

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年9月26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。

第一部【証券情報】**（１）【ファンドの名称】**

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

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

（５）【申込手数料】

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

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

（６）【申込単位】

販売会社または「（８）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

（７）【申込期間】

平成29年 9月27日から平成30年 9月25日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

（ 9 ） 【 払込期日 】

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

（ 1 0 ） 【 払込取扱場所 】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

（ 1 1 ） 【 振替機関に関する事項 】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

（ 1 2 ） 【 その他 】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

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

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

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

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

年12回(毎月)

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

グローバル(含む日本)

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジなし

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1 日本、海外先進国および新興国の経済規模に応じた資産配分を行いません。

- 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)見直しを行いません。
 - 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いません。

- 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いません。
- ※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)を行いません。

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2017年予想の値をもとに日興アセットマネジメントが作成。）
※端数処理の関係で合計が100%にならない場合があります。

2 資産の安定成長をめざすため、株式と債券に分散投資を行ないます。

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

【株式部分:50%】

【債券部分:50%】



【ワールドクルーズの資産配分比率】

- 上記は2017年6月現在の目標とする資産配分比率であり、将来変更になる場合があります。
- 各マザーファンドへの実際の資産配分比率は時価の影響などにより、必ずしも上記数値とは一致しません。

投資対象国・地域

日本および、海外先進国、新興国など計49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、アルゼンチン	
【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、パキスタン	
【アフリカ】	エジプト、南アフリカ	

(26の国と地域)

●上図は2017年6月末現在の当ファンドが連動をめざす各指数をもとに作成した投資対象国・地域であり、将来変更になる可能性があります。

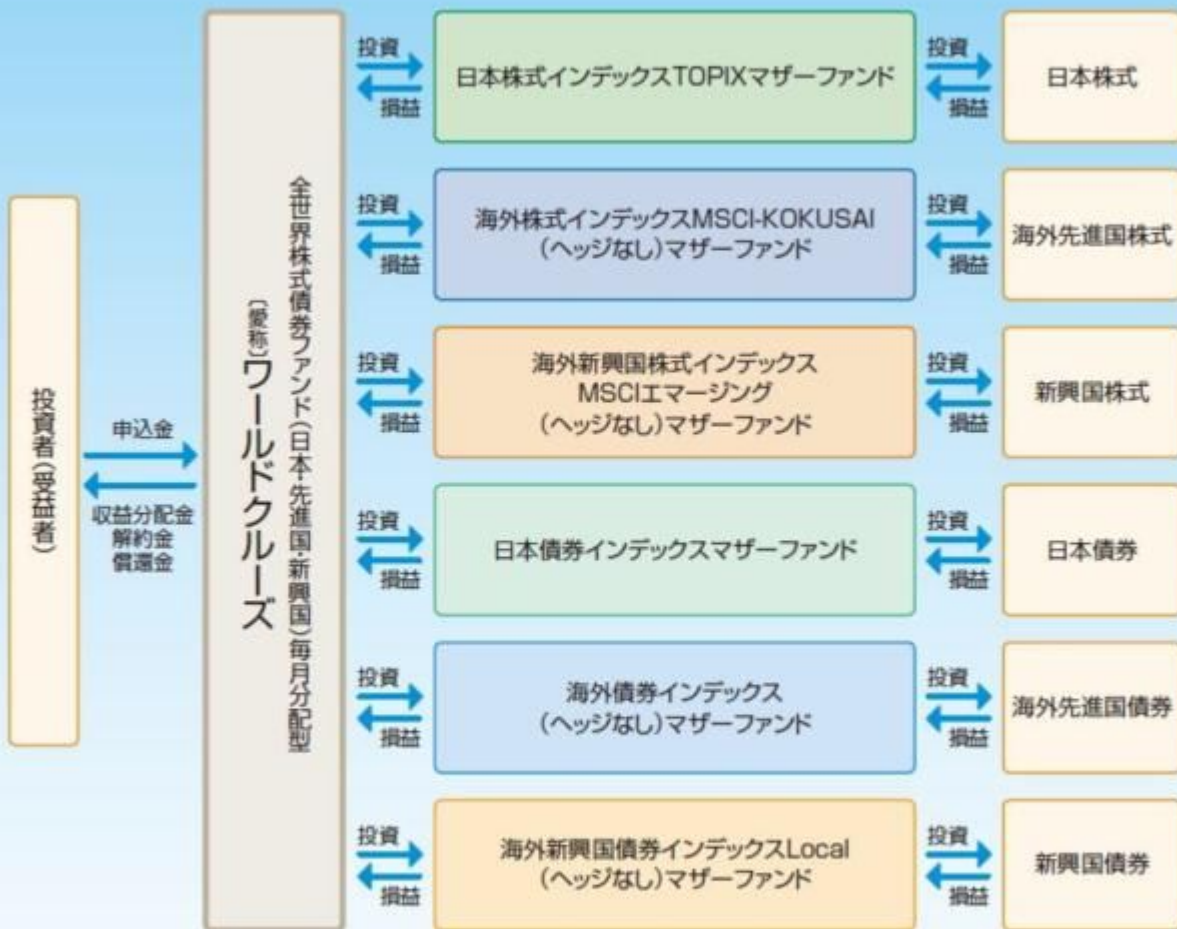
(参考)グローバル分散投資の意義 ～ワールドクルーズをめざすもの～

世界の経済成長に伴なう

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

ファンドの仕組み

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



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

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

収益分配金に関する留意事項

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

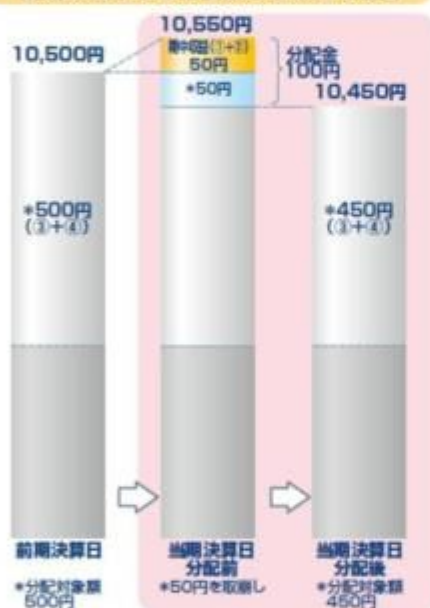
投資信託で分配金が支払われるイメージ



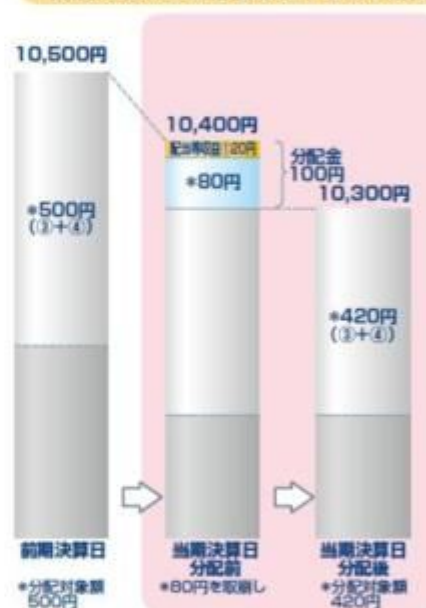
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算から基準価額が上昇した場合



前期決算から基準価額が下落した場合



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

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

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

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

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

信託金限度額

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

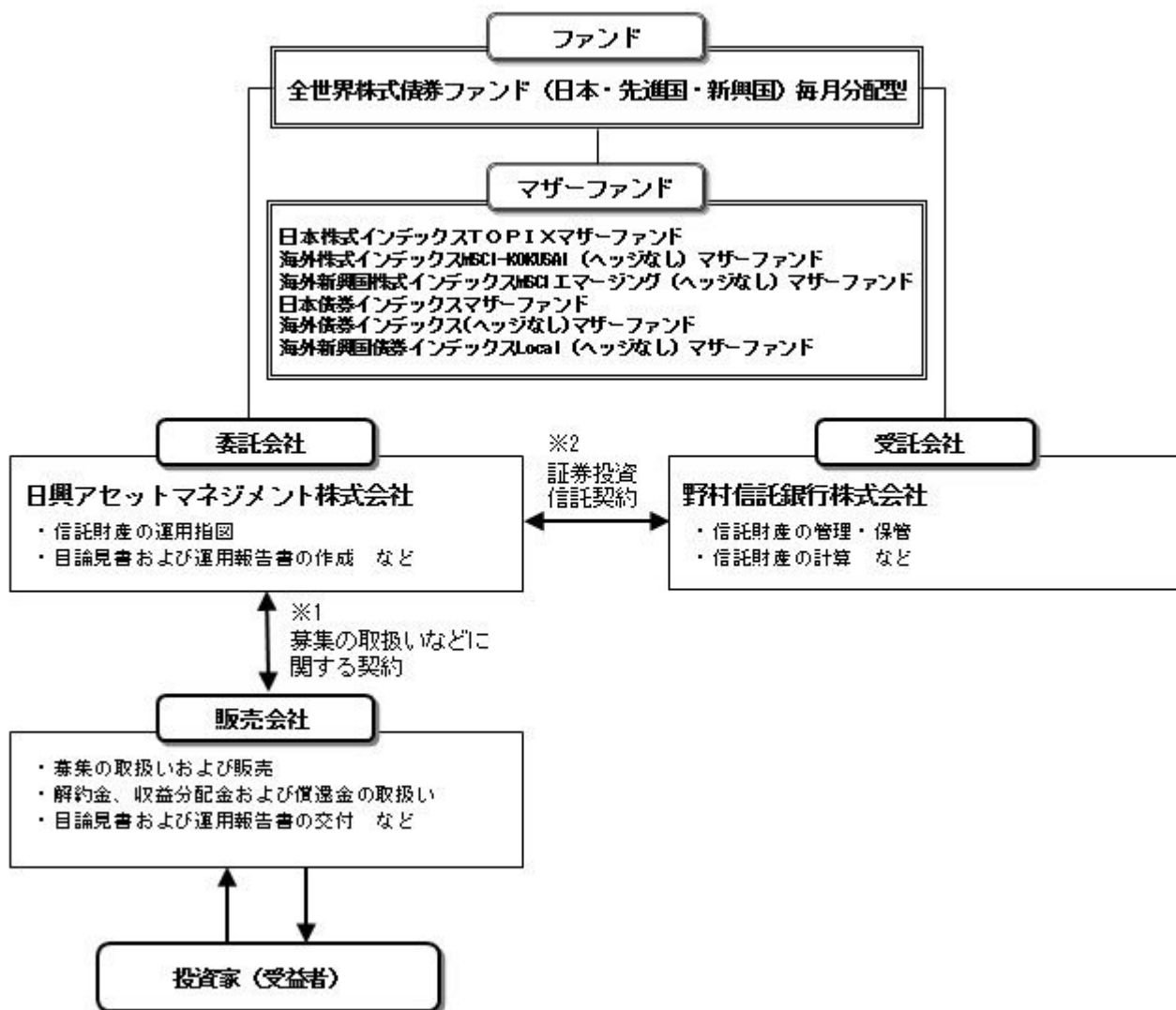
(2) 【ファンドの沿革】

平成20年 3月31日

- ・ ファンドの信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

委託会社の概況（平成29年6月末現在）

- 1) 資本金
17,363百万円
- 2) 沿革
昭和34年：日興証券投資信託委託株式会社として設立
平成11年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更
- 3) 大株主の状況

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

2 【投資方針】

（１）【投資方針】

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

（２）【投資対象】

<全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型>

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

証券投資信託 「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

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

証券投資信託 「日本債券インデックスマザーファンド」

証券投資信託 「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

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

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

同じ。)で18)に定めるもの以外のもの

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

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

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

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

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

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

- 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。) および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1) ~ 8) の証券または証書の性質を有するもの
- 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。) で12) に定めるもの以外のもの
- 12) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。) または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
- 13) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 15) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 19) 外国の者に対する権利で18) の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。) により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5) の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引

<日本債券インデックスマザーファンド>

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

ます。)を除きます。)には投資しません。

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

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

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

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

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

新興国の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

投資対象とするマザーファンドの概要

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

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

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・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 >

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカンントリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用

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

その他

委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成12年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

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

運用の基本方針

基本方針	主として金融商品取引所に上場されている新興国の株式に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	新興国の株式（DR（預託証券）およびカンントリーファンドなどを含まず。）を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として、新興国の株式（DR（預託証券）およびカンントリーファンドなどを含まず。）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まず。）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、野村證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ないます。 ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成10年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

^{*}シティ世界国債インデックス（除く日本）は、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが開発した、日本を除く世界の主要国の国債市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケッツ・

インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

< 海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド >

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

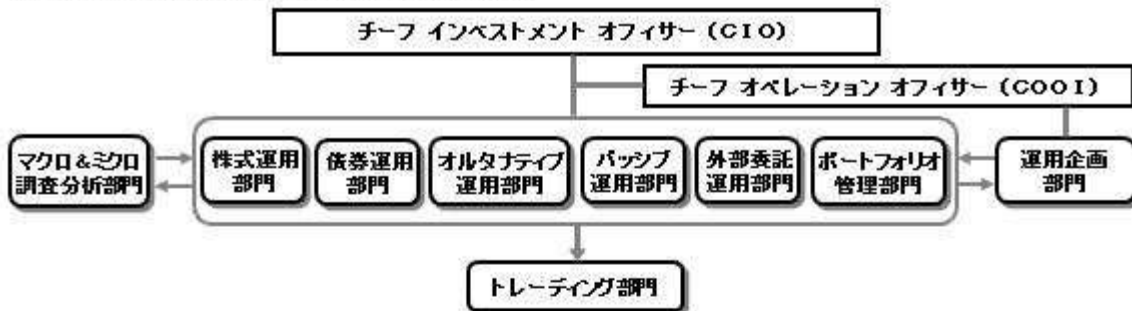
信託期間	無期限（平成20年3月31日設定）
決算日	毎年5月16日（休業日の場合は翌営業日）

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

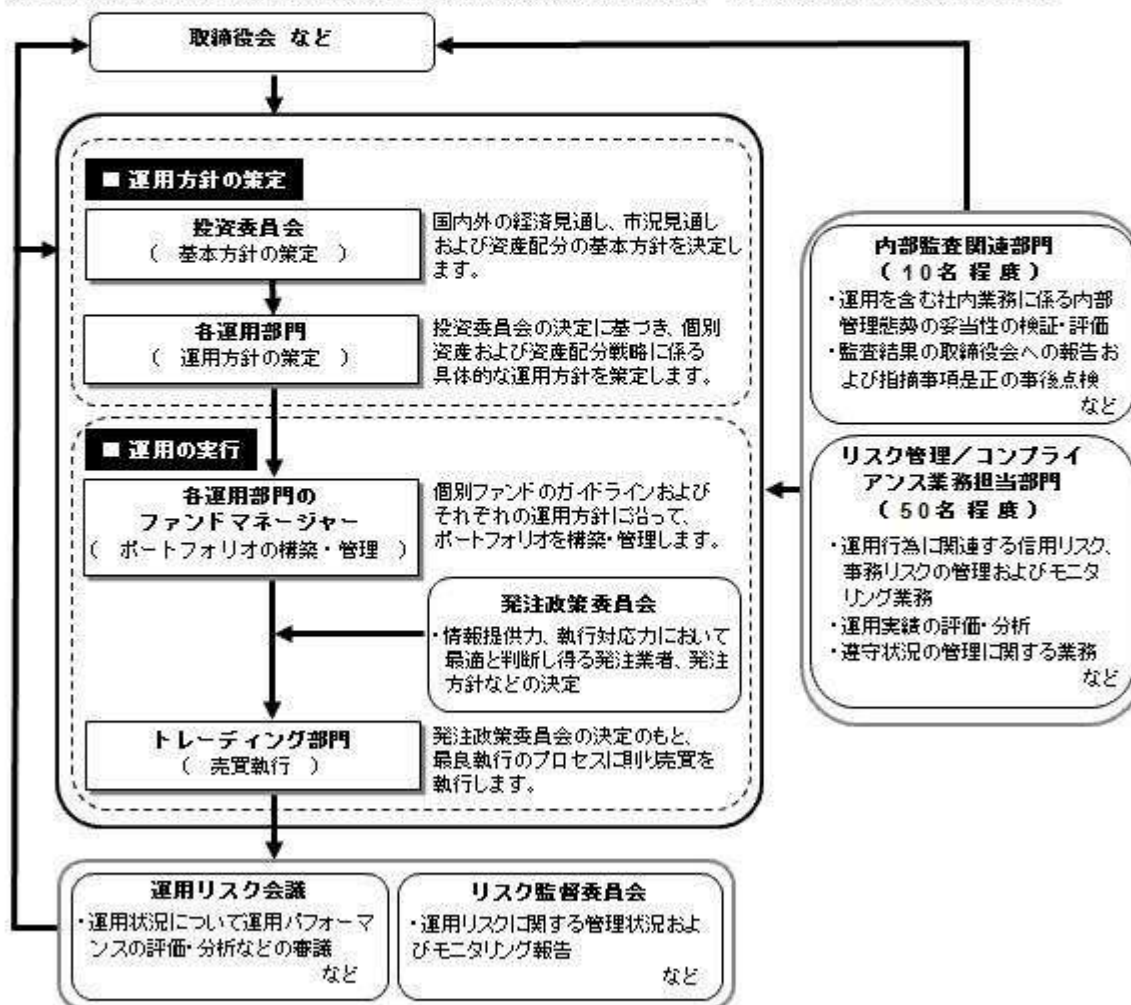
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はJPMorgan Chase & Co.に帰属します。また、JPMorgan Chase & Co.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

（３）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

上記体制は平成29年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

１）分配対象額の範囲

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

２）分配対象額についての分配方針

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

３）留保益の運用方針

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

収益分配金の支払い

<分配金再投資コース>

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

<分配金受取りコース>

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

（５）【投資制限】

約款に定める投資制限

<全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型>

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

の指図をすることができます。金利先渡し取引および為替先渡し取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
 - 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
 - 15) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て(解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
 - イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
 - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
 - ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の範囲内
 - ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
 - ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。
- 16) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
 - 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) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。)されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 4) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内と

します。

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

- 7) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 15) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 16) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

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

- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。以下同じ。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。また、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、投資することを指図することができるものとします。
- 3) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指

図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

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

可能なものについてはこの限りではありません。

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

ありません。

- 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 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) 株式（新株引受権証券、新株予約権証券および新株引受権付社債券を含みます。）への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 3) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 4) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期間が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 13) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

同一法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行なう投資信託全体で、当該株式の議決権

の過半数を保有することとなる取引は行ないません。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

流動性リスク

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

信用リスク

- ・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れや廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト（債務不履行）が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。
- ・一般に新興国の債券は、先進国の債券に比べて利回りが高い反面、価格変動が大きく、デフォルトが生じるリスクが高まる場合があります。
- ・格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。
- ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

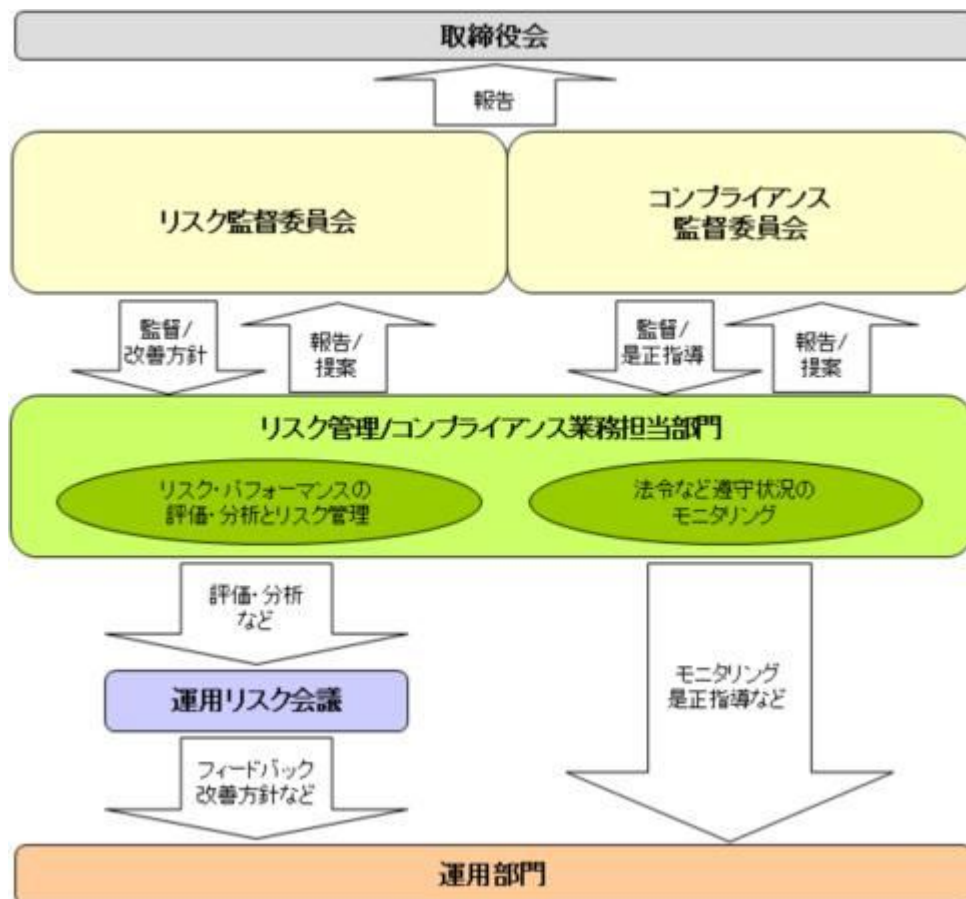
為替変動リスク

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

<その他の留意事項>

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

(2) リスク管理体制



全社リスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理/コンプライアンス業務担当部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況についてはコンプライアンス部門が事務局を務めるコンプライアンス監督委員会、リスク管理状況についてはリスク管理部門が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。両委員会およびそれに関連する部門別会議においては、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リスク会議に報告し、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。

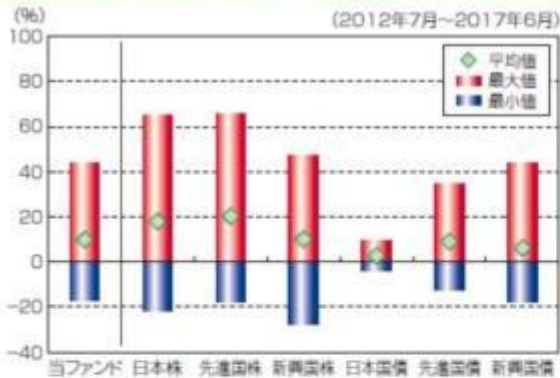
法令など遵守状況のモニタリング

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29年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	9.9%	18.0%	20.3%	10.0%	2.7%	9.0%	6.2%
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%	-4.0%	-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7月から2017年6月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株 …… 東証株価指数(TOPIX, 配当込)

先進国株 …… MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込, 円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

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7月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

日本国債 …… NOMURA-BPI国債

先進国債 …… シティ世界国債インデックス(除く日本, 円ベース)

新興国債 …… JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド(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】

（1）【申込手数料】

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

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

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

（2）【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

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

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

（3）【信託報酬等】

信託報酬

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

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

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

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

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

格付の取得に要する費用。

ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。

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

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

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

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

< 投資対象とするマザーファンドに係る費用 >

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

なりますので、表示することができません。

（５）【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

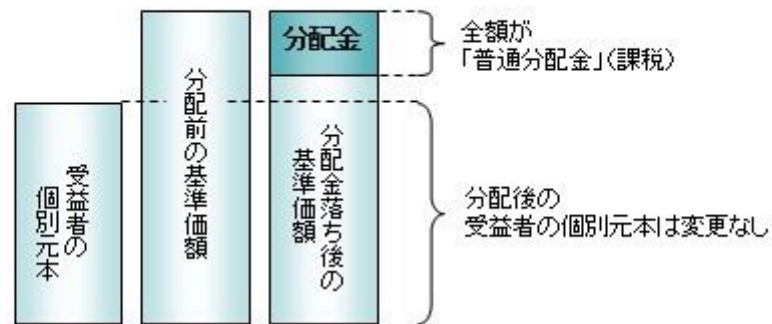
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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。

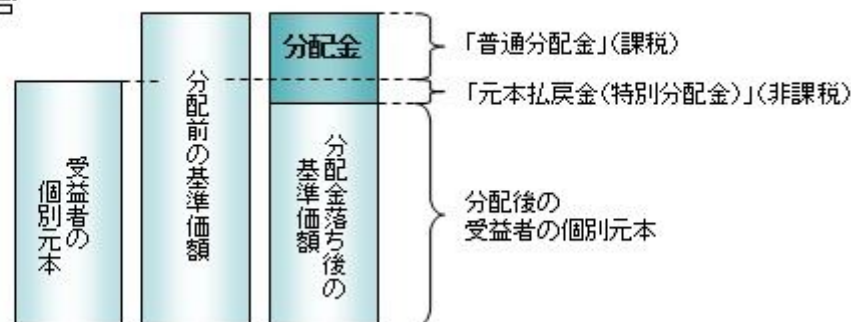
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<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 9月26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2017年 6月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	227,735,287	98.82
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		2,730,165	1.18
合計(純資産総額)		230,465,452	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	27,550,540	2.2202	61,167,709	2.2366	61,619,537	26.74
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	27,835,640	2.1949	61,096,447	2.2045	61,363,668	26.63
日本	親投資信託受益証券	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	27,167,287	1.6712	45,401,971	1.6836	45,738,844	19.85
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	34,791,589	1.2996	45,215,150	1.3064	45,451,731	19.72
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	4,813,455	1.4126	6,799,487	1.4140	6,806,225	2.95
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	4,889,463	1.3856	6,774,840	1.3816	6,755,282	2.93

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.82
合計	98.82

【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
第19特定期間末	(2017年 6月26日)	229	230	0.9813	0.9833
	2016年 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	
	2017年 1月末日	219		0.9424	
	2月末日	223		0.9500	
	3月末日	224		0.9573	
	4月末日	223		0.9598	
	5月末日	228		0.9737	
	6月末日	230		0.9866	

(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
第19特定期間	2016年12月27日～2017年 6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
第19特定期間	2016年12月27日～2017年 6月26日	5.14

(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
第19特定期間	2016年12月27日～2017年 6月26日	9,351,042	6,719,832

(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2017年 6月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	27,447,150,230	98.81
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		331,049,212	1.19
合計(純資産総額)		27,778,199,442	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	322,300,000	1.16

(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	142,000	6,018.91	854,685,540	5,893.00	836,806,000	3.01
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	873,400	538.89	470,666,811	754.80	659,242,320	2.37
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	92,500	4,741.38	438,578,100	5,310.00	491,175,000	1.77

日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	51,900	6,664.78	345,902,495	9,097.00	472,134,300	1.70
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	92,300	3,568.88	329,407,672	4,379.00	404,181,700	1.46
日本	株式	ソニー	電気機器	82,500	3,351.85	276,527,976	4,286.00	353,595,000	1.27
日本	株式	KDDI	情報・通信業	112,600	3,107.38	349,890,988	2,975.00	334,985,000	1.21
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	105,100	3,141.69	330,191,656	3,064.00	322,026,400	1.16
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,566,100	172.40	269,995,846	205.40	321,676,940	1.16
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	72,500	3,964.67	287,438,830	3,947.00	286,157,500	1.03
日本	株式	任天堂	その他製品	7,200	24,920.60	179,428,380	37,680.00	271,296,000	0.98
日本	株式	キーエンス	電気機器	5,300	39,072.16	207,082,500	49,340.00	261,502,000	0.94
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	45,800	4,830.98	221,259,228	5,709.00	261,472,200	0.94
日本	株式	ファナック	電気機器	11,800	19,786.71	233,483,215	21,655.00	255,529,000	0.92
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	22,600	9,448.68	213,540,240	10,745.00	242,837,000	0.87
日本	株式	キヤノン	電気機器	62,900	3,077.20	193,556,084	3,816.00	240,026,400	0.86
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	84,800	2,604.43	220,856,175	2,652.00	224,889,600	0.81
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	48,200	4,500.43	216,921,063	4,628.00	223,069,600	0.80
日本	株式	信越化学工業	化学	21,900	7,773.38	170,237,151	10,185.00	223,051,500	0.80
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	46,400	4,076.01	189,127,280	4,651.00	215,806,400	0.78
日本	株式	村田製作所	電気機器	12,300	14,541.63	178,862,095	17,070.00	209,961,000	0.76
日本	株式	パナソニック	電気機器	134,100	1,086.27	145,668,915	1,524.00	204,368,400	0.74
日本	株式	三菱商事	卸売業	86,500	2,358.34	203,996,848	2,356.00	203,794,000	0.73
日本	株式	花王	化学	30,500	5,777.19	176,204,409	6,672.00	203,496,000	0.73
日本	株式	三菱電機	電気機器	124,600	1,404.79	175,037,472	1,615.50	201,291,300	0.72
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	41,300	3,988.32	164,717,898	4,840.00	199,892,000	0.72
日本	株式	日立製作所	電気機器	280,000	529.15	148,162,490	689.40	193,032,000	0.69
日本	株式	ダイキン工業	機械	16,000	9,933.79	158,940,765	11,470.00	183,520,000	0.66
日本	株式	三菱地所	不動産業	85,700	2,042.29	175,025,022	2,093.50	179,412,950	0.65
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	9,700	17,540.10	170,139,000	18,310.00	177,607,000	0.64

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	0.31
		建設業	3.14
		食料品	4.54
		繊維製品	0.67
		パルプ・紙	0.26
		化学	6.92
		医薬品	4.56
		石油・石炭製品	0.48
		ゴム製品	0.98
		ガラス・土石製品	0.97

鉄鋼	1.19
非鉄金属	0.92
金属製品	0.70
機械	5.02
電気機器	13.02
輸送用機器	8.31
精密機器	1.58
その他製品	2.12
電気・ガス業	1.81
陸運業	4.16
海運業	0.21
空運業	0.56
倉庫・運輸関連業	0.20
情報・通信業	7.95
卸売業	4.33
小売業	4.64
銀行業	8.00
証券、商品先物取引業	1.10
保険業	2.51
その他金融業	1.28
不動産業	2.44
サービス業	3.83
合計	98.81

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09月	買建	20	日本円	321,615,800	322,300,000	1.16

(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2017年 6月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
-------	------	---------	---------

出資金	アメリカ	5,843,598	0.01
株式	アメリカ	46,709,718,781	59.10
	カナダ	2,988,550,216	3.78
	モーリシャス	4,013,256	0.01
	ドイツ	3,043,646,471	3.85
	イタリア	617,679,698	0.78
	フランス	3,004,107,484	3.80
	オランダ	1,448,078,149	1.83
	スペイン	1,113,216,560	1.41
	ベルギー	360,923,931	0.46
	オーストリア	77,994,239	0.10
	ルクセンブルク	97,116,118	0.12
	フィンランド	316,938,314	0.40
	アイルランド	1,274,564,052	1.61
	ポルトガル	46,999,910	0.06
	イギリス	5,284,755,085	6.69
	スイス	2,982,661,787	3.77
	スウェーデン	913,231,646	1.16
	ノルウェー	189,998,716	0.24
	デンマーク	560,959,857	0.71
	ケイマン	196,367,977	0.25
	オーストラリア	2,044,274,649	2.59
	バミューダ	222,906,985	0.28
	ニュージーランド	60,066,083	0.08
	香港	842,824,036	1.07
	シンガポール	618,706,329	0.78
	イスラエル	180,063,898	0.23
	ジャージー	396,067,174	0.50
英ヴァージン諸島	14,114,352	0.02	
	小計	75,610,545,753	95.67
投資証券	アメリカ	1,552,994,802	1.97
	カナダ	11,520,609	0.01
	フランス	110,420,533	0.14
	イギリス	76,241,083	0.10
	オーストラリア	218,319,360	0.28
	香港	41,259,120	0.05
	シンガポール	31,087,867	0.04
	小計	2,041,843,374	2.58
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,372,239,687	1.74
合計（純資産総額）		79,030,472,412	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,016,400,000	1.29
	買建	ドイツ	300,025,665	0.38

(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		898,772,000	1.14
	売建		44,789,500	0.06

(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	108,212	13,244.00	1,433,159,728	16,092.16	1,741,364,818	2.20
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	151,684	6,830.88	1,036,135,202	7,670.88	1,163,549,762	1.47
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	8,365	93,540.15	782,463,438	109,304.15	914,329,298	1.16
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	55,931	12,763.51	713,876,437	14,855.67	830,893,038	1.05
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	48,330	14,816.47	716,080,478	16,916.47	817,573,478	1.03
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	85,471	9,712.63	830,149,053	9,038.39	772,521,086	0.98
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	73,810	7,705.60	568,750,336	10,208.80	753,511,528	0.95
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	6,442	90,459.04	582,737,136	102,792.47	662,189,156	0.84
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	6,120	92,797.60	567,921,312	105,035.84	642,819,341	0.81
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	64,293	8,440.02	542,634,591	9,792.06	629,561,492	0.80
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	98,300	5,120.64	503,358,912	6,247.36	614,115,488	0.78
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	206,549	1,872.63	386,791,919	2,723.83	562,606,428	0.71
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	179,773	3,208.80	576,855,603	3,026.24	544,036,244	0.69
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	126,537	4,110.39	520,117,684	4,213.43	533,156,057	0.67
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	52,669	9,740.63	513,029,768	9,742.88	513,147,747	0.65
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	25,320	16,097.75	407,595,283	18,961.60	480,107,712	0.61

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	122,600	3,615.36	443,243,136	3,766.56	461,780,256	0.58
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	39,081	11,286.24	441,077,546	11,661.44	455,740,737	0.58
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	46,163	8,492.70	392,048,649	9,417.47	434,738,991	0.55
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	25,340	13,814.07	350,048,787	17,041.92	431,842,253	0.55
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	57,117	5,554.07	317,232,387	7,501.76	428,478,026	0.54
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	409,061	912.64	373,327,640	1,043.12	426,702,757	0.54
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア	97,474	3,613.12	352,185,259	4,353.44	424,347,211	0.54
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	84,002	4,764.48	400,225,849	5,020.96	421,770,682	0.53
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	32,088	10,816.95	347,094,612	13,112.95	420,768,660	0.53
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	14,518	26,713.09	387,820,670	28,902.11	419,600,891	0.53
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	84,267	5,358.08	451,509,328	4,973.92	419,137,317	0.53
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	19,860	16,103.35	319,812,729	20,750.23	412,099,766	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	56,783	6,938.40	393,983,168	7,206.08	409,182,841	0.52
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	38,302	9,187.36	351,894,263	10,575.03	405,045,182	0.51

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	6.40
		素材	4.65
		資本財	7.49
		商業・専門サービス	0.98
		運輸	2.01
		自動車・自動車部品	1.45
		耐久消費財・アパレル	1.72
		消費者サービス	1.86
		メディア	2.52
		小売	3.81
		食品・生活必需品小売り	1.78
		食品・飲料・タバコ	5.75
		家庭用品・パーソナル用品	2.15
		ヘルスケア機器・サービス	4.17
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.71		

	銀行	9.62
	各種金融	4.29
	保険	4.22
	不動産	0.55
	ソフトウェア・サービス	9.47
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.80
	電気通信サービス	2.63
	公益事業	3.19
	半導体・半導体製造装置	2.45
投資証券		2.58
合計		98.26

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 EMINI1709	買建	75	米ドル	9,117,200	1,021,126,400	9,075,000	1,016,400,000	1.29
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1709	買建	75	ユーロ	2,385,000	305,208,450	2,344,500	300,025,665	0.38

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	6,150,000.00	684,202,700	687,580,500	0.87
	ユーロ	買建	1,650,000.00	205,741,415	211,191,500	0.27
	ユーロ	売建	350,000.00	44,520,175	44,789,500	0.06

(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2017年6月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	37,816,464	0.31
	メキシコ	412,396,244	3.33

	ブラジル	763,059,052	6.16
	チリ	131,485,089	1.06
	コロンビア	51,919,833	0.42
	ペルー	42,738,897	0.34
	トルコ	131,038,381	1.06
	チェコ	20,750,777	0.17
	ハンガリー	37,465,575	0.30
	ポーランド	153,416,233	1.24
	ロシア	369,053,894	2.98
	ケイマン	941,969,297	7.60
	バミューダ	83,752,627	0.68
	香港	481,377,794	3.88
	マレーシア	278,554,160	2.25
	タイ	254,043,938	2.05
	フィリピン	136,981,372	1.11
	インドネシア	285,634,272	2.30
	韓国	1,823,994,331	14.72
	台湾	1,445,852,022	11.67
	中国	1,739,299,064	14.03
	インド	1,030,117,480	8.31
	パキスタン	14,883,643	0.12
	カタール	75,365,849	0.61
	エジプト	15,293,352	0.12
	南アフリカ	722,745,393	5.83
	アラブ首長国連邦	85,663,632	0.69
	小計	11,566,668,665	93.33
投資信託受益証券	アメリカ	46,712,400	0.38
投資証券	メキシコ	12,027,900	0.10
	トルコ	5,419,125	0.04
	南アフリカ	41,195,233	0.33
	小計	58,642,258	0.47
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		721,445,123	5.82
合計（純資産総額）		12,393,468,446	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	724,061,520	5.84

(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		78,035,000	0.63

(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 (%)
中国	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	126,000	3,718.71	468,558,499	4,075.40	513,500,400	4.14
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	2,165	226,120.49	489,550,882	235,145.69	509,090,440	4.11
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	547,355	758.20	415,008,578	772.80	422,995,944	3.41
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP-ADR	ソフトウェア・サービス	25,050	13,625.67	341,323,088	15,770.72	395,056,536	3.19
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	9,740	23,483.01	228,724,544	21,955.32	213,844,893	1.73
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,873,920	92.96	174,213,397	87.24	163,495,772	1.32
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	136,700	1,227.20	167,758,822	1,192.48	163,012,700	1.32
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	382.72	133,096,621	437.92	152,293,249	1.23
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA - H	銀行	1,636,575	73.90	120,946,984	75.76	124,000,015	1.00
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	ソフトウェア・サービス	6,020	20,847.67	125,503,033	20,118.55	121,113,731	0.98
中国	株式	BANK OF CHINA LTD - H	銀行	1,784,000	55.82	99,585,556	55.10	98,305,536	0.79
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	33,675	2,734.90	92,097,780	2,856.34	96,187,586	0.78
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	銀行	70,436	1,365.76	96,199,164	1,237.32	87,152,146	0.70
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	114,000	671.58	76,560,120	749.78	85,475,775	0.69
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	12,630	5,454.36	68,888,567	6,719.85	84,871,706	0.68
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	405	173,017.81	70,072,217	186,390.00	75,487,950	0.61
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	62,880	1,393.27	87,609,446	1,139.60	71,658,048	0.58
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	28,946	2,352.17	68,086,058	2,437.22	70,547,915	0.57
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	15,400	4,505.76	69,388,704	4,424.00	68,129,600	0.55
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	電気通信サービス	750,800	91.78	68,911,276	89.17	66,953,040	0.54
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	107,400	666.29	71,559,584	618.49	66,426,095	0.54
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	40,140	1,665.21	66,841,630	1,627.85	65,341,899	0.53
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PRF	銀行	66,486	1,084.47	72,102,737	937.05	62,301,271	0.50

ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	ソフトウェア・サービス	1,770	31,836.00	56,349,720	33,835.20	59,888,304	0.48
中国	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	169,000	357.89	60,483,577	344.40	58,203,600	0.47
ロシア	株式	GAZPROM PAO-SPON ADR	エネルギー	121,700	516.20	62,822,514	446.88	54,385,296	0.44
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車部品	3,430	15,107.40	51,818,382	15,794.10	54,173,763	0.44
韓国	株式	NAVER CORP	ソフトウェア・サービス	628	82,305.89	51,688,105	83,679.29	52,550,600	0.42
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON-ADR	エネルギー	9,535	5,706.40	54,410,524	5,450.47	51,970,326	0.42
韓国	株式	KB FINANCIAL GROUP INC	銀行	8,905	5,311.34	47,297,506	5,670.18	50,492,953	0.41

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	6.17
		素材	6.55
		資本財	3.68
		商業・専門サービス	0.11
		運輸	1.59
		自動車・自動車部品	3.30
		耐久消費財・アパレル	1.19
		消費者サービス	1.04
		メディア	2.24
		小売	2.04
		食品・生活必需品小売り	1.63
		食品・飲料・タバコ	3.56
		家庭用品・パーソナル用品	1.16
		ヘルスケア機器・サービス	0.59
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.68
		銀行	16.24
		各種金融	2.54
		保険	3.23
		不動産	2.06
		ソフトウェア・サービス	11.35
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.72		
電気通信サービス	5.00		
公益事業	2.46		
半導体・半導体製造装置	5.17		
投資信託受益証券			0.38
投資証券			0.47
合計			94.18

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	MINMSCIE1709	買建	129	米ドル	6,500,675	728,075,600	6,464,835	724,061,520	5.84

(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	韓国ウォン	買建	400,000,000.00	39,164,000	39,240,000	0.32
	台湾ドル	買建	6,500,000.00	23,935,275	23,920,000	0.19
	インドルピー	買建	8,500,000.00	14,701,600	14,875,000	0.12

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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2017年 6月30日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	27,494,348,215	75.51
地方債証券	日本	2,819,801,270	7.74
特殊債券	日本	4,322,936,000	11.87
社債券	日本	1,379,214,000	3.79
	オーストラリア	301,021,000	0.83
	小計	1,680,235,000	4.61
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		92,610,790	0.25
合計(純資産総額)		36,409,931,275	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341回利付国債(10年)	750,000,000	102.72	770,438,100	102.23	766,770,000	0.300	2025/12/20	2.11

日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	581,000,000	104.75	608,603,310	103.32	600,329,870	1.400	2019/9/20	1.65
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	560,000,000	101.19	566,686,400	100.57	563,242,400	0.100	2020/6/20	1.55
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	505,000,000	101.11	510,605,500	100.52	507,671,450	0.100	2020/3/20	1.39
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	490,000,000	100.61	493,003,500	100.28	491,416,100	0.100	2027/3/20	1.35
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	473,000,000	104.83	495,845,900	103.44	489,285,390	1.300	2019/12/20	1.34
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	420,000,000	103.55	434,939,100	103.07	432,906,600	0.400	2025/9/20	1.19
日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	410,000,000	103.70	425,186,400	102.42	419,934,300	1.300	2019/3/20	1.15
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	370,000,000	106.66	394,675,300	105.13	388,995,800	1.300	2021/3/20	1.07
日本	国債証券	第29回利付国債(30年)	276,000,000	141.98	391,864,800	134.76	371,937,600	2.400	2038/9/20	1.02
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	300,000,000	123.07	369,210,000	120.07	360,219,000	2.300	2026/6/20	0.99
日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	290,000,000	126.67	367,348,800	123.09	356,966,800	2.100	2029/9/20	0.98
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	280,000,000	124.35	348,191,200	120.19	336,543,200	1.700	2032/9/20	0.92
日本	国債証券	第120回利付国債(5年)	330,000,000	101.26	334,184,400	100.66	332,194,500	0.200	2019/9/20	0.91
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	325,000,000	101.25	329,085,250	100.61	326,989,000	0.100	2020/9/20	0.90
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	295,000,000	109.92	324,264,000	107.94	318,431,850	1.400	2022/12/20	0.87
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	300,000,000	104.42	313,262,000	103.02	309,060,000	0.400	2025/6/20	0.85
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	300,000,000	101.04	303,135,000	100.48	301,443,000	0.100	2019/12/20	0.83
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	250,000,000	123.55	308,887,500	120.52	301,312,500	2.300	2026/9/20	0.83
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	99.98	299,961,000	0.001	2018/11/20	0.82
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	208,000,000	137.09	285,147,200	131.94	274,445,600	2.400	2034/3/20	0.75
日本	国債証券	第34回利付国債(30年)	200,000,000	139.96	279,923,200	132.52	265,046,000	2.200	2041/3/20	0.73
日本	国債証券	第50回利付国債(20年)	237,000,000	109.34	259,135,800	107.37	254,483,490	1.900	2021/3/22	0.70
日本	国債証券	第149回利付国債(20年)	215,000,000	121.63	261,517,400	117.37	252,364,850	1.500	2034/6/20	0.69
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	230,000,000	106.69	245,403,100	105.01	241,543,700	0.800	2023/6/20	0.66
日本	国債証券	第137回利付国債(20年)	200,000,000	124.16	248,320,000	120.13	240,264,000	1.700	2032/6/20	0.66
日本	国債証券	第43回利付国債(30年)	195,000,000	132.35	258,098,100	122.26	238,416,750	1.700	2044/6/20	0.65
日本	国債証券	第141回利付国債(20年)	195,000,000	124.53	242,835,450	120.33	234,647,400	1.700	2032/12/20	0.64
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	230,000,000	100.57	231,331,600	100.32	230,756,700	0.100	2026/12/20	0.63
日本	国債証券	第290回利付国債(10年)	226,000,000	101.24	228,810,982	101.24	228,810,982	1.400	2018/3/20	0.63

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
----	---------

国債証券	75.51
地方債証券	7.74
特殊債券	11.87
社債券	4.61
合 計	99.75

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2017年 6月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	68,356,098,932	43.27
	カナダ	3,290,615,387	2.08
	メキシコ	1,468,443,371	0.93
	ドイツ	11,365,935,306	7.19
	イタリア	15,148,374,068	9.59
	フランス	15,537,083,116	9.83
	オランダ	3,506,137,154	2.22
	スペイン	8,861,064,858	5.61
	ベルギー	4,012,812,049	2.54
	オーストリア	2,358,340,986	1.49
	フィンランド	985,243,416	0.62
	アイルランド	1,287,159,308	0.81
	イギリス	11,206,170,575	7.09
	スイス	295,928,713	0.19
	スウェーデン	759,423,856	0.48
	ノルウェー	448,005,653	0.28
	デンマーク	970,169,642	0.61
	ポーランド	1,043,434,100	0.66
	オーストラリア	3,392,061,316	2.15
	シンガポール	618,900,213	0.39
マレーシア	671,276,380	0.42	

	南アフリカ	861,529,668	0.55
	小計	156,444,208,067	99.02
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,543,262,327	0.98
合計（純資産総額）		157,987,470,394	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		72,663,400	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	14,864.94	1,707,981,882	14,136.94	1,624,334,682	8.000	2021/11/15	1.03
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,780,000	11,989.02	1,292,417,305	11,709.90	1,262,327,479	3.375	2019/11/15	0.80
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,270,000	12,126.24	1,245,364,848	11,819.05	1,213,817,216	3.625	2020/2/15	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,100,000	11,849.60	1,078,313,600	11,568.59	1,052,741,872	3.750	2018/11/15	0.67
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,830,000	11,338.90	1,001,225,082	11,228.00	991,432,400	1.500	2018/12/31	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,530,000	11,840.64	1,010,006,592	11,538.18	984,207,095	4.000	2018/8/15	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,340,000	11,474.53	956,976,169	11,315.05	943,675,804	2.250	2018/7/31	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,830,000	12,126.24	949,484,592	11,826.05	925,980,310	3.500	2020/5/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,150,000	11,362.74	926,063,897	11,055.18	900,997,496	1.750	2023/5/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,450,000	11,439.68	852,256,160	11,286.18	840,820,708	1.750	2019/9/30	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,130,000	11,544.96	823,155,648	11,227.77	800,540,429	2.000	2023/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	11,485.90	804,013,168	11,322.71	792,590,288	2.375	2018/6/30	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,900,000	11,526.67	795,340,896	11,428.37	788,558,165	2.250	2021/7/31	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,610,000	14,379.68	806,700,048	13,652.18	765,887,522	8.750	2020/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,400,000	11,631.37	744,408,269	11,375.43	728,027,955	2.125	2021/6/30	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,030,000	12,325.60	743,233,680	11,976.33	722,173,254	3.625	2021/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	12,667.15	747,362,156	11,889.28	701,467,614	3.125	2044/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,350,000	13,830.90	739,953,278	12,942.12	692,403,762	3.625	2043/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,930,000	11,705.09	694,112,288	11,290.77	669,543,017	2.250	2024/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,940,000	11,687.59	694,242,964	11,234.33	667,319,748	2.250	2025/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	11,923.18	691,544,672	11,501.66	667,096,326	2.500	2024/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	12,083.53	700,844,995	11,361.66	658,976,326	2.875	2043/5/15	0.42
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4,000,000	16,790.86	671,634,676	16,126.45	645,058,379	4.250	2023/10/25	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	11,900.87	654,548,048	11,519.59	633,577,560	2.500	2023/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,520,000	11,229.97	619,894,410	11,173.97	616,803,210	1.000	2018/5/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,170,000	12,121.59	626,686,306	11,798.71	609,993,741	3.125	2021/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,370,000	11,549.44	620,204,928	11,350.50	609,522,151	2.000	2020/7/31	0.39
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4,300,000	14,469.56	622,191,419	14,056.97	604,450,132	3.750	2019/10/25	0.38

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	12,079.81	640,230,248	11,317.25	599,814,398	2.875	2045/8/15	0.38
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,080,000	20,777.20	639,938,044	19,326.22	595,247,618	5.500	2029/4/25	0.38

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.02
合計	99.02

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	英ポンド	売建	401,000.00	58,410,747	58,454,770	0.04
	ポーランドズロチ	売建	191,000.00	5,761,515	5,754,830	0.00
	南アフリカランド	売建	983,000.00	8,456,749	8,453,800	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

海外新興国債券インデックスLocal(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2017年6月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アルゼンチン	37,588,535	1.22
	メキシコ	314,437,510	10.17
	ブラジル	302,910,031	9.80
	チリ	56,448,678	1.83
	コロンビア	213,257,309	6.90
	ペルー	70,610,604	2.28
	トルコ	245,724,525	7.95
	チェコ	74,375,226	2.41
	ハンガリー	131,185,494	4.24
	ポーランド	302,554,341	9.79
	ロシア	186,159,899	6.02
	ルーマニア	88,662,512	2.87
	マレーシア	207,399,937	6.71

	タイ	217,304,803	7.03
	フィリピン	11,544,000	0.37
	インドネシア	295,054,371	9.55
	南アフリカ	257,372,019	8.33
	小計	3,012,589,794	97.46
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		78,566,018	2.54
合計（純資産総額）		3,091,155,812	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		28,445,158	0.92
	売建		9,236,001	0.30

