

## 【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成30年3月23日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 柴田 拓美
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

有価証券報告書を提出しましたので平成29年 9月26日付をもって提出しました有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出します。

## 2【訂正の内容】

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

<更新後>

ファンドの特色

#### **1 日本、海外先進国および新興国の経済規模に応じた資産配分を行ないます。**

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

#### **2 資産の安定成長をめざすため、株式と債券に分散投資を行ないます。**

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

#### **3 毎月安定的な分配を行なうことをめざします。**

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

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

## 1 日本・海外先進国・新興国の経済規模に応じた資産配分を行ないます。

各地域の資産配分比率は各地域のGDP比率に基づいて決定します。



【各地域のGDP比率】  
（IMFの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12月末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50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、ウルグアイ
  - 【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、バキスタン
  - 【アフリカ】 エジプト、南アフリカ
- (27の国と地域)

● 上図は2017年12月末現在の当ファンドが連動をめざす各指数をもとに作成した投資対象国・地域であり、将来変更になる可能性があります。

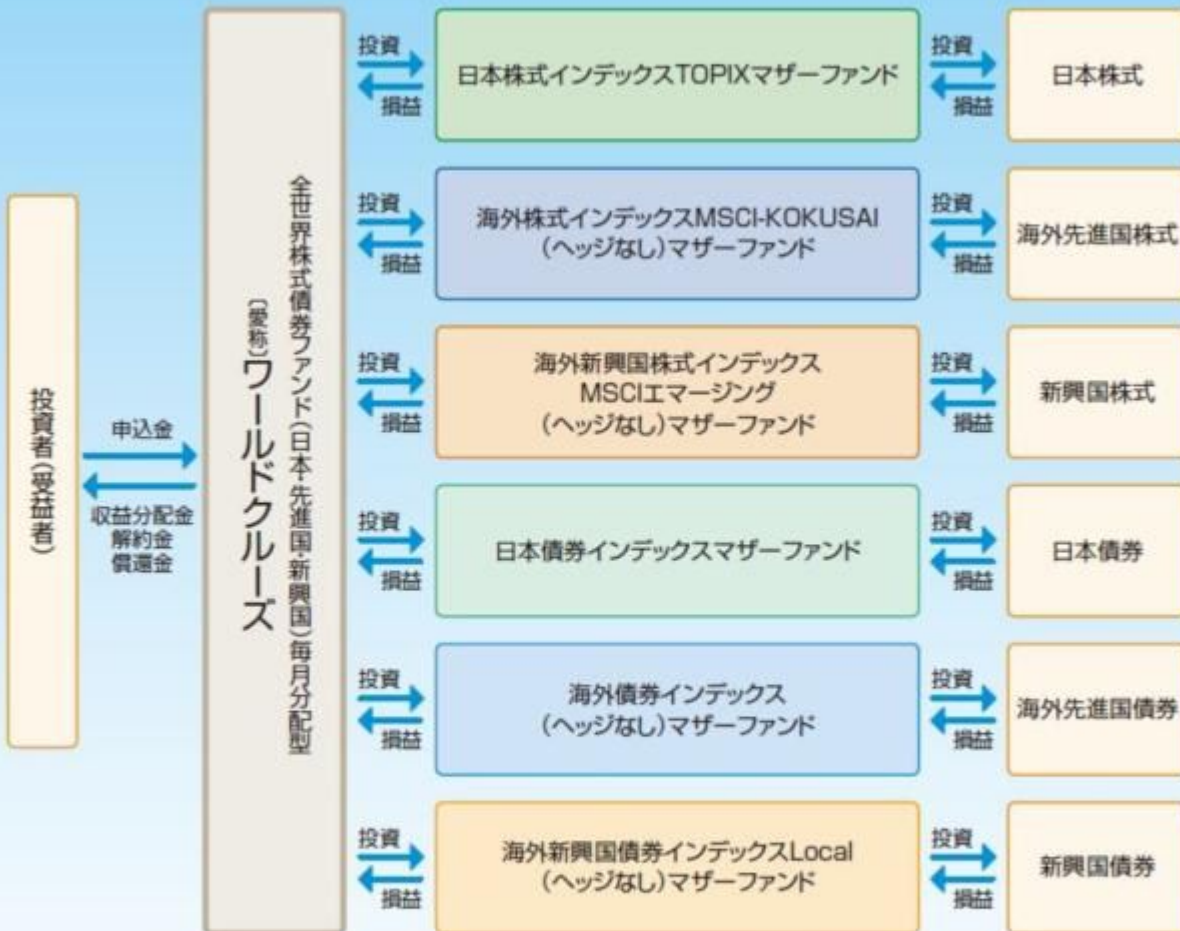
## (参考)グローバル分散投資の意義 ～ワールドクルーズをめざすもの～

世界の経済成長に伴なう

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

## ファンドの仕組み

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



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

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

## 収益分配金に関する留意事項

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

### 投資信託で分配金が支払われるイメージ



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

### 計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。  
※ 上記はイメージであり、将来の分配金の支払いおよび金額ならびに基準価額について示唆、保証するものではありません。

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

#### 分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



#### 分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

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

### (3) 【ファンドの仕組み】

< 更新後 >

委託会社の概況（平成29年12月末現在）

#### 1) 資本金

17,363百万円

## 2) 沿革

昭和34年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

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

## 3) 大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## (2)【投資対象】

## &lt;更新後&gt;

投資対象とするマザーファンドの概要

&lt;日本株式インデックスTOPIXマザーファンド&gt;

(略)

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

(略)

&lt;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&gt;

(略)

&lt;日本債券インデックスマザーファンド&gt;

(略)

&lt;海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド&gt;

**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、FTSE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"> <li>・主として世界各国の債券に投資し、FTSE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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>



主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 株式への投資は行ないません。</li> <li>・ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・ 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。</li> <li>・ 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。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
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。
<b>その他</b>	
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）

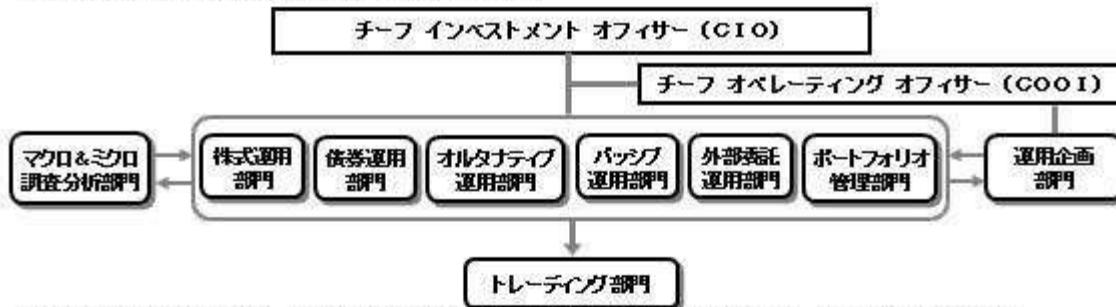
\* FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権などの知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

< 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 >  
（略）

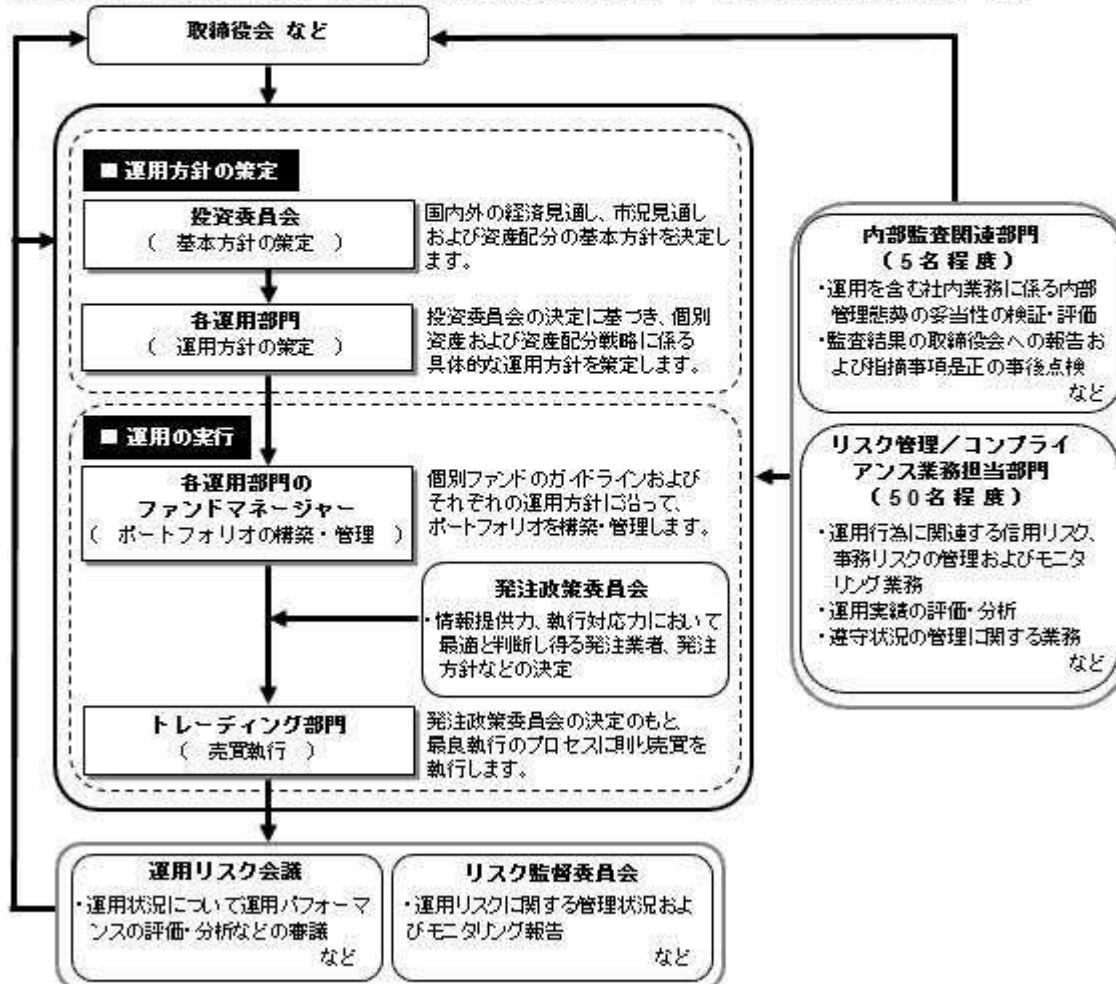
### （3）【運用体制】

< 更新後 >

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



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

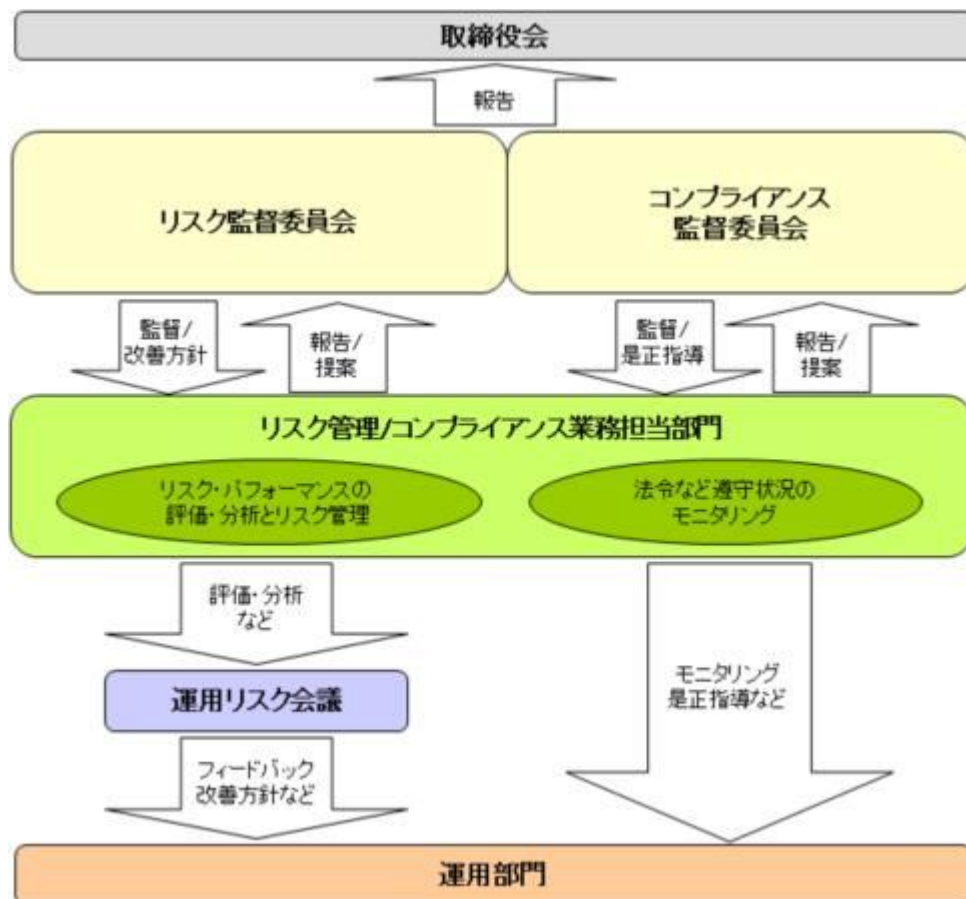
「受託会社」に対しては、日々の純資産照会、月次の勘定残高照会などを行っております。また、独立した監査法人が所定の手続きで受託業務について監査を行っており、内部統制が有効に機能している旨の監査報告書を定期的に受け取っております。

上記体制は平成29年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

### 3【投資リスク】

< 更新後 >

#### (2) リスク管理体制



### 全社リスク管理

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

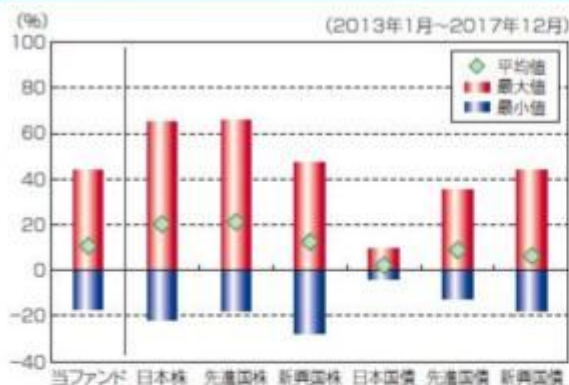
運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は平成29年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

< 更新後 >

## (参考情報)

## 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	10.7%	20.3%	21.2%	12.5%	2.3%	9.0%	6.4%
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2013年1月から2017年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

## &lt;各資産クラスの指数&gt;

日本株……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

## 代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

## 東証株価指数(TOPIX、配当込)

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

## MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

## MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

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

## NOMURA-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。

## FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

当指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。当指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

## 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、2013年1月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……FTSE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・ディバースファイド(円ヘッジなし、円ベース)

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

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

### 4【手数料等及び税金】

#### （5）【課税上の取扱い】

##### <更新後>

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

##### 個人受益者の場合

##### 1) 収益分配金に対する課税

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

##### 2) 解約金および償還金に対する課税

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

<sup>\*</sup>解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益

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

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

##### 法人受益者の場合

##### 1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、15.315%（所得税のみ）の税率による源泉徴収が行なわれます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。

##### 2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

##### 個別元本

1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。

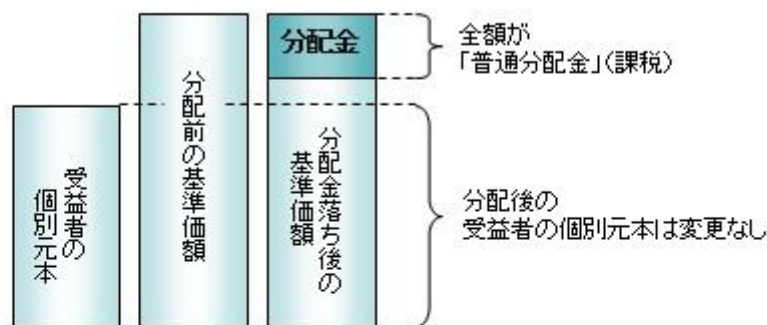
2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

## 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

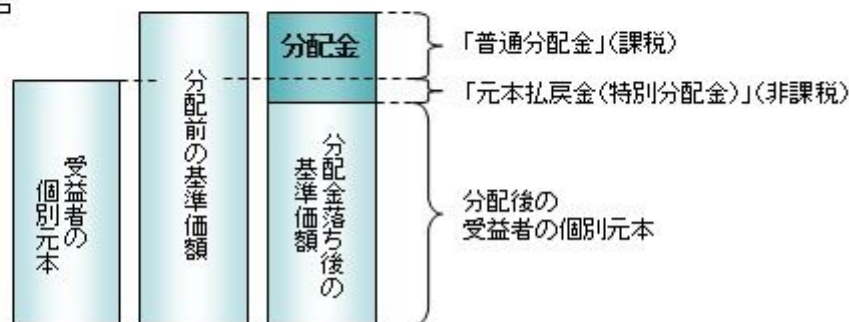
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
  - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
  - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
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

## &lt;分配金に関するイメージ図&gt;

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は平成30年 3月23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12月29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	235,606,581	98.92
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		2,573,657	1.08
合計(純資産総額)		238,180,238	100.00

## （２）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-K OKUSAI(ヘッジなし)マザー ファンド	25,992,446	2.4553	63,819,252	2.4610	63,967,409	26.86
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	27,002,128	2.3147	62,501,825	2.3241	62,755,645	26.35
日本	親投資信託受益証券	海外新興国株式インデックスMSC Iエマージング(ヘッジなし)マ ザーファンド	24,477,692	1.9361	47,391,259	1.9557	47,871,022	20.10
日本	親投資信託受益証券	海外新興国債券インデックスLoc al(ヘッジなし)マザーファンド	34,397,093	1.3580	46,711,252	1.3658	46,979,549	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	4,408,078	1.6207	7,144,172	1.6099	7,096,564	2.98
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	4,994,522	1.3894	6,939,388	1.3888	6,936,392	2.91

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.92
合計	98.92

## 【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
第20特定期間末	(2017年12月25日)	236	237	1.0478	1.0498
	2016年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	
	7月末日	230		0.9942	
	8月末日	232		1.0020	
	9月末日	234		1.0203	
	10月末日	235		1.0297	
	11月末日	235		1.0330	
	12月末日	238		1.0526	

(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
第20特定期間	2017年 6月27日～2017年12月25日	0.0120

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1特定期間	2008年 3月31日～2008年 6月25日	5.77
第2特定期間	2008年 6月26日～2008年12月25日	33.52
第3特定期間	2008年12月26日～2009年 6月25日	13.80
第4特定期間	2009年 6月26日～2009年12月25日	10.59
第5特定期間	2009年12月26日～2010年 6月25日	5.31
第6特定期間	2010年 6月26日～2010年12月27日	3.32
第7特定期間	2010年12月28日～2011年 6月27日	0.25
第8特定期間	2011年 6月28日～2011年12月26日	9.02
第9特定期間	2011年12月27日～2012年 6月25日	4.75
第10特定期間	2012年 6月26日～2012年12月25日	14.61
第11特定期間	2012年12月26日～2013年 6月25日	10.09
第12特定期間	2013年 6月26日～2013年12月25日	15.03
第13特定期間	2013年12月26日～2014年 6月25日	2.62
第14特定期間	2014年 6月26日～2014年12月25日	11.63
第15特定期間	2014年12月26日～2015年 6月25日	2.75
第16特定期間	2015年 6月26日～2015年12月25日	10.32
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
第20特定期間	2017年 6月27日～2017年12月25日	8.00

(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
第20特定期間	2017年 6月27日～2017年12月25日	7,906,032	15,927,991

(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12月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	28,960,790,400	99.67
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		96,879,027	0.33
合計（純資産総額）		29,057,669,427	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	127,190,000	0.44

(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	135,700	7,032.07	954,251,899	7,213.00	978,804,100	3.37
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	778,100	769.75	598,942,475	826.40	643,021,840	2.21
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	49,600	10,153.56	503,616,576	8,920.00	442,432,000	1.52
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	78,600	5,372.66	422,291,076	5,301.00	416,658,600	1.43
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	83,400	4,520.31	376,993,854	4,868.00	405,991,200	1.40
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	100,500	3,509.96	352,750,980	3,862.00	388,131,000	1.34
日本	株式	ソニー	電気機器	74,600	4,275.59	318,959,492	5,083.00	379,191,800	1.30
日本	株式	キーエンス	電気機器	5,500	61,980.96	340,895,280	63,120.00	347,160,000	1.19
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,496,400	204.90	306,612,360	204.60	306,163,440	1.05
日本	株式	ファナック	電気機器	10,600	25,075.00	265,795,000	27,060.00	286,836,000	0.99
日本	株式	任天堂	その他製品	6,900	42,447.10	292,884,990	41,190.00	284,211,000	0.98
日本	株式	KDDI	情報・通信業	98,700	3,021.08	298,180,596	2,804.50	276,804,150	0.95
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	41,100	6,327.03	260,040,933	6,401.00	263,081,100	0.91
日本	株式	キヤノン	電気機器	60,100	4,179.35	251,178,935	4,200.00	252,420,000	0.87
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	69,300	3,799.36	263,295,648	3,631.00	251,628,300	0.87
日本	株式	三菱商事	卸売業	77,200	2,666.15	205,826,780	3,113.00	240,323,600	0.83
日本	株式	日立製作所	電気機器	268,000	863.11	231,313,480	877.90	235,277,200	0.81
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	82,300	2,742.95	225,744,785	2,800.00	230,440,000	0.79
日本	株式	信越化学工業	化学	19,500	11,321.67	220,772,565	11,450.00	223,275,000	0.77
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	20,100	10,876.37	218,615,037	10,995.00	220,999,500	0.76
日本	株式	小松製作所	機械	53,900	3,665.49	197,569,911	4,078.00	219,804,200	0.76
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	46,100	4,556.43	210,051,423	4,683.00	215,886,300	0.74
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	81,100	2,702.76	219,193,836	2,661.00	215,807,100	0.74
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	41,500	4,872.11	202,192,565	5,141.00	213,351,500	0.73
日本	株式	日本電産	電気機器	13,400	14,597.79	195,610,386	15,810.00	211,854,000	0.73
日本	株式	パナソニック	電気機器	127,600	1,709.84	218,175,584	1,649.50	210,476,200	0.72
日本	株式	三菱電機	電気機器	111,700	1,951.81	218,017,177	1,871.50	209,046,550	0.72
日本	株式	花王	化学	27,400	7,134.90	195,496,260	7,619.00	208,760,600	0.72
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	39,500	5,431.81	214,556,495	5,238.00	206,901,000	0.71
日本	株式	ダイキン工業	機械	15,200	12,527.96	190,424,992	13,335.00	202,692,000	0.70

## ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
----	-------	----	---------

株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.34
		建設業	3.28
		食料品	4.45
		繊維製品	0.69
		パルプ・紙	0.27
		化学	7.22
		医薬品	4.38
		石油・石炭製品	0.72
		ゴム製品	0.98
		ガラス・土石製品	1.05
		鉄鋼	1.20
		非鉄金属	1.01
		金属製品	0.71
		機械	5.63
		電気機器	13.64
		輸送用機器	8.88
		精密機器	1.58
		その他製品	2.04
		電気・ガス業	1.51
		陸運業	3.92
		海運業	0.24
		空運業	0.63
		倉庫・運輸関連業	0.19
		情報・通信業	7.26
		卸売業	4.70
		小売業	4.67
		銀行業	7.50
		証券、商品先物取引業	0.99
		保険業	2.27
その他金融業	1.19		
不動産業	2.24		
サービス業	4.19		
合 計		99.67	

## 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 03月	2018年	買建	7日本円	126,523,780	127,190,000	0.44
----------	-------	-----------------	-------	----	------	-------------	-------------	------

(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12月29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	5,050,575	0.01
株式	アメリカ	51,545,094,191	60.30
	カナダ	3,315,970,635	3.88
	モーリシャス	4,063,969	0.00
	ドイツ	3,393,886,582	3.97
	イタリア	661,736,486	0.77
	フランス	3,312,260,728	3.87
	オランダ	1,594,241,508	1.87
	スペイン	1,124,770,406	1.32
	ベルギー	382,619,348	0.45
	オーストリア	94,317,627	0.11
	ルクセンブルク	108,921,769	0.13
	フィンランド	317,745,847	0.37
	アイルランド	1,213,392,662	1.42
	ポルトガル	51,972,683	0.06
	イギリス	5,687,004,983	6.65
	スイス	3,088,746,945	3.61
	スウェーデン	920,793,721	1.08
	ノルウェー	225,526,676	0.26
	デンマーク	623,701,761	0.73
	ケイマン	244,192,310	0.29
	オーストラリア	2,136,712,254	2.50
	バミューダ	218,286,083	0.26
	ニュージーランド	60,474,199	0.07
香港	898,080,934	1.05	
シンガポール	671,134,909	0.79	
イスラエル	154,783,905	0.18	
ジャージー	418,684,962	0.49	
英ヴァージン諸島	25,349,459	0.03	
	小計	82,494,467,542	96.51
投資証券	アメリカ	1,620,454,761	1.90
	カナダ	11,994,022	0.01

	フランス	117,699,921	0.14
	イギリス	74,438,288	0.09
	オーストラリア	230,181,068	0.27
	香港	50,598,432	0.06
	シンガポール	36,355,675	0.04
	小計	2,141,722,167	2.51
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		838,210,393	0.98
合計（純資産総額）		85,479,450,677	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	682,839,225	0.80
	買建	ドイツ	191,398,896	0.22

(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		656,959,500	0.77

(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	104,762	17,674.32	1,851,598,159	19,332.03	2,025,263,174	2.37
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	148,584	8,885.19	1,320,197,071	9,686.35	1,439,238,114	1.68
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	8,295	110,049.93	912,864,218	134,029.30	1,111,773,044	1.30
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	48,020	19,277.80	925,719,956	20,104.95	965,440,179	1.13
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	71,360	11,415.25	814,592,953	12,180.26	869,184,067	1.02
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	54,411	16,086.67	875,292,345	15,883.27	864,225,148	1.01
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	85,871	9,398.20	807,033,690	9,494.25	815,281,600	0.95
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	6,342	109,986.28	697,533,051	118,439.81	751,145,338	0.88
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	6,040	112,034.97	676,691,279	119,322.35	720,706,994	0.84

アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	202,039	3,122.19	630,804,146	3,367.40	680,346,129	0.80
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	95,560	6,243.25	596,604,970	6,926.90	661,934,564	0.77
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	63,183	9,415.76	594,916,154	9,687.09	612,059,660	0.72
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	25,720	21,331.80	548,653,992	22,550.28	579,993,202	0.68
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	124,397	3,784.37	470,764,275	4,427.34	550,747,814	0.64
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	38,461	13,383.72	514,751,255	14,190.54	545,782,359	0.64
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	51,669	9,815.18	507,140,536	10,403.91	537,559,626	0.63
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	23,920	18,765.90	448,880,567	21,445.14	512,967,749	0.60
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	82,627	5,496.32	454,144,433	6,037.59	498,867,949	0.58
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	95,192	4,608.14	438,658,063	5,222.85	497,174,489	0.58
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	120,490	4,086.07	492,331,779	4,109.81	495,191,007	0.58
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	19,640	23,454.27	460,642,059	25,173.00	494,397,916	0.58
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	37,062	12,372.37	458,544,777	12,921.54	478,898,486	0.56
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	55,727	8,319.06	463,596,257	8,484.03	472,790,097	0.55
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	406,321	1,127.31	458,052,590	1,158.46	470,709,388	0.55
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	101,650	3,875.90	393,985,236	4,360.67	443,262,106	0.52
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア	95,254	4,161.79	396,427,145	4,552.77	433,669,554	0.51
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	45,243	9,294.53	420,512,421	9,548.54	432,004,686	0.51
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	82,192	5,203.65	427,698,401	5,166.35	424,633,461	0.50
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	14,288	26,428.79	377,614,609	28,564.80	408,133,920	0.48
アメリカ	株式	BOEING CO/THE	資本財	11,652	29,201.46	340,255,412	33,487.55	390,196,933	0.46

## 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	6.75
		素材	5.04
		資本財	7.46
		商業・専門サービス	1.02
		運輸	2.10
		自動車・自動車部品	1.54
		耐久消費財・アパレル	1.81

	消費者サービス	1.87
	メディア	2.26
	小売	3.93
	食品・生活必需品小売り	1.72
	食品・飲料・タバコ	5.30
	家庭用品・パーソナル用品	2.04
	ヘルスケア機器・サービス	4.11
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.01
	銀行	9.64
	各種金融	4.61
	保険	4.10
	不動産	0.57
	ソフトウェア・サービス	10.20
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.04
	電気通信サービス	2.52
	公益事業	3.00
	半導体・半導体製造装置	2.86
投資証券		2.51
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	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 EMINI 1803	買建	45	米ドル	6,013,087.5	679,478,887	6,042,825	682,839,225	0.80
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1803	買建	45	ユーロ	1,422,950	192,012,873	1,418,400	191,398,896	0.22

(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	4,750,000.00	533,062,170	535,542,500	0.63
	ユーロ	買建	900,000.00	119,972,675	121,417,000	0.14

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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

以下の運用状況は2017年12月29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	43,532,075	0.27
	メキシコ	426,878,279	2.66
	ブラジル	1,035,964,441	6.47
	チリ	188,097,625	1.17
	コロンビア	61,813,324	0.39
	ペルー	58,156,060	0.36
	ルクセンブルク	2,868,689	0.02
	トルコ	157,526,507	0.98
	チェコ	26,306,470	0.16
	ハンガリー	49,536,571	0.31
	ポーランド	199,956,736	1.25
	ロシア	517,666,125	3.23
	ケイマン	1,370,891,250	8.56
	バミューダ	99,185,479	0.62
	香港	603,144,725	3.77
	マレーシア	353,533,951	2.21
	タイ	343,573,925	2.14
	フィリピン	170,487,853	1.06
	インドネシア	342,045,627	2.14
	韓国	2,356,347,126	14.71
	台湾	1,676,455,587	10.47
	中国	2,435,466,778	15.20
	インド	1,321,354,503	8.25
	パキスタン	10,864,248	0.07
	カタール	84,309,507	0.53
	エジプト	16,932,693	0.11
	南アフリカ	1,012,737,589	6.32
アラブ首長国連邦	98,857,109	0.62	
小計		15,064,490,852	94.04
投資信託受益証券	アメリカ	49,360,773	0.31
投資証券	メキシコ	12,180,480	0.08
	トルコ	4,925,128	0.03
	南アフリカ	54,383,848	0.34
小計		71,489,456	0.45
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		834,057,539	5.21
合計（純資産総額）		16,019,398,620	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	850,771,350	5.31

(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		20,230,000	0.13

(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	141,400	3,872.23	547,534,691	5,902.57	834,623,681	5.21
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	2,415	247,580.83	597,907,720	270,597.60	653,493,204	4.08
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP-ADR	ソフトウェア・サービス	28,540	14,409.38	411,243,840	19,469.90	555,670,946	3.47
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	610,355	787.41	480,605,409	856.54	522,793,472	3.26
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	10,825	25,121.85	271,944,106	31,357.53	339,445,273	2.12
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	2,080,920	93.98	195,577,178	103.67	215,746,040	1.35
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	ソフトウェア・サービス	6,780	21,485.99	145,675,077	26,525.62	179,843,704	1.12
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	152,700	1,229.93	187,810,650	1,130.77	172,668,884	1.08
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA - H	銀行	1,833,575	75.48	138,416,030	91.38	167,565,285	1.05
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	129,000	703.88	90,800,944	1,179.93	152,211,744	0.95
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	387,765	397.09	153,980,272	357.39	138,586,048	0.87
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	69,480	1,423.89	98,931,893	1,909.70	132,685,956	0.83
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	14,530	6,147.76	89,327,074	8,124.30	118,046,079	0.74
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	37,825	2,817.36	106,566,926	3,019.14	114,199,235	0.71
中国	株式	BANK OF CHINA LTD - H	銀行	1,961,000	56.27	110,352,128	55.09	108,036,589	0.67
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	64,592	1,224.92	79,120,441	1,645.07	106,258,749	0.66
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	銀行	70,436	1,373.02	96,710,107	1,450.70	102,181,547	0.64
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	435	189,636.97	82,492,084	221,958.00	96,551,730	0.60

ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PRF	銀行	73,136	1,089.70	79,696,845	1,153.26	84,345,518	0.53
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	114,200	671.32	76,665,219	725.00	82,796,096	0.52
ブラジル	株式	VALE SA	素材	58,639	1,023.64	60,025,642	1,371.65	80,432,665	0.50
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	電気通信サービス	818,800	85.47	69,988,665	97.46	79,804,506	0.50
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	ソフトウェア・サービス	1,965	32,550.35	63,961,452	39,544.35	77,704,648	0.49
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	16,310	4,545.06	74,130,017	4,704.19	76,725,339	0.48
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	41,534	1,693.43	70,335,279	1,839.18	76,388,710	0.48
香港	株式	CNOOC LTD	エネルギー	441,000	133.56	58,901,307	163.39	72,058,518	0.45
ロシア	株式	GAZPROM PAO-SPON ADR	エネルギー	135,450	517.46	70,090,721	504.99	68,401,844	0.43
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON-ADR	エネルギー	10,465	5,740.12	60,070,422	6,494.10	67,960,861	0.42
韓国	株式	KB FINANCIAL GROUP INC	銀行	9,785	5,760.01	56,361,719	6,733.08	65,883,188	0.41
中国	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	183,000	361.16	66,093,799	354.27	64,831,410	0.40

## 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	6.42
		素材	6.97
		資本財	3.34
		商業・専門サービス	0.10
		運輸	1.51
		自動車・自動車部品	3.09
		耐久消費財・アパレル	0.97
		消費者サービス	1.09
		メディア	2.53
		小売	1.87
		食品・生活必需品小売り	1.63
		食品・飲料・タバコ	3.37
		家庭用品・パーソナル用品	1.19
		ヘルスケア機器・サービス	0.55
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.99
		銀行	16.12
		各種金融	2.51
		保険	3.52
		不動産	2.23
		ソフトウェア・サービス	12.95
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.12		
電気通信サービス	4.49		
公益事業	2.25		
半導体・半導体製造装置	5.21		
投資信託受益証券			0.31
投資証券			0.45

合 計	94.79
-----	-------

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	MINMSCIE1803	買建	130	米ドル	7,286,830	823,411,790	7,528,950	850,771,350	5.31

(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	香港ドル	買建	1,400,000.00	20,248,200	20,230,000	0.13

(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12月29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	29,152,484,788	78.31
地方債証券	日本	2,910,785,960	7.82
特殊債券	日本	3,315,457,792	8.91
社債券	日本	1,446,172,000	3.88
	オーストラリア	300,864,000	0.81
	小計	1,747,036,000	4.69
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		102,503,876	0.28
合計(純資産総額)		37,228,268,416	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)	1,090,000,000	102.40	1,116,184,200	102.59	1,118,231,000	0.300	2025/12/20	3.00
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	610,000,000	100.63	613,903,400	100.80	614,910,500	0.100	2026/12/20	1.65
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	581,000,000	102.94	598,127,880	102.61	596,204,770	1.400	2019/9/20	1.60
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	560,000,000	100.60	563,404,800	100.54	563,029,600	0.100	2020/6/20	1.51
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	490,000,000	103.65	507,929,100	103.80	508,644,500	0.500	2024/9/20	1.37
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	505,000,000	100.56	507,838,100	100.49	507,504,800	0.100	2020/3/20	1.36
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	490,000,000	100.51	492,518,600	100.73	493,596,600	0.100	2027/3/20	1.33
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	473,000,000	103.10	487,667,730	102.79	486,215,620	1.300	2019/12/20	1.31
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	420,000,000	103.15	433,255,200	103.32	433,948,200	0.400	2025/9/20	1.17
日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	410,000,000	102.02	418,286,100	101.72	417,084,800	1.300	2019/3/20	1.12
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	340,000,000	120.12	408,428,400	120.39	409,349,800	1.700	2032/9/20	1.10
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	370,000,000	104.79	387,730,400	104.54	386,827,600	1.300	2021/3/20	1.04
日本	国債証券	第29回利付国債(30年)	276,000,000	134.28	370,629,360	135.14	372,997,440	2.400	2038/9/20	1.00
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	300,000,000	119.66	358,983,000	119.49	358,488,000	2.300	2026/6/20	0.96
日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	290,000,000	122.85	356,267,900	122.85	356,288,200	2.100	2029/9/20	0.96
日本	国債証券	第120回利付国債(5年)	330,000,000	100.67	332,220,900	100.56	331,861,200	0.200	2019/9/20	0.89
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	325,000,000	100.65	327,119,000	100.58	326,894,750	0.100	2020/9/20	0.88
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	310,000,000	103.10	319,628,600	103.25	320,081,200	0.400	2025/3/20	0.86
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	295,000,000	107.61	317,449,500	107.49	317,119,100	1.400	2022/12/20	0.85
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	300,000,000	103.13	309,402,000	103.28	309,867,000	0.400	2025/6/20	0.83
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	300,000,000	100.51	301,545,000	100.44	301,323,000	0.100	2019/12/20	0.81
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	250,000,000	120.12	300,317,500	119.97	299,932,500	2.300	2026/9/20	0.81
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	208,000,000	131.56	273,655,200	131.93	274,431,040	2.400	2034/3/20	0.74
日本	国債証券	第34回利付国債(30年)	200,000,000	131.73	263,466,000	133.12	266,258,000	2.200	2041/3/20	0.72
日本	国債証券	第149回利付国債(20年)	215,000,000	117.34	252,287,450	117.89	253,467,800	1.500	2034/6/20	0.68
日本	国債証券	第50回利付国債(20年)	237,000,000	106.82	253,172,880	106.50	252,416,850	1.900	2021/3/22	0.68
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	230,000,000	104.89	241,258,500	104.90	241,286,100	0.800	2023/6/20	0.65
日本	国債証券	第137回利付国債(20年)	200,000,000	119.96	239,936,000	120.31	240,624,000	1.700	2032/6/20	0.65
日本	国債証券	第43回利付国債(30年)	195,000,000	121.76	237,447,600	123.14	240,132,750	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	120.18	234,364,650	120.55	235,086,150	1.700	2032/12/20	0.63

## 口.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	78.31
地方債証券	7.82
特殊債券	8.91
社債券	4.69
合 計	99.72

#### 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12月29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	67,141,920,875	42.33
	カナダ	3,426,104,098	2.16
	メキシコ	1,213,657,826	0.77
	ドイツ	11,518,150,583	7.26
	イタリア	15,651,755,859	9.87
	フランス	16,139,845,709	10.18
	オランダ	3,516,817,247	2.22
	スペイン	9,104,538,555	5.74
	ベルギー	4,066,518,941	2.56
	オーストリア	2,518,082,613	1.59
	フィンランド	982,088,810	0.62
	アイルランド	1,267,814,768	0.80
	イギリス	11,187,350,262	7.05
	スイス	282,128,923	0.18
	スウェーデン	746,280,375	0.47
	ノルウェー	458,573,493	0.29
	デンマーク	975,460,026	0.61
	ポーランド	1,017,814,019	0.64
	オーストラリア	3,425,271,294	2.16
	シンガポール	614,254,392	0.39

	マレーシア	712,998,196	0.45
	南アフリカ	950,318,469	0.60
	小計	156,917,745,333	98.93
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,698,639,408	1.07
合計（純資産総額）		158,616,384,741	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（%）
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,460,000	13,987.14	1,463,054,844	13,771.20	1,440,468,388	8.000	2021/11/15	0.91
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,530,000	11,701.24	1,232,140,614	11,610.97	1,222,635,773	3.375	2019/11/15	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,700,000	11,210.83	1,087,450,675	11,135.79	1,080,172,571	1.875	2022/7/31	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	11,134.47	1,002,102,984	11,096.06	998,646,201	0.750	2019/8/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,070,000	11,805.18	952,678,761	11,703.44	944,467,923	3.625	2020/2/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,830,000	11,814.24	925,055,023	11,710.50	916,932,651	3.500	2020/5/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,150,000	11,065.61	901,847,655	11,010.87	897,386,573	1.750	2023/5/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,450,000	11,332.66	844,283,788	11,272.41	839,795,044	1.750	2019/9/30	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,900,000	11,441.25	789,446,250	11,360.47	783,872,954	2.250	2021/7/31	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,610,000	13,483.41	756,419,857	13,262.05	744,001,168	8.750	2020/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,760,000	15,026.69	715,270,564	14,959.04	712,050,385	6.125	2027/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,050,000	11,396.23	689,471,963	11,317.20	684,691,199	2.125	2021/6/30	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,650,000	11,710.19	661,625,735	12,110.86	684,263,895	3.125	2044/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,120,000	12,751.79	652,891,653	13,155.67	673,570,545	3.625	2043/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	11,201.35	649,678,358	11,590.44	672,245,746	2.875	2043/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,930,000	11,269.54	668,284,108	11,225.62	665,679,468	2.250	2024/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,940,000	11,203.11	665,464,960	11,185.45	664,415,843	2.250	2025/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	11,473.25	665,448,593	11,411.45	661,864,210	2.500	2024/5/15	0.42
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,930,000	16,902.43	664,265,734	16,831.28	661,469,387	4.250	2023/10/25	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	11,236.21	651,700,267	11,173.98	648,090,979	2.000	2023/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	11,509.88	633,043,741	11,441.91	629,305,419	2.500	2023/8/15	0.40
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,820,000	22,024.65	621,095,142	22,246.92	627,363,245	5.750	2032/10/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,149.04	590,899,295	11,559.10	612,632,777	2.875	2045/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,370,000	11,386.07	611,432,072	11,313.45	607,532,711	2.000	2020/7/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,500,000	13,024.13	586,085,913	13,433.31	604,499,207	3.750	2043/11/15	0.38
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,160,000	19,018.86	600,996,036	19,034.31	601,484,276	6.500	2027/11/1	0.38
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,920,000	15,423.99	604,620,519	15,324.38	600,715,701	3.250	2021/10/25	0.38
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,900,000	15,461.95	603,016,107	15,346.99	598,532,847	3.750	2021/4/25	0.38
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,110,000	19,106.55	594,213,998	19,150.64	595,585,038	6.000	2031/5/1	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,180,000	11,574.96	599,582,938	11,494.22	595,400,824	2.625	2020/8/15	0.38

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.93
合 計	98.93

## 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12月29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	30,385,962	0.83
	メキシコ	325,508,939	8.86
	ブラジル	350,976,237	9.55
	チリ	85,235,637	2.32
	コロンビア	239,591,088	6.52
	ペルー	99,157,916	2.70
	ウルグアイ	10,436,836	0.28
	トルコ	260,971,004	7.10
	チェコ	136,280,902	3.71
	ハンガリー	162,695,344	4.43
	ポーランド	323,760,546	8.81
	ロシア	273,080,081	7.43
	ルーマニア	102,152,933	2.78
	マレーシア	199,937,702	5.44
	タイ	290,010,794	7.89
	フィリピン	11,650,300	0.32
	インドネシア	343,003,511	9.33
南アフリカ	312,204,261	8.50	
	小計	3,557,039,993	96.80
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		117,610,941	3.20
合計（純資産総額）		3,674,650,934	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		5,647,000	0.15

(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	442,000,000	19.54	86,385,000	19.28	85,235,637	5.500	2020/8/5	2.32
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	2,360,000	2,581.06	60,913,146	2,772.27	65,425,712		2020/7/1	1.78
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,400,000	1,017.57	54,949,242	1,018.20	54,982,958	10.500	2026/12/21	1.50
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	1,105,000,000	4.60	50,873,942	4.55	50,369,654	10.000	2024/7/24	1.37
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	1,210,000,000	4.07	49,272,293	4.03	48,764,712	7.500	2026/8/26	1.33
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	1,360,000	3,443.74	46,834,933	3,449.86	46,918,172	10.000	2023/1/1	1.28
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	1,200,000	3,442.70	41,312,438	3,507.10	42,085,238	10.000	2021/1/1	1.15
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	1,055,000,000	3.92	41,409,988	3.96	41,824,497	7.000	2022/5/4	1.14
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,180,000	588.65	42,265,658	578.53	41,539,135	8.000	2020/6/11	1.13
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,820,000	370.52	40,090,654	371.94	40,244,578	3.650	2021/12/17	1.10
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,110,000	669.57	40,910,869	645.71	39,452,926	10.000	2024/12/5	1.07
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,800,000	563.27	38,302,413	553.98	37,670,857	6.500	2021/6/10	1.03
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	3,850,000,000	0.90	34,767,748	0.93	36,049,560	8.375	2024/3/15	0.98
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	1,040,000	3,387.47	35,229,734	3,402.50	35,386,086	10.000	2025/1/1	0.96
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	1,100,000	2,896.12	31,857,403	3,128.30	34,411,382		2019/4/1	0.94
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	8,080,000	415.67	33,586,257	424.38	34,289,994	4.875	2029/6/22	0.93
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,140,000	821.81	34,022,943	824.91	34,151,628	8.750	2048/2/28	0.93
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	1,100,000	2,997.36	32,971,063	2,988.62	32,874,824		2019/10/1	0.89
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	9,150,000	362.29	33,150,139	358.18	32,774,378	3.875	2019/6/13	0.89
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	3,290,000,000	0.91	30,095,604	0.94	31,190,598	8.375	2026/9/15	0.85
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	3,400,000,000	0.84	28,881,720	0.88	29,959,440	7.000	2027/5/15	0.82
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	970,000	3,046.72	29,553,228	3,059.96	29,681,630	2.500	2026/7/25	0.81
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	7,800,000	371.50	28,977,308	375.95	29,324,594	3.625	2023/6/16	0.80

タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	7,570,000	379.38	28,719,126	386.57	29,263,628	3.850	2025/12/12	0.80
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	870,000	3,162.06	27,509,956	3,201.23	27,850,706	1.500	2020/4/25	0.76
ブラジル	国債証券	LETRA TESOIRO NACIONAL	950,000	2,699.70	25,647,214	2,917.07	27,712,197		2020/1/1	0.75
ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	13,700,000	199.58	27,343,570	201.55	27,612,581	7.750	2026/9/16	0.75
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	625,000,000	4.33	27,101,655	4.29	26,839,536	11.000	2020/7/24	0.73
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,850,000	560.39	27,179,388	548.74	26,614,149	6.500	2022/6/9	0.72
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	2,650,000,000	0.94	25,132,662	0.99	26,345,578	9.000	2029/3/15	0.72

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.80
合計	96.80

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

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	50,000.00	5,645,500	5,647,000	0.15

(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12月29日現在

### 基準価額・純資産の推移



基準価額..... 10,526円  
 純資産総額..... 2.38億円

※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)

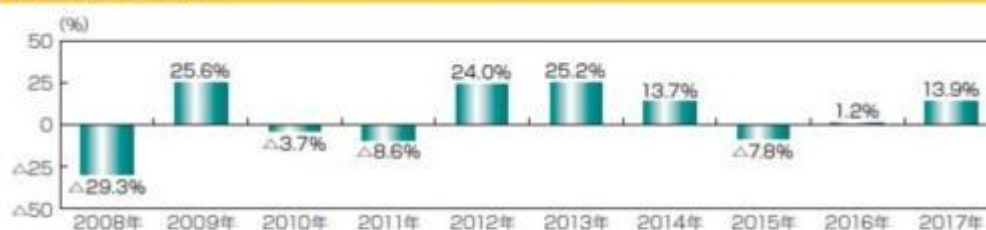
2017年8月	2017年9月	2017年10月	2017年11月	2017年12月	直近1年間累計	設定来累計
20円	20円	20円	20円	20円	240円	2,740円

## 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	3.4%
			三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	2.2%
			ソフトバンクグループ	日本	1.5%
			日本電信電話	日本	1.4%
			三井住友フィナンシャルグループ	日本	1.4%
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI(ヘッジなし) マザーファンド	海外先進国株式	26.9%	APPLE INC	アメリカ	2.4%
			MICROSOFT CORP	アメリカ	1.7%
			AMAZON.COM INC	アメリカ	1.3%
			FACEBOOK INC-A	アメリカ	1.1%
			JPMORGAN CHASE & CO	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	20.1%	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	5.2%
			SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	4.1%
			ALIBABA GROUP HOLDING-SP-ADR	ケイマン諸島	3.5%
			TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	3.3%
			NASPERS LTD-N SHS	南アフリカ	2.1%
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	3.0%
			第345回利付国債(10年)	日本	1.7%
			第303回利付国債(10年)	日本	1.6%
			第124回利付国債(5年)	日本	1.5%
			第335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	26.3%	US TREASURY N/B(クーポン8%)	アメリカ	0.9%
			US TREASURY N/B(クーポン3.375%)	アメリカ	0.8%
			US TREASURY N/B(クーポン1.875%)	アメリカ	0.7%
			US TREASURY N/B(クーポン0.75%)	アメリカ	0.6%
			US TREASURY N/B(クーポン3.625%)	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	2.3%
			LETRA TESOURO NACIONAL(クーポンなし)	ブラジル	1.8%
			REPUBLIC OF SOUTH AFRICA(クーポン10.5%)	南アフリカ	1.5%
			TITULOS DE TESORERIA B(クーポン10%)	コロンビア	1.4%
			TITULOS DE TESORERIA B(クーポン7.5%)	コロンビア	1.3%
現金その他		1.1%			

