

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2018年10月17日提出
【計算期間】	第2期(自 2017年7月19日至 2018年7月17日)
【ファンド名】	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-08
【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
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## ファンドの目的

主として、日本を含む世界各国の株式、債券、不動産投信およびコモディティ(商品)連動証券などに投資を行なう投資信託証券に投資を行ない、インカム収益の確保と信託財産の成長をめざします。

## ファンドの基本的性格

## 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 追加型投信

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

## 内外

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

## 資産複合

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

## 2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

資産複合 資産配分変更型(その他資産(投資信託証券(株式、債券、不動産投信、その他資産(商品))))

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式、債券、不動産投信およびその他資産(商品)に投資を行いません。

「資産配分変更型」とは、目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。

年1回

目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。

グローバル(含む日本)

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

ファンド・オブ・ファンズ

「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。

為替ヘッジあり(部分ヘッジ)

目論見書または投資信託約款において、一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるものをいいます。

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

## 1 世界の様々な資産に分散投資を行ない、世界経済の成長に沿った収益の獲得をめざします。

- 主として、世界(日本を含む)の資産(株式、債券、不動産、コモディティ(商品)など)を投資対象とします\*1。
- 複数の異なる資産への分散投資に加え、市場環境の変化に応じた資産配分の適宜見直しにより、インカム収益の確保と信託財産の成長をめざします。
- 資産配分比率の決定および変更については、三井住友信託銀行株式会社の助言に基づき、日興アセットマネジメント株式会社が行ないます。

\*1 世界の資産への投資は、各資産を主要投資対象とする投資信託証券を通じて行ないます。

## 2 世界の資産への投資を段階的に積み増すことで、投資タイミングを分散します。

- 世界(日本を含む)の資産(株式、債券、不動産、コモディティ(商品)など)への投資比率は、設定当初、純資産総額の25%程度とし、その後、約3ヵ月ごとに25%程度ずつ段階的に引き上げます\*2。(設定日から約9ヵ月が経過した後は、世界の資産への投資比率を高位に保つことを原則とします。)

\*2 その他の資産については、低リスク資産による安定的な運用を行ないます。

## 3 運用目的やリスク許容度に応じて、「安定指向」と「成長指向」の2つのファンドから選択できます。

- 「安定指向」は安定性を、「成長指向」は安定性と収益性のバランスを重視した運用を行ないます。

※「安定指向」とは元本保証等を意味するものではなく、「成長指向」と比較して安定的な運用をめざすファンドであることを意味しています。

### 繰上償還について

- 1万口当たり基準価額(税引前分配金控除後、以下「基準価額」)が、2026年6月30日以前の営業日に13,000円以上となった場合には、投資信託証券への投資比率を引き下げ、短期公社債などによる安定運用に移行後、繰上償還します。

※基準価額や償還価額が13,000円以上になることを保証するものではありません。

※安定運用への移行後も、繰上償還するまでは、基準価額は市況動向などの影響を受けるため、基準価額や償還価額が13,000円を下回ることがあります。

※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行なえない場合があります。

## 資産分散について

- 当ファンドは、主として、世界（日本を含む）の資産（株式、債券、不動産、コモディティ（商品）など）を投資対象とします。値動きの異なる複数の資産に分散投資を行なうことで、価格変動リスクの軽減を図りながら、信託財産の成長をめざします。

### 投資対象資産と期待される収益・効果



\*投資対象資産は今後、追加・変更される可能性があります。

\*\*各資産への投資は、投資信託証券を通じて行ないます。

(2016年6月末現在)

## 投資タイミングの分散について

- 資産価格は市況動向などにより変動するため、投資タイミングを分散する「エントリー分散」により、投資資産の短期的な価格変動の影響を小さくすることをめざします。
- 当ファンドでは、世界の資産への分散投資を、設定当初に純資産総額の25%程度から開始し、約3ヵ月ごとに25%程度ずつ段階的に引き上げることで、投資タイミングの分散を図ります。

### 「エントリー分散」の仕組み



\*「エントリー分散」の仕組みは、「安定指向」「成長指向」とも同様です。なお、世界の資産への分散投資における資産配分比率は、「安定指向」と「成長指向」で異なります。

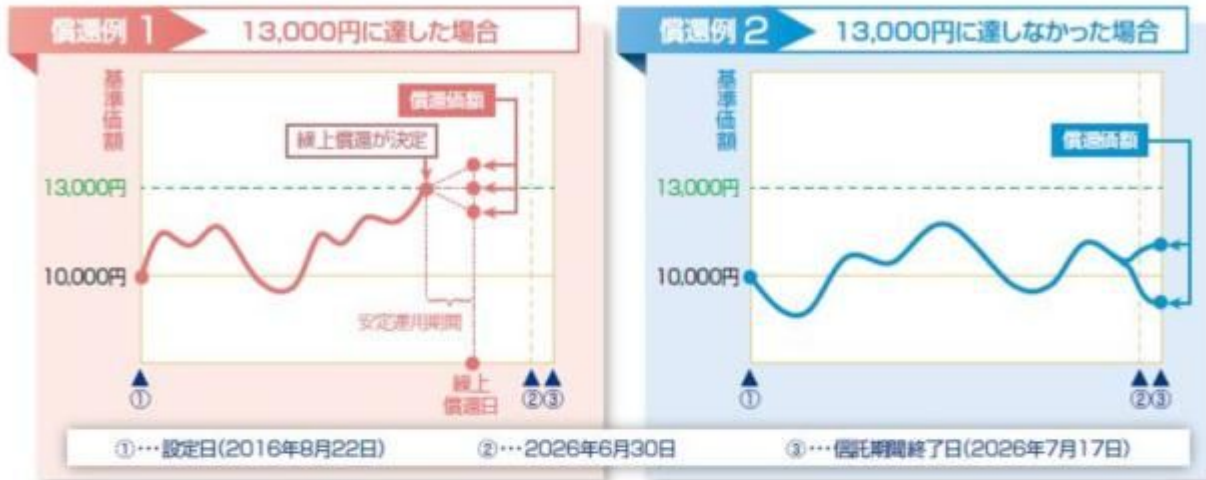
\*低リスク資産は、内外のソブリン債を投資対象とし、外貨建資産については為替ヘッジを行なうことで為替変動リスクの軽減を図ります。ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。また、為替ヘッジを行なうことに伴い、為替ヘッジコストがかかります。

\*上記は「エントリー分散」の仕組みについて説明するためのイメージ図です。

\*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行なえない場合があります。

## 繰上償還について

- 1万口当たり基準価額（税引前分配金控除後、以下「基準価額」）が、2026年6月30日以前の営業日に13,000円以上となった場合には、投資信託証券への投資比率を引き下げ、短期公社債などによる安定運用に移行後、繰上償還します。

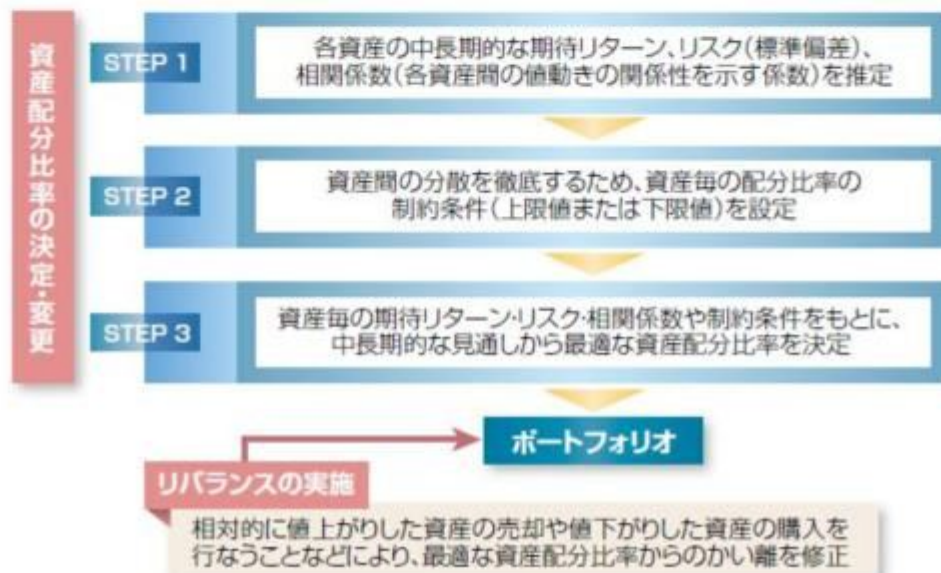


※上記は繰上償還について説明するためのイメージ図です。

- ※13,000円の基準価額水準は、あくまで安定運用に切り替えるための水準であり、基準価額が13,000円以上となることを示唆あるいは保証するものではありません。
- ※基準価額が13,000円以上となった場合には、安定運用に移行します。安定運用への移行後も繰上償還するまでは、基準価額は市況動向などの影響を受けるため、基準価額や償還価額が13,000円を下回ることがあります。

## 資産配分の決定プロセス

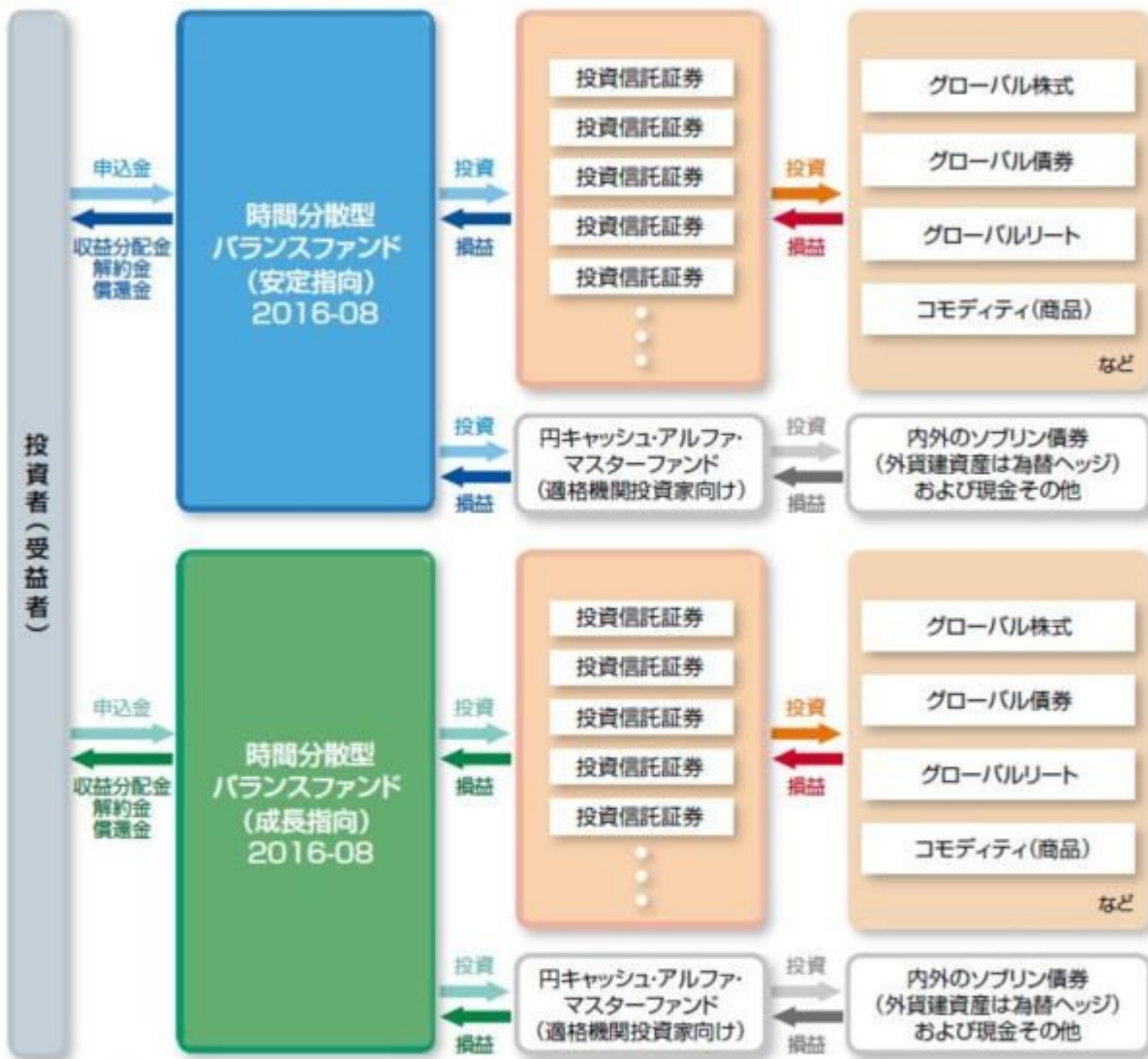
- 当ファンドにおいて、世界の資産への分散投資における資産配分比率の決定および変更は、年金運用などで豊富な運用ノウハウを持つ三井住友信託銀行株式会社からの投資助言に基づき行ないます。



- ※各資産への投資は、投資信託証券を通じて行ない、各投資信託証券は、追加・変更される場合があります。
- ※上記は、2016年6月末現在のものであり、将来変更される場合があります。

## ファンドの仕組み

■当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



※投資先投資信託証券は適宜見直しを行いません。

※投資先投資信託証券の詳細については、後述の追加的記載事項をご覧ください。

### 〈主な投資制限〉

- 投資信託証券、短期社債等、コマーシャルペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
- 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

### 〈分配方針〉

- 毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。

※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。

## 追加的記載事項

当ファンドが投資対象とする投資信託証券は、資産クラスごとに以下のものを定めています。  
※各投資信託証券は、追加、変更される場合があります。

資産クラス	投資信託証券	主な投資資産
株式	インデックス マザーファンドTOPIX	日本の株式
	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)	先進国(日本を除く)の株式
	先進国資本エマージング株式マザーファンド	先進国企業が資本参加している 新興国企業の株式
債券	ソブリン(円ヘッジ)マザーファンド	内外のソブリン債券 (外貨建資産は為替ヘッジ)
	インデックス マザーファンド 海外先進国債券	先進国(日本を除く)のソブリン債券
	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)	新興国のソブリン債券
不動産	インデックス マザーファンドJリート	日本の不動産投資信託
	インデックスファンド海外先進国リート (適格機関投資家向け)	先進国(日本を除く)の不動産投資信託
コモディティ (商品)	インデックス マザーファンド コモディティ	コモディティ関連のETF
	FOFs用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり (適格機関投資家専用)	金のETF

(有価証券報告書提出日現在)

### 信託金限度額

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

### (2) 【ファンドの沿革】

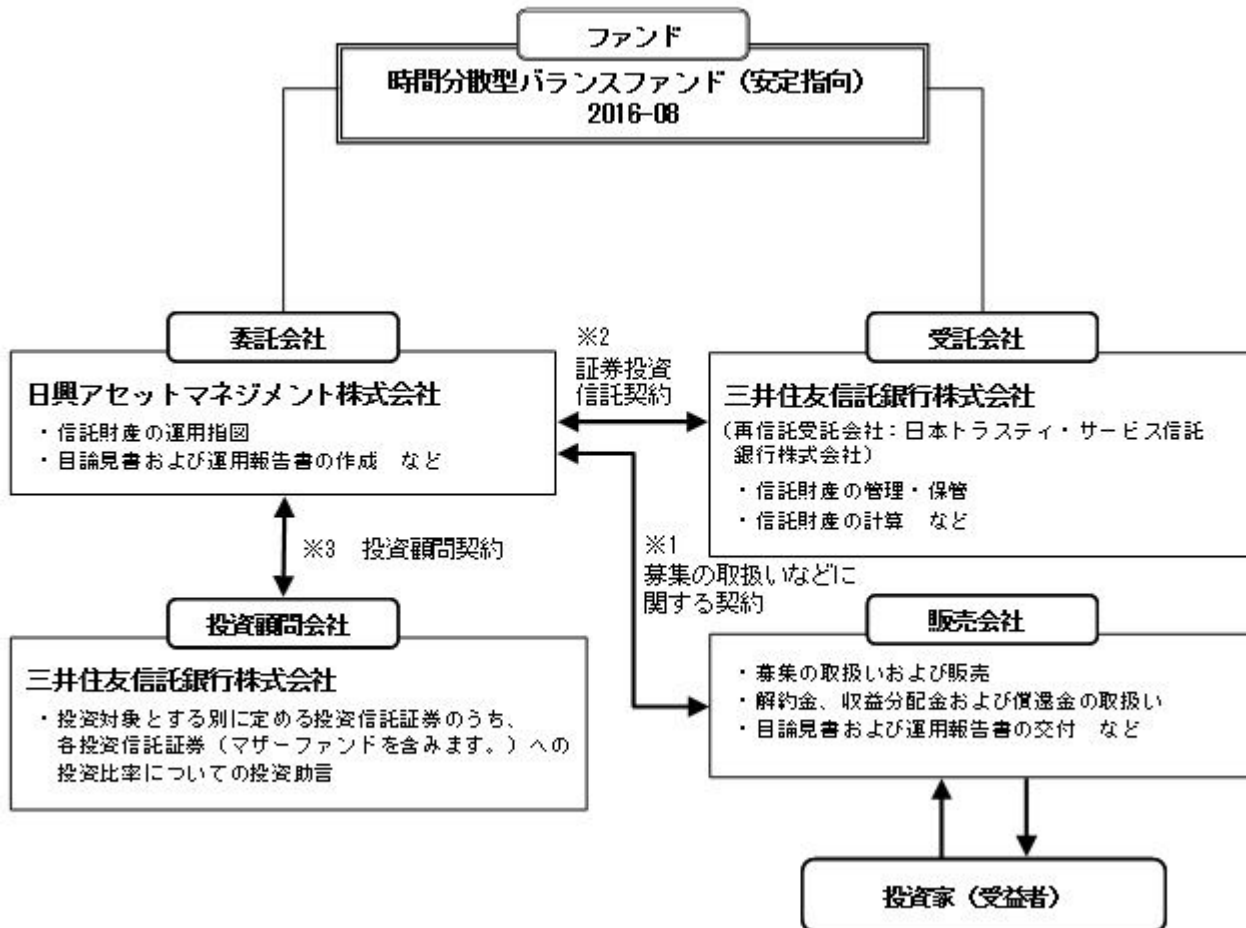
2016年 8月22日

- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

### (3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み

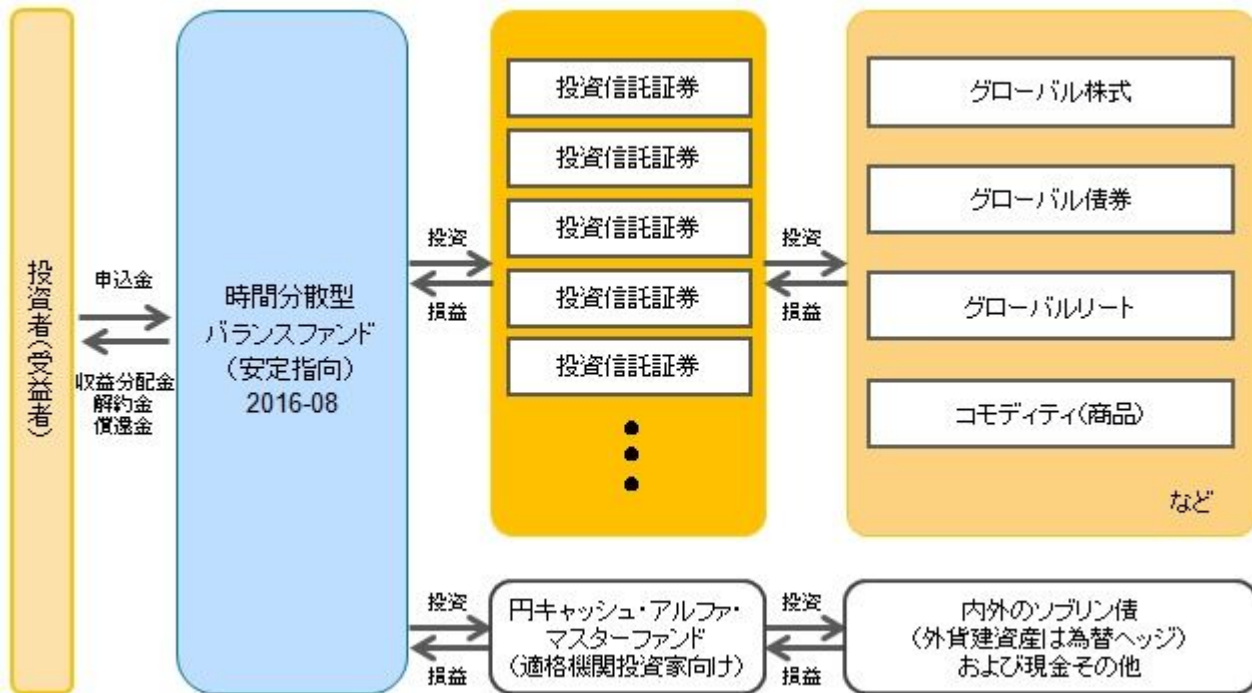




- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものです。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものです。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。
- 3 投資顧問会社から株式、債券などの有価証券に対する投資判断についての助言（有価証券の種類、銘柄、数量、売買時期の判断など）を受けるルールを委託会社と投資顧問会社との間で規定したものです。投資助言を受ける対象資産、助言の内容、報酬の取決めの内容などが含まれています。