(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 (%)
チリ	国債証券	REPUBLIC OF CHILE	315,000,000	17.92	56,471,510	17.92	56,448,678	5.500	2020/8/5	1.83
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,800,000	963.94	46,269,461	958.91	46,027,878	10.500	2026/12/21	1.49
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	1,690,000	2,545.55	43,019,851	2,551.57	43,121,668		2020/7/1	1.40
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	1,200,000	3,424.51	41,094,175	3,384.88	40,618,579	10.000	2021/1/1	1.31
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	1,200,000	3,414.01	40,968,154	3,340.14	40,081,761	10.000	2023/1/1	1.30
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	865,000,000	4.48	38,810,143	4.46	38,619,512	10.000	2024/7/24	1.25
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	930,000,000	3.96	36,898,201	3.91	36,445,423	7.500	2026/8/26	1.18
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,910,000	724.97	35,596,225	741.27	36,396,770	10.000	2024/12/5	1.18
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,850,000	608.97	35,625,010	619.89	36,263,853	6.500	2021/6/10	1.17
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,220,000	352.22	35,997,808	354.29	36,208,697	3.650	2021/12/17	1.17
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,150,000	344.50	34,967,436	343.67	34,883,284	3.875	2019/6/13	1.13
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	1,110,000	2,953.51	32,784,001	2,979.60	33,073,659		2019/1/1	1.07
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	1,100,000	2,880.82	31,689,092	2,909.79	32,007,750		2019/4/1	1.04
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	3,450,000,000	0.90	31,071,748	0.91	31,514,910	8.375	2024/3/15	1.02
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	3,290,000,000	0.91	30,095,604	0.92	30,565,416	8.375	2026/9/15	0.99

タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	7,580,000	394.54	29,906,264	400.15	30,331,460	4.875	2029/6/22	0.98
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	775,000,000	3.82	29,644,907	3.83	29,709,329	7.000	2022/5/4	0.96
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	890,000	3,362.37	29,925,154	3,300.15	29,371,394	10.000	2025/1/1	0.95
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,790,000	777.05	29,450,293	772.49	29,277,646	8.750	2048/2/28	0.95
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,570,000	592.55	27,079,626	599.45	27,394,937	5.000	2019/12/11	0.89
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,260,000	635.65	27,078,950	635.80	27,085,416	8.500	2018/12/13	0.88
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,180,000	636.59	26,609,783	644.99	26,960,582	8.000	2020/6/11	0.87
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,000,000	637.78	25,511,468	660.18	26,407,349	7.750	2042/11/13	0.85
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	625,000,000	4.21	26,312,982	4.22	26,394,066	11.000	2020/7/24	0.85
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	950,000	2,685.44	25,511,716	2,692.56	25,579,325		2020/1/1	0.83
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	870,000	2,840.39	24,711,423	2,842.50	24,729,779	2.500	2026/7/25	0.80
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	6,570,000	359.72	23,634,104	365.71	24,027,481	3.850	2025/12/12	0.78
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	820,000	2,908.96	23,853,489	2,927.49	24,005,485	1.750	2021/7/25	0.78
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	780,000	3,037.20	23,690,221	3,036.60	23,685,519	3.250	2025/7/25	0.77
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	2,600,000,000	0.88	23,063,040	0.90	23,543,520	8.375	2034/3/15	0.76

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.46
合計	97.46

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	買建	80,000.00	8,956,000	8,957,600	0.29
	チリペソ	買建	54,647,230.00	9,267,345	9,197,128	0.30
	トルコリラ	買建	141,000.00	4,506,783	4,475,340	0.14
	ポーランドズロチ	買建	193,000.00	5,837,864	5,815,090	0.19
	米ドル	売建	82,486.39	9,267,345	9,236,001	0.30

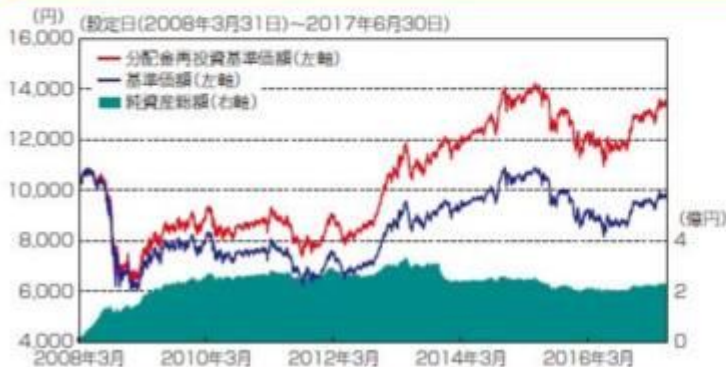
(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

参考情報

運用実績

2017年6月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額……………9,866円
純資産総額……………2.30億円

※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)

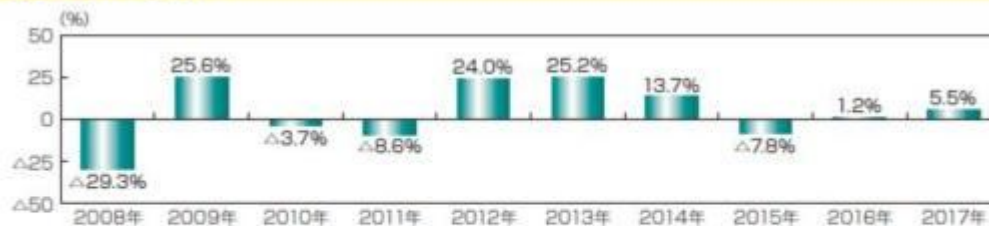
2017年2月	2017年3月	2017年4月	2017年5月	2017年6月	直近1年間累計	設定来累計
20円	20円	20円	20円	20円	240円	2,620円

主要な資産の状況

組入資産	投資対象	比率 ^{※1}	組入上位銘柄	国・地域名	比率 ^{※2}
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	日本株式	3.0%	トヨタ自動車	日本	3.0%
			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%
			ソフトバンクグループ	日本	1.7%
			三井住友フィナンシャルグループ	日本	1.5%
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI(ヘッジなし) マザーファンド	海外先進国株式	26.6%	APPLE INC	アメリカ	2.2%
			MICROSOFT CORP	アメリカ	1.5%
			AMAZON.COM INC	アメリカ	1.2%
			JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	1.1%
			FACEBOOK INC-A	アメリカ	1.0%
海外新興国株式インデックス MSCIエマージング(ヘッジなし) マザーファンド	新興国株式	19.8%	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	4.1%
			SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	4.1%
			TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	3.4%
			ALIBABA GROUP HOLDING-SP-ADR	ケイマン諸島	3.2%
			NASPERS LTD-N SHS	南アフリカ	1.7%
日本債券インデックス マザーファンド	日本債券	2.9%	第341回利付国債(10年)	日本	2.1%
			第303回利付国債(10年)	日本	1.7%
			第124回利付国債(5年)	日本	1.6%
			第123回利付国債(5年)	日本	1.4%
			第346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	26.7%	US TREASURY N/B(クーポン8%)	アメリカ	1.0%
			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1.5%)	アメリカ	0.6%
海外新興国債券インデックス Local(ヘッジなし) マザーファンド	新興国債券	19.7%	REPUBLIC OF CHILE(クーポン5.5%)	チリ	1.8%
			REPUBLIC OF SOUTH AFRICA(クーポン10.5%)	南アフリカ	1.5%
			LETRA TESOURO NACIONAL(クーポンなし)	ブラジル	1.4%
			NOTA DO TESOURO NACIONAL(クーポン10%)	ブラジル	1.3%
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。

※2017年は、2017年6月末までの騰落率です。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

(2) コースの選択

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

＜分配金再投資コース＞

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

＜分配金受取りコース＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

(3) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(4) 取扱時間

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

(5) 取得申込不可日

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

(6) 申込金額

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

(7) 申込単位

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

＜委託会社の照会先＞

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(8) 申込代金の支払い

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

(9) 受付の中止および取消

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、投資対象

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

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

(10) 償還乗換

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

(11) 乗換優遇

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

2【換金(解約)手続等】

<解約請求による換金>

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約請求不可日

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

(4) 解約制限

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

(5) 解約価額

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

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時~午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(6) 手取額

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

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

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(7) 解約単位

1口単位

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

(8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(9) 受付の中止および取消

- ・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少など、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
- ・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

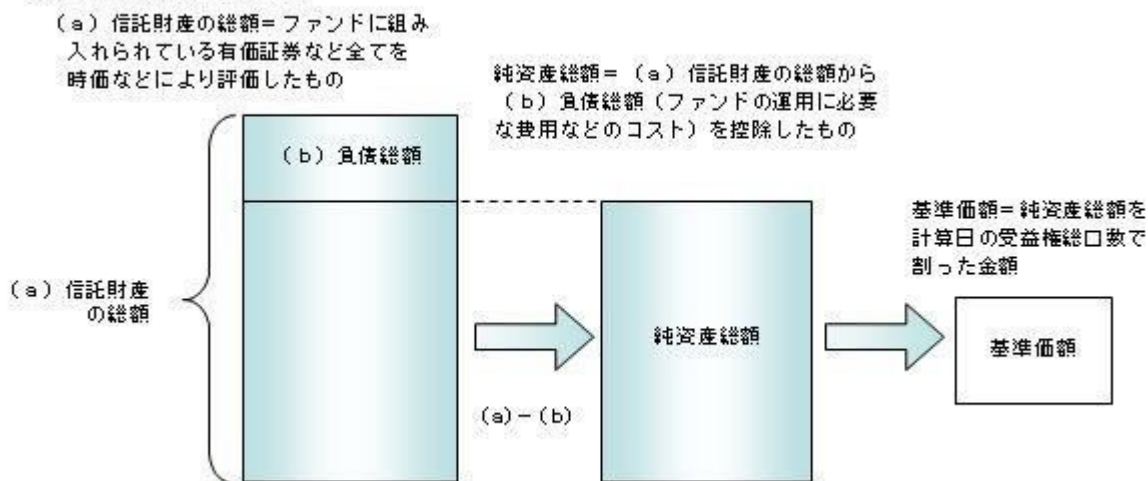
3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

外国株式

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

公社債（国内・外国）

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

- ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
 - ・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）
 - ・価格情報会社の提供する価額
- 残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。

^{*}外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

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

（4）【計算期間】

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

（5）【その他】

信託の終了（繰上償還）

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

償還金について

 - ・償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場

合は翌営業日）から起算して5営業日まで）から受益者に支払います。

- ・償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

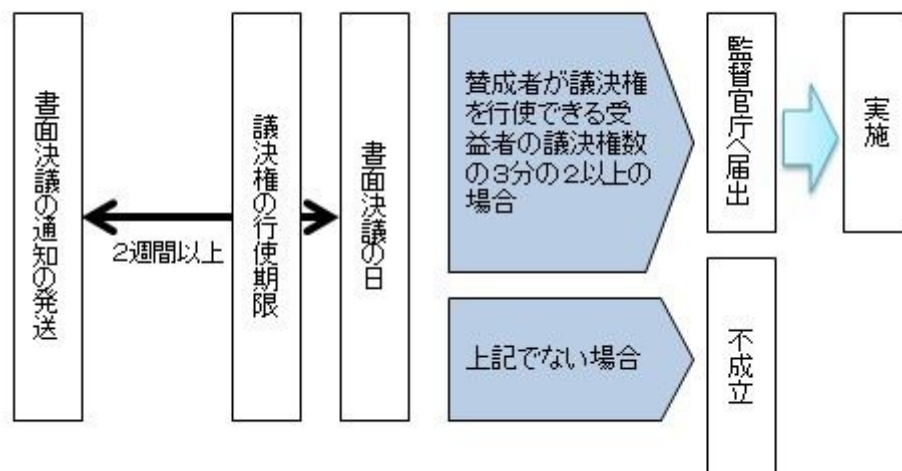
信託約款の変更など

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

書面決議

- 1) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に対して、委託会社は書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにその内容および理由などの事項を定め、決議の日の2週間前までに知っている受益者に対し書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- 2) 受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、書面決議について賛成するものとみなします。
- 3) 書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
- 4) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に関する委託会社の提案に対して、すべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときは、書面決議を行ないません。
- 5) 当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、併合にかかる他のファンドにおいて併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
- 6) 当ファンドは、受益者からの換金請求に対して、投資信託契約の一部を解約することにより応じることができるため、受益者の保護に欠けるおそれがないものとして、書面決議において反対した受益者からの買取請求は受け付けません。

<書面決議の主な流れ>



公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

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

運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

関係法人との契約について

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

他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は、6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、平成28年12月27日から平成29年6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12月26日現在	当期 平成29年 6月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,296,809	3,392,904
親投資信託受益証券	216,206,872	227,067,341
未収入金	2,514,248	-
流動資産合計	222,017,929	230,460,245
資産合計	222,017,929	230,460,245
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	462,812	468,075
未払解約金	2,529,924	-
未払受託者報酬	10,035	10,858
未払委託者報酬	200,874	217,355
未払利息	2	5
その他未払費用	196,837	106,815
流動負債合計	3,400,484	803,108
負債合計	3,400,484	803,108
純資産の部		
元本等		
元本	231,406,445	234,037,655
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	12,789,000	4,380,518
（分配準備積立金）	53,254,496	51,713,121
元本等合計	218,617,445	229,657,137
純資産合計	218,617,445	229,657,137
負債純資産合計	222,017,929	230,460,245

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期		当期	
	自	平成28年 6月28日 平成28年12月26日	自	平成28年12月27日 平成29年 6月26日
営業収益				
有価証券売買等損益		32,041,764		12,766,295
営業収益合計		32,041,764		12,766,295
営業費用				
支払利息		428		536
受託者報酬		55,254		60,278
委託者報酬		1,106,344		1,206,817
その他費用		102,310		111,610
営業費用合計		1,264,336		1,379,241
営業利益又は営業損失（ ）		30,777,428		11,387,054
経常利益又は経常損失（ ）		30,777,428		11,387,054
当期純利益又は当期純損失（ ）		30,777,428		11,387,054
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（ ）		192,705		56,045
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		40,613,739		12,789,000
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,091,290		322,646
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,091,290		322,646
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		1,056,717		435,485
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		1,056,717		435,485
分配金		2,794,557		2,809,688
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		12,789,000		4,380,518

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎月26日から翌月25日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当特定期間は平成28年12月27日から平成29年 6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 平成28年12月26日現在	当期 平成29年 6月26日現在
1.	期首元本額	232,471,235円	231,406,445円
	期中追加設定元本額	8,626,944円	9,351,042円
	期中一部解約元本額	9,691,734円	6,719,832円
2.	受益権の総数	231,406,445口	234,037,655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	12,789,000円	4,380,518円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 平成28年 6月28日 至 平成28年12月26日		当期 自 平成28年12月27日 至 平成29年 6月26日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
自 平成28年 6月28日 至 平成28年 7月25日		自 平成28年12月27日 至 平成29年 1月25日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	578,351円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 223,823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	17,517,965円	C 信託約款に定める収益調整金 19,473,999円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	55,180,678円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 53,105,888円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	73,276,994円	E 分配対象収益 (A+B+C+D) 72,803,710円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,152円	F 分配対象収益(1万口当たり) 3,136円
G	分配金額	464,882円	G 分配金額 464,259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 7月26日 至 平成28年 8月25日		自 平成29年 1月26日 至 平成29年 2月27日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	331,970円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 561,685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	17,826,336円	C	信託約款に定める収益調整金	20,360,264円
D	信託約款に定める分配準備積立金	54,807,882円	D	信託約款に定める分配準備積立金	52,794,359円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	72,966,188円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	73,716,308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)	3,140円
G	分配金額	463,712円	G	分配金額	469,468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 8月26日			自 平成29年 2月28日	
	至 平成28年 9月26日			至 平成29年 3月27日	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	403,243円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	316,327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	18,274,280円	C	信託約款に定める収益調整金	20,605,226円
D	信託約款に定める分配準備積立金	54,653,179円	D	信託約款に定める分配準備積立金	52,530,094円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	73,330,702円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	73,451,647円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,144円	F	分配対象収益(1万口当たり)	3,134円
G	分配金額	466,420円	G	分配金額	468,726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 9月27日			自 平成29年 3月28日	
	至 平成28年10月25日			至 平成29年 4月25日	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	459,280円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	476,026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	18,629,035円	C	信託約款に定める収益調整金	20,981,828円
D	信託約款に定める分配準備積立金	54,321,018円	D	信託約款に定める分配準備積立金	52,314,582円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	73,409,333円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	73,772,436円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,144円	F	分配対象収益(1万口当たり)	3,134円
G	分配金額	466,950円	G	分配金額	470,727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10月26日			自 平成29年 4月26日	
	至 平成28年11月25日			至 平成29年 5月25日	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	489,044円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	668,252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	19,072,102円	C	信託約款に定める収益調整金	21,165,785円
D	信託約款に定める分配準備積立金	54,313,348円	D	信託約款に定める分配準備積立金	51,784,382円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	73,874,494円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	73,618,419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)	3,143円
G	分配金額	469,781円	G	分配金額	468,433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11月26日 至 平成28年12月26日		自 平成29年 5月26日 至 平成29年 6月26日	
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	489,557円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	510,174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	19,097,053円	C 信託約款に定める収益調整金	21,427,240円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	53,227,751円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	51,671,022円
E 分配対象収益（A+B+C+D）	72,814,361円	E 分配対象収益（A+B+C+D）	73,608,436円
F 分配対象収益(1万口当たり)	3,146円	F 分配対象収益(1万口当たり)	3,145円
G 分配金額	462,812円	G 分配金額	468,075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28年 6月28日 至 平成28年12月26日	当期 自 平成28年12月27日 至 平成29年 6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12月26日現在	当期 平成29年 6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 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品 同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>同左</p>

（有価証券に関する注記）

前期（平成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

当期（平成29年 6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	1,167,710
合計	1,167,710

（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12月26日現在		当期 平成29年 6月26日現在	
1口当たり純資産額	0.9447円	1口当たり純資産額	0.9813円
(1万口当たり純資産額)	(9,447円)	(1万口当たり純資産額)	(9,813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	27,908,547	61,256,469	
	日本債券インデックスマザーファンド	4,896,618	6,784,753	
	海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド	27,641,461	61,369,571	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	4,838,907	6,835,440	
	海外新興国株式インデックスMSCIエマージング (ヘッジなし) マザーファンド	27,288,287	45,604,185	
	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	34,792,954	45,216,923	
合計		127,366,774	227,067,341	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

（参考）

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

貸借対照表

	平成28年12月26日現在	平成29年 6月26日現在
（単位：円）		
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	48,360,215	857,775,433
株式	26,988,375,700	27,475,796,770
派生商品評価勘定	973,380	1,769,060
未収入金	163,576,710	33,081,530
未収配当金	1,933,900	117,158,487
流動資産合計	27,203,219,905	28,485,581,280
資産合計	27,203,219,905	28,485,581,280
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	25,540	-
前受金	1,140,000	1,630,000
未払金	-	747,001,760
未払解約金	123,696,719	60,661,146
未払利息	42	1,346
流動負債合計	124,862,301	809,294,252
負債合計	124,862,301	809,294,252
純資産の部		
元本等		
元本	20,334,605,022	19,591,921,031
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	6,743,752,582	8,084,365,997
元本等合計	27,078,357,604	27,676,287,028
純資産合計	27,078,357,604	27,676,287,028
負債純資産合計	27,203,219,905	28,485,581,280

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）金融商品取引所等の上場されている有価証券 金融商品取引所等の上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>（2）金融商品取引所等の上場されていない有価証券</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>デリバティブ取引</p> <p>個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

		平成28年12月26日現在	平成29年 6月26日現在
1.	期首	平成28年 6月28日	平成28年12月27日
	期首元本額	22,534,437,913円	20,334,605,022円
	期首からの追加設定元本額	723,053,386円	1,250,365,755円
	期首からの一部解約元本額	2,922,886,277円	1,993,049,746円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	237,016,975円	258,830,849円
	DCインデックスバランス（株式40）	776,652,933円	807,647,657円
	DCインデックスバランス（株式60）	1,454,913,172円	1,536,048,259円
	DCインデックスバランス（株式80）	1,646,787,230円	1,761,672,523円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,279,193,123円	1,272,256,995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	4,914,473,675円	4,247,041,813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	4,894,926円	4,838,907円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	- 円	531,199,094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）	4,079,233円	3,974,162円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	59,442,609円	57,246,399円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	48,624,509円	46,017,810円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	70,440,839円	68,055,742円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	90,793,256円	77,284,750円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	6,211,833,000円	5,550,460,970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）	16,821,844円	13,036,155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）	37,879,274円	35,577,302円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	33,832,071円	- 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	274,997,182円	268,211,843円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	831,830,984円	792,260,947円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,155,868,643円	1,124,189,351円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,184,229,544円	1,136,069,503円
計	20,334,605,022円	19,591,921,031円
2. 受益権の総数	20,334,605,022口	19,591,921,031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	446,795,000円	415,920,000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28年 6月28日 至 平成28年12月26日	自 平成28年12月27日 至 平成29年 6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12月26日現在	平成29年 6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	(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

（平成29年 6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	3,784,294,711
合計	3,784,294,711

(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

(平成29年 6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	175,380,000	-	177,155,000	1,775,000
合計		175,380,000	-	177,155,000	1,775,000

(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12月26日現在		平成29年 6月26日現在	
1口当たり純資産額	1.3316円	1口当たり純資産額	1.4126円
(1万口当たり純資産額)	(13,316円)	(1万口当たり純資産額)	(14,126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	3,085.00	1,542,500	
日本水産	17,000	668.00	11,356,000	
マルハニチロ	2,500	3,020.00	7,550,000	
カネコ種苗	500	1,486.00	743,000	
サカタのタネ	1,900	3,510.00	6,669,000	
ホクト	1,300	1,978.00	2,571,400	
ホクリヨウ	200	1,014.00	202,800	
住石ホールディングス	3,900	100.00	390,000	
日鉄鉱業	400	5,980.00	2,392,000	
三井松島産業	800	1,369.00	1,095,200	
国際石油開発帝石	68,900	1,038.00	71,518,200	
日本海洋掘削	500	2,216.00	1,108,000	
石油資源開発	2,100	2,277.00	4,781,700	
K&Oエナジーグループ	900	1,787.00	1,608,300	
ショーボンドホールディングス	1,300	5,820.00	7,566,000	
ミライト・ホールディングス	4,000	1,257.00	5,028,000	
サンヨーホームズ	300	644.00	193,200	
ファーストコーポレーション	300	1,136.00	340,800	
インベスターズクラウド	200	5,530.00	1,106,000	
ダイセキ環境ソリューション	400	1,302.00	520,800	
安藤・間	9,400	688.00	6,467,200	
東急建設	4,700	943.00	4,432,100	
コムシスホールディングス	5,100	2,376.00	12,117,600	
ミサワホーム	1,600	1,028.00	1,644,800	
高松コンストラクショングループ	1,000	2,776.00	2,776,000	
東建コーポレーション	500	14,190.00	7,095,000	
ソネック	200	797.00	159,400	
ヤマウラ	600	961.00	576,600	
大成建設	66,000	1,050.00	69,300,000	
大林組	39,300	1,345.00	52,858,500	
清水建設	40,000	1,228.00	49,120,000	
飛島建設	12,800	169.00	2,163,200	
長谷工コーポレーション	15,300	1,387.00	21,221,100	
松井建設	1,400	890.00	1,246,000	

銭高組	2,000	440.00	880,000	
鹿島建設	58,000	967.00	56,086,000	
不動テトラ	10,800	182.00	1,965,600	
大末建設	500	1,006.00	503,000	
鉄建建設	8,000	338.00	2,704,000	
西松建設	15,000	613.00	9,195,000	
三井住友建設	50,300	121.00	6,086,300	
大豊建設	5,000	534.00	2,670,000	
前田建設工業	9,000	1,284.00	11,556,000	
ナカノフドー建設	1,000	639.00	639,000	
奥村組	11,000	786.00	8,646,000	
東鉄工業	1,600	3,460.00	5,536,000	
イチケン	1,000	396.00	396,000	
浅沼組	5,000	326.00	1,630,000	
戸田建設	15,000	719.00	10,785,000	
熊谷組	20,000	355.00	7,100,000	
青木あすなろ建設	900	854.00	768,600	
北野建設	3,000	330.00	990,000	
植木組	2,000	271.00	542,000	
三井ホーム	2,000	747.00	1,494,000	
矢作建設工業	1,800	921.00	1,657,800	
ピーエス三菱	1,400	493.00	690,200	
日本ハウスホールディングス	2,700	534.00	1,441,800	
大東建託	4,700	17,695.00	83,166,500	
新日本建設	1,600	946.00	1,513,600	
N I P P O	3,000	2,235.00	6,705,000	
東亜道路工業	2,000	459.00	918,000	
前田道路	4,000	2,199.00	8,796,000	
日本道路	4,000	582.00	2,328,000	
東亜建設工業	1,100	1,803.00	1,983,300	
若築建設	8,000	164.00	1,312,000	
東洋建設	3,900	424.00	1,653,600	
五洋建設	14,600	659.00	9,621,400	
大林道路	1,400	937.00	1,311,800	
福田組	2,000	1,083.00	2,166,000	
住友林業	9,000	1,784.00	16,056,000	

日本基礎技術	1,500	367.00	550,500
日成ビルド工業	4,000	618.00	2,472,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	7,000	85.00	595,000
巴コーポレーション	1,800	360.00	648,000
パナホーム	5,000	1,198.00	5,990,000
大和ハウス工業	38,700	3,837.00	148,491,900
ライト工業	2,500	1,234.00	3,085,000
積水ハウス	40,000	1,971.50	78,860,000
日特建設	1,200	583.00	699,600
北陸電気工事	700	947.00	662,900
ユアテック	2,000	763.00	1,526,000
西部電気工業	300	2,306.00	691,800
四電工	1,000	507.00	507,000
中電工	1,500	2,944.00	4,416,000
関電工	5,000	1,184.00	5,920,000
きんでん	8,700	1,798.00	15,642,600
東京エネシス	1,300	999.00	1,298,700
トーエネック	2,000	690.00	1,380,000
住友電設	900	1,578.00	1,420,200
日本電設工業	2,200	2,305.00	5,071,000
協和エクシオ	5,100	1,944.00	9,914,400
新日本空調	1,000	1,601.00	1,601,000
N D S	200	3,170.00	634,000
九電工	2,500	4,160.00	10,400,000
三機工業	2,900	1,237.00	3,587,300
日揮	12,200	1,718.00	20,959,600
中外炉工業	4,000	221.00	884,000
ヤマト	1,300	655.00	851,500
太平電業	2,000	1,291.00	2,582,000
高砂熱学工業	3,600	1,817.00	6,541,200
三晃金属工業	200	3,335.00	667,000
朝日工業社	300	3,055.00	916,500
明星工業	2,400	666.00	1,598,400
大気社	1,700	2,965.00	5,040,500
ダイダン	2,000	1,313.00	2,626,000
日比谷総合設備	1,500	1,894.00	2,841,000

東芝プラントシステム	2,100	1,795.00	3,769,500
東洋エンジニアリング	8,000	271.00	2,168,000
千代田化工建設	9,000	631.00	5,679,000
新興プランテック	2,700	854.00	2,305,800
日本製粉	3,900	1,825.00	7,117,500
日清製粉グループ本社	14,300	1,885.00	26,955,500
日東富士製粉	100	3,945.00	394,500
昭和産業	5,000	624.00	3,120,000
鳥越製粉	1,100	807.00	887,700
中部飼料	1,400	1,507.00	2,109,800
フィード・ワン	7,900	235.00	1,856,500
東洋精糖	2,000	116.00	232,000
日本甜菜製糖	700	2,158.00	1,510,600
三井製糖	900	3,210.00	2,889,000
塩水港精糖	1,600	248.00	396,800
日新製糖	600	1,871.00	1,122,600
森永製菓	2,600	6,710.00	17,446,000
中村屋	300	5,130.00	1,539,000
江崎グリコ	3,300	6,220.00	20,526,000
名糖産業	600	1,448.00	868,800
不二家	7,000	256.00	1,792,000
山崎製パン	9,600	2,303.00	22,108,800
第一屋製パン	2,000	121.00	242,000
モロゾフ	2,000	645.00	1,290,000
亀田製菓	700	5,690.00	3,983,000
寿スピリッツ	1,300	3,945.00	5,128,500
カルビー	5,300	4,485.00	23,770,500
森永乳業	12,000	892.00	10,704,000
六甲バター	600	2,679.00	1,607,400
ヤクルト本社	7,000	7,890.00	55,230,000
明治ホールディングス	7,800	9,270.00	72,306,000
雪印メグミルク	2,800	3,250.00	9,100,000
プリマハム	8,000	683.00	5,464,000
日本ハム	9,000	3,495.00	31,455,000
林兼産業	500	841.00	420,500
丸大食品	6,000	532.00	3,192,000

S Foods	700	4,100.00	2,870,000
伊藤ハム米久ホールディングス	7,500	1,038.00	7,785,000
サッポロホールディングス	4,300	3,165.00	13,609,500
アサヒグループホールディングス	24,500	4,283.00	104,933,500
キリンホールディングス	56,300	2,334.00	131,404,200
宝ホールディングス	9,500	1,202.00	11,419,000
オエノンホールディングス	3,000	282.00	846,000
養命酒製造	400	2,078.00	831,200
コカ・コーラボトラーズジャパン	8,300	3,375.00	28,012,500
サントリー食品インターナショナル	9,000	5,270.00	47,430,000
ダイドーグループホールディングス	600	5,730.00	3,438,000
伊藤園	3,900	4,225.00	16,477,500
キーコーヒー	1,100	2,191.00	2,410,100
ユニカフェ	400	987.00	394,800
ジャパンフーズ	200	1,372.00	274,400
日清オイリオグループ	8,000	682.00	5,456,000
不二製油グループ本社	3,500	2,702.00	9,457,000
かどや製油	100	5,190.00	519,000
J - オイルミルズ	600	4,085.00	2,451,000
キッコーマン	9,200	3,700.00	34,040,000
味の素	27,000	2,475.00	66,825,000
キューピー	6,700	2,990.00	20,033,000
ハウス食品グループ本社	4,800	2,945.00	14,136,000
カゴメ	4,700	3,605.00	16,943,500
焼津水産化学工業	600	1,203.00	721,800
アリアケジャパン	1,100	7,940.00	8,734,000
ピエトロ	200	1,629.00	325,800
エバラ食品工業	300	2,105.00	631,500
ニチレイ	6,400	3,330.00	21,312,000
東洋水産	6,400	4,375.00	28,000,000
イトアンド	200	2,297.00	459,400
大冷	100	1,837.00	183,700
日清食品ホールディングス	5,100	7,120.00	36,312,000
永谷園ホールディングス	1,000	1,460.00	1,460,000
一正蒲鉾	500	1,370.00	685,000
フジッコ	1,300	2,625.00	3,412,500

ロック・フィールド	1,300	1,950.00	2,535,000	
日本たばこ産業	72,500	4,090.00	296,525,000	
ケンコーマヨネーズ	700	3,230.00	2,261,000	
わらべや日洋ホールディングス	800	3,155.00	2,524,000	
なとり	600	2,161.00	1,296,600	
イフジ産業	200	742.00	148,400	
北の達人コーポレーション	600	818.00	490,800	
ユーグレナ	4,500	1,216.00	5,472,000	
ミヨシ油脂	5,000	143.00	715,000	
理研ビタミン	400	4,500.00	1,800,000	
片倉工業	1,500	1,347.00	2,020,500	
ゲンゼ	9,000	411.00	3,699,000	
東洋紡	48,000	213.00	10,224,000	
ユニチカ	34,000	81.00	2,754,000	
富士紡ホールディングス	600	3,280.00	1,968,000	
倉敷紡績	12,000	260.00	3,120,000	
シキボウ	7,000	150.00	1,050,000	
日本毛織	3,400	947.00	3,219,800	
ダイトウボウ	2,000	73.00	146,000	
トーア紡コーポレーション	500	551.00	275,500	
ガイドーリミテッド	1,400	442.00	618,800	
帝国繊維	1,300	1,877.00	2,440,100	
帝人	10,000	2,151.00	21,510,000	
東レ	88,700	934.00	82,845,800	
サカイオーベックス	300	1,789.00	536,700	
住江織物	4,000	279.00	1,116,000	
日本フェルト	700	509.00	356,300	
イチカワ	1,000	312.00	312,000	
日東製網	200	1,849.00	369,800	
アツギ	10,000	122.00	1,220,000	
ダイニック	2,000	187.00	374,000	
セーレン	3,100	1,734.00	5,375,400	
ソトー	400	1,138.00	455,200	
東海染工	2,000	135.00	270,000	
小松精練	1,700	732.00	1,244,400	
ワコールホールディングス	7,000	1,545.00	10,815,000	

ホギメディカル	800	7,780.00	6,224,000	
レナウン	3,600	147.00	529,200	
クラウドディア	300	634.00	190,200	
T S Iホールディングス	5,000	820.00	4,100,000	
三陽商会	7,000	178.00	1,246,000	
ナイガイ	5,000	65.00	325,000	
オンワードホールディングス	8,000	829.00	6,632,000	
ルック	2,000	251.00	502,000	
キムラタン	59,000	7.00	413,000	
ゴールドウイン	500	7,000.00	3,500,000	
デサント	2,800	1,535.00	4,298,000	
キング	500	408.00	204,000	
ヤマトインターナショナル	700	429.00	300,300	
特種東海製紙	700	4,105.00	2,873,500	
王子ホールディングス	48,000	567.00	27,216,000	
日本製紙	5,500	2,222.00	12,221,000	
三菱製紙	1,800	765.00	1,377,000	
北越紀州製紙	6,800	889.00	6,045,200	
中越パルプ工業	5,000	239.00	1,195,000	
巴川製紙所	2,000	238.00	476,000	
大王製紙	4,900	1,538.00	7,536,200	
阿波製紙	300	608.00	182,400	
レンゴー	11,800	641.00	7,563,800	
トモク	4,000	379.00	1,516,000	
ザ・パック	900	3,675.00	3,307,500	
クラレ	20,600	2,092.00	43,095,200	
旭化成	76,000	1,199.50	91,162,000	
共和レザー	700	926.00	648,200	
昭和電工	8,200	2,540.00	20,828,000	
住友化学	90,000	607.00	54,630,000	
住友精化	500	5,510.00	2,755,000	
日産化学工業	6,700	3,735.00	25,024,500	
ラサ工業	5,000	139.00	695,000	
クレハ	900	5,490.00	4,941,000	
多木化学	1,000	900.00	900,000	
テイカ	2,000	958.00	1,916,000	

石原産業	2,200	1,142.00	2,512,400	
片倉コープアグリ	1,000	268.00	268,000	
日東エフシー	700	956.00	669,200	
日本曹達	7,000	610.00	4,270,000	
東ソー	35,000	1,131.00	39,585,000	
トクヤマ	19,000	495.00	9,405,000	
セントラル硝子	13,000	471.00	6,123,000	
東亜合成	7,700	1,448.00	11,149,600	
大阪ソーダ	5,000	543.00	2,715,000	
関東電化工業	2,500	893.00	2,232,500	
デンカ	25,000	544.00	13,600,000	
信越化学工業	21,900	10,095.00	221,080,500	
日本カーバイド工業	4,000	179.00	716,000	
堺化学工業	5,000	436.00	2,180,000	
エア・ウォーター	10,100	2,039.00	20,593,900	
大陽日酸	9,400	1,240.00	11,656,000	
日本化学工業	5,000	221.00	1,105,000	
日本パーカライジング	6,200	1,705.00	10,571,000	
高圧ガス工業	1,800	811.00	1,459,800	
四国化成工業	2,000	1,380.00	2,760,000	
戸田工業	3,000	271.00	813,000	
ステラ ケミファ	600	2,902.00	1,741,200	
保土谷化学工業	400	4,485.00	1,794,000	
日本触媒	1,900	7,040.00	13,376,000	
大日精化工業	5,000	896.00	4,480,000	
カネカ	16,000	846.00	13,536,000	
三菱瓦斯化学	11,400	2,276.00	25,946,400	
三井化学	56,000	573.00	32,088,000	
J S R	12,300	1,878.00	23,099,400	
東京応化工業	2,300	3,835.00	8,820,500	
大阪有機化学工業	800	1,430.00	1,144,000	
三菱ケミカルホールディングス	82,400	886.60	73,055,840	
K Hネオケム	2,000	2,023.00	4,046,000	
ダイセル	16,500	1,309.00	21,598,500	
住友ベークライト	11,000	782.00	8,602,000	
積水化学工業	27,800	2,021.00	56,183,800	

日本ゼオン	10,000	1,175.00	11,750,000
アイカ工業	3,900	3,365.00	13,123,500
宇部興産	62,000	286.00	17,732,000
積水樹脂	1,900	2,059.00	3,912,100
タキロンシーアイ	2,000	611.00	1,222,000
旭有機材	4,000	246.00	984,000
日立化成	6,800	3,315.00	22,542,000
ニチバン	1,000	960.00	960,000
リケンテクノス	2,600	583.00	1,515,800
大倉工業	3,000	622.00	1,866,000
積水化成成品工業	1,700	953.00	1,620,100
群栄化学工業	300	3,650.00	1,095,000
タイガースポリマー	600	757.00	454,200
ミライアル	500	1,079.00	539,500
ダイキアクシス	200	2,306.00	461,200
ダイキョーニシカワ	2,100	1,479.00	3,105,900
日本化薬	8,000	1,618.00	12,944,000
カーリットホールディングス	1,100	594.00	653,400
日本精化	1,000	990.00	990,000
扶桑化学工業	900	3,715.00	3,343,500
A D E K A	5,200	1,678.00	8,725,600
日油	10,000	1,443.00	14,430,000
新日本理化	2,100	158.00	331,800
ハリマ化成グループ	1,000	894.00	894,000
花王	30,500	6,855.00	209,077,500
第一工業製薬	3,000	494.00	1,482,000
日華化学	400	1,215.00	486,000
ニイタカ	200	1,764.00	352,800
三洋化成工業	800	5,200.00	4,160,000
有機合成薬品工業	900	285.00	256,500
大日本塗料	7,000	302.00	2,114,000
日本ペイントホールディングス	9,400	4,200.00	39,480,000
関西ペイント	12,900	2,577.00	33,243,300
神東塗料	1,000	205.00	205,000
中国塗料	3,500	854.00	2,989,000
日本特殊塗料	800	1,641.00	1,312,800

藤倉化成	1,700	625.00	1,062,500
太陽ホールディングス	1,000	5,110.00	5,110,000
D I C	4,800	3,930.00	18,864,000
サカティンクス	2,500	1,782.00	4,455,000
東洋インキ S C ホールディングス	12,000	582.00	6,984,000
T & K T O K A	900	1,185.00	1,066,500
富士フィルムホールディングス	24,200	4,035.00	97,647,000
資生堂	23,200	4,050.00	93,960,000
ライオン	15,200	2,431.00	36,951,200
高砂香料工業	800	4,230.00	3,384,000
マンダム	1,200	6,120.00	7,344,000
ミルボン	700	6,230.00	4,361,000
ファンケル	2,600	2,148.00	5,584,800
コーセー	2,000	12,900.00	25,800,000
コタ	500	1,270.00	635,000
シーズ・ホールディングス	1,600	4,200.00	6,720,000
シーボン	200	2,473.00	494,600
ポーラ・オルビスホールディングス	5,000	3,060.00	15,300,000
ノエビアホールディングス	800	5,820.00	4,656,000
アジュバンコスメジャパン	200	951.00	190,200
エステー	800	2,710.00	2,168,000
アグロ カネショウ	500	1,540.00	770,000
コニシ	1,900	1,618.00	3,074,200
長谷川香料	1,600	2,355.00	3,768,000
星光 P M C	700	1,269.00	888,300
小林製薬	3,300	6,840.00	22,572,000
荒川化学工業	1,000	2,024.00	2,024,000
メック	900	1,315.00	1,183,500
日本高純度化学	400	2,438.00	975,200
タカラバイオ	3,500	1,573.00	5,505,500
J C U	800	4,005.00	3,204,000
新田ゼラチン	800	730.00	584,000
O A T アグリオ	200	1,622.00	324,400
デクセリアルズ	3,200	1,097.00	3,510,400
アース製薬	900	5,880.00	5,292,000
北興化学工業	1,200	482.00	578,400

大成ラミック	400	2,919.00	1,167,600	
クミアイ化学工業	5,200	649.00	3,374,800	
日本農薬	3,100	641.00	1,987,100	
アキレス	1,000	1,948.00	1,948,000	
有沢製作所	2,100	870.00	1,827,000	
日東電工	8,800	8,998.00	79,182,400	
レック	800	2,805.00	2,244,000	
きもと	2,300	250.00	575,000	
藤森工業	900	3,535.00	3,181,500	
前澤化成工業	800	1,254.00	1,003,200	
J S P	600	3,245.00	1,947,000	
エフピコ	1,100	6,340.00	6,974,000	
天馬	800	2,120.00	1,696,000	
信越ポリマー	2,400	878.00	2,107,200	
東リ	3,000	385.00	1,155,000	
ニフコ	2,100	6,080.00	12,768,000	
日本バルカー工業	900	2,175.00	1,957,500	
ユニ・チャーム	24,800	2,890.50	71,684,400	
協和発酵キリン	14,600	2,102.00	30,689,200	
武田薬品工業	45,800	5,784.00	264,907,200	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	124,900	1,401.50	175,047,350	
大日本住友製薬	8,600	1,598.00	13,742,800	
塩野義製薬	15,500	6,419.00	99,494,500	
田辺三菱製薬	14,300	2,600.00	37,180,000	
わかもと製薬	2,000	290.00	580,000	
あすか製薬	1,300	1,713.00	2,226,900	
日本新薬	2,800	7,290.00	20,412,000	
バイオフェルミン製薬	200	3,050.00	610,000	
中外製薬	12,200	4,260.00	51,972,000	
科研製薬	2,300	5,980.00	13,754,000	
エーザイ	15,000	6,254.00	93,810,000	
ロート製薬	6,000	2,421.00	14,526,000	
小野薬品工業	27,800	2,528.00	70,278,400	
久光製薬	3,400	5,510.00	18,734,000	
持田製薬	800	8,140.00	6,512,000	

参天製薬	22,100	1,532.00	33,857,200
扶桑薬品工業	400	2,791.00	1,116,400
日本ケミファ	200	5,350.00	1,070,000
ツムラ	4,100	4,620.00	18,942,000
日医工	2,900	1,690.00	4,901,000
キッセイ薬品工業	2,200	3,090.00	6,798,000
生化学工業	2,300	1,891.00	4,349,300
栄研化学	1,000	3,410.00	3,410,000
日水製薬	500	1,400.00	700,000
鳥居薬品	800	2,831.00	2,264,800
JCRファーマ	900	2,906.00	2,615,400
東和薬品	600	5,290.00	3,174,000
富士製薬工業	400	3,925.00	1,570,000
沢井製薬	2,100	6,300.00	13,230,000
ゼリア新薬工業	2,500	2,012.00	5,030,000
第一三共	36,000	2,550.00	91,800,000
キョーリン製薬ホールディングス	3,000	2,546.00	7,638,000
大幸薬品	600	2,016.00	1,209,600
ダイト	700	2,474.00	1,731,800
大塚ホールディングス	26,300	4,893.00	128,685,900
大正製薬ホールディングス	2,600	8,750.00	22,750,000
ペプチドリーム	2,300	7,060.00	16,238,000
日本コークス工業	10,000	97.00	970,000
昭和シェル石油	10,900	1,062.00	11,575,800
ニチレキ	1,500	1,327.00	1,990,500
ユシロ化学工業	700	1,509.00	1,056,300
ビーピー・カストロール	500	1,982.00	991,000
富士石油	2,900	326.00	945,400
MORESCO	400	2,079.00	831,600
出光興産	5,800	3,155.00	18,299,000
JXTGホールディングス	186,500	476.80	88,923,200
コスモエネルギーホールディングス	3,700	1,711.00	6,330,700
横浜ゴム	7,400	2,252.00	16,664,800
東洋ゴム工業	6,500	2,252.00	14,638,000
ブリヂストン	41,300	4,855.00	200,511,500
住友ゴム工業	11,500	1,906.00	21,919,000

藤倉ゴム工業	1,100	655.00	720,500
オカモト	4,000	1,359.00	5,436,000
フコク	500	987.00	493,500
ニッタ	1,100	3,515.00	3,866,500
住友理工	2,300	1,166.00	2,681,800
三ツ星ベルト	3,000	1,240.00	3,720,000
バンドー化学	2,200	1,122.00	2,468,400
日東紡績	10,000	563.00	5,630,000
旭硝子	60,000	939.00	56,340,000
日本板硝子	5,600	854.00	4,782,400
石塚硝子	2,000	216.00	432,000
日本山村硝子	5,000	184.00	920,000
日本電気硝子	25,000	827.00	20,675,000
オハラ	500	1,299.00	649,500
住友大阪セメント	23,000	557.00	12,811,000
太平洋セメント	74,000	394.00	29,156,000
日本ヒューム	1,200	697.00	836,400
日本コンクリート工業	2,900	412.00	1,194,800
三谷セキサン	600	2,922.00	1,753,200
アジアパイルホールディングス	1,600	739.00	1,182,400
東海カーボン	11,400	620.00	7,068,000
日本カーボン	6,000	364.00	2,184,000
東洋炭素	700	1,976.00	1,383,200
ノリタケカンパニーリミテド	700	3,775.00	2,642,500
TOTO	9,000	4,330.00	38,970,000
日本碍子	15,400	2,196.00	33,818,400
日本特殊陶業	10,600	2,304.00	24,422,400
ダントーホールディングス	1,000	149.00	149,000
MARUWA	400	4,580.00	1,832,000
品川リフラクトリーズ	3,000	272.00	816,000
黒崎播磨	3,000	433.00	1,299,000
ヨータイ	1,000	377.00	377,000
イソライト工業	600	378.00	226,800
東京窯業	1,500	211.00	316,500
ニッカトー	400	597.00	238,800
フジミインコーポレーテッド	1,000	2,307.00	2,307,000

エーアンドエーマテリアル	3,000	123.00	369,000	
ニチアス	6,000	1,331.00	7,986,000	
ニチハ	1,600	4,015.00	6,424,000	
新日鐵住金	55,100	2,356.00	129,815,600	
神戸製鋼所	21,200	1,044.00	22,132,800	
合同製鐵	700	1,771.00	1,239,700	
ジェイ エフ イー ホールディングス	33,400	1,787.00	59,685,800	
日新製鋼	4,000	1,169.00	4,676,000	
東京製鐵	6,200	897.00	5,561,400	
共英製鋼	1,300	1,768.00	2,298,400	
大和工業	2,500	2,744.00	6,860,000	
東京鐵鋼	2,000	418.00	836,000	
大阪製鐵	800	2,127.00	1,701,600	
淀川製鋼所	1,700	2,886.00	4,906,200	
東洋鋼鈹	3,000	390.00	1,170,000	
丸一鋼管	4,100	3,200.00	13,120,000	
モリ工業	400	2,207.00	882,800	
大同特殊鋼	20,000	617.00	12,340,000	
日本高周波鋼業	5,000	82.00	410,000	
日本冶金工業	10,200	218.00	2,223,600	
山陽特殊製鋼	7,000	592.00	4,144,000	
愛知製鋼	700	4,220.00	2,954,000	
日立金属	12,400	1,422.00	17,632,800	
日本金属	300	1,547.00	464,100	
大平洋金属	8,000	279.00	2,232,000	
新日本電工	7,000	362.00	2,534,000	
栗本鐵工所	600	1,959.00	1,175,400	
虹技	2,000	231.00	462,000	
日本鑄鉄管	1,000	170.00	170,000	
三菱製鋼	8,000	256.00	2,048,000	
日亜鋼業	1,700	281.00	477,700	
日本精線	1,000	712.00	712,000	
シンニッタン	1,000	708.00	708,000	
新家工業	3,000	188.00	564,000	
大紀アルミニウム工業所	2,000	580.00	1,160,000	
日本軽金属ホールディングス	31,500	259.00	8,158,500	

三井金属鉱業	33,000	424.00	13,992,000
東邦亜鉛	7,000	436.00	3,052,000
三菱マテリアル	7,600	3,140.00	23,864,000
住友金属鉱山	32,000	1,439.50	46,064,000
DOWAホールディングス	14,000	805.00	11,270,000
古河機械金属	19,000	189.00	3,591,000
エス・サイエンス	6,100	102.00	622,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,400	1,766.00	2,472,400
東邦チタニウム	2,100	818.00	1,717,800
UACJ	17,000	290.00	4,930,000
古河電気工業	4,100	5,150.00	21,115,000
住友電気工業	46,000	1,701.00	78,246,000
フジクラ	16,100	964.00	15,520,400
昭和電線ホールディングス	15,000	83.00	1,245,000
タツタ電線	2,300	631.00	1,451,300
沖電線	2,000	248.00	496,000
カナレ電気	200	2,495.00	499,000
平河ヒューテック	600	1,475.00	885,000
リョービ	8,000	455.00	3,640,000
アーレスティ	1,400	1,071.00	1,499,400
アサヒホールディングス	1,900	1,840.00	3,496,000
稲葉製作所	700	1,440.00	1,008,000
宮地エンジニアリンググループ	4,000	250.00	1,000,000
トーカロ	800	3,645.00	2,916,000
アルファC o	400	2,341.00	936,400
SUMCO	12,800	1,645.00	21,056,000
川田テクノロジーズ	200	7,200.00	1,440,000
RS Technologies	100	8,510.00	851,000
東洋製罐グループホールディングス	8,700	1,856.00	16,147,200
ホッカンホールディングス	3,000	434.00	1,302,000
コロナ	700	1,161.00	812,700
横河ブリッジホールディングス	2,200	1,574.00	3,462,800
駒井ハルテック	300	2,192.00	657,600
高田機工	1,000	278.00	278,000
三和ホールディングス	12,100	1,209.00	14,628,900
文化シャッター	3,400	875.00	2,975,000