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

## 年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。  
 ※当ファンドには、ベンチマークはありません。  
 ※2008年は、設定時から2008年末までの騰落率です。

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

## 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は、6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、平成29年6月27日から平成29年12月25日までの特定期間の財務諸表について、PwCあらた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29年6月26日現在	当期 平成29年12月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	3,392,904	3,194,173
親投資信託受益証券	227,067,341	234,507,148
流動資産合計	230,460,245	237,701,321
資産合計	230,460,245	237,701,321
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	468,075	452,031
未払受託者報酬	10,858	9,740
未払委託者報酬	217,355	194,996
未払利息	5	4
その他未払費用	106,815	217,258
流動負債合計	803,108	874,029
負債合計	803,108	874,029
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	234,037,655	226,015,696
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,380,518	10,811,596
（分配準備積立金）	51,713,121	48,350,148
元本等合計	229,657,137	236,827,292
純資産合計	229,657,137	236,827,292
負債純資産合計	230,460,245	237,701,321

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 平成28年12月27日 至 平成29年6月26日	当期 自 平成29年6月27日 至 平成29年12月25日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	12,766,295	19,536,200
営業収益合計	12,766,295	19,536,200
<b>営業費用</b>		
支払利息	536	710

	前期 自 平成28年12月27日 至 平成29年 6月26日	当期 自 平成29年 6月27日 至 平成29年12月25日
受託者報酬	60,278	63,017
委託者報酬	1,206,817	1,261,525
その他費用	111,610	116,672
営業費用合計	1,379,241	1,441,924
営業利益又は営業損失（ ）	11,387,054	18,094,276
経常利益又は経常損失（ ）	11,387,054	18,094,276
当期純利益又は当期純損失（ ）	11,387,054	18,094,276
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（ ）	56,045	115,838
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	12,789,000	4,380,518
剰余金増加額又は欠損金減少額	322,646	224,756
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	322,646	97,099
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	127,657
剰余金減少額又は欠損金増加額	435,485	256,463
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	234,858
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	435,485	21,605
分配金	2,809,688	2,754,617
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,380,518	10,811,596

## (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29年 6月27日から平成29年12月25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29年 6月26日現在	当期 平成29年12月25日現在
1. 期首元本額	231,406,445円	234,037,655円
期中追加設定元本額	9,351,042円	7,906,032円
期中一部解約元本額	6,719,832円	15,927,991円
2. 受益権の総数	234,037,655口	226,015,696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	4,380,518円	- 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 平成28年12月27日 至 平成29年 6月26日		当期 自 平成29年 6月27日 至 平成29年12月25日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
自 平成28年12月27日 至 平成29年 1月25日		自 平成29年 6月27日 至 平成29年 7月25日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	223,823円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 679,546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	19,473,999円	C 信託約款に定める収益調整金 21,576,460円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	53,105,888円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 51,134,874円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	72,803,710円	E 分配対象収益(A+B+C+D) 73,390,880円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,136円	F 分配対象収益(1万口当たり) 3,154円
G	分配金額	464,259円	G 分配金額 465,287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29年 1月26日 至 平成29年 2月27日		自 平成29年 7月26日 至 平成29年 8月25日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	561,685円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 369,429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	20,360,264円	C 信託約款に定める収益調整金 21,792,356円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	52,794,359円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 50,922,793円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	73,716,308円	E 分配対象収益(A+B+C+D) 73,084,578円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,140円	F 分配対象収益(1万口当たり) 3,150円
G	分配金額	469,468円	G 分配金額 463,911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29年 2月28日 至 平成29年 3月27日		自 平成29年 8月26日 至 平成29年 9月25日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	316,327円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 546,806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	20,605,226円	C 信託約款に定める収益調整金 21,772,633円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	52,530,094円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 49,959,048円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	73,451,647円	E 分配対象収益(A+B+C+D) 72,278,487円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,134円	F 分配対象収益(1万口当たり) 3,155円
G	分配金額	468,726円	G 分配金額 458,179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29年 3月28日 至 平成29年 4月25日		自 平成29年 9月26日 至 平成29年10月25日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	476,026円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 477,504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	20,981,828円	C	信託約款に定める収益調整金	22,312,826円
D	信託約款に定める分配準備積立金	52,314,582円	D	信託約款に定める分配準備積立金	49,795,331円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	73,772,436円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	72,585,661円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,134円	F	分配対象収益(1万口当たり)	3,155円
G	分配金額	470,727円	G	分配金額	459,988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29年 4月26日			自 平成29年10月26日	
	至 平成29年 5月25日			至 平成29年11月27日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	668,252円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	300,444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	21,165,785円	C	信託約款に定める収益調整金	22,318,609円
D	信託約款に定める分配準備積立金	51,784,382円	D	信託約款に定める分配準備積立金	49,067,346円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	73,618,419円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	71,686,399円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,143円	F	分配対象収益(1万口当たり)	3,149円
G	分配金額	468,433円	G	分配金額	455,221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29年 5月26日			自 平成29年11月28日	
	至 平成29年 6月26日			至 平成29年12月25日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	510,174円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	452,450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	21,427,240円	C	信託約款に定める収益調整金	22,388,476円
D	信託約款に定める分配準備積立金	51,671,022円	D	信託約款に定める分配準備積立金	48,349,729円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	73,608,436円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	71,190,655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)	3,149円
G	分配金額	468,075円	G	分配金額	452,031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12月27日 至 平成29年 6月26日	当期 自 平成29年 6月27日 至 平成29年12月25日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	前期 平成29年 6月26日現在	当期 平成29年12月25日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

前期（平成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

当期(平成29年12月25日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	4,398,202
合計	4,398,202

(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29年 6月26日現在		当期 平成29年12月25日現在	
1口当たり純資産額	0.9813円	1口当たり純資産額	1.0478円
(1万口当たり純資産額)	(9,813円)	(1万口当たり純資産額)	(10,478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	25,992,446	63,819,252	
	日本債券インデックスマザーファンド	4,994,522	6,939,388	

海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	27,002,128	62,501,825	
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	4,408,078	7,144,172	
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	24,477,692	47,391,259	
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	34,397,093	46,711,252	
合計	121,271,959	234,507,148	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

(参考)

### 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

#### 貸借対照表

(単位:円)

	平成29年 6月26日現在	平成29年12月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	857,775,433	61,850,607
株式	27,475,796,770	29,203,559,950
派生商品評価勘定	1,769,060	1,453,380
未収入金	33,081,530	158,582,990
未収配当金	117,158,487	1,881,450
流動資産合計	28,485,581,280	29,427,328,377
資産合計	28,485,581,280	29,427,328,377
負債の部		
流動負債		

	平成29年 6月26日現在	平成29年12月25日現在
派生商品評価勘定	-	11,080
前受金	1,630,000	1,335,000
未払金	747,001,760	-
未払解約金	60,661,146	68,847,572
未払利息	1,346	87
流動負債合計	809,294,252	70,193,739
負債合計	809,294,252	70,193,739
純資産の部		
元本等		
元本	19,591,921,031	18,114,380,072
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	8,084,365,997	11,242,754,566
元本等合計	27,676,287,028	29,357,134,638
純資産合計	27,676,287,028	29,357,134,638
負債純資産合計	28,485,581,280	29,427,328,377

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	平成29年 6月26日現在	平成29年12月25日現在
1. 期首	平成28年12月27日	平成29年 6月27日
期首元本額	20,334,605,022円	19,591,921,031円
期首からの追加設定元本額	1,250,365,755円	733,414,602円
期首からの一部解約元本額	1,993,049,746円	2,210,955,561円
元本の内訳		
DCインデックスバランス(株式20)	258,830,849円	270,804,778円
DCインデックスバランス(株式40)	807,647,657円	835,808,259円
DCインデックスバランス(株式60)	1,536,048,259円	1,665,819,851円

DCインデックスバランス(株式80)	1,761,672,523円	1,823,194,869円
インデックスファンド日本株式(DC専用)	1,272,256,995円	1,246,887,965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	4,247,041,813円	3,516,757,728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	4,838,907円	4,408,078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)	531,199,094円	495,308,762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)	3,974,162円	-円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	57,246,399円	52,197,606円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	46,017,810円	38,924,118円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	68,055,742円	60,938,561円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	77,284,750円	63,449,306円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	5,550,460,970円	4,904,560,773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)	13,036,155円	9,684,494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)	35,577,302円	29,008,213円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	268,211,843円	243,592,877円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	792,260,947円	718,539,596円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	1,124,189,351円	1,062,440,491円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	1,136,069,503円	1,072,053,747円
計	19,591,921,031円	18,114,380,072円
2. 受益権の総数	19,591,921,031口	18,114,380,072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	415,920,000円	496,680,000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12月27日 至 平成29年 6月26日	自 平成29年 6月27日 至 平成29年12月25日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成29年 6月26日現在	平成29年12月25日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成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

（平成29年12月25日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,234,657,126
合計	1,234,657,126

(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

（平成29年12月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	90,080,000	-	91,525,000	1,445,000
合計		90,080,000	-	91,525,000	1,445,000

（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29年 6月26日現在		平成29年12月25日現在	
1口当たり純資産額	1.4126円	1口当たり純資産額	1.6207円
(1万口当たり純資産額)	(14,126円)	(1万口当たり純資産額)	(16,207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	4,275.00	2,137,500	
日本水産	14,100	613.00	8,643,300	
マルハニチロ	2,400	3,405.00	8,172,000	
カネコ種苗	400	1,709.00	683,600	
サカタのタネ	1,800	3,940.00	7,092,000	
ホクト	1,300	2,022.00	2,628,600	
ホクリヨウ	200	1,168.00	233,600	
住石ホールディングス	3,600	156.00	561,600	
日鉄鉱業	400	8,070.00	3,228,000	
三井松島産業	600	1,521.00	912,600	
国際石油開発帝石	60,800	1,395.50	84,846,400	
日本海洋掘削	500	2,181.00	1,090,500	
石油資源開発	2,000	2,920.00	5,840,000	
K & O エナジーグループ	700	1,907.00	1,334,900	
ショーボンドホールディングス	1,200	7,830.00	9,396,000	
ミライト・ホールディングス	3,900	1,660.00	6,474,000	
サンヨーホームズ	200	964.00	192,800	
ファーストコーポレーション	300	1,467.00	440,100	
ベステラ	200	2,141.00	428,200	
インベスターズクラウド	200	8,740.00	1,748,000	

ダイセキ環境ソリューション	300	1,405.00	421,500
安藤・間	9,700	890.00	8,633,000
東急建設	4,800	1,084.00	5,203,200
コムシスホールディングス	4,400	3,305.00	14,542,000
ミサワホーム	1,100	1,001.00	1,101,100
高松コンストラクショングループ	800	3,125.00	2,500,000
東建コーポレーション	500	13,250.00	6,625,000
ソネック	200	812.00	162,400
ヤマウラ	600	867.00	520,200
大成建設	12,700	5,550.00	70,485,000
大林組	37,500	1,358.00	50,925,000
清水建設	38,300	1,162.00	44,504,600
飛島建設	12,000	180.00	2,160,000
長谷工コーポレーション	14,600	1,772.00	25,871,200
松井建設	1,400	969.00	1,356,600
銭高組	200	6,280.00	1,256,000
鹿島建設	55,000	1,067.00	58,685,000
不動テトラ	10,000	181.00	1,810,000
大末建設	400	1,158.00	463,200
鉄建建設	800	3,300.00	2,640,000
西松建設	2,900	3,145.00	9,120,500
三井住友建設	9,100	620.00	5,642,000
大豊建設	5,000	555.00	2,775,000
前田建設工業	8,900	1,546.00	13,759,400
ナカノフドー建設	1,000	635.00	635,000
奥村組	2,100	4,615.00	9,691,500
東鉄工業	1,500	3,740.00	5,610,000
イチケン	200	2,370.00	474,000
浅沼組	4,000	404.00	1,616,000
戸田建設	14,000	890.00	12,460,000
熊谷組	2,000	3,075.00	6,150,000
青木あすなろ建設	800	1,026.00	820,800
北野建設	3,000	400.00	1,200,000
植木組	200	2,743.00	548,600
三井ホーム	2,000	786.00	1,572,000
矢作建設工業	1,700	987.00	1,677,900
ピーエス三菱	1,500	898.00	1,347,000
日本ハウスホールディングス	2,400	746.00	1,790,400
大東建託	4,500	23,010.00	103,545,000
新日本建設	1,500	948.00	1,422,000
N I P P O	3,000	2,604.00	7,812,000
東亜道路工業	300	4,340.00	1,302,000
前田道路	4,000	2,585.00	10,340,000



日本道路	300	6,660.00	1,998,000
東亜建設工業	1,000	3,010.00	3,010,000
若築建設	700	1,721.00	1,204,700
東洋建設	4,000	646.00	2,584,000
五洋建設	14,100	832.00	11,731,200
福田組	400	6,680.00	2,672,000
住友林業	8,000	2,001.00	16,008,000
日本基礎技術	1,500	413.00	619,500
日成ビルド工業	1,800	1,497.00	2,694,600
ヤマダ・エスバイエルホーム	6,000	77.00	462,000
巴コーポレーション	1,600	658.00	1,052,800
大和ハウス工業	36,900	4,384.00	161,769,600
ライト工業	2,400	1,266.00	3,038,400
積水ハウス	40,700	2,044.00	83,190,800
日特建設	1,100	709.00	779,900
北陸電気工事	700	1,160.00	812,000
ユアテック	2,000	958.00	1,916,000
西部電気工業	200	2,985.00	597,000
四電工	200	2,955.00	591,000
中電工	1,600	3,240.00	5,184,000
関電工	5,000	1,167.00	5,835,000
きんでん	8,400	1,861.00	15,632,400
東京エネシス	1,400	1,292.00	1,808,800
トーエネック	400	3,315.00	1,326,000
住友電設	1,000	2,410.00	2,410,000
日本電設工業	1,900	2,397.00	4,554,300
協和エクシオ	4,500	2,988.00	13,446,000
新日本空調	1,000	1,476.00	1,476,000
N D S	200	4,290.00	858,000
九電工	2,500	5,490.00	13,725,000
三機工業	2,700	1,356.00	3,661,200
日揮	10,800	2,144.00	23,155,200
中外炉工業	400	2,391.00	956,400
ヤマト	1,100	837.00	920,700
太平電業	800	2,815.00	2,252,000
高砂熱学工業	3,500	2,060.00	7,210,000
三晃金属工業	200	4,095.00	819,000
朝日工業社	300	3,520.00	1,056,000
明星工業	2,300	829.00	1,906,700
大気社	1,700	3,810.00	6,477,000
ダイダン	800	2,905.00	2,324,000
日比谷総合設備	1,400	2,419.00	3,386,600
東芝プラントシステム	2,700	2,126.00	5,740,200

東洋エンジニアリング	1,500	1,238.00	1,857,000
千代田化工建設	8,100	821.00	6,650,100
新興プランテック	2,400	1,200.00	2,880,000
日本製粉	3,700	1,737.00	6,426,900
日清製粉グループ本社	13,700	2,320.00	31,784,000
日東富士製粉	100	4,880.00	488,000
昭和産業	1,000	2,887.00	2,887,000
鳥越製粉	1,000	1,013.00	1,013,000
中部飼料	1,400	2,507.00	3,509,800
フィード・ワン	7,600	267.00	2,029,200
東洋精糖	200	1,205.00	241,000
日本甜菜製糖	600	2,699.00	1,619,400
三井製糖	900	4,880.00	4,392,000
塩水港精糖	1,500	262.00	393,000
日新製糖	500	2,302.00	1,151,000
森永製菓	2,600	5,760.00	14,976,000
中村屋	300	5,050.00	1,515,000
江崎グリコ	3,100	5,650.00	17,515,000
名糖産業	600	1,571.00	942,600
不二家	700	2,716.00	1,901,200
山崎製パン	9,100	2,261.00	20,575,100
第一屋製パン	200	1,237.00	247,400
モロゾフ	200	7,690.00	1,538,000
亀田製菓	700	5,110.00	3,577,000
寿スピリッツ	1,100	6,270.00	6,897,000
カルビー	5,100	3,705.00	18,895,500
森永乳業	2,200	4,810.00	10,582,000
六甲バター	600	2,878.00	1,726,800
ヤクルト本社	6,700	8,750.00	58,625,000
明治ホールディングス	7,400	9,820.00	72,668,000
雪印メグミルク	2,700	3,310.00	8,937,000
プリマハム	8,000	827.00	6,616,000
日本ハム	10,000	2,765.00	27,650,000
林兼産業	400	875.00	350,000
丸大食品	6,000	501.00	3,006,000
S Foods	800	5,180.00	4,144,000
伊藤ハム米久ホールディングス	7,200	1,043.00	7,509,600
サッポロホールディングス	4,100	3,515.00	14,411,500
アサヒグループホールディングス	23,500	5,750.00	135,125,000
キリンホールディングス	53,900	2,927.50	157,792,250
宝ホールディングス	9,100	1,309.00	11,911,900
オエノンホールディングス	3,200	367.00	1,174,400
養命酒製造	400	2,505.00	1,002,000

コカ・コーラボトラーズジャパン	7,900	4,215.00	33,298,500
サントリー食品インターナショナル	8,600	5,160.00	44,376,000
ダイドーグループホールディングス	600	5,930.00	3,558,000
伊藤園	3,700	4,480.00	16,576,000
キーコーヒー	1,100	2,160.00	2,376,000
ユニカフェ	400	1,390.00	556,000
ジャパンフーズ	200	1,495.00	299,000
日清オイリオグループ	1,300	3,440.00	4,472,000
不二製油グループ本社	3,000	3,350.00	10,050,000
かどや製油	100	6,520.00	652,000
J・オイルミルズ	600	3,990.00	2,394,000
キッコーマン	8,800	4,620.00	40,656,000
味の素	25,800	2,126.00	54,850,800
キューピー	6,200	3,035.00	18,817,000
ハウス食品グループ本社	4,300	3,810.00	16,383,000
カゴメ	4,500	4,290.00	19,305,000
焼津水産化学工業	600	1,224.00	734,400
アリアケジャパン	1,000	9,700.00	9,700,000
ピエトロ	200	1,700.00	340,000
エバラ食品工業	200	2,129.00	425,800
ニチレイ	5,300	3,165.00	16,774,500
東洋水産	6,200	4,895.00	30,349,000
イトアンド	100	4,780.00	478,000
大冷	100	2,046.00	204,600
日清食品ホールディングス	4,900	8,370.00	41,013,000
永谷園ホールディングス	1,000	1,400.00	1,400,000
一正蒲鉾	500	1,302.00	651,000
フジッコ	1,200	2,502.00	3,002,400
ロック・フィールド	1,200	2,082.00	2,498,400
日本たばこ産業	69,300	3,718.00	257,657,400
ケンコーマヨネーズ	700	3,995.00	2,796,500
わらべや日洋ホールディングス	700	3,190.00	2,233,000
なとり	600	2,050.00	1,230,000
イフジ産業	200	806.00	161,200
北の達人コーポレーション	1,100	1,406.00	1,546,600
ユーグレナ	4,400	1,028.00	4,523,200
ミヨシ油脂	400	1,545.00	618,000
理研ビタミン	400	4,560.00	1,824,000
片倉工業	1,300	1,456.00	1,892,800
ゲンゼ	900	6,300.00	5,670,000
東洋紡	4,300	2,061.00	8,862,300
ユニチカ	3,400	834.00	2,835,600
富士紡ホールディングス	600	3,715.00	2,229,000

倉敷紡績	12,000	365.00	4,380,000
シキボウ	600	1,394.00	836,400
日本毛織	3,300	1,088.00	3,590,400
ダイトウボウ	2,200	108.00	237,600
トーア紡コーポレーション	500	643.00	321,500
ガイドーリミテッド	1,400	440.00	616,000
帝国繊維	1,200	2,467.00	2,960,400
帝人	9,500	2,532.00	24,054,000
東レ	84,900	1,069.50	90,800,550
サカイオーベックス	300	2,719.00	815,700
住江織物	300	3,105.00	931,500
日本フェルト	600	510.00	306,000
イチカワ	1,000	366.00	366,000
日東製網	100	1,788.00	178,800
アツギ	800	1,287.00	1,029,600
ダイニック	500	1,125.00	562,500
セーレン	2,700	2,203.00	5,948,100
ソトー	400	1,121.00	448,400
東海染工	200	1,440.00	288,000
小松精練	1,800	948.00	1,706,400
ワコールホールディングス	3,200	3,620.00	11,584,000
ホギメディカル	700	8,660.00	6,062,000
レナウン	3,300	184.00	607,200
クラウドディアホールディングス	300	581.00	174,300
T S Iホールディングス	4,400	829.00	3,647,600
三陽商会	600	2,254.00	1,352,400
ナイガイ	500	548.00	274,000
オンワードホールディングス	7,000	980.00	6,860,000
ルック	2,000	380.00	760,000
キムラタン	5,500	48.00	264,000
ゴールドウイン	300	8,990.00	2,697,000
デサント	2,600	1,919.00	4,989,400
キング	600	668.00	400,800
ヤマトインターナショナル	800	443.00	354,400
特種東海製紙	700	4,160.00	2,912,000
王子ホールディングス	49,000	752.00	36,848,000
日本製紙	5,200	2,135.00	11,102,000
三菱製紙	1,700	714.00	1,213,800
北越紀州製紙	6,600	680.00	4,488,000
中越パルプ工業	500	2,025.00	1,012,500
巴川製紙所	2,000	312.00	624,000
大王製紙	4,700	1,499.00	7,045,300
阿波製紙	300	715.00	214,500

レンゴー	11,300	811.00	9,164,300
トーモク	700	2,191.00	1,533,700
ザ・パック	800	3,650.00	2,920,000
クラレ	19,700	2,174.00	42,827,800
旭化成	72,900	1,473.00	107,381,700
共和レザー	700	1,007.00	704,900
昭和電工	7,800	4,970.00	38,766,000
住友化学	86,000	830.00	71,380,000
住友精化	500	6,310.00	3,155,000
日産化学工業	6,800	4,525.00	30,770,000
ラサ工業	400	2,173.00	869,200
クレハ	1,000	7,850.00	7,850,000
多木化学	200	5,860.00	1,172,000
テイカ	900	3,290.00	2,961,000
石原産業	2,100	2,102.00	4,414,200
片倉コープアグリ	300	1,436.00	430,800
日東エフシー	700	808.00	565,600
日本曹達	8,000	736.00	5,888,000
東ソー	16,900	2,576.00	43,534,400
トクヤマ	3,400	3,575.00	12,155,000
セントラル硝子	2,400	2,395.00	5,748,000
東亜合成	6,900	1,464.00	10,101,600
大阪ソーダ	1,000	2,914.00	2,914,000
関東電化工業	2,800	1,342.00	3,757,600
デンカ	4,300	4,520.00	19,436,000
信越化学工業	19,500	11,610.00	226,395,000
日本カーバイド工業	400	2,109.00	843,600
堺化学工業	800	3,040.00	2,432,000
エア・ウォーター	9,600	2,409.00	23,126,400
大陽日酸	9,000	1,592.00	14,328,000
日本化学工業	500	2,530.00	1,265,000
東邦アセチレン	200	1,640.00	328,000
日本パーカラライジング	6,000	1,906.00	11,436,000
高圧ガス工業	1,700	971.00	1,650,700
四国化成工業	1,700	1,802.00	3,063,400
戸田工業	200	4,500.00	900,000
ステラ ケミファ	600	3,590.00	2,154,000
保土谷化学工業	400	5,930.00	2,372,000
日本触媒	1,800	7,690.00	13,842,000
大日精化工業	900	5,590.00	5,031,000
カネカ	16,000	1,023.00	16,368,000
三菱瓦斯化学	10,100	3,270.00	33,027,000
三井化学	10,600	3,675.00	38,955,000

J S R	11,700	2,256.00	26,395,200
東京応化工業	2,000	4,995.00	9,990,000
大阪有機化学工業	800	1,294.00	1,035,200
三菱ケミカルホールディングス	78,300	1,258.50	98,540,550
K Hネオケム	1,800	2,753.00	4,955,400
ダイセル	15,800	1,300.00	20,540,000
住友ベークライト	9,000	956.00	8,604,000
積水化学工業	24,300	2,314.00	56,230,200
日本ゼオン	9,900	1,651.00	16,344,900
アイカ工業	3,300	4,235.00	13,975,500
宇部興産	5,900	3,320.00	19,588,000
積水樹脂	1,800	2,305.00	4,149,000
タキロンシーアイ	2,000	792.00	1,584,000
旭有機材	700	2,056.00	1,439,200
日立化成	5,800	2,884.00	16,727,200
ニチバン	600	3,235.00	1,941,000
リケンテクノス	2,500	623.00	1,557,500
大倉工業	3,000	696.00	2,088,000
積水化成品工業	1,500	1,463.00	2,194,500
群栄化学工業	300	3,760.00	1,128,000
タイガースポリマー	600	824.00	494,400
ミライアル	400	1,790.00	716,000
ダイキアクシス	400	1,638.00	655,200
ダイキョーニシカワ	2,300	1,828.00	4,204,400
竹本容器	200	2,246.00	449,200
日本化薬	7,600	1,695.00	12,882,000
カーリットホールディングス	1,100	1,186.00	1,304,600
日本精化	1,000	1,138.00	1,138,000
扶桑化学工業	800	3,060.00	2,448,000
A D E K A	5,000	1,970.00	9,850,000
日油	4,500	3,100.00	13,950,000
新日本理化	1,900	278.00	528,200
ハリマ化成グループ	900	914.00	822,600
花王	27,400	7,750.00	212,350,000
第一工業製薬	2,000	886.00	1,772,000
日華化学	400	1,283.00	513,200
ニイタカ	200	1,848.00	369,600
三洋化成工業	700	5,940.00	4,158,000
有機合成薬品工業	800	298.00	238,400
大日本塗料	1,300	1,827.00	2,375,100
日本ペイントホールディングス	9,000	3,645.00	32,805,000
関西ペイント	12,300	2,994.00	36,826,200
神東塗料	900	262.00	235,800

中国塗料	3,400	949.00	3,226,600
日本特殊塗料	700	2,284.00	1,598,800
藤倉化成	1,500	743.00	1,114,500
太陽ホールディングス	900	5,080.00	4,572,000
D I C	4,600	4,320.00	19,872,000
サカタインクス	2,400	1,809.00	4,341,600
東洋インキ S C ホールディングス	12,000	678.00	8,136,000
T & K T O K A	800	1,502.00	1,201,600
富士フィルムホールディングス	23,200	4,681.00	108,599,200
資生堂	20,800	5,577.00	116,001,600
ライオン	15,600	2,169.00	33,836,400
高砂香料工業	700	3,470.00	2,429,000
マンダム	2,200	3,715.00	8,173,000
ミルボン	800	7,930.00	6,344,000
ファンケル	2,700	3,295.00	8,896,500
コーセー	1,900	17,880.00	33,972,000
コタ	500	1,610.00	805,000
シーズ・ホールディングス	1,500	5,750.00	8,625,000
シーボン	100	3,460.00	346,000
ポーラ・オルビスホールディングス	4,800	4,095.00	19,656,000
ノエビアホールディングス	700	8,240.00	5,768,000
アジュバンコスメジャパン	300	1,058.00	317,400
エステー	800	2,822.00	2,257,600
アグロ カネショウ	500	2,128.00	1,064,000
コニシ	1,800	2,066.00	3,718,800
長谷川香料	1,500	2,322.00	3,483,000
星光 P M C	600	1,115.00	669,000
小林製薬	3,100	7,560.00	23,436,000
荒川化学工業	1,000	2,300.00	2,300,000
メック	800	2,292.00	1,833,600
日本高純度化学	300	2,615.00	784,500
タカラバイオ	2,900	1,547.00	4,486,300
J C U	700	5,570.00	3,899,000
新田ゼラチン	800	837.00	669,600
O A T アグリオ	200	2,793.00	558,600
デクセリアルズ	2,900	1,449.00	4,202,100
アース製薬	800	5,800.00	4,640,000
北興化学工業	1,200	750.00	900,000
大成ラミック	400	3,175.00	1,270,000
クミアイ化学工業	5,100	771.00	3,932,100
日本農薬	2,900	667.00	1,934,300
アキレス	900	2,374.00	2,136,600
有沢製作所	1,900	1,283.00	2,437,700

日東電工	8,400	10,295.00	86,478,000	
レック	700	2,884.00	2,018,800	
きもと	2,000	324.00	648,000	
藤森工業	900	3,975.00	3,577,500	
前澤化成工業	800	1,258.00	1,006,400	
J S P	600	3,930.00	2,358,000	
エフピコ	900	5,910.00	5,319,000	
天馬	900	2,243.00	2,018,700	
信越ポリマー	2,300	1,271.00	2,923,300	
東リ	2,800	441.00	1,234,800	
ニフコ	2,000	7,720.00	15,440,000	
日本バルカー工業	900	3,055.00	2,749,500	
ユニ・チャーム	23,700	2,971.00	70,412,700	
協和発酵キリン	14,000	2,159.00	30,226,000	
武田薬品工業	41,100	6,447.00	264,971,700	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	114,700	1,440.00	165,168,000	
大日本住友製薬	8,300	1,675.00	13,902,500	
塩野義製薬	16,000	6,217.00	99,472,000	
田辺三菱製薬	13,600	2,388.00	32,476,800	
わかもと製薬	2,000	273.00	546,000	
あすか製薬	1,300	2,019.00	2,624,700	
日本新薬	2,900	8,410.00	24,389,000	
ピオフェルミン製薬	200	2,982.00	596,400	
中外製薬	11,700	5,870.00	68,679,000	
科研製薬	2,000	5,930.00	11,860,000	
エーザイ	13,400	6,148.00	82,383,200	
ロート製薬	6,100	3,075.00	18,757,500	
小野薬品工業	26,400	2,658.00	70,171,200	
久光製薬	3,300	6,880.00	22,704,000	
持田製薬	800	8,670.00	6,936,000	
参天製薬	21,100	1,747.00	36,861,700	
扶桑薬品工業	400	2,867.00	1,146,800	
日本ケミファ	200	4,830.00	966,000	
ツムラ	4,000	3,800.00	15,200,000	
日医工	2,900	1,660.00	4,814,000	
キッセイ薬品工業	2,100	3,250.00	6,825,000	
生化学工業	2,200	1,686.00	3,709,200	
栄研化学	900	5,430.00	4,887,000	
日水製薬	500	1,557.00	778,500	
鳥居薬品	700	2,938.00	2,056,600	
J C R ファーマ	800	5,200.00	4,160,000	
東和薬品	500	6,180.00	3,090,000	
富士製薬工業	400	4,205.00	1,682,000	



沢井製薬	2,200	5,000.00	11,000,000
ゼリア新薬工業	2,400	2,204.00	5,289,600
第一三共	32,000	2,893.00	92,576,000
キョーリン製薬ホールディングス	3,100	2,173.00	6,736,300
大幸薬品	600	2,310.00	1,386,000
ダイト	700	3,230.00	2,261,000
大塚ホールディングス	23,200	5,005.00	116,116,000
大正製薬ホールディングス	2,500	9,120.00	22,800,000
ペプチドリーム	4,600	3,855.00	17,733,000
日本コークス工業	9,600	127.00	1,219,200
昭和シェル石油	10,400	1,552.00	16,140,800
ニチレキ	1,500	1,484.00	2,226,000
ユシロ化学工業	600	1,705.00	1,023,000
ビーピー・カストロール	500	2,202.00	1,101,000
富士石油	2,700	577.00	1,557,900
MORESCO	400	2,200.00	880,000
出光興産	9,400	4,535.00	42,629,000
JXTGホールディングス	178,200	722.50	128,749,500
コスモエネルギーホールディングス	3,200	3,885.00	12,432,000
横浜ゴム	6,500	2,795.00	18,167,500
東洋ゴム工業	6,600	2,361.00	15,582,600
ブリヂストン	39,500	5,397.00	213,181,500
住友ゴム工業	10,900	2,154.00	23,478,600
藤倉ゴム工業	1,000	955.00	955,000
オカモト	4,000	1,140.00	4,560,000
フコク	500	1,128.00	564,000
ニッタ	1,200	4,295.00	5,154,000
住友理工	2,100	1,218.00	2,557,800
三ツ星ベルト	3,000	1,518.00	4,554,000
バンドー化学	2,100	1,327.00	2,786,700
日東紡績	1,700	3,245.00	5,516,500
旭硝子	11,400	4,800.00	54,720,000
日本板硝子	5,700	1,035.00	5,899,500
石塚硝子	100	3,000.00	300,000
日本山村硝子	5,000	189.00	945,000
日本電気硝子	4,800	4,380.00	21,024,000
オハラ	400	3,405.00	1,362,000
住友大阪セメント	22,000	533.00	11,726,000
太平洋セメント	7,100	4,835.00	34,328,500
日本ヒューム	1,200	808.00	969,600
日本コンクリート工業	2,500	477.00	1,192,500
三谷セキサン	600	2,747.00	1,648,200
アジアパイルホールディングス	1,500	717.00	1,075,500

東海カーボン	10,200	1,411.00	14,392,200
日本カーボン	600	5,050.00	3,030,000
東洋炭素	700	3,410.00	2,387,000
ノリタケカンパニーリミテド	700	5,750.00	4,025,000
TOTO	8,600	6,580.00	56,588,000
日本碍子	13,600	2,118.00	28,804,800
日本特殊陶業	9,600	2,723.00	26,140,800
ダントーホールディングス	1,000	144.00	144,000
MARUWA	400	7,820.00	3,128,000
品川リフラクトリーズ	300	3,425.00	1,027,500
黒崎播磨	200	4,760.00	952,000
ヨータイ	700	624.00	436,800
イソライト工業	600	1,069.00	641,400
東京窯業	1,500	433.00	649,500
ニッカトー	400	1,037.00	414,800
フジミインコーポレーテッド	1,000	2,415.00	2,415,000
エーアンドエーマテリアル	300	1,398.00	419,400
ニチアス	6,000	1,464.00	8,784,000
ニチハ	1,700	4,625.00	7,862,500
新日鐵住金	49,400	2,858.00	141,185,200
神戸製鋼所	20,200	1,039.00	20,987,800
合同製鐵	600	2,293.00	1,375,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	29,800	2,705.00	80,609,000
日新製鋼	3,000	1,813.00	5,439,000
東京製鐵	5,900	996.00	5,876,400
共英製鋼	1,300	2,105.00	2,736,500
大和工業	2,400	3,270.00	7,848,000
東京鐵鋼	500	1,999.00	999,500
大阪製鐵	700	2,384.00	1,668,800
淀川製鋼所	1,600	3,555.00	5,688,000
東洋鋼鈑	2,800	481.00	1,346,800
丸一鋼管	3,900	3,300.00	12,870,000
モリ工業	400	3,575.00	1,430,000
大同特殊鋼	2,000	6,830.00	13,660,000
日本高周波鋼業	400	908.00	363,200
日本冶金工業	9,300	240.00	2,232,000
山陽特殊製鋼	1,300	2,851.00	3,706,300
愛知製鋼	600	4,495.00	2,697,000
日立金属	11,900	1,603.00	19,075,700
日本金属	300	2,580.00	774,000
大平洋金属	700	3,080.00	2,156,000
新日本電工	6,700	475.00	3,182,500
栗本鐵工所	600	2,287.00	1,372,200

虹技	200	2,139.00	427,800
日本鑄鉄管	1,000	173.00	173,000
三菱製鋼	800	2,796.00	2,236,800
日亜鋼業	1,700	334.00	567,800
日本精線	200	5,210.00	1,042,000
シンニッタン	900	776.00	698,400
新家工業	300	2,171.00	651,300
大紀アルミニウム工業所	1,900	856.00	1,626,400
日本軽金属ホールディングス	32,400	319.00	10,335,600
三井金属鉱業	3,000	6,540.00	19,620,000
東邦亜鉛	600	6,170.00	3,702,000
三菱マテリアル	7,300	3,925.00	28,652,500
住友金属鉱山	14,100	4,914.00	69,287,400
D O W Aホールディングス	2,800	4,545.00	12,726,000
古河機械金属	1,800	2,309.00	4,156,200
エス・サイエンス	5,400	93.00	502,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,200	2,027.00	2,432,400
東邦チタニウム	2,000	1,126.00	2,252,000
U A C J	1,700	2,941.00	4,999,700
古河電気工業	3,700	5,670.00	20,979,000
住友電気工業	41,300	1,921.00	79,337,300
フジクラ	13,400	1,036.00	13,882,400
昭和電線ホールディングス	1,500	961.00	1,441,500
タツタ電線	2,200	908.00	1,997,600
沖電線	100	3,625.00	362,500
カナレ電気	200	2,550.00	510,000
平河ヒューテック	600	1,281.00	768,600
リョービ	1,400	3,220.00	4,508,000
アーレスティ	1,400	892.00	1,248,800
アサヒホールディングス	1,900	2,078.00	3,948,200
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	300	2,547.00	764,100
トーカロ	800	4,960.00	3,968,000
アルファC o	400	2,356.00	942,400
S U M C O	10,200	2,983.00	30,426,600
川田テクノロジーズ	200	6,020.00	1,204,000
R S T e c h n o l o g i e s	100	6,360.00	636,000
東洋製罐グループホールディングス	7,600	1,817.00	13,809,200
ホッカンホールディングス	3,000	451.00	1,353,000
コロナ	600	1,460.00	876,000
横河ブリッジホールディングス	2,100	2,517.00	5,285,700
駒井ハルテック	300	2,608.00	782,400
高田機工	100	3,255.00	325,500

三和ホールディングス	10,600	1,550.00	16,430,000
文化シャッター	3,200	1,077.00	3,446,400
三協立山	1,500	1,640.00	2,460,000
アルインコ	800	1,238.00	990,400
東洋シャッター	300	616.00	184,800
LIXILグループ	16,300	3,025.00	49,307,500
日本フィルコン	900	772.00	694,800
ノーリツ	2,400	2,243.00	5,383,200
長府製作所	1,200	2,641.00	3,169,200
リンナイ	2,000	10,300.00	20,600,000
ダイニチ工業	600	848.00	508,800
日東精工	1,600	694.00	1,110,400
三洋工業	200	2,154.00	430,800
岡部	2,200	1,108.00	2,437,600
ジーテクト	1,200	2,290.00	2,748,000
中国工業	200	889.00	177,800
東プレ	2,000	3,285.00	6,570,000
高周波熱錬	2,100	1,260.00	2,646,000
東京製綱	800	1,752.00	1,401,600
サンコール	600	749.00	449,400
モリテック スチール	700	755.00	528,500
パイオラックス	1,600	3,405.00	5,448,000
エイチワン	800	1,714.00	1,371,200
日本発條	11,000	1,246.00	13,706,000
中央発條	100	3,695.00	369,500
アドバネクス	200	3,505.00	701,000
立川ブラインド工業	500	1,470.00	735,000
三益半導体工業	1,000	2,051.00	2,051,000
日本ドライケミカル	200	2,513.00	502,600
日本製鋼所	3,600	3,625.00	13,050,000
三浦工業	4,800	3,075.00	14,760,000
タクマ	3,800	1,635.00	6,213,000
ツガミ	3,000	1,450.00	4,350,000
オークマ	1,300	7,660.00	9,958,000
東芝機械	6,000	865.00	5,190,000
アマダホールディングス	17,000	1,548.00	26,316,000
アイダエンジニアリング	2,800	1,388.00	3,886,400
滝澤鉄工所	400	2,135.00	854,000
富士機械製造	3,300	2,194.00	7,240,200
牧野フライス製作所	5,000	1,159.00	5,795,000
オーエスジー	5,000	2,414.00	12,070,000
ダイジェット工業	200	1,897.00	379,400
旭ダイヤモンド工業	3,300	1,304.00	4,303,200

DMG森精機	6,100	2,378.00	14,505,800
ソディック	2,400	1,482.00	3,556,800
ディスコ	1,500	25,630.00	38,445,000
日東工器	700	2,927.00	2,048,900
日進工具	300	2,535.00	760,500
パンチ工業	500	2,680.00	1,340,000
富士ダイス	400	1,173.00	469,200
豊和工業	600	1,756.00	1,053,600
OKK	400	1,301.00	520,400
東洋機械金属	900	940.00	846,000
津田駒工業	3,000	195.00	585,000
島精機製作所	1,400	7,330.00	10,262,000
NCホールディングス	400	801.00	320,400
フリー	800	1,068.00	854,400
ヤマシンフィルタ	1,500	1,439.00	2,158,500
日阪製作所	1,600	1,194.00	1,910,400
やまびこ	2,100	1,696.00	3,561,600
平田機工	300	11,480.00	3,444,000
ペガサスミシン製造	1,100	769.00	845,900
ナブテスコ	6,100	4,445.00	27,114,500
三井海洋開発	1,200	2,791.00	3,349,200
レオン自動機	1,000	1,951.00	1,951,000
SMC	3,500	47,250.00	165,375,000
新川	900	1,149.00	1,034,100
ホソカワミクロン	400	8,120.00	3,248,000
ユニオンツール	500	4,375.00	2,187,500
オイレス工業	1,400	2,285.00	3,199,000
日精エー・エス・ビー機械	400	6,850.00	2,740,000
サトーホールディングス	1,500	3,440.00	5,160,000
技研製作所	600	2,887.00	1,732,200
日本エアーテック	400	938.00	375,200
日精樹脂工業	900	1,755.00	1,579,500
オカダアイヨン	400	2,253.00	901,200
ワイエイシイホールディングス	400	1,070.00	428,000
小松製作所	53,900	4,039.00	217,702,100
住友重機械工業	6,400	4,830.00	30,912,000
日立建機	5,200	4,015.00	20,878,000
日工	300	2,388.00	716,400
巴工業	500	2,115.00	1,057,500
井関農機	1,100	2,866.00	3,152,600
TOWA	900	2,215.00	1,993,500
丸山製作所	300	2,090.00	627,000
北川鉄工所	600	3,115.00	1,869,000

ローツェ	600	2,644.00	1,586,400
タカキタ	400	1,013.00	405,200
クボタ	60,300	2,226.00	134,227,800
荏原実業	400	2,059.00	823,600
三菱化工機	400	2,247.00	898,800
月島機械	2,200	1,533.00	3,372,600
帝国電機製作所	800	1,602.00	1,281,600
新東工業	2,700	1,478.00	3,990,600
澁谷工業	1,000	4,600.00	4,600,000
アイチ コーポレーション	1,900	847.00	1,609,300
小森コーポレーション	2,800	1,572.00	4,401,600
鶴見製作所	900	2,059.00	1,853,100
住友精密工業	2,000	374.00	748,000
酒井重工業	200	4,555.00	911,000
荏原製作所	4,600	4,320.00	19,872,000
石井鐵工所	200	1,748.00	349,600
西島製作所	1,200	1,187.00	1,424,400
北越工業	1,300	1,287.00	1,673,100
ダイキン工業	15,200	13,490.00	205,048,000
オルガノ	400	3,435.00	1,374,000
トーヨーカネツ	500	4,485.00	2,242,500
栗田工業	6,000	3,740.00	22,440,000
椿本チエイン	7,000	902.00	6,314,000
大同工業	500	1,787.00	893,500
木村化工機	1,000	620.00	620,000
アネスト岩田	1,900	1,312.00	2,492,800
ダイフク	5,600	6,370.00	35,672,000
サムコ	300	1,398.00	419,400
加藤製作所	500	3,310.00	1,655,000
油研工業	200	2,736.00	547,200
タダノ	5,400	1,803.00	9,736,200
フジテック	3,600	1,621.00	5,835,600
C K D	3,100	2,562.00	7,942,200
キトー	900	1,786.00	1,607,400
平和	3,500	2,075.00	7,262,500
理想科学工業	1,100	2,095.00	2,304,500
S A N K Y O	2,800	3,555.00	9,954,000
日本金銭機械	1,000	1,102.00	1,102,000
マースエンジニアリング	700	2,513.00	1,759,100
福島工業	700	5,140.00	3,598,000
オーイズミ	500	504.00	252,000
ダイコク電機	500	1,739.00	869,500
竹内製作所	1,900	2,525.00	4,797,500

アマノ	3,400	3,045.00	10,353,000
JUKI	1,700	1,908.00	3,243,600
サンデンホールディングス	1,400	2,268.00	3,175,200
蛇の目マシン工業	1,100	849.00	933,900
マックス	1,700	1,606.00	2,730,200
グローリー	3,300	4,335.00	14,305,500
新晃工業	1,100	2,187.00	2,405,700
大和冷機工業	1,800	1,352.00	2,433,600
セガサミーホールディングス	11,100	1,381.00	15,329,100
日本ピストンリング	400	2,250.00	900,000
リケン	500	6,460.00	3,230,000
T P R	1,200	3,765.00	4,518,000
ツバキ・ナカシマ	1,100	2,627.00	2,889,700
ホシザキ	3,500	10,220.00	35,770,000
大豊工業	900	1,693.00	1,523,700
日本精工	23,000	1,774.00	40,802,000
NTN	25,900	560.00	14,504,000
ジェイテクト	11,900	1,948.00	23,181,200
不二越	10,000	759.00	7,590,000
日本トムソン	3,600	841.00	3,027,600
T H K	7,000	4,320.00	30,240,000
ユーシン精機	500	3,130.00	1,565,000
前澤給装工業	500	1,996.00	998,000
イーグル工業	1,400	2,077.00	2,907,800
前澤工業	800	425.00	340,000
日本ピラー工業	1,100	1,658.00	1,823,800
キッツ	5,000	844.00	4,220,000
マキタ	14,600	4,845.00	70,737,000
日立造船	8,900	576.00	5,126,400
三菱重工業	18,700	4,245.00	79,381,500
I H I	8,600	3,795.00	32,637,000
スター精密	1,800	1,937.00	3,486,600
日清紡ホールディングス	6,800	1,508.00	10,254,400
イビデン	6,800	1,677.00	11,403,600
コニカミノルタ	26,100	1,080.00	28,188,000
ブラザー工業	13,700	2,873.00	39,360,100
ミネベアミツミ	20,500	2,386.00	48,913,000
日立製作所	268,000	889.80	238,466,400
三菱電機	111,700	1,917.50	214,184,750
富士電機	34,000	862.00	29,308,000
東洋電機製造	500	1,910.00	955,000
安川電機	13,000	5,060.00	65,780,000
シンフォニアテクノロジー	7,000	439.00	3,073,000

明電舎	10,000	467.00	4,670,000
オリジン電気	300	1,715.00	514,500
山洋電気	500	8,240.00	4,120,000
デンヨー	1,000	1,994.00	1,994,000
東芝テック	8,000	706.00	5,648,000
芝浦メカトロニクス	2,000	437.00	874,000
マブチモーター	3,100	6,070.00	18,817,000
日本電産	13,400	16,150.00	216,410,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	400	2,930.00	1,172,000
東光高岳	600	1,870.00	1,122,000
ダブル・スコープ	1,600	2,273.00	3,636,800
ダイヘン	6,000	1,010.00	6,060,000
田淵電機	1,700	320.00	544,000
ヤーマン	1,400	1,901.00	2,661,400
JVCケンウッド	8,300	384.00	3,187,200
ミマキエンジニアリング	1,000	1,033.00	1,033,000
第一精工	500	2,948.00	1,474,000
日新電機	2,600	1,335.00	3,471,000
大崎電気工業	2,400	821.00	1,970,400
オムロン	11,900	6,850.00	81,515,000
日東工業	1,800	1,813.00	3,263,400
I D E C	1,400	2,572.00	3,600,800
不二電機工業	100	1,422.00	142,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	20,000	562.00	11,240,000
サクサホールディングス	300	1,994.00	598,200
メルコホールディングス	500	4,035.00	2,017,500
テクノメディカ	300	1,954.00	586,200
日本電気	14,500	3,055.00	44,297,500
富士通	115,000	811.90	93,368,500
沖電気工業	4,500	1,584.00	7,128,000
岩崎通信機	500	780.00	390,000
電気興業	600	3,290.00	1,974,000
サンケン電気	6,000	791.00	4,746,000
ナカヨ	200	2,004.00	400,800
アイホン	600	1,950.00	1,170,000
ルネサスエレクトロニクス	5,800	1,309.00	7,592,200
セイコーエプソン	16,600	2,697.00	44,770,200
ワコム	8,700	620.00	5,394,000
アルバック	1,900	7,160.00	13,604,000
アクセル	500	813.00	406,500
E I Z O	1,000	5,430.00	5,430,000
ジャパンディスプレイ	23,000	233.00	5,359,000
日本信号	3,100	1,181.00	3,661,100



