
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,530,000	18,461.61	651,694,967	17,788.37	627,929,502	6.500	2027/11/1	0.39

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	99.03
合計	99.03

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	米ドル	売建	410,000.00	47,872,440	47,728,000	0.03
	ユーロ	売建	60,000.00	7,357,740	7,360,800	0.00
	デンマーククローネ	売建	320,000.00	5,278,880	5,280,000	0.00
	シンガポールドル	売建	139,000.00	11,179,881	11,197,840	0.01
	南アフリカランド	売建	760,000.00	6,494,276	6,505,600	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12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	メキシコ	244,558,891	9.35
	ブラジル	256,018,543	9.79
	チリ	9,180,558	0.35
	コロンビア	188,220,199	7.20
	ペルー	49,784,912	1.90
	トルコ	226,075,346	8.64
	ハンガリー	129,145,386	4.94
	ポーランド	252,212,853	9.64
	ロシア	161,061,385	6.16
	ルーマニア	78,673,232	3.01
	マレーシア	227,928,136	8.71
	タイ	187,385,498	7.16
	フィリピン	11,701,708	0.45
	インドネシア	253,213,972	9.68
南アフリカ	248,217,940	9.49	
	小計	2,523,378,559	96.47
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		92,228,215	3.53
合計（純資産総額）		2,615,606,774	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,450,000	934.02	41,563,899	946.20	42,106,072	10.500	2026/12/21	1.61
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	865,000,000	4.39	38,054,139	4.56	39,496,236	10.000	2024/7/24	1.51
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,220,000	360.16	36,808,627	346.80	35,443,095	3.650	2021/12/17	1.36
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	920,000	3,246.74	29,870,035	3,359.02	30,902,995	10.000	2023/1/1	1.18
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	9,050,000	348.27	31,518,435	341.24	30,882,390	3.875	2019/6/13	1.18
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	3,450,000,000	0.90	31,065,525	0.89	30,855,420	8.375	2024/3/15	1.18
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	3,290,000,000	0.91	30,055,934	0.89	29,485,525	8.375	2026/9/15	1.13
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,250,000	583.78	30,648,678	547.96	28,768,287	6.500	2021/6/10	1.10
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,410,000	709.95	31,308,875	650.19	28,673,687	10.000	2024/12/5	1.10
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	960,000	2,628.63	25,234,896	2,900.10	27,841,026		2019/1/1	1.06
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	625,000,000	4.35	27,215,833	4.40	27,511,225	11.000	2020/7/24	1.05
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	800,000	3,328.91	26,631,328	3,437.24	27,497,983	10.000	2021/1/1	1.05
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	7,080,000	424.56	30,059,313	384.12	27,196,025	4.875	2029/6/22	1.04
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	680,000,000	3.80	25,870,341	3.98	27,073,901	7.500	2026/8/26	1.04
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	830,000	2,909.13	24,145,778	3,127.64	25,959,438		2018/4/1	0.99
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,190,000	765.54	24,421,019	784.16	25,014,745	8.750	2048/2/28	0.96
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,310,000	604.66	26,060,932	579.41	24,972,690	8.500	2018/12/13	0.95
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,670,000	551.64	25,761,825	533.59	24,918,781	5.000	2019/12/11	0.95
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	950,000	2,355.55	22,377,727	2,600.05	24,700,559		2020/1/1	0.94
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	595,000,000	3.76	22,417,772	3.92	23,347,029	7.000	2022/5/4	0.89
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	6,570,000	382.21	25,111,471	354.04	23,260,431	3.850	2025/12/12	0.89
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	6,600,000	366.89	24,215,148	346.76	22,886,356	3.625	2023/6/16	0.87
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	870,000	2,673.24	23,257,222	2,556.87	22,244,811	2.500	2026/7/25	0.85
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	720,000	2,780.80	20,021,775	3,050.48	21,963,514		2018/7/1	0.84
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	820,000	2,720.11	22,304,915	2,669.23	21,887,696	1.750	2021/7/25	0.84
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	2,350,000,000	0.94	22,172,602	0.92	21,661,477	9.000	2029/3/15	0.83
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	780,000	2,864.67	22,344,460	2,748.96	21,441,951	3.250	2025/7/25	0.82

インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	2,380,000,000	0.90	21,500,710	0.89	21,275,312	8.250	2021/7/15	0.81
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	760,000	2,756.87	20,952,238	2,708.26	20,582,800	2.000	2021/4/25	0.79
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	750,000	2,740.90	20,556,760	2,705.19	20,288,973	1.500	2020/4/25	0.78

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.47
合計	96.47

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

参考情報

運用実績

2016年12月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額.....9,467円
純資産総額.....2.19億円

※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)

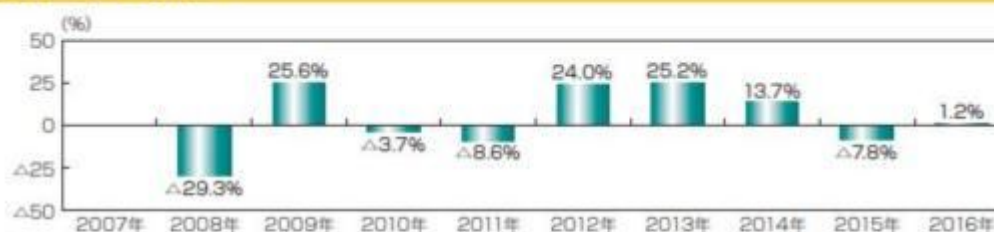
2016年8月	2016年9月	2016年10月	2016年11月	2016年12月	最近1年間累計	設定来累計
20円	20円	20円	20円	20円	240円	2,500円

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	3.8%
			三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	2.4%
			日本電信電話	日本	1.8%
			三井住友フィナンシャルグループ	日本	1.6%
			ソフトバンクグループ	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	27.0%	APPLE INC	アメリカ	2.0%
			MICROSOFT CORP	アメリカ	1.5%
			EXXON MOBIL CORP	アメリカ	1.2%
			JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	1.0%
			JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	1.0%
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	新興国株式	19.3%	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	3.7%
			TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	3.4%
			TENCENT HOLDINGS LTD	中国	3.4%
			ALIBABA GROUP HOLDING-SP-ADR	ケイマン諸島	2.4%
			NASPERS LTD-N SHS	南アフリカ	1.6%
日本債券インデックス マザーファンド	日本債券	2.9%	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	1.6%
			第123回利付国債(5年)	日本	1.5%
			第305回利付国債(10年)	日本	1.4%
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	27.3%	US TREASURY N/B(クーポン8%)	アメリカ	1.1%
			US TREASURY N/B(クーポン3.375%)	アメリカ	0.8%
			US TREASURY N/B(クーポン3.625%)	アメリカ	0.8%
			US TREASURY N/B(クーポン3.75%)	アメリカ	0.7%
			US TREASURY N/B(クーポン4%)	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	19.4%	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA(クーポン10.5%)	南アフリカ	1.6%
			TITULOS DE TESORERIA B(クーポン10%)	コロンビア	1.5%
			THAILAND GOVERNMENT BOND(クーポン3.65%)	タイ	1.4%
			NOTA DO TESOURO NACIONAL(クーポン10%)	ブラジル	1.2%
			THAILAND GOVERNMENT BOND(クーポン3.875%)	タイ	1.2%
現金その他		1.2%			

※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して計算しております。
 ※当ファンドにはベンチマークはありません。
 ※2008年は、設定時から2008年末までの騰落率です。

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
 ※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は、6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、平成28年6月28日から平成28年12月26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28年6月27日現在	当期 平成28年12月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,237,037	3,296,809
親投資信託受益証券	189,395,020	216,206,872
未収入金	-	2,514,248
流動資産合計	192,632,057	222,017,929
資産合計	192,632,057	222,017,929
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	464,942	462,812
未払解約金	-	2,529,924
未払受託者報酬	9,975	10,035
未払委託者報酬	199,756	200,874
未払利息	5	2
その他未払費用	99,883	196,837
流動負債合計	774,561	3,400,484
負債合計	774,561	3,400,484
純資産の部		
元本等		
元本	232,471,235	231,406,445
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	40,613,739	12,789,000
（分配準備積立金）	55,540,985	53,254,496
元本等合計	191,857,496	218,617,445
純資産合計	191,857,496	218,617,445
負債純資産合計	192,632,057	222,017,929

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 平成27年12月26日 至 平成28年6月27日	当期 自 平成28年6月28日 至 平成28年12月26日
営業収益		
受取利息	170	-
有価証券売買等損益	26,315,188	32,041,764

	前期		当期	
	自	平成27年12月26日 平成28年 6月27日	自	平成28年 6月28日 平成28年12月26日
営業収益合計		26,315,018		32,041,764
営業費用				
支払利息		300		428
受託者報酬		56,383		55,254
委託者報酬		1,128,753		1,106,344
その他費用		104,389		102,310
営業費用合計		1,289,825		1,264,336
営業利益又は営業損失（ ）		27,604,843		30,777,428
経常利益又は経常損失（ ）		27,604,843		30,777,428
当期純利益又は当期純損失（ ）		27,604,843		30,777,428
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（ ）		174,623		192,705
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		9,535,873		40,613,739
剰余金増加額又は欠損金減少額		504,389		1,091,290
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		504,389		1,091,290
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,384,758		1,056,717
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,384,758		1,056,717
分配金		2,767,277		2,794,557
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		40,613,739		12,789,000

(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いたしますので、当特定期間は平成28年 6月28日から平成28年12月26日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

		前期	当期
		平成28年 6月27日現在	平成28年12月26日現在
1.	期首元本額	223,573,148円	232,471,235円
	期中追加設定元本額	14,202,130円	8,626,944円
	期中一部解約元本額	5,304,043円	9,691,734円
2.	受益権の総数	232,471,235口	231,406,445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	40,613,739円	12,789,000円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 平成27年12月26日 至 平成28年 6月27日		当期 自 平成28年 6月28日 至 平成28年12月26日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
自 平成27年12月26日		自 平成28年 6月28日	
至 平成28年 1月25日		至 平成28年 7月25日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	240,433円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益
			578,351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	13,532,644円	C 信託約款に定める収益調整金
			17,517,965円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	56,912,607円	D 信託約款に定める分配準備積立 金
			55,180,678円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	70,685,684円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)
			73,276,994円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,145円	F 分配対象収益(1万口当たり)
			3,152円
G	分配金額	449,427円	G 分配金額
			464,882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28年 1月26日		自 平成28年 7月26日	
至 平成28年 2月25日		至 平成28年 8月25日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	369,834円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益
			331,970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	13,974,852円	C 信託約款に定める収益調整金
			17,826,336円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	56,648,490円	D 信託約款に定める分配準備積立 金
			54,807,882円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	70,993,176円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)
			72,966,188円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,142円	F 分配対象収益(1万口当たり)
			3,147円
G	分配金額	451,890円	G 分配金額
			463,712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28年 2月26日		自 平成28年 8月26日	
至 平成28年 3月25日		至 平成28年 9月26日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	575,748円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益
			403,243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	16,142,890円	C 信託約款に定める収益調整金
			18,274,280円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	56,562,733円	D 信託約款に定める分配準備積立 金
			54,653,179円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	73,281,371円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)
			73,330,702円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,147円	F 分配対象収益(1万口当たり)
			3,144円
G	分配金額	465,682円	G 分配金額
			466,420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28年 3月26日		自 平成28年 9月27日	
至 平成28年 4月25日		至 平成28年10月25日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	548,814円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益
			459,280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	16,573,968円	C	信託約款に定める収益調整金	18,629,035円
D	信託約款に定める分配準備積立金	56,633,545円	D	信託約款に定める分配準備積立金	54,321,018円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	73,756,327円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	73,409,333円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,150円	F	分配対象収益(1万口当たり)	3,144円
G	分配金額	468,174円	G	分配金額	466,950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28年 4月26日			自 平成28年10月26日	
	至 平成28年 5月25日			至 平成28年11月25日	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	433,497円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	489,044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	16,887,434円	C	信託約款に定める収益調整金	19,072,102円
D	信託約款に定める分配準備積立金	56,247,646円	D	信託約款に定める分配準備積立金	54,313,348円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	73,568,577円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	73,874,494円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,149円	F	分配対象収益(1万口当たり)	3,145円
G	分配金額	467,162円	G	分配金額	469,781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28年 5月26日			自 平成28年11月26日	
	至 平成28年 6月27日			至 平成28年12月26日	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	408,068円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	489,557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	17,162,803円	C	信託約款に定める収益調整金	19,097,053円
D	信託約款に定める分配準備積立金	55,597,859円	D	信託約款に定める分配準備積立金	53,227,751円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	73,168,730円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	72,814,361円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,147円	F	分配対象収益(1万口当たり)	3,146円
G	分配金額	464,942円	G	分配金額	462,812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12月26日 至 平成28年 6月27日	当期 自 平成28年 6月28日 至 平成28年12月26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28年 6月27日現在	当期 平成28年12月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

前期（平成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

当期（平成28年12月26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	7,818,931
合計	7,818,931

（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28年 6月27日現在		当期 平成28年12月26日現在	
1口当たり純資産額	0.8253円	1口当たり純資産額	0.9447円
(1万口当たり純資産額)	(8,253円)	(1万口当たり純資産額)	(9,447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	28,616,258	59,541,848	
	日本債券インデックスマザーファンド	4,610,364	6,388,120	

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	27,026,652	59,647,820	
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	4,894,926	6,518,083	
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	28,859,789	41,705,281	
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	34,383,946	42,405,720	
合計	128,391,935	216,206,872	

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

（参考）

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

貸借対照表

	（単位：円）	
	平成28年 6月27日現在	平成28年12月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	150,782,868	48,360,215
株式	23,417,541,340	26,988,375,700
派生商品評価勘定	-	973,380
未収入金	-	163,576,710
未収配当金	97,523,248	1,933,900
前払金	26,515,000	-
流動資産合計	23,692,362,456	27,203,219,905
資産合計	23,692,362,456	27,203,219,905
負債の部		

	平成28年 6月27日現在	平成28年12月26日現在
流動負債		
派生商品評価勘定	18,334,720	25,540
前受金	-	1,140,000
未払金	2,502,160	-
未払解約金	8,444,541	123,696,719
未払利息	241	42
流動負債合計	29,281,662	124,862,301
負債合計	29,281,662	124,862,301
純資産の部		
元本等		
元本	22,534,437,913	20,334,605,022
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,128,642,881	6,743,752,582
元本等合計	23,663,080,794	27,078,357,604
純資産合計	23,663,080,794	27,078,357,604
負債純資産合計	23,692,362,456	27,203,219,905

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	平成28年 6月27日現在	平成28年12月26日現在
1. 期首	平成27年12月26日	平成28年 6月28日
期首元本額	20,794,371,054円	22,534,437,913円
期首からの追加設定元本額	3,035,797,717円	723,053,386円
期首からの一部解約元本額	1,295,730,858円	2,922,886,277円
元本の内訳		
DCインデックスバランス（株式20）	233,880,475円	237,016,975円
DCインデックスバランス（株式40）	832,600,883円	776,652,933円

DCインデックスバランス(株式60)	1,510,872,965円	1,454,913,172円
DCインデックスバランス(株式80)	1,654,317,998円	1,646,787,230円
インデックスファンド日本株式(DC専用)	1,296,825,433円	1,279,193,123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	5,741,871,154円	4,914,473,675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	5,411,194円	4,894,926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)	4,150,364円	4,079,233円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	67,090,469円	59,442,609円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	56,561,448円	48,624,509円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	83,325,527円	70,440,839円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	107,845,703円	90,793,256円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	7,086,486,959円	6,211,833,000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)	18,158,754円	16,821,844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)	44,117,367円	37,879,274円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	41,541,362円	33,832,071円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	313,667,912円	274,997,182円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	946,775,402円	831,830,984円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	1,274,629,281円	1,155,868,643円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	1,214,307,263円	1,184,229,544円
計	22,534,437,913円	20,334,605,022円
2. 受益権の総数	22,534,437,913口	20,334,605,022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	327,950,000円	446,795,000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12月26日 至平成28年6月27日	自平成28年6月28日 至平成28年12月26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28年 6月27日現在	平成28年12月26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

（平成28年12月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	2,721,511,773
合計	2,721,511,773

(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	240,085,000	-	221,760,000	18,325,000
合計		240,085,000	-	221,760,000	18,325,000

（平成28年12月26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	60,410,000	-	61,360,000	950,000
合計		60,410,000	-	61,360,000	950,000

（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28年 6月27日現在		平成28年12月26日現在	
1口当たり純資産額	1.0501円	1口当たり純資産額	1.3316円
(1万口当たり純資産額)	(10,501円)	(1万口当たり純資産額)	(13,316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	500	2,734.00	1,367,000	
日本水産	17,500	555.00	9,712,500	
マルハニチロ	2,600	3,115.00	8,099,000	
カネコ種苗	500	1,584.00	792,000	
サカタのタネ	2,000	3,330.00	6,660,000	
ホクト	1,400	2,154.00	3,015,600	
ホクリヨウ	200	749.00	149,800	
住石ホールディングス	3,800	96.00	364,800	
日鉄鉱業	400	5,600.00	2,240,000	
三井松島産業	800	1,325.00	1,060,000	
国際石油開発帝石	71,000	1,200.50	85,235,500	
日本海洋掘削	500	2,444.00	1,222,000	
石油資源開発	2,100	2,636.00	5,535,600	
K & O エナジーグループ	900	1,882.00	1,693,800	
ショーボンドホールディングス	1,400	4,995.00	6,993,000	
ミライト・ホールディングス	4,200	1,033.00	4,338,600	
サンヨーホームズ	300	651.00	195,300	
ダイセキ環境ソリューション	300	1,355.00	406,500	
安藤・間	9,700	778.00	7,546,600	
東急建設	4,800	938.00	4,502,400	

コムシスホールディングス	5,300	2,126.00	11,267,800
ミサワホーム	1,600	989.00	1,582,400
高松コンストラクショングループ	1,000	2,490.00	2,490,000
東建コーポレーション	600	8,540.00	5,124,000
ソネック	200	627.00	125,400
ヤマウラ	700	556.00	389,200
大成建設	69,000	828.00	57,132,000
大林組	40,400	1,131.00	45,692,400
清水建設	41,000	1,089.00	44,649,000
飛鳥建設	13,100	187.00	2,449,700
長谷工コーポレーション	15,700	1,202.00	18,871,400
松井建設	1,500	1,077.00	1,615,500
銭高組	2,000	495.00	990,000
鹿島建設	59,000	807.00	47,613,000
不動テトラ	11,000	210.00	2,310,000
大末建設	500	922.00	461,000
鉄建建設	8,000	343.00	2,744,000
西松建設	15,000	574.00	8,610,000
三井住友建設	51,800	125.00	6,475,000
大豊建設	5,000	565.00	2,825,000
前田建設工業	8,000	1,028.00	8,224,000
ナカノフドー建設	1,100	619.00	680,900
奥村組	11,000	663.00	7,293,000
東鉄工業	1,600	3,050.00	4,880,000
イチケン	1,000	413.00	413,000
浅沼組	4,000	392.00	1,568,000
戸田建設	16,000	627.00	10,032,000
熊谷組	21,000	302.00	6,342,000
青木あすなろ建設	900	773.00	695,700
北野建設	3,000	325.00	975,000
植木組	2,000	260.00	520,000
三井ホーム	2,000	508.00	1,016,000
矢作建設工業	1,800	1,062.00	1,911,600
ピーエス三菱	1,500	393.00	589,500
日本ハウスホールディングス	2,800	501.00	1,402,800
大東建託	5,000	17,440.00	87,200,000
新日本建設	1,600	943.00	1,508,800
N I P P O	3,000	2,197.00	6,591,000
東亜道路工業	3,000	347.00	1,041,000
前田道路	4,000	1,945.00	7,780,000
日本道路	4,000	464.00	1,856,000
東亜建設工業	1,100	2,018.00	2,219,800
若築建設	8,000	156.00	1,248,000

東洋建設	3,900	413.00	1,610,700
五洋建設	15,000	561.00	8,415,000
大林道路	1,400	721.00	1,009,400
福田組	2,000	1,249.00	2,498,000
住友林業	9,300	1,573.00	14,628,900
日本基礎技術	1,500	360.00	540,000
日成ビルド工業	4,000	536.00	2,144,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	7,000	79.00	553,000
巴コーポレーション	1,700	357.00	606,900
パナホーム	5,000	974.00	4,870,000
大和ハウス工業	39,800	3,263.00	129,867,400
ライト工業	2,600	1,219.00	3,169,400
積水ハウス	42,400	1,956.00	82,934,400
日特建設	1,200	471.00	565,200
北陸電気工事	700	852.00	596,400
ユアテック	2,000	795.00	1,590,000
西部電気工業	200	2,204.00	440,800
四電工	1,000	443.00	443,000
中電工	1,700	2,570.00	4,369,000
関電工	6,000	1,048.00	6,288,000
きんでん	9,000	1,465.00	13,185,000
東京エネシス	1,000	1,028.00	1,028,000
トーエネック	2,000	578.00	1,156,000
住友電設	1,000	1,283.00	1,283,000
日本電設工業	2,200	1,907.00	4,195,400
協和エクシオ	5,300	1,686.00	8,935,800
新日本空調	1,100	1,277.00	1,404,700
NDS	200	2,891.00	578,200
九電工	2,600	3,080.00	8,008,000
三機工業	3,000	987.00	2,961,000
日揮	12,600	2,127.00	26,800,200
中外炉工業	4,000	225.00	900,000
ヤマト	1,200	568.00	681,600
太平電業	2,000	1,144.00	2,288,000
高砂熱学工業	3,700	1,508.00	5,579,600
三晃金属工業	100	3,160.00	316,000
朝日工業社	300	2,962.00	888,600
明星工業	2,500	578.00	1,445,000
大気社	1,800	2,826.00	5,086,800
ダイダン	2,000	972.00	1,944,000
日比谷総合設備	1,500	1,677.00	2,515,500
東芝プラントシステム	2,200	1,682.00	3,700,400
東洋エンジニアリング	8,000	310.00	2,480,000

千代田化工建設	10,000	830.00	8,300,000
新興プランテック	2,800	848.00	2,374,400
日本製粉	4,000	1,606.00	6,424,000
日清製粉グループ本社	14,800	1,763.00	26,092,400
日東富士製粉	100	3,815.00	381,500
昭和産業	6,000	610.00	3,660,000
鳥越製粉	1,100	826.00	908,600
中部飼料	1,500	1,014.00	1,521,000
フィード・ワン	8,100	154.00	1,247,400
東洋精糖	2,000	115.00	230,000
日本甜菜製糖	700	2,299.00	1,609,300
三井製糖	1,000	2,508.00	2,508,000
塩水港精糖	1,500	242.00	363,000
日新製糖	600	1,653.00	991,800
森永製菓	2,600	4,835.00	12,571,000
中村屋	300	4,900.00	1,470,000
江崎グリコ	3,400	5,370.00	18,258,000
名糖産業	600	1,383.00	829,800
不二家	8,000	227.00	1,816,000
山崎製パン	9,900	2,299.00	22,760,100
第一屋製パン	2,000	139.00	278,000
モロゾフ	2,000	489.00	978,000
亀田製菓	800	5,360.00	4,288,000
寿スピリッツ	1,000	2,795.00	2,795,000
カルビー	5,500	3,685.00	20,267,500
森永乳業	12,000	824.00	9,888,000
六甲バター	600	2,583.00	1,549,800
ヤクルト本社	7,200	5,370.00	38,664,000
明治ホールディングス	8,000	9,170.00	73,360,000
雪印メグミルク	2,900	3,225.00	9,352,500
プリマハム	9,000	408.00	3,672,000
日本ハム	9,000	3,135.00	28,215,000
林兼産業	500	860.00	430,000
丸大食品	6,000	491.00	2,946,000
S Foods	700	2,953.00	2,067,100
伊藤ハム米久ホールディングス	7,800	1,082.00	8,439,600
サッポロホールディングス	4,400	3,050.00	13,420,000
アサヒグループホールディングス	25,300	3,721.00	94,141,300
キリンホールディングス	58,000	1,948.00	112,984,000
宝ホールディングス	9,800	1,047.00	10,260,600
オエノンホールディングス	4,000	272.00	1,088,000
養命酒製造	400	1,860.00	744,000
コカ・コーラウエスト	4,600	3,460.00	15,916,000

コカ・コーライーストジャパン	5,200	2,575.00	13,390,000
サントリー食品インターナショナル	9,200	4,915.00	45,218,000
ダイトードリンク	600	5,880.00	3,528,000
伊藤園	4,000	3,805.00	15,220,000
キーコーヒー	1,200	2,169.00	2,602,800
ユニカフェ	400	1,034.00	413,600
ジャパンフーズ	200	1,229.00	245,800
日清オイリオグループ	8,000	532.00	4,256,000
不二製油グループ本社	3,600	2,285.00	8,226,000
かどや製油	100	3,635.00	363,500
J・オイルミルズ	600	3,840.00	2,304,000
キッコーマン	9,000	3,765.00	33,885,000
味の素	27,700	2,385.50	66,078,350
キューピー	6,900	2,802.00	19,333,800
ハウス食品グループ本社	5,000	2,438.00	12,190,000
カゴメ	4,800	2,907.00	13,953,600
焼津水産化学工業	700	1,080.00	756,000
アリアケジャパン	1,100	6,160.00	6,776,000
ピエトロ	200	1,605.00	321,000
エバラ食品工業	300	2,044.00	613,200
ニチレイ	6,600	2,411.00	15,912,600
東洋水産	6,600	4,175.00	27,555,000
イトアンド	200	2,146.00	429,200
日清食品ホールディングス	5,300	6,050.00	32,065,000
永谷園ホールディングス	1,000	1,354.00	1,354,000
一正蒲鉾	500	1,132.00	566,000
フジッコ	1,300	2,413.00	3,136,900
ロック・フィールド	1,400	1,566.00	2,192,400
日本たばこ産業	74,700	3,935.00	293,944,500
ケンコーマヨネーズ	500	3,300.00	1,650,000
わらべや日洋ホールディングス	800	2,471.00	1,976,800
なとり	700	1,842.00	1,289,400
北の達人コーポレーション	300	479.00	143,700
ユーグレナ	4,300	1,270.00	5,461,000
ミヨシ油脂	5,000	145.00	725,000
理研ビタミン	400	4,870.00	1,948,000
片倉工業	1,600	1,435.00	2,296,000
グンゼ	9,000	380.00	3,420,000
東洋紡	50,000	172.00	8,600,000
ユニチカ	35,000	83.00	2,905,000
富士紡ホールディングス	600	3,275.00	1,965,000
倉敷紡績	13,000	225.00	2,925,000
シキボウ	7,000	142.00	994,000

日本毛織	3,500	869.00	3,041,500
ダイトウボウ	2,000	73.00	146,000
トーア紡コーポレーション	600	578.00	346,800
ガイドーリミテッド	1,400	404.00	565,600
帝国繊維	1,300	1,630.00	2,119,000
帝人	10,300	2,368.00	24,390,400
東レ	91,000	978.40	89,034,400
サカイオーベックス	300	1,768.00	530,400
住江織物	3,000	258.00	774,000
日本フェルト	700	513.00	359,100
イチカワ	1,000	294.00	294,000
日東製網	100	2,111.00	211,100
アツギ	10,000	123.00	1,230,000
ダイニック	3,000	175.00	525,000
セーレン	3,100	1,447.00	4,485,700
ソトー	500	1,131.00	565,500
東海染工	2,000	142.00	284,000
小松精練	1,800	752.00	1,353,600
ワコールホールディングス	8,000	1,376.00	11,008,000
ホギメディカル	800	7,030.00	5,624,000
レナウン	3,500	114.00	399,000
クラウディア	300	521.00	156,300
T S Iホールディングス	5,200	709.00	3,686,800
三陽商会	7,000	176.00	1,232,000
ナイガイ	5,000	61.00	305,000
オンワードホールディングス	8,000	815.00	6,520,000
ルック	2,000	173.00	346,000
キムラタン	54,000	7.00	378,000
ゴールドウイン	500	5,280.00	2,640,000
デサント	2,900	1,330.00	3,857,000
キング	600	397.00	238,200
ヤマトインターナショナル	700	402.00	281,400
特種東海製紙	700	3,955.00	2,768,500
王子ホールディングス	49,000	488.00	23,912,000
日本製紙	5,600	2,010.00	11,256,000
三菱製紙	1,800	755.00	1,359,000
北越紀州製紙	7,000	685.00	4,795,000
中越パルプ工業	5,000	239.00	1,195,000
巴川製紙所	2,000	227.00	454,000
大王製紙	5,000	1,276.00	6,380,000
阿波製紙	200	607.00	121,400
レンゴー	12,100	668.00	8,082,800
トーモク	4,000	327.00	1,308,000

ザ・パックス	900	2,689.00	2,420,100
クラレ	21,200	1,757.00	37,248,400
旭化成	78,000	1,038.00	80,964,000
共和レザー	700	842.00	589,400
昭和電工	8,400	1,739.00	14,607,600
住友化学	93,000	573.00	53,289,000
日本化成	2,000	162.00	324,000
住友精化	500	4,615.00	2,307,500
日産化学工業	6,900	3,930.00	27,117,000
ラサ工業	5,000	135.00	675,000
クレハ	1,000	4,405.00	4,405,000
多木化学	1,000	870.00	870,000
テイカ	2,000	641.00	1,282,000
石原産業	2,300	946.00	2,175,800
片倉コープアグリ	1,000	227.00	227,000
日東エフシー	700	917.00	641,900
日本曹達	8,000	552.00	4,416,000
東ソー	37,000	836.00	30,932,000
トクヤマ	20,000	454.00	9,080,000
セントラル硝子	13,000	551.00	7,163,000
東亜合成	7,900	1,175.00	9,282,500
大阪ソーダ	6,000	476.00	2,856,000
関東電化工業	2,000	1,047.00	2,094,000
デンカ	26,000	519.00	13,494,000
信越化学工業	22,600	9,281.00	209,750,600
日本カーバイド工業	5,000	152.00	760,000
堺化学工業	5,000	389.00	1,945,000
エア・ウォーター	10,400	2,129.00	22,141,600
大陽日酸	9,700	1,399.00	13,570,300
日本化学工業	5,000	241.00	1,205,000
日本パーカライズン	6,400	1,378.00	8,819,200
高圧ガス工業	1,900	762.00	1,447,800
四国化成工業	2,000	1,053.00	2,106,000
戸田工業	2,000	281.00	562,000
ステラ ケミファ	600	3,285.00	1,971,000
保土谷化学工業	400	2,716.00	1,086,400
日本触媒	2,000	7,440.00	14,880,000
大日精化工業	5,000	632.00	3,160,000
カネカ	17,000	976.00	16,592,000
三菱瓦斯化学	11,700	1,992.00	23,306,400
三井化学	57,000	531.00	30,267,000
J S R	12,600	1,859.00	23,423,400
東京応化工業	2,300	3,955.00	9,096,500

大阪有機化学工業	800	958.00	766,400
三菱ケミカルホールディングス	84,300	774.80	65,315,640
KHネオケム	1,600	1,294.00	2,070,400
ダイセル	17,000	1,314.00	22,338,000
住友ベークライト	11,000	668.00	7,348,000
積水化学工業	28,600	1,833.00	52,423,800
日本ゼオン	11,000	1,148.00	12,628,000
アイカ工業	4,000	3,095.00	12,380,000
宇部興産	63,000	248.00	15,624,000
積水樹脂	1,900	1,837.00	3,490,300
タキロン	3,000	524.00	1,572,000
旭有機材	4,000	220.00	880,000
日立化成	7,000	2,905.00	20,335,000
ニチバン	1,000	835.00	835,000
リケンテクノス	2,700	533.00	1,439,100
大倉工業	3,000	506.00	1,518,000
積水化成成品工業	1,800	813.00	1,463,400
群栄化学工業	300	3,255.00	976,500
タイガースポリマー	600	794.00	476,400
ミライアル	500	947.00	473,500
ダイキアクシス	200	1,166.00	233,200
ダイキョーニシカワ	2,200	1,443.00	3,174,600
日本化薬	8,000	1,445.00	11,560,000
カーリットホールディングス	1,200	552.00	662,400
日本精化	1,000	908.00	908,000
扶桑化学工業	900	2,499.00	2,249,100
ADEKA	5,400	1,586.00	8,564,400
日油	10,000	1,121.00	11,210,000
新日本理化	2,000	156.00	312,000
ハリマ化成グループ	1,100	750.00	825,000
花王	32,000	5,626.00	180,032,000
第一工業製薬	3,000	378.00	1,134,000
ニイタカ	200	1,443.00	288,600
三洋化成工業	800	5,040.00	4,032,000
有機合成薬品工業	800	249.00	199,200
大日本塗料	7,000	246.00	1,722,000
日本ペイントホールディングス	9,700	3,175.00	30,797,500
関西ペイント	13,200	2,154.00	28,432,800
神東塗料	1,000	223.00	223,000
中国塗料	3,600	866.00	3,117,600
日本特殊塗料	900	1,730.00	1,557,000
藤倉化成	1,700	670.00	1,139,000
太陽ホールディングス	1,000	4,585.00	4,585,000

D I C	5,000	3,655.00	18,275,000
サカティクス	2,600	1,446.00	3,759,600
東洋インキSCホールディングス	12,000	537.00	6,444,000
T & K T O K A	900	1,009.00	908,100
富士フィルムホールディングス	25,000	4,504.00	112,600,000
資生堂	23,900	2,999.00	71,676,100
ライオン	16,000	1,902.00	30,432,000
高砂香料工業	800	3,145.00	2,516,000
マンダム	1,300	5,040.00	6,552,000
ミルボン	700	4,395.00	3,076,500
ファンケル	2,700	1,639.00	4,425,300
コーセー	2,000	9,810.00	19,620,000
コタ	500	1,286.00	643,000
シーズ・ホールディングス	1,600	3,310.00	5,296,000
シーボン	100	2,374.00	237,400
ポーラ・オルビスホールディングス	1,300	9,760.00	12,688,000
ノエビアホールディングス	800	3,770.00	3,016,000
アジュバンコスメジャパン	300	921.00	276,300
エステー	900	1,481.00	1,332,900
アグロ カネショウ	500	1,178.00	589,000
コニシ	2,000	1,267.00	2,534,000
長谷川香料	1,600	1,988.00	3,180,800
星光PMC	700	1,177.00	823,900
小林製薬	3,500	5,120.00	17,920,000
荒川化学工業	1,100	1,798.00	1,977,800
メック	1,000	933.00	933,000
日本高純度化学	300	2,444.00	733,200
タカラバイオ	2,700	1,425.00	3,847,500
J C U	400	5,590.00	2,236,000
新田ゼラチン	800	721.00	576,800
O A T アグリオ	200	1,375.00	275,000
デクセリアルズ	3,300	1,144.00	3,775,200
アース製薬	900	4,950.00	4,455,000
イハラケミカル工業	1,700	1,131.00	1,922,700
北興化学工業	1,000	458.00	458,000
大成ラミック	400	3,135.00	1,254,000
クミアイ化学工業	2,600	711.00	1,848,600
日本農薬	2,900	637.00	1,847,300
アキレス	1,000	1,589.00	1,589,000
有沢製作所	2,100	645.00	1,354,500
日東電工	9,100	9,096.00	82,773,600
レック	400	3,170.00	1,268,000
きもと	2,300	249.00	572,700

藤森工業	900	2,935.00	2,641,500	
前澤化成工業	800	1,179.00	943,200	
J S P	600	2,749.00	1,649,400	
エフピコ	1,100	5,370.00	5,907,000	
天馬	800	2,019.00	1,615,200	
信越ポリマー	2,500	905.00	2,262,500	
東リ	3,000	368.00	1,104,000	
ニフコ	2,200	6,160.00	13,552,000	
日本バルカー工業	1,000	1,549.00	1,549,000	
ユニ・チャーム	25,500	2,569.00	65,509,500	
協和発酵キリン	15,100	1,632.00	24,643,200	
武田薬品工業	47,200	4,855.00	229,156,000	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	128,600	1,634.00	210,132,400	
大日本住友製薬	8,900	1,989.00	17,702,100	
塩野義製薬	17,000	5,551.00	94,367,000	
田辺三菱製薬	14,700	2,291.00	33,677,700	
わかもと製薬	2,000	241.00	482,000	
あすか製薬	1,400	1,662.00	2,326,800	
日本新薬	2,900	5,700.00	16,530,000	
ピオフェルミン製薬	200	2,918.00	583,600	
中外製薬	12,500	3,460.00	43,250,000	
科研製薬	2,400	6,180.00	14,832,000	
エーザイ	15,500	6,777.00	105,043,500	
ロート製薬	6,200	1,845.00	11,439,000	
小野薬品工業	28,600	2,453.00	70,155,800	
久光製薬	3,500	5,730.00	20,055,000	
持田製薬	900	8,070.00	7,263,000	
参天製薬	23,200	1,419.00	32,920,800	
扶桑薬品工業	400	2,750.00	1,100,000	
日本ケミファ	200	5,490.00	1,098,000	
ツムラ	4,200	3,280.00	13,776,000	
日医工	2,900	1,683.00	4,880,700	
キッセイ薬品工業	2,200	2,851.00	6,272,200	
生化学工業	2,300	1,689.00	3,884,700	
栄研化学	1,100	3,045.00	3,349,500	
日水製薬	500	1,293.00	646,500	
鳥居薬品	900	2,591.00	2,331,900	
J C R ファーマ	1,000	2,629.00	2,629,000	
東和薬品	600	4,630.00	2,778,000	
富士製薬工業	400	2,658.00	1,063,200	
沢井製薬	2,100	6,280.00	13,188,000	
ゼリア新薬工業	2,600	1,780.00	4,628,000	
第一三共	37,100	2,390.00	88,669,000	

キョーリン製薬ホールディングス	3,100	2,463.00	7,635,300
大幸薬品	600	1,799.00	1,079,400
ダイト	600	2,259.00	1,355,400
大塚ホールディングス	27,100	5,080.00	137,668,000
大正製薬ホールディングス	2,700	9,720.00	26,244,000
ペプチドリーム	2,100	5,580.00	11,718,000
日本コークス工業	10,300	112.00	1,153,600
昭和シェル石油	11,300	1,127.00	12,735,100
ニチレキ	1,600	914.00	1,462,400
東燃ゼネラル石油	20,000	1,256.00	25,120,000
ユシロ化学工業	700	1,443.00	1,010,100
ピーピー・カストロール	500	1,531.00	765,500
富士石油	3,000	395.00	1,185,000
MORESCO	500	1,535.00	767,500
出光興産	6,000	3,085.00	18,510,000
JXホールディングス	139,700	496.30	69,333,110
コスモエネルギーホールディングス	3,800	1,665.00	6,327,000
横浜ゴム	7,600	2,140.00	16,264,000
東洋ゴム工業	6,700	1,496.00	10,023,200
ブリヂストン	42,500	4,368.00	185,640,000
住友ゴム工業	11,800	1,894.00	22,349,200
藤倉ゴム工業	1,100	676.00	743,600
オカモト	4,000	1,063.00	4,252,000
フコク	500	920.00	460,000
ニッタ	1,100	3,150.00	3,465,000
住友理工	2,300	1,123.00	2,582,900
三ツ星ベルト	3,000	980.00	2,940,000
バンドー化学	2,300	1,026.00	2,359,800
日東紡績	10,000	450.00	4,500,000
旭硝子	62,000	814.00	50,468,000
日本板硝子	5,800	867.00	5,028,600
石塚硝子	2,000	197.00	394,000
日本山村硝子	5,000	205.00	1,025,000
日本電気硝子	26,000	641.00	16,666,000
オハラ	500	813.00	406,500
住友大阪セメント	23,000	446.00	10,258,000
太平洋セメント	76,000	375.00	28,500,000
日本ヒューム	1,200	714.00	856,800
日本コンクリート工業	2,900	349.00	1,012,100
三谷セキサン	600	3,005.00	1,803,000
アジアパイルホールディングス	1,600	529.00	846,400
東海カーボン	12,000	384.00	4,608,000
日本カーボン	6,000	236.00	1,416,000

東洋炭素	700	1,856.00	1,299,200
ノリタケカンパニーリミテド	700	2,759.00	1,931,300
TOTO	9,300	4,615.00	42,919,500
日本碍子	15,900	2,312.00	36,760,800
日本特殊陶業	10,900	2,631.00	28,677,900
ダントーホールディングス	1,000	190.00	190,000
MARUWA	500	3,870.00	1,935,000
品川リフラクトリーズ	3,000	239.00	717,000
黒崎播磨	3,000	307.00	921,000
ヨータイ	1,000	341.00	341,000
イソライト工業	600	276.00	165,600
東京窯業	1,600	188.00	300,800
ニッカトー	400	411.00	164,400
フジインコーポレーテッド	1,100	2,186.00	2,404,600
エーアンドエーマテリアル	3,000	127.00	381,000
ニチアス	7,000	1,104.00	7,728,000
ニチハ	1,700	2,800.00	4,760,000
新日鐵住金	56,800	2,665.50	151,400,400
神戸製鋼所	21,800	1,155.00	25,179,000
合同製鐵	700	2,125.00	1,487,500
ジェイ エフ イー ホールディングス	34,400	1,822.50	62,694,000
日新製鋼	5,800	1,424.00	8,259,200
東京製鐵	6,400	898.00	5,747,200
共英製鋼	1,400	2,182.00	3,054,800
大和工業	2,500	3,270.00	8,175,000
東京鐵鋼	3,000	475.00	1,425,000
大阪製鐵	800	2,118.00	1,694,400
淀川製鋼所	1,700	3,045.00	5,176,500
東洋鋼鈹	3,100	362.00	1,122,200
丸一鋼管	4,200	3,785.00	15,897,000
モリ工業	400	1,967.00	786,800
大同特殊鋼	21,000	487.00	10,227,000
日本高周波鋼業	5,000	87.00	435,000
日本冶金工業	10,500	192.00	2,016,000
山陽特殊製鋼	7,000	556.00	3,892,000
愛知製鋼	700	4,945.00	3,461,500
日立金属	12,800	1,551.00	19,852,800
日本金属	300	1,276.00	382,800
大平洋金属	8,000	378.00	3,024,000
新日本電工	7,200	247.00	1,778,400
栗本鐵工所	500	2,289.00	1,144,500
虹技	2,000	262.00	524,000
日本鑄鉄管	1,000	193.00	193,000