三協立山	1,600	1,792.00	2,867,200	
アルインコ	800	1,134.00	907,200	
東洋シヤッター	300	636.00	190,800	
LIXILグループ	17,000	2,797.00	47,549,000	
日本フィルコン	900	618.00	556,200	
ノーリツ	2,400	2,254.00	5,409,600	
長府製作所	1,300	2,728.00	3,546,400	
リンナイ	2,100	10,630.00	22,323,000	
ダイニチ工業	700	777.00	543,900	
日東精工	1,700	468.00	795,600	
三洋工業	2,000	220.00	440,000	
岡部	2,500	1,033.00	2,582,500	
ジーテクト	1,300	2,084.00	2,709,200	
中国工業	200	752.00	150,400	
東プレ	2,300	2,946.00	6,775,800	
高周波熱錬	2,200	1,044.00	2,296,800	
東京製綱	900	1,671.00	1,503,900	
サンコール	700	620.00	434,000	
モリテック スチール	700	289.00	202,300	
パイオラックス	1,800	3,080.00	5,544,000	
エイチワン	900	1,170.00	1,053,000	
日本発條	11,500	1,160.00	13,340,000	
中央発條	1,000	348.00	348,000	
アドバネクス	200	1,761.00	352,200	
立川ブラインド工業	500	1,179.00	589,500	
三益半導体工業	1,000	1,759.00	1,759,000	
日本ドライケミカル	200	2,375.00	475,000	
日本製鋼所	4,100	1,717.00	7,039,700	
三浦工業	5,000	2,239.00	11,195,000	
タクマ	3,900	1,155.00	4,504,500	
ツガミ	3,000	812.00	2,436,000	
オークマ	8,000	1,045.00	8,360,000	
東芝機械	7,000	505.00	3,535,000	
アマダホールディングス	16,400	1,318.00	21,615,200	
アイダエンジニアリング	3,500	1,069.00	3,741,500	
滝澤鉄工所	4,000	178.00	712,000	

富士機械製造	3,700	1,641.00	6,071,700
牧野フライス製作所	6,000	903.00	5,418,000
オーエスジー	5,600	2,269.00	12,706,400
ダイジェット工業	2,000	173.00	346,000
旭ダイヤモンド工業	3,500	819.00	2,866,500
D M G 森精機	7,000	1,770.00	12,390,000
ソディック	3,100	1,311.00	4,064,100
ディスコ	1,400	18,520.00	25,928,000
日東工器	700	2,533.00	1,773,100
パンチ工業	400	1,184.00	473,600
富士ダイス	400	745.00	298,000
豊和工業	700	761.00	532,700
O K K	4,000	129.00	516,000
東洋機械金属	900	741.00	666,900
津田駒工業	3,000	180.00	540,000
島精機製作所	1,600	5,430.00	8,688,000
N C ホールディングス	400	872.00	348,800
フリュー	700	1,312.00	918,400
ヤマシンフィルタ	300	2,186.00	655,800
日阪製作所	1,700	960.00	1,632,000
やまびこ	2,200	1,253.00	2,756,600
ベガサスミシン製造	1,200	715.00	858,000
ナプテスコ	6,300	3,370.00	21,231,000
三井海洋開発	1,200	2,337.00	2,804,400
レオン自動機	1,000	1,314.00	1,314,000
S M C	3,700	35,250.00	130,425,000
新川	1,000	729.00	729,000
ホソカワミクロン	500	4,995.00	2,497,500
ユニオンツール	500	3,275.00	1,637,500
オイレス工業	1,500	1,954.00	2,931,000
日精エー・エス・ビー機械	400	3,870.00	1,548,000
サトーホールディングス	1,500	2,711.00	4,066,500
日本エアータック	400	840.00	336,000
日精樹脂工業	1,000	1,059.00	1,059,000
オカダアイヨン	300	1,337.00	401,100
ワイエイシイホールディングス	500	1,361.00	680,500

小松製作所	56,400	2,733.00	154,141,200
住友重機械工業	36,000	738.00	26,568,000
日立建機	5,500	2,715.00	14,932,500
日工	300	2,194.00	658,200
巴工業	500	1,826.00	913,000
井関農機	12,000	223.00	2,676,000
T O W A	1,000	1,714.00	1,714,000
丸山製作所	200	1,781.00	356,200
北川鉄工所	600	2,340.00	1,404,000
ローツェ	600	2,698.00	1,618,800
タカキタ	400	522.00	208,800
クボタ	58,500	1,864.00	109,044,000
荏原実業	300	1,491.00	447,300
三菱化工機	4,000	256.00	1,024,000
月島機械	2,300	1,268.00	2,916,400
帝国電機製作所	900	1,158.00	1,042,200
新東工業	2,800	1,141.00	3,194,800
澁谷工業	1,000	3,520.00	3,520,000
アイチ コーポレーション	1,700	780.00	1,326,000
小森コーポレーション	2,900	1,400.00	4,060,000
鶴見製作所	900	1,796.00	1,616,400
住友精密工業	2,000	350.00	700,000
酒井重工業	2,000	320.00	640,000
荏原製作所	5,500	3,010.00	16,555,000
石井鐵工所	200	1,638.00	327,600
西島製作所	1,200	1,145.00	1,374,000
北越工業	1,300	969.00	1,259,700
ダイキン工業	16,000	11,470.00	183,520,000
オルガノ	2,000	565.00	1,130,000
トーヨーカネツ	6,000	304.00	1,824,000
栗田工業	6,700	3,110.00	20,837,000
椿本チエイン	7,000	971.00	6,797,000
大同工業	2,000	305.00	610,000
木村化工機	1,100	365.00	401,500
アネスト岩田	2,100	993.00	2,085,300
ダイフク	5,800	3,395.00	19,691,000

サムコ	300	913.00	273,900	
加藤製作所	700	3,015.00	2,110,500	
油研工業	2,000	227.00	454,000	
タダノ	6,100	1,263.00	7,704,300	
フジテック	3,400	1,396.00	4,746,400	
C K D	3,500	1,746.00	6,111,000	
キトー	1,500	1,151.00	1,726,500	
平和	3,600	2,473.00	8,902,800	
理想科学工業	1,200	2,145.00	2,574,000	
S A N K Y O	3,200	3,830.00	12,256,000	
日本金銭機械	1,100	1,177.00	1,294,700	
マースエンジニアリング	700	2,504.00	1,752,800	
福島工業	700	4,160.00	2,912,000	
オーイズミ	500	583.00	291,500	
ダイコク電機	500	1,749.00	874,500	
竹内製作所	2,100	1,925.00	4,042,500	
アマノ	3,600	2,446.00	8,805,600	
J U K I	1,900	1,567.00	2,977,300	
サンデンホールディングス	7,000	292.00	2,044,000	
蛇の目マシン工業	1,200	885.00	1,062,000	
マックス	2,000	1,651.00	3,302,000	
グローリー	3,700	3,785.00	14,004,500	
新晃工業	1,100	1,831.00	2,014,100	
大和冷機工業	1,900	1,235.00	2,346,500	
セガサミーホールディングス	11,600	1,487.00	17,249,200	
日本ピストンリング	500	2,201.00	1,100,500	
リケン	500	4,735.00	2,367,500	
T P R	1,300	3,515.00	4,569,500	
ツバキ・ナカシマ	1,300	2,173.00	2,824,900	
ホシザキ	3,400	10,340.00	35,156,000	
大豊工業	1,000	1,396.00	1,396,000	
日本精工	24,000	1,389.00	33,336,000	
N T N	27,000	500.00	13,500,000	
ジェイテクト	12,500	1,580.00	19,750,000	
不二越	12,000	611.00	7,332,000	
日本トムソン	3,700	598.00	2,212,600	

THK	8,200	3,275.00	26,855,000	
ユーシン精機	500	2,762.00	1,381,000	
前澤給装工業	400	1,533.00	613,200	
イーグル工業	1,300	1,826.00	2,373,800	
前澤工業	800	324.00	259,200	
日本ピラー工業	1,200	1,666.00	1,999,200	
キッツ	5,600	1,043.00	5,840,800	
日立工機	900	867.00	780,300	
マキタ	15,200	4,135.00	62,852,000	
日立造船	9,300	543.00	5,049,900	
三菱重工業	196,000	436.90	85,632,400	
IHI	90,000	386.00	34,740,000	
スター精密	2,100	1,693.00	3,555,300	
日清紡ホールディングス	6,500	1,093.00	7,104,500	
イビデン	8,200	1,937.00	15,883,400	
コニカミノルタ	27,400	896.00	24,550,400	
ブラザー工業	15,100	2,569.00	38,791,900	
ミネベアミツミ	21,300	1,892.00	40,299,600	
日立製作所	280,000	671.20	187,936,000	
東芝	261,000	298.20	77,830,200	
三菱電機	124,600	1,585.50	197,553,300	
富士電機	35,000	598.00	20,930,000	
東洋電機製造	500	1,645.00	822,500	
安川電機	13,500	2,451.00	33,088,500	
シンフォニアテクノロジー	8,000	412.00	3,296,000	
明電舎	11,000	375.00	4,125,000	
オリジン電気	2,000	304.00	608,000	
山洋電気	3,000	1,158.00	3,474,000	
デンヨー	1,100	2,076.00	2,283,600	
東芝テック	7,000	583.00	4,081,000	
芝浦メカトロニクス	2,000	347.00	694,000	
マブチモーター	3,300	5,740.00	18,942,000	
日本電産	15,100	11,760.00	177,576,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	400	1,683.00	673,200	
東光高岳	600	1,638.00	982,800	
ダブル・スコープ	1,100	2,000.00	2,200,000	

ダイヘン	6,000	893.00	5,358,000	
田淵電機	1,800	352.00	633,600	
ヤーマン	200	9,690.00	1,938,000	
JVCケンウッド	8,700	331.00	2,879,700	
ミマキエンジニアリング	1,100	703.00	773,300	
第一精工	600	2,044.00	1,226,400	
日新電機	2,300	1,204.00	2,769,200	
大崎電気工業	2,000	825.00	1,650,000	
オムロン	12,400	4,840.00	60,016,000	
日東工業	1,700	1,774.00	3,015,800	
I D E C	1,500	1,556.00	2,334,000	
不二電機工業	100	1,384.00	138,400	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	22,000	484.00	10,648,000	
サクサホールディングス	3,000	202.00	606,000	
メルコホールディングス	600	3,290.00	1,974,000	
テクノメディカ	300	2,000.00	600,000	
日本電気	160,000	289.00	46,240,000	
富士通	112,000	831.60	93,139,200	
沖電気工業	5,100	1,628.00	8,302,800	
岩崎通信機	6,000	82.00	492,000	
電気興業	3,000	578.00	1,734,000	
サンケン電気	7,000	474.00	3,318,000	
ナカヨ	1,000	396.00	396,000	
アイホン	700	1,949.00	1,364,300	
ルネサスエレクトロニクス	6,100	998.00	6,087,800	
セイコーエプソン	17,400	2,498.00	43,465,200	
ワコム	9,100	356.00	3,239,600	
アルバック	2,000	5,720.00	11,440,000	
アクセル	500	801.00	400,500	
E I Z O	1,100	4,465.00	4,911,500	
ジャパンディスプレイ	21,900	203.00	4,445,700	
日本信号	3,200	1,052.00	3,366,400	
京三製作所	3,000	549.00	1,647,000	
能美防災	1,300	1,601.00	2,081,300	
ホーチキ	900	1,814.00	1,632,600	
エレコム	1,000	2,393.00	2,393,000	

日本無線	700	1,379.00	965,300
パナソニック	134,100	1,539.00	206,379,900
アンリツ	8,500	1,055.00	8,967,500
富士通ゼネラル	4,000	2,612.00	10,448,000
日立国際電気	3,000	2,655.00	7,965,000
ソニー	82,500	4,298.00	354,585,000
T D K	6,600	7,430.00	49,038,000
帝国通信工業	2,000	211.00	422,000
タムラ製作所	4,000	517.00	2,068,000
アルプス電気	10,800	3,195.00	34,506,000
池上通信機	4,000	155.00	620,000
パイオニア	17,700	216.00	3,823,200
日本電波工業	1,100	871.00	958,100
鈴木	500	791.00	395,500
日本トリム	300	4,520.00	1,356,000
ローランド ディー . ジー .	600	2,656.00	1,593,600
フォスター電機	1,400	1,908.00	2,671,200
クラリオン	6,000	417.00	2,502,000
S M K	3,000	415.00	1,245,000
ヨコオ	800	1,505.00	1,204,000
ホシデン	3,600	1,297.00	4,669,200
ヒロセ電機	1,900	16,290.00	30,951,000
日本航空電子工業	3,000	1,521.00	4,563,000
T O A	1,400	1,078.00	1,509,200
日立マクセル	1,800	2,221.00	3,997,800
古野電気	1,500	665.00	997,500
ユニデンホールディングス	4,000	250.00	1,000,000
アルパイン	2,800	1,609.00	4,505,200
スミダコーポレーション	1,100	1,754.00	1,929,400
アイコム	700	2,537.00	1,775,900
リオン	500	1,702.00	851,000
本多通信工業	500	1,545.00	772,500
船井電機	1,300	874.00	1,136,200
横河電機	12,700	1,841.00	23,380,700
新電元工業	5,000	569.00	2,845,000
アズビル	3,500	4,390.00	15,365,000

東亜ディーケーケー	600	726.00	435,600	
日本光電工業	4,900	2,629.00	12,882,100	
チノー	400	1,234.00	493,600	
共和電業	1,300	445.00	578,500	
日本電子材料	500	724.00	362,000	
堀場製作所	2,300	7,140.00	16,422,000	
アドバンテスト	8,000	2,041.00	16,328,000	
小野測器	600	762.00	457,200	
エスベック	1,100	1,716.00	1,887,600	
キーエンス	5,300	50,910.00	269,823,000	
日置電機	600	2,287.00	1,372,200	
シスメックス	9,100	6,800.00	61,880,000	
日本マイクロニクス	2,000	1,258.00	2,516,000	
メガチップス	1,100	2,869.00	3,155,900	
OBARA GROUP	700	5,890.00	4,123,000	
澤藤電機	1,000	592.00	592,000	
コーセル	1,600	1,411.00	2,257,600	
イリソ電子工業	500	9,220.00	4,610,000	
新日本無線	1,000	725.00	725,000	
オブテックスグループ	900	3,820.00	3,438,000	
千代田インテグレ	600	2,172.00	1,303,200	
アイ・オー・データ機器	500	1,222.00	611,000	
レーザーテック	2,600	1,688.00	4,388,800	
スタンレー電気	8,300	3,375.00	28,012,500	
岩崎電気	5,000	182.00	910,000	
ウシオ電機	7,100	1,433.00	10,174,300	
岡谷電機産業	600	404.00	242,400	
ヘリオス テクノ ホールディング	1,100	842.00	926,200	
日本セラミック	1,000	2,650.00	2,650,000	
遠藤照明	600	1,145.00	687,000	
古河電池	1,000	783.00	783,000	
双信電機	500	312.00	156,000	
山一電機	1,100	1,843.00	2,027,300	
図研	800	1,568.00	1,254,400	
日本電子	4,000	590.00	2,360,000	
カシオ計算機	9,400	1,705.00	16,027,000	

ファナック	11,800	21,845.00	257,771,000	
日本シイエムケイ	2,500	946.00	2,365,000	
エンプラス	500	3,510.00	1,755,000	
大真空	400	1,678.00	671,200	
ローム	5,600	8,980.00	50,288,000	
浜松ホトニクス	8,500	3,445.00	29,282,500	
三井ハイテック	1,600	1,729.00	2,766,400	
新光電気工業	4,400	979.00	4,307,600	
京セラ	19,200	6,630.00	127,296,000	
太陽誘電	5,700	1,823.00	10,391,100	
村田製作所	12,300	17,310.00	212,913,000	
ユーシン	1,600	755.00	1,208,000	
双葉電子工業	1,900	1,962.00	3,727,800	
北陸電気工業	5,000	138.00	690,000	
ニチコン	3,700	1,206.00	4,462,200	
日本ケミコン	10,000	418.00	4,180,000	
K O A	1,600	2,090.00	3,344,000	
市光工業	2,000	895.00	1,790,000	
小糸製作所	7,000	5,800.00	40,600,000	
ミツバ	2,200	1,966.00	4,325,200	
S C R E E Nホールディングス	2,400	7,810.00	18,744,000	
キャノン電子	1,100	2,383.00	2,621,300	
キャノン	62,900	3,905.00	245,624,500	代用有価証券 10,000株
リコー	35,100	953.00	33,450,300	
M U T O Hホールディングス	2,000	252.00	504,000	
東京エレクトロン	7,800	16,275.00	126,945,000	
トヨタ紡織	4,100	2,071.00	8,491,100	
芦森工業	3,000	263.00	789,000	
ユニプレス	2,300	2,468.00	5,676,400	
豊田自動織機	10,600	5,670.00	60,102,000	
モリタホールディングス	2,000	1,749.00	3,498,000	
三櫻工業	1,500	803.00	1,204,500	
デンソー	28,800	4,679.00	134,755,200	
東海理化電機製作所	3,100	1,990.00	6,169,000	
三井造船	42,000	153.00	6,426,000	

川崎重工業	91,000	317.00	28,847,000	
名村造船所	3,500	666.00	2,331,000	
サノヤスホールディングス	1,500	255.00	382,500	
日本車輛製造	4,000	284.00	1,136,000	
ニチュ三菱フォークリフト	1,400	733.00	1,026,200	
近畿車輛	200	2,561.00	512,200	
日産自動車	137,700	1,081.00	148,853,700	
いすゞ自動車	33,900	1,350.50	45,781,950	
トヨタ自動車	142,000	5,838.00	828,996,000	代用有価証券 35,000株
日野自動車	16,700	1,239.00	20,691,300	
三菱自動車工業	42,800	736.00	31,500,800	
エフテック	700	1,422.00	995,400	
レシップホールディングス	400	904.00	361,600	
G M B	200	1,186.00	237,200	
ファルテック	200	1,287.00	257,400	
武蔵精密工業	1,400	3,190.00	4,466,000	
日産車体	5,100	1,126.00	5,742,600	
新明和工業	5,000	919.00	4,595,000	
極東開発工業	2,300	1,803.00	4,146,900	
日信工業	2,600	1,732.00	4,503,200	
トピー工業	1,000	3,215.00	3,215,000	
ティラド	4,000	356.00	1,424,000	
曙ブレーキ工業	5,500	337.00	1,853,500	
タチエス	2,000	1,968.00	3,936,000	
N O K	5,600	2,358.00	13,204,800	
フタバ産業	3,600	950.00	3,420,000	
K Y B	13,000	542.00	7,046,000	
大同メタル工業	1,500	1,014.00	1,521,000	
プレス工業	6,200	503.00	3,118,600	
ミクニ	1,500	459.00	688,500	
太平洋工業	2,600	1,416.00	3,681,600	
ケーヒン	2,700	1,519.00	4,101,300	
河西工業	1,600	1,401.00	2,241,600	
アイシン精機	10,700	5,650.00	60,455,000	
富士機工	1,200	737.00	884,400	

マツダ	37,000	1,511.00	55,907,000
今仙電機製作所	1,100	1,261.00	1,387,100
本田技研工業	105,100	3,065.00	322,131,500
スズキ	23,100	5,282.00	122,014,200
S U B A R U	36,300	3,665.00	133,039,500
安永	600	1,178.00	706,800
ヤマハ発動機	16,500	2,978.00	49,137,000
ショーワ	3,000	1,084.00	3,252,000
T B K	1,600	499.00	798,400
エクセディ	1,600	3,045.00	4,872,000
豊田合成	3,800	2,652.00	10,077,600
愛三工業	2,100	872.00	1,831,200
盟和産業	200	1,198.00	239,600
ヨロズ	1,100	1,728.00	1,900,800
エフ・シー・シー	1,900	2,186.00	4,153,400
シマノ	4,700	17,510.00	82,297,000
テイ・エス テック	2,700	3,250.00	8,775,000
ジャムコ	700	2,536.00	1,775,200
テルモ	17,900	4,515.00	80,818,500
クリエートメディック	400	996.00	398,400
日機装	4,000	1,076.00	4,304,000
島津製作所	15,000	2,187.00	32,805,000
J M S	2,000	328.00	656,000
長野計器	900	771.00	693,900
ブイ・テクノロジー	200	21,040.00	4,208,000
東京計器	4,000	281.00	1,124,000
愛知時計電機	200	3,795.00	759,000
インターアクション	500	791.00	395,500
オーバル	1,200	268.00	321,600
東京精密	2,300	3,765.00	8,659,500
マニー	1,400	2,998.00	4,197,200
ニコン	20,400	1,844.00	37,617,600
トプコン	5,900	1,912.00	11,280,800
オリンパス	18,600	4,040.00	75,144,000
理研計器	1,000	2,153.00	2,153,000
タムロン	1,000	1,938.00	1,938,000

HOYA	24,000	5,730.00	137,520,000
シード	200	2,571.00	514,200
ノーリツ鋼機	1,200	967.00	1,160,400
エー・アンド・デイ	1,100	457.00	502,700
シチズン時計	12,800	772.00	9,881,600
リズム時計工業	5,000	230.00	1,150,000
大研医器	1,000	804.00	804,000
メニコン	800	3,655.00	2,924,000
松風	600	1,351.00	810,600
セイコーホールディングス	8,000	440.00	3,520,000
ニプロ	8,100	1,486.00	12,036,600
スノーピーク	200	3,335.00	667,000
パラマウントベッドホールディングス	1,100	5,000.00	5,500,000
トランザクション	500	1,203.00	601,500
SHO-BI	400	458.00	183,200
ニホンフラッシュ	600	1,521.00	912,600
前田工織	1,200	1,649.00	1,978,800
永大産業	2,000	513.00	1,026,000
アートネイチャー	1,200	723.00	867,600
ダンロップスポーツ	800	1,125.00	900,000
バンダイナムコホールディングス	12,900	3,965.00	51,148,500
アイフィスジャパン	300	798.00	239,400
共立印刷	1,900	340.00	646,000
SHOEI	500	3,070.00	1,535,000
フランスベッドホールディングス	1,500	1,002.00	1,503,000
パイロットコーポレーション	2,000	4,620.00	9,240,000
萩原工業	300	3,055.00	916,500
トッパン・フォームズ	2,100	1,161.00	2,438,100
フジシールインターナショナル	2,600	3,120.00	8,112,000
タカラトミー	4,600	1,400.00	6,440,000
廣濟堂	1,300	362.00	470,600
As-me エステール	400	707.00	282,800
アーク	5,000	117.00	585,000
タカノ	500	1,161.00	580,500
プロネクサス	1,100	1,271.00	1,398,100
ホクシン	900	187.00	168,300

ウッドワン	2,000	285.00	570,000	
大建工業	800	2,407.00	1,925,600	
凸版印刷	33,000	1,235.00	40,755,000	
大日本印刷	34,000	1,247.00	42,398,000	
図書印刷	2,000	510.00	1,020,000	
共同印刷	3,000	390.00	1,170,000	
日本写真印刷	2,000	3,190.00	6,380,000	
光村印刷	1,000	256.00	256,000	
宝印刷	600	1,644.00	986,400	
アシックス	11,600	1,951.00	22,631,600	
ツツミ	500	2,167.00	1,083,500	
小松ウオール工業	400	2,073.00	829,200	
ヤマハ	7,900	3,905.00	30,849,500	
河合楽器製作所	500	2,363.00	1,181,500	
クリナップ	1,400	835.00	1,169,000	
ピジョン	7,100	4,185.00	29,713,500	
兼松サステック	1,000	217.00	217,000	
キングジム	1,000	981.00	981,000	
リンテック	2,800	2,713.00	7,596,400	
イトーキ	2,500	875.00	2,187,500	
任天堂	7,200	39,280.00	282,816,000	
三菱鉛筆	1,000	6,330.00	6,330,000	
タカラスタANDARD	2,400	1,860.00	4,464,000	
コクヨ	6,100	1,493.00	9,107,300	
ナカバヤシ	2,000	319.00	638,000	
岡村製作所	4,100	1,021.00	4,186,100	
美津濃	6,000	662.00	3,972,000	
東京電力ホールディングス	99,100	462.00	45,784,200	
中部電力	38,500	1,490.50	57,384,250	
関西電力	47,600	1,565.00	74,494,000	
中国電力	16,100	1,235.00	19,883,500	
北陸電力	11,400	1,012.00	11,536,800	
東北電力	29,200	1,567.00	45,756,400	
四国電力	10,500	1,340.00	14,070,000	
九州電力	25,800	1,381.00	35,629,800	
北海道電力	11,000	853.00	9,383,000	

沖縄電力	1,900	2,540.00	4,826,000	
電源開発	9,300	2,804.00	26,077,200	
エフオン	600	988.00	592,800	
イーレックス	1,500	951.00	1,426,500	
東京瓦斯	125,000	586.40	73,300,000	
大阪瓦斯	113,000	460.70	52,059,100	
東邦瓦斯	29,000	837.00	24,273,000	
北海道瓦斯	3,000	274.00	822,000	
広島ガス	2,500	355.00	887,500	
西部瓦斯	13,000	269.00	3,497,000	
静岡ガス	3,600	744.00	2,678,400	
メタウォーター	600	3,140.00	1,884,000	
SBSホールディングス	1,200	878.00	1,053,600	
東武鉄道	63,000	623.00	39,249,000	
相鉄ホールディングス	19,000	553.00	10,507,000	
東京急行電鉄	64,000	857.00	54,848,000	
京浜急行電鉄	32,000	1,398.00	44,736,000	
小田急電鉄	18,700	2,311.00	43,215,700	
京王電鉄	33,000	958.00	31,614,000	
京成電鉄	8,800	3,135.00	27,588,000	
富士急行	3,000	1,187.00	3,561,000	
東日本旅客鉄道	22,600	10,985.00	248,261,000	
西日本旅客鉄道	11,200	8,162.00	91,414,400	
東海旅客鉄道	9,700	18,400.00	178,480,000	
西武ホールディングス	16,200	2,137.00	34,619,400	
鴻池運輸	1,700	1,492.00	2,536,400	
西日本鉄道	14,000	500.00	7,000,000	
ハマキョウレックス	800	2,742.00	2,193,600	
サカイ引越センター	500	4,255.00	2,127,500	
近鉄グループホールディングス	118,000	438.00	51,684,000	
阪急阪神ホールディングス	14,800	4,060.00	60,088,000	
南海電気鉄道	25,000	586.00	14,650,000	
京阪ホールディングス	26,000	716.00	18,616,000	
神戸電鉄	3,000	400.00	1,200,000	
名古屋鉄道	42,000	536.00	22,512,000	
山陽電気鉄道	4,000	580.00	2,320,000	

日本通運	43,000	710.00	30,530,000	
ヤマトホールディングス	20,900	2,317.00	48,425,300	
山九	15,000	729.00	10,935,000	
丸運	600	273.00	163,800	
丸全昭和運輸	4,000	464.00	1,856,000	
センコーグループホールディングス	5,500	702.00	3,861,000	
トナミホールディングス	3,000	427.00	1,281,000	
ニッコンホールディングス	4,000	2,593.00	10,372,000	
日本石油輸送	100	2,659.00	265,900	
福山通運	7,000	723.00	5,061,000	
セイノーホールディングス	8,300	1,520.00	12,616,000	
神奈川中央交通	1,000	729.00	729,000	
日立物流	2,400	2,641.00	6,338,400	
丸和運輸機関	300	4,170.00	1,251,000	
C & F ロジホールディングス	1,200	1,330.00	1,596,000	
九州旅客鉄道	11,600	3,670.00	42,572,000	
日本郵船	99,000	201.00	19,899,000	
商船三井	61,000	325.00	19,825,000	
川崎汽船	44,000	272.00	11,968,000	
N S ユナイテッド海運	5,000	212.00	1,060,000	
明治海運	1,100	423.00	465,300	
飯野海運	6,100	470.00	2,867,000	
共栄タンカー	1,000	211.00	211,000	
乾汽船	800	854.00	683,200	
日本航空	20,500	3,446.00	70,643,000	
A N A ホールディングス	217,000	388.20	84,239,400	
パスコ	1,000	373.00	373,000	
トランコム	300	5,490.00	1,647,000	
日新	5,000	547.00	2,735,000	
三菱倉庫	8,000	1,497.00	11,976,000	
三井倉庫ホールディングス	7,000	303.00	2,121,000	
住友倉庫	8,000	704.00	5,632,000	
澁澤倉庫	3,000	366.00	1,098,000	
東陽倉庫	2,000	300.00	600,000	
日本トランスシティ	3,000	461.00	1,383,000	
ケイヒン	2,000	161.00	322,000	

中央倉庫	700	1,089.00	762,300
安田倉庫	900	734.00	660,600
東洋埠頭	3,000	185.00	555,000
宇徳	900	471.00	423,900
上組	14,000	1,186.00	16,604,000
サンリツ	300	688.00	206,400
キムラユニティー	300	1,142.00	342,600
キューソー流通システム	400	2,491.00	996,400
郵船ロジスティクス	1,100	1,008.00	1,108,800
近鉄エクスプレス	2,100	1,964.00	4,124,400
東海運	700	429.00	300,300
エーアイティー	700	1,034.00	723,800
内外トランスライン	300	1,300.00	390,000
N E C ネットエスアイ	1,300	2,505.00	3,256,500
システナ	900	2,404.00	2,163,600
デジタルアーツ	500	3,930.00	1,965,000
新日鉄住金ソリューションズ	1,800	2,739.00	4,930,200
キューブシステム	700	887.00	620,900
コア	500	1,528.00	764,000
ソフトクリエイティブホールディングス	600	1,432.00	859,200
T I S	3,800	3,215.00	12,217,000
ネオス	400	484.00	193,600
電算システム	400	1,775.00	710,000
グリー	7,000	1,046.00	7,322,000
コーエーテクモホールディングス	2,700	2,281.00	6,158,700
三菱総合研究所	500	3,380.00	1,690,000
ボルテージ	200	1,440.00	288,000
電算	100	2,218.00	221,800
A G S	300	1,689.00	506,700
ファインデックス	900	926.00	833,400
ヒト・コミュニケーションズ	200	1,899.00	379,800
ブレインパッド	300	1,337.00	401,100
K L a b	2,200	1,871.00	4,116,200
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	800	1,728.00	1,382,400
イーブックイニシアティブジャパン	200	1,148.00	229,600

ネクソン	12,700	2,313.00	29,375,100
アイスタイル	2,400	907.00	2,176,800
エムアップ	300	1,875.00	562,500
エイチーム	800	2,987.00	2,389,600
テクノスジャパン	900	1,178.00	1,060,200
e n i s h	400	2,018.00	807,200
コロプラ	3,700	1,156.00	4,277,200
モバイルクリエイト	900	421.00	378,900
ブロードリーフ	2,800	719.00	2,013,200
ハーツユナイテッドグループ	600	1,718.00	1,030,800
メディアドゥ	300	2,786.00	835,800
ブイキューブ	700	624.00	436,800
サイバーリンクス	200	1,330.00	266,000
ディー・エル・イー	600	531.00	318,600
フィックスターズ	200	3,565.00	713,000
VOYAGE GROUP	600	2,308.00	1,384,800
オブティム	300	3,230.00	969,000
セレス	300	1,589.00	476,700
ベリサーブ	200	3,690.00	738,000
ティーガイア	1,100	2,191.00	2,410,100
日本アジアグループ	1,400	419.00	586,600
豆蔵ホールディングス	900	1,031.00	927,900
テクマトリックス	700	1,891.00	1,323,700
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	24,200	288.00	6,969,600
GMOペイメントゲートウェイ	800	6,820.00	5,456,000
ザッパラス	600	523.00	313,800
システムリサーチ	100	2,285.00	228,500
インターネットイニシアティブ	1,700	2,059.00	3,500,300
さくらインターネット	1,000	918.00	918,000
GMOクラウド	300	3,840.00	1,152,000
SRAホールディングス	600	3,050.00	1,830,000
Minor iソリューションズ	300	1,346.00	403,800
システムインテグレータ	200	749.00	149,800
朝日ネット	1,100	518.00	569,800
アドソル日進	300	1,203.00	360,900
フリービット	900	899.00	809,100

コムチュア	200	5,410.00	1,082,000	
サイバーコム	200	1,134.00	226,800	
メディカル・データ・ビジョン	500	2,781.00	1,390,500	
g u m i	1,300	1,414.00	1,838,200	
ショーケース・ティービー	200	1,119.00	223,800	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	200	2,061.00	412,200	
P C Iホールディングス	200	2,581.00	516,200	
パイブドHD	200	1,046.00	209,200	
アイビーシー	100	1,162.00	116,200	
オープンドア	200	3,540.00	708,000	
L I N E	2,600	4,055.00	10,543,000	
オークネット	300	1,351.00	405,300	
A O I T Y O H o l d i n g s	1,000	1,090.00	1,090,000	
マクロミル	1,500	2,560.00	3,840,000	
ソルクシーズ	500	923.00	461,500	
フェイス	300	1,276.00	382,800	
ハイマックス	100	1,672.00	167,200	
野村総合研究所	8,600	4,530.00	38,958,000	
サイバネットシステム	900	743.00	668,700	
C E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	600	2,215.00	1,329,000	
東邦システムサイエンス	400	682.00	272,800	
ソースネクスト	700	654.00	457,800	
フォーカスシステムズ	600	1,009.00	605,400	
クレスコ	300	3,705.00	1,111,500	
フジ・メディア・ホールディングス	12,000	1,481.00	17,772,000	
オービック	4,000	6,990.00	27,960,000	
ジャストシステム	1,900	1,761.00	3,345,900	
T D Cソフトウェアエンジニアリング	500	1,278.00	639,000	
ヤフー	82,600	489.00	40,391,400	
トレンドマイクロ	6,100	5,920.00	36,112,000	
インフォメーション・ディベロプメント	300	1,491.00	447,300	
日本オラクル	1,800	6,900.00	12,420,000	
アルファシステムズ	400	2,407.00	962,800	
フューチャー	1,500	904.00	1,356,000	

C A C Holdings	800	1,090.00	872,000
ソフトバンク・テクノロジー	600	2,118.00	1,270,800
トーセ	300	2,112.00	633,600
オービックビジネスコンサルタント	600	5,990.00	3,594,000
伊藤忠テクノソリューションズ	2,600	4,050.00	10,530,000
アイティフォー	1,500	667.00	1,000,500
東計電算	200	2,785.00	557,000
エクスネット	200	893.00	178,600
大塚商会	3,100	7,230.00	22,413,000
サイボウズ	1,500	526.00	789,000
ソフトブレーン	1,600	532.00	851,200
電通国際情報サービス	700	2,790.00	1,953,000
デジタルガレージ	2,300	2,132.00	4,903,600
E Mシステムズ	400	2,534.00	1,013,600
ウェザーニューズ	400	3,785.00	1,514,000
C I J	1,000	581.00	581,000
東洋ビジネスエンジニアリング	100	1,822.00	182,200
日本エンタープライズ	1,200	282.00	338,400
WOWOW	600	3,155.00	1,893,000
スカラ	800	864.00	691,200
日本コロムビア	400	748.00	299,200
イマジカ・ロボット ホールディングス	1,000	735.00	735,000
ネットワンシステムズ	5,000	1,077.00	5,385,000
システムソフト	2,800	159.00	445,200
アルゴグラフィックス	500	2,743.00	1,371,500
マーベラス	2,000	1,115.00	2,230,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	2,100	1,463.00	3,072,300
日本ユニシス	3,200	1,805.00	5,776,000
兼松エレクトロニクス	700	3,530.00	2,471,000
東京放送ホールディングス	7,600	1,960.00	14,896,000
日本テレビホールディングス	10,500	1,870.00	19,635,000
朝日放送	1,100	811.00	892,100
テレビ朝日ホールディングス	3,200	2,019.00	6,460,800
スカパーJ S A Tホールディングス	7,500	480.00	3,600,000
テレビ東京ホールディングス	1,000	2,262.00	2,262,000
日本BS放送	400	1,228.00	491,200

ビジョン	200	5,570.00	1,114,000
U - N E X T	300	1,185.00	355,500
ワイヤレスゲート	500	1,583.00	791,500
コネクシオ	1,000	1,913.00	1,913,000
日本通信	9,900	167.00	1,653,300
クロップス	300	605.00	181,500
日本電信電話	92,500	5,429.00	502,182,500
K D D I	114,000	2,999.50	341,943,000
光通信	1,400	11,570.00	16,198,000
N T T ドコモ	84,800	2,738.50	232,224,800
エムティーアイ	1,600	751.00	1,201,600
G M O インターネット	4,200	1,501.00	6,304,200
アйдママーケティングコミュニケーション	100	745.00	74,500
カドカワ	3,400	1,439.00	4,892,600
学研ホールディングス	400	3,235.00	1,294,000
ゼンリン	1,500	3,255.00	4,882,500
昭文社	700	723.00	506,100
インプレスホールディングス	1,100	141.00	155,100
アイネット	600	1,353.00	811,800
松竹	7,000	1,446.00	10,122,000
東宝	7,500	3,505.00	26,287,500
東映	4,000	1,066.00	4,264,000
エヌ・ティ・ティ・データ	7,100	6,390.00	45,369,000
ピー・シー・エー	200	1,495.00	299,000
ビジネスブレイン太田昭和	200	1,034.00	206,800
D T S	1,200	3,515.00	4,218,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	4,500	3,885.00	17,482,500
シーイーシー	700	2,172.00	1,520,400
カプコン	2,700	2,799.00	7,557,300
アイ・エス・ピー	300	1,520.00	456,000
ジャステック	700	1,234.00	863,800
S C S K	3,100	5,270.00	16,337,000
日本システムウエア	400	1,865.00	746,000
アイネス	1,400	1,135.00	1,589,000
T K C	1,100	3,300.00	3,630,000
富士ソフト	1,700	3,200.00	5,440,000

N S D	2,500	2,066.00	5,165,000
コナミホールディングス	5,200	6,510.00	33,852,000
福井コンピュータホールディングス	300	3,985.00	1,195,500
J B C Cホールディングス	1,000	851.00	851,000
ミロク情報サービス	1,100	2,475.00	2,722,500
ソフトバンクグループ	51,900	9,258.00	480,490,200
ハウスイ	1,000	126.00	126,000
高千穂交易	400	1,110.00	444,000
伊藤忠食品	300	4,705.00	1,411,500
エレマテック	500	1,803.00	901,500
J A L U X	400	2,730.00	1,092,000
あらた	500	3,915.00	1,957,500
トーメンデバイス	200	2,224.00	444,800
東京エレクトロン デバイス	400	1,690.00	676,000
フィールズ	900	1,178.00	1,060,200
双日	68,200	265.00	18,073,000
アルフレッサ ホールディングス	13,600	2,168.00	29,484,800
横浜冷凍	2,700	1,053.00	2,843,100
神栄	2,000	169.00	338,000
山下医科器械	100	1,736.00	173,600
ラサ商事	500	975.00	487,500
ラクーン	800	608.00	486,400
アルコニックス	700	1,974.00	1,381,800
神戸物産	600	5,480.00	3,288,000
あい ホールディングス	1,700	3,080.00	5,236,000
ディーブイエックス	400	1,316.00	526,400
ダイワボウホールディングス	10,000	398.00	3,980,000
マクニカ・富士エレホールディングス	2,100	1,676.00	3,519,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,200	929.00	2,043,800
八洲電機	900	808.00	727,200
メディアスホールディングス	200	3,140.00	628,000
U K Cホールディングス	700	1,905.00	1,333,500
O C H Iホールディングス	300	1,375.00	412,500
T O K A Iホールディングス	5,100	828.00	4,222,800
大阪工機	100	795.00	79,500
三洋貿易	600	2,569.00	1,541,400

ビューティガレージ	100	1,679.00	167,900	
ウイン・パートナーズ	800	1,368.00	1,094,400	
ミタチ産業	200	646.00	129,200	
シップヘルスケアホールディングス	2,200	3,400.00	7,480,000	
明治電機工業	400	1,355.00	542,000	
デリカフーズ	300	1,625.00	487,500	
スターティア	300	644.00	193,200	
コメダホールディングス	2,100	1,810.00	3,801,000	
富士興産	400	500.00	200,000	
協栄産業	1,000	188.00	188,000	
小野建	1,000	1,711.00	1,711,000	
佐鳥電機	800	841.00	672,800	
エコートレーディング	300	717.00	215,100	
伯東	800	1,393.00	1,114,400	
コンドーテック	900	945.00	850,500	
中山福	700	791.00	553,700	
ナガイレーベン	1,500	2,628.00	3,942,000	
三菱食品	1,300	3,260.00	4,238,000	
松田産業	800	1,471.00	1,176,800	
第一興商	1,900	5,370.00	10,203,000	
メディバルホールディングス	11,500	2,083.00	23,954,500	
S P K	200	2,651.00	530,200	
萩原電気	400	2,190.00	876,000	
アズワン	900	5,410.00	4,869,000	
スズデン	400	1,284.00	513,600	
シモジマ	700	1,139.00	797,300	
ドウシシャ	1,300	2,178.00	2,831,400	
小津産業	200	2,179.00	435,800	
高速	700	1,061.00	742,700	
たけびし	400	1,401.00	560,400	
黒田電気	1,600	2,245.00	3,592,000	
リックス	200	1,878.00	375,600	
丸文	1,000	787.00	787,000	
ハビネット	1,000	2,152.00	2,152,000	
橋本総業ホールディングス	300	1,738.00	521,400	
日本ライフライン	1,300	4,795.00	6,233,500	

エクセル	500	1,432.00	716,000
マルカキカイ	400	1,878.00	751,200
I D O M	3,100	736.00	2,281,600
日本エム・ディ・エム	900	980.00	882,000
進和	700	2,182.00	1,527,400
エスケイジャパン	300	292.00	87,600
ダイトロン	500	1,340.00	670,000
シークス	800	4,395.00	3,516,000
田中商事	400	734.00	293,600
オーハシテクニカ	600	1,401.00	840,600
白銅	300	1,706.00	511,800
伊藤忠商事	84,400	1,620.50	136,770,200
丸紅	113,400	690.10	78,257,340
高島	2,000	209.00	418,000
長瀬産業	6,900	1,662.00	11,467,800
蝶理	700	2,079.00	1,455,300
豊田通商	12,800	3,320.00	42,496,000
三共生興	1,700	393.00	668,100
兼松	25,000	229.00	5,725,000
ツカモトコーポレーション	2,000	126.00	252,000
三井物産	104,200	1,525.50	158,957,100
日本紙パルプ商事	6,000	425.00	2,550,000
日立ハイテクノロジーズ	4,000	4,400.00	17,600,000
カメイ	1,500	1,501.00	2,251,500
東都水産	200	1,884.00	376,800
O U Gホールディングス	2,000	261.00	522,000
スターゼン	500	5,010.00	2,505,000
山善	4,400	1,130.00	4,972,000
椿本興業	1,000	437.00	437,000
住友商事	72,500	1,434.00	103,965,000
内田洋行	500	2,773.00	1,386,500
三菱商事	86,500	2,262.50	195,706,250
第一実業	3,000	594.00	1,782,000
キャノンマーケティングジャパン	3,300	2,592.00	8,553,600
西華産業	3,000	398.00	1,194,000
佐藤商事	1,000	894.00	894,000

菱洋エレクトロ	1,100	1,801.00	1,981,100
東京産業	1,200	444.00	532,800
ユアサ商事	1,100	3,410.00	3,751,000
神鋼商事	300	2,641.00	792,300
小林産業	800	300.00	240,000
阪和興業	12,000	767.00	9,204,000
カナデン	1,100	1,198.00	1,317,800
菱電商事	2,000	780.00	1,560,000
フルサト工業	600	1,747.00	1,048,200
岩谷産業	13,000	701.00	9,113,000
すてきナイスグループ	5,000	151.00	755,000
昭光通商	5,000	96.00	480,000
ニチモウ	2,000	177.00	354,000
極東貿易	2,000	269.00	538,000
イワキ	2,000	417.00	834,000
三愛石油	3,100	1,087.00	3,369,700
稲畑産業	2,800	1,472.00	4,121,600
G S Iクレオス	3,000	142.00	426,000
明和産業	1,100	438.00	481,800
ワキタ	2,400	1,271.00	3,050,400
東邦ホールディングス	3,700	2,226.00	8,236,200
サンゲツ	3,900	1,964.00	7,659,600
ミツウロコグループホールディングス	1,800	720.00	1,296,000
シナネンホールディングス	500	2,286.00	1,143,000
伊藤忠エネクス	2,500	934.00	2,335,000
サンリオ	3,600	2,157.00	7,765,200
サンワテクノス	700	1,571.00	1,099,700
リョーサン	1,700	4,210.00	7,157,000
新光商事	1,300	1,414.00	1,838,200
トーヨー	500	3,050.00	1,525,000
三信電気	1,300	1,442.00	1,874,600
東陽テクニカ	1,300	1,096.00	1,424,800
モスフードサービス	1,500	3,515.00	5,272,500
加賀電子	1,000	2,319.00	2,319,000
ソーダニッカ	1,200	529.00	634,800
立花エレテック	800	1,536.00	1,228,800

フォーバル	500	734.00	367,000
PALTAC	1,800	3,805.00	6,849,000
三谷産業	1,200	417.00	500,400
太平洋興発	5,000	96.00	480,000
ヤマタネ	600	1,622.00	973,200
丸紅建材リース	1,000	220.00	220,000
日鉄住金物産	1,000	5,210.00	5,210,000
トラスコ中山	2,600	2,551.00	6,632,600
オートバックスセブン	4,300	1,836.00	7,894,800
モリト	900	936.00	842,400
加藤産業	1,800	3,030.00	5,454,000
イノテック	1,000	668.00	668,000
イエローハット	1,100	2,718.00	2,989,800
J Kホールディングス	1,200	665.00	798,000
日伝	500	3,920.00	1,960,000
北沢産業	1,000	202.00	202,000
杉本商事	700	1,543.00	1,080,100
因幡電機産業	1,600	4,220.00	6,752,000
バイテックホールディングス	500	1,391.00	695,500
ミスミグループ本社	13,000	2,542.00	33,046,000
アルテック	1,100	225.00	247,500
タキヒヨー	1,000	464.00	464,000
蔵王産業	200	1,463.00	292,600
スズケン	5,300	3,700.00	19,610,000
ジェコス	800	1,315.00	1,052,000
ルネサスイーストン	1,100	583.00	641,300
ローソン	3,600	7,690.00	27,684,000
サンエー	900	4,980.00	4,482,000
カワチ薬品	900	2,709.00	2,438,100
エービーシー・マート	2,100	6,620.00	13,902,000
ハードオフコーポレーション	500	1,160.00	580,000
アスクル	1,200	3,355.00	4,026,000
ゲオホールディングス	1,900	1,197.00	2,274,300
アダストリア	1,800	3,125.00	5,625,000
ジーフット	700	807.00	564,900
シー・ヴィ・エス・バイエリア	200	724.00	144,800

くらコーポレーション	700	5,170.00	3,619,000
キャンドウ	600	1,687.00	1,012,200
パルグループホールディングス	600	2,921.00	1,752,600
エディオン	4,500	1,020.00	4,590,000
サーラコーポレーション	1,400	724.00	1,013,600
ワッツ	500	1,265.00	632,500
ハローズ	400	2,390.00	956,000
あみやき亭	200	4,105.00	821,000
ひらまつ	1,600	670.00	1,072,000
ゲンキー	500	3,090.00	1,545,000
大黒天物産	300	5,560.00	1,668,000
ハニーズホールディングス	1,100	1,266.00	1,392,600
ファーマライズホールディングス	300	525.00	157,500
アルペン	900	2,071.00	1,863,900
クオール	1,300	1,729.00	2,247,700
ジンス	800	6,310.00	5,048,000
ビックカメラ	6,600	1,208.00	7,972,800
D C Mホールディングス	7,000	975.00	6,825,000
MonotaRO	4,100	3,695.00	15,149,500
東京一番フーズ	300	579.00	173,700
ダイヤモンドダイニング	300	2,307.00	692,100
きちり	300	671.00	201,300
アークランドサービスホールディングス	500	4,135.00	2,067,500
J.フロント リテイリング	14,600	1,633.00	23,841,800
ドトール・日レスホールディングス	2,000	2,396.00	4,792,000
マツモトキヨシホールディングス	2,200	6,650.00	14,630,000
ブロンコビリー	600	2,709.00	1,625,400
スタートトゥデイ	10,500	2,940.00	30,870,000
トレジャー・ファクトリー	300	803.00	240,900
物語コーポレーション	300	5,940.00	1,782,000
ココカラファイン	1,200	5,630.00	6,756,000
三越伊勢丹ホールディングス	23,000	1,118.00	25,714,000
Hamee	300	1,684.00	505,200
ウエルシアホールディングス	3,000	4,260.00	12,780,000
クリエイティブSDホールディングス	1,700	2,607.00	4,431,900
丸善CHIホールディングス	1,300	362.00	470,600

ミサワ	300	456.00	136,800	
ティーライフ	200	1,734.00	346,800	
エー・ピーカンパニー	200	899.00	179,800	
チムニー	400	2,810.00	1,124,000	
シュッピン	400	1,971.00	788,400	
ネクステージ	400	1,483.00	593,200	
ジョイフル本田	1,900	3,455.00	6,564,500	
鳥貴族	400	2,546.00	1,018,400	
キリン堂ホールディングス	400	938.00	375,200	
ホットランド	600	1,554.00	932,400	
すかいらーく	5,000	1,664.00	8,320,000	
綿半ホールディングス	500	2,285.00	1,142,500	
ヨシックス	100	1,542.00	154,200	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3,800	1,204.00	4,575,200	
ブックオフコーポレーション	700	792.00	554,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	500	862.00	431,000	
B E E N O S	200	1,474.00	294,800	
あさひ	900	1,367.00	1,230,300	
日本調剤	400	3,615.00	1,446,000	
コスモス薬品	600	23,180.00	13,908,000	
トーエル	600	887.00	532,200	
一六堂	300	395.00	118,500	
オンリー	200	821.00	164,200	
セブン&アイ・ホールディングス	48,200	4,723.00	227,648,600	
薬王堂	600	3,445.00	2,067,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	3,100	1,018.00	3,155,800	
ツルハホールディングス	2,300	12,350.00	28,405,000	
サンマルクホールディングス	700	3,425.00	2,397,500	
フェリシモ	400	1,104.00	441,600	
トリドールホールディングス	1,400	2,791.00	3,907,400	
T O K Y O B A S E	200	4,495.00	899,000	
サツドラホールディングス	200	2,049.00	409,800	
ダイユー・リックホールディングス	400	784.00	313,600	
パロックジャパンリミテッド	900	1,107.00	996,300	
クスリのアオキホールディングス	900	5,400.00	4,860,000	