京三製作所	3,000	690.00	2,070,000
能美防災	1,500	2,031.00	3,046,500
ホーチキ	800	2,462.00	1,969,600
エレコム	1,000	2,668.00	2,668,000
パナソニック	127,600	1,674.50	213,666,200
アンリツ	8,100	1,285.00	10,408,500
富士通ゼネラル	3,400	2,486.00	8,452,400
日立国際電気	2,200	3,110.00	6,842,000
ソニー	74,500	5,191.00	386,729,500
T D K	5,800	8,950.00	51,910,000
帝国通信工業	500	1,299.00	649,500
タムラ製作所	4,300	829.00	3,564,700
アルプス電気	9,600	3,290.00	31,584,000
池上通信機	4,000	172.00	688,000
パイオニア	18,700	229.00	4,282,300
日本電波工業	1,000	758.00	758,000
鈴木	400	1,145.00	458,000
日本トリム	200	5,110.00	1,022,000
ローランド ディー . ジー .	600	3,200.00	1,920,000
フォスター電機	1,300	2,807.00	3,649,100
クラリオン	6,000	411.00	2,466,000
S M K	3,000	604.00	1,812,000
ヨコオ	700	1,632.00	1,142,400
ホシデン	2,800	1,695.00	4,746,000
ヒロセ電機	1,800	16,910.00	30,438,000
日本航空電子工業	3,000	1,882.00	5,646,000
T O A	1,200	1,451.00	1,741,200
マクセルホールディングス	2,200	2,441.00	5,370,200
古野電気	1,300	847.00	1,101,100
ユニデンホールディングス	3,000	295.00	885,000
アルパイン	2,700	2,366.00	6,388,200
スミダコーポレーション	1,100	1,931.00	2,124,100
アイコム	600	2,723.00	1,633,800
リオン	500	2,234.00	1,117,000
本多通信工業	900	1,135.00	1,021,500
船井電機	1,200	867.00	1,040,400
横河電機	11,200	2,212.00	24,774,400
新電元工業	400	8,420.00	3,368,000
アズビル	3,300	5,060.00	16,698,000
東亜ディーケーケー	600	1,032.00	619,200
日本光電工業	4,700	2,659.00	12,497,300
チノー	400	1,725.00	690,000
共和電業	1,300	469.00	609,700

日本電子材料	500	599.00	299,500
堀場製作所	2,200	6,890.00	15,158,000
アドバンテスト	6,200	2,109.00	13,075,800
小野測器	500	737.00	368,500
エスベック	1,000	2,834.00	2,834,000
キーエンス	5,500	65,250.00	358,875,000
日置電機	600	2,986.00	1,791,600
シスメックス	8,700	8,900.00	77,430,000
日本マイクロニクス	2,000	1,122.00	2,244,000
メガチップス	900	3,340.00	3,006,000
O B A R A G R O U P	700	7,840.00	5,488,000
澤藤電機	100	2,252.00	225,200
コーセル	1,600	1,905.00	3,048,000
イリソ電子工業	900	6,640.00	5,976,000
新日本無線	700	1,040.00	728,000
オブテックスグループ	900	6,030.00	5,427,000
千代田インテグレ	500	2,840.00	1,420,000
アイ・オー・データ機器	500	1,061.00	530,500
レーザーテック	2,500	2,890.00	7,225,000
スタンレー電気	8,600	4,620.00	39,732,000
岩崎電気	500	1,647.00	823,500
ウシオ電機	6,800	1,645.00	11,186,000
岡谷電機産業	600	613.00	367,800
ヘリオス テクノ ホールディング	1,000	1,080.00	1,080,000
日本セラミック	1,100	3,010.00	3,311,000
遠藤照明	600	1,245.00	747,000
古河電池	800	1,159.00	927,200
双信電機	500	765.00	382,500
山一電機	800	2,013.00	1,610,400
図研	700	1,866.00	1,306,200
日本電子	4,000	639.00	2,556,000
カシオ計算機	9,000	1,624.00	14,616,000
ファナック	10,600	27,740.00	294,044,000
日本シイエムケイ	2,000	1,037.00	2,074,000
エンプラス	500	4,710.00	2,355,000
大真空	400	1,674.00	669,600
ローム	5,000	12,510.00	62,550,000
浜松ホトニクス	8,100	3,850.00	31,185,000
三井ハイテック	1,500	2,084.00	3,126,000
新光電気工業	4,200	899.00	3,775,800
京セラ	18,300	7,564.00	138,421,200
太陽誘電	5,000	1,742.00	8,710,000
村田製作所	11,700	15,250.00	178,425,000

ユーシン	1,700	775.00	1,317,500	
双葉電子工業	1,800	2,369.00	4,264,200	
北陸電気工業	400	1,701.00	680,400	
ニチコン	3,500	1,465.00	5,127,500	
日本ケミコン	900	3,495.00	3,145,500	
K O A	1,500	2,246.00	3,369,000	
市光工業	1,700	994.00	1,689,800	
小糸製作所	6,700	8,020.00	53,734,000	
ミツバ	2,100	1,655.00	3,475,500	
S C R E E Nホールディングス	2,100	9,360.00	19,656,000	
キャノン電子	1,000	2,557.00	2,557,000	
キャノン	60,100	4,419.00	265,581,900	代用有価証券 10,000株
リコー	33,600	1,072.00	36,019,200	
M U T O Hホールディングス	200	2,442.00	488,400	
東京エレクトロン	7,400	20,800.00	153,920,000	
トヨタ紡織	3,300	2,355.00	7,771,500	
芦森工業	300	2,890.00	867,000	
ユニプレス	2,100	3,020.00	6,342,000	
豊田自動織機	9,000	7,280.00	65,520,000	
モリタホールディングス	1,800	2,067.00	3,720,600	
三櫻工業	1,400	884.00	1,237,600	
デンソー	24,800	6,807.00	168,813,600	
東海理化電機製作所	2,900	2,386.00	6,919,400	
三井造船	4,000	1,658.00	6,632,000	
川崎重工業	8,700	3,675.00	31,972,500	
名村造船所	3,400	694.00	2,359,600	
サノヤスホールディングス	1,400	305.00	427,000	
日本車輛製造	4,000	331.00	1,324,000	
三菱ロジスネクスト	1,300	1,056.00	1,372,800	
近畿車輛	200	2,899.00	579,800	
日産自動車	131,700	1,128.00	148,557,600	
いすゞ自動車	32,400	1,861.50	60,312,600	
トヨタ自動車	135,700	7,282.00	988,167,400	代用有価証券 35,000株
日野自動車	16,000	1,460.00	23,360,000	
三菱自動車工業	41,400	811.00	33,575,400	
エフテック	700	1,723.00	1,206,100	
レシップホールディングス	400	935.00	374,000	
G M B	200	2,123.00	424,600	
ファルテック	200	1,456.00	291,200	
武蔵精密工業	1,200	3,435.00	4,122,000	
日産車体	4,400	1,148.00	5,051,200	
新明和工業	4,900	1,075.00	5,267,500	

極東開発工業	2,100	2,008.00	4,216,800
日信工業	2,300	2,227.00	5,122,100
トピー工業	900	3,450.00	3,105,000
ティラド	400	4,005.00	1,602,000
曙ブレーキ工業	5,200	308.00	1,601,600
タチエス	1,900	2,109.00	4,007,100
N O K	6,000	2,660.00	15,960,000
フタバ産業	3,400	1,057.00	3,593,800
K Y B	1,200	6,560.00	7,872,000
大同メタル工業	1,400	1,104.00	1,545,600
プレス工業	5,900	681.00	4,017,900
ミクニ	1,400	822.00	1,150,800
太平洋工業	2,300	1,767.00	4,064,100
ケーヒン	2,600	2,267.00	5,894,200
河西工業	1,400	1,822.00	2,550,800
アイシン精機	9,200	6,400.00	58,880,000
富士機工	1,100	739.00	812,900
マツダ	35,100	1,501.00	52,685,100
今仙電機製作所	1,100	1,352.00	1,487,200
本田技研工業	100,500	3,929.00	394,864,500
スズキ	22,100	6,524.00	144,180,400
S U B A R U	34,700	3,530.00	122,491,000
安永	500	2,526.00	1,263,000
ヤマハ発動機	15,800	3,735.00	59,013,000
ショーワ	2,900	1,362.00	3,949,800
T B K	1,400	544.00	761,600
エクセディ	1,300	3,470.00	4,511,000
豊田合成	4,100	2,905.00	11,910,500
愛三工業	2,000	1,354.00	2,708,000
盟和産業	200	1,302.00	260,400
ヨロズ	1,100	2,462.00	2,708,200
エフ・シー・シー	1,800	2,960.00	5,328,000
シマノ	4,500	16,060.00	72,270,000
テイ・エス テック	2,600	4,645.00	12,077,000
ジャムコ	600	2,724.00	1,634,400
テルモ	17,100	5,350.00	91,485,000
クリエートメディック	400	1,378.00	551,200
日機装	3,900	1,240.00	4,836,000
島津製作所	13,300	2,594.00	34,500,200
J M S	1,000	636.00	636,000
長野計器	900	1,265.00	1,138,500
ブイ・テクノロジー	300	18,380.00	5,514,000
東京計器	700	1,383.00	968,100

愛知時計電機	100	4,515.00	451,500
インターアクション	400	881.00	352,400
オーバル	1,100	297.00	326,700
東京精密	2,000	4,595.00	9,190,000
マニー	1,300	3,420.00	4,446,000
ニコン	19,500	2,293.00	44,713,500
トプコン	6,000	2,419.00	14,514,000
オリンパス	16,600	4,370.00	72,542,000
理研計器	1,100	2,564.00	2,820,400
タムロン	900	2,503.00	2,252,700
H O Y A	23,000	5,732.00	131,836,000
シード	100	4,875.00	487,500
ノーリツ銅機	1,100	2,299.00	2,528,900
エー・アンド・デイ	1,000	846.00	846,000
シチズン時計	13,400	842.00	11,282,800
リズム時計工業	400	2,288.00	915,200
大研医器	1,000	761.00	761,000
メニコン	800	6,150.00	4,920,000
松風	500	1,486.00	743,000
セイコーホールディングス	1,700	3,250.00	5,525,000
ニプロ	7,700	1,653.00	12,728,100
中本パックス	100	4,015.00	401,500
スノーピーク	400	1,412.00	564,800
パラマウントベッドホールディングス	1,200	5,560.00	6,672,000
トランザクション	500	1,019.00	509,500
S H O - B I	400	433.00	173,200
ニホンフラッシュ	500	3,210.00	1,605,000
前田工織	1,100	2,037.00	2,240,700
永大産業	2,000	574.00	1,148,000
アートネイチャー	1,200	790.00	948,000
ダンロップスポーツ	700	1,692.00	1,184,400
バンダイナムコホールディングス	11,600	3,775.00	43,790,000
アイフィスジャパン	300	618.00	185,400
共立印刷	1,800	376.00	676,800
S H O E I	500	5,250.00	2,625,000
フランスベッドホールディングス	1,400	1,038.00	1,453,200
パイロットコーポレーション	2,000	5,490.00	10,980,000
萩原工業	600	2,060.00	1,236,000
トッパン・フォームズ	2,400	1,288.00	3,091,200
フジシールインターナショナル	2,500	3,820.00	9,550,000
タカラトミー	4,700	1,517.00	7,129,900
廣済堂	1,100	424.00	466,400
A s - m e エステール	400	1,034.00	413,600

アーク	4,700	117.00	549,900
タカノ	500	1,163.00	581,500
プロネクサス	1,000	1,508.00	1,508,000
ホクシン	900	198.00	178,200
ウッドワン	400	1,565.00	626,000
大建工業	900	2,909.00	2,618,100
凸版印刷	31,000	1,018.00	31,558,000
大日本印刷	14,600	2,504.00	36,558,400
図書印刷	800	988.00	790,400
共同印刷	300	3,635.00	1,090,500
N I S S H A	2,200	3,380.00	7,436,000
光村印刷	100	2,347.00	234,700
宝印刷	600	1,766.00	1,059,600
アシックス	11,100	1,760.00	19,536,000
ツツミ	400	2,140.00	856,000
小松ウオール工業	400	2,432.00	972,800
ヤマハ	7,500	4,090.00	30,675,000
河合楽器製作所	400	2,592.00	1,036,800
クリナップ	1,000	871.00	871,000
ピジョン	6,700	4,365.00	29,245,500
兼松サステック	100	2,087.00	208,700
キングジム	1,000	1,014.00	1,014,000
リンテック	2,700	3,135.00	8,464,500
イトーキ	2,400	832.00	1,996,800
任天堂	6,900	42,360.00	292,284,000
三菱鉛筆	1,800	2,471.00	4,447,800
タカラスタンド	2,300	1,808.00	4,158,400
コクヨ	5,400	2,147.00	11,593,800
ナカバヤシ	1,100	726.00	798,600
岡村製作所	3,900	1,586.00	6,185,400
美津濃	1,100	3,315.00	3,646,500
東京電力ホールディングス	89,100	441.00	39,293,100
中部電力	34,200	1,390.50	47,555,100
関西電力	45,600	1,371.00	62,517,600
中国電力	15,500	1,206.00	18,693,000
北陸電力	11,000	900.00	9,900,000
東北電力	26,200	1,437.00	37,649,400
四国電力	10,100	1,226.00	12,382,600
九州電力	24,700	1,171.00	28,923,700
北海道電力	11,200	732.00	8,198,400
沖縄電力	1,800	2,979.00	5,362,200
電源開発	8,900	3,020.00	26,878,000
エフオン	600	1,440.00	864,000

イーレックス	1,800	1,052.00	1,893,600
東京瓦斯	23,800	2,607.50	62,058,500
大阪瓦斯	21,700	2,201.00	47,761,700
東邦瓦斯	5,500	3,095.00	17,022,500
北海道瓦斯	3,000	297.00	891,000
広島ガス	2,300	369.00	848,700
西部瓦斯	1,300	2,721.00	3,537,300
静岡ガス	3,200	942.00	3,014,400
メタウォーター	600	2,834.00	1,700,400
SBSホールディングス	1,100	1,125.00	1,237,500
東武鉄道	12,000	3,700.00	44,400,000
相鉄ホールディングス	3,600	2,994.00	10,778,400
東京急行電鉄	30,300	1,802.00	54,600,600
京浜急行電鉄	15,300	2,185.00	33,430,500
小田急電鉄	16,600	2,429.00	40,321,400
京王電鉄	6,300	5,060.00	31,878,000
京成電鉄	7,800	3,725.00	29,055,000
富士急行	1,500	3,310.00	4,965,000
東日本旅客鉄道	20,100	11,130.00	223,713,000
西日本旅客鉄道	10,100	8,338.00	84,213,800
東海旅客鉄道	10,000	20,280.00	202,800,000
西武ホールディングス	14,300	2,059.00	29,443,700
鴻池運輸	1,600	1,950.00	3,120,000
西日本鉄道	3,100	3,040.00	9,424,000
ハマキョウレックス	800	3,175.00	2,540,000
サカイ引越センター	600	5,730.00	3,438,000
近鉄グループホールディングス	10,600	4,375.00	46,375,000
阪急阪神ホールディングス	14,100	4,595.00	64,789,500
南海電気鉄道	5,000	2,824.00	14,120,000
京阪ホールディングス	4,700	3,330.00	15,651,000
神戸電鉄	300	3,980.00	1,194,000
名古屋鉄道	8,100	2,861.00	23,174,100
山陽電気鉄道	800	2,798.00	2,238,400
日本通運	4,100	7,630.00	31,283,000
ヤマトホールディングス	18,600	2,302.00	42,817,200
山九	2,700	4,945.00	13,351,500
丸運	500	326.00	163,000
丸全昭和運輸	4,000	509.00	2,036,000
センコーグループホールディングス	6,300	811.00	5,109,300
トナミホールディングス	200	5,590.00	1,118,000
ニッコンホールディングス	4,000	3,180.00	12,720,000
日本石油輸送	100	3,905.00	390,500
福山通運	1,500	4,265.00	6,397,500

セイノーホールディングス	7,900	1,803.00	14,243,700
神奈川中央交通	300	3,650.00	1,095,000
日立物流	2,300	2,953.00	6,791,900
丸和運輸機関	500	3,780.00	1,890,000
C & F ロジホールディングス	1,100	1,645.00	1,809,500
九州旅客鉄道	8,900	3,550.00	31,595,000
日本郵船	8,800	2,701.00	23,768,800
商船三井	6,700	3,745.00	25,091,500
川崎汽船	4,900	2,866.00	14,043,400
N S ユナイテッド海運	500	2,746.00	1,373,000
明治海運	1,200	454.00	544,800
飯野海運	5,400	622.00	3,358,800
共栄タンカー	100	2,123.00	212,300
乾汽船	800	750.00	600,000
日本航空	19,600	4,428.00	86,788,800
A N A ホールディングス	20,700	4,728.00	97,869,600
パスコ	1,000	328.00	328,000
トランコム	300	7,870.00	2,361,000
日新	900	3,165.00	2,848,500
三菱倉庫	3,700	2,951.00	10,918,700
三井倉庫ホールディングス	6,000	374.00	2,244,000
住友倉庫	7,000	832.00	5,824,000
澁澤倉庫	600	2,050.00	1,230,000
東陽倉庫	2,000	328.00	656,000
日本トランスシティ	2,000	485.00	970,000
ケイヒン	200	1,661.00	332,200
中央倉庫	700	1,238.00	866,600
川西倉庫	200	2,358.00	471,600
安田倉庫	1,000	934.00	934,000
東洋埠頭	300	1,802.00	540,600
宇徳	900	546.00	491,400
上組	6,700	2,536.00	16,991,200
サンリツ	300	898.00	269,400
キムラユニティー	300	1,178.00	353,400
キューソー流通システム	300	3,155.00	946,500
郵船ロジスティクス	1,000	1,503.00	1,503,000
近鉄エクスプレス	2,000	2,344.00	4,688,000
東海運	600	401.00	240,600
エーアイティー	800	1,330.00	1,064,000
内外トランスライン	400	2,051.00	820,400
日本コンセプト	200	1,368.00	273,600
N E C ネットズエスアイ	1,200	2,966.00	3,559,200
システナ	900	3,560.00	3,204,000



デジタルアーツ	500	4,535.00	2,267,500
新日鉄住金ソリューションズ	1,700	3,025.00	5,142,500
キューブシステム	600	838.00	502,800
コア	500	1,505.00	752,500
ソフトクリエイトホールディングス	500	1,556.00	778,000
T I S	3,600	3,930.00	14,148,000
ネオス	400	410.00	164,000
電算システム	400	2,166.00	866,400
グリー	6,700	708.00	4,743,600
コーエーテックモホールディングス	1,900	2,317.00	4,402,300
三菱総合研究所	500	4,025.00	2,012,500
ボルテージ	200	1,065.00	213,000
電算	100	2,504.00	250,400
A G S	600	935.00	561,000
ファインデックス	900	746.00	671,400
ヒト・コミュニケーションズ	200	2,549.00	509,800
ブレインパッド	300	1,333.00	399,900
K L a b	2,100	1,821.00	3,824,100
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	800	2,098.00	1,678,400
イーブックイニシアティブジャパン	200	1,043.00	208,600
ネクソン	12,300	3,275.00	40,282,500
アイスタイル	2,500	897.00	2,242,500
エムアップ	400	1,314.00	525,600
エイチーム	800	2,717.00	2,173,600
テクノスジャパン	1,000	919.00	919,000
e n i s h	300	1,355.00	406,500
コロプラ	3,600	1,191.00	4,287,600
モバイルクリエイト	900	374.00	336,600
オルトプラス	600	1,023.00	613,800
ブロードリーフ	2,700	1,098.00	2,964,600
ハーツユニテッドグループ	600	1,726.00	1,035,600
メディアドゥホールディングス	400	2,387.00	954,800
ブイキューブ	700	528.00	369,600
サイバーリンクス	200	1,397.00	279,400
ディー・エル・イー	500	488.00	244,000
フィックスターズ	200	5,820.00	1,164,000
VOYAGE GROUP	600	1,416.00	849,600
オブティム	200	2,664.00	532,800
セレス	300	2,126.00	637,800
ベリサーブ	100	3,665.00	366,500
ティーガイア	1,100	2,581.00	2,839,100
セック	100	2,477.00	247,700
日本アジアグループ	1,200	503.00	603,600

豆蔵ホールディングス	800	1,275.00	1,020,000
テクマトリックス	600	1,925.00	1,155,000
プロシップ	100	2,423.00	242,300
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	29,700	312.00	9,266,400
GMOペイメントゲートウェイ	800	9,320.00	7,456,000
ザッパラス	600	395.00	237,000
システムリサーチ	100	2,105.00	210,500
インターネットイニシアティブ	1,800	2,084.00	3,751,200
さくらインターネット	1,300	808.00	1,050,400
ヴィンクス	100	1,246.00	124,600
GMOクラウド	200	2,357.00	471,400
SRAホールディングス	600	4,155.00	2,493,000
Minorityソリューションズ	200	1,501.00	300,200
システムインテグレータ	200	913.00	182,600
朝日ネット	1,000	535.00	535,000
アドソル日進	400	1,223.00	489,200
フリービット	800	1,116.00	892,800
コムチュア	600	2,885.00	1,731,000
サイバーコム	200	1,127.00	225,400
メディカル・データ・ビジョン	400	2,228.00	891,200
gumi	1,300	1,022.00	1,328,600
ショーケース・ティービー	200	1,493.00	298,600
モバイルファクトリー	200	1,310.00	262,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	100	2,159.00	215,900
PCIホールディングス	200	3,060.00	612,000
パイプドHD	200	1,158.00	231,600
アイビーシー	100	1,048.00	104,800
オープンドア	100	7,420.00	742,000
アカツキ	200	6,580.00	1,316,000
LINE	3,100	4,660.00	14,446,000
シンクロ・フード	100	2,628.00	262,800
オークネット	300	1,478.00	443,400
AOI TYO Holdings	900	1,318.00	1,186,200
マクロミル	1,400	2,631.00	3,683,400
ソルクシーズ	400	1,276.00	510,400
フェイス	400	1,303.00	521,200
ハイマックス	100	1,783.00	178,300
野村総合研究所	7,300	5,270.00	38,471,000
サイバネットシステム	900	709.00	638,100
CEホールディングス	300	836.00	250,800
日本システム技術	200	1,346.00	269,200
インテージホールディングス	1,300	1,423.00	1,849,900
東邦システムサイエンス	400	828.00	331,200

ソースネクスト	800	1,296.00	1,036,800
フォーカスシステムズ	600	902.00	541,200
クレスコ	200	4,645.00	929,000
フジ・メディア・ホールディングス	11,500	1,752.00	20,148,000
オービック	3,500	8,360.00	29,260,000
ジャストシステム	1,800	2,183.00	3,929,400
TDCソフト	500	1,164.00	582,000
ヤフー	79,000	510.00	40,290,000
トレンドマイクロ	5,400	6,430.00	34,722,000
インフォメーション・ディベロプメント	300	1,381.00	414,300
日本オラクル	1,800	9,440.00	16,992,000
アルファシステムズ	400	2,469.00	987,600
フューチャー	1,500	1,219.00	1,828,500
CAC Holdings	800	1,111.00	888,800
ソフトバンク・テクノロジー	400	1,895.00	758,000
トーセ	300	2,107.00	632,100
オービックビジネスコンサルタント	600	6,450.00	3,870,000
伊藤忠テクノソリューションズ	2,500	4,940.00	12,350,000
アイティフォー	1,300	812.00	1,055,600
東計電算	200	3,465.00	693,000
エクスネット	200	909.00	181,800
大塚商会	3,300	8,780.00	28,974,000
サイボウズ	1,500	509.00	763,500
ソフトブレーン	900	407.00	366,300
電通国際情報サービス	700	2,615.00	1,830,500
デジタルガレージ	2,000	3,020.00	6,040,000
EMシステムズ	400	2,513.00	1,005,200
ウェザーニューズ	400	3,390.00	1,356,000
C I J	1,000	721.00	721,000
東洋ビジネスエンジニアリング	100	1,849.00	184,900
日本エンタープライズ	1,200	232.00	278,400
WOWOW	500	3,325.00	1,662,500
スカラ	800	708.00	566,400
イマジカ・ロボットホールディングス	900	1,137.00	1,023,300
ネットワンシステムズ	4,500	1,738.00	7,821,000
システムソフト	2,700	142.00	383,400
アルゴグラフィックス	500	3,385.00	1,692,500
マーベラス	1,900	1,027.00	1,951,300
エイベックス	2,000	1,589.00	3,178,000
日本ユニシス	3,000	2,287.00	6,861,000
兼松エレクトロニクス	700	3,380.00	2,366,000
東京放送ホールディングス	6,600	2,832.00	18,691,200
日本テレビホールディングス	10,000	1,930.00	19,300,000

朝日放送	1,100	914.00	1,005,400
テレビ朝日ホールディングス	3,000	2,300.00	6,900,000
スカパーJ S A Tホールディングス	8,300	512.00	4,249,600
テレビ東京ホールディングス	900	2,400.00	2,160,000
日本BS放送	400	1,291.00	516,400
ビジョン	300	2,695.00	808,500
USEN-NEXT HOLDINGS	300	992.00	297,600
ワイヤレスゲート	500	1,319.00	659,500
コネクシオ	800	2,383.00	1,906,400
日本通信	10,200	104.00	1,060,800
クロップス	300	1,157.00	347,100
日本電信電話	78,600	5,377.00	422,632,200
KDDI	98,700	2,837.50	280,061,250
光通信	1,300	16,430.00	21,359,000
NTTドコモ	81,100	2,685.00	217,753,500
エムティーアイ	1,500	626.00	939,000
GMOインターネット	4,000	1,936.00	7,744,000
アйдママーケティングコミュニケーション	200	701.00	140,200
カドカワ	3,200	1,372.00	4,390,400
学研ホールディングス	400	4,840.00	1,936,000
ゼンリン	1,300	3,720.00	4,836,000
昭文社	500	740.00	370,000
インプレスホールディングス	1,100	163.00	179,300
アイネット	600	1,689.00	1,013,400
松竹	700	19,510.00	13,657,000
東宝	7,200	3,915.00	28,188,000
東映	400	11,670.00	4,668,000
エヌ・ティ・ティ・データ	34,000	1,343.00	45,662,000
ピー・シー・エー	200	1,791.00	358,200
ビジネスブレイン太田昭和	200	1,800.00	360,000
D T S	1,100	3,705.00	4,075,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,100	5,540.00	28,254,000
シーイーシー	700	3,350.00	2,345,000
カブコン	2,400	3,570.00	8,568,000
アイ・エス・ピー	200	1,322.00	264,400
ジャステック	700	1,275.00	892,500
S C S K	2,600	5,240.00	13,624,000
日本システムウエア	400	2,670.00	1,068,000
アイネス	1,400	1,167.00	1,633,800
T K C	1,000	4,080.00	4,080,000
富士ソフト	1,500	3,560.00	5,340,000
N S D	1,800	2,363.00	4,253,400
コナミホールディングス	4,500	6,320.00	28,440,000

福井コンピュータホールディングス	300	3,235.00	970,500
J B C Cホールディングス	900	1,126.00	1,013,400
ミロク情報サービス	1,000	3,045.00	3,045,000
ソフトバンクグループ	49,600	8,956.00	444,217,600
ハウスイ	100	1,183.00	118,300
高千穂交易	400	1,150.00	460,000
伊藤忠食品	300	6,320.00	1,896,000
エレマテック	500	2,627.00	1,313,500
J A L U X	300	2,883.00	864,900
あらた	500	6,060.00	3,030,000
トーメンデバイス	100	3,415.00	341,500
東京エレクトロン デバイス	400	2,015.00	806,000
フィールズ	800	1,222.00	977,600
双日	65,100	341.00	22,199,100
アルフレッサ ホールディングス	12,200	2,658.00	32,427,600
横浜冷凍	2,600	1,155.00	3,003,000
神栄	100	1,535.00	153,500
ラサ商事	500	1,014.00	507,000
ラクーン	700	814.00	569,800
アルコニックス	1,200	2,359.00	2,830,800
神戸物産	700	4,360.00	3,052,000
ペッパーフードサービス	600	5,010.00	3,006,000
あい ホールディングス	1,600	2,707.00	4,331,200
ディーブイエックス	400	1,334.00	533,600
ダイワボウホールディングス	900	4,625.00	4,162,500
マクニカ・富士エレホールディングス	2,000	2,526.00	5,052,000
ラクト・ジャパン	200	4,615.00	923,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,000	1,006.00	2,012,000
八洲電機	900	1,041.00	936,900
メディアスホールディングス	200	2,466.00	493,200
U K Cホールディングス	700	2,326.00	1,628,200
ジュテックホールディングス	300	1,364.00	409,200
大光	200	978.00	195,600
O C H Iホールディングス	300	1,496.00	448,800
T O K A Iホールディングス	5,800	937.00	5,434,600
大阪工機	200	1,131.00	226,200
三洋貿易	600	2,711.00	1,626,600
ビューティガレージ	100	1,978.00	197,800
ウイン・パートナーズ	800	1,393.00	1,114,400
ミタチ産業	300	1,632.00	489,600
シップヘルスケアホールディングス	2,300	3,725.00	8,567,500
明治電機工業	400	1,831.00	732,400
デリカフーズホールディングス	200	1,490.00	298,000

スターティア	200	972.00	194,400
コメダホールディングス	2,000	2,048.00	4,096,000
富士興産	500	581.00	290,500
協栄産業	200	2,154.00	430,800
小野建	1,000	2,066.00	2,066,000
佐島電機	800	1,209.00	967,200
エコートレーディング	300	700.00	210,000
伯東	700	1,933.00	1,353,100
コンドーテック	900	1,080.00	972,000
中山福	700	789.00	552,300
ナガイレーベン	1,400	2,679.00	3,750,600
三菱食品	1,200	3,320.00	3,984,000
松田産業	800	1,830.00	1,464,000
第一興商	1,600	5,630.00	9,008,000
メディバルホールディングス	11,000	2,238.00	24,618,000
S P K	300	3,220.00	966,000
萩原電気	400	3,635.00	1,454,000
アズワン	900	6,960.00	6,264,000
スズデン	400	1,630.00	652,000
シモジマ	700	1,246.00	872,200
ドウシシャ	1,200	2,326.00	2,791,200
小津産業	300	2,149.00	644,700
高速	700	1,342.00	939,400
たけびし	400	1,873.00	749,200
黒田電気	1,400	2,709.00	3,792,600
リックス	200	1,918.00	383,600
丸文	1,000	1,136.00	1,136,000
ハピネット	800	2,143.00	1,714,400
橋本総業ホールディングス	300	1,830.00	549,000
日本ライフライン	1,600	4,725.00	7,560,000
エクセル	400	2,679.00	1,071,600
マルカキカイ	400	2,147.00	858,800
I D O M	3,300	797.00	2,630,100
日本エム・ディ・エム	800	925.00	740,000
進和	700	2,733.00	1,913,100
エスケイジャパン	300	444.00	133,200
ダイトロン	500	2,406.00	1,203,000
シークス	700	4,780.00	3,346,000
田中商事	400	831.00	332,400
オーハシテクニカ	600	1,794.00	1,076,400
白銅	400	2,373.00	949,200
伊藤忠商事	80,700	2,112.00	170,438,400
丸紅	90,300	812.90	73,404,870

高島	200	2,221.00	444,200
長瀬産業	6,600	2,070.00	13,662,000
蝶理	700	2,098.00	1,468,600
豊田通商	12,300	4,550.00	55,965,000
三共生興	1,900	488.00	927,200
兼松	4,700	1,582.00	7,435,400
ツカモトコーポレーション	200	1,300.00	260,000
三井物産	93,400	1,804.50	168,540,300
日本紙パルプ商事	600	4,240.00	2,544,000
日立ハイテクノロジーズ	3,800	4,735.00	17,993,000
カメイ	1,400	1,916.00	2,682,400
東都水産	200	2,023.00	404,600
OUGホールディングス	200	2,698.00	539,600
スターゼン	400	5,430.00	2,172,000
山善	4,300	1,339.00	5,757,700
椿本興業	300	2,885.00	865,500
住友商事	69,400	1,927.50	133,768,500
内田洋行	500	3,195.00	1,597,500
三菱商事	77,200	3,063.00	236,463,600
第一実業	500	3,395.00	1,697,500
キヤノンマーケティングジャパン	3,100	3,115.00	9,656,500
西華産業	700	3,070.00	2,149,000
佐藤商事	1,000	1,357.00	1,357,000
菱洋エレクトロ	1,000	2,047.00	2,047,000
東京産業	1,100	537.00	590,700
ユアサ商事	1,000	4,085.00	4,085,000
神鋼商事	300	3,255.00	976,500
小林産業	800	356.00	284,800
阪和興業	2,100	5,070.00	10,647,000
正栄食品工業	600	4,840.00	2,904,000
カナデン	1,000	1,416.00	1,416,000
菱電商事	800	1,818.00	1,454,400
フルサト工業	600	1,885.00	1,131,000
岩谷産業	2,400	3,605.00	8,652,000
すてきナイスグループ	500	1,534.00	767,000
昭光通商	4,000	137.00	548,000
ニチモウ	200	1,957.00	391,400
極東貿易	1,000	513.00	513,000
イワキ	1,000	500.00	500,000
三愛石油	2,900	1,638.00	4,750,200
稲畑産業	2,600	1,704.00	4,430,400
G S I クレオス	300	1,575.00	472,500
明和産業	1,100	481.00	529,100

ワキタ	2,400	1,389.00	3,333,600
東邦ホールディングス	3,300	2,541.00	8,385,300
サンゲツ	3,700	2,108.00	7,799,600
ミツウロコグループホールディングス	1,600	875.00	1,400,000
シナネンホールディングス	500	2,689.00	1,344,500
伊藤忠エネクス	2,400	1,099.00	2,637,600
サンリオ	3,100	1,860.00	5,766,000
サンワテクノス	700	2,261.00	1,582,700
リョーサン	1,400	4,355.00	6,097,000
新光商事	1,200	2,109.00	2,530,800
トーヨー	500	2,812.00	1,406,000
三信電気	1,000	1,874.00	1,874,000
東陽テクニカ	1,300	984.00	1,279,200
モスフードサービス	1,400	3,415.00	4,781,000
加賀電子	1,000	3,125.00	3,125,000
ソーダニッカ	1,200	620.00	744,000
立花エレテック	700	1,943.00	1,360,100
フォーバル	500	869.00	434,500
PALTAC	1,500	5,200.00	7,800,000
三谷産業	1,200	440.00	528,000
太平洋興発	500	1,055.00	527,500
西本Wismettacホールディングス	200	4,265.00	853,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,598.00	159,800
ヤマタネ	600	2,186.00	1,311,600
丸紅建材リース	1,000	240.00	240,000
日鉄住金物産	900	6,700.00	6,030,000
トラスコ中山	2,300	3,395.00	7,808,500
オートバックスセブン	4,300	2,156.00	9,270,800
モリト	900	1,003.00	902,700
加藤産業	1,700	4,120.00	7,004,000
イノテック	1,000	1,091.00	1,091,000
イエローハット	1,000	3,400.00	3,400,000
JKホールディングス	1,100	1,010.00	1,111,000
日伝	900	2,293.00	2,063,700
北沢産業	900	291.00	261,900
杉本商事	600	1,788.00	1,072,800
因幡電機産業	1,400	5,240.00	7,336,000
バイテックホールディングス	500	1,770.00	885,000
ミスミグループ本社	12,800	3,335.00	42,688,000
アルテック	1,000	363.00	363,000
タキヒヨー	400	2,347.00	938,800
蔵王産業	200	1,958.00	391,600
スズケン	5,000	4,665.00	23,325,000



ジェコス	800	1,383.00	1,106,400
ルネサスイーストン	1,000	749.00	749,000
ローソン	2,800	7,710.00	21,588,000
サンエー	800	5,400.00	4,320,000
カワチ薬品	800	2,760.00	2,208,000
エービーシー・マート	2,000	6,450.00	12,900,000
ハードオフコーポレーション	500	1,257.00	628,500
アスクル	1,100	3,190.00	3,509,000
ゲオホールディングス	2,000	2,179.00	4,358,000
アダストリア	1,700	2,492.00	4,236,400
ジーフット	700	780.00	546,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	200	702.00	140,400
くらコーポレーション	600	6,390.00	3,834,000
キャンドウ	500	1,784.00	892,000
パルグループホールディングス	600	3,515.00	2,109,000
エディオン	4,200	1,315.00	5,523,000
サーラコーポレーション	1,900	693.00	1,316,700
ワッツ	500	1,233.00	616,500
ハローズ	400	2,622.00	1,048,800
あみやき亭	200	5,170.00	1,034,000
ひらまつ	1,600	555.00	888,000
大黒天物産	300	5,040.00	1,512,000
ハニーズホールディングス	1,100	1,150.00	1,265,000
ファーマライズホールディングス	300	606.00	181,800
アルペン	800	2,423.00	1,938,400
クオール	1,100	2,071.00	2,278,100
ジンズ	700	5,930.00	4,151,000
ビックカメラ	6,300	1,585.00	9,985,500
D C Mホールディングス	5,900	1,089.00	6,425,100
Monotaro	3,900	3,590.00	14,001,000
東京一番フーズ	300	611.00	183,300
DDホールディングス	200	4,725.00	945,000
きちり	400	845.00	338,000
アークランドサービスホールディングス	900	2,681.00	2,412,900
J.フロント リテイリング	13,100	1,989.00	26,055,900
ドトール・日レスホールディングス	1,900	2,802.00	5,323,800
マツモトキヨシホールディングス	2,300	9,380.00	21,574,000
broncoピリー	600	3,460.00	2,076,000
スタートトゥデイ	10,800	3,540.00	38,232,000
トレジャー・ファクトリー	300	986.00	295,800
物語コーポレーション	300	10,530.00	3,159,000
ココカラファイン	1,100	7,280.00	8,008,000
三越伊勢丹ホールディングス	20,600	1,319.00	27,171,400

H a m e e	300	1,725.00	517,500
ウエルシアホールディングス	2,900	4,840.00	14,036,000
クリエイティブSDホールディングス	1,600	3,010.00	4,816,000
丸善CHIホールディングス	1,300	345.00	448,500
ミサワ	300	495.00	148,500
ティーライフ	100	1,326.00	132,600
エー・ピーカンパニー	200	849.00	169,800
チムニー	300	2,855.00	856,500
シュッピン	300	3,145.00	943,500
ネクステージ	1,200	936.00	1,123,200
ジョイフル本田	1,800	3,465.00	6,237,000
鳥貴族	400	3,885.00	1,554,000
キリン堂ホールディングス	400	2,026.00	810,400
ホットランド	700	1,503.00	1,052,100
すかいらーく	6,800	1,640.00	11,152,000
綿半ホールディングス	400	3,200.00	1,280,000
ヨシックス	200	3,860.00	772,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3,600	1,161.00	4,179,600
ブックオフコーポレーション	700	817.00	571,900
ゴルフダイジェスト・オンライン	400	1,032.00	412,800
B E E N O S	200	1,855.00	371,000
あさひ	800	1,371.00	1,096,800
日本調剤	400	3,425.00	1,370,000
コスモス薬品	600	23,800.00	14,280,000
トーエル	500	1,039.00	519,500
一六堂	300	519.00	155,700
オンリー	200	978.00	195,600
セブン&アイ・ホールディングス	46,100	4,697.00	216,531,700
薬王堂	500	3,150.00	1,575,000
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	2,900	1,320.00	3,828,000
ツルハホールディングス	2,200	15,080.00	33,176,000
サンマルクホールディングス	800	3,080.00	2,464,000
フェリシモ	300	1,367.00	410,100
トリドールホールディングス	1,400	4,170.00	5,838,000
T O K Y O B A S E	200	4,655.00	931,000
サツドラホールディングス	200	2,000.00	400,000
ダイユー・リックホールディングス	500	1,163.00	581,500
パロックジャパンリミテッド	900	968.00	871,200
クスリのアオキホールディングス	900	5,800.00	5,220,000
スシローグローバルホールディングス	1,000	4,290.00	4,290,000
L I X I L ビバ	1,000	1,916.00	1,916,000
メディカルシステムネットワーク	1,300	599.00	778,700

総合メディカル	500	6,060.00	3,030,000
はるやまホールディングス	500	1,050.00	525,000
ノジマ	1,900	2,697.00	5,124,300
カッパ・クリエイト	1,400	1,265.00	1,771,000
ライトオン	1,000	903.00	903,000
ジーンズメイト	400	1,230.00	492,000
良品計画	1,500	34,650.00	51,975,000
三城ホールディングス	1,300	472.00	613,600
アドヴァン	1,100	1,081.00	1,189,100
アルビス	200	4,065.00	813,000
コナカ	1,400	622.00	870,800
ハウス オブ ローゼ	200	1,833.00	366,600
G - 7ホールディングス	300	2,516.00	754,800
イオン北海道	1,100	752.00	827,200
コジマ	1,900	372.00	706,800
ヒマラヤ	300	1,170.00	351,000
コーナン商事	1,500	2,411.00	3,616,500
エコス	400	1,244.00	497,600
ワタミ	1,300	1,669.00	2,169,700
マルシェ	400	809.00	323,600
ドンキホーテホールディングス	7,100	5,900.00	41,890,000
西松屋チェーン	2,400	1,249.00	2,997,600
ゼンショーホールディングス	5,700	1,944.00	11,080,800
幸楽苑ホールディングス	700	1,809.00	1,266,300
ハークスレイ	300	1,183.00	354,900
サイゼリヤ	1,600	3,760.00	6,016,000
V Tホールディングス	3,800	572.00	2,173,600
魚力	300	1,165.00	349,500
ポブラ	300	687.00	206,100
フジ・コーポレーション	200	2,277.00	455,400
ユナイテッドアローズ	1,400	4,465.00	6,251,000
ハイデイ日高	1,200	3,700.00	4,440,000
京都きもの友禅	800	760.00	608,000
コロワイド	3,700	2,240.00	8,288,000
ピーシーデボコーポレーション	1,700	842.00	1,431,400
壱番屋	800	4,550.00	3,640,000
トップカルチャー	400	500.00	200,000
P L A N T	300	1,348.00	404,400
スギホールディングス	2,400	5,690.00	13,656,000
ヴィア・ホールディングス	1,000	732.00	732,000
スクロール	1,700	526.00	894,200
ヨンドシーホールディングス	1,100	3,075.00	3,382,500
ユニー・ファミリーマートホールディングス	3,500	7,790.00	27,265,000

木曽路	1,300	2,752.00	3,577,600
S R S ホールディングス	1,300	944.00	1,227,200
千趣会	2,000	631.00	1,262,000
タカキュー	900	222.00	199,800
ケーヨー	2,100	711.00	1,493,100
上新電機	1,300	4,010.00	5,213,000
日本瓦斯	2,000	3,945.00	7,890,000
ロイヤルホールディングス	2,000	3,200.00	6,400,000
東天紅	100	2,181.00	218,100
いなげや	1,200	1,868.00	2,241,600
島忠	2,700	3,320.00	8,964,000
チヨダ	1,300	2,994.00	3,892,200
ライフコーポレーション	800	3,020.00	2,416,000
リンガーハット	1,400	2,561.00	3,585,400
さが美グループホールディングス	1,000	131.00	131,000
MrMaxHD	1,400	903.00	1,264,200
テンアライド	1,100	489.00	537,900
AOKIホールディングス	2,200	1,686.00	3,709,200
オークワ	1,000	1,157.00	1,157,000
コメリ	1,700	3,275.00	5,567,500
青山商事	2,100	4,195.00	8,809,500
しまむら	1,300	13,080.00	17,004,000
はせがわ	700	506.00	354,200
高島屋	17,000	1,145.00	19,465,000
松屋	2,200	1,477.00	3,249,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	5,200	2,279.00	11,850,800
近鉄百貨店	400	4,115.00	1,646,000
パルコ	1,100	1,619.00	1,780,900
丸井グループ	10,600	2,000.00	21,200,000
アクシアル リテイリング	900	4,190.00	3,771,000
イオン	42,300	1,910.00	80,793,000
イズミ	2,000	7,030.00	14,060,000
東武ストア	200	2,982.00	596,400
平和堂	2,200	2,499.00	5,497,800
フジ	1,300	2,402.00	3,122,600
ヤオコー	1,300	5,540.00	7,202,000
ゼビオホールディングス	1,500	2,187.00	3,280,500
ケーズホールディングス	4,700	2,878.00	13,526,600
Olympicグループ	600	594.00	356,400
日産東京販売ホールディングス	1,700	404.00	686,800
Genky DrugStores	500	4,000.00	2,000,000
アインホールディングス	1,600	6,790.00	10,864,000
元気寿司	300	3,765.00	1,129,500

ヤマダ電機	36,800	609.00	22,411,200	
アークランドサカモト	1,900	1,846.00	3,507,400	
ニトリホールディングス	4,400	16,015.00	70,466,000	
愛眼	900	672.00	604,800	
ケーユーホールディングス	600	1,229.00	737,400	
吉野家ホールディングス	3,600	1,924.00	6,926,400	
松屋フーズ	500	4,180.00	2,090,000	
サガミチェーン	1,500	1,402.00	2,103,000	
関西スーパーマーケット	800	1,215.00	972,000	
王将フードサービス	800	5,400.00	4,320,000	
プレナス	1,200	2,443.00	2,931,600	
ミニストップ	800	2,407.00	1,925,600	
アークス	2,000	2,641.00	5,282,000	
パローホールディングス	2,500	2,622.00	6,555,000	
藤久	100	1,747.00	174,700	
ベルク	500	6,730.00	3,365,000	
大庄	600	1,725.00	1,035,000	
ファーストリテイリング	1,800	44,650.00	80,370,000	
サンドラッグ	4,600	5,270.00	24,242,000	
サックスパー ホールディングス	1,000	1,368.00	1,368,000	
ヤマザワ	200	1,739.00	347,800	
やまや	200	3,355.00	671,000	
ベルーナ	2,700	1,359.00	3,669,300	
島根銀行	300	1,359.00	407,700	
じもとホールディングス	7,700	191.00	1,470,700	
めぶきフィナンシャルグループ	57,200	479.00	27,398,800	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	1,500	3,250.00	4,875,000	
九州フィナンシャルグループ	18,100	685.00	12,398,500	
ゆうちょ銀行	31,100	1,479.00	45,996,900	
富山第一銀行	2,800	526.00	1,472,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	66,900	680.00	45,492,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	7,500	1,343.00	10,072,500	
新生銀行	9,600	1,944.00	18,662,400	
あおぞら銀行	6,600	4,445.00	29,337,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	778,100	839.80	653,448,380	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	120,900	681.80	82,429,620	
三井住友トラスト・ホールディングス	21,900	4,503.00	98,615,700	
三井住友フィナンシャルグループ	83,400	4,917.00	410,077,800	代用有価証券 10,000株
第四銀行	1,300	5,080.00	6,604,000	
北越銀行	1,100	2,575.00	2,832,500	
千葉銀行	40,000	933.00	37,320,000	
群馬銀行	22,400	689.00	15,433,600	

武蔵野銀行	1,700	3,730.00	6,341,000
千葉興業銀行	3,100	564.00	1,748,400
筑波銀行	4,600	380.00	1,748,000
七十七銀行	3,500	2,796.00	9,786,000
青森銀行	900	3,520.00	3,168,000
秋田銀行	700	3,035.00	2,124,500
山形銀行	1,200	2,452.00	2,942,400
岩手銀行	800	4,470.00	3,576,000
東邦銀行	9,800	394.00	3,861,200
東北銀行	600	1,503.00	901,800
みちのく銀行	700	1,767.00	1,236,900
ふくおかフィナンシャルグループ	45,000	630.00	28,350,000
静岡銀行	29,000	1,163.00	33,727,000
十六銀行	1,500	3,320.00	4,980,000
スルガ銀行	11,300	2,391.00	27,018,300
八十二銀行	19,900	650.00	12,935,000
山梨中央銀行	7,000	484.00	3,388,000
大垣共立銀行	1,700	2,809.00	4,775,300
福井銀行	900	2,638.00	2,374,200
北國銀行	1,200	4,460.00	5,352,000
清水銀行	400	3,225.00	1,290,000
富山銀行	200	4,205.00	841,000
滋賀銀行	10,000	582.00	5,820,000
南都銀行	1,300	3,040.00	3,952,000
百五銀行	10,500	537.00	5,638,500
京都銀行	4,200	5,940.00	24,948,000
紀陽銀行	4,200	1,855.00	7,791,000
三重銀行	500	2,512.00	1,256,000
ほくほくフィナンシャルグループ	7,300	1,766.00	12,891,800
広島銀行	16,300	964.00	15,713,200
山陰合同銀行	6,500	1,084.00	7,046,000
中国銀行	7,600	1,509.00	11,468,400
鳥取銀行	300	1,778.00	533,400
伊予銀行	15,700	913.00	14,334,100
百十四銀行	12,000	368.00	4,416,000
四国銀行	1,700	1,552.00	2,638,400
阿波銀行	9,000	705.00	6,345,000
大分銀行	600	4,380.00	2,628,000
宮崎銀行	700	3,830.00	2,681,000
佐賀銀行	700	2,552.00	1,786,400
十八銀行	7,000	293.00	2,051,000
沖縄銀行	1,100	4,540.00	4,994,000
琉球銀行	2,100	1,720.00	3,612,000