#### <ファンド・オブ・ファンズの仕組み>

当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



投資先投資信託証券は適宜見直しを行いません。

投資先投資信託証券の詳細については、前述の追加的記載事項をご覧ください。

委託会社の概況（2018年7月末現在）

- 1) 資本金  
17,363百万円
- 2) 沿革  
1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立  
1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更
- 3) 大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

- ・主として、日本を含む世界各国の債券、株式、不動産投信およびコモディティ連動証券などに実質的に投資を行なう別に定める投資信託証券（以下、「別に定める投資信託証券」といいます。）ならびに円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）受益証券の一部、またはすべてに投資を行ない、インカム収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
- ・各投資信託証券への投資比率の合計は、原則として高位を保ちます。
- ・一方で、原則として、以下の要件にしたがって、信託財産の純資産総額に対する各投資信託証券への投資比率を変更していきます。投資比率を変更するタイミングについては、ファンドの状況などを勘案し、合理的な範囲で決定できるものとしします。

当初設定時からの約3ヵ月間において、以下の投資比率を目指します。

別に定める投資信託証券への投資比率の合計	...	25%
円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）	...	75%

2016年11月下旬以降の約3ヵ月間において、以下の投資比率を目指します。

別に定める投資信託証券への投資比率の合計	...	50%
円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）	...	50%

2017年2月下旬以降の約3ヵ月間において、以下の投資比率を目指します。

別に定める投資信託証券への投資比率の合計 … 75%

円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）… 25%

2017年5月下旬以降の信託期間中において、以下の投資比率を目指します。

別に定める投資信託証券への投資比率の合計 … 100%

円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）… 0%

- ・なお、別に定める投資信託証券については、収益機会の追求やリスクの分散などを目的として、適宜見直しを行いません。この際、定性評価や定量評価等を勘案のうえ、新たに投資信託証券を指定したり、既に指定されていた投資信託証券を外したりする場合があります。
- ・2026年6月30日以前の毎営業日において、1万口当たり基準価額が13,000円以上となった場合には、各投資信託証券への投資比率を引き下げ、短期有価証券や短期金融商品等の資産による安定運用に切り替えることを基本とします。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

## （２）【投資対象】

投資信託証券（投資信託または外国投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) 金銭債権
- 3) 約束手形
- 4) 為替手形

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

- 1) 追加型証券投資信託 円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け） 受益証券
- 2) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
- 3) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、2)の証券の性質を有するもの
- 4) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形  
次の取引ができます。
  - 1) 外国為替予約取引
  - 2) 資金の借入

投資対象とする投資信託証券の概要

<インデックス マザーファンド T O P I X >

運用の基本方針	
基本方針	わが国の長期成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、T O P I X（東証株価指数） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざします。

主な投資対象	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>投資成果をＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の動きにできるだけ連動させるため、「バラ日本株式モデル」に従い次のポートフォリオ管理を行います。 東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とし、分散投資を行いません。 資金の流出入に伴う売買にあたっては、最適ポートフォリオと信託財産のポートフォリオのカイ離を縮小するように売買を行いません。 株式の組入比率は、高位を保ちます。</li> <li>株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。</li> <li>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。</li> <li>投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</li> <li>外貨建資産への投資は行いません。</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	ありません。
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	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2001年10月26日設定）
決算日	毎年2月12日（休業日の場合は翌営業日）

\* T O P I X（東証株価指数）は、東京証券取引所第一部に上場されている普通株式全銘柄（算出対象除外後の整理ポスト割当銘柄および算出対象組入前の新規上場銘柄を除きます。）の浮動株調整後の時価総額を指数化したもので、市場全体の動向を反映するものです。  
T O P I Xの指数値およびT O P I Xの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびT O P I Xの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

<ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド>

**運用の基本方針**

基本方針	内外の公社債に投資を行ない、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外のソブリン債券（国債、州政府債、政府保証債、政府機関債、国際機関債などをいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・原則として、日本および世界の高格付け国の中から、為替ヘッジコスト考慮後の利回りや信用力などを勘案して複数国を選定し、当該国通貨建てのソブリン債券に分散投資するとともに、外貨建て資産については為替ヘッジを行なうことにより、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざします。</li> <li>・ポートフォリオの構築にあたっては、為替ヘッジコスト考慮後の利回りの水準や方向性、信用力、流動性などの分析を行ない、組入国やその配分比率、および組入銘柄を決定します。なお、金利動向などによっては、組入債券の一部売却や先物取引などの活用により、実質的な債券組入比率を調整することがあります。</li> <li>・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。</li> <li>・投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</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	ありません。
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	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2011年2月28日設定）
決算日	毎年2月10日（休業日の場合は翌営業日）

<インデックス マザーファンド リポート>

### 運用の基本方針

基本方針	わが国の金融商品取引所に上場する不動産投信（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。）の投資信託証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）に投資を行ない、別に定める日本の不動産投資信託証券市場の動きをとらえる指数（東証REIT指数（配当込み）（有価証券届出書提出日現在）以下同じ。）に連動する投資成果を目標として運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券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、わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、別に定める日本の不動産投資信託証券市場の動きをとらえる指数に連動する投資成果を目標として運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し委託会社の判断により決定するものとします。</li> <li>運用にあたって、運用目的を達成するために有用であると判断される場合は、有価証券指数等先物取引（別に定める日本の不動産投資信託証券市場の動きをとらえる指数を対象とする先物取引とします。）を活用したり、対象指数に採用されていない不動産投資信託証券について投資を行なうことがあります。また、対象指数に採用されている不動産投資信託証券の一部または全部の値動きに連動を目指す上場投資信託証券や債券等に投資する場合もあります。</li> <li>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</li> <li>外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</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	ありません。
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	三井住友信託銀行株式会社

信託期間	無期限（2015年3月17日設定）
決算日	毎年6月15日（休業日の場合は翌営業日）

< インデックス マザーファンド 海外先進国債券 >

運用の基本方針	
基本方針	日本を除く先進国の債券に投資を行ない、別に定める日本を除く先進国債券市場を代表する指数（FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）（有価証券届出書提出日現在）以下同じ。）に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	海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>主として日本を除く先進国の債券に投資を行ない、別に定める日本を除く先進国債券市場を代表する指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し委託会社の判断により決定するものとします。</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等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等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等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>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。</li> <li>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</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。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

信託期間	無期限（2016年8月22日設定）
決算日	毎年7月17日（休業日の場合は翌営業日）

## &lt;先進国資本エマージング株式マザーファンド&gt;

運用の基本方針	
基本方針	主として、世界の金融商品取引所上場株式に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	世界の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>主として、世界の金融商品取引所に上場されており、先進国企業が資本参加している新興国企業の株式（預託証券を含みます。以下同じ。）に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。</li> <li>株式の銘柄選定にあたっては、各企業の成長性、収益性、流動性等を勘案して行ないます。</li> <li>株式の組入比率は、高位を維持することを基本とします。なお、ファンドの状況等によっては、上場投資信託証券等に投資する場合があります。</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、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</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。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社



投資顧問会社	日興アセットマネジメント アジア リミテッド（投資助言）
信託期間	無期限（2016年 6月30日設定）
決算日	毎年 6月21日（休業日の場合は翌営業日）

## &lt; インデックス マザーファンド コモディティ &gt;

運用の基本方針	
基本方針	コモディティに関連する上場投資信託証券に投資し、別に定める商品市場を代表する指数（ブルームバーグ・コモディティ・インデックス・トータルリターン（円換算ベース）（有価証券届出書提出日現在）以下同じ。）に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	コモディティに関連する上場投資信託証券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、日本または海外の金融商品取引所に上場されている投資信託証券であって、コモディティ商品指数への連動を目指す投資信託証券に投資し、別に定める商品市場を代表する指数に連動する投資成果を目標として運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し委託会社の判断により決定するものとします。</li> <li>また、ファンドの状況に応じて、コモディティに関連する上場投資信託証券以外の有価証券に投資を行なう場合があります。</li> <li>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。</li> <li>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</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。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

信託期間	無期限（2016年8月22日設定）
決算日	毎年7月17日（休業日の場合は翌営業日）

< 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） >

運用の基本方針	
基本方針	別に定める日本を除く先進国株式市場を代表する指数（MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジなし・円ベース）（有価証券届出書提出日現在）以下同じ。）に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド受益証券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、海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド受益証券に投資を行ない、別に定める日本を除く先進国株式市場を代表する指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し、委託会社の判断により決定するものとします。</li> <li>マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。</li> <li>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。</li> <li>投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</li> <li>外貨建資産への実質投資割合には、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	毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。
ファンドに係る費用	
信託報酬	純資産総額に対し年率0.0972%（税抜0.09%）
その他報酬	<ul style="list-style-type: none"> <li>有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.54（税抜0.5）を乗じて得た額</li> <li>投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.54（税抜0.5）を乗じて得た額（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限り、他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）</li> </ul>
申込手数料	ファンドで買い付ける場合はありません。
信託財産留保額	ありません。

その他の費用など	<ul style="list-style-type: none"> <li>運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用、「別に定める日本を除く先進国株式市場を代表する指数」その他これに類する標章の使用料などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。</li> <li>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については、その都度、信託財産から支払われます。</li> </ul> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
<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（2016年8月23日設定）
決算日	毎月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジなし・円ベース） <sup>*</sup> に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびコントリーファンド等を含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。</li> <li>投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、株価指数先物取引や外国為替予約取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等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等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>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等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（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</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0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

**その他**

委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2000年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

**< インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け） >**

運用の基本方針	
基本方針	別に定める日本を除く先進国リート市場を代表する指数（S & P 先進国 REIT 指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）（有価証券届出書提出日現在）以下同じ。）に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド受益証券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、海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド受益証券に投資を行ない、別に定める日本を除く先進国リート市場を代表する指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し、委託者の判断により決定するものとします。</li> <li>マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。</li> <li>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</li> <li>外貨建資産への実質投資割合には、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	毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。
ファンドに係る費用	
信託報酬	純資産総額に対し年率0.0972%（税抜0.09%）

その他報酬	<ul style="list-style-type: none"> <li>・有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.54(税抜0.5)を乗じて得た額</li> <li>・投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.54(税抜0.5)を乗じて得た額(当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限ります。他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。)</li> </ul>
申込手数料	ファンドで買い付ける場合はありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<ul style="list-style-type: none"> <li>・運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用(業務委託する場合の委託費用を含みます。)、監査費用、「別に定める日本を除く先進国リート市場を代表する指数」その他これに類する標章の使用料などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。</li> <li>・組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税などについては、その都度、信託財産から支払われます。</li> </ul> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
<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(2016年8月23日設定)
決算日	毎月15日(休業日の場合は翌営業日)

(ご参考) < 海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド >

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投信(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。)の投資信託証券(以下「不動産投資信託証券」といいます。)に投資を行ない、S & P先進国REIT指数(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目標として運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券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、日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、S &amp; P先進国REIT指数(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の動きに連動した投資成果をめざします。</li> <li>・不動産投資信託証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。</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は行ないません。</li> <li>・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。</li> <li>・有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。</li> <li>・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</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>・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0.3% (1口当たり)
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 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(2005年6月30日設定)
決算日	毎年6月15日(休業日の場合は翌営業日)

\* S & P先進国REIT指数(除く日本)は、スタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービス エル エル シー(S & P社)が発表している、日本を除く世界の主要国の不動産投信市場の合成パフォーマンスを表す指数です。(ヘッジなし・円ベース)とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。

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

#### <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)>

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	別に定める新興国債券市場を代表する指数(JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル・ディバシファイド(円ヘッジなし・円ベース)(有価証券届出書提出日現在)以下同じ。)に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	海外新興国債券インデックスLocal(ヘッジなし)マザーファンド受益証券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、海外新興国債券インデックスLocal(ヘッジなし)マザーファンド受益証券に投資を行ない、別に定める新興国債券市場を代表する指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し、委託者の判断により決定するものとしします。</li> <li>・マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。</li> <li>・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。</li> <li>投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</li> <li>外貨建資産への実質投資割合には、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	毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。
<b>ファンドに係る費用</b>	
信託報酬	純資産総額に対し年率0.0972%（税抜0.09%）
その他報酬	<ul style="list-style-type: none"> <li>有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.54（税抜0.5）を乗じて得た額</li> <li>投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.54（税抜0.5）を乗じて得た額（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限ります。他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）</li> </ul>
申込手数料	ファンドで買い付ける場合はありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<ul style="list-style-type: none"> <li>運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用、「別に定める新興国債券市場を代表する指数」その他これに類する標章の使用料などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。</li> <li>組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税などについては、その都度、信託財産から支払われます。</li> </ul> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
<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（2016年8月23日設定）
決算日	毎月16日（休業日の場合は翌営業日）

（ご参考）＜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＞

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

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として、新興国の現地通貨建債券に投資し、J Pモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ グローバル・ディバースファイド（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。なお、新興国の現地通貨建債券の騰落率に償還価額などが連動する債券を活用することもあります。</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、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式（新株引受権証券、新株予約権証券および新株引受権付社債券を含みます。）への投資は行ないません。</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（2008年3月31日設定）
決算日	毎年5月16日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

<円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）>

#### 運用の基本方針



基本方針	インカム収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行いません。
主な投資対象	ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド受益証券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、ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド受益証券に投資を行ない、インカム収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行いません。</li> <li>マザーファンド受益証券の組入比率は、この信託の純資産総額に対して50%以上となることを原則とし、金利動向等に応じて機動的に変更できるものとします。</li> <li>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。</li> <li>投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</li> <li>外貨建資産への実質投資割合には、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	毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。
<b>ファンドに係る費用</b>	
信託報酬	純資産総額に対し年率0.0864%（税抜0.08%）
その他報酬	<ul style="list-style-type: none"> <li>有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.54（税抜0.5）を乗じて得た額</li> <li>投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.54（税抜0.5）を乗じて得た額（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限り、他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）</li> </ul>
申込手数料	ファンドで買い付ける場合はありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<ul style="list-style-type: none"> <li>運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。</li> <li>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については、その都度、信託財産から支払われます。</li> </ul> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
<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	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2016年8月22日設定）
決算日	毎年8月10日（休業日の場合は翌営業日）

< F O F s 用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用） >

運用の基本方針	
基本方針	信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	ゴールド・マザーファンド受益証券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、ゴールド・マザーファンド受益証券に投資を行ない、信託財産の成長を目指して運用を行ないます。</li> <li>マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることがあります。</li> <li>実質外貨建資産については、為替変動リスクの低減を図るため、原則として対円での為替ヘッジを行ないます。</li> <li>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。</li> <li>投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</li> <li>外貨建資産への実質投資割合には、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	毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。
ファンドに係る費用	
信託報酬	純資産総額に対し年率0.1404%（税抜0.13%）
その他報酬	<ul style="list-style-type: none"> <li>有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.54（税抜0.5）を乗じて得た額</li> <li>投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.54（税抜0.5）を乗じて得た額（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限ります。他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）</li> </ul>
申込手数料	ファンドで買い付ける場合はありません。
信託財産留保額	ありません。

その他の費用など	<ul style="list-style-type: none"> <li>運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。</li> <li>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については、その都度、信託財産から支払われます。</li> </ul> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
<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	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	2027年7月8日まで（2017年9月29日設定）
決算日	毎年7月8日（休業日の場合は翌営業日）

## （ご参考）＜ゴールド・マザーファンド＞

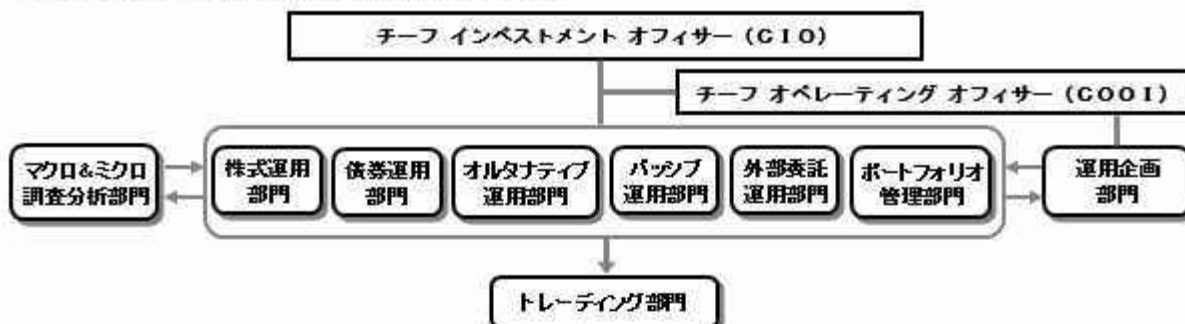
<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	主に金地金価格への連動をめざす上場投資信託証券に投資を行ない、信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	金地金価格への連動をめざす上場投資信託証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場されている投資信託証券であって、金地金価格への連動をめざす投資信託証券に投資を行ない、信託財産の成長をめざして運用を行ないます。なお、ファンドの状況や投資環境に応じて、金地金価格への連動をめざすために、金先物価格への連動をめざす上場投資信託証券や上場投資信託証券以外の有価証券に投資を行なう場合があります。</li> <li>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。</li> <li>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</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	ありません。