三菱製鋼	9,000	230.00	2,070,000
日亜鋼業	1,800	279.00	502,200
日本精線	1,000	559.00	559,000
シンニッタン	1,100	668.00	734,800
新家工業	3,000	159.00	477,000
大紀アルミニウム工業所	2,000	515.00	1,030,000
日本軽金属ホールディングス	28,600	248.00	7,092,800
三井金属鉱業	34,000	295.00	10,030,000
東邦亜鉛	7,000	458.00	3,206,000
三菱マテリアル	7,800	3,630.00	28,314,000
住友金属鉱山	32,000	1,512.50	48,400,000
D O W Aホールディングス	14,000	901.00	12,614,000
古河機械金属	20,000	215.00	4,300,000
エス・サイエンス	5,800	37.00	214,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,400	1,623.00	2,272,200
東邦チタニウム	2,200	783.00	1,722,600
U A C J	16,000	320.00	5,120,000
古河電気工業	4,200	3,355.00	14,091,000
住友電気工業	47,400	1,693.00	80,248,200
フジクラ	16,600	637.00	10,574,200
昭和電線ホールディングス	15,000	88.00	1,320,000
タツタ電線	2,400	457.00	1,096,800
沖電線	1,000	234.00	234,000
カナレ電気	200	2,116.00	423,200
平河ヒューテック	600	1,200.00	720,000
リョービ	8,000	466.00	3,728,000
アーレスティ	1,500	1,302.00	1,953,000
アサヒホールディングス	1,900	2,029.00	3,855,100
稲葉製作所	700	1,336.00	935,200
宮地エンジニアリンググループ	4,000	193.00	772,000
トーカロ	800	2,598.00	2,078,400
アルファC o	400	1,110.00	444,000
S U M C O	13,100	1,557.00	20,396,700
川田テクノロジーズ	200	6,880.00	1,376,000
東洋製罐グループホールディングス	8,900	2,200.00	19,580,000
ホッカンホールディングス	2,000	458.00	916,000
コロナ	700	1,165.00	815,500
横河ブリッジホールディングス	2,200	1,362.00	2,996,400
駒井ハルテック	300	2,123.00	636,900
高田機工	1,000	229.00	229,000
三和ホールディングス	12,500	1,114.00	13,925,000
文化シャッター	3,500	915.00	3,202,500
三協立山	1,700	1,626.00	2,764,200

アルインコ	900	1,045.00	940,500
東洋シャッター	300	612.00	183,600
L I X I Lグループ	17,500	2,700.00	47,250,000
日本フィルコン	900	576.00	518,400
ノーリツ	2,500	2,039.00	5,097,500
長府製作所	1,300	2,719.00	3,534,700
リンナイ	2,100	9,480.00	19,908,000
ダイニチ工業	700	716.00	501,200
日東精工	1,800	422.00	759,600
三洋工業	2,000	198.00	396,000
岡部	2,600	988.00	2,568,800
ジーテクト	1,300	2,339.00	3,040,700
中国工業	200	703.00	140,600
東プレ	2,400	2,940.00	7,056,000
高周波熱錬	2,400	898.00	2,155,200
東京製綱	900	1,952.00	1,756,800
サンコール	700	542.00	379,400
モリテック スチール	700	282.00	197,400
パイオラックス	600	7,370.00	4,422,000
日本発條	11,800	1,120.00	13,216,000
中央発條	2,000	320.00	640,000
アドバネクス	200	1,705.00	341,000
立川ブラインド工業	500	880.00	440,000
三益半導体工業	900	1,661.00	1,494,900
日本ドライケミカル	100	2,351.00	235,100
日本製鋼所	4,200	2,068.00	8,685,600
三浦工業	5,100	1,801.00	9,185,100
タクマ	4,000	966.00	3,864,000
ツガミ	3,000	681.00	2,043,000
オークマ	8,000	1,133.00	9,064,000
東芝機械	7,000	472.00	3,304,000
アマダホールディングス	16,900	1,299.00	21,953,100
アイダエンジニアリング	3,600	1,117.00	4,021,200
滝澤鉄工所	4,000	159.00	636,000
富士機械製造	3,800	1,343.00	5,103,400
牧野フライス製作所	6,000	917.00	5,502,000
オーエスジー	5,700	2,296.00	13,087,200
ダイジェット工業	2,000	167.00	334,000
旭ダイヤモンド工業	3,600	844.00	3,038,400
D M G 森精機	7,500	1,476.00	11,070,000
ソディック	3,200	978.00	3,129,600
ディスコ	1,500	13,970.00	20,955,000
日東工器	700	2,546.00	1,782,200

パンチ工業	400	914.00	365,600
豊和工業	700	603.00	422,100
OKK	5,000	117.00	585,000
東洋機械金属	900	450.00	405,000
津田駒工業	3,000	167.00	501,000
島精機製作所	1,700	3,880.00	6,596,000
NCホールディングス	400	902.00	360,800
フリー	300	3,175.00	952,500
ヤマシンフィルタ	300	1,093.00	327,900
日阪製作所	1,700	880.00	1,496,000
やまびこ	2,300	1,548.00	3,560,400
ペガサスミシン製造	1,200	694.00	832,800
ナブテスコ	6,500	2,741.00	17,816,500
三井海洋開発	1,300	1,900.00	2,470,000
レオン自動機	1,100	880.00	968,000
S M C	3,800	28,145.00	106,951,000
新川	1,100	754.00	829,400
ホソカワミクロン	2,000	765.00	1,530,000
ユニオンツール	500	3,090.00	1,545,000
オイレス工業	1,600	2,112.00	3,379,200
日精エー・エス・ビー機械	400	2,429.00	971,600
サトーホールディングス	1,600	2,440.00	3,904,000
日本エアテック	400	654.00	261,600
日精樹脂工業	1,000	999.00	999,000
オカダアイヨン	300	1,030.00	309,000
ワイエイシイ	500	1,204.00	602,000
小松製作所	58,100	2,707.50	157,305,750
住友重機械工業	37,000	757.00	28,009,000
日立建機	5,600	2,604.00	14,582,400
日工	400	2,098.00	839,200
巴工業	400	1,591.00	636,400
井関農機	13,000	227.00	2,951,000
T O W A	1,000	1,560.00	1,560,000
丸山製作所	3,000	189.00	567,000
北川鉄工所	600	2,309.00	1,385,400
ローツェ	500	1,664.00	832,000
タカキタ	400	552.00	220,800
クボタ	60,400	1,680.50	101,502,200
荏原実業	300	1,366.00	409,800
三菱化工機	4,000	212.00	848,000
月島機械	2,400	1,257.00	3,016,800
帝国電機製作所	900	959.00	863,100
新東工業	2,900	1,017.00	2,949,300

澁谷工業	1,100	2,570.00	2,827,000
アイチ コーポレーション	1,800	826.00	1,486,800
小森コーポレーション	3,000	1,510.00	4,530,000
鶴見製作所	900	1,687.00	1,518,300
住友精密工業	2,000	361.00	722,000
酒井重工業	2,000	319.00	638,000
荏原製作所	5,200	3,300.00	17,160,000
石井鐵工所	200	1,749.00	349,800
西島製作所	1,300	1,132.00	1,471,600
北越工業	1,400	806.00	1,128,400
ダイキン工業	16,400	10,745.00	176,218,000
オルガノ	2,000	454.00	908,000
トーヨーカネツ	6,000	315.00	1,890,000
栗田工業	7,100	2,507.00	17,799,700
椿本チエイン	7,000	952.00	6,664,000
大同工業	3,000	246.00	738,000
木村化工機	1,100	338.00	371,800
アネスト岩田	2,200	1,127.00	2,479,400
ダイフク	6,000	2,327.00	13,962,000
サムコ	300	1,005.00	301,500
加藤製作所	700	3,050.00	2,135,000
油研工業	2,000	216.00	432,000
タダノ	6,300	1,497.00	9,431,100
フジテック	3,500	1,349.00	4,721,500
C K D	3,600	1,355.00	4,878,000
キトー	1,500	1,263.00	1,894,500
平和	3,700	2,667.00	9,867,900
理想科学工業	1,200	1,972.00	2,366,400
S A N K Y O	3,300	3,820.00	12,606,000
日本金銭機械	1,100	1,457.00	1,602,700
マースエンジニアリング	700	2,230.00	1,561,000
福島工業	700	3,365.00	2,355,500
オーイズミ	500	710.00	355,000
ダイコク電機	500	1,792.00	896,000
竹内製作所	2,200	2,589.00	5,695,800
アマノ	3,700	2,057.00	7,610,900
J U K I	1,900	1,094.00	2,078,600
サンデンホールディングス	7,000	365.00	2,555,000
蛇の目マシン工業	1,200	815.00	978,000
マックス	2,000	1,407.00	2,814,000
グローリー	3,800	3,675.00	13,965,000
新晃工業	900	1,353.00	1,217,700
大和冷機工業	1,900	902.00	1,713,800

セガサミーホールディングス	11,900	1,728.00	20,563,200
日本ピストンリング	500	2,071.00	1,035,500
リケン	600	4,390.00	2,634,000
T P R	1,400	3,375.00	4,725,000
ツバキ・ナカシマ	1,400	1,791.00	2,507,400
ホシザキ	2,600	9,060.00	23,556,000
大豊工業	1,000	1,625.00	1,625,000
日本精工	24,700	1,353.00	33,419,100
N T N	28,000	487.00	13,636,000
ジェイテクト	12,800	1,916.00	24,524,800
不二越	12,000	510.00	6,120,000
日本トムソン	3,900	500.00	1,950,000
T H K	8,500	2,610.00	22,185,000
ユーシン精機	500	2,648.00	1,324,000
前澤給装工業	500	1,513.00	756,500
イーグル工業	1,300	1,535.00	1,995,500
前澤工業	900	366.00	329,400
日本ピラー工業	1,200	1,228.00	1,473,600
キッツ	5,800	659.00	3,822,200
日立工機	3,200	1,253.00	4,009,600
マキタ	7,800	7,900.00	61,620,000
日立造船	9,600	610.00	5,856,000
三菱重工業	202,000	541.20	109,322,400
I H I	93,000	312.00	29,016,000
スター精密	2,100	1,612.00	3,385,200
日清紡ホールディングス	6,700	1,149.00	7,698,300
イビデン	8,400	1,607.00	13,498,800
コニカミノルタ	28,200	1,159.00	32,683,800
ブラザー工業	15,600	2,088.00	32,572,800
ミネベア	19,400	1,159.00	22,484,600
日立製作所	289,000	639.00	184,671,000
東芝	269,000	443.10	119,193,900
三菱電機	128,200	1,632.00	209,222,400
富士電機	36,000	599.00	21,564,000
東洋電機製造	500	1,586.00	793,000
安川電機	14,000	1,836.00	25,704,000
シンフォニアテクノロジー	8,000	270.00	2,160,000
明電舎	11,000	397.00	4,367,000
オリジン電気	2,000	312.00	624,000
山洋電気	3,000	810.00	2,430,000
デンヨー	1,100	1,607.00	1,767,700
東芝テック	8,000	552.00	4,416,000
芝浦メカトロニクス	2,000	256.00	512,000

マブチモーター	3,400	6,190.00	21,046,000
日本電産	15,600	10,140.00	158,184,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	200	2,981.00	596,200
東光高岳	600	2,030.00	1,218,000
ダブル・スコープ	1,200	1,709.00	2,050,800
ダイヘン	7,000	721.00	5,047,000
田淵電機	1,900	404.00	767,600
ヤーマン	100	5,550.00	555,000
JVCケンウッド	8,900	314.00	2,794,600
ミマキエンジニアリング	1,100	667.00	733,700
第一精工	600	1,352.00	811,200
日新電機	2,400	1,223.00	2,935,200
大崎電気工業	2,000	1,214.00	2,428,000
オムロン	12,800	4,525.00	57,920,000
日東工業	1,800	1,619.00	2,914,200
I D E C	1,600	1,098.00	1,756,800
不二電機工業	100	1,399.00	139,900
ジーエス・ユアサ コーポレーション	23,000	487.00	11,201,000
サクサホールディングス	3,000	219.00	657,000
メルコホールディングス	700	3,210.00	2,247,000
テクノメディカ	300	1,976.00	592,800
日本電気	165,000	309.00	50,985,000
富士通	116,000	662.60	76,861,600
沖電気工業	5,200	1,658.00	8,621,600
岩崎通信機	6,000	82.00	492,000
電気興業	3,000	584.00	1,752,000
サンケン電気	7,000	534.00	3,738,000
ナカヨ	1,000	391.00	391,000
アイホン	700	1,954.00	1,367,800
ルネサスエレクトロニクス	6,200	959.00	5,945,800
セイコーエプソン	17,900	2,436.00	43,604,400
ワコム	9,300	307.00	2,855,100
アルバック	2,200	3,455.00	7,601,000
アクセル	500	992.00	496,000
E I Z O	1,200	3,535.00	4,242,000
ジャパンディスプレイ	22,500	321.00	7,222,500
日本信号	3,300	998.00	3,293,400
京三製作所	3,000	391.00	1,173,000
能美防災	1,400	1,729.00	2,420,600
ホーチキ	900	1,405.00	1,264,500
エレコム	1,000	2,009.00	2,009,000
日本無線	700	1,422.00	995,400
パナソニック	137,400	1,223.00	168,040,200

アンリツ	8,800	632.00	5,561,600
富士通ゼネラル	4,000	2,457.00	9,828,000
日立国際電気	3,200	2,355.00	7,536,000
ソニー	84,900	3,333.00	282,971,700
T D K	6,800	8,210.00	55,828,000
帝国通信工業	3,000	173.00	519,000
ミツミ電機	4,300	681.00	2,928,300
タムラ製作所	5,000	442.00	2,210,000
アルプス電気	11,100	2,805.00	31,135,500
池上通信機	4,000	152.00	608,000
パイオニア	18,200	242.00	4,404,400
日本電波工業	1,200	891.00	1,069,200
鈴木	500	506.00	253,000
日本トリム	300	4,450.00	1,335,000
ローランド ディー . ジー .	500	3,145.00	1,572,500
フォスター電機	1,400	2,243.00	3,140,200
クラリオン	6,000	405.00	2,430,000
S M K	2,000	422.00	844,000
ヨコオ	900	877.00	789,300
ホシデン	3,700	932.00	3,448,400
ヒロセ電機	1,900	14,650.00	27,835,000
日本航空電子工業	3,000	1,662.00	4,986,000
T O A	1,400	1,047.00	1,465,800
日立マクセル	1,800	2,021.00	3,637,800
古野電気	1,600	846.00	1,353,600
ユニデンホールディングス	4,000	165.00	660,000
アルパイン	2,900	1,524.00	4,419,600
スミダコーポレーション	1,000	1,002.00	1,002,000
アイコム	700	2,311.00	1,617,700
リオン	500	1,617.00	808,500
本多通信工業	400	1,249.00	499,600
船井電機	1,400	943.00	1,320,200
横河電機	13,000	1,706.00	22,178,000
新電元工業	5,000	438.00	2,190,000
アズビル	3,700	3,290.00	12,173,000
東亜ディーケーケー	600	528.00	316,800
日本光電工業	5,000	2,589.00	12,945,000
チノー	400	1,092.00	436,800
共和電業	1,400	401.00	561,400
日本電子材料	500	605.00	302,500
堀場製作所	2,400	5,500.00	13,200,000
アドバンテスト	8,200	1,911.00	15,670,200
小野測器	600	883.00	529,800

エスベック	1,100	1,306.00	1,436,600
パナソニック デバイスSUNX	1,100	827.00	909,700
キーエンス	2,700	79,130.00	213,651,000
日置電機	600	2,157.00	1,294,200
シスメックス	9,300	6,630.00	61,659,000
日本マイクロニクス	2,300	1,149.00	2,642,700
メガチップス	1,100	2,572.00	2,829,200
OBARA GROUP	700	5,280.00	3,696,000
澤藤電機	1,000	216.00	216,000
コーセル	1,700	1,306.00	2,220,200
イリソ電子工業	400	6,660.00	2,664,000
新日本無線	1,100	389.00	427,900
オブテックス	900	2,594.00	2,334,600
千代田インテグレ	600	2,492.00	1,495,200
アイ・オー・データ機器	400	1,199.00	479,600
レーザーテック	1,400	2,094.00	2,931,600
スタンレー電気	8,600	3,200.00	27,520,000
岩崎電気	5,000	183.00	915,000
ウシオ電機	7,300	1,484.00	10,833,200
岡谷電機産業	700	407.00	284,900
ヘリオス テクノ ホールディング	1,100	499.00	548,900
日本セラミック	1,000	2,034.00	2,034,000
遠藤照明	600	856.00	513,600
日本デジタル研究所	1,200	2,391.00	2,869,200
古河電池	1,000	739.00	739,000
双信電機	600	283.00	169,800
山一電機	1,200	1,151.00	1,381,200
図研	800	1,175.00	940,000
日本電子	4,000	514.00	2,056,000
カシオ計算機	10,100	1,672.00	16,887,200
ファナック	12,200	20,165.00	246,013,000
日本シイエムケイ	2,600	707.00	1,838,200
エンプラス	500	3,485.00	1,742,500
大真空	500	1,395.00	697,500
ローム	5,800	6,710.00	38,918,000
浜松ホトニクス	9,400	3,110.00	29,234,000
三井ハイテック	1,600	854.00	1,366,400
新光電気工業	4,600	801.00	3,684,600
京セラ	19,700	5,940.00	117,018,000
太陽誘電	5,900	1,417.00	8,360,300
村田製作所	12,600	15,975.00	201,285,000
ユーシン	1,600	742.00	1,187,200
双葉電子工業	2,000	1,967.00	3,934,000

北陸電気工業	5,000	135.00	675,000	
ニチコン	3,800	1,017.00	3,864,600	
日本ケミコン	11,000	261.00	2,871,000	
K O A	1,700	1,150.00	1,955,000	
市光工業	3,000	375.00	1,125,000	
小糸製作所	7,200	6,140.00	44,208,000	
ミツバ	2,200	1,862.00	4,096,400	
S C R E E Nホールディングス	2,500	7,200.00	18,000,000	
キャノン電子	1,100	1,820.00	2,002,000	
キャノン	64,700	3,430.00	221,921,000	代用有価証券 10,000株
リコー	36,200	997.00	36,091,400	
M U T O Hホールディングス	2,000	250.00	500,000	
東京エレクトロン	8,000	11,060.00	88,480,000	
トヨタ紡織	4,200	2,740.00	11,508,000	
芦森工業	3,000	160.00	480,000	
ユニプレス	2,300	2,308.00	5,308,400	
豊田自動織機	10,900	5,700.00	62,130,000	
モリタホールディングス	2,100	1,591.00	3,341,100	
三櫻工業	1,500	889.00	1,333,500	
デンソー	29,600	5,197.00	153,831,200	
東海理化電機製作所	3,200	2,398.00	7,673,600	
三井造船	43,000	181.00	7,783,000	
川崎重工業	94,000	369.00	34,686,000	
名村造船所	3,600	819.00	2,948,400	
サノヤスホールディングス	1,500	275.00	412,500	
日本車輛製造	4,000	271.00	1,084,000	
ニチユ三菱フォークリフト	1,400	838.00	1,173,200	
近畿車輛	200	2,559.00	511,800	
日産自動車	143,900	1,194.50	171,888,550	
いすゞ自動車	34,800	1,494.00	51,991,200	
トヨタ自動車	149,500	6,991.00	1,045,154,500	代用有価証券 35,000株
日野自動車	17,200	1,212.00	20,846,400	
三菱自動車工業	44,100	668.00	29,458,800	
エフテック	700	1,318.00	922,600	
レシップホールディングス	400	855.00	342,000	
G M B	200	1,152.00	230,400	
ファルテック	200	1,321.00	264,200	
武蔵精密工業	1,400	3,105.00	4,347,000	
日産車体	5,300	1,149.00	6,089,700	
新明和工業	5,000	1,082.00	5,410,000	
極東開発工業	2,400	1,559.00	3,741,600	
日信工業	2,700	1,831.00	4,943,700	

トピー工業	1,000	2,889.00	2,889,000
ティラド	5,000	292.00	1,460,000
曙ブレーキ工業	5,600	308.00	1,724,800
タチエス	2,000	1,948.00	3,896,000
NOK	5,800	2,404.00	13,943,200
フタバ産業	3,700	697.00	2,578,900
KYB	13,000	554.00	7,202,000
大同メタル工業	1,500	1,161.00	1,741,500
プレス工業	6,400	515.00	3,296,000
ミクニ	1,600	397.00	635,200
カルソニックカンセイ	8,000	1,779.00	14,232,000
太平洋工業	2,500	1,508.00	3,770,000
ケーヒン	2,800	2,023.00	5,664,400
河西工業	1,600	1,388.00	2,220,800
アイシン精機	11,000	5,190.00	57,090,000
富士機工	1,200	463.00	555,600
マツダ	38,100	1,974.50	75,228,450
今仙電機製作所	1,100	998.00	1,097,800
本田技研工業	108,200	3,495.00	378,159,000
スズキ	23,800	4,122.00	98,103,600
富士重工業	37,300	4,824.00	179,935,200
安永	500	2,070.00	1,035,000
ヤマハ発動機	17,000	2,657.00	45,169,000
ショーワ	3,200	807.00	2,582,400
TBK	1,600	490.00	784,000
エクセディ	1,600	3,235.00	5,176,000
豊田合成	3,900	2,759.00	10,760,100
愛三工業	2,100	996.00	2,091,600
盟和産業	200	1,178.00	235,600
ヨロズ	1,100	1,736.00	1,909,600
エフ・シー・シー	2,000	2,134.00	4,268,000
シマノ	4,900	18,570.00	90,993,000
タカタ	2,200	606.00	1,333,200
テイ・エス テック	2,800	2,971.00	8,318,800
ジャムコ	700	2,438.00	1,706,600
テルモ	18,400	4,325.00	79,580,000
クリエートメディック	400	984.00	393,600
日機装	4,200	1,066.00	4,477,200
島津製作所	16,000	1,871.00	29,936,000
JMS	2,000	303.00	606,000
長野計器	1,000	688.00	688,000
ブイ・テクノロジー	200	13,220.00	2,644,000
東京計器	4,000	229.00	916,000

愛知時計電機	200	3,685.00	737,000
オーバル	1,200	266.00	319,200
東京精密	2,300	3,435.00	7,900,500
マニー	1,600	2,804.00	4,486,400
ニコン	21,000	1,798.00	37,758,000
トプコン	6,100	1,722.00	10,504,200
オリンパス	19,200	4,065.00	78,048,000
理研計器	1,100	1,654.00	1,819,400
タムロン	1,100	1,981.00	2,179,100
H O Y A	24,700	4,874.00	120,387,800
ノーリツ鋼機	1,200	835.00	1,002,000
エー・アンド・デイ	1,100	470.00	517,000
シチズン時計	13,600	710.00	9,656,000
リズム時計工業	5,000	181.00	905,000
大研医器	1,100	799.00	878,900
メニコン	800	3,140.00	2,512,000
松風	600	1,343.00	805,800
セイコーホールディングス	8,000	425.00	3,400,000
ニプロ	8,300	1,272.00	10,557,600
スノーピーク	200	3,065.00	613,000
パラマウントベッドホールディングス	1,100	4,580.00	5,038,000
トランザクション	300	1,542.00	462,600
S H O - B I	400	425.00	170,000
ニホンフラッシュ	600	1,320.00	792,000
前田工織	1,200	1,274.00	1,528,800
永大産業	2,000	505.00	1,010,000
アートネイチャー	1,300	710.00	923,000
ダンロップスポーツ	800	1,022.00	817,600
バンダイナムコホールディングス	13,300	3,235.00	43,025,500
アイフィスジャパン	300	424.00	127,200
共立印刷	2,000	315.00	630,000
S H O E I	500	2,146.00	1,073,000
フランスベッドホールディングス	1,500	934.00	1,401,000
パイロットコーポレーション	2,100	4,870.00	10,227,000
萩原工業	300	2,573.00	771,900
トッパン・フォームズ	2,200	1,202.00	2,644,400
フジシールインターナショナル	1,300	4,815.00	6,259,500
タカラトミー	4,700	1,277.00	6,001,900
廣濟堂	1,200	347.00	416,400
A s - m e エステール	300	697.00	209,100
アーケ	5,100	123.00	627,300
タカノ	600	829.00	497,400
プロネクサス	1,100	1,074.00	1,181,400

ホクシン	900	198.00	178,200
ウッドワン	2,000	271.00	542,000
大建工業	900	2,054.00	1,848,600
凸版印刷	34,000	1,138.00	38,692,000
大日本印刷	35,000	1,157.00	40,495,000
図書印刷	2,000	493.00	986,000
共同印刷	4,000	400.00	1,600,000
日本写真印刷	2,000	2,793.00	5,586,000
光村印刷	1,000	213.00	213,000
宝印刷	600	1,546.00	927,600
アシックス	12,000	2,366.00	28,392,000
ツツミ	400	1,923.00	769,200
小松ウオール工業	400	1,916.00	766,400
ヤマハ	8,100	3,570.00	28,917,000
河合楽器製作所	500	2,299.00	1,149,500
クリナップ	1,400	943.00	1,320,200
ピジョン	7,300	2,960.00	21,608,000
兼松サステック	1,000	184.00	184,000
キングジム	1,000	850.00	850,000
リンテック	2,900	2,570.00	7,453,000
T A S A K I	300	1,565.00	469,500
イトーキ	2,600	760.00	1,976,000
任天堂	7,400	24,555.00	181,707,000
三菱鉛筆	1,000	6,290.00	6,290,000
タカラスタANDARD	2,500	1,944.00	4,860,000
コクヨ	6,300	1,376.00	8,668,800
ナカバヤシ	2,000	267.00	534,000
岡村製作所	4,200	1,045.00	4,389,000
美津濃	6,000	574.00	3,444,000
アデランス	2,300	621.00	1,428,300
東京電力ホールディングス	102,000	492.00	50,184,000
中部電力	39,600	1,681.00	66,567,600
関西電力	49,100	1,314.50	64,541,950
中国電力	16,600	1,412.00	23,439,200
北陸電力	11,800	1,350.00	15,930,000
東北電力	30,000	1,514.00	45,420,000
四国電力	10,800	1,214.00	13,111,200
九州電力	26,600	1,302.00	34,633,200
北海道電力	11,300	934.00	10,554,200
沖縄電力	1,800	2,645.00	4,761,000
電源開発	9,600	2,775.00	26,640,000
エフオン	500	913.00	456,500
イーレックス	500	2,991.00	1,495,500

東京瓦斯	129,000	538.30	69,440,700
大阪瓦斯	116,000	459.30	53,278,800
東邦瓦斯	30,000	957.00	28,710,000
北海道瓦斯	3,000	276.00	828,000
広島ガス	2,500	375.00	937,500
西部瓦斯	14,000	255.00	3,570,000
静岡ガス	3,700	847.00	3,133,900
メタウォーター	700	2,778.00	1,944,600
SBSホールディングス	1,200	839.00	1,006,800
東武鉄道	64,000	585.00	37,440,000
相鉄ホールディングス	19,000	577.00	10,963,000
東京急行電鉄	65,000	879.00	57,135,000
京浜急行電鉄	33,000	1,343.00	44,319,000
小田急電鉄	19,300	2,349.00	45,335,700
京王電鉄	34,000	971.00	33,014,000
京成電鉄	9,000	2,866.00	25,794,000
富士急行	3,000	1,098.00	3,294,000
東日本旅客鉄道	23,200	10,260.00	238,032,000
西日本旅客鉄道	11,600	7,288.00	84,540,800
東海旅客鉄道	10,000	19,530.00	195,300,000
西武ホールディングス	16,600	2,148.00	35,656,800
鴻池運輸	1,700	1,545.00	2,626,500
西日本鉄道	14,000	540.00	7,560,000
ハマキョウレックス	800	2,107.00	1,685,600
サカイ引越センター	400	2,694.00	1,077,600
近鉄グループホールディングス	121,000	450.00	54,450,000
阪急阪神ホールディングス	15,200	3,795.00	57,684,000
南海電気鉄道	26,000	599.00	15,574,000
京阪ホールディングス	27,000	778.00	21,006,000
神戸電鉄	3,000	371.00	1,113,000
名古屋鉄道	44,000	576.00	25,344,000
山陽電気鉄道	4,000	599.00	2,396,000
日本通運	46,000	626.00	28,796,000
ヤマトホールディングス	21,500	2,417.50	51,976,250
山九	16,000	715.00	11,440,000
丸運	600	249.00	149,400
丸全昭和運輸	4,000	461.00	1,844,000
センコー	5,400	793.00	4,282,200
トナミホールディングス	3,000	338.00	1,014,000
ニッコンホールディングス	4,100	2,468.00	10,118,800
日本石油輸送	100	2,435.00	243,500
福山通運	7,000	679.00	4,753,000
セイノーホールディングス	8,500	1,331.00	11,313,500

神奈川中央交通	1,000	718.00	718,000
日立物流	2,500	2,414.00	6,035,000
丸和運輸機関	300	2,897.00	869,100
C & F ロジホールディングス	1,200	1,412.00	1,694,400
九州旅客鉄道	9,000	3,050.00	27,450,000
日本郵船	102,000	224.00	22,848,000
商船三井	63,000	326.00	20,538,000
川崎汽船	46,000	272.00	12,512,000
N S ユナイテッド海運	6,000	209.00	1,254,000
明治海運	1,100	437.00	480,700
飯野海運	6,300	470.00	2,961,000
共栄タンカー	1,000	219.00	219,000
乾汽船	900	952.00	856,800
日本航空	21,700	3,509.00	76,145,300
A N A ホールディングス	223,000	321.50	71,694,500
パスコ	1,000	397.00	397,000
ランコム	300	5,700.00	1,710,000
日新	5,000	365.00	1,825,000
三菱倉庫	8,000	1,669.00	13,352,000
三井倉庫ホールディングス	7,000	352.00	2,464,000
住友倉庫	9,000	612.00	5,508,000
澁澤倉庫	3,000	347.00	1,041,000
東陽倉庫	2,100	300.00	630,000
日本トランスシティ	3,000	420.00	1,260,000
ケイヒン	2,000	151.00	302,000
中央倉庫	700	1,074.00	751,800
安田倉庫	1,000	761.00	761,000
東洋埠頭	4,000	185.00	740,000
宇徳	1,000	410.00	410,000
上組	14,000	1,120.00	15,680,000
サンリツ	300	528.00	158,400
キムラユニティー	300	1,172.00	351,600
キューソー流通システム	400	2,428.00	971,200
郵船ロジスティクス	1,100	1,275.00	1,402,500
近鉄エクスプレス	2,100	1,682.00	3,532,200
東海運	700	443.00	310,100
エーアイティー	800	1,053.00	842,400
内外トランスライン	400	1,176.00	470,400
N E C ネットエスアイ	1,300	2,129.00	2,767,700
システナ	1,000	1,746.00	1,746,000
デジタルアーツ	500	2,601.00	1,300,500
新日鉄住金ソリューションズ	2,000	2,109.00	4,218,000
キューブシステム	500	686.00	343,000

コア	500	1,153.00	576,500
ソフトクリエイトホールディングス	600	1,335.00	801,000
T I S	3,900	2,521.00	9,831,900
ネオス	400	436.00	174,400
電算システム	400	1,905.00	762,000
グリー	7,200	618.00	4,449,600
コーエーテクモホールディングス	2,800	2,090.00	5,852,000
三菱総合研究所	500	3,245.00	1,622,500
ボルテージ	200	1,080.00	216,000
電算	100	2,235.00	223,500
A G S	300	1,331.00	399,300
ファインデックス	900	900.00	810,000
ヒト・コミュニケーションズ	300	1,490.00	447,000
ブレインパッド	200	1,057.00	211,400
K L a b	2,300	664.00	1,527,200
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	900	1,015.00	913,500
イーブックイニシアティブジャパン	200	864.00	172,800
ネクソン	13,100	1,715.00	22,466,500
アイスタイル	1,800	841.00	1,513,800
エムアップ	400	592.00	236,800
エイチーム	700	2,353.00	1,647,100
テクノスジャパン	500	1,164.00	582,000
e n i s h	400	470.00	188,000
コロプラ	3,300	993.00	3,276,900
モバイルクリエイト	800	379.00	303,200
ブロードリーフ	1,500	659.00	988,500
ハーツユナイテッドグループ	600	1,659.00	995,400
メディアドゥ	300	1,430.00	429,000
ブイキューブ	700	653.00	457,100
サイバーリンクス	200	1,064.00	212,800
ディー・エル・イー	400	611.00	244,400
VOYAGE GROUP	400	1,011.00	404,400
オブティム	100	5,170.00	517,000
ベリサーブ	100	2,990.00	299,000
ティーガイア	1,100	1,904.00	2,094,400
日本アジアグループ	1,400	435.00	609,000
豆蔵ホールディングス	900	941.00	846,900
テクマトリックス	400	2,065.00	826,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	24,900	248.00	6,175,200
GMOペイメントゲートウェイ	1,000	5,080.00	5,080,000
ザッパラス	700	419.00	293,300
インターネットイニシアティブ	1,800	1,757.00	3,162,600
さくらインターネット	900	925.00	832,500

GMOクラウド	300	1,266.00	379,800
SRAホールディングス	600	2,607.00	1,564,200
Minorisソリューションズ	300	1,046.00	313,800
システムインテグレータ	200	631.00	126,200
朝日ネット	1,100	483.00	531,300
アドソル日進	300	1,167.00	350,100
フリービット	700	791.00	553,700
コムチュア	200	3,290.00	658,000
サイバーコム	200	844.00	168,800
gumi	1,200	814.00	976,800
PCIホールディングス	100	2,514.00	251,400
パイブドHD	200	1,111.00	222,200
LINE	2,000	4,010.00	8,020,000
ソルクシーズ	400	568.00	227,200
フェイス	300	1,219.00	365,700
ハイマックス	100	1,349.00	134,900
野村総合研究所	8,100	3,955.00	32,035,500
サイバネットシステム	1,000	656.00	656,000
CEホールディングス	200	1,089.00	217,800
インテージホールディングス	700	1,984.00	1,388,800
東邦システムサイエンス	400	649.00	259,600
ソースネクスト	700	569.00	398,300
ティー・ワイ・オー	2,400	148.00	355,200
フォーカスシステムズ	500	472.00	236,000
クレスコ	300	2,363.00	708,900
フジ・メディア・ホールディングス	12,300	1,663.00	20,454,900
オービック	4,100	5,100.00	20,910,000
ジャストシステム	1,900	1,049.00	1,993,100
TDCソフトウェアエンジニアリング	500	1,123.00	561,500
ヤフー	84,900	452.00	38,374,800
トレンドマイクロ	6,300	4,305.00	27,121,500
インフォメーション・ディベロプメント	200	1,590.00	318,000
日本オラクル	1,900	5,950.00	11,305,000
アルファシステムズ	400	1,834.00	733,600
フューチャー	1,600	723.00	1,156,800
CAC Holdings	900	937.00	843,300
ソフトバンク・テクノロジー	300	3,130.00	939,000
トーセ	300	795.00	238,500
オービックビジネスコンサルタント	600	5,120.00	3,072,000
伊藤忠テクノソリューションズ	2,700	2,996.00	8,089,200
アイティフォー	1,600	628.00	1,004,800
東計電算	200	2,214.00	442,800
エクスネット	100	1,695.00	169,500

大塚商会	3,200	5,620.00	17,984,000
サイボウズ	1,600	455.00	728,000
ソフトブレーン	1,700	394.00	669,800
電通国際情報サービス	700	1,833.00	1,283,100
デジタルガレージ	1,800	1,982.00	3,567,600
E Mシステムズ	400	1,600.00	640,000
ウェザーニューズ	400	3,625.00	1,450,000
C I J	1,100	532.00	585,200
東洋ビジネスエンジニアリング	100	1,537.00	153,700
日本エンタープライズ	1,200	277.00	332,400
WOWOW	600	3,480.00	2,088,000
スカラ	800	838.00	670,400
日本コロムビア	400	622.00	248,800
イマジカ・ロボット ホールディングス	1,000	651.00	651,000
ネットワンシステムズ	5,100	746.00	3,804,600
システムソフト	2,100	150.00	315,000
アルゴグラフィックス	500	2,243.00	1,121,500
マーベラス	2,000	772.00	1,544,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	2,200	1,737.00	3,821,400
日本ユニシス	3,300	1,472.00	4,857,600
兼松エレクトロニクス	800	2,461.00	1,968,800
東京放送ホールディングス	7,800	1,889.00	14,734,200
日本テレビホールディングス	10,800	2,142.00	23,133,600
朝日放送	1,200	698.00	837,600
テレビ朝日ホールディングス	3,200	2,341.00	7,491,200
スカパーJ S A Tホールディングス	7,700	550.00	4,235,000
テレビ東京ホールディングス	1,000	2,338.00	2,338,000
日本BS放送	300	1,077.00	323,100
U - N E X T	300	559.00	167,700
ワイヤレスゲート	400	1,705.00	682,000
コネクシオ	1,100	1,507.00	1,657,700
日本通信	10,100	167.00	1,686,700
クロップス	300	549.00	164,700
日本電信電話	95,200	4,946.00	470,859,200
K D D I	117,400	2,950.50	346,388,700
光通信	1,400	10,980.00	15,372,000
N T T ドコモ	88,600	2,672.50	236,783,500
エムティーアイ	1,800	713.00	1,283,400
G M O インターネット	4,300	1,515.00	6,514,500
カドカワ	3,500	1,702.00	5,957,000
学研ホールディングス	4,000	318.00	1,272,000
ゼンリン	1,600	1,953.00	3,124,800
昭文社	700	651.00	455,700

インプレスホールディングス	1,000	142.00	142,000
アイネット	700	1,080.00	756,000
松竹	8,000	1,280.00	10,240,000
東宝	7,800	3,305.00	25,779,000
東映	4,000	986.00	3,944,000
AOI Pro.	600	858.00	514,800
エヌ・ティ・ティ・データ	7,300	5,810.00	42,413,000
ピー・シー・エー	200	1,354.00	270,800
ビジネスブレイン太田昭和	200	1,000.00	200,000
D T S	1,200	2,540.00	3,048,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	4,600	3,000.00	13,800,000
シーイーシー	700	1,719.00	1,203,300
カプコン	2,800	2,741.00	7,674,800
アイ・エス・ビー	200	931.00	186,200
ジャステック	800	1,055.00	844,000
S C S K	3,200	4,160.00	13,312,000
日本システムウエア	400	1,421.00	568,400
アイネス	1,500	1,221.00	1,831,500
T K C	1,100	3,105.00	3,415,500
富士ソフト	1,800	2,809.00	5,056,200
N S D	2,500	1,834.00	4,585,000
コナミホールディングス	5,400	4,645.00	25,083,000
福井コンピュータホールディングス	400	2,703.00	1,081,200
J B C Cホールディングス	1,000	752.00	752,000
ミロク情報サービス	900	1,764.00	1,587,600
ソフトバンクグループ	53,400	7,847.00	419,029,800
ハウスイ	1,000	129.00	129,000
高千穂交易	500	999.00	499,500
伊藤忠食品	300	4,335.00	1,300,500
エレマテック	500	1,867.00	933,500
J A L U X	400	1,943.00	777,200
あらた	500	2,562.00	1,281,000
トーメンデバイス	200	2,025.00	405,000
東京エレクトロン デバイス	400	1,575.00	630,000
フィールズ	900	1,406.00	1,265,400
双日	70,100	286.00	20,048,600
アルフレッサ ホールディングス	14,000	1,937.00	27,118,000
横浜冷凍	2,900	1,040.00	3,016,000
神栄	2,000	182.00	364,000
山下医科器械	100	1,738.00	173,800
ラサ商事	500	612.00	306,000
ラクーン	500	469.00	234,500
アルコニックス	700	1,689.00	1,182,300

神戸物産	600	3,895.00	2,337,000
あい ホールディングス	2,100	2,322.00	4,876,200
ディーブイエックス	400	1,385.00	554,000
ダイワボウホールディングス	10,000	292.00	2,920,000
マクニカ・富士エレホールディングス	2,200	1,508.00	3,317,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,200	978.00	2,151,600
八洲電機	900	604.00	543,600
U K Cホールディングス	800	2,136.00	1,708,800
O C H Iホールディングス	400	1,206.00	482,400
T O K A Iホールディングス	5,200	803.00	4,175,600
大阪工機	100	731.00	73,100
三洋貿易	700	1,585.00	1,109,500
ビューティガレージ	100	1,092.00	109,200
ウイン・パートナーズ	400	2,140.00	856,000
ミタチ産業	300	618.00	185,400
シップヘルスケアホールディングス	2,300	3,000.00	6,900,000
明治電機工業	400	1,210.00	484,000
デリカフーズ	300	1,000.00	300,000
スターティア	300	522.00	156,600
コメダホールディングス	1,600	1,842.00	2,947,200
富士興産	400	455.00	182,000
協栄産業	1,000	153.00	153,000
小野建	1,100	1,351.00	1,486,100
佐鳥電機	900	726.00	653,400
エコートレーディング	300	668.00	200,400
伯東	800	1,041.00	832,800
コンドーテック	1,000	839.00	839,000
中山福	700	818.00	572,600
ナガイレーベン	1,700	2,570.00	4,369,000
三菱食品	1,300	3,485.00	4,530,500
松田産業	900	1,522.00	1,369,800
第一興商	1,900	4,545.00	8,635,500
メディバルホールディングス	11,900	1,822.00	21,681,800
S P K	300	2,357.00	707,100
萩原電気	400	2,108.00	843,200
アズワン	900	4,885.00	4,396,500
スズデン	400	1,030.00	412,000
シモジマ	700	1,120.00	784,000
ドウシシャ	1,400	2,055.00	2,877,000
小津産業	300	2,139.00	641,700
高速	700	1,083.00	758,100
たけびし	400	1,186.00	474,400
黒田電気	1,600	2,347.00	3,755,200