セブン銀行	41,400	383.00	15,856,200
みずほフィナンシャルグループ	1,496,400	206.10	308,408,040
高知銀行	400	1,300.00	520,000
山口フィナンシャルグループ	10,000	1,359.00	13,590,000
長野銀行	400	1,945.00	778,000
名古屋銀行	900	4,395.00	3,955,500
北洋銀行	16,600	378.00	6,274,800
愛知銀行	400	5,360.00	2,144,000
第三銀行	600	1,783.00	1,069,800
中京銀行	500	2,304.00	1,152,000
大光銀行	400	2,489.00	995,600
愛媛銀行	1,500	1,342.00	2,013,000
トマト銀行	400	1,527.00	610,800
みなと銀行	1,000	2,066.00	2,066,000
京葉銀行	10,000	514.00	5,140,000
関西アーバン銀行	1,500	1,427.00	2,140,500
栃木銀行	5,700	454.00	2,587,800
北日本銀行	300	3,115.00	934,500
東和銀行	1,900	1,499.00	2,848,100
福島銀行	1,100	906.00	996,600
大東銀行	500	1,627.00	813,500
トモニホールディングス	9,000	581.00	5,229,000
フィデアホールディングス	10,800	199.00	2,149,200
池田泉州ホールディングス	11,700	411.00	4,808,700
F P G	4,000	1,363.00	5,452,000
S B I ホールディングス	12,500	2,314.00	28,925,000
ジャフコ	1,600	6,560.00	10,496,000
大和証券グループ本社	94,000	699.10	65,715,400
野村ホールディングス	198,800	667.80	132,758,640
岡三証券グループ	9,000	688.00	6,192,000
丸三証券	3,500	1,006.00	3,521,000
東洋証券	4,000	317.00	1,268,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	12,600	722.00	9,097,200
光世証券	300	1,511.00	453,300
水戸証券	3,400	415.00	1,411,000
いちよし証券	2,300	1,294.00	2,976,200
松井証券	5,400	954.00	5,151,600
だいこう証券ビジネス	500	744.00	372,000
マネックスグループ	11,700	322.00	3,767,400
カブドットコム証券	7,000	355.00	2,485,000
極東証券	1,500	1,638.00	2,457,000
岩井コスモホールディングス	1,100	1,421.00	1,563,100
藍澤証券	2,100	763.00	1,602,300

マネーパートナーズグループ	1,400	411.00	575,400
かんぽ生命保険	4,200	2,646.00	11,113,200
S O M P Oホールディングス	21,600	4,415.00	95,364,000
アニコム ホールディングス	800	3,620.00	2,896,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	28,800	3,833.00	110,390,400
ソニーフィナンシャルホールディングス	9,100	2,005.00	18,245,500
第一生命ホールディングス	62,300	2,366.50	147,432,950
東京海上ホールディングス	41,500	5,204.00	215,966,000
T & Dホールディングス	34,100	1,964.50	66,989,450
アドバンスクリエイト	300	1,948.00	584,400
全国保証	3,100	4,925.00	15,267,500
クレディセゾン	8,400	2,044.00	17,169,600
芙蓉総合リース	1,300	7,540.00	9,802,000
興銀リース	2,100	2,873.00	6,033,300
東京センチュリー	2,200	5,490.00	12,078,000
日本証券金融	4,500	620.00	2,790,000
アイフル	18,700	387.00	7,236,900
リコーリース	900	3,910.00	3,519,000
イオンフィナンシャルサービス	7,800	2,656.00	20,716,800
アコム	22,300	474.00	10,570,200
ジャックス	1,300	2,602.00	3,382,600
オリエン트コーポレーション	24,300	180.00	4,374,000
日立キャピタル	3,000	2,861.00	8,583,000
アプラスフィナンシャル	5,900	115.00	678,500
オリックス	73,500	1,929.50	141,818,250
三菱UFJリース	28,000	678.00	18,984,000
日本取引所グループ	32,400	1,994.00	64,605,600
イー・ギャランティ	300	3,535.00	1,060,500
アサックス	200	1,913.00	382,600
N E Cキャピタルソリューション	500	2,255.00	1,127,500
いちご	15,700	418.00	6,562,600
日本駐車場開発	13,400	194.00	2,599,600
ヒューリック	23,000	1,301.00	29,923,000
三栄建築設計	400	2,544.00	1,017,600
スター・マイカ	400	1,706.00	682,400
野村不動産ホールディングス	7,300	2,544.00	18,571,200
三重交通グループホールディングス	2,200	481.00	1,058,200
サムティ	900	1,680.00	1,512,000
ディア・ライフ	1,100	668.00	734,800
コーセーアールイー	200	1,308.00	261,600
エー・ディー・ワークス	15,400	41.00	631,400
日本商業開発	600	1,684.00	1,010,400
プレサンスコーポレーション	1,500	1,508.00	2,262,000



ユニゾホールディングス	1,300	3,095.00	4,023,500
THEグローバル社	500	860.00	430,000
日本管理センター	700	1,657.00	1,159,900
サンセイランディック	300	1,102.00	330,600
エストラスト	200	1,146.00	229,200
フージャースホールディングス	1,400	1,277.00	1,787,800
オープンハウス	1,800	6,080.00	10,944,000
東急不動産ホールディングス	26,700	808.00	21,573,600
飯田グループホールディングス	9,200	2,124.00	19,540,800
ムゲンエステート	700	1,151.00	805,700
ファーストブラザーズ	300	1,178.00	353,400
ハウスドゥ	200	2,427.00	485,400
シーアールイー	200	1,512.00	302,400
ケイアイスター不動産	400	3,020.00	1,208,000
パーク24	6,100	2,780.00	16,958,000
パラカ	400	2,569.00	1,027,600
三井不動産	55,000	2,550.50	140,277,500
三菱地所	82,000	1,976.50	162,073,000
平和不動産	2,000	2,043.00	4,086,000
東京建物	12,100	1,533.00	18,549,300
ダイビル	2,900	1,405.00	4,074,500
京阪神ビルディング	1,800	886.00	1,594,800
住友不動産	26,000	3,755.00	97,630,000
大京	1,800	2,184.00	3,931,200
テオーシー	3,800	967.00	3,674,600
東京楽天地	200	5,980.00	1,196,000
レオパレス21	13,200	912.00	12,038,400
スターツコーポレーション	1,500	2,920.00	4,380,000
フジ住宅	1,400	856.00	1,198,400
空港施設	1,100	673.00	740,300
明和地所	600	845.00	507,000
ゴールドクレスト	900	2,302.00	2,071,800
日本エスリード	400	2,467.00	986,800
日神不動産	1,500	945.00	1,417,500
日本エスコン	2,000	684.00	1,368,000
タカラレーベン	5,200	488.00	2,537,600
サンヨーハウジング名古屋	600	1,186.00	711,600
イオンモール	7,100	2,210.00	15,691,000
ファースト住建	400	1,765.00	706,000
トーセイ	1,400	1,087.00	1,521,800
エヌ・ティ・ティ都市開発	6,800	1,311.00	8,914,800
サンフロンティア不動産	1,200	1,290.00	1,548,000
エフ・ジェー・ネクスト	900	1,010.00	909,000

インテリックス	300	1,048.00	314,400
ランドビジネス	800	319.00	255,200
グランディハウス	1,000	574.00	574,000
日本空港ビルデング	3,200	4,245.00	13,584,000
日本工営	700	3,525.00	2,467,500
L I F U L L	3,700	1,044.00	3,862,800
ジェイエイシーリクルートメント	800	2,218.00	1,774,400
日本M&Aセンター	3,700	5,500.00	20,350,000
メンバーズ	300	759.00	227,700
中広	100	742.00	74,200
タケエイ	1,100	1,348.00	1,482,800
トラスト・テック	500	3,410.00	1,705,000
コシダカホールディングス	600	5,360.00	3,216,000
パソナグループ	900	2,313.00	2,081,700
C D S	300	1,391.00	417,300
リンクアンドモチベーション	2,000	908.00	1,816,000
G C A	1,200	1,171.00	1,405,200
エス・エム・エス	2,100	3,630.00	7,623,000
パーソルホールディングス	9,800	2,862.00	28,047,600
リニカル	700	1,550.00	1,085,000
クックパッド	3,400	608.00	2,067,200
エスクリ	400	992.00	396,800
アイ・ケイ・ケイ	600	799.00	479,400
学情	500	1,856.00	928,000
スタジオアリス	500	2,808.00	1,404,000
シミックホールディングス	600	1,864.00	1,118,400
N J S	300	1,551.00	465,300
総合警備保障	4,200	6,190.00	25,998,000
カカクコム	8,200	1,891.00	15,506,200
アイロムグループ	400	1,744.00	697,600
セントケア・ホールディング	500	885.00	442,500
サイネックス	200	967.00	193,400
ルネサンス	500	1,928.00	964,000
ディップ	1,500	2,847.00	4,270,500
オプトホールディング	800	1,265.00	1,012,000
新日本科学	1,300	559.00	726,700
ツクイ	2,500	1,018.00	2,545,000
キャリアデザインセンター	300	2,394.00	718,200
エムスリー	11,200	3,935.00	44,072,000
ツカダ・グローバルホールディング	800	636.00	508,800
プラス	100	1,074.00	107,400
アウトソーシング	3,200	2,026.00	6,483,200
ウェルネット	900	1,175.00	1,057,500

ワールドホールディングス	400	3,600.00	1,440,000
ディー・エヌ・エー	5,800	2,315.00	13,427,000
博報堂D Yホールディングス	14,800	1,489.00	22,037,200
ぐるなび	1,700	1,305.00	2,218,500
エスアールジータカミヤ	1,300	655.00	851,500
ジャパンベストレスキューシステム	1,400	729.00	1,020,600
ファンコミュニケーションズ	3,000	909.00	2,727,000
ライク	400	2,602.00	1,040,800
ビジネス・ブレークスルー	500	485.00	242,500
WDBホールディングス	500	3,705.00	1,852,500
ティア	600	1,030.00	618,000
C D G	100	1,927.00	192,700
パリュコマース	1,000	737.00	737,000
インフォーマート	5,400	649.00	3,504,600
J Pホールディングス	3,400	313.00	1,064,200
エコナックホールディングス	2,200	120.00	264,000
E P Sホールディングス	1,600	2,483.00	3,972,800
レグス	300	922.00	276,600
プレステージ・インターナショナル	2,200	1,403.00	3,086,600
アミューズ	700	3,155.00	2,208,500
ドリームインキュベータ	300	2,249.00	674,700
クイック	700	1,778.00	1,244,600
T A C	700	346.00	242,200
ケネディクス	14,800	711.00	10,522,800
電通	13,000	4,795.00	62,335,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	1,160.00	580,000
ぴあ	400	7,540.00	3,016,000
イオンファンタジー	300	4,925.00	1,477,500
シーティーエス	1,100	865.00	951,500
みらかホールディングス	3,200	4,845.00	15,504,000
アルプス技研	500	4,665.00	2,332,500
ダイオーズ	200	1,434.00	286,800
日本空調サービス	1,200	786.00	943,200
オリエンタルランド	12,600	10,330.00	130,158,000
ダスキン	2,900	3,010.00	8,729,000
明光ネットワークジャパン	1,400	1,350.00	1,890,000
ファルコホールディングス	600	1,785.00	1,071,000
秀英予備校	300	482.00	144,600
田谷	200	664.00	132,800
ラウンドワン	3,300	1,930.00	6,369,000
リゾートトラスト	4,500	2,590.00	11,655,000
ビー・エム・エル	1,400	2,820.00	3,948,000
ワタベウェディング	200	652.00	130,400

りらいあコミュニケーションズ	1,700	1,275.00	2,167,500
リソー教育	1,800	933.00	1,679,400
早稲田アカデミー	200	1,695.00	339,000
ユー・エス・エス	13,000	2,456.00	31,928,000
東京個別指導学院	400	986.00	394,400
サイバーエージェント	7,000	4,435.00	31,045,000
楽天	54,700	1,028.50	56,258,950
クリーク・アンド・リバー社	600	1,129.00	677,400
テー・オー・ダブリュー	1,000	945.00	945,000
セントラルスポーツ	400	4,305.00	1,722,000
フルキャストホールディングス	900	2,215.00	1,993,500
リソルホールディングス	100	4,700.00	470,000
テクノプロ・ホールディングス	1,900	6,230.00	11,837,000
アトラ	200	685.00	137,000
インターワークス	300	1,162.00	348,600
K e e P e r 技研	300	1,341.00	402,300
ファーストロジック	100	1,970.00	197,000
三機サービス	100	1,319.00	131,900
デザインワン・ジャパン	200	1,389.00	277,800
イー・ガーディアン	500	2,637.00	1,318,500
リブセンス	700	481.00	336,700
ジャパンマテリアル	1,000	3,825.00	3,825,000
ベクトル	1,300	1,653.00	2,148,900
ウチヤマホールディングス	600	581.00	348,600
ライクキッズネクスト	100	2,323.00	232,300
キャリアリンク	400	551.00	220,400
I B J	800	1,112.00	889,600
アサンテ	400	1,892.00	756,800
N・フィールド	600	1,557.00	934,200
バリューHR	100	5,050.00	505,000
M&Aキャピタルパートナーズ	200	7,440.00	1,488,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	500	1,093.00	546,500
E R Iホールディングス	300	920.00	276,000
アビスト	100	5,560.00	556,000
ウィルグループ	500	1,735.00	867,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,500	535.00	802,500
日本ビューホテル	300	1,381.00	414,300
リクルートホールディングス	82,300	2,822.50	232,291,750
エラン	300	1,377.00	413,100
土木管理総合試験所	300	766.00	229,800
日本郵政	60,500	1,292.00	78,166,000
ベルシステム24ホールディングス	1,800	1,417.00	2,550,600
鎌倉新書	200	1,827.00	365,400

一蔵	100	1,109.00	110,900
LITALICO	200	2,009.00	401,800
グローバルグループ	100	1,781.00	178,100
エボラブルアジア	200	2,257.00	451,400
ストライク	100	5,350.00	535,000
ソラスト	600	2,639.00	1,583,400
インソース	100	3,285.00	328,500
リログループ	5,800	3,100.00	17,980,000
東祥	700	3,705.00	2,593,500
エイチ・アイ・エス	1,700	4,165.00	7,080,500
ラックランド	200	2,248.00	449,600
共立メンテナンス	1,900	4,485.00	8,521,500
イチネンホールディングス	1,200	1,593.00	1,911,600
建設技術研究所	800	1,197.00	957,600
スペース	600	1,803.00	1,081,800
燦ホールディングス	300	3,350.00	1,005,000
スバル興業	100	7,500.00	750,000
東京テアトル	500	1,475.00	737,500
タナベ経営	200	1,674.00	334,800
ナガワ	200	4,870.00	974,000
よみうりランド	200	4,915.00	983,000
東京都競馬	800	4,280.00	3,424,000
常磐興産	400	1,866.00	746,400
カナモト	1,600	3,545.00	5,672,000
東京ドーム	4,300	1,125.00	4,837,500
西尾レントオール	900	3,735.00	3,361,500
トランス・コスモス	1,200	2,704.00	3,244,800
乃村工藝社	2,500	2,586.00	6,465,000
藤田観光	400	3,570.00	1,428,000
KNT-CTホールディングス	700	1,766.00	1,236,200
日本管財	1,100	2,086.00	2,294,600
トーカイ	500	5,110.00	2,555,000
白洋舎	100	4,585.00	458,500
セコム	11,300	8,575.00	96,897,500
セントラル警備保障	500	2,490.00	1,245,000
丹青社	2,200	1,299.00	2,857,800
メイテック	1,200	5,960.00	7,152,000
アサツー ディ・ケイ	2,000	3,650.00	7,300,000
応用地質	1,200	1,481.00	1,777,200
船井総研ホールディングス	1,500	3,910.00	5,865,000
進学会ホールディングス	500	680.00	340,000
オオバ	900	514.00	462,600
いであ	200	1,166.00	233,200

学究社	300	1,628.00	488,400
ベネッセホールディングス	3,900	4,055.00	15,814,500
イオンディライト	1,300	4,235.00	5,505,500
ナック	700	983.00	688,100
ニチイ学館	2,000	1,431.00	2,862,000
ダイセキ	1,800	3,115.00	5,607,000
ステップ	400	1,784.00	713,600
合 計	13,474,800		29,203,559,950

## (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29年 6月26日現在	平成29年12月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	516,701,800	169,207,641
コール・ローン	687,242,026	393,984,840
出資金	5,546,633	5,042,493
株式	75,332,794,252	82,346,012,968
投資証券	2,046,576,522	2,119,172,660
派生商品評価勘定	2,716,624	8,231,315
未収入金	414,455	1,149,305
未収配当金	122,054,919	72,071,102
差入委託証拠金	158,716,882	167,307,747
流動資産合計	78,872,764,113	85,282,180,071
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,355,078	608,008
未払金	-	57,150
未払解約金	103,684,796	121,019,396
未払利息	1,078	556
流動負債合計	105,040,952	121,685,110
<b>負債合計</b>		
	105,040,952	121,685,110
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	35,886,980,317	34,684,805,033
剰余金		

	平成29年 6月26日現在	平成29年12月25日現在
剰余金又は欠損金( )	42,880,742,844	50,475,689,928
元本等合計	78,767,723,161	85,160,494,961
純資産合計	78,767,723,161	85,160,494,961
負債純資産合計	78,872,764,113	85,282,180,071

## 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29年 6月26日現在	平成29年12月25日現在
1.	期首	平成28年12月27日	平成29年 6月27日
	期首元本額	37,314,699,206円	35,886,980,317円
	期首からの追加設定元本額	1,303,663,775円	1,240,871,799円
	期首からの一部解約元本額	2,731,382,664円	2,443,047,083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)	14,994,003,660円	15,349,375,400円
	DCインデックスバランス(株式20)	55,569,138円	59,342,687円
	DCインデックスバランス(株式40)	172,792,075円	183,185,288円
	DCインデックスバランス(株式60)	329,832,802円	365,880,171円
	DCインデックスバランス(株式80)	378,759,741円	400,091,666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	2,727,977,754円	2,318,001,134円
日興五大陸株式ファンド	6,101,422,930円	5,732,335,467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	27,908,547円	25,992,446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）	275,567,429円	171,893,417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）	114,014,686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）	1,885,558円	- 円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	6,101,058円	5,747,708円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	4,912,728円	4,269,536円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	7,230,647円	6,666,068円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	8,269,628円	6,956,482円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	5,941,459,098円	5,371,077,017円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	28,673,129円	26,732,169円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	84,782,603円	79,239,573円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	120,116,937円	117,293,559円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	121,207,757円	117,786,185円
インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,384,492,412円	4,228,924,374円
計	35,886,980,317円	34,684,805,033円
2. 受益権の総数	35,886,980,317口	34,684,805,033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12月27日 至 平成29年 6月26日	自 平成29年 6月27日 至 平成29年12月25日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左



金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成29年 6月26日現在	平成29年12月25日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成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

(平成29年12月25日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
出資金	621,992
株式	2,902,205,122
投資証券	38,798,083
合計	2,941,625,197

(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

(平成29年12月25日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	579,886,895	-	583,408,942	3,522,047

合計	579,886,895	-	583,408,942	3,522,047
----	-------------	---	-------------	-----------

## (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	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

(平成29年12月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引				
	買建	378,997,795	-	383,029,500	4,031,705
	米ドル	312,929,270	-	315,969,500	3,040,230
	ユーロ	66,068,525	-	67,060,000	991,475
	売建	117,573,715	-	117,504,160	69,555
	米ドル	84,975,000	-	84,907,500	67,500
	英ポンド	18,791,964	-	18,792,200	236

	豪ドル	13,806,751	-	13,804,460	2,291
	合計	496,571,510	-	500,533,660	4,101,260

## (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29年 6月26日現在		平成29年12月25日現在	
1口当たり純資産額	2.1949円	1口当たり純資産額	2.4553円
(1万口当たり純資産額)	(21,949円)	(1万口当たり純資産額)	(24,553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	11,203	52.93	592,974.79	
	ANDEAVOR	3,000	112.18	336,540.00	
	ANTERO RESOURCES CORP	3,670	18.59	68,225.30	
	APACHE CORP	7,904	42.91	339,160.64	
	BAKER HUGHES A GE CO	8,105	32.23	261,224.15	
	CABOT OIL & GAS CORP	9,730	27.59	268,450.70	
	CHENIERE ENERGY INC	4,070	53.00	215,710.00	
	CHEVRON CORP	38,461	124.98	4,806,855.78	
	CIMAREX ENERGY CO	2,005	119.95	240,499.75	

CONCHO RESOURCES INC	3,055	151.77	463,657.35
CONOCOPHILLIPS	25,240	55.50	1,400,820.00
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,960	51.90	101,724.00
DEVON ENERGY CORPORATION	9,991	41.57	415,325.87
DIAMONDBACK ENERGY INC	1,940	124.37	241,277.80
EOG RESOURCES INC	11,802	107.11	1,264,112.22
EQT CORP	4,895	54.77	268,099.15
EXXON MOBIL CORP	85,871	83.97	7,210,587.87
HALLIBURTON CO	18,027	48.01	865,476.27
HELMERICH & PAYNE	2,120	64.32	136,358.40
HESS CORP	6,000	47.01	282,060.00
HOLLYFRONTIER CORP	3,740	50.62	189,318.80
KINDER MORGAN INC	40,700	18.05	734,635.00
MARATHON OIL CORP	17,867	16.90	301,952.30
MARATHON PETROLEUM CORP	10,852	66.36	720,138.72
NATIONAL OILWELL VARCO INC	7,521	35.44	266,544.24
NEWFIELD EXPLORATION CO	4,040	31.46	127,098.40
NOBLE ENERGY INC	9,492	28.79	273,274.68
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	15,101	72.99	1,102,221.99
ONEOK INC	7,690	53.21	409,184.90
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	4,490	29.54	132,634.60
PHILLIPS 66	9,045	100.89	912,550.05
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,420	171.12	585,230.40
RANGE RESOURCES CORP	4,050	16.46	66,663.00
SCHLUMBERGER LTD	28,141	67.44	1,897,829.04
TARGA RESOURCES CORP	4,560	47.19	215,186.40
TECHNIPFMC PLC	9,351	31.15	291,283.65
VALERO ENERGY CORP	9,172	91.13	835,844.36
WILLIAMS COS INC	16,874	30.31	511,450.94
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	4,255	163.42	695,352.10
ALBEMARLE CORP	2,320	129.29	299,952.80
AVERY DENNISON CORP	1,820	114.17	207,789.40
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	4,170	31.99	133,398.30
BALL CORP	6,840	37.97	259,714.80
CELANESE CORP-SERIES A	2,990	106.54	318,554.60
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,850	41.71	202,293.50
CHEMOURS CO/THE	3,600	49.02	176,472.00
CROWN HOLDINGS INC	2,815	56.15	158,062.25
DOWDUPONT INC	47,417	72.11	3,419,239.87
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,015	92.65	279,339.75
ECOLAB INC	5,440	133.97	728,796.80
FMC CORP	2,790	95.46	266,333.40
FREEMPORT-MCMORAN INC	25,748	18.10	466,038.80

INTERNATIONAL PAPER CO	8,120	57.98	470,797.60
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,664	152.51	253,776.64
LYONDELLBASELL INDU-CL A	6,750	109.98	742,365.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,245	211.10	262,819.50
MONSANTO CO	8,881	116.28	1,032,682.68
MOSAIC CO/THE	6,820	25.52	174,046.40
NEWMONT MINING CORP	10,560	36.92	389,875.20
NUCOR CORP	6,569	64.56	424,094.64
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,950	120.09	234,175.50
PPG INDUSTRIES INC	5,004	116.19	581,414.76
PRAXAIR INC	5,920	153.84	910,732.80
SEALED AIR CORP	3,966	49.09	194,690.94
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,747	413.09	721,668.23
STEEL DYNAMICS INC	4,510	43.26	195,102.60
VULCAN MATERIALS CO	2,743	124.23	340,762.89
WESTROCK CO	5,329	63.73	339,617.17
WR GRACE & CO	1,400	70.26	98,364.00
3M CO	12,076	234.73	2,834,599.48
ACUITY BRANDS INC	640	172.18	110,195.20
AERCAP HOLDINGS NV	2,660	53.06	141,139.60
AGCO CORP	1,250	72.94	91,175.00
ALLEGION PLC	1,750	80.34	140,595.00
AMETEK INC	4,533	72.60	329,095.80
ARCONIC INC	7,943	26.83	213,110.69
BOEING CO/THE	11,652	295.10	3,438,505.20
CATERPILLAR INC	11,946	155.75	1,860,589.50
CUMMINS INC	3,195	175.76	561,553.20
DEERE & CO	5,710	157.53	899,496.30
DOVER CORP	3,150	100.46	316,449.00
EATON CORP PLC	9,026	77.51	699,605.26
EMERSON ELECTRIC CO	12,970	69.66	903,490.20
FASTENAL CO	6,153	54.05	332,569.65
FLOWERVE CORP	2,575	41.39	106,579.25
FLUOR CORP	2,903	51.07	148,256.21
FORTIVE CORP	6,364	72.47	461,199.08
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,160	68.53	216,554.80
GENERAL DYNAMICS CORP	5,182	202.64	1,050,080.48
GENERAL ELECTRIC CO	175,303	17.50	3,067,802.50
HD SUPPLY HOLDINGS INC	3,740	39.37	147,243.80
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	14,616	153.49	2,243,409.84
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	960	237.44	227,942.40
IDEX CORP	1,420	132.07	187,539.40

ILLINOIS TOOL WORKS	6,320	167.13	1,056,261.60
INGERSOLL-RAND PLC	5,336	89.77	479,012.72
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,420	66.28	160,397.60
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4,370	61.19	267,400.30
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	4,500	39.37	177,165.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	18,864	38.11	718,907.04
L3 TECHNOLOGIES INC	1,651	197.70	326,402.70
LENNOX INTERNATIONAL INC	700	205.65	143,955.00
LOCKHEED MARTIN CORP	5,331	318.03	1,695,417.93
MASCO CORP	6,789	43.83	297,561.87
MIDDLEBY CORP	1,180	132.04	155,807.20
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,384	303.78	1,027,991.52
OWENS CORNING	2,170	91.20	197,904.00
PACCAR INC	7,014	71.00	497,994.00
PARKER HANNIFIN CORP	2,760	199.25	549,930.00
PENTAIR PLC	3,498	69.73	243,915.54
RAYTHEON COMPANY	5,822	187.31	1,090,518.82
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,683	194.57	522,031.31
ROCKWELL COLLINS INC.	3,373	135.09	455,658.57
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,150	259.53	557,989.50
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,460	51.28	177,428.80
SMITH (A.O.) CORP	3,020	61.26	185,005.20
SNAP-ON INC	1,250	174.70	218,375.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	2,310	86.72	200,323.20
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,116	167.46	521,805.36
TEXTRON INC	5,416	56.76	307,412.16
TRANSDIGM GROUP INC	1,100	270.65	297,715.00
UNITED RENTALS INC	1,840	169.49	311,861.60
UNITED TECHNOLOGIES CORP	15,335	127.23	1,951,072.05
WABCO HOLDINGS INC	1,110	143.81	159,629.10
WABTEC CORP	1,880	79.63	149,704.40
WW GRAINGER INC	1,057	234.84	248,225.88
XYLEM INC	3,548	67.58	239,773.84
CINTAS CORP	1,727	156.85	270,879.95
EQUIFAX INC	2,404	119.73	287,830.92
IHS MARKIT LTD	7,543	45.05	339,812.15
MANPOWERGROUP INC	1,447	127.04	183,826.88
NIELSEN HOLDINGS PLC	7,405	36.54	270,578.70
REPUBLIC SERVICES INC	5,100	66.93	341,343.00
ROBERT HALF INTL INC	2,375	55.68	132,240.00
ROLLINS INC	1,610	46.45	74,784.50
STERICYCLE INC	1,705	68.31	116,468.55

TRANSUNION	3,000	55.16	165,480.00
VERISK ANALYTICS INC	3,170	95.33	302,196.10
WASTE CONNECTIONS INC	5,806	71.34	414,200.04
WASTE MANAGEMENT INC	9,154	85.91	786,420.14
AMERCO	155	379.27	58,786.85
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	2,840	52.59	149,355.60
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	2,900	88.70	257,230.00
CSX CORP	18,723	55.00	1,029,765.00
DELTA AIR LINES INC	3,955	56.03	221,598.65
EXPEDITORS INTL WASH INC	3,647	64.77	236,216.19
FEDEX CORP	5,148	250.02	1,287,102.96
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,670	114.53	191,265.10
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	97,000	0.41	39,770.00
KANSAS CITY SOUTHERN	2,160	108.19	233,690.40
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	2,750	44.35	121,962.50
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	1,570	63.85	100,244.50
NORFOLK SOUTHERN CORP	5,860	144.52	846,887.20
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,190	132.68	157,889.20
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,400	65.97	224,298.00
UNION PACIFIC CORP	16,286	134.47	2,189,978.42
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	1,715	67.25	115,333.75
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	13,917	118.64	1,651,112.88
APTIV PLC	5,420	84.79	459,561.80
AUTOLIV INC	1,770	127.72	226,064.40
BORGWARNER INC	4,330	51.71	223,904.30
FORD MOTOR COMPANY	72,185	12.58	908,087.30
GENERAL MOTORS CORP	27,305	42.02	1,147,356.10
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	5,430	32.85	178,375.50
HARLEY-DAVIDSON INC	3,709	51.84	192,274.56
LEAR CORP	1,370	177.69	243,435.30
TESLA INC	2,660	325.20	865,032.00
DR HORTON INC	7,936	50.83	403,386.88
GARMIN LTD	2,395	59.18	141,736.10
HANESBRANDS INC	7,940	20.41	162,055.40
HASBRO INC	2,288	93.54	214,030.96
LEGGETT & PLATT INC	2,778	47.06	130,732.68
LENNAR CORP-CL A	3,900	64.00	249,600.00
LULULEMON ATHLETICA INC	2,010	78.48	157,744.80
MATTEL INC	7,349	15.84	116,408.16
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	3,530	63.40	223,802.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,318	276.46	364,374.28
NEWELL BRANDS INC	9,146	30.67	280,507.82



NIKE INC -CL B	26,508	63.29	1,677,691.32
NVR INC	70	3,480.00	243,600.00
POLARIS INDUSTRIES INC	1,240	125.22	155,272.80
PULTE GROUP INC	5,660	33.37	188,874.20
PVH CORP	1,750	135.60	237,300.00
RALPH LAUREN CORP	1,165	101.80	118,597.00
TAPESTRY INC	5,696	44.38	252,788.48
TOLL BROTHERS INC	3,781	47.29	178,803.49
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	3,560	15.50	55,180.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	4,112	13.80	56,745.60
VF CORP	7,100	73.87	524,477.00
WHIRLPOOL CORP	1,614	171.68	277,091.52
ARAMARK	4,960	42.80	212,288.00
CARNIVAL CORP	7,257	66.35	481,501.95
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	485	295.23	143,186.55
DARDEN RESTAURANTS INC	2,553	96.40	246,109.20
DOMINO'S PIZZA INC	1,020	192.87	196,727.40
H&R BLOCK INC	4,510	26.23	118,297.30
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,710	79.35	294,388.50
LAS VEGAS SANDS CORP	8,180	69.74	570,473.20
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	6,503	133.97	871,206.91
MCDONALD'S CORP	16,691	171.42	2,861,171.22
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	4,100	28.46	116,686.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	9,760	33.34	325,398.40
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	3,220	54.03	173,976.60
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,538	121.06	428,310.28
STARBUCKS CORP	29,314	57.30	1,679,692.20
VAIL RESORTS INC	740	215.17	159,225.80
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,240	113.58	254,419.20
WYNN RESORTS LTD	1,660	167.75	278,465.00
YUM! BRANDS INC	6,804	82.40	560,649.60
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	7,458	60.17	448,747.86
CHARTER COMMUNICATION-A	3,891	338.20	1,315,936.20
COMCAST CORP-CLASS A	95,254	40.78	3,884,458.12
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,320	23.73	78,783.60
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	6,490	22.47	145,830.30
DISH NETWORK CORP-A	4,769	48.53	231,439.57
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	6,846	20.39	139,589.94
LIBERTY BROADBAND-C	2,140	85.19	182,306.60
LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,475	35.52	158,952.00
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	12,321	33.88	417,435.48
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	3,890	34.37	133,699.30
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	3,210	39.60	127,116.00

LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	1,975	39.77	78,545.75
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	2,760	42.07	116,113.20
NEWS CORP - CLASS A	7,570	16.42	124,299.40
OMNICOM GROUP	4,577	73.61	336,912.97
SIRIUS XM HOLDINGS INC	34,250	5.37	183,922.50
THE WALT DISNEY CO.	31,253	108.67	3,396,263.51
TIME WARNER INC	15,778	92.38	1,457,571.64
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	9,599	34.72	333,277.28
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	20,442	35.24	720,376.08
VIACOM INC-CLASS B	7,248	32.23	233,603.04
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,508	100.55	151,629.40
AMAZON.COM INC	8,295	1,168.36	9,691,546.20
AUTONATION INC	1,650	51.54	85,041.00
AUTOZONE INC	552	710.09	391,969.68
BEST BUY CO INC	5,564	67.11	373,400.04
CARMAX INC	3,969	65.23	258,897.87
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	5,450	92.91	506,359.50
DOLLAR TREE INC	4,896	109.46	535,916.16
EXPEDIA INC	2,552	120.18	306,699.36
GAP INC/THE	5,106	34.44	175,850.64
GENUINE PARTS CO	2,841	95.11	270,207.51
HOME DEPOT INC	23,920	188.13	4,500,069.60
KOHL'S CORP	3,872	53.66	207,771.52
L BRANDS INC	5,308	61.36	325,698.88
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	8,930	26.18	233,787.40
LKQ CORP	6,330	40.82	258,390.60
LOWE'S COS INC	16,892	91.19	1,540,381.48
MACY'S INC	6,469	25.67	166,059.23
NETFLIX INC	8,750	189.94	1,661,975.00
NORDSTROM INC	2,850	47.54	135,489.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,775	242.50	430,437.50
PRICELINE GROUP INC/THE	995	1,775.26	1,766,383.70
ROSS STORES INC	7,732	80.44	621,962.08
TARGET CORP	10,600	65.39	693,134.00
TIFFANY & CO	2,610	102.84	268,412.40
TJX COMPANIES INC	12,393	76.25	944,966.25
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,750	74.48	204,820.00
TRIPADVISOR INC	2,330	34.57	80,548.10
ULTA BEAUTY INC	1,240	226.27	280,574.80
COSTCO WHOLESALE CORP	8,879	186.63	1,657,087.77
CVS HEALTH CORP	20,707	73.41	1,520,100.87
KROGER CO	16,700	28.25	471,775.00

SYSCO CORP	10,546	60.72	640,353.12
WAL-MART STORES INC	30,612	98.21	3,006,404.52
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	18,352	72.71	1,334,373.92
ALTRIA GROUP INC	38,828	72.14	2,801,051.92
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	11,343	40.19	455,875.17
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	4,224	67.79	286,344.96
BUNGE LTD	2,857	66.74	190,676.18
CAMPBELL SOUP CO	3,485	48.77	169,963.45
COCA-COLA CO/THE	82,192	45.59	3,747,133.28
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	4,220	39.40	166,268.00
CONAGRA BRANDS INC	8,960	38.08	341,196.80
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,460	223.81	774,382.60
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	3,769	96.12	362,276.28
GENERAL MILLS INC	11,439	60.13	687,827.07
HERSHEY CO/THE	3,015	114.95	346,574.25
HORMEL FOODS CORP	5,960	36.73	218,910.80
INGREDION INC	1,470	140.57	206,637.90
JM SMUCKER CO/THE	2,250	125.22	281,745.00
KELLOGG CO	5,408	68.10	368,284.80
KRAFT HEINZ CO/THE	12,241	78.24	957,735.84
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,275	101.92	231,868.00
MOLSON COORS BREWING CO -B	3,870	81.10	313,857.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	30,685	43.36	1,330,501.60
MONSTER BEVERAGE CORP	8,290	63.77	528,653.30
PEPSICO INC	28,891	118.60	3,426,472.60
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	31,588	104.65	3,305,684.20
TYSON FOODS INC-CL A	5,736	80.62	462,436.32
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,430	50.05	271,771.50
CLOROX COMPANY	2,736	149.52	409,086.72
COLGATE-PALMOLIVE CO	17,140	75.15	1,288,071.00
COTY INC-CL A	10,000	19.93	199,300.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,480	127.75	572,320.00
KIMBERLY-CLARK CORP	7,293	120.66	879,973.38
PROCTER & GAMBLE CO	51,669	92.13	4,760,264.97
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	520	114.11	59,337.20
ABBOTT LABORATORIES	35,396	56.93	2,015,094.28
AETNA INC	6,819	179.96	1,227,147.24
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,470	223.12	327,986.40
AMERISOURCEBERGEN CORP	3,254	92.46	300,864.84
ANTHEM INC	5,436	225.60	1,226,361.60
BAXTER INTERNATIONAL INC	10,399	64.72	673,023.28
BECTON DICKINSON AND CO	5,167	217.23	1,122,427.41

BOSTON SCIENTIFIC CORP	28,738	25.10	721,323.80
CARDINAL HEALTH INC	6,565	62.49	410,246.85
CENTENE CORP	3,530	102.16	360,624.80
CERNER CORP	6,230	67.38	419,777.40
CIGNA CORP	5,220	203.39	1,061,695.80
COOPER COS INC/THE	1,040	219.80	228,592.00
DANAHER CORP	12,719	93.46	1,188,717.74
DAVITA INC	3,438	71.98	247,467.24
DENTSPLY SIRONA INC	4,852	65.82	319,358.64
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,410	112.49	496,080.90
ENVISION HEALTHCARE CORP	2,312	34.38	79,486.56
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	11,414	74.53	850,685.42
HCA HEALTHCARE INC	6,165	89.09	549,239.85
HENRY SCHEIN INC	3,340	71.01	237,173.40
HOLOGIC INC	5,708	43.37	247,555.96
HUMANA INC	2,945	245.00	721,525.00
IDEXX LABORATORIES INC	1,830	157.65	288,499.50
INTUITIVE SURGICAL INC	2,250	363.16	817,110.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,155	160.72	346,351.60
MCKESSON CORP	4,324	158.44	685,094.56
MEDTRONIC PLC	27,488	81.54	2,241,371.52
QUEST DIAGNOSTICS	3,116	99.24	309,231.84
RESMED INC	2,950	85.11	251,074.50
STRYKER CORP	7,043	154.14	1,085,608.02
TELEFLEX INC	900	249.44	224,496.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	19,640	220.00	4,320,800.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,810	115.06	208,258.60
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,924	110.91	213,390.84
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	1,910	56.07	107,093.70
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	4,162	120.12	499,939.44
ABBVIE INC	32,426	98.21	3,184,557.46
AGILENT TECHNOLOGIES INC	6,620	67.35	445,857.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	4,540	118.78	539,261.20
ALKERMES PLC	3,220	53.04	170,788.80
ALLERGAN PLC	6,815	164.90	1,123,793.50
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,620	123.96	200,815.20
AMGEN INC	14,801	176.42	2,611,192.42
BIOGEN INC	4,333	319.50	1,384,393.50
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,500	90.46	316,610.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	33,421	60.96	2,037,344.16
CELGENE CORP	15,854	106.33	1,685,755.82
ELI LILLY & CO	20,133	85.07	1,712,714.31

GILEAD SCIENCES INC	26,584	72.71	1,932,922.64
ILLUMINA INC	3,025	215.72	652,553.00
INCYTE CORP	3,520	95.81	337,251.20
IQVIA HOLDINGS INC	2,793	99.38	277,568.34
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,180	132.78	156,680.40
JOHNSON & JOHNSON	54,411	140.12	7,624,069.32
MERCK & CO. INC.	55,213	56.36	3,111,804.68
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	540	614.77	331,975.80
MYLAN NV	9,585	42.05	403,049.25
PERRIGO CO PLC	2,559	87.01	222,658.59
PFIZER INC	120,490	36.14	4,354,508.60
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,620	381.00	617,220.00
SEATTLE GENETICS INC	2,020	53.43	107,928.60
TESARO INC	660	80.68	53,248.80
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	19,610	18.75	367,687.50
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	7,944	190.42	1,512,696.48
UNITED THERAPEUTICS CORP	940	137.25	129,015.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,100	149.97	764,847.00
WATERS CORP	1,666	193.79	322,854.14
ZOETIS INC	9,740	71.99	701,182.60
BANK OF AMERICA CORP	202,039	29.88	6,036,925.32
BB&T CORP	15,838	50.45	799,027.10
CIT GROUP INC	2,655	50.35	133,679.25
CITIGROUP INC	55,727	75.49	4,206,831.23
CITIZENS FINANCIAL GROUP	10,590	42.63	451,451.70
COMERICA INC	3,360	87.74	294,806.40
EAST WEST BANCORP INC	2,660	61.81	164,414.60
FIFTH THIRD BANCORP	15,509	30.84	478,297.56
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,070	87.20	267,704.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	21,790	14.78	322,056.20
JPMORGAN CHASE & CO	71,360	107.45	7,667,632.00
KEYCORP	22,678	20.44	463,538.32
M & T BANK CORP	2,813	173.07	486,845.91
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	9,654	13.28	128,205.12
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	6,370	18.91	120,488.55
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	9,790	146.12	1,430,514.80
REGIONS FINANCIAL CORP	23,184	17.47	405,024.48
SIGNATURE BANK	990	139.11	137,718.90
SUNTRUST BANKS INC	9,557	65.76	628,468.32
SVB FINANCIAL GROUP	990	241.70	239,283.00
US BANCORP	33,811	54.46	1,841,347.06
WELLS FARGO & CO	95,560	61.55	5,881,718.00
ZIONS BANCORPORATION	3,750	51.33	192,487.50

AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,100	204.20	224,620.00
ALLY FINANCIAL INC	9,120	29.25	266,760.00
AMERICAN EXPRESS CO	15,344	98.74	1,515,066.56
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,060	171.51	524,820.60
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	20,892	54.00	1,128,168.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	25,720	197.92	5,090,502.40
BLACKROCK INC	2,435	512.12	1,247,012.20
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	9,795	100.50	984,397.50
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,880	124.47	234,003.60
CME GROUP INC	6,840	148.98	1,019,023.20
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	7,640	77.13	589,273.20
E*TRADE FINANCIAL CORP	5,840	49.71	290,306.40
EATON VANCE CORP	2,260	56.43	127,531.80
FRANKLIN RESOURCES INC	6,635	43.91	291,342.85
GOLDMAN SACHS GROUP INC	7,228	258.97	1,871,835.16
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	11,990	70.25	842,297.50
INVESCO LTD	8,467	36.64	310,230.88
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	26.21	191,464.05
MOODY'S CORP	3,637	146.99	534,602.63
MORGAN STANLEY	28,325	52.72	1,493,294.00
MSCI INC	2,000	128.33	256,660.00
NASDAQ INC	2,555	76.09	194,409.95
NORTHERN TRUST CORP	4,420	98.98	437,491.60
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,500	90.64	226,600.00
S&P GLOBAL INC	5,442	167.83	913,330.86
SCHWAB (CHARLES) CORP	24,634	52.08	1,282,938.72
SEI INVESTMENTS COMPANY	2,715	72.01	195,507.15
STATE STREET CORP	7,617	97.93	745,932.81
SYNCHRONY FINANCIAL	16,310	38.77	632,338.70
T ROWE PRICE GROUP INC	4,925	105.24	518,307.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	5,270	51.95	273,776.50
VOYA FINANCIAL INC	4,150	51.14	212,231.00
AFLAC INC	7,822	87.21	682,156.62
ALLEGHANY CORP	330	589.86	194,653.80
ALLSTATE CORP	7,673	104.11	798,836.03
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,490	108.36	161,456.40
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	17,975	59.31	1,066,097.25
AON PLC	5,357	133.35	714,355.95
ARCH CAPITAL GROUP LTD	2,775	89.71	248,945.25
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,300	62.60	206,580.00
ASSURANT INC	1,270	101.03	128,308.10
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	2,270	51.82	117,631.40

AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	1,485	50.06	74,339.10
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	1,774	59.54	105,623.96
CHUBB LTD	9,395	145.20	1,364,154.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,400	73.99	251,566.00
EVEREST RE GROUP LTD	874	218.95	191,362.30
FNF GROUP	5,241	39.07	204,765.87
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	6,942	55.55	385,628.10
LINCOLN NATIONAL CORP	4,513	77.75	350,885.75
LOEWS CORP	6,105	49.66	303,174.30
MARKEL CORP	280	1,126.69	315,473.20
MARSH & MCLENNAN COS	10,383	80.69	837,804.27
METLIFE INC	18,535	50.76	940,836.60
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6,000	71.26	427,560.00
PROGRESSIVE CORP	12,350	56.09	692,711.50
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	8,932	116.16	1,037,541.12
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,310	155.07	203,141.70
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	887	125.83	111,611.21
TORCHMARK CORP	2,216	90.69	200,969.04
TRAVELERS COS INC/THE	5,314	134.39	714,148.46
UNUM GROUP	4,788	54.79	262,334.52
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,568	151.74	389,668.32
WR BERKLEY CORP	2,063	70.90	146,266.70
XL GROUP LTD	5,720	35.17	201,172.40
CBRE GROUP INC	5,950	43.37	258,051.50
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	23,700	7.02	166,374.00
JONES LANG LASALLE INC	890	149.57	133,117.30
ACCENTURE PLC-CL A	12,488	153.89	1,921,778.32
ACTIVISION BLIZZARD INC	14,600	64.51	941,846.00
ADOBE SYSTEMS INC	10,089	175.00	1,765,575.00
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	3,690	65.45	241,510.50
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,075	251.99	270,889.25
ALPHABET INC-CL A	6,040	1,068.86	6,455,914.40
ALPHABET INC-CL C	6,342	1,060.12	6,723,281.04
ANSYS INC	1,820	146.66	266,921.20
AUTODESK INC	4,190	103.89	435,299.10
AUTOMATIC DATA PROCESSING	9,116	116.88	1,065,478.08
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	2,420	90.95	220,099.00
CA INC	6,760	33.52	226,595.20
CADENCE DESIGN SYS INC	6,170	42.26	260,744.20
CDK GLOBAL INC	2,720	71.34	194,044.80
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2,480	101.92	252,761.60
CITRIX SYSTEMS INC	3,228	87.88	283,676.64

COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	12,078	71.70	865,992.60
COSTAR GROUP INC	660	299.79	197,861.40
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	4,320	82.08	354,585.60
DXC TECHNOLOGY CO	5,903	95.89	566,038.67
EBAY INC	21,227	37.76	801,531.52
ELECTRONIC ARTS INC	6,204	106.02	657,748.08
FACEBOOK INC-A	48,020	177.20	8,509,144.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	6,455	94.32	608,835.60
FIRST DATA CORP- CLASS-A	6,130	16.62	101,880.60
FISERV INC	4,508	130.32	587,482.56
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,950	190.46	371,397.00
FORTINET INC	3,100	43.92	136,152.00
GARTNER INC	1,750	123.59	216,282.50
GLOBAL PAYMENTS INC	3,200	100.36	321,152.00
IAC/INTERACTIVECORP	1,440	126.97	182,836.80
INTL BUSINESS MACHINES CORP	17,922	152.50	2,733,105.00
INTUIT INC	4,966	158.50	787,111.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,530	116.84	178,765.20
LEIDOS HOLDINGS INC	2,630	65.22	171,528.60
MASTERCARD INC	19,390	150.85	2,924,981.50
MERCADOLIBRE INC	810	314.83	255,012.30
MICROSOFT CORP	148,584	85.51	12,705,417.84
ORACLE CORP	63,033	47.36	2,985,242.88
PAYCHEX INC	6,562	68.27	447,987.74
PAYPAL HOLDINGS INC	23,257	73.89	1,718,459.73
RED HAT INC	3,600	122.92	442,512.00
SABRE CORP	4,520	20.76	93,835.20
SALESFORCE.COM INC	13,700	102.63	1,406,031.00
SERVICENOW INC	3,400	129.19	439,246.00
SPLUNK INC	2,830	82.75	234,182.50
SQUARE INC - A	4,950	35.14	173,943.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	3,120	40.44	126,172.80
SYMANTEC CORP	13,055	28.32	369,717.60
SYNOPSIS INC	3,207	85.82	275,224.74
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2,080	109.14	227,011.20
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,636	78.80	286,516.80
TWITTER INC	12,260	24.46	299,879.60
VANTIV INC - CL-A	3,230	74.36	240,182.80
VERISIGN INC	1,810	113.99	206,321.90
VISA INC-CLASS A SHARES	37,062	112.69	4,176,516.78
VMWARE INC	1,555	127.69	198,557.95
WESTERN UNION CO	10,451	19.08	199,405.08
WORKDAY INC-CLASS A	2,520	102.32	257,846.40