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	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	無期限(2013年3月25日設定)
決算日	毎年3月8日(休業日の場合は翌営業日)

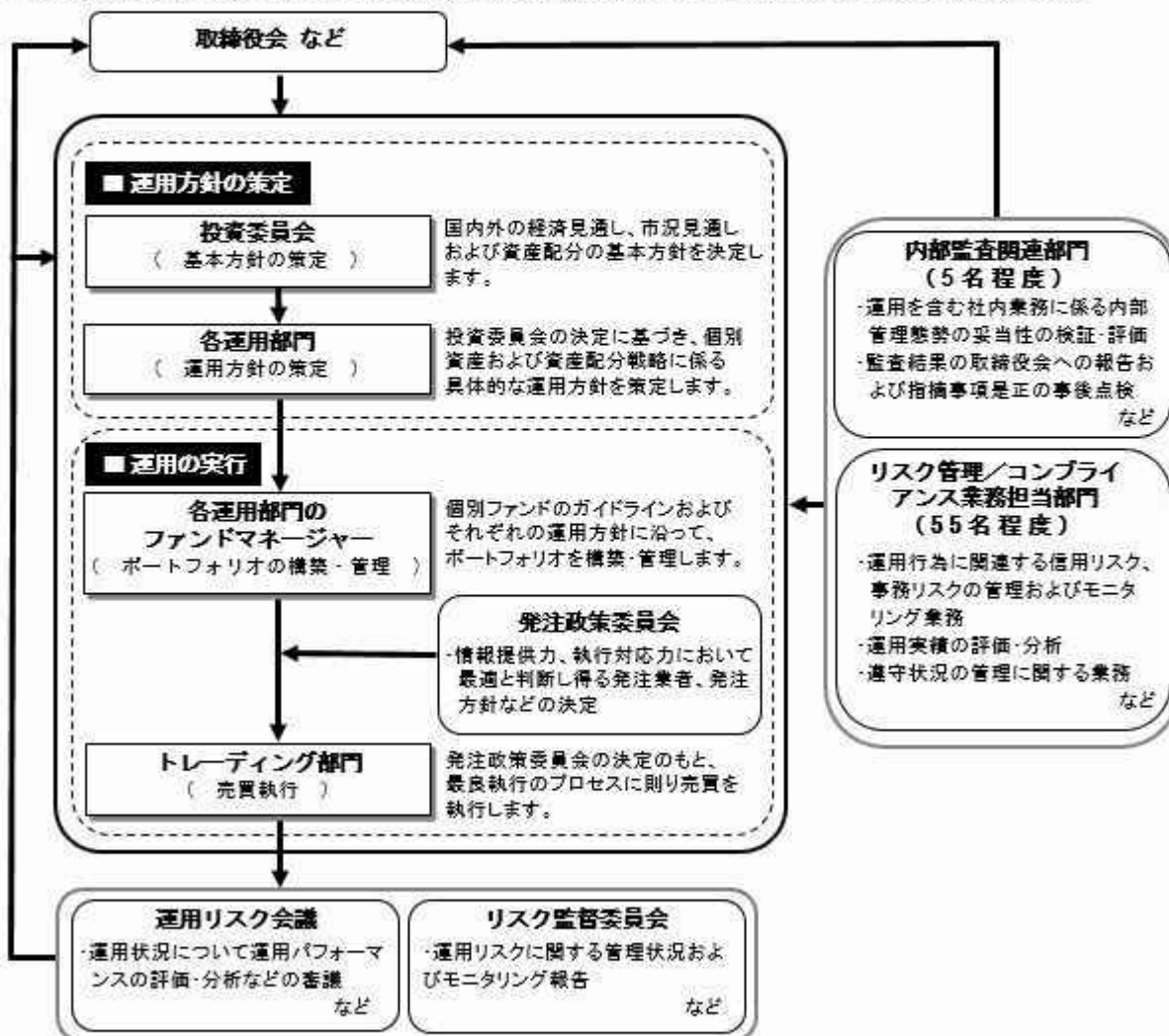
## (3) 【運用体制】

<日興アセットマネジメント株式会社(委託会社)における運用体制>

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



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

「受託会社」に対しては、日々の純資産照会、月次の勘定残高照会などを行なっております。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なっており、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。

「投資顧問会社」については、投資顧問会社の管理体制およびリスク管理状況のモニタリングをリスク管理業務担当部門にて行ないます。また、外部委託運用部門で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。

上記体制は2018年7月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### (4) 【分配方針】

##### 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

##### 1) 分配対象額の範囲

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

##### 2) 分配対象額についての分配方針

分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。

### 3) 留保益の運用方針

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

収益分配金の支払い

#### < 分配金再投資コース >

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

#### < 分配金受取りコース >

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

## (5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

- 1) 投資信託証券、短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。)、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
  - 2) 有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。
  - 3) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
  - 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
  - 5) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て(解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
    - イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
    - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
  - ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の範囲内
  - ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
  - ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。
- 6) 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。

## 3 【投資リスク】

### (1) ファンドのリスク

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

・ 投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資

元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者（受益者）の皆様に帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。

- ・当ファンドは、主に債券、株式、不動産投信およびコモディティ連動証券を実質的な投資対象としますので、債券、株式、不動産投信およびコモディティ連動証券の価格の下落や、債券、株式および不動産投信の発行体の財務状況や業績の悪化、不動産、商品（コモディティ）の市況の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

投資対象とする投資信託証券の主なリスクは以下の通りです。

#### 価格変動リスク

- ・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。
- ・一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に不動産投信は、不動産や不動産証券化商品に投資して得られる収入や売却益などを収益源としており、不動産を取り巻く環境や規制、賃料水準、稼働率、不動産市況や長短の金利動向、マクロ経済の変化など様々な要因により価格が変動します。また、不動産の老朽化や立地条件の変化、火災、自然災害などに伴う不動産の滅失・毀損などにより、その価格が影響を受ける可能性もあります。不動産投信の財務状況、業績や市況環境が悪化する場合、不動産投信の分配金や価格は下がり、ファンドに損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に新興国の債券および株式は、先進国の債券および株式に比べて価格変動が大きくなる傾向があり、基準価額にも大きな影響を与える場合があります。
- ・一般にコモディティ連動証券の価格は、投資対象となる商品および当該商品が関係する市況や市況の変化などの要因により価格が変動するリスクがあります。上記事項に関する変動があった場合、ファンドに損失が生じるリスクがあります。

#### 流動性リスク

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

#### 信用リスク

- ・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト（債務不履行）が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。
- ・一般に新興国の債券は、先進国の債券に比べて利回りが高い反面、価格変動が大きく、デフォルトが生じるリスクが高まる場合があります。
- ・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れや廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・不動産投信が支払不能や債務超過の状態になった場合、またはそうなることが予想される場合、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れや廃止となる場合も不動産投信の価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・上場投資信託証券について、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止され

る可能性があり、廃止される恐れや廃止となる場合も上場投資信託証券の価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。

- ・格付を有する有価証券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。
- ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

#### 為替変動リスク

- ・一部の資産を除き、原則として、為替ヘッジを行わないため、外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。
- ・一部の資産において、為替ヘッジを行なうにあたっては、円の金利が為替ヘッジを行なう通貨の金利より低い場合、この金利差に相当するヘッジコストが発生します。為替および金利の動向によっては、為替ヘッジに伴なうヘッジコストが予想以上に発生する場合があります。
- ・一般に新興国の通貨は、先進国の通貨に比べて為替変動が大きくなる場合があります。

#### カントリー・リスク

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

#### 有価証券の貸付などにおけるリスク

有価証券の貸付行為などにおいては、取引相手先リスク(取引の相手方の倒産などにより貸付契約が不履行になったり、契約が解除されたりするリスク)を伴ない、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。貸付契約が不履行や契約解除の事態を受けて、貸付契約に基づく担保金を用いて清算手続きを行なう場合においても、買戻しを行なう際に、市場の時価変動などにより調達コストが担保金を上回る可能性もあり、不足金額をファンドが負担することにより、その結果ファンドに損害が発生する恐れがあります。

#### < 繰上償還に関する事項 >

- ・1万口当たり基準価額が13,000円以上となった場合には、信託約款の規定に基づき、繰上償還します(償還価額が13,000円以上であることを保証するものではありません。 )。
- ・13,000円は、あくまでも安定運用に切り替えるための価額水準であり、ファンドの基準価額が13,000円以上となることを示唆あるいは保証するものではありません。また、資産価格の変動の影響および外国為替予約取引等の決済を速やかに行なえないなどの事由により、基準価額が13,000円以上となった日の翌営業日以降(安定運用への切り替え完了後も含みます。 )の基準価額が13,000円を下回る場合があります。

ファンドが投資対象とする投資信託証券は、これらの影響を受けて価格が変動しますので、ファンド自身にもこれらのリスクがあります。

#### < その他の留意事項 >

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由により基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。

- ・投資対象とする投資信託証券に関する事項



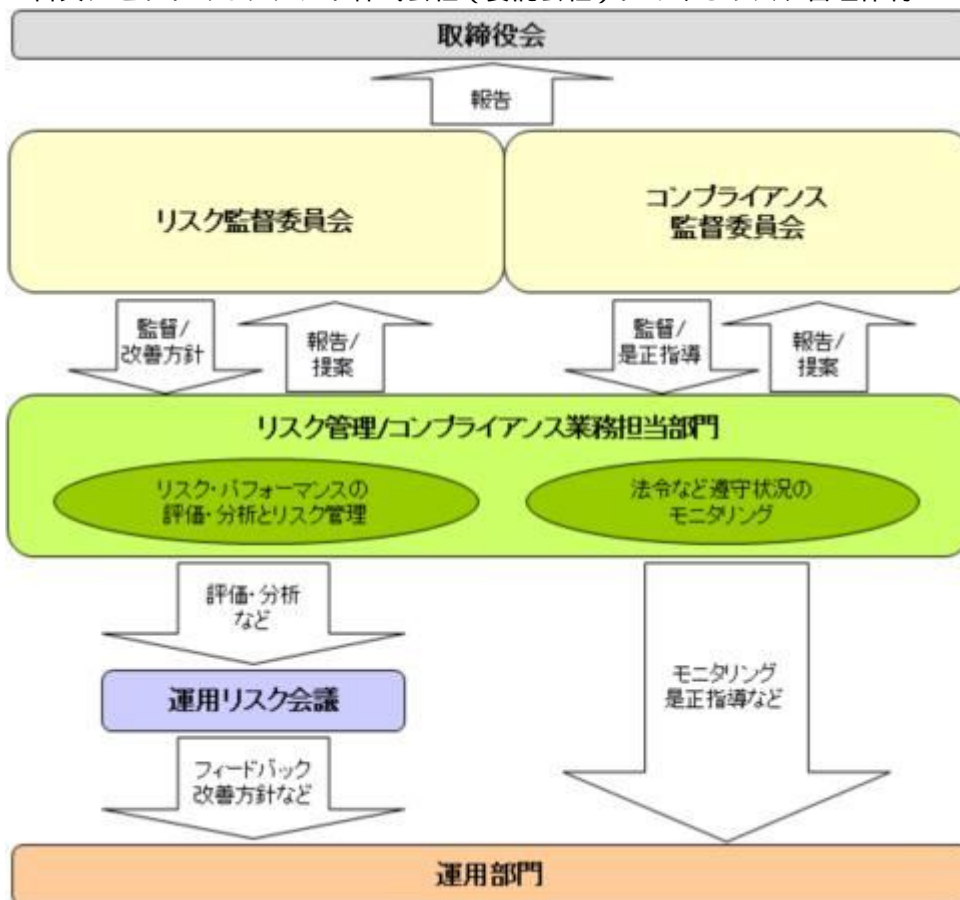
諸事情により、投資対象とする投資信託証券にかかる投資や換金ができない場合があります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができなくなる場合があります。また、一時的にファンドの取得・換金ができなくなることもあります。

ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴う資金流入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項  
一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。
- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項  
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項  
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。
- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項  
ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

## （２）リスク管理体制

<日興アセットマネジメント株式会社（委託会社）におけるリスク管理体制>



### 全社的なリスク管理

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2018年7月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 4【手数料等及び税金】

### （１）【申込手数料】

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

- ・販売会社における申込手数料率は1.62%（税抜1.5%）が上限となっております。
- ・申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
- ・＜分配金再投資コース＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
- ・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

本書提出日現在、取得申込みの受付は終了しております。上記は申込受付当時のものです。

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

### （２）【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

### （３）【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬率（年率）＜純資産総額に対し＞	
当ファンド	0.8964%（税抜0.83%）
投資対象とする投資信託証券	0.0972%（税抜0.09%）以内 <sup>1</sup>
実質的負担	0.9936%（税抜0.92%）以内 <sup>2</sup>

- ・当ファンドの信託報酬は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.8964%（税抜0.83%）の率を乗じて得た額とします。

- ・投資対象とする投資信託証券の組入れに係る信託報酬率（年率）0.0972%（税抜0.09%）以内<sup>1</sup>がか

かり、受益者が実質的に負担する信託報酬率（年率）は0.9936%（税抜0.92%）以内<sup>2</sup>となります。

1 投資対象とする投資信託証券の想定される組入比率に基づき委託会社が算出した上限値です。

1 投資対象とする投資信託証券の信託報酬の詳細については、「第1 ファンドの状況 - 2 投資方針 - (2) 投資対象」 - 「投資対象とする投資信託証券の概要」をご覧ください。

2 当ファンドの信託報酬率（年率）に投資対象とする投資信託証券の信託報酬率（年率）を加えた、受益者が実質的に負担する信託報酬率（年率）について、委託会社が算出した上限値です。当該上限値は、投資対象とする投資信託証券の想定される組入比率に基づき委託会社が算出したものですが、当該投資信託証券の変更などにより見直すことがあります。

2 この他に、実質的に不動産投信や上場投資信託証券などに投資する場合には、運用などに係る費用がかかりますが、投資する銘柄は固定されていないため、事前に料率、上限額などを表示することができません。

#### 信託報酬の配分

当ファンドの信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.83%	0.40%	0.40%	0.03%

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

投資顧問会社が受ける報酬は、上記委託会社が受ける信託報酬の中から支払います。

#### 支払時期

信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

#### （4）【その他の手数料等】

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

ファンドの計理業務（設定解約処理、約定処理、基準価額算出、決算処理等）およびこれに付随する業務（法定帳簿管理、法定報告等）に係る費用。

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

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

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

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

す。 )。

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

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

格付の取得に要する費用。

ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。

別に定める投資信託証券の1つである「インデックス マザーファンド 」リート」の運用の基本方針に規定する「別に定める日本の不動産投資信託証券市場の動きをとらえる指数」その他これに類する標章の使用料。

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

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料。

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

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

#### < 投資対象とする投資信託証券に係る費用 >

「円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）」

「FOFs用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）」

・運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。

・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については、その都度、信託財産から支払われます。

上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

「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）」

「インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）」

「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）」

・運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用、「各信託約款に定めるベンチマーク指数」その他これに類する標章の使用料などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。

・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については、その都度、信託財産から支払われます。

上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

「インデックス マザーファンド TOPIX」

「ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド」

「インデックス マザーファンド 」リート」

「インデックス マザーファンド 海外先進国債券」

「先進国資本エマージング株式マザーファンド」

「インデックス マザーファンド コモディティ」

・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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

投資家の皆様にご負担いただく手数料などの合計額については、保有期間や運用の状況などに依りて異なりますので、表示することができません。

#### （５）【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

##### 1) 収益分配金に対する課税

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

##### 2) 解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益（譲渡益）<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。

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

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

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

法人受益者の場合

##### 1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

##### 2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

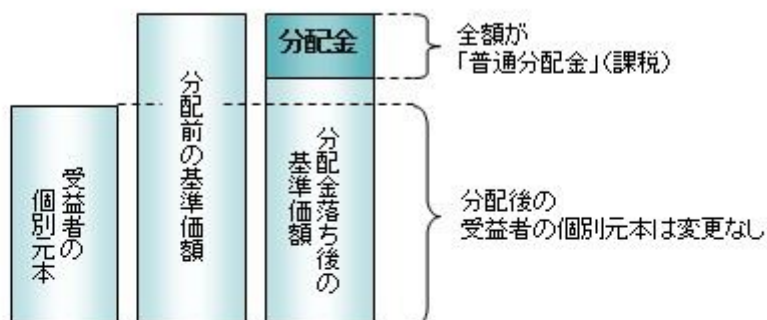
- 1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

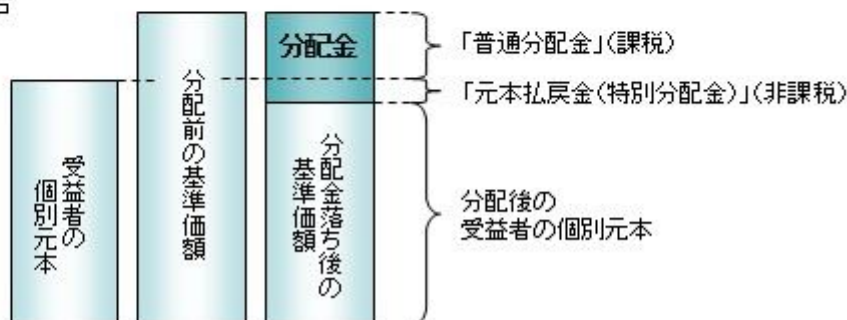
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
  - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
  - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
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

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は2018年10月17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】

### 【時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-08】

以下の運用状況は2018年7月31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(%)
投資信託受益証券	日本	109,610,646	21.20
親投資信託受益証券	日本	391,937,969	75.82
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		15,402,488	2.98
合計(純資産総額)		516,951,103	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	ソブリン(円ヘッジ)マザーファンド	144,645,342	1.2871	186,173,020	1.2791	185,015,856	35.79
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド T O P I X	37,743,707	2.1244	80,182,732	2.1345	80,563,942	15.58
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド 海外先進国債券	66,472,441	1.1043	73,405,517	1.0831	71,996,300	13.93
日本	投資信託受益証券	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)	44,779,026	1.4244	63,783,244	1.4132	63,281,719	12.24
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド J リート	41,621,008	1.0982	45,708,191	1.0955	45,595,814	8.82
日本	投資信託受益証券	インデックスファンド海外先進国リート(適格機関投資家向け)	31,357,569	1.1406	35,766,443	1.1155	34,979,368	6.77
日本	投資信託受益証券	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)	7,251,013	1.1227	8,140,712	1.1161	8,092,855	1.57
日本	親投資信託受益証券	先進国資本エマージング株式マザーファンド	5,837,117	1.2128	7,079,255	1.2226	7,136,459	1.38
日本	投資信託受益証券	F O F s 用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	3,495,818	0.9478	3,313,336	0.9316	3,256,704	0.63
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド コモディティ	1,578,915	1.0224	1,614,282	1.0321	1,629,598	0.32

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	21.20
親投資信託受益証券	75.82
合計	97.02