スシローグローバルホールディングス	1,000	3,335.00	3,335,000
LIXILビバ	1,100	2,000.00	2,200,000
メディカルシステムネットワーク	1,300	511.00	664,300
総合メディカル	500	5,010.00	2,505,000
はるやまホールディングス	500	1,034.00	517,000
ノジマ	1,800	1,822.00	3,279,600
カップ・クリエイト	1,600	1,285.00	2,056,000
ライトオン	1,000	1,021.00	1,021,000
ジーンズメイト	400	504.00	201,600
良品計画	1,500	29,280.00	43,920,000
三城ホールディングス	1,300	467.00	607,100
アドヴァン	1,200	1,157.00	1,388,400
アルビス	300	5,250.00	1,575,000
コナカ	1,500	603.00	904,500
ハウス オブ ローゼ	200	1,559.00	311,800
G-7ホールディングス	400	2,203.00	881,200
イオン北海道	1,200	604.00	724,800
コジマ	2,100	316.00	663,600
ヒマラヤ	300	833.00	249,900
コーナン商事	1,600	2,120.00	3,392,000
エコス	400	1,212.00	484,800
ワタミ	1,400	1,397.00	1,955,800
マルシェ	300	828.00	248,400
ドンキホーテホールディングス	7,500	4,270.00	32,025,000
西松屋チェーン	2,000	1,173.00	2,346,000
ゼンショーホールディングス	6,000	2,092.00	12,552,000
幸楽苑ホールディングス	700	1,830.00	1,281,000
ハークスレイ	300	1,112.00	333,600
サイゼリヤ	1,700	3,345.00	5,686,500
V Tホールディングス	3,900	565.00	2,203,500
魚力	300	1,243.00	372,900
ポブラ	300	577.00	173,100
フジ・コーポレーション	200	1,936.00	387,200
ユナイテッドアローズ	1,500	3,765.00	5,647,500
ハイデイ日高	1,200	2,604.00	3,124,800
京都きもの友禅	700	931.00	651,700

コロワイド	3,800	1,910.00	7,258,000
ピーシーデポコーポレーション	1,600	574.00	918,400
売番屋	800	3,890.00	3,112,000
トップカルチャー	400	496.00	198,400
P L A N T	300	1,221.00	366,300
スギホールディングス	2,500	6,110.00	15,275,000
ヴィア・ホールディングス	900	972.00	874,800
スクロール	1,800	385.00	693,000
ヨンドシーホールディングス	1,200	2,830.00	3,396,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	5,100	6,520.00	33,252,000
木曽路	1,400	2,779.00	3,890,600
サトレストランシステムズ	1,300	903.00	1,173,900
千趣会	2,100	844.00	1,772,400
タカキュー	900	198.00	178,200
ケーヨー	2,000	793.00	1,586,000
上新電機	3,000	1,546.00	4,638,000
日本瓦斯	2,100	3,700.00	7,770,000
ベスト電器	3,800	160.00	608,000
ロイヤルホールディングス	1,900	2,613.00	4,964,700
東天紅	1,000	206.00	206,000
いなげや	1,300	1,882.00	2,446,600
島忠	3,000	2,712.00	8,136,000
チヨダ	1,300	3,030.00	3,939,000
ライフコーポレーション	900	3,225.00	2,902,500
リンガーハット	1,300	2,431.00	3,160,300
さが美	1,000	121.00	121,000
MrMax	1,400	562.00	786,800
テンアライド	1,100	396.00	435,600
AOKIホールディングス	2,300	1,436.00	3,302,800
オークワ	2,000	1,289.00	2,578,000
コメリ	1,800	2,879.00	5,182,200
青山商事	2,400	4,020.00	9,648,000
しまむら	1,300	13,950.00	18,135,000
はせがわ	600	476.00	285,600
高島屋	19,000	1,118.00	21,242,000
松屋	2,500	1,086.00	2,715,000

エイチ・ツー・オー リテイリング	5,900	2,004.00	11,823,600	
近鉄百貨店	4,000	354.00	1,416,000	
パルコ	1,100	1,246.00	1,370,600	
丸井グループ	12,200	1,694.00	20,666,800	
アクシアル リテイリング	900	4,340.00	3,906,000	
イオン	47,400	1,707.50	80,935,500	
イズミ	2,100	6,570.00	13,797,000	
東武ストア	100	3,070.00	307,000	
平和堂	2,400	2,414.00	5,793,600	
フジ	1,300	2,900.00	3,770,000	
ヤオコー	1,300	4,965.00	6,454,500	
ゼビオホールディングス	1,600	1,957.00	3,131,200	
ケーズホールディングス	4,900	2,248.00	11,015,200	
O l y m p i cグループ	700	615.00	430,500	
日産東京販売ホールディングス	1,700	421.00	715,700	
アインホールディングス	1,500	8,030.00	12,045,000	
元気寿司	300	2,264.00	679,200	
ヤマダ電機	38,600	570.00	22,002,000	
アークランドサカモト	1,900	1,542.00	2,929,800	
ニトリホールディングス	5,000	16,790.00	83,950,000	
愛眼	900	218.00	196,200	
ケーユーホールディングス	600	978.00	586,800	
吉野家ホールディングス	4,000	1,902.00	7,608,000	
松屋フーズ	600	4,295.00	2,577,000	
サガミチェーン	1,400	1,411.00	1,975,400	
関西スーパーマーケット	900	1,590.00	1,431,000	
王将フードサービス	900	4,335.00	3,901,500	
プレナス	1,300	2,354.00	3,060,200	
ミニストップ	800	2,368.00	1,894,400	
アークス	2,200	2,463.00	5,418,600	
バローホールディングス	2,500	2,567.00	6,417,500	
藤久	100	1,756.00	175,600	
ベルク	500	5,530.00	2,765,000	
大庄	600	1,804.00	1,082,400	
ファーストリテイリング	1,900	37,050.00	70,395,000	
サンドラッグ	4,400	4,295.00	18,898,000	

サクスパー ホールディングス	1,100	1,246.00	1,370,600	
ヤマザワ	300	1,797.00	539,100	
やまや	300	1,597.00	479,100	
ペルーナ	2,500	1,355.00	3,387,500	
島根銀行	300	1,301.00	390,300	
じもとホールディングス	8,200	198.00	1,623,600	
めぶきフィナンシャルグループ	55,600	423.00	23,518,800	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	1,700	2,926.00	4,974,200	
九州フィナンシャルグループ	18,900	694.00	13,116,600	
ゆうちょ銀行	32,600	1,420.00	46,292,000	
富山第一銀行	2,900	513.00	1,487,700	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	74,700	542.80	40,547,160	
西日本フィナンシャルホールディングス	7,800	1,122.00	8,751,600	
新生銀行	110,000	187.00	20,570,000	
あおぞら銀行	73,000	427.00	31,171,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	873,400	726.90	634,874,460	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	134,900	582.90	78,633,210	
三井住友トラスト・ホールディングス	24,100	3,792.00	91,387,200	
三井住友フィナンシャルグループ	92,300	4,201.00	387,752,300	代用有価証券 10,000株
第四銀行	14,000	512.00	7,168,000	
北越銀行	1,200	2,686.00	3,223,200	
千葉銀行	44,000	793.00	34,892,000	
群馬銀行	25,600	645.00	16,512,000	
武蔵野銀行	1,800	3,335.00	6,003,000	
千葉興業銀行	3,200	576.00	1,843,200	
筑波銀行	4,800	333.00	1,598,400	
七十七銀行	18,000	517.00	9,306,000	
青森銀行	9,000	389.00	3,501,000	
秋田銀行	7,000	326.00	2,282,000	
山形銀行	6,000	489.00	2,934,000	
岩手銀行	800	4,425.00	3,540,000	
東邦銀行	10,000	389.00	3,890,000	
東北銀行	6,000	151.00	906,000	
みちのく銀行	7,000	183.00	1,281,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	47,000	534.00	25,098,000	

静岡銀行	30,000	983.00	29,490,000	
十六銀行	15,000	346.00	5,190,000	
スルガ銀行	11,800	2,722.00	32,119,600	
八十二銀行	22,200	686.00	15,229,200	
山梨中央銀行	7,000	458.00	3,206,000	
大垣共立銀行	18,000	318.00	5,724,000	
福井銀行	10,000	280.00	2,800,000	
北國銀行	12,000	426.00	5,112,000	
清水銀行	400	3,550.00	1,420,000	
富山銀行	200	4,195.00	839,000	
滋賀銀行	11,000	584.00	6,424,000	
南都銀行	1,100	3,150.00	3,465,000	
百五銀行	10,000	450.00	4,500,000	
京都銀行	21,000	1,068.00	22,428,000	
紀陽銀行	4,300	1,944.00	8,359,200	
三重銀行	500	2,503.00	1,251,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	7,700	1,709.00	13,159,300	
広島銀行	34,000	482.00	16,388,000	
山陰合同銀行	6,800	908.00	6,174,400	
中国銀行	8,200	1,629.00	13,357,800	
鳥取銀行	400	1,693.00	677,200	
伊予銀行	16,400	887.00	14,546,800	
百十四銀行	13,000	361.00	4,693,000	
四国銀行	9,000	308.00	2,772,000	
阿波銀行	10,000	762.00	7,620,000	
大分銀行	7,000	430.00	3,010,000	
宮崎銀行	8,000	357.00	2,856,000	
佐賀銀行	7,000	262.00	1,834,000	
十八銀行	7,000	318.00	2,226,000	
沖縄銀行	1,100	4,500.00	4,950,000	
琉球銀行	2,400	1,612.00	3,868,800	
セブン銀行	43,200	423.00	18,273,600	
みずほフィナンシャルグループ	1,564,700	197.40	308,871,780	
高知銀行	4,000	127.00	508,000	
山口フィナンシャルグループ	11,000	1,340.00	14,740,000	
長野銀行	400	1,985.00	794,000	

名古屋銀行	900	4,165.00	3,748,500
北洋銀行	18,900	390.00	7,371,000
愛知銀行	400	6,290.00	2,516,000
第三銀行	700	1,704.00	1,192,800
中京銀行	500	2,312.00	1,156,000
大光銀行	4,000	237.00	948,000
愛媛銀行	1,400	1,397.00	1,955,800
トマト銀行	500	1,552.00	776,000
みなと銀行	1,000	2,068.00	2,068,000
京葉銀行	9,000	473.00	4,257,000
関西アーバン銀行	1,600	1,321.00	2,113,600
栃木銀行	6,400	471.00	3,014,400
北日本銀行	300	3,160.00	948,000
東和銀行	22,000	130.00	2,860,000
福島銀行	13,000	87.00	1,131,000
大東銀行	6,000	162.00	972,000
トモニホールディングス	9,500	544.00	5,168,000
フィデアホールディングス	11,300	187.00	2,113,100
池田泉州ホールディングス	12,200	461.00	5,624,200
F P G	4,100	1,012.00	4,149,200
S B I ホールディングス	13,100	1,447.00	18,955,700
ジャフコ	1,900	4,440.00	8,436,000
大和証券グループ本社	105,000	663.50	69,667,500
野村ホールディングス	235,700	668.40	157,541,880
岡三証券グループ	10,000	711.00	7,110,000
丸三証券	3,700	912.00	3,374,400
東洋証券	4,000	248.00	992,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	13,200	591.00	7,801,200
光世証券	3,000	159.00	477,000
水戸証券	3,700	314.00	1,161,800
いちよし証券	2,600	939.00	2,441,400
松井証券	6,600	905.00	5,973,000
だいこう証券ビジネス	600	637.00	382,200
マネックスグループ	12,300	289.00	3,554,700
カブドットコム証券	8,500	375.00	3,187,500
極東証券	1,600	1,593.00	2,548,800

岩井コスモホールディングス	1,100	1,213.00	1,334,300	
藍澤証券	2,200	695.00	1,529,000	
マネーパートナーズグループ	1,500	509.00	763,500	
かんぽ生命保険	4,300	2,424.00	10,423,200	
S O M P Oホールディングス	24,100	4,230.00	101,943,000	
アニコム ホールディングス	800	2,473.00	1,978,400	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	34,500	3,769.00	130,030,500	
ソニーフィナンシャルホールディングス	11,100	1,800.00	19,980,000	
第一生命ホールディングス	69,500	1,931.00	134,204,500	
東京海上ホールディングス	46,400	4,670.00	216,688,000	
T & Dホールディングス	42,000	1,628.00	68,376,000	
アドバンスクリエイト	300	1,923.00	576,900	
全国保証	3,200	4,825.00	15,440,000	
クレディセゾン	8,800	2,213.00	19,474,400	
芙蓉総合リース	1,300	6,210.00	8,073,000	
興銀リース	2,200	2,674.00	5,882,800	
東京センチュリー	2,300	4,390.00	10,097,000	
日本証券金融	5,100	560.00	2,856,000	
アイフル	19,500	425.00	8,287,500	
ポケットカード	900	726.00	653,400	
リコーリース	900	3,810.00	3,429,000	
イオンフィナンシャルサービス	7,400	2,357.00	17,441,800	
アコム	23,200	515.00	11,948,000	
ジャックス	6,000	527.00	3,162,000	
オリエントコーポレーション	25,100	195.00	4,894,500	
日立キャピタル	2,700	2,600.00	7,020,000	
アプラスフィナンシャル	5,800	113.00	655,400	
オリックス	81,600	1,769.00	144,350,400	
三菱UFJリース	29,300	585.00	17,140,500	
日本取引所グループ	35,800	2,016.00	72,172,800	
イー・ギャランティ	400	2,668.00	1,067,200	
アサックス	200	1,684.00	336,800	
N E Cキャピタルソリューション	500	1,802.00	901,000	
いちご	11,000	327.00	3,597,000	
日本駐車場開発	13,900	162.00	2,251,800	

ヒューリック	24,000	1,103.00	26,472,000
三栄建築設計	400	1,781.00	712,400
野村不動産ホールディングス	7,700	2,158.00	16,616,600
三重交通グループホールディングス	2,100	392.00	823,200
サムティ	900	1,214.00	1,092,600
ディア・ライフ	1,000	413.00	413,000
エー・ディー・ワークス	11,000	45.00	495,000
日本商業開発	600	1,614.00	968,400
プレサンスコーポレーション	1,800	1,431.00	2,575,800
ユニゾホールディングス	900	2,961.00	2,664,900
THEグローバル社	600	587.00	352,200
日本管理センター	800	1,390.00	1,112,000
サンセイランディック	300	779.00	233,700
エストラスト	200	693.00	138,600
フージャースホールディングス	1,500	977.00	1,465,500
オープンハウス	1,900	3,280.00	6,232,000
東急不動産ホールディングス	27,900	657.00	18,330,300
飯田グループホールディングス	9,600	1,855.00	17,808,000
ムゲンエステート	500	920.00	460,000
ファーストブラザーズ	200	1,483.00	296,600
ハウスドゥ	200	1,801.00	360,200
シーアールイー	200	1,550.00	310,000
ケイアイスター不動産	300	2,033.00	609,900
エコナックホールディングス	5,000	64.00	320,000
パーク24	5,900	2,874.00	16,956,600
パラカ	400	2,073.00	829,200
三井不動産	61,100	2,631.00	160,754,100
三菱地所	85,700	2,086.00	178,770,200
平和不動産	2,200	1,799.00	3,957,800
東京建物	13,400	1,496.00	20,046,400
ダイビル	3,000	1,134.00	3,402,000
京阪神ビルディング	1,900	701.00	1,331,900
住友不動産	28,000	3,477.00	97,356,000
大京	21,000	235.00	4,935,000
テーオーシー	4,500	1,076.00	4,842,000
東京楽天地	2,000	576.00	1,152,000

レオパレス21	14,600	673.00	9,825,800
スタートコーポレーション	1,600	2,738.00	4,380,800
フジ住宅	1,500	743.00	1,114,500
空港施設	1,400	608.00	851,200
明和地所	700	804.00	562,800
ゴールドクレスト	1,000	2,388.00	2,388,000
日本エスリード	400	1,864.00	745,600
日神不動産	1,400	579.00	810,600
日本エスコン	2,000	491.00	982,000
タカラレーベン	5,000	511.00	2,555,000
サンヨーハウジング名古屋	600	1,089.00	653,400
イオンモール	7,400	2,226.00	16,472,400
ファースト住建	400	1,562.00	624,800
トーセイ	1,600	787.00	1,259,200
エヌ・ティ・ティ都市開発	7,200	1,077.00	7,754,400
サンフロンティア不動産	1,200	1,121.00	1,345,200
エフ・ジェー・ネクスト	1,000	853.00	853,000
インテリックス	400	824.00	329,600
ランドビジネス	800	290.00	232,000
グランディハウス	1,000	428.00	428,000
日本空港ビルデング	3,700	4,320.00	15,984,000
日本工営	800	3,225.00	2,580,000
L i f u l l	3,000	904.00	2,712,000
ジェイエイシーリクルートメント	700	1,733.00	1,213,100
日本M&Aセンター	3,500	4,330.00	15,155,000
メンバーズ	300	730.00	219,000
中広	100	752.00	75,200
タケエイ	1,100	1,091.00	1,200,100
トラスト・テック	500	2,367.00	1,183,500
コシダカホールディングス	600	2,846.00	1,707,600
パソナグループ	900	1,091.00	981,900
C D S	300	1,378.00	413,400
リンクアンドモチベーション	2,900	852.00	2,470,800
G C A	1,100	1,020.00	1,122,000
エス・エム・エス	1,700	3,505.00	5,958,500
テンブホールディングス	9,400	2,279.00	21,422,600

リニカル	700	1,833.00	1,283,100
クックパッド	2,700	926.00	2,500,200
エスクリ	500	716.00	358,000
アイ・ケイ・ケイ	500	808.00	404,000
学情	500	1,260.00	630,000
スタジオアリス	500	2,445.00	1,222,500
シミックホールディングス	600	1,523.00	913,800
N J S	300	1,389.00	416,700
総合警備保障	4,400	5,240.00	23,056,000
カカクコム	8,700	1,606.00	13,972,200
アイロムグループ	400	1,458.00	583,200
セントケア・ホールディング	200	1,651.00	330,200
サイネックス	100	1,001.00	100,100
ルネサンス	600	1,949.00	1,169,400
ディップ	1,600	2,317.00	3,707,200
オプトホールディング	900	1,480.00	1,332,000
新日本科学	1,400	698.00	977,200
ツクイ	2,900	661.00	1,916,900
キャリアデザインセンター	300	1,405.00	421,500
エムスリー	10,600	3,285.00	34,821,000
ツカダ・グローバルホールディング	900	594.00	534,600
プラス	100	1,124.00	112,400
アウトソーシング	800	5,600.00	4,480,000
ウェルネット	900	1,501.00	1,350,900
ワールドホールディングス	400	2,484.00	993,600
ディー・エヌ・エー	5,500	2,546.00	14,003,000
博報堂D Yホールディングス	16,900	1,476.00	24,944,400
ぐるなび	1,800	1,795.00	3,231,000
エスアールジータカミヤ	1,300	571.00	742,300
ジャパンベストレスキューシステム	1,400	279.00	390,600
ファンコミュニケーションズ	3,100	1,065.00	3,301,500
ライク	200	3,455.00	691,000
ビジネス・ブレークスルー	500	399.00	199,500
W D Bホールディングス	500	2,481.00	1,240,500
ティア	600	778.00	466,800
C D G	100	1,808.00	180,800

バリューコマース	1,100	687.00	755,700
インフォーマート	5,200	923.00	4,799,600
J Pホールディングス	3,500	300.00	1,050,000
E P Sホールディングス	1,700	1,710.00	2,907,000
レッグス	300	783.00	234,900
プレステージ・インターナショナル	2,300	1,249.00	2,872,700
アミューズ	700	3,190.00	2,233,000
ドリームインキュベータ	400	2,170.00	868,000
クイック	600	1,519.00	911,400
T A C	700	251.00	175,700
ケネディクス	15,500	535.00	8,292,500
電通	13,600	5,360.00	72,896,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	777.00	466,200
ぴあ	400	3,850.00	1,540,000
イオンファンタジー	400	3,210.00	1,284,000
シーティーエス	700	1,070.00	749,000
みらかホールディングス	3,100	5,000.00	15,500,000
アルプス技研	500	3,820.00	1,910,000
ダイオーズ	200	1,261.00	252,200
日本空調サービス	1,200	688.00	825,600
オリエンタルランド	13,200	7,740.00	102,168,000
ダスキン	3,000	2,932.00	8,796,000
明光ネットワークジャパン	1,400	1,484.00	2,077,600
ファルコホールディングス	600	1,515.00	909,000
秀英予備校	300	452.00	135,600
田谷	200	668.00	133,600
ラウンドワン	3,800	1,098.00	4,172,400
リゾートトラスト	4,700	2,149.00	10,100,300
ビー・エム・エル	1,600	2,231.00	3,569,600
ワタベウェディング	200	522.00	104,400
りらいあコミュニケーションズ	2,000	1,231.00	2,462,000
リソー教育	2,100	918.00	1,927,800
早稲田アカデミー	200	1,479.00	295,800
ユー・エス・エス	14,800	2,311.00	34,202,800
東京個別指導学院	400	1,533.00	613,200
サイバーエージェント	7,300	3,655.00	26,681,500

楽天	62,300	1,354.00	84,354,200
クリーク・アンド・リバー社	600	1,017.00	610,200
テー・オー・ダブリュー	1,000	870.00	870,000
セントラルスポーツ	400	4,710.00	1,884,000
フルキャストホールディングス	1,300	1,307.00	1,699,100
リソルホールディングス	1,000	369.00	369,000
テクノプロ・ホールディングス	2,000	4,750.00	9,500,000
アトラ	200	701.00	140,200
インターワークス	300	1,196.00	358,800
K e e P e r 技研	200	2,813.00	562,600
ファーストロジック	100	2,647.00	264,700
三機サービス	100	1,317.00	131,700
デザインワン・ジャパン	200	1,505.00	301,000
イー・ガーディアン	600	2,347.00	1,408,200
リブセンス	800	649.00	519,200
ジャパンマテリアル	900	2,166.00	1,949,400
ベクトル	1,000	1,930.00	1,930,000
ウチヤマホールディングス	600	457.00	274,200
サクセスホールディングス	100	1,641.00	164,100
キャリアリンク	300	657.00	197,100
I B J	1,000	769.00	769,000
アサンテ	500	1,888.00	944,000
N・フィールド	600	1,409.00	845,400
バリューHR	100	3,175.00	317,500
M&Aキャピタルパートナーズ	200	5,530.00	1,106,000
ライドオン・エクスプレス	300	978.00	293,400
E R Iホールディングス	300	816.00	244,800
アビスト	200	4,070.00	814,000
ウィルグループ	500	1,031.00	515,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	300	2,236.00	670,800
日本ビューホテル	300	1,374.00	412,200
リクルートホールディングス	26,700	6,180.00	165,006,000
エラン	200	2,531.00	506,200
土木管理総合試験所	200	1,019.00	203,800
日本郵政	31,800	1,383.00	43,979,400
ベルシステム24ホールディングス	1,900	1,137.00	2,160,300

一蔵	100	1,115.00	111,500	
LITALICO	100	1,601.00	160,100	
エボラブルアジア	200	3,060.00	612,000	
ソラスト	800	1,491.00	1,192,800	
リログループ	6,100	2,261.00	13,792,100	
東祥	400	5,410.00	2,164,000	
エイチ・アイ・エス	2,000	3,450.00	6,900,000	
ラックランド	200	2,174.00	434,800	
共立メンテナンス	2,000	3,465.00	6,930,000	
イチネンホールディングス	1,200	1,215.00	1,458,000	
建設技術研究所	800	1,150.00	920,000	
スペース	700	1,531.00	1,071,700	
燦ホールディングス	200	2,224.00	444,800	
スバル興業	1,000	589.00	589,000	
東京テアトル	5,000	141.00	705,000	
タナベ経営	300	1,402.00	420,600	
ナガワ	200	3,995.00	799,000	
よみうりランド	2,000	538.00	1,076,000	
東京都競馬	8,000	283.00	2,264,000	
常磐興産	500	1,793.00	896,500	
カナモト	1,700	3,790.00	6,443,000	
東京ドーム	4,900	1,035.00	5,071,500	
西尾レントオール	1,000	3,525.00	3,525,000	
トランス・コスモス	1,400	2,503.00	3,504,200	
乃村工藝社	2,600	2,627.00	6,830,200	
藤田観光	4,000	377.00	1,508,000	
KNT-CTホールディングス	7,000	162.00	1,134,000	
日本管財	1,000	1,973.00	1,973,000	
トーカイ	500	4,400.00	2,200,000	
白洋舎	100	3,090.00	309,000	
セコム	12,700	8,624.00	109,524,800	
セントラル警備保障	600	2,047.00	1,228,200	
丹青社	2,100	1,194.00	2,507,400	
メイテック	1,400	4,890.00	6,846,000	
アサツー ディ・ケイ	2,000	2,827.00	5,654,000	
応用地質	1,100	1,570.00	1,727,000	

船井総研ホールディングス	1,600	2,958.00	4,732,800	
進学会	500	585.00	292,500	
オオバ	1,000	519.00	519,000	
いであ	200	1,093.00	218,600	
学究社	300	1,604.00	481,200	
ベネッセホールディングス	4,100	4,225.00	17,322,500	
イオンディライト	1,400	3,725.00	5,215,000	
ナック	800	986.00	788,800	
ニチイ学館	2,100	1,142.00	2,398,200	
ダイセキ	2,100	2,518.00	5,287,800	
ステップ	400	1,446.00	578,400	
合 計	17,703,300		27,475,796,770	

(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12月26日現在	平成29年 6月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,145,521,417	516,701,800
コール・ローン	380,042,015	687,242,026
出資金	8,377,888	5,546,633
株式	74,169,705,951	75,332,794,252
投資証券	1,973,237,719	2,046,576,522
派生商品評価勘定	21,230,531	2,716,624
未収入金	142,935	414,455

	平成28年12月26日現在	平成29年 6月26日現在
未収配当金	85,062,586	122,054,919
差入委託証拠金	172,088,523	158,716,882
流動資産合計	77,955,409,565	78,872,764,113
資産合計	77,955,409,565	78,872,764,113
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,971,413	1,355,078
未払金	217,800	-
未払解約金	307,828,685	103,684,796
未払利息	334	1,078
流動負債合計	313,018,232	105,040,952
負債合計	313,018,232	105,040,952
純資産の部		
元本等		
元本	37,314,699,206	35,886,980,317
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	40,327,692,127	42,880,742,844
元本等合計	77,642,391,333	78,767,723,161
純資産合計	77,642,391,333	78,767,723,161
負債純資産合計	77,955,409,565	78,872,764,113

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>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。</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12月26日現在	平成29年 6月26日現在
1.	期首	平成28年 6月28日	平成28年12月27日
	期首元本額	38,699,928,355円	37,314,699,206円
	期首からの追加設定元本額	1,658,069,455円	1,303,663,775円
	期首からの一部解約元本額	3,043,298,604円	2,731,382,664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）	14,738,958,804円	14,994,003,660円
	DCインデックスバランス（株式20）	51,755,877円	55,569,138円
	DCインデックスバランス（株式40）	168,341,653円	172,792,075円
	DCインデックスバランス（株式60）	314,357,822円	329,832,802円
	DCインデックスバランス（株式80）	353,978,238円	378,759,741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	3,181,104,450円	2,727,977,754円
	日興五大陸株式ファンド	6,605,352,995円	6,101,422,930円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	28,616,258円	27,908,547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）	108,505,614円	275,567,429円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	- 円	114,014,686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	1,885,558円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	6,407,468円	6,101,058円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	5,233,751円	4,912,728円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	7,553,149円	7,230,647円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	9,797,467円	8,269,628円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	6,712,682,456円	5,941,459,098円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	8,749,394円	- 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	29,487,715円	28,673,129円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	89,644,984円	84,782,603円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	125,300,408円	120,116,937円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	128,568,232円	121,207,757円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,638,464,914円	4,384,492,412円
	計	37,314,699,206円	35,886,980,317円
2.	受益権の総数	37,314,699,206口	35,886,980,317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28年 6月28日 至 平成28年12月26日	自 平成28年12月27日 至 平成29年 6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12月26日現在	平成29年 6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	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品 同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成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

（平成29年 6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	2,261,318
株式	8,527,827,292
投資証券	63,644,330
合計	8,589,210,304

(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

（平成29年 6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	1,136,398,196	-	1,137,849,212	1,451,016
合計		1,136,398,196	-	1,137,849,212	1,451,016

(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
	英債券	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

(平成29年 6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	為替予約取引				

の取引	買建	736,408,970	-	736,252,000	156,970
	米ドル	555,728,875	-	555,543,500	185,375
	ユーロ	180,680,095	-	180,708,500	28,405
	売建	250,402,500	-	250,335,000	67,500
	米ドル	250,402,500	-	250,335,000	67,500
	合計	986,811,470	-	986,587,000	89,470

(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12月26日現在		平成29年 6月26日現在	
1口当たり純資産額	2.0807円	1口当たり純資産額	2.1949円
(1万口当たり純資産額)	(20,807円)	(1万口当たり純資産額)	(21,949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	45.50	535,671.50	
	ANTERO RESOURCES CORP	3,670	20.78	76,262.60	
	APACHE CORP	7,904	46.08	364,216.32	

BAKER HUGHES INC	8,835	53.99	477,001.65
CABOT OIL & GAS CORP	9,730	23.74	230,990.20
CHENIERE ENERGY INC	4,070	47.62	193,813.40
CHEVRON CORP	39,081	105.00	4,103,505.00
CIMAREX ENERGY CO	2,005	93.00	186,465.00
CONCHO RESOURCES INC	3,055	116.48	355,846.40
CONOCOPHILLIPS	25,640	44.83	1,149,441.20
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,960	31.14	61,034.40
CORE LABORATORIES N.V.	1,080	98.23	106,088.40
DEVON ENERGY CORPORATION	9,991	30.48	304,525.68
DIAMONDBACK ENERGY INC	1,940	88.40	171,496.00
EOG RESOURCES INC	11,802	87.79	1,036,097.58
EQT CORP	3,885	56.19	218,298.15
EXXON MOBIL CORP	85,471	81.61	6,975,288.31
HALLIBURTON CO	18,027	41.50	748,120.50
HELMERICH & PAYNE	2,120	52.74	111,808.80
HESS CORP	6,000	41.40	248,400.00
HOLLYFRONTIER CORP	3,740	27.15	101,541.00
KINDER MORGAN INC	41,860	18.79	786,549.40
MARATHON OIL CORP	17,867	11.53	206,006.51
MARATHON PETROLEUM CORP	10,852	51.50	558,878.00
MURPHY OIL CORP	3,715	24.85	92,317.75
NATIONAL OILWELL VARCO INC	8,231	31.64	260,428.84
NEWFIELD EXPLORATION CO	4,040	27.54	111,261.60
NOBLE ENERGY INC	9,492	28.20	267,674.40
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	15,801	60.12	949,956.12
ONEOK INC	4,590	49.19	225,782.10
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	4,490	27.17	121,993.30
PHILLIPS 66	9,045	80.27	726,042.15
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,590	155.93	559,788.70
RANGE RESOURCES CORP	4,050	22.26	90,153.00
SCHLUMBERGER LTD	28,861	65.93	1,902,805.73
TARGA RESOURCES CORP	3,420	42.60	145,692.00
TECHNIPFMC PLC	9,351	26.70	249,671.70
TESORO CORP	2,530	92.28	233,468.40

VALERO ENERGY CORP	9,172	65.98	605,168.56
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	20,199	4.01	80,997.99
WILLIAMS COS INC	16,874	28.75	485,127.50
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	4,255	144.94	616,719.70
ALBEMARLE CORP	2,320	104.85	243,252.00
AVERY DENNISON CORP	1,820	88.05	160,251.00
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	4,170	31.94	133,189.80
BALL CORP	6,840	42.07	287,758.80
CELANESE CORP-SERIES A	2,990	93.56	279,744.40
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,850	27.45	133,132.50
CROWN HOLDINGS INC	2,815	58.02	163,326.30
DOW CHEMICAL CO/THE	24,843	63.47	1,576,785.21
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	17,788	80.99	1,440,650.12
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,015	82.97	250,154.55
ECOLAB INC	5,440	131.66	716,230.40
FMC CORP	2,790	74.78	208,636.20
FREEPORT-MCMORAN INC	25,748	11.76	302,796.48
INTERNATIONAL PAPER CO	8,120	56.85	461,622.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,664	136.15	226,553.60
LYONDELLBASELL INDU-CL A	6,750	80.17	541,147.50
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,245	228.27	284,196.15
MONSANTO CO	9,081	117.02	1,062,658.62
MOSAIC CO/THE	6,820	22.97	156,655.40
NEWMONT MINING CORP	11,290	33.81	381,714.90
NUCOR CORP	6,569	57.50	377,717.50
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,950	109.43	213,388.50
PPG INDUSTRIES INC	5,004	110.68	553,842.72
PRAXAIR INC	5,920	132.80	786,176.00
SEALED AIR CORP	3,966	44.83	177,795.78
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,617	357.10	577,430.70
STEEL DYNAMICS INC	4,510	33.43	150,769.30
VULCAN MATERIALS CO	2,743	132.23	362,706.89
WESTROCK CO	5,329	57.31	305,404.99
WR GRACE & CO	1,400	70.25	98,350.00
3M CO	12,266	212.90	2,611,431.40

ACUITY BRANDS INC	960	177.15	170,064.00
AERCAP HOLDINGS NV	3,450	45.64	157,458.00
AGCO CORP	1,250	66.82	83,525.00
ALLEGION PLC	1,750	81.45	142,537.50
AMETEK INC	5,073	60.43	306,561.39
ARCONIC INC	9,363	25.54	239,131.02
BOEING CO/THE	12,042	202.23	2,435,253.66
CATERPILLAR INC	12,136	104.11	1,263,478.96
CUMMINS INC	3,385	159.14	538,688.90
DEERE & CO	5,710	123.60	705,756.00
DOVER CORP	3,150	78.51	247,306.50
EATON CORP PLC	9,396	76.88	722,364.48
EMERSON ELECTRIC CO	13,520	59.08	798,761.60
FASTENAL CO	6,153	42.87	263,779.11
FLOWSERVE CORP	2,575	44.47	114,510.25
FLUOR CORP	2,903	44.00	127,732.00
FORTIVE CORP	6,364	64.10	407,932.40
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,160	66.05	208,718.00
GENERAL DYNAMICS CORP	5,272	201.32	1,061,359.04
GENERAL ELECTRIC CO	179,773	27.57	4,956,341.61
HD SUPPLY HOLDINGS INC	3,740	31.20	116,688.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	14,866	133.99	1,991,895.34
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	960	186.84	179,366.40
IDEX CORP	1,420	112.70	160,034.00
ILLINOIS TOOL WORKS	6,650	145.78	969,437.00
INGERSOLL-RAND PLC	5,336	91.08	486,002.88
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,420	52.81	127,800.20
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4,370	64.57	282,170.90
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	4,500	41.55	186,975.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	19,704	41.82	824,021.28
L3 TECHNOLOGIES INC	1,651	167.88	277,169.88
LENNOX INTERNATIONAL INC	700	187.61	131,327.00
LOCKHEED MARTIN CORP	5,401	280.64	1,515,736.64
MASCO CORP	6,789	38.91	264,159.99
MIDDLEBY CORP	1,180	121.56	143,440.80

NORTHROP GRUMMAN CORP	3,534	257.40	909,651.60
PACCAR INC	7,404	62.51	462,824.04
PARKER HANNIFIN CORP	2,760	159.63	440,578.80
PENTAIR PLC	3,498	65.63	229,573.74
RAYTHEON COMPANY	5,822	162.36	945,259.92
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,683	162.19	435,155.77
ROCKWELL COLLINS INC.	3,373	104.94	353,962.62
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,150	231.51	497,746.50
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,460	41.08	142,136.80
SMITH (A.O.) CORP	3,020	56.36	170,207.20
SNAP-ON INC	1,250	154.47	193,087.50
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,116	143.05	445,743.80
TEXTRON INC	5,416	45.78	247,944.48
TRANSDIGM GROUP INC	1,100	268.12	294,932.00
UNITED RENTALS INC	1,840	104.85	192,924.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	15,735	122.22	1,923,131.70
WABCO HOLDINGS INC	1,110	122.63	136,119.30
WABTEC CORP	1,880	88.52	166,417.60
MW GRAINGER INC	1,197	176.38	211,126.86
XYLEM INC	3,548	54.33	192,762.84
CINTAS CORP	1,727	129.41	223,491.07
EQUIFAX INC	2,404	139.39	335,093.56
IHS MARKIT LTD	7,543	46.55	351,126.65
MANPOWERGROUP INC	1,447	106.58	154,221.26
NIELSEN HOLDINGS PLC	7,405	37.46	277,391.30
REPUBLIC SERVICES INC	5,100	64.04	326,604.00
ROBERT HALF INTL INC	2,375	47.46	112,717.50
ROLLINS INC	1,610	42.01	67,636.10
STERICYCLE INC	1,705	76.88	131,080.40
VERISK ANALYTICS INC	3,170	82.36	261,081.20
WASTE CONNECTIONS INC	5,806	64.85	376,519.10
WASTE MANAGEMENT INC	9,154	73.43	672,178.22
AMERCO	155	340.72	52,811.60
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	2,840	48.63	138,109.20
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	2,900	66.99	194,271.00

CSX CORP	19,593	52.65	1,031,571.45
DELTA AIR LINES INC	3,955	52.92	209,298.60
EXPEDITORS INTL WASH INC	3,647	55.36	201,897.92
FEDEX CORP	5,238	215.35	1,128,003.30
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,000	86.78	173,560.00
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	97,000	0.42	40,740.00
KANSAS CITY SOUTHERN	2,160	101.86	220,017.60
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	1,570	78.35	123,009.50
NORFOLK SOUTHERN CORP	6,090	119.29	726,476.10
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,400	61.92	210,528.00
UNION PACIFIC CORP	16,726	108.10	1,808,080.60
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	1,715	76.79	131,694.85
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	14,277	110.27	1,574,324.79
AUTOLIV INC	1,770	108.81	192,593.70
BORGWARNER INC	4,330	41.20	178,396.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	5,640	86.03	485,209.20
FORD MOTOR COMPANY	78,255	11.04	863,935.20
GENERAL MOTORS CORP	27,575	34.20	943,065.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	5,430	33.65	182,719.50
HARLEY-DAVIDSON INC	3,709	55.54	205,997.86
LEAR CORP	1,560	138.02	215,311.20
TESLA INC	2,660	383.45	1,019,977.00
COACH INC	5,696	46.71	266,060.16
DR HORTON INC	7,936	33.88	268,871.68
GARMIN LTD	2,395	51.28	122,815.60
HANESBRANDS INC	7,940	22.60	179,444.00
HASBRO INC	2,538	111.91	284,027.58
LEGGETT & PLATT INC	2,778	52.61	146,150.58
LENNAR CORP-CL A	3,900	52.12	203,268.00
LULULEMON ATHLETICA INC	2,440	55.37	135,102.80
MATTEL INC	7,349	20.68	151,977.32
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	3,530	35.34	124,750.20
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,318	246.50	324,887.00
NEWELL BRANDS INC	9,146	53.10	485,652.60
NIKE INC -CL B	27,208	52.85	1,437,942.80

NVR INC	70	2,426.60	169,862.00
POLARIS INDUSTRIES INC	1,240	89.72	111,252.80
PULTE GROUP INC	6,890	24.15	166,393.50
PVH CORP	1,750	110.48	193,340.00
RALPH LAUREN CORP	1,165	72.73	84,730.45
TOLL BROTHERS INC	3,781	39.07	147,723.67
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	3,560	21.20	75,472.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	4,112	19.65	80,800.80
VF CORP	7,100	56.43	400,653.00
WHIRLPOOL CORP	1,614	188.68	304,529.52
ARAMARK	4,960	41.46	205,641.60
CARNIVAL CORP	7,257	66.45	482,227.65
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	485	415.28	201,410.80
DARDEN RESTAURANTS INC	2,553	88.73	226,527.69
DOMINO'S PIZZA INC	1,020	217.05	221,391.00
H&R BLOCK INC	4,510	31.25	140,937.50
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,710	65.40	242,634.00
LAS VEGAS SANDS CORP	8,180	64.97	531,454.60
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	6,813	104.06	708,960.78
MCDONALD'S CORP	17,251	154.64	2,667,694.64
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	4,100	23.53	96,473.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	9,760	34.16	333,401.60
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	3,220	54.81	176,488.20
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,538	111.86	395,760.68
STARBUCKS CORP	29,954	59.81	1,791,548.74
VAIL RESORTS INC	740	211.28	156,347.20
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,240	104.38	233,811.20
WYNN RESORTS LTD	1,660	138.32	229,611.20
YUM! BRANDS INC	6,804	74.82	509,075.28
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	7,458	63.61	474,403.38
CHARTER COMMUNICATION-A	4,451	330.80	1,472,390.80
COMCAST CORP-CLASS A	97,474	39.50	3,850,223.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,320	25.79	85,622.80
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	4,690	25.06	117,531.40
DISH NETWORK CORP-A	4,769	63.89	304,691.41

INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	6,846	24.25	166,015.50
LIBERTY BROADBAND-C	2,140	85.72	183,440.80
LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,475	29.98	134,160.50
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	13,041	29.14	380,014.74
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	4,240	40.62	172,228.80
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	1,975	40.83	80,639.25
NEWS CORP - CLASS A	7,570	13.59	102,876.30
OMNICOM GROUP	5,007	82.37	412,426.59
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	1,620	67.40	109,188.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	34,250	5.35	183,237.50
THE WALT DISNEY CO.	32,303	104.36	3,371,141.08
TIME WARNER INC	15,928	99.70	1,588,021.60
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	10,339	26.93	278,429.27
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	20,442	27.19	555,817.98
VIACOM INC-CLASS B	7,248	34.11	247,229.28
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,508	119.74	180,567.92
AMAZON.COM INC	8,365	1,003.74	8,396,285.10
AUTONATION INC	1,650	39.52	65,208.00
AUTOZONE INC	612	574.98	351,887.76
BED BATH & BEYOND INC	3,062	29.65	90,788.30
BEST BUY CO INC	6,114	55.18	337,370.52
CARMAX INC	3,969	61.71	244,926.99
DICK'S SPORTING GOODS INC	1,780	39.06	69,526.80
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	5,980	69.75	417,105.00
DOLLAR TREE INC	4,896	66.60	326,073.60
EXPEDIA INC	2,552	154.43	394,105.36
FOOT LOCKER INC	2,820	48.03	135,444.60
GAP INC/THE	5,106	21.97	112,178.82
GENUINE PARTS CO	3,201	90.74	290,458.74
HOME DEPOT INC	25,340	151.31	3,834,195.40
KOHL'S CORP	3,872	37.03	143,380.16
L BRANDS INC	5,308	53.46	283,765.68
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	8,930	24.49	218,695.70
LKQ CORP	6,330	32.27	204,269.10
LOWE'S COS INC	18,022	76.07	1,370,933.54

MACY'S INC	6,469	22.27	144,064.63
NETFLIX INC	8,920	158.02	1,409,538.40
NORDSTROM INC	2,850	48.00	136,800.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,775	220.08	390,642.00
PRICELINE GROUP INC/THE	1,015	1,874.28	1,902,394.20
ROSS STORES INC	8,272	56.29	465,630.88
SIGNET JEWELERS LTD	1,500	58.41	87,615.00
STAPLES INC	13,744	9.29	127,681.76
TARGET CORP	10,600	50.76	538,056.00
TIFFANY & CO	2,610	91.79	239,571.90
TJX COMPANIES INC	13,193	69.27	913,879.11
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,750	52.65	144,787.50
TRIPADVISOR INC	2,330	36.96	86,116.80
ULTA BEAUTY INC	1,240	284.71	353,040.40
COSTCO WHOLESALE CORP	9,019	157.13	1,417,155.47
CVS HEALTH CORP	21,077	77.41	1,631,570.57
KROGER CO	19,050	22.60	430,530.00
SYSCO CORP	10,546	49.92	526,456.32
WAL-MART STORES INC	31,612	74.84	2,365,842.08
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	18,922	76.34	1,444,505.48
WHOLE FOODS MARKET INC	7,080	42.94	304,050.60
ALTRIA GROUP INC	40,028	76.49	3,061,741.72
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	12,033	41.16	495,278.28
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	4,224	48.91	206,595.84
BUNGE LTD	2,857	75.72	216,332.04
CAMPBELL SOUP CO	4,215	53.58	225,839.70
COCA-COLA CO/THE	84,002	45.25	3,801,090.50
CONAGRA BRANDS INC	8,960	37.23	333,580.80
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,460	184.57	638,612.20
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	3,769	92.91	350,177.79
GENERAL MILLS INC	11,439	55.94	639,897.66
HERSHEY CO/THE	3,015	109.81	331,077.15
HORMEL FOODS CORP	5,960	34.94	208,242.40
INGREDION INC	1,470	117.63	172,916.10
JM SMUCKER CO/THE	2,530	120.72	305,421.60

KELLOGG CO	5,408	70.56	381,588.48
KRAFT HEINZ CO/THE	12,711	88.85	1,129,372.35
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,275	100.23	228,023.25
MOLSON COORS BREWING CO -B	3,870	86.50	334,755.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	31,345	44.90	1,407,390.50
MONSTER BEVERAGE CORP	8,290	51.99	430,997.10
PEPSICO INC	29,491	116.96	3,449,267.36
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	32,088	119.56	3,836,441.28
REYNOLDS AMERICAN INC	17,766	65.65	1,166,337.90
TYSON FOODS INC-CL A	6,146	62.79	385,907.34
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,430	53.04	288,007.20
CLOROX COMPANY	2,736	138.91	380,057.76
COLGATE-PALMOLIVE CO	17,320	75.92	1,314,934.40
COTY INC-CL A	10,000	19.14	191,400.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,740	96.99	459,732.60
KIMBERLY-CLARK CORP	7,293	132.30	964,863.90
PROCTER & GAMBLE CO	52,669	89.42	4,709,661.98
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	520	126.53	65,795.60
ABBOTT LABORATORIES	35,766	49.08	1,755,395.28
AETNA INC	7,319	152.10	1,113,219.90
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,470	153.50	225,645.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	3,254	95.82	311,798.28
ANTHEM INC	5,606	190.17	1,066,093.02
BAXTER INTERNATIONAL INC	10,399	61.38	638,290.62
BECTON DICKINSON AND CO	4,457	195.15	869,783.55
BOSTON SCIENTIFIC CORP	28,738	28.10	807,537.80
CARDINAL HEALTH INC	6,565	79.68	523,099.20
CENTENE CORP	3,530	84.15	297,049.50
CERNER CORP	6,230	68.32	425,633.60
CIGNA CORP	5,350	169.61	907,413.50
COOPER COS INC/THE	1,040	246.19	256,037.60
CR BARD INC	1,574	315.98	497,352.52
DANAHER CORP	13,029	85.66	1,116,064.14
DAVITA INC	3,438	64.89	223,091.82
DENTSPLY SIRONA INC	4,852	63.84	309,751.68

DEXCOM INC	1,700	77.33	131,461.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,410	120.15	529,861.50
ENVISION HEALTHCARE CORP	2,312	60.65	140,222.80
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	12,254	65.22	799,205.88
HCA HEALTHCARE INC	6,425	86.24	554,092.00
HENRY SCHEIN INC	1,670	184.17	307,563.90
HOLOGIC INC	5,708	46.13	263,310.04
HUMANA INC	3,115	238.42	742,678.30
IDEXX LABORATORIES INC	1,830	167.35	306,250.50
INTUITIVE SURGICAL INC	820	948.94	778,130.80
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,155	151.62	326,741.10
MCKESSON CORP	4,324	166.96	721,935.04
MEDNAX INC	1,860	59.97	111,544.20
MEDTRONIC PLC	28,488	89.20	2,541,129.60
PATTERSON COS INC	2,042	47.84	97,689.28
QUEST DIAGNOSTICS	3,116	109.70	341,825.20
RESMED INC	2,950	78.44	231,398.00
STRYKER CORP	7,043	141.12	993,908.16
TELEFLEX INC	900	206.11	185,499.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	19,860	185.25	3,679,065.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,810	115.43	208,928.30
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,924	105.03	202,077.72
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	1,910	63.82	121,896.20
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	4,162	129.09	537,272.58
ABBVIE INC	32,946	72.64	2,393,197.44
AGILENT TECHNOLOGIES INC	6,620	59.77	395,677.40
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	4,730	126.07	596,311.10
ALKERMES PLC	3,220	58.47	188,273.40
ALLERGAN PLC	6,885	246.46	1,696,877.10
AMGEN INC	15,151	172.50	2,613,547.50
BIOGEN INC	4,433	280.32	1,242,658.56
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,500	95.00	332,500.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	34,391	56.64	1,947,906.24
CELGENE CORP	16,034	134.31	2,153,526.54
ELI LILLY & CO	20,413	83.89	1,712,446.57

GILEAD SCIENCES INC	26,864	70.52	1,894,449.28
ILLUMINA INC	3,025	185.28	560,472.00
INCYTE CORP	3,520	136.28	479,705.60
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,330	158.80	211,204.00
JOHNSON & JOHNSON	55,931	136.43	7,630,666.33
MALLINCKRODT PLC	2,400	46.32	111,168.00
MERCK & CO. INC.	56,783	66.16	3,756,763.28
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	540	599.64	323,805.60
MYLAN NV	9,585	39.03	374,102.55
PERRIGO CO PLC	3,039	75.28	228,775.92
PFIZER INC	122,600	34.17	4,189,242.00
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	3,113	91.08	283,532.04
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,620	517.33	838,074.60
SEATTLE GENETICS INC	2,020	61.74	124,714.80
TESARO INC	660	146.72	96,835.20
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	19,610	32.61	639,482.10
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	8,184	174.44	1,427,616.96
UNITED THERAPEUTICS CORP	940	131.59	123,694.60
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,100	133.50	680,850.00
WATERS CORP	1,666	185.47	308,993.02
ZOETIS INC	9,740	62.78	611,477.20
BANK OF AMERICA CORP	206,549	22.82	4,713,448.18
BB&T CORP	16,708	43.17	721,284.36
CIT GROUP INC	4,085	47.81	195,303.85
CITIGROUP INC	57,117	63.41	3,621,788.97
CITIZENS FINANCIAL GROUP	10,590	34.49	365,249.10
COMERICA INC	3,360	70.85	238,056.00
EAST WEST BANCORP INC	2,660	56.21	149,518.60
FIFTH THIRD BANCORP	15,509	24.66	382,451.94
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,070	99.10	304,237.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	21,790	12.71	276,950.90
JPMORGAN CHASE & CO	73,810	86.86	6,411,136.60
KEYCORP	22,678	17.90	405,936.20
M & T BANK CORP	2,813	157.84	444,003.92
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	9,654	12.70	122,605.80

PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	6,370	17.22	109,691.40	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	9,950	119.55	1,189,522.50	
REGIONS FINANCIAL CORP	25,864	13.57	350,974.48	
SIGNATURE BANK	990	136.06	134,699.40	
SUNTRUST BANKS INC	10,377	54.43	564,820.11	
SVB FINANCIAL GROUP	990	170.84	169,131.60	
US BANCORP	34,821	50.77	1,767,862.17	
WELLS FARGO & CO	98,300	52.45	5,155,835.00	
ZIONS BANCORPORATION	3,750	41.93	157,237.50	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,100	161.27	177,397.00	
ALLY FINANCIAL INC	9,120	20.54	187,324.80	
AMERICAN EXPRESS CO	15,714	82.22	1,292,005.08	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,300	125.55	414,315.00	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	20,892	49.17	1,027,259.64	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	25,320	167.22	4,234,010.40	
BLACKROCK INC	2,555	421.62	1,077,239.10	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	9,795	79.52	778,898.40	
CBOE HOLDINGS INC	1,880	88.77	166,887.60	
CME GROUP INC	7,140	124.12	886,216.80	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	8,510	60.04	510,940.40	
E*TRADE FINANCIAL CORP	5,840	36.24	211,641.60	
EATON VANCE CORP	2,260	46.97	106,152.20	
FRANKLIN RESOURCES INC	7,355	43.98	323,472.90	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	7,468	217.19	1,621,974.92	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	12,600	64.28	809,928.00	
INVESCO LTD	8,467	34.97	296,090.99	
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	24.99	182,551.95	
MOODY'S CORP	3,637	120.06	436,658.22	
MORGAN STANLEY	29,245	43.69	1,277,714.05	
MSCI INC	2,000	104.72	209,440.00	
NASDAQ INC	2,555	69.86	178,492.30	
NAVIENT CORP	7,192	15.96	114,784.32	
NORTHERN TRUST CORP	4,420	94.01	415,524.20	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,500	76.62	191,550.00	
S&P GLOBAL INC	5,442	146.70	798,341.40	

SCHWAB (CHARLES) CORP	24,634	41.62	1,025,267.08
SEI INVESTMENTS COMPANY	2,715	53.02	143,949.30
STATE STREET CORP	8,007	87.24	698,530.68
SYNCHRONY FINANCIAL	17,550	28.97	508,423.50
T ROWE PRICE GROUP INC	4,925	73.74	363,169.50
TD AMERITRADE HOLDING CORP	5,270	40.78	214,910.60
VOYA FINANCIAL INC	4,150	35.24	146,246.00
AFLAC INC	7,822	77.60	606,987.20
ALLEGHANY CORP	330	584.39	192,848.70
ALLSTATE CORP	7,763	88.08	683,765.04
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,360	98.39	133,810.40
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	20,105	63.02	1,267,017.10
AON PLC	5,567	132.40	737,070.80
ARCH CAPITAL GROUP LTD	2,775	92.94	257,908.50
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,300	56.71	187,143.00
ASSURANT INC	1,270	101.25	128,587.50
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	1,250	50.25	62,812.50
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,175	63.61	138,351.75
CHUBB LTD	9,645	144.85	1,397,078.25
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,400	71.23	242,182.00
EVEREST RE GROUP LTD	874	253.98	221,978.52
FNF GROUP	5,241	44.58	233,643.78
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	6,942	51.45	357,165.90
LINCOLN NATIONAL CORP	4,933	65.05	320,891.65
LOEWS CORP	6,105	46.28	282,539.40
MARKEL CORP	310	953.39	295,550.90
MARSH & MCLENNAN COS	10,823	78.06	844,843.38
METLIFE INC	19,515	52.26	1,019,853.90
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6,000	62.58	375,480.00
PROGRESSIVE CORP	12,350	44.39	548,216.50
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	8,932	103.36	923,211.52
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,310	126.05	165,125.50
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	887	140.17	124,330.79
TORCHMARK CORP	2,216	75.68	167,706.88
TRAVELERS COS INC/THE	5,484	127.66	700,087.44

UNUM GROUP	4,788	45.11	215,986.68
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,758	145.36	400,902.88
WR BERKLEY CORP	2,063	68.53	141,377.39
XL GROUP LTD	5,720	43.41	248,305.20
CBRE GROUP INC	6,610	35.35	233,663.50
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	23,700	7.43	176,091.00
JONES LANG LASALLE INC	890	118.52	105,482.80
ACCENTURE PLC-CL A	12,938	122.74	1,588,010.12
ACTIVISION BLIZZARD INC	14,600	60.44	882,424.00
ADOBE SYSTEMS INC	10,259	145.41	1,491,761.19
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	3,690	51.30	189,297.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,075	261.25	280,843.75
ALPHABET INC-CL A	6,120	986.09	6,034,870.80
ALPHABET INC-CL C	6,442	965.59	6,220,330.78
ANSYS INC	1,820	122.52	222,986.40
AUTODESK INC	4,190	107.75	451,472.50
AUTOMATIC DATA PROCESSING	9,436	101.41	956,904.76
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	2,420	76.44	184,984.80
CA INC	6,760	34.98	236,464.80
CADENCE DESIGN SYS INC	6,170	34.26	211,384.20
CDK GLOBAL INC	2,720	62.65	170,408.00
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2,670	113.95	304,246.50
CITRIX SYSTEMS INC	3,228	81.41	262,791.48
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	12,808	67.38	863,003.04
COSTAR GROUP INC	660	266.93	176,173.80
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	4,720	63.62	300,286.40
DXC TECHNOLOGY CO	5,903	78.46	463,149.38
EBAY INC	21,227	35.57	755,044.39
ELECTRONIC ARTS INC	6,204	110.87	687,837.48
FACEBOOK INC-A	48,330	155.07	7,494,533.10
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	6,455	84.84	547,642.20
FIRST DATA CORP- CLASS-A	6,130	18.65	114,324.50
FISERV INC	4,688	124.80	585,062.40
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,950	144.08	280,956.00
FORTINET INC	3,100	38.29	118,699.00

GARTNER INC	1,750	123.98	216,965.00
GLOBAL PAYMENTS INC	3,200	91.26	292,032.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	18,722	154.11	2,885,247.42
INTUIT INC	5,156	140.40	723,902.40
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,430	105.60	151,008.00
LEIDOS HOLDINGS INC	2,630	53.56	140,862.80
MASTERCARD INC	19,950	124.01	2,473,999.50
MERCADOLIBRE INC	810	275.23	222,936.30
MICROSOFT CORP	151,684	71.21	10,801,417.64
MOBILEYE NV	3,560	62.95	224,102.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	5,800	18.84	109,272.00
ORACLE CORP	63,833	50.95	3,252,291.35
PAYCHEX INC	6,562	59.24	388,732.88
PAYPAL HOLDINGS INC	23,667	54.33	1,285,828.11
RED HAT INC	3,820	99.42	379,784.40
SABRE CORP	4,520	22.67	102,468.40
SALESFORCE.COM INC	13,340	88.62	1,182,190.80
SERVICENOW INC	3,400	107.79	366,486.00
SPLUNK INC	2,830	58.43	165,356.90
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	3,120	38.84	121,180.80
SYMANTEC CORP	13,055	28.53	372,459.15
SYNOPSYS INC	3,207	74.36	238,472.52
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,636	58.77	213,687.72
TWITTER INC	12,260	18.50	226,810.00
VANTIV INC - CL-A	3,230	62.45	201,713.50
VERISIGN INC	2,220	93.96	208,591.20
VISA INC-CLASS A SHARES	38,302	95.58	3,660,905.16
VMWARE INC	1,555	90.92	141,380.60
WESTERN UNION CO	10,451	19.17	200,345.67
WORKDAY INC-CLASS A	2,520	103.33	260,391.60
ZILLOW GROUP INC - C	2,000	51.04	102,080.00
AMPHENOL CORP-CL A	6,450	75.08	484,266.00
APPLE INC	108,212	146.28	15,829,251.36
ARISTA NETWORKS INC	840	161.62	135,760.80
ARROW ELECTRONICS INC	1,930	79.31	153,068.30

AVNET INC	2,610	38.69	100,980.90
CDW CORP/DE	2,960	65.22	193,051.20
CISCO SYSTEMS INC	103,520	32.09	3,321,956.80
COMMSCOPE HOLDING CO INC	3,570	38.08	135,945.60
CORNING INC	18,388	29.99	551,456.12
F5 NETWORKS INC	1,445	129.99	187,835.55
FLEX LTD	10,936	17.06	186,568.16
FLIR SYSTEMS INC	2,675	35.03	93,705.25
HARRIS CORP	2,550	111.39	284,044.50
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	35,075	16.85	591,013.75
HP INC	36,065	17.80	641,957.00
JUNIPER NETWORKS INC	7,023	28.29	198,680.67
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3,045	88.64	269,908.80
NETAPP INC	5,916	39.87	235,870.92
PALO ALTO NETWORKS INC	1,900	138.41	262,979.00
SEAGATE TECHNOLOGY	6,264	42.67	267,284.88
TE CONNECTIVITY LTD	7,545	78.77	594,319.65
TRIMBLE INC	5,170	36.45	188,446.50
WESTERN DIGITAL CORP	5,848	93.34	545,852.32
XEROX CORP	4,938	28.44	140,436.72
AT&T INC	126,537	37.95	4,802,079.15
CENTURYLINK INC	11,426	24.41	278,908.66
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	6,500	60.06	390,390.00
SPRINT CORP	17,350	8.05	139,667.50
T-MOBILE US INC	6,082	63.40	385,598.80
VERIZON COMMUNICATIONS INC	84,267	45.39	3,824,879.13
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	3,180	31.54	100,297.20
AES CORP	13,728	11.56	158,695.68
ALLIANT ENERGY CORP	4,250	41.45	176,162.50
AMEREN CORPORATION	5,182	55.94	289,881.08
AMERICAN ELECTRIC POWER	10,238	71.55	732,528.90
AMERICAN WATER WORKS CO INC	3,455	81.13	280,304.15
ATMOS ENERGY CORP	1,920	83.51	160,339.20
CENTERPOINT ENERGY INC	8,142	28.05	228,383.10
CMS ENERGY CORP	6,140	47.31	290,483.40

CONSOLIDATED EDISON INC	6,306	83.84	528,695.04
DOMINION RESOURCES INC/VA	12,957	78.39	1,015,699.23
DTE ENERGY COMPANY	3,698	108.89	402,675.22
DUKE ENERGY CORP	14,256	85.96	1,225,445.76
EDISON INTERNATIONAL	6,589	80.03	527,317.67
ENTERGY CORP	3,847	78.99	303,874.53
EVERSOURCE ENERGY	6,300	62.25	392,175.00
EXELON CORP	19,006	36.50	693,719.00
FIRSTENERGY CORP	8,995	28.91	260,045.45
NEXTERA ENERGY INC	9,565	143.14	1,369,134.10
NISOURCE INC	6,540	25.81	168,797.40
OGE ENERGY CORP	3,830	35.47	135,850.10
P G & E CORP	10,581	68.03	719,825.43
PINNACLE WEST CAPITAL	2,199	87.84	193,160.16
PPL CORP	13,758	38.83	534,223.14
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	10,188	43.57	443,891.16
SCANA CORP	2,683	69.45	186,334.35
SEMPRA ENERGY	4,827	112.81	544,533.87
SOUTHERN CO	19,895	49.84	991,566.80
UGI CORP	3,500	49.20	172,200.00
WEC ENERGY GROUP INC	6,320	63.46	401,067.20
WESTAR ENERGY INC	2,880	53.11	152,956.80
XCEL ENERGY INC	10,414	47.13	490,811.82
ADVANCED MICRO DEVICES	16,000	14.17	226,720.00
ANALOG DEVICES INC	7,630	81.55	622,226.50
APPLIED MATERIALS INC	22,473	44.09	990,834.57
BROADCOM LTD	8,240	245.26	2,020,942.40
INTEL CORP	97,362	34.19	3,328,806.78
KLA-TENCOR CORPORATION	3,199	97.95	313,342.05
LAM RESEARCH CORP	3,247	151.78	492,829.66
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	9,254	17.67	163,518.18
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	5,850	45.92	268,632.00
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	4,614	81.59	376,456.26
MICRON TECHNOLOGY INC	21,887	31.73	694,474.51
NVIDIA CORP	11,135	153.83	1,712,897.05

	NXP SEMICONDUCTORS NV	6,097	109.98	670,548.06
	QORVO INC	2,670	69.94	186,739.80
	QUALCOMM INC	30,352	56.91	1,727,332.32
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	3,920	104.36	409,091.20
	TEXAS INSTRUMENTS INC	20,552	79.58	1,635,528.16
	XILINX INC	5,075	67.53	342,714.75
米ドル小計		6,466,969		442,064,855.02 (49,192,977,066)
加ドル	ALTAGAS LTD	3,050	30.02	91,561.00
	ARC RESOURCES LTD	7,925	17.00	134,725.00
	CAMECO CORP	7,892	12.39	97,781.88
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	23,194	37.80	876,733.20
	CENOVUS ENERGY INC	17,463	9.16	159,961.08
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	11,475	10.16	116,586.00
	ENBRIDGE INC	33,597	52.22	1,754,435.34
	ENCANA CORP	21,068	11.23	236,593.64
	HUSKY ENERGY INC	6,873	15.23	104,675.79
	IMPERIAL OIL LTD	5,952	39.17	233,139.84
	INTER PIPELINE LTD	7,180	24.85	178,423.00
	KEYERA CORP	3,540	40.88	144,715.20
	PEMBINA PIPELINE CORP	7,915	43.01	340,424.15
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	3,680	23.57	86,737.60
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	4,100	28.83	118,203.00
	SEVEN GENERATIONS ENERGY -A	4,430	22.13	98,035.90
	SUNCOR ENERGY INC	34,429	38.52	1,326,205.08
	TOURMALINE OIL CORP	4,575	26.43	120,917.25
	TRANSCANADA CORP	17,673	62.35	1,101,911.55
	VERESEN INC	5,360	18.27	97,927.20
	VERMILION ENERGY INC	2,640	42.50	112,200.00
	AGNICO EAGLE MINES LTD	4,695	63.43	297,803.85
	AGRIUM INC	2,705	122.39	331,064.95
	BARRICK GOLD CORP	23,944	21.86	523,415.84
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,050	66.09	201,574.50
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	14,710	10.41	153,131.10
	FRANCO-NEVADA CORP	3,805	98.69	375,515.45

GOLDCORP INC	17,917	18.29	327,701.93
KINROSS GOLD CORP	25,015	5.62	140,584.30
METHANEX CORP	1,650	55.86	92,169.00
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	17,917	21.96	393,457.32
TECK RESOURCES LTD-CLS B	11,955	21.97	262,651.35
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	23,419	3.49	81,732.31
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,460	59.81	87,322.60
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	9,395	26.82	251,973.90
YAMANA GOLD INC	19,626	3.53	69,279.78
BOMBARDIER INC 'B'	34,746	2.47	85,822.62
CAE INC	6,315	22.21	140,256.15
FINNING INTERNATIONAL INC	2,845	25.50	72,547.50
SNC-LAVALIN GROUP INC	3,195	54.86	175,277.70
CANADIAN NATL RAILWAY CO	15,598	106.59	1,662,590.82
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	2,915	211.25	615,793.75
LINAMAR CORP	980	63.24	61,975.20
MAGNA INTERNATIONAL INC	7,018	59.77	419,465.86
GILDAN ACTIVEWEAR INC	4,540	41.64	189,045.60
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	4,638	82.41	382,217.58
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	8,165	30.29	247,317.85
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,560	146.96	229,257.60
DOLLARAMA INC	2,510	124.54	312,595.40
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	9,120	61.42	560,150.40
EMPIRE CO LTD 'A'	3,000	18.94	56,820.00
LOBLAW COMPANIES LTD	4,989	73.02	364,296.78
METRO INC	4,380	43.15	188,997.00
WESTON (GEORGE) LTD	1,182	118.19	139,700.58
SAPUTO INC	5,040	41.71	210,218.40
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	6,734	20.93	140,942.62
BANK OF MONTREAL	13,261	93.86	1,244,677.46
BANK OF NOVA SCOTIA	24,929	79.45	1,980,609.05
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	8,045	107.38	863,872.10
NATIONAL BANK OF CANADA	6,740	53.76	362,342.40
ROYAL BANK OF CANADA	30,349	94.12	2,856,447.88
TORONTO-DOMINION BANK	38,490	65.27	2,512,242.30

	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	18,183	51.38	934,242.54	
	CI FINANCIAL CORP	4,630	27.40	126,862.00	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	7,180	9.00	64,620.00	
	IGM FINANCIAL INC	1,945	40.75	79,258.75	
	ONEX CORPORATION	1,905	101.79	193,909.95	
	THOMSON REUTERS CORP	5,534	61.75	341,724.50	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	490	557.78	273,312.20	
	GREAT-WEST LIFECO INC	5,974	34.25	204,609.50	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	1,735	53.68	93,134.80	
	INTACT FINANCIAL CORP	2,485	95.97	238,485.45	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	41,291	23.61	974,880.51	
	POWER CORP OF CANADA	7,800	29.25	228,150.00	
	POWER FINANCIAL CORP	5,715	33.13	189,337.95	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	12,944	44.88	580,926.72	
	TRISURA GROUP LTD-WI	106	21.00	2,226.00	
	CGI GROUP INC - CL A	4,650	67.94	315,921.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	420	712.21	299,128.20	
	OPEN TEXT CORP	5,100	42.55	217,005.00	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	1,330	125.36	166,728.80	
	BLACKBERRY LTD	10,328	12.86	132,818.08	
	BCE INC	2,930	59.17	173,368.10	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	7,185	62.87	451,720.95	
	TELUS CORP	4,366	45.02	196,557.32	
	ATCO LTD -CLASS I	1,920	50.97	97,862.40	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,590	42.01	108,805.90	
	FORTIS INC	8,075	46.67	376,860.25	
	HYDRO ONE LTD	3,450	23.45	80,902.50	
加ドル小計		836,819		34,340,110.85	(2,881,822,102)
ユーロ	ENAGAS SA	5,680	26.22	148,958.00	
	ENI SPA	51,366	13.58	697,550.28	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	9,315	13.11	122,166.22	
	NESTE OYJ	2,740	34.80	95,352.00	
	OMV AG	3,490	45.83	159,946.70	
	REPSOL SA	24,709	13.53	334,312.77	

SAIPEM SPA	12,351	3.18	39,300.88
SNAM SPA	46,120	4.09	188,999.76
TENARIS SA	9,355	13.35	124,889.25
TOTAL SA	46,757	44.11	2,062,451.27
VOPAK	1,270	42.20	53,594.00
AIR LIQUIDE SA	8,118	111.50	905,157.00
AKZO NOBEL	5,058	78.00	394,524.00
ARCELORMITTAL	12,982	18.85	244,775.61
ARKEMA	1,615	94.30	152,294.50
BASF SE	18,885	84.98	1,604,847.30
COVESTRO AG	1,350	64.95	87,682.50
CRH PLC	17,110	32.17	550,428.70
EVONIK INDUSTRIES AG	3,580	28.94	103,623.10
FUCHS PETROLUB SE-PRF	1,720	49.65	85,406.60
HEIDELBERGCEMENT AG	2,845	85.82	244,157.90
IMERYS SA	830	77.21	64,084.30
K+S AG	3,880	22.87	88,735.60
KONINKLIJKE DSM NV	3,842	66.10	253,956.20
LANXESS AG	1,935	66.50	128,677.50
LINDE AG	3,895	171.15	666,629.25
SOLVAY SA	1,581	119.80	189,403.80
STORA ENSO OYJ-R SHS	12,085	11.76	142,119.60
SYMRISE AG	2,640	64.63	170,623.20
THYSSENKRUPP AG	7,415	25.33	187,821.95
UMICORE	2,120	63.04	133,644.80
UPM-KYMMENE OYJ	10,878	25.10	273,037.80
VOESTALPINE AG	2,509	39.63	99,431.67
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4,176	35.65	148,895.28
AIRBUS GROUP SE	12,268	75.70	928,687.60
ALSTOM	3,590	31.94	114,682.55
ANDRITZ AG	1,420	53.57	76,069.40
BOSKALIS WESTMINSTER	1,695	29.45	49,926.22
BOUYGUES SA	4,210	39.07	164,505.75
BRENTAG AG	3,095	51.31	158,804.45
CNH INDUSTRIAL NV	22,370	10.13	226,608.10

COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	10,566	48.20	509,334.03
DASSAULT AVIATION SA	50	1,304.85	65,242.50
EIFFAGE	1,130	84.37	95,338.10
FERROVIAL SA	9,975	20.07	200,248.12
GAMESA CORP TECNOLOGICA SA	4,180	18.62	77,852.50
GEA GROUP AG	3,940	36.76	144,854.10
HOCHTIEF AG	440	168.35	74,074.00
KONE OYJ-B	6,474	46.37	300,199.38
KONINKLIJKE PHILIPS NV	19,861	32.83	652,135.93
LEGRAND SA	5,628	61.86	348,148.08
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	9,630	15.34	147,724.20
MAN SE	824	94.74	78,065.76
METSO OYJ	2,420	30.96	74,923.20
OSRAM LICHT AG	1,962	72.00	141,264.00
PRYSMIAN SPA	3,425	26.54	90,899.50
REXEL SA	6,250	14.59	91,187.50
SAFRAN SA	6,520	81.82	533,466.40
SCHNEIDER ELECTRIC SE	11,908	70.16	835,465.28
SIEMENS AG-REG	15,736	124.75	1,963,066.00
THALES SA	2,345	98.33	230,583.85
VINCI SA	10,650	78.97	841,030.50
WARTSILA OYJ ABP	2,940	54.30	159,642.00
ZODIAC AEROSPACE	4,550	23.95	108,972.50
BUREAU VERITAS SA	5,650	20.45	115,542.50
EDENRED	3,906	23.80	92,962.80
RANDSTAD HOLDING NV	2,285	51.19	116,969.15
RELX NV	20,559	18.59	382,191.81
SOCIETE BIC SA	565	106.45	60,144.25
WOLTERS KLUWER	6,297	39.09	246,181.21
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	13,091	16.37	214,299.67
ADP	650	144.80	94,120.00
AENA SA	1,490	174.90	260,601.00
ATLANTIA SPA	9,360	25.20	235,872.00
BOLLORE	20,400	4.06	82,824.00
DEUTCHE LUFTHANSA	5,680	18.63	105,818.40

DEUTSCHE POST AG-REG	20,063	32.49	651,947.18
FRAPORT AG	980	77.72	76,165.60
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	8,760	9.63	84,358.80
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	12,822	6.82	87,458.86
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	6,935	83.60	579,766.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,190	72.74	86,560.60
CONTINENTAL AG	2,235	196.80	439,848.00
DAIMLER AG	19,782	65.34	1,292,555.88
FERRARI NV	2,384	79.55	189,647.20
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	19,647	9.70	190,674.13
MICHELIN (CGDE)-B	3,679	119.15	438,352.85
NOKIAN RENKAAT OYJ	1,965	36.98	72,665.70
PEUGEOT SA	9,800	18.16	178,017.00
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	3,150	50.43	158,854.50
RENAULT SA	3,477	80.40	279,550.80
SCHAEFFLER AG-PRF	3,550	14.38	51,049.00
VALEO SA	4,860	61.10	296,946.00
VOLKSWAGEN AG	771	137.05	105,665.55
VOLKSWAGEN AG-PFD	3,853	133.65	514,953.45
ADIDAS AG	3,961	168.50	667,428.50
CHRISTIAN DIOR SE	1,170	255.25	298,642.50
HERMES INTERNATIONAL	432	438.20	189,302.40
HUGO BOSS AG -ORD	1,490	64.70	96,403.00
KERING	1,607	307.35	493,911.45
LUXOTTICA GROUP SPA	3,486	54.15	188,766.90
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	5,724	231.65	1,325,964.60
SEB SA	480	160.40	76,992.00
ACCOR SA	3,456	41.36	142,940.16
PADDY POWER BETFAIR PLC	1,630	98.26	160,163.80
SODEXO	1,970	117.15	230,785.50
ALTICE NV -A	8,340	22.12	184,480.80
ALTICE NV -B	1,940	22.08	42,844.90
AXEL SPRINGER SE	995	55.26	54,983.70
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	24.11	91,497.45
JC DECAUX SA	1,200	29.24	35,088.00

LAGARDERE S.C.A.	2,980	28.13	83,827.40
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	4,805	37.21	178,794.05
PUBLICIS GROUPE	4,075	67.23	273,962.25
RTL GROUP	630	67.33	42,417.90
SES	7,520	22.17	166,756.00
TELENET GROUP HOLDING NV	1,240	56.27	69,774.80
VIVENDI	21,730	20.59	447,529.35
INDITEX	22,705	34.86	791,496.30
ZALANDO SE	1,700	41.02	69,734.00
CARREFOUR SA	12,213	22.01	268,808.13
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,344	51.85	69,686.40
COLRUYT SA	1,375	44.29	60,898.75
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	11,008	5.49	60,433.92
JERONIMO MARTINS	5,075	17.46	88,634.87
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	26,448	17.09	451,996.32
METRO AG	4,140	29.80	123,372.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	15,711	100.95	1,586,025.45
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	4,910	36.20	177,742.00
DANONE	12,354	67.48	833,647.92
HEINEKEN HOLDING NV	2,125	81.51	173,208.75
HEINEKEN NV	4,593	86.25	396,146.25
KERRY GROUP PLC-A	3,380	76.98	260,192.40
PERNOD-RICARD SA	4,406	121.80	536,650.80
REMY COINTREAU	470	103.60	48,692.00
BEIERSDORF AG	2,015	96.01	193,460.15
HENKEL AG & CO KGAA	2,190	110.30	241,557.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	3,743	125.55	469,933.65
L'OREAL	5,166	188.10	971,724.60
UNILEVER NV-CVA	33,735	49.91	1,683,713.85
ESSILOR INTERNATIONAL	4,465	118.25	527,986.25
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	4,683	87.64	410,418.12
FRESENIUS SE & CO KGAA	8,675	78.24	678,732.00
BAYER AG	17,010	121.90	2,073,519.00
EUROFINS SCIENTIFIC	220	504.80	111,056.00
GRIFOLS SA	6,820	26.24	178,990.90

IPSEN	640	125.30	80,192.00
MERCK KGAA	2,630	111.15	292,324.50
ORION OYJ-CLASS B	1,830	57.60	105,408.00
QIAGEN N.V.	4,364	30.88	134,760.32
RECORDATI SPA	1,730	37.21	64,373.30
SANOFI	23,926	87.87	2,102,377.62
UCB SA	2,798	62.01	173,503.98
ABN AMRO GROUP NV-CVA	4,670	23.01	107,456.70
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	135,993	7.23	984,317.33
BANCO DE SABADELL SA	109,692	1.70	187,353.93
BANCO SANTANDER SA	302,679	5.79	1,754,024.80
BANK OF IRELAND	558,550	0.22	126,790.85
BANKIA SA	23,750	4.01	95,261.25
BANKINTER SA	13,960	7.98	111,400.80
BNP PARIBAS	23,072	61.50	1,418,928.00
CAIXABANK S.A	76,740	4.03	309,262.20
COMMERZBANK AG	21,334	9.27	197,915.51
CREDIT AGRICOLE SA	21,992	13.83	304,259.32
ERSTE GROUP BANK AG	6,438	31.24	201,155.31
ING GROEP NV-CVA	80,245	14.92	1,197,656.62
INTESA SANPAOLO	279,763	2.61	731,860.00
KBC GROEP NV	5,119	63.38	324,442.22
MEDIOBANCA SPA	11,670	8.26	96,452.55
NATIXIS	19,150	5.81	111,299.80
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	2,770	21.23	58,820.95
SOCIETE GENERALE	16,119	46.08	742,844.11
UNICREDIT SPA	39,726	15.77	626,479.02
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	42,465	14.90	632,728.50
DEUTSCHE BOERSE AG	4,000	94.67	378,680.00
EURAZEO SE	1,005	66.50	66,832.50
EXOR NV	2,264	50.60	114,558.40
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,432	85.51	122,450.32
WENDEL	600	135.65	81,390.00
AEGON NV	38,139	4.37	166,972.54
AGEAS	4,044	35.29	142,732.98

ALLIANZ SE-REG	9,398	173.90	1,634,312.20
ASSICURAZIONI GENERALI	23,958	14.49	347,151.42
AXA	39,772	23.92	951,346.24
CNP ASSURANCES	3,530	19.73	69,646.90
HANNOVER RUECK SE-REG	1,355	105.60	143,088.00
MAPFRE SA	20,814	3.05	63,628.39
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,336	177.30	591,472.80
NN GROUP NV	6,340	30.44	192,989.60
POSTE ITALIANE SPA	10,260	6.00	61,560.00
SAMPO OYJ-A SHS	9,639	45.62	439,731.18
SCOR SE	3,152	35.90	113,156.80
UNIPOLSAI SPA	18,580	1.94	36,100.94
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	7,500	34.56	259,237.50
VONOVIA SE	10,088	35.60	359,132.80
AMADEUS IT GROUP SA	9,610	53.78	516,825.80
ATOS SE	2,060	127.40	262,444.00
CAP GEMINI SA	3,149	93.63	294,840.87
DASSAULT SYSTEMES SA	2,790	82.94	231,402.60
GEMALTO	1,850	55.15	102,027.50
SAP SE	20,212	95.93	1,938,937.16
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2,930	49.98	146,441.40
INGENICO GROUP	1,160	80.17	92,997.20
NOKIA OYJ	119,986	5.76	691,119.36
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	67,846	16.66	1,130,314.36
ELISA OYJ	2,505	34.53	86,497.65
ILIAD SA	520	217.00	112,840.00
KONINKLIJKE KPN NV	65,606	2.92	191,963.15
ORANGE S.A.	41,574	14.37	597,418.38
PROXIMUS	2,440	31.19	76,103.60
TELECOM ITALIA SPA	233,203	0.81	190,060.44
TELECOM ITALIA-RSP	125,887	0.65	82,078.32
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	12,220	4.30	52,594.88
TELEFONICA SA	96,049	9.49	912,081.30
E.ON SE	40,629	8.90	361,801.24
EDF	7,875	10.03	79,025.62

	ENDESA SA	6,840	22.24	152,155.80
	ENEL SPA	170,287	4.89	834,065.72
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	54,991	2.97	163,378.26
	ENGIE	35,254	13.91	490,559.41
	FORTUM OYJ	8,865	14.23	126,148.95
	GAS NATURAL SDG SA	7,722	21.06	162,663.93
	IBERDROLA SA	117,842	7.07	833,142.94
	INNOGY SE	2,850	36.02	102,671.25
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	9,010	20.06	180,785.65
	RWE AG	10,685	19.07	203,762.95
	SUEZ	6,199	16.54	102,562.45
	TERNA SPA	34,477	4.95	170,868.01
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	9,184	19.09	175,368.48
	ASML HOLDING NV	7,762	120.00	931,440.00
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	23,445	19.66	460,928.70
	STMICROELECTRONICS NV	12,733	13.41	170,749.53
ユーロ小計		4,492,693		80,315,647.73 (10,004,920,237)
英債券	BP PLC	404,268	4.56	1,844,877.01
	PETROFAC LTD	5,025	4.21	21,200.47
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	89,948	20.66	1,858,775.42
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	77,719	20.96	1,629,378.83
	ANGLO AMERICAN PLC	28,964	9.72	281,790.75
	ANTOFAGASTA PLC	8,730	7.72	67,395.60
	BHP BILLITON PLC	44,501	11.43	508,868.93
	CRODA INTERNATIONAL PLC	2,751	39.43	108,471.93
	FRESNILLO PLC	5,160	16.05	82,818.00
	GLENCORE PLC	253,673	2.79	709,016.03
	JOHNSON MATTHEY PLC	4,199	29.41	123,492.59
	MONDI PLC	7,400	20.58	152,292.00
	RANDGOLD RESOURCES LTD	1,840	71.15	130,916.00
	RIO TINTO PLC	25,595	30.52	781,287.37
	ASHTREAD GROUP PLC	10,920	16.20	176,904.00
	BAE SYSTEMS PLC ORD	65,595	6.50	426,367.50
	BUNZL PLC	7,276	23.40	170,258.40

COBHAM PLC	48,771	1.37	67,011.35
DCC PLC	1,810	71.40	129,234.00
IMI PLC	6,116	12.37	75,654.92
MEGGITT PLC	13,905	5.01	69,733.57
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	33,045	9.42	311,283.90
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENTITL-C	2,721,075	0.00	2,721.07
SMITHS GROUP PLC	8,813	16.27	143,387.51
TRAVIS PERKINS PLC	5,800	14.79	85,782.00
WEIR GROUP PLC/THE	3,880	17.70	68,676.00
WOLSELEY PLC	5,324	48.65	259,012.60
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,275	9.03	56,694.62
CAPITA PLC	15,309	6.91	105,861.73
EXPERIAN PLC	20,558	16.19	332,834.02
G4S PLC	34,639	3.32	115,209.31
INTERTEK GROUP PLC	3,545	44.02	156,050.90
RELX PLC	20,676	17.01	351,698.76
EASYJET PLC	3,840	13.37	51,340.80
ROYAL MAIL PLC	19,950	4.31	86,124.15
GKN PLC	33,065	3.45	114,371.83
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	22,900	5.65	129,385.00
BERKELEY GROUP HOLDINGS	2,600	33.16	86,216.00
BURBERRY GROUP PLC	8,904	17.55	156,265.20
PERSIMMON PLC	7,000	22.78	159,460.00
TAYLOR WIMPEY PLC	73,610	1.79	132,277.17
CARNIVAL PLC	4,050	51.90	210,195.00
COMPASS GROUP PLC	33,767	16.68	563,233.56
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	3,859	43.87	169,294.33
MERLIN ENTERTAINME	15,550	4.90	76,210.55
TUI AG-DI	9,943	11.33	112,654.19
WHITBREAD PLC	3,520	39.59	139,356.80
ITV PLC	77,235	1.82	141,185.58
PEARSON PLC	17,749	7.10	126,017.90
SKY PLC	21,334	9.66	206,086.44
WPP PLC	26,764	16.59	444,014.76
DIXONS CARPHONE PLC	22,000	3.01	66,330.00

KINGFISHER PLC	45,257	3.02	137,038.19
MARKS & SPENCER GROUP PLC	34,970	3.42	119,912.13
NEXT PLC	2,987	40.47	120,883.89
SAINSBURY (J) PLC	32,441	2.53	82,205.49
TESCO PLC	171,154	1.66	285,056.98
WM MORRISON SUPERMARKETS	49,255	2.40	118,556.78
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	7,335	29.32	215,062.20
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	38,377	54.82	2,103,827.14
COCA-COLA HBC AG-CDI	3,550	23.63	83,886.50
DIAGEO PLC	51,812	23.05	1,194,266.60
IMPERIAL BRANDS PLC	19,942	35.75	712,926.50
TATE & LYLE PLC	10,510	7.12	74,883.75
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	13,145	78.56	1,032,671.20
UNILEVER PLC	26,357	42.85	1,129,529.23
CONVATEC GROUP PLC	19,830	3.35	66,509.82
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	7,000	7.57	52,990.00
SMITH & NEPHEW PLC	16,356	13.69	223,913.64
ASTRAZENECA PLC	26,003	54.01	1,404,422.03
GLAXOSMITHKLINE PLC	101,571	17.08	1,735,340.53
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2,860	15.90	45,474.00
SHIRE PLC	18,675	45.18	843,829.87
BARCLAYS PLC	354,681	1.97	700,672.31
HSBC HOLDINGS PLC	409,061	6.80	2,784,478.22
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,468,476	0.66	979,179.79
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	72,080	2.45	177,028.48
STANDARD CHARTERED PLC	69,010	7.39	509,983.90
3I GROUP PLC	20,499	9.08	186,233.41
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	16,400	2.93	48,084.80
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,720	13.38	76,533.60
INVESTEC PLC	13,185	5.77	76,077.45
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	6,577	37.53	246,834.81
PROVIDENT FINANCIAL PLC	3,310	24.40	80,764.00
SCHRODERS PLC	1,921	31.57	60,645.97
ADMIRAL GROUP PLC	3,295	20.36	67,086.20
AVIVA PLC	84,235	5.28	445,181.97

	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	29,333	3.60	105,745.46	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	115,841	2.57	298,174.73	
	OLD MUTUAL PLC	104,159	1.98	206,651.45	
	PRUDENTIAL PLC	53,712	17.97	965,204.64	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	21,498	6.21	133,502.58	
	ST JAMES'S PLACE PLC	11,000	11.95	131,450.00	
	STANDARD LIFE PLC	40,716	3.89	158,670.25	
	AUTO TRADER GROUP PLC	23,390	3.88	90,753.20	
	SAGE GROUP PLC/THE	20,480	7.15	146,432.00	
	WORLDPAY GROUP PLC	42,180	3.15	132,867.00	
	BT GROUP PLC	173,382	2.85	495,699.13	
	INMARSAT PLC	10,010	7.87	78,778.70	
	VODAFONE GROUP PLC	551,068	2.23	1,232,739.11	
	CENTRICA PLC	111,175	2.08	231,799.87	
	NATIONAL GRID PLC	72,118	10.00	721,180.00	
	SEVERN TRENT PLC	4,423	23.09	102,127.07	
	SSE PLC	21,427	15.08	323,119.16	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	13,325	9.07	120,924.37	
英債券小計		9,047,819		38,472,766.45 (5,458,900,831)	
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	170	692.00	117,640.00	
	GIVAUDAN-REG	183	1,956.00	357,948.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	9,359	55.95	523,636.05	
	SIKA AG-BR	47	6,375.00	299,625.00	
	ABB LTD-REG	41,255	24.57	1,013,635.35	
	GEBERIT AG-REG	805	458.50	369,092.50	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	360	205.80	74,088.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	970	210.40	204,088.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	3,557	73.70	262,150.90	
	SGS SA-REG	113	2,364.00	267,132.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,150	157.60	181,240.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	11,039	80.60	889,743.40	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	680	369.10	250,988.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	930	72.80	67,704.00	
	DUFREY AG-REG	900	159.80	143,820.00	

	BARRY CALLEBAUT AG-REG	45	1,344.00	60,480.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	25	5,840.00	146,000.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	69,830.00	139,660.00	
	NESTLE SA-REG	64,293	82.10	5,278,455.30	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,160	163.60	189,776.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	170	561.50	95,455.00	
	LONZA GROUP AG-REG	1,608	208.60	335,428.80	
	NOVARTIS AG-REG	46,163	83.70	3,863,843.10	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	14,518	252.80	3,670,150.40	
	VIFOR PHARMA AG	1,070	110.40	118,128.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	45,828	13.35	611,803.80	
	JULIUS BAER GROUP LTD	4,600	50.90	234,140.00	
	PARGESA HOLDING SA-BR	655	74.15	48,568.25	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	370	595.50	220,335.00	
	UBS GROUP AG-REG	76,112	15.61	1,188,108.32	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,080	147.60	159,408.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	640	323.90	207,296.00	
	SWISS RE AG	6,569	89.30	586,611.70	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,171	284.60	902,466.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,460	88.10	128,626.00	
	SWISSCOM AG-REG	504	468.40	236,073.60	
	スイスフラン小計	341,561		23,443,345.07 (2,690,592,713)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	4,320	163.90	708,048.00	
	BOLIDEN AB	5,920	231.60	1,371,072.00	
	ALFA LAVAL AB	5,430	182.10	988,803.00	
	ASSA ABLOY AB-B	20,910	192.30	4,020,993.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	13,705	338.80	4,643,254.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	8,620	306.50	2,642,030.00	
	SANDVIK AB	21,690	138.20	2,997,558.00	
	SKANSKA AB-B SHS	7,170	208.10	1,492,077.00	
	SKF AB-B SHARES-B	7,829	182.90	1,431,924.10	
	VOLVO AB-B SHS-B	32,660	150.40	4,912,064.00	
	SECURITAS AB-B SHS	5,849	147.00	859,803.00	
	ELECTROLUX AB - B	5,455	293.20	1,599,406.00	

	HUSQVARNA AB-B SHS	8,480	86.35	732,248.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	19,678	203.50	4,004,473.00	
	ICA GRUPPEN AB	1,450	316.20	458,490.00	
	SWEDISH MATCH AB	4,040	306.70	1,239,068.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	13,015	241.60	3,144,424.00	
	GETINGE AB-B SHS	4,450	172.90	769,405.00	
	NORDEA BANK AB	62,628	108.10	6,770,086.80	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	31,870	103.40	3,295,358.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	31,220	120.70	3,768,254.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	18,880	204.90	3,868,512.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,700	212.00	572,400.00	
	INVESTOR AB-B SHS	9,135	420.00	3,836,700.00	
	KINNEVIK AB - B	4,235	262.80	1,112,958.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	700	693.00	485,100.00	
	ERICSSON LM-B SHS	64,235	63.85	4,101,404.75	
	HEXAGON AB-B SHS	5,260	417.40	2,195,524.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,370	505.00	691,850.00	
	TELE2 AB-B SHS	6,255	90.30	564,826.50	
	TELIA CO AB	53,480	39.04	2,087,859.20	
	スウェーデンクローナ小計	482,639		71,365,973.35 (910,629,819)	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	23,294	139.90	3,258,830.60	
	NORSK HYDRO A S	26,460	45.15	1,194,669.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	3,780	306.50	1,158,570.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	1,430	188.50	269,555.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	1,650	203.80	336,270.00	
	MARINE HARVEST	7,720	145.60	1,124,032.00	
	ORKLA ASA	17,310	84.40	1,460,964.00	
	DNB ASA	19,945	135.90	2,710,525.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,200	141.00	592,200.00	
	TELENOR ASA	14,895	138.00	2,055,510.00	
	ノルウェークローネ小計	120,684		14,161,126.10 (186,643,641)	
デンマーク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,890	489.00	924,210.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	4,865	293.00	1,425,445.00	

	VESTAS WIND SYSTEMS AS	4,690	588.50	2,760,065.00	
	ISS A/S	3,100	269.50	835,450.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	80	12,030.00	962,400.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	138	12,650.00	1,745,700.00	
	DSV A/S	3,870	404.90	1,566,963.00	
	PANDORA A/S	2,320	627.50	1,455,800.00	
	CARLSBERG AS-B	2,180	712.00	1,552,160.00	
	COLOPLAST-B	2,545	578.50	1,472,282.50	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	3,000	175.00	525,000.00	
	GENMAB A/S	1,180	1,478.00	1,744,040.00	
	H LUNDBECK A/S	1,090	373.20	406,788.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	37,205	294.00	10,938,270.00	
	DANSKE BANK A/S	14,255	249.30	3,553,771.50	
	TRYG A/S	2,575	142.80	367,710.00	
	TDC A/S	14,545	38.81	564,491.45	
	DONG ENERGY A/S	2,990	301.20	900,588.00	
	デンマーククローネ小計	102,518		33,701,134.45	(564,494,002)
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	5,335	31.48	167,945.80	
	OIL SEARCH LTD	28,830	6.55	188,836.50	
	ORIGIN ENERGY LTD	35,950	6.92	248,774.00	
	SANTOS LTD	33,135	2.92	96,754.20	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	16,528	29.30	484,270.40	
	ALUMINA LTD	46,512	1.92	89,303.04	
	AMCOR LIMITED	23,840	16.59	395,505.60	
	BHP BILLITON LTD	66,586	22.41	1,492,192.26	
	BLUESCOPE STEEL LTD	9,840	12.48	122,803.20	
	BORAL LTD	17,115	6.99	119,633.85	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	29,665	4.66	138,238.90	
	INCITEC PIVOT LTD	31,550	3.38	106,639.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	8,505	20.06	170,610.30	
	NEWCREST MINING LTD	15,439	21.25	328,078.75	
	ORICA LIMITED	6,935	20.27	140,572.45	
	RIO TINTO LTD	9,218	58.83	542,294.94	
	SOUTH32 LTD	117,667	2.57	302,404.19	

CIMIC GROUP LTD	1,867	39.20	73,186.40
BRAMBLES LTD	32,868	10.16	333,938.88
SEEK LTD	8,040	17.24	138,609.60
AURIZON HOLDINGS LTD	46,150	5.51	254,286.50
QANTAS AIRWAYS LTD	7,093	5.58	39,578.94
SYDNEY AIRPORT	24,156	7.60	183,585.60
TRANSURBAN GROUP	43,195	12.60	544,257.00
ARISTOCRAT LEISURE LTD	12,510	23.56	294,735.60
CROWN RESORTS LTD	6,745	12.75	85,998.75
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,180	53.60	63,248.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	970	38.46	37,306.20
TABCORP HOLDINGS LTD	15,336	4.56	69,932.16
TATTS GROUP LTD	30,060	4.22	126,853.20
REA GROUP LTD	1,150	66.50	76,475.00
WESFARMERS LTD	23,665	40.72	963,638.80
WOOLWORTHS LTD	26,772	25.36	678,937.92
COCA-COLA AMATIL LTD	10,650	9.06	96,489.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	15,946	13.34	212,719.64
COCHLEAR LTD	1,277	159.54	203,732.58
HEALTHSCOPE LTD	44,380	2.17	96,304.60
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,935	72.98	214,196.30
SONIC HEALTHCARE LTD	8,110	24.08	195,288.80
CSL LTD	9,502	143.33	1,361,921.66
AUST AND NZ BANKING GROUP	60,889	27.68	1,685,407.52
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	8,120	10.96	88,995.20
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	10,478	10.63	111,381.14
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	35,657	81.25	2,897,131.25
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	55,253	29.31	1,619,465.43
WESTPAC BANKING CORP	68,971	30.18	2,081,544.78
AMP LTD	62,647	5.13	321,379.11
ASX LTD	3,445	52.79	181,861.55
CHALLENGER LTD	9,950	13.39	133,230.50
MACQUARIE GROUP LTD	6,494	89.40	580,563.60
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	50,298	6.49	326,434.02
MEDIBANK PRIVATE LTD	62,000	2.74	169,880.00

	QBE INSURANCE GROUP LTD	29,380	11.88	349,034.40	
	SUNCORP GROUP LTD	27,180	14.60	396,828.00	
	COMPUTERSHARE LTD	11,490	14.42	165,685.80	
	TELSTRA CORPORATION LTD	87,384	4.35	380,120.40	
	AGL ENERGY LTD	12,851	26.20	336,696.20	
	AUSNET SERVICES	40,750	1.72	70,293.75	
豪ドル小計		1,520,444		23,376,011.16	(1,967,792,619)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	15,180	7.75	117,645.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	21,455	7.04	151,043.20	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	8,500	8.30	70,550.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	45,157	3.75	169,564.53	
	CONTACT ENERGY LIMITED	15,350	5.19	79,666.50	
	MERCURY NZ LTD	13,500	3.34	45,090.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	28,000	3.00	84,140.00	
ニュージーランドドル小計		147,142		717,699.23	(58,119,283)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	56,708	99.05	5,616,927.40	
	NWS HOLDINGS LTD	28,500	15.48	441,180.00	
	MTR CORP	34,000	43.75	1,487,500.00	
	LI & FUNG LTD	138,000	2.80	386,400.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	29,000	35.75	1,036,750.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	14,500	31.80	461,100.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	50,000	47.15	2,357,500.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	16,800	17.16	288,288.00	
	SANDS CHINA LTD	49,800	35.75	1,780,350.00	
	SJM HOLDINGS LTD	48,000	8.30	398,400.00	
	WYNN MACAU LTD	35,800	18.02	645,116.00	
	WH GROUP LTD	153,500	7.63	1,171,205.00	
	BANK OF EAST ASIA	21,640	33.40	722,776.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	77,000	34.65	2,668,050.00	
	HANG SENG BANK LTD	16,300	160.50	2,616,150.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	23,600	200.60	4,734,160.00	
	AIA GROUP LTD	247,790	57.45	14,235,535.50	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	55,708	61.70	3,437,183.60		

	HANG LUNG GROUP LTD	17,000	31.40	533,800.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	46,000	19.24	885,040.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	25,126	44.40	1,115,594.40	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	15,000	37.50	562,500.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	11,450	26.40	302,280.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	134,666	10.22	1,376,286.52	
	SINO LAND CO	63,050	13.00	819,650.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	30,480	116.60	3,553,968.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	10,517	76.05	799,817.85	
	SWIRE PROPERTIES LTD	23,200	25.50	591,600.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	27,800	66.25	1,841,750.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	19,600	60.10	1,177,960.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	54,000	10.22	551,880.00	
	PCCW LTD	80,000	4.44	355,200.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	13,000	66.95	870,350.00	
	CLP HOLDINGS LTD	34,500	83.50	2,880,750.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	56,000	7.19	402,640.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	171,517	14.86	2,548,742.62	
	POWER ASSETS HOLDINGS	28,500	70.55	2,010,675.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	4,200	113.40	476,280.00	
	香港ドル小計	1,962,252		68,141,335.89 (972,376,863)	
シンガポールド ル	KEPPEL CORP LTD	34,660	6.23	215,931.80	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	21,000	3.05	64,050.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,000	3.71	122,430.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,000	2.37	109,020.00	
	SATS LTD	13,000	5.07	65,910.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	12,800	9.96	127,488.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	114,500	1.06	121,942.50	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	32,550	3.22	104,811.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,000	44.88	89,760.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	130,000	0.37	48,750.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	29,660	3.49	103,513.40	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	36,715	20.35	747,150.25	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	68,240	10.66	727,438.40	

	UNITED OVERSEAS BANK LTD	26,300	22.92	602,796.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	20,000	7.39	147,800.00	
	CAPITALAND LTD	51,800	3.54	183,372.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	10,000	10.92	109,200.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	60,000	2.84	170,400.00	
	UOL GROUP LTD	12,250	7.60	93,100.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	172,180	3.79	652,562.20	
シンガポールドル小計		926,655		4,607,425.55	(369,699,826)
イスラエルシュケル	FRUTAROM	810	239.00	193,590.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	9,770	15.82	154,561.40	
	ELBIT SYSTEMS LTD	500	439.80	219,900.00	
	BANK HAPOALIM BM	21,225	23.83	505,791.75	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	24,465	17.00	415,905.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	2,900	63.98	185,542.00	
	NICE LTD	1,385	281.30	389,600.50	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	48,790	5.79	282,494.10	
イスラエルシュケル小計		109,845		2,347,384.75	(73,825,250)
合 計		26,558,040		75,332,794,252	(75,332,794,252)