ZILLOW GROUP INC - C	2,000	42.34	84,680.00
AMPHENOL CORP-CL A	6,450	88.14	568,503.00
APPLE INC	104,762	175.01	18,334,397.62
ARISTA NETWORKS INC	840	236.55	198,702.00
ARROW ELECTRONICS INC	1,930	80.40	155,172.00
AVNET INC	2,610	39.60	103,356.00
CDW CORP/DE	2,960	69.20	204,832.00
CISCO SYSTEMS INC	101,650	38.55	3,918,607.50
COGNEX CORP	3,400	61.89	210,426.00
COMMSCOPE HOLDING CO INC	3,570	38.31	136,766.70
CORNING INC	18,388	32.38	595,403.44
F5 NETWORKS INC	1,205	132.37	159,505.85
FLEX LTD	10,936	17.97	196,519.92
FLIR SYSTEMS INC	2,675	47.36	126,688.00
HARRIS CORP	2,550	142.78	364,089.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	32,915	14.71	484,179.65
HP INC	34,005	21.26	722,946.30
IPG PHOTONICS CORP	730	213.12	155,577.60
JUNIPER NETWORKS INC	7,023	28.86	202,683.78
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3,655	90.76	331,727.80
NETAPP INC	5,236	56.30	294,786.80
PALO ALTO NETWORKS INC	1,900	146.15	277,685.00
SEAGATE TECHNOLOGY	6,264	42.17	264,152.88
TE CONNECTIVITY LTD	6,955	94.95	660,377.25
TRIMBLE INC	5,170	40.51	209,436.70
WESTERN DIGITAL CORP	5,848	80.68	471,816.64
XEROX CORP	4,938	29.58	146,066.04
AT&T INC	124,397	38.94	4,844,019.18
CENTURYLINK INC	19,626	17.24	338,352.24
SPRINT CORP	17,350	5.64	97,854.00
T-MOBILE US INC	6,082	63.62	386,936.84
VERIZON COMMUNICATIONS INC	82,627	53.19	4,394,930.13
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	3,700	36.00	133,200.00
AES CORP	13,728	10.71	147,026.88
ALLIANT ENERGY CORP	4,250	42.50	180,625.00
AMEREN CORPORATION	4,602	58.69	270,091.38
AMERICAN ELECTRIC POWER	9,798	73.65	721,622.70
AMERICAN WATER WORKS CO INC	3,455	90.51	312,712.05
ATMOS ENERGY CORP	1,920	85.09	163,372.80
CENTERPOINT ENERGY INC	8,142	28.07	228,545.94
CMS ENERGY CORP	5,350	47.35	253,322.50
CONSOLIDATED EDISON INC	6,306	84.75	534,433.50

DOMINION RESOURCES INC/VA	12,627	80.44	1,015,715.88
DTE ENERGY COMPANY	3,698	108.72	402,046.56
DUKE ENERGY CORP	14,256	84.17	1,199,927.52
EDISON INTERNATIONAL	6,589	65.23	429,800.47
ENTERGY CORP	3,847	80.31	308,952.57
EVERSOURCE ENERGY	6,300	62.37	392,931.00
EXELON CORP	19,006	39.01	741,424.06
FIRSTENERGY CORP	8,995	30.48	274,167.60
NEXTERA ENERGY INC	9,565	154.54	1,478,175.10
NISOURCE INC	6,540	25.28	165,331.20
OGE ENERGY CORP	3,830	33.01	126,428.30
P G & E CORP	10,191	44.57	454,212.87
PINNACLE WEST CAPITAL	2,199	85.14	187,222.86
PPL CORP	13,758	31.13	428,286.54
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	10,188	51.07	520,301.16
SCANA CORP	2,683	39.01	104,663.83
SEMPRA ENERGY	4,827	108.31	522,812.37
SOUTHERN CO	19,895	48.50	964,907.50
UGI CORP	3,500	47.02	164,570.00
VISTRA ENERGY CORP	4,810	17.98	86,483.80
WEC ENERGY GROUP INC	6,320	65.72	415,350.40
WESTAR ENERGY INC	2,880	52.78	152,006.40
XCEL ENERGY INC	10,414	48.25	502,475.50
ADVANCED MICRO DEVICES	16,000	10.54	168,640.00
ANALOG DEVICES INC	7,630	88.85	677,925.50
APPLIED MATERIALS INC	21,863	52.06	1,138,187.78
BROADCOM LTD	8,170	262.35	2,143,399.50
INTEL CORP	95,192	46.70	4,445,466.40
KLA-TENCOR CORPORATION	3,199	109.32	349,714.68
LAM RESEARCH CORP	3,247	186.69	606,182.43
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	8,004	22.01	176,168.04
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	5,850	53.15	310,927.50
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	4,614	88.92	410,276.88
MICRON TECHNOLOGY INC	21,887	44.12	965,654.44
NVIDIA CORP	12,135	195.27	2,369,601.45
NXP SEMICONDUCTORS NV	6,097	116.70	711,519.90
QORVO INC	2,670	67.69	180,732.30
QUALCOMM INC	30,012	64.73	1,942,676.76
SKYWORKS SOLUTIONS INC	3,920	97.07	380,514.40
TEXAS INSTRUMENTS INC	20,312	104.13	2,115,088.56
XILINX INC	5,075	67.92	344,694.00
	6,301,565		476,308,757.82

米ドル小計			(53,932,440,648)	
加ドル	ALTAGAS LTD	3,050	28.41	86,650.50
	ARC RESOURCES LTD	7,925	14.55	115,308.75
	CAMECO CORP	7,892	11.97	94,467.24
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	23,194	44.22	1,025,638.68
	CENOVUS ENERGY INC	17,463	11.17	195,061.71
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	11,475	9.16	105,111.00
	ENBRIDGE INC	33,207	49.14	1,631,791.98
	ENCANA CORP	21,068	16.04	337,930.72
	HUSKY ENERGY INC	6,873	17.53	120,483.69
	IMPERIAL OIL LTD	5,952	38.44	228,794.88
	INTER PIPELINE LTD	7,180	25.51	183,161.80
	KEYERA CORP	3,540	35.05	124,077.00
	PEMBINA PIPELINE CORP	10,212	45.13	460,867.56
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	4,100	31.71	130,011.00
	SEVEN GENERATIONS ENERGY -A	4,430	17.95	79,518.50
	SUNCOR ENERGY INC	33,899	44.70	1,515,285.30
	TOURMALINE OIL CORP	4,575	22.42	102,571.50
	TRANSCANADA CORP	17,673	61.68	1,090,070.64
	VERMILION ENERGY INC	2,640	45.11	119,090.40
	AGNICO EAGLE MINES LTD	4,695	57.62	270,525.90
	AGRIUM INC	2,705	143.68	388,654.40
	BARRICK GOLD CORP	23,944	18.40	440,569.60
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,050	58.57	178,638.50
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	14,710	17.12	251,835.20
	FRANCO-NEVADA CORP	3,805	99.86	379,967.30
	GOLDCORP INC	17,917	16.00	286,672.00
	KINROSS GOLD CORP	25,015	5.40	135,081.00
	LUNDIN MINING CORP	12,280	8.20	100,696.00
	METHANEX CORP	1,650	75.59	124,723.50
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	17,917	25.64	459,391.88
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	11,955	32.33	386,505.15
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	23,419	4.23	99,062.37
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,460	77.49	113,135.40
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	9,395	28.03	263,341.85
	BOMBARDIER INC 'B'	34,746	3.02	104,932.92
	CAE INC	6,315	23.49	148,339.35
	FINNING INTERNATIONAL INC	2,845	31.42	89,389.90
	SNC-LAVALIN GROUP INC	3,195	57.47	183,616.65
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	15,248	103.97	1,585,334.56
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	2,915	231.75	675,551.25
	LINAMAR CORP	980	74.45	72,961.00

MAGNA INTERNATIONAL INC	7,018	73.00	512,314.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	4,540	41.13	186,730.20
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	4,638	77.98	361,671.24
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	8,165	28.99	236,703.35
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,560	163.56	255,153.60
DOLLARAMA INC	2,180	155.51	339,011.80
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	8,510	65.40	556,554.00
EMPIRE CO LTD 'A'	3,000	24.25	72,750.00
LOBLAW COMPANIES LTD	4,989	68.16	340,050.24
METRO INC	4,380	40.35	176,733.00
WESTON (GEORGE) LTD	1,182	109.01	128,849.82
SAPUTO INC	5,040	44.64	224,985.60
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	6,734	27.44	184,780.96
BANK OF MONTREAL	12,701	100.78	1,280,006.78
BANK OF NOVA SCOTIA	24,319	82.29	2,001,210.51
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	8,705	123.11	1,071,672.55
NATIONAL BANK OF CANADA	6,740	62.35	420,239.00
ROYAL BANK OF CANADA	29,529	102.45	3,025,246.05
TORONTO-DOMINION BANK	37,350	72.99	2,726,176.50
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	16,413	54.59	895,985.67
CI FINANCIAL CORP	4,630	29.53	136,723.90
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	7,180	9.60	68,928.00
IGM FINANCIAL INC	1,945	44.27	86,105.15
ONEX CORPORATION	1,905	93.08	177,317.40
THOMSON REUTERS CORP	5,534	55.23	305,642.82
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	500	666.00	333,000.00
GREAT-WEST LIFECO INC	5,974	35.03	209,269.22
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	1,735	59.56	103,336.60
INTACT FINANCIAL CORP	2,485	104.07	258,613.95
MANULIFE FINANCIAL CORP	41,291	26.71	1,102,882.61
POWER CORP OF CANADA	7,800	32.40	252,720.00
POWER FINANCIAL CORP	5,715	34.91	199,510.65
SUN LIFE FINANCIAL INC	12,944	51.82	670,758.08
FIRST CAPITAL REALTY INC	3,320	20.62	68,458.40
CGI GROUP INC - CL A	4,650	68.92	320,478.00
CONSTELLATION SOFTWARE INC	420	767.34	322,282.80
OPEN TEXT CORP	5,100	41.69	212,619.00
SHOPIFY INC - CLASS-A	1,800	131.99	237,582.00
BLACKBERRY LTD	10,328	14.74	152,234.72
BCE INC	2,930	60.39	176,942.70
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	7,185	64.15	460,917.75
TELUS CORP	4,366	47.73	208,389.18

	ATCO LTD -CLASS I	1,920	44.40	85,248.00
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,590	36.97	95,752.30
	FORTIS INC	8,075	45.82	369,996.50
	HYDRO ONE LTD	6,290	22.39	140,833.10
加ドル小計		822,814		36,238,186.23 (3,220,849,992)
ユーロ	ENAGAS SA	5,680	24.13	137,058.40
	ENI SPA	51,366	14.02	720,151.32
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	9,315	15.66	145,872.90
	NESTE OYJ	2,740	53.55	146,727.00
	OMV AG	3,490	54.14	188,948.60
	REPSOL SA	24,709	15.04	371,623.36
	REPSOL SA-RTS	24,709	0.38	9,537.67
	SNAM SPA	46,120	4.09	188,907.52
	TENARIS SA	9,355	13.35	124,889.25
	TOTAL SA	48,107	46.47	2,235,532.29
	VOPAK	1,270	36.72	46,640.75
	AIR LIQUIDE SA	8,929	106.55	951,384.95
	AKZO NOBEL	5,058	73.29	370,700.82
	ARCELORMITTAL	12,982	27.47	356,615.54
	ARKEMA	1,335	101.75	135,836.25
	BASF SE	18,615	93.51	1,740,688.65
	COVESTRO AG	2,140	86.25	184,575.00
	CRH PLC	17,110	29.96	512,615.60
	EVONIK INDUSTRIES AG	3,580	31.58	113,074.30
	FUCHS PETROLUB SE-PRF	1,720	44.57	76,669.00
	HEIDELBERGCEMENT AG	2,845	90.12	256,391.40
	IMERYS SA	830	79.02	65,586.60
	K+S AG	3,880	20.26	78,608.80
	KONINKLIJKE DSM NV	3,842	80.26	308,358.92
	LANXESS AG	1,935	64.93	125,639.55
	LINDE AG	3,695	180.25	666,023.75
	SOLVAY SA	1,581	115.90	183,237.90
	STORA ENSO OYJ-R SHS	12,085	13.42	162,180.70
	SYMRISE AG	2,640	70.64	186,489.60
	THYSSENKRUPP AG	7,415	23.93	177,440.95
	UMICORE	4,240	38.72	164,194.00
	UPM-KYMMENE OYJ	10,878	26.39	287,070.42
	VOESTALPINE AG	2,509	50.82	127,507.38
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4,176	32.52	135,803.52
	AIRBUS GROUP SE	11,848	84.55	1,001,748.40
	ALSTOM	3,590	34.90	125,308.95

ANDRITZ AG	1,420	46.82	66,491.50
BOSKALIS WESTMINSTER	1,695	31.36	53,163.67
BOUYGUES SA	4,210	43.82	184,482.20
BRENTAG AG	3,095	53.09	164,313.55
CNH INDUSTRIAL NV	22,370	11.34	253,675.80
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	10,106	46.45	469,423.70
DASSAULT AVIATION SA	50	1,296.25	64,812.50
EIFFAGE	1,130	90.77	102,570.10
FERROVIAL SA	9,975	19.16	191,170.87
GEA GROUP AG	3,940	39.50	155,630.00
HOCHTIEF AG	440	144.10	63,404.00
KION GROUP AG	1,400	73.64	103,096.00
KONE OYJ-B	6,474	44.69	289,323.06
LEGRAND SA	5,628	64.35	362,161.80
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	8,130	9.91	80,608.95
MAN SE	824	95.14	78,395.36
METSO OYJ	2,420	28.43	68,800.60
MTU AERO ENGINES AG	1,010	152.30	153,823.00
OSRAM LICHT AG	1,582	75.12	118,839.84
PRYSMIAN SPA	3,425	27.54	94,324.50
REXEL SA	6,250	15.03	93,968.75
SAFRAN SA	6,520	88.05	574,086.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	11,448	72.32	827,919.36
SIEMENS AG-REG	15,506	117.45	1,821,179.70
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	4,180	11.61	48,550.70
THALES SA	2,345	89.69	210,323.05
VINCI SA	10,390	85.93	892,812.70
WARTSILA OYJ ABP	2,940	53.00	155,820.00
ZODIAC AEROSPACE	4,550	24.98	113,681.75
BUREAU VERITAS SA	5,650	22.73	128,452.75
EDENRED	3,906	24.10	94,134.60
RANDSTAD HOLDING NV	2,285	51.46	117,586.10
RELX NV	20,559	19.27	396,171.93
SOCIETE BIC SA	565	92.24	52,115.60
TELEPERFORMANCE	1,120	118.75	133,000.00
WOLTERS KLUWER	6,297	44.22	278,453.34
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	12,000	18.45	221,460.00
ADP	650	158.30	102,895.00
AENA SA	1,490	169.45	252,480.50
ATLANTIA SPA	9,360	26.53	248,320.80
BOLLORE	20,400	4.51	92,126.40
DEUTCHE LUFTHANSA	5,680	31.05	176,392.40

DEUTSCHE POST AG-REG	20,063	40.49	812,451.18
FRAPORT AG	980	91.41	89,581.80
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	8,760	10.72	93,907.20
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	12,822	7.31	93,780.10
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	6,645	87.52	581,570.40
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,190	74.03	88,095.70
CONTINENTAL AG	2,235	226.30	505,780.50
DAIMLER AG	19,492	71.31	1,389,974.52
FAURECIA	1,440	66.36	95,558.40
FERRARI NV	2,384	89.55	213,487.20
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	19,647	15.45	303,546.15
MICHELIN (CGDE)-B	3,679	121.85	448,286.15
NOKIAN RENKAAT OYJ	1,965	37.67	74,021.55
PEUGEOT SA	9,800	17.09	167,531.00
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	3,150	70.12	220,878.00
RENAULT SA	3,477	84.18	292,693.86
SCHAEFFLER AG-PRF	3,550	14.74	52,327.00
VALEO SA	4,860	62.32	302,875.20
VOLKSWAGEN AG	591	170.00	100,470.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	3,853	169.00	651,157.00
ADIDAS AG	3,831	169.40	648,971.40
HERMES INTERNATIONAL	612	448.40	274,420.80
HUGO BOSS AG -ORD	1,230	71.62	88,092.60
KERING	1,607	391.30	628,819.10
LUXOTTICA GROUP SPA	3,486	51.70	180,226.20
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	5,724	249.50	1,428,138.00
SEB SA	480	154.35	74,088.00
ACCOR SA	3,456	41.89	144,789.12
PADDY POWER BETFAIR PLC	1,630	97.98	159,707.40
SODEXO	1,970	112.10	220,837.00
ALTICE NV -A	8,340	8.56	71,432.10
AXEL SPRINGER SE	995	66.22	65,888.90
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	19.91	75,558.45
JC DECAUX SA	1,200	33.75	40,500.00
LAGARDERE S.C.A.	2,980	27.07	80,668.60
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	4,805	28.98	139,248.90
PUBLICIS GROUPE	4,075	56.79	231,419.25
RTL GROUP	630	67.43	42,480.90
SES	7,520	13.65	102,648.00
TELENET GROUP HOLDING NV	1,240	57.96	71,870.40
VIVENDI	20,560	22.76	468,048.40
INDITEX	22,705	29.61	672,408.57

ZALANDO SE	1,700	43.90	74,630.00
CARREFOUR SA	12,213	17.54	214,216.02
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,344	49.94	67,119.36
COLRUYT SA	1,375	43.02	59,152.50
JERONIMO MARTINS	5,075	16.04	81,403.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	26,448	18.20	481,353.60
METRO WHOLESALE & FOOD SPECI	4,140	16.60	68,744.70
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	15,451	93.99	1,452,239.49
DANONE	12,354	70.60	872,192.40
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	10,800	6.41	69,228.00
HEINEKEN HOLDING NV	2,125	83.10	176,587.50
HEINEKEN NV	5,293	87.70	464,196.10
KERRY GROUP PLC-A	3,380	93.00	314,340.00
PERNOD-RICARD SA	4,406	130.80	576,304.80
REMY COINTREAU	470	115.75	54,402.50
BEIERSDORF AG	2,015	98.41	198,296.15
HENKEL AG & CO KGAA	1,850	99.79	184,611.50
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	3,743	110.50	413,601.50
L'OREAL	5,106	186.80	953,800.80
UNILEVER NV-CVA	33,315	47.48	1,581,796.20
BIOMERIEUX	750	74.12	55,590.00
ESSILOR INTERNATIONAL	4,215	115.25	485,778.75
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	4,303	88.23	379,653.69
FRESENIUS SE & CO KGAA	8,675	65.36	566,998.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	19,211	31.95	613,791.45
BAYER AG	16,770	105.45	1,768,396.50
EUROFINS SCIENTIFIC	220	503.50	110,770.00
GRIFOLS SA	6,820	24.79	169,067.80
IPSEN	640	100.90	64,576.00
MERCK KGAA	2,630	90.28	237,436.40
ORION OYJ-CLASS B	1,830	30.37	55,577.10
QIAGEN N.V.	4,364	27.00	117,828.00
RECORDATI SPA	1,730	37.00	64,010.00
SANOFI	23,086	72.55	1,674,889.30
UCB SA	2,798	65.98	184,612.04
ABN AMRO GROUP NV-CVA	7,170	26.89	192,801.30
AIB GROUP PLC	15,300	5.56	85,068.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	135,993	7.26	987,853.15
BANCO DE SABADELL SA	109,692	1.68	185,269.78
BANCO SANTANDER SA	325,679	5.59	1,821,848.32
BANK OF IRELAND GROUP PLC	18,619	7.19	133,870.61
BANKIA SA	23,750	4.01	95,261.25



BANKINTER SA	13,960	8.02	111,959.20
BNP PARIBAS	22,732	62.95	1,430,979.40
CAIXABANK S.A	76,740	3.94	302,355.60
COMMERZBANK AG	21,334	12.63	269,448.42
CREDIT AGRICOLE SA	21,992	14.00	307,888.00
ERSTE GROUP BANK AG	6,438	36.54	235,244.52
ING GROEP NV-CVA	79,405	15.54	1,234,350.72
INTESA SANPAOLO	270,973	2.84	769,563.32
INTESA SANPAOLO-RSP	20,000	2.73	54,600.00
KBC GROEP NV	5,119	71.21	364,523.99
MEDIOBANCA SPA	11,670	9.54	111,331.80
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	2,770	30.35	84,069.50
SOCIETE GENERALE	15,469	43.45	672,205.39
UNICREDIT SPA	39,726	15.92	632,437.92
AMUNDI SA	1,140	70.84	80,757.60
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	42,465	16.31	692,816.47
DEUTSCHE BOERSE AG	4,000	96.63	386,520.00
EURAZEO SE	1,005	76.78	77,163.90
EXOR NV	2,264	51.40	116,369.60
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,432	89.99	128,865.68
NATIXIS	19,150	6.68	127,941.15
WENDEL	600	143.70	86,220.00
AEGON NV	38,139	5.29	201,907.86
AGEAS	4,044	41.11	166,248.84
ALLIANZ SE-REG	9,288	195.25	1,813,482.00
ASSICURAZIONI GENERALI	23,958	15.28	366,078.24
AXA	39,772	25.17	1,001,260.10
CNP ASSURANCES	3,530	19.22	67,846.60
HANNOVER RUECK SE-REG	1,355	105.95	143,562.25
MAPFRE SA	20,814	2.68	55,968.84
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,096	183.50	568,116.00
NN GROUP NV	6,340	36.46	231,156.40
POSTE ITALIANE SPA	10,260	6.33	64,945.80
SAMPO OYJ-A SHS	9,109	45.74	416,645.66
SCOR SE	3,152	34.00	107,168.00
UNIPOLSAI SPA	18,580	1.96	36,565.44
DEUTSCHE WOHNEN SE	7,500	36.34	272,550.00
VONOVIA SE	9,298	40.97	380,985.55
AMADEUS IT GROUP SA	9,370	60.73	569,040.10
ATOS SE	2,060	122.25	251,835.00
CAP GEMINI SA	3,149	99.52	313,388.48
DASSAULT SYSTEMES SA	2,790	89.14	248,700.60

	SAP SE	19,972	94.58	1,888,951.76
	UBISOFT ENTERTAINMENT	1,190	65.37	77,790.30
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2,930	58.17	170,438.10
	WIRECARD AG	2,310	94.11	217,394.10
	INGENICO GROUP	1,160	88.29	102,416.40
	NOKIA OYJ	119,986	4.03	484,023.52
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	66,416	15.00	996,572.08
	DRILLISCH AG	980	68.16	66,796.80
	ELISA OYJ	2,505	32.77	82,088.85
	ILIAD SA	520	200.35	104,182.00
	KONINKLIJKE KPN NV	65,606	2.90	190,847.85
	ORANGE S.A.	41,574	14.64	608,643.36
	PROXIMUS	2,440	27.74	67,685.60
	TELECOM ITALIA SPA	233,203	0.73	172,103.81
	TELECOM ITALIA-RSP	125,887	0.60	75,909.86
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	12,220	4.24	51,898.34
	TELEFONICA SA	94,699	8.25	781,740.24
	E.ON SE	44,659	9.21	411,443.36
	EDF	7,875	10.55	83,120.62
	ENDESA SA	6,840	18.96	129,686.40
	ENEL SPA	164,637	5.28	870,106.54
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	54,991	2.86	157,769.17
	ENGIE	35,254	14.56	513,474.51
	FORTUM OYJ	8,865	16.53	146,538.45
	GAS NATURAL SDG SA	7,722	19.24	148,571.28
	IBERDROLA SA	117,842	6.51	768,094.15
	INNOGY SE	2,850	32.55	92,767.50
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	9,010	18.58	167,405.80
	RWE AG	10,685	17.04	182,125.82
	SUEZ	6,199	14.61	90,598.38
	TERNA SPA	27,677	4.93	136,558.31
	UNIPER SE	3,820	25.02	95,576.40
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	9,184	21.48	197,318.24
	ASML HOLDING NV	7,662	147.00	1,126,314.00
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	23,445	23.21	544,275.67
	STMICROELECTRONICS NV	12,733	18.59	236,706.47
	ユーロ小計	4,001,572		81,650,478.98 (10,947,696,221)
英債券	BP PLC	399,108	5.17	2,064,186.57
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	89,948	24.52	2,205,974.70
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	76,749	24.71	1,896,851.53
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	13,000	6.48	84,240.00

ANGLO AMERICAN PLC	27,074	15.01	406,380.74
ANTOFAGASTA PLC	8,730	9.64	84,157.20
BHP BILLITON PLC	42,721	14.63	625,221.83
CRODA INTERNATIONAL PLC	2,751	43.63	120,026.13
FRESNILLO PLC	3,990	13.50	53,865.00
GLENCORE PLC	250,373	3.75	939,900.24
JOHNSON MATTHEY PLC	4,199	30.71	128,951.29
MONDI PLC	7,400	18.74	138,676.00
RANDGOLD RESOURCES LTD	1,840	71.35	131,284.00
RIO TINTO PLC	25,265	37.46	946,553.22
ASHTREAD GROUP PLC	9,930	19.44	193,039.20
BAE SYSTEMS PLC ORD	65,595	5.68	372,579.60
BUNZL PLC	7,276	20.65	150,249.40
COBHAM PLC	48,771	1.25	61,207.60
DCC PLC	1,810	74.40	134,664.00
FERGUSON PLC	5,324	54.25	288,827.00
IMI PLC	6,116	13.26	81,098.16
MEGGITT PLC	13,905	4.90	68,134.50
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	33,045	8.59	284,021.77
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENTITL-C	1,520,070	0.00	1,520.07
SMITHS GROUP PLC	8,813	14.85	130,873.05
TRAVIS PERKINS PLC	5,800	15.43	89,494.00
WEIR GROUP PLC/THE	3,880	21.10	81,868.00
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,275	7.02	44,050.50
CAPITA PLC	15,309	4.00	61,236.00
EXPERIAN PLC	18,678	15.97	298,287.66
G4S PLC	34,639	2.60	90,096.03
INTERTEK GROUP PLC	3,545	51.65	183,099.25
RELX PLC	20,676	17.32	358,108.32
EASYJET PLC	3,840	14.45	55,488.00
ROYAL MAIL PLC	19,950	4.53	90,393.45
GKN PLC	33,065	3.14	103,923.29
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	22,900	6.44	147,476.00
BERKELEY GROUP HOLDINGS	2,600	42.04	109,304.00
BURBERRY GROUP PLC	8,904	17.59	156,621.36
PERSIMMON PLC	7,000	27.19	190,330.00
TAYLOR WIMPEY PLC	73,610	2.05	151,268.55
CARNIVAL PLC	4,050	49.03	198,571.50
COMPASS GROUP PLC	32,468	15.69	509,422.92
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	3,859	47.18	182,067.62
MERLIN ENTERTAINME	15,550	3.60	56,104.40
TUI AG-DI	9,943	15.32	152,326.76

WHITBREAD PLC	3,520	39.48	138,969.60
ITV PLC	77,235	1.65	127,514.98
PEARSON PLC	17,749	7.35	130,455.15
SKY PLC	21,334	10.15	216,540.10
WPP PLC	25,184	13.45	338,724.80
KINGFISHER PLC	45,257	3.41	154,643.16
MARKS & SPENCER GROUP PLC	34,970	3.13	109,630.95
NEXT PLC	2,987	45.79	136,774.73
SAINSBURY (J) PLC	32,441	2.38	77,209.58
TESCO PLC	171,154	2.06	353,860.89
WM MORRISON SUPERMARKETS	49,255	2.13	105,257.93
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	7,335	28.19	206,773.65
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	46,667	49.70	2,319,349.90
COCA-COLA HBC AG-CDI	3,550	23.79	84,454.50
DIAGEO PLC	50,982	26.89	1,371,160.89
IMPERIAL BRANDS PLC	19,242	31.29	602,082.18
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	13,145	68.33	898,197.85
UNILEVER PLC	26,037	41.28	1,074,807.36
CONVATEC GROUP PLC	27,730	2.05	56,957.42
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	7,000	6.22	43,575.00
SMITH & NEPHEW PLC	18,786	12.93	242,902.98
ASTRAZENECA PLC	25,683	49.42	1,269,253.86
GLAXOSMITHKLINE PLC	100,071	13.02	1,302,924.42
SHIRE PLC	17,695	38.80	686,654.47
BARCLAYS PLC	338,381	2.02	684,037.19
HSBC HOLDINGS PLC	406,321	7.61	3,094,540.73
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,450,176	0.67	974,663.28
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	72,080	2.75	198,796.64
STANDARD CHARTERED PLC	65,660	7.68	504,531.44
3I GROUP PLC	20,499	9.01	184,798.48
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,720	17.56	100,443.20
INVESTEC PLC	13,185	5.27	69,550.87
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	6,577	37.38	245,848.26
SCHRODERS PLC	1,921	34.89	67,023.69
ST JAMES'S PLACE PLC	11,000	12.02	132,220.00
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	53,130	4.28	227,608.92
ADMIRAL GROUP PLC	3,295	19.22	63,329.90
AVIVA PLC	84,235	5.00	421,175.00
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	29,333	3.73	109,588.08
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	115,841	2.70	313,581.58
OLD MUTUAL PLC	104,159	2.22	231,545.45
PRUDENTIAL PLC	52,292	18.87	986,750.04

	RSA INSURANCE GROUP PLC	21,498	6.17	132,750.15	
	AUTO TRADER GROUP PLC	17,950	3.52	63,201.95	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	8,700	24.99	217,413.00	
	SAGE GROUP PLC/THE	20,480	7.95	162,918.40	
	WORLDPAY GROUP PLC	42,180	4.28	180,783.48	
	BT GROUP PLC	173,382	2.74	475,240.06	
	VODAFONE GROUP PLC	541,898	2.35	1,278,337.38	
	CENTRICA PLC	111,175	1.38	154,310.90	
	NATIONAL GRID PLC	68,318	8.66	592,043.78	
	SEVERN TRENT PLC	4,423	21.42	94,740.66	
	SSE PLC	19,737	13.04	257,370.48	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	13,325	8.18	108,998.50	
英債券小計		7,742,224		39,278,838.25	(5,953,100,725)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	4,430	27.51	121,869.30	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	170	658.00	111,860.00	
	GIVAUDAN-REG	183	2,242.00	410,286.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	9,359	54.40	509,129.60	
	SIKA AG-BR	47	7,815.00	367,305.00	
	ABB LTD-REG	40,195	26.27	1,055,922.65	
	GEBERIT AG-REG	805	430.50	346,552.50	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	360	219.60	79,056.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	970	225.40	218,638.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	3,557	74.60	265,352.20	
	SGS SA-REG	113	2,530.00	285,890.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,150	171.30	196,995.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	10,429	89.00	928,181.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	680	395.80	269,144.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	930	74.35	69,145.50	
	DUFREY AG-REG	690	144.00	99,360.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	45	1,987.00	89,415.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	18	5,910.00	106,380.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	69,660.00	139,320.00	
	NESTLE SA-REG	63,183	83.60	5,282,098.80	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,160	153.60	178,176.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	170	691.00	117,470.00	
	LONZA GROUP AG-REG	1,608	261.70	420,813.60	
	NOVARTIS AG-REG	45,243	82.20	3,718,974.60	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	14,288	246.30	3,519,134.40	
	VIFOR PHARMA AG	1,070	122.40	130,968.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	50,088	17.82	892,568.16	
	JULIUS BAER GROUP LTD	4,600	59.30	272,780.00	

	PARGESA HOLDING SA-BR	655	84.00	55,020.00
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	370	666.50	246,605.00
	UBS GROUP AG-REG	74,892	18.11	1,356,294.12
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,080	151.70	163,836.00
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	640	344.30	220,352.00
	SWISS RE AG	6,569	91.80	603,034.20
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,171	298.00	944,958.00
	SWISS PRIME SITE-REG	1,460	88.15	128,699.00
	SWISSCOM AG-REG	504	519.50	261,828.00
スイスフラン小計		344,884		24,183,411.63 (2,770,935,304)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	4,320	193.20	834,624.00
	BOLIDEN AB	5,920	277.80	1,644,576.00
	ALFA LAVAL AB	5,430	197.30	1,071,339.00
	ASSA ABLOY AB-B	20,910	173.10	3,619,521.00
	ATLAS COPCO AB-A SHS	13,705	361.90	4,959,839.50
	ATLAS COPCO AB-B SHS	7,670	322.10	2,470,507.00
	SANDVIK AB	21,690	145.50	3,155,895.00
	SKANSKA AB-B SHS	7,170	171.00	1,226,070.00
	SKF AB-B SHARES-B	7,829	185.20	1,449,930.80
	VOLVO AB-B SHS-B	32,660	160.00	5,225,600.00
	SECURITAS AB-B SHS	5,849	145.40	850,444.60
	ELECTROLUX AB - B	5,455	269.80	1,471,759.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	8,480	80.60	683,488.00
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	18,788	170.70	3,207,111.60
	ICA GRUPPEN AB	1,450	296.40	429,780.00
	SWEDISH MATCH AB	4,040	324.00	1,308,960.00
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	13,015	237.00	3,084,555.00
	GETINGE AB-B SHS	4,450	119.30	530,885.00
	NORDEA BANK AB	62,628	101.60	6,363,004.80
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	31,870	98.10	3,126,447.00
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	31,220	115.10	3,593,422.00
	SWEDBANK AB - A SHARES	17,930	202.10	3,623,653.00
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,700	203.90	550,530.00
	INVESTOR AB-B SHS	9,135	379.20	3,463,992.00
	KINNEVIK AB - B	4,235	277.90	1,176,906.50
	LUNDBERGS AB-B SHS	700	615.50	430,850.00
	ERICSSON LM-B SHS	64,235	55.40	3,558,619.00
	HEXAGON AB-B SHS	5,260	415.40	2,185,004.00
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,370	556.50	762,405.00
	TELE2 AB-B SHS	6,255	103.80	649,269.00
	TELIA CO AB	53,480	37.10	1,984,108.00

スウェーデンクローナ小計		479,849		68,693,095.80 (922,548,276)
ノルウェークローネ	STATOIL ASA	23,294	175.00	4,076,450.00
	NORSK HYDRO A S	26,460	61.20	1,619,352.00
	YARA INTERNATIONAL ASA	3,780	377.90	1,428,462.00
	SCHIBSTED ASA-B SHS	1,430	213.50	305,305.00
	MARINE HARVEST	7,720	135.40	1,045,288.00
	ORKLA ASA	17,310	86.35	1,494,718.50
	DNB ASA	19,945	151.30	3,017,678.50
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,200	153.20	643,440.00
	TELENOR ASA	14,895	178.50	2,658,757.50
ノルウェークローネ小計		119,034		16,289,451.50 (220,884,962)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,890	582.50	1,100,925.00
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	4,865	352.80	1,716,372.00
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	4,440	432.90	1,922,076.00
	ISS A/S	3,100	240.50	745,550.00
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	80	10,050.00	804,000.00
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	138	10,530.00	1,453,140.00
	DSV A/S	3,870	485.80	1,880,046.00
	PANDORA A/S	2,320	664.00	1,540,480.00
	CARLSBERG AS-B	2,180	746.50	1,627,370.00
	COLOPLAST-B	2,545	502.50	1,278,862.50
	WILLIAM DEMANT HOLDING	3,000	173.70	521,100.00
	GENMAB A/S	1,180	1,046.00	1,234,280.00
	H LUNDBECK A/S	1,090	299.60	326,564.00
	NOVO NORDISK A/S-B	37,205	335.80	12,493,439.00
	DANSKE BANK A/S	15,655	245.00	3,835,475.00
	TRYG A/S	2,575	154.40	397,580.00
	TDC A/S	14,545	38.35	557,800.75
	ORSTED A/S	2,990	339.80	1,016,002.00
デンマーククローネ小計		103,668		34,451,062.25 (620,808,141)
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	5,335	33.95	181,123.25
	OIL SEARCH LTD	28,830	7.66	220,837.80
	ORIGIN ENERGY LTD	35,950	9.41	338,289.50
	SANTOS LTD	33,135	5.31	175,946.85
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	15,438	32.73	505,285.74
	ALUMINA LTD	46,512	2.41	112,093.92
	AMCOR LIMITED	23,840	15.48	369,043.20
	BHP BILLITON LTD	65,796	29.10	1,914,663.60
	BLUESCOPE STEEL LTD	9,840	15.09	148,485.60
	BORAL LTD	17,115	7.91	135,379.65

FORTESCUE METALS GROUP LTD	29,665	4.90	145,358.50
INCITEC PIVOT LTD	31,550	3.92	123,676.00
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	8,505	22.40	190,512.00
NEWCREST MINING LTD	15,439	22.41	345,987.99
ORICA LIMITED	6,935	18.24	126,494.40
RIO TINTO LTD	8,718	74.28	647,573.04
SOUTH32 LTD	106,097	3.36	356,485.92
CIMIC GROUP LTD	1,867	52.12	97,308.04
BRAMBLES LTD	32,868	10.18	334,596.24
SEEK LTD	8,040	18.98	152,599.20
AURIZON HOLDINGS LTD	46,150	4.95	228,442.50
SYDNEY AIRPORT	24,156	7.28	175,855.68
TRANSURBAN GROUP	43,195	12.57	542,961.15
TRANSURBAN GROUP-RTS	3,502	0.88	3,099.27
ARISTOCRAT LEISURE LTD	10,890	23.83	259,508.70
CROWN RESORTS LTD	6,745	12.93	87,212.85
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,180	46.60	54,988.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	970	44.65	43,310.50
TABCORP HOLDINGS LTD	39,384	5.59	220,156.56
WESFARMERS LTD	23,665	44.22	1,046,466.30
WOOLWORTHS GROUP LTD	26,772	27.35	732,214.20
COCA-COLA AMATIL LTD	10,650	8.52	90,738.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	15,946	16.14	257,368.44
COCHLEAR LTD	1,277	174.14	222,376.78
HEALTHSCOPE LTD	33,080	2.07	68,475.60
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,935	69.59	204,246.65
SONIC HEALTHCARE LTD	8,110	23.01	186,611.10
CSL LTD	9,502	141.20	1,341,682.40
AUST AND NZ BANKING GROUP	59,389	28.87	1,714,560.43
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	8,120	12.67	102,880.40
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	10,478	11.51	120,601.78
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	35,097	80.39	2,821,447.83
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	54,133	29.57	1,600,712.81
WESTPAC BANKING CORP	67,991	31.28	2,126,758.48
AMP LTD	62,647	5.25	328,896.75
ASX LTD	3,445	55.04	189,612.80
CHALLENGER LTD	9,950	14.17	140,991.50
MACQUARIE GROUP LTD	6,494	99.93	648,945.42
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	50,298	7.25	364,660.50
MEDIBANK PRIVATE LTD	62,000	3.30	204,600.00
QBE INSURANCE GROUP LTD	24,040	10.74	258,189.60
SUNCORP GROUP LTD	27,180	13.95	379,161.00



	COMPUTERSHARE LTD	11,490	16.80	193,032.00	
	REA GROUP LTD	1,150	77.23	88,814.50	
	TELSTRA CORPORATION LTD	72,054	3.66	263,717.64	
	AGL ENERGY LTD	12,851	24.39	313,435.89	
	AUSNET SERVICES	40,750	1.80	73,350.00	
豪ドル小計		1,459,141		24,321,824.45 (2,125,484,238)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	15,180	7.68	116,582.40	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	21,455	6.57	141,066.62	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	10,700	14.14	151,298.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	8,500	10.52	89,420.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	35,157	3.62	127,268.34	
	MERCURY NZ LTD	13,500	3.43	46,305.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	28,000	2.93	82,040.00	
ニュージーランドドル小計		132,492		753,980.36 (60,024,376)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	56,708	96.60	5,477,992.80	
	NWS HOLDINGS LTD	28,500	14.02	399,570.00	
	MTR CORP	34,000	45.60	1,550,400.00	
	MINTH GROUP LTD	14,000	45.90	642,600.00	
	LI & FUNG LTD	138,000	4.28	590,640.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	29,000	49.35	1,431,150.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	14,500	30.45	441,525.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	50,000	61.95	3,097,500.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	16,800	23.05	387,240.00	
	SANDS CHINA LTD	49,800	39.70	1,977,060.00	
	SJM HOLDINGS LTD	48,000	6.99	335,520.00	
	WYNN MACAU LTD	35,800	24.20	866,360.00	
	WH GROUP LTD	153,500	8.88	1,363,080.00	
	BANK OF EAST ASIA	21,640	33.45	723,858.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	77,000	39.00	3,003,000.00	
	HANG SENG BANK LTD	14,600	191.80	2,800,280.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	23,600	236.00	5,569,600.00	
	KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	74,000	7.69	569,060.00	
	AIA GROUP LTD	246,390	63.95	15,756,640.50	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	55,708	68.65	3,824,354.20	
	HANG LUNG GROUP LTD	17,000	28.70	487,900.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	46,000	18.70	860,200.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	25,126	50.75	1,275,144.50	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	15,000	41.00	615,000.00	
KERRY PROPERTIES LTD	11,450	34.50	395,025.00		
NEW WORLD DEVELOPMENT	134,666	11.30	1,521,725.80		

	SINO LAND CO	63,050	13.54	853,697.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	30,480	127.00	3,870,960.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	10,517	72.30	760,379.10	
	SWIRE PROPERTIES LTD	23,200	25.40	589,280.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	24,800	26.70	662,160.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	24,800	51.80	1,284,640.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	19,600	53.70	1,052,520.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	54,000	9.88	533,520.00	
	PCCW LTD	80,000	4.56	364,800.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	13,000	66.35	862,550.00	
	CLP HOLDINGS LTD	34,500	79.90	2,756,550.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	56,000	7.10	397,600.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	171,517	15.22	2,610,488.74	
	POWER ASSETS HOLDINGS	28,500	65.65	1,871,025.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	4,200	109.20	458,640.00	
香港ドル小計		2,068,952		74,891,235.64 (1,083,676,179)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	29,060	7.47	217,078.20	
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	21,000	3.04	63,840.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,000	3.21	105,930.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,000	1.93	88,780.00	
	SATS LTD	13,000	5.22	67,860.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	12,800	10.65	136,320.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	114,500	1.31	149,995.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	32,550	2.66	86,583.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,000	40.43	80,860.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	130,000	0.37	48,750.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	29,660	3.09	91,649.40	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	36,715	24.72	907,594.80	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	61,540	12.29	756,326.60	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	26,300	25.73	676,699.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	12,300	7.43	91,389.00	
	CAPITALAND LTD	51,800	3.51	181,818.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	10,000	12.23	122,300.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	60,000	3.36	201,600.00	
	UOL GROUP LTD	12,250	8.63	105,717.50	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	172,180	3.59	618,126.20	
シンガポールドル小計		906,655		4,799,216.70 (404,477,983)	
イスラエルシュケル	FRUTAROM	810	315.90	255,879.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	9,770	14.11	137,854.70	
	ELBIT SYSTEMS LTD	500	472.30	236,150.00	

	BANK HAPOALIM BM	21,225	25.15	533,808.75	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	24,465	20.83	509,605.95	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	2,900	63.96	185,484.00	
	NICE LTD	1,385	315.00	436,275.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	48,790	5.31	259,074.90	
イスラエルシュケル小計		109,845		2,554,132.30 (83,085,923)	
合 計		24,592,695		82,346,012,968 (82,346,012,968)	

(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	44,533.19		
	出資金小計		2,027.00	44,533.19 (5,042,493)		
	投資証券		AGNC INVESTMENT CORP	7,010	141,742.20	
			ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	1,490	192,895.40	
			AMERICAN TOWER CORP	8,589	1,208,128.74	
			ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	20,020	241,241.00	
			AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,855	508,532.60	
			BOSTON PROPERTIES INC	3,147	400,738.98	
			BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	6,100	110,776.00	
			CAMDEN PROPERTY TRUST	1,940	176,365.40	
			COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	10,000	117,500.00	
			CROWN CASTLE INTL CORP	8,010	869,485.50	
			DIGITAL REALTY TRUST INC	4,135	458,902.30	
			DUKE REALTY CORPORATION	6,875	184,662.50	
			EQUINIX INC	1,628	727,064.80	
			EQUITY RESIDENTIAL-REIT	7,530	480,414.00	
			ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,400	335,146.00	
			EXTRA SPACE STORAGE INC	2,450	210,994.00	
			FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,415	184,501.85	
			GGP INC	12,545	293,553.00	
			HCP INC	9,285	238,345.95	
			HOST HOTELS & RESORTS INC	15,169	305,503.66	
			INVITATION HOMES INC	6,200	144,460.00	
	IRON MOUNTAIN INC	5,515	207,694.90			
	KIMCO REALTY CORPORATION	8,795	158,485.90			
	LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	133,641.09			
	MACERICH CO/THE	2,460	160,392.00			

		MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,270	226,432.50
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	2,990	126,596.60
		PROLOGIS INC	10,932	697,789.56
		PUBLIC STORAGE	3,039	625,942.83
		REALTY INCOME CORP	5,400	301,590.00
		REGENCY CENTERS CORP	3,175	216,185.75
		SBA COMMUNICATIONS CORP	2,580	413,367.60
		SIMON PROPERTY GROUP INC	6,374	1,064,904.18
		SL GREEN REALTY CORP	2,040	204,081.60
		UDR INC	5,820	222,091.20
		VENTAS INC	7,285	438,119.90
		VEREIT INC	19,554	152,912.28
		VORNADO REALTY TRUST	3,491	269,505.20
		WELLTOWER INC	7,380	467,892.00
		WEYERHAEUSER CO	15,508	541,849.52
	投資証券小計		255,514	14,160,428.49 (1,603,385,317)
米ドル小計			257,541	14,204,961.68 (1,608,427,810)
加ドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2,340	49,303.80
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,380	84,466.20
加ドル小計			5,720	133,770.00 (11,889,477)
ユーロ	投資証券	FONCIERE DES REGIONS	595	55,834.80
		GECINA SA	970	147,052.00
		ICADE	685	55,457.60
		KLEPIERRE	4,732	171,109.12
		UNIBAIL-RODAMCO SE-NA	2,070	436,045.50
ユーロ小計			9,052	865,499.02 (116,046,108)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	21,701	146,264.74
		HAMMERSON PLC	15,295	81,675.30
		LAND SECURITIES GROUP PLC	15,214	150,162.18
		SEGRO PLC	18,063	104,223.51
英ポンド小計			70,273	482,325.73 (73,101,287)
豪ドル	投資証券	APA GROUP	21,286	183,698.18
		DEXUS	18,487	183,760.78
		GOODMAN GROUP	39,332	338,255.20
		GPT GROUP	33,695	176,561.80
		LENDLEASE GROUP	12,197	199,664.89
		MIRVAC GROUP	86,525	207,660.00
		SCENTRE GROUP	116,381	486,472.58

		STOCKLAND	55,310	252,766.70	
		VICINITY CENTRES	72,862	202,556.36	
		WESTFIELD CORP	41,745	392,403.00	
豪ドル小計			497,820	2,623,799.49 (229,293,837)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	48,000	3,427,200.00	
香港ドル小計			48,000	3,427,200.00 (49,591,584)	
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	51,900	139,092.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	46,640	89,082.40	
		CAPITALAND MALL TRUST	48,100	101,972.00	
		SUNTEC REIT	45,000	95,400.00	
シンガポールドル小計			191,640	425,546.40 (35,865,050)	
合計				2,124,215,153 (2,124,215,153)	

(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 600銘柄	97.1%			63.8%
	投資証券 40銘柄			2.9%	1.9%
加ドル	株式 87銘柄	99.6%			3.8%
	投資証券 2銘柄			0.4%	0.0%
ユーロ	株式 240銘柄	99.0%			13.0%
	投資証券 5銘柄			1.0%	0.1%
英ポンド	株式 100銘柄	98.8%			7.0%
	投資証券 4銘柄			1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 37銘柄	100.0%			3.3%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	100.0%			1.1%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.0%			0.7%
豪ドル	株式 57銘柄	90.3%			2.5%
	投資証券 10銘柄			9.7%	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 41銘柄	95.6%			1.3%
	投資証券 1銘柄			4.4%	0.1%
シンガポールドル	株式 20銘柄	91.9%			0.5%

	投資証券	4銘柄			8.1%	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29年 6月26日現在	平成29年12月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	148,640,474	277,464,637
コール・ローン	80,417,431	137,230,848
株式	11,494,943,065	14,886,171,808
投資信託受益証券	45,719,388	49,896,384
投資証券	59,485,589	69,637,993
派生商品評価勘定	2,711,894	20,698,314
未収入金	87,333	5,201,249
未収配当金	33,994,969	10,426,585
差入委託証拠金	374,496,482	366,040,330
流動資産合計	12,240,496,625	15,822,768,148
資産合計	12,240,496,625	15,822,768,148
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	484,068	-
未払金	-	31,647,993
未払解約金	4,209,200	3,760,000
未払利息	126	193
流動負債合計	4,693,394	35,408,186
負債合計	4,693,394	35,408,186
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	7,321,484,408	8,154,304,705
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,914,318,823	7,633,055,257
元本等合計	12,235,803,231	15,787,359,962
純資産合計	12,235,803,231	15,787,359,962
負債純資産合計	12,240,496,625	15,822,768,148