## 【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】

該当事項はありません。

## （３）【運用実績】

## 【純資産の推移】

純資産総額(百万円)	1口当たり純資産額(円)
------------	--------------

期別	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2017年 7月18日)	1,033	1,033	1.0099	1.0099
第2計算期間末 (2018年 7月17日)	529	529	1.0490	1.0490
2017年 7月末日	1,026		1.0099	
8月末日	979		1.0146	
9月末日	889		1.0255	
10月末日	859		1.0369	
11月末日	780		1.0437	
12月末日	732		1.0527	
2018年 1月末日	674		1.0442	
2月末日	594		1.0205	
3月末日	586		1.0175	
4月末日	566		1.0310	
5月末日	539		1.0289	
6月末日	529		1.0342	
7月末日	516		1.0413	

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金(円)
第1期	2016年 8月22日～2017年 7月18日	0.0000
第2期	2017年 7月19日～2018年 7月17日	0.0000

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率(%)
第1期	2016年 8月22日～2017年 7月18日	0.99
第2期	2017年 7月19日～2018年 7月17日	3.87

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額(分配落ち)に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額(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期	2016年 8月22日～2017年 7月18日	1,302,197,533	278,705,244
第2期	2017年 7月19日～2018年 7月17日	0	518,521,796

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(参考)



## 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)

以下の運用状況は2018年 7月31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(%)
親投資信託受益証券	日本	269,055,387	98.99
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		2,731,518	1.01
合計(純資産総額)		271,786,905	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)	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-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	107,428,783	2.5208	270,806,477	2.5045	269,055,387	98.99

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.99
合計	98.99

## 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2018年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
出資金	アメリカ	8,900,860	0.01
株式	アメリカ	54,495,400,092	61.85
	カナダ	3,306,773,080	3.75
	モーリシャス	3,022,168	0.00
	ドイツ	3,300,893,108	3.75
	イタリア	662,656,175	0.75
	フランス	3,387,972,968	3.84
	オランダ	1,657,790,053	1.88
	スペイン	1,043,703,816	1.18
	ベルギー	369,057,759	0.42
	オーストリア	81,993,297	0.09
	ルクセンブルク	114,161,382	0.13
	フィンランド	349,244,170	0.40
	アイルランド	1,291,612,456	1.47
	ポルトガル	58,293,467	0.07
	イギリス	5,627,036,865	6.39
	スイス	3,092,219,778	3.51
	スウェーデン	884,847,772	1.00
	ノルウェー	240,949,466	0.27
	デンマーク	587,767,510	0.67
	ケイマン	212,945,014	0.24
	オーストラリア	2,141,486,775	2.43
	バミューダ	238,289,834	0.27
	ニュージーランド	69,752,689	0.08
	香港	920,053,676	1.04
	シンガポール	403,313,768	0.46
	イスラエル	178,680,337	0.20
	ジャージー	395,083,893	0.45
	英ヴァージン諸島	21,816,229	0.02
	アラブ首長国連邦	11,705,900	0.01
	マン島	18,493,889	0.02
小計		85,167,017,386	96.65
投資証券	アメリカ	1,605,287,017	1.82
	カナダ	15,462,076	0.02
	フランス	120,493,820	0.14
	イギリス	72,085,704	0.08
	オーストラリア	186,886,029	0.21
	香港	50,571,710	0.06
	シンガポール	36,251,747	0.04
小計		2,087,038,103	2.37
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		851,825,902	0.97

合計(純資産総額)	88,114,782,251	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	777,958,080	0.88
	買建	ドイツ	203,860,170	0.23

(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		721,193,000	0.82

(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	106,162	17,431.68	1,850,582,999	21,081.90	2,238,097,634	2.54
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	153,074	8,809.55	1,348,513,167	11,697.12	1,790,525,513	2.03
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	8,615	111,496.10	960,538,987	197,511.21	1,701,559,093	1.93
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	50,190	19,033.83	955,308,404	18,989.37	953,076,510	1.08
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	71,730	11,232.90	805,736,251	12,958.19	929,491,492	1.05
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	6,602	108,755.26	718,002,257	135,403.33	893,932,834	1.01
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	6,250	110,700.00	691,875,030	136,546.74	853,417,127	0.97
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	56,221	15,724.19	884,030,184	14,672.19	824,885,290	0.94
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	88,691	9,213.30	817,137,349	9,073.95	804,778,356	0.91
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	203,329	3,071.92	624,611,624	3,475.72	706,715,302	0.80
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	97,740	6,139.50	600,075,402	6,492.97	634,623,367	0.72
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	65,243	9,136.96	596,122,729	9,112.39	594,520,052	0.67
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	26,680	20,994.85	560,142,649	22,100.98	589,654,170	0.67
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	37,732	12,204.16	460,487,448	15,150.64	571,664,130	0.65

アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア 機器・サー ビス	20,280	23,184.34	470,178,444	28,178.77	571,465,626	0.65
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	40,011	13,150.10	526,148,966	14,190.40	567,772,426	0.64
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信 サービス	151,637	3,709.65	562,520,714	3,552.32	538,663,148	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	24,450	18,513.54	452,656,156	21,900.05	535,456,291	0.61
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	124,880	4,014.39	501,317,890	4,283.87	534,970,422	0.61
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半 導体製造装 置	97,852	4,564.57	446,652,692	5,294.06	518,035,034	0.59
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信 サービス	86,237	5,398.60	465,559,263	5,826.91	502,495,660	0.57
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	100,680	3,837.75	386,385,218	4,681.29	471,312,448	0.53
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・ パーソナル 用品	52,809	9,615.41	507,780,658	8,903.00	470,158,633	0.53
アメリカ	株式	BOEING CO/THE	資本財	11,692	29,067.70	339,859,651	38,971.17	455,650,927	0.52
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	417,851	1,078.52	450,664,057	1,057.41	441,843,176	0.50
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲 料・タバコ	84,962	5,099.90	433,297,709	5,131.99	436,024,330	0.49
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	46,633	9,027.95	421,000,446	9,332.62	435,208,143	0.49
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	53,657	8,165.40	438,131,066	8,024.91	430,592,751	0.49
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェ ア・サービ ス	19,550	16,350.61	319,654,528	21,965.54	429,426,477	0.49
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	56,523	6,911.78	390,674,747	7,194.55	406,658,007	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	7.12
		素材	4.72
		資本財	7.14
		商業・専門サービス	1.12
		運輸	2.01
		自動車・自動車部品	1.34
		耐久消費財・アパレル	1.85
		消費者サービス	1.79
		メディア	1.97
		小売	4.77
		食品・生活必需品小売り	1.51
		食品・飲料・タバコ	4.80

	家庭用品・パーソナル用品	1.85
	ヘルスケア機器・サービス	4.67
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.11
	銀行	9.03
	各種金融	4.36
	保険	3.83
	不動産	0.54
	ソフトウェア・サービス	11.49
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.25
	電気通信サービス	2.33
	公益事業	3.03
	半導体・半導体製造装置	3.01
投資証券		2.37
合計		99.03

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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 EMINI1809	買建	50	米ドル	6,903,625	766,371,411	7,008,000	777,958,080	0.88
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1809	買建	50	ユーロ	1,528,150	198,552,529	1,569,000	203,860,170	0.23

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	5,400,000.00	597,649,945	597,754,000	0.68
	ユーロ	買建	950,000.00	122,668,340	123,439,000	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。

### インデックスファンド海外先進国リート(適格機関投資家向け)

以下の運用状況は2018年7月31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(%)
-------	------	---------	---------

親投資信託受益証券	日本	126,282,433	99.00
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		1,273,825	1.00
合計(純資産総額)		127,556,258	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)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド	62,506,773	2.0658	129,126,492	2.0203	126,282,433	99.00

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.00
合計	99.00

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2018年7月31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(%)
投資証券	アメリカ	4,536,857,121	69.82
	カナダ	116,168,374	1.79
	ドイツ	17,372,539	0.27
	イタリア	7,178,909	0.11
	フランス	322,872,469	4.97
	オランダ	28,678,794	0.44
	スペイン	53,690,660	0.83
	ベルギー	51,937,711	0.80

	アイルランド	16,856,217	0.26
	イギリス	352,652,003	5.43
	オーストラリア	440,100,166	6.77
	ニュージーランド	15,105,068	0.23
	香港	152,327,745	2.34
	シンガポール	233,325,970	3.59
	イスラエル	3,856,158	0.06
	ガーンジー	4,847,997	0.07
	マン島	3,692,462	0.06
	小計	6,357,520,363	97.84
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		140,482,741	2.16
合計(純資産総額)		6,498,003,104	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)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	15,578	18,211.19	283,693,925	19,078.17	297,199,866	4.57
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	26,815	7,151.26	191,761,150	7,215.65	193,487,655	2.98
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	7,531	23,807.20	179,292,057	23,811.64	179,325,498	2.76
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,788	24,881.59	168,896,267	24,608.74	167,044,141	2.57
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	10,362	11,836.99	122,654,956	13,404.45	138,896,989	2.14
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,949	18,669.66	129,735,480	19,112.59	132,813,400	2.04
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	18,515	7,076.88	131,028,572	7,079.10	131,069,679	2.02
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	18,718	6,397.50	119,748,523	6,849.31	128,205,516	1.97
香港	投資証券	LINK REIT	108,300	1,009.59	109,339,246	1,099.38	119,063,395	1.83
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	17,931	6,040.05	108,304,210	6,152.17	110,314,636	1.70
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	7,770	13,307.87	103,402,219	13,550.99	105,291,198	1.62
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	269,060	346.10	93,122,769	349.39	94,007,546	1.45
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	14,307	5,882.41	84,159,781	6,146.62	87,939,745	1.35
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,321	26,068.47	86,573,416	25,954.13	86,193,692	1.33
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	37,300	2,367.84	88,320,555	2,296.79	85,670,524	1.32
アメリカ	投資証券	GGP INC	31,829	2,301.23	73,246,082	2,348.97	74,765,417	1.15
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	5,183	14,171.53	73,451,074	13,634.24	70,666,308	1.09
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	8,718	7,986.05	69,622,466	7,777.36	67,803,030	1.04
アメリカ	投資証券	HCP INC	23,659	2,649.80	62,691,824	2,828.53	66,920,305	1.03
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	6,345	10,826.80	68,696,080	10,380.54	65,864,559	1.01
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	81,054	780.17	63,236,134	798.25	64,702,093	1.00
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,726	10,753.53	61,574,763	10,951.13	62,706,208	0.97
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORPORATION	17,959	3,169.33	56,918,096	3,171.55	56,957,969	0.88
アメリカ	投資証券	UDR INC	13,469	4,118.47	55,471,686	4,112.92	55,396,926	0.85

アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	14,184	3,773.22	53,519,492	3,875.35	54,968,093	0.85
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	7,420	6,661.71	49,429,889	6,960.32	51,645,626	0.79
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	37,831	1,388.42	52,525,532	1,357.39	51,351,561	0.79
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	3,688	13,442.20	49,574,836	13,592.06	50,127,533	0.77
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	4,456	10,861.21	48,397,589	11,159.83	49,728,226	0.77
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	50,825	976.12	49,611,451	970.58	49,330,073	0.76

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.84
合計	97.84

### 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。

### 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)

以下の運用状況は2018年7月31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(%)
親投資信託受益証券	日本	25,265,955	99.01
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		253,773	0.99
合計(純資産総額)		25,519,728	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)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	海外新興国債券インデックスLocal(ヘッジなし)マザーファンド	19,720,540	1.2887	25,413,860	1.2812	25,265,955	99.01

## ロ.種類別の投資比率



種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.01
合 計	99.01

#### 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2018年 7月31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	31,392,542	0.80
	メキシコ	409,580,596	10.42
	ブラジル	393,445,608	10.01
	チリ	101,099,460	2.57
	コロンビア	296,312,633	7.54
	ペルー	115,317,088	2.93
	ウルグアイ	8,796,216	0.22
	トルコ	181,221,536	4.61
	チェコ	171,510,726	4.36
	ハンガリー	174,763,940	4.45
	ポーランド	345,742,826	8.79
	ロシア	290,429,778	7.39
	ルーマニア	99,080,050	2.52
	マレーシア	210,940,881	5.37
	タイ	297,979,911	7.58
	フィリピン	10,462,801	0.27
	インドネシア	342,081,208	8.70
南アフリカ	335,139,015	8.52	
	小計	3,815,296,815	97.05
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		115,975,805	2.95
合計（純資産総額）		3,931,272,620	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 (%)
チリ	国債証券	REPUBLIC OF CHILE	560,000,000	18.10	101,389,490	18.05	101,099,460	5.500	2020/8/5	2.57
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	2,660,000	2,528.35	67,254,237	2,548.98	67,802,868		2020/7/1	1.72
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,900,000	944.04	55,698,509	937.89	55,335,929	10.500	2026/12/21	1.41
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	1,360,000,000	4.12	56,095,913	4.05	55,107,938	7.500	2026/8/26	1.40
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,980,000	603.94	54,234,276	601.14	53,982,551	8.000	2020/6/11	1.37
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	1,335,000,000	4.04	54,020,973	4.01	53,619,551	7.000	2022/5/4	1.36
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	1,105,000,000	4.62	51,148,411	4.57	50,529,516	10.000	2024/7/24	1.29
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	1,700,000	3,041.60	51,707,221	2,957.04	50,269,789	10.000	2023/1/1	1.28
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,800,000	579.89	45,231,851	579.16	45,175,100	6.500	2021/6/10	1.15
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,610,000	669.24	44,237,421	667.12	44,097,219	10.000	2024/12/5	1.12
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	1,380,000	3,082.65	42,540,656	3,043.61	42,001,941	10.000	2021/1/1	1.07
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,340,000	788.10	42,085,071	782.26	41,772,720	8.750	2048/2/28	1.06
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	11,620,000	354.58	41,202,655	351.34	40,826,402	3.650	2021/12/17	1.04
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,550,000	573.46	37,562,071	573.57	37,569,182	6.500	2022/6/9	0.96
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	1,350,000	2,650.42	35,780,771	2,671.25	36,061,908		2020/1/1	0.92
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	855,000,000	4.17	35,673,096	4.08	34,945,557	7.750	2030/9/18	0.89
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	8,680,000	397.01	34,460,618	394.72	34,262,409	4.875	2029/6/22	0.87
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	1,290,000	2,588.95	33,397,529	2,609.67	33,664,743		2020/4/1	0.86
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	4,250,000,000	0.81	34,718,703	0.79	33,600,394	8.375	2024/3/15	0.85
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	1,150,000	2,898.00	33,327,109	2,917.32	33,549,227	2.500	2026/7/25	0.85
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	1,450,000	2,275.75	32,998,397	2,297.29	33,310,778		2021/7/1	0.85
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,370,000	576.30	30,947,490	577.49	31,011,258	5.000	2019/12/11	0.79
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	3,790,000,000	0.82	31,189,331	0.79	30,041,418	8.375	2026/9/15	0.76
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	1,100,000	2,708.14	29,789,567	2,730.45	30,035,005		2019/10/1	0.76
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	1,040,000	3,006.79	31,270,655	2,878.80	29,939,561	10.000	2025/1/1	0.76
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,030,000	588.22	29,587,572	589.33	29,643,333	7.500	2027/6/3	0.75

ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	970,000	3,019.11	29,285,452	3,028.24	29,373,942	1.750	2021/7/25	0.75
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	1,020,000	2,969.30	30,286,950	2,821.98	28,784,211	10.000	2027/1/1	0.73
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	990,000	2,864.52	28,358,827	2,885.22	28,563,682	2.500	2027/7/25	0.73
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	8,500,000	333.39	28,338,796	331.04	28,139,189	2.000	2022/12/17	0.72

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.05
合計	97.05

## 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。

## F O F s用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)

以下の運用状況は2018年 7月31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(%)
親投資信託受益証券	日本	2,311,699,507	99.52
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		11,116,927	0.48
合計(純資産総額)		2,322,816,434	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		2,307,755,700	99.35

(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)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ゴールド・マザーファンド	2,661,715,035	0.8872	2,361,606,674	0.8685	2,311,699,507	99.52

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.52
合計	99.52

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	売建	20,830,000.00	2,307,234,921	2,307,755,700	99.35

(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。

## ゴールド・マザーファンド

以下の運用状況は2018年7月31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(%)
投資信託受益証券	アメリカ	77,503,613,583	100.00
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		950,063	0.00
合計(純資産総額)		77,504,563,646	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		41,015,740	0.05

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資信託受益 証券	ISHARES GOLD TRUST-ETF	48,650,000	1,406.93	68,447,363,944	1,301.03	63,295,459,780	81.67
アメリカ	投資信託受益 証券	SPDR GOLD TRUST-ETF	1,106,700	13,538.26	14,982,802,186	12,838.30	14,208,153,803	18.33

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	100.00
合 計	100.00

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	369,511.18	41,000,000	41,015,740	0.05

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## インデックス マザーファンド TOPIX

以下の運用状況は2018年 7月31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	42,157,096,500	99.83
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		69,880,963	0.17
合計(純資産総額)		42,226,977,463	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	69,920,000	0.17

(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	204,800	7,269.78	1,488,852,876	7,305.00	1,496,064,000	3.54
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,163,500	765.40	890,553,048	689.40	802,116,900	1.90
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	74,900	8,975.18	672,241,111	9,260.00	693,574,000	1.64
日本	株式	ソニー	電気機器	113,000	5,110.15	577,447,232	5,828.00	658,564,000	1.56
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	118,800	4,697.90	558,111,150	5,168.00	613,958,400	1.45
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	125,800	4,678.13	588,509,010	4,445.00	559,181,000	1.32
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	151,600	3,724.67	564,661,400	3,355.00	508,618,000	1.20
日本	株式	キーエンス	電気機器	8,300	63,419.39	526,381,000	58,910.00	488,953,000	1.16
日本	株式	KDDI	情報・通信業	145,800	2,602.92	379,506,459	3,113.00	453,875,400	1.07
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,257,900	195.82	442,143,156	194.60	439,387,340	1.04
日本	株式	任天堂	その他製品	10,400	44,397.30	461,732,000	36,760.00	382,304,000	0.91
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	124,200	2,432.36	302,099,245	3,055.00	379,431,000	0.90
日本	株式	三菱商事	卸売業	116,400	2,923.96	340,349,328	3,117.00	362,818,800	0.86
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	15,100	19,708.26	297,594,784	23,245.00	350,999,500	0.83
日本	株式	ファナック	電気機器	16,000	26,752.85	428,045,712	21,920.00	350,720,000	0.83
日本	株式	村田製作所	電気機器	17,700	15,093.20	267,149,675	19,500.00	345,150,000	0.82
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	118,900	2,653.30	315,477,504	2,873.00	341,599,700	0.81
日本	株式	花王	化学	41,400	7,847.54	324,888,450	8,137.00	336,871,800	0.80
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	62,600	4,871.73	304,970,340	5,301.00	331,842,600	0.79
日本	株式	日本電産	電気機器	20,300	16,662.56	338,250,000	16,180.00	328,454,000	0.78
日本	株式	キヤノン	電気機器	90,700	3,931.35	356,573,616	3,617.00	328,061,900	0.78
日本	株式	信越化学工業	化学	29,100	11,149.10	324,438,876	11,270.00	327,957,000	0.78
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	69,500	4,446.95	309,063,176	4,555.00	316,572,500	0.75
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	30,300	10,197.82	308,994,194	10,440.00	316,332,000	0.75
日本	株式	日立製作所	電気機器	404,000	807.62	326,280,400	778.60	314,554,400	0.74
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	97,700	3,122.21	305,039,917	3,176.00	310,295,200	0.73
日本	株式	ダイキン工業	機械	23,000	12,181.26	280,169,000	13,320.00	306,360,000	0.73
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	165,700	1,460.95	242,079,954	1,817.50	301,159,750	0.71
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	62,100	5,880.00	365,148,070	4,675.00	290,317,500	0.69
日本	株式	パナソニック	電気機器	192,500	1,593.25	306,702,345	1,438.00	276,815,000	0.66

## ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.11

鉱業	0.30
建設業	3.17
食料品	4.22
繊維製品	0.63
パルプ・紙	0.27
化学	7.48
医薬品	4.79
石油・石炭製品	0.83
ゴム製品	0.77
ガラス・土石製品	1.01
鉄鋼	1.05
非鉄金属	0.85
金属製品	0.65
機械	5.16
電気機器	13.55
輸送用機器	8.67
精密機器	1.75
その他製品	2.04
電気・ガス業	1.74
陸運業	4.30
海運業	0.19
空運業	0.59
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	7.75
卸売業	4.75
小売業	4.81
銀行業	6.91
証券、商品先物取引業	0.91
保険業	2.28
その他金融業	1.20
不動産業	2.40
サービス業	4.53
合 計	99.83

## 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 2018年09月	買建	4	日本円	69,022,160	69,920,000	0.17

(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。

## ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド

以下の運用状況は2018年 7月31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	3,146,739,192	3.20
	フランス	23,241,704,606	23.64
	ベルギー	26,826,981,105	27.29
	イギリス	9,070,401,994	9.23
	小計	62,285,826,897	63.36
地方債証券	カナダ	9,629,418,969	9.80
特殊債券	アメリカ	1,075,936,673	1.09
	ドイツ	1,168,705,065	1.19
	オランダ	244,305,025	0.25
	スウェーデン	2,530,474,259	2.57
	ノルウェー	1,040,924,118	1.06
	国際機関	17,085,731,120	17.38
	小計	23,146,076,260	23.55
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		3,236,363,252	3.29
合計（純資産総額）		98,297,685,378	100.00

### その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		95,935,329,568	97.60

(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（％）
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	73,170,000	16,981.91	12,425,667,911	17,036.59	12,465,676,127	4.500	2026/3/28	12.68
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	28,000,000	18,942.34	5,303,855,639	18,922.25	5,298,231,541	5.500	2028/3/28	5.39
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	33,000,000	15,244.14	5,030,566,595	15,532.97	5,125,881,943	2.750	2027/10/25	5.21
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	300,000,000	1,519.96	4,559,885,232	1,561.30	4,683,913,891	3.750	2032/6/1	4.77



フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	26,500,000	15,263.75	4,044,895,007	15,389.74	4,078,281,300	2.500	2030/5/25	4.15
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	25,000,000	15,970.86	3,992,716,418	16,143.04	4,035,762,227	3.500	2026/4/25	4.11
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	302,000,000	1,304.04	3,938,228,705	1,334.07	4,028,892,632	1.750	2026/11/12	4.10
イギリス	国債証券	UK TREASURY	22,000,000	18,232.22	4,011,090,459	18,269.24	4,019,233,539	4.250	2027/12/7	4.09
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	27,000,000	13,267.36	3,582,187,250	13,533.77	3,654,119,292	1.000	2026/6/22	3.72
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	23,500,000	13,160.47	3,092,712,746	13,494.94	3,171,312,210	1.000	2027/5/25	3.23
カナダ	地方債証券	MANITOBA (PROVINCE OF)	27,000,000	11,099.29	2,996,808,420	10,927.93	2,950,542,561	3.050	2024/5/14	3.00
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	20,000,000	12,739.88	2,547,977,453	13,070.49	2,614,098,050	0.750	2028/5/25	2.66
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	20,000,000	13,134.75	2,626,950,726	13,049.27	2,609,855,836	0.800	2028/6/22	2.66
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	200,000,000	1,277.61	2,555,235,560	1,300.63	2,601,269,032	1.250	2025/5/12	2.65
スウェーデン	特殊債券	KOMMUNINVEST I SVERIGE	200,000,000	1,242.92	2,485,848,064	1,265.23	2,530,474,259	0.625	2023/11/13	2.57
イギリス	国債証券	UK TREASURY	10,000,000	21,190.75	2,119,075,618	20,958.32	2,095,832,236	6.000	2028/12/7	2.13
カナダ	地方債証券	PROVINCE OF QUEBEC	16,500,000	10,558.32	1,742,124,057	10,506.13	1,733,511,568	2.500	2026/4/20	1.76
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	13,000,000	13,042.50	1,695,525,433	12,996.33	1,689,524,096	0.750	2028/11/25	1.72
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	14,500,000	10,817.97	1,568,605,991	10,815.01	1,568,177,326	2.000	2021/12/31	1.60
イギリス	国債証券	UK TREASURY	10,000,000	14,904.23	1,490,423,269	14,800.44	1,480,044,313	1.500	2026/7/22	1.51
イギリス	国債証券	UK TREASURY	10,000,000	14,643.30	1,464,330,190	14,752.91	1,475,291,906	1.625	2028/10/22	1.50
国際機関	特殊債券	NORDIC INVESTMENT BANK	100,000,000	1,433.44	1,433,441,032	1,470.85	1,470,855,781	2.940	2031/10/17	1.50
カナダ	地方債証券	PROVINCE OF ALBERTA	14,500,000	10,116.07	1,466,830,857	10,118.41	1,467,170,492	2.050	2026/8/17	1.49
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	11,000,000	12,905.22	1,419,574,902	13,191.27	1,451,040,050	0.800	2027/6/22	1.48
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	10,000,000	13,966.13	1,396,613,478	13,878.47	1,387,847,296	1.000	2026/9/21	1.41
カナダ	地方債証券	ONTARIO (PROVINCE OF)	12,500,000	10,924.74	1,365,593,678	10,790.70	1,348,838,106	2.450	2022/6/29	1.37
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	5,600,000	21,001.91	1,176,107,390	21,250.03	1,190,002,156	5.750	2032/10/25	1.21
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	10,000,000	11,354.00	1,135,400,289	11,220.32	1,122,032,465	3.250	2024/1/29	1.14
アメリカ	特殊債券	TENN VALLEY AUTHORITY	10,000,000	10,966.86	1,096,686,662	10,759.36	1,075,936,673	2.875	2027/2/1	1.09
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	8,000,000	12,926.99	1,034,159,644	13,176.98	1,054,158,470	1.250	2033/4/22	1.07

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	63.36
地方債証券	9.80
特殊債券	23.55
合計	96.71

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	売建	171,840,317.41	18,700,240,812	19,037,368,426	19.37
	ユーロ	売建	389,000,000.00	50,338,454,910	50,552,411,000	51.43
	英ポンド	売建	72,607,182.96	10,724,383,109	10,570,925,698	10.75
	スウェーデンクローナ	売建	1,244,055,555.56	15,489,298,311	15,774,624,444	16.05

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## インデックス マザーファンド リート

以下の運用状況は2018年 7月31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(%)
投資証券	日本	3,074,559,800	98.74
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		39,182,801	1.26
合計(純資産総額)		3,113,742,601	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	28,128,000	0.90

(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	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	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	352	619,000	217,888,000	622,000	218,944,000	7.03
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	363	572,000	207,636,000	585,000	212,355,000	6.82
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	1,076	157,200	169,147,200	158,400	170,438,400	5.47
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人 投資証券	686	200,700	137,680,200	203,900	139,875,400	4.49
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	801	172,500	138,172,500	173,400	138,893,400	4.46
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	723	174,200	125,946,600	174,200	125,946,600	4.04
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	455	262,652.65	119,506,956	276,000	125,580,000	4.03

日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	487	229,600	111,815,200	226,100	110,110,700	3.54
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	354	277,909.98	98,380,134	290,900	102,978,600	3.31
日本	投資証券	G L P 投資法人 投資証券	803	119,361.23	95,847,075	119,400	95,878,200	3.08
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	230	404,000	92,920,000	402,500	92,575,000	2.97
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	174	485,375.74	84,455,380	499,000	86,826,000	2.79
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	1,051	81,000	85,131,000	81,900	86,076,900	2.76
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	112	684,000	76,608,000	678,000	75,936,000	2.44
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	937	68,737.58	64,407,120	72,200	67,651,400	2.17
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	121	491,000	59,411,000	529,000	64,009,000	2.06
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	84	640,449.64	53,797,770	681,000	57,204,000	1.84
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	123	451,000	55,473,000	450,000	55,350,000	1.78
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	390	140,100	54,639,000	138,100	53,859,000	1.73
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	1,068	50,764.51	54,216,505	49,350	52,705,800	1.69
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	242	225,300	54,522,600	216,000	52,272,000	1.68
日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	423	120,800	51,098,400	120,600	51,013,800	1.64
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	325	144,400	46,930,000	143,700	46,702,500	1.50
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	262	168,891.94	44,249,690	172,900	45,299,800	1.45
日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	373	122,635.47	45,743,032	119,500	44,573,500	1.43
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	259	160,000	41,440,000	162,100	41,983,900	1.35
日本	投資証券	日本リート投資法人 投資証券	117	327,258.58	38,289,255	346,500	40,540,500	1.30
日本	投資証券	プレミア投資法人 投資証券	345	106,129.31	36,614,612	112,800	38,916,000	1.25
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	408	87,300	35,618,400	91,000	37,128,000	1.19
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	243	148,600	36,109,800	152,500	37,057,500	1.19

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.74
合計	98.74

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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REIT指数先物 8年09月	201	買建	16	日本円	27,544,000	28,128,000	0.90
----------	-------	---------------------	-----	----	----	-----	------------	------------	------

(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。

## インデックス マザーファンド 海外先進国債券

以下の運用状況は2018年7月31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	100,798,934	43.43
	カナダ	4,735,118	2.04
	メキシコ	1,917,229	0.83
	ドイツ	16,414,200	7.07
	イタリア	21,114,372	9.10
	フランス	23,834,234	10.27
	オランダ	5,112,607	2.20
	スペイン	13,611,005	5.86
	ベルギー	5,956,259	2.57
	オーストリア	3,428,373	1.48
	フィンランド	1,471,852	0.63
	アイルランド	1,818,992	0.78
	イギリス	16,080,431	6.93
	スイス	269,888	0.12
	スウェーデン	944,649	0.41
	ノルウェー	572,550	0.25
	デンマーク	1,367,358	0.59
	ポーランド	1,457,432	0.63
	オーストラリア	4,907,113	2.11
	シンガポール	847,267	0.37
マレーシア	1,179,018	0.51	
南アフリカ	1,465,332	0.63	
	小計	229,304,213	98.80
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		2,782,375	1.20
合計(純資産総額)		232,086,588	100.00

### その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		285,846	0.12

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 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	178,000	11,098.77	19,755,828	11,090.15	19,740,474	2.625	2020/8/15	8.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	146,000	10,857.88	15,852,516	10,831.71	15,814,299	2.000	2021/10/31	6.81
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	127,000	10,542.26	13,388,675	10,502.58	13,338,287	1.625	2023/4/30	5.75
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	87,000	11,011.08	9,579,641	11,010.14	9,578,830	1.625	2019/7/31	4.13
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	80,000	10,186.27	8,149,022	10,112.53	8,090,027	1.625	2026/2/15	3.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	76,000	10,127.44	7,696,861	9,856.47	7,490,922	2.500	2046/2/15	3.23
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	45,000	15,045.40	6,770,430	14,930.02	6,718,510	5.500	2022/11/1	2.89
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	44,000	14,632.84	6,438,452	14,582.46	6,416,285	3.000	2022/4/25	2.76
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	61,000	10,708.34	6,532,091	10,453.15	6,376,426	2.750	2042/8/15	2.75
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	59,000	10,831.93	6,390,840	10,774.90	6,357,194	2.375	2024/8/15	2.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	56,000	10,772.08	6,032,369	10,742.38	6,015,734	1.875	2022/3/31	2.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	55,000	10,687.74	5,878,257	10,598.42	5,829,133	2.375	2027/5/15	2.51
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	39,000	13,293.13	5,184,324	13,215.01	5,153,855	0.500	2025/5/25	2.22
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	40,000	12,752.63	5,101,052	12,610.21	5,044,085	2.000	2025/12/1	2.17
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	23,000	20,447.91	4,703,021	20,198.26	4,645,602	4.750	2035/4/25	2.00
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	30,000	14,494.21	4,348,263	14,432.71	4,329,813	2.000	2023/8/15	1.87
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	24,000	17,729.34	4,255,043	17,596.81	4,223,236	5.150	2028/10/31	1.82
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	26,000	16,097.02	4,185,227	15,813.06	4,111,397	5.250	2029/11/1	1.77
イギリス	国債証券	UK TREASURY	24,000	15,057.68	3,613,845	15,033.54	3,608,051	1.750	2022/9/7	1.55
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	17,000	20,293.15	3,449,837	20,145.51	3,424,738	6.500	2027/7/4	1.48
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	24,000	13,764.78	3,303,548	13,689.42	3,285,462	1.600	2025/4/30	1.42
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	16,000	19,584.48	3,133,518	19,396.21	3,103,395	5.500	2029/4/25	1.34
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	21,000	14,001.41	2,940,297	13,971.03	2,933,917	2.500	2021/1/4	1.26
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	15,000	19,066.06	2,859,910	18,922.25	2,838,338	5.500	2028/3/28	1.22
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	20,000	13,751.55	2,750,311	13,707.52	2,741,505	4.250	2020/3/1	1.18
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	13,000	21,172.03	2,752,364	20,867.01	2,712,712	4.500	2041/4/25	1.17
イギリス	国債証券	UK TREASURY	13,000	19,895.42	2,586,405	19,690.73	2,559,795	3.500	2045/1/22	1.10
イギリス	国債証券	UK TREASURY	12,000	21,345.03	2,561,404	21,153.01	2,538,362	4.250	2040/12/7	1.09
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	16,000	15,930.81	2,548,931	15,617.96	2,498,875	4.750	2044/9/1	1.08
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	14,000	17,579.60	2,461,145	17,468.71	2,445,620	4.850	2026/3/15	1.05

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.80
合 計	98.80

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

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	ユーロ	売建	2,200.00	284,968	285,846	0.12

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

#### 先進国資本エマージング株式マザーファンド

以下の運用状況は2018年 7月31日現在です。

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

#### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	メキシコ	1,190,042,320	6.30
	ブラジル	1,303,588,927	6.90
	チリ	1,534,521,031	8.12
	ギリシャ	227,676,339	1.20
	トルコ	561,218,538	2.97
	チェコ	518,086,672	2.74
	ポーランド	443,151,785	2.34
	ロシア	251,284,326	1.33
	ケイマン	1,425,895,764	7.54
	香港	431,688,544	2.28
	マレーシア	1,148,962,942	6.08
	タイ	534,067,131	2.83
	フィリピン	290,214,202	1.54
	インドネシア	1,061,868,854	5.62
	韓国	580,021,885	3.07
	台湾	264,099,198	1.40
	中国	1,669,268,481	8.83
	インド	3,820,645,524	20.22
	南アフリカ	1,475,151,369	7.81
小計	18,731,453,832	99.11	

コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		167,598,000	0.89
合計(純資産総額)		18,899,051,832	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	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 (%)
インド	株式	HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	家庭用品・パーソナル用品	250,615	2,611.91	654,584,325	2,752.58	689,838,087	3.65
インド	株式	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	自動車・自動車部品	40,948	14,585.72	597,256,431	15,292.49	626,197,167	3.31
インド	株式	NESTLE INDIA LIMITED	食品・飲料・タバコ	37,048	15,904.94	589,246,249	16,499.51	611,273,921	3.23
インドネシア	株式	PT UNILEVER INDONESIA TBK	家庭用品・パーソナル用品	1,694,100	341.01	577,715,383	339.57	575,265,537	3.04
チェコ	株式	KOMERCNI BANKA AS	銀行	107,523	4,653.17	500,323,700	4,818.37	518,086,672	2.74
チリ	株式	ENEL CHILE SA-ADR	公益事業	853,617	568.37	485,171,318	577.25	492,752,120	2.61
インドネシア	株式	HM SAMPOERNA TBK PT	食品・飲料・タバコ	16,039,400	27.19	436,255,929	30.33	486,603,317	2.57
中国	株式	HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	食品・飲料・タバコ	1,144,921	430.65	493,066,104	417.43	477,930,784	2.53
南アフリカ	株式	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	素材	138,500	2,837.58	393,005,487	3,308.94	458,288,688	2.42
チリ	株式	BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	銀行	124,535	3,531.40	439,783,104	3,635.57	452,756,644	2.40
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP-ADR	ソフトウェア・サービス	21,367	22,814.77	487,483,302	20,516.86	438,383,923	2.32
メキシコ	株式	WALMART DE MEXICO -SER V	食品・生活必需品 小売り	1,343,200	309.33	415,503,107	324.53	435,919,710	2.31
インド	株式	AMBUJA CEMENTS LIMITED	素材	1,142,192	324.68	370,847,132	370.01	422,622,462	2.24
メキシコ	株式	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	公益事業	753,900	505.67	381,226,920	552.39	416,452,701	2.20
ポーランド	株式	BANK ZACHODNI WBK SA	銀行	35,025	10,694.91	374,589,249	11,125.20	389,660,410	2.06
マレーシア	株式	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	食品・飲料・タバコ	92,400	3,998.57	369,467,868	4,034.12	372,753,150	1.97
ブラジル	株式	TIM PARTICIPACOES SA-ADR	電気通信サービス	197,746	1,921.44	379,958,595	1,861.63	368,131,409	1.95
南アフリカ	株式	KUMBA IRON ORE LTD	素材	146,857	2,415.24	354,695,252	2,410.89	354,056,910	1.87
インド	株式	SIEMENS INDIA LIMITED	資本財	214,525	1,629.18	349,500,912	1,596.17	342,419,978	1.81
メキシコ	株式	BANCO SANTANDER MEXICO -ADR	銀行	359,126	737.10	264,714,073	940.25	337,669,909	1.79
南アフリカ	株式	VODACOM GROUP LTD	電気通信サービス	271,962	1,076.27	292,705,812	1,162.91	316,269,641	1.67
チリ	株式	ENEL AMERICAS SA-SPONS ADR	公益事業	316,054	1,045.71	330,502,156	972.44	307,345,954	1.63