リックス	300	1,479.00	443,700
丸文	1,100	683.00	751,300
ハピネット	1,000	1,278.00	1,278,000
橋本総業ホールディングス	300	1,520.00	456,000
日本ライフライン	1,000	2,326.00	2,326,000
エクセル	500	1,482.00	741,000
マルカキカイ	400	1,592.00	636,800
I D O M	3,200	669.00	2,140,800
日本エム・ディ・エム	900	805.00	724,500
進和	700	1,720.00	1,204,000
エスケイジャパン	200	305.00	61,000
ダイトエレクトロン	600	965.00	579,000
シークス	800	3,965.00	3,172,000
田中商事	400	699.00	279,600
オーハシテクニカ	700	1,396.00	977,200
白銅	300	1,429.00	428,700
伊藤忠商事	86,900	1,589.00	138,084,100
丸紅	116,800	674.70	78,804,960
高島	2,000	189.00	378,000
長瀬産業	7,100	1,526.00	10,834,600
蝶理	800	1,729.00	1,383,200
豊田通商	13,200	3,070.00	40,524,000
三共生興	1,800	393.00	707,400
兼松	25,000	199.00	4,975,000
ツカモトコーポレーション	2,000	128.00	256,000
三井物産	107,300	1,624.50	174,308,850
日本紙パルプ商事	5,000	370.00	1,850,000
日立ハイテクノロジーズ	4,100	4,610.00	18,901,000
カメイ	1,600	1,235.00	1,976,000
東都水産	200	1,850.00	370,000
O U G ホールディングス	2,000	260.00	520,000
スターゼン	500	4,835.00	2,417,500
山善	4,500	983.00	4,423,500
椿本興業	2,000	348.00	696,000
住友商事	74,700	1,393.50	104,094,450
内田洋行	3,000	484.00	1,452,000
三菱商事	89,000	2,522.50	224,502,500
第一実業	3,000	655.00	1,965,000
キャノンマーケティングジャパン	3,400	1,987.00	6,755,800
西華産業	4,000	343.00	1,372,000
佐藤商事	1,100	863.00	949,300
菱洋エレクトロ	1,100	1,426.00	1,568,600
東京産業	1,200	485.00	582,000

ユアサ商事	1,100	2,953.00	3,248,300
神鋼商事	300	2,428.00	728,400
小林産業	900	259.00	233,100
阪和興業	12,000	764.00	9,168,000
カナデン	1,100	1,048.00	1,152,800
菱電商事	2,000	742.00	1,484,000
フルサト工業	700	1,666.00	1,166,200
岩谷産業	13,000	626.00	8,138,000
すてきナイスグループ	5,000	153.00	765,000
昭光通商	4,000	100.00	400,000
ニチモウ	2,000	174.00	348,000
極東貿易	2,000	234.00	468,000
イワキ	2,000	219.00	438,000
三愛石油	3,200	865.00	2,768,000
稲畑産業	2,800	1,302.00	3,645,600
G S Iクレオス	3,000	126.00	378,000
明和産業	1,100	391.00	430,100
ワキタ	2,500	979.00	2,447,500
東邦ホールディングス	3,800	2,313.00	8,789,400
サンゲツ	4,100	2,036.00	8,347,600
ミツウロコグループホールディングス	1,900	721.00	1,369,900
シナネンホールディングス	500	2,106.00	1,053,000
伊藤忠エネクス	2,600	930.00	2,418,000
サンリオ	3,700	2,266.00	8,384,200
サンワテクノス	700	934.00	653,800
リョーサン	1,800	3,505.00	6,309,000
新光商事	1,300	1,219.00	1,584,700
トーヨー	500	2,552.00	1,276,000
三信電気	1,300	1,131.00	1,470,300
東陽テクニカ	1,600	1,035.00	1,656,000
モスフードサービス	1,600	3,525.00	5,640,000
加賀電子	1,100	1,899.00	2,088,900
ソーダニッカ	1,200	513.00	615,600
立花エレテック	800	1,339.00	1,071,200
フォーバル	500	709.00	354,500
P A L T A C	1,900	2,752.00	5,228,800
三谷産業	1,300	342.00	444,600
太平洋興発	5,000	100.00	500,000
ヤマタネ	600	1,607.00	964,200
丸紅建材リース	1,000	222.00	222,000
日鉄住金物産	1,000	4,530.00	4,530,000
トラスコ中山	1,400	4,930.00	6,902,000
オートバックスセブン	4,400	1,767.00	7,774,800

加藤産業	1,900	2,726.00	5,179,400
イノテック	1,100	571.00	628,100
イエローハット	1,100	2,469.00	2,715,900
J Kホールディングス	1,200	595.00	714,000
日伝	500	3,160.00	1,580,000
北沢産業	1,000	185.00	185,000
杉本商事	700	1,471.00	1,029,700
因幡電機産業	1,700	4,025.00	6,842,500
バイテックホールディングス	500	1,254.00	627,000
ミスミグループ本社	13,300	1,934.00	25,722,200
アルテック	1,000	194.00	194,000
タキヒヨー	2,000	452.00	904,000
蔵王産業	200	1,415.00	283,000
スズケン	5,400	3,810.00	20,574,000
ジェコス	800	1,050.00	840,000
ルネサスイーストン	1,000	518.00	518,000
ローソン	4,100	8,260.00	33,866,000
サンエー	900	5,640.00	5,076,000
カワチ薬品	900	2,869.00	2,582,100
エービーシー・マート	2,200	6,640.00	14,608,000
ハードオフコーポレーション	500	1,190.00	595,000
アスクル	1,500	4,295.00	6,442,500
ゲオホールディングス	2,000	1,387.00	2,774,000
アダストリア	1,800	3,325.00	5,985,000
ジーフット	700	789.00	552,300
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	200	709.00	141,800
くらコーポレーション	800	4,865.00	3,892,000
キャンドウ	600	1,756.00	1,053,600
パルグループホールディングス	600	2,810.00	1,686,000
エディオン	4,600	1,119.00	5,147,400
サーラコーポレーション	1,500	652.00	978,000
ワッツ	500	1,109.00	554,500
ハローズ	400	2,384.00	953,600
あみやき亭	200	3,900.00	780,000
ひらまつ	1,600	674.00	1,078,400
ゲンキー	200	5,600.00	1,120,000
大黒天物産	300	5,050.00	1,515,000
ハニーズ	1,000	1,201.00	1,201,000
ファーマライズホールディングス	300	524.00	157,200
アルペン	1,100	2,144.00	2,358,400
クオール	1,300	1,425.00	1,852,500
ジェイアイエヌ	800	5,220.00	4,176,000
ビックカメラ	6,800	1,070.00	7,276,000

DCMホールディングス	7,000	1,017.00	7,119,000
Monotaro	4,200	2,465.00	10,353,000
東京一番フーズ	300	543.00	162,900
ダイヤモンドダイニング	300	1,215.00	364,500
きちり	300	687.00	206,100
アークランドサービスホールディングス	400	2,998.00	1,199,200
J.フロント リテイリング	15,000	1,687.00	25,305,000
ドトール・日レスホールディングス	2,100	2,142.00	4,498,200
マツモトキヨシホールディングス	2,200	5,930.00	13,046,000
ブロンコビリー	600	3,005.00	1,803,000
スタートトゥデイ	10,800	2,044.00	22,075,200
トレジャー・ファクトリー	300	892.00	267,600
物語コーポレーション	300	4,235.00	1,270,500
ココカラファイン	1,200	4,395.00	5,274,000
三越伊勢丹ホールディングス	23,600	1,310.00	30,916,000
Hamee	200	925.00	185,000
ウエルシアホールディングス	1,200	7,110.00	8,532,000
クリエイティブSDホールディングス	1,700	2,551.00	4,336,700
丸善CHIホールディングス	1,400	364.00	509,600
ミサワ	200	485.00	97,000
ティーライフ	100	1,384.00	138,400
エー・ピーカンパニー	200	716.00	143,200
チムニー	400	2,930.00	1,172,000
シュッピン	500	1,439.00	719,500
ネクステージ	300	2,004.00	601,200
ジョイフル本田	1,900	3,195.00	6,070,500
鳥貴族	300	2,485.00	745,500
キリン堂ホールディングス	400	840.00	336,000
ホットランド	600	1,242.00	745,200
すかいらーく	5,100	1,623.00	8,277,300
綿半ホールディングス	500	1,671.00	835,500
ヨシックス	100	1,357.00	135,700
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3,900	985.00	3,841,500
ブックオフコーポレーション	700	789.00	552,300
ゴルフダイジェスト・オンライン	500	907.00	453,500
B E E N O S	100	1,542.00	154,200
あさひ	900	1,296.00	1,166,400
日本調剤	400	4,515.00	1,806,000
コスモス薬品	600	21,540.00	12,924,000
トーエル	600	915.00	549,000
一六堂	300	359.00	107,700
オンリー	100	787.00	78,700
セブン&アイ・ホールディングス	49,700	4,512.00	224,246,400

葉王堂	600	2,182.00	1,309,200
クリエイティブ・レストラン・ホールディングス	3,200	1,023.00	3,273,600
ツルハホールディングス	2,700	11,310.00	30,537,000
サンマルクホールディングス	800	3,535.00	2,828,000
フェリシモ	400	1,021.00	408,400
トリドールホールディングス	1,500	2,467.00	3,700,500
サツドラホールディングス	200	1,953.00	390,600
ダイユー・リックホールディングス	400	697.00	278,800
クスリのアオキホールディングス	1,100	5,260.00	5,786,000
メディカルシステムネットワーク	1,400	429.00	600,600
総合メディカル	600	4,015.00	2,409,000
はるやま商事	500	859.00	429,500
ノジマ	1,400	1,295.00	1,813,000
カッパ・クリエイティブ	1,700	1,301.00	2,211,700
ライトオン	900	1,025.00	922,500
ジーンズメイト	400	188.00	75,200
良品計画	1,600	22,990.00	36,784,000
三城ホールディングス	1,400	456.00	638,400
アドヴァン	1,200	1,198.00	1,437,600
アルビス	300	3,330.00	999,000
コナカ	1,500	570.00	855,000
ハウス オブ ローゼ	200	1,542.00	308,400
G-7ホールディングス	400	1,504.00	601,600
イオン北海道	1,200	590.00	708,000
コジマ	1,800	287.00	516,600
ヒマラヤ	400	854.00	341,600
コーナン商事	1,700	2,272.00	3,862,400
エコス	500	1,272.00	636,000
ワタミ	1,400	1,098.00	1,537,200
マルシェ	300	821.00	246,300
ドンキホーテホールディングス	7,700	4,375.00	33,687,500
西松屋チェーン	2,100	1,427.00	2,996,700
ゼンショーホールディングス	6,100	1,896.00	11,565,600
幸楽苑ホールディングス	700	1,628.00	1,139,600
ハークスレイ	300	1,089.00	326,700
サイゼリヤ	1,900	2,701.00	5,131,900
V Tホールディングス	4,000	584.00	2,336,000
魚力	400	1,252.00	500,800
ポプラ	300	501.00	150,300
フジ・コーポレーション	200	2,250.00	450,000
ユナイテッドアローズ	1,600	3,405.00	5,448,000
ハイデイ日高	1,100	2,731.00	3,004,100
京都きもの友禅	800	938.00	750,400

コロワイド	3,900	1,893.00	7,382,700
ピーシーデポコーポレーション	1,600	675.00	1,080,000
巻番屋	1,100	3,800.00	4,180,000
トップカルチャー	500	481.00	240,500
P L A N T	300	1,204.00	361,200
スギホールディングス	2,600	5,630.00	14,638,000
スクロール	1,800	352.00	633,600
ヨンドシーホールディングス	900	2,484.00	2,235,600
ユニー・ファミリーマートホールディングス	5,200	7,910.00	41,132,000
木曽路	1,400	2,369.00	3,316,600
サトレストランシステムズ	1,400	812.00	1,136,800
千趣会	2,100	740.00	1,554,000
タカキュー	900	190.00	171,000
ケーヨー	2,000	553.00	1,106,000
上新電機	3,000	960.00	2,880,000
日本瓦斯	2,200	3,395.00	7,469,000
ベスト電器	3,900	157.00	612,300
ロイヤルホールディングス	2,000	1,988.00	3,976,000
東天紅	1,000	150.00	150,000
いなげや	1,300	1,477.00	1,920,100
島忠	3,100	3,160.00	9,796,000
チヨダ	1,400	2,750.00	3,850,000
ライフコーポレーション	900	3,380.00	3,042,000
リンガーハット	1,200	2,251.00	2,701,200
さが美	1,000	128.00	128,000
MrMax	1,500	426.00	639,000
テンアライド	1,100	377.00	414,700
AOKIホールディングス	2,400	1,469.00	3,525,600
オークワ	2,000	1,180.00	2,360,000
コメリ	1,800	2,716.00	4,888,800
青山商事	2,500	4,145.00	10,362,500
しまむら	1,400	14,170.00	19,838,000
はせがわ	700	441.00	308,700
高島屋	20,000	1,036.00	20,720,000
松屋	2,600	1,083.00	2,815,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	6,100	1,835.00	11,193,500
近鉄百貨店	4,000	352.00	1,408,000
丸栄	3,000	87.00	261,000
パルコ	1,200	1,035.00	1,242,000
丸井グループ	12,500	1,757.00	21,962,500
アクシアル リテイリング	900	3,970.00	3,573,000
イオン	48,800	1,699.00	82,911,200
イズミ	2,300	5,100.00	11,730,000

東武ストア	100	2,825.00	282,500
平和堂	2,400	2,522.00	6,052,800
フジ	1,300	2,441.00	3,173,300
ヤオコー	1,300	4,660.00	6,058,000
ゼビオホールディングス	1,600	1,848.00	2,956,800
ケーズホールディングス	5,500	2,055.00	11,302,500
O l y m p i c グループ	700	616.00	431,200
日産東京販売ホールディングス	1,800	335.00	603,000
アインホールディングス	1,400	7,670.00	10,738,000
元気寿司	300	2,093.00	627,900
ヤマダ電機	39,700	633.00	25,130,100
アークランドサカモト	2,000	1,431.00	2,862,000
ニトリホールディングス	5,100	13,220.00	67,422,000
愛眼	900	198.00	178,200
ケーユーホールディングス	600	824.00	494,400
吉野家ホールディングス	4,100	1,582.00	6,486,200
松屋フーズ	600	3,775.00	2,265,000
サガミチェーン	1,500	1,288.00	1,932,000
関西スーパーマーケット	1,000	1,509.00	1,509,000
王将フードサービス	900	4,360.00	3,924,000
プレナス	1,300	2,287.00	2,973,100
ミニストップ	900	2,087.00	1,878,300
アークス	2,200	2,675.00	5,885,000
パローホールディングス	2,600	3,140.00	8,164,000
藤久	100	1,744.00	174,400
ベルク	500	4,575.00	2,287,500
大庄	600	1,559.00	935,400
ファーストリテイリング	2,000	43,340.00	86,680,000
サンドラッグ	2,200	8,140.00	17,908,000
サクスパー ホールディングス	1,100	1,177.00	1,294,700
ヤマザワ	200	1,754.00	350,800
やまや	300	1,724.00	517,200
ベルーナ	3,000	714.00	2,142,000
島根銀行	300	1,368.00	410,400
じもとホールディングス	8,500	202.00	1,717,000
めぶきフィナンシャルグループ	57,200	439.00	25,110,800
東京ＴＹフィナンシャルグループ	1,700	4,175.00	7,097,500
九州フィナンシャルグループ	19,400	806.00	15,636,400
ゆうちょ銀行	33,600	1,421.00	47,745,600
富山第一銀行	3,000	541.00	1,623,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	77,700	566.50	44,017,050
西日本フィナンシャルホールディングス	8,000	1,219.00	9,752,000
新生銀行	113,000	202.00	22,826,000

あおぞら銀行	75,000	423.00	31,725,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	899,200	736.20	661,991,040	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	138,800	613.50	85,153,800	
三井住友トラスト・ホールディングス	25,100	4,355.00	109,310,500	
三井住友フィナンシャルグループ	95,000	4,564.00	433,580,000	代用有価証券 10,000株
第四銀行	14,000	526.00	7,364,000	
北越銀行	1,300	2,622.00	3,408,600	
千葉銀行	46,000	718.00	33,028,000	
群馬銀行	26,400	651.00	17,186,400	
武蔵野銀行	1,900	3,430.00	6,517,000	
千葉興業銀行	3,300	600.00	1,980,000	
筑波銀行	5,000	350.00	1,750,000	
七十七銀行	19,000	574.00	10,906,000	
青森銀行	9,000	392.00	3,528,000	
秋田銀行	8,000	376.00	3,008,000	
山形銀行	7,000	491.00	3,437,000	
岩手銀行	800	4,740.00	3,792,000	
東邦銀行	11,000	441.00	4,851,000	
東北銀行	6,000	154.00	924,000	
みちのく銀行	6,000	223.00	1,338,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	48,000	531.00	25,488,000	
静岡銀行	32,000	1,003.00	32,096,000	
十六銀行	16,000	413.00	6,608,000	
スルガ銀行	12,100	2,619.00	31,689,900	
八十二銀行	22,900	694.00	15,892,600	
山梨中央銀行	7,000	570.00	3,990,000	
大垣共立銀行	16,000	456.00	7,296,000	
福井銀行	10,000	295.00	2,950,000	
北國銀行	13,000	414.00	5,382,000	
清水銀行	400	3,760.00	1,504,000	
富山銀行	200	4,430.00	886,000	
滋賀銀行	11,000	648.00	7,128,000	
南都銀行	1,100	4,500.00	4,950,000	
百五銀行	11,000	482.00	5,302,000	
京都銀行	21,000	902.00	18,942,000	
紀陽銀行	4,700	1,892.00	8,892,400	
三重銀行	500	2,352.00	1,176,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	7,900	2,028.00	16,021,200	
広島銀行	35,000	557.00	19,495,000	
山陰合同銀行	7,100	977.00	6,936,700	
中国銀行	8,400	1,687.00	14,170,800	
鳥取銀行	400	1,898.00	759,200	

伊予銀行	12,700	843.00	10,706,100
百十四銀行	13,000	401.00	5,213,000
四国銀行	9,000	285.00	2,565,000
阿波銀行	10,000	714.00	7,140,000
大分銀行	7,000	444.00	3,108,000
宮崎銀行	8,000	359.00	2,872,000
佐賀銀行	7,000	301.00	2,107,000
十八銀行	7,000	351.00	2,457,000
沖縄銀行	1,100	4,275.00	4,702,500
琉球銀行	2,400	1,549.00	3,717,600
セブン銀行	44,400	342.00	15,184,800
みずほフィナンシャルグループ	1,610,900	214.90	346,182,410
高知銀行	5,000	132.00	660,000
山口フィナンシャルグループ	11,000	1,284.00	14,124,000
長野銀行	400	2,022.00	808,800
名古屋銀行	900	4,240.00	3,816,000
北洋銀行	19,400	494.00	9,583,600
愛知銀行	400	6,770.00	2,708,000
第三銀行	700	1,834.00	1,283,800
中京銀行	500	2,333.00	1,166,500
大光銀行	4,000	271.00	1,084,000
愛媛銀行	1,400	1,358.00	1,901,200
トマト銀行	500	1,625.00	812,500
みなと銀行	1,100	2,125.00	2,337,500
京葉銀行	10,000	529.00	5,290,000
関西アーバン銀行	1,700	1,460.00	2,482,000
栃木銀行	6,600	577.00	3,808,200
北日本銀行	400	3,035.00	1,214,000
東和銀行	22,000	113.00	2,486,000
福島銀行	13,000	97.00	1,261,000
大東銀行	6,000	167.00	1,002,000
トモニホールディングス	9,800	613.00	6,007,400
フィデアホールディングス	11,600	212.00	2,459,200
池田泉州ホールディングス	12,500	547.00	6,837,500
F P G	4,300	975.00	4,192,500
S B Iホールディングス	13,400	1,527.00	20,461,800
ジャフコ	2,000	3,880.00	7,760,000
大和証券グループ本社	111,000	742.50	82,417,500
野村ホールディングス	242,600	709.40	172,100,440
岡三証券グループ	10,000	734.00	7,340,000
丸三証券	3,800	1,007.00	3,826,600
東洋証券	4,000	278.00	1,112,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	13,700	637.00	8,726,900

光世証券	3,000	204.00	612,000
水戸証券	3,700	330.00	1,221,000
いちよし証券	2,700	921.00	2,486,700
松井証券	6,800	1,026.00	6,976,800
だいこう証券ビジネス	600	648.00	388,800
マネックスグループ	12,800	332.00	4,249,600
カブドットコム証券	8,800	415.00	3,652,000
極東証券	1,600	1,742.00	2,787,200
岩井コスモホールディングス	1,100	1,123.00	1,235,300
藍澤証券	2,200	657.00	1,445,400
マネーパートナーズグループ	1,500	545.00	817,500
かんぽ生命保険	4,500	2,541.00	11,434,500
S O M P Oホールディングス	24,800	4,006.00	99,348,800
アニコム ホールディングス	800	2,362.00	1,889,600
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	35,500	3,676.00	130,498,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	11,400	1,857.00	21,169,800
第一生命ホールディングス	71,600	1,950.00	139,620,000
東京海上ホールディングス	48,100	4,863.00	233,910,300
T & Dホールディングス	43,300	1,540.50	66,703,650
アドバンスクリエイト	300	1,790.00	537,000
全国保証	3,400	3,755.00	12,767,000
クレディセゾン	9,000	2,145.00	19,305,000
芙蓉総合リース	1,400	5,680.00	7,952,000
興銀リース	2,300	2,614.00	6,012,200
東京センチュリー	2,400	4,015.00	9,636,000
日本証券金融	5,300	651.00	3,450,300
アイフル	20,000	347.00	6,940,000
ポケットカード	900	547.00	492,300
リコーリース	900	3,650.00	3,285,000
イオンフィナンシャルサービス	7,600	2,136.00	16,233,600
アコム	23,900	518.00	12,380,200
ジャックス	7,000	532.00	3,724,000
オリエン트コーポレーション	25,800	218.00	5,624,400
日立キャピタル	2,800	2,945.00	8,246,000
アプラスフィナンシャル	5,800	123.00	713,400
オリックス	84,000	1,833.50	154,014,000
三菱UFJリース	30,200	609.00	18,391,800
日本取引所グループ	36,900	1,711.00	63,135,900
イー・ギャランティ	400	2,449.00	979,600
アサックス	200	1,639.00	327,800
N E Cキャピタルソリューション	500	1,835.00	917,500
いちご	11,300	435.00	4,915,500
日本駐車場開発	14,300	168.00	2,402,400

ヒューリック	24,700	1,075.00	26,552,500
三栄建築設計	500	1,690.00	845,000
野村不動産ホールディングス	7,900	2,020.00	15,958,000
三重交通グループホールディングス	2,100	391.00	821,100
サムティ	1,000	1,116.00	1,116,000
ディア・ライフ	800	384.00	307,200
エー・ディー・ワークス	11,000	45.00	495,000
日本商業開発	700	2,044.00	1,430,800
プレサンスコーポレーション	1,800	1,479.00	2,662,200
ユニゾホールディングス	1,000	3,170.00	3,170,000
THEグローバル社	400	465.00	186,000
日本管理センター	900	1,381.00	1,242,900
サンセイランディック	200	712.00	142,400
エストラスト	200	625.00	125,000
フージャースホールディングス	1,600	619.00	990,400
オープンハウス	1,700	2,849.00	4,843,300
東急不動産ホールディングス	28,700	706.00	20,262,200
飯田グループホールディングス	9,900	2,243.00	22,205,700
ムゲンエステート	400	747.00	298,800
シーアールイー	200	1,533.00	306,600
エコナックホールディングス	5,000	58.00	290,000
パーク24	6,000	3,180.00	19,080,000
パラカ	300	1,994.00	598,200
三井不動産	63,000	2,763.00	174,069,000
三菱地所	88,000	2,364.50	208,076,000
平和不動産	2,300	1,638.00	3,767,400
東京建物	13,800	1,618.00	22,328,400
ダイビル	3,100	1,015.00	3,146,500
京阪神ビルディング	2,000	613.00	1,226,000
住友不動産	28,000	3,211.00	89,908,000
大京	22,000	239.00	5,258,000
テーオーシー	4,600	941.00	4,328,600
東京楽天地	2,000	518.00	1,036,000
レオパレス21	15,000	629.00	9,435,000
スターツコーポレーション	1,200	1,968.00	2,361,600
フジ住宅	1,500	752.00	1,128,000
空港施設	1,500	567.00	850,500
明和地所	700	697.00	487,900
住友不動産販売	1,100	2,826.00	3,108,600
ゴールドクレスト	1,100	2,137.00	2,350,700
日本エスリード	500	1,351.00	675,500
日神不動産	1,400	553.00	774,200
日本エスコン	1,600	449.00	718,400

タカラレーベン	5,200	690.00	3,588,000
サンヨーハウジング名古屋	600	1,082.00	649,200
イオンモール	7,700	1,717.00	13,220,900
ファースト住建	400	1,513.00	605,200
トーセイ	1,600	890.00	1,424,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	7,400	1,072.00	7,932,800
サンフロンティア不動産	1,300	1,060.00	1,378,000
エフ・ジェー・ネクスト	1,000	734.00	734,000
インテリックス	300	736.00	220,800
ランドビジネス	700	271.00	189,700
グランディハウス	1,000	401.00	401,000
日本空港ビルデング	3,800	4,405.00	16,739,000
日本工営	4,000	530.00	2,120,000
ネクスト	3,100	754.00	2,337,400
ジェイエシーリクルートメント	800	1,298.00	1,038,400
日本M&Aセンター	3,600	3,200.00	11,520,000
アコーディア・ゴルフ	3,800	1,201.00	4,563,800
中広	100	691.00	69,100
タケエイ	1,100	903.00	993,300
トラスト・テック	500	1,723.00	861,500
パソナグループ	1,100	793.00	872,300
C D S	300	1,047.00	314,100
リンクアンドモチベーション	3,000	425.00	1,275,000
G C A	1,100	868.00	954,800
エス・エム・エス	1,700	2,576.00	4,379,200
テンプホールディングス	9,700	1,791.00	17,372,700
リニカル	800	1,235.00	988,000
クックパッド	2,800	1,107.00	3,099,600
エスクリ	500	605.00	302,500
アイ・ケイ・ケイ	600	672.00	403,200
学情	500	1,189.00	594,500
スタジオアリス	500	2,275.00	1,137,500
シミックホールディングス	700	1,482.00	1,037,400
N J S	300	1,398.00	419,400
総合警備保障	4,600	4,510.00	20,746,000
カカクコム	9,000	1,921.00	17,289,000
ルネサンス	700	1,459.00	1,021,300
ディップ	1,600	2,367.00	3,787,200
オプトホールディング	900	720.00	648,000
新日本科学	1,400	580.00	812,000
ツクイ	3,000	749.00	2,247,000
キャリアデザインセンター	300	1,241.00	372,300
エムスリー	10,900	2,893.00	31,533,700

ツカダ・グローバルホールディング	900	717.00	645,300
アウトソーシング	700	3,340.00	2,338,000
ウェルネット	1,000	1,306.00	1,306,000
ワールドホールディングス	300	2,186.00	655,800
ディー・エヌ・エー	5,600	2,576.00	14,425,600
博報堂D Yホールディングス	17,400	1,435.00	24,969,000
ぐるなび	1,800	2,320.00	4,176,000
エスアールジータカミヤ	1,400	610.00	854,000
ジャパンベストレスキューシステム	1,600	245.00	392,000
ファンコミュニケーションズ	3,200	736.00	2,355,200
ライク	300	1,874.00	562,200
WDBホールディングス	500	1,228.00	614,000
ティア	600	631.00	378,600
バリューコマース	1,200	326.00	391,200
インフォマート	2,700	1,366.00	3,688,200
J Pホールディングス	3,600	255.00	918,000
E P Sホールディングス	1,500	1,344.00	2,016,000
レッグス	300	885.00	265,500
プレステージ・インターナショナル	1,800	747.00	1,344,600
アミューズ	700	1,813.00	1,269,100
ドリームインキュベータ	400	1,994.00	797,600
クイック	700	1,047.00	732,900
T A C	700	229.00	160,300
ケネディクス	16,900	426.00	7,199,400
電通	14,000	5,650.00	79,100,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	727.00	436,200
ぴあ	400	2,901.00	1,160,400
イオンファンタジー	400	3,065.00	1,226,000
シーティーエス	400	1,242.00	496,800
みらかホールディングス	3,200	5,190.00	16,608,000
アルプス技研	500	2,510.00	1,255,000
ダイオーズ	200	1,063.00	212,600
日本空調サービス	1,200	613.00	735,600
オリエンタルランド	13,600	6,659.00	90,562,400
ダスキン	3,200	2,341.00	7,491,200
明光ネットワークジャパン	1,600	1,079.00	1,726,400
ファルコホールディングス	600	1,449.00	869,400
秀英予備校	300	407.00	122,100
田谷	200	629.00	125,800
ラウンドワン	3,900	785.00	3,061,500
リゾートトラスト	4,900	2,183.00	10,696,700
ビー・エム・エル	1,600	2,772.00	4,435,200
ワタベウェディング	200	416.00	83,200

りらいあコミュニケーションズ	2,100	1,130.00	2,373,000
リソー教育	2,200	570.00	1,254,000
早稲田アカデミー	200	993.00	198,600
ユー・エス・エス	15,200	1,865.00	28,348,000
東京個別指導学院	400	813.00	325,200
サイバーエージェント	6,600	2,753.00	18,169,800
楽天	64,100	1,158.00	74,227,800
クリーク・アンド・リバー社	500	780.00	390,000
テー・オー・ダブリュー	1,000	666.00	666,000
セントラルスポーツ	400	2,681.00	1,072,400
フルキャストホールディングス	1,300	949.00	1,233,700
リソルホールディングス	1,000	328.00	328,000
テクノプロ・ホールディングス	2,000	3,770.00	7,540,000
アトラ	200	834.00	166,800
インターワークス	300	1,010.00	303,000
K e e P e r 技研	100	1,915.00	191,500
ファーストロジック	100	2,129.00	212,900
デザインワン・ジャパン	100	2,159.00	215,900
イー・ガーディアン	400	1,264.00	505,600
リブセンス	900	446.00	401,400
ジャパンマテリアル	500	3,575.00	1,787,500
ベクトル	1,000	1,099.00	1,099,000
ウチヤマホールディングス	600	429.00	257,400
サクセスホールディングス	100	1,203.00	120,300
キャリアリンク	300	796.00	238,800
I B J	1,000	635.00	635,000
アサンテ	500	1,710.00	855,000
N・フィールド	600	1,406.00	843,600
M&Aキャピタルパートナーズ	200	3,045.00	609,000
ライドオン・エクスプレス	300	868.00	260,400
E R Iホールディングス	300	756.00	226,800
アピスト	200	3,135.00	627,000
ウィルグループ	500	604.00	302,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	200	1,509.00	301,800
日本ビューホテル	200	1,488.00	297,600
リクルートホールディングス	27,400	4,655.00	127,547,000
エラン	200	1,314.00	262,800
土木管理総合試験所	100	793.00	79,300
日本郵政	32,700	1,489.00	48,690,300
ベルシステム24ホールディングス	1,900	949.00	1,803,100
ソラスト	600	1,185.00	711,000
リログループ	500	16,250.00	8,125,000
東祥	300	5,310.00	1,593,000

エイチ・アイ・エス	2,100	3,025.00	6,352,500
ラックランド	200	2,067.00	413,400
共立メンテナンス	1,000	7,050.00	7,050,000
イチネンホールディングス	1,300	1,143.00	1,485,900
建設技術研究所	800	1,070.00	856,000
スペース	700	1,285.00	899,500
燦ホールディングス	200	1,558.00	311,600
スバル興業	1,000	492.00	492,000
東京テアトル	5,000	154.00	770,000
タナベ経営	300	1,288.00	386,400
ナガワ	200	4,200.00	840,000
よみうりランド	2,000	497.00	994,000
東京都競馬	9,000	276.00	2,484,000
常磐興産	500	1,555.00	777,500
カナモト	1,800	3,120.00	5,616,000
東京ドーム	5,000	1,170.00	5,850,000
西尾レントオール	1,000	3,605.00	3,605,000
トランス・コスモス	1,400	2,733.00	3,826,200
乃村工藝社	2,700	1,680.00	4,536,000
藤田観光	4,000	373.00	1,492,000
KNT - CTホールディングス	7,000	144.00	1,008,000
日本管財	1,100	1,800.00	1,980,000
トーカイ	600	3,980.00	2,388,000
白洋舎	100	2,732.00	273,200
セコム	13,100	8,582.00	112,424,200
セントラル警備保障	600	1,942.00	1,165,200
丹青社	2,200	820.00	1,804,000
メイテック	1,500	4,450.00	6,675,000
アサツー ディ・ケイ	2,100	2,876.00	6,039,600
応用地質	1,100	1,359.00	1,494,900
船井総研ホールディングス	1,600	1,824.00	2,918,400
進学会	500	567.00	283,500
オオバ	900	456.00	410,400
学究社	300	1,416.00	424,800
ベネッセホールディングス	4,200	3,250.00	13,650,000
イオンディライト	1,400	3,250.00	4,550,000
ナック	800	972.00	777,600
ニチイ学館	2,200	862.00	1,896,400
ダイセキ	2,200	2,286.00	5,029,200
ステップ	400	1,333.00	533,200
合 計	18,160,900		26,988,375,700

(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28年 6月27日現在	平成28年12月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,018,017,609	1,145,521,417
コール・ローン	258,252,167	380,042,015
出資金	-	8,377,888
株式	60,263,865,073	74,169,705,951
投資証券	1,797,145,408	1,973,237,719
派生商品評価勘定	-	21,230,531
未収入金	2,309,007	142,935
未収配当金	103,367,198	85,062,586
差入委託証拠金	234,542,987	172,088,523
流動資産合計	63,677,499,449	77,955,409,565
資産合計	63,677,499,449	77,955,409,565
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	74,855,038	4,971,413
未払金	-	217,800
未払解約金	49,840,927	307,828,685
未払利息	412	334
流動負債合計	124,696,377	313,018,232
負債合計	124,696,377	313,018,232
純資産の部		
元本等		
元本	38,699,928,355	37,314,699,206
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	24,852,874,717	40,327,692,127
元本等合計	63,552,803,072	77,642,391,333
純資産合計	63,552,803,072	77,642,391,333
負債純資産合計	63,677,499,449	77,955,409,565

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	出資金、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。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券
--------------------	--

	<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</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> <p>(2) 為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

		平成28年 6月27日現在	平成28年12月26日現在
1.	期首	平成27年12月26日	平成28年 6月28日
	期首元本額	38,512,109,073円	38,699,928,355円
	期首からの追加設定元本額	1,826,922,613円	1,658,069,455円
	期首からの一部解約元本額	1,639,103,331円	3,043,298,604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）	14,480,711,934円	14,738,958,804円
	DCインデックスバランス（株式20）	49,381,602円	51,755,877円
	DCインデックスバランス（株式40）	170,813,413円	168,341,653円
	DCインデックスバランス（株式60）	310,574,069円	314,357,822円
	DCインデックスバランス（株式80）	349,107,576円	353,978,238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	3,644,464,969円	3,181,104,450円
	日興五大陸株式ファンド	6,954,834,498円	6,605,352,995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	31,054,706円	28,616,258円
	インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）	- 円	108,505,614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）	1,837,557円	1,837,557円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	7,070,597円	6,407,468円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	5,809,840円	5,233,751円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	8,831,229円	7,553,149円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	11,331,022円	9,797,467円

国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	7,476,439,018円	6,712,682,456円
グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	10,215,961円	8,749,394円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	32,809,443円	29,487,715円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	97,076,286円	89,644,984円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	130,900,460円	125,300,408円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	128,355,534円	128,568,232円
インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,798,308,641円	4,638,464,914円
計	38,699,928,355円	37,314,699,206円
2. 受益権の総数	38,699,928,355口	37,314,699,206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12月26日 至 平成28年 6月27日	自 平成28年 6月28日 至 平成28年12月26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28年 6月27日現在	平成28年12月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左

時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記 「有価証券の評価基準及び評価方法」に 記載しております。 (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

(平成28年12月26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
出資金	167,191
株式	3,342,349,233
投資証券	51,994,628
合計	3,290,521,796

(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	1,513,541,058	-	1,467,473,865	46,067,193
合計		1,513,541,058	-	1,467,473,865	46,067,193

(平成28年12月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,350,276,818	-	1,348,477,496	1,799,322
合計		1,350,276,818	-	1,348,477,496	1,799,322

(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

(平成28年12月26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	848,034,280	-	862,576,000	14,541,720
	米ドル	629,263,780	-	642,509,500	13,245,720
	ユーロ	218,770,500	-	220,066,500	1,296,000
	売建	740,123,180	-	736,606,460	3,516,720
	米ドル	558,117,500	-	555,772,500	2,345,000
	ユーロ	91,933,500	-	91,642,500	291,000
	英ポンド	57,992,580	-	57,260,260	732,320
	スイスフラン	32,079,600	-	31,931,200	148,400
	合計	1,588,157,460	-	1,599,182,460	18,058,440

(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28年 6月27日現在		平成28年12月26日現在	
1口当たり純資産額	1.6422円	1口当たり純資産額	2.0807円
(1万口当たり純資産額)	(16,422円)	(1万口当たり純資産額)	(20,807円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	11,773	71.25	838,826.25	
	ANTERO RESOURCES CORP	3,670	24.27	89,070.90	
	APACHE CORP	7,904	66.40	524,825.60	
	BAKER HUGHES INC	8,835	64.93	573,656.55	
	CABOT OIL & GAS CORP	9,730	22.79	221,746.70	
	CHENIERE ENERGY INC	4,380	41.55	181,989.00	
	CHEVRON CORP	39,781	118.42	4,710,866.02	
	CIMAREX ENERGY CO	2,005	135.72	272,118.60	
	CONCHO RESOURCES INC	3,055	136.33	416,488.15	
	CONOCOPHILLIPS	26,010	51.37	1,336,133.70	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,960	52.58	103,056.80	
	CORE LABORATORIES N.V.	1,080	119.44	128,995.20	
	DEVON ENERGY CORPORATION	9,991	46.54	464,981.14	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	1,600	102.93	164,688.00	
	EOG RESOURCES INC	11,802	102.03	1,204,158.06	
	EQT CORP	3,885	66.40	257,964.00	
	EXXON MOBIL CORP	87,431	90.71	7,930,866.01	
	FMC TECHNOLOGIES INC	4,415	35.02	154,613.30	
	HALLIBURTON CO	18,027	54.84	988,600.68	
	HELMERICH & PAYNE	2,120	78.34	166,080.80	
	HESS CORP	6,000	63.78	382,680.00	
	HOLLYFRONTIER CORP	3,740	33.13	123,906.20	
	KINDER MORGAN INC	40,460	21.13	854,919.80	
	MARATHON OIL CORP	17,867	18.06	322,678.02	
MARATHON PETROLEUM CORP	11,412	50.78	579,501.36		
MURPHY OIL CORP	3,715	32.31	120,031.65		

NATIONAL OILWELL VARCO INC	8,231	38.38	315,905.78
NEWFIELD EXPLORATION CO	4,040	42.40	171,296.00
NOBLE ENERGY INC	9,492	39.19	371,991.48
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	16,031	72.11	1,155,995.41
ONEOK INC	4,590	58.69	269,387.10
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	3,070	35.56	109,169.20
PHILLIPS 66	9,895	87.72	867,989.40
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,590	185.01	664,185.90
RANGE RESOURCES CORP	4,050	34.70	140,535.00
SCHLUMBERGER LTD	29,271	85.51	2,502,963.21
SOUTHWESTERN ENERGY CO	10,435	11.01	114,889.35
SPECTRA ENERGY CORP	15,234	41.54	632,820.36
TARGA RESOURCES CORP	3,420	58.04	198,496.80
TESORO CORP	2,530	90.95	230,103.50
VALERO ENERGY CORP	9,722	68.96	670,429.12
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	20,199	5.02	101,398.98
WILLIAMS COS INC	15,074	31.56	475,735.44
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	4,255	146.48	623,272.40
ALBEMARLE CORP	2,540	88.82	225,602.80
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	1,310	110.02	144,126.20
AVERY DENNISON CORP	1,820	71.43	130,002.60
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	4,170	27.05	112,798.50
BALL CORP	3,420	76.22	260,672.40
CELANESE CORP-SERIES A	3,270	80.68	263,823.60
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,850	30.71	148,943.50
CROWN HOLDINGS INC	2,815	53.49	150,574.35
DOW CHEMICAL CO/THE	23,723	58.43	1,386,134.89
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	18,358	74.93	1,375,564.94
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,395	76.56	259,921.20
ECOLAB INC	5,690	118.76	675,744.40
FMC CORP	2,790	56.69	158,165.10
FREEPORT-MCMORAN INC	25,748	13.81	355,579.88
INTERNATIONAL PAPER CO	8,120	54.03	438,723.60
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,664	118.24	196,751.36
LYONDELLBASELL INDU-CL A	7,430	87.70	651,611.00

MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,245	225.11	280,261.95
MONSANTO CO	9,321	105.26	981,128.46
MOSAIC CO/THE	6,820	29.18	199,007.60
NEWMONT MINING CORP	11,290	32.46	366,473.40
NUCOR CORP	6,569	61.49	403,927.81
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,950	86.48	168,636.00
PPG INDUSTRIES INC	5,524	94.69	523,067.56
PRAXAIR INC	6,190	117.59	727,882.10
SEALED AIR CORP	4,356	46.34	201,857.04
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,687	272.30	459,370.10
VALSPAR CORP/THE	1,530	103.48	158,324.40
VULCAN MATERIALS CO	2,743	125.59	344,493.37
WESTROCK CO	5,329	51.89	276,521.81
WR GRACE & CO	1,400	67.78	94,892.00
3M CO	12,756	178.75	2,280,135.00
ACUITY BRANDS INC	960	234.92	225,523.20
AERCAP HOLDINGS NV	3,450	42.20	145,590.00
AGCO CORP	1,670	57.76	96,459.20
AMETEK INC	5,073	49.45	250,859.85
ARCONIC INC	9,363	19.78	185,200.14
B/E AEROSPACE INC	2,060	60.03	123,661.80
BOEING CO/THE	12,502	157.81	1,972,940.62
CATERPILLAR INC	12,366	94.32	1,166,361.12
CUMMINS INC	3,385	138.24	467,942.40
DEERE & CO	5,710	103.12	588,815.20
DOVER CORP	3,150	75.60	238,140.00
EATON CORP PLC	9,756	68.26	665,944.56
EMERSON ELECTRIC CO	13,520	56.80	767,936.00
FASTENAL CO	6,153	48.14	296,205.42
FLOWSERVE CORP	2,965	48.82	144,751.30
FLUOR CORP	2,903	53.51	155,339.53
FORTIVE CORP	6,734	54.51	367,070.34
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,160	54.98	173,736.80
GENERAL DYNAMICS CORP	5,542	175.25	971,235.50
GENERAL ELECTRIC CO	189,293	31.88	6,034,660.84