## 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	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>(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29年 6月26日現在	平成29年12月25日現在
1.	期首	平成28年12月27日	平成29年 6月27日
	期首元本額	7,049,884,290円	7,321,484,408円
	期首からの追加設定元本額	692,270,696円	1,220,338,963円
	期首からの一部解約元本額	420,670,578円	387,518,666円
	元本の内訳		
	日興五大陸株式ファンド	1,954,757,370円	1,794,783,177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	27,288,287円	24,477,692円
	インデックスファンド海外新興国（エマージング）株式	5,337,861,907円	6,335,043,836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）	1,576,844円	- 円
	計	7,321,484,408円	8,154,304,705円
2.	受益権の総数	7,321,484,408口	8,154,304,705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12月27日 至 平成29年 6月26日	自 平成29年 6月27日 至 平成29年12月25日
--	--------------------------------	--------------------------------

金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成29年 6月26日現在	平成29年12月25日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成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

（平成29年12月25日現在）

## 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,557,687,289
投資信託受益証券	3,568,312
投資証券	480,625
合計	1,561,736,226

(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

（平成29年12月25日現在）

（単位：円）

--	--	--	--	--

区分	種類	契約額等	時価		
			うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	766,418,202	-	787,112,683	20,694,481
合計		766,418,202	-	787,112,683	20,694,481

## (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29年 6月26日現在)

該当事項はありません。

(平成29年12月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	時価		
			うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,044,154	-	2,047,987	3,833
	マレーシアリングット	2,044,154	-	2,047,987	3,833
合計		2,044,154	-	2,047,987	3,833

## (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29年 6月26日現在		平成29年12月25日現在	
1口当たり純資産額	1.6712円	1口当たり純資産額	1.9361円
(1万口当たり純資産額)	(16,712円)	(1万口当たり純資産額)	(19,361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	3,440	13.83	47,575.20	
	GAZPROM PAO-SPON ADR	135,450	4.46	604,242.45	
	LUKOIL PJSC-SPON-ADR	10,465	56.92	595,667.80	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	2,326	119.90	278,887.40	
	PETROLEO BRASILEIRO S.A.-ADR	9,500	9.99	94,905.00	
	PETROLEO BRASILEIRO-SPON ADR	1,250	9.47	11,837.50	
	ROSNEFT PJSC-REG S GDR	29,940	4.97	148,951.50	
	SURGUTNEFTGAS-SP ADR	36,800	4.79	176,419.20	
	TATNEFT-SPONSORED-ADR	6,119	48.98	299,708.62	
	ULTRAPAR PARTICPAC-SPON ADR	380	22.20	8,436.00	
	BRASKEM SA-SPON ADR	1,780	26.25	46,725.00	
	CEMEX SAB-SPONS ADR PART CER	2,704	7.45	20,144.80	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	4,650	13.70	63,705.00	
	CIA SIDERURGICA NAACL-SP ADR	10,170	2.38	24,204.60	
	GERDAU SA -SPON ADR	3,700	3.71	13,727.00	
	MAGNITOGORSK IRON & STEEL WORKS-GDR	4,000	9.63	38,520.00	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	16,724	18.48	309,059.52	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	3,490	24.95	87,075.50	
PHOSAGRO PJSC REG S-GDR	3,700	15.30	56,610.00		

POLYUS PJSC-REG S-GDR	1,260	37.95	47,817.00
QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	1,100	59.64	65,604.00
SEVERSTAL - GDR REG S	8,270	14.98	123,884.60
SOUTHERN COPPER CORP(US)	2,080	46.21	96,116.80
VALE SA-SP ADR	20,000	11.92	238,400.00
DP WORLD LTD	4,470	24.05	107,503.50
GRUPO AEROPORTUARIO PAC-ADR	110	101.46	11,160.60
LATAM AIRLINES GROUP-SP -ADR	2,280	13.72	31,281.60
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP-ADR	3,350	91.75	307,362.50
TAL EDUCATION GROUP- ADR	7,000	29.40	205,800.00
YUM CHINA HOLDINGS INC	9,470	40.87	387,038.90
GRUPO TELEVISA SA-SPONS ADR	2,440	18.92	46,164.80
CTIP.COM INTERNATIONAL-ADR	9,650	45.15	435,697.50
JD.COM INC-ADR	16,310	42.19	688,118.90
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	10,200	12.21	124,542.00
CIA BRASILEIRA-SP ADR PREF	2,380	22.14	52,693.20
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	9,070	26.55	240,808.50
AMBEV SA-ADR	1,900	6.27	11,913.00
BRF SA-ADR	2,580	10.86	28,018.80
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	1,780	29.15	51,887.00
EMBOTELLADORA ANDINA-ADR B	200	29.23	5,846.00
FOMENTO ECONOMICO MEX-SP ADR	120	91.04	10,924.80
BANCO BRADESCO-ADR	1,300	10.17	13,221.00
BANCO DE CHILE-ADR	110	93.64	10,300.40
BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	2,233	31.08	69,401.64
BANCOLOMBIA S.A. -SPONS ADR	2,760	39.63	109,378.80
CREDICORP LTD	1,690	206.84	349,559.60
GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORE-ADR	1,850	8.69	16,076.50
GRUPO FIN SANTANDER B-ADR	2,600	7.14	18,564.00
ITAU CORPBANCA-ADR	800	13.13	10,504.00
ITAU UNIBANCO HLDNG-PREF ADR	9,900	12.84	127,116.00
SBERBANK-SPONSORED ADR	69,480	16.58	1,152,325.80
VTB BANK OJSC-GDR-REG S	87,030	1.77	154,217.16
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	23,400	1.40	32,900.40
58.COM INC-ADR	2,320	70.38	163,281.60
ALIBABA GROUP HOLDING-SP-ADR	28,540	176.29	5,031,316.60
AUTOHOME INC-ADR	1,300	64.97	84,461.00
BAIDU INC - SPON ADR	6,780	239.05	1,620,759.00
MOMO INC-SPON-ADR	2,550	25.42	64,821.00
NETEASE INC-ADR	1,965	365.63	718,462.95
SINA CORP	1,430	104.26	149,091.80
WEIBO CORP-SPON-ADR	1,094	106.82	116,861.08

	YY INC-ADR	1,030	114.60	118,038.00	
	AMERICA MOVIL-SPN CL L-ADR	600	16.96	10,176.00	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	12,562	10.42	130,896.04	
	TELEF BRASIL-ADR	4,474	14.93	66,796.82	
	CIA SANEAMIENTO BASICO DE-ADR	6,180	10.21	63,097.80	
	ENEL AMERICAS SA-SPONS ADR	940	10.67	10,029.80	
	ENEL CHILE SA-ADR	1,500	5.56	8,340.00	
	ENEL GENERACION CHILE-SP ADR	850	26.30	22,355.00	
	RUSHYDRO PJSC-ADR	61,000	1.20	73,505.00	
米ドル小計		740,876		16,760,840.88 (1,897,830,012)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	331,903	14.71	4,882,293.13	
	GRUPO MEXICO SA-SER B	92,078	62.27	5,733,697.06	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	3,700	389.06	1,439,522.00	
	MEXICHEM SAB DE CV-*	26,565	48.11	1,278,042.15	
	ALFA S.A.B.-A	73,000	21.23	1,549,790.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	13,700	62.14	851,318.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	7,900	199.94	1,579,526.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	5,000	353.69	1,768,450.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	5,900	194.36	1,146,724.00	
	GRUPO TELEVISA SAB	49,700	74.56	3,705,632.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	4,400	122.18	537,592.00	
	WALMART DE MEXICO -SER V	131,400	46.01	6,045,714.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	10,900	132.00	1,438,800.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	12,400	133.87	1,659,988.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	46,600	179.48	8,363,768.00	
	GRUMA S.A.B.-B	4,800	245.12	1,176,576.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	40,800	42.28	1,725,024.00	
	GRUPO LALA SAB DE CV	13,000	27.62	359,060.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	41,670	33.29	1,387,194.30	
	GRUPO FIN SANTANDER-B	32,000	28.07	898,240.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	60,800	104.56	6,357,248.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	59,200	31.37	1,857,104.00	
	ENTERA SAB DE CV	30,000	16.14	484,200.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	818,800	16.78	13,739,464.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	13,300	97.03	1,290,499.00	
メキシコペソ小計		1,929,516		71,255,465.64 (409,006,372)	
ブラジルリアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	3,900	41.00	159,900.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	53,360	16.59	885,242.40	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	94,500	15.75	1,488,375.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	8,640	73.88	638,323.20	

BRASKEM SA-PREF A	1,000	43.21	43,210.00
CIA SIDERURGICA NACIONAL	7,800	8.05	62,790.00
FIBRIA CELULOSE SA	5,929	48.40	286,963.60
GERDAU SA-PREF	22,000	12.44	273,680.00
KLABIN SA - UNIT	14,900	17.70	263,730.00
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	11,000	18.64	205,040.00
VALE SA	58,639	39.79	2,333,245.81
EMBRAER SA	16,000	19.91	318,560.00
WEG SA	14,220	24.27	345,119.40
CCR SA	30,600	15.90	486,540.00
LOCALIZA RENT A CAR	12,261	21.40	262,385.40
RUMO SA	25,800	12.32	317,856.00
KROTON EDUCACIONAL SA	35,448	17.81	631,328.88
LOJAS AMERICANAS SA-PRF	17,092	15.84	270,737.28
LOJAS RENNER S.A.	17,000	33.70	572,900.00
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	9,300	14.74	137,082.00
CIA BRASILEIRA DE DIS-PRF	1,450	73.91	107,169.50
RAIA DROGASIL SA	5,700	89.98	512,886.00
AMBEV SA	114,200	21.03	2,401,626.00
BRF SA	8,400	36.36	305,424.00
JBS SA	21,600	9.18	198,288.00
M DIAS BRANCO SA	2,850	48.64	138,624.00
NATURA COSMETICOS SA	4,300	31.92	137,256.00
ODONTOPREV S.A.	6,700	15.30	102,510.00
QUALICORP SA	5,800	28.86	167,388.00
HYPERMARCAS SA	9,000	36.00	324,000.00
BANCO BRADESCO S.A.	23,263	31.60	735,110.80
BANCO BRADESCO SA-PRF	73,136	34.07	2,491,743.52
BANCO DO BRASIL S.A.	20,600	31.30	644,780.00
BANCO SAN. BRASIL-UNIT	9,700	31.80	308,460.00
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	70,436	42.53	2,995,643.08
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PRF	97,185	10.96	1,065,147.60
BM&FBOVESPA SA	51,083	22.29	1,138,640.07
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	16,800	28.21	473,928.00
PORTO SEGURO SA	3,200	35.79	114,528.00
SUL AMERICA SA - UNITS	6,362	18.65	118,651.30
BR MALLS PARTICIPACOES SA	20,397	12.32	251,291.04
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	2,000	70.40	140,800.00
CIELO SA	30,168	23.12	697,484.16
TELEFONICA BRASIL S.A. -PREF	6,830	49.36	337,128.80
TIM PARTICIPACOES SA	19,905	12.70	252,793.50
CENTRAIS ELETRICAS BRAS	5,900	18.78	110,802.00

	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	6,600	22.29	147,114.00	
	CIA ENERGETICA DE MIN GE-RCT	3,082	6.57	20,248.74	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	19,399	6.59	127,839.41	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	2,160	33.84	73,094.40	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	7,300	13.50	98,550.00	
	ENGIE BRASIL SA	3,700	35.31	130,647.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	4,900	63.96	313,404.00	
	TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	4,000	20.79	83,160.00	
ブラジルリアル小計		1,147,495		27,249,169.89	(925,109,317)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	10,890	9,777.80	106,480,242.00	
	EMPRESAS CMPC SA	28,000	2,094.10	58,634,800.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B-PRF	1,400	37,177.00	52,047,800.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	5,300	8,647.40	45,831,220.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	18,500	6,137.00	113,534,500.00	
	CENCOSUD SA	34,050	1,806.00	61,494,300.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PRF B	5,600	3,014.40	16,880,640.00	
	BANCO DE CHILE	599,174	98.65	59,108,515.10	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	970	41,817.00	40,562,490.00	
	BANCO SANTANDER CHILE SA	747,000	48.74	36,408,780.00	
	ITAU CORPBANCA	2,600,000	5.46	14,219,400.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	3,440	6,900.00	23,736,000.00	
	AES GENER SA	80,000	201.57	16,125,600.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	56,000	402.51	22,540,560.00	
	COLBUN SA	208,000	140.00	29,120,000.00	
	ENEL AMERICAS SA	656,060	133.79	87,774,267.40	
	ENEL CHILE SA	419,500	71.09	29,822,255.00	
ENEL GENERACION CHILE SA	57,700	546.99	31,561,323.00		
チリペソ小計		5,531,584		845,882,692.50	(153,950,650)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	50,000	2,025.00	101,250,000.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	11,190	11,400.00	127,566,000.00	
	GRUPO ARGOS SA	5,760	20,780.00	119,692,800.00	
	BANCOLOMBIA SA	4,400	29,600.00	130,240,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PRF	2,000	29,600.00	59,200,000.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES-PRF	47,000	1,295.00	60,865,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	6,600	40,680.00	268,488,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF-PRF	1,200	38,780.00	46,536,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	13,000	14,280.00	185,640,000.00	
コロンビアペソ小計		141,150		1,099,477,800.00	(42,109,999)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	3,070	119.50	366,865.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	35,017	9.64	337,563.88	

	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	15,000	7.45	111,750.00	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	4,300	32.14	138,202.00	
	KOC HOLDING AS	18,924	17.40	329,277.60	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	21,170	4.48	94,841.60	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	3,200	21.48	68,736.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	14,550	15.15	220,432.50	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,700	59.30	100,810.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	3,300	31.28	103,224.00	
	ARCELIK A.S.	6,500	20.48	133,120.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	5,100	76.25	388,875.00	
	ANADOLU EFES BIRACILIK	5,581	24.50	136,734.50	
	COCA-COLA ICECEK URETIM AS	2,000	33.66	67,320.00	
	ULKER BISKUVI SANAYI	2,700	19.61	52,947.00	
	AKBANK T.A.S.	54,059	9.35	505,451.65	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	58,540	10.11	591,839.40	
	TURKIYE HALK BANKASI	14,660	10.24	150,118.40	
	TURKIYE IS BANKASI-C	39,904	6.71	267,755.84	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	19,682	6.34	124,783.88	
	YAPI VE KREDI BANKASI	18,033	4.21	75,918.93	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	23,953	10.78	258,213.34	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	12,000	6.31	75,720.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	27,556	15.01	413,615.56	
	トルコリラ小計	410,499		5,114,116.08	(152,196,094)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,950	906.10	1,766,895.00	
	MONETA MONEY BANK AS	12,500	82.10	1,026,250.00	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	1,300	271.50	352,950.00	
	CEZ AS	3,930	500.00	1,965,000.00	
	チェココルナ小計	19,680		5,111,095.00	(26,679,915)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	9,040	2,975.00	26,894,000.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	3,250	6,806.00	22,119,500.00	
	OTP BANK PLC	5,885	10,550.00	62,086,750.00	
	ハンガリーフォリント小計	18,175		111,100,250.00	(47,884,207)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	3,000	58.33	174,990.00	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	7,330	111.15	814,729.50	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	37,985	6.11	232,088.35	
	GRUPA AZOTY SA	1,400	67.76	94,864.00	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	900	95.00	85,500.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	3,710	109.25	405,317.50	
	CCC SA	650	278.10	180,765.00	
	LPP SA	33	8,949.45	295,331.85	



	CYFROWY POLSAT SA	5,600	24.35	136,360.00	
	DINO POLSKA SA	1,120	74.57	83,518.40	
	ALIOR BANK SA	2,050	78.70	161,335.00	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	850	77.92	66,232.00	
	BANK MILLENNIUM SA	13,000	8.65	112,450.00	
	BANK PEKAO SA	3,892	126.85	493,700.20	
	BANK ZACHODNI WBK SA	900	394.00	354,600.00	
	MBANK	410	477.00	195,570.00	
	PKO BANK POLSKI SA	23,245	43.25	1,005,346.25	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	15,040	41.25	620,400.00	
	CD PROJEKT SA	1,580	100.15	158,237.00	
	ORANGE POLSKA SA	18,105	5.95	107,724.75	
	PLAY COMMUNICATIONS SA	2,630	33.50	88,105.00	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	20,400	11.90	242,760.00	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	28,500	3.01	85,785.00	
ポーランドズロチ小計		192,330		6,195,709.80 (198,386,627)	
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	46,000	7.40	340,400.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	623,300	5.76	3,590,208.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	84,000	19.90	1,671,600.00	
	CNOOC LTD	441,000	11.08	4,886,280.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	80,000	8.18	654,400.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	529,000	5.49	2,904,210.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	50,000	8.61	430,500.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	89,000	5.49	488,610.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	31,000	35.85	1,111,350.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	87,000	4.75	413,250.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	74,000	6.63	490,620.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	31,000	11.76	364,560.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	37,000	9.65	357,050.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	42,000	12.70	533,400.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	88,500	4.49	397,365.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD	147,750	2.77	409,267.50	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	52,000	3.97	206,440.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	12,000	45.95	551,400.00	
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	112,000	8.75	980,000.00	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	39,500	18.14	716,530.00	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	46,000	8.98	413,080.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	100,000	5.74	574,000.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	52,000	10.76	559,520.00	
	CITIC LTD	142,000	11.08	1,573,360.00	
	CRRC CORP LTD- H	109,000	7.90	861,100.00	

FOSUN INTERNATIONAL LTD	62,500	17.34	1,083,750.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	16,000	24.00	384,000.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	70,000	3.24	226,800.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	13,000	21.80	283,400.00
WEICHAJ POWER CO LTD-H	48,400	8.28	400,752.00
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	12,900	50.65	653,385.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	55,000	11.02	606,100.00
AIR CHINA LTD-H	58,000	9.32	540,560.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	40,000	11.64	465,600.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	31,000	19.84	615,040.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	38,000	8.18	310,840.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	42,000	7.97	334,740.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	24,000	11.66	279,840.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	43,000	8.25	354,750.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	76,000	19.70	1,497,200.00
BYD CO LTD-H	16,000	64.55	1,032,800.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	68,000	9.31	633,080.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	12,800	32.10	410,880.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	120,000	25.65	3,078,000.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	75,000	8.73	654,750.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	52,318	18.00	941,724.00
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	21,000	18.26	383,460.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	25,000	33.35	833,750.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	36,000	21.60	777,600.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	18,000	72.55	1,305,900.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	300,000	0.99	297,000.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	291,160	0.94	273,690.40
SUN ART RETAIL GROUP	59,000	8.28	488,520.00
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	90,000	0.42	37,800.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	66,000	23.50	1,551,000.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	41,000	28.65	1,174,650.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	50,000	15.52	776,000.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	8,000	39.65	317,200.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	132,000	6.55	864,600.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	17,500	85.10	1,489,250.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	76,000	3.91	297,160.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	44,000	5.50	242,000.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	16,400	21.05	345,220.00
SINOPHARM GROUP CO-H	30,400	33.25	1,010,800.00
3SBIO INC	25,000	15.10	377,500.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	35,000	17.98	629,300.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	44,500	10.28	457,460.00

CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	116,000	15.96	1,851,360.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	12,500	47.85	598,125.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	90,000	2.84	255,600.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	113,000	13.00	1,469,000.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	649,000	3.64	2,362,360.00
BANK OF CHINA LTD - H	1,961,000	3.80	7,451,800.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	216,245	5.78	1,249,896.10
CHINA CITIC BANK - H	225,000	4.88	1,098,000.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	2,080,920	7.05	14,670,486.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	90,000	3.64	327,600.00
CHINA MERCHANTS BANK - H	95,650	30.90	2,955,585.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	131,200	7.81	1,024,672.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	75,000	5.48	411,000.00
IND & COMM BK OF CHINA - H	1,818,575	6.28	11,420,651.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	215,000	2.83	608,450.00
CHINA EVERBRIGHT LTD	22,000	17.26	379,720.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	84,000	5.60	470,400.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	241,000	3.59	865,190.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	57,000	16.08	916,560.00
FAR EAST HORIZON LTD	50,000	6.72	336,000.00
GF SECURITIES CO LTD-H	35,600	15.60	555,360.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	79,200	11.34	898,128.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	39,200	15.50	607,600.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	183,000	24.65	4,510,950.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	65,200	37.95	2,474,340.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	39,540	29.65	1,172,361.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO-H	19,500	52.35	1,020,825.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	163,000	3.89	634,070.00
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	115,334	15.22	1,755,383.48
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	129,000	82.90	10,694,100.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	36,000	10.90	392,400.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	80,000	24.85	1,988,000.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	110,000	3.22	354,200.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	96,320	24.40	2,350,208.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	67,777	22.15	1,501,260.55
CHINA VANKE CO LTD-H	30,360	29.95	909,282.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	132,713	13.40	1,778,354.20
FULLSHARE HOLDINGS LTD	137,500	3.24	445,500.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	26,400	16.94	447,216.00
LONGFOR PROPERTIES	35,500	19.04	675,920.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	32,000	16.58	530,560.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	65,000	5.25	341,250.00

	SOHO CHINA LTD	65,000	4.48	291,200.00	
	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	51,000	30.25	1,542,750.00	
	KINGSOFT CORP LTD	20,000	23.85	477,000.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	140,900	405.80	57,177,220.00	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	20,000	23.45	469,000.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	18,000	142.50	2,565,000.00	
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	16,000	15.08	241,280.00	
	KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	15,500	40.90	633,950.00	
	LENOVO GROUP LTD	182,000	4.58	833,560.00	
	MEITU INC	30,000	10.38	311,400.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	18,000	99.55	1,791,900.00	
	ZTE CORP-H	21,600	29.00	626,400.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	60,000	5.22	313,200.00	
	CHINA MOBILE LTD	152,700	78.00	11,910,600.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD	339,000	3.75	1,271,250.00	
	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	147,882	10.50	1,552,761.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	118,000	6.11	720,980.00	
	CGN POWER CO LTD-H	261,000	2.14	558,540.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	46,000	22.10	1,016,600.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	79,000	5.48	432,920.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	22,000	28.10	618,200.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	47,000	14.36	674,920.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	19,000	57.15	1,085,850.00	
	GUANGDONG INVEST	70,000	10.46	732,200.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	106,000	4.95	524,700.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	118,000	2.61	307,980.00	
	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	298,000	1.38	411,240.00	
	HANERGY THIN FILM POWER GROU	240,000	4.09	981,600.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	68,000	12.02	817,360.00	
	香港ドル小計	18,395,744		231,847,636.23 (3,354,835,296)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	70,000	2.47	172,900.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	6,300	24.24	152,712.00	
	SAPURA ENERGY BHD	96,000	0.71	68,160.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	58,300	7.60	443,080.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	30,500	5.02	153,110.00	
	GAMUDA BHD	40,000	4.99	199,600.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	15,800	9.60	151,680.00	
	IJM CORP BHD	70,000	2.93	205,100.00	
	SIME DARBY BERHAD	58,720	2.10	123,312.00	
	AIRASIA BHD	47,000	3.31	155,570.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	18,000	8.55	153,900.00	

MISC BHD	35,000	7.13	249,550.00	
WESTPORTS HOLDINGS BHD	24,000	3.74	89,760.00	
UMW HOLDINGS BHD	11,700	5.08	59,436.00	
GENTING BHD	56,100	9.10	510,510.00	
GENTING MALAYSIA BHD	72,500	5.59	405,275.00	
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	43,000	2.61	112,230.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	3,700	36.44	134,828.00	
FELDA GLOBAL VENTURES	43,000	1.70	73,100.00	
GENTING PLANTATIONS BHD	5,500	10.74	59,070.00	
IOI CORPORATION BERHAD	52,675	4.55	239,671.25	
KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	12,000	24.68	296,160.00	
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,400	102.00	142,800.00	
PPB GROUP BERHAD	11,700	16.90	197,730.00	
SIME DARBY PLANTATION BHD	58,720	5.43	318,849.60	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	17,000	10.74	182,580.00	
IHH HEALTHCARE BHD	55,000	5.81	319,550.00	
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	27,000	4.07	109,890.00	
AMMB HOLDINGS BHD	42,600	4.33	184,458.00	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	113,500	6.49	736,615.00	
HONG LEONG BANK BERHAD	15,800	16.64	262,912.00	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,000	17.60	88,000.00	
MALAYAN BANKING BHD	106,850	9.48	1,012,938.00	
PUBLIC BANK BERHAD	71,370	20.70	1,477,359.00	
RHB BANK BHD	18,259	4.93	90,016.87	
IOI PROPERTIES GROUP BHD	66,845	1.82	121,657.90	
SIME DARBY PROPERTY BHD	58,720	1.41	82,795.20	
SP SETIA BHD	30,500	3.34	101,870.00	
AXIATA GROUP BERHAD	66,900	5.39	360,591.00	
DIGI.COM BHD	74,000	4.80	355,200.00	
MAXIS BHD	50,300	6.00	301,800.00	
TELEKOM MALAYSIA BHD	25,000	6.50	162,500.00	
PETRONAS GAS BERHAD	17,500	17.10	299,250.00	
TENAGA NASIONAL BERHAD	80,625	14.98	1,207,762.50	
YTL CORP BHD	107,598	1.31	140,953.38	
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	74,970	1.25	93,712.50	
マレーシアリングット小計	2,066,952		12,560,505.20 (349,056,439)	
タイパーツ				
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	52,500	19.00	997,500.00	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	28,000	50.25	1,407,000.00	
IRPC PCL - NVDR	244,800	6.95	1,701,360.00	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	34,010	99.75	3,392,497.50	
PTT PCL-NVDR	26,100	446.00	11,640,600.00	

THAI OIL PCL-NVDR	27,800	101.00	2,807,800.00	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	39,000	54.00	2,106,000.00	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	57,145	85.25	4,871,611.25	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	2,600	488.00	1,268,800.00	
SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	7,300	490.00	3,577,000.00	
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	30,000	61.25	1,837,500.00	
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	104,800	64.75	6,785,800.00	
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-NVDR	174,000	7.75	1,348,500.00	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	160,000	8.35	1,336,000.00	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	55,000	43.00	2,365,000.00	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	100,000	13.00	1,300,000.00	
ROBINSON PCL-NVDR	12,000	73.00	876,000.00	
CP ALL PCL-NVDR	123,200	76.25	9,394,000.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	70,000	24.80	1,736,000.00	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	40,000	19.20	768,000.00	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	110,000	21.40	2,354,000.00	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	8,000	194.50	1,556,000.00	
BANGKOK BANK-FOREIGN REG	6,640	214.00	1,420,960.00	
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	29,200	235.00	6,862,000.00	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	15,800	233.00	3,681,400.00	
KRUNG THAI BANK - NVDR	91,125	19.00	1,731,375.00	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	44,800	150.50	6,742,400.00	
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	400,000	2.98	1,192,000.00	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	34,500	82.75	2,854,875.00	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	12,000	76.00	912,000.00	
KCE ELECTRONICS -NVDR	6,400	85.75	548,800.00	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	24,800	186.00	4,612,800.00	
TRUE CORP PCL-NVDR	244,700	6.15	1,504,905.00	
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	3,000	223.00	669,000.00	
GLOW ENERGY PCL - NVDR	12,800	83.25	1,065,600.00	
タイパーツ小計	2,432,020		99,225,083.75 (343,318,789)	
フィリピンペソ				
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	52,000	72.70	3,780,400.00	
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	102,000	15.94	1,625,880.00	
DMCI HOLDINGS INC	115,000	14.28	1,642,200.00	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	71,500	73.80	5,276,700.00	
SM INVESTMENTS CORP	5,718	984.50	5,629,371.00	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	10,000	105.00	1,050,000.00	
JOLLIBEE FOODS CORPORATION	10,000	247.00	2,470,000.00	
UNIVERSAL ROBINA CORP	21,000	151.00	3,171,000.00	
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	17,741	106.00	1,880,546.00	
BDO UNIBANK INC	49,084	153.60	7,539,302.40	

	METROPOLITAN BANK & TRUST	18,827	98.00	1,845,046.00	
	SECURITY BANK CORP	5,000	252.00	1,260,000.00	
	AYALA CORPORATION	5,942	1,010.00	6,001,420.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	2,200	1,268.00	2,789,600.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	320,000	6.73	2,153,600.00	
	AYALA LAND INC	183,960	43.25	7,956,270.00	
	MEGAWORLD CORP	303,000	5.11	1,548,330.00	
	ROBINSONS LAND CO	35,000	21.20	742,000.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	211,710	37.00	7,833,270.00	
	GLOBE TELECOM INC	830	1,854.00	1,538,820.00	
	PLDT INC	2,110	1,470.00	3,101,700.00	
	ABOITIZ POWER CORP	46,000	40.90	1,881,400.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	5,300	320.80	1,700,240.00	
	フィリピンペソ小計	1,593,922		74,417,095.40 (168,182,635)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	348,000	1,890.00	657,720,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	43,500	34,250.00	1,489,875,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	43,000	20,200.00	868,600,000.00	
	SEMEN GRESIK (PERSERO) PT	76,000	9,825.00	746,700,000.00	
	AKR CORPORINDO TBK PT	45,000	6,350.00	285,750,000.00	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	100,000	2,160.00	216,000,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	49,000	6,300.00	308,700,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	495,000	8,200.00	4,059,000,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	147,000	2,480.00	364,560,000.00	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	64,000	10,875.00	696,000,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	200,000	3,180.00	636,000,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	12,800	80,950.00	1,036,160,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	222,000	4,650.00	1,032,300,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	56,000	9,000.00	504,000,000.00	
	PT INDOFOOD SUKSES MAK TBK	112,000	7,625.00	854,000,000.00	
	PT UNILEVER INDONESIA TBK	37,000	54,125.00	2,002,625,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	550,000	1,650.00	907,500,000.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	78,000	6,000.00	468,000,000.00	
	BANK MANDIRI TBK	459,000	7,675.00	3,522,825,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	1,345,000	3,460.00	4,653,700,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	96,500	3,500.00	337,750,000.00	
	PT BANK CENTRAL ASIA	245,500	21,500.00	5,278,250,000.00	
	PT BANK NEGARA INDONESIA	180,000	9,850.00	1,773,000,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	170,000	1,690.00	287,300,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	520,000	675.00	351,000,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	1,248,000	4,300.00	5,366,400,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	54,000	6,350.00	342,900,000.00	

	XL AXIATA TBK PT	78,000	2,880.00	224,640,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	274,500	1,740.00	477,630,000.00	
インドネシアルピア小計		7,348,800		39,748,885,000.00 (333,890,634)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	1,270	62,100.00	78,867,000.00	
	S-OIL CORPORATION	1,065	124,500.00	132,592,500.00	
	SK INNOVATION CO LTD	1,622	204,000.00	330,888,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	2,650	29,950.00	79,367,500.00	
	HYOSUNG CORPORATION	550	136,500.00	75,075,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	2,030	57,400.00	116,522,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	215	483,000.00	103,845,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	460	96,800.00	44,528,000.00	
	LG CHEM LTD	1,132	393,500.00	445,442,000.00	
	LG CHEM LTD-PRF	230	244,500.00	56,235,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	370	360,500.00	133,385,000.00	
	OCI CO LTD	420	127,500.00	53,550,000.00	
	POSCO	1,815	337,000.00	611,655,000.00	
	CJ CORP	370	181,500.00	67,155,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	610	81,100.00	49,471,000.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	3,686	5,740.00	21,157,640.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	850	35,100.00	29,835,000.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	1,400	15,650.00	21,910,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,203	26,900.00	32,360,700.00	
	HANWHA CORPORATION	1,160	40,700.00	47,212,000.00	
	HANWHA TECHWIN CO LTD	710	34,200.00	24,282,000.00	
	HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	1,595	38,750.00	61,806,250.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	1,910	34,900.00	66,659,000.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	767	134,000.00	102,778,000.00	
	KCC CORP	150	379,000.00	56,850,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,730	46,200.00	79,926,000.00	
	LG CORP	2,300	88,000.00	202,400,000.00	
	LOTTE CORP	734	61,900.00	45,434,600.00	
	POSCO DAEWOO CORP	1,431	17,850.00	25,543,350.00	
	SAMSUNG C&T CORP	1,917	123,000.00	235,791,000.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	5,981	7,200.00	43,063,200.00	
	SK HOLDINGS CO LTD	761	278,500.00	211,938,500.00	
SK NETWORKS CO LTD	3,550	6,590.00	23,394,500.00		
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	450	40,000.00	18,000,000.00		
S1 CORPORATION	420	103,000.00	43,260,000.00		
CJ LOGISTICS	205	139,500.00	28,597,500.00		
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	500	136,000.00	68,000,000.00		
KOREAN AIR LINES CO LTD	1,214	33,150.00	40,244,100.00		



PAN OCEAN CO LTD	5,000	4,955.00	24,775,000.00
HANKOOK TIRE CO LTD	1,782	54,100.00	96,406,200.00
HANON SYSTEMS	5,400	13,300.00	71,820,000.00
HYUNDAI MOBIS	1,695	260,000.00	440,700,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	3,870	153,000.00	592,110,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	850	104,500.00	88,825,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	480	93,200.00	44,736,000.00
HYUNDAI WIA CORP	320	63,600.00	20,352,000.00
KIA MOTORS CORPORATION	6,340	33,100.00	209,854,000.00
COWAY CO LTD	1,290	99,300.00	128,097,000.00
HANSSEM CO LTD	270	181,000.00	48,870,000.00
LG ELECTRONICS INC	2,645	100,000.00	264,500,000.00
KANGWON LAND INC	2,770	34,650.00	95,980,500.00
CHEIL WORLDWIDE INC	2,350	21,350.00	50,172,500.00
CJ E&M CORP	470	95,400.00	44,838,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	830	82,800.00	68,724,000.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	380	101,000.00	38,380,000.00
LOTTE SHOPPING CO	272	191,500.00	52,088,000.00
SHINSEGAE CO LTD	167	282,000.00	47,094,000.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	212	219,500.00	46,534,000.00
DONGSUH COMPANIES INC	850	29,400.00	24,990,000.00
E-MART CO LTD	537	270,000.00	144,990,000.00
GS RETAIL CO LTD	600	39,850.00	23,910,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	194	367,000.00	71,198,000.00
KT&G CORP	2,865	120,000.00	343,800,000.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	526	113,500.00	59,701,000.00
OTTOGI CORPORATION	30	798,000.00	23,940,000.00
AMOREPACIFIC CORP	800	299,000.00	239,200,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	220	161,000.00	35,420,000.00
AMOREPACIFIC GROUP	750	138,500.00	103,875,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	230	1,178,000.00	270,940,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PRF	55	683,000.00	37,565,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	800	95,900.00	76,720,000.00
CELLTRION INC	1,984	201,900.00	400,569,600.00
HANMI PHARM CO LTD	154	573,000.00	88,242,000.00
HANMI SCIENCE CO LTD	272	109,000.00	29,648,000.00
MEDY-TOX INC	110	469,000.00	51,590,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	400	347,000.00	138,800,000.00
SILLAJEN INC	1,270	81,000.00	102,870,000.00
YUHAN CORPORATION	252	221,000.00	55,692,000.00
BNK FINANCIAL GROUP INC	6,484	9,690.00	62,829,960.00
DGB FINANCIAL GROUP INC	4,186	11,050.00	46,255,300.00

	HANA FINANCIAL GROUP	7,408	50,300.00	372,622,400.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	6,440	17,200.00	110,768,000.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	9,785	62,300.00	609,605,500.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	10,550	50,700.00	534,885,000.00	
	WOORI BANK	9,111	16,200.00	147,598,200.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	955	67,400.00	64,367,000.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	9,858	8,960.00	88,327,680.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	3,171	14,000.00	44,394,000.00	
	SAMSUNG CARD CO	690	41,200.00	28,428,000.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,517	35,950.00	54,536,150.00	
	DONGBU INSURANCE CO LTD	1,200	71,500.00	85,800,000.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	6,000	6,980.00	41,880,000.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	1,550	47,300.00	73,315,000.00	
	ING LIFE INSURANCE KOREA LTD	770	53,500.00	41,195,000.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	780	267,500.00	208,650,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	1,770	122,000.00	215,940,000.00	
	KAKAO CORP	810	129,500.00	104,895,000.00	
	NAVER CORP	698	862,000.00	601,676,000.00	
	NCSOFT CORPORATION	435	436,500.00	189,877,500.00	
	NETMARBLE GAMES CORP	415	183,000.00	75,945,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	820	197,500.00	161,950,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	5,560	30,000.00	166,800,000.00	
	LG INNOTEK CO LTD	360	144,000.00	51,840,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,330	99,800.00	132,734,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	2,405	2,485,000.00	5,976,425,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	435	2,002,000.00	870,870,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	1,383	202,500.00	280,057,500.00	
	KT CORP	1,027	31,050.00	31,888,350.00	
	SK TELECOM	485	274,000.00	132,890,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	6,340	38,750.00	245,675,000.00	
	KOREA GAS CORPORATION	828	42,350.00	35,065,800.00	
	HYUNDAI ROBOTICS CO LTD	246	369,000.00	90,774,000.00	
	SK HYNIX INC	14,530	76,700.00	1,114,451,000.00	
韓国ウォン小計		220,057		21,802,749,480.00 (2,293,649,245)	
台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	32,080	113.00	3,625,040.00	
	ASIA CEMENT CORP	57,978	27.20	1,577,001.60	
	CHINA STEEL CORP	310,181	24.45	7,583,925.45	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	72,047	97.50	7,024,582.50	
	FORMOSA PLASTICS CORP	103,424	95.40	9,866,649.60	
	NAN YA PLASTICS CORP	116,145	76.20	8,850,249.00	
	TAIWAN CEMENT	91,170	35.15	3,204,625.50	

AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	3,000	520.00	1,560,000.00
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	83,957	26.05	2,187,079.85
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	5,039	324.50	1,635,155.50
TECO ELECTRIC & MACHINERY	46,000	28.25	1,299,500.00
CHINA AIRLINES LTD	67,000	12.15	814,050.00
EVA AIRWAYS CORP	44,482	15.95	709,487.90
EVERGREEN MARINE CORP LTD	50,365	16.35	823,467.75
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	45,000	23.25	1,046,250.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	45,947	51.10	2,347,891.70
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	4,254	285.50	1,214,517.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	8,921	133.00	1,186,493.00
FORMOSA TAFFETA CO.	18,000	31.15	560,700.00
GIANT MANUFACTURING	7,000	157.00	1,099,000.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	4,000	299.00	1,196,000.00
POU CHEN	58,145	38.25	2,224,046.25
RUENTEX INDUSTRIES LTD	12,000	49.30	591,600.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	7,000	345.50	2,418,500.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	14,448	274.00	3,958,752.00
STANDARD FOODS CORP	14,320	72.40	1,036,768.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	119,703	65.30	7,816,605.90
TAIMED BIOLOGICS INC	4,000	183.50	734,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	117,540	16.45	1,933,533.00
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	350,715	10.15	3,559,757.25
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	428,746	20.25	8,682,106.50
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	226,992	18.85	4,278,799.20
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	226,984	19.40	4,403,489.60
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	173,166	16.75	2,900,530.50
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	264,356	23.80	6,291,672.80
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	267,133	9.69	2,588,518.77
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	228,706	13.75	3,144,707.50
TAIWAN BUSINESS BANK	94,788	8.38	794,323.44
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	197,159	16.50	3,253,123.50
CHAILEASE HOLDING CO LTD	29,329	85.00	2,492,965.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	164,743	51.00	8,401,893.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	247,257	13.75	3,399,783.75
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	206,538	53.90	11,132,398.20
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	60,357	30.00	1,810,710.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	195,337	10.55	2,060,805.35
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	14,950	41.75	624,162.50
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	34,023	31.25	1,063,218.75
ACER INC	64,812	22.65	1,467,991.80
ADVANTECH CO LTD	8,216	210.50	1,729,468.00

ASUSTEK COMPUTER INC	17,797	274.00	4,876,378.00
AU OPTRONICS CORP	217,994	12.45	2,714,025.30
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	16,405	334.00	5,479,270.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	13,260	75.20	997,152.00
COMPAL ELECTRONICS	103,955	21.25	2,209,043.75
DELTA ELECTRONICS INC	47,541	139.50	6,631,969.50
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	23,787	84.70	2,014,758.90
GENERAL INTERFACE SOLUTION	4,000	214.00	856,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	387,765	92.90	36,023,368.50
HTC CORP	17,011	75.10	1,277,526.10
INNOLUX CORP	214,282	12.50	2,678,525.00
INVENTEC CORP	62,162	23.75	1,476,347.50
LARGAN PRECISION CO LTD	2,536	4,200.00	10,651,200.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	53,787	39.50	2,124,586.50
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	17,000	74.70	1,269,900.00
PEGATRON CORP	47,854	72.30	3,459,844.20
QUANTA COMPUTER INC	67,416	61.50	4,146,084.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	32,120	40.55	1,302,466.00
WISTRON CORP	62,311	23.10	1,439,384.10
WPG HOLDINGS LTD	40,000	39.50	1,580,000.00
YAGEO CORPORATION	5,000	342.50	1,712,500.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	11,000	67.60	743,600.00
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	50,000	9.68	484,000.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	93,371	105.50	9,850,640.50
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	42,000	72.80	3,057,600.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	40,188	106.50	4,280,022.00
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	166,775	38.00	6,337,450.00
GLOBALWAFERS CO LTD	5,000	397.00	1,985,000.00
MACRONIX INTERNATIONAL	43,000	42.00	1,806,000.00
MEDIATEK INC	37,132	290.50	10,786,846.00
NANYA TECHNOLOGY CORP	18,000	77.80	1,400,400.00
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	14,522	113.50	1,648,247.00
PHISON ELECTRONICS CORP	4,000	302.00	1,208,000.00
POWERTECH TECHNOLOGY INC	16,635	87.30	1,452,235.50
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	11,815	105.50	1,246,482.50
SILICONWARE PRECISION INDS	49,082	49.95	2,451,645.90
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	610,355	227.50	138,855,762.50
UNITED MICROELECTRONICS CORP	288,592	14.40	4,155,724.80
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	22,000	63.00	1,386,000.00
WIN SEMICONDUCTORS CORP	9,000	297.00	2,673,000.00
WINBOND ELECTRONICS CORP	69,000	23.50	1,621,500.00
	8,102,903		446,556,382.96

台湾ドル小計				(1,692,448,691)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	18,150	535.15	9,712,972.50
	COAL INDIA LTD	17,100	265.90	4,546,890.00
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	14,650	429.30	6,289,245.00
	INDIAN OIL CORP LTD	14,000	410.25	5,743,500.00
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	33,490	193.40	6,476,966.00
	PETRONET LNG LTD	10,500	252.85	2,654,925.00
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	64,592	920.40	59,450,476.80
	ACC LIMITED	1,330	1,721.65	2,289,794.50
	AMBUJA CEMENTS LIMITED	14,370	267.60	3,845,412.00
	ASIAN PAINTS LTD	7,200	1,138.00	8,193,600.00
	GRASIM INDUSTRIES LTD	7,950	1,134.15	9,016,492.50
	HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	29,280	267.85	7,842,648.00
	JSW STEEL LTD	20,000	264.50	5,290,000.00
	SHREE CEMENT LTD	200	17,847.10	3,569,420.00
	TATA STEEL LIMITED	7,416	711.20	5,274,259.20
	ULTRATECH CEMENT LTD	2,100	4,288.90	9,006,690.00
	UPL LTD	8,900	731.60	6,511,240.00
	VEDANTA LTD	37,660	316.55	11,921,273.00
	ASHOK LEYLAND LTD	31,000	117.60	3,645,600.00
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	19,725	92.20	1,818,645.00
	EICHER MOTORS LTD	320	30,250.75	9,680,240.00
	HAVELLS INDIA LTD	6,100	550.05	3,355,305.00
	LARSEN & TOUBRO LTD	11,950	1,266.15	15,130,492.50
	SIEMENS INDIA LIMITED	1,890	1,230.60	2,325,834.00
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	17,600	402.15	7,077,840.00
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	1,150	1,362.90	1,567,335.00
	BAJAJ AUTO LTD	2,400	3,328.95	7,989,480.00
	BHARAT FORGE LTD	5,200	728.90	3,790,280.00
	BOSCH LTD	160	19,926.50	3,188,240.00
	HERO MOTOCORP LTD	1,400	3,792.80	5,309,920.00
	MAHINDRA & MAHINDRA LIMITED	9,200	746.20	6,865,040.00
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD(N)	9,200	746.20	6,865,040.00
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,550	9,700.00	24,735,000.00
	MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	16,000	376.85	6,029,600.00
TATA MOTORS LTD	37,728	422.00	15,921,216.00	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	9,400	240.35	2,259,290.00	
TITAN CO LTD	7,600	856.85	6,512,060.00	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	13,630	574.55	7,831,116.50	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	680	4,746.65	3,227,722.00	
ITC LTD	84,465	263.10	22,222,741.50	
NESTLE INDIA LIMITED	560	7,883.30	4,414,648.00	

UNITED SPIRITS LIMITED	1,330	3,554.40	4,727,352.00	
DABUR INDIA LTD	12,200	353.55	4,313,310.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	6,400	987.60	6,320,640.00	
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	16,220	1,356.50	22,002,430.00	
MARICO LTD	11,400	316.95	3,613,230.00	
AUROBINDO PHARMA LTD	7,500	681.30	5,109,750.00	
CADILA HEALTHCARE LTD	5,300	423.30	2,243,490.00	
CIPLA LTD	7,650	601.20	4,599,180.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	2,820	2,332.70	6,578,214.00	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	2,900	567.60	1,646,040.00	
LUPIN LTD	5,530	871.65	4,820,224.50	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	2,000	2,901.10	5,802,200.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	23,204	530.95	12,320,163.80	
AXIS BANK LTD	41,680	553.60	23,074,048.00	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	37,125	1,709.35	63,459,618.75	
ICICI BANK LTD	59,687	316.60	18,896,904.20	
IDFC BANK LTD	29,000	55.00	1,595,000.00	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	8,020	1,193.40	9,571,068.00	
LIC HOUSING FINANCE LTD	7,000	567.75	3,974,250.00	
STATE BANK OF INDIA	41,500	319.85	13,273,775.00	
YES BANK LTD	41,700	310.15	12,933,255.00	
BAJAJ FINANCE LTD	4,100	1,782.45	7,308,045.00	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	7,400	474.45	3,510,930.00	
POWER FINANCE CORPORATION	13,000	120.95	1,572,350.00	
RURAL ELECTRIFICATION CORP	17,600	156.65	2,757,040.00	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	4,000	1,465.00	5,860,000.00	
BAJAJ FINSERV LTD	920	5,428.15	4,993,898.00	
HCL TECHNOLOGIES LTD	13,600	886.90	12,061,840.00	
INFOSYS LTD	41,534	1,039.35	43,168,362.90	
TATA CONSULTANCY SVS LTD	11,380	2,646.75	30,120,015.00	
TECH MAHINDRA LTD	11,500	493.45	5,674,675.00	
VAKRANGEE LTD	5,000	399.55	1,997,750.00	
VAKRANGEE LTD(N)	5,000	399.55	1,997,750.00	
WIPRO LTD	23,939	301.60	7,220,002.40	
BHARTI AIRTEL LTD	30,500	528.55	16,120,775.00	
BHARTI INFRATEL LTD	16,390	363.95	5,965,140.50	
IDEA CELLULAR LTD	34,000	100.65	3,422,100.00	
GAIL INDIA LTD	14,500	503.10	7,294,950.00	
NTPC LIMITED	37,500	179.75	6,740,625.00	
TATA POWER CO LTD	29,640	92.75	2,749,110.00	
インドルピー小計	1,290,465		740,807,992.05 (1,318,638,225)	