中国	株式	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	銀行	3,636,000	88.01	320,013,745	79.60	289,455,415	1.53
南アフリカ	株式	NEDBANK GROUP LTD	銀行	117,266	2,162.62	253,602,798	2,305.60	270,369,076	1.43
ブラジル	株式	TELEF BRASIL-ADR	電気通信サービス	217,900	1,358.49	296,015,070	1,231.10	268,256,886	1.42
ブラジル	株式	ENGIE BRASIL SA	公益事業	242,600	996.62	241,781,225	1,104.32	267,908,032	1.42
ブラジル	株式	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	食品・生活必需品小売り	583,000	456.66	266,234,237	452.20	263,632,600	1.39
ケイマン	株式	51JOB INC-ADR	商業・専門サービス	26,100	11,874.73	309,930,706	9,955.37	259,835,334	1.37
ケイマン	株式	TOWNGAS CHINA CO LTD	公益事業	2,350,000	106.40	250,054,194	109.30	256,860,170	1.36
マレーシア	株式	IHH HEALTHCARE BHD	ヘルスケア機器・サービス	1,565,000	160.93	251,861,192	163.00	255,104,390	1.35

## 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	2.38
		素材	8.78
		資本財	3.33
		商業・専門サービス	2.04
		運輸	1.23
		自動車・自動車部品	6.14
		小売	0.89
		食品・生活必需品小売り	3.70
		食品・飲料・タバコ	13.37
		家庭用品・パーソナル用品	6.69
		ヘルスケア機器・サービス	1.35
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.22
		銀行	19.55
		各種金融	3.15
		保険	1.15
		不動産	1.02
		ソフトウェア・サービス	2.32
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	0.91
		電気通信サービス	7.44
公益事業	11.33		
半導体・半導体製造装置	1.11		
合計		99.11	

## 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。

## インデックス マザーファンド コモディティ

以下の運用状況は2018年 7月31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（％）
投資信託受益証券	ドイツ	8,094,700	99.55
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		36,290	0.45
合計（純資産総額）		8,130,990	100.00

### その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		36,380	0.45

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	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 （％）
ドイツ	投資信託受益 証券	ISH DIV COMDTY SWAP DE-ETF	3,387	2,321.84	7,864,103	2,389.93	8,094,700	99.55

##### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	99.55
合計	99.55

### 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	ユーロ	売建	280.00	36,268	36,380	0.45

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込(販売)手続等】

本書提出日現在、取得申込みの受付は行なってありません。

### 2【換金(解約)手続等】

#### <解約請求による換金>

#### (1)解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

#### (2)取扱時間

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

#### (3)解約請求不可日

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

英国証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### (4)解約制限

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

#### (5)解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### <委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

#### (6)手取額

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

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

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

#### (7)解約単位

1口単位

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

#### (8)解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して7営業日目からお支払いします。

#### (9)受付の中止および取消

・委託会社は、投資対象とする投資信託証券からの換金ができない場合、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、投資対象国における非常事態(金融危機、デフォルト、

重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争などによる市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少など、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。

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

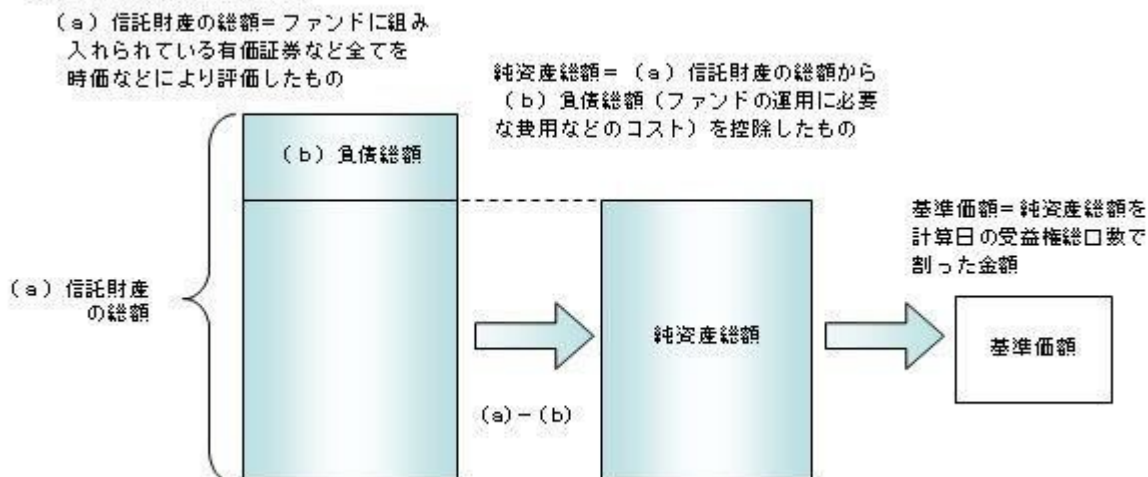
### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### 基準価額の算出

- ・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。
- ・基準価額とは、信託財産に属する資産を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは1万口当りに換算した価額で表示することがあります。

##### <基準価額算出の流れ>



##### 有価証券などの評価基準

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

##### <主な資産の評価方法>

###### 投資信託証券（国内籍）

原則として、基準価額計算日の基準価額で評価します。

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

##### 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

##### <委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

2026年7月17日までとします(2016年8月22日設定)。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

#### (4)【計算期間】

毎年7月18日から翌年7月17日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

#### (5)【その他】

信託の終了(繰上償還)

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
  - イ) 受益者の解約により純資産総額が10億円を下回ることとなった場合
  - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
  - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、委託会社は書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行ないます。(後述の「書面決議」をご覧ください。)
- 3) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
  - イ) 2026年6月30日以前の毎営業日において、この信託の1万口当たり基準価額が13,000円以上となった場合
  - ロ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、書面決議が困難な場合
  - ハ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
  - ニ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき(監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。)
  - ホ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 4) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

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

信託約款の変更など

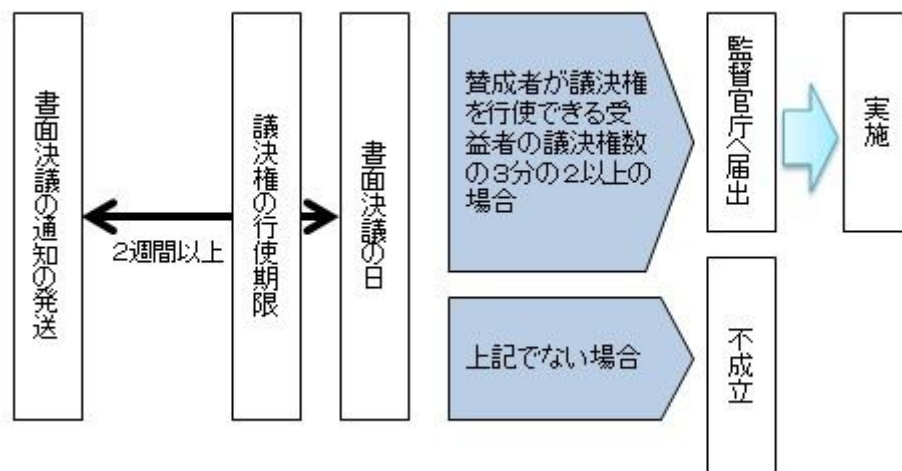
- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合(以下「併合」といいます。)を行なうことができます。信託約款の変更または併合を行なう際には、委託会社は、その旨および内容をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものまたは併合(受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものを除きます。)については、書面決議を行ないます。(後述の「書面決議」をご覧ください。)
- 3) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとする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

書面決議

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

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

<書面決議の主な流れ>



公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

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

運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

関係法人との契約について

- ・販売会社との募集の取扱いなどに関する契約の有効期間は契約日より1年間とします。ただし、期間満了の3ヵ月前までに、販売会社、委託会社いずれからも別段の意思表示がないときは、自動的に1年間延長されるものとし、以後も同様とします。
- ・投資顧問会社との投資顧問契約は、当ファンドの信託期間終了まで存続します。ただし、投資顧問会社、委託会社が重大な契約違反を行なったとき、その他契約を継続し難い重大な事由があるときは、相手方に通知をなすことにより契約を終了することができます。

他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づき作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(平成29年7月19日から平成30年7月17日まで)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】

## 【時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-08】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 平成29年 7月18日現在	第2期 平成30年 7月17日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	4,081,245
コール・ローン	35,857,283	14,661,876
投資信託受益証券	216,868,185	114,897,216
親投資信託受益証券	786,897,881	399,365,289
未収入金	4,535,549	-
流動資産合計	1,044,158,898	533,005,626
資産合計	1,044,158,898	533,005,626
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	5,565,479	-
未払受託者報酬	143,002	93,007
未払委託者報酬	3,814,721	2,481,693
未払利息	58	27
その他未払費用	977,182	703,197
流動負債合計	10,500,442	3,277,924
負債合計	10,500,442	3,277,924
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,023,492,289	504,970,493
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	10,166,167	24,757,209
(分配準備積立金)	11,187,374	25,261,050
元本等合計	1,033,658,456	529,727,702
純資産合計	1,033,658,456	529,727,702
負債純資産合計	1,044,158,898	533,005,626



## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期		第2期	
	自	平成28年 8月22日 至 平成29年 7月18日	自	平成29年 7月19日 至 平成30年 7月17日
営業収益				
受取利息		72		77
有価証券売買等損益		19,964,719		39,818,057
営業収益合計		19,964,791		39,818,134
営業費用				
支払利息		17,931		12,765
受託者報酬		326,278		235,329
委託者報酬		8,703,655		6,278,622
その他費用		1,007,133		727,202
営業費用合計		10,054,997		7,253,918
営業利益又は営業損失( )		9,909,794		32,564,216
経常利益又は経常損失( )		9,909,794		32,564,216
当期純利益又は当期純損失( )		9,909,794		32,564,216
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( )		1,277,580		12,822,770
期首剰余金又は期首欠損金( )		-		10,166,167
剰余金増加額又は欠損金減少額		276,453		-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		276,453		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,297,660		5,150,404
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		5,150,404
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,297,660		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		10,166,167		24,757,209

## ( 3 ) 【注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
-----------------	--

( 貸借対照表に関する注記 )

		第1期 平成29年 7月18日現在	第2期 平成30年 7月17日現在
1.	期首元本額	547,281,529円	1,023,492,289円
	期中追加設定元本額	754,916,004円	- 円
	期中一部解約元本額	278,705,244円	518,521,796円
2.	受益権の総数	1,023,492,289口	504,970,493口

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第1期 自 平成28年 8月22日 至 平成29年 7月18日		第2期 自 平成29年 7月19日 至 平成30年 7月17日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	4,838,756円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 6,839,311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	6,348,618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 12,902,135円
C	信託約款に定める収益調整金	178,251円	C 信託約款に定める収益調整金 87,947円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	0円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 5,519,604円
E	分配対象収益 ( A+B+C+D )	11,365,625円	E 分配対象収益 ( A+B+C+D ) 25,348,997円
F	分配対象収益(1万口当たり)	111円	F 分配対象収益(1万口当たり) 501円
G	分配金額	0円	G 分配金額 0円
H	分配金額(1万口当たり)	0円	H 分配金額(1万口当たり) 0円

( 金融商品に関する注記 )

金融商品の状況に関する事項

	第1期 自 平成28年 8月22日 至 平成29年 7月18日	第2期 自 平成29年 7月19日 至 平成30年 7月17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

	第1期 平成29年 7月18日現在	第2期 平成30年 7月17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)

第1期（平成29年 7月18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
投資信託受益証券	19,305,967
親投資信託受益証券	13,607,770
合計	32,913,737

第2期（平成30年 7月17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
投資信託受益証券	7,710,396
親投資信託受益証券	15,797,575
合計	23,507,971

（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）

第1期 平成29年 7月18日現在		第2期 平成30年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	1.0099円	1口当たり純資産額	1.0490円
(1万口当たり純資産額)	(10,099円)	(1万口当たり純資産額)	(10,490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
投資信託受益証券	F O F s用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	3,495,818	3,313,336	
	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）	46,780,874	66,634,676	
	インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）	32,064,485	36,572,751	
	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）	7,460,990	8,376,453	
投資信託受益証券 合計		89,802,167	114,897,216	
親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド T O P I X	38,111,193	80,963,418	
	ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド	146,451,186	188,497,321	
	インデックス マザーファンド Jリート	42,062,940	46,193,520	
	先進国資本エマージング株式マザーファンド	5,837,117	7,079,255	
	インデックス マザーファンド 海外先進国債券	67,932,168	75,017,493	
	インデックス マザーファンド コモディティ	1,578,915	1,614,282	
親投資信託受益証券 合計		301,973,519	399,365,289	
合計		391,775,686	514,262,505	

(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、「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）」「インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）」「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）」「F O F s用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）」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「投資信託受益証券」は同投資信託です。なお、同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。

また、当ファンドは、「インデックス マザーファンド T O P I X」「ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド」「インデックス マザーファンド Jリート」「インデックス マザーファンド 海外先進国債券」「先進国資本エマージング株式マザーファンド」「インデックス マザーファンド コモディティ」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）

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）

貸借対照表

（単位：円）

	平成29年 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	954,307
コール・ローン	6,144,649	2,140,223
親投資信託受益証券	581,834,116	287,739,485
未収入金	7,337,944	575,141
流動資産合計	595,316,709	291,409,156
資産合計	595,316,709	291,409,156
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	7,363,722	535,529
未払受託者報酬	11,727	5,308
未払委託者報酬	23,470	10,629
未払利息	9	4
その他未払費用	267,200	254,864
流動負債合計	7,666,128	806,334
負債合計	7,666,128	806,334
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	459,725,262	204,021,248
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	127,925,319	86,581,574
（分配準備積立金）	32,977,473	48,909,140
元本等合計	587,650,581	290,602,822
純資産合計	587,650,581	290,602,822
負債純資産合計	595,316,709	291,409,156

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
-----------------	--

（貸借対照表に関する注記）

		平成29年 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
1.	期首	平成28年 8月23日	平成29年 7月19日
	期首元本額	25,483,390円	459,725,262円
	期首からの追加設定元本額	571,408,701円	113,997,248円
	期首からの一部解約元本額	137,166,829円	369,701,262円
2.	受益権の総数	459,725,262口	204,021,248口

期首は当該投資信託の期首日であります。

（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 8月23日 至 平成29年 7月18日	自 平成29年 7月19日 至 平成30年 7月17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 7月18日現在	平成30年 7月17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 7月18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
親投資信託受益証券	14,399,786
合計	14,399,786

(平成30年 7月17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
親投資信託受益証券	14,718,744
合計	14,718,744

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、当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 7月18日現在		平成30年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	1.2783円	1口当たり純資産額	1.4244円
(1万口当たり純資産額)	(12,783円)	(1万口当たり純資産額)	(14,244円)

附属明細表



## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
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	114,010,415	287,739,485	
合計		114,010,415	287,739,485	

(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。

「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）」は、「海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI（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。

## 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 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
資産の部		
流動資産		
預金	307,569,638	100,541,259
金銭信託	-	240,784,057
コール・ローン	451,753,117	540,006,374
出資金	6,057,465	8,742,434
株式	77,209,492,890	85,801,513,296

投資証券	2,049,932,032	2,130,214,696
派生商品評価勘定	15,197,796	45,434,244
未収入金	971,553	4,465,246
未収配当金	72,533,750	75,897,879
差入委託証拠金	159,621,542	239,882,601
流動資産合計	80,273,129,783	89,187,482,086
資産合計	80,273,129,783	89,187,482,086
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,052,531	348,771
未払解約金	123,078,197	34,813,722
未払利息	709	1,082
流動負債合計	125,131,437	35,163,575
負債合計	125,131,437	35,163,575
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	35,612,262,377	35,324,568,583
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	44,535,735,969	53,827,749,928
元本等合計	80,147,998,346	89,152,318,511
純資産合計	80,147,998,346	89,152,318,511
負債純資産合計	80,273,129,783	89,187,482,086

## 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 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
1.	期首	平成28年 8月23日	平成29年 7月19日
	期首元本額	38,963,610,372円	35,612,262,377円
	期首からの追加設定元本額	2,303,121,189円	3,350,271,901円
	期首からの一部解約元本額	5,654,469,184円	3,637,965,695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）	15,033,115,682円	16,639,822,213円
	DCインデックスバランス（株式20）	56,955,306円	72,844,871円
	DCインデックスバランス（株式40）	176,794,578円	211,604,433円
	DCインデックスバランス（株式60）	335,512,071円	414,152,909円
	DCインデックスバランス（株式80）	384,439,297円	447,074,660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	2,669,064,633円	2,170,163,367円
	日興五大陸株式ファンド	6,053,085,502円	5,558,401,225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	27,608,632円	23,381,245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）	258,524,001円	114,010,415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	155,261,740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）	5,815,577円	5,393,742円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	4,652,168円	4,402,036円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	7,031,416円	6,747,744円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	8,047,942円	6,773,633円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	5,839,116,164円	4,868,477,400円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	28,015,269円	26,978,569円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	83,026,016円	78,905,103円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	119,041,456円	117,308,896円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	119,469,441円	116,492,414円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,287,046,982円	4,286,371,968円
	計	35,612,262,377円	35,324,568,583円
2.	受益権の総数	35,612,262,377口	35,324,568,583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 8月23日 至 平成29年 7月18日	自 平成29年 7月19日 至 平成30年 7月17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 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品            短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>(1)有価証券            同左</p> <p>(2)デリバティブ取引            同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品            同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成29年 7月18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	1,831,174
株式	9,080,913,781
投資証券	34,783,285
合計	9,113,865,892

（平成30年 7月17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	1,431,388
株式	5,156,474,098
投資証券	35,287,461
合計	5,193,192,947

(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 7月18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	889,324,435	-	894,432,290	5,107,855
合計		889,324,435	-	894,432,290	5,107,855

（平成30年 7月17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	1,156,470,072	-	1,185,079,860	28,609,788
合計		1,156,470,072	-	1,185,079,860	28,609,788

## (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 7月18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	454,716,590	-	462,754,000	8,037,410
	米ドル	311,344,150	-	314,259,500	2,915,350
	ユーロ	143,372,440	-	148,494,500	5,122,060
合計		454,716,590	-	462,754,000	8,037,410

(平成30年 7月17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	830,943,315	-	847,419,000	16,475,685
	米ドル	681,831,085	-	695,968,000	14,136,915
	ユーロ	149,112,230	-	151,451,000	2,338,770
合計		830,943,315	-	847,419,000	16,475,685

## (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 7月18日現在		平成30年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	2.2506円	1口当たり純資産額	2.5238円
(1万口当たり純資産額)	(22,506円)	(1万口当たり純資産額)	(25,238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	72.84	816,026.52	
	ANDEAVOR	3,000	135.07	405,210.00	
	ANTERO RESOURCES CORP	4,560	21.42	97,675.20	
	APACHE CORP	7,904	46.00	363,584.00	
	BAKER HUGHES A GE CO	9,345	32.33	302,123.85	
	CABOT OIL & GAS CORP	9,730	23.70	230,601.00	
	CHENIERE ENERGY INC	4,070	60.99	248,229.30	
	CHEVRON CORP	40,011	122.98	4,920,552.78	