HONEYWELL INTERNATIONAL INC	15,256	116.99	1,784,799.44
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	960	187.01	179,529.60
ILLINOIS TOOL WORKS	6,900	124.85	861,465.00
INGERSOLL-RAND PLC	5,336	76.86	410,124.96
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,810	58.19	163,513.90
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	5,300	54.65	289,645.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	19,704	42.50	837,420.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	1,651	153.15	252,850.65
LOCKHEED MARTIN CORP	5,601	249.59	1,397,953.59
MASCO CORP	7,529	32.06	241,379.74
MIDDLEBY CORP	1,180	130.43	153,907.40
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,664	232.99	853,675.36
PACCAR INC	7,404	65.43	484,443.72
PARKER HANNIFIN CORP	2,760	142.74	393,962.40
PENTAIR PLC	3,498	56.82	198,756.36
RAYTHEON COMPANY	6,242	143.30	894,478.60
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,683	136.01	364,914.83
ROCKWELL COLLINS INC.	2,735	93.97	257,007.95
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,150	185.93	399,749.50
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,970	40.04	158,958.80
SMITH (A.O.) CORP	3,020	47.84	144,476.80
SNAP-ON INC	1,250	173.41	216,762.50
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,116	116.69	363,606.04
TEXTRON INC	5,416	48.94	265,059.04
TRANSDIGM GROUP INC	1,190	250.10	297,619.00
UNITED RENTALS INC	1,840	108.06	198,830.40
UNITED TECHNOLOGIES CORP	16,785	110.65	1,857,260.25
WABCO HOLDINGS INC	1,110	108.35	120,268.50
WABTEC CORP	1,880	83.91	157,750.80
WW GRAINGER INC	1,197	237.06	283,760.82
XYLEM INC	3,548	51.01	180,983.48
CINTAS CORP	1,727	116.36	200,953.72
DUN & BRADSTREET CORP	872	123.27	107,491.44
EQUIFAX INC	2,634	119.65	315,158.10
IHS MARKIT LTD	7,543	35.39	266,946.77

MANPOWERGROUP INC	1,447	90.39	130,794.33
NIELSEN HOLDINGS PLC	7,405	42.75	316,563.75
REPUBLIC SERVICES INC	5,100	57.36	292,536.00
ROBERT HALF INTL INC	2,375	48.95	116,256.25
STERICYCLE INC	1,705	77.46	132,069.30
VERISK ANALYTICS INC	3,170	82.11	260,288.70
WASTE CONNECTIONS INC	3,871	79.07	306,079.97
WASTE MANAGEMENT INC	9,154	70.92	649,201.68
AMERCO	155	371.16	57,529.80
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	2,840	48.48	137,683.20
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	2,900	74.54	216,166.00
CSX CORP	20,143	36.65	738,240.95
DELTA AIR LINES INC	3,955	49.89	197,314.95
EXPEDITORS INTL WASH INC	3,647	53.70	195,843.90
FEDEX CORP	5,318	191.86	1,020,311.48
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,000	97.47	194,940.00
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	97,000	0.44	42,680.00
KANSAS CITY SOUTHERN	2,390	85.29	203,843.10
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	1,570	82.81	130,011.70
NORFOLK SOUTHERN CORP	6,270	109.28	685,185.60
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,400	50.45	171,530.00
UNION PACIFIC CORP	17,546	105.18	1,845,488.28
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	1,715	74.79	128,264.85
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	14,617	115.97	1,695,133.49
AUTOLIV INC	1,770	111.46	197,284.20
BORGWARNER INC	4,330	39.73	172,030.90
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	5,640	67.80	382,392.00
FORD MOTOR COMPANY	78,255	12.46	975,057.30
GENERAL MOTORS CORP	29,485	35.69	1,052,319.65
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	5,430	31.64	171,805.20
HARLEY-DAVIDSON INC	3,709	58.18	215,789.62
LEAR CORP	1,560	133.55	208,338.00
TESLA MOTORS INC	2,480	213.34	529,083.20
COACH INC	6,286	34.36	215,986.96
DR HORTON INC	7,936	27.56	218,716.16

GARMIN LTD	2,395	50.47	120,875.65
HANESBRANDS INC	7,940	21.69	172,218.60
HARMAN INTERNATIONAL	1,600	110.96	177,536.00
HASBRO INC	2,538	78.36	198,877.68
LEGGETT & PLATT INC	2,778	49.68	138,011.04
LENNAR CORP-CL A	3,900	42.56	165,984.00
LULULEMON ATHLETICA INC	2,440	64.41	157,160.40
MATTEL INC	7,349	28.34	208,270.66
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	3,530	42.84	151,225.20
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,318	203.71	268,489.78
NEWELL BRANDS INC	9,146	45.39	415,136.94
NIKE INC -CL B	28,388	51.91	1,473,621.08
POLARIS INDUSTRIES INC	1,420	80.22	113,912.40
PULTE GROUP INC	6,890	18.38	126,638.20
PVH CORP	1,750	90.04	157,570.00
RALPH LAUREN CORP	1,165	89.45	104,209.25
TOLL BROTHERS INC	3,781	31.33	118,458.73
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	3,560	29.29	104,272.40
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	4,112	25.23	103,745.76
VF CORP	7,100	53.30	378,430.00
WHIRLPOOL CORP	1,614	181.95	293,667.30
ARAMARK	4,960	36.22	179,651.20
CARNIVAL CORP	7,257	53.03	384,838.71
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	605	389.77	235,810.85
DARDEN RESTAURANTS INC	2,553	74.48	190,147.44
DOMINO'S PIZZA INC	1,020	161.57	164,801.40
H&R BLOCK INC	4,510	23.28	104,992.80
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	11,130	27.37	304,628.10
LAS VEGAS SANDS CORP	9,060	54.25	491,505.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	7,043	84.09	592,245.87
MCDONALD'S CORP	17,951	123.14	2,210,486.14
MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	4,100	15.68	64,288.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	9,760	29.36	286,553.60
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	3,220	43.51	140,102.20
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,538	84.25	298,076.50

STARBUCKS CORP	30,834	57.01	1,757,846.34
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,240	77.23	172,995.20
WYNN RESORTS LTD	1,660	88.34	146,644.40
YUM! BRANDS INC	7,594	63.81	484,573.14
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	8,698	64.67	562,499.66
CHARTER COMMUNICATION-A	4,551	290.43	1,321,746.93
COMCAST CORP-CLASS A	50,597	70.65	3,574,678.05
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,320	28.00	92,960.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	4,690	27.30	128,037.00
DISH NETWORK CORP-A	4,769	58.89	280,846.41
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	8,736	23.60	206,169.60
LIBERTY BROADBAND-C	2,140	74.72	159,900.80
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	2,151	21.74	46,762.74
LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,475	30.86	138,098.50
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	13,641	29.79	406,365.39
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	4,240	34.53	146,407.20
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	1,975	34.91	68,947.25
NEWS CORP - CLASS A	7,570	11.73	88,796.10
OMNICOM GROUP	5,007	86.37	432,454.59
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	1,620	72.51	117,466.20
SIRIUS XM HOLDINGS INC	34,250	4.51	154,467.50
TEGNA INC	4,330	21.99	95,216.70
THE WALT DISNEY CO.	32,153	105.15	3,380,887.95
TIME WARNER INC	16,348	96.41	1,576,110.68
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	8,559	27.70	237,084.30
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	22,672	28.38	643,431.36
VIACOM INC-CLASS B	7,248	35.15	254,767.20
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,608	170.89	274,791.12
AMAZON.COM INC	8,495	760.59	6,461,212.05
AUTONATION INC	1,650	48.99	80,833.50
AUTOZONE INC	642	795.82	510,916.44
BED BATH & BEYOND INC	3,512	40.77	143,184.24
BEST BUY CO INC	6,114	44.77	273,723.78
CARMAX INC	4,269	64.04	273,386.76
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,110	52.30	110,353.00

DOLLAR GENERAL CORP/OLD	5,980	74.14	443,357.20
DOLLAR TREE INC	4,896	78.70	385,315.20
EXPEDIA INC	2,682	113.86	305,372.52
FOOT LOCKER INC	2,820	71.75	202,335.00
GAP INC/THE	5,106	22.58	115,293.48
GENUINE PARTS CO	3,201	96.90	310,176.90
HOME DEPOT INC	26,090	135.05	3,523,454.50
KOHL'S CORP	3,872	49.86	193,057.92
L BRANDS INC	5,308	66.69	353,990.52
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	8,930	19.93	177,974.90
LKQ CORP	6,330	30.93	195,786.90
LOWE'S COS INC	18,562	72.30	1,342,032.60
MACY'S INC	6,469	36.48	235,989.12
NETFLIX INC	9,090	125.59	1,141,613.10
NORDSTROM INC	2,850	48.75	138,937.50
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,015	283.22	570,688.30
PRICELINE GROUP INC/THE	1,045	1,486.20	1,553,079.00
ROSS STORES INC	8,572	67.11	575,266.92
SIGNET JEWELERS LTD	1,500	93.21	139,815.00
STAPLES INC	13,744	9.22	126,719.68
TARGET CORP	11,490	73.50	844,515.00
TIFFANY & CO	2,610	77.13	201,309.30
TJX COMPANIES INC	13,773	76.44	1,052,808.12
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,750	76.13	209,357.50
TRIPADVISOR INC	2,330	46.54	108,438.20
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	1,240	256.86	318,506.40
COSTCO WHOLESALE CORP	9,219	162.08	1,494,215.52
CVS HEALTH CORP	22,507	79.14	1,781,203.98
KROGER CO	19,050	35.08	668,274.00
RITE AID CORP	22,930	8.39	192,382.70
SYSCO CORP	11,386	56.23	640,234.78
WAL-MART STORES INC	32,702	69.54	2,274,097.08
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	19,452	84.28	1,639,414.56
WHOLE FOODS MARKET INC	7,080	31.91	225,922.80
ALTRIA GROUP INC	41,228	67.72	2,791,960.16

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	12,443	45.15	561,801.45
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	4,224	44.83	189,361.92
BUNGE LTD	3,107	71.43	221,933.01
CAMPBELL SOUP CO	4,215	60.28	254,080.20
COCA-COLA CO/THE	86,362	41.60	3,592,659.20
CONAGRA BRANDS INC	8,960	39.77	356,339.20
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,720	150.79	560,938.80
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	4,109	90.78	373,015.02
GENERAL MILLS INC	12,569	62.16	781,289.04
HERSHEY CO/THE	3,015	103.62	312,414.30
HORMEL FOODS CORP	5,960	35.31	210,447.60
INGREDION INC	1,470	125.87	185,028.90
JM SMUCKER CO/THE	2,530	129.46	327,533.80
KELLOGG CO	5,708	73.57	419,937.56
KRAFT HEINZ CO/THE	12,851	87.57	1,125,362.07
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,275	93.05	211,688.75
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	3,991	71.25	284,358.75
MOLSON COORS BREWING CO -B	4,080	97.74	398,779.20
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	32,675	45.01	1,470,701.75
MONSTER BEVERAGE CORP	8,290	45.57	377,775.30
PEPSICO INC	30,301	105.09	3,184,332.09
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	32,768	91.58	3,000,893.44
REYNOLDS AMERICAN INC	18,036	56.03	1,010,557.08
TYSON FOODS INC-CL A	6,456	62.55	403,822.80
WHITEWAVE FOODS CO	3,520	55.50	195,360.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,430	44.72	242,829.60
CLOROX COMPANY	2,736	120.90	330,782.40
COLGATE-PALMOLIVE CO	17,980	66.27	1,191,534.60
COTY INC-CL A	10,000	18.67	186,700.00
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	1,311	73.96	96,961.56
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,740	78.38	371,521.20
KIMBERLY-CLARK CORP	7,673	114.82	881,013.86
PROCTER & GAMBLE CO	53,959	84.96	4,584,356.64
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	520	121.28	63,065.60
ABBOTT LABORATORIES	30,847	38.42	1,185,141.74

AETNA INC	7,319	125.95	921,828.05
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,470	98.50	144,795.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,024	78.56	316,125.44
ANTHEM INC	5,606	146.02	818,588.12
BAXTER INTERNATIONAL INC	10,399	44.22	459,843.78
BECTON DICKINSON AND CO	4,607	166.48	766,973.36
BOSTON SCIENTIFIC CORP	28,738	21.81	626,775.78
CARDINAL HEALTH INC	6,565	72.88	478,457.20
CENTENE CORP	3,770	58.64	221,072.80
CERNER CORP	6,590	48.04	316,583.60
CIGNA CORP	5,350	138.61	741,563.50
COOPER COS INC/THE	1,040	175.43	182,447.20
CR BARD INC	1,574	223.10	351,159.40
DANAHER CORP	13,029	78.95	1,028,639.55
DAVITA INC	3,438	65.20	224,157.60
DENTSPLY SIRONA INC	4,852	59.24	287,432.48
DEXCOM INC	1,700	62.51	106,267.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,410	93.00	410,130.00
ENVISION HEALTHCARE CORP	2,312	65.34	151,066.08
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	13,434	69.00	926,946.00
HCA HOLDINGS INC	6,425	74.46	478,405.50
HENRY SCHEIN INC	1,670	152.79	255,159.30
HOLOGIC INC	5,708	40.33	230,203.64
HUMANA INC	3,115	205.53	640,225.95
IDEXX LABORATORIES INC	1,830	119.88	219,380.40
INTUITIVE SURGICAL INC	820	640.75	525,415.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,155	128.23	276,335.65
MCKESSON CORP	4,764	141.18	672,581.52
MEDNAX INC	1,860	67.76	126,033.60
MEDTRONIC PLC	29,318	71.95	2,109,430.10
PATTERSON COS INC	2,042	40.85	83,415.70
QUEST DIAGNOSTICS	3,116	92.41	287,949.56
RESMED INC	2,950	62.03	182,988.50
ST JUDE MEDICAL INC	6,120	79.83	488,559.60
STRYKER CORP	7,233	120.76	873,457.08

TELEFLEX INC	900	161.43	145,287.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	20,060	163.03	3,270,381.80
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,810	107.93	195,353.30
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,924	91.01	175,103.24
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	4,162	102.32	425,855.84
ABBVIE INC	34,386	62.34	2,143,623.24
AGILENT TECHNOLOGIES INC	7,010	46.20	323,862.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	4,730	127.19	601,608.70
ALKERMES PLC	3,220	57.99	186,727.80
ALLERGAN PLC	8,345	199.08	1,661,322.60
AMGEN INC	15,771	147.55	2,327,011.05
BIOGEN INC	4,613	287.53	1,326,375.89
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,500	85.66	299,810.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	35,161	59.61	2,095,947.21
CELGENE CORP	16,324	118.93	1,941,413.32
ELI LILLY & CO	20,913	73.79	1,543,170.27
ENDO INTERNATIONAL PLC	4,160	16.27	67,683.20
GILEAD SCIENCES INC	27,824	73.64	2,048,959.36
ILLUMINA INC	3,175	128.75	408,781.25
INCYTE CORP	3,680	102.94	378,819.20
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,330	110.40	146,832.00
JOHNSON & JOHNSON	57,681	115.96	6,688,688.76
MALLINCKRODT PLC	2,400	53.18	127,632.00
MERCK & CO. INC.	58,273	59.56	3,470,739.88
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	600	426.07	255,642.00
MYLAN NV	9,585	37.50	359,437.50
PERRIGO CO PLC	3,039	84.98	258,254.22
PFIZER INC	127,850	32.48	4,152,568.00
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	3,113	76.22	237,272.86
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,620	381.78	618,483.60
SEATTLE GENETICS INC	2,020	61.86	124,957.20
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	19,610	36.82	722,040.20
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	8,314	141.84	1,179,257.76
UNITED THERAPEUTICS CORP	940	142.01	133,489.40
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,320	74.31	395,329.20

WATERS CORP	1,666	136.21	226,925.86
ZOETIS INC	10,200	53.78	548,556.00
BANK OF AMERICA CORP	215,039	22.60	4,859,881.40
BB&T CORP	16,708	47.54	794,298.32
CIT GROUP INC	4,085	43.82	179,004.70
CITIGROUP INC	61,197	60.99	3,732,405.03
CITIZENS FINANCIAL GROUP	11,210	36.33	407,259.30
COMERICA INC	3,360	69.25	232,680.00
FIFTH THIRD BANCORP	16,559	27.68	458,353.12
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,070	91.57	281,119.90
HUNTINGTON BANCSHARES INC	21,790	13.42	292,421.80
JPMORGAN CHASE & CO	76,140	87.05	6,627,987.00
KEYCORP	22,678	18.47	418,862.66
M & T BANK CORP	2,813	157.10	441,922.30
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	9,654	15.79	152,436.66
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	6,370	19.36	123,323.20
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	10,310	117.96	1,216,167.60
REGIONS FINANCIAL CORP	25,864	14.56	376,579.84
SIGNATURE BANK	990	150.35	148,846.50
SUNTRUST BANKS INC	10,377	56.17	582,876.09
US BANCORP	35,991	52.20	1,878,730.20
WELLS FARGO & CO	101,030	55.96	5,653,638.80
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,100	143.98	158,378.00
ALLY FINANCIAL INC	9,120	19.71	179,755.20
AMERICAN EXPRESS CO	16,484	74.97	1,235,805.48
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,470	111.93	388,397.10
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	22,392	47.58	1,065,411.36
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	25,670	165.32	4,243,764.40
BLACKROCK INC	2,555	385.74	985,565.70
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	10,715	89.68	960,921.20
CME GROUP INC	7,140	116.92	834,808.80
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	8,510	72.64	618,166.40
E*TRADE FINANCIAL CORP	5,840	35.43	206,911.20
EATON VANCE CORP	2,260	42.22	95,417.20
FRANKLIN RESOURCES INC	7,995	40.48	323,637.60

GOLDMAN SACHS GROUP INC	7,728	240.97	1,862,216.16
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	12,600	56.82	715,932.00
INVESCO LTD	8,467	30.86	261,291.62
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	23.54	171,959.70
MOODY'S CORP	3,637	95.42	347,042.54
MORGAN STANLEY	30,365	43.06	1,307,516.90
MSCI INC	2,000	78.59	157,180.00
NASDAQ INC	2,555	67.17	171,619.35
NAVIENT CORP	7,192	16.66	119,818.72
NORTHERN TRUST CORP	4,420	89.53	395,722.60
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,500	71.80	179,500.00
S&P GLOBAL INC	5,632	109.02	614,000.64
SCHWAB (CHARLES) CORP	24,944	40.32	1,005,742.08
SEI INVESTMENTS COMPANY	2,715	49.40	134,121.00
STATE STREET CORP	8,347	78.69	656,825.43
SYNCHRONY FINANCIAL	17,550	36.97	648,823.50
T ROWE PRICE GROUP INC	4,925	76.59	377,205.75
TD AMERITRADE HOLDING CORP	5,270	44.47	234,356.90
VOYA FINANCIAL INC	4,150	40.29	167,203.50
AFLAC INC	8,622	70.15	604,833.30
ALLEGHANY CORP	330	613.74	202,534.20
ALLSTATE CORP	8,143	74.58	607,304.94
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	22,595	66.41	1,500,533.95
AON PLC	5,797	112.89	654,423.33
ARCH CAPITAL GROUP LTD	2,775	87.25	242,118.75
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,300	52.01	171,633.00
ASSURANT INC	1,270	93.28	118,465.60
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,175	65.87	143,267.25
CHUBB LTD	9,795	133.11	1,303,812.45
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,400	76.49	260,066.00
EVEREST RE GROUP LTD	874	217.46	190,060.04
FNF GROUP	5,241	34.02	178,298.82
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	8,312	48.25	401,054.00
LINCOLN NATIONAL CORP	4,933	67.59	333,421.47
LOEWS CORP	6,485	47.51	308,102.35

MARKEL CORP	310	904.03	280,249.30
MARSH & MCLENNAN COS	10,823	68.52	741,591.96
METLIFE INC	19,735	54.43	1,074,176.05
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6,430	58.41	375,576.30
PROGRESSIVE CORP	12,350	35.60	439,660.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	9,272	106.20	984,686.40
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,310	126.95	166,304.50
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	887	136.45	121,031.15
TORCHMARK CORP	2,216	74.27	164,582.32
TRAVELERS COS INC/THE	6,034	122.12	736,872.08
UNUM GROUP	4,788	44.47	212,922.36
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,758	124.49	343,343.42
WR BERKLEY CORP	2,063	66.68	137,560.84
XL GROUP LTD	6,310	37.99	239,716.90
CBRE GROUP INC	6,610	31.61	208,942.10
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	23,700	6.22	147,414.00
JONES LANG LASALLE INC	890	100.54	89,480.60
ACCENTURE PLC-CL A	13,158	117.48	1,545,801.84
ACTIVISION BLIZZARD INC	12,800	36.50	467,200.00
ADOBE SYSTEMS INC	10,529	105.02	1,105,755.58
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	3,690	67.63	249,554.70
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,275	233.64	297,891.00
ALPHABET INC-CL A	6,200	807.80	5,008,360.00
ALPHABET INC-CL C	6,532	789.91	5,159,692.12
ANSYS INC	1,820	92.80	168,896.00
AUTODESK INC	4,190	76.00	318,440.00
AUTOMATIC DATA PROCESSING	9,796	102.93	1,008,302.28
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	2,420	66.08	159,913.60
CA INC	6,760	32.05	216,658.00
CADENCE DESIGN SYS INC	6,170	25.76	158,939.20
CDK GLOBAL INC	2,720	60.54	164,668.80
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2,670	84.89	226,656.30
CITRIX SYSTEMS INC	3,228	90.84	293,231.52
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	12,808	56.49	723,523.92
COMPUTER SCIENCES CORP	2,890	60.88	175,943.20

COSTAR GROUP INC	660	190.79	125,921.40
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	4,720	56.09	264,744.80
EBAY INC	22,607	29.79	673,462.53
ELECTRONIC ARTS INC	6,504	80.67	524,677.68
FACEBOOK INC-A	48,970	117.27	5,742,711.90
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	6,925	76.02	526,438.50
FIRST DATA CORP- CLASS-A	6,130	14.68	89,988.40
FISERV INC	4,688	108.00	506,304.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,950	143.44	279,708.00
FORTINET INC	3,100	29.17	90,427.00
GARTNER INC	1,750	102.75	179,812.50
GLOBAL PAYMENTS INC	3,200	70.30	224,960.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	19,242	166.71	3,207,833.82
INTUIT INC	5,156	116.92	602,839.52
MASTERCARD INC	20,490	104.71	2,145,507.90
MERCADOLIBRE INC	810	156.66	126,894.60
MICROSOFT CORP	156,324	63.24	9,885,929.76
MOBILEYE NV	3,560	34.74	123,674.40
NUANCE COMMUNICATIONS INC	5,800	14.90	86,420.00
ORACLE CORP	65,443	38.78	2,537,879.54
PAYCHEX INC	7,052	61.73	435,319.96
PAYPAL HOLDINGS INC	23,217	39.58	918,928.86
RED HAT INC	3,820	71.01	271,258.20
SABRE CORP	4,520	24.84	112,276.80
SALESFORCE.COM INC	13,670	69.87	955,122.90
SERVICENOW INC	3,630	76.02	275,952.60
SPLUNK INC	2,830	52.57	148,773.10
SYMANTEC CORP	13,055	24.14	315,147.70
SYNOPSYS INC	3,207	59.76	191,650.32
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,636	49.99	181,763.64
TWITTER INC	12,260	16.50	202,290.00
VANTIV INC - CL-A	3,730	59.31	221,226.30
VERISIGN INC	2,220	76.47	169,763.40
VISA INC-CLASS A SHARES	39,772	78.15	3,108,181.80
VMWARE INC	1,555	80.12	124,586.60

WESTERN UNION CO	10,451	21.85	228,354.35
WORKDAY INC-CLASS A	2,520	67.47	170,024.40
XEROX CORP	19,754	8.95	176,798.30
YAHOO! INC	19,225	38.66	743,238.50
ZILLOW GROUP INC - C	2,000	37.23	74,460.00
AMPHENOL CORP-CL A	6,450	68.30	440,535.00
APPLE INC	113,642	116.52	13,241,565.84
ARROW ELECTRONICS INC	1,930	71.98	138,921.40
AVNET INC	2,610	48.07	125,462.70
CDW CORP/DE	3,420	53.03	181,362.60
CISCO SYSTEMS INC	105,920	30.53	3,233,737.60
CORNING INC	22,558	24.77	558,761.66
F5 NETWORKS INC	1,445	145.45	210,175.25
FLEX LTD	12,536	14.64	183,527.04
FLIR SYSTEMS INC	3,195	36.57	116,841.15
HARRIS CORP	2,550	103.72	264,486.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	35,075	23.82	835,486.50
HP INC	36,065	15.10	544,581.50
JUNIPER NETWORKS INC	7,633	28.46	217,235.18
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3,045	83.41	253,983.45
NETAPP INC	5,916	36.32	214,869.12
PALO ALTO NETWORKS INC	1,900	127.40	242,060.00
SEAGATE TECHNOLOGY	6,264	39.11	244,985.04
TE CONNECTIVITY LTD	7,545	70.62	532,827.90
TRIMBLE INC	5,170	30.42	157,271.40
WESTERN DIGITAL CORP	6,048	70.35	425,476.80
AT&T INC	129,737	42.73	5,543,662.01
CENTURYLINK INC	11,426	24.06	274,909.56
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	25,774	3.42	88,147.08
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	6,500	56.78	369,070.00
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	2,580	104.84	270,487.20
SPRINT CORP	17,350	8.50	147,475.00
T-MOBILE US INC	6,372	58.02	369,703.44
VERIZON COMMUNICATIONS INC	86,057	53.68	4,619,539.76
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	3,180	33.46	106,402.80

AES CORP	13,728	11.73	161,029.44
ALLIANT ENERGY CORP	4,250	37.86	160,905.00
AMEREN CORPORATION	5,182	52.45	271,795.90
AMERICAN ELECTRIC POWER	10,238	63.17	646,734.46
AMERICAN WATER WORKS CO INC	3,455	72.95	252,042.25
ATMOS ENERGY CORP	1,920	74.61	143,251.20
CALPINE CORP	8,060	11.64	93,818.40
CENTERPOINT ENERGY INC	8,142	24.83	202,165.86
CMS ENERGY CORP	6,140	41.70	256,038.00
CONSOLIDATED EDISON INC	6,306	73.63	464,310.78
DOMINION RESOURCES INC/VA	12,957	76.75	994,449.75
DTE ENERGY COMPANY	3,698	98.74	365,140.52
DUKE ENERGY CORP	14,636	77.62	1,136,046.32
EDISON INTERNATIONAL	7,059	71.90	507,542.10
ENERGY CORP	3,847	72.89	280,407.83
EVERSOURCE ENERGY	6,900	55.46	382,674.00
EXELON CORP	19,686	35.30	694,915.80
FIRSTENERGY CORP	8,995	31.27	281,273.65
NEXTERA ENERGY INC	9,805	119.23	1,169,050.15
NISOURCE INC	6,540	22.30	145,842.00
OGE ENERGY CORP	4,680	33.74	157,903.20
P G & E CORP	10,581	61.19	647,451.39
PINNACLE WEST CAPITAL	2,199	77.66	170,774.34
PPL CORP	14,578	34.29	499,879.62
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	10,978	43.68	479,519.04
SCANA CORP	2,683	74.69	200,393.27
SEMPRA ENERGY	5,067	101.67	515,161.89
SOUTHERN CO	19,895	49.33	981,420.35
UGI CORP	3,500	45.80	160,300.00
WEC ENERGY GROUP INC	6,860	58.73	402,887.80
WESTAR ENERGY INC	2,880	56.16	161,740.80
XCEL ENERGY INC	10,414	40.67	423,537.38
ANALOG DEVICES INC	6,481	73.84	478,557.04
APPLIED MATERIALS INC	23,193	32.90	763,049.70
BROADCOM LTD	8,340	181.94	1,517,379.60

	INTEL CORP	99,592	36.97	3,681,916.24	
	KLA-TENCOR CORPORATION	3,199	79.12	253,104.88	
	LAM RESEARCH CORP	3,247	108.06	350,870.82	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	4,954	62.55	309,872.70	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	9,254	14.32	132,517.28	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	5,850	39.26	229,671.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	4,614	65.40	301,755.60	
	MICRON TECHNOLOGY INC	21,887	23.26	509,091.62	
	NVIDIA CORP	11,275	109.78	1,237,769.50	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	6,337	98.20	622,293.40	
	QORVO INC	2,670	55.53	148,265.10	
	QUALCOMM INC	31,062	66.86	2,076,805.32	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	3,920	78.03	305,877.60	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	21,082	74.38	1,568,079.16	
	XILINX INC	5,075	60.56	307,342.00	
米ドル小計		6,659,375		421,435,841.34 (49,316,422,153)	
加ドル	ALTAGAS LTD	3,050	34.17	104,218.50	
	ARC RESOURCES LTD	7,925	22.85	181,086.25	
	CAMECO CORP	7,892	14.21	112,145.32	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	23,194	43.52	1,009,402.88	
	CENOVUS ENERGY INC	17,463	20.47	357,467.61	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	11,475	18.17	208,500.75	
	ENBRIDGE INC	19,985	57.59	1,150,936.15	
	ENCANA CORP	21,068	16.36	344,672.48	
	HUSKY ENERGY INC	6,873	16.38	112,579.74	
	IMPERIAL OIL LTD	5,952	47.34	281,767.68	
	INTER PIPELINE LTD	7,180	29.72	213,389.60	
	KEYERA CORP	4,120	40.58	167,189.60	
	PEMBINA PIPELINE CORP	7,915	42.50	336,387.50	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	3,680	33.58	123,574.40	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	4,100	31.88	130,708.00	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY -A	4,430	30.60	135,558.00	
	SUNCOR ENERGY INC	35,329	44.36	1,567,194.44	
	TOURMALINE OIL CORP	4,575	36.01	164,745.75	

TRANSCANADA CORP	17,673	62.13	1,098,023.49
VERESEN INC	5,360	12.63	67,696.80
VERMILION ENERGY INC	2,640	57.10	150,744.00
AGNICO EAGLE MINES LTD	4,695	52.61	247,003.95
AGRIUM INC	2,705	135.76	367,230.80
BARRICK GOLD CORP	23,944	19.69	471,457.36
CCL INDUSTRIES INC - CL B	610	267.50	163,175.00
ELDORADO GOLD CORP	14,630	4.13	60,421.90
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	14,710	13.83	203,439.30
FRANCO-NEVADA CORP	3,805	78.42	298,388.10
GOLDCORP INC	17,917	17.04	305,305.68
KINROSS GOLD CORP	25,015	3.97	99,309.55
METHANEX CORP	1,650	59.78	98,637.00
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	17,917	24.40	437,174.80
SILVER WHEATON CORP	9,395	23.74	223,037.30
TECK RESOURCES LTD-CLS B	11,955	27.76	331,870.80
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	23,419	4.31	100,935.89
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,460	48.47	70,766.20
YAMANA GOLD INC	19,626	3.43	67,317.18
BOMBARDIER INC 'B'	34,746	2.11	73,314.06
CAE INC	6,315	18.84	118,974.60
FINNING INTERNATIONAL INC	2,845	26.26	74,709.70
SNC-LAVALIN GROUP INC	3,195	58.50	186,907.50
CANADIAN NATL RAILWAY CO	16,398	91.52	1,500,744.96
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,125	193.87	605,843.75
MAGNA INTERNATIONAL INC	8,378	59.79	500,920.62
GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,400	34.59	186,786.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	4,948	64.53	319,294.44
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	8,165	26.98	220,291.70
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,560	139.32	217,339.20
DOLLARAMA INC	2,510	97.88	245,678.80
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	9,120	61.20	558,144.00
EMPIRE CO LTD 'A'	3,000	15.32	45,960.00
LOBLAW COMPANIES LTD	4,989	70.62	352,323.18
METRO INC	4,380	40.19	176,032.20

WESTON (GEORGE) LTD	1,182	113.62	134,298.84
SAPUTO INC	5,040	47.29	238,341.60
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	6,734	19.38	130,504.92
BANK OF MONTREAL	13,261	97.17	1,288,571.37
BANK OF NOVA SCOTIA	25,469	76.04	1,936,662.76
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	8,295	110.86	919,583.70
NATIONAL BANK OF CANADA	7,340	55.14	404,727.60
ROYAL BANK OF CANADA	31,249	91.68	2,864,908.32
TORONTO-DOMINION BANK	38,960	67.07	2,613,047.20
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	18,933	44.62	844,790.46
CI FINANCIAL CORP	5,550	28.98	160,839.00
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	7,180	12.41	89,103.80
IGM FINANCIAL INC	2,535	38.92	98,662.20
ONEX CORPORATION	1,905	91.77	174,821.85
THOMSON REUTERS CORP	6,774	59.45	402,714.30
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	490	659.68	323,243.20
GREAT-WEST LIFECO INC	5,974	35.63	212,853.62
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	1,735	54.74	94,973.90
INTACT FINANCIAL CORP	2,485	97.13	241,368.05
MANULIFE FINANCIAL CORP	43,001	24.43	1,050,514.43
POWER CORP OF CANADA	7,800	30.45	237,510.00
POWER FINANCIAL CORP	5,715	34.36	196,367.40
SUN LIFE FINANCIAL INC	13,374	51.69	691,302.06
CGI GROUP INC - CL A	4,650	63.73	296,344.50
CONSTELLATION SOFTWARE INC	420	612.54	257,266.80
OPEN TEXT CORP	2,550	83.15	212,032.50
BLACKBERRY LTD	10,328	9.51	98,219.28
BCE INC	2,930	58.26	170,701.80
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	7,185	52.07	374,122.95
TELUS CORP	4,366	42.77	186,733.82
ATCO LTD -CLASS I	1,920	44.30	85,056.00
CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,590	36.05	93,369.50
FORTIS INC	8,595	41.50	356,692.50
HYDRO ONE LTD	3,450	23.49	81,040.50
	844,371		34,508,015.19

加ドル小計				(2,989,774,436)
ユーロ	ENI SPA	54,006	15.34	828,452.04
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	9,315	14.19	132,226.42
	NESTE OYJ	2,740	36.78	100,777.20
	OMV AG	3,490	33.99	118,625.10
	REPSOL SA	24,709	13.43	331,965.41
	REPSOL SA-RTS	24,709	0.35	8,821.11
	SAIPEM SPA	123,510	0.51	63,360.63
	SNAM SPA	46,120	3.88	179,222.32
	TECHNIP SA	2,468	67.85	167,453.80
	TENARIS SA	9,355	16.99	158,941.45
	TOTAL SA	47,647	48.36	2,304,208.92
	VOPAK	1,270	44.19	56,127.65
	AIR LIQUIDE SA	8,408	105.20	884,521.60
	AKZO NOBEL	5,058	59.37	300,293.46
	ARCELORMITTAL	38,948	7.08	275,985.52
	ARKEMA	1,615	93.27	150,631.05
	BASF SE	19,265	87.45	1,684,724.25
	COVESTRO AG	1,350	66.62	89,937.00
	CRH PLC	17,880	32.10	573,948.00
	EVONIK INDUSTRIES AG	3,580	28.48	101,976.30
	FUCHS PETROLUB SE-PRF	1,720	39.69	68,266.80
	HEIDELBERGCEMENT AG	2,845	87.40	248,653.00
	IMERYS SA	830	71.56	59,394.80
	K+S AG	3,880	22.35	86,718.00
	KONINKLIJKE DSM NV	3,842	57.14	219,531.88
	LANXESS AG	1,935	62.19	120,337.65
	LINDE AG	3,895	158.10	615,799.50
	SOLVAY SA	1,581	111.25	175,886.25
	STORA ENSO OYJ-R SHS	12,085	10.07	121,695.95
	SYMRISE AG	2,640	57.89	152,829.60
THYSSENKRUPP AG	7,415	22.73	168,542.95	
UMICORE	2,120	53.55	113,526.00	
UPM-KYMMENE OYJ	10,878	23.05	250,737.90	
VOESTALPINE AG	2,509	37.09	93,071.35	

ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4,176	30.00	125,280.00	
AIRBUS GROUP SE	12,268	62.90	771,657.20	
ALSTOM	3,590	25.87	92,873.30	
ANDRITZ AG	1,420	47.61	67,613.30	
BOSKALIS WESTMINSTER	1,695	32.91	55,790.92	
BOUYGUES SA	4,210	34.53	145,371.30	
BRENTAG AG	3,095	52.72	163,168.40	
CNH INDUSTRIAL NV	22,370	8.25	184,664.35	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	10,566	43.69	461,681.37	
DASSAULT AVIATION SA	50	1,071.30	53,565.00	
EIFFAGE	1,130	66.66	75,325.80	
FERROVIAL SA	9,975	17.30	172,567.50	
GEA GROUP AG	3,940	38.04	149,877.60	
HOCHTIEF AG	440	134.45	59,158.00	
KONE OYJ-B	6,474	42.40	274,497.60	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	19,861	28.96	575,174.56	
LEGRAND SA	5,628	54.02	304,024.56	
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	9,630	13.48	129,812.40	
MAN SE	824	94.66	77,999.84	
METSO OYJ	2,420	27.29	66,041.80	
OSRAM LICHT AG	1,962	49.75	97,609.50	
PRYSMIAN SPA	3,425	24.31	83,261.75	
REXEL SA	7,240	15.73	113,921.40	
SAFRAN SA	6,790	67.98	461,584.20	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	11,908	65.15	775,806.20	
SIEMENS AG-REG	16,196	115.25	1,866,589.00	
THALES SA	2,345	91.96	215,646.20	
VINCI SA	10,950	64.48	706,056.00	
WARTSILA OYJ ABP	3,290	43.18	142,062.20	
ZARDOYA OTIS SA	4,418	8.14	35,962.52	
ZODIAC AEROSPACE	4,550	21.98	100,031.75	
BUREAU VERITAS SA	5,650	18.41	104,016.50	
EDENRED	3,906	18.63	72,788.31	
RANDSTAD HOLDING NV	2,285	51.95	118,705.75	
RELX NV	20,559	15.94	327,813.25	

SOCIETE BIC SA	565	128.60	72,659.00
WOLTERS KLUWER	6,297	34.39	216,553.83
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	13,091	13.40	175,419.40
ADP	650	101.20	65,780.00
AENA SA	1,490	132.20	196,978.00
ATLANTIA SPA	9,360	22.67	212,191.20
BOLLORE	20,400	3.32	67,728.00
DEUTCHE LUFTHANSA	5,680	12.88	73,158.40
DEUTSCHE POST AG-REG	20,993	31.21	655,296.49
FRAPORT AG	980	55.96	54,840.80
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	8,760	8.94	78,323.16
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	16,992	5.34	90,873.21
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	6,935	89.96	623,872.60
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,190	73.55	87,524.50
CONTINENTAL AG	2,345	185.10	434,059.50
DAIMLER AG	20,272	71.03	1,439,920.16
FERRARI NV	2,384	55.90	133,265.60
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	19,647	8.63	169,651.84
MICHELIN (CGDE)-B	3,679	106.45	391,629.55
NOKIAN RENKAAT OYJ	1,965	35.39	69,541.35
PEUGEOT SA	9,800	15.75	154,399.00
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	3,150	53.42	168,273.00
RENAULT SA	4,117	85.29	351,138.93
SCHAEFFLER AG-PRF	3,550	13.99	49,664.50
VALEO SA	4,860	54.95	267,057.00
VOLKSWAGEN AG	771	141.85	109,366.35
VOLKSWAGEN AG-PFD	3,853	137.50	529,787.50
ADIDAS AG	3,961	144.50	572,364.50
CHRISTIAN DIOR SE	1,170	198.45	232,186.50
HERMES INTERNATIONAL	572	388.10	221,993.20
HUGO BOSS AG -ORD	1,490	57.40	85,526.00
KERING	1,607	212.05	340,764.35
LUXOTTICA GROUP SPA	3,976	51.55	204,962.80
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	5,854	179.30	1,049,622.20
SEB SA	480	126.50	60,720.00

ACCOR SA	3,456	36.00	124,433.28
PADDY POWER BETFAIR PLC	1,630	103.50	168,705.00
SODEXO	1,970	108.15	213,055.50
ALTICE NV -A	8,340	18.70	155,958.00
ALTICE NV -B	1,940	18.68	36,248.90
AXEL SPRINGER SE	995	45.46	45,237.67
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	18.68	70,890.60
JC DECAUX SA	1,200	27.94	33,528.00
LAGARDERE S.C.A.	2,980	26.12	77,837.60
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	4,805	36.46	175,190.30
PUBLICIS GROUPE	4,075	65.46	266,749.50
RTL GROUP	630	69.06	43,507.80
SES	7,520	21.02	158,108.00
TELENET GROUP HOLDING NV	1,240	52.70	65,348.00
VIVENDI	21,730	17.73	385,272.90
INDITEX	23,795	32.19	765,961.05
ZALANDO SE	1,700	36.07	61,319.00
CARREFOUR SA	12,213	22.60	276,013.80
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,344	45.56	61,239.36
COLRUYT SA	1,375	46.49	63,930.62
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	11,008	4.63	50,989.05
JERONIMO MARTINS	5,075	14.39	73,054.62
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	28,248	19.65	555,073.20
METRO AG	4,140	31.26	129,416.40
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	16,021	99.08	1,587,360.68
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	4,910	30.82	151,350.75
DANONE	12,354	58.87	727,279.98
HEINEKEN HOLDING NV	2,125	66.00	140,250.00
HEINEKEN NV	5,033	71.08	357,745.64
KERRY GROUP PLC-A	3,380	67.70	228,826.00
PERNOD-RICARD SA	4,406	102.05	449,632.30
REMY COINTREAU	470	80.28	37,731.60
BEIERSDORF AG	2,015	80.82	162,852.30
HENKEL AG & CO KGAA	2,190	98.75	216,262.50
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	3,743	113.05	423,146.15