(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	49,843.93	
	出資金小計		2,027.00	49,843.93	(5,546,633)
	投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	7,010	155,692.10	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	1,490	179,694.00	
		AMERICAN TOWER CORP	8,929	1,177,556.52	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	20,020	252,252.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,855	553,955.65	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,147	395,168.79	

BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	6,100	109,129.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	1,940	169,847.00	
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	10,000	145,000.00	
CROWN CASTLE INTL CORP	7,430	741,811.20	
DIGITAL REALTY TRUST INC	3,235	389,946.90	
DUKE REALTY CORPORATION	6,875	193,600.00	
EQUINIX INC	1,478	641,555.46	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	7,530	506,091.30	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,400	372,106.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	2,800	220,500.00	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,415	176,945.75	
GGP INC	12,545	296,940.15	
HCP INC	10,125	338,073.75	
HOST HOTELS & RESORTS INC	15,169	283,963.68	
IRON MOUNTAIN INC	5,515	190,377.80	
KIMCO REALTY CORPORATION	8,795	158,222.05	
LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	129,874.36	
MACERICH CO/THE	2,460	141,327.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,270	247,838.60	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	2,990	114,008.70	
PROLOGIS INC	10,932	639,740.64	
PUBLIC STORAGE	3,039	647,641.29	
REALTY INCOME CORP	5,400	298,512.00	
REGENCY CENTERS CORP	3,175	193,897.25	
SBA COMMUNICATIONS CORP	2,580	340,327.80	
SIMON PROPERTY GROUP INC	6,594	1,047,786.60	
SL GREEN REALTY CORP	2,040	217,810.80	
UDR INC	5,820	230,879.40	
VENTAS INC	7,285	522,480.20	
VEREIT INC	19,554	157,605.24	
VORNADO REALTY TRUST	3,491	328,782.38	
WELLTOWER INC	7,380	571,433.40	
WEYERHAEUSER CO	15,508	529,443.12	
投資証券小計	249,434	14,007,817.88	(1,558,789,973)

米ドル小計			251,461	14,057,661.81 (1,564,336,606)
加ドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2,340	52,275.60
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,380	82,167.80
加ドル小計			5,720	134,443.40 (11,282,490)
ユーロ	投資証券	FONCIERE DES REGIONS	595	49,628.95
		GECINA SA	970	136,091.00
		ICADE	685	51,375.00
		KLEPIERRE	4,732	177,710.26
		UNIBAIL-RODAMCO SE-NA	2,070	481,999.50
ユーロ小計			9,052	896,804.71 (111,714,962)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	21,701	134,871.71
		HAMMERSON PLC	15,295	90,011.07
		INTU PROPERTIES PLC	19,860	53,900.04
		LAND SECURITIES GROUP PLC	16,229	166,996.41
		SEGRO PLC	18,063	89,393.78
英ポンド小計			91,148	535,173.01 (75,935,698)
豪ドル	投資証券	APA GROUP	21,286	202,642.72
		DEXUS	18,487	185,609.48
		GOODMAN GROUP	39,332	324,882.32
		GPT GROUP	33,695	172,518.40
		LENDLEASE GROUP	12,197	198,323.22
		MIRVAC GROUP	86,525	196,411.75
		SCENTRE GROUP	116,381	482,981.15
		STOCKLAND	55,310	262,169.40
		VICINITY CENTRES	72,862	201,099.12
		WESTFIELD CORP	41,745	347,735.85
豪ドル小計			497,820	2,574,373.41 (216,710,753)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	48,000	2,901,600.00
香港ドル小計			48,000	2,901,600.00 (41,405,832)
シンガ	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	51,900	138,573.00

ポールドル	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	40,000	66,000.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	48,100	95,238.00	
	SUNTEC REIT	45,000	83,250.00	
シンガポールドル小計		185,000	383,061.00 (30,736,814)	
合計			2,052,123,155 (2,052,123,155)	

(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 604銘柄	96.9%			63.6%
	投資証券 39銘柄			3.1%	2.0%
加ドル	株式 89銘柄	99.6%			3.7%
	投資証券 2銘柄			0.4%	0.0%
ユーロ	株式 232銘柄	98.9%			12.9%
	投資証券 5銘柄			1.1%	0.1%
英ポンド	株式 105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 36銘柄	100.0%			3.5%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	100.0%			1.2%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.0%			0.7%
豪ドル	株式 58銘柄	90.1%			2.5%
	投資証券 10銘柄			9.9%	0.3%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 38銘柄	95.9%			1.3%
	投資証券 1銘柄			4.1%	0.1%
シンガポールドル	株式 20銘柄	92.3%			0.5%
	投資証券 4銘柄			7.7%	0.0%

イスラエルシュケル	株式	8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MSCIEマージング（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

	（単位：円）	
	平成28年12月26日現在	平成29年 6月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	121,772,739	148,640,474
コール・ローン	70,002,860	80,417,431
株式	9,776,973,580	11,494,943,065
投資信託受益証券	37,685,120	45,719,388
投資証券	47,533,214	59,485,589
派生商品評価勘定	-	2,711,894
未収入金	-	87,333
未収配当金	10,167,084	33,994,969
差入委託証拠金	149,739,494	374,496,482
流動資産合計	10,213,874,091	12,240,496,625
資産合計	10,213,874,091	12,240,496,625
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	16,018,868	484,068
未払解約金	10,198,816	4,209,200
未払利息	61	126
流動負債合計	26,217,745	4,693,394
負債合計	26,217,745	4,693,394
純資産の部		
元本等		
元本	7,049,884,290	7,321,484,408
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	3,137,772,056	4,914,318,823
元本等合計	10,187,656,346	12,235,803,231
純資産合計	10,187,656,346	12,235,803,231
負債純資産合計	10,213,874,091	12,240,496,625

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12月26日現在	平成29年 6月26日現在
1.	期首	平成28年 6月28日	平成28年12月27日
	期首元本額	6,874,168,506円	7,049,884,290円
	期首からの追加設定元本額	617,108,837円	692,270,696円
	期首からの一部解約元本額	441,393,053円	420,670,578円
	元本の内訳		
	日興五大陸株式ファンド	2,224,016,829円	1,954,757,370円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	28,859,789円	27,288,287円
	インデックスファンド海外新興国（エマージング）株式	4,795,341,473円	5,337,861,907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	1,576,844円
	計	7,049,884,290円	7,321,484,408円
2.	受益権の総数	7,049,884,290口	7,321,484,408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28年 6月28日 至 平成28年12月26日	自 平成28年12月27日 至 平成29年 6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12月26日現在	平成29年 6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

(平成29年 6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	89,932,427
投資信託受益証券	1,523,980
投資証券	148,953
合計	91,307,454

(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

(平成29年 6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	644,222,732	-	646,450,558	2,227,826
	合計	644,222,732	-	646,450,558	2,227,826

(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12月26日現在		平成29年 6月26日現在	
1口当たり純資産額	1.4451円	1口当たり純資産額	1.6712円
(1万口当たり純資産額)	(14,451円)	(1万口当たり純資産額)	(16,712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	8.86	21,618.40	
	GAZPROM PAO-SPON ADR	121,700	3.93	479,193.75	
	LUKOIL PJSC-SPON-ADR	9,535	46.68	445,141.47	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	2,326	106.60	247,951.60	
	PETROLEO BRASILEIRO S.A.-ADR	8,250	7.75	63,937.50	
	ROSNEFT PJSC-REG S GDR	26,540	5.34	141,723.60	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	34,100	4.21	143,629.20	
	TATNEFT-SPONSORED-ADR	5,449	37.55	204,609.95	

BRASKEM SA-SPON ADR	1,780	19.36	34,460.80
CEMEX SAB-SPONS ADR PART CER	2,704	9.19	24,849.76
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	4,650	11.57	53,800.50
CIA SIDERURGICA NAACL-SP ADR	10,170	1.90	19,323.00
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	13,394	13.45	180,149.30
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	2,340	18.07	42,283.80
PHOSAGRO PJSC REG S-GDR	3,700	13.60	50,320.00
QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	1,100	33.32	36,652.00
SEVERSTAL - GDR REG S	7,270	12.16	88,403.20
SOUTHERN COPPER CORP(US)	2,080	34.88	72,550.40
DP WORLD LTD	4,470	21.20	94,764.00
LATAM AIRLINES GROUP-SP -ADR	2,280	11.09	25,285.20
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP-ADR	2,600	72.72	189,072.00
TAL EDUCATION GROUP- ADR	1,000	119.78	119,780.00
YUM CHINA HOLDINGS INC	8,700	39.99	347,913.00
GRUPO TELEVISA SA-SPONS ADR	2,040	24.47	49,918.80
CTIP.COM INTERNATIONAL-ADR	8,150	55.63	453,384.50
JD.COM INC-ADR	15,400	42.95	661,430.00
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	7,700	11.87	91,399.00
CIA BRASILEIRA-SP ADR PREF	2,380	18.98	45,172.40
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	6,920	33.57	232,304.40
BRF SA-ADR	2,580	12.00	30,960.00
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	1,450	26.35	38,207.50
BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	1,983	25.11	49,793.13
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	2,260	42.53	96,117.80
CREDICORP LTD	1,430	180.35	257,900.50
GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORE-ADR	1,850	7.98	14,763.00
GRUPO FIN SANTANDER B-ADR	2,600	9.57	24,882.00
ITAU UNIBANCO HLDNG-PREF ADR	2,200	10.61	23,342.00
SBERBANK-SPONSORED ADR	62,880	10.10	635,088.00
VTB BANK OJSC-GDR-REG S	66,030	2.08	137,342.40
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	17,100	1.57	26,881.20
58.COM INC-ADR	2,120	43.30	91,796.00
ALIBABA GROUP HOLDING-SP-ADR	25,050	143.01	3,582,400.50
AUTOHOME INC-ADR	1,000	45.47	45,470.00

	BAIDU INC - SPON ADR	6,020	178.14	1,072,402.80	
	MOMO INC-SPON-ADR	1,800	39.35	70,830.00	
	NETEASE INC-ADR	1,770	333.56	590,401.20	
	SINA CORP	1,140	87.61	99,875.40	
	WEIBO CORP-SPON-ADR	680	72.38	49,218.40	
	WEIBO CORP-SPON-ADR(N)	114	72.38	8,251.32	
	YY INC-ADR	700	58.80	41,160.00	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	12,562	8.80	110,545.60	
	ROSTELECOM-SPONSORED-ADR	2,641	7.04	18,592.64	
	SISTEMA PJSC-REG S SPONS GDR	2,800	4.73	13,244.00	
	TELEF BRASIL-ADR	3,924	13.63	53,484.12	
	CIA SANEAMIENTO BASICO DE-ADR	6,180	9.27	57,288.60	
	RUSHYDRO PJSC-ADR	42,000	1.26	52,920.00	
米ドル小計		594,032		11,954,179.64	(1,330,261,110)
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	284,903	16.53	4,709,446.59	
	GRUPO MEXICO SA-SER B	82,078	48.31	3,965,188.18	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	3,700	412.55	1,526,435.00	
	MEXICHEM SAB DE CV-*	23,765	48.74	1,158,306.10	
	ALFA S.A.B.-A	61,000	25.81	1,574,410.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	13,700	76.17	1,043,529.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	7,900	197.60	1,561,040.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	4,000	373.21	1,492,840.00	
	OHL MEXICO SAB DE CV	21,000	26.16	549,360.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	5,000	210.04	1,050,200.00	
	GRUPO TELEvisa SAB	43,100	87.91	3,788,921.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	4,400	143.80	632,720.00	
	WALMART DE MEXICO -SER V	120,200	41.57	4,996,714.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	9,300	136.72	1,271,496.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	10,900	151.04	1,646,336.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	41,900	174.19	7,298,561.00	
	GRUMA S.A.B.-B	4,800	235.53	1,130,544.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	36,500	46.17	1,685,205.00	
	GRUPO LALA SAB DE CV	13,000	32.25	419,250.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	41,670	38.86	1,619,296.20	

	GRUPO FIN SANTANDER-B	32,000	34.55	1,105,600.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	52,100	113.33	5,904,493.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	54,000	31.54	1,703,160.00	
	GENTERA SAB DE CV	30,000	28.38	851,400.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	750,800	14.22	10,676,376.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	10,600	94.52	1,001,912.00	
メキシコペソ小計		1,762,316		64,362,739.07	(398,405,354)
ブラジルリアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	2,600	31.80	82,680.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	53,360	12.89	687,810.40	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	85,100	11.93	1,015,243.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	8,100	75.63	612,603.00	
	BRASKEM SA-PREF A	1,000	32.41	32,410.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL	7,800	6.38	49,764.00	
	DURATEX SA	7,260	8.03	58,297.80	
	FIBRIA CELULOSE SA	5,929	34.05	201,882.45	
	GERDAU SA-PREF	16,000	9.70	155,200.00	
	KLABIN SA - UNIT	13,300	16.48	219,184.00	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	9,000	14.50	130,500.00	
	VALE SA	25,760	27.24	701,702.40	
	VALE SA-PREF A	46,150	25.37	1,170,825.50	
	EMBRAER SA	16,000	15.83	253,280.00	
	WEG SA	12,820	17.75	227,555.00	
	CCR SA	26,100	16.48	430,128.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	3,087	43.92	135,581.04	
	RUMO SA	16,000	8.25	132,000.00	
	KROTON EDUCACIONAL SA	29,448	14.03	413,155.44	
	LOJAS AMERICANAS SA	6,000	11.91	71,460.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PRF	13,092	13.50	176,742.00	
	LOJAS RENNER S.A.	15,400	26.58	409,332.00	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PRF	850	63.60	54,060.00	
	RAIA DROGASIL SA	4,700	71.89	337,883.00	
	AMBEV SA	107,400	18.24	1,958,976.00	
	BRF SA	8,400	40.10	336,840.00	
	JBS SA	18,100	6.26	113,306.00	

	M DIAS BRANCO SA	2,850	49.92	142,272.00	
	NATURA COSMETICOS SA	3,300	26.55	87,615.00	
	ODONTOPREV S.A.	4,700	11.76	55,272.00	
	QUALICORP SA	5,000	30.65	153,250.00	
	HYPERMARCAS SA	8,000	28.95	231,600.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	20,763	26.32	546,482.16	
	BANCO BRADESCO SA-PRF	66,486	26.41	1,755,895.26	
	BANCO DO BRASIL S.A.	19,200	25.48	489,216.00	
	BANCO SAN. BRASIL-UNIT	7,700	24.96	192,192.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	70,436	35.49	2,499,773.64	
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PRF	84,785	8.67	735,085.95	
	BM&FBOVESPA SA	46,983	18.86	886,099.38	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	14,000	28.30	396,200.00	
	PORTO SEGURO SA	3,200	30.71	98,272.00	
	SUL AMERICA SA - UNITS	6,362	17.57	111,780.34	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	20,397	11.86	241,908.42	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	1,500	65.45	98,175.00	
	CIELO SA	28,368	24.67	699,838.56	
	TELEFONICA BRASIL S.A. -PREF	5,330	45.51	242,568.30	
	TIM PARTICIPACOES SA	16,905	9.83	166,176.15	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS	4,500	11.99	53,955.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	4,800	15.94	76,512.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	14,399	7.69	110,728.31	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PRF-B	3,000	24.80	74,400.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	2,160	30.94	66,830.40	
	CPFL ENERGIA SA	3,605	26.35	94,991.75	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	7,300	13.70	100,010.00	
	ENGIE BRASIL SA	3,700	34.56	127,872.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	4,900	53.00	259,700.00	
	TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	4,000	21.60	86,400.00	
	ブラジルリアル小計	1,047,385		21,049,472.65 (700,736,944)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	9,890	7,492.60	74,101,814.00	
	EMPRESAS CMPC SA	20,000	1,583.50	31,670,000.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B-PRF	1,400	22,085.00	30,919,000.00	

	LATAM AIRLINES GROUP SA	5,300	7,349.50	38,952,350.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	13,300	5,606.50	74,566,450.00	
	CENCOSUD SA	30,150	1,768.90	53,332,335.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PRF B	5,600	2,751.60	15,408,960.00	
	BANCO DE CHILE	583,660	86.03	50,212,269.80	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	959	37,188.00	35,663,292.00	
	BANCO SANTANDER CHILE SA	747,000	41.66	31,120,020.00	
	ITAU CORPBANCA	2,600,000	5.97	15,522,000.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	3,440	7,343.10	25,260,264.00	
	AES GENER SA	80,000	246.36	19,708,800.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	56,000	381.49	21,363,440.00	
	COLBUN SA	208,000	145.14	30,189,120.00	
	ENEL AMERICAS SA	656,060	124.90	81,941,894.00	
	ENEL CHILE SA	419,500	73.41	30,795,495.00	
	ENEL GENERACION CHILE SA	57,700	502.70	29,005,790.00	
チリペソ小計		5,497,959		689,733,293.80	(116,013,140)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	50,000	1,340.00	67,000,000.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	8,890	11,780.00	104,724,200.00	
	GRUPO ARGOS SA	5,760	20,860.00	120,153,600.00	
	BANCOLOMBIA SA	4,400	30,100.00	132,440,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PRF	2,000	32,140.00	64,280,000.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES-PRF	47,000	1,215.00	57,105,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	6,600	38,800.00	256,080,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	13,000	13,600.00	176,800,000.00	
コロンビアペソ小計		137,650		978,582,800.00	(36,011,847)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	2,720	98.35	267,512.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	46,017	6.49	298,650.33	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	4,300	22.02	94,686.00	
	KOC HOLDING AS	12,124	16.40	198,833.60	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	12,000	4.61	55,320.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	19,550	7.77	151,903.50	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	3,300	29.68	97,944.00	
	ARCELIK A.S.	6,500	25.92	168,480.00	

	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	4,400	65.10	286,440.00	
	ANADOLU EFES BIRACILIK	5,581	21.50	119,991.50	
	COCA-COLA ICECEK URETIM AS	2,000	41.00	82,000.00	
	AKBANK T.A.S.	49,259	9.94	489,634.46	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	52,740	9.71	512,105.40	
	TURKIYE HALK BANKASI	14,660	12.97	190,140.20	
	TURKIYE IS BANKASI-C	39,904	7.26	289,703.04	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	19,682	6.51	128,129.82	
	YAPI VE KREDI BANKASI	18,033	4.46	80,427.18	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	27,753	10.93	303,340.29	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	12,000	6.29	75,480.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	17,056	11.61	198,020.16	
トルコリラ小計		369,579		4,088,741.48	(130,021,979)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,800	901.10	1,621,980.00	
	MONETA MONEY BANK AS	11,000	76.05	836,550.00	
	02 CZECH REPUBLIC AS	1,300	285.00	370,500.00	
	CEZ AS	3,530	434.00	1,532,020.00	
チェココルナ小計		17,630		4,361,050.00	(20,671,377)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	1,060	21,730.00	23,033,800.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	2,750	7,040.00	19,360,000.00	
	OTP BANK PLC	5,385	9,235.00	49,730,475.00	
ハンガリーフォリント小計		9,195		92,124,275.00	(37,061,595)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	3,000	53.66	160,980.00	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	7,330	117.75	863,107.50	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	37,985	6.50	246,902.50	
	GRUPA AZOTY SA	1,400	69.01	96,614.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	3,710	108.80	403,648.00	
	SYNTHOS SA	12,000	4.42	53,040.00	
	CCC SA	650	222.05	144,332.50	
	LPP SA	20	6,698.50	133,970.00	
	CYFROWY POLSAT SA	4,500	25.19	113,355.00	
	EUROCASH SA	2,100	30.99	65,079.00	

	ALIOR BANK SA	1,500	60.60	90,900.00	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	850	70.36	59,806.00	
	BANK MILLENNIUM SA	13,000	7.08	92,040.00	
	BANK PEKAO SA	3,152	122.00	384,544.00	
	BANK ZACHODNI WBK SA	810	340.00	275,400.00	
	MBANK	410	447.60	183,516.00	
	PKO BANK POLSKI SA	20,445	34.00	695,130.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	13,500	44.76	604,260.00	
	ORANGE POLSKA SA	14,105	5.17	72,922.85	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	18,400	12.27	225,768.00	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	22,000	3.60	79,200.00	
	ポーランドズロチ小計	180,867		5,044,515.35 (148,863,647)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	85,000	3.77	320,450.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	46,000	6.20	285,200.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	539,300	6.18	3,332,874.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	73,000	19.68	1,436,640.00	
	CNOOC LTD	388,000	8.52	3,305,760.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	66,000	6.61	436,260.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	467,000	4.85	2,264,950.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	50,000	6.47	323,500.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	89,000	3.83	340,870.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	23,000	25.35	583,050.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	74,000	4.33	320,420.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	31,000	11.90	368,900.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	42,000	9.36	393,120.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	64,500	4.00	258,000.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD	147,750	2.61	385,627.50	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	52,000	4.65	241,800.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	12,000	38.50	462,000.00	
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	96,000	10.20	979,200.00	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	31,000	14.10	437,100.00	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	46,000	10.24	471,040.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	100,000	6.15	615,000.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	52,000	12.38	643,760.00	

CITIC LTD	123,000	12.04	1,480,920.00	
CRRIC CORP LTD- H	79,000	7.00	553,000.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	49,000	11.90	583,100.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	12,000	20.80	249,600.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	70,000	3.80	266,000.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	13,000	22.90	297,700.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	32,000	7.38	236,160.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	19,200	6.17	118,464.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H(N)	19,200	6.17	118,464.00	
ZHUZHOU CRRIC TIMES ELECTRIC	9,000	38.80	349,200.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	55,000	9.71	534,050.00	
AIR CHINA LTD-H	58,000	7.58	439,640.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	40,000	11.18	447,200.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	31,000	22.00	682,000.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	38,000	6.49	246,620.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	32,000	9.11	291,520.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	24,000	11.14	267,360.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	43,000	9.78	420,540.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	64,000	14.22	910,080.00	
BYD CO LTD-H	14,500	48.35	701,075.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B	28,000	10.24	286,720.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	60,000	9.46	567,600.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	10,000	29.95	299,500.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	100,000	14.84	1,484,000.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	75,000	9.81	735,750.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	52,318	13.94	729,312.92	
MINH GROUP LTD	14,000	32.50	455,000.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	25,000	23.25	581,250.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	36,000	20.25	729,000.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	13,000	51.00	663,000.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	180,000	1.34	241,200.00	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	145,000	6.09	883,050.00	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	191,160	0.97	185,425.20	
SUN ART RETAIL GROUP	43,000	6.74	289,820.00	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	90,000	0.42	37,800.00	

CHINA MENGNIU DAIRY CO	58,000	15.44	895,520.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	37,000	20.50	758,500.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	38,000	9.08	345,040.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	6,000	35.70	214,200.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	132,000	5.20	686,400.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	17,500	60.10	1,051,750.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	76,000	3.88	294,880.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	32,000	5.83	186,560.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	13,000	23.05	299,650.00
SINOPHARM GROUP CO-H	26,400	35.95	949,080.00
3SBIO INC	25,000	10.62	265,500.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	24,000	13.64	327,360.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	96,000	11.96	1,148,160.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	11,000	30.50	335,500.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	90,000	3.32	298,800.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	102,000	6.97	710,940.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	604,000	3.65	2,204,600.00
BANK OF CHINA LTD - H	1,784,000	3.81	6,797,040.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	216,245	5.91	1,278,007.95
CHINA CITIC BANK - H	206,000	4.77	982,620.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,873,920	6.11	11,449,651.20
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	90,000	3.57	321,300.00
CHINA MERCHANTS BANK - H	81,150	23.20	1,882,680.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	131,200	7.79	1,022,048.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	75,000	5.23	392,250.00
IND & COMM BK OF CHINA - H	1,636,575	5.20	8,510,190.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	171,000	2.92	499,320.00
CHINA EVERBRIGHT LTD	18,000	16.94	304,920.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	63,000	7.14	449,820.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	161,000	3.05	491,050.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	46,000	16.00	736,000.00
FAR EAST HORIZON LTD	40,000	6.88	275,200.00
GF SECURITIES CO LTD-H	30,600	15.80	483,480.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	67,600	12.88	870,688.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	32,000	15.18	485,760.00

CHINA LIFE INSURANCE CO-H	169,000	24.20	4,089,800.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	54,600	29.90	1,632,540.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	34,940	20.10	702,294.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO-H	14,000	39.80	557,200.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	163,000	3.30	537,900.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	99,334	13.28	1,319,155.52	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	114,000	52.30	5,962,200.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	96,000	14.34	1,376,640.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	110,000	2.88	316,800.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	86,320	22.75	1,963,780.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	61,777	21.90	1,352,916.30	
CHINA VANKE CO LTD-H	30,360	21.90	664,884.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	100,713	8.72	878,217.36	
FULLSHARE HOLDINGS LTD	102,500	3.20	328,000.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	26,400	12.06	318,384.00	
LONGFOR PROPERTIES	31,000	15.38	476,780.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	37,500	13.68	513,000.00	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	65,000	3.73	242,450.00	
SOHO CHINA LTD	65,000	3.69	239,850.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	40,000	14.16	566,400.00	
KINGSOFT CORP LTD	16,000	20.45	327,200.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	126,000	280.20	35,305,200.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	20,000	22.50	450,000.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	18,000	96.00	1,728,000.00	
LENOVO GROUP LTD	154,000	5.03	774,620.00	
SUNNY OPTICAL TECH	14,000	70.75	990,500.00	
ZTE CORP-H	21,600	18.40	397,440.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	60,000	4.46	267,600.00	
CHINA MOBILE LTD	136,700	83.40	11,400,780.00	
CHINA TELECOM CORP LTD	315,000	3.77	1,187,550.00	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	123,882	11.70	1,449,419.40	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	90,000	6.18	556,200.00	
CGN POWER CO LTD-H	186,000	2.22	412,920.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	54,000	14.98	808,920.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	48,000	5.76	276,480.00	

	CHINA POWER INTERNATIONAL	55,000	2.84	156,200.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	30,000	26.75	802,500.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	47,000	15.42	724,740.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	17,000	46.25	786,250.00	
	GUANGDONG INVEST	62,000	11.06	685,720.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	106,000	5.61	594,660.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	64,000	2.43	155,520.00	
	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	298,000	0.76	226,480.00	
	HANERGY THIN FILM POWER GROU	240,000	3.50	840,000.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	68,000	8.39	570,520.00	
香港ドル小計		16,444,744		169,685,718.35 (2,421,415,200)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	70,000	1.93	135,100.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	5,000	24.22	121,100.00	
	SAPURA ENERGY BHD	70,000	1.57	109,900.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	53,000	7.15	378,950.00	
	GAMUDA BHD	30,000	5.45	163,500.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	10,000	9.09	90,900.00	
	IJM CORP BHD	70,000	3.41	238,700.00	
	SIME DARBY BERHAD	64,720	9.61	621,959.20	
	AIRASIA BHD	47,000	3.19	149,930.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	18,000	8.70	156,600.00	
	MISC BHD	30,000	7.40	222,000.00	
	UMW HOLDINGS BHD	11,700	6.02	70,434.00	
	GENTING BHD	45,300	9.72	440,316.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	72,500	5.83	422,675.00	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	30,000	2.65	79,500.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	2,500	44.00	110,000.00	
	FELDA GLOBAL VENTURES	43,000	1.75	75,250.00	
	IOI CORPORATION BERHAD	41,675	4.48	186,704.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	12,000	24.80	297,600.00	
	PPB GROUP BERHAD	11,700	16.84	197,028.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	17,000	6.99	118,830.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	72,000	5.98	430,560.00	
	ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	37,000	3.90	144,300.00	

	AMMB HOLDINGS BHD	32,600	4.98	162,348.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	75,600	6.68	505,008.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	12,300	15.54	191,142.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,000	17.30	86,500.00	
	MALAYAN BANKING BHD	79,850	9.60	766,560.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	61,370	20.38	1,250,720.60	
	RHB BANK BHD	18,259	5.13	93,668.67	
	IOI PROPERTIES GROUP BHD	66,845	2.14	143,048.30	
	AXIATA GROUP BERHAD	51,900	4.94	256,386.00	
	DIGI.COM BHD	74,000	4.99	369,260.00	
	MAXIS BHD	44,000	5.64	248,160.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	25,000	6.62	165,500.00	
	PETRONAS GAS BERHAD	14,000	18.90	264,600.00	
	TENAGA NASIONAL BERHAD	66,125	14.16	936,330.00	
	YTL CORPORATION BERHAD	144,704	1.48	214,161.92	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	73,500	1.45	106,575.00	
	マレーシアリングット小計	1,709,148		10,721,804.69	(278,338,049)
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	52,500	17.40	913,500.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	28,000	34.50	966,000.00	
	IRPC PCL - NVDR	191,800	5.15	987,770.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	28,710	86.50	2,483,415.00	
	PTT PCL-NVDR	21,600	380.00	8,208,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	28,000	78.25	2,191,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	39,000	39.00	1,521,000.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	39,045	69.25	2,703,866.25	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	2,600	512.00	1,331,200.00	
	SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	7,300	512.00	3,737,600.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	23,000	45.50	1,046,500.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	98,000	46.25	4,532,500.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-NVDR	174,000	7.40	1,287,600.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	160,000	8.65	1,384,000.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	55,000	40.75	2,241,250.00	
	BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	31,000	22.10	685,100.00	
	ROBINSON PCL-NVDR	12,000	57.25	687,000.00	

	CP ALL PCL-NVDR	108,800	61.75	6,718,400.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	70,000	25.50	1,785,000.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	40,000	21.50	860,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	110,000	18.90	2,079,000.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	8,000	172.00	1,376,000.00	
	BANGKOK BANK-FOREIGN REG	6,640	190.00	1,261,600.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	24,200	198.50	4,803,700.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	13,200	193.00	2,547,600.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	75,125	18.80	1,412,350.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	36,300	154.00	5,590,200.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	400,000	2.30	920,000.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	31,000	66.25	2,053,750.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	12,000	90.50	1,086,000.00	
	KCE ELECTRONICS -NVDR	6,400	109.00	697,600.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	24,800	179.50	4,451,600.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	182,700	6.10	1,114,470.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	3,000	216.00	648,000.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	10,000	79.00	790,000.00	
タイパーツ小計		2,153,720		77,102,571.25 (252,896,433)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	52,000	75.85	3,944,200.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	54,000	14.54	785,160.00	
	DMCI HOLDINGS INC	115,000	14.64	1,683,600.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	65,000	79.00	5,135,000.00	
	SM INVESTMENTS CORP	4,968	783.00	3,889,944.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	10,000	98.25	982,500.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	10,000	211.00	2,110,000.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	21,000	161.50	3,391,500.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	17,741	104.70	1,857,482.70	
	BDO UNIBANK INC	37,084	120.60	4,472,330.40	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	18,827	86.95	1,637,007.65	
	SECURITY BANK CORP	5,000	220.20	1,101,000.00	
	AYALA CORPORATION	4,942	840.50	4,153,751.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,700	1,206.00	2,050,200.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	320,000	6.20	1,984,000.00	

	AYALA LAND INC	156,960	39.45	6,192,072.00	
	MEGAWORLD CORP	240,000	4.54	1,089,600.00	
	ROBINSONS LAND CO	35,000	24.10	843,500.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	199,710	33.20	6,630,372.00	
	GLOBE TELECOM INC	630	2,118.00	1,334,340.00	
	PLDT INC	2,110	1,829.00	3,859,190.00	
	ABOITIZ POWER CORP	46,000	39.75	1,828,500.00	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	175,000	6.07	1,062,250.00	
	フィリピンペソ小計	1,592,672		62,017,499.75 (137,678,849)	
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY TBK PT	270,000	1,580.00	426,600,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	33,500	27,450.00	919,575,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	32,000	18,450.00	590,400,000.00	
	SEMEN GRESIK (PERSERO) PT	66,000	10,000.00	660,000,000.00	
	AKR CORPORINDO TBK PT	45,000	6,525.00	293,625,000.00	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	100,000	2,320.00	232,000,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	495,000	8,925.00	4,417,875,000.00	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	100,000	1,840.00	184,000,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	100,000	2,590.00	259,000,000.00	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	52,000	14,175.00	737,100,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	200,000	3,180.00	636,000,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	15,000	78,300.00	1,174,500,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	190,000	3,840.00	729,600,000.00	
	PT INDOFOOD SUKSES MAK TBK	136,000	8,600.00	1,169,600,000.00	
	PT UNILEVER INDONESIA TBK	30,000	48,800.00	1,464,000,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	550,000	1,625.00	893,750,000.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	48,000	5,125.00	246,000,000.00	
	BANK MANDIRI TBK	209,000	12,750.00	2,664,750,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	248,000	15,250.00	3,782,000,000.00	
	PT BANK CENTRAL ASIA	228,000	18,150.00	4,138,200,000.00	
PT BANK NEGARA INDONESIA	180,000	6,600.00	1,188,000,000.00		
BUMI SERPONG DAMAI PT	170,000	1,830.00	311,100,000.00		
LIPPO KARAWACI TBK/PT	450,000	660.00	297,000,000.00		
PAKUWON JATI TBK PT	520,000	615.00	319,800,000.00		
SUMMARECON AGUNG TBK PT	185,000	1,290.00	238,650,000.00		

	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	1,115,000	4,520.00	5,039,800,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	36,000	6,800.00	244,800,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	78,000	3,410.00	265,980,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	213,500	2,250.00	480,375,000.00	
インドネシアルピア小計		6,095,000		34,004,080,000.00	(285,634,272)
韓国ウォン	GS HOLDINGS	1,270	67,000.00	85,090,000.00	
	S-OIL CORPORATION	825	94,900.00	78,292,500.00	
	SK INNOVATION CO LTD	1,482	158,500.00	234,897,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	2,000	29,500.00	59,000,000.00	
	HYOSUNG CORPORATION	550	172,000.00	94,600,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	1,830	58,500.00	107,055,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	155	439,000.00	68,045,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	460	74,400.00	34,224,000.00	
	LG CHEM LTD	1,002	283,500.00	284,067,000.00	
	LG CHEM LTD-PRF	230	193,500.00	44,505,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	370	338,000.00	125,060,000.00	
	OCI CO LTD	320	92,400.00	29,568,000.00	
	POSCO	1,610	270,500.00	435,505,000.00	
	CJ CORP	280	198,000.00	55,440,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	610	86,700.00	52,887,000.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	3,686	7,080.00	26,096,880.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	850	35,200.00	29,920,000.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	800	21,900.00	17,520,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,203	29,550.00	35,548,650.00	
	HANWHA CORPORATION	1,160	46,400.00	53,824,000.00	
	HANWHA TECHWIN CO LTD	710	45,400.00	32,234,000.00	
	HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	1,595	46,200.00	73,689,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	1,310	45,400.00	59,474,000.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	667	174,500.00	116,391,500.00	
KCC CORP	120	432,000.00	51,840,000.00		
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,500	58,700.00	88,050,000.00		
LG CORP	2,000	79,800.00	159,600,000.00		
POSCO DAEWOO CORP	1,431	22,250.00	31,839,750.00		
SAMSUNG C&T CORP	1,657	139,000.00	230,323,000.00		

SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	5,981	12,850.00	76,855,850.00	
SK HOLDINGS CO LTD	761	277,500.00	211,177,500.00	
SK NETWORKS CO LTD	1,950	6,570.00	12,811,500.00	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	450	47,900.00	21,555,000.00	
S1 CORPORATION	420	99,200.00	41,664,000.00	
CJ KOREA EXPRESS CORP	130	188,000.00	24,440,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	400	151,000.00	60,400,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	864	38,500.00	33,264,000.00	
PAN OCEAN CO LTD	5,000	5,110.00	25,550,000.00	
HANKOOK TIRE CO LTD	1,482	64,800.00	96,033,600.00	
HANON SYSTEMS	5,400	10,850.00	58,590,000.00	
HYUNDAI MOBIS	1,500	257,000.00	385,500,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	3,430	164,000.00	562,520,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	850	118,000.00	100,300,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	480	113,000.00	54,240,000.00	
HYUNDAI WIA CORP	320	73,800.00	23,616,000.00	
KIA MOTORS CORPORATION	5,640	38,850.00	219,114,000.00	
COWAY CO LTD	1,090	104,000.00	113,360,000.00	
HANSSEM CO LTD	170	185,500.00	31,535,000.00	
LG ELECTRONICS INC	2,465	84,100.00	207,306,500.00	
KANGWON LAND INC	2,770	35,150.00	97,365,500.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	2,350	18,600.00	43,710,000.00	
CJ E&M CORP	470	78,000.00	36,660,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	830	55,500.00	46,065,000.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	380	111,000.00	42,180,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	215	300,500.00	64,607,500.00	
SHINSEGAE CO LTD	167	233,500.00	38,994,500.00	
BGF RETAIL CO LTD	380	104,500.00	39,710,000.00	
DONGSUH COMPANIES INC	850	30,250.00	25,712,500.00	
E-MART CO LTD	472	219,500.00	103,604,000.00	
GS RETAIL CO LTD	600	51,300.00	30,780,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	194	370,500.00	71,877,000.00	
KT&G CORP	2,535	116,000.00	294,060,000.00	
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO	15	1,736,000.00	26,040,000.00	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	150	202,500.00	30,375,000.00	

ORION CORP	80	798,000.00	63,840,000.00	
OTTOGI CORPORATION	30	815,000.00	24,450,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	730	318,500.00	232,505,000.00	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	120	193,500.00	23,220,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	750	137,000.00	102,750,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	200	992,000.00	198,400,000.00	
CELLTRION INC	1,789	113,300.00	202,693,700.00	
HANMI PHARM CO LTD	114	409,000.00	46,626,000.00	
HANMI SCIENCE CO LTD	272	91,600.00	24,915,200.00	
MEDY-TOX INC	80	558,000.00	44,640,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	325	249,000.00	80,925,000.00	
YUHAN CORPORATION	252	241,000.00	60,732,000.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	6,484	10,850.00	70,351,400.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	2,586	11,450.00	29,609,700.00	
HANA FINANCIAL GROUP	6,008	42,800.00	257,142,400.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	6,440	13,750.00	88,550,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	8,905	55,200.00	491,556,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	9,400	48,800.00	458,720,000.00	
WOORI BANK	8,411	17,350.00	145,930,850.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	955	67,500.00	64,462,500.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	9,858	10,500.00	103,509,000.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	3,171	14,350.00	45,503,850.00	
SAMSUNG CARD CO	690	39,350.00	27,151,500.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,517	40,350.00	61,210,950.00	
DONGBU INSURANCE CO LTD	800	67,500.00	54,000,000.00	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	6,000	6,810.00	40,860,000.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	1,200	38,600.00	46,320,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	780	278,000.00	216,840,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	1,400	114,500.00	160,300,000.00	
KAKAO CORP	660	101,500.00	66,990,000.00	
NAVER CORP	628	887,000.00	557,036,000.00	
NCSOFT CORPORATION	350	389,000.00	136,150,000.00	
NETMARBLE GAMES CORP	330	153,500.00	50,655,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	820	174,000.00	142,680,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	5,560	36,500.00	202,940,000.00	

	LG INNOTEK CO LTD	280	162,500.00	45,500,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,330	100,500.00	133,665,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	2,165	2,381,000.00	5,154,865,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	405	1,899,000.00	769,095,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	1,228	164,500.00	202,006,000.00	
	KT CORP	1,027	32,100.00	32,966,700.00	
	LG UPLUS CORP.	5,000	16,700.00	83,500,000.00	
	SK TELECOM	400	258,000.00	103,200,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	5,640	42,350.00	238,854,000.00	
	KOREA GAS CORPORATION	828	51,900.00	42,973,200.00	
	HYUNDAI ROBOTICS CO LTD	141	375,500.00	52,945,500.00	
	SK HYNIX INC	12,630	65,000.00	820,950,000.00	
韓国ウォン小計		201,613		18,450,846,680.00	(1,811,873,143)
台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	27,080	108.50	2,938,180.00	
	ASIA CEMENT CORP	57,978	26.35	1,527,720.30	
	CHINA STEEL CORP	269,181	24.50	6,594,934.50	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	66,047	92.10	6,082,928.70	
	FORMOSA PLASTICS CORP	94,424	91.50	8,639,796.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	103,145	72.80	7,508,956.00	
	TAIWAN CEMENT	76,170	34.90	2,658,333.00	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	20,000	40.35	807,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	75,957	24.05	1,826,765.85	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	3,960	205.50	813,780.00	
	TECO ELECTRIC & MACHINERY	36,000	29.20	1,051,200.00	
	CHINA AIRLINES LTD	67,000	9.34	625,780.00	
	EVA AIRWAYS CORP	43,187	15.00	647,805.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	45,216	15.15	685,022.40	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	37,000	25.15	930,550.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	45,947	62.20	2,857,903.40	
	YULON MOTOR COMPANY	35,020	26.95	943,789.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	3,191	357.00	1,139,187.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	6,921	126.50	875,506.50	
	FORMOSA TAFFETA CO.	18,000	30.25	544,500.00	
	GIANT MANUFACTURING	5,000	175.00	875,000.00	

MERIDA INDUSTRY CO LTD	5,250	162.50	853,125.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	3,000	325.50	976,500.00	
POU CHEN	38,145	41.35	1,577,295.75	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	12,000	44.65	535,800.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	7,000	376.00	2,632,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	12,448	270.00	3,360,960.00	
STANDARD FOODS CORP	7,770	80.80	627,816.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	109,703	60.60	6,648,001.80	
OBI PHARMA INC	2,000	253.00	506,000.00	
TAI MED BIOLOGICS INC	3,000	183.00	549,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	93,848	17.15	1,609,493.20	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	350,715	8.40	2,946,006.00	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	399,746	19.40	7,755,072.40	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	188,060	18.40	3,460,304.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	204,887	19.90	4,077,251.30	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	164,920	17.15	2,828,378.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	222,356	24.70	5,492,193.20	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	224,284	9.04	2,027,527.36	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	181,891	13.75	2,501,001.25	
TAIWAN BUSINESS BANK	134,746	8.28	1,115,696.88	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	191,417	15.70	3,005,246.90	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	24,329	84.60	2,058,233.40	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	137,743	47.40	6,529,018.20	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	217,257	13.10	2,846,066.70	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	185,538	49.00	9,091,362.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	78,310	29.45	2,306,229.50	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	121,337	7.81	947,641.97	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	14,950	50.10	748,995.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	28,353	33.95	962,584.35	
ACER INC	64,812	15.90	1,030,510.80	
ADVANTECH CO LTD	6,561	240.00	1,574,640.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	15,797	287.50	4,541,637.50	
AU OPTRONICS CORP	173,994	12.85	2,235,822.90	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	13,405	364.00	4,879,420.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	13,195	76.80	1,013,376.00	

COMPAL ELECTRONICS	86,955	20.15	1,752,143.25	
DELTA ELECTRONICS INC	42,541	169.00	7,189,429.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	23,787	89.60	2,131,315.20	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	347,765	112.50	39,123,562.50	
HTC CORP	17,011	69.00	1,173,759.00	
INNOLUX CORP	189,282	15.25	2,886,550.50	
INVENTEC CORP	62,162	25.10	1,560,266.20	
LARGAN PRECISION CO LTD	2,236	4,965.00	11,101,740.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	45,787	50.50	2,312,243.50	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	13,000	70.90	921,700.00	
PEGATRON CORP	43,854	96.90	4,249,452.60	
QUANTA COMPUTER INC	63,416	72.00	4,565,952.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	32,120	34.35	1,103,322.00	
TRANSCEND INFORMATION INC	7,346	103.00	756,638.00	
WISTRON CORP	49,836	31.70	1,579,801.20	
WPG HOLDINGS LTD	40,000	40.50	1,620,000.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	7,000	73.00	511,000.00	
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	50,000	10.35	517,500.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	83,371	108.50	9,045,753.50	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	42,000	79.00	3,318,000.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	33,188	114.50	3,800,026.00	
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	149,775	37.90	5,676,472.50	
GLOBALWAFERS CO LTD	3,000	222.50	667,500.00	
MEDIATEK INC	33,132	265.50	8,796,546.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	15,000	52.60	789,000.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	12,522	123.50	1,546,467.00	
PHISON ELECTRONICS CORP	3,000	360.50	1,081,500.00	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	11,635	95.10	1,106,488.50	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	11,815	110.50	1,305,557.50	
SILICONWARE PRECISION INDS	42,082	49.55	2,085,163.10	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	547,355	217.00	118,776,035.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	238,592	12.80	3,053,977.60	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	22,000	58.20	1,280,400.00	
台湾ドル小計	7,161,756		393,810,106.66 (1,445,283,091)	

インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	10,500	630.75	6,622,875.00	
	CAIRN INDIA LTD	9,100	285.35	2,596,685.00	
	COAL INDIA LTD	14,000	244.90	3,428,600.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	8,100	508.45	4,118,445.00	
	INDIAN OIL CORP LTD	12,000	383.40	4,600,800.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	30,190	158.10	4,773,039.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	28,946	1,435.85	41,562,114.10	
	ACC LIMITED	1,330	1,636.70	2,176,811.00	
	AMBUJA CEMENTS LIMITED	10,970	243.30	2,669,001.00	
	ASIAN PAINTS LTD	6,200	1,153.65	7,152,630.00	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	5,750	1,171.65	6,736,987.50	
	HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	29,280	188.70	5,525,136.00	
	JSW STEEL LTD	20,000	195.70	3,914,000.00	
	SHREE CEMENT LTD	200	16,935.60	3,387,120.00	
	TATA STEEL LIMITED	5,416	507.25	2,747,266.00	
	ULTRATECH CEMENT LTD	1,750	3,999.00	6,998,250.00	
	UPL LTD	8,000	834.05	6,672,400.00	
	VEDANTA LTD	23,260	236.85	5,509,131.00	
	ASHOK LEYLAND LTD	27,000	92.35	2,493,450.00	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	13,150	135.00	1,775,250.00	
	EICHER MOTORS LTD	280	27,166.70	7,606,676.00	
	HAVELLS INDIA LTD	6,100	463.70	2,828,570.00	
	LARSEN & TOUBRO LTD	6,980	1,722.70	12,024,446.00	
	SIEMENS INDIA LIMITED	1,890	1,326.80	2,507,652.00	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	15,000	365.45	5,481,750.00	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	1,750	1,164.20	2,037,350.00	
	BAJAJ AUTO LTD	2,400	2,824.30	6,778,320.00	
	BHARAT FORGE LIMITED	1,800	1,109.45	1,997,010.00	
	BOSCH LTD	160	23,795.50	3,807,280.00	
	HERO MOTOCORP LTD	1,400	3,660.10	5,124,140.00	
	MAHINDRA & MAHINDRA LIMITED	8,600	1,376.20	11,835,320.00	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,300	7,219.15	16,604,045.00	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	9,000	462.25	4,160,250.00		
TATA MOTORS LTD	33,528	443.15	14,857,933.20		
TATA MOTORS LTD-A-DVR	5,700	276.25	1,574,625.00		

TITAN CO LTD	6,000	513.30	3,079,800.00
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	13,630	509.75	6,947,892.50
ITC LTD	75,765	311.00	23,562,915.00
NESTLE INDIA LIMITED	560	6,639.65	3,718,204.00
UNITED SPIRITS LIMITED	1,330	2,248.70	2,990,771.00
DABUR INDIA LTD	9,500	289.80	2,753,100.00
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	3,700	956.75	3,539,975.00
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD(N)	3,700	956.75	3,539,975.00
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	15,520	1,097.90	17,039,408.00
MARICO LTD	8,600	312.45	2,687,070.00
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	2,300	1,280.05	2,944,115.00
AUROBINDO PHARMA LTD	7,500	672.25	5,041,875.00
CADILA HEALTHCARE LTD	5,300	525.60	2,785,680.00
CIPLA LTD	7,650	541.15	4,139,797.50
DR. REDDY'S LABORATORIES	2,190	2,643.70	5,789,703.00
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	2,900	627.05	1,818,445.00
LUPIN LTD	4,130	1,060.00	4,377,800.00
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	2,000	2,820.50	5,641,000.00
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	20,804	543.80	11,313,215.20
AXIS BANK LTD	36,980	504.65	18,661,957.00
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	33,675	1,651.35	55,609,211.25
ICICI BANK LTD	45,625	291.85	13,315,656.25
ICICI BANK LTD(N)	4,562	291.85	1,331,419.70
IDFC BANK LTD	29,000	56.85	1,648,650.00
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	7,500	1,102.00	8,265,000.00
LIC HOUSING FINANCE LTD	7,000	753.60	5,275,200.00
STATE BANK OF INDIA	34,000	288.95	9,824,300.00
YES BANK LTD	6,840	1,435.40	9,818,136.00
BAJAJ FINANCE LTD	3,200	1,400.75	4,482,400.00
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	7,400	330.65	2,446,810.00
POWER FINANCE CORPORATION	13,000	122.35	1,590,550.00
RURAL ELECTRIFICATION CORP	13,600	176.35	2,398,360.00
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	4,000	967.40	3,869,600.00
BAJAJ FINSERV LTD	720	4,101.30	2,952,936.00
HCL TECHNOLOGIES LTD	11,900	851.85	10,137,015.00