CIMAREX ENERGY CO	2,005	97.92	196,329.60
CONCHO RESOURCES INC	3,055	147.86	451,712.30
CONOCOPHILLIPS	24,740	70.58	1,746,149.20
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,960	60.95	119,462.00
DEVON ENERGY CORPORATION	11,251	44.21	497,406.71
DIAMONDBACK ENERGY INC	2,210	129.99	287,277.90
EOG RESOURCES INC	12,182	124.61	1,517,999.02
EQT CORP	5,765	54.87	316,325.55
EXXON MOBIL CORP	88,691	82.49	7,316,120.59
HALLIBURTON CO	18,077	44.96	812,741.92
HELMERICH & PAYNE	2,120	62.55	132,606.00
HESS CORP	6,000	63.88	383,280.00
HOLLYFRONTIER CORP	3,740	68.90	257,686.00
KINDER MORGAN INC	40,700	17.80	724,460.00
MARATHON OIL CORP	17,867	20.04	358,054.68
MARATHON PETROLEUM CORP	10,032	71.42	716,485.44
NATIONAL OILWELL VARCO INC	8,671	43.85	380,223.35
NEWFIELD EXPLORATION CO	4,040	29.09	117,523.60
NOBLE ENERGY INC	10,672	34.86	372,025.92
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	16,101	82.53	1,328,815.53
ONEOK INC	8,790	70.01	615,387.90
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	4,490	31.49	141,390.10
PHILLIPS 66	9,505	111.32	1,058,096.60
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,420	183.00	625,860.00
SCHLUMBERGER LTD	29,091	67.42	1,961,315.22
TARGA RESOURCES CORP	4,560	51.68	235,660.80
TECHNIPFMC PLC	9,351	30.58	285,953.58
VALERO ENERGY CORP	8,992	106.30	955,849.60
WILLIAMS COS INC	16,874	27.25	459,816.50
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	4,535	155.55	705,419.25
ALBEMARLE CORP	2,320	94.96	220,307.20
AVERY DENNISON CORP	1,820	103.00	187,460.00
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	4,170	29.66	123,682.20
BALL CORP	6,840	37.41	255,884.40
CELANESE CORP-SERIES A	2,700	108.57	293,139.00



CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,850	42.24	204,864.00
CHEMOURS CO/THE	3,600	43.18	155,448.00
CROWN HOLDINGS INC	2,815	44.75	125,971.25
DOWDUPONT INC	48,897	65.72	3,213,510.84
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,015	98.61	297,309.15
ECOLAB INC	5,710	142.62	814,360.20
FMC CORP	2,790	86.72	241,948.80
FREEPORT-MCMORAN INC	27,868	16.77	467,346.36
INTERNATIONAL PAPER CO	8,020	52.46	420,729.20
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,664	127.38	211,960.32
LYONDELLBASELL INDU-CL A	7,340	106.22	779,654.80
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,245	224.92	280,025.40
MOSAIC CO/THE	8,490	27.98	237,550.20
NEWMONT MINING CORP	11,050	36.50	403,325.00
NUCOR CORP	6,569	64.01	420,481.69
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,950	114.29	222,865.50
PPG INDUSTRIES INC	5,124	102.37	524,543.88
PRAXAIR INC	5,920	167.04	988,876.80
SEALED AIR CORP	3,966	42.49	168,515.34
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,857	416.85	774,090.45
STEEL DYNAMICS INC	5,580	46.85	261,423.00
VULCAN MATERIALS CO	2,713	122.91	333,454.83
WESTLAKE CHEMICAL CORP	790	105.51	83,352.90
WESTROCK CO	5,239	57.04	298,832.56
3M CO	12,466	201.11	2,507,037.26
ACUITY BRANDS INC	890	132.33	117,773.70
AERCAP HOLDINGS NV	2,660	54.96	146,193.60
AGCO CORP	1,250	58.59	73,237.50
ALLEGION PLC	2,080	79.24	164,819.20
AMETEK INC	4,763	72.97	347,556.11
ARCONIC INC	8,783	19.20	168,633.60
BOEING CO/THE	11,692	356.10	4,163,521.20
CATERPILLAR INC	12,556	138.08	1,733,732.48
CUMMINS INC	3,195	134.68	430,302.60
DEERE & CO	6,540	136.27	891,205.80

DOVER CORP	3,150	74.10	233,415.00
EATON CORP PLC	9,026	77.34	698,070.84
EMERSON ELECTRIC CO	12,970	69.31	898,950.70
FASTENAL CO	5,753	55.43	318,888.79
FLOWSERVE CORP	2,575	41.14	105,935.50
FLUOR CORP	2,903	48.09	139,605.27
FORTIVE CORP	6,364	76.46	486,591.44
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,160	55.13	174,210.80
GENERAL DYNAMICS CORP	5,182	191.50	992,353.00
GENERAL ELECTRIC CO	181,973	13.90	2,529,424.70
HARRIS CORP	2,410	149.57	360,463.70
HD SUPPLY HOLDINGS INC	3,740	43.88	164,111.20
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	15,706	146.40	2,299,358.40
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	960	226.95	217,872.00
IDEX CORP	1,570	137.42	215,749.40
ILLINOIS TOOL WORKS	6,320	141.82	896,302.40
INGERSOLL-RAND PLC	5,096	89.96	458,436.16
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,420	65.45	158,389.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	5,170	64.67	334,343.90
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	4,500	38.08	171,360.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	18,864	34.76	655,712.64
L3 TECHNOLOGIES INC	1,651	204.20	337,134.20
LENNOX INTERNATIONAL INC	770	212.56	163,671.20
LOCKHEED MARTIN CORP	5,411	319.05	1,726,379.55
MASCO CORP	6,439	37.69	242,685.91
MIDDLEBY CORP	1,180	99.64	117,575.20
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,384	320.33	1,083,996.72
OWENS CORNING	2,170	64.45	139,856.50
PACCAR INC	7,014	62.57	438,865.98
PARKER HANNIFIN CORP	2,760	157.70	435,252.00
PENTAIR PLC	3,498	43.07	150,658.86
RAYTHEON COMPANY	6,002	199.61	1,198,059.22
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,683	167.63	449,751.29
ROCKWELL COLLINS INC.	3,373	137.83	464,900.59
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,260	282.59	638,653.40

SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,460	50.34	174,176.40
SMITH (A.O.) CORP	3,020	59.47	179,599.40
SNAP-ON INC	1,160	163.87	190,089.20
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	2,310	87.76	202,725.60
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,116	134.51	419,133.16
TEXTRON INC	5,416	66.68	361,138.88
TRANSDIGM GROUP INC	1,100	361.03	397,133.00
UNITED RENTALS INC	1,720	151.75	261,010.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	15,895	128.98	2,050,137.10
WABCO HOLDINGS INC	1,110	120.51	133,766.10
WABTEC CORP	1,880	102.75	193,170.00
MW GRAINGER INC	1,107	302.92	335,332.44
XYLEM INC	3,548	67.40	239,135.20
CINTAS CORP	1,857	192.50	357,472.50
COPART INC	4,260	58.43	248,911.80
COSTAR GROUP INC	755	427.81	322,996.55
EQUIFAX INC	2,404	126.64	304,442.56
IHS MARKIT LTD	9,063	52.11	472,272.93
MANPOWERGROUP INC	1,447	85.00	122,995.00
NIELSEN HOLDINGS PLC	7,405	31.17	230,813.85
REPUBLIC SERVICES INC	4,590	69.38	318,454.20
ROBERT HALF INTL INC	3,075	67.08	206,271.00
ROLLINS INC	2,000	55.03	110,060.00
STERICYCLE INC	1,705	67.82	115,633.10
TRANSUNION	4,100	74.80	306,680.00
VERISK ANALYTICS INC	3,170	112.01	355,071.70
WASTE CONNECTIONS INC	6,026	77.33	465,990.58
WASTE MANAGEMENT INC	8,864	83.77	742,537.28
AMERCO	155	370.55	57,435.25
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	2,270	37.28	84,625.60
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	2,900	87.30	253,170.00
CSX CORP	17,833	64.00	1,141,312.00
DELTA AIR LINES INC	3,615	50.67	183,172.05
EXPEDITORS INTL WASH INC	3,647	72.33	263,787.51
FEDEX CORP	5,358	230.18	1,233,304.44

HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,820	121.13	220,456.60
KANSAS CITY SOUTHERN	2,160	104.95	226,692.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	2,750	36.36	99,990.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	5,860	155.23	909,647.80
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,190	142.95	170,110.50
SOUTHWEST AIRLINES CO	2,890	53.08	153,401.20
UNION PACIFIC CORP	16,426	138.89	2,281,407.14
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	1,715	72.26	123,925.90
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	14,427	110.65	1,596,347.55
XPO LOGISTICS INC	2,450	99.07	242,721.50
APTIV PLC	5,900	93.55	551,945.00
AUTOLIV INC	1,770	105.34	186,451.80
BORGWARNER INC	4,330	44.86	194,243.80
FORD MOTOR COMPANY	78,845	10.85	855,468.25
GENERAL MOTORS CORP	26,215	39.56	1,037,065.40
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	5,430	22.42	121,740.60
HARLEY-DAVIDSON INC	3,709	42.94	159,264.46
LEAR CORP	1,370	186.71	255,792.70
TESLA INC	2,720	310.10	843,472.00
DR HORTON INC	7,256	41.98	304,606.88
GARMIN LTD	2,395	63.44	151,938.80
HANESBRANDS INC	7,940	21.86	173,568.40
HASBRO INC	2,748	94.35	259,273.80
LEGGETT & PLATT INC	2,778	45.25	125,704.50
LENNAR CORP-CL A	5,820	54.05	314,571.00
LULULEMON ATHLETICA INC	2,010	127.26	255,792.60
MATTEL INC	7,349	16.28	119,641.72
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	2,970	67.17	199,494.90
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,318	221.52	291,963.36
NEWELL BRANDS INC	10,026	27.77	278,422.02
NIKE INC -CL B	27,248	77.75	2,118,532.00
NVR INC	70	3,070.88	214,961.60
POLARIS INDUSTRIES INC	1,240	122.35	151,714.00
PULTE GROUP INC	5,660	30.13	170,535.80
PVH CORP	1,600	148.00	236,800.00

RALPH LAUREN CORP	1,165	129.90	151,333.50
TAPESTRY INC	5,696	47.03	267,882.88
TOLL BROTHERS INC	3,321	37.01	122,910.21
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	3,560	21.56	76,753.60
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	4,112	20.11	82,692.32
VF CORP	7,420	88.80	658,896.00
WHIRLPOOL CORP	1,414	153.44	216,964.16
ARAMARK	4,960	38.61	191,505.60
CARNIVAL CORP	8,647	58.40	504,984.80
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	485	452.06	219,249.10
DARDEN RESTAURANTS INC	2,553	111.28	284,097.84
DOMINO'S PIZZA INC	940	279.19	262,438.60
H&R BLOCK INC	4,510	24.00	108,240.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	6,340	80.08	507,707.20
LAS VEGAS SANDS CORP	8,100	74.08	600,048.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	6,373	130.79	833,524.67
MCDONALD'S CORP	16,591	158.78	2,634,318.98
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	5,100	25.25	128,775.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	11,570	31.12	360,058.40
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	4,910	47.19	231,702.90
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,538	109.08	385,925.04
STARBUCKS CORP	29,264	50.94	1,490,708.16
VAIL RESORTS INC	840	288.13	242,029.20
WYNN RESORTS LTD	2,030	166.03	337,040.90
YUM! BRANDS INC	7,324	78.66	576,105.84
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	7,068	58.83	415,810.44
CHARTER COMMUNICATION-A	3,451	304.19	1,049,759.69
COMCAST CORP-CLASS A	97,244	34.97	3,400,622.68
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,320	27.35	90,802.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	6,490	25.35	164,521.50
DISH NETWORK CORP-A	4,769	32.76	156,232.44
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	7,836	23.70	185,713.20
LIBERTY BROADBAND-C	2,140	79.10	169,274.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	3,975	28.81	114,519.75
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	12,321	27.95	344,371.95

LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	3,890	38.05	148,014.50
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	3,580	47.70	170,766.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	1,975	47.45	93,713.75
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	2,760	51.24	141,422.40
NEWS CORP - CLASS A	7,570	15.41	116,653.70
OMNICOM GROUP	5,247	78.10	409,790.70
SIRIUS XM HOLDINGS INC	34,250	7.04	241,120.00
THE WALT DISNEY CO.	31,483	110.20	3,469,426.60
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	9,599	46.41	445,489.59
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	21,392	46.71	999,220.32
VIACOM INC-CLASS B	7,248	29.69	215,193.12
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,508	139.67	210,622.36
AMAZON.COM INC	8,615	1,822.49	15,700,751.35
AUTOZONE INC	552	692.78	382,414.56
BEST BUY CO INC	5,564	75.48	419,970.72
BOOKING HOLDINGS INC	1,008	2,020.00	2,036,160.00
CARMAX INC	3,679	77.25	284,202.75
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	5,570	99.13	552,154.10
DOLLAR TREE INC	4,896	86.09	421,496.64
EXPEDIA INC	2,552	126.66	323,236.32
GAP INC/THE	5,106	29.48	150,524.88
GENUINE PARTS CO	2,961	93.24	276,083.64
HOME DEPOT INC	24,450	198.88	4,862,616.00
KOHL'S CORP	3,292	70.65	232,579.80
L BRANDS INC	4,858	32.02	155,553.16
LKQ CORP	6,330	33.34	211,042.20
LOWE'S COS INC	17,442	99.63	1,737,746.46
MACY'S INC	6,469	36.99	239,288.31
NETFLIX INC	9,090	400.48	3,640,363.20
NORDSTROM INC	2,540	52.43	133,172.20
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,775	285.32	506,443.00
QURATE RETAIL INC	8,930	21.99	196,370.70
ROSS STORES INC	7,862	85.14	669,370.68
TARGET CORP	10,600	77.21	818,426.00
TIFFANY & CO	2,610	132.71	346,373.10

TJX COMPANIES INC	13,313	95.19	1,267,264.47
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,750	78.42	215,655.00
TRIPADVISOR INC	2,330	59.35	138,285.50
ULTA BEAUTY INC	1,240	255.50	316,820.00
COSTCO WHOLESALE CORP	9,219	214.85	1,980,702.15
KROGER CO	17,720	27.99	495,982.80
SYSCO CORP	10,866	70.49	765,944.34
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	18,322	65.16	1,193,861.52
WALMART INC	31,022	87.64	2,718,768.08
ALTRIA GROUP INC	39,908	57.14	2,280,343.12
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	11,343	47.17	535,049.31
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5,280	51.17	270,177.60
BUNGE LTD	2,857	67.66	193,304.62
CAMPBELL SOUP CO	3,485	40.58	141,421.30
COCA-COLA CO/THE	84,962	44.73	3,800,350.26
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	4,220	41.43	174,834.60
CONAGRA BRANDS INC	8,610	35.69	307,290.90
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,530	213.45	753,478.50
GENERAL MILLS INC	12,689	43.96	557,808.44
HERSHEY CO/THE	3,015	92.75	279,641.25
HORMEL FOODS CORP	5,960	37.17	221,533.20
INGREDION INC	1,470	98.01	144,074.70
JM SMUCKER CO/THE	2,250	108.41	243,922.50
KELLOGG CO	5,408	70.59	381,750.72
KRAFT HEINZ CO/THE	13,121	62.64	821,899.44
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,465	118.47	292,028.55
MOLSON COORS BREWING CO -B	3,870	66.90	258,903.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	31,305	42.31	1,324,514.55
MONSTER BEVERAGE CORP	9,160	61.07	559,401.20
PEPSICO INC	29,781	112.96	3,364,061.76
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	32,588	81.92	2,669,608.96
TYSON FOODS INC-CL A	6,166	65.86	406,092.76
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,200	54.87	285,324.00
CLOROX COMPANY	2,616	134.20	351,067.20
COLGATE-PALMOLIVE CO	17,720	65.62	1,162,786.40

COTY INC-CL A	10,000	14.23	142,300.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,600	140.95	648,370.00
KIMBERLY-CLARK CORP	7,293	105.40	768,682.20
PROCTER & GAMBLE CO	52,809	79.53	4,199,899.77
ABBOTT LABORATORIES	36,666	61.78	2,265,225.48
ABIOMED INC	860	419.38	360,666.80
AETNA INC	6,879	191.45	1,316,984.55
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,560	362.28	565,156.80
AMERISOURCEBERGEN CORP	3,254	86.90	282,772.60
ANTHEM INC	5,386	248.28	1,337,236.08
BAXTER INTERNATIONAL INC	11,029	74.01	816,256.29
BECTON DICKINSON AND CO	5,607	245.13	1,374,443.91
BOSTON SCIENTIFIC CORP	28,218	33.15	935,426.70
CARDINAL HEALTH INC	6,565	50.71	332,911.15
CENTENE CORP	4,130	133.23	550,239.90
CERNER CORP	6,230	61.03	380,216.90
CIGNA CORP	5,010	172.35	863,473.50
COOPER COS INC/THE	1,040	242.70	252,408.00
CVS HEALTH CORP	21,367	68.24	1,458,084.08
DANAHER CORP	13,219	98.17	1,297,709.23
DAVITA INC	2,978	71.71	213,552.38
DENTSPLY SIRONA INC	4,852	44.72	216,981.44
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,410	146.68	646,858.80
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	11,634	80.93	941,539.62
HCA HEALTHCARE INC	5,815	106.83	621,216.45
HENRY SCHEIN INC	3,340	74.08	247,427.20
HOLOGIC INC	5,708	41.09	234,541.72
HUMANA INC	2,945	315.68	929,677.60
IDEXX LABORATORIES INC	1,830	237.92	435,393.60
INTUITIVE SURGICAL INC	2,310	518.06	1,196,718.60
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,155	186.44	401,778.20
MCKESSON CORP	4,324	135.58	586,247.92
MEDTRONIC PLC	28,448	87.73	2,495,743.04
QUEST DIAGNOSTICS	2,876	114.38	328,956.88
RESMED INC	2,950	108.97	321,461.50



STRYKER CORP	7,013	173.42	1,216,194.46
TELEFLEX INC	1,090	272.65	297,188.50
UNITEDHEALTH GROUP INC	20,280	256.98	5,211,554.40
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,810	114.71	207,625.10
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,924	114.59	220,471.16
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	2,450	82.23	201,463.50
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	4,162	112.63	468,766.06
ABBVIE INC	31,816	96.25	3,062,290.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	6,620	62.72	415,206.40
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	4,540	134.58	610,993.20
ALKERMES PLC	3,220	44.57	143,515.40
ALLERGAN PLC	6,955	175.66	1,221,715.30
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,800	102.76	184,968.00
AMGEN INC	14,141	194.88	2,755,798.08
BIOGEN INC	4,403	353.03	1,554,391.09
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,500	102.73	359,555.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	34,301	56.43	1,935,605.43
CELGENE CORP	16,084	85.23	1,370,839.32
ELI LILLY & CO	20,743	89.07	1,847,579.01
GILEAD SCIENCES INC	27,514	77.26	2,125,731.64
ILLUMINA INC	3,025	301.99	913,519.75
INCYTE CORP	3,700	70.11	259,407.00
IQVIA HOLDINGS INC	3,533	107.69	380,468.77
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,180	174.81	206,275.80
JOHNSON & JOHNSON	56,221	124.69	7,010,196.49
MERCK & CO. INC.	56,523	62.59	3,537,774.57
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	540	575.36	310,694.40
MYLAN NV	10,965	36.40	399,126.00
NEKTAR THERAPEUTICS	3,290	47.79	157,229.10
PERRIGO CO PLC	2,559	75.04	192,027.36
PFIZER INC	124,880	37.38	4,668,014.40
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,620	364.75	590,895.00
SEATTLE GENETICS INC	2,280	68.99	157,297.20
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	18,720	23.30	436,176.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	8,454	208.80	1,765,195.20