パキスタンルピー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	17,000	162.14	2,756,380.00
	LUCKY CEMENT	2,800	475.18	1,330,504.00
	HABIB BANK LTD	15,300	170.07	2,602,071.00
	MCB BANK LTD	8,500	202.45	1,720,825.00
	UNITED BANK LTD	10,500	182.80	1,919,400.00
パキスタンルピー小計		54,100		10,329,180.00 (10,639,055)
カタールリアル	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	5,200	15.80	82,160.00
	INDUSTRIES QATAR	3,830	99.00	379,170.00
	COMMERCIAL BANK QSC	4,917	28.50	140,134.50
	DOHA BANK QSC	2,760	28.79	79,460.40
	MASRAF AL RAYAN	9,240	37.88	350,011.20
	QATAR ISLAMIC BANK	1,670	96.50	161,155.00
	QATAR NATIONAL BANK	5,487	128.70	706,176.90
	QATAR INSURANCE CO	3,325	52.50	174,562.50
	BARWA REAL ESTATE CO	3,000	32.51	97,530.00
	EZDAN HOLDING GROUP	18,900	12.12	229,068.00
	OOREDOO QSC	2,160	96.20	207,792.00
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	680	179.99	122,393.20
カタールリアル小計		61,169		2,729,613.70 (85,027,466)
エジプトポンド	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	25,687	75.24	1,932,689.88
	EFG-HERMES HOLDING SAE	10,000	23.31	233,100.00
	GLOBAL TELECOM HOLDING	60,000	7.42	445,200.00
エジプトポンド小計		95,687		2,610,989.88 (16,553,675)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	6,110	157.38	961,591.80
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	1,660	346.99	576,003.40
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	9,820	121.50	1,193,130.00
	GOLD FIELDS LTD	19,590	52.24	1,023,381.60
	KUMBA IRON ORE LTD	1,500	371.36	557,040.00
	MONDI LTD	2,730	321.49	877,667.70
	SAPPI LIMITED	14,415	91.47	1,318,540.05
	SASOL LTD	13,600	418.87	5,696,632.00
	SIBANYE GOLD LTD	45,000	14.79	665,550.00
	BIDVEST GROUP LTD	8,622	213.00	1,836,486.00
	NASPERS LTD-N SHS	10,825	3,451.42	37,361,621.50
	FOSCHINI GROUP LTD/THE	5,925	180.00	1,066,500.00
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	3,655	251.50	919,232.50
	MR PRICE GROUP LTD	6,000	241.77	1,450,620.00
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	10,620	91.01	966,526.20
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	25,805	62.93	1,623,908.65
BID CORP LTD	8,509	297.63	2,532,533.67	

PICK'N PAY STORES LTD	9,400	66.60	626,040.00		
SHOPRITE HOLDINGS LTD	11,110	204.50	2,271,995.00		
SPAR GROUP LIMITED/THE	4,660	190.93	889,733.80		
PIONEER FOODS LTD	2,700	133.86	361,422.00		
TIGER BRANDS LTD	3,940	443.77	1,748,453.80		
LIFE HEALTHCARE GROUP	31,343	26.89	842,813.27		
NETCARE LTD	26,950	23.94	645,183.00		
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	9,741	278.00	2,707,998.00		
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	17,000	172.00	2,924,000.00		
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,000	1,050.52	1,050,520.00		
NEDBANK GROUP LTD	5,250	247.58	1,299,795.00		
STANDARD BANK GROUP LTD	31,716	187.23	5,938,186.68		
BRAIT SE	9,800	40.26	394,548.00		
CORONATION FUND MANAGERS LTD	5,500	72.00	396,000.00		
FIRSTRAND LTD	83,370	63.65	5,306,500.50		
INVESTEC LTD	6,500	90.23	586,495.00		
PSG GROUP LTD	2,100	259.00	543,900.00		
REMGRO LTD	12,890	228.03	2,939,306.70		
RMB HOLDINGS LTD	17,530	74.64	1,308,439.20		
DISCOVERY LTD	8,507	181.48	1,543,850.36		
LIBERTY HOLDINGS LTD	4,000	122.64	490,560.00		
MMI HOLDINGS LTD	24,429	20.45	499,573.05		
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	19,830	44.92	890,763.60		
SANLAM LTD	34,635	85.33	2,955,404.55		
NEPI ROCKCASTLE PLC	9,090	216.80	1,970,712.00		
MTN GROUP LTD	42,015	130.65	5,489,259.75		
TELKOM SA SOC LTD	6,700	46.08	308,736.00		
VODACOM GROUP LTD	14,685	140.80	2,067,648.00		
南アフリカランド小計	650,777		109,624,802.33 (981,141,980)		
アラブディルハム	DXB ENTERTAINMENTS PJSC	74,000	0.63	46,990.00	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	50,250	6.75	339,187.50	
	DUBAI ISLAMIC BANK	29,800	6.20	184,760.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	37,955	10.25	389,038.75	
	DUBAI INVESTMENTS PJSC	34,000	2.41	81,940.00	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	84,600	2.18	184,428.00	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO	44,000	3.30	145,200.00	
	EMAAR MALLS PJSC	48,000	2.07	99,360.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	82,550	7.06	582,803.00	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	42,700	16.85	719,495.00	
アラブディルハム小計	527,855		2,773,202.25 (85,636,485)		



合計	52,971,756		14,886,171,808 (14,886,171,808)
----	------------	--	------------------------------------

(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	42,700	440,664.00	
米ドル小計			42,700	440,664.00 (49,896,384)	
メキシコペソ	投資証券	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	73,300	2,081,720.00	
メキシコペソ小計			73,300	2,081,720.00 (11,949,072)	
トルコリラ	投資証券	EMLAK KONUT GAYRIMEN	58,000	158,340.00	
トルコリラ小計			58,000	158,340.00 (4,712,198)	
南アフリカランド	投資証券	FORTRESS REIT LTD-A	24,000	439,440.00	
		FORTRESS REIT LTD-B	18,000	746,100.00	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	60,000	1,636,200.00	
		HYPROP INVESTMENTS LTD	5,800	655,980.00	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	126,000	1,317,960.00	
		RESILIENT REIT LTD	7,700	1,123,507.00	
南アフリカランド小計			241,500	5,919,187.00 (52,976,723)	
合計				119,534,377 (119,534,377)	

(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 70銘柄	97.4%			12.6%
	投資信託受益証券 1銘柄		2.6%		0.3%
メキシコペソ	株式 25銘柄	97.2%			2.7%
	投資証券 1銘柄			2.8%	0.1%
ブラジルリアル	株式 54銘柄	100.0%			6.2%
チリペソ	株式 18銘柄	100.0%			1.0%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	100.0%			0.3%

トルコリラ	株式	24銘柄	97.0%			1.0%
	投資証券	1銘柄			3.0%	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	23銘柄	100.0%			1.3%
香港ドル	株式	138銘柄	100.0%			22.4%
マレーシアリングギット	株式	46銘柄	100.0%			2.3%
タイバーツ	株式	35銘柄	100.0%			2.3%
フィリピンペソ	株式	23銘柄	100.0%			1.1%
インドネシアアルピア	株式	29銘柄	100.0%			2.2%
韓国ウォン	株式	113銘柄	100.0%			15.3%
台湾ドル	株式	90銘柄	100.0%			11.3%
インドルピー	株式	81銘柄	100.0%			8.8%
パキスタンルピー	株式	5銘柄	100.0%			0.1%
カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%			0.6%
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	45銘柄	94.9%			6.5%
	投資証券	6銘柄			5.1%	0.4%
アラブディルハム	株式	10銘柄	100.0%			0.6%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

## 日本債券インデックスマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

	平成29年 6月26日現在	平成29年12月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,523,344,997	10,660,092
国債証券	27,338,461,139	29,115,682,772
地方債証券	2,822,875,362	2,911,586,340
特殊債券	4,328,157,000	3,316,386,504
社債券	1,682,241,000	1,747,440,000
未収利息	66,612,882	68,037,563
前払費用	1,759,843	1,352,956
流動資産合計	37,763,452,223	37,171,146,227
資産合計	37,763,452,223	37,171,146,227
<b>負債の部</b>		
流動負債		

	平成29年 6月26日現在	平成29年12月25日現在
未払金	1,466,962,700	-
未払解約金	-	5,533,849
未払利息	2,390	15
流動負債合計	1,466,965,090	5,533,864
負債合計	1,466,965,090	5,533,864
純資産の部		
元本等		
元本	26,195,380,333	26,749,059,072
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	10,101,106,800	10,416,553,291
元本等合計	36,296,487,133	37,165,612,363
純資産合計	36,296,487,133	37,165,612,363
負債純資産合計	37,763,452,223	37,171,146,227

## 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29年 6月26日現在	平成29年12月25日現在
1. 期首	平成28年12月27日	平成29年 6月27日
期首元本額	24,649,841,004円	26,195,380,333円
期首からの追加設定元本額	2,298,834,977円	1,418,134,121円
期首からの一部解約元本額	753,295,648円	864,455,382円
元本の内訳		
DCインデックスバランス（株式20）	1,140,350,401円	1,357,362,982円
DCインデックスバランス（株式40）	1,223,109,430円	1,436,413,016円
DCインデックスバランス（株式60）	867,408,843円	1,073,817,116円
DCインデックスバランス（株式80）	149,539,820円	176,521,828円
インデックスファンド日本債券（DC専用）	1,647,131,768円	1,732,190,101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	4,291,981,706円	4,071,887,608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	4,896,618円	4,994,522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)	1,082,407,274円	1,094,893,656円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	4,785,001円	4,993,954円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	25,929,494円	25,086,790円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	102,266,692円	104,165,549円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	341,793,945円	318,328,046円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	5,555,994,108円	5,481,306,102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)	32,311,158円	27,666,287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)	123,558,103円	116,047,635円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	1,173,785,760円	1,221,979,198円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	1,199,467,932円	1,222,765,226円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	628,162,355円	675,382,466円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	95,362,529円	103,126,597円
インデックスファンド日本債券(1年決算型)	6,264,421,845円	6,250,900,728円
日本債券インデックスファンド(個人型年金向け)	240,715,551円	249,229,665円
計	26,195,380,333円	26,749,059,072円
2. 受益権の総数	26,195,380,333口	26,749,059,072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12月27日 至 平成29年 6月26日	自 平成29年 6月27日 至 平成29年12月25日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成29年 6月26日現在	平成29年12月25日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成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

（平成29年12月25日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	89,233,595
地方債証券	2,337,660
特殊債券	558,496
社債券	1,436,000
合計	84,901,439

（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29年 6月26日現在		平成29年12月25日現在	
1口当たり純資産額	1.3856円	1口当たり純資産額	1.3894円
(1万口当たり純資産額)	(13,856円)	(1万口当たり純資産額)	(13,894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

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第116回利付国債（5年）	44,500,000	44,654,472	
	第117回利付国債（5年）	90,000,000	90,376,200	
	第118回利付国債（5年）	100,000,000	100,504,000	
	第119回利付国債（5年）	74,000,000	74,262,700	
	第120回利付国債（5年）	330,000,000	331,947,000	
	第121回利付国債（5年）	100,000,000	100,416,000	
	第122回利付国債（5年）	300,000,000	301,398,000	
	第123回利付国債（5年）	505,000,000	507,651,250	
	第124回利付国債（5年）	560,000,000	563,203,200	
	第125回利付国債（5年）	325,000,000	327,002,000	
	第126回利付国債（5年）	220,000,000	221,480,600	
	第1回利付国債（40年）	70,000,000	99,564,500	
	第2回利付国債（40年）	165,000,000	226,680,300	
	第3回利付国債（40年）	50,000,000	68,906,000	
	第4回利付国債（40年）	95,000,000	131,464,800	
	第5回利付国債（40年）	35,000,000	46,535,300	
	第6回利付国債（40年）	70,000,000	91,161,000	
	第7回利付国債（40年）	50,000,000	62,115,500	
	第8回利付国債（40年）	95,000,000	109,004,900	
	第9回利付国債（40年）	160,000,000	131,990,400	
	第10回利付国債（40年）	65,000,000	63,616,150	
	第299回利付国債（10年）	410,000,000	417,281,600	
	第300回利付国債（10年）	36,000,000	36,727,920	
	第301回利付国債（10年）	206,000,000	211,007,860	
	第302回利付国債（10年）	94,000,000	96,146,020	
	第303回利付国債（10年）	581,000,000	596,530,130	
	第304回利付国債（10年）	36,000,000	36,899,640	
	第305回利付国債（10年）	473,000,000	486,480,500	
	第306回利付国債（10年）	93,000,000	96,177,810	
	第308回利付国債（10年）	140,000,000	144,961,600	
	第309回利付国債（10年）	134,000,000	138,081,640	
	第310回利付国債（10年）	78,000,000	80,393,820	
	第311回利付国債（10年）	23,000,000	23,579,830	
	第312回利付国債（10年）	205,000,000	213,093,400	
	第313回利付国債（10年）	370,000,000	386,957,100	
	第315回利付国債（10年）	65,000,000	67,985,450	
	第316回利付国債（10年）	35,000,000	36,485,400	
	第317回利付国債（10年）	105,000,000	109,780,650	
	第318回利付国債（10年）	185,000,000	192,729,300	
	第319回利付国債（10年）	5,000,000	5,240,850	
第320回利付国債（10年）	190,000,000	198,392,300		

第3 2 1 回利付国債(10年)	175,000,000	183,249,500	
第3 2 2 回利付国債(10年)	75,000,000	78,216,750	
第3 2 3 回利付国債(10年)	45,000,000	47,035,350	
第3 2 4 回利付国債(10年)	25,000,000	26,018,250	
第3 2 5 回利付国債(10年)	210,000,000	218,983,800	
第3 2 6 回利付国債(10年)	30,000,000	31,201,200	
第3 2 7 回利付国債(10年)	65,000,000	67,928,250	
第3 2 8 回利付国債(10年)	115,000,000	119,260,750	
第3 2 9 回利付国債(10年)	230,000,000	241,403,400	
第3 3 0 回利付国債(10年)	210,000,000	220,829,700	
第3 3 1 回利付国債(10年)	80,000,000	83,204,000	
第3 3 3 回利付国債(10年)	210,000,000	219,004,800	
第3 3 4 回利付国債(10年)	120,000,000	125,313,600	
第3 3 5 回利付国債(10年)	490,000,000	509,061,000	
第3 3 6 回利付国債(10年)	80,000,000	83,198,400	
第3 3 7 回利付国債(10年)	30,000,000	30,778,500	
第3 3 8 回利付国債(10年)	310,000,000	320,350,900	
第3 3 9 回利付国債(10年)	300,000,000	310,134,000	
第3 4 0 回利付国債(10年)	420,000,000	434,330,400	
第3 4 1 回利付国債(10年)	1,090,000,000	1,119,222,900	
第3 4 2 回利付国債(10年)	130,000,000	131,339,000	
第3 4 3 回利付国債(10年)	200,000,000	201,952,000	
第3 4 5 回利付国債(10年)	610,000,000	615,477,800	
第3 4 6 回利付国債(10年)	490,000,000	494,062,100	
第3 4 7 回利付国債(10年)	160,000,000	161,209,600	
第3 4 8 回利付国債(10年)	90,000,000	90,655,200	
第1 4 回利付国債(30年)	208,000,000	274,951,040	
第1 5 回利付国債(30年)	147,000,000	197,009,400	
第1 6 回利付国債(30年)	35,000,000	47,005,350	
第1 8 回利付国債(30年)	110,000,000	144,498,200	
第2 1 回利付国債(30年)	20,000,000	26,374,200	
第2 2 回利付国債(30年)	40,000,000	54,178,400	
第2 3 回利付国債(30年)	55,000,000	74,553,600	
第2 4 回利付国債(30年)	68,000,000	92,400,440	
第2 5 回利付国債(30年)	20,000,000	26,470,200	
第2 6 回利付国債(30年)	170,000,000	228,259,000	
第2 7 回利付国債(30年)	29,000,000	39,522,940	
第2 8 回利付国債(30年)	94,000,000	128,416,220	
第2 9 回利付国債(30年)	276,000,000	373,102,320	
第3 0 回利付国債(30年)	147,000,000	196,458,150	
第3 1 回利付国債(30年)	120,000,000	158,433,600	
第3 2 回利付国債(30年)	50,000,000	67,263,500	
第3 3 回利付国債(30年)	135,000,000	173,499,300	



第34回利付国債(30年)	200,000,000	266,320,000	
第35回利付国債(30年)	168,000,000	216,859,440	
第36回利付国債(30年)	135,000,000	174,609,000	
第37回利付国債(30年)	61,000,000	77,659,710	
第38回利付国債(30年)	70,000,000	87,636,500	
第39回利付国債(30年)	75,000,000	95,597,250	
第40回利付国債(30年)	90,000,000	112,691,700	
第41回利付国債(30年)	40,000,000	49,171,200	
第42回利付国債(30年)	105,000,000	129,124,800	
第43回利付国債(30年)	195,000,000	239,898,750	
第44回利付国債(30年)	70,000,000	86,150,400	
第45回利付国債(30年)	45,000,000	53,230,050	
第46回利付国債(30年)	100,000,000	118,295,000	
第47回利付国債(30年)	115,000,000	138,852,150	
第48回利付国債(30年)	105,000,000	121,644,600	
第49回利付国債(30年)	90,000,000	104,252,400	
第50回利付国債(30年)	25,000,000	25,144,750	
第51回利付国債(30年)	70,000,000	61,383,000	
第52回利付国債(30年)	90,000,000	83,303,100	
第53回利付国債(30年)	105,000,000	99,706,950	
第54回利付国債(30年)	110,000,000	110,000,000	
第55回利付国債(30年)	110,000,000	109,868,000	
第56回利付国債(30年)	50,000,000	49,880,000	
第41回利付国債(20年)	27,000,000	27,547,560	
第42回利付国債(20年)	168,000,000	173,670,000	
第43回利付国債(20年)	47,000,000	49,479,720	
第44回利付国債(20年)	51,000,000	53,996,250	
第47回利付国債(20年)	21,000,000	22,339,380	
第48回利付国債(20年)	99,000,000	106,798,230	
第49回利付国債(20年)	57,000,000	61,106,280	
第50回利付国債(20年)	237,000,000	252,535,350	
第51回利付国債(20年)	39,000,000	41,883,660	
第54回利付国債(20年)	15,000,000	16,385,400	
第55回利付国債(20年)	66,000,000	71,918,220	
第57回利付国債(20年)	52,000,000	56,704,960	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	147,906,000	
第59回利付国債(20年)	33,000,000	35,991,120	
第60回利付国債(20年)	295,000,000	317,307,900	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	28,568,160	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	34,245,080	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	60,190,560	
第65回利付国債(20年)	100,000,000	111,932,000	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	37,852,540	

第67回利付国債(20年)	34,000,000	38,225,180	
第68回利付国債(20年)	78,000,000	89,157,900	
第70回利付国債(20年)	104,000,000	120,758,560	
第72回利付国債(20年)	112,000,000	128,480,800	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	129,363,530	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	135,914,760	
第75回利付国債(20年)	10,000,000	11,563,700	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	23,978,850	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	45,964,400	
第79回利付国債(20年)	160,000,000	184,624,000	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	69,957,600	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	153,845,900	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	358,962,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	19,081,760	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	300,335,000	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	71,315,400	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	71,072,400	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	59,688,500	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	99,783,340	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	117,397,140	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	54,527,850	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	112,989,880	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	141,099,660	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	36,581,700	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	81,823,500	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	100,790,730	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	13,573,010	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	40,031,310	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	93,698,990	
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,455,060	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	158,670,200	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	160,633,840	
第109回利付国債(20年)	27,000,000	32,449,950	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	119,960,820	
第111回利付国債(20年)	25,000,000	30,975,750	
第112回利付国債(20年)	80,000,000	98,214,400	
第113回利付国債(20年)	290,000,000	356,839,200	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	64,160,200	
第115回利付国債(20年)	55,000,000	68,511,300	
第116回利付国債(20年)	55,000,000	68,702,700	
第117回利付国債(20年)	93,000,000	115,051,230	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	12,281,300	
第119回利付国債(20年)	30,000,000	36,108,000	

第120回利付国債(20年)	70,000,000	82,534,900	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	26,792,920	
第122回利付国債(20年)	17,000,000	20,491,460	
第123回利付国債(20年)	65,000,000	80,984,150	
第124回利付国債(20年)	80,000,000	98,656,000	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	63,089,500	
第126回利付国債(20年)	25,000,000	30,898,250	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	79,608,100	
第129回利付国債(20年)	50,000,000	60,579,500	
第130回利付国債(20年)	60,000,000	72,781,200	
第131回利付国債(20年)	12,000,000	14,395,920	
第132回利付国債(20年)	35,000,000	42,054,250	
第133回利付国債(20年)	30,000,000	36,453,600	
第134回利付国債(20年)	50,000,000	60,856,500	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	36,075,300	
第136回利付国債(20年)	180,000,000	213,971,400	
第137回利付国債(20年)	200,000,000	241,028,000	
第138回利付国債(20年)	120,000,000	141,157,200	
第139回利付国債(20年)	150,000,000	178,545,000	
第140回利付国債(20年)	340,000,000	410,043,400	
第141回利付国債(20年)	195,000,000	235,318,200	
第142回利付国債(20年)	55,000,000	67,212,750	
第143回利付国債(20年)	54,000,000	64,457,100	
第144回利付国債(20年)	90,000,000	106,035,300	
第145回利付国債(20年)	125,000,000	151,221,250	
第146回利付国債(20年)	75,000,000	90,773,250	
第147回利付国債(20年)	60,000,000	71,730,600	
第148回利付国債(20年)	120,000,000	141,625,200	
第149回利付国債(20年)	215,000,000	253,917,150	
第150回利付国債(20年)	90,000,000	104,853,600	
第151回利付国債(20年)	150,000,000	169,755,000	
第152回利付国債(20年)	90,000,000	101,767,500	
第153回利付国債(20年)	120,000,000	137,643,600	
第154回利付国債(20年)	120,000,000	135,558,000	
第155回利付国債(20年)	140,000,000	153,190,800	
第156回利付国債(20年)	110,000,000	108,706,400	
第157回利付国債(20年)	50,000,000	47,502,500	
第158回利付国債(20年)	170,000,000	170,144,500	
第159回利付国債(20年)	150,000,000	152,467,500	
第160回利付国債(20年)	140,000,000	144,530,400	
第161回利付国債(20年)	120,000,000	121,375,200	
第162回利付国債(20年)	110,000,000	110,977,900	
国債証券 合計	26,224,500,000	29,115,682,772	

地方債証券	第26回東京都公募公債(20年)	100,000,000	118,347,000	
	第690回東京都公募公債	100,000,000	103,752,000	
	第694回東京都公募公債	200,000,000	208,518,000	
	第708回東京都公募公債	100,000,000	103,854,000	
	第709回東京都公募公債	100,000,000	103,361,000	
	第712回東京都公募公債	200,000,000	207,000,000	
	第730回東京都公募公債	100,000,000	103,876,000	
	第731回東京都公募公債	100,000,000	103,696,000	
	平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	207,886,000	
	平成22年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	103,958,000	
	平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	104,429,000	
	平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	104,074,000	
	平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	103,372,000	
	第10回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	103,661,000	
	第83回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,057,000	
	第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,656,000	
	第99回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,999,000	
	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	103,729,000	
	平成25年度第1回島根県公募公債	200,000,000	200,377,340	
	平成26年度第1回栃木県公募公債	100,000,000	102,964,000	
	第3回川崎市公募公債(15年)	100,000,000	105,345,000	
	第51回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	99,929,000	
	平成22年度第2回福井県公募公債	100,000,000	104,557,000	
平成23年度第2回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	104,189,000		
地方債証券 合計	2,800,000,000	2,911,586,340		
特殊債券	第1回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	103,843,000	
	第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	104,941,000	
	第5回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,420,000	
	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,403,504	
	第6回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,440,000	
	第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,902,000	
	第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,977,000	
	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,144,000	
	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	103,405,000	
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	119,040,000	
	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	105,520,000	
	第56回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,820,000	
	第86回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,750,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,389,000	
	第135回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,104,000	
	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	104,053,000	

	第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,155,000	
	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	99,637,000	
	第1回地方公営企業等金融機構債券（20年）	100,000,000	119,267,000	
	第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	101,438,000	
	第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,480,000	
	F223回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,110,000	
	F290回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,609,000	
	第17回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	104,110,000	
	第298回信中金債（5年）	200,000,000	200,470,000	
	第316回信中金債（5年）	100,000,000	99,919,000	
	第318回信中金債（5年）	100,000,000	99,823,000	
	第320回信中金債（5年）	100,000,000	99,705,000	
	第322回信中金債（5年）	200,000,000	199,512,000	
特殊債券 合計		3,200,000,000	3,316,386,504	
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	103,281,000	
	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	100,317,000	
	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	100,263,000	
	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	100,314,000	
	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	103,346,000	
	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	99,450,000	
	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	103,059,000	
	第8回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,402,000	
	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	103,049,000	
	第7回株式会社セブン銀行無担保社債（社債間限定同順位特約付）	200,000,000	201,650,000	
	第43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	105,387,000	
	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	112,504,000	
	第87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	103,664,000	
	第563回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,719,000	
	第299回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,810,000	
	第19回沖縄電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,225,000	
社債券 合計		1,700,000,000	1,747,440,000	
合計		33,924,500,000	37,091,095,616	

## 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29年 6月26日現在	平成29年12月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	72,716,338	280,328,786
コール・ローン	279,550,821	51,079,470
国債証券	155,372,708,448	156,333,134,880
派生商品評価勘定	303,781	63,400
未収入金	622,078,834	-
未収利息	1,366,383,233	1,358,318,767
前払費用	25,521,838	26,071,325
流動資産合計	157,739,263,293	158,048,996,628
資産合計	157,739,263,293	158,048,996,628
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	22,902	4,500
未払金	131,800,171	-
未払解約金	120,424,456	116,575,995
未払利息	438	72
流動負債合計	252,247,967	116,580,567
負債合計	252,247,967	116,580,567
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	70,935,063,552	68,229,329,807
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	86,551,951,774	89,703,086,254
元本等合計	157,487,015,326	157,932,416,061
純資産合計	157,487,015,326	157,932,416,061
負債純資産合計	157,739,263,293	158,048,996,628

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

## （貸借対照表に関する注記）

		平成29年 6月26日現在	平成29年12月25日現在
1.	期首	平成28年12月27日	平成29年 6月27日
	期首元本額	72,453,501,529円	70,935,063,552円
	期首からの追加設定元本額	1,617,879,446円	1,224,053,253円
	期首からの一部解約元本額	3,136,317,423円	3,929,786,998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）	11,375,286,015円	11,567,602,293円
	DCインデックスバランス（株式20）	109,958,568円	125,242,375円
	DCインデックスバランス（株式40）	171,497,997円	191,755,522円
	DCインデックスバランス（株式60）	217,594,283円	257,544,310円
	DCインデックスバランス（株式80）	187,320,973円	211,633,950円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	24,232,032,717円	23,840,791,172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	2,707,775,849円	2,439,136,286円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	23,394,409,214円	21,583,845,086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	27,641,461円	27,002,128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）	978,409,675円	936,911,723円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	247,003,587円	309,287,835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）	112,785,347円	112,785,347円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	3,012,248円	3,002,414円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	3,265,225円	3,009,910円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	7,175,910円	6,945,836円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	16,443,470円	14,687,431円
	世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	797,377,534円	672,382,781円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,177,102,352円	1,115,217,944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）	28,552,229円	23,410,884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）	89,115,411円	80,178,974円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	56,981,586円	56,356,099円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	84,146,367円	82,042,952円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	79,359,228円	81,291,454円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	60,034,533円	61,984,897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	4,526,709,270円	4,183,028,204円
海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	244,072,503円	242,252,000円
計	70,935,063,552円	68,229,329,807円
2. 受益権の総数	70,935,063,552口	68,229,329,807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12月27日 至 平成29年 6月26日	自 平成29年 6月27日 至 平成29年12月25日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成29年 6月26日現在	平成29年12月25日現在



貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成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

(平成29年12月25日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	217,428,584
合計	217,428,584

(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

（平成29年12月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	107,606,400	-	107,547,500	58,900
	米ドル	107,606,400	-	107,547,500	58,900
合計		107,606,400	-	107,547,500	58,900

## （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29年 6月26日現在		平成29年12月25日現在	
1口当たり純資産額	2.2202円	1口当たり純資産額	2.3147円
(1万口当たり純資産額)	(22,202円)	(1万口当たり純資産額)	(23,147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-1.25%-18/11/30	3,100,000.00	3,085,045.60	
		US TREASURY N/B-1.5%-18/12/31	5,140,000.00	5,123,634.24	
		US TREASURY N/B-1.25%-18/12/31	2,000,000.00	1,988,868.00	
		US TREASURY N/B-1.125%-19/01/15	760,000.00	754,581.96	
		US TREASURY N/B-1.5%-19/01/31	3,000,000.00	2,989,218.00	
		US TREASURY N/B-1.25%-19/01/31	1,170,000.00	1,162,778.76	
		US TREASURY N/B-1.125%-19/01/31	1,500,000.00	1,488,457.50	
		US TREASURY N/B-8.875%-19/02/15	4,550,000.00	4,913,476.75	
		US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	4,650,000.00	4,697,862.45	
		US TREASURY N/B-0.75%-19/02/15	1,400,000.00	1,383,047.40	
		US TREASURY N/B-1.375%-19/02/28	3,000,000.00	2,983,710.00	

US TREASURY N/B-1.5%-19/02/28	4,000,000.00	3,983,908.00	
US TREASURY N/B-1.0%-19/03/15	1,070,000.00	1,059,049.62	
US TREASURY N/B-1.625%-19/03/31	2,000,000.00	1,994,376.00	
US TREASURY N/B-1.25%-19/03/31	1,500,000.00	1,488,633.00	
US TREASURY N/B-0.875%-19/04/15	1,200,000.00	1,184,929.20	
US TREASURY N/B-1.625%-19/04/30	3,900,000.00	3,887,890.50	
US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	4,000,000.00	4,070,080.00	
US TREASURY N/B-0.875%-19/05/15	3,000,000.00	2,960,097.00	
US TREASURY N/B-1.5%-19/05/31	4,100,000.00	4,079,020.30	
US TREASURY N/B-0.875%-19/06/15	3,000,000.00	2,957,169.00	
US TREASURY N/B-1.625%-19/06/30	2,510,000.00	2,501,076.95	
US TREASURY N/B-0.75%-19/07/15	2,650,000.00	2,604,504.80	
US TREASURY N/B-1.625%-19/07/31	3,000,000.00	2,988,573.00	
US TREASURY N/B-1.375%-19/07/31	800,000.00	793,718.40	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	4,320,000.00	4,440,908.16	
US TREASURY N/B-8.125%-19/08/15	4,110,000.00	4,522,122.03	
US TREASURY N/B-0.75%-19/08/15	9,000,000.00	8,837,406.00	
US TREASURY N/B-1.0%-19/08/31	3,300,000.00	3,251,981.70	
US TREASURY N/B-1.625%-19/08/31	3,600,000.00	3,584,250.00	
US TREASURY N/B-1.75%-19/09/30	7,450,000.00	7,431,665.55	
US TREASURY N/B-1.0%-19/10/15	5,100,000.00	5,019,516.90	
US TREASURY N/B-1.5%-19/10/31	4,100,000.00	4,070,693.20	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	10,530,000.00	10,822,039.02	
US TREASURY N/B-1.5%-19/11/30	5,000,000.00	4,962,010.00	
US TREASURY N/B-1.625%-19/12/31	1,900,000.00	1,889,090.20	
US TREASURY N/B-1.25%-20/01/31	4,000,000.00	3,945,312.00	
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	8,070,000.00	8,358,599.34	
US TREASURY N/B-1.375%-20/03/31	1,100,000.00	1,086,486.50	
US TREASURY N/B-1.375%-20/04/30	2,430,000.00	2,398,485.33	
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	7,830,000.00	8,114,448.24	
US TREASURY N/B-1.375%-20/05/31	2,440,000.00	2,407,164.92	
US TREASURY N/B-1.5%-20/05/31	5,100,000.00	5,046,409.20	
US TREASURY N/B-1.875%-20/06/30	710,000.00	708,724.13	
US TREASURY N/B-1.625%-20/06/30	4,000,000.00	3,967,968.00	
US TREASURY N/B-2.0%-20/07/31	5,370,000.00	5,375,139.09	

US TREASURY N/B-1.625%-20/07/31	4,000,000.00	3,966,016.00	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	5,610,000.00	6,586,712.22	
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	5,180,000.00	5,267,516.10	
US TREASURY N/B-2.125%-20/08/31	1,450,000.00	1,455,805.80	
US TREASURY N/B-1.375%-20/08/31	2,300,000.00	2,264,377.60	
US TREASURY N/B-1.375%-20/09/30	3,700,000.00	3,640,381.90	
US TREASURY N/B-1.75%-20/10/31	2,000,000.00	1,986,836.00	
US TREASURY N/B-1.375%-20/10/31	1,060,000.00	1,041,884.60	
US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	3,500,000.00	3,561,320.00	
US TREASURY N/B-1.75%-20/11/15	1,400,000.00	1,390,813.20	
US TREASURY N/B-1.625%-20/11/30	1,120,000.00	1,107,771.84	
US TREASURY N/B-2.375%-20/12/31	3,000,000.00	3,030,879.00	
US TREASURY N/B-1.75%-20/12/31	2,000,000.00	1,983,868.00	
US TREASURY N/B-2.125%-21/01/31	2,400,000.00	2,406,048.00	
US TREASURY N/B-1.375%-21/01/31	2,000,000.00	1,959,648.00	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	4,730,000.00	4,958,184.66	
US TREASURY N/B-2.0%-21/02/28	2,370,000.00	2,365,925.97	
US TREASURY N/B-1.125%-21/02/28	2,000,000.00	1,942,540.00	
US TREASURY N/B-2.25%-21/03/31	340,000.00	341,859.46	
US TREASURY N/B-1.25%-21/03/31	1,270,000.00	1,237,331.79	
US TREASURY N/B-2.25%-21/04/30	4,280,000.00	4,303,407.32	
US TREASURY N/B-1.375%-21/04/30	2,000,000.00	1,954,258.00	
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	4,320,000.00	4,466,473.92	
US TREASURY N/B-1.375%-21/05/31	2,060,000.00	2,010,873.12	
US TREASURY N/B-2.125%-21/06/30	6,050,000.00	6,053,309.35	
US TREASURY N/B-1.125%-21/06/30	3,900,000.00	3,771,194.70	
US TREASURY N/B-2.25%-21/07/31	6,900,000.00	6,930,725.70	
US TREASURY N/B-1.125%-21/07/31	5,000,000.00	4,827,830.00	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	3,900,000.00	3,900,078.00	
US TREASURY N/B-1.125%-21/08/31	4,400,000.00	4,243,162.00	
US TREASURY N/B-2.125%-21/09/30	2,400,000.00	2,398,312.80	
US TREASURY N/B-1.125%-21/09/30	1,500,000.00	1,444,864.50	
US TREASURY N/B-2.0%-21/10/31	4,830,000.00	4,803,396.36	
US TREASURY N/B-1.25%-21/10/31	2,000,000.00	1,934,258.00	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	10,460,000.00	12,743,836.40	

US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	4,000,000.00	3,980,468.00	
US TREASURY N/B-1.75%-21/11/30	600,000.00	590,683.80	
US TREASURY N/B-2.125%-21/12/31	4,800,000.00	4,792,780.80	
US TREASURY N/B-1.5%-22/01/31	800,000.00	778,656.00	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,500,000.00	2,482,910.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/02/28	2,900,000.00	2,849,250.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/03/31	1,800,000.00	1,766,250.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/04/30	3,000,000.00	2,942,343.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/04/30	500,000.00	492,832.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	2,000,000.00	1,963,046.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/05/31	3,420,000.00	3,372,174.72	
US TREASURY N/B-2.125%-22/06/30	2,500,000.00	2,489,550.00	
US TREASURY N/B-2.0%-22/07/31	3,930,000.00	3,891,313.08	
US TREASURY N/B-1.875%-22/07/31	9,700,000.00	9,545,973.70	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	2,000,000.00	1,948,204.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/08/31	1,900,000.00	1,869,050.90	
US TREASURY N/B-1.75%-22/09/30	3,550,000.00	3,470,125.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	3,000,000.00	2,949,141.00	
US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	1,000,000.00	971,855.00	
US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	1,000,000.00	988,281.00	
US TREASURY N/B-2.125%-22/12/31	3,900,000.00	3,873,948.00	
US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	2,000,000.00	1,949,766.00	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	5,800,000.00	5,723,991.00	
US TREASURY N/B-1.5%-23/02/28	1,000,000.00	962,148.00	
US TREASURY N/B-1.5%-23/03/31	2,000,000.00	1,922,540.00	
US TREASURY N/B-1.625%-23/04/30	660,000.00	637,983.06	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	8,150,000.00	7,926,038.00	
US TREASURY N/B-1.625%-23/05/31	1,500,000.00	1,448,437.50	
US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	4,000,000.00	3,808,124.00	
US TREASURY N/B-1.25%-23/07/31	2,000,000.00	1,888,984.00	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,500,000.00	5,557,255.00	
US TREASURY N/B-1.375%-23/08/31	1,850,000.00	1,757,427.85	
US TREASURY N/B-1.375%-23/09/30	2,500,000.00	2,373,145.00	
US TREASURY N/B-1.625%-23/10/31	1,700,000.00	1,635,651.60	
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	4,095,780.00	

US TREASURY N/B-2.125%-23/11/30	3,230,000.00	3,193,094.02	
US TREASURY N/B-2.25%-23/12/31	2,500,000.00	2,486,720.00	
US TREASURY N/B-2.25%-24/01/31	2,000,000.00	1,988,554.00	
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	3,300,000.00	3,374,121.30	
US TREASURY N/B-2.125%-24/02/29	1,500,000.00	1,479,990.00	
US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	3,000,000.00	2,958,165.00	
US TREASURY N/B-2.0%-24/04/30	2,000,000.00	1,956,680.00	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	5,800,000.00	5,842,253.00	
US TREASURY N/B-2.0%-24/05/31	4,330,000.00	4,233,168.21	
US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	1,100,000.00	1,074,584.50	
US TREASURY N/B-2.125%-24/07/31	180,000.00	177,169.86	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,616,031.42	
US TREASURY N/B-1.875%-24/08/31	1,420,000.00	1,376,151.82	
US TREASURY N/B-2.125%-24/09/30	2,400,000.00	2,360,109.60	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	5,930,000.00	5,873,825.11	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,970,000.00	4,835,944.19	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	4,703,904.00	
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	4,720,000.00	4,578,494.40	
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	5,940,000.00	5,859,138.78	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	2,274,046.20	
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,750,000.00	3,521,703.75	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	3,400,000.00	3,185,307.00	
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,699,532.00	
US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,450,000.00	3,239,838.35	
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	5,040,000.00	4,849,523.28	
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	4,800,000.00	4,709,529.60	
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	2,330,000.00	2,309,384.16	
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	5,090,000.00	4,986,611.92	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	4,760,000.00	6,276,226.60	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,000,000.00	1,260,176.00	
US TREASURY N/B-5.25%-29/02/15	1,000,000.00	1,265,176.00	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,260,000.00	1,758,905.82	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	1,460,000.00	1,925,004.16	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	1,900,000.00	2,572,459.40	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	1,170,000.00	1,475,456.58	

		US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	1,600,000.00	2,051,312.00	
		US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	2,200,000.00	2,740,889.80	
		US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,820,000.00	2,343,817.84	
		US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	1,750,000.00	2,218,910.75	
		US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	1,680,000.00	2,200,931.04	
		US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	2,019,268.20	
		US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,990,000.00	2,360,364.87	
		US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	2,010,000.00	2,513,442.69	
		US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	2,005,576.50	
		US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	2,070,000.00	2,637,672.66	
		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	1,960,000.00	2,285,810.80	
		US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	791,281.60	
		US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	1,976,680.00	
		US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	2,110,898.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	5,800,000.00	5,854,259.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	5,120,000.00	5,872,000.00	
		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	4,500,000.00	5,268,865.50	
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	3,000,000.00	3,444,609.00	
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	3,400,000.00	3,746,772.80	
		US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	5,650,000.00	5,961,190.70	
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	3,300,000.00	3,402,996.30	
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	3,085,371.30	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	3,200,000.00	3,298,249.60	
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	5,300,000.00	5,333,538.40	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	3,900,000.00	4,019,589.60	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	2,800,000.00	2,611,873.60	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	2,500,000.00	2,330,080.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	1,899,140.15	
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	1,500,000.00	1,509,286.50	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	1,800,000.00	1,856,566.80	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	2,680,000.00	2,763,487.36	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	2,000,000.00	1,962,656.00	
		米ドル小計	579,170,000.00	592,096,302.65 (67,043,064,349)	
加ドル	国債証券	CANADA GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	386,596.70	



		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-19/02/01	1,110,000.00	1,097,712.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/03/01	1,050,000.00	1,052,730.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-19/05/01	1,190,000.00	1,176,850.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	1,800,000.00	1,854,252.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-19/08/01	1,090,000.00	1,074,783.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/09/01	1,390,000.00	1,392,557.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-19/11/01	850,000.00	843,710.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-20/02/01	360,000.00	356,760.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-20/03/01	2,170,000.00	2,161,406.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	1,150,000.00	1,199,151.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-20/09/01	2,020,000.00	1,970,146.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/03/01	1,510,000.00	1,463,839.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	950,000.00	996,930.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/09/01	1,340,000.00	1,291,894.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-22/03/01	1,190,000.00	1,127,870.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	1,100,000.00	1,144,044.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-22/09/01	1,310,000.00	1,261,006.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-23/03/01	450,000.00	447,367.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,380,000.00	1,353,821.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,120,000.00	1,158,942.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	1,030,000.00	1,050,043.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	1,100,000.00	1,057,111.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	370,000.00	559,192.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	1,160,000.00	1,058,674.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	497,000.00	494,172.07	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	890,000.00	1,220,795.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	1,015,000.00	1,493,217.25	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	1,090,000.00	1,569,447.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	1,345,000.00	1,768,809.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,460,000.00	1,832,796.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	1,055,000.00	1,172,738.00	
		加ドル小計	35,877,000.00	38,089,368.32	(3,385,383,056)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-18/12/13	17,500,000.00	17,649,362.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11	17,200,000.00	16,378,415.34	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	20,900,000.00	21,071,429.11	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	25,100,000.00	24,204,406.90	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	14,100,000.00	13,459,410.91	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	8,200,000.00	8,308,640.16	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	23,000,000.00	25,806,185.15	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	7,150,000.00	6,297,220.93	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	9,200,000.00	9,034,076.16	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	11,750,000.00	12,406,238.67	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	11,900,000.00	11,879,720.61	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	5,800,000.00	5,772,599.06	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	7,800,000.00	9,438,854.88	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	10,300,000.00	10,897,462.31	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	15,500,000.00	15,180,520.20	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	3,100,000.00	3,110,465.91	
			208,500,000.00	210,895,008.80	
		メキシコペソ小計		(1,210,537,350)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	980,000.00	1,036,671.44	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-19/09/28	960,000.00	1,019,934.72	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	1,628,000.00	1,818,379.94	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	1,385,000.00	1,625,431.84	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	1,180,000.00	1,396,684.58	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,320,000.00	1,598,952.96	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	1,080,000.00	1,217,384.64	
		BELGIUM KINGDOM-0.2%-23/10/22	410,000.00	414,118.86	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	1,340,000.00	1,556,349.70	
		BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	420,000.00	429,005.64	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,320,000.00	1,369,580.52	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	970,000.00	1,302,199.78	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	1,210,000.00	1,268,484.14	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	830,000.00	845,950.10	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,760,000.00	2,629,765.60	

BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	750,000.00	754,581.75	
BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	760,000.00	1,072,480.84	
BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	590,000.00	757,811.34	
BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,585,000.00	2,563,816.75	
BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	220,000.00	226,630.58	
BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	530,000.00	585,351.61	
BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,430,000.00	2,254,736.77	
BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	815,000.00	1,225,555.43	
BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	650,000.00	646,220.25	
BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	260,000.00	291,850.78	
BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	280,000.00	302,060.36	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%- 19/01/31	1,290,000.00	1,299,128.04	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 19/04/30	1,860,000.00	1,938,324.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%- 19/07/30	1,870,000.00	2,018,268.56	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%- 19/10/31	1,850,000.00	2,009,451.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 20/01/31	1,480,000.00	1,531,617.96	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%- 20/04/30	2,280,000.00	2,506,114.44	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.15%- 20/07/30	1,180,000.00	1,221,041.58	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%- 20/10/31	1,790,000.00	2,043,870.33	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.05%- 21/01/31	190,000.00	190,676.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	2,250,000.00	2,665,570.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.75%- 21/07/30	1,725,000.00	1,772,075.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	2,060,000.00	2,546,456.64	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.4%- 22/04/30	1,630,000.00	1,648,476.05	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.45%- 22/10/31	280,000.00	282,275.84	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%-	1,815,000.00	2,279,351.41	

23/01/31			
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	1,750,000.00	2,141,657.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	1,510,000.00	1,892,643.06	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	1,680,000.00	2,010,751.68	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	1,960,000.00	2,223,212.32	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	1,660,000.00	1,748,006.56	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,850,000.00	2,356,130.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	1,690,000.00	1,831,696.36	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 26/04/30	1,660,000.00	1,764,523.56	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,620,000.00	2,243,781.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%- 26/10/31	1,525,000.00	1,534,375.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%- 27/04/30	1,495,000.00	1,515,136.15	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 27/10/31	1,200,000.00	1,199,947.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,395,000.00	1,886,542.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	2,010,000.00	2,905,048.98	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,630,000.00	1,654,234.84	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,700,000.00	2,524,981.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%- 33/07/30	700,000.00	722,264.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,630,000.00	2,122,330.09	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,420,000.00	2,023,894.76	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,430,000.00	1,997,253.83	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-	1,180,000.00	1,746,971.12	

44/10/31		
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%- 46/10/31	1,010,000.00	1,047,313.44
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%- 66/07/30	560,000.00	616,148.96
BUNDESobligation-1.0%-19/02/22	1,320,000.00	1,347,318.72
BUNDESobligation-0.25%-20/10/16	1,000,000.00	1,023,057.00
BUNDESobligation-0.0%-21/04/09	1,200,000.00	1,219,118.40
BUNDESobligation-0.0%-21/10/08	740,000.00	751,379.72
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 19/01/04	2,550,000.00	2,668,773.90
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%- 19/07/04	3,770,000.00	4,016,188.54
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 20/01/04	3,220,000.00	3,477,316.64
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%- 20/07/04	2,720,000.00	2,968,205.44
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 20/09/04	2,150,000.00	2,314,404.05
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 21/01/04	1,800,000.00	1,966,253.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	1,730,000.00	1,957,661.08
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 21/09/04	1,580,000.00	1,737,304.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	2,000,000.00	2,192,256.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 22/07/04	2,470,000.00	2,700,623.90
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	1,600,000.00	1,733,582.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	1,900,000.00	2,064,872.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	1,720,000.00	1,872,835.76
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	1,780,000.00	1,991,921.46
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	1,390,000.00	1,917,935.90
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	2,060,000.00	2,286,043.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-	1,950,000.00	2,136,888.00

24/05/15			
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	1,830,000.00	1,948,110.03	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	2,170,000.00	2,234,251.53	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	2,840,000.00	3,027,215.64	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	2,270,000.00	2,326,037.22	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 26/08/15	2,130,000.00	2,081,203.83	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15	2,370,000.00	2,350,667.91	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,410,000.00	2,217,552.12	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 27/08/15	1,730,000.00	1,743,976.67	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,150,000.00	1,736,664.45	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	980,000.00	1,408,652.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	830,000.00	1,378,755.33	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,320,000.00	2,122,049.16	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	2,150,000.00	3,454,744.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	1,775,000.00	2,727,603.45	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,060,000.00	1,730,218.92	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,280,000.00	2,245,514.24	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	1,220,000.00	1,789,589.94	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,690,000.00	2,212,977.26	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	1,770,000.00	2,340,961.29	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/12/01	1,960,000.00	2,031,681.12	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-	2,030,000.00	2,132,543.42	

19/02/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 19/03/01	2,320,000.00	2,452,112.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.1%- 19/04/15	1,000,000.00	1,005,359.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 19/05/01	1,400,000.00	1,453,188.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 19/08/01	730,000.00	751,015.97	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/09/01	2,940,000.00	3,162,693.24	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.05%- 19/10/15	470,000.00	472,425.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.05%- 19/12/01	1,100,000.00	1,126,536.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 20/02/01	2,540,000.00	2,788,389.14	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 20/03/01	2,670,000.00	2,927,735.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.7%- 20/05/01	750,000.00	763,976.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 20/06/15	400,000.00	403,954.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	2,550,000.00	2,824,300.95	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 20/11/01	940,000.00	956,530.84	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	2,000,000.00	2,230,190.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/05/01	1,200,000.00	1,342,950.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%- 21/06/01	540,000.00	545,138.64	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	3,360,000.00	3,781,848.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 21/09/01	3,050,000.00	3,550,999.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 21/11/01	770,000.00	771,826.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 21/12/15	1,060,000.00	1,134,312.36	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-	2,250,000.00	2,675,171.25	

22/03/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.2%- 22/04/01	810,000.00	834,341.31	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 22/04/15	970,000.00	1,004,542.67	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 22/08/01	120,000.00	121,654.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,900,000.00	2,331,231.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 22/09/15	1,310,000.00	1,359,900.52	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	2,000,000.00	2,462,080.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/15	960,000.00	967,555.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	1,300,000.00	1,549,280.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,700,000.00	2,060,656.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 23/10/15	380,000.00	373,313.14	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	2,740,000.00	3,985,349.18	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,650,000.00	1,983,339.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 24/05/15	795,000.00	828,793.06	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,500,000.00	1,741,869.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,400,000.00	1,511,272.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	3,160,000.00	3,948,457.92	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	690,000.00	692,851.77	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	2,060,000.00	2,129,010.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,430,000.00	1,750,796.19	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	1,230,000.00	1,225,110.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-	1,710,000.00	2,492,653.32	