L'OREAL	5,286	172.55	912,099.30
UNILEVER NV-CVA	34,645	39.13	1,355,832.07
ESSILOR INTERNATIONAL	4,465	105.45	470,834.25
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	4,683	81.39	381,149.37
FRESENIUS SE & CO KGAA	8,675	73.54	637,959.50
BAYER AG	17,410	98.50	1,714,885.00
EUROFINS SCIENTIFIC	220	400.90	88,198.00
GRIFOLS SA	6,820	18.68	127,397.60
MERCK KGAA	2,630	98.86	260,001.80
ORION OYJ-CLASS B	1,830	42.20	77,226.00
QIAGEN N.V.	5,145	26.54	136,574.02
SANOFI	24,396	75.86	1,850,680.56
UCB SA	2,798	61.00	170,678.00
ABN AMRO GROUP NV-CVA	4,670	21.26	99,284.20
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	135,993	6.46	878,514.78
BANCO DE SABADELL SA	109,692	1.35	148,413.27
BANCO POPULAR ESPANOL	75,856	0.91	69,104.81
BANCO SANTANDER SA	306,839	4.97	1,525,910.34
BANK OF IRELAND	558,550	0.24	135,727.65
BANKIA SA	95,000	0.97	92,150.00
BANKINTER SA	13,960	7.44	103,862.40
BNP PARIBAS	22,262	61.17	1,361,766.54
CAIXABANK S.A	68,530	3.17	217,856.87
COMMERZBANK AG	21,334	7.49	159,940.99
CREDIT AGRICOLE SA	21,992	11.90	261,814.76
ERSTE GROUP BANK AG	6,438	28.69	184,738.41
ING GROEP NV-CVA	81,695	13.62	1,113,094.37
INTESA SANPAOLO	279,763	2.46	688,216.98
KBC GROEP NV	5,119	59.53	304,734.07
MEDIOBANCA SPA	11,670	7.93	92,601.45
NATIXIS	19,150	5.37	102,950.40
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	2,770	17.77	49,222.90
SOCIETE GENERALE	16,119	46.81	754,530.39
UNICREDIT SPA	110,353	2.83	312,961.10
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	28,865	17.81	514,085.65

DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	4,000	78.34	313,360.00
EURAZEO	958	55.10	52,785.80
EXOR NV	2,264	41.74	94,499.36
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,432	79.54	113,901.28
WENDEL	600	114.10	68,460.00
AEGON NV	38,139	5.26	200,878.11
AGEAS	4,044	37.80	152,863.20
ALLIANZ SE-REG	9,628	156.95	1,511,114.60
ASSICURAZIONI GENERALI	25,868	14.37	371,723.16
AXA	40,792	24.05	981,047.60
CNP ASSURANCES	3,530	17.60	62,128.00
HANNOVER RUECK SE-REG	1,355	103.05	139,632.75
MAPFRE SA	20,814	2.90	60,443.85
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,476	178.50	620,466.00
NN GROUP NV	7,180	32.74	235,073.20
POSTE ITALIANE SPA	10,260	6.41	65,766.60
SAMPO OYJ-A SHS	9,639	43.16	416,019.24
SCOR SE	3,152	32.60	102,755.20
UNIPOLSAI SPA	18,580	2.05	38,126.16
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	7,500	29.83	223,762.50
IMMOEAST AG-TEMPORARY	16,150	-	-
IMMOFINANZ AG-TEMPORARY	13,000	-	-
VONOVIA SE	10,088	30.59	308,591.92
AMADEUS IT GROUP SA	9,610	43.18	414,959.80
ATOS SE	2,060	100.25	206,515.00
CAP GEMINI SA	3,639	80.36	292,430.04
DASSAULT SYSTEMES SA	2,790	71.86	200,489.40
GEMALTO	1,850	55.04	101,824.00
SAP SE	20,782	82.01	1,704,331.82
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2,930	36.86	108,014.45
INGENICO GROUP	1,160	78.30	90,828.00
NOKIA OYJ	126,056	4.65	587,168.84
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	68,486	16.12	1,103,994.32
ELISA OYJ	2,505	30.66	76,803.30
ILIID SA	520	181.90	94,588.00

	KONINKLIJKE KPN NV	75,066	2.79	209,884.53
	ORANGE S.A.	41,574	14.29	594,092.46
	PROXIMUS	2,440	27.19	66,343.60
	SFR GROUP SA	2,250	26.14	58,815.00
	TELECOM ITALIA SPA	199,943	0.85	171,451.12
	TELECOM ITALIA-RSP	125,887	0.70	88,246.78
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16,000	4.07	65,200.00
	TELEFONICA SA	98,419	8.84	870,712.89
	E.ON SE	44,099	6.65	293,258.35
	EDF	6,075	9.67	58,793.85
	ENAGAS	5,680	24.31	138,080.80
	ENDESA SA	6,840	20.74	141,895.80
	ENEL SPA	154,777	4.12	637,681.24
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	54,991	2.88	158,759.01
	ENGIE	29,984	12.04	361,157.28
	FORTUM OYJ	9,825	14.72	144,624.00
	GAS NATURAL SDG SA	7,722	17.59	135,868.59
	IBERDROLA SA	117,842	6.13	723,314.19
	INNOGY SE	2,850	32.43	92,439.75
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	9,010	17.71	159,567.10
	RWE AG	10,685	11.58	123,732.30
	SUEZ	6,199	13.87	85,980.13
	TERNA SPA	34,477	4.32	148,940.64
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	9,184	15.94	146,438.88
	ASML HOLDING NV	7,762	105.85	821,607.70
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	24,715	16.54	408,786.10
	STMICROELECTRONICS NV	12,733	10.74	136,816.08
ユーロ小計		4,885,080		73,994,620.13 (9,041,402,633)
英ポンド	BP PLC	397,238	5.03	1,998,107.14
	PETROFAC LTD	5,025	8.74	43,918.50
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	91,408	22.13	2,023,316.08
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	78,919	23.21	1,831,709.99
	ANGLO AMERICAN PLC	30,274	11.25	340,733.87
	ANTOFAGASTA PLC	8,730	6.75	58,971.15

BHP BILLITON PLC	44,501	12.57	559,600.07
CRODA INTERNATIONAL PLC	2,751	31.50	86,656.50
FRESNILLO PLC	5,160	11.12	57,379.20
GLENCORE PLC	257,683	2.70	697,419.03
JOHNSON MATTHEY PLC	4,199	31.53	132,394.47
MONDI PLC	7,400	16.05	118,770.00
RANDGOLD RESOURCES LTD	1,840	58.35	107,364.00
RIO TINTO PLC	26,015	30.64	797,099.60
ASHTED GROUP PLC	10,920	15.67	171,116.40
BAE SYSTEMS PLC ORD	69,635	5.93	413,283.72
BUNZL PLC	7,276	20.88	151,922.88
COBHAM PLC	34,837	1.67	58,317.13
DCC PLC	1,810	60.55	109,595.50
IMI PLC	6,116	10.24	62,627.84
MEGGITT PLC	13,905	4.66	64,839.01
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	38,325	6.80	260,801.62
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C	1,997,550	0.00	1,997.55
SMITHS GROUP PLC	8,813	14.13	124,527.69
TRAVIS PERKINS PLC	5,800	14.62	84,796.00
WEIR GROUP PLC/THE	3,880	18.75	72,750.00
WOLSELEY PLC	5,324	49.39	262,952.36
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,275	9.44	59,236.00
CAPITA PLC	15,309	5.20	79,683.34
EXPERIAN PLC	20,558	15.53	319,265.74
G4S PLC	34,639	2.30	79,773.61
INTERTEK GROUP PLC	3,545	33.97	120,423.65
RELX PLC	23,666	14.38	340,317.08
EASYJET PLC	3,840	10.35	39,744.00
ROYAL MAIL PLC	19,950	4.56	91,011.90
GKN PLC	33,065	3.30	109,279.82
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	22,900	4.69	107,469.70
BERKELEY GROUP HOLDINGS	2,600	28.52	74,152.00
BURBERRY GROUP PLC	8,904	14.63	130,265.52
PERSIMMON PLC	7,000	17.65	123,550.00
TAYLOR WIMPEY PLC	73,610	1.53	113,285.79

CARNIVAL PLC	4,050	41.47	167,953.50
COMPASS GROUP PLC	35,287	14.56	513,778.72
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	4,031	36.01	145,156.31
MERLIN ENTERTAINME	15,550	4.47	69,648.45
TUI AG-DI	11,263	11.48	129,299.24
WHITBREAD PLC	3,520	37.62	132,422.40
WILLIAM HILL PLC	18,010	2.97	53,507.71
ITV PLC	77,235	2.03	157,173.22
PEARSON PLC	17,749	8.17	145,009.33
SKY PLC	21,334	9.82	209,606.55
WPP PLC	26,764	17.95	480,413.80
DIXONS CARPHONE PLC	22,000	3.49	76,934.00
KINGFISHER PLC	50,397	3.46	174,726.39
MARKS & SPENCER GROUP PLC	34,970	3.52	123,094.40
NEXT PLC	2,987	49.22	147,020.14
SAINSBURY (J) PLC	32,441	2.48	80,680.76
TESCO PLC	177,834	2.05	366,071.28
WM MORRISON SUPERMARKETS	49,255	2.29	113,138.73
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	7,335	26.99	197,971.65
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	39,347	45.58	1,793,436.26
COCA-COLA HBC AG-CDI	3,550	17.16	60,918.00
DIAGEO PLC	52,822	20.97	1,107,677.34
IMPERIAL BRANDS PLC	20,372	35.39	720,965.08
TATE & LYLE PLC	10,510	7.06	74,200.60
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	13,345	68.11	908,927.95
UNILEVER PLC	27,257	32.72	891,985.32
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	7,000	7.52	52,640.00
SMITH & NEPHEW PLC	19,376	12.03	233,093.28
ASTRAZENECA PLC	26,653	44.07	1,174,597.71
GLAXOSMITHKLINE PLC	103,081	15.49	1,596,724.69
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2,860	18.10	51,766.00
SHIRE PLC	19,095	45.48	868,440.60
BARCLAYS PLC	354,681	2.24	797,854.90
HSBC HOLDINGS PLC	417,621	6.46	2,699,919.76
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,346,196	0.63	858,873.04

	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	72,080	2.31	166,576.88	
	STANDARD CHARTERED PLC	69,010	6.61	456,570.16	
	3I GROUP PLC	20,499	6.95	142,468.05	
	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	22,730	2.58	58,643.40	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,720	12.20	69,784.00	
	INVESTEC PLC	13,185	5.25	69,221.25	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	6,577	28.44	187,049.88	
	NEX GROUP PLC	12,270	4.62	56,687.40	
	PROVIDENT FINANCIAL PLC	3,310	28.15	93,176.50	
	SCHRODERS PLC	2,971	29.85	88,684.35	
	ADMIRAL GROUP PLC	4,925	17.99	88,600.75	
	AVIVA PLC	89,285	4.80	428,835.85	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	29,333	3.67	107,886.77	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	127,081	2.47	313,890.07	
	OLD MUTUAL PLC	104,159	1.98	207,172.25	
	PRUDENTIAL PLC	54,632	16.05	876,843.60	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	21,498	5.77	124,043.46	
	ST JAMES'S PLACE PLC	11,000	9.98	109,835.00	
	STANDARD LIFE PLC	40,716	3.64	148,287.67	
	AUTO TRADER GROUP PLC	23,390	4.04	94,706.11	
	SAGE GROUP PLC/THE	24,400	6.54	159,576.00	
	WORLDPAY GROUP PLC	42,180	2.67	112,915.86	
	BT GROUP PLC	177,102	3.70	655,897.25	
	INMARSAT PLC	10,010	7.53	75,375.30	
	VODAFONE GROUP PLC	559,928	2.00	1,122,935.60	
	CENTRICA PLC	119,035	2.30	274,375.67	
	NATIONAL GRID PLC	78,675	9.51	748,435.27	
	SEVERN TRENT PLC	4,423	22.28	98,544.44	
	SSE PLC	21,427	15.54	332,975.58	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	13,325	9.00	119,925.00	
英ボンド小計		8,301,849		37,445,971.93 (5,387,726,441)	
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	170	516.50	87,805.00	
	GIVAUDAN-REG	203	1,838.00	373,114.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	9,359	53.35	499,302.65	

SIKA AG-BR	47	4,894.00	230,018.00
SYNGENTA AG-REG	1,968	408.10	803,140.80
ABB LTD-REG	40,445	21.65	875,634.25
GEBERIT AG-REG	805	407.20	327,796.00
SCHINDLER HOLDING AG-REG	360	177.50	63,900.00
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	970	178.40	173,048.00
ADECCO GROUP AG-REG	3,557	66.90	237,963.30
SGS SA-REG	113	2,063.00	233,119.00
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,150	134.90	155,135.00
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	11,039	66.50	734,093.50
SWATCH GROUP AG/THE-BR	680	315.10	214,268.00
SWATCH GROUP AG/THE-REG	930	61.40	57,102.00
DUFREY AG-REG	1,050	125.80	132,090.00
ARYZTA AG	2,110	43.99	92,818.90
BARRY CALLEBAUT AG-REG	45	1,204.00	54,180.00
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	25	5,225.00	130,625.00
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	61,215.00	122,430.00
NESTLE SA-REG	65,633	73.10	4,797,772.30
SONOVA HOLDING AG-REG	1,160	122.70	142,332.00
ACTELION LTD-REG	2,040	222.40	453,696.00
GALENICA AG-REG	70	1,140.00	79,800.00
LONZA GROUP AG-REG	1,080	173.50	187,380.00
NOVARTIS AG-REG	47,173	73.90	3,486,084.70
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	14,848	232.20	3,447,705.60
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	38,778	15.19	589,037.82
JULIUS BAER GROUP LTD	4,600	45.73	210,358.00
PARGESA HOLDING SA-BR	655	65.65	43,000.75
PARTNERS GROUP HOLDING AG	370	477.25	176,582.50
UBS GROUP AG-REG	77,952	16.08	1,253,468.16
BALOISE HOLDING AG - REG	1,080	129.40	139,752.00
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	640	290.30	185,792.00
SWISS RE AG	7,039	97.05	683,134.95
ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,221	281.50	906,711.50
SWISS PRIME SITE-REG	1,460	82.35	120,231.00
SWISSCOM AG-REG	504	455.40	229,521.60

スイスフラン小計		343,331		22,729,944.28 (2,592,122,845)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	4,320	195.30	843,696.00	
	BOLIDEN AB	5,920	237.00	1,403,040.00	
	ALFA LAVAL AB	6,930	152.10	1,054,053.00	
	ASSA ABLOY AB-B	20,910	170.10	3,556,791.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	13,705	279.40	3,829,177.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	8,620	250.00	2,155,000.00	
	SANDVIK AB	21,690	114.10	2,474,829.00	
	SKANSKA AB-B SHS	7,170	217.10	1,556,607.00	
	SKF AB-B SHARES-B	8,909	167.10	1,488,693.90	
	VOLVO AB-B SHS-B	32,660	107.30	3,504,418.00	
	SECURITAS AB-B SHS	7,249	142.00	1,029,358.00	
	ELECTROLUX AB - B	5,455	226.40	1,235,012.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	8,480	70.10	594,448.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	19,678	253.80	4,994,276.40	
	ICA GRUPPEN AB	1,450	275.60	399,620.00	
	SWEDISH MATCH AB	4,040	288.60	1,165,944.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	13,015	255.40	3,324,031.00	
	GETINGE AB-B SHS	4,450	147.20	655,040.00	
	NORDEA BANK AB	64,688	102.50	6,630,520.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	31,870	96.50	3,075,455.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	32,620	127.40	4,155,788.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	18,880	222.00	4,191,360.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,700	167.90	453,330.00	
	INVESTOR AB-B SHS	9,135	343.30	3,136,045.50	
KINNEVIK AB - B	4,235	218.70	926,194.50		
ERICSSON LM-B SHS	64,235	53.70	3,449,419.50		
HEXAGON AB-B SHS	5,260	327.80	1,724,228.00		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,370	396.70	543,479.00		
TELE2 AB-B SHS	6,255	72.90	455,989.50		
TELIA CO AB	53,480	36.83	1,969,668.40		
スウェーデンクローナ小計		489,379		65,975,511.70 (834,590,223)	
ノルウェーク	STATOIL ASA	24,664	157.80	3,891,979.20	

ローネ	NORSK HYDRO A S	30,900	40.83	1,261,647.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	3,780	338.10	1,278,018.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	1,430	180.50	258,115.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	1,650	195.20	322,080.00	
	MARINE HARVEST	7,720	156.60	1,208,952.00	
	ORKLA ASA	19,380	77.45	1,500,981.00	
	DNB ASA	19,945	129.20	2,576,894.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,200	136.10	571,620.00	
	TELENOR ASA	14,895	127.60	1,900,602.00	
ノルウェークローネ小計		128,564		14,770,888.20	(198,373,028)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,890	386.00	729,540.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	4,865	242.20	1,178,303.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	4,690	438.70	2,057,503.00	
	ISS A/S	3,100	236.30	732,530.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	90	10,760.00	968,400.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	138	11,400.00	1,573,200.00	
	DSV A/S	4,320	310.70	1,342,224.00	
	PANDORA A/S	2,320	896.50	2,079,880.00	
	CARLSBERG AS-B	2,180	601.50	1,311,270.00	
	COLOPLAST-B	2,545	480.20	1,222,109.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	3,000	123.00	369,000.00	
	GENMAB A/S	1,180	1,141.00	1,346,380.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	40,135	255.00	10,234,425.00	
	DANSKE BANK A/S	14,255	215.00	3,064,825.00	
	TRYG A/S	2,575	127.80	329,085.00	
	TDC A/S	14,545	35.20	511,984.00	
DONG ENERGY A/S	1,790	266.40	476,856.00		
デンマーククローネ小計		103,618		29,527,514.00	(485,432,330)
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	5,335	30.60	163,251.00	
	OIL SEARCH LTD	28,830	6.96	200,656.80	
	ORIGIN ENERGY LTD	35,950	6.44	231,518.00	
	SANTOS LTD	33,135	3.95	130,883.25	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	16,528	31.68	523,607.04	

ALUMINA LTD	46,512	1.79	83,489.04
AMCOR LIMITED	23,840	15.07	359,268.80
BHP BILLITON LTD	67,546	24.63	1,663,657.98
BORAL LTD	17,115	5.39	92,249.85
FORTESCUE METALS GROUP LTD	29,665	5.77	171,167.05
INCITEC PIVOT LTD	31,550	3.59	113,264.50
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	8,505	22.00	187,110.00
NEWCREST MINING LTD	17,209	18.08	311,138.72
ORICA LIMITED	6,935	17.59	121,986.65
RIO TINTO LTD	9,218	58.77	541,741.86
SOUTH32 LTD	117,667	2.73	321,230.91
CIMIC GROUP LTD	1,867	34.31	64,056.77
BRAMBLES LTD	32,868	12.40	407,563.20
SEEK LTD	8,040	14.95	120,198.00
AURIZON HOLDINGS LTD	46,150	5.04	232,596.00
QANTAS AIRWAYS LTD	13,113	3.38	44,321.94
SYDNEY AIRPORT	24,156	6.02	145,419.12
TRANSURBAN GROUP	43,195	10.53	454,843.35
ARISTOCRAT LEISURE LTD	12,510	15.30	191,403.00
CROWN RESORTS LTD	6,745	11.45	77,230.25
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,180	64.78	76,440.40
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	970	31.19	30,254.30
TABCORP HOLDINGS LTD	15,336	4.76	72,999.36
TATTS GROUP LTD	30,060	4.42	132,865.20
REA GROUP LTD	1,150	54.55	62,732.50
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	14,370	5.02	72,137.40
WESFARMERS LTD	23,665	42.08	995,823.20
WOOLWORTHS LTD	26,772	23.85	638,512.20
COCA-COLA AMATIL LTD	10,650	9.93	105,754.50
TREASURY WINE ESTATES LTD	15,946	10.43	166,316.78
COCHLEAR LTD	1,277	119.93	153,150.61
HEALTHSCOPE LTD	44,380	2.24	99,411.20
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,935	66.99	196,615.65
SONIC HEALTHCARE LTD	8,110	21.37	173,310.70
CSL LTD	9,752	97.80	953,745.60

	AUST AND NZ BANKING GROUP	62,029	30.73	1,906,151.17	
	BANK OF QUEENSLAND LIMITED	8,120	11.95	97,034.00	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	10,478	12.69	132,965.82	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	36,057	82.50	2,974,702.50	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	56,223	30.65	1,723,234.95	
	WESTPAC BANKING CORP	70,071	32.64	2,287,117.44	
	AMP LTD	62,647	5.04	315,740.88	
	ASX LTD	3,445	49.11	169,183.95	
	CHALLENGER LTD	9,950	11.18	111,241.00	
	MACQUARIE GROUP LTD	6,494	86.93	564,523.42	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	50,298	5.99	301,285.02	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	62,000	2.78	172,360.00	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	29,380	12.47	366,368.60	
	SUNCORP GROUP LTD	29,020	13.52	392,350.40	
	COMPUTERSHARE LTD	11,490	12.44	142,935.60	
	TELSTRA CORPORATION LTD	87,384	5.04	440,415.36	
	TPG TELECOM LTD	7,200	6.73	48,456.00	
	VOCUS COMMUNICATIONS LTD	12,010	3.84	46,118.40	
	AGL ENERGY LTD	12,851	22.18	285,035.18	
	AUSNET SERVICES	40,750	1.55	63,162.50	
	DUET GROUP	54,050	2.82	152,421.00	
豪ドル小計		1,612,684		23,576,725.87	(1,983,745,714)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	17,130	10.75	184,147.50	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	24,545	6.66	163,469.70	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	8,500	8.29	70,465.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	45,157	3.45	155,791.65	
	CONTACT ENERGY LIMITED	19,340	4.66	90,124.40	
	MERIDIAN ENERGY LTD	28,000	2.57	72,100.00	
ニュージーランドドル小計		142,672		736,098.25	(59,476,738)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	58,208	88.10	5,128,124.80	
	NWS HOLDINGS LTD	28,500	12.50	356,250.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	25,000	10.22	255,500.00	
	MTR CORP	34,000	37.30	1,268,200.00	

LI & FUNG LTD	138,000	3.49	481,620.00	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	29,000	27.90	809,100.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	14,500	28.05	406,725.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	50,000	33.10	1,655,000.00	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	16,800	14.72	247,296.00	
SANDS CHINA LTD	49,800	33.15	1,650,870.00	
SJM HOLDINGS LTD	48,000	5.88	282,240.00	
WYNN MACAU LTD	35,800	12.20	436,760.00	
WH GROUP LTD	153,500	6.22	954,770.00	
BANK OF EAST ASIA	21,640	29.80	644,872.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	77,000	27.80	2,140,600.00	
HANG SENG BANK LTD	16,300	143.90	2,345,570.00	
FIRST PACIFIC CO	44,250	5.43	240,277.50	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	24,500	179.90	4,407,550.00	
AIA GROUP LTD	255,200	43.95	11,216,040.00	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	60,208	47.40	2,853,859.20	
HANG LUNG GROUP LTD	17,000	26.70	453,900.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	57,000	16.08	916,560.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	26,842	40.50	1,087,101.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	15,000	32.05	480,750.00	
KERRY PROPERTIES LTD	11,450	20.90	239,305.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	134,666	8.16	1,098,874.56	
SINO LAND CO	63,050	11.38	717,509.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	30,480	97.25	2,964,180.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	13,017	73.10	951,542.70	
SWIRE PROPERTIES LTD	23,200	21.50	498,800.00	
WHARF HOLDINGS LTD	27,800	50.25	1,396,950.00	
WHEELLOCK & CO LTD	19,600	43.05	843,780.00	
HKT TRUST AND HKT LTD	67,000	9.46	633,820.00	
PCCW LTD	80,000	4.20	336,000.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	15,000	60.40	906,000.00	
CLP HOLDINGS LTD	34,500	71.60	2,470,200.00	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	56,000	6.37	356,720.00	
HONG KONG & CHINA GAS	155,925	13.60	2,120,580.00	
POWER ASSETS HOLDINGS	28,500	68.15	1,942,275.00	

	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	4,200	82.80	347,760.00	
香港ドル小計		2,060,436		58,543,831.76 (882,840,982)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	34,660	5.80	201,028.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	21,000	2.86	60,060.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,000	3.21	105,930.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,000	2.54	116,840.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	12,800	9.69	124,032.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	114,500	0.90	103,622.50	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	32,550	3.53	114,901.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,000	39.37	78,740.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	130,000	0.42	55,250.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	44,700	3.59	160,473.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	36,715	17.39	638,473.85	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	68,240	8.93	609,383.20	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	26,300	20.35	535,205.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	20,000	7.13	142,600.00	
	CAPITALAND LTD	51,800	2.98	154,364.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	10,000	8.10	81,000.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	60,000	2.21	132,600.00	
UOL GROUP LTD	12,250	5.97	73,132.50		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	172,180	3.65	628,457.00		
シンガポールドル小計		928,695		4,116,092.55 (333,074,209)	
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	9,770	15.25	148,992.50	
	ELBIT SYSTEMS LTD	500	384.70	192,350.00	
	BANK HAPOLIM BM	21,225	22.83	484,566.75	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	36,465	15.86	578,334.90	
	NICE LTD	1,385	257.40	356,499.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	48,790	7.09	346,165.05	
イスラエルシュケル小計		118,135		2,106,908.20 (64,724,219)	
合 計		26,618,189		74,169,705,951 (74,169,705,951)	

(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	出資金	PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A-LP	2,027.00	71,593.64	
	出資金小計		2,027.00	71,593.64 (8,377,888)	
	投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	7,010	127,231.50	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	1,490	162,857.00	
		AMERICAN TOWER CORP	9,009	955,224.27	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	20,020	206,206.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,855	498,168.95	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,417	423,947.19	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	6,100	147,071.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,940	161,369.20	
		CROWN CASTLE INTL CORP	7,060	615,914.40	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,235	311,692.25	
		DUKE REALTY CORPORATION	6,875	178,475.00	
		EQUINIX INC	1,478	527,069.58	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	7,980	502,341.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,400	322,938.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	2,800	209,328.00	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,415	197,618.90	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	12,545	308,105.20	
		HCP INC	10,125	296,257.50	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	16,589	314,029.77	
		IRON MOUNTAIN INC	5,515	179,458.10	
		KIMCO REALTY CORPORATION	8,795	220,402.70	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	122,776.72	
		MACERICH CO/THE	2,870	195,647.90	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,270	216,853.10	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	2,990	128,390.60	
PROLOGIS INC	11,402	590,053.50			
PUBLIC STORAGE	3,209	701,872.48			

		REALTY INCOME CORP	5,400	304,614.00	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	2,355	158,844.75	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	6,594	1,160,214.30	
		SL GREEN REALTY CORP	2,260	238,633.40	
		UDR INC	5,820	207,017.40	
		VENTAS INC	7,285	443,365.10	
		VEREIT INC	19,554	164,449.14	
		VORNADO REALTY TRUST	3,491	359,119.17	
		WELLTOWER INC	7,680	503,116.80	
		WEYERHAEUSER CO	15,508	474,079.56	
		投資証券小計	239,454	12,834,753.43	(1,501,922,846)
米ドル小計			241,481	12,906,347.07	(1,510,300,734)
加ドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2,340	51,573.60	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,380	89,164.40	
加ドル小計			5,720	140,738.00	(12,193,540)
ユーロ	投資証券	FONCIERE DES REGIONS	595	48,772.15	
		GECINA SA	970	124,548.00	
		ICADE	685	45,531.95	
		KLEPIERRE	4,732	173,806.36	
		UNIBAIL-RODAMCO SE-NA	2,070	458,608.50	
ユーロ小計			9,052	851,266.96	(104,016,309)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	21,701	139,103.41	
		HAMMERSON PLC	15,295	87,028.55	
		INTU PROPERTIES PLC	19,860	54,932.76	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	16,229	173,650.30	
		SEGRO PLC	15,053	68,445.99	
英ポンド小計			88,138	523,161.01	(75,272,406)
豪ドル	投資証券	APA GROUP	21,286	184,762.48	
		DEXUS PROPERTY GROUP	18,487	181,912.08	
		GOODMAN GROUP	39,332	285,157.00	
		GPT GROUP	33,695	170,833.65	

		LENLEASE GROUP	12,197	177,100.44	
		MIRVAC GROUP	86,525	188,624.50	
		SCENTRE GROUP	116,381	530,697.36	
		STOCKLAND	55,310	256,638.40	
		VICINITY CENTRES	72,862	217,857.38	
		WESTFIELD CORP	41,745	384,471.45	
豪ドル小計			497,820	2,578,054.74	(216,917,525)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	48,000	2,361,600.00	
香港ドル小計			48,000	2,361,600.00	(35,612,928)
シンガ ポールド ル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	51,900	116,775.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	40,000	58,000.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	48,100	89,947.00	
		SUNTEC REIT	45,000	72,675.00	
シンガポールドル小計			185,000	337,397.00	(27,302,165)
合計				1,981,615,607	(1,981,615,607)

(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	組入出資金 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	出資金 1銘柄		0.0%		0.0%
	株式 601銘柄	97.0%			64.8%
	投資証券 37銘柄			3.0%	2.0%
加ドル	株式 87銘柄	99.6%			3.9%
	投資証券 2銘柄			0.4%	0.0%
ユーロ	株式 236銘柄	98.9%			11.9%
	投資証券 5銘柄			1.1%	0.1%
英ポンド	株式 106銘柄	98.6%			7.1%

	投資証券	5銘柄			1.4%	0.1%
スイスフラン	株式	38銘柄	100.0%			3.4%
スウェーデンクローナ	株式	30銘柄	100.0%			1.1%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式	17銘柄	100.0%			0.6%
豪ドル	株式	61銘柄	90.1%			2.6%
	投資証券	10銘柄			9.9%	0.3%
ニュージーランドドル	株式	6銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式	40銘柄	96.1%			1.2%
	投資証券	1銘柄			3.9%	0.0%
シンガポールドル	株式	19銘柄	92.4%			0.4%
	投資証券	4銘柄			7.6%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	6銘柄	100.0%			0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成28年 6月27日現在	平成28年12月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	83,494,590	121,772,739
コール・ローン	48,265,986	70,002,860
株式	7,957,760,346	9,776,973,580
投資信託受益証券	29,386,457	37,685,120
投資証券	41,490,510	47,533,214
派生商品評価勘定	75,614	-
未収入金	169,746	-
未収配当金	30,558,098	10,167,084
差入委託証拠金	16,243,146	149,739,494

	平成28年 6月27日現在	平成28年12月26日現在
流動資産合計	8,207,444,493	10,213,874,091
資産合計	8,207,444,493	10,213,874,091
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,236,552	16,018,868
未払解約金	8,348,600	10,198,816
未払利息	77	61
流動負債合計	11,585,229	26,217,745
負債合計	11,585,229	26,217,745
純資産の部		
元本等		
元本	6,874,168,506	7,049,884,290
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,321,690,758	3,137,772,056
元本等合計	8,195,859,264	10,187,656,346
純資産合計	8,195,859,264	10,187,656,346
負債純資産合計	8,207,444,493	10,213,874,091

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	平成28年 6月27日現在	平成28年12月26日現在
--	---------------	---------------

1.	期首	平成27年12月26日	平成28年 6月28日
	期首元本額	6,709,790,933円	6,874,168,506円
	期首からの追加設定元本額	609,016,303円	617,108,837円
	期首からの一部解約元本額	444,638,730円	441,393,053円
	元本の内訳		
	日興五大陸株式ファンド	2,442,754,966円	2,224,016,829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	31,138,222円	28,859,789円
	インデックスファンド海外新興国（エマージング）株式	4,398,609,119円	4,795,341,473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）	1,666,199円	1,666,199円
	計	6,874,168,506円	7,049,884,290円
2.	受益権の総数	6,874,168,506口	7,049,884,290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12月26日 至 平成28年 6月27日	自 平成28年 6月28日 至 平成28年12月26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28年 6月27日現在	平成28年12月26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 「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>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）

（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

（平成28年12月26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	584,095,581
投資信託受益証券	2,428,165
投資証券	2,707,188
合計	578,960,228

(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

(平成28年12月26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	345,430,753	-	329,411,885	16,018,868
	合計	345,430,753	-	329,411,885	16,018,868

(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。

(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28年 6月27日現在		平成28年12月26日現在	
1口当たり純資産額	1.1923円	1口当たり純資産額	1.4451円
(1万口当たり純資産額)	(11,923円)	(1万口当たり純資産額)	(14,451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	8.90	21,716.00	
	GAZPROM PAO-SPON ADR	132,700	4.88	648,637.60	
	LUKOIL PJSC-SPON-ADR	9,535	55.71	531,194.85	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	2,326	124.50	289,587.00	
	PETROLEO BRASILEIRO S.A.-ADR	3,750	10.11	37,912.50	
	ROSNEFT PJSC-REG S GDR	26,540	6.25	165,875.00	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	38,500	4.88	187,957.00	
	TATNEFT-SPONSORED-ADR	5,449	38.86	211,748.14	
	BRASKEM SA-SPON ADR	1,780	20.34	36,205.20	
	CEMEX SAB-SPONS ADR PART CER	2,600	7.82	20,332.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	4,650	10.40	48,360.00	
	CIA SIDERURGICA NAACL-SP ADR	10,170	3.04	30,916.80	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	13,394	16.30	218,322.20	
	PHOSAGRO OAO REG S-GDR	3,700	14.60	54,020.00	
	QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	1,100	28.37	31,207.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	7,270	14.62	106,287.40	
	SOUTHERN COPPER CORP(US)	2,080	32.09	66,747.20	
	DP WORLD LTD	4,470	17.05	76,213.50	
	LATAM AIRLINES GROUP-SP -ADR	2,280	8.21	18,718.80	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP-ADR	2,600	42.50	110,500.00	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	1,000	68.71	68,710.00	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	8,700	26.01	226,287.00	
	GRUPO TELEVISA SA-SPONS ADR	2,040	20.89	42,615.60	
	CTIP.COM INTERNATIONAL-ADR	8,150	39.98	325,837.00	
JD.COM INC-ADR	15,400	25.49	392,546.00		
QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	600	30.00	18,000.00		
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	7,700	11.11	85,547.00		
CIA BRASILEIRA-SP ADR PREF	2,380	16.15	38,437.00		

	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	6,920	40.20	278,184.00	
	BRF SA-ADR	5,980	14.20	84,916.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	1,450	20.43	29,623.50	
	BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	1,983	21.54	42,713.82	
	BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	1,850	36.28	67,118.00	
	CREDICORP LTD	1,430	155.78	222,765.40	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORE-ADR	1,850	7.86	14,541.00	
	GRUPO FIN SANTANDER B-ADR	2,600	7.49	19,474.00	
	ITAU UNIBANCO HLDNG-PREF ADR	2,200	9.87	21,714.00	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	61,000	11.30	689,300.00	
	VTB BANK OJSC-GDR-REG S	66,030	2.28	150,680.46	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	17,100	1.47	25,222.50	
	58.COM INC-ADR	1,600	28.76	46,016.00	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP-ADR	24,450	86.79	2,122,015.50	
	BAIDU INC - SPON ADR	6,020	163.62	984,992.40	
	NETEASE INC-ADR	1,770	223.67	395,895.90	
	SINA CORP	1,140	62.41	71,147.40	
	WEIBO CORP-SPON-ADR	680	41.25	28,050.00	
	YY INC-ADR	350	41.55	14,542.50	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	12,562	9.04	113,560.48	
	ROSTELECOM-SPONSORED-ADR	2,641	8.21	21,682.61	
	SISTEMA PJSC-REG S SPONS GDR	2,800	8.74	24,472.00	
	TELEF BRASIL-ADR	3,924	13.14	51,561.36	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE-ADR	6,180	8.34	51,541.20	
	RUSHYDRO PJSC-ADR	28,000	1.42	39,760.00	
米ドル小計		585,814		9,721,927.82 (1,137,659,993)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	273,945	16.05	4,396,817.25	
	GRUPO MEXICO SA-SER B	82,078	56.54	4,640,690.12	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	3,700	387.28	1,432,936.00	
	MEXICHEM SAB DE CV-*	23,765	47.68	1,133,115.20	
	ALFA S.A.B.-A	61,000	26.30	1,604,300.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	13,700	80.80	1,106,960.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	7,900	167.08	1,319,932.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	4,000	295.31	1,181,240.00	

	OHL MEXICO SAB DE CV	21,000	20.00	420,000.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	5,000	174.54	872,700.00	
	GRUPO TELEVISIA SAB	43,100	85.99	3,706,169.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	4,400	150.00	660,000.00	
	WALMART DE MEXICO -SER V	120,200	37.53	4,511,106.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	9,300	107.12	996,216.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	10,900	129.94	1,416,346.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	38,900	156.39	6,083,571.00	
	GRUMA S.A.B. -B	3,000	258.13	774,390.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	36,500	44.54	1,625,710.00	
	GRUPO LALA SAB DE CV	13,000	30.18	392,340.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	41,670	36.44	1,518,454.80	
	GRUPO FIN SANTANDER-B	32,000	30.95	990,400.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	52,100	99.91	5,205,311.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	54,000	30.31	1,636,740.00	
	GENTERA SAB DE CV	30,000	31.66	949,800.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	705,800	12.87	9,083,646.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	10,600	87.53	927,818.00	
	メキシコペソ小計	1,701,558		58,586,708.37	(333,358,370)
ブラジルリアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	2,600	36.89	95,914.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	53,360	16.57	884,175.20	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	85,100	14.24	1,211,824.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	8,100	65.90	533,790.00	
	BRASKEM SA-PREF A	1,000	33.12	33,120.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL	7,800	9.95	77,610.00	
	DURATEX SA	7,260	6.30	45,738.00	
	FIBRIA CELULOSE SA	5,929	30.30	179,648.70	
	GERDAU SA-PREF	16,000	10.30	164,800.00	
	KLABIN SA - UNIT	13,300	16.80	223,440.00	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	9,000	13.18	118,620.00	
	VALE SA	25,760	25.19	648,894.40	
	VALE SA-PREF A	46,150	22.27	1,027,760.50	
	EMBRAER SA	16,000	15.30	244,800.00	
	WEG SA	12,820	14.85	190,377.00	

CCR SA	20,600	15.29	314,974.00	
LOCALIZA RENT A CAR	2,940	34.49	101,400.60	
RUMO LOGISTICA OPERADORA MUL	16,000	5.92	94,720.00	
KROTON EDUCACIONAL SA	29,448	13.03	383,707.44	
LOJAS AMERICANAS SA	6,000	12.01	72,060.00	
LOJAS AMERICANAS SA-PRF	13,092	16.55	216,672.60	
LOJAS RENNER S.A.	14,000	21.51	301,140.00	
CIA BRASILEIRA DE DIS-PRF	850	53.08	45,118.00	
RAIA DROGASIL SA	4,700	58.40	274,480.00	
AMBEV SA	102,000	16.00	1,632,000.00	
BRF SA	8,400	46.48	390,432.00	
JBS SA	18,100	11.40	206,340.00	
M DIAS BRANCO SA	950	110.15	104,642.50	
NATURA COSMETICOS SA	3,300	22.09	72,897.00	
ODONTOPREV S.A.	4,700	12.51	58,797.00	
QUALICORP SA	5,000	18.51	92,550.00	
HYPERMARCAS SA	8,000	24.99	199,920.00	
BANCO BRADESCO S.A.	18,876	27.34	516,069.84	
BANCO BRADESCO SA-PRF	60,442	27.31	1,650,671.02	
BANCO DO BRASIL S.A.	19,200	26.74	513,408.00	
BANCO SAN. BRASIL-UNIT	7,700	27.15	209,055.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	70,436	32.47	2,287,056.92	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PRF	83,419	7.90	659,010.10	
BM&FBOVESPA SA	37,573	15.74	591,399.02	
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	4,700	43.99	206,753.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	14,000	27.25	381,500.00	
PORTO SEGURO SA	3,200	25.60	81,920.00	
SUL AMERICA SA - UNITS	5,500	17.30	95,150.00	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	13,650	11.55	157,657.50	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	1,500	57.52	86,280.00	
CIELO SA	20,890	27.95	583,875.50	
TELEFONICA BRASIL S.A. -PREF	5,330	42.74	227,804.20	
TIM PARTICIPACOES SA	16,905	7.61	128,647.05	
AES TIETE ENERGIA SA-UNIT	5,500	13.62	74,910.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	4,800	25.17	120,816.00	

	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	14,399	7.52	108,280.48	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PRF-B	3,000	26.36	79,080.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	2,160	27.43	59,248.80	
	CPFL ENERGIA SA	3,605	25.15	90,665.75	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	7,300	13.41	97,893.00	
	ENGIE BRASIL SA	3,700	34.14	126,318.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	3,800	52.60	199,880.00	
ブラジルリアル小計		999,844		19,575,712.12	(700,614,736)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	9,890	6,277.60	62,085,464.00	
	EMPRESAS CMPC SA	20,000	1,312.30	26,246,000.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B-PRF	1,400	18,840.00	26,376,000.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	5,300	5,549.80	29,413,940.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	13,300	5,065.60	67,372,480.00	
	CENCOSUD SA	30,150	1,838.00	55,415,700.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PRF B	5,600	2,411.10	13,502,160.00	
	BANCO DE CHILE	583,660	76.99	44,935,983.40	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	959	32,305.00	30,980,495.00	
	BANCO SANTANDER CHILE SA	747,000	36.00	26,892,000.00	
	ITAU CORPBANCA	2,600,000	5.40	14,055,600.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	3,440	6,761.30	23,258,872.00	
	AES GENER SA	80,000	225.31	18,024,800.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	56,000	345.45	19,345,200.00	
	COLBUN SA	208,000	125.26	26,054,080.00	
	ENDESA AMERICAS SA	57,700	294.62	16,999,574.00	
ENEL AMERICAS SA	419,500	105.69	44,336,955.00		
ENEL CHILE SA	419,500	60.21	25,258,095.00		
ENEL GENERACION CHILE SA	57,700	419.50	24,205,150.00		
チリペソ小計		5,319,099		594,758,548.40	(103,250,084)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	50,000	1,335.00	66,750,000.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	8,890	11,760.00	104,546,400.00	
	GRUPO ARGOS SA	5,760	18,900.00	108,864,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PRF	2,000	26,940.00	53,880,000.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES-PRF	47,000	1,180.00	55,460,000.00	

	CORP FINANCIERA COLOMBIANA	1,863	36,420.00	67,850,460.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	6,600	36,500.00	240,900,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	13,000	9,820.00	127,660,000.00	
コロンビアペソ小計		135,113		825,910,860.00 (32,210,523)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	1,770	70.60	124,962.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	46,017	5.09	234,226.53	
	KOC HOLDING AS	12,124	13.32	161,491.68	
	TURK HAVA YOLLARI AO	19,550	4.94	96,577.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	3,300	23.80	78,540.00	
	ARCELIK A.S.	6,500	20.94	136,110.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	4,400	48.36	212,784.00	
	ANADOLU EFES BIRACILIK	5,581	17.58	98,113.98	
	COCA-COLA ICECEK URETIM AS	2,000	32.82	65,640.00	
	AKBANK T.A.S.	49,259	7.72	380,279.48	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	52,740	7.61	401,351.40	
	TURKIYE HALK BANKASI	14,660	9.31	136,484.60	
	TURKIYE IS BANKASI-C	39,904	5.11	203,909.44	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	19,682	4.33	85,223.06	
	YAPI VE KREDI BANKASI	18,033	3.37	60,771.21	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	27,753	9.18	254,772.54	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	12,000	5.14	61,680.00	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	17,056	9.45	161,179.20		
トルコリラ小計		352,329		2,954,096.12 (98,489,564)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,800	869.60	1,565,280.00	
	MONETA MONEY BANK AS	8,000	82.25	658,000.00	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	1,300	254.50	330,850.00	
	CEZ AS	3,530	420.50	1,484,365.00	
チェココルナ小計		14,630		4,038,495.00 (18,294,382)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	1,060	20,100.00	21,306,000.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	2,750	6,144.00	16,896,000.00	
	OTP BANK PLC	4,585	8,370.00	38,376,450.00	
		8,395		76,578,450.00	