	INFOSYS LTD	40,140	943.25	37,862,055.00	
	TATA CONSULTANCY SVS LTD	10,450	2,361.70	24,679,765.00	
	TECH MAHINDRA LTD	10,000	380.70	3,807,000.00	
	WIPRO LTD	27,280	256.85	7,006,868.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	26,000	366.20	9,521,200.00	
	BHARTI INFRATEL LTD	11,390	372.15	4,238,788.50	
	IDEA CELLULAR LTD	26,000	79.35	2,063,100.00	
	GAIL INDIA LTD	14,500	354.15	5,135,175.00	
	NTPC LIMITED	32,000	157.85	5,051,200.00	
	TATA POWER CO LTD	29,640	81.50	2,415,660.00	
	インドルピー小計	1,041,511		591,804,111.70	(1,029,739,154)
パキスタンルピー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	13,000	139.81	1,817,530.00	
	ENGRO CORPORATION LTD	5,500	337.83	1,858,065.00	
	LUCKY CEMENT	2,800	831.75	2,328,900.00	
	HABIB BANK LTD	12,800	253.33	3,242,624.00	
	MCB BANK LTD	8,500	209.60	1,781,600.00	
	UNITED BANK LTD	10,500	226.56	2,378,880.00	
	パキスタンルピー小計	53,100		13,407,599.00	(14,346,130)
カタールリアル	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	5,200	17.04	88,608.00	
	INDUSTRIES QATAR	3,390	95.50	323,745.00	
	COMMERCIAL BANK QSC	3,717	30.35	112,810.95	
	DOHA BANK QSC	2,300	30.50	70,150.00	
	DOHA BANK QSC(N)	460	30.50	14,030.00	
	MASRAF AL RAYAN	9,240	39.50	364,980.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	1,670	92.50	154,475.00	
	QATAR NATIONAL BANK	5,187	127.00	658,749.00	
	QATAR INSURANCE CO	2,125	67.40	143,225.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	3,000	32.30	96,900.00	
	EZDAN HOLDING GROUP	15,900	12.59	200,181.00	
	OORED00 QSC	2,160	91.90	198,504.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	430	189.90	81,657.00	
	カタールリアル小計	54,779		2,508,014.95	(76,143,333)

エジプト債券	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	22,687	80.98	1,837,193.26	
	EFG-HERMES HOLDING SAE	10,000	24.02	240,200.00	
	GLOBAL TELECOM HOLDING	60,000	6.82	409,200.00	
エジプト債券小計		92,687		2,486,593.26	(15,242,816)
南アフリカ債券	EXXARO RESOURCES LTD	3,510	86.41	303,299.10	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	1,660	296.50	492,190.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	8,520	137.11	1,168,177.20	
	GOLD FIELDS LTD	16,590	46.67	774,255.30	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	11,430	35.50	405,765.00	
	MONDI LTD	2,730	337.73	922,002.90	
	SAPPI LIMITED	14,415	89.00	1,282,935.00	
	SASOL LTD	12,300	360.60	4,435,380.00	
	SIBANYE GOLD LTD	38,000	16.20	615,600.00	
	BIDVEST GROUP LTD	8,122	158.78	1,289,611.16	
	STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	67,460	65.77	4,436,844.20	
	NASPERS LTD-N SHS	9,740	2,638.61	25,700,061.40	
	FOSCHINI GROUP LTD/THE	4,175	138.06	576,400.50	
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	3,655	158.81	580,450.55	
	MR PRICE GROUP LTD	5,300	154.83	820,599.00	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	10,620	71.55	759,861.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	21,405	62.89	1,346,160.45	
	BID CORP LTD	7,509	291.21	2,186,695.89	
	MASSMART HOLDINGS LTD	2,739	107.00	293,073.00	
	PICK'N PAY STORES LTD	7,000	56.30	394,100.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	9,710	197.50	1,917,725.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	4,660	153.52	715,403.20	
	PIONEER FOODS LTD	2,700	136.89	369,603.00	
	TIGER BRANDS LTD	3,490	373.87	1,304,806.30	
	LIFE HEALTHCARE GROUP	26,843	26.52	711,876.36	
	NETCARE LTD	22,150	25.70	569,255.00	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	8,341	284.38	2,372,013.58	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	14,200	144.25	2,048,350.00		
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	800	785.00	628,000.00		
NEDBANK GROUP LTD	5,250	206.01	1,081,552.50		

	STANDARD BANK GROUP LTD	28,616	140.36	4,016,541.76	
	BRAIT SE	7,000	59.17	414,190.00	
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	3,200	66.50	212,800.00	
	FIRSTRAND LTD	70,870	47.68	3,379,081.60	
	INVESTEC LTD	6,500	95.23	618,995.00	
	PSG GROUP LTD	2,100	233.66	490,686.00	
	REMGRO LTD	11,640	210.82	2,453,944.80	
	RMB HOLDINGS LTD	17,530	59.61	1,044,963.30	
	DISCOVERY LTD	8,507	130.50	1,110,163.50	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	4,000	112.61	450,440.00	
	MMI HOLDINGS LTD	24,429	20.15	492,244.35	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	19,830	38.87	770,792.10	
	SANLAM LTD	28,635	65.37	1,871,869.95	
	NEW EUROPE PROPERTY INVEST	4,700	167.00	784,900.00	
	MTN GROUP LTD	36,215	113.85	4,123,077.75	
	TELKOM SA SOC LTD	6,700	63.75	427,125.00	
	VODACOM GROUP LTD	11,835	163.32	1,932,892.20	
南アフリカランド小計		647,331		85,096,753.90	(733,534,018)
アラブディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	44,250	7.17	317,272.50	
	DUBAI ISLAMIC BANK	22,500	5.76	129,600.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	37,955	10.50	398,527.50	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	84,600	2.29	193,734.00	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO	33,000	3.04	100,320.00	
	EMAAR MALLS PJSC	36,000	2.51	90,360.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	78,750	7.90	622,125.00	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	36,000	17.15	617,400.00	
アラブディルハム小計		373,055		2,469,339.00	(74,771,584)
合 計		47,237,729		11,494,943,065	(11,494,943,065)

(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	410,850.00	
米ドル小計			41,500	410,850.00 (45,719,388)	
メキシコペソ	投資証券	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	57,000	1,967,640.00	
メキシコペソ小計			57,000	1,967,640.00 (12,179,691)	
トルコリラ	投資証券	EMLAK KONUT GAYRIMEN	58,000	172,840.00	
トルコリラ小計			58,000	172,840.00 (5,496,312)	
南アフリカランド	投資証券	FORTRESS INCOME FUND LTD-A	24,000	409,200.00	
		FORTRESS INCOME FUND LTD-B	12,000	417,600.00	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	60,000	1,494,600.00	
		HYPROP INVESTMENTS LTD	5,800	692,520.00	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	110,000	1,179,200.00	
		RESILIENT REIT LTD	5,400	657,180.00	
南アフリカランド小計			217,200	4,850,300.00 (41,809,586)	
合計				105,204,977 (105,204,977)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 56銘柄	96.7%			11.5%
	投資信託受益証券 1銘柄		3.3%		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%			6.0%
チリペソ	株式 18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	20銘柄	95.9%			1.1%
	投資証券	1銘柄			4.1%	0.0%
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	21銘柄	100.0%			1.3%
香港ドル	株式	137銘柄	100.0%			20.9%
マレーシアリングギット	株式	39銘柄	100.0%			2.4%
タイバーツ	株式	35銘柄	100.0%			2.2%
フィリピンペソ	株式	23銘柄	100.0%			1.2%
インドネシアルピア	株式	29銘柄	100.0%			2.5%
韓国ウォン	株式	111銘柄	100.0%			15.6%
台湾ドル	株式	89銘柄	100.0%			12.5%
インドルピー	株式	80銘柄	100.0%			8.9%
パキスタンルピー	株式	6銘柄	100.0%			0.1%
カタールリアル	株式	13銘柄	100.0%			0.7%
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	47銘柄	94.6%			6.3%
	投資証券	6銘柄			5.4%	0.4%
アラブディルハム	株式	8銘柄	100.0%			0.6%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

	平成28年12月26日現在	平成29年 6月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	227,864,390	1,523,344,997
国債証券	26,060,494,976	27,338,461,139
地方債証券	2,096,129,000	2,822,875,362
特殊債券	3,929,254,000	4,328,157,000
社債券	1,778,059,148	1,682,241,000
未収利息	66,309,790	66,612,882
前払費用	303,842	1,759,843
流動資産合計	34,158,415,146	37,763,452,223
資産合計	34,158,415,146	37,763,452,223
負債の部		
流動負債		
未払金	-	1,466,962,700
未払解約金	4,690,424	-
未払利息	200	2,390
流動負債合計	4,690,624	1,466,965,090
負債合計	4,690,624	1,466,965,090
純資産の部		
元本等		
元本	24,649,841,004	26,195,380,333
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	9,503,883,518	10,101,106,800
元本等合計	34,153,724,522	36,296,487,133
純資産合計	34,153,724,522	36,296,487,133
負債純資産合計	34,158,415,146	37,763,452,223

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12月26日現在	平成29年 6月26日現在
--	---------------	---------------

1.	期首	平成28年 6月28日	平成28年12月27日
	期首元本額	24,142,587,930円	24,649,841,004円
	期首からの追加設定元本額	1,459,061,935円	2,298,834,977円
	期首からの一部解約元本額	951,808,861円	753,295,648円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス(株式20)	960,382,030円	1,140,350,401円
	DCインデックスバランス(株式40)	1,084,918,562円	1,223,109,430円
	DCインデックスバランス(株式60)	751,715,422円	867,408,843円
	DCインデックスバランス(株式80)	130,320,409円	149,539,820円
	インデックスファンド日本債券(DC専用)	1,550,023,813円	1,647,131,768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	4,404,873,502円	4,291,981,706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	4,610,364円	4,896,618円
	インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	-円	1,082,407,274円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	4,709,714円	4,785,001円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	26,185,649円	25,929,494円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	102,363,204円	102,266,692円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	366,967,306円	341,793,945円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	5,654,833,853円	5,555,994,108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)	38,364,178円	32,311,158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)	120,970,117円	123,558,103円
	グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	26,252,279円	-円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	1,149,970,664円	1,173,785,760円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	1,165,399,044円	1,199,467,932円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	594,405,630円	628,162,355円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	87,127,009円	95,362,529円
	インデックスファンド日本債券(1年決算型)	6,197,225,930円	6,264,421,845円
	日本債券インデックスファンド(個人型年金向け)	228,222,325円	240,715,551円
	計	24,649,841,004円	26,195,380,333円
2.	受益権の総数	24,649,841,004口	26,195,380,333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28年 6月28日 至 平成28年12月26日	自 平成28年12月27日 至 平成29年 6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12月26日現在	平成29年 6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

(平成29年 6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	650,171,641
地方債証券	21,240,638
特殊債券	27,218,000
社債券	12,014,000
合計	710,644,279

(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12月26日現在		平成29年 6月26日現在	
1口当たり純資産額	1.3856円	1口当たり純資産額	1.3856円
(1万口当たり純資産額)	(13,856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 1 1 1 回利付国債（5年）	40,000,000	40,214,606	
	第 1 1 2 回利付国債（5年）	70,000,000	70,359,418	
	第 1 1 4 回利付国債（5年）	90,000,000	90,454,500	
	第 1 1 6 回利付国債（5年）	110,000,000	110,504,900	
	第 1 1 7 回利付国債（5年）	90,000,000	90,482,400	
	第 1 1 8 回利付国債（5年）	100,000,000	100,594,000	
	第 1 1 9 回利付国債（5年）	74,000,000	74,293,040	
	第 1 2 0 回利付国債（5年）	330,000,000	332,174,700	
	第 1 2 1 回利付国債（5年）	100,000,000	100,435,000	
	第 1 2 2 回利付国債（5年）	300,000,000	301,416,000	
	第 1 2 3 回利付国債（5年）	505,000,000	507,620,950	
	第 1 2 4 回利付国債（5年）	560,000,000	563,175,200	
	第 1 2 5 回利付国債（5年）	325,000,000	326,998,750	
	第 1 2 6 回利付国債（5年）	220,000,000	221,458,600	
	第 1 回利付国債（40年）	40,000,000	57,122,800	
	第 2 回利付国債（40年）	165,000,000	227,480,550	
	第 3 回利付国債（40年）	50,000,000	69,141,000	
	第 4 回利付国債（40年）	95,000,000	131,724,150	
	第 5 回利付国債（40年）	35,000,000	46,603,900	
	第 6 回利付国債（40年）	70,000,000	91,140,700	
	第 7 回利付国債（40年）	50,000,000	62,068,500	
	第 8 回利付国債（40年）	95,000,000	108,836,750	
	第 9 回利付国債（40年）	160,000,000	131,366,400	
	第 2 9 0 回利付国債（10年）	226,000,000	228,853,694	
	第 2 9 3 回利付国債（10年）	56,000,000	57,055,380	
	第 2 9 4 回利付国債（10年）	32,000,000	32,571,924	
	第 2 9 5 回利付国債（10年）	13,000,000	13,206,902	
	第 2 9 6 回利付国債（10年）	14,000,000	14,277,620	
	第 2 9 7 回利付国債（10年）	28,000,000	28,622,160	
	第 2 9 8 回利付国債（10年）	11,000,000	11,228,140	

第299回利付国債(10年)	410,000,000	419,958,900	
第300回利付国債(10年)	36,000,000	36,999,000	
第301回利付国債(10年)	206,000,000	212,532,260	
第302回利付国債(10年)	94,000,000	96,794,620	
第303回利付国債(10年)	581,000,000	600,475,120	
第304回利付国債(10年)	36,000,000	37,126,440	
第305回利付国債(10年)	473,000,000	489,398,910	
第306回利付国債(10年)	93,000,000	96,786,030	
第308回利付国債(10年)	140,000,000	145,789,000	
第309回利付国債(10年)	134,000,000	138,739,580	
第310回利付国債(10年)	78,000,000	80,740,920	
第311回利付国債(10年)	23,000,000	23,659,180	
第312回利付国債(10年)	205,000,000	214,192,200	
第313回利付国債(10年)	370,000,000	389,151,200	
第315回利付国債(10年)	65,000,000	68,333,850	
第316回利付国債(10年)	35,000,000	36,655,500	
第317回利付国債(10年)	105,000,000	110,258,400	
第318回利付国債(10年)	185,000,000	193,480,400	
第319回利付国債(10年)	5,000,000	5,265,200	
第320回利付国債(10年)	190,000,000	199,224,500	
第321回利付国債(10年)	175,000,000	183,965,250	
第322回利付国債(10年)	75,000,000	78,486,750	
第323回利付国債(10年)	45,000,000	47,191,950	
第324回利付国債(10年)	25,000,000	26,093,000	
第325回利付国債(10年)	210,000,000	219,588,600	
第326回利付国債(10年)	30,000,000	31,261,800	
第327回利付国債(10年)	65,000,000	68,091,400	
第328回利付国債(10年)	115,000,000	119,395,300	
第329回利付国債(10年)	230,000,000	241,865,700	
第330回利付国債(10年)	210,000,000	221,224,500	
第331回利付国債(10年)	80,000,000	83,275,200	
第333回利付国債(10年)	110,000,000	114,902,700	
第334回利付国債(10年)	120,000,000	125,461,200	
第335回利付国債(10年)	190,000,000	197,438,500	
第336回利付国債(10年)	80,000,000	83,209,600	
第337回利付国債(10年)	30,000,000	30,753,600	

第338回利付国債(10年)	210,000,000	216,906,900	
第339回利付国債(10年)	300,000,000	309,942,000	
第340回利付国債(10年)	420,000,000	434,002,800	
第341回利付国債(10年)	500,000,000	512,715,000	
第342回利付国債(10年)	100,000,000	100,828,000	
第343回利付国債(10年)	200,000,000	201,614,000	
第345回利付国債(10年)	230,000,000	231,520,300	
第346回利付国債(10年)	490,000,000	492,846,900	
第14回利付国債(30年)	208,000,000	276,028,480	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	197,648,850	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	47,151,300	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	144,833,700	
第21回利付国債(30年)	20,000,000	26,425,000	
第22回利付国債(30年)	40,000,000	54,302,400	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	74,779,100	
第24回利付国債(30年)	68,000,000	92,589,480	
第25回利付国債(30年)	20,000,000	26,507,800	
第26回利付国債(30年)	170,000,000	228,609,200	
第27回利付国債(30年)	29,000,000	39,655,470	
第28回利付国債(30年)	94,000,000	128,942,620	
第29回利付国債(30年)	276,000,000	374,490,600	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	197,115,240	
第31回利付国債(30年)	120,000,000	158,905,200	
第32回利付国債(30年)	50,000,000	67,471,000	
第33回利付国債(30年)	135,000,000	174,066,300	
第34回利付国債(30年)	200,000,000	267,016,000	
第35回利付国債(30年)	168,000,000	217,524,720	
第36回利付国債(30年)	135,000,000	175,128,750	
第37回利付国債(30年)	61,000,000	77,864,670	
第38回利付国債(30年)	70,000,000	87,838,800	
第39回利付国債(30年)	75,000,000	95,942,250	
第40回利付国債(30年)	90,000,000	113,067,000	
第42回利付国債(30年)	85,000,000	104,844,950	
第43回利付国債(30年)	195,000,000	240,614,400	
第44回利付国債(30年)	70,000,000	86,404,500	
第45回利付国債(30年)	45,000,000	53,357,850	

第46回利付国債(30年)	100,000,000	118,575,000	
第47回利付国債(30年)	115,000,000	139,214,400	
第48回利付国債(30年)	105,000,000	121,750,650	
第49回利付国債(30年)	90,000,000	104,339,700	
第50回利付国債(30年)	25,000,000	25,117,250	
第51回利付国債(30年)	70,000,000	61,190,500	
第52回利付国債(30年)	90,000,000	83,208,600	
第53回利付国債(30年)	105,000,000	99,633,450	
第54回利付国債(30年)	110,000,000	110,000,000	
第39回利付国債(20年)	86,000,000	87,835,725	
第41回利付国債(20年)	27,000,000	27,749,250	
第42回利付国債(20年)	168,000,000	175,857,360	
第43回利付国債(20年)	47,000,000	50,145,710	
第44回利付国債(20年)	51,000,000	54,609,270	
第47回利付国債(20年)	21,000,000	22,551,900	
第48回利付国債(20年)	99,000,000	107,918,910	
第49回利付国債(20年)	57,000,000	61,673,430	
第50回利付国債(20年)	237,000,000	254,656,500	
第51回利付国債(20年)	39,000,000	42,247,920	
第54回利付国債(20年)	15,000,000	16,537,350	
第55回利付国債(20年)	66,000,000	72,533,340	
第57回利付国債(20年)	52,000,000	57,117,320	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	148,960,350	
第59回利付国債(20年)	33,000,000	36,212,550	
第60回利付国債(20年)	295,000,000	318,850,750	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	28,652,670	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	34,479,750	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	60,618,240	
第65回利付国債(20年)	100,000,000	112,749,000	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	38,113,320	
第67回利付国債(20年)	34,000,000	38,487,320	
第68回利付国債(20年)	78,000,000	89,873,940	
第70回利付国債(20年)	104,000,000	121,799,600	
第72回利付国債(20年)	112,000,000	129,426,080	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	130,243,800	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	136,891,800	

第75回利付国債(20年)	10,000,000	11,649,400	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	24,138,450	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	46,288,000	
第79回利付国債(20年)	160,000,000	185,825,600	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	70,427,400	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	154,888,500	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	361,623,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	19,213,440	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	302,512,500	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	71,739,600	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	71,393,400	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	59,978,500	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	100,367,180	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	118,004,740	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	54,819,000	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	113,554,820	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	141,781,770	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	36,783,000	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	82,371,300	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	101,450,070	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	13,650,010	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	40,232,280	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	94,154,060	
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,467,780	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	159,507,400	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	161,282,400	
第109回利付国債(20年)	27,000,000	32,594,940	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	120,576,260	
第111回利付国債(20年)	25,000,000	31,140,250	
第113回利付国債(20年)	290,000,000	358,558,900	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	64,500,280	
第115回利付国債(20年)	55,000,000	68,896,300	
第116回利付国債(20年)	55,000,000	69,036,550	
第117回利付国債(20年)	93,000,000	115,573,890	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	12,331,500	
第119回利付国債(20年)	30,000,000	36,209,100	

第120回利付国債(20年)	70,000,000	82,710,600	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	26,907,100	
第122回利付国債(20年)	17,000,000	20,572,040	
第123回利付国債(20年)	65,000,000	81,370,250	
第124回利付国債(20年)	80,000,000	99,095,200	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	63,401,500	
第126回利付国債(20年)	25,000,000	31,032,250	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	79,916,850	
第129回利付国債(20年)	50,000,000	60,795,500	
第130回利付国債(20年)	60,000,000	73,080,600	
第131回利付国債(20年)	12,000,000	14,450,520	
第132回利付国債(20年)	35,000,000	42,150,500	
第133回利付国債(20年)	30,000,000	36,574,200	
第134回利付国債(20年)	50,000,000	61,050,500	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	36,204,000	
第136回利付国債(20年)	180,000,000	214,513,200	
第137回利付国債(20年)	200,000,000	241,518,000	
第138回利付国債(20年)	120,000,000	141,349,200	
第139回利付国債(20年)	150,000,000	178,848,000	
第140回利付国債(20年)	280,000,000	338,324,000	
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	67,353,000	
第143回利付国債(20年)	54,000,000	64,541,880	
第144回利付国債(20年)	40,000,000	47,208,400	
第145回利付国債(20年)	125,000,000	151,451,250	
第146回利付国債(20年)	75,000,000	90,898,500	
第147回利付国債(20年)	60,000,000	71,797,200	
第148回利付国債(20年)	120,000,000	141,692,400	
第149回利付国債(20年)	215,000,000	253,809,650	
第150回利付国債(20年)	90,000,000	104,760,000	
第151回利付国債(20年)	150,000,000	169,465,500	
第152回利付国債(20年)	90,000,000	101,664,900	
第153回利付国債(20年)	120,000,000	137,536,800	
第154回利付国債(20年)	120,000,000	135,391,200	
第155回利付国債(20年)	140,000,000	152,875,800	
第156回利付国債(20年)	110,000,000	108,115,700	

	第157回利付国債(20年)	50,000,000	47,195,000	
	第158回利付国債(20年)	170,000,000	169,257,100	
	第159回利付国債(20年)	150,000,000	151,719,000	
	第160回利付国債(20年)	140,000,000	143,864,000	
国債証券 合計		24,471,000,000	27,338,461,139	
地方債証券	第26回東京都公募公債(20年)	100,000,000	118,517,000	
	第660回東京都公募公債	100,000,000	101,542,362	
	第694回東京都公募公債	200,000,000	209,714,000	
	第708回東京都公募公債	100,000,000	104,149,000	
	第712回東京都公募公債	200,000,000	207,410,000	
	第730回東京都公募公債	100,000,000	103,984,000	
	第731回東京都公募公債	100,000,000	103,789,000	
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	117,112,000	
	平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	208,394,000	
	平成26年度第3回広島県公募公債	100,000,000	103,238,000	
	平成22年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	104,484,000	
	平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	104,770,000	
	平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	104,241,000	
	平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	103,507,000	
	第10回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	103,731,000	
	第64回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,798,000	
	第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,172,000	
	第99回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,447,000	
	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	103,928,000	
	平成25年度第1回島根県公募公債	200,000,000	200,568,000	
平成26年度第1回栃木県公募公債	100,000,000	102,872,000		
平成23年度第2回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	104,508,000		
地方債証券 合計		2,700,000,000	2,822,875,362	
特殊債券	第1回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	104,091,000	
	第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	105,199,000	
	第5回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,558,000	
	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,104,000	
	第6回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,034,000	
	第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,266,000	
	第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,233,000	
	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,321,000	

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	103,763,000	
第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	119,688,000	
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	106,322,000	
第56回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,543,000	
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	203,780,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,481,000	
第135回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,026,000	
第139回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,651,000	
第146回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,555,000	
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	104,475,000	
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	206,296,000	
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	99,348,000	
第1回地方公営企業等金融機構債券（20年）	100,000,000	119,784,000	
第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	102,087,000	
第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,962,000	
F223回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,390,000	
F290回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,510,000	
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	199,990,000	
第44回日本学生支援債券	200,000,000	199,988,000	
第45回日本学生支援債券	300,000,000	299,982,000	
第17回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	104,764,000	
第298回信金中金債（5年）	200,000,000	200,720,000	
第316回信金中金債（5年）	100,000,000	100,037,000	
第318回信金中金債（5年）	100,000,000	99,921,000	
第320回信金中金債（5年）	100,000,000	99,714,000	
第322回信金中金債（5年）	200,000,000	199,574,000	
特殊債券 合計	4,200,000,000	4,328,157,000	
社債券			
第8回成田国際空港株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,064,000	
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	100,438,000	
第10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	100,345,000	

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	100,313,000	
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	102,930,000	
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	103,066,000	
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	99,136,000	
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	103,381,000	
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	103,506,000	
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	118,990,000	
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	113,030,000	
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	116,152,000	
第563回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,871,000	
第299回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,916,000	
第281回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,395,000	
第19回沖縄電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,708,000	
社債券 合計	1,600,000,000	1,682,241,000	
合計	32,971,000,000	36,171,734,501	

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12月26日現在	平成29年 6月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	186,021,961	72,716,338
コール・ローン	33,783,569	279,550,821
国債証券	158,302,461,966	155,372,708,448
派生商品評価勘定	1,327,228	303,781
未収入金	95,770,740	622,078,834
未収利息	1,471,823,369	1,366,383,233
前払費用	18,907,409	25,521,838
流動資産合計	160,110,096,242	157,739,263,293
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	22,902
未払金	-	131,800,171
未払解約金	207,081,197	120,424,456
未払利息	29	438
流動負債合計	207,081,226	252,247,967
純資産の部		
元本等		
元本	72,453,501,529	70,935,063,552
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	87,449,513,487	86,551,951,774
元本等合計	159,903,015,016	157,487,015,326
純資産合計	159,903,015,016	157,487,015,326
負債純資産合計	160,110,096,242	157,739,263,293

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。
---------------------------	---

（貸借対照表に関する注記）

		平成28年12月26日現在	平成29年 6月26日現在
1.	期首	平成28年 6月28日	平成28年12月27日
	期首元本額	75,008,369,772円	72,453,501,529円
	期首からの追加設定元本額	859,678,400円	1,617,879,446円
	期首からの一部解約元本額	3,414,546,643円	3,136,317,423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）	11,171,648,338円	11,375,286,015円
	DCインデックスバランス（株式20）	93,627,064円	109,958,568円
	DCインデックスバランス（株式40）	153,737,243円	171,497,997円
	DCインデックスバランス（株式60）	192,209,140円	217,594,283円
	DCインデックスバランス（株式80）	165,195,842円	187,320,973円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	24,114,825,182円	24,232,032,717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	2,931,152,195円	2,707,775,849円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	25,452,705,460円	23,394,409,214円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	27,026,652円	27,641,461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）	997,560,718円	978,409,675円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	211,871,597円	247,003,587円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	- 円	112,785,347円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	3,013,401円	3,012,248円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	3,291,686円	3,265,225円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	7,132,611円	7,175,910円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	18,138,890円	16,443,470円
	世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	198,007,005円	797,377,534円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,231,281,227円	1,177,102,352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）	34,894,181円	28,552,229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）	89,791,496円	89,115,411円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	37,129,664円	- 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	55,549,827円	56,981,586円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	83,144,046円	84,146,367円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	76,765,177円	79,359,228円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	57,932,579円	60,034,533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	4,802,231,315円	4,526,709,270円
海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	243,638,993円	244,072,503円
計	72,453,501,529円	70,935,063,552円
2. 受益権の総数	72,453,501,529口	70,935,063,552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28年 6月28日 至 平成28年12月26日	自 平成28年12月27日 至 平成29年 6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12月26日現在	平成29年 6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	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品

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

（有価証券に関する注記）

（平成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

（平成29年 6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	3,904,438,078
合計	3,904,438,078

(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

(平成29年 6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	99,431,490	-	99,667,190	235,700
	米ドル	27,840,000	-	27,817,500	22,500
	ユーロ	63,678,690	-	63,904,410	225,720
	英ポンド	7,912,800	-	7,945,280	32,480
	売建	589,531,611	-	589,486,432	45,179
	米ドル	279,300,752	-	279,262,600	38,152
	加ドル	11,243,538	-	11,243,940	402
	メキシコペソ	10,944,458	-	10,938,600	5,858
	ユーロ	276,421,939	-	276,420,830	1,109
	スイスフラン	4,373,156	-	4,372,737	419
	デンマーククローネ	7,247,768	-	7,247,725	43
	合計	688,963,101	-	689,153,622	280,879

(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12月26日現在		平成29年 6月26日現在	
1口当たり純資産額	2.2070円	1口当たり純資産額	2.2202円
(1万口当たり純資産額)	(22,070円)	(1万口当たり純資産額)	(22,202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-1.0%-18/05/31	5,520,000.00	5,508,463.20	
		US TREASURY N/B-2.375%-18/06/30	7,000,000.00	7,079,163.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-18/07/31	8,340,000.00	8,429,913.54	
		US TREASURY N/B-1.375%-18/07/31	2,500,000.00	2,502,977.50	
		US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	8,530,000.00	8,792,894.60	
		US TREASURY N/B-1.375%-18/09/30	970,000.00	971,061.18	
		US TREASURY N/B-1.75%-18/10/31	3,000,000.00	3,019,161.00	
		US TREASURY N/B-1.25%-18/10/31	3,000,000.00	2,998,302.00	
		US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	9,100,000.00	9,406,943.00	
		US TREASURY N/B-1.25%-18/11/30	3,100,000.00	3,097,699.80	
		US TREASURY N/B-1.5%-18/12/31	8,830,000.00	8,854,829.96	
		US TREASURY N/B-1.25%-18/12/31	2,000,000.00	1,997,930.00	
		US TREASURY N/B-1.125%-19/01/15	760,000.00	757,699.48	
		US TREASURY N/B-1.5%-19/01/31	3,000,000.00	3,008,556.00	
		US TREASURY N/B-1.25%-19/01/31	1,170,000.00	1,168,583.13	
US TREASURY N/B-1.125%-19/01/31	1,500,000.00	1,495,342.50			

US TREASURY N/B-8.875%-19/02/15	4,550,000.00	5,113,239.95	
US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	5,100,000.00	5,218,039.50	
US TREASURY N/B-0.75%-19/02/15	1,400,000.00	1,386,984.20	
US TREASURY N/B-1.375%-19/02/28	3,000,000.00	3,002,226.00	
US TREASURY N/B-1.5%-19/02/28	4,000,000.00	4,011,248.00	
US TREASURY N/B-1.0%-19/03/15	1,070,000.00	1,064,002.65	
US TREASURY N/B-1.625%-19/03/31	2,000,000.00	2,010,156.00	
US TREASURY N/B-1.25%-19/03/31	1,500,000.00	1,497,774.00	
US TREASURY N/B-0.875%-19/04/15	1,200,000.00	1,190,156.40	
US TREASURY N/B-1.625%-19/04/30	3,900,000.00	3,920,260.50	
US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	4,000,000.00	4,132,736.00	
US TREASURY N/B-0.875%-19/05/15	3,000,000.00	2,973,984.00	
US TREASURY N/B-1.5%-19/05/31	4,100,000.00	4,112,332.80	
US TREASURY N/B-0.875%-19/06/15	3,000,000.00	2,972,286.00	
US TREASURY N/B-1.625%-19/06/30	2,510,000.00	2,523,579.10	
US TREASURY N/B-0.75%-19/07/15	2,650,000.00	2,617,444.75	
US TREASURY N/B-1.625%-19/07/31	3,000,000.00	3,016,056.00	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	4,320,000.00	4,524,102.72	
US TREASURY N/B-8.125%-19/08/15	4,110,000.00	4,697,360.10	
US TREASURY N/B-1.0%-19/08/31	3,300,000.00	3,273,639.60	
US TREASURY N/B-1.625%-19/08/31	3,600,000.00	3,619,123.20	
US TREASURY N/B-1.75%-19/09/30	7,450,000.00	7,510,531.25	
US TREASURY N/B-1.0%-19/10/15	5,100,000.00	5,055,772.80	
US TREASURY N/B-1.5%-19/10/31	4,100,000.00	4,110,090.10	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	10,780,000.00	11,279,836.26	
US TREASURY N/B-1.5%-19/11/30	5,000,000.00	5,011,330.00	
US TREASURY N/B-1.625%-19/12/31	1,900,000.00	1,909,834.40	
US TREASURY N/B-1.25%-20/01/31	4,000,000.00	3,981,016.00	
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	10,270,000.00	10,848,488.56	
US TREASURY N/B-1.375%-20/03/31	1,100,000.00	1,097,443.60	
US TREASURY N/B-1.375%-20/04/30	1,930,000.00	1,924,233.16	
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	7,830,000.00	8,277,625.44	
US TREASURY N/B-1.375%-20/05/31	2,440,000.00	2,432,279.84	
US TREASURY N/B-1.5%-20/05/31	5,100,000.00	5,100,897.60	
US TREASURY N/B-1.875%-20/06/30	380,000.00	384,297.42	

US TREASURY N/B-1.625%-20/06/30	4,000,000.00	4,014,376.00	
US TREASURY N/B-2.0%-20/07/31	5,370,000.00	5,448,138.87	
US TREASURY N/B-1.625%-20/07/31	4,000,000.00	4,012,812.00	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	5,610,000.00	6,850,662.72	
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	4,850,000.00	5,012,644.75	
US TREASURY N/B-2.125%-20/08/31	1,450,000.00	1,476,479.90	
US TREASURY N/B-1.375%-20/08/31	2,300,000.00	2,288,725.40	
US TREASURY N/B-1.375%-20/09/30	3,700,000.00	3,679,983.00	
US TREASURY N/B-1.75%-20/10/31	2,000,000.00	2,012,852.00	
US TREASURY N/B-1.375%-20/10/31	1,060,000.00	1,053,705.72	
US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	3,500,000.00	3,621,611.00	
US TREASURY N/B-1.625%-20/11/30	1,120,000.00	1,121,968.96	
US TREASURY N/B-2.375%-20/12/31	3,000,000.00	3,081,798.00	
US TREASURY N/B-1.75%-20/12/31	2,000,000.00	2,011,210.00	
US TREASURY N/B-2.125%-21/01/31	2,400,000.00	2,443,874.40	
US TREASURY N/B-1.375%-21/01/31	2,000,000.00	1,984,726.00	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	6,030,000.00	6,460,578.18	
US TREASURY N/B-2.0%-21/02/28	2,370,000.00	2,403,791.46	
US TREASURY N/B-1.125%-21/02/28	2,000,000.00	1,965,274.00	
US TREASURY N/B-2.25%-21/03/31	340,000.00	347,948.86	
US TREASURY N/B-1.25%-21/03/31	1,270,000.00	1,252,761.02	
US TREASURY N/B-2.25%-21/04/30	4,800,000.00	4,910,064.00	
US TREASURY N/B-1.375%-21/04/30	2,000,000.00	1,980,860.00	
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	5,170,000.00	5,459,096.06	
US TREASURY N/B-1.375%-21/05/31	2,060,000.00	2,038,555.40	
US TREASURY N/B-2.125%-21/06/30	6,400,000.00	6,516,000.00	
US TREASURY N/B-1.125%-21/06/30	3,900,000.00	3,818,954.10	
US TREASURY N/B-2.25%-21/07/31	6,900,000.00	7,057,947.90	
US TREASURY N/B-1.125%-21/07/31	5,000,000.00	4,891,015.00	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	3,900,000.00	3,969,314.70	
US TREASURY N/B-1.125%-21/08/31	4,400,000.00	4,301,088.00	
US TREASURY N/B-2.125%-21/09/30	2,400,000.00	2,442,280.80	
US TREASURY N/B-1.125%-21/09/30	1,500,000.00	1,464,727.50	
US TREASURY N/B-1.25%-21/10/31	2,000,000.00	1,961,954.00	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	11,490,000.00	14,542,479.36	

US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	4,000,000.00	4,050,936.00	
US TREASURY N/B-1.75%-21/11/30	600,000.00	601,089.60	
US TREASURY N/B-2.125%-21/12/31	4,800,000.00	4,883,342.40	
US TREASURY N/B-1.5%-22/01/31	800,000.00	791,703.20	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,500,000.00	2,531,200.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/02/28	2,900,000.00	2,901,641.40	
US TREASURY N/B-1.75%-22/03/31	1,800,000.00	1,800,000.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/04/30	3,000,000.00	2,998,476.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	2,000,000.00	1,999,648.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/05/31	2,000,000.00	2,010,782.00	
US TREASURY N/B-2.125%-22/06/30	2,500,000.00	2,541,602.50	
US TREASURY N/B-2.0%-22/07/31	3,930,000.00	3,969,453.27	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	2,000,000.00	1,983,672.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/08/31	1,900,000.00	1,907,125.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/09/30	3,550,000.00	3,538,629.35	
US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	3,000,000.00	3,007,968.00	
US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	1,000,000.00	989,434.00	
US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	1,000,000.00	1,008,555.00	
US TREASURY N/B-2.125%-22/12/31	3,900,000.00	3,957,587.40	
US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	2,000,000.00	1,988,946.00	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	7,130,000.00	7,186,398.30	
US TREASURY N/B-1.5%-23/02/28	1,000,000.00	980,430.00	
US TREASURY N/B-1.5%-23/03/31	2,000,000.00	1,959,454.00	
US TREASURY N/B-1.625%-23/04/30	660,000.00	650,563.98	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	8,150,000.00	8,089,991.55	
US TREASURY N/B-1.625%-23/05/31	1,500,000.00	1,477,792.50	
US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	4,000,000.00	3,881,564.00	
US TREASURY N/B-1.25%-23/07/31	2,000,000.00	1,924,960.00	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,500,000.00	5,691,103.00	
US TREASURY N/B-1.375%-23/08/31	1,850,000.00	1,791,898.90	
US TREASURY N/B-1.375%-23/09/30	2,500,000.00	2,419,435.00	
US TREASURY N/B-1.625%-23/10/31	1,700,000.00	1,669,852.20	
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	4,200,236.00	
US TREASURY N/B-2.125%-23/11/30	3,230,000.00	3,268,924.73	
US TREASURY N/B-2.25%-23/12/31	2,500,000.00	2,547,510.00	

US TREASURY N/B-2.25%-24/01/31	2,000,000.00	2,037,540.00	
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	3,300,000.00	3,465,709.50	
US TREASURY N/B-2.125%-24/02/29	1,500,000.00	1,516,113.00	
US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	3,000,000.00	3,030,879.00	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	5,800,000.00	5,999,943.40	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,739,380.80	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	5,930,000.00	6,027,056.31	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,500,000.00	4,488,484.50	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	4,825,406.40	
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	4,720,000.00	4,693,728.48	
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	5,940,000.00	6,012,741.24	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	2,359,863.00	
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,750,000.00	3,608,422.50	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	3,400,000.00	3,264,663.00	
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,791,252.00	
US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,450,000.00	3,366,932.10	
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	5,040,000.00	4,981,525.92	
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	4,800,000.00	4,843,876.80	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	2,760,000.00	3,778,881.60	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,000,000.00	1,306,836.00	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	2,080,000.00	3,013,400.00	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	2,310,000.00	3,159,465.54	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	1,900,000.00	2,659,813.80	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	1,170,000.00	1,522,347.84	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	1,800,000.00	2,380,289.40	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	2,300,000.00	2,942,516.50	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,820,000.00	2,407,554.24	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	1,750,000.00	2,277,836.75	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	1,680,000.00	2,261,962.08	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	2,290,000.00	2,984,559.29	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,990,000.00	2,420,027.06	
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	2,010,000.00	2,580,062.13	
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	2,062,822.50	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	2,200,000.00	2,880,281.80	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	2,960,000.00	3,541,420.96	

		US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	809,952.80	
		US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	2,023,438.00	
		US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	2,162,774.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	5,800,000.00	5,993,940.40	
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	5,350,000.00	6,296,489.90	
		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	4,500,000.00	5,410,548.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	3,000,000.00	3,537,012.00	
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	3,400,000.00	3,845,121.20	
		US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	5,900,000.00	6,384,100.90	
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	3,300,000.00	3,488,459.70	
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	3,159,106.50	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	3,200,000.00	3,380,000.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	5,300,000.00	5,463,971.40	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	3,900,000.00	4,118,766.60	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	2,800,000.00	2,675,094.80	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	2,500,000.00	2,386,622.50	
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	1,943,146.35	
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	1,500,000.00	1,547,431.50	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	1,800,000.00	1,904,378.40	
		米ドル小計	587,570,000.00	613,756,042.52 (68,298,772,411)	
加ドル	国債証券	CANADA GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	418,806.95	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	1,180,000.00	1,217,111.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-18/08/01	1,350,000.00	1,344,789.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/09/01	650,000.00	653,016.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-18/11/01	1,230,000.00	1,224,120.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-19/02/01	910,000.00	904,758.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/03/01	1,050,000.00	1,065,477.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-19/05/01	1,190,000.00	1,186,846.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	1,800,000.00	1,897,686.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/09/01	1,390,000.00	1,414,853.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-20/03/01	2,220,000.00	2,251,790.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	1,330,000.00	1,426,504.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-20/09/01	1,150,000.00	1,140,834.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/03/01	1,210,000.00	1,197,113.50	

		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	1,150,000.00	1,247,094.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/09/01	1,340,000.00	1,321,910.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-22/03/01	1,190,000.00	1,156,323.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	1,200,000.00	1,292,100.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-22/09/01	200,000.00	198,284.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,380,000.00	1,402,659.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,220,000.00	1,320,345.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	1,130,000.00	1,208,953.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	1,100,000.00	1,110,318.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	370,000.00	592,802.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	540,000.00	516,483.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	990,000.00	1,432,292.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	1,060,000.00	1,641,049.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	1,190,000.00	1,796,602.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	1,345,000.00	1,859,341.45	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,460,000.00	1,934,076.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	1,055,000.00	1,245,533.00	
			34,915,000.00	38,619,876.50	
				(3,240,980,035)	
加ドル小計					
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-4.75%- 18/06/14	18,000,000.00	17,652,420.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-18/12/13	23,900,000.00	24,504,968.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11	17,200,000.00	16,619,500.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	18,900,000.00	19,667,812.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	23,800,000.00	23,800,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	9,700,000.00	9,696,968.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	8,200,000.00	8,798,911.60	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	24,500,000.00	29,354,062.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	4,250,000.00	3,995,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	6,700,000.00	7,093,209.60	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	12,200,000.00	13,923,250.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	11,900,000.00	12,859,437.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	5,800,000.00	6,306,340.00	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	7,800,000.00	10,269,187.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	12,100,000.00	14,045,075.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	14,340,000.00	15,468,558.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	3,100,000.00	3,446,657.50	
メキシコペソ小計			222,390,000.00	237,501,359.20	(1,470,133,413)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-1.25%-18/06/22	520,000.00	529,621.56	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	1,280,000.00	1,383,988.48	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-19/09/28	960,000.00	1,037,954.88	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	1,728,000.00	1,968,629.18	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	1,425,000.00	1,708,401.15	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	1,280,000.00	1,544,558.08	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,440,000.00	1,781,874.72	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	1,170,000.00	1,336,652.46	
		BELGIUM KINGDOM-0.2%-23/10/22	410,000.00	415,982.72	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	1,460,000.00	1,715,266.40	
		BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	420,000.00	429,987.18	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,320,000.00	1,375,210.32	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	1,080,000.00	1,473,764.76	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	1,210,000.00	1,271,916.91	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	455,000.00	464,120.47	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,760,000.00	2,673,105.60	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	750,000.00	752,888.25	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	760,000.00	1,081,147.12	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	590,000.00	766,569.30	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,585,000.00	2,596,551.75	
		BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	220,000.00	226,193.44	
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	530,000.00	588,147.89	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,520,000.00	2,407,880.64	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	815,000.00	1,227,062.37	
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	490,000.00	487,797.45	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	260,000.00	289,766.10	
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	280,000.00	300,188.00	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%- 18/07/30	2,190,000.00	2,296,602.63	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.75%- 18/10/31	1,690,000.00	1,784,812.38	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%- 19/01/31	1,290,000.00	1,301,122.38	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 19/04/30	1,860,000.00	1,964,909.58	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%- 19/07/30	1,870,000.00	2,061,112.13	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%- 19/10/31	2,030,000.00	2,247,758.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 20/01/31	1,480,000.00	1,544,831.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%- 20/04/30	2,280,000.00	2,554,546.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.15%- 20/07/30	1,180,000.00	1,230,091.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%- 20/10/31	1,790,000.00	2,090,866.78	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	2,360,000.00	2,867,876.72	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.75%- 21/07/30	1,535,000.00	1,585,025.65	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	2,060,000.00	2,604,406.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.4%- 22/04/30	600,000.00	605,919.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%- 23/01/31	2,040,000.00	2,609,978.04	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	1,890,000.00	2,344,174.56	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	1,510,000.00	1,916,812.12	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	1,880,000.00	2,266,682.16	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	2,040,000.00	2,316,876.96	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	1,760,000.00	1,846,192.48	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,850,000.00	2,372,782.25	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	1,880,000.00	2,037,859.84
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 26/04/30	1,800,000.00	1,918,054.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,620,000.00	2,274,445.98
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%- 26/10/31	1,525,000.00	1,532,867.47
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%- 27/04/30	1,150,000.00	1,163,701.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,220,000.00	1,676,167.76
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	2,010,000.00	2,955,783.39
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,730,000.00	1,770,329.76
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,760,000.00	2,654,569.28
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%- 33/07/30	700,000.00	729,633.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,630,000.00	2,141,102.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,320,000.00	1,911,703.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,340,000.00	1,899,691.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	990,000.00	1,494,603.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%- 46/10/31	1,010,000.00	1,067,778.06
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%- 66/07/30	360,000.00	400,890.24
BUNDESobligation-1.0%-18/10/12	1,880,000.00	1,920,982.12
BUNDESobligation-1.0%-19/02/22	1,320,000.00	1,356,763.32
BUNDESobligation-0.25%-20/10/16	1,000,000.00	1,027,024.00
BUNDESobligation-0.0%-21/04/09	1,200,000.00	1,223,637.60
BUNDESobligation-0.0%-21/10/08	740,000.00	754,552.10
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 18/07/04	2,750,000.00	2,890,263.75
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 19/01/04	2,550,000.00	2,723,035.35

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%- 19/07/04	3,770,000.00	4,088,542.38
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 20/01/04	3,220,000.00	3,539,063.36
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%- 20/07/04	2,720,000.00	3,018,590.72
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 20/09/04	2,150,000.00	2,345,843.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 21/01/04	1,800,000.00	1,995,669.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	1,730,000.00	1,994,788.61
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 21/09/04	1,580,000.00	1,763,534.38
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	2,000,000.00	2,223,282.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 22/07/04	2,470,000.00	2,735,967.13
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	1,600,000.00	1,755,480.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	1,900,000.00	2,093,091.30
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	1,720,000.00	1,899,860.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	1,780,000.00	2,025,540.32
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	1,390,000.00	1,974,763.27
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	2,060,000.00	2,325,525.76
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	1,400,000.00	1,558,607.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	1,830,000.00	1,975,706.43
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	2,170,000.00	2,260,280.68
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	2,340,000.00	2,527,590.78
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	2,270,000.00	2,349,118.58
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 26/08/15	2,130,000.00	2,095,660.14

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15	2,030,000.00	2,029,831.51	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,050,000.00	1,701,740.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,300,000.00	2,018,464.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	980,000.00	1,445,657.78	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	830,000.00	1,416,610.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,620,000.00	2,673,597.78	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,710,000.00	2,824,725.06	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	2,015,000.00	3,183,756.42	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,190,000.00	1,997,726.78	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,400,000.00	2,528,479.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	1,330,000.00	2,005,773.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,690,000.00	2,275,236.86	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	1,770,000.00	2,409,757.65	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-18/06/15	1,000,000.00	1,006,774.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/06/01	1,270,000.00	1,316,480.73	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/08/01	2,400,000.00	2,528,860.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.3%- 18/10/15	700,000.00	705,887.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/12/01	2,040,000.00	2,150,441.52	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/02/01	2,320,000.00	2,485,648.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 19/03/01	2,320,000.00	2,503,860.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.1%- 19/04/15	1,000,000.00	1,005,548.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-	1,400,000.00	1,469,203.40	

19/05/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 19/08/01	730,000.00	754,579.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/09/01	3,010,000.00	3,293,731.63	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.05%- 19/10/15	470,000.00	470,900.52	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.05%- 19/12/01	1,100,000.00	1,128,182.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 20/02/01	2,540,000.00	2,834,843.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 20/03/01	2,670,000.00	2,970,642.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.7%- 20/05/01	750,000.00	763,286.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 20/06/15	100,000.00	100,688.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	2,750,000.00	3,088,404.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 20/11/01	940,000.00	955,395.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	2,100,000.00	2,369,948.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/05/01	1,200,000.00	1,357,077.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%- 21/06/01	540,000.00	542,209.14	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	3,670,000.00	4,167,784.12	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 21/09/01	3,350,000.00	3,947,107.35	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 21/11/01	530,000.00	527,074.93	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 21/12/15	1,060,000.00	1,135,637.36	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	2,250,000.00	2,701,867.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 22/04/15	870,000.00	897,753.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,900,000.00	2,355,711.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%-	1,000,000.00	1,033,108.00	

22/09/15			
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	2,000,000.00	2,485,720.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/15	960,000.00	961,677.12	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	1,300,000.00	1,558,776.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,700,000.00	2,074,695.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 23/10/15	380,000.00	369,324.66	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	3,000,000.00	4,440,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,650,000.00	1,992,295.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,500,000.00	1,740,112.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,400,000.00	1,502,480.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	3,230,000.00	4,051,757.22	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	690,000.00	687,273.12	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	2,060,000.00	2,117,490.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,430,000.00	1,756,397.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	830,000.00	821,819.52	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	1,710,000.00	2,523,103.29	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	1,470,000.00	1,404,295.41	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%- 27/06/01	680,000.00	698,473.56	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	3,320,000.00	4,736,179.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	850,000.00	1,078,182.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	3,220,000.00	4,303,095.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-	940,000.00	1,073,586.22	

30/03/01		
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	3,290,000.00	4,749,759.84
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,540,000.00	1,423,127.86
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,900,000.00	2,729,730.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	490,000.00	490,847.21
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	2,080,000.00	2,803,203.52
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	400,000.00	380,841.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	2,710,000.00	3,281,389.95
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,770,000.00	2,416,697.82
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	2,140,000.00	2,900,641.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,660,000.00	2,200,285.18
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,240,000.00	1,301,112.16
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	1,080,000.00	1,014,238.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 67/03/01	680,000.00	595,605.20
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-18/09/15	210,000.00	214,545.45
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	580,000.00	638,404.26
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	740,000.00	821,284.56
FINNISH GOVERNMENT-0.375%-20/09/15	300,000.00	308,147.70
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	740,000.00	850,820.92
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	300,000.00	328,912.20
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	550,000.00	602,214.25
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-23/09/15	250,000.00	250,672.50
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	700,000.00	794,022.60
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	590,000.00	771,574.27
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	400,000.00	421,159.60
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	410,000.00	416,888.00
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	469,973.36

FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	385,000.00	384,193.81	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	380,000.00	508,859.52	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-18/10/25	2,300,000.00	2,448,934.20	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-18/11/25	1,200,000.00	1,227,044.40	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-19/02/25	810,000.00	817,936.38	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25	3,630,000.00	3,952,402.08	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-19/05/25	1,470,000.00	1,513,700.16	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-19/10/25	1,050,000.00	1,273,008.45	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	4,300,000.00	4,733,220.70	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-19/11/25	1,650,000.00	1,690,731.90	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-20/02/25	1,000,000.00	1,013,170.00	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	3,180,000.00	3,541,483.32	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-20/05/25	1,600,000.00	1,621,827.20	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	3,480,000.00	3,824,593.08	
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-20/11/25	2,550,000.00	2,608,637.25	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	3,900,000.00	4,526,121.60	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	3,920,000.00	4,532,253.04	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	3,770,000.00	4,367,032.28	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	2,850,000.00	3,219,699.15	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	1,140,000.00	1,715,741.04	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	3,140,000.00	3,481,895.76	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	4,000,000.00	5,093,164.00	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	3,290,000.00	3,788,444.87	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	3,000,000.00	3,353,475.00	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	3,010,000.00	3,066,187.67	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	2,630,000.00	3,883,005.64	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	2,845,000.00	3,000,536.15	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	3,320,000.00	4,221,712.00	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	1,740,000.00	1,748,874.00	
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	2,280,000.00	2,221,248.96	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	370,000.00	384,083.31	
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,330,000.00	4,036,579.38	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	3,080,000.00	4,741,767.80	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	2,220,000.00	2,658,365.64	
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	2,070,000.00	2,211,968.88	

FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	2,820,000.00	4,726,320.00	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	2,470,000.00	3,908,216.78	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	980,000.00	974,806.00	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	2,380,000.00	3,575,609.66	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-39/06/25	810,000.00	865,067.04	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	2,785,000.00	4,526,850.40	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	2,140,000.00	2,954,912.00	
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	500,000.00	540,720.00	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	1,370,000.00	2,236,220.86	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	1,160,000.00	1,937,196.52	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-66/05/25	370,000.00	361,921.42	
IRISH TREASURY-4.5%-18/10/18	770,000.00	820,257.13	
IRISH TREASURY-4.4%-19/06/18	700,000.00	766,887.80	
IRISH TREASURY-5.9%-19/10/18	570,000.00	653,734.14	
IRISH TREASURY-4.5%-20/04/18	1,010,000.00	1,149,602.20	
IRISH TREASURY-5.0%-20/10/18	700,000.00	825,455.40	
IRISH TREASURY-0.8%-22/03/15	480,000.00	502,127.04	
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	510,000.00	624,601.08	
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	680,000.00	825,717.20	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	930,000.00	1,281,783.66	
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	780,000.00	804,928.80	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	820,000.00	951,951.12	
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	345,000.00	356,178.69	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	575,000.00	608,271.22	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	1,640,000.00	1,720,545.32	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-19/01/15	1,050,000.00	1,081,044.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	1,480,000.00	1,621,273.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-20/01/15	1,340,000.00	1,369,186.54	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	1,510,000.00	1,698,441.96	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	1,590,000.00	1,831,168.02	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-22/01/15	700,000.00	711,118.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	1,500,000.00	1,694,953.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	500,000.00	611,361.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	970,000.00	1,389,443.52	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	950,000.00	1,059,519.80	

		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	1,030,000.00	1,175,915.98	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	880,000.00	886,917.68	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	875,000.00	891,509.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	510,000.00	524,916.48	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	1,280,000.00	1,952,832.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	1,200,000.00	1,508,635.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,400,000.00	2,193,058.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,420,000.00	2,271,473.18	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,105,000.00	1,560,999.24	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.15%-18/10/19	660,000.00	675,079.02	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	1,110,000.00	1,204,150.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.95%-19/06/18	530,000.00	556,194.72	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-19/10/18	610,000.00	621,048.93	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	1,290,000.00	1,463,128.32	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	1,330,000.00	1,548,465.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	780,000.00	928,308.42	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	940,000.00	1,123,328.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/07/15	130,000.00	130,406.90	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	1,170,000.00	1,304,359.29	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	890,000.00	989,579.43	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	830,000.00	894,615.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	750,000.00	1,048,148.25	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	560,000.00	576,816.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	155,000.00	155,038.44	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	800,000.00	1,264,771.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	540,000.00	662,838.12	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,090,000.00	1,689,372.47	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	630,000.00	896,827.05	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	320,000.00	328,574.72	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	360,000.00	625,063.68	
		ユーロ小計	418,713,000.00	499,585,944.29 (62,233,421,080)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.25%-18/07/22	2,630,000.00	2,658,645.96	
		UK TREASURY-4.5%-19/03/07	1,850,000.00	1,984,199.00	
		UK TREASURY-1.75%-19/07/22	1,993,000.00	2,055,400.83	

UK TREASURY-3.75%-19/09/07	1,590,000.00	1,713,399.90	
UK TREASURY-4.75%-20/03/07	1,710,000.00	1,919,782.80	
UK TREASURY-2.0%-20/07/22	1,870,000.00	1,969,106.26	
UK TREASURY-3.75%-20/09/07	1,820,000.00	2,024,204.00	
UK TREASURY-1.5%-21/01/22	2,580,000.00	2,688,968.88	
UK TREASURY-8.0%-21/06/07	1,020,000.00	1,329,816.84	
UK TREASURY-3.75%-21/09/07	1,520,000.00	1,737,436.00	
UK TREASURY-4.0%-22/03/07	1,210,000.00	1,414,187.50	
UK TREASURY-1.75%-22/09/07	2,130,000.00	2,267,598.00	
UK TREASURY-2.25%-23/09/07	1,710,000.00	1,879,375.50	
UK TREASURY-2.75%-24/09/07	1,570,000.00	1,793,411.00	
UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,970,000.00	2,596,960.38	
UK TREASURY-1.5%-26/07/22	1,070,000.00	1,119,701.50	
UK TREASURY-4.25%-27/12/07	1,250,000.00	1,647,875.00	
UK TREASURY-6.0%-28/12/07	1,000,000.00	1,524,732.00	
UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,300,000.00	1,855,230.00	
UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,650,000.00	2,281,966.50	
UK TREASURY-4.5%-34/09/07	2,000,000.00	2,900,460.00	
UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,670,000.00	2,391,122.70	
UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,490,000.00	2,330,285.50	
UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,410,000.00	2,083,119.90	
UK TREASURY-4.25%-40/12/07	1,610,000.00	2,411,425.80	
UK TREASURY-4.5%-42/12/07	2,540,000.00	4,019,550.00	
UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,380,000.00	1,828,417.20	
UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,740,000.00	2,422,306.20	
UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,560,000.00	2,481,429.60	
UK TREASURY-1.5%-47/07/22	465,000.00	445,625.31	
UK TREASURY-4.25%-49/12/07	1,340,000.00	2,217,056.80	
UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,530,000.00	2,411,922.60	
UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,580,000.00	2,811,783.80	
UK TREASURY-1.75%-57/07/22	260,000.00	275,623.40	
UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,400,000.00	2,484,146.00	
UK TREASURY-3.5%-68/07/22	1,690,000.00	2,892,362.33	
UNITED KINGDOM GILT-0.5%-22/07/22	1,025,000.00	1,024,592.05	
UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	1,180,000.00	1,288,807.80	

		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	1,142,000.00	1,529,094.60	
英債券小計			60,455,000.00	78,711,129.44	(11,168,322,156)
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-3.0%-19/05/12	400,000.00	429,521.20	
		SWITZERLAND-2.25%-20/07/06	400,000.00	437,832.00	
		SWITZERLAND-2.0%-21/04/28	220,000.00	243,462.78	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	696,000.00	877,656.00	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	385,000.00	558,078.29	
スイスフラン小計			2,101,000.00	2,546,550.27	(292,267,574)
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	9,662,827.90	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	8,370,000.00	9,950,172.30	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	8,500,000.00	10,045,725.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	7,020,000.00	7,663,958.64	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	5,450,000.00	6,410,420.80	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	5,090,000.00	5,355,061.75	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,150,000.00	3,191,271.30	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	4,180,000.00	5,806,667.90	
スウェーデンクローナ小計			50,660,000.00	58,086,105.59	(741,178,707)
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	6,980,000.00	7,487,655.40	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	6,900,000.00	7,657,026.60	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	4,900,000.00	5,143,461.40	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	4,190,000.00	4,668,079.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	3,470,000.00	3,577,049.50	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	3,110,000.00	3,135,340.28	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,000,000.00	2,047,510.00	
ノルウェークローネ小計			31,550,000.00	33,716,122.18	(444,378,490)
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	4,088,383.04	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	8,190,000.00	9,060,433.20	
		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	7,570,000.00	8,672,608.35	
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	6,140,000.00	6,750,162.50	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	6,740,000.00	7,604,971.16	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	1,850,000.00	1,849,080.55	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	11,130,000.00	18,999,099.21	

デンマーククローネ小計			45,660,000.00	57,024,738.01 (955,164,361)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-18/07/25	2,480,000.00	2,503,436.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-18/10/25	2,290,000.00	2,238,933.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-19/04/25	520,000.00	502,489.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-19/07/25	2,190,000.00	2,248,801.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	1,700,000.00	1,835,575.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.5%-20/04/25	2,570,000.00	2,527,595.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	1,720,000.00	1,884,690.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25	2,410,000.00	2,375,296.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-21/07/25	2,430,000.00	2,362,567.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	1,610,000.00	1,825,257.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-22/04/25	1,160,000.00	1,140,193.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	2,220,000.00	2,554,332.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	2,370,000.00	2,531,752.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,580,000.00	2,618,313.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	3,210,000.00	3,052,228.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	1,800,000.00	1,688,760.00
POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	830,000.00	1,028,195.70		
ポーランドズロチ小計			34,090,000.00	34,918,414.70 (1,030,442,417)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-18/10/21	1,430,000.00	1,460,469.01
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	1,907,000.00	2,022,522.24
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-19/10/21	2,100,000.00	2,149,423.50
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	2,340,000.00	2,514,135.78
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-20/11/21	2,120,000.00	2,113,232.96
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	2,510,000.00	2,871,344.62
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.0%-21/12/21	1,055,000.00	1,056,570.89
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	2,050,000.00	2,416,964.35
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	2,120,000.00	2,514,366.64
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	2,150,000.00	2,226,436.80
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	2,390,000.00	2,556,238.84
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	2,760,000.00	3,180,127.20
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	2,430,000.00	2,933,935.83
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	1,840,000.00	1,894,596.48

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	1,470,000.00	1,439,479.86	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	910,000.00	933,452.52	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,350,000.00	1,450,920.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,050,000.00	1,287,318.90	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	630,000.00	617,894.55	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	870,000.00	972,100.59	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	390,000.00	401,805.69	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	700,000.00	664,125.70	
豪ドル小計			36,572,000.00	39,677,463.55	(3,340,048,881)
シンガ ポールド ル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	560,000.00	579,208.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01	760,000.00	779,148.20	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-19/10/01	350,000.00	353,220.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-20/07/01	220,000.00	224,554.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	430,000.00	455,886.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	640,000.00	660,032.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-21/10/01	170,000.00	168,929.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-22/04/01	210,000.00	212,838.15	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	500,000.00	539,350.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	320,000.00	339,936.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	583,740.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	200,000.00	207,500.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	200,000.00	203,600.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	540,000.00	611,838.90	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	200,000.00	216,500.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	330,000.00	356,536.95	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	270,000.00	310,365.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	145,000.00	144,999.27	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	445,000.00	484,827.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	200,000.00	217,828.00	
シンガポールドル小計			7,230,000.00	7,650,836.97	(613,903,158)
マレーシ アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.759%-19/03/15	100,000.00	100,755.60	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.659%-20/10/15	1,010,000.00	1,012,542.17	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	460,000.00	467,045.82	

		MALAYSIA GOVERNMENT-3.62%-21/11/30	850,000.00	847,799.35	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	480,000.00	479,292.96	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	600,000.00	597,975.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	980,000.00	977,902.80	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	450,000.00	449,482.05	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	300,000.00	299,836.80	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	600,000.00	585,201.60	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	590,000.00	607,636.28	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	700,000.00	698,968.20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.58%-18/09/28	700,000.00	702,660.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	1,220,000.00	1,275,662.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	2,980,000.00	3,045,089.16	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.492%-20/03/31	550,000.00	549,889.45	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.889%-20/07/31	800,000.00	807,456.80	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	2,130,000.00	2,169,313.41	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	650,000.00	640,516.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,750,000.00	1,716,284.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	956,449.06	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,270,000.00	1,300,507.94	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	440,569.35	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	650,000.00	617,699.55	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	430,000.00	411,701.78	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000.00	823,118.25	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	1,210,000.00	1,222,100.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	885,000.00	869,180.62	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	450,000.00	434,489.85	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	680,000.00	639,832.40	
マレーシアリングット小計			25,615,000.00	25,746,959.75	(668,391,075)
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 18/12/21	3,900,000.00	3,931,600.33	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	5,350,000.00	5,327,946.23	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	5,250,000.00	5,115,419.40	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	5,600,000.00	5,553,783.76	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	15,600,000.00	17,591,850.12	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	6,200,000.00	5,704,473.68	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	11,150,000.00	9,296,853.27	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	5,220,000.00	4,800,814.42	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	3,210,000.00	3,047,424.09	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	8,300,000.00	5,996,260.30	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	8,200,000.00	7,441,178.56	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%- 40/01/31	3,680,000.00	3,476,576.96	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	8,000,000.00	5,731,526.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	7,850,000.00	7,175,247.36	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	12,400,000.00	11,352,513.09	
南アフリカランド小計		109,910,000.00	101,543,467.57 (875,304,690)	
合計			155,372,708,448 (155,372,708,448)	

(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 175銘柄	100.0%	43.9%
加ドル	国債証券 31銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 17銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 282銘柄	100.0%	40.1%
英ポンド	国債証券 39銘柄	100.0%	7.2%
スイスフラン	国債証券 5銘柄	100.0%	0.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.5%

ノルウェークローネ	国債証券	7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%	0.7%
豪ドル	国債証券	22銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	国債証券	20銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	30銘柄	100.0%	0.4%
南アフリカランド	国債証券	15銘柄	100.0%	0.6%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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12月26日現在	平成29年 6月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	6,887,879	16,395,875
コール・ローン	30,319,514	11,562,412
国債証券	2,511,778,389	2,960,181,058
未収利息	40,000,359	52,171,982
前払費用	2,569,101	5,910,774
流動資産合計	2,591,555,242	3,046,222,101
資産合計	2,591,555,242	3,046,222,101
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	85,680	3,369
未払金	5,868,752	8,840,460
未払解約金	3,154,505	2,559,035
未払利息	26	18
流動負債合計	9,108,963	11,402,882
負債合計	9,108,963	11,402,882
純資産の部		
元本等		
元本	2,093,872,199	2,335,188,029
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	488,574,080	699,631,190
元本等合計	2,582,446,279	3,034,819,219
純資産合計	2,582,446,279	3,034,819,219

平成28年12月26日現在

平成29年 6月26日現在

負債純資産合計	2,591,555,242	3,046,222,101
---------	---------------	---------------

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成28年12月26日現在	平成29年 6月26日現在
1.	期首	平成28年 6月28日	平成28年12月27日
	期首元本額	1,878,450,995円	2,093,872,199円
	期首からの追加設定元本額	305,576,700円	308,064,124円
	期首からの一部解約元本額	90,155,496円	66,748,294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	34,383,946円	34,792,954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)	2,039,781,876円	2,251,602,428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)	19,706,377円	48,792,647円
	計	2,093,872,199円	2,335,188,029円
2.	受益権の総数	2,093,872,199口	2,335,188,029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28年 6月28日 至 平成28年12月26日	自 平成28年12月27日 至 平成29年 6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12月26日現在	平成29年 6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

（平成29年 6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	16,324,031
合計	16,324,031

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（平成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

（平成29年 6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	4,660,699	-	4,657,330	3,369
	チェココルナ	2,757,135	-	2,753,940	3,195
	タイバーツ	1,903,564	-	1,903,390	174
合計		4,660,699	-	4,657,330	3,369

（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12月26日現在		平成29年 6月26日現在	
1口当たり純資産額	1.2333円	1口当たり純資産額	1.2996円
(1万口当たり純資産額)	(12,333円)	(1万口当たり純資産額)	(12,996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
アルゼンチンペソ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA-18.2%-21/10/03	2,000,000.00	2,116,656.00	
		REPUBLIC OF ARGENTINA-16.0%-23/10/17	1,200,000.00	1,284,533.28	
		REPUBLIC OF ARGENTINA-15.5%-26/10/17	1,900,000.00	2,092,718.14	
アルゼンチンペソ小計			5,100,000.00	5,493,907.42 (37,798,083)	
メキシコペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-18/12/13	4,260,000.00	4,367,831.24	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11	4,570,000.00	4,415,762.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	4,180,000.00	4,349,812.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	5,850,000.00	5,850,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	3,350,000.00	3,348,953.12	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	1,830,000.00	1,963,659.54	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	4,910,000.00	5,882,793.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%-26/03/05	3,200,000.00	3,008,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	2,130,000.00	2,255,005.44	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	1,860,000.00	2,122,725.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	2,550,000.00	2,755,593.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-34/11/23	2,000,000.00	2,174,600.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	1,180,000.00	1,553,543.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	1,490,000.00	1,729,517.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	4,000,000.00	4,314,800.00	
MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	700,000.00	778,277.50			
メキシコペソ小計			48,060,000.00	50,870,875.59 (314,890,719)	
ブラジルレアル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL-10.25%-28/01/10	250,000.00	263,750.00	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-18/10/01	550,000.00	493,625.00	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-19/01/01	1,110,000.00	974,358.00	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-19/04/01	1,100,000.00	943,140.00	

		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-19/07/01	600,000.00	501,900.00	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-20/01/01	950,000.00	753,635.00	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-20/07/01	1,690,000.00	1,269,866.00	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-19/01/01	200,000.00	202,931.85	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-21/01/01	900,000.00	898,433.32	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-23/01/01	1,200,000.00	1,181,231.10	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-25/01/01	890,000.00	865,310.72	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-27/01/01	350,000.00	337,560.73	
ブラジルリアル小計			9,790,000.00	8,685,741.72	(289,148,341)
チリペソ	国債証券	REPUBLIC OF CHILE-5.5%-20/08/05	265,000,000.00	282,238,621.00	
チリペソ小計			265,000,000.00	282,238,621.00	(47,472,536)
コロンビアペソ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA-7.75%-21/04/14	60,000,000.00	64,177,764.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA-4.375%-23/03/21	30,000,000.00	28,026,832.50	
		REPUBLIC OF COLOMBIA-9.85%-27/06/28	97,000,000.00	125,933,475.25	
		TITULOS DE TESORERIA B-5.0%-18/11/21	340,000,000.00	340,763,300.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-19/09/11	437,000,000.00	451,761,860.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-11.0%-20/07/24	625,000,000.00	719,625,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-22/05/04	775,000,000.00	810,293,500.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-10.0%-24/07/24	865,000,000.00	1,056,502,350.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.5%-26/08/26	930,000,000.00	999,722,100.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-6.0%-28/04/28	450,000,000.00	429,102,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.75%-30/09/18	505,000,000.00	553,611,300.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-32/06/30	250,000,000.00	253,207,500.00	
コロンビアペソ小計			5,364,000,000.00	5,832,726,981.75	(214,644,352)
ペルーヌエボソル	国債証券	BONOS DE TESORERIA-5.7%-24/08/12	280,000.00	291,577.72	
		BONOS DE TESORERIA-6.35%-28/08/12	610,000.00	649,747.29	
		PERU BONO SOBERANO-7.84%-20/08/12	125,000.00	138,904.75	
		PERU BONO SOBERANO-8.2%-26/08/12	290,000.00	348,448.34	
		PERU BONO SOBERANO-6.95%-31/08/12	360,000.00	398,071.62	

		PERU BONO SOBERANO-6.9%-37/08/12	200,000.00	218,358.10	
ペルーヌエボソル小計			1,865,000.00	2,045,107.82	(69,881,334)
トルコリラ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND-8.7%-18/07/11	360,000.00	351,990.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.8%-18/11/14	520,000.00	505,960.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.4%-19/03/27	240,000.00	238,680.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.5%-19/07/10	480,000.00	461,040.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.5%-20/01/15	345,000.00	344,827.50	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-7.4%-20/02/05	460,000.00	427,340.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.4%-20/07/08	450,000.00	437,175.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.7%-21/02/17	610,000.00	613,660.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.2%-21/09/22	580,000.00	555,495.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.5%-22/01/12	330,000.00	319,027.50	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-11.0%-22/03/02	100,000.00	102,127.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.5%-22/09/14	360,000.00	334,170.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-7.1%-23/03/08	510,000.00	441,915.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.8%-23/09/27	470,000.00	439,685.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.4%-24/03/20	270,000.00	272,835.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.0%-24/07/24	430,000.00	405,490.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.0%-25/03/12	470,000.00	417,242.50	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.6%-26/02/11	710,000.00	727,224.60	
TURKEY GOVERNMENT BOND-11.0%-27/02/24	210,000.00	220,815.00			
トルコリラ小計			7,905,000.00	7,616,699.10	(242,211,031)
チェココルナ	国債証券	CZECH REPUBLIC-1.5%-19/10/29	1,680,000.00	1,748,258.40	
		CZECH REPUBLIC-3.75%-20/09/12	1,550,000.00	1,742,959.50	
		CZECH REPUBLIC-3.85%-21/09/29	1,540,000.00	1,793,330.00	
		CZECH REPUBLIC-4.7%-22/09/12	1,270,000.00	1,585,779.15	
		CZECH REPUBLIC-5.7%-24/05/25	1,820,000.00	2,516,322.90	
		CZECH REPUBLIC-2.4%-25/09/17	1,800,000.00	2,053,899.00	
		CZECH REPUBLIC-1.0%-26/06/26	900,000.00	918,207.00	
		CZECH REPUBLIC-2.5%-28/08/25	1,270,000.00	1,475,003.40	
		CZECH REPUBLIC-0.95%-30/05/15	610,000.00	598,904.10	
チェココルナ小計			12,440,000.00	14,432,663.45	(68,410,824)

ハンガリーフォリント	国債証券	HUNGARY GOVERNMENT BOND-5.5%-18/12/20	9,500,000.00	10,256,352.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.5%-19/06/24	28,300,000.00	31,837,471.70	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.0%-19/10/30	21,000,000.00	21,836,997.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.5%-20/06/24	28,000,000.00	30,413,656.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-7.5%-20/11/12	27,200,000.00	33,253,237.60	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.5%-21/10/27	25,000,000.00	26,358,437.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-7.0%-22/06/24	31,800,000.00	40,160,379.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.0%-23/11/24	31,000,000.00	38,324,308.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-24/06/26	23,000,000.00	24,022,235.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-5.5%-25/06/24	39,800,000.00	48,048,908.20	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-27/10/27	14,500,000.00	14,607,336.25	
ハンガリーフォリント小計			279,100,000.00	319,119,318.25	(128,381,701)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-18/07/25	640,000.00	646,048.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-18/10/25	720,000.00	703,944.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-19/04/25	200,000.00	193,265.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-19/07/25	600,000.00	616,110.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	390,000.00	421,102.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.5%-20/04/25	750,000.00	737,625.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	360,000.00	394,470.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25	710,000.00	699,776.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-21/07/25	820,000.00	797,245.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	450,000.00	510,165.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-22/04/25	500,000.00	491,462.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	610,000.00	701,866.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	660,000.00	705,045.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	780,000.00	791,583.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	870,000.00	827,239.50	
POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	520,000.00	487,864.00			
ポーランドズロチ小計			9,580,000.00	9,724,810.50	(286,979,157)
ロシアルーブル	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.5%-19/02/27	5,300,000.00	5,270,850.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.7%-19/05/15	7,200,000.00	7,059,600.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.8%-19/12/11	5,000,000.00	4,882,500.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.4%-20/05/27	5,100,000.00	4,908,750.00	

		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.6%-21/04/14	5,300,000.00	5,249,650.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.5%-21/08/18	9,300,000.00	9,180,960.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.6%-22/07/20	4,800,000.00	4,761,600.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.4%-22/12/07	6,500,000.00	6,392,750.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.0%-23/01/25	5,400,000.00	5,211,000.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.0%-23/08/16	8,300,000.00	8,005,350.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.75%-26/09/16	9,200,000.00	9,209,200.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-8.15%-27/02/03	9,000,000.00	9,373,500.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.05%-28/01/19	8,200,000.00	7,826,900.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-8.5%-31/09/17	7,450,000.00	7,919,350.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.7%-33/03/23	3,300,000.00	3,257,925.00	
ロシアルーブル小計			99,350,000.00	98,509,885.00	(184,213,484)
ルーマニア アレイ	国債証券	ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.6%-18/11/28	290,000.00	308,687.60	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-2.5%-19/04/29	240,000.00	245,101.20	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.75%- 19/06/24	260,000.00	277,460.30	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-2.25%- 20/02/26	235,000.00	238,174.85	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.75%- 20/04/29	250,000.00	277,513.75	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.25%- 21/03/22	320,000.00	332,364.80	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.95%- 21/06/11	270,000.00	307,957.95	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.5%-22/12/19	280,000.00	290,231.20	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.85%- 23/04/26	230,000.00	267,163.40	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.75%- 25/02/24	280,000.00	306,063.80	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.8%-27/07/26	190,000.00	223,402.95	
ルーマニアアレイ小計			2,845,000.00	3,074,121.80	(83,862,042)
マレーシ アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.759%-19/03/15	220,000.00	221,662.32	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.654%-19/10/31	410,000.00	412,255.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.659%-20/10/15	400,000.00	401,006.80	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	450,000.00	456,892.65	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.62%-21/11/30	180,000.00	179,533.98	

		MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	360,000.00	359,469.72	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	350,000.00	348,818.75	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	400,000.00	399,144.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	350,000.00	349,597.15	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	200,000.00	195,067.20	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.743%- 21/08/26	240,000.00	239,689.68	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.39%- 23/07/07	400,000.00	409,600.40	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.07%- 26/09/30	380,000.00	378,746.76	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.58%-18/09/28	350,000.00	351,330.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	580,000.00	592,668.36	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.492%-20/03/31	310,000.00	309,937.69	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	450,000.00	458,305.65	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	360,000.00	354,747.60	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	340,000.00	333,449.56	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	380,000.00	386,649.62	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	360,000.00	363,600.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	460,000.00	451,777.50	
		マレーシアリングット小計	7,930,000.00	7,953,950.39 (206,484,552)	
タイバー ツ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND-3.45%- 19/03/08	2,900,000.00	2,995,053.30	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.875%- 19/06/13	10,150,000.00	10,616,199.65	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.55%- 20/06/26	6,100,000.00	6,270,970.80	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.65%- 21/12/17	10,220,000.00	11,040,144.78	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-1.875%- 22/06/17	5,800,000.00	5,797,152.20	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.625%- 23/06/16	6,600,000.00	7,175,282.40	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.85%- 25/12/12	6,570,000.00	7,350,437.16	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.125%- 26/12/17	2,700,000.00	2,637,589.50	

		THAILAND GOVERNMENT BOND-4.875%- 29/06/22	7,580,000.00	9,291,192.58	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.4%- 36/06/17	3,000,000.00	3,185,997.00	
タイバーツ小計			61,620,000.00	66,360,019.37 (217,660,863)	
フィリピン	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES-4.95%- 21/01/15	5,000,000.00	5,212,500.00	
フィリピンペソ小計			5,000,000.00	5,212,500.00 (11,571,750)	
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT-7.875%-19/04/15	1,600,000,000.00	1,645,720,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-20/11/15	500,000,000.00	566,672,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-12.8%-21/06/15	500,000,000.00	606,902,500.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-21/07/15	2,630,000,000.00	2,771,362,500.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-22/05/15	1,650,000,000.00	1,673,925,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-5.625%-23/05/15	1,150,000,000.00	1,082,500,750.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-24/03/15	3,450,000,000.00	3,751,512,750.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-25/09/15	760,000,000.00	958,124,400.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-26/09/15	3,290,000,000.00	3,638,740,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-27/05/15	2,000,000,000.00	2,025,000,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.125%-28/05/15	800,000,000.00	743,425,600.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.0%-29/03/15	2,350,000,000.00	2,680,250,200.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-10.5%-30/08/15	810,000,000.00	1,027,089,720.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.75%-31/05/15	1,600,000,000.00	1,804,800,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.5%-31/07/15	820,000,000.00	966,557,780.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-32/06/15	1,100,000,000.00	1,164,565,600.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.5%-32/08/15	500,000,000.00	506,500,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.625%-33/05/15	1,280,000,000.00	1,181,821,440.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-34/03/15	2,600,000,000.00	2,802,800,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-36/05/15	1,960,000,000.00	2,100,630,000.00	
		PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-8.25%- 20/09/15	750,000,000.00	783,117,000.00	
		PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-8.875%- 31/11/15	590,000,000.00	646,688,380.00	
インドネシア小計			32,690,000,000.00	35,128,705,620.00 (295,081,127)	

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	1,209,723.18	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	1,400,000.00	1,394,228.92	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	1,290,000.00	1,256,931.62	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	1,750,000.00	1,735,557.42	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	4,800,000.00	5,412,876.96	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	2,530,000.00	2,327,793.29	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	2,540,000.00	2,117,848.19	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	1,850,000.00	1,701,438.06	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	1,600,000.00	1,518,965.28	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	2,190,000.00	1,582,145.79	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	2,410,000.00	2,186,980.52	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%- 40/01/31	1,120,000.00	1,058,088.64	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	2,040,000.00	1,461,539.13	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	2,080,000.00	1,901,212.03	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	3,790,000.00	3,469,840.69			
南アフリカランド小計			32,590,000.00	30,335,169.72	(261,489,162)
合計				2,960,181,058	(2,960,181,058)

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

アルゼンチンペソ	国債証券	3銘柄	100.0%	1.3%
メキシコペソ	国債証券	16銘柄	100.0%	10.5%
ブラジルリアル	国債証券	12銘柄	100.0%	9.8%
チリペソ	国債証券	1銘柄	100.0%	1.6%
コロンビアペソ	国債証券	12銘柄	100.0%	7.3%
ペルーヌエボソル	国債証券	6銘柄	100.0%	2.4%
トルコリラ	国債証券	19銘柄	100.0%	8.2%
チェココルナ	国債証券	9銘柄	100.0%	2.3%
ハンガリーフォリント	国債証券	11銘柄	100.0%	4.3%
ポーランドズロチ	国債証券	16銘柄	100.0%	9.7%
ロシアルーブル	国債証券	15銘柄	100.0%	6.2%
ルーマニアレイ	国債証券	11銘柄	100.0%	2.8%
マレーシアリングット	国債証券	22銘柄	100.0%	7.0%
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%	0.4%
インドネシアアルピア	国債証券	22銘柄	100.0%	10.0%
南アフリカランド	国債証券	15銘柄	100.0%	8.8%

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。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2017年 6月30日現在です。

【全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型】

【純資産額計算書】

資産総額	230,615,423円
負債総額	149,971円
純資産総額(-)	230,465,452円
発行済口数	233,589,295口
1口当たり純資産額(/)	0.9866円

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	27,816,675,777円
負債総額	38,476,335円
純資産総額(-)	27,778,199,442円
発行済口数	19,645,540,255口
1口当たり純資産額(/)	1.4140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	79,122,692,431円
負債総額	92,220,019円
純資産総額(-)	79,030,472,412円
発行済口数	35,849,747,504口
1口当たり純資産額(/)	2.2045円

海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし)マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	12,408,311,064円
負債総額	14,842,618円
純資産総額（ - ）	12,393,468,446円
発行済口数	7,361,173,727口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6836円

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	36,670,364,616円
負債総額	260,433,341円
純資産総額（ - ）	36,409,931,275円
発行済口数	26,354,098,103口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3816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	158,128,656,822円
負債総額	141,186,428円
純資産総額（ - ）	157,987,470,394円
発行済口数	70,635,840,410口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2366円

海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	3,111,644,577円
負債総額	20,488,765円
純資産総額（ - ）	3,091,155,812円
発行済口数	2,366,140,453口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3064円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

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

いものとしてします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

平成29年6月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（平成29年6月末現在）

・株主総会

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

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

・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。

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

・監査役会

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

(3) 運用の意思決定プロセス（平成29年6月末現在）

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

2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、平成29年6月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	730	143,519

株式投資信託	684	117,396
単位型	197	8,211
追加型	487	109,184
公社債投資信託	46	26,123
単位型	32	341
追加型	14	25,781

3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。)並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第58期事業年度(平成28年4月1日から平成29年3月31日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位:百万円)

	第57期 (平成28年3月31日)		第58期 (平成29年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	14,308	3	16,761
金銭の信託	3	153	3	152
有価証券		86		10
前払費用	3	489		506
未収入金		10		136
未収委託者報酬		9,374		10,757
未収収益	3	2,280	3	2,799
関係会社短期貸付金		5,333		962
立替金		2,960		1,240
繰延税金資産		819		865
その他	2,3	428	2,3	385
流動資産合計		36,243		34,577
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	146	1	93
器具備品	1	210	1	190
有形固定資産合計		356		283
無形固定資産				
ソフトウェア		140		138
無形固定資産合計		140		138
投資その他の資産				
投資有価証券		12,195		11,783
関係会社株式		21,702		23,203
関係会社長期貸付金		60		60

長期差入保証金	781	782
長期前払費用	0	0
繰延税金資産	425	423
投資その他の資産合計	35,165	36,253
固定資産合計	35,662	36,674
資産合計	71,905	71,252

(単位：百万円)

	第57期 (平成28年3月31日)		第58期 (平成29年3月31日)	
負債の部				
流動負債				
預り金	410	3	589	
未払金	3,841		4,043	
未払収益分配金	6		7	
未払償還金	112		91	
未払手数料	3	3,269	3	3,499
その他未払金		453		445
未払費用	3	4,920	3	4,229
未払法人税等		354		1,808
未払消費税等	4	649	4	538
関係会社短期借入金		5,631		-
賞与引当金		2,080		2,077
役員賞与引当金		145		168
その他	3	278	3	62
流動負債合計		18,312		13,517
固定負債				
退職給付引当金		1,154		1,259
固定負債合計		1,154		1,259
負債合計		19,466		14,777
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		29,948		34,015
利益剰余金合計		29,948		34,015
自己株式		502		672
株主資本合計		52,028		55,926
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		151		282
繰延ヘッジ損益		258		266

評価・換算差額等合計	410	548
純資産合計	52,438	56,475
負債純資産合計	71,905	71,252

(2)【損益計算書】

(単位：百万円)

	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	66,339	64,680
その他営業収益	4,382	4,218
営業収益合計	70,722	68,898
営業費用		
支払手数料	30,529	28,675
広告宣伝費	1,098	969
公告費	3	2
調査費	17,470	17,322
調査費	821	841
委託調査費	16,600	16,456
図書費	48	24
委託計算費	505	498
営業雑経費	718	656
通信費	195	185
印刷費	321	276
協会費	65	66
諸会費	22	17
その他	113	111
営業費用計	50,327	48,124
一般管理費		
給料	8,138	8,243
役員報酬	365	360
役員賞与引当金繰入額	145	168
給料・手当	5,495	5,576
賞与	51	61
賞与引当金繰入額	2,080	2,077
交際費	185	99
寄付金	27	17
旅費交通費	503	412
租税公課	258	375
不動産賃借料	875	889
退職給付費用	372	390
退職金	113	20
固定資産減価償却費	196	192
福利費	952	959
諸経費	2,952	2,791
一般管理費計	14,577	14,394
営業利益	5,817	6,380

(単位：百万円)

	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
	営業外収益			
受取利息		91		19
受取配当金	1	1,330	1	1,644
時効成立分配金・償還金		1		22
為替差益		32		177
その他		32		36
営業外収益合計		1,488		1,899
営業外費用				
支払利息	1	242	1	223
有価証券償還損		-		7
デリバティブ費用	1	69	1	146
時効成立後支払分配金・償還金		5		2
支払源泉所得税		119		155
その他		94		73
営業外費用合計		531		608
経常利益		6,774		7,670
特別利益				
投資有価証券売却益		720		174
その他		0		-
特別利益合計		720		174
特別損失				
投資有価証券売却損		100		120
固定資産処分損		6		13
特別賞与		204		-
割増退職金		91		-
役員退職一時金		64		-
特別損失合計		467		134
税引前当期純利益		7,027		7,710
法人税、住民税及び事業税		1,359		2,137
過年度法人税等		-	2	115
法人税等調整額		706		104
法人税等合計		2,065		2,147
当期純利益		4,962		5,562

(3) 【株主資本等変動計算書】

第57期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己 株式	
		資本 準備金	資本 剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	25,836	25,836	68	48,351
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
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

第58期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						自己 株式	株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				
		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	
当期変動額								
剰余金の配当				1,495	1,495		1,495	
当期純利益				5,562	5,562		5,562	
自己株式の取得						170	170	
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）								
当期変動額合計	-	-	-	4,067	4,067	170	3,897	
当期末残高	17,363	5,220	5,220	34,015	34,015	672	55,926	

	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
当期変動額				
剰余金の配当				1,495
当期純利益				5,562

自己株式の取得				170
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	130	7	138	138
当期変動額合計	130	7	138	4,036
当期末残高	282	266	548	56,475

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(2) 金銭の信託 時価法</p> <p>(3) デリバティブ 時価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 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)

<p>第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)</p>	
<p>(減価償却方法)</p> <p>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)を当事業年度に適用し、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。</p> <p>この結果、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。</p>	

(追加情報)

<p>第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31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)を当事業年度から適用しております。</p>	

(貸借対照表関係)

第57期 (平成28年3月31日)		第58期 (平成29年3月31日)	
1	<p>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>	1	<p>有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,222百万円</p> <p>器具備品 603百万円</p>
2	<p>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>	2	<p>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 border="0"> <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 border="0"> <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</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務728百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソンタワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務689百万円に対して保証を行っております。</p>	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	<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 border="0"> <tr><td>現金・預金</td><td style="text-align: right;">3,243百万円</td></tr> <tr><td>金銭の信託</td><td style="text-align: right;">152百万円</td></tr> <tr><td>未収収益</td><td style="text-align: right;">619百万円</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">20百万円</td></tr> </table> <p>(流動負債)</p> <table border="0"> <tr><td>預り金</td><td style="text-align: right;">177百万円</td></tr> <tr><td>未払手数料</td><td style="text-align: right;">144百万円</td></tr> <tr><td>未払費用</td><td style="text-align: right;">251百万円</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">61百万円</td></tr> </table> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務587百万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546百万円に対して保証を行っております。</p>	現金・預金	3,243百万円	金銭の信託	152百万円	未収収益	619百万円	その他	20百万円	預り金	177百万円	未払手数料	144百万円	未払費用	251百万円	その他	61百万円
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																																
現金・預金	3,243百万円																																
金銭の信託	152百万円																																
未収収益	619百万円																																
その他	20百万円																																
預り金	177百万円																																
未払手数料	144百万円																																
未払費用	251百万円																																
その他	61百万円																																

(損益計算書関係)

第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29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 border="0"> <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	<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 border="0"> <tr><td>受取配当金</td><td style="text-align: right;">1,550百万円</td></tr> <tr><td>デリバティブ収益</td><td style="text-align: right;">347百万円</td></tr> <tr><td>支払利息</td><td style="text-align: right;">58百万円</td></tr> </table> <p>2 過年度の取引に関する法人税等の追加費用計上額です。</p>	受取配当金	1,550百万円	デリバティブ収益	347百万円	支払利息	58百万円
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												
受取配当金	1,550百万円												
デリバティブ収益	347百万円												
支払利息	58百万円												

(株主資本等変動計算書関係)

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

第58期（自 平成28年4月1日 至 平成29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)	814,100	305,000	-	1,119,100

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	1,762,200	-	72,600	1,689,600	-
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	-	1,848,000	2,890,800	-
平成28年度 ストックオプション(1)	普通株式	-	4,437,000	33,000	4,404,000	-
合計		6,675,900	4,437,000	1,953,600	9,159,300	-

- (注) 1 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。
 2 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
 3 平成21年度ストックオプション(1)1,689,600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)2,890,800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。また、平成28年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来していません。

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29年5月25日 取締役会	普通株式	利益剰余金	1,036	5.29	平成29年3月31日	平成29年6月22日

(リース取引関係)

第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29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	865百万円	1年内	865百万円
1年超	2,653百万円	1年超	1,787百万円
合計	3,518百万円	合計	2,653百万円

(金融商品関係)

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、自社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ードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、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てい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ているもののうち193百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、23百万円は流動負債のその他に含まれております。

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

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

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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、自社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ードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、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29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	16,761	16,761	-
(2) 未収委託者報酬	10,757	10,757	-
(3) 未収収益	2,799	2,799	-
(4) 関係会社短期貸付金	962	962	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	11,777	11,777	-
(6) 未払金	(4,043)	(4,043)	-
(7) 未払費用	(4,229)	(4,229)	-
(8) 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	35	35	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(1)	(1)	-
デリバティブ取引計	34	34	-

(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) 未払金及び(7) 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。

(8) 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ていないもののうち75百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、39百万円は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ているもののうち20百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、22百万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20,310百万円)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	16,761	-	-	-
未収委託者報酬	10,757	-	-	-
未収収益	2,799	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	10	616	907	735

合計	30,328	616	907	735
----	--------	-----	-----	-----

(有価証券関係)

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

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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	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	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	6,299	5,590	708
	小計	6,299	5,590	708
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	5,478	5,780	302
	小計	5,478	5,780	302
合計		11,777	11,370	406

(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
投資信託	3,198	174	120
合計	3,198	174	120

(デリバティブ取引関係)

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)
為替予約取引					

市場取引以外の取引	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。

第58期(平成29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	1,729	-	35	35
	買建	-	-	-	-
合計		1,729	-	35	35

(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				
	米ドル		2,993	-	11
	豪ドル		77	-	2

原則的処理 方法	シンガポールドル	投資有価証券	1,639	-	20
	香港ドル		205	-	2
	人民元		1,946	-	6
	ユーロ		57	-	0
	合計		6,920	-	1

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第57期 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	第58期 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29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 3,037	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,030
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 9,686	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 9,455
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,901	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,092

(退職給付関係)

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
勤務費用	145
利息費用	7
数理計算上の差異の発生額	33
退職給付の支払額	119
退職給付債務の期末残高	1,299

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.2%

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、209百万円でありました。

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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	1,299
勤務費用	150
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	190
退職給付の支払額	72
<u>退職給付債務の期末残高</u>	<u>1,190</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	1,190
未積立退職給付債務	1,190
未認識数理計算上の差異	69
<u>貸借対照表に計上された負債の額</u>	<u>1,259</u>

退職給付引当金	1,259
<u>貸借対照表に計上された負債の額</u>	<u>1,259</u>

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	150
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	23
<u>確定給付制度に係る退職給付費用</u>	<u>177</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、213百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション(新株予約権)の数

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

権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

- 2 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 - 百万円
- 3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するよう調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第58期(自 平成28年 4 月 1 日 至 平成29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23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の取締役・従業員 186名	当社及び関係会社の取締役・従業員 16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 6,101,700株	普通株式 4,437,000株
付与日	平成23年10月7日	平成28年7月15日
権利確定条件	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。	平成30年7月15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3分の1、3分の1、3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25年10月7日から平成33年10月6日まで	平成30年7月15日から平成38年7月31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	1,762,200	174,900
付与	0	0
失効	72,600	0
権利確定	0	0
権利未確定残	1,689,600	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23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与日	平成23年10月7日	平成28年7月15日
権利確定前(株)		
期首	4,738,800	-
付与	0	4,437,000
失効	1,848,000	33,000
権利確定	0	0
権利未確定残	2,890,800	4,404,000
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23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与日	平成23年10月7日	平成28年7月15日
権利行使価格(円)	737 (注)3	558
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（取引事例比準法等による評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。

- 2 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 - 百万円
- 3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するよう調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

(税効果会計関係)

第57期 (平成28年3月31日)	第58期 (平成29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;">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%;">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%;">繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 1px solid 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	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	繰延税金資産の純額	1,244	<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;">641</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">224</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">865</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;">385</td> </tr> <tr> <td>固定資産減価償却費</td> <td style="text-align: right;">119</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">63</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,095</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産小計</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">評価性引当金</td> <td style="text-align: right;">1,430</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,530</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;">0</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">0</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;">123</td> </tr> <tr> <td>繰延ヘッジ利益</td> <td style="text-align: right;">117</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">241</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%;">繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 1px solid black;">1,288</td> </tr> </table>	賞与引当金	641	その他	224	小計	865	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	385	固定資産減価償却費	119	その他	63	小計	2,095	評価性引当金	1,430	繰延税金資産合計	1,530	その他有価証券評価差額金	0	小計	0	その他有価証券評価差額金	123	繰延ヘッジ利益	117	小計	241	繰延税金資産の純額	1,288
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																																																																		
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																																																																		
繰延税金資産の純額	1,244																																																																		
賞与引当金	641																																																																		
その他	224																																																																		
小計	865																																																																		
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	385																																																																		
固定資産減価償却費	119																																																																		
その他	63																																																																		
小計	2,095																																																																		
評価性引当金	1,430																																																																		
繰延税金資産合計	1,530																																																																		
その他有価証券評価差額金	0																																																																		
小計	0																																																																		
その他有価証券評価差額金	123																																																																		
繰延ヘッジ利益	117																																																																		
小計	241																																																																		
繰延税金資産の純額	1,288																																																																		
<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 (調整)</td> <td style="text-align: right;">33.1%</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 (調整)	33.1%	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>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 (調整)</td> <td style="text-align: right;">30.9%</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;">0.6%</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;">5.3%</td> </tr> <tr> <td>過年度法人税等</td> <td style="text-align: right;">1.5%</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;">0.2%</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;">27.9%</td> </tr> </table>	法定実効税率 (調整)	30.9%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.6%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	5.3%	過年度法人税等	1.5%	海外子会社の留保利益の影響額等	0.2%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.9%																																								
法定実効税率 (調整)	33.1%																																																																		
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 (調整)	30.9%																																																																		
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.6%																																																																		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	5.3%																																																																		
過年度法人税等	1.5%																																																																		
海外子会社の留保利益の影響額等	0.2%																																																																		
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.9%																																																																		

第57期 (平成28年3月31日)	第58期 (平成29年3月31日)
----------------------	----------------------

<p>3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」（平成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 (SGD 千)	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)	90 (SGD 1,000 千)(注2)	関係会社短期貸付金	333 (SGD 4,000 千)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	18 (SGD 215 千)	未収収益	6 (SGD 74 千)
							資金の貸付(円貸建)(注3)	5,000	関係会社短期貸付金	5,000
							貸付金利息(円貸建)(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 (USD 千)(注4)	アセットマネジメント業	間接 100.00	資金の借入	資金の借入(米ドル貸建)(注5)	6,176 (USD 50,000 千)	関係会社短期借入金	5,631 (USD 50,000 千)
							借入金利息(米ドル貸建)(注5)	113 (USD 949 千)	未払費用	106 (USD 949 千)

(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

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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	312,000(SGD千)	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)	65(SGD800千)(注2)	関係会社短期貸付金	385(SGD4,800千)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	13(SGD177千)	未収収益	8(SGD105千)
							資金の貸付(円貸建)(注3)	4,422(注4)	関係会社短期貸付金	577
							貸付金利息(円貸建)(注3)	3	未収収益	3

						-	増資の引受 (注5)	1,501 (SGD 20,000 千)	-	-
子会社	Nikko Asset Management Americas, Inc.	アメリ カ 合衆国	181,542 (USD 千) (注6)	アセット マネジメ ント業	間接 100.00	資金の 借入	資金の借入 (米ドル貸建) (注7)	5,549 (USD 50,000 千) (注8)	関係会社 短期借入 金	-
							借入金利息 (米ドル貸建) (注7)	48 (USD 453 千)	未払費用	-

(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65百万円 (SGD800千) の内訳は、貸付505百万円 (SGD6,600千) 及び返済439百万円 (SGD5,800千) 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 資金の貸付に係る取引金額 4,422百万円の内訳は、貸付577百万円及び返済5,000百万円であります。
- 5 Nikko Asset Management International Limitedの行った20,000,000株の新株発行増資を、1株につき1シンガポールドルで当社が引受けたものであります。
- 6 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。
- 7 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。
- 8 資金の借入に係る取引金額 5,549百万円 (USD 50,000千) は、返済であります。

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28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	25,221百万円
負債合計	5,428百万円
純資産合計	19,792百万円
営業収益	18,250百万円
税引前当期純利益	6,809百万円
当期純利益	4,680百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

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。

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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せん。

(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58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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せん。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第57期(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。

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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。

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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。

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	267円27銭	288円29銭
1株当たり当期純利益金額	25円25銭	28円38銭

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
当期純利益(百万円)	4,962	5,562
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)	4,962	5,562
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,464	196,009
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) 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	平成21年度ストックオプション(1) 1,689,600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) 2,890,800株、平成28年度ストックオプション(1) 4,404,000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57期 (平成28年3月31日)	第58期 (平成29年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	52,438	56,475
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)	52,438	56,475
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)	196,198	195,893

(重要な後発事象)

新株予約権(ストックオプション)の付与

当社は平成29年3月15日付の臨時株主総会及び平成29年3月22日開催の取締役会の決議に基づき、平成29年4月27日にストックオプションとして新株予約権を当社、当社子会社の取締役及び従業員31

名に付与いたしました。

新株予約権の数	4,409個
新株予約権の目的となる株式の種類及び数	当社普通株式 4,409,000株
新株予約権の発行価額	無償
新株予約権の行使時の払込金額	1株当たり金553円
新株予約権の行使期間	平成31年4月27日から平成39年4月30日まで

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更
委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (平成29年3月末現在)	事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (平成29年3月末現在)	事業の内容
農林中央金庫	3,480,488百万円 (平成28年9月末現在)	全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
日興アセットマネジメント株式会社	17,363百万円	証券投資信託の設定を行なうとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用(投資運用業)を行なっています。また金融商品取引法に定める投資助言業務を行なっています。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

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

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

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

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

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

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。

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

「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。

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

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

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

「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

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

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。

有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。

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

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

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

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

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

独立監査人の監査報告書

平成29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29年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成29年7月26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12月27日から平成29年6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29年6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。