26/11/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	1,470,000.00	1,413,487.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%- 27/06/01	680,000.00	701,210.56	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	460,000.00	466,411.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	3,160,000.00	4,472,152.08	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	1,050,000.00	1,323,598.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	2,870,000.00	3,803,797.55	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	1,240,000.00	1,408,642.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	3,110,000.00	4,438,694.63	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,485,000.00	1,361,314.35	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,740,000.00	2,460,133.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	490,000.00	487,636.24	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	2,080,000.00	2,770,836.64	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	900,000.00	847,066.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	2,710,000.00	3,236,309.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,770,000.00	2,373,221.31	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	1,820,000.00	2,426,746.14	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,560,000.00	2,040,848.16	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,240,000.00	1,290,702.36	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	1,270,000.00	1,183,091.36	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 48/03/01	700,000.00	742,288.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-	680,000.00	601,746.96	

67/03/01			
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	350,000.00	376,834.85	
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	740,000.00	806,471.24	
FINNISH GOVERNMENT-0.375%-20/09/15	300,000.00	307,056.00	
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	740,000.00	835,198.78	
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	300,000.00	325,564.50	
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	550,000.00	595,424.50	
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-23/09/15	250,000.00	249,915.00	
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	600,000.00	671,346.60	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	590,000.00	753,941.53	
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	320,000.00	334,328.00	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	410,000.00	414,334.52	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	270,000.00	268,120.26	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	462,800.10	
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	385,000.00	380,224.07	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	380,000.00	501,869.80	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-19/02/25	810,000.00	816,262.92	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25	3,530,000.00	3,760,816.11	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-19/05/25	1,470,000.00	1,503,602.73	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-19/10/25	1,050,000.00	1,226,033.55	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	4,050,000.00	4,375,210.95	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-19/11/25	1,650,000.00	1,684,008.15	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-20/02/25	1,000,000.00	1,011,201.00	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	3,180,000.00	3,477,457.20	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-20/05/25	1,600,000.00	1,619,091.20	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	3,480,000.00	3,772,045.08	
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-20/11/25	2,450,000.00	2,497,184.55	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	3,900,000.00	4,440,516.60	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	3,920,000.00	4,456,553.92	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	3,770,000.00	4,298,418.28	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	2,750,000.00	3,067,504.00	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	960,000.00	1,399,673.28	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	2,940,000.00	3,226,441.26	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	3,930,000.00	4,909,029.81	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	3,140,000.00	3,574,406.44	
	3,000,000.00	3,325,725.00	

FRANCE (GOVT OF) -1.75%-24/11/25			
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-25/05/25	3,230,000.00	3,290,501.13	
FRANCE (GOVT OF) -6.0%-25/10/25	2,530,000.00	3,666,612.62	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-25/11/25	2,645,000.00	2,784,473.49	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-26/04/25	3,320,000.00	4,183,930.40	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-26/05/25	1,990,000.00	2,006,570.73	
FRANCE (GOVT OF) -0.25%-26/11/25	2,280,000.00	2,231,454.24	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-27/05/25	2,280,000.00	2,366,624.04	
FRANCE (GOVT OF) -2.75%-27/10/25	3,330,000.00	4,007,355.30	
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/05/25	350,000.00	350,472.50	
FRANCE (GOVT OF) -5.5%-29/04/25	2,670,000.00	4,050,897.30	
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-30/05/25	2,600,000.00	3,091,808.20	
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-31/05/25	2,670,000.00	2,842,767.69	
FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	2,820,000.00	4,664,731.20	
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	2,390,000.00	3,745,574.54	
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-36/05/25	1,480,000.00	1,471,115.56	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	2,220,000.00	3,309,544.92	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-39/06/25	765,000.00	816,284.83	
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	2,605,000.00	4,206,048.63	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	2,030,000.00	2,778,984.74	
FRANCE (GOVT OF) -2.0%-48/05/25	1,170,000.00	1,255,854.60	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	1,220,000.00	1,964,163.40	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	1,110,000.00	1,834,679.04	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-66/05/25	545,000.00	528,449.98	
IRISH TREASURY -4.4%-19/06/18	600,000.00	644,165.40	
IRISH TREASURY -5.9%-19/10/18	570,000.00	636,799.44	
IRISH TREASURY -4.5%-20/04/18	935,000.00	1,044,994.33	
IRISH TREASURY -5.0%-20/10/18	700,000.00	809,062.80	
IRISH TREASURY -0.8%-22/03/15	480,000.00	499,369.44	
IRISH TREASURY -3.9%-23/03/20	510,000.00	612,710.94	
IRISH TREASURY -3.4%-24/03/18	670,000.00	802,302.89	
IRISH TREASURY -5.4%-25/03/13	965,000.00	1,308,918.28	
IRISH TREASURY -1.0%-26/05/15	1,025,000.00	1,058,340.17	
IRISH TREASURY -2.4%-30/05/15	785,000.00	910,372.35	
IRISH TREASURY -1.7%-37/05/15	415,000.00	433,074.91	

IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	615,000.00	655,781.26
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-19/01/15	1,050,000.00	1,071,924.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	1,380,000.00	1,481,316.84
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-20/01/15	1,340,000.00	1,364,473.76
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	1,380,000.00	1,523,910.54
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	1,540,000.00	1,742,269.76
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-22/01/15	700,000.00	708,301.30
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	1,500,000.00	1,671,046.50
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	500,000.00	599,100.50
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	970,000.00	1,344,919.55
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	950,000.00	1,045,877.80
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	1,580,000.00	1,778,835.10
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	1,165,000.00	1,166,808.08
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	925,000.00	936,285.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	880,000.00	899,066.96
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	1,195,000.00	1,780,995.73
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	1,150,000.00	1,416,877.05
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,275,000.00	1,950,174.97
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,335,000.00	2,084,566.45
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,105,000.00	1,515,310.81
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	205,000.00	182,396.29
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	300,000.00	325,944.00
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	980,000.00	1,039,157.70
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.95%-19/06/18	530,000.00	550,043.01
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-19/10/18	610,000.00	619,068.87
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	1,218,000.00	1,354,903.20
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	1,330,000.00	1,522,131.80
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	780,000.00	910,977.60
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	940,000.00	1,103,544.02
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/07/15	130,000.00	129,850.24
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	1,170,000.00	1,288,483.56
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	890,000.00	980,279.82
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	900,000.00	962,091.00
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	700,000.00	960,526.00
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	960,000.00	982,963.20

		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	495,000.00	492,052.77	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	800,000.00	1,235,019.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	570,000.00	686,809.53	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,090,000.00	1,663,564.54	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	630,000.00	885,610.53	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	320,000.00	324,788.16	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	273,000.00	464,997.07	
			408,839,000.00	481,117,760.02	
				(64,508,269,263)	
ユーロ小計					
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-4.5%-19/03/07	1,850,000.00	1,940,193.05	
		UK TREASURY-1.75%-19/07/22	2,093,000.00	2,135,736.96	
		UK TREASURY-3.75%-19/09/07	1,490,000.00	1,574,110.50	
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	1,610,000.00	1,761,645.90	
		UK TREASURY-2.0%-20/07/22	1,870,000.00	1,941,907.11	
		UK TREASURY-3.75%-20/09/07	1,610,000.00	1,750,870.17	
		UK TREASURY-1.5%-21/01/22	2,330,000.00	2,397,010.80	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	1,020,000.00	1,277,598.96	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	1,110,000.00	1,237,983.00	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	1,210,000.00	1,378,107.72	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	2,130,000.00	2,228,597.70	
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	1,610,000.00	1,734,333.86	
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	1,230,000.00	1,372,837.44	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,805,000.00	2,307,566.15	
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	1,290,000.00	1,327,638.33	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	605,000.00	603,844.45	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	1,190,000.00	1,524,449.50	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	1,000,000.00	1,477,900.00	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,300,000.00	1,802,235.50	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,460,000.00	1,965,945.48	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	2,000,000.00	2,824,160.00	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,670,000.00	2,330,341.38	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,490,000.00	2,265,694.00	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,310,000.00	1,885,713.56	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	1,560,000.00	2,272,998.00	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	2,215,000.00	3,396,768.95	

		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,380,000.00	1,777,152.96	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,740,000.00	2,349,991.80	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,560,000.00	2,402,493.60	
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	715,000.00	663,477.81	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	1,340,000.00	2,142,124.00	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,530,000.00	2,326,288.50	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,580,000.00	2,705,492.46	
		UK TREASURY-1.75%-57/07/22	545,000.00	555,431.30	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,220,000.00	2,081,588.40	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	1,660,000.00	2,726,882.00	
		UNITED KINGDOM GILT-0.5%-22/07/22	1,565,000.00	1,548,019.75	
		UNITED KINGDOM GILT-0.75%-23/07/22	525,000.00	520,855.12	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	1,180,000.00	1,262,954.00	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	1,142,000.00	1,467,983.90	
英bond小計			57,740,000.00	73,246,924.07	(11,101,303,812)
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-3.0%-19/05/12	400,000.00	421,820.00	
		SWITZERLAND-2.25%-20/07/06	400,000.00	430,924.00	
		SWITZERLAND-2.0%-21/04/28	220,000.00	239,882.72	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	651,000.00	803,431.65	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	385,000.00	548,066.75	
スイスフラン小計			2,056,000.00	2,444,125.12	(280,047,856)
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	7,940,000.00	8,428,333.82	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	8,010,000.00	9,291,840.30	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	8,500,000.00	9,870,081.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	6,820,000.00	7,367,502.78	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	4,950,000.00	5,736,792.60	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	5,090,000.00	5,306,243.56	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,150,000.00	3,157,027.65	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	3,840,000.00	5,292,111.36	
スウェーデンクローナ小計			48,300,000.00	54,449,933.07	(731,262,601)
ノルウェーク	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	6,780,000.00	7,169,070.30	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	6,700,000.00	7,344,198.30	

ローネ		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	4,900,000.00	5,115,683.30	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	4,190,000.00	4,622,621.69	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	3,270,000.00	3,349,997.28	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	3,250,000.00	3,262,662.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,580,000.00	2,626,029.78	
ノルウェークローネ小計			31,670,000.00	33,490,262.65	(454,127,961)
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	7,920,000.00	8,608,263.84	
		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	7,570,000.00	8,550,277.15	
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	6,140,000.00	6,689,800.16	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	8,190,000.00	9,187,705.80	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	2,130,000.00	2,137,676.52	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	11,030,000.00	18,701,133.37	
デンマーククローネ小計			42,980,000.00	53,874,856.84	(970,824,920)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-19/04/25	840,000.00	822,864.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-19/07/25	2,190,000.00	2,245,626.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	1,700,000.00	1,815,005.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.5%-20/04/25	2,570,000.00	2,548,026.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-20/07/25	220,000.00	209,880.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	1,590,000.00	1,732,464.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25	2,410,000.00	2,393,853.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-21/07/25	2,430,000.00	2,389,783.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	1,410,000.00	1,589,140.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-22/04/25	1,980,000.00	1,961,190.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	2,070,000.00	2,367,562.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-23/01/25	530,000.00	526,237.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	2,370,000.00	2,527,368.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,580,000.00	2,605,026.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	2,900,000.00	2,745,140.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,320,000.00	2,168,272.00	
POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	700,000.00	870,534.00			
ポーランドズロチ小計			30,810,000.00	31,517,972.00	(1,009,205,463)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	1,707,000.00	1,775,612.86	

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-19/10/21	1,850,000.00	1,874,671.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	2,340,000.00	2,466,558.90	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-20/11/21	2,120,000.00	2,095,342.28	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	2,510,000.00	2,797,668.59	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.0%-21/12/21	1,155,000.00	1,142,388.55	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	2,050,000.00	2,350,357.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-22/11/21	460,000.00	456,961.24	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	2,020,000.00	2,328,656.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	2,150,000.00	2,178,061.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	2,330,000.00	2,431,091.71	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	2,660,000.00	2,975,933.52	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	2,330,000.00	2,723,553.31	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	2,020,000.00	2,026,922.54	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	1,670,000.00	1,595,157.28	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	1,450,000.00	1,446,399.65	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,620,000.00	1,690,883.10	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,145,000.00	1,357,746.72	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	630,000.00	598,256.82	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	930,000.00	1,005,542.04	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	625,000.00	622,849.37	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	900,000.00	827,136.00	
豪ドル小計			36,672,000.00	38,767,751.68	(3,387,913,819)
シンガ ポールド ル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01	770,000.00	779,490.25	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-19/10/01	450,000.00	450,000.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-20/07/01	220,000.00	221,958.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	365,000.00	380,439.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	640,000.00	652,032.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-21/10/01	240,000.00	236,136.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-22/04/01	210,000.00	210,514.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	380,000.00	403,750.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	455,000.00	477,067.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	576,990.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	200,000.00	205,800.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	200,000.00	202,200.00	



		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	540,000.00	606,406.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	200,000.00	215,300.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	330,000.00	354,090.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	355,000.00	404,236.72	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	145,000.00	143,365.12	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	425,000.00	453,475.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	280,000.00	299,685.40	
シンガポールドル小計			6,945,000.00	7,272,936.49	(612,963,087)
マレーシ アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.759%-19/03/15	100,000.00	100,820.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.659%-20/10/15	1,010,000.00	1,018,828.41	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	460,000.00	467,193.02	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.62%-21/11/30	850,000.00	853,088.05	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	480,000.00	480,775.68	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	600,000.00	599,325.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	980,000.00	973,400.68	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	450,000.00	443,475.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	300,000.00	298,625.70	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	600,000.00	576,374.40	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	440,000.00	448,453.72	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	590,000.00	592,318.70	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	1,040,000.00	1,016,335.84	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	1,220,000.00	1,269,815.04	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	2,670,000.00	2,730,205.83	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.492%-20/03/31	550,000.00	553,574.45	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.889%-20/07/31	800,000.00	811,995.20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	2,130,000.00	2,183,354.37	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	650,000.00	640,380.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,750,000.00	1,730,365.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	954,283.30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,270,000.00	1,294,375.11	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	439,388.55	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	650,000.00	610,174.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	430,000.00	410,089.71	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000.00	804,589.50	

		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	1,210,000.00	1,212,502.28	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,014,837.16	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	450,000.00	433,091.25	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	680,000.00	636,383.44	
マレーシアリングット小計			25,535,000.00	25,598,418.89	(711,380,060)
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 18/12/21	3,500,000.00	3,526,320.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	4,850,000.00	4,836,651.83	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	4,650,000.00	4,528,367.39	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	6,100,000.00	6,034,224.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	15,600,000.00	17,324,476.26	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	7,000,000.00	6,358,883.65	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	10,150,000.00	8,378,260.15	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	6,920,000.00	6,280,754.62	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	5,010,000.00	4,687,524.08	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	8,300,000.00	5,936,697.01	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	8,800,000.00	7,858,292.20	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%- 40/01/31	4,310,000.00	3,987,844.09	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	7,450,000.00	5,219,930.03	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	7,850,000.00	7,027,946.03	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	12,900,000.00	11,572,631.28			
南アフリカランド小計			113,390,000.00	103,558,802.62	(926,851,283)
合計				156,333,134,880	(156,333,134,880)

(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 183銘柄	100.0%	42.7%
加ドル	国債証券 32銘柄	100.0%	2.2%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 280銘柄	100.0%	41.3%
英ポンド	国債証券 40銘柄	100.0%	7.1%
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 6銘柄	100.0%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券 17銘柄	100.0%	0.6%
豪ドル	国債証券 22銘柄	100.0%	2.2%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 30銘柄	100.0%	0.5%
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29年 6月26日現在

平成29年12月25日現在

資産の部  
流動資産

	平成29年 6月26日現在	平成29年12月25日現在
預金	16,395,875	9,522,918
コール・ローン	11,562,412	43,044,075
国債証券	2,960,181,058	3,540,165,479
派生商品評価勘定	-	4,029
未収利息	52,171,982	53,972,127
前払費用	5,910,774	4,282,222
流動資産合計	3,046,222,101	3,650,990,850
資産合計	3,046,222,101	3,650,990,850
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,369	99,681
未払金	8,840,460	21,624,583
未払解約金	2,559,035	851,572
未払利息	18	60
流動負債合計	11,402,882	22,575,896
負債合計	11,402,882	22,575,896
純資産の部		
元本等		
元本	2,335,188,029	2,671,902,859
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	699,631,190	956,512,095
元本等合計	3,034,819,219	3,628,414,954
純資産合計	3,034,819,219	3,628,414,954
負債純資産合計	3,046,222,101	3,650,990,850

## 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29年 6月26日現在	平成29年12月25日現在
1.	期首	平成28年12月27日	平成29年 6月27日
	期首元本額	2,093,872,199円	2,335,188,029円
	期首からの追加設定元本額	308,064,124円	433,860,279円
	期首からの一部解約元本額	66,748,294円	97,145,449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	34,792,954円	34,397,093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）	2,251,602,428円	2,603,891,771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）	48,792,647円	33,613,995円
	計	2,335,188,029円	2,671,902,859円
2.	受益権の総数	2,335,188,029口	2,671,902,859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12月27日 至 平成29年 6月26日	自 平成29年 6月27日 至 平成29年12月25日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成29年 6月26日現在	平成29年12月25日現在

貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成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

(平成29年12月25日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	11,111,123
合計	11,111,123

(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

（平成29年12月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	34,031,190	-	33,934,439	96,751
	米ドル	12,112,400	-	12,113,470	1,070
	メキシコペソ	4,515,240	-	4,515,240	-
	ブラジルリアル	12,443,860	-	12,344,179	99,681
	ポーランドズロチ	4,959,690	-	4,961,550	1,860
	売建	12,443,860	-	12,442,761	1,099
	米ドル	12,443,860	-	12,442,761	1,099
合計		46,475,050	-	46,377,200	95,652

## （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29年 6月26日現在		平成29年12月25日現在	
1口当たり純資産額	1.2996円	1口当たり純資産額	1.3580円
(1万口当たり純資産額)	(12,996円)	(1万口当たり純資産額)	(13,580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	2,052,566.60	
		REPUBLIC OF ARGENTINA-16.0%-23/10/17	1,200,000.00	1,189,666.68	
		REPUBLIC OF ARGENTINA-15.5%-26/10/17	1,900,000.00	1,909,236.09	
アルゼンチンペソ小計			5,100,000.00	5,151,469.37 (32,299,712)	
メキシコペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11	4,570,000.00	4,351,706.86	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	7,180,000.00	7,238,892.87	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	6,800,000.00	6,557,369.20	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	4,850,000.00	4,629,655.52	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	2,230,000.00	2,259,544.82	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	6,110,000.00	6,855,469.18	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%-26/03/05	4,100,000.00	3,610,993.82	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	3,730,000.00	3,662,728.70	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	2,360,000.00	2,491,806.23	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	2,950,000.00	2,944,972.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-34/11/23	2,000,000.00	1,990,551.40	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	1,780,000.00	2,153,995.08	



		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	2,390,000.00	2,528,634.45	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	4,260,000.00	4,172,194.58	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	1,100,000.00	1,103,713.71	
メキシコペソ小計			56,410,000.00	56,552,229.17	(324,609,795)
ブラジル リアル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL-10.25%-28/01/10	250,000.00	271,250.00	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-19/01/01	1,110,000.00	1,038,072.00	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-19/04/01	1,100,000.00	1,008,590.00	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-19/07/01	600,000.00	538,500.00	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-20/01/01	950,000.00	811,015.00	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-20/07/01	2,360,000.00	1,912,779.91	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-21/07/01	950,000.00	691,220.00	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL-10.0%-19/01/01	200,000.00	205,790.60	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL-10.0%-21/01/01	1,200,000.00	1,230,303.64	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL-10.0%-23/01/01	1,360,000.00	1,368,912.12	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL-10.0%-25/01/01	1,040,000.00	1,029,031.15	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL-10.0%-27/01/01	350,000.00	343,158.56	
ブラジルリアル小計			11,470,000.00	10,448,622.98	(354,730,750)
チリペソ	国債証券	REPUBLIC OF CHILE-5.5%-20/08/05	442,000,000.00	464,358,768.90	
チリペソ小計			442,000,000.00	464,358,768.90	(84,513,295)
コロンビア アペソ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA-7.75%-21/04/14	60,000,000.00	63,530,838.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA-4.375%-23/03/21	30,000,000.00	28,334,467.50	
		REPUBLIC OF COLOMBIA-9.85%-27/06/28	97,000,000.00	121,196,451.15	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-19/09/11	437,000,000.00	452,227,265.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-11.0%-20/07/24	625,000,000.00	709,906,250.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-22/05/04	1,055,000,000.00	1,104,985,900.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-10.0%-24/07/24	1,105,000,000.00	1,333,016,750.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.5%-26/08/26	1,210,000,000.00	1,289,376,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-6.0%-28/04/28	450,000,000.00	429,048,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.75%-30/09/18	505,000,000.00	547,460,400.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-32/06/30	250,000,000.00	251,648,750.00	
コロンビアアペソ小計			5,824,000,000.00	6,330,731,071.65	(242,467,000)
ペルーヌ エボソル	国債証券	BONOS DE TESORERIA-5.7%-24/08/12	280,000.00	300,700.82	
		BONOS DE TESORERIA-6.35%-28/08/12	610,000.00	663,645.53	
		BONOS DE TESORERIA-6.15%-32/08/12	350,000.00	370,447.00	

		PERU BONO SOBERANO-7.84%-20/08/12	125,000.00	138,840.06	
		PERU BONO SOBERANO-8.2%-26/08/12	440,000.00	540,206.04	
		PERU BONO SOBERANO-6.95%-31/08/12	520,000.00	589,731.22	
		PERU BONO SOBERANO-6.9%-37/08/12	200,000.00	223,654.30	
ペルーヌエボソル小計			2,525,000.00	2,827,224.97	(99,009,418)
ウルグアイ ペソ	国債証券	REPUBLICA ORIENT URUGUAY-9.875%- 22/06/20	1,300,000.00	1,379,105.00	
		REPUBLICA ORIENT URUGUAY-8.5%- 28/03/15	1,300,000.00	1,296,750.00	
ウルグアイペソ小計			2,600,000.00	2,675,855.00	(10,542,868)
トルコリ ラ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND-10.4%-19/03/27	240,000.00	232,080.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.5%-19/07/10	570,000.00	534,660.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.5%-20/01/15	495,000.00	473,962.50	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-7.4%-20/02/05	460,000.00	412,160.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.4%-20/07/08	450,000.00	414,787.50	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.7%-21/02/17	610,000.00	575,230.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.2%-21/09/22	580,000.00	521,420.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.5%-22/01/12	480,000.00	434,160.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-11.0%-22/03/02	590,000.00	560,500.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.7%-22/08/17	500,000.00	470,000.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.5%-22/09/14	360,000.00	312,120.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-7.1%-23/03/08	610,000.00	492,422.50	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.8%-23/09/27	470,000.00	406,315.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.4%-24/03/20	270,000.00	252,045.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.0%-24/07/24	430,000.00	378,830.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.0%-25/03/12	620,000.00	503,905.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.6%-26/02/11	810,000.00	754,515.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-11.0%-27/02/24	570,000.00	542,355.00	
TURKEY GOVERNMENT BOND-10.5%-27/08/11	380,000.00	354,160.00			
トルコリラ小計			9,495,000.00	8,625,627.50	(256,698,674)
チェココ ルナ	国債証券	CZECH REPUBLIC-1.5%-19/10/29	2,980,000.00	3,048,540.00	
		CZECH REPUBLIC-0.0%-20/02/10	1,400,000.00	1,391,880.00	
		CZECH REPUBLIC-3.75%-20/09/12	2,650,000.00	2,895,628.50	
		CZECH REPUBLIC-3.85%-21/09/29	2,840,000.00	3,212,324.00	
		CZECH REPUBLIC-4.7%-22/09/12	2,170,000.00	2,574,932.85	
		CZECH REPUBLIC-0.45%-23/10/25	1,600,000.00	1,556,720.00	
		CZECH REPUBLIC-5.7%-24/05/25	2,620,000.00	3,399,594.10	
		CZECH REPUBLIC-2.4%-25/09/17	2,200,000.00	2,395,503.00	
		CZECH REPUBLIC-1.0%-26/06/26	1,800,000.00	1,754,172.00	
		CZECH REPUBLIC-2.5%-28/08/25	2,910,000.00	3,157,102.65	

		CZECH REPUBLIC-0.95%-30/05/15	1,410,000.00	1,284,143.40	
チェココルナ小計			24,580,000.00	26,670,540.50 (139,220,221)	
ハンガリーフォロント	国債証券	HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.5%-19/06/24	32,300,000.00	35,416,594.70	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.0%-19/10/30	13,500,000.00	13,986,918.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.5%-20/06/24	28,000,000.00	30,180,360.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-1.0%-20/09/23	9,000,000.00	9,120,753.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-7.5%-20/11/12	27,200,000.00	32,579,371.20	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.5%-21/10/27	25,000,000.00	26,542,787.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-7.0%-22/06/24	31,800,000.00	40,176,708.30	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-1.75%-22/10/26	31,000,000.00	31,937,471.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.0%-23/11/24	37,000,000.00	46,926,989.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-24/06/26	29,000,000.00	31,755,493.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-5.5%-25/06/24	39,800,000.00	50,226,266.70	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-27/10/27	23,000,000.00	24,964,993.50	
ハンガリーフォロント小計			326,600,000.00	373,814,705.90 (161,114,138)	
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-19/04/25	540,000.00	528,984.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-19/07/25	600,000.00	615,240.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	490,000.00	523,148.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.5%-20/04/25	870,000.00	862,561.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	520,000.00	566,592.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25	710,000.00	705,243.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-21/07/25	820,000.00	806,429.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	450,000.00	507,172.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-22/04/25	790,000.00	782,495.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	610,000.00	697,687.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-23/01/25	250,000.00	248,225.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	660,000.00	703,824.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	780,000.00	787,566.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	970,000.00	918,202.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	830,000.00	775,718.00	
ポーランドズロチ小計			9,890,000.00	10,029,088.00 (321,131,397)	
ロシアルーブル	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-7.5%-19/02/27	5,300,000.00	5,337,179.50	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-6.7%-19/05/15	8,200,000.00	8,182,862.00	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-6.8%-19/12/11	5,000,000.00	4,993,725.00	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-6.4%-20/05/27	7,900,000.00	7,818,709.00	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-7.6%-21/04/14	5,300,000.00	5,400,938.50	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-7.5%-21/08/18	10,800,000.00	10,976,040.00	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-7.6%-22/07/20	4,800,000.00	4,914,456.00	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-7.4%-22/12/07	12,400,000.00	12,578,002.00	

		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-7.0%-23/01/25	5,400,000.00	5,399,811.00	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-7.0%-23/08/16	9,900,000.00	9,910,543.50	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-7.1%-24/10/16	10,200,000.00	10,158,945.00	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-7.75%-26/09/16	13,700,000.00	14,067,160.00	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-8.15%-27/02/03	11,500,000.00	12,123,472.50	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-7.05%-28/01/19	8,200,000.00	7,984,299.00	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-8.5%-31/09/17	8,750,000.00	9,463,868.75	
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-7.7%-33/03/23	9,300,000.00	9,326,691.00	
ロシアルーブル小計			136,650,000.00	138,636,702.75 (268,955,203)	
ルーマニア アレイ	国債証券	ROMANIA GOVERNMENT BOND-2.5%-19/04/29	290,000.00	288,650.05	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.75%- 19/06/24	305,000.00	313,056.57	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-2.25%- 20/02/26	285,000.00	279,347.02	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.75%- 20/04/29	300,000.00	316,221.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.25%- 21/03/22	320,000.00	317,428.80	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.95%- 21/06/11	370,000.00	397,613.10	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.4%-22/03/08	180,000.00	177,149.70	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.5%-22/12/19	280,000.00	274,712.20	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.85%- 23/04/26	360,000.00	392,106.60	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.25%- 24/04/29	150,000.00	143,150.25	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.75%- 25/02/24	340,000.00	353,326.30	
ルーマニアアレイ小計			3,420,000.00	3,520,361.59 (101,949,671)	
マレーシ アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.759%-19/03/15	270,000.00	272,214.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.654%-19/10/31	410,000.00	413,927.39	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.659%-20/10/15	400,000.00	403,496.40	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.62%-21/11/30	280,000.00	281,017.24	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	350,000.00	349,606.25	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	400,000.00	403,372.80	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	500,000.00	496,633.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	350,000.00	344,925.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	200,000.00	199,083.80	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	210,000.00	214,034.73	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.226%- 20/04/15	300,000.00	298,290.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.39%- 23/07/07	400,000.00	407,484.00	

		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	580,000.00	593,078.42
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.492%-20/03/31	360,000.00	362,339.64
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	450,000.00	461,272.05
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	360,000.00	354,672.00
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	490,000.00	484,502.20
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	380,000.00	385,774.10
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	460,000.00	451,038.74
マレーシアリングット小計			7,150,000.00	7,176,761.76 (199,442,209)
タイバーツ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND-3.45%-19/03/08	2,350,000.00	2,406,456.40
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.875%-19/06/13	9,150,000.00	9,476,572.65
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.55%-20/06/26	6,100,000.00	6,252,524.40
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.65%-21/12/17	10,220,000.00	10,978,170.70
		THAILAND GOVERNMENT BOND-1.875%-22/06/17	7,000,000.00	7,024,955.00
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.0%-22/12/17	2,900,000.00	2,917,576.90
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.625%-23/06/16	7,800,000.00	8,473,537.80
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.85%-25/12/12	7,570,000.00	8,438,218.44
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.125%-26/12/17	5,900,000.00	5,778,442.30
		THAILAND GOVERNMENT BOND-4.875%-29/06/22	8,080,000.00	9,878,090.88
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.65%-31/06/20	5,800,000.00	6,351,812.00
THAILAND GOVERNMENT BOND-3.4%-36/06/17	4,000,000.00	4,293,976.00		
タイバーツ小計			76,870,000.00	82,270,333.47 (284,655,353)
フィリピンペソ	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES-4.95%-21/01/15	5,000,000.00	5,155,000.00
フィリピンペソ小計			5,000,000.00	5,155,000.00 (11,650,300)
インドネシアルピア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT-7.875%-19/04/15	1,600,000,000.00	1,651,945,600.00
		INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-20/11/15	500,000,000.00	568,965,500.00
		INDONESIA GOVERNMENT-12.8%-21/06/15	500,000,000.00	608,653,000.00
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-21/07/15	2,630,000,000.00	2,833,825,000.00
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-22/05/15	2,250,000,000.00	2,346,750,000.00
		INDONESIA GOVERNMENT-5.625%-23/05/15	1,150,000,000.00	1,130,996,250.00
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-24/03/15	3,850,000,000.00	4,290,089,650.00
		INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-25/09/15	760,000,000.00	973,028,000.00
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-26/09/15	3,290,000,000.00	3,711,120,000.00

		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-27/05/15	3,400,000,000.00	3,563,200,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.125%-28/05/15	800,000,000.00	779,360,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.0%-29/03/15	2,650,000,000.00	3,129,607,600.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-10.5%-30/08/15	810,000,000.00	1,048,262,310.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.75%-31/05/15	1,900,000,000.00	2,204,950,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.5%-31/07/15	820,000,000.00	992,590,320.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-32/06/15	1,100,000,000.00	1,217,814,400.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.5%-32/08/15	1,100,000,000.00	1,157,200,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.625%-33/05/15	1,280,000,000.00	1,250,490,880.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-34/03/15	2,600,000,000.00	2,892,500,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-36/05/15	2,260,000,000.00	2,513,120,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.5%-38/05/15	450,000,000.00	469,125,000.00	
		PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-8.25%-20/09/15	750,000,000.00	797,009,250.00	
		PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-8.875%-31/11/15	590,000,000.00	672,870,220.00	
インドネシアルピア小計			37,040,000,000.00	40,803,472,980.00 (342,749,173)	
南アフリカランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%-20/01/15	1,600,000.00	1,595,596.48	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%-21/03/31	1,490,000.00	1,451,025.25	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%-23/02/28	2,050,000.00	2,027,894.94	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%-26/12/21	5,400,000.00	5,996,934.09	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%-30/01/31	2,530,000.00	2,298,282.23	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%-31/02/28	2,940,000.00	2,426,806.38	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%-32/03/31	2,750,000.00	2,495,964.62	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%-35/02/28	2,100,000.00	1,964,830.45	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%-36/03/31	2,590,000.00	1,852,535.57	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%-37/01/31	2,810,000.00	2,509,295.57	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%-40/01/31	1,720,000.00	1,591,436.62	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%-41/02/28	2,540,000.00	1,779,680.84	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%-44/01/31	2,580,000.00	2,309,821.74	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%-48/02/28	4,140,000.00	3,714,007.24	
南アフリカランド小計			37,240,000.00	34,014,112.02 (304,426,302)	
				3,540,165,479	

合計	(3,540,165,479)
----	-----------------

(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%	0.9%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	9.2%
ブラジルレアル	国債証券 12銘柄	100.0%	10.0%
チリペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	2.4%
コロンビアペソ	国債証券 11銘柄	100.0%	6.8%
ペルーヌエボソル	国債証券 7銘柄	100.0%	2.8%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.3%
トルコリラ	国債証券 19銘柄	100.0%	7.3%
チェココルナ	国債証券 11銘柄	100.0%	3.9%
ハンガリーフォリント	国債証券 12銘柄	100.0%	4.6%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	9.1%
ロシアルーブル	国債証券 16銘柄	100.0%	7.6%
ルーマニアレイ	国債証券 12銘柄	100.0%	2.9%
マレーシアリングット	国債証券 19銘柄	100.0%	5.6%
タイバーツ	国債証券 12銘柄	100.0%	8.0%
フィリピンペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.3%
インドネシアルピア	国債証券 23銘柄	100.0%	9.7%
南アフリカランド	国債証券 14銘柄	100.0%	8.6%

#### 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。

#### 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2017年12月29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	238,212,362円
------	--------------

負債総額	32,124円
純資産総額（ - ）	238,180,238円
発行済口数	226,288,210口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0526円

（参考）

#### 日本株式インデックストップIXマザーファンド

##### 純資産額計算書

資産総額	29,129,864,295円
負債総額	72,194,868円
純資産総額（ - ）	29,057,669,427円
発行済口数	18,049,408,628口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6099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	85,563,899,721円
負債総額	84,449,044円
純資産総額（ - ）	85,479,450,677円
発行済口数	34,733,222,584口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4610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	16,057,712,958円
負債総額	38,314,338円
純資産総額（ - ）	16,019,398,620円
発行済口数	8,191,264,071口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9557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	37,236,022,984円
負債総額	7,754,568円
純資産総額( - )	37,228,268,416円
発行済口数	26,805,251,019口
1口当たり純資産額( / )	1.3888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	158,680,919,481円
負債総額	64,534,740円
純資産総額( - )	158,616,384,741円
発行済口数	68,249,769,688口
1口当たり純資産額( / )	2.3241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	3,724,844,548円
負債総額	50,193,614円
純資産総額( - )	3,674,650,934円
発行済口数	2,690,473,270口
1口当たり純資産額( / )	1.3658円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

<更新後>

##### (1) 資本金の額

平成29年12月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の意思決定機関（平成29年12月末現在）

###### ・株主総会

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

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

###### ・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。

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

###### ・監査役会

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

##### (3) 運用の意思決定プロセス（平成29年12月末現在）

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

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

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

・委託会社の運用する、平成29年12月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	775	171,954
株式投資信託	728	141,383
単位型	218	8,932
追加型	510	132,451
公社債投資信託	47	30,570
単位型	33	519
追加型	14	30,050

### 3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第59期中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

#### (1)【貸借対照表】

<更新後>

	(単位：百万円)	
	第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
金銭の信託	3	153
有価証券		86
前払費用	3	489
未収入金		10
未収委託者報酬		9,374
未収収益	3	2,280
関係会社短期貸付金		5,333
立替金		2,960
		3
		16,761
		3
		152
		10
		506
		136
		10,757
		2,799
		962
		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】

&lt; 更新後 &gt;

( 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】

&lt; 更新後 &gt;

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	
	資本剰余金	利益剰余金

	資本金	資本準備金	資本 剰余金 合計	その他利益剰 余金	利益剰余金 合計	自己 株式	株主資本 合計
				繰越利益 剰余金			
当期首残高	17,363	5,220	5,220	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
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。</p> <p>建物 3年～15年 器具備品 5年～20年</p>



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

## (会計方針の変更)

第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
<p>(減価償却方法) 法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第32号 平成28年6月17日)を当事業年度に適用し、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。 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)

第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
<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)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,170百万円</p> <p>器具備品 653百万円</p> <p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 4,072百万円</p> <p>金銭の信託 153百万円</p> <p>前払費用 2百万円</p> <p>未収収益 147百万円</p> <p>その他 193百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 93百万円</p> <p>未払費用 722百万円</p> <p>その他 266百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務728百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソンタワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務689百万円に対して保証を行っております。</p>	<p>1 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> <p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 3,243百万円</p> <p>金銭の信託 152百万円</p> <p>未収収益 619百万円</p> <p>その他 20百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>預り金 177百万円</p> <p>未払手数料 144百万円</p> <p>未払費用 251百万円</p> <p>その他 61百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務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>

## ( 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> <p>受取配当金 1,193百万円</p> <p>支払利息 123百万円</p> <p>デリバティブ費用 889百万円</p>	<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p>受取配当金 1,550百万円</p> <p>デリバティブ収益 347百万円</p> <p>支払利息 58百万円</p> <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>

## ( 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	新株予約権の目的となる株式の数(株)
-------	--------------------

新株予約権の内訳	の 目的となる 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	当事業年 度末残高 (百万円)
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おりま  
 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 其他有価証券	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、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しております。当社が行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、有価証券及び投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されており、また一部外貨建て預金を保有しているため為替変動リスクにも晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシ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)
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 米ドル	5,631	-	243	243
合計		5,631	-	243	243

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

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	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)
原則的処理 方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		2,993	-	11
	豪ドル		77	-	2
	シンガポールドル		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
退職給付債務の期末残高	1,190

## (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
貸借対照表に計上された負債の額	1,259

退職給付引当金	1,259
---------	-------

貸借対照表に計上された負債の額	1,259
-----------------	-------

## (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
----------------	----

確定給付制度に係る退職給付費用	177
-----------------	-----

## (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tockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

## (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

（注） 株式数に換算して記載しております。

## (2) スtockオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

## ストックオプション（新株予約権）の数

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年 2 月 8 日	平成22年 8 月20日
権利確定前(株)		
期首	15,902,700	1,567,500
付与	0	0
失効	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)	
1	繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 の主な原因別の内訳  (単位：百万円)	1	繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 の主な原因別の内訳  (単位：百万円)
	繰延税金資産(流動)		繰延税金資産(流動)
	賞与引当金 642		賞与引当金 641
	その他 177		その他 224
	小計 819		小計 865
	繰延税金資産(固定)		繰延税金資産(固定)
	投資有価証券評価損 96		投資有価証券評価損 96
	関係会社株式評価損 1,430		関係会社株式評価損 1,430
	退職給付引当金 353		退職給付引当金 385
	固定資産減価償却費 122		固定資産減価償却費 119
	その他 65		その他 63
	小計 2,068		小計 2,095
	繰延税金資産小計 2,888		繰延税金資産小計 2,961
	評価性引当金 1,430		評価性引当金 1,430
	繰延税金資産合計 1,457		繰延税金資産合計 1,530
	繰延税金負債(固定)		繰延税金負債(流動)
	その他有価証券評価差額金 71		その他有価証券評価差額金 0
	繰延ヘッジ利益 114		小計 0
	その他 26		繰延税金負債(固定)
	小計 213		その他有価証券評価差額金 123
	繰延税金負債合計 213		繰延ヘッジ利益 117
	繰延税金資産の純額 1,244		小計 241
			繰延税金負債合計 242
			繰延税金資産の純額 1,288
2	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	2	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳
	法定実効税率 33.1%		法定実効税率 30.9%
	(調整)		(調整)
	交際費等永久に損金に算入されない項目 1.4%		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 4.8%		受取配当金等永久に益金に算入されない項目 5.3%
	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正 1.3%		過年度法人税等 1.5%
	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 0.2%
	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 27.9%
	税効果会計適用後の法人税等の負担率 29.4%		

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 (円貨建) (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 (米ドル貨建) (注7)	5,549 (USD 50,000 千) (注8)	関係会社 短期借入 金	-
							借入金利息 (米ドル貨建) (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す。

###### (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

##### 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第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す。

###### (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

##### 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

#### 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第57期(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いません。

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第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

< 更新後 >

## 中間財務諸表等

### (1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

		第59期中間会計期間 (平成29年9月30日)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
現金及び預金		16,734
有価証券		17
未収委託者報酬		9,940
未収収益		2,241
関係会社短期貸付金		976
繰延税金資産		866
その他	2	2,935
流動資産合計		33,712
固定資産		
有形固定資産	1	243
無形固定資産		118
投資その他の資産		
投資有価証券		14,687
関係会社株式		23,203
関係会社長期貸付金		60
長期差入保証金		784
繰延税金資産		298
長期前払費用		0
投資その他の資産合計		39,035
固定資産合計		39,397
資産合計		73,109

(単位：百万円)

第59期中間会計期間  
(平成29年9月30日)

## 負債の部

### 流動負債



未払金		4,545
未払費用		4,058
未払法人税等		1,473
未払消費税等	3	495
賞与引当金		1,207
役員賞与引当金		60
その他		943
流動負債合計		12,784
固定負債		
退職給付引当金		1,305
その他		43
固定負債合計		1,348
負債合計		14,133
純資産の部		
株主資本		
資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		36,351
利益剰余金合計		36,351
自己株式		786
株主資本合計		58,148
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		716
繰延ヘッジ損益		111
評価・換算差額等合計		827
純資産合計		58,976
負債純資産合計		73,109

## ( 2 ) 中間損益計算書

(単位：百万円)

		第59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		33,067
その他営業収益		2,422
営業収益合計		35,490
営業費用及び一般管理費	1	31,576
営業利益		3,913
営業外収益	2	1,051
営業外費用	3	431
経常利益		4,533

特別利益	4	174
特別損失	5	124
税引前中間純利益		4,582
法人税等	6	1,211
中間純利益		3,371

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第59期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

(単位：百万円)

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益剰 余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	34,015	34,015	672	55,926
当中間期変動額							
剰余金の配当				1,036	1,036		1,036
中間純利益				3,371	3,371		3,371
自己株式の取得						113	113
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)							
当中間期変動額合計				2,335	2,335	113	2,221
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	36,351	36,351	786	58,148

	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	282	266	548	56,475
当中間期変動額				
剰余金の配当				1,036
中間純利益				3,371
自己株式の取得				113
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	434	155	279	279
当中間期変動額合計	434	155	279	2,501
当中間期末残高	716	111	827	58,976

## 注記事項

(重要な会計方針)

項目	第59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法

	<p>その他有価証券 時価のあるもの 中間決算末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定） 時価のないもの 総平均法による原価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(2) デリバティブ 時価法</p> <p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>
4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
5 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。</p> <p>(2) 税金費用の計算方法 税金費用については、当中間会計期間を含む事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り、税引前中間純利益に、当該見積実効税率を乗じて計算しております。</p>

## （中間貸借対照表関係）

第59期中間会計期間 (平成29年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 1,819百万円
2	信託資産 流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
3	消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
4	保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務599百万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476百万円に対して保証を行っております。

## （中間損益計算書関係）

第59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
1	減価償却実施額 有形固定資産 55百万円 無形固定資産 21百万円
2	営業外収益のうち主要なもの 受取利息 13百万円 受取配当金 1,005百万円
3	営業外費用のうち主要なもの 支払利息 104百万円 支払源泉所得税 97百万円 デリバティブ費用 205百万円
4	特別利益のうち主要なもの 投資有価証券売却益 174百万円
5	特別損失のうち主要なもの 投資有価証券売却損 119百万円
6	中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第59期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	1,119,100	182,600	-	1,301,700

(注) 自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

## 3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会計期間末残高(百万円)
		当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末	
平成21年度ストックオプション(1)	普通株式	1,689,600	-	9,900	1,679,700	-
平成21年度ストックオプション(2)	普通株式	174,900	-	66,000	108,900	-
平成23年度ストックオプション(1)	普通株式	2,890,800	-	198,000	2,692,800	-
平成28年度ストックオプション(1)	普通株式	4,404,000	-	-	4,404,000	-
平成28年度ストックオプション(2)	普通株式	-	4,409,000	-	4,409,000	-
合計		9,159,300	4,409,000	273,900	13,294,400	-

(注) 1 平成28年度ストックオプション(2)の増加は、新株予約権の発行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)1,679,700株、平成21年度ストックオプション(2) 108,900株及び平成23年度ストックオプション(1)2,692,800株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成28年度ストックオプション(1)及び平成28年度ストックオプション(2)は権利行使期間の初日が到来しておりません。

## 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29年5月25日取締役会	普通株式	1,036	5.29	平成29年3月31日	平成29年6月22日

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

該当事項はありません。

## (リース取引関係)

第59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
オペレーティング・リース取引

解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	865百万円
1年超	1,355百万円
合計	2,220百万円

## (金融商品関係)

第59期中間会計期間(平成29年9月30日)

## 1 金融商品の時価等に関する事項

平成29年9月30日(当中間決算日)における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	中間貸借対照表 計上額( 1)	時価( 1)	差額
(1) 現金及び預金	16,734	16,734	-
(2) 未収委託者報酬	9,940	9,940	-
(3) 未収収益	2,241	2,241	-
(4) 関係会社短期貸付金	976	976	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	14,688	14,688	-
(6) 未払金	(4,545)	(4,545)	-
(7) 未払費用	(4,058)	(4,058)	-
(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	(263)	(263)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(52)	(52)	-
デリバティブ取引計	(316)	(316)	-

( 1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

- (1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益並びに(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14百万円は、貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、66百万円は、流動負債のその他に含ま  
れております。

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

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

## （有価証券関係）

第59期中間会計期間(平成29年9月30日)

## 1 子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上 額
子会社株式	20,310
関連会社株式	2,892

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

## 2 その他有価証券

（単位：百万円）

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	11,892	10,815	1,077
	小計	11,892	10,815	1,077
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	2,796	2,841	44
	小計	2,796	2,841	44
合計		14,688	13,656	1,032

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

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

## （デリバティブ取引関係）

第59期中間会計期間(平成29年9月30日)

## 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 株式関連

種類		契約額 等 (百万円)	契約額等 のうち1年 超 (百万円)	時 価 (百万円)	評価損 益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	5,080	-	263	263
	合計	5,080	-	263	263

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

## 2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

ヘッジ 会 計 の 方 法	デリバティブ取 引の種類等	主なヘッジ 対象	契約額 等 (百万円)	契約額等のう ち1年 超 (百万円)	時 価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証 券			
	米ドル		4,855	-	13
	豪ドル		140	-	1
	シンガ ポー ルドル		1,616	-	17
	ユーロ		167	-	3
	香港ドル		541	-	1
	人民元		2,050	-	43
	合計		9,372	-	52

## (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59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	3,036百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	9,571百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	835百万円

## (ストックオプション等関係)

第59期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

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

## (セグメント情報等)

## [セグメント情報]

第59期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

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

## [関連情報]

第59期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報



## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

## 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載していません。

## 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59期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第59期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第59期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

該当事項はありません。

## (1株当たり情報)

項目	第59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
1株当たり純資産額	301円34銭
1株当たり中間純利益金額	17円21銭

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

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

項目	第59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
中間純利益(百万円)	3,371
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式に係る中間純利益(百万円)	3,371
普通株式の期中平均株式数(千株)	195,877
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1) 1,679,700株、平成21年度ストックオプション(2) 108,900株、平成23年度ストックオプション(1) 2,692,800株、平成28年度ストックオプション(1) 4,404,000株、平成28年度ストックオプション(2) 4,409,000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59期中間会計期間 (平成29年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額（百万円）	58,976
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額（百万円）	58,976
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数（千株）	195,711

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<更新後>

（1）受託会社

名 称	資本金の額 (平成29年9月末現在)	事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

<更新後>

（2）販売会社

名 称	資本金の額 (平成29年9月末現在)	事業の内容
農林中央金庫	3,480,488百万円	全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。

日興アセットマネジメント株式会社	17,363百万円	証券投資信託の設定を行なうとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また金融商品取引法に定める投資助言業務を行なっています。
------------------	-----------	---

## 独立監査人の監査報告書

平成30年1月31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  
業務執行社員 公認会計士 鶴田 光夫指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 辻村 和之

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29年6月27日から平成29年12月25日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型の平成29年12月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

日興アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成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。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成29年12月5日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第59期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成29年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。