ハンガリーフォリント小計				(30,279,119)
ポーランドズロチ	GRUPA LOTOS SA	3,000	38.60	115,800.00
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	7,330	86.08	630,966.40
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	37,985	5.47	207,777.95
	GRUPA AZOTY SA	1,400	62.00	86,800.00
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	3,710	91.20	338,352.00
	CCC SA	650	197.70	128,505.00
	LPP SA	20	5,635.90	112,718.00
	CYFROWY POLSAT SA	4,500	24.04	108,180.00
	EUROCASH SA	2,100	38.65	81,165.00
	ALIOR BANK SA	1,500	54.15	81,225.00
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	850	76.17	64,744.50
	BANK MILLENNIUM SA	13,000	5.08	66,040.00
	BANK PEKAO SA	3,152	123.65	389,744.80
	BANK ZACHODNI WBK SA	810	311.50	252,315.00
	MBANK	410	330.85	135,648.50
	PKO BANK POLSKI SA	18,445	28.15	519,226.75
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	12,000	32.60	391,200.00
	ORANGE POLSKA SA	14,105	5.25	74,051.25
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	18,400	10.53	193,752.00	
TAURON POLSKA ENERGIA SA	22,000	2.94	64,680.00	
ポーランドズロチ小計	165,367			4,042,892.15 (112,149,828)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	85,000	3.54	300,900.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	46,000	7.05	324,300.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	539,300	5.48	2,955,364.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	73,000	14.30	1,043,900.00
	CNOOC LTD	388,000	9.57	3,713,160.00
	KUNLUN ENERGY CO LTD	66,000	5.83	384,780.00
	PETROCHINA CO LTD-H	467,000	5.81	2,713,270.00
	YANZHOU COAL MINING CO-H	50,000	5.19	259,500.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	89,000	3.11	276,790.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	23,000	21.20	487,600.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	74,000	3.69	273,060.00
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	31,000	10.66	330,460.00

NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	42,000	6.93	291,060.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	64,500	4.09	263,805.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	147,750	2.32	342,780.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	52,000	5.20	270,400.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	12,000	34.85	418,200.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	96,000	8.50	816,000.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	31,000	13.66	423,460.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	46,000	9.77	449,420.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	100,000	6.20	620,000.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	52,000	11.38	591,760.00	
CITIC LTD	94,000	10.90	1,024,600.00	
CRRC CORP LTD- H	79,000	6.89	544,310.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	49,000	10.78	528,220.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	12,000	14.56	174,720.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	70,000	3.36	235,200.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	13,000	20.60	267,800.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	32,000	6.33	202,560.00	
WEICHAJ POWER CO LTD-H	19,200	12.06	231,552.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	9,000	38.40	345,600.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	55,000	8.24	453,200.00	
AIR CHINA LTD-H	58,000	5.02	291,160.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	40,000	7.30	292,000.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	21,000	18.86	396,060.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	38,000	4.10	155,800.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	32,000	7.72	247,040.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	24,000	9.48	227,520.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	43,000	7.33	315,190.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	64,000	10.14	648,960.00	
BYD CO LTD-H	14,500	40.30	584,350.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B	28,000	10.67	298,760.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	60,000	7.50	450,000.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	10,000	23.25	232,500.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	100,000	7.09	709,000.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	75,000	7.10	532,500.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	52,318	9.03	472,431.54	

ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	25,000	22.30	557,500.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	36,000	11.86	426,960.00	
HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD	424,000	0.37	156,880.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	13,000	47.55	618,150.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	180,000	1.32	237,600.00	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	145,000	4.29	622,050.00	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	191,160	0.91	173,955.60	
SUN ART RETAIL GROUP	43,000	6.69	287,670.00	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	90,000	2.83	254,700.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	58,000	14.34	831,720.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	37,000	14.64	541,680.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	38,000	9.29	353,020.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	6,000	29.30	175,800.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	132,000	4.77	629,640.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	17,500	55.10	964,250.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	76,000	3.79	288,040.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	32,000	4.99	159,680.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	13,000	16.80	218,400.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	26,400	31.45	830,280.00	
3SBIO INC	25,000	7.32	183,000.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	24,000	11.80	283,200.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	78,000	8.03	626,340.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	11,000	22.70	249,700.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	102,000	5.25	535,500.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	485,000	3.13	1,518,050.00	
BANK OF CHINA LTD - H	1,784,000	3.35	5,976,400.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	216,245	5.46	1,180,697.70	
CHINA CITIC BANK - H	206,000	4.81	990,860.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,836,920	5.62	10,323,490.40	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	90,000	3.40	306,000.00	
CHINA MERCHANTS BANK - H	81,150	17.74	1,439,601.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	131,200	8.03	1,053,536.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	75,000	4.40	330,000.00	
IND & COMM BK OF CHINA - H	1,636,575	4.49	7,348,221.75	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	171,000	2.62	448,020.00	

CHINA EVERBRIGHT LTD	18,000	14.34	258,120.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	63,000	6.86	432,180.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	98,000	2.56	250,880.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	46,000	15.50	713,000.00	
FAR EAST HORIZON LTD	40,000	6.38	255,200.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	30,600	15.98	488,988.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	67,600	13.10	885,560.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	32,000	14.64	468,480.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	159,000	20.05	3,187,950.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	54,600	26.60	1,452,360.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	34,940	15.64	546,461.60	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO-H	14,000	34.95	489,300.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	163,000	3.01	490,630.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	99,334	11.90	1,182,074.60	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	114,000	38.40	4,377,600.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	96,000	4.74	455,040.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	110,000	2.03	223,300.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	86,320	20.40	1,760,928.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	61,777	17.32	1,069,977.64	
CHINA VANKE CO LTD-H	30,360	17.54	532,514.40	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	100,713	4.28	431,051.64	
FULLSHARE HOLDINGS LTD	102,500	3.43	351,575.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	26,400	9.09	239,976.00	
LONGFOR PROPERTIES	31,000	9.63	298,530.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	37,500	9.96	373,500.00	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	65,000	3.31	215,150.00	
SOHO CHINA LTD	65,000	3.74	243,100.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	40,000	6.43	257,200.00	
KINGSOFT CORP LTD	16,000	15.46	247,360.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	123,400	179.70	22,174,980.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	20,000	15.70	314,000.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	18,000	67.45	1,214,100.00	
LENOVO GROUP LTD	154,000	4.67	719,180.00	
SUNNY OPTICAL TECH	14,000	32.80	459,200.00	
ZTE CORP-H	21,600	12.56	271,296.00	

	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	60,000	4.86	291,600.00	
	CHINA MOBILE LTD	133,700	80.50	10,762,850.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD	315,000	3.56	1,121,400.00	
	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	123,882	8.98	1,112,460.36	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	90,000	4.91	441,900.00	
	CGN POWER CO LTD-H	186,000	2.10	390,600.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	54,000	10.22	551,880.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	48,000	5.76	276,480.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	55,000	2.73	150,150.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	30,000	21.20	636,000.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	47,000	12.02	564,940.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	12,000	31.40	376,800.00	
	GUANGDONG INVEST	62,000	9.96	617,520.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	106,000	4.91	520,460.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	64,000	2.35	150,400.00	
	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	298,000	0.95	283,100.00	
	HANERGY THIN FILM POWER GROU	240,000	2.94	705,600.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	50,000	10.94	547,000.00	
香港ドル小計		16,430,944		135,363,478.23 (2,041,281,251)	
マレーシアリン ギット	PETRONAS DAGANGAN BHD	5,000	23.50	117,500.00	
	SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	70,000	1.60	112,000.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	53,000	6.90	365,700.00	
	DIALOG GROUP BHD	70,000	1.53	107,100.00	
	GAMUDA BHD	30,000	4.80	144,000.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	10,000	8.18	81,800.00	
	IJM CORP BHD	70,000	3.18	222,600.00	
	SIME DARBY BERHAD	64,720	8.03	519,701.60	
	AIRASIA BHD	47,000	2.31	108,570.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	18,000	6.01	108,180.00	
	MISC BHD	30,000	7.23	216,900.00	
	UMW HOLDINGS BHD	11,700	4.65	54,405.00	
	BERJAYA SPORTS TOTO BERHAD	27,653	2.95	81,576.35	
	GENTING BHD	45,300	7.72	349,716.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	72,500	4.54	329,150.00	

	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	30,000	2.65	79,500.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	2,500	42.50	106,250.00	
	FELDA GLOBAL VENTURES	43,000	1.53	65,790.00	
	IOI CORPORATION BERHAD	41,675	4.36	181,703.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	12,000	23.54	282,480.00	
	PPB GROUP BERHAD	11,700	15.74	184,158.00	
	HARTELEGA HOLDINGS BHD	17,000	4.66	79,220.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	54,000	6.34	342,360.00	
	ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	37,000	3.68	136,160.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	32,600	4.26	138,876.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	75,600	4.58	346,248.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	12,300	13.08	160,884.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,000	14.54	72,700.00	
	MALAYAN BANKING BHD	67,850	7.74	525,159.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	61,370	19.68	1,207,761.60	
	RHB BANK BHD	18,259	4.65	84,904.35	
	IOI PROPERTIES GROUP BHD	53,476	2.02	108,021.52	
	AXIATA GROUP BERHAD	51,900	4.50	233,550.00	
	DIGI.COM BHD	74,000	4.95	366,300.00	
	MAXIS BHD	44,000	5.95	261,800.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	25,000	5.95	148,750.00	
	PETRONAS GAS BERHAD	14,000	21.20	296,800.00	
	TENAGA NASIONAL BERHAD	66,125	13.66	903,267.50	
	YTL CORPORATION BERHAD	144,704	1.53	221,397.12	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	73,500	1.42	104,370.00	
	マレーシアリングット小計	1,693,432		9,557,309.04 (250,114,777)	
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	52,500	18.70	981,750.00	
	IRPC PCL - NVDR	191,800	4.78	916,804.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	28,710	91.00	2,612,610.00	
	PTT PCL-NVDR	21,600	365.00	7,884,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	28,000	71.75	2,009,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	39,000	32.75	1,277,250.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	39,045	62.75	2,450,073.75	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	2,600	484.00	1,258,400.00	

	SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	7,300	482.00	3,518,600.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	23,000	49.50	1,138,500.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	8,000	388.00	3,104,000.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-NVDR	174,000	7.35	1,278,900.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	160,000	8.40	1,344,000.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	55,000	34.25	1,883,750.00	
	BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	31,000	16.50	511,500.00	
	ROBINSON DEPT STORE-NVDR	12,000	61.25	735,000.00	
	CP ALL PCL-NVDR	98,800	60.75	6,002,100.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	70,000	28.75	2,012,500.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	40,000	20.50	820,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	110,000	22.40	2,464,000.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	8,000	174.00	1,392,000.00	
	BANGKOK BANK-FOREIGN REG	6,640	158.50	1,052,440.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	24,200	173.00	4,186,600.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	13,200	173.00	2,283,600.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	75,125	17.40	1,307,175.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	36,300	146.50	5,317,950.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	400,000	2.08	832,000.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	31,000	55.25	1,712,750.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	12,000	80.00	960,000.00	
	KCE ELECTRONICS -NVDR	6,400	118.50	758,400.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	20,800	144.50	3,005,600.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	182,700	7.00	1,278,900.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	3,000	194.00	582,000.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	10,000	77.00	770,000.00	
タイパーツ小計		2,021,720		69,642,152.75 (226,336,996)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	52,000	66.95	3,481,400.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	54,000	12.30	664,200.00	
	DMCI HOLDINGS INC	115,000	12.60	1,449,000.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	65,000	66.00	4,290,000.00	
	SM INVESTMENTS CORP	4,968	615.00	3,055,320.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	10,000	69.85	698,500.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	10,000	190.60	1,906,000.00	

	UNIVERSAL ROBINA CORP	21,000	150.00	3,150,000.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	17,741	87.40	1,550,563.40	
	BDO UNIBANK INC	31,000	105.00	3,255,000.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	18,827	71.55	1,347,071.85	
	SECURITY BANK CORP	5,000	200.00	1,000,000.00	
	AYALA CORPORATION	4,942	708.00	3,498,936.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,700	1,209.00	2,055,300.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	320,000	5.99	1,916,800.00	
	AYALA LAND INC	156,960	30.05	4,716,648.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	176,710	27.00	4,771,170.00	
	GLOBE TELECOM INC	630	1,445.00	910,350.00	
	PLDT INC	2,110	1,313.00	2,770,430.00	
	ABOITIZ POWER CORP	46,000	41.50	1,909,000.00	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	175,000	4.94	864,500.00	
	フィリピンペソ小計	1,288,588		49,260,189.25 (116,254,046)	
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY TBK PT	270,000	1,655.00	446,850,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	33,500	19,675.00	659,112,500.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	32,000	14,800.00	473,600,000.00	
	SEMEN GRESIK (PERSERO) PT	66,000	9,050.00	597,300,000.00	
	AKR CORPORINDO TBK PT	45,000	5,575.00	250,875,000.00	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	100,000	2,300.00	230,000,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	495,000	7,325.00	3,625,875,000.00	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	100,000	1,620.00	162,000,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	100,000	2,760.00	276,000,000.00	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	52,000	14,275.00	742,300,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	200,000	2,900.00	580,000,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	15,000	60,300.00	904,500,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	190,000	3,640.00	691,600,000.00	
	PT INDOFOOD SUKSES MAK TBK	136,000	7,275.00	989,400,000.00	
	PT UNILEVER INDONESIA TBK	30,000	37,875.00	1,136,250,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	550,000	1,440.00	792,000,000.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	48,000	3,330.00	159,840,000.00	
	BANK MANDIRI TBK	209,000	10,775.00	2,251,975,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	248,000	10,875.00	2,697,000,000.00	

	PT BANK CENTRAL ASIA	270,000	14,450.00	3,901,500,000.00	
	PT BANK NEGARA INDONESIA	180,000	5,250.00	945,000,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	170,000	1,600.00	272,000,000.00	
	LIPPO KARAWACI TBK/PT	450,000	710.00	319,500,000.00	
	SUMMARECON AGUNG TBK PT	185,000	1,255.00	232,175,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	1,115,000	3,690.00	4,114,350,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	36,000	4,980.00	179,280,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	78,000	2,250.00	175,500,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	213,500	2,520.00	538,020,000.00	
	インドネシアルピア小計	5,617,000		28,343,802,500.00 (246,591,081)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	1,270	53,600.00	68,072,000.00	
	S-OIL CORPORATION	825	84,900.00	70,042,500.00	
	SK INNOVATION CO LTD	1,482	146,500.00	217,113,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	2,000	25,650.00	51,300,000.00	
	HYOSUNG CORPORATION	550	148,500.00	81,675,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	1,830	59,200.00	108,336,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	155	479,000.00	74,245,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	460	82,400.00	37,904,000.00	
	LG CHEM LTD	1,002	266,500.00	267,033,000.00	
	LG CHEM LTD-PRF	230	180,000.00	41,400,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	370	356,000.00	131,720,000.00	
	OCI CO LTD	320	77,300.00	24,736,000.00	
	POSCO	1,470	264,500.00	388,815,000.00	
	CJ CORP	280	184,500.00	51,660,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	610	82,800.00	50,508,000.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	3,686	5,150.00	18,982,900.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	800	28,000.00	22,400,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,203	25,700.00	30,917,100.00	
	HANWHA CORPORATION	1,160	35,100.00	40,716,000.00	
	HANWHA TECHWIN CO LTD	710	43,700.00	31,027,000.00	
	HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	1,595	44,850.00	71,535,750.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	1,310	43,000.00	56,330,000.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	895	148,500.00	132,907,500.00	
	KCC CORP	120	369,000.00	44,280,000.00	

KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,000	67,000.00	67,000,000.00	
LG CORP	2,000	59,000.00	118,000,000.00	
POSCO DAEWOO CORP	1,431	28,100.00	40,211,100.00	
SAMSUNG C&T CORP	1,657	128,500.00	212,924,500.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	5,981	9,430.00	56,400,830.00	
SK HOLDINGS CO LTD	1,021	230,000.00	234,830,000.00	
SK NETWORKS CO LTD	1,950	6,830.00	13,318,500.00	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	450	57,000.00	25,650,000.00	
S1 CORPORATION	420	89,100.00	37,422,000.00	
CJ KOREA EXPRESS CORP	130	179,500.00	23,335,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	400	155,000.00	62,000,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	864	28,750.00	24,840,000.00	
HANKOOK TIRE CO LTD	1,482	57,100.00	84,622,200.00	
HANON SYSTEMS	5,400	9,890.00	53,406,000.00	
HYUNDAI MOBIS	1,500	266,500.00	399,750,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	3,430	144,000.00	493,920,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	850	101,500.00	86,275,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	480	96,500.00	46,320,000.00	
HYUNDAI WIA CORP	320	73,500.00	23,520,000.00	
KIA MOTORS CORPORATION	5,640	39,100.00	220,524,000.00	
COWAY CO LTD	1,090	90,900.00	99,081,000.00	
HANSSEM CO LTD	170	191,000.00	32,470,000.00	
LG ELECTRONICS INC	2,085	49,650.00	103,520,250.00	
KANGWON LAND INC	2,770	37,550.00	104,013,500.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	2,350	15,400.00	36,190,000.00	
CJ E&M CORP	470	67,900.00	31,913,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	830	48,400.00	40,172,000.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	380	111,000.00	42,180,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	215	220,500.00	47,407,500.00	
SHINSEGAE CO LTD	167	178,500.00	29,809,500.00	
BGF RETAIL CO LTD	380	83,200.00	31,616,000.00	
DONGSUH COMPANIES INC	850	27,150.00	23,077,500.00	
E-MART CO LTD	472	184,500.00	87,084,000.00	
GS RETAIL CO LTD	600	47,200.00	28,320,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	194	365,000.00	70,810,000.00	

KT&G CORP	2,535	105,000.00	266,175,000.00	
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO	15	1,470,000.00	22,050,000.00	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	150	183,000.00	27,450,000.00	
ORION CORP	80	653,000.00	52,240,000.00	
OTTOGI CORPORATION	30	666,000.00	19,980,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	730	322,500.00	235,425,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	750	129,000.00	96,750,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	200	848,000.00	169,600,000.00	
CELLTRION INC	1,704	104,000.00	177,216,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	107	321,000.00	34,347,000.00	
HANMI SCIENCE CO LTD	255	64,200.00	16,371,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	325	144,000.00	46,800,000.00	
YUHAN CORPORATION	240	205,000.00	49,200,000.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	6,484	8,930.00	57,902,120.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	2,586	9,970.00	25,782,420.00	
HANA FINANCIAL GROUP	6,008	32,950.00	197,963,600.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	6,440	13,450.00	86,618,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	8,005	43,550.00	348,617,750.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	9,400	46,800.00	439,920,000.00	
WOORI BANK	8,411	13,250.00	111,445,750.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	955	42,000.00	40,110,000.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	4,575	7,250.00	33,168,750.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	1,778	20,500.00	36,449,000.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	3,171	9,980.00	31,646,580.00	
SAMSUNG CARD CO	690	41,600.00	28,704,000.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,517	32,200.00	48,847,400.00	
DONGBU INSURANCE CO LTD	800	63,700.00	50,960,000.00	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	6,000	6,740.00	40,440,000.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	1,200	31,650.00	37,980,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	780	273,000.00	212,940,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	1,400	114,500.00	160,300,000.00	
KAKAO CORP	660	75,000.00	49,500,000.00	
NAVER CORP	628	768,000.00	482,304,000.00	
NCSOFT CORPORATION	350	249,500.00	87,325,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	650	138,000.00	89,700,000.00	

	LG DISPLAY CO LTD	5,560	31,300.00	174,028,000.00	
	LG INNOTEK CO LTD	280	87,000.00	24,360,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,330	49,400.00	65,702,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	2,185	1,782,000.00	3,893,670,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	375	1,396,000.00	523,500,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	1,228	108,500.00	133,238,000.00	
	KT CORP	1,027	30,250.00	31,066,750.00	
	LG UPLUS CORP.	5,000	11,950.00	59,750,000.00	
	SK TELECOM	400	230,500.00	92,200,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	5,640	45,950.00	259,158,000.00	
	KOREA GAS CORPORATION	828	48,250.00	39,951,000.00	
	SK HYNIX INC	12,630	46,300.00	584,769,000.00	
韓国ウォン小計		189,854		15,039,210,250.00 (1,470,834,762)	
台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	27,080	105.00	2,843,400.00	
	ASIA CEMENT CORP	57,978	26.20	1,519,023.60	
	CHINA STEEL CORP	269,181	24.60	6,621,852.60	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	66,047	93.20	6,155,580.40	
	FORMOSA PLASTICS CORP	85,424	86.10	7,355,006.40	
	NAN YA PLASTICS CORP	103,145	70.40	7,261,408.00	
	TAIWAN CEMENT	76,170	34.35	2,616,439.50	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	20,000	40.00	800,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	75,957	24.00	1,822,968.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	3,960	143.50	568,260.00	
	TECO ELECTRIC & MACHINERY	36,000	26.80	964,800.00	
	CHINA AIRLINES LTD	67,000	9.28	621,760.00	
	EVA AIRWAYS CORP	43,187	14.55	628,370.85	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	45,216	11.00	497,376.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	45,947	59.00	2,710,873.00	
	YULON MOTOR COMPANY	35,020	26.50	928,030.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	3,191	333.50	1,064,198.50	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	6,921	117.00	809,757.00	
	FORMOSA TAFFETA CO.	18,000	28.60	514,800.00	
	GIANT MANUFACTURING	5,000	181.50	907,500.00	
	MERIDA INDUSTRY CO LTD	5,250	138.00	724,500.00	

NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	3,000	315.50	946,500.00
POU CHEN	38,145	39.15	1,493,376.75
RUENTEX INDUSTRIES LTD	12,000	53.20	638,400.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	7,000	360.50	2,523,500.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	12,448	228.50	2,844,368.00
STANDARD FOODS CORP	7,770	74.90	581,973.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	109,703	52.20	5,726,496.60
OBI PHARMA INC	2,000	246.00	492,000.00
TAIMED BIOLOGICS INC	3,000	161.00	483,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	93,848	16.70	1,567,261.60
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	350,715	7.96	2,791,691.40
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	399,746	17.45	6,975,567.70
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	177,433	18.05	3,202,665.65
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	204,887	16.80	3,442,101.60
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	164,920	16.00	2,638,720.00
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	222,356	22.90	5,091,952.40
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	224,284	8.95	2,007,341.80
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	181,891	11.70	2,128,124.70
TAIWAN BUSINESS BANK	134,746	8.08	1,088,747.68
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	191,417	13.85	2,651,125.45
CHAILEASE HOLDING CO LTD	15,329	54.40	833,897.60
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	137,743	49.80	6,859,601.40
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	217,257	11.70	2,541,906.90
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	185,538	47.00	8,720,286.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	78,310	31.50	2,466,765.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	121,337	7.80	946,428.60
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	14,950	44.70	668,265.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	28,353	36.15	1,024,960.95
ACER INC	64,812	13.00	842,556.00
ADVANTECH CO LTD	6,561	247.50	1,623,847.50
ASUSTEK COMPUTER INC	15,797	264.00	4,170,408.00
AU OPTRONICS CORP	173,994	12.00	2,087,928.00
CASETEK HOLDINGS LTD	3,000	82.70	248,100.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	13,405	221.50	2,969,207.50
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	13,195	72.40	955,318.00

	COMPAL ELECTRONICS	86,955	18.05	1,569,537.75	
	DELTA ELECTRONICS INC	42,541	155.00	6,593,855.00	
	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	23,787	82.70	1,967,184.90	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	347,765	82.70	28,760,165.50	
	HTC CORP	17,011	77.20	1,313,249.20	
	INNOLUX CORP	189,282	11.65	2,205,135.30	
	INVENTEC CORP	62,162	20.85	1,296,077.70	
	LARGAN PRECISION CO LTD	2,236	3,550.00	7,937,800.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	45,787	47.50	2,174,882.50	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	13,000	72.00	936,000.00	
	PEGATRON CORP	43,854	76.10	3,337,289.40	
	QUANTA COMPUTER INC	63,416	58.40	3,703,494.40	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	32,120	32.35	1,039,082.00	
	TRANSCEND INFORMATION INC	7,346	84.00	617,064.00	
	WISTRON CORP	49,836	23.15	1,153,703.40	
	WPG HOLDINGS LTD	40,000	37.45	1,498,000.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	7,000	63.20	442,400.00	
	ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	50,000	10.25	512,500.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	83,371	101.00	8,420,471.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	42,000	70.50	2,961,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	33,188	102.00	3,385,176.00	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	127,784	32.35	4,133,812.40	
	MEDIATEK INC	33,132	216.50	7,173,078.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	12,522	103.50	1,296,027.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	3,000	255.50	766,500.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	11,635	84.20	979,667.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	11,815	99.20	1,172,048.00	
	SILICONWARE PRECISION INDS	42,082	46.75	1,967,333.50	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	538,355	178.50	96,096,367.50	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	238,592	11.30	2,696,089.60	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	22,000	54.00	1,188,000.00	
台湾ドル小計		7,050,138		333,503,285.68 (1,213,951,959)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	10,500	610.90	6,414,450.00	
	CAIRN INDIA LTD	9,100	243.95	2,219,945.00	

COAL INDIA LTD	14,000	287.85	4,029,900.00
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	8,100	420.55	3,406,455.00
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	15,460	192.95	2,983,007.00
OIL & NATURAL GAS CORP LTD(N)	7,730	192.95	1,491,503.50
RELIANCE INDUSTRIES LTD	28,946	1,057.30	30,604,605.80
ACC LIMITED	1,330	1,296.30	1,724,079.00
AMBUJA CEMENTS LIMITED	10,970	200.05	2,194,548.50
ASIAN PAINTS LTD	5,000	874.00	4,370,000.00
HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	29,280	159.30	4,664,304.00
JSW STEEL LIMITED	2,000	1,568.05	3,136,100.00
SHREE CEMENT LTD	200	13,628.45	2,725,690.00
TATA STEEL LIMITED	5,416	390.85	2,116,843.60
ULTRATECH CEMENT LTD	1,750	3,107.10	5,437,425.00
UPL LTD	5,900	627.00	3,699,300.00
VEDANTA LTD	23,260	216.65	5,039,279.00
ASHOK LEYLAND LTD	27,000	77.70	2,097,900.00
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	13,150	119.00	1,564,850.00
EICHER MOTORS LTD	280	20,921.90	5,858,132.00
HAVELLS INDIA LTD	6,100	325.55	1,985,855.00
LARSEN & TOUBRO LTD	6,980	1,337.45	9,335,401.00
SIEMENS INDIA LIMITED	1,890	1,070.85	2,023,906.50
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	15,000	262.90	3,943,500.00
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	1,400	1,102.20	1,543,080.00
BAJAJ AUTO LTD	2,400	2,618.80	6,285,120.00
BHARAT FORGE LIMITED	1,800	911.95	1,641,510.00
BOSCH LTD	160	19,715.95	3,154,552.00
HERO MOTOCORP LTD	1,400	3,040.10	4,256,140.00
MAHINDRA & MAHINDRA LIMITED	8,600	1,171.60	10,075,760.00
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,300	5,197.15	11,953,445.00
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	6,000	309.10	1,854,600.00
TATA MOTORS LTD	33,528	465.65	15,612,313.20
TATA MOTORS LTD-A-DVR	5,700	293.70	1,674,090.00
TITAN CO LTD	6,000	314.30	1,885,800.00
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	13,630	442.65	6,033,319.50
ITC LTD	75,765	224.70	17,024,395.50

NESTLE INDIA LIMITED	560	5,803.60	3,250,016.00	
UNITED SPIRITS LIMITED	1,330	1,852.55	2,463,891.50	
DABUR INDIA LTD	9,500	262.05	2,489,475.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	3,700	1,433.60	5,304,320.00	
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	15,520	789.50	12,253,040.00	
MARICO LTD	8,600	245.40	2,110,440.00	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	2,300	1,136.40	2,613,720.00	
AUROBINDO PHARMA LTD	7,500	647.55	4,856,625.00	
CADILA HEALTHCARE LTD	5,300	336.85	1,785,305.00	
CIPLA LTD	7,650	582.30	4,454,595.00	
DIVI'S LABORATORIES LTD	1,900	861.50	1,636,850.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	2,190	2,998.55	6,566,824.50	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	2,900	925.70	2,684,530.00	
LUPIN LTD	4,130	1,445.80	5,971,154.00	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	2,000	1,468.30	2,936,600.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	20,804	623.50	12,971,294.00	
AXIS BANK LTD	33,580	438.10	14,711,398.00	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	32,575	1,224.85	39,899,488.75	
ICICI BANK LTD	23,825	251.85	6,000,326.25	
IDFC BANK LTD	29,000	58.75	1,703,750.00	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	5,800	639.25	3,707,650.00	
LIC HOUSING FINANCE LTD	7,000	541.80	3,792,600.00	
STATE BANK OF INDIA	34,000	249.15	8,471,100.00	
YES BANK LTD	6,840	1,124.70	7,692,948.00	
BAJAJ FINANCE LTD	3,200	808.95	2,588,640.00	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	7,400	256.05	1,894,770.00	
POWER FINANCE CORPORATION	13,000	119.70	1,556,100.00	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	4,000	803.65	3,214,600.00	
BAJAJ FINSERV LTD	720	2,620.40	1,886,688.00	
HCL TECHNOLOGIES LTD	11,900	793.75	9,445,625.00	
INFOSYS LTD	40,140	988.45	39,676,383.00	
TATA CONSULTANCY SVS LTD	10,450	2,288.10	23,910,645.00	
TECH MAHINDRA LTD	5,200	467.10	2,428,920.00	
WIPRO LTD	13,640	458.75	6,257,350.00	
BHARTI AIRTEL LTD	26,000	295.55	7,684,300.00	

	BHARTI INFRATEL LTD	11,390	336.40	3,831,596.00	
	IDEA CELLULAR LTD	26,000	70.80	1,840,800.00	
	GAIL INDIA LTD	10,875	431.55	4,693,106.25	
	NTPC LIMITED	20,000	161.05	3,221,000.00	
	TATA POWER CO LTD	29,640	73.95	2,191,878.00	
インドルピー小計		910,084		472,711,447.35 (822,517,918)	
カタールリアル	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	5,200	22.82	118,664.00	
	INDUSTRIES QATAR	3,390	116.50	394,935.00	
	COMMERCIAL BANK QSC	3,000	30.90	92,700.00	
	COMMERCIAL BANK QSC/THE-RTS	540	4.77	2,575.80	
	DOHA BANK QSC	2,300	34.65	79,695.00	
	MASRAF AL RAYAN	9,240	37.60	347,424.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	1,670	102.50	171,175.00	
	QATAR NATIONAL BANK	4,716	161.00	759,276.00	
	QATAR INSURANCE CO	1,848	83.10	153,568.80	
	BARWA REAL ESTATE CO	3,000	32.90	98,700.00	
	EZDAN HOLDING GROUP	15,900	15.78	250,902.00	
	OOREDOO QSC	2,160	102.90	222,264.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	430	218.10	93,783.00	
カタールリアル小計		53,394		2,785,662.60 (89,698,335)	
エジプトポンド	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	22,687	71.23	1,615,995.01	
	T M G HOLDING	23,000	9.67	222,410.00	
	GLOBAL TELECOM HOLDING	60,000	7.45	447,000.00	
エジプトポンド小計		105,687		2,285,405.01 (14,260,927)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	3,510	85.44	299,894.40	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	1,660	253.21	420,328.60	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	8,520	135.90	1,157,868.00	
	GOLD FIELDS LTD	16,590	39.56	656,300.40	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	11,430	40.96	468,172.80	
	MONDI LTD	2,730	274.72	749,985.60	
	SAPPI LIMITED	14,415	85.70	1,235,365.50	
	SASOL LTD	12,300	396.23	4,873,629.00	

SIBANYE GOLD LTD	18,000	22.07	397,260.00	
BIDVEST GROUP LTD	6,372	176.50	1,124,658.00	
STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	62,960	69.50	4,375,720.00	
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	10,000	27.00	270,000.00	
NASPERS LTD-N SHS	9,580	1,936.82	18,554,735.60	
FOSCHINI GROUP LTD/THE	4,175	153.01	638,816.75	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	3,655	181.50	663,382.50	
MR PRICE GROUP LTD	5,300	152.20	806,660.00	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	10,620	76.99	817,633.80	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	21,405	68.12	1,458,108.60	
BID CORP LTD	7,509	241.00	1,809,669.00	
MASSMART HOLDINGS LTD	2,739	122.59	335,774.01	
PICK'N PAY STORES LTD	7,000	62.55	437,850.00	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	9,710	169.03	1,641,281.30	
SPAR GROUP LIMITED/THE	3,360	191.84	644,582.40	
PIONEER FOODS LTD	2,700	150.91	407,457.00	
TIGER BRANDS LTD	3,490	387.47	1,352,270.30	
LIFE HEALTHCARE GROUP	20,000	31.65	633,000.00	
NETCARE LTD	22,150	30.78	681,777.00	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	8,341	271.80	2,267,083.80	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	8,900	164.50	1,464,050.00	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	800	672.78	538,224.00	
NEDBANK GROUP LTD	5,250	232.21	1,219,102.50	
STANDARD BANK GROUP LTD	28,616	149.02	4,264,356.32	
BRAIT SE	7,000	84.64	592,480.00	
CORONATION FUND MANAGERS LTD	3,200	66.40	212,480.00	
FIRSTRAND LTD	70,870	51.30	3,635,631.00	
INVESTEC LTD	6,500	89.23	579,995.00	
PSG GROUP LTD	2,100	206.07	432,747.00	
REMGRO LTD	10,240	218.51	2,237,542.40	
RMB HOLDINGS LTD	17,530	64.00	1,121,920.00	
DISCOVERY LTD	8,507	112.50	957,037.50	
LIBERTY HOLDINGS LTD	4,000	107.03	428,120.00	
MMI HOLDINGS LTD	24,429	22.87	558,691.23	
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	19,830	38.43	762,066.90	

	SANLAM LTD	28,635	61.06	1,748,453.10	
	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	5,800	113.93	660,794.00	
	NEW EUROPE PROPERTY INVEST	4,700	153.73	722,531.00	
	MTN GROUP LTD	36,215	120.22	4,353,767.30	
	TELKOM SA SOC LTD	3,700	70.67	261,479.00	
	VODACOM GROUP LTD	9,035	144.52	1,305,738.20	
南アフリカランド小計		616,078		77,236,470.81	(641,835,072)
アラブディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	44,250	6.74	298,245.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	22,500	5.54	124,650.00	
	FIRST GULF BANK	20,192	12.60	254,419.20	
	NATIONAL BANK OF ABU DHABI	19,635	9.75	191,441.25	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	84,600	2.65	224,190.00	
	EMAAR MALLS PJSC	36,000	2.63	94,680.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	78,750	7.25	570,937.50	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	36,000	18.15	653,400.00	
アラブディルハム小計		341,927		2,411,962.95	(76,989,857)
合 計		45,600,995		9,776,973,580	(9,776,973,580)

(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	322,040.00	
米ドル小計			41,500	322,040.00	(37,685,120)
メキシコペソ	投資証券	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	57,000	1,781,820.00	
メキシコペソ小計			57,000	1,781,820.00	(10,138,555)
トルコリラ	投資証券	EMLAK KONUT GAYRIMEN	58,000	171,100.00	

トルコリラ小計			58,000	171,100.00 (5,704,474)	
南アフリ カランド	投資証券	FORTRESS INCOME FUND LTD-A	24,000	393,120.00	
		FORTRESS INCOME FUND LTD-B	12,000	390,240.00	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	60,000	1,500,000.00	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	91,000	946,400.00	
		RESILIENT REIT LTD	5,400	583,740.00	
南アフリカランド小計			192,400	3,813,500.00 (31,690,185)	
合計				85,218,334 (85,218,334)	

(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 53銘柄	96.8%			11.5%
	投資信託受 益証券 1銘柄		3.2%		0.4%
メキシコペソ	株式 26銘柄	97.0%			3.4%
	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%			7.1%
チリペソ	株式 19銘柄	100.0%			1.0%
コロンビアペソ	株式 8銘柄	100.0%			0.3%
トルコリラ	株式 18銘柄	94.5%			1.0%
	投資証券 1銘柄			5.5%	0.1%
チェココルナ	株式 4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 20銘柄	100.0%			1.1%
香港ドル	株式 135銘柄	100.0%			20.9%
マレーシアリングギット	株式 40銘柄	100.0%			2.5%
タイバーツ	株式 34銘柄	100.0%			2.3%

フィリピンペソ	株式	21銘柄	100.0%			1.2%
インドネシアルピア	株式	28銘柄	100.0%			2.5%
韓国ウォン	株式	106銘柄	100.0%			14.9%
台湾ドル	株式	87銘柄	100.0%			12.3%
インドルピー	株式	77銘柄	100.0%			8.3%
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%			0.1%
南アフリカランド	株式	49銘柄	95.3%			6.5%
	投資証券	5銘柄			4.7%	0.3%
アラブディルハム	株式	8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28年 6月27日現在	平成28年12月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	7,658,730	227,864,390
国債証券	26,805,844,873	26,060,494,976
地方債証券	2,449,406,932	2,096,129,000
特殊債券	3,162,949,000	3,929,254,000
社債券	2,009,260,590	1,778,059,148
未収入金	73,483,200	-
未収利息	70,003,385	66,309,790
前払費用	1,220,614	303,842
流動資産合計	34,579,827,324	34,158,415,146
資産合計	34,579,827,324	34,158,415,146
負債の部		
流動負債		
未払解約金	39,069,276	4,690,424
未払利息	12	200
流動負債合計	39,069,288	4,690,624
負債合計	39,069,288	4,690,624

平成28年 6月27日現在

平成28年12月26日現在

純資産の部		
元本等		
元本	24,142,587,930	24,649,841,004
剰余金		
剰余金又は欠損金()	10,398,170,106	9,503,883,518
元本等合計	34,540,758,036	34,153,724,522
純資産合計	34,540,758,036	34,153,724,522
負債純資産合計	34,579,827,324	34,158,415,146

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28年 6月27日現在	平成28年12月26日現在
1.	期首	平成27年12月26日	平成28年 6月28日
	期首元本額	25,910,721,706円	24,142,587,930円
	期首からの追加設定元本額	1,077,600,636円	1,459,061,935円
	期首からの一部解約元本額	2,845,734,412円	951,808,861円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス(株式20)	791,969,158円	960,382,030円
	DCインデックスバランス(株式40)	931,403,085円	1,084,918,562円
	DCインデックスバランス(株式60)	627,632,647円	751,715,422円
	DCインデックスバランス(株式80)	107,801,282円	130,320,409円
	インデックスファンド日本債券(DC専用)	1,557,600,732円	1,550,023,813円
	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	4,595,333,210円	4,404,873,502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	4,222,074円	4,610,364円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	4,505,266円	4,709,714円

アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	23,467,085円	26,185,649円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	99,201,199円	102,363,204円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	371,583,055円	366,967,306円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	5,739,135,332円	5,654,833,853円
世界アセットバランスファンド40（適格機関投資家向け）	37,947,798円	38,364,178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）	129,073,874円	120,970,117円
グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	24,745,907円	26,252,279円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	1,086,239,601円	1,149,970,664円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,058,562,162円	1,165,399,044円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	528,562,403円	594,405,630円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	79,274,327円	87,127,009円
インデックスファンド日本債券（1年決算型）	6,133,643,638円	6,197,225,930円
日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	210,684,095円	228,222,325円
計	24,142,587,930円	24,649,841,004円
2. 受益権の総数	24,142,587,930口	24,649,841,004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12月26日 至 平成28年 6月27日	自 平成28年 6月28日 至 平成28年12月26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28年 6月27日現在	平成28年12月26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

(平成28年12月26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	492,890,250
地方債証券	12,615,000
特殊債券	16,199,000
社債券	11,686,791
合計	533,391,041

(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28年 6月27日現在		平成28年12月26日現在	
1口当たり純資産額	1.4307円	1口当たり純資産額	1.3856円
(1万口当たり純資産額)	(14,307円)	(1万口当たり純資産額)	(13,856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）	38,000,000	38,129,250	
	第106回利付国債（5年）	10,000,000	10,034,506	
	第107回利付国債（5年）	705,000,000	708,454,122	
	第109回利付国債（5年）	180,000,000	180,784,800	

第111回利付国債(5年)	40,000,000	40,321,600	
第112回利付国債(5年)	70,000,000	70,642,600	
第114回利付国債(5年)	90,000,000	90,772,200	
第116回利付国債(5年)	110,000,000	110,829,400	
第117回利付国債(5年)	90,000,000	90,743,400	
第118回利付国債(5年)	100,000,000	100,907,000	
第119回利付国債(5年)	74,000,000	74,487,660	
第120回利付国債(5年)	330,000,000	333,161,400	
第121回利付国債(5年)	100,000,000	100,684,000	
第122回利付国債(5年)	300,000,000	302,106,000	
第123回利付国債(5年)	505,000,000	508,676,400	
第124回利付国債(5年)	560,000,000	564,200,000	
第125回利付国債(5年)	325,000,000	327,554,500	
第126回利付国債(5年)	220,000,000	221,799,600	
第1回利付国債(40年)	40,000,000	59,167,600	
第2回利付国債(40年)	165,000,000	236,288,250	
第3回利付国債(40年)	50,000,000	72,061,500	
第4回利付国債(40年)	95,000,000	137,767,100	
第5回利付国債(40年)	35,000,000	48,822,550	
第6回利付国債(40年)	70,000,000	95,936,400	
第7回利付国債(40年)	50,000,000	65,539,000	
第8回利付国債(40年)	75,000,000	91,106,250	
第9回利付国債(40年)	55,000,000	48,359,300	
第289回利付国債(10年)	199,000,000	202,503,546	
第290回利付国債(10年)	226,000,000	230,578,760	
第291回利付国債(10年)	187,000,000	190,560,480	
第292回利付国債(10年)	306,000,000	313,328,700	
第293回利付国債(10年)	56,000,000	57,675,520	
第294回利付国債(10年)	32,000,000	32,910,080	
第295回利付国債(10年)	13,000,000	13,330,200	
第296回利付国債(10年)	14,000,000	14,410,340	
第297回利付国債(10年)	28,000,000	28,875,280	
第298回利付国債(10年)	11,000,000	11,321,970	
第299回利付国債(10年)	410,000,000	423,411,100	
第300回利付国債(10年)	36,000,000	37,338,120	
第301回利付国債(10年)	206,000,000	214,448,060	

第302回利付国債(10年)	94,000,000	97,621,820	
第303回利付国債(10年)	581,000,000	605,587,920	
第304回利付国債(10年)	36,000,000	37,424,880	
第305回利付国債(10年)	473,000,000	493,291,700	
第306回利付国債(10年)	93,000,000	97,575,600	
第308回利付国債(10年)	140,000,000	146,888,000	
第309回利付国債(10年)	134,000,000	139,657,480	
第310回利付国債(10年)	78,000,000	81,226,080	
第311回利付国債(10年)	23,000,000	23,779,010	
第312回利付国債(10年)	205,000,000	215,643,600	
第313回利付国債(10年)	370,000,000	391,892,900	
第315回利付国債(10年)	65,000,000	68,753,100	
第316回利付国債(10年)	35,000,000	36,863,750	
第317回利付国債(10年)	105,000,000	110,907,300	
第318回利付国債(10年)	185,000,000	194,529,350	
第319回利付国債(10年)	5,000,000	5,293,550	
第320回利付国債(10年)	190,000,000	200,204,900	
第321回利付国債(10年)	175,000,000	184,817,500	
第322回利付国債(10年)	75,000,000	78,814,500	
第323回利付国債(10年)	45,000,000	47,386,350	
第324回利付国債(10年)	25,000,000	26,188,500	
第325回利付国債(10年)	210,000,000	220,380,300	
第326回利付国債(10年)	30,000,000	31,358,400	
第327回利付国債(10年)	65,000,000	68,333,200	
第328回利付国債(10年)	115,000,000	119,666,700	
第329回利付国債(10年)	230,000,000	242,622,400	
第330回利付国債(10年)	210,000,000	221,900,700	
第331回利付国債(10年)	80,000,000	83,454,400	
第333回利付国債(10年)	110,000,000	114,809,200	
第334回利付国債(10年)	120,000,000	125,335,200	
第335回利付国債(10年)	130,000,000	134,919,200	
第337回利付国債(10年)	30,000,000	30,681,300	
第338回利付国債(10年)	90,000,000	92,808,000	
第339回利付国債(10年)	300,000,000	309,516,000	
第340回利付国債(10年)	80,000,000	82,612,800	
第341回利付国債(10年)	110,000,000	112,608,100	

第342回利付国債(10年)	100,000,000	100,551,000	
第343回利付国債(10年)	200,000,000	201,132,000	
第14回利付国債(30年)	208,000,000	276,147,040	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	197,909,040	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	47,206,600	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	144,763,300	
第21回利付国債(30年)	20,000,000	26,400,000	
第22回利付国債(30年)	40,000,000	54,268,800	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	74,721,900	
第24回利付国債(30年)	68,000,000	92,504,480	
第25回利付国債(30年)	20,000,000	26,490,800	
第26回利付国債(30年)	100,000,000	134,527,000	
第27回利付国債(30年)	29,000,000	39,781,330	
第28回利付国債(30年)	14,000,000	19,298,580	
第29回利付国債(30年)	276,000,000	376,563,360	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	198,338,280	
第31回利付国債(30年)	120,000,000	160,164,000	
第32回利付国債(30年)	40,000,000	54,471,600	
第33回利付国債(30年)	135,000,000	175,900,950	
第34回利付国債(30年)	160,000,000	216,433,600	
第35回利付国債(30年)	78,000,000	102,285,300	
第36回利付国債(30年)	135,000,000	177,770,700	
第37回利付国債(30年)	46,000,000	59,727,320	
第38回利付国債(30年)	40,000,000	51,108,000	
第39回利付国債(30年)	75,000,000	97,722,000	
第40回利付国債(30年)	90,000,000	115,275,600	
第42回利付国債(30年)	85,000,000	106,880,700	
第43回利付国債(30年)	195,000,000	245,594,700	
第44回利付国債(30年)	70,000,000	88,200,700	
第45回利付国債(30年)	45,000,000	54,441,450	
第46回利付国債(30年)	100,000,000	121,138,000	
第47回利付国債(30年)	115,000,000	142,449,350	
第48回利付国債(30年)	105,000,000	124,818,750	
第49回利付国債(30年)	90,000,000	107,112,600	
第50回利付国債(30年)	25,000,000	25,794,250	
第51回利付国債(30年)	70,000,000	62,927,200	

第5 2 回利付国債(30年)	70,000,000	66,636,500	
第3 4 回利付国債(20年)	2,000,000	2,016,772	
第3 9 回利付国債(20年)	86,000,000	89,010,000	
第4 1 回利付国債(20年)	27,000,000	28,000,620	
第4 2 回利付国債(20年)	168,000,000	178,350,480	
第4 3 回利付国債(20年)	47,000,000	50,920,740	
第4 4 回利付国債(20年)	51,000,000	55,316,130	
第4 7 回利付国債(20年)	21,000,000	22,813,140	
第4 8 回利付国債(20年)	99,000,000	109,265,310	
第4 9 回利付国債(20年)	57,000,000	62,313,540	
第5 0 回利付国債(20年)	237,000,000	257,081,010	
第5 1 回利付国債(20年)	39,000,000	42,656,250	
第5 4 回利付国債(20年)	15,000,000	16,709,250	
第5 5 回利付国債(20年)	66,000,000	73,148,460	
第5 7 回利付国債(20年)	52,000,000	57,631,600	
第5 8 回利付国債(20年)	135,000,000	150,296,850	
第5 9 回利付国債(20年)	33,000,000	36,484,470	
第6 0 回利付国債(20年)	295,000,000	320,839,050	
第6 1 回利付国債(20年)	27,000,000	28,787,940	
第6 3 回利付国債(20年)	31,000,000	34,715,040	
第6 4 回利付国債(20年)	54,000,000	61,068,060	
第6 5 回利付国債(20年)	100,000,000	113,495,000	
第6 6 回利付国債(20年)	34,000,000	38,350,640	
第6 7 回利付国債(20年)	34,000,000	38,695,060	
第6 8 回利付国債(20年)	78,000,000	90,462,840	
第7 0 回利付国債(20年)	104,000,000	122,616,000	
第7 2 回利付国債(20年)	112,000,000	130,076,800	
第7 3 回利付国債(20年)	113,000,000	130,873,210	
第7 4 回利付国債(20年)	118,000,000	137,604,520	
第7 5 回利付国債(20年)	10,000,000	11,707,900	
第7 6 回利付国債(20年)	21,000,000	24,241,560	
第7 7 回利付国債(20年)	40,000,000	46,503,200	
第7 9 回利付国債(20年)	160,000,000	186,729,600	
第8 2 回利付国債(20年)	60,000,000	70,843,200	
第8 7 回利付国債(20年)	130,000,000	155,950,600	
第8 8 回利付国債(20年)	300,000,000	364,179,000	

第90回利付国債(20年)	16,000,000	19,339,840	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	304,605,000	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	72,211,800	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	71,828,400	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	60,365,500	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	101,017,440	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	118,689,760	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	55,177,200	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	114,258,880	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	142,641,720	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	37,013,400	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	82,895,340	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	102,080,250	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	13,738,010	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	40,465,590	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	94,687,670	
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,482,580	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	160,299,100	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	162,068,980	
第109回利付国債(20年)	27,000,000	32,731,020	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	121,158,380	
第111回利付国債(20年)	25,000,000	31,296,000	
第113回利付国債(20年)	290,000,000	360,406,200	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	64,784,720	
第115回利付国債(20年)	55,000,000	69,220,800	
第116回利付国債(20年)	55,000,000	69,395,700	
第117回利付国債(20年)	93,000,000	116,139,330	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	12,378,300	
第119回利付国債(20年)	30,000,000	36,346,500	
第120回利付国債(20年)	70,000,000	82,914,300	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	26,997,300	
第122回利付国債(20年)	17,000,000	20,634,430	
第123回利付国債(20年)	65,000,000	81,682,250	
第124回利付国債(20年)	80,000,000	99,445,600	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	63,655,000	
第126回利付国債(20年)	25,000,000	31,116,250	

	第128回利付国債(20年)	65,000,000	80,095,600	
	第129回利付国債(20年)	50,000,000	60,912,500	
	第130回利付国債(20年)	60,000,000	73,159,200	
	第131回利付国債(20年)	12,000,000	14,461,440	
	第132回利付国債(20年)	35,000,000	42,205,100	
	第133回利付国債(20年)	30,000,000	36,607,500	
	第134回利付国債(20年)	30,000,000	36,658,500	
	第135回利付国債(20年)	30,000,000	36,220,500	
	第136回利付国債(20年)	140,000,000	166,983,600	
	第137回利付国債(20年)	220,000,000	265,944,800	
	第138回利付国債(20年)	90,000,000	106,051,500	
	第140回利付国債(20年)	280,000,000	338,623,600	
	第141回利付国債(20年)	195,000,000	235,905,150	
	第142回利付国債(20年)	55,000,000	67,373,350	
	第143回利付国債(20年)	54,000,000	64,511,640	
	第144回利付国債(20年)	40,000,000	47,134,400	
	第145回利付国債(20年)	125,000,000	151,406,250	
	第146回利付国債(20年)	75,000,000	90,785,250	
	第147回利付国債(20年)	60,000,000	71,674,200	
	第148回利付国債(20年)	120,000,000	141,384,000	
	第149回利付国債(20年)	215,000,000	253,424,800	
	第150回利付国債(20年)	90,000,000	104,553,000	
	第151回利付国債(20年)	150,000,000	168,991,500	
	第152回利付国債(20年)	90,000,000	101,283,300	
	第153回利付国債(20年)	120,000,000	137,048,400	
	第154回利付国債(20年)	120,000,000	134,730,000	
	第155回利付国債(20年)	140,000,000	151,869,200	
	第156回利付国債(20年)	110,000,000	107,131,200	
	第157回利付国債(20年)	50,000,000	46,715,500	
	第158回利付国債(20年)	170,000,000	167,888,600	
国債証券 合計		23,183,000,000	26,060,494,976	
地方債証券	第26回東京都公募公債(20年)	100,000,000	118,658,000	
	第660回東京都公募公債	100,000,000	102,327,000	
	第708回東京都公募公債	100,000,000	104,678,000	
	第731回東京都公募公債	100,000,000	103,914,000	
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	118,066,000	

	平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	209,346,000	
	平成26年度第3回広島県公募公債	100,000,000	103,261,000	
	平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	105,317,000	
	平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	104,640,000	
	平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	103,855,000	
	第10回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	103,983,000	
	第64回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,588,000	
	第162回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,376,000	
	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	104,360,000	
	平成25年度第1回島根県公募公債	200,000,000	200,864,000	
	平成26年度第1回栃木県公募公債	100,000,000	102,862,000	
	平成23年度第2回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	105,034,000	
地方債証券 合計		2,000,000,000	2,096,129,000	
特殊債券	第1回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	104,494,000	
	第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	105,626,000	
	第5回新関西国際空港株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,232,000	
	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,765,000	
	第6回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,567,000	
	第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,692,000	
	第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,696,000	
	第21回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,841,000	
	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,581,000	
	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	104,210,000	
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	120,103,000	
	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	107,204,000	
	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	205,420,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,033,000	
	第135回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,038,000	
	第139回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,951,000	
	第146回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,618,000	
	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	104,909,000	
	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	206,302,000	

	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	99,265,000	
	第1回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	120,333,000	
	第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	102,696,000	
	第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,317,000	
	F290回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,934,000	
	第55回株式会社日本政策金融公庫社債(一般担保付)	200,000,000	199,970,000	
	第44回日本学生支援債券	200,000,000	199,968,000	
	第45回日本学生支援債券	300,000,000	299,946,000	
	第316回信金中金債(5年)	100,000,000	100,061,000	
	第318回信金中金債(5年)	100,000,000	99,929,000	
	第320回信金中金債(5年)	100,000,000	99,791,000	
	第322回信金中金債(5年)	200,000,000	199,762,000	
	特殊債券 合計	3,800,000,000	3,929,254,000	
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	100,422,000	
	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	100,222,148	
	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	99,935,000	
	第63回中日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人日本高速道路保有・債務返済機構重畳的債務引受条項付)	100,000,000	103,191,000	
	第14回森永乳業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,536,000	
	第6回サントリー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	98,369,000	
	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	104,021,000	
	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	100,114,000	
	第28回東レ株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,392,000	
	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	101,234,000	
	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	117,790,000	
	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	113,646,000	

第25回日本郵船株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	116,121,000	
第540回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,861,000	
第299回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,326,000	
第281回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,605,000	
第19回沖縄電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,274,000	
社債券 合計	1,700,000,000	1,778,059,148	
合計	30,683,000,000	33,863,937,124	

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28年 6月27日現在	平成28年12月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	31,923,798	186,021,961
コール・ローン	22,947,339	33,783,569
国債証券	151,133,633,468	158,302,461,966
派生商品評価勘定	2,739,512	1,327,228
未収入金	41,175,360	95,770,740
未収利息	1,440,707,107	1,471,823,369
前払費用	40,233,943	18,907,409
流動資産合計	152,713,360,527	160,110,096,242
資産合計	152,713,360,527	160,110,096,242
負債の部		
流動負債		
未払解約金	48,620,599	207,081,197
未払利息	36	29
流動負債合計	48,620,635	207,081,226
負債合計	48,620,635	207,081,226
純資産の部		
元本等		
元本	75,008,369,772	72,453,501,529

	平成28年 6月27日現在	平成28年12月26日現在
剰余金		
剰余金又は欠損金()	77,656,370,120	87,449,513,487
元本等合計	152,664,739,892	159,903,015,016
純資産合計	152,664,739,892	159,903,015,016
負債純資産合計	152,713,360,527	160,110,096,242

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</p> <p>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成28年 6月27日現在	平成28年12月26日現在
1. 期首	平成27年12月26日	平成28年 6月28日
期首元本額	77,403,768,367円	75,008,369,772円
期首からの追加設定元本額	1,828,615,980円	859,678,400円
期首からの一部解約元本額	4,224,014,575円	3,414,546,643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)	11,039,683,651円	11,171,648,338円
DCインデックスバランス(株式20)	81,721,256円	93,627,064円
DCインデックスバランス(株式40)	138,606,050円	153,737,243円
DCインデックスバランス(株式60)	168,125,385円	192,209,140円
DCインデックスバランス(株式80)	143,999,187円	165,195,842円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	24,154,635,227円	24,114,825,182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	2,914,350,112円	2,931,152,195円
日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	27,687,246,381円	25,452,705,460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	25,666,344円	27,026,652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)	975,270,199円	997,560,718円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	186,389,835円	211,871,597円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	2,944,409円	3,013,401円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	3,142,643円	3,291,686円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	7,119,538円	7,132,611円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	18,963,067円	18,138,890円
世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	546,260,511円	198,007,005円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	1,222,259,589円	1,231,281,227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)	34,127,450円	34,894,181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)	94,759,044円	89,791,496円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	37,279,521円	37,129,664円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	54,477,547円	55,549,827円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	78,753,254円	83,144,046円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	70,779,740円	76,765,177円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	53,080,737円	57,932,579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	5,026,362,624円	4,802,231,315円
海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	242,366,471円	243,638,993円
計	75,008,369,772円	72,453,501,529円
2. 受益権の総数	75,008,369,772口	72,453,501,529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12月26日 至 平成28年 6月27日	自 平成28年 6月28日 至 平成28年12月26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28年 6月27日現在	平成28年12月26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

(平成28年12月26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	5,323,734,313
合計	5,323,734,313

(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				
	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

(平成28年12月26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	250,267,458	-	248,940,230	1,327,228
	米ドル	128,407,456	-	127,535,800	871,656
	ユーロ	101,878,818	-	101,662,080	216,738
	英ポンド	11,203,854	-	11,077,990	125,864

	豪ドル	8,777,330	-	8,664,360	112,970
	合計	250,267,458	-	248,940,230	1,327,228

(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28年 6月27日現在		平成28年12月26日現在	
1口当たり純資産額	2.0353円	1口当たり純資産額	2.2070円
(1万口当たり純資産額)	(20,353円)	(1万口当たり純資産額)	(22,070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-0.625%-17/11/30	3,000,000.00	2,992,560.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-17/11/30	3,500,000.00	3,543,134.00	
		US TREASURY N/B-1.0%-17/12/15	5,200,000.00	5,205,990.40	

US TREASURY N/B-2.75%-17/12/31	6,170,000.00	6,281,831.25	
US TREASURY N/B-2.625%-18/01/31	4,000,000.00	4,070,936.00	
US TREASURY N/B-0.875%-18/01/31	1,200,000.00	1,199,062.80	
US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	7,950,000.00	8,170,644.30	
US TREASURY N/B-2.75%-18/02/28	7,400,000.00	7,547,274.80	
US TREASURY N/B-0.75%-18/02/28	5,100,000.00	5,084,960.10	
US TREASURY N/B-1.0%-18/03/15	1,000,000.00	999,883.00	
US TREASURY N/B-0.75%-18/03/31	3,000,000.00	2,989,806.00	
US TREASURY N/B-2.875%-18/03/31	2,500,000.00	2,557,130.00	
US TREASURY N/B-0.625%-18/04/30	3,000,000.00	2,982,363.00	
US TREASURY N/B-0.75%-18/04/30	3,000,000.00	2,987,931.00	
US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	7,550,000.00	7,844,185.75	
US TREASURY N/B-1.0%-18/05/31	5,520,000.00	5,512,884.72	
US TREASURY N/B-2.375%-18/06/30	7,000,000.00	7,128,926.00	
US TREASURY N/B-2.25%-18/07/31	8,340,000.00	8,487,417.84	
US TREASURY N/B-1.375%-18/07/31	2,500,000.00	2,509,375.00	
US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	8,850,000.00	9,265,020.75	
US TREASURY N/B-1.375%-18/09/30	970,000.00	973,069.08	
US TREASURY N/B-1.75%-18/10/31	3,000,000.00	3,030,351.00	
US TREASURY N/B-1.25%-18/10/31	3,000,000.00	3,002,694.00	
US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	9,100,000.00	9,531,185.30	
US TREASURY N/B-1.25%-18/11/30	3,100,000.00	3,100,604.50	
US TREASURY N/B-1.5%-18/12/31	8,830,000.00	8,872,428.15	
US TREASURY N/B-1.125%-19/01/15	500,000.00	498,398.50	
US TREASURY N/B-1.5%-19/01/31	3,000,000.00	3,012,948.00	
US TREASURY N/B-1.25%-19/01/31	200,000.00	199,843.80	
US TREASURY N/B-8.875%-19/02/15	4,550,000.00	5,287,773.40	
US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	5,100,000.00	5,257,085.10	
US TREASURY N/B-1.375%-19/02/28	3,000,000.00	3,004,686.00	
US TREASURY N/B-1.5%-19/02/28	4,000,000.00	4,016,484.00	
US TREASURY N/B-1.0%-19/03/15	500,000.00	496,650.50	
US TREASURY N/B-1.625%-19/03/31	2,000,000.00	2,013,320.00	
US TREASURY N/B-0.875%-19/04/15	1,200,000.00	1,187,508.00	
US TREASURY N/B-1.625%-19/04/30	3,900,000.00	3,922,928.10	
US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	4,000,000.00	4,164,844.00	

US TREASURY N/B-0.875%-19/05/15	3,000,000.00	2,966,310.00	
US TREASURY N/B-1.5%-19/05/31	4,100,000.00	4,112,332.80	
US TREASURY N/B-1.625%-19/06/30	1,090,000.00	1,096,046.23	
US TREASURY N/B-1.625%-19/07/31	3,000,000.00	3,015,234.00	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	4,320,000.00	4,565,445.12	
US TREASURY N/B-8.125%-19/08/15	3,210,000.00	3,764,540.34	
US TREASURY N/B-1.0%-19/08/31	3,300,000.00	3,263,198.40	
US TREASURY N/B-1.625%-19/08/31	3,600,000.00	3,617,366.40	
US TREASURY N/B-1.75%-19/09/30	7,650,000.00	7,708,568.40	
US TREASURY N/B-1.5%-19/10/31	4,100,000.00	4,099,200.50	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	10,780,000.00	11,349,313.36	
US TREASURY N/B-1.625%-19/12/31	1,800,000.00	1,804,570.20	
US TREASURY N/B-1.25%-20/01/31	4,000,000.00	3,960,392.00	
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	10,270,000.00	10,910,673.41	
US TREASURY N/B-1.375%-20/03/31	1,100,000.00	1,090,933.80	
US TREASURY N/B-1.375%-20/04/30	1,930,000.00	1,912,132.06	
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	8,030,000.00	8,508,973.44	
US TREASURY N/B-1.375%-20/05/31	2,440,000.00	2,416,075.80	
US TREASURY N/B-1.5%-20/05/31	5,100,000.00	5,066,732.70	
US TREASURY N/B-1.875%-20/06/30	380,000.00	382,389.82	
US TREASURY N/B-1.625%-20/06/30	4,000,000.00	3,987,108.00	
US TREASURY N/B-2.0%-20/07/31	5,770,000.00	5,825,109.27	
US TREASURY N/B-1.625%-20/07/31	4,000,000.00	3,983,828.00	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	6,860,000.00	8,552,492.34	
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	5,000,000.00	5,151,170.00	
US TREASURY N/B-2.125%-20/08/31	1,450,000.00	1,468,493.30	
US TREASURY N/B-1.375%-20/08/31	2,300,000.00	2,267,432.00	
US TREASURY N/B-1.375%-20/09/30	3,800,000.00	3,743,224.20	
US TREASURY N/B-1.75%-20/10/31	2,000,000.00	1,996,602.00	
US TREASURY N/B-1.375%-20/10/31	1,060,000.00	1,042,568.30	
US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	3,500,000.00	3,604,520.50	
US TREASURY N/B-1.625%-20/11/30	1,120,000.00	1,110,746.56	
US TREASURY N/B-2.375%-20/12/31	3,000,000.00	3,061,113.00	
US TREASURY N/B-1.75%-20/12/31	2,000,000.00	1,990,976.00	
US TREASURY N/B-1.375%-21/01/31	2,000,000.00	1,958,946.00	

US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	8,550,000.00	9,142,822.80	
US TREASURY N/B-1.125%-21/02/28	2,000,000.00	1,936,758.00	
US TREASURY N/B-2.25%-21/03/31	340,000.00	344,675.00	
US TREASURY N/B-1.25%-21/03/31	1,270,000.00	1,234,405.71	
US TREASURY N/B-2.25%-21/04/30	4,800,000.00	4,861,219.20	
US TREASURY N/B-1.375%-21/04/30	2,000,000.00	1,951,836.00	
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	5,170,000.00	5,423,650.54	
US TREASURY N/B-1.375%-21/05/31	2,060,000.00	2,008,862.56	
US TREASURY N/B-2.125%-21/06/30	6,400,000.00	6,437,248.00	
US TREASURY N/B-2.25%-21/07/31	3,000,000.00	3,030,819.00	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	3,900,000.00	3,916,528.20	
US TREASURY N/B-1.125%-21/08/31	4,400,000.00	4,227,696.00	
US TREASURY N/B-2.125%-21/09/30	2,400,000.00	2,409,093.60	
US TREASURY N/B-1.25%-21/10/31	2,000,000.00	1,929,376.00	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	11,490,000.00	14,659,171.80	
US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	4,000,000.00	3,989,220.00	
US TREASURY N/B-2.125%-21/12/31	4,800,000.00	4,814,625.60	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,500,000.00	2,488,232.50	
US TREASURY N/B-1.75%-22/02/28	2,900,000.00	2,847,889.90	
US TREASURY N/B-1.75%-22/03/31	1,800,000.00	1,765,899.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/04/30	3,000,000.00	2,939,766.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	2,000,000.00	1,959,844.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/05/31	2,000,000.00	1,971,876.00	
US TREASURY N/B-2.125%-22/06/30	2,500,000.00	2,494,140.00	
US TREASURY N/B-2.0%-22/07/31	5,100,000.00	5,050,392.30	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	2,000,000.00	1,939,726.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/08/31	1,900,000.00	1,867,046.40	
US TREASURY N/B-1.75%-22/09/30	4,000,000.00	3,900,156.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	3,000,000.00	2,942,109.00	
US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	1,000,000.00	967,148.00	
US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	1,000,000.00	987,148.00	
US TREASURY N/B-2.125%-22/12/31	4,000,000.00	3,972,656.00	
US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	2,000,000.00	1,941,876.00	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	9,300,000.00	9,160,862.70	
US TREASURY N/B-1.5%-23/02/28	1,000,000.00	955,312.00	

US TREASURY N/B-1.625%-23/04/30	660,000.00	633,935.28	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	8,150,000.00	7,883,535.75	
US TREASURY N/B-1.625%-23/05/31	1,500,000.00	1,438,506.00	
US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	4,000,000.00	3,772,500.00	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,500,000.00	5,559,834.50	
US TREASURY N/B-1.375%-23/08/31	1,850,000.00	1,739,434.75	
US TREASURY N/B-1.625%-23/10/31	1,700,000.00	1,623,534.00	
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	4,103,828.00	
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	2,900,000.00	2,973,802.10	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	5,800,000.00	5,842,479.20	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,605,021.96	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	5,930,000.00	5,845,106.12	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	3,850,000.00	3,716,755.35	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	4,667,438.40	
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	3,920,000.00	3,765,112.96	
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	5,940,000.00	5,813,080.02	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	2,311,524.00	
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,070,000.00	2,842,807.72	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	3,100,000.00	2,863,442.10	
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,643,284.00	
US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,450,000.00	3,296,303.50	
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	1,950,000.00	1,858,936.95	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	2,920,000.00	3,887,991.68	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,000,000.00	1,262,129.00	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	2,480,000.00	3,475,826.64	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	2,810,000.00	3,706,510.83	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	1,900,000.00	2,526,369.20	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	1,170,000.00	1,439,557.47	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	1,800,000.00	2,251,616.40	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	2,300,000.00	2,764,850.70	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,820,000.00	2,262,558.48	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	1,750,000.00	2,138,486.00	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	2,710,000.00	3,430,003.64	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	2,290,000.00	2,800,642.52	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	2,240,000.00	2,546,205.76	

		US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	2,500,000.00	3,004,540.00	
		US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,600,000.00	2,064,968.00	
		US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	2,200,000.00	2,695,816.20	
		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	3,500,000.00	3,903,732.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	500,000.00	466,816.50	
		US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	2,003,906.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	5,800,000.00	5,537,526.80	
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	5,350,000.00	5,867,756.95	
		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	4,500,000.00	5,047,735.50	
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	3,000,000.00	3,289,395.00	
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	3,400,000.00	3,565,617.40	
		US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	5,900,000.00	5,904,147.70	
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	3,300,000.00	3,222,139.80	
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	2,907,029.40	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	3,200,000.00	3,122,873.60	
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	5,300,000.00	5,043,278.60	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	3,900,000.00	3,803,716.80	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	2,800,000.00	2,460,172.40	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	2,500,000.00	2,196,582.50	
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	1,786,265.15	
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	1,000,000.00	954,492.00	
米ドル小計			582,750,000.00	600,900,423.48 (70,317,367,555)	
加ドル	国債証券	CANADA GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	371,645.65	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/02/01	1,480,000.00	1,489,501.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/03/01	1,290,000.00	1,298,655.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-18/05/01	1,480,000.00	1,470,646.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	1,300,000.00	1,364,467.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-18/08/01	1,350,000.00	1,344,006.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/09/01	650,000.00	655,050.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-18/11/01	1,230,000.00	1,223,481.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-19/02/01	200,000.00	198,684.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/03/01	1,050,000.00	1,070,958.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	1,900,000.00	2,032,126.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/09/01	1,050,000.00	1,073,982.00	

		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-20/03/01	1,170,000.00	1,188,848.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	1,430,000.00	1,548,761.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-20/09/01	1,150,000.00	1,136,487.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/03/01	1,210,000.00	1,189,998.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	1,150,000.00	1,252,189.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/09/01	1,340,000.00	1,312,530.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-22/03/01	540,000.00	518,783.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	1,200,000.00	1,287,996.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,380,000.00	1,381,752.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,320,000.00	1,403,067.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	1,190,000.00	1,240,420.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	1,100,000.00	1,072,005.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	370,000.00	582,783.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	100,000.00	91,442.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	990,000.00	1,387,029.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	1,140,000.00	1,681,283.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	1,230,000.00	1,749,675.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	1,440,000.00	1,857,542.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,540,000.00	1,885,884.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	870,000.00	940,557.00	
			35,175,000.00	38,302,241.05	
				(3,318,506,164)	
加ドル小計					
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 17/12/14	12,600,000.00	12,782,611.80	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-4.75%- 18/06/14	18,000,000.00	17,548,020.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-18/12/13	23,900,000.00	24,660,311.58	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11	8,100,000.00	7,707,150.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	19,900,000.00	20,541,377.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	23,800,000.00	23,264,500.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	8,500,000.00	8,243,554.57	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	8,200,000.00	8,534,724.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	25,500,000.00	29,545,034.40	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	2,450,000.00	2,178,552.12	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	6,700,000.00	6,697,302.58	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	13,700,000.00	14,711,745.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	11,900,000.00	11,972,114.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-34/11/23	5,800,000.00	5,793,040.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	7,800,000.00	9,543,803.88	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	12,100,000.00	12,953,376.70	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	12,440,000.00	12,384,189.18	
メキシコペソ小計			221,390,000.00	229,061,406.81	(1,303,359,404)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.0%-18/03/28	1,480,000.00	1,568,259.80	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-18/06/22	520,000.00	535,292.68	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	1,280,000.00	1,416,183.04	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-19/09/28	960,000.00	1,056,612.48	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	1,860,000.00	2,163,645.00	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	1,590,000.00	1,945,070.85	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	1,280,000.00	1,573,703.68	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,500,000.00	1,888,206.00	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	1,170,000.00	1,348,648.47	
		BELGIUM KINGDOM-0.2%-23/10/22	210,000.00	212,292.78	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	1,300,000.00	1,533,911.60	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,260,000.00	1,303,657.74	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	1,140,000.00	1,562,798.64	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	810,000.00	843,013.17	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,810,000.00	2,766,831.16	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	750,000.00	751,226.25	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	810,000.00	1,158,636.96	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	590,000.00	770,719.36	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,800,000.00	2,982,333.60	
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	590,000.00	664,461.54	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,520,000.00	2,456,548.00	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	875,000.00	1,347,162.25	
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	430,000.00	435,856.60	
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	280,000.00	307,697.60	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.5%- 18/01/31	1,900,000.00	1,999,123.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%- 18/04/30	1,030,000.00	1,037,226.48	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%- 18/07/30	2,440,000.00	2,608,589.36	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.75%- 18/10/31	1,690,000.00	1,815,369.27	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%- 19/01/31	1,060,000.00	1,069,337.54	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 19/04/30	1,860,000.00	1,986,790.62	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%- 19/07/30	2,040,000.00	2,287,992.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%- 19/10/31	2,200,000.00	2,471,194.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 20/01/31	1,480,000.00	1,543,853.12	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%- 20/04/30	2,430,000.00	2,750,881.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.15%- 20/07/30	1,180,000.00	1,226,453.06	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%- 20/10/31	1,890,000.00	2,232,093.78	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	2,360,000.00	2,899,342.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.75%- 21/07/30	1,160,000.00	1,186,474.68	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	2,060,000.00	2,627,138.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%- 23/01/31	2,040,000.00	2,620,176.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	1,690,000.00	2,094,021.54	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	1,510,000.00	1,917,247.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	1,980,000.00	2,375,615.88	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	2,200,000.00	2,476,540.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	1,860,000.00	1,924,716.84	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,850,000.00	2,367,108.30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	1,880,000.00	2,019,821.24
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 26/04/30	1,800,000.00	1,899,901.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,620,000.00	2,281,446.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%- 26/10/31	930,000.00	924,839.43
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,220,000.00	1,688,963.12
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	2,010,000.00	2,982,234.99
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,600,000.00	1,637,440.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,760,000.00	2,685,136.96
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,630,000.00	2,165,944.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,370,000.00	2,003,148.24
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,340,000.00	1,918,602.62
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	1,060,000.00	1,614,062.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%- 46/10/31	820,000.00	877,024.44
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%- 66/07/30	360,000.00	402,103.80
BUNDESobligation-0.5%-18/02/23	1,850,000.00	1,878,377.15
BUNDESobligation-0.25%-18/04/13	1,170,000.00	1,186,484.13
BUNDESobligation-1.0%-18/10/12	1,880,000.00	1,941,694.08
BUNDESobligation-1.0%-19/02/22	1,320,000.00	1,372,109.64
BUNDESobligation-0.25%-20/10/16	1,000,000.00	1,034,931.00
BUNDESobligation-0.0%-21/04/09	1,200,000.00	1,230,937.20
BUNDESobligation-0.0%-21/10/08	740,000.00	758,607.30
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 18/01/04	3,600,000.00	3,779,906.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 18/07/04	2,750,000.00	2,963,138.75

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 19/01/04	2,550,000.00	2,787,529.95
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%- 19/07/04	3,770,000.00	4,182,886.63
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 20/01/04	3,220,000.00	3,614,137.66
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%- 20/07/04	2,720,000.00	3,078,226.72
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 20/09/04	2,150,000.00	2,386,521.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 21/01/04	1,800,000.00	2,031,170.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	1,730,000.00	2,035,562.98
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 21/09/04	1,580,000.00	1,791,302.88
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	2,000,000.00	2,251,088.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 22/07/04	2,470,000.00	2,766,632.18
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	1,600,000.00	1,772,593.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	1,900,000.00	2,112,699.30
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	1,820,000.00	2,029,032.46
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	1,780,000.00	2,048,507.66
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	1,650,000.00	2,397,210.75
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	2,280,000.00	2,593,458.96
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	1,400,000.00	1,568,488.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	1,830,000.00	1,982,413.38
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	1,370,000.00	1,429,926.54
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	2,340,000.00	2,533,312.08
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	1,590,000.00	1,642,470.00

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 26/08/15	90,000.00	88,078.77
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,050,000.00	1,731,231.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,300,000.00	2,050,054.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	1,060,000.00	1,586,812.58
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	830,000.00	1,445,187.70
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,670,000.00	2,809,522.83
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,840,000.00	3,106,483.04
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	2,090,000.00	3,373,644.56
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,240,000.00	2,131,378.96
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,480,000.00	2,736,910.72
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	1,390,000.00	2,152,490.06
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,850,000.00	2,575,838.25
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	1,770,000.00	2,494,252.14
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-18/03/16	1,000,000.00	1,010,079.00
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-18/06/15	1,000,000.00	1,011,929.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.75%- 18/01/15	850,000.00	858,776.25
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/02/01	2,510,000.00	2,639,194.72
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%- 18/05/15	950,000.00	955,394.10
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/06/01	1,370,000.00	1,442,075.70
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/08/01	2,880,000.00	3,095,107.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.3%- 18/10/15	700,000.00	705,584.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/12/01	2,150,000.00	2,301,340.65

BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/02/01	2,660,000.00	2,902,695.74
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 19/03/01	2,520,000.00	2,770,674.48
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.1%- 19/04/15	1,000,000.00	1,003,862.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 19/05/01	1,400,000.00	1,483,042.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 19/08/01	730,000.00	758,053.90
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/09/01	3,010,000.00	3,349,449.74
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.05%- 19/12/01	1,100,000.00	1,131,935.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 20/02/01	2,640,000.00	2,996,598.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 20/03/01	2,820,000.00	3,185,065.92
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.7%- 20/05/01	750,000.00	763,770.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	2,850,000.00	3,244,725.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 20/11/01	700,000.00	711,158.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	2,100,000.00	2,394,583.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/05/01	1,200,000.00	1,368,326.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%- 21/06/01	100,000.00	99,982.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	3,670,000.00	4,210,675.41
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 21/09/01	3,350,000.00	4,000,268.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 21/12/15	680,000.00	730,776.96
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	2,250,000.00	2,736,540.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 22/04/15	770,000.00	792,484.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,900,000.00	2,390,295.00

BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 22/09/15	900,000.00	929,713.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	2,000,000.00	2,518,068.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/15	560,000.00	558,067.44
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	950,000.00	1,149,777.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,700,000.00	2,099,870.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 23/10/15	380,000.00	367,230.48
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	3,000,000.00	4,543,158.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,650,000.00	2,012,835.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,500,000.00	1,754,449.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,300,000.00	1,402,252.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	3,300,000.00	4,189,680.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	530,000.00	527,643.62
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	2,060,000.00	2,116,032.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,030,000.00	1,271,343.42
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	740,000.00	731,877.76
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	1,880,000.00	2,821,611.16
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	710,000.00	674,452.43
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	3,530,000.00	5,117,970.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	850,000.00	1,093,151.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	3,680,000.00	4,989,178.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	940,000.00	1,090,686.70

BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	3,290,000.00	4,840,083.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,540,000.00	1,450,134.84	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,900,000.00	2,770,861.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	2,080,000.00	2,856,686.56	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	400,000.00	392,236.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	2,710,000.00	3,349,405.53	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,770,000.00	2,473,090.02	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	2,280,000.00	3,171,293.04	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,660,000.00	2,264,181.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,240,000.00	1,340,452.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	1,000,000.00	970,988.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 67/03/01	310,000.00	281,250.91	
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-18/09/15	210,000.00	216,615.00	
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	580,000.00	653,941.88	
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	740,000.00	837,253.76	
FINNISH GOVERNMENT-0.375%-20/09/15	300,000.00	309,925.20	
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	740,000.00	866,591.06	
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	300,000.00	332,409.60	
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	550,000.00	606,239.70	
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-23/09/15	160,000.00	160,249.12	
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	550,000.00	628,463.00	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	590,000.00	780,863.82	
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	330,000.00	347,256.03	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	410,000.00	414,813.81	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	440,000.00	550,071.72	
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	385,000.00	384,936.47	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	410,000.00	560,350.28	

FRANCE (GOVT OF) -4.0%-18/04/25	3,850,000.00	4,093,420.10	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-18/05/25	3,000,000.00	3,072,798.00	
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-18/10/25	2,300,000.00	2,509,461.00	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-18/11/25	1,200,000.00	1,238,559.60	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-19/02/25	570,000.00	578,188.62	
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-19/04/25	4,140,000.00	4,615,280.28	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-19/05/25	1,470,000.00	1,529,020.50	
FRANCE (GOVT OF) -8.5%-19/10/25	1,050,000.00	1,322,808.90	
FRANCE (GOVT OF) -3.75%-19/10/25	4,300,000.00	4,831,243.50	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-19/11/25	1,650,000.00	1,701,999.75	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-20/04/25	3,180,000.00	3,606,546.12	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-20/05/25	1,600,000.00	1,626,291.20	
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-20/10/25	3,900,000.00	4,340,372.40	
FRANCE (GOVT OF) -0.25%-20/11/25	2,550,000.00	2,615,047.95	
FRANCE (GOVT OF) -3.75%-21/04/25	3,900,000.00	4,597,569.60	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-21/10/25	3,920,000.00	4,586,603.84	
FRANCE (GOVT OF) -3.0%-22/04/25	3,770,000.00	4,407,130.00	
FRANCE (GOVT OF) -2.25%-22/10/25	2,950,000.00	3,349,214.65	
FRANCE (GOVT OF) -8.5%-23/04/25	1,090,000.00	1,677,860.98	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-23/05/25	3,230,000.00	3,584,828.42	
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-23/10/25	3,900,000.00	5,010,232.50	
FRANCE (GOVT OF) -2.25%-24/05/25	3,290,000.00	3,788,096.13	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-24/11/25	3,150,000.00	3,511,194.75	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-25/05/25	3,010,000.00	3,031,714.14	
FRANCE (GOVT OF) -6.0%-25/10/25	2,730,000.00	4,054,759.80	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-25/11/25	3,635,000.00	3,783,715.12	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-26/04/25	3,320,000.00	4,202,243.52	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-26/05/25	1,180,000.00	1,166,444.16	
FRANCE (GOVT OF) -0.25%-26/11/25	750,000.00	717,627.00	
FRANCE (GOVT OF) -2.75%-27/10/25	3,380,000.00	4,072,778.32	
FRANCE (GOVT OF) -5.5%-29/04/25	3,140,000.00	4,853,011.30	
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-30/05/25	2,220,000.00	2,649,303.60	
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-31/05/25	1,620,000.00	1,717,507.80	
FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	2,820,000.00	4,744,029.60	
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	2,470,000.00	3,919,568.90	

FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	780,000.00	772,122.00	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	2,380,000.00	3,582,019.00	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	2,660,000.00	4,330,107.60	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	1,990,000.00	2,762,028.46	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	1,370,000.00	2,288,790.50	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	1,160,000.00	1,989,270.08	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-66/05/25	320,000.00	315,510.40	
IRISH TREASURY-4.5%-18/10/18	820,000.00	895,558.90	
IRISH TREASURY-4.4%-19/06/18	700,000.00	786,648.10	
IRISH TREASURY-5.9%-19/10/18	620,000.00	733,084.28	
IRISH TREASURY-4.5%-20/04/18	1,010,000.00	1,176,383.36	
IRISH TREASURY-5.0%-20/10/18	750,000.00	906,529.50	
IRISH TREASURY-0.8%-22/03/15	480,000.00	502,230.72	
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	510,000.00	629,754.12	
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	680,000.00	824,391.20	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	1,010,000.00	1,397,388.53	
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	620,000.00	631,722.34	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	740,000.00	851,992.34	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	575,000.00	615,385.12	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-18/01/15	940,000.00	960,099.08	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-18/04/15	990,000.00	999,710.91	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	2,080,000.00	2,234,435.84	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-19/01/15	1,050,000.00	1,093,325.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	1,780,000.00	1,997,281.04	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-20/01/15	1,340,000.00	1,379,551.44	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	1,530,000.00	1,758,624.84	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	1,590,000.00	1,866,119.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-22/01/15	700,000.00	712,468.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	1,500,000.00	1,715,944.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	580,000.00	722,334.32	
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	970,000.00	1,429,433.71	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	950,000.00	1,068,395.65	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	940,000.00	1,078,195.04	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	760,000.00	762,001.08	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	590,000.00	597,458.19	

		NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	1,360,000.00	2,101,077.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	1,250,000.00	1,595,616.25	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,400,000.00	2,239,503.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,560,000.00	2,561,871.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,030,000.00	1,494,921.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	1,110,000.00	1,173,196.74	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.15%-18/10/19	660,000.00	682,449.24	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	1,260,000.00	1,401,009.12	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.95%-19/06/18	530,000.00	564,937.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-19/10/18	610,000.00	625,640.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	1,290,000.00	1,493,226.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	1,490,000.00	1,762,819.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	840,000.00	1,015,165.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	940,000.00	1,138,889.90	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/07/15	130,000.00	130,248.17	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	890,000.00	1,001,703.01	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	890,000.00	995,649.23	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	730,000.00	788,122.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	750,000.00	1,062,239.25	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	440,000.00	452,337.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	800,000.00	1,284,054.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	500,000.00	620,825.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,140,000.00	1,798,543.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	650,000.00	951,042.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	240,000.00	253,362.24	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	360,000.00	653,788.08	
	ユーロ小計		428,070,000.00	516,803,111.25 (63,148,172,163)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-5.0%-18/03/07	1,630,000.00	1,725,746.20	
		UK TREASURY-1.25%-18/07/22	2,930,000.00	2,984,673.80	
		UK TREASURY-4.5%-19/03/07	1,990,000.00	2,184,651.85	
		UK TREASURY-1.75%-19/07/22	1,880,000.00	1,958,350.88	
		UK TREASURY-3.75%-19/09/07	1,590,000.00	1,745,899.50	
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	2,090,000.00	2,390,416.60	
		UK TREASURY-2.0%-20/07/22	1,870,000.00	1,977,942.01	

		UK TREASURY-3.75%-20/09/07	1,820,000.00	2,048,246.20	
		UK TREASURY-1.5%-21/01/22	2,580,000.00	2,686,123.14	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	1,020,000.00	1,358,217.72	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	1,580,000.00	1,814,566.80	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	1,520,000.00	1,782,221.28	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	2,130,000.00	2,248,129.80	
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	1,930,000.00	2,100,897.64	
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	1,570,000.00	1,767,506.00	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	2,110,000.00	2,755,027.00	
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	730,000.00	740,351.40	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	1,250,000.00	1,605,990.00	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	1,000,000.00	1,496,668.00	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,550,000.00	2,154,128.00	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,860,000.00	2,496,449.22	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	2,100,000.00	2,953,713.00	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,670,000.00	2,310,383.21	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,600,000.00	2,418,160.00	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,460,000.00	2,081,215.40	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	1,660,000.00	2,393,700.08	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	2,680,000.00	4,083,784.00	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,380,000.00	1,752,144.60	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,740,000.00	2,314,287.00	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,560,000.00	2,375,334.00	
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	90,000.00	81,673.74	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	1,340,000.00	2,118,935.30	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,530,000.00	2,291,328.00	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,650,000.00	2,787,625.50	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,400,000.00	2,344,553.40	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	1,690,000.00	2,677,720.50	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	1,180,000.00	1,257,856.40	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	970,000.00	1,200,540.87	
英債券小計			62,330,000.00	79,465,158.04	(11,433,446,938)
スイス ラン	国債証券	SWITZERLAND-3.0%-18/01/08	435,000.00	453,219.54	
		SWITZERLAND-3.0%-19/05/12	400,000.00	437,971.60	

		SWITZERLAND-2.25%-20/07/06	400,000.00	443,580.40	
		SWITZERLAND-2.0%-21/04/28	220,000.00	246,162.40	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	1,110,000.00	1,418,803.11	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	230,000.00	335,695.12	
スイスフラン小計			2,795,000.00	3,335,432.17	(380,372,684)
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	8,900,000.00	9,867,510.10	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	8,700,000.00	10,545,000.30	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	8,500,000.00	10,154,763.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	7,020,000.00	7,652,502.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	6,000,000.00	7,044,234.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	4,950,000.00	5,132,046.15	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	4,480,000.00	6,066,247.04	
スウェーデンクローナ小計			48,550,000.00	56,462,302.59	(714,248,127)
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	6,980,000.00	7,602,064.58	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	6,900,000.00	7,685,033.70	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	4,900,000.00	5,082,760.20	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	4,190,000.00	4,621,486.20	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	3,470,000.00	3,512,389.52	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	3,110,000.00	3,067,290.37	
ノルウェークローネ小計			29,550,000.00	31,571,024.57	(423,998,859)
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-0.25%-18/11/15	4,040,000.00	4,105,488.40	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	8,790,000.00	9,943,933.62	
		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	7,570,000.00	8,793,546.67	
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	7,200,000.00	7,927,142.40	
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	2,900,000.00	4,472,655.50	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	6,740,000.00	7,575,038.82	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	11,370,000.00	19,734,567.90	
デンマーククローネ小計			48,610,000.00	62,552,373.31	(1,028,361,017)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-18/04/25	1,800,000.00	1,846,080.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-18/07/25	2,480,000.00	2,504,800.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-18/10/25	1,810,000.00	1,747,374.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-19/07/25	2,190,000.00	2,248,473.00	

		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	1,700,000.00	1,850,195.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.5%-20/04/25	2,570,000.00	2,498,554.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	1,980,000.00	2,177,406.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25	2,410,000.00	2,350,177.77	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-21/07/25	2,330,000.00	2,236,800.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	1,610,000.00	1,830,248.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-22/04/25	300,000.00	291,090.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	2,220,000.00	2,544,675.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	2,470,000.00	2,604,738.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,580,000.00	2,564,262.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	3,210,000.00	2,970,534.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	500,000.00	456,800.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	830,000.00	1,011,587.40	
		ポーランドズロチ小計	32,990,000.00	33,733,794.67 (935,775,464)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-18/01/21	1,870,000.00	1,942,855.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-18/10/21	1,620,000.00	1,658,651.58	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	2,140,000.00	2,289,949.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-19/10/21	2,030,000.00	2,069,010.51	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	2,340,000.00	2,516,824.44	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-20/11/21	1,830,000.00	1,798,855.23	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	2,510,000.00	2,874,065.46	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	2,050,000.00	2,403,192.45	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	2,070,000.00	2,427,205.41	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	2,250,000.00	2,261,857.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	2,390,000.00	2,474,209.26	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	2,760,000.00	3,082,751.64	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	2,430,000.00	2,834,971.65	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	1,410,000.00	1,385,076.84	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	1,020,000.00	947,305.62	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,210,000.00	1,230,180.38	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,050,000.00	1,202,530.35	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	470,000.00	420,451.66	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	870,000.00	887,645.34	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	450,000.00	418,242.15	

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	750,000.00	630,960.75	
豪ドル小計			35,520,000.00	37,756,793.22	(3,176,856,581)
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-18/04/01	640,000.00	634,112.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	560,000.00	585,088.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01	640,000.00	655,360.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-19/10/01	350,000.00	350,805.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-20/07/01	220,000.00	222,376.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	430,000.00	453,521.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	640,000.00	650,560.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-21/10/01	170,000.00	165,218.75	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	580,000.00	611,726.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	250,000.00	257,500.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	563,490.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	200,000.00	199,400.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	200,000.00	195,135.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	490,000.00	533,855.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	230,000.00	235,750.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	330,000.00	337,131.30	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	270,000.00	293,490.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	445,000.00	448,560.00	
SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	200,000.00	202,210.00			
シンガポールドル小計			7,385,000.00	7,595,288.05	(614,610,709)
マレーシアリンギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.759%-19/03/15	100,000.00	100,522.20	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.659%-20/10/15	1,010,000.00	1,008,649.63	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	460,000.00	461,300.42	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.62%-21/11/30	850,000.00	846,570.25	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	380,000.00	373,663.88	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	300,000.00	294,458.70	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	880,000.00	856,375.52	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	450,000.00	437,877.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	600,000.00	568,651.80	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	590,000.00	586,252.91	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	550,000.00	553,093.75	

		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	1,820,000.00	1,831,160.24	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.26%-18/03/01	820,000.00	818,709.32	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.58%-18/09/28	700,000.00	699,217.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	1,220,000.00	1,284,029.26	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	3,130,000.00	3,193,582.82	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.492%-20/03/31	350,000.00	348,023.90	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.889%-20/07/31	500,000.00	503,494.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	2,300,000.00	2,336,763.20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	650,000.00	628,100.85	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,750,000.00	1,670,914.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	927,502.70	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,270,000.00	1,265,975.37	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	432,000.90	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	650,000.00	599,269.45	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	430,000.00	400,220.78	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000.00	794,283.75	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	1,210,000.00	1,166,504.13	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	600,000.00	572,006.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	450,000.00	417,966.75	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	600,000.00	532,609.20	
		マレーシアリングット小計	26,760,000.00	26,509,750.98 (693,760,183)	
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 18/12/21	4,400,000.00	4,400,652.74	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	5,680,000.00	5,535,348.57	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	5,500,000.00	5,188,880.67	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	5,600,000.00	5,354,216.28	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	15,600,000.00	17,151,263.22	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	6,200,000.00	5,553,547.08	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	11,150,000.00	9,074,128.68	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	5,220,000.00	4,681,491.48	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	3,210,000.00	3,001,235.72	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	8,300,000.00	5,889,751.79	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	8,200,000.00	7,339,610.49	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%- 40/01/31	3,230,000.00	3,020,057.26	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	8,000,000.00	5,670,276.80	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	6,650,000.00	6,045,518.99	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	11,000,000.00	10,003,300.45	
南アフリカランド小計		107,940,000.00	97,909,280.22 (813,626,118)	
	合計		158,302,461,966 (158,302,461,966)	

(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 164銘柄	100.0%	44.5%
加ドル	国債証券 32銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 17銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 277銘柄	100.0%	39.9%
英ポンド	国債証券 38銘柄	100.0%	7.2%
スイスフラン	国債証券 6銘柄	100.0%	0.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券 17銘柄	100.0%	0.6%
豪ドル	国債証券 21銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 31銘柄	100.0%	0.4%

南アフリカランド	国債証券	15銘柄	100.0%	0.5%
----------	------	------	--------	------

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「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28年 6月27日現在	平成28年12月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	10,299,931	6,887,879
コール・ローン	10,372,487	30,319,514
国債証券	1,988,676,842	2,511,778,389
派生商品評価勘定	7,081	-
未収利息	33,881,849	40,000,359
前払費用	4,540,962	2,569,101
流動資産合計	2,047,779,152	2,591,555,242
資産合計	2,047,779,152	2,591,555,242
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	85,680
未払金	-	5,868,752
未払解約金	1,678,037	3,154,505
未払利息	16	26
流動負債合計	1,678,053	9,108,963
負債合計	1,678,053	9,108,963
純資産の部		
元本等		
元本	1,878,450,995	2,093,872,199
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	167,650,104	488,574,080
元本等合計	2,046,101,099	2,582,446,279
純資産合計	2,046,101,099	2,582,446,279
負債純資産合計	2,047,779,152	2,591,555,242

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	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>(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28年 6月27日現在	平成28年12月26日現在
1.	期首	平成27年12月26日	平成28年 6月28日
	期首元本額	1,659,465,714円	1,878,450,995円
	期首からの追加設定元本額	249,487,071円	305,576,700円
	期首からの一部解約元本額	30,501,790円	90,155,496円
	元本の内訳		
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	34,253,908円	34,383,946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）	1,844,197,087円	2,039,781,876円
インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）	- 円	19,706,377円	
計	1,878,450,995円	2,093,872,199円	
2.	受益権の総数	1,878,450,995口	2,093,872,199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12月26日 至 平成28年 6月27日	自 平成28年 6月28日 至 平成28年12月26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28年 6月27日現在	平成28年12月26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

(平成28年12月26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	36,170,062
合計	36,170,062

(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

(平成28年12月26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	6,061,680	-	5,976,000	85,680
	南アフリカランド	6,061,680	-	5,976,000	85,680

合計	6,061,680	-	5,976,000	85,680
----	-----------	---	-----------	--------

(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28年 6月27日現在		平成28年12月26日現在	
1口当たり純資産額	1.0892円	1口当たり純資産額	1.2333円
(1万口当たり純資産額)	(10,892円)	(1万口当たり純資産額)	(12,333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-4.75%- 18/06/14	2,950,000.00	2,875,925.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-18/12/13	4,310,000.00	4,447,110.58	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11	4,270,000.00	4,062,905.00	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	2,330,000.00	2,405,095.90	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	5,250,000.00	5,131,875.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	1,750,000.00	1,697,202.41	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	1,530,000.00	1,592,454.60	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	4,410,000.00	5,109,553.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	1,600,000.00	1,422,727.91	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	1,630,000.00	1,629,343.76	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	1,560,000.00	1,675,206.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	2,300,000.00	2,313,938.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	1,600,000.00	1,598,080.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	1,180,000.00	1,443,806.22	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	1,740,000.00	1,862,716.98	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	3,130,000.00	3,115,957.56	
メキシコペソ小計			41,540,000.00	42,383,898.42	(241,164,382)
ブラジル レアル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL-10.25%- 28/01/10	250,000.00	227,500.00	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-18/01/01	610,000.00	546,133.00	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-18/04/01	830,000.00	725,005.00	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-18/07/01	720,000.00	613,367.96	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-18/10/01	350,000.00	290,500.00	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-19/01/01	960,000.00	777,120.00	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-19/07/01	400,000.00	307,240.00	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-20/01/01	950,000.00	689,605.00	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-20/07/01	540,000.00	370,386.00	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL-10.0%- 18/01/01	200,000.00	197,322.55	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL-10.0%- 19/01/01	200,000.00	196,642.55	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL-10.0%- 21/01/01	800,000.00	767,930.20	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL-10.0%- 23/01/01	920,000.00	865,547.74	

		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-25/01/01	590,000.00	547,586.52	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-27/01/01	220,000.00	202,622.80	
ブラジルリアル小計			8,540,000.00	7,324,509.32 (262,144,188)	
チリペソ	国債証券	REPUBLIC OF CHILE-5.5%-20/08/05	50,000,000.00	52,619,845.00	
チリペソ小計			50,000,000.00	52,619,845.00 (9,134,805)	
コロンビアペソ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA-7.75%-21/04/14	60,000,000.00	62,255,334.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA-4.375%-23/03/21	30,000,000.00	26,123,053.50	
		REPUBLIC OF COLOMBIA-9.85%-27/06/28	97,000,000.00	115,026,353.90	
		TITULOS DE TESORERIA B-5.0%-18/11/21	300,000,000.00	293,496,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-19/09/11	437,000,000.00	443,052,450.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-11.0%-20/07/24	625,000,000.00	711,031,250.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-22/05/04	595,000,000.00	603,297,275.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-10.0%-24/07/24	865,000,000.00	1,019,173,275.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.5%-26/08/26	600,000,000.00	615,633,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-6.0%-28/04/28	450,000,000.00	404,410,500.00	
TITULOS DE TESORERIA B-7.75%-30/09/18	465,000,000.00	480,103,200.00			
コロンビアペソ小計			4,524,000,000.00	4,773,601,691.40 (186,170,465)	
ペルーヌエボソル	国債証券	BONOS DE TESORERIA-5.7%-24/08/12	220,000.00	217,849.28	
		BONOS DE TESORERIA-6.35%-28/08/12	330,000.00	327,284.26	
		PERU BONO SOBERANO-7.84%-20/08/12	125,000.00	135,761.31	
		PERU BONO SOBERANO-8.2%-26/08/12	240,000.00	271,640.64	
		PERU BONO SOBERANO-6.95%-31/08/12	310,000.00	318,080.15	
		PERU BONO SOBERANO-6.9%-37/08/12	170,000.00	170,554.88	
ペルーヌエボソル小計			1,395,000.00	1,441,170.52 (49,907,735)	
トルコリラ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND-6.3%-18/02/14	320,000.00	309,920.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.3%-18/06/20	400,000.00	389,400.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.7%-18/07/11	220,000.00	215,050.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.8%-18/11/14	420,000.00	409,059.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.4%-19/03/27	240,000.00	240,240.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.5%-19/07/10	480,000.00	460,056.00	

		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.5%-20/01/15	345,000.00	346,707.75	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-7.4%-20/02/05	460,000.00	421,498.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.4%-20/07/08	450,000.00	433,327.50	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.7%-21/02/17	510,000.00	510,000.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.2%-21/09/22	110,000.00	103,433.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.5%-22/01/12	330,000.00	312,427.50	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.5%-22/09/14	360,000.00	323,460.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-7.1%-23/03/08	490,000.00	406,700.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.8%-23/09/27	450,000.00	404,190.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.4%-24/03/20	270,000.00	262,426.50	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.0%-24/07/24	430,000.00	387,537.50	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.0%-25/03/12	470,000.00	395,505.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.6%-26/02/11	410,000.00	401,800.00	
トルコリラ小計			7,165,000.00	6,732,737.75	(224,469,476)
ハンガリー リーフォ リント	国債証券	HUNGARY GOVERNMENT BOND-4.0%-18/04/25	15,000,000.00	15,754,740.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.5%-18/06/22	14,500,000.00	14,984,691.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-5.5%-18/12/20	15,000,000.00	16,532,250.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.5%-19/06/24	39,300,000.00	44,823,615.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.0%-19/10/30	16,000,000.00	16,533,304.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.5%-20/06/24	28,000,000.00	30,180,122.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-7.5%-20/11/12	31,200,000.00	38,485,200.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.5%-21/10/27	19,000,000.00	19,698,630.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-7.0%-22/06/24	26,800,000.00	33,902,000.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.0%-23/11/24	31,000,000.00	38,202,075.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-24/06/26	18,000,000.00	18,372,510.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-5.5%-25/06/24	32,800,000.00	39,122,200.00	
ハンガリーフォリント小計			286,600,000.00	326,591,337.50	(129,134,214)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-18/04/25	460,000.00	471,776.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-18/07/25	640,000.00	646,400.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-18/10/25	620,000.00	598,548.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-19/07/25	600,000.00	616,020.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	430,000.00	467,990.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.5%-20/04/25	750,000.00	729,150.00	

		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	490,000.00	538,853.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25	760,000.00	741,134.90	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-21/07/25	820,000.00	787,200.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	450,000.00	511,560.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	610,000.00	699,212.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	660,000.00	696,003.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	780,000.00	775,242.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	870,000.00	805,098.00	
ポーランドズロチ小計			8,940,000.00	9,084,187.90	(251,995,372)
ロシア ルーブル	国債証券	RUSSIA FOREIGN BOND-7.85%-18/03/10	5,000,000.00	4,955,000.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.2%-18/01/31	4,100,000.00	4,002,010.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.5%-18/03/15	3,500,000.00	3,471,125.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.5%-19/02/27	5,300,000.00	5,236,400.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.7%-19/05/15	5,200,000.00	5,031,000.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.8%-19/12/11	5,000,000.00	4,814,750.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.4%-20/05/27	5,100,000.00	4,821,157.50	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.6%-21/04/14	5,300,000.00	5,181,810.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.5%-21/08/18	6,400,000.00	6,227,200.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.6%-22/07/20	5,600,000.00	5,449,920.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.0%-23/01/25	5,400,000.00	5,089,527.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.0%-23/08/16	8,300,000.00	7,793,700.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-8.15%-27/02/03	9,000,000.00	8,932,500.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.05%-28/01/19	8,200,000.00	7,466,100.00	
RUSSIA GOVT BOND - OFZ-8.5%-31/09/17	4,200,000.00	4,207,665.00			
ロシアルーブル小計			85,600,000.00	82,679,864.50	(157,918,541)
ルーマニ アレイ	国債証券	ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.25%- 18/01/17	290,000.00	296,403.20	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.6%-18/11/28	200,000.00	215,937.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-2.5%-19/04/29	240,000.00	245,025.60	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.75%- 19/06/24	260,000.00	279,780.80	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-2.25%- 20/02/26	150,000.00	151,125.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.75%- 20/04/29	200,000.00	223,955.00	

		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.25%- 21/03/22	220,000.00	226,875.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.95%- 21/06/11	270,000.00	309,015.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.5%-22/12/19	200,000.00	204,000.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.85%- 23/04/26	230,000.00	265,217.60	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.75%- 25/02/24	280,000.00	301,774.20	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.8%-27/07/26	150,000.00	175,549.50	
ルーマニアレイ小計			2,690,000.00	2,894,657.90	(78,242,603)
マレーシ アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.759%-19/03/15	290,000.00	291,514.38	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.654%-19/10/31	410,000.00	410,684.70	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.659%-20/10/15	400,000.00	399,465.20	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	350,000.00	350,989.45	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.62%-21/11/30	180,000.00	179,273.70	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	360,000.00	353,997.36	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	350,000.00	343,535.15	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	440,000.00	428,187.76	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	250,000.00	243,265.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	200,000.00	189,550.60	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.39%- 23/07/07	100,000.00	101,650.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.07%- 26/09/30	380,000.00	368,982.28	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	460,000.00	462,820.72	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.26%-18/03/01	270,000.00	269,575.02	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.58%-18/09/28	350,000.00	349,608.70	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	220,000.00	231,546.26	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	580,000.00	591,782.12	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.492%-20/03/31	310,000.00	308,249.74	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.889%-20/07/31	280,000.00	281,956.92	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	410,000.00	416,553.44	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	360,000.00	347,871.24	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	440,000.00	420,115.52	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	380,000.00	374,947.90	

		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	430,000.00	428,637.33	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	360,000.00	347,059.08	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	290,000.00	276,469.76	
マレーシアリングット小計			8,850,000.00	8,768,289.33	(229,466,131)
タイバーツ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND-5.125%-18/03/13	2,900,000.00	3,020,973.50	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.45%-19/03/08	2,100,000.00	2,174,965.80	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.875%-19/06/13	9,050,000.00	9,497,513.45	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.55%-20/06/26	6,100,000.00	6,219,511.20	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.65%-21/12/17	10,220,000.00	10,862,715.36	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-1.875%-22/06/17	1,800,000.00	1,749,961.80	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.625%-23/06/16	6,600,000.00	7,002,270.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.85%-25/12/12	6,570,000.00	7,080,232.77	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-4.875%-29/06/22	7,080,000.00	8,359,787.88	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.4%-36/06/17	1,500,000.00	1,506,754.50	
タイバーツ小計			53,920,000.00	57,474,686.26	(186,792,730)
フィリピンペソ	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES-4.95%-21/01/15	5,000,000.00	5,006,000.00	
フィリピンペソ小計			5,000,000.00	5,006,000.00	(11,814,160)
インドネシアルピア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT-5.25%-18/05/15	500,000,000.00	488,250,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.875%-19/04/15	1,600,000,000.00	1,620,000,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-20/11/15	500,000,000.00	561,450,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-12.8%-21/06/15	500,000,000.00	593,562,500.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-21/07/15	2,380,000,000.00	2,447,841,900.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-22/05/15	1,100,000,000.00	1,071,374,700.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-5.625%-23/05/15	850,000,000.00	759,928,900.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-24/03/15	3,450,000,000.00	3,563,850,000.00	

		INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-25/09/15	760,000,000.00	904,181,120.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-26/09/15	3,290,000,000.00	3,400,215,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-27/05/15	900,000,000.00	854,786,700.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.125%-28/05/15	800,000,000.00	685,892,800.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.0%-29/03/15	2,350,000,000.00	2,487,475,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-10.5%-30/08/15	810,000,000.00	961,713,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.75%-31/05/15	1,600,000,000.00	1,680,400,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.5%-31/07/15	520,000,000.00	575,172,520.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-32/06/15	1,100,000,000.00	1,108,034,400.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.625%-33/05/15	1,280,000,000.00	1,099,471,360.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-34/03/15	2,300,000,000.00	2,325,300,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-36/05/15	1,460,000,000.00	1,480,264,800.00	
		PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-8.25%- 20/09/15	500,000,000.00	517,721,000.00	
インドネシアルピア小計			28,550,000,000.00	29,186,885,700.00 (253,925,905)	
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 18/12/21	1,200,000.00	1,200,178.02	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	1,610,000.00	1,568,998.45	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	1,640,000.00	1,547,229.87	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	1,750,000.00	1,673,192.58	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	4,450,000.00	4,892,507.77	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	2,530,000.00	2,266,205.50	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	2,440,000.00	1,985,728.60	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	1,850,000.00	1,659,149.28	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	1,200,000.00	1,121,957.28	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	2,190,000.00	1,554,042.94	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	2,410,000.00	2,157,129.41	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%- 40/01/31	1,120,000.00	1,047,202.51	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	2,040,000.00	1,445,920.58	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	1,980,000.00	1,800,019.18	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	3,190,000.00	2,900,957.13	
南アフリカランド小計		31,600,000.00	28,820,419.10 (239,497,682)	
	合計		2,511,778,389 (2,511,778,389)	

(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 16銘柄	100.0%	9.6%
ブラジルリアル	国債証券 15銘柄	100.0%	10.6%
チリペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.4%
コロンビアペソ	国債証券 11銘柄	100.0%	7.4%
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 19銘柄	100.0%	8.9%
ハンガリーフォリント	国債証券 12銘柄	100.0%	5.1%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	10.0%
ロシアルーブル	国債証券 15銘柄	100.0%	6.3%
ルーマニアレイ	国債証券 12銘柄	100.0%	3.1%
マレーシアリングット	国債証券 26銘柄	100.0%	9.1%
タイバーツ	国債証券 10銘柄	100.0%	7.4%
フィリピンペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.5%
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12月30日現在です。

【全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型】

【純資産額計算書】

資産総額	219,313,807円
負債総額	71,822円
純資産総額（ - ）	219,241,985円
発行済口数	231,573,381口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9467円

（参考）

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	26,756,367,746円
負債総額	79,062,125円
純資産総額（ - ）	26,677,305,621円
発行済口数	20,265,028,315口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3164円

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	77,200,286,322円
負債総額	179,275,188円
純資産総額（ - ）	77,021,011,134円
発行済口数	37,234,396,014口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0685円

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

純資産額計算書

資産総額	10,388,700,831円
負債総額	12,464,129円
純資産総額（ - ）	10,376,236,702円
発行済口数	7,069,318,236口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4678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	34,508,603,526円
負債総額	144,418,676円
純資産総額（ - ）	34,364,184,850円
発行済口数	24,783,745,842口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3866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	160,453,966,017円
負債総額	237,649,144円
純資産総額（ - ）	160,216,316,873円
発行済口数	72,386,418,246口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2133円

海外新興国債券インデックスL o c a l（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	2,623,268,395円
負債総額	7,661,621円
純資産総額（ - ）	2,615,606,774円
発行済口数	2,116,303,312口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2359円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

<更新後>

(1) 資本金の額

平成28年12月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（平成28年12月末現在）

・株主総会

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

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

・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。

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

・監査役会

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

(3) 運用の意思決定プロセス（平成28年12月末現在）

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

2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

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

・委託会社の運用する、平成28年12月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	678	130,779
株式投資信託	629	104,098
単位型	167	7,247
追加型	462	96,850
公社債投資信託	49	26,681
単位型	35	423
追加型	14	26,257

3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第58期中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

<更新後>

	(単位：百万円)			
	第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	3	14,308
金銭の信託		-	3	153
有価証券		277		86
前払費用	3	509	3	489
未収入金		3		10
未収委託者報酬		8,441		9,374
未収収益	3	1,566	3	2,280
関係会社短期貸付金		436		5,333
立替金		666		2,960

繰延税金資産		1,446		819
その他	2	195	2,3	428
流動資産合計		27,750		36,243
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	56	1	146
器具備品	1	166	1	210
有形固定資産合計		222		356
無形固定資産				
ソフトウェア		113		140
無形固定資産合計		113		140
投資その他の資産				
投資有価証券		14,184		12,195
関係会社株式		21,702		21,702
関係会社長期貸付金		60		60
長期差入保証金		740		781
長期前払費用		0		0
繰延税金資産		248		425
投資その他の資産合計		36,936		35,165
固定資産合計		37,273		35,662
資産合計		65,023		71,905

(単位：百万円)

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

資本金	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金	5,220	5,220
資本剰余金合計	5,220	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	25,836	29,948
利益剰余金合計	25,836	29,948
自己株式	68	502
株主資本合計	48,351	52,028
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,002	151
繰延ヘッジ損益	88	258
評価・換算差額等合計	913	410
純資産合計	49,265	52,438
負債純資産合計	65,023	71,905

(2) 【損益計算書】

< 更新後 >

(単位：百万円)

	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	63,990	66,339
その他営業収益	3,729	4,382
営業収益合計	67,719	70,722
営業費用		
支払手数料	30,408	30,529
広告宣伝費	1,045	1,098
公告費	5	3
調査費	15,571	17,470
調査費	747	821
委託調査費	14,782	16,600
図書費	41	48
委託計算費	502	505
営業雑経費	660	718
通信費	199	195
印刷費	263	321
協会費	64	65
諸会費	27	22
その他	106	113
営業費用計	48,193	50,327
一般管理費		
給料	7,585	8,138
役員報酬	289	365
役員賞与引当金繰入額	120	145
給料・手当	5,127	5,495

賞与	59	51
賞与引当金繰入額	1,990	2,080
交際費	163	185
寄付金	36	27
旅費交通費	503	503
租税公課	208	258
不動産賃借料	785	875
退職給付費用	349	372
退職金	16	113
固定資産減価償却費	148	196
福利費	908	952
諸経費	2,673	2,952
一般管理費計	13,380	14,577
営業利益	6,146	5,817

(単位：百万円)

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

法人税、住民税及び事業税	2,356	1,359
法人税等調整額	466	706
法人税等合計	1,890	2,065
当期純利益	3,101	4,962

(3) 【株主資本等変動計算書】

< 更新後 >

第56期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

(単位：百万円)

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

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

第57期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	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 其他有価証券 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。 建物 3年～15年 器具備品 5年～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p>
4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。</p>

（会計方針の変更）

第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
<p>（企業結合に関する会計基準等の適用）</p> <p>「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>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>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> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>現金・預金</td> <td style="text-align: right;">4,256百万円</td> </tr> <tr> <td>前払費用</td> <td style="text-align: right;">2百万円</td> </tr> <tr> <td>未収収益</td> <td style="text-align: right;">110百万円</td> </tr> </table> <p>(流動負債)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>未払手数料</td> <td style="text-align: right;">108百万円</td> </tr> <tr> <td>未払費用</td> <td style="text-align: right;">500百万円</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">57百万円</td> </tr> </table> <p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示してありません。</p> <p>5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務27百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務842百万円に対して保証を行っております。</p>	現金・預金	4,256百万円	前払費用	2百万円	未収収益	110百万円	未払手数料	108百万円	未払費用	500百万円	その他	57百万円	<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> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>現金・預金</td> <td style="text-align: right;">4,072百万円</td> </tr> <tr> <td>金銭の信託</td> <td style="text-align: right;">153百万円</td> </tr> <tr> <td>前払費用</td> <td style="text-align: right;">2百万円</td> </tr> <tr> <td>未収収益</td> <td style="text-align: right;">147百万円</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">193百万円</td> </tr> </table> <p>(流動負債)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>未払手数料</td> <td style="text-align: right;">93百万円</td> </tr> <tr> <td>未払費用</td> <td style="text-align: right;">722百万円</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">266百万円</td> </tr> </table> <p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示してありません。</p> <p>5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務728百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務689百万円に対して保証を行っております。</p>	現金・預金	4,072百万円	金銭の信託	153百万円	前払費用	2百万円	未収収益	147百万円	その他	193百万円	未払手数料	93百万円	未払費用	722百万円	その他	266百万円
現金・預金	4,256百万円																												
前払費用	2百万円																												
未収収益	110百万円																												
未払手数料	108百万円																												
未払費用	500百万円																												
その他	57百万円																												
現金・預金	4,072百万円																												
金銭の信託	153百万円																												
前払費用	2百万円																												
未収収益	147百万円																												
その他	193百万円																												
未払手数料	93百万円																												
未払費用	722百万円																												
その他	266百万円																												

(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> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>受取配当金</td> <td style="text-align: right;">719百万円</td> </tr> </table> <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>	受取配当金	719百万円	<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> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>受取配当金</td> <td style="text-align: right;">1,193百万円</td> </tr> <tr> <td>支払利息</td> <td style="text-align: right;">123百万円</td> </tr> <tr> <td>デリバティブ費用</td> <td style="text-align: right;">889百万円</td> </tr> </table>	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
受取配当金	719百万円								
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								

(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)
	為替予約取引 売建				

原則的処理 方法	米ドル 豪ドル シンガポールドル ユーロ	投資有価証券	2,586 276 878 219	- - - -	68 8 4 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	投資有価証券			
	売建				
	米ドル		3,943	-	179
	豪ドル		767	-	18
	シンガポールドル		75	-	4
	香港ドル		151	-	5
	人民元		1,948	-	8
ユーロ	173	-	0		
合計			7,060	-	170

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

(持分法損益等)

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

(退職給付関係)

第56期(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.6%

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、196百万円でありました。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,233
会計方針の変更による累積的影響額	-
会計方針の変更を反映した期首残高	1,233
勤務費用	145
利息費用	7
数理計算上の差異の発生額	33
退職給付の支払額	119
<u>退職給付債務の期末残高</u>	<u>1,299</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	1,299
未積立退職給付債務	1,299
未認識数理計算上の差異	144
<u>貸借対照表に計上された負債の額</u>	<u>1,154</u>
退職給付引当金	1,154
<u>貸借対照表に計上された負債の額</u>	<u>1,154</u>

(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
<u>確定給付制度に係る退職給付費用</u>	<u>162</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 0.2%

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 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション（新株予約権）の数

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社の従業員 1名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 186名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)	普通株式 2,310,000株	普通株式 6,101,700株
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日

権利確定条件	平成24年1月22日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	平成25年10月7日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	平成24年1月22日から 平成32年1月21日まで	平成25年10月7日から 平成33年10月6日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション(新株予約権)の数

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

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

失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

- 2 ス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の主な原因別の内訳</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <p>繰延税金資産(流動)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">賞与引当金</td> <td style="text-align: right;">658</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">813</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,472</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">投資有価証券評価損</td> <td style="text-align: right;">134</td> </tr> <tr> <td>関係会社株式評価損</td> <td style="text-align: right;">1,510</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">360</td> </tr> <tr> <td>固定資産減価償却費</td> <td style="text-align: right;">133</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">73</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,213</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産小計</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;"></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> <tr> <td>繰延税金資産の純額</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	繰延税金資産の純額	1,694	<p>1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <p>繰延税金資産(流動)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">賞与引当金</td> <td style="text-align: right;">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> <tr> <td>繰延税金資産の純額</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	繰延税金資産の純額	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																																																																								
繰延税金資産の純額	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																																																																								
繰延税金資産の純額	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(シンガポールドル貸建)(注1)	184(千SGD 2,059)(注2)	関係会社短期貸付金	436(千SGD 5,000)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	7(千SGD 92)	未収収益	7(千SGD 82)

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠SGD11,000千、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 SGD 1,000) (注2)	関係会社 短期貸付金	333 (千 SGD 4,000)
							貸付金利息(シンガポールドル貨建)(注1)	18 (千 SGD 215)	未収収益	6 (千 SGD 74)
							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 USD 50,000)	関係会社 短期借入金	5,631 (千 USD 50,000)
							借入金利息(米ドル貨建)(注5)	113 (千 USD 949)	未払費用	106 (千 USD 949)

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

(セグメント情報等)

セグメント情報

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

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

関連情報

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

<更新後>

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

第58期中間会計期間
(平成28年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金	16,370
金銭の信託	152
有価証券	29
未収委託者報酬	8,443
未収収益	1,681
関係会社短期貸付金	488
繰延税金資産	821
その他	2

流動資産合計		30,070
固定資産		
有形固定資産	1	323
無形固定資産		129
投資その他の資産		
投資有価証券		11,401
関係会社株式		23,203
関係会社長期貸付金		60
長期差入保証金		781
繰延税金資産		409
長期前払費用		0
投資その他の資産合計		35,857
固定資産合計		36,311
資産合計		66,382

(単位：百万円)

第58期中間会計期間
(平成28年9月30日)

負債の部

流動負債

未払金		4,011
未払費用		4,007
未払法人税等		1,052
未払消費税等	3	440
賞与引当金		1,112
役員賞与引当金		60
その他		517
流動負債合計		11,201

固定負債

退職給付引当金		1,203
固定負債合計		1,203

負債合計

12,404

純資産の部

株主資本

資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220

利益剰余金

その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		31,627
利益剰余金合計		31,627

自己株式 672

株主資本合計 53,537

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金 340

繰延ヘッジ損益	780
評価・換算差額等合計	439
純資産合計	53,977
負債純資産合計	66,382

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第58期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)		
営業収益		
委託者報酬		32,215
その他営業収益		1,942
営業収益合計		34,158
営業費用及び一般管理費	1	31,520
営業利益		2,637
営業外収益	2	1,760
営業外費用	3	327
経常利益		4,070
特別利益	4	50
特別損失	5	19
税引前中間純利益		4,102
法人税等	6	927
中間純利益		3,174

(3) 中間株主資本等変動計算書

第58期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

(単位：百万円)

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己 株式	
		資本 準備金	資本 剰余金 合計	その他利 益剰余金 繰越利益 剰余金	利益 剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	29,948	29,948	502	52,028
当中間期変動額							
剰余金の配当				1,495	1,495		1,495
中間純利益				3,174	3,174		3,174
自己株式の取得						170	170
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）							
当中間期変動額合計				1,679	1,679	170	1,508
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	31,627	31,627	672	53,537

	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	151	258	410	52,438
当中間期変動額				
剰余金の配当				1,495
中間純利益				3,174
自己株式の取得				170
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	491	521	29	29
当中間期変動額合計	491	521	29	1,538
当中間期末残高	340	780	439	53,977

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第58期中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30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 中間決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <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。ただし、平成28年 4月 1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p>

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

(会計方針の変更)

<p>第58期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)</p> <p>(減価償却方法) 法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第32号 平成28年6月17日)を当中間会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。 この結果、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益に与える影響は軽微であります。</p> <p>(税金費用の計算方法) 従来、年度決算と同様の方法による税金費用の計算を適用しておりましたが、当社の中間決算業務の一層の効率化を図るため、当中間会計期間より事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り算出された見積実効税率に、税引前中間純利益を乗ずる計算方法に変更しております。 なお、この変更による影響は軽微であるため、遡及適用は行っておりません。</p>

(追加情報)

<p>第58期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)</p> <p>「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)を当中間会計期間から適用しております。</p>
--

(中間貸借対照表関係)

<p>第58期中間会計期間 (平成28年9月30日)</p> <p>1 有形固定資産の減価償却累計額 1,891百万円</p> <p>2 信託資産 流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p>

4 保証債務

当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務582百万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558百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

第58期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	70百万円
無形固定資産	20百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	7百万円
受取配当金	1,591百万円
デリバティブ収益	6百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	128百万円
支払源泉所得税	155百万円
4 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	50百万円
5 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	18百万円
6 中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。	

(中間株主資本等変動計算書関係)

第58期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	814,100	305,000	-	1,119,100

(注) 自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会 計期間末 残高 (百万円)
		当事業 年度期首	当中間 会計期間 増加	当中間 会計期間 減少	当中間 会計期間末	
平成21年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,762,200	-	19,800	1,742,400	-

平成21年度 ストックオプション(2)	普通株式	174,900	-	-	174,900	-
平成23年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,738,800	-	-	4,738,800	-
平成28年度 ストックオプション(1)	普通株式	-	4,437,000	-	4,437,000	-
合計		6,675,900	4,437,000	19,800	11,093,100	-

- (注) 1 平成21年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。
 2 平成28年度ストックオプション(1)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。
 3 平成21年度ストックオプション(1)1,742,400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、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

該当事項はありません。

(リース取引関係)

第58期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	865百万円
1年超	2,220百万円
合計	3,085百万円

(金融商品関係)

第58期中間会計期間(平成28年9月30日)

1 金融商品の時価等に関する事項

平成28年9月30日(当中間決算日)における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	中間貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金及び預金	16,370	16,370	-
(2) 未収委託者報酬	8,443	8,443	-
(3) 未収収益	1,681	1,681	-
(4) 金銭の信託	152	152	-
(5) 関係会社短期貸付金	488	488	-
(6) 有価証券及び投資有価証券			

その他有価証券	11,431	11,431	-
(7) 未払金	(4,011)	(4,011)	-
(8) 未払費用	(4,007)	(4,007)	-
(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	24	24	-
ヘッジ会計が適用されているもの	268	268	-
デリバティブ取引計	292	292	-

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

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

(4) 金銭の信託

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

(6) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(7) 未払金及び(8) 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。

(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、上記金額は貸借対照表上、流動資産のその他に含まれております。

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

3 子会社株式(中間貸借対照表計上額20,310百万円)及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額2,892百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

(有価証券関係)

第58期中間会計期間(平成28年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	20,310
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位:百万円)

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	3,215	2,649	565
	小計	3,215	2,649	565
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	8,199	9,255	1,056
	小計	8,199	9,255	1,056
合計		11,414	11,905	490

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

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

(デリバティブ取引関係)

第58期中間会計期間(平成28年9月30日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	3,386	-	24	24
合計		3,386	-	24	24

(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	投資有価証券			
	米ドル		3,575	-	156
	豪ドル		67	-	1
	シンガポールドル		685	-	38
	ユーロ		82	-	2
	香港ドル		87	-	4
	人民元		1,831	-	65
合計			6,329	-	268

(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58期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	3,017百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	8,257百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,144百万円

(ストックオプション等関係)

第58期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

当中間会計期間において、ストックオプションを付与しておりますが、当該ストックオプションの付与による影響が当社の財政状態、経営成績等にとって重要でないと認められるため注記を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第58期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

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

[関連情報]

第58期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第58期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第58期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第58期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第58期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
1株当たり純資産額	275円54銭
1株当たり中間純利益金額	16円18銭

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

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第58期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
中間純利益(百万円)	3,174
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式に係る中間純利益(百万円)	3,174
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,123
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1) 1,742,400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、 平成28年度ストックオプション(1) 4,437,000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58期中間会計期間 (平成28年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円)	53,977
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額(百万円)	53,977
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数(千株)	195,893

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<更新後>

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (平成28年9月末現在)	事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

<更新後>

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (平成28年9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。

独立監査人の監査報告書

平成29年 1月25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28年6月28日から平成28年12月26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12月26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。

[次へ](#)

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。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月5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28年4月1日から平成29年3月31日までの第58期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。