UNITED THERAPEUTICS CORP	940	122.24	114,905.60
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,200	181.22	942,344.00
WATERS CORP	1,666	193.50	322,371.00
ZOETIS INC	9,960	84.58	842,416.80
BANK OF AMERICA CORP	203,329	29.78	6,055,137.62
BB&T CORP	16,118	51.64	832,333.52
CIT GROUP INC	2,655	51.93	137,874.15
CITIGROUP INC	53,657	69.46	3,727,015.22
CITIZENS FINANCIAL GROUP	10,080	39.98	402,998.40
COMERICA INC	3,570	90.70	323,799.00
EAST WEST BANCORP INC	3,000	65.03	195,090.00
FIFTH THIRD BANCORP	14,459	29.46	425,962.14
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,220	97.09	312,629.80
HUNTINGTON BANCSHARES INC	21,790	14.90	324,671.00
JPMORGAN CHASE & CO	71,730	110.58	7,931,903.40
KEYCORP	22,078	19.92	439,793.76
M & T BANK CORP	3,153	168.12	530,082.36
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	9,654	11.49	110,924.46
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	7,100	18.27	129,717.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	9,920	140.89	1,397,628.80
REGIONS FINANCIAL CORP	23,184	17.51	405,951.84
SIGNATURE BANK	1,130	123.85	139,950.50
SUNTRUST BANKS INC	9,747	68.70	669,618.90
SVB FINANCIAL GROUP	1,090	302.39	329,605.10
US BANCORP	32,681	51.30	1,676,535.30
WELLS FARGO & CO	97,740	56.99	5,570,202.60
ZIONS BANCORPORATION	4,120	52.39	215,846.80
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,100	148.62	163,482.00
ALLY FINANCIAL INC	9,120	27.25	248,520.00
AMERICAN EXPRESS CO	15,224	100.69	1,532,904.56
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,060	142.24	435,254.40
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	20,992	53.70	1,127,270.40
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	26,680	192.00	5,122,560.00
BLACKROCK INC	2,525	503.96	1,272,499.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	10,395	95.91	996,984.45

CBOE GLOBAL MARKETS INC	2,540	103.73	263,474.20
CME GROUP INC	7,120	168.22	1,197,726.40
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	7,280	70.56	513,676.80
E*TRADE FINANCIAL CORP	5,300	59.91	317,523.00
EATON VANCE CORP	2,260	53.21	120,254.60
FRANKLIN RESOURCES INC	6,635	32.10	212,983.50
GOLDMAN SACHS GROUP INC	7,588	231.44	1,756,166.72
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	11,990	75.19	901,528.10
INVESCO LTD	8,467	25.50	215,908.50
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	6,485	22.69	147,144.65
MOODY'S CORP	3,527	182.32	643,042.64
MORGAN STANLEY	28,005	48.90	1,369,444.50
MSCI INC	1,800	170.58	307,044.00
NASDAQ INC	2,825	93.89	265,239.25
NORTHERN TRUST CORP	4,420	105.46	466,133.20
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,690	94.00	252,860.00
S&P GLOBAL INC	5,372	211.47	1,136,016.84
SCHWAB (CHARLES) CORP	25,504	51.06	1,302,234.24
SEI INVESTMENTS COMPANY	2,715	64.18	174,248.70
STATE STREET CORP	7,617	93.20	709,904.40
SYNCHRONY FINANCIAL	15,730	32.56	512,168.80
T ROWE PRICE GROUP INC	4,925	120.38	592,871.50
TD AMERITRADE HOLDING CORP	5,600	55.45	310,520.00
VOYA FINANCIAL INC	3,700	47.93	177,341.00
AFLAC INC	16,044	42.78	686,362.32
ALLEGHANY CORP	330	603.40	199,122.00
ALLSTATE CORP	7,253	93.46	677,865.38
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,490	108.52	161,694.80
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	19,075	54.77	1,044,737.75
AON PLC	5,197	145.21	754,656.37
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,325	28.53	237,512.25
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,730	69.46	259,085.80
ASSURANT INC	1,110	107.98	119,857.80
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	3,700	44.28	163,836.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	1,485	57.37	85,194.45

BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	1,774	41.16	73,017.84
CHUBB LTD	9,775	133.37	1,303,691.75
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,190	70.54	225,022.60
EVEREST RE GROUP LTD	874	235.18	205,547.32
FNF GROUP	6,671	37.23	248,361.33
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	7,282	53.07	386,455.74
LINCOLN NATIONAL CORP	4,513	64.31	290,231.03
LOEWS CORP	5,785	49.81	288,150.85
MARKEL CORP	320	1,142.93	365,737.60
MARSH & MCLENNAN COS	10,993	86.76	953,752.68
METLIFE INC	18,535	44.44	823,695.40
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6,000	54.08	324,480.00
PROGRESSIVE CORP	12,140	58.42	709,218.80
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	9,242	96.30	890,004.60
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,310	137.75	180,452.50
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	887	123.22	109,296.14
TORCHMARK CORP	2,216	84.46	187,163.36
TRAVELERS COS INC/THE	5,654	128.19	724,786.26
UNUM GROUP	4,788	38.14	182,614.32
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,878	157.56	453,457.68
WR BERKLEY CORP	2,063	74.42	153,528.46
XL GROUP LTD	5,190	56.43	292,871.70
CBRE GROUP INC - A	7,550	48.79	368,364.50
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	23,700	7.25	171,825.00
JONES LANG LASALLE INC	890	167.00	148,630.00
ACCENTURE PLC-CL A	12,968	167.64	2,173,955.52
ACTIVISION BLIZZARD INC	15,180	80.23	1,217,891.40
ADOBE SYSTEMS INC	10,319	254.68	2,628,042.92
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	3,690	77.68	286,639.20
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,010	218.97	221,159.70
ALPHABET INC-CL A	6,250	1,196.51	7,478,187.50
ALPHABET INC-CL C	6,602	1,183.86	7,815,843.72
ANSYS INC	1,820	178.79	325,397.80
AUTODESK INC	4,630	136.24	630,791.20
AUTOMATIC DATA PROCESSING	9,226	137.12	1,265,069.12

BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	2,420	117.72	284,882.40	
CA INC	6,270	44.05	276,193.50	
CADENCE DESIGN SYS INC	5,760	45.07	259,603.20	
CDK GLOBAL INC	2,510	66.38	166,613.80	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2,710	108.97	295,308.70	
CITRIX SYSTEMS INC	3,228	109.97	354,983.16	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	12,078	81.96	989,912.88	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	4,320	94.78	409,449.60	
DXC TECHNOLOGY CO	5,903	85.72	506,005.16	
EBAY INC	20,147	37.73	760,146.31	
ELECTRONIC ARTS INC	6,294	146.68	923,203.92	
FACEBOOK INC-A	50,190	207.23	10,400,873.70	
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	7,285	107.70	784,594.50	
FIRST DATA CORP- CLASS-A	9,680	22.25	215,380.00	
FISERV INC	9,166	76.87	704,590.42	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,850	216.18	399,933.00	
FORTINET INC	3,100	66.23	205,313.00	
GARTNER INC	2,050	139.66	286,303.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	3,620	117.00	423,540.00	
GODADDY INC-CLASS A	2,850	77.16	219,906.00	
IAC/INTERACTIVECORP	1,650	154.37	254,710.50	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	19,302	145.46	2,807,668.92	
INTUIT INC	5,206	214.46	1,116,478.76	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,530	135.17	206,810.10	
LEIDOS HOLDINGS INC	2,900	62.49	181,221.00	
MASTERCARD INC	19,550	204.08	3,989,764.00	
MERCADOLIBRE INC	870	343.25	298,627.50	
MICROSOFT CORP	153,074	104.91	16,058,993.34	
ORACLE CORP	65,073	48.46	3,153,437.58	
PAYCHEX INC	6,562	69.98	459,208.76	
PAYPAL HOLDINGS INC	23,947	87.77	2,101,828.19	
RED HAT INC	3,600	146.22	526,392.00	
SABRE CORP	4,520	26.01	117,565.20	
SALESFORCE.COM INC	14,430	146.96	2,120,632.80	
SERVICENOW INC	3,780	189.08	714,722.40	

SPLUNK INC	2,830	106.20	300,546.00
SQUARE INC - A	6,130	66.95	410,403.50
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	4,830	54.02	260,916.60
SYMANTEC CORP	13,055	21.55	281,335.25
SYNOPSYS INC	3,207	91.49	293,408.43
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2,350	125.89	295,841.50
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,366	88.92	299,304.72
TWITTER INC	14,350	44.26	635,131.00
VERISIGN INC	1,810	147.94	267,771.40
VISA INC-CLASS A SHARES	37,732	138.46	5,224,372.72
VMWARE INC	1,555	155.24	241,398.20
WESTERN UNION CO	9,241	20.27	187,315.07
WORKDAY INC-CLASS A	2,810	132.88	373,392.80
WORLDPAY INC-CLASS A	6,570	86.51	568,370.70
ZILLOW GROUP INC - C	2,720	62.90	171,088.00
AMPHENOL CORP-CL A	6,750	88.53	597,577.50
APPLE INC	106,162	190.91	20,267,387.42
ARISTA NETWORKS INC	1,130	270.84	306,049.20
ARROW ELECTRONICS INC	1,930	77.05	148,706.50
AVNET INC	2,610	43.93	114,657.30
CDW CORP/DE	3,500	84.94	297,290.00
CISCO SYSTEMS INC	100,680	42.50	4,278,900.00
COGNEX CORP	3,400	45.43	154,462.00
COMMSCOPE HOLDING CO INC	4,030	29.27	117,958.10
CORNING INC	18,388	28.60	525,896.80
F5 NETWORKS INC	1,335	175.68	234,532.80
FLEX LTD	10,936	14.80	161,852.80
FLIR SYSTEMS INC	2,675	52.64	140,812.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	32,915	15.64	514,790.60
HP INC	34,005	23.57	801,497.85
IPG PHOTONICS CORP	730	234.08	170,878.40
JUNIPER NETWORKS INC	7,933	27.86	221,013.38
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	3,830	59.62	228,344.60
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3,385	121.35	410,769.75
NETAPP INC	5,836	81.85	477,676.60

PALO ALTO NETWORKS INC	1,900	214.36	407,284.00
SEAGATE TECHNOLOGY	5,684	58.45	332,229.80
TE CONNECTIVITY LTD	7,185	91.26	655,703.10
TRIMBLE INC	5,170	34.12	176,400.40
WESTERN DIGITAL CORP	6,058	78.43	475,128.94
XEROX CORP	4,938	24.97	123,301.86
AT&T INC	151,637	31.90	4,837,220.30
CENTURYLINK INC	19,626	19.61	384,865.86
SPRINT CORP	17,350	5.65	98,027.50
T-MOBILE US INC	7,192	61.63	443,242.96
VERIZON COMMUNICATIONS INC	86,237	51.59	4,448,966.83
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	5,050	38.47	194,273.50
AES CORP	13,728	13.13	180,248.64
ALLIANT ENERGY CORP	4,740	42.78	202,777.20
AMEREN CORPORATION	4,942	61.34	303,142.28
AMERICAN ELECTRIC POWER	10,718	70.42	754,761.56
AMERICAN WATER WORKS CO INC	3,655	87.57	320,068.35
ATMOS ENERGY CORP	2,190	91.11	199,530.90
CENTERPOINT ENERGY INC	8,142	27.73	225,777.66
CMS ENERGY CORP	5,770	47.71	275,286.70
CONSOLIDATED EDISON INC	6,986	79.20	553,291.20
DOMINION RESOURCES INC/VA	13,867	69.88	969,025.96
DTE ENERGY COMPANY	3,698	106.30	393,097.40
DUKE ENERGY CORP	14,576	80.78	1,177,449.28
EDISON INTERNATIONAL	6,589	65.66	432,633.74
ENTERGY CORP	3,847	81.81	314,723.07
EVERGY INC	5,580	56.00	312,480.00
EVERSOURCE ENERGY	7,280	59.04	429,811.20
EXELON CORP	20,896	42.15	880,766.40
FIRSTENERGY CORP	10,755	36.15	388,793.25
NEXTERA ENERGY INC	9,835	169.50	1,667,032.50
NISOURCE INC	8,510	26.26	223,472.60
OGE ENERGY CORP	3,830	35.29	135,160.70
P G & E CORP	10,491	43.04	451,532.64
PINNACLE WEST CAPITAL	2,199	80.31	176,601.69

	PPL CORP	15,728	28.52	448,562.56	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	11,128	51.81	576,541.68	
	SCANA CORP	2,683	38.10	102,222.30	
	SEMPRA ENERGY	5,377	115.76	622,441.52	
	SOUTHERN CO	21,495	47.71	1,025,526.45	
	UGI CORP	3,500	52.58	184,030.00	
	VISTRA ENERGY CORP	7,920	23.71	187,783.20	
	WEC ENERGY GROUP INC	7,190	65.04	467,637.60	
	XCEL ENERGY INC	10,414	46.07	479,772.98	
	ADVANCED MICRO DEVICES	19,050	16.58	315,849.00	
	ANALOG DEVICES INC	7,630	97.64	744,993.20	
	APPLIED MATERIALS INC	21,753	46.31	1,007,381.43	
	BROADCOM INC	8,590	203.25	1,745,917.50	
	INTEL CORP	97,852	52.01	5,089,282.52	
	KLA-TENCOR CORPORATION	3,199	104.16	333,207.84	
	LAM RESEARCH CORP	3,357	171.79	576,699.03	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	10,014	21.15	211,796.10	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	5,850	60.67	354,919.50	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	4,904	94.11	461,515.44	
	MICRON TECHNOLOGY INC	24,307	56.15	1,364,838.05	
	NVIDIA CORP	12,045	248.20	2,989,569.00	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	7,297	104.05	759,252.85	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	8,730	23.30	203,409.00	
	QORVO INC	2,670	81.33	217,151.10	
	QUALCOMM INC	31,002	58.35	1,808,966.70	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	3,810	99.76	380,085.60	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	20,572	114.56	2,356,728.32	
	XILINX INC	5,075	67.72	343,679.00	
	米ドル小計	6,405,744		510,332,340.40 (57,381,768,354)	
加ドル	ALTAGAS LTD	3,850	27.99	107,761.50	
	ARC RESOURCES LTD	7,925	14.45	114,516.25	
	CAMECO CORP	7,892	14.16	111,750.72	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	25,834	47.70	1,232,281.80	
	CENOVUS ENERGY INC	20,853	13.65	284,643.45	



CRESCENT POINT ENERGY CORP	11,475	9.91	113,717.25
ENBRIDGE INC	35,677	46.48	1,658,266.96
ENCANA CORP	21,068	16.76	353,099.68
HUSKY ENERGY INC	6,873	20.61	141,652.53
IMPERIAL OIL LTD	5,952	44.33	263,852.16
INTER PIPELINE LTD	7,180	25.00	179,500.00
KEYERA CORP	4,270	36.92	157,648.40
PEMBINA PIPELINE CORP	10,212	46.08	470,568.96
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	4,100	24.80	101,680.00
SEVEN GENERATIONS ENERGY -A	4,430	14.92	66,095.60
SUNCOR ENERGY INC	34,519	54.17	1,869,894.23
TOURMALINE OIL CORP	4,575	23.81	108,930.75
TRANSCANADA CORP	19,053	57.12	1,088,307.36
VERMILION ENERGY INC	2,640	47.26	124,766.40
AGNICO EAGLE MINES LTD	4,695	59.98	281,606.10
BARRICK GOLD CORP	23,944	16.85	403,456.40
CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,050	64.59	196,999.50
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	14,710	18.71	275,224.10
FRANCO-NEVADA CORP	3,805	96.66	367,791.30
GOLDCORP INC	17,917	17.24	308,889.08
KINROSS GOLD CORP	25,015	4.92	123,073.80
LUNDIN MINING CORP	12,280	7.48	91,854.40
METHANEX CORP	1,650	91.61	151,156.50
NUTRIEN LTD	13,198	69.31	914,753.38
TECK RESOURCES LTD-CLS B	11,955	31.97	382,201.35
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	23,419	3.85	90,163.15
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,460	93.49	136,495.40
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	9,395	28.96	272,079.20
BOMBARDIER INC 'B'	40,026	5.21	208,535.46
CAE INC	5,615	27.73	155,703.95
FINNING INTERNATIONAL INC	3,545	32.64	115,708.80
SNC-LAVALIN GROUP INC	3,605	56.98	205,412.90
WSP GLOBAL INC	2,100	68.03	142,863.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	15,538	111.37	1,730,467.06
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	2,915	243.75	710,531.25

LINAMAR CORP	980	57.62	56,467.60
MAGNA INTERNATIONAL INC	7,018	78.60	551,614.80
GILDAN ACTIVEWEAR INC	4,540	37.28	169,251.20
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	4,638	83.06	385,232.28
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	8,935	27.44	245,176.40
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,290	173.75	224,137.50
DOLLARAMA INC	6,540	49.57	324,187.80
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	8,800	62.75	552,200.00
EMPIRE CO LTD 'A'	3,000	26.80	80,400.00
LOBLAW COMPANIES LTD	4,269	69.49	296,652.81
METRO INC	6,210	45.11	280,133.10
WESTON (GEORGE) LTD	1,182	110.69	130,835.58
SAPUTO INC	4,730	45.39	214,694.70
BAUSCH HEALTH COS INC	6,734	30.20	203,366.80
BANK OF MONTREAL	13,291	103.59	1,376,814.69
BANK OF NOVA SCOTIA	24,909	75.99	1,892,834.91
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	8,955	116.24	1,040,929.20
NATIONAL BANK OF CANADA	7,950	63.16	502,122.00
ROYAL BANK OF CANADA	30,239	101.94	3,082,563.66
TORONTO-DOMINION BANK	38,600	76.09	2,937,074.00
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	17,133	54.95	941,458.35
CI FINANCIAL CORP	5,700	23.99	136,743.00
IGM FINANCIAL INC	1,945	39.33	76,496.85
ONEX CORPORATION	1,725	98.23	169,446.75
THOMSON REUTERS CORP	5,534	55.70	308,243.80
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	590	722.50	426,275.00
GREAT-WEST LIFECO INC	5,974	32.49	194,095.26
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	2,225	51.75	115,143.75
INTACT FINANCIAL CORP	2,885	95.61	275,834.85
MANULIFE FINANCIAL CORP	40,561	23.74	962,918.14
POWER CORP OF CANADA	7,800	29.56	230,568.00
POWER FINANCIAL CORP	5,715	30.91	176,650.65
SUN LIFE FINANCIAL INC	12,574	53.38	671,200.12
FIRST CAPITAL REALTY INC	3,320	20.10	66,732.00
BLACKBERRY LTD	10,328	13.29	137,259.12

	CGI GROUP INC - CL A	5,940	86.52	513,928.80	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	420	1,086.54	456,346.80	
	OPEN TEXT CORP	5,390	50.01	269,553.90	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	1,700	217.43	369,631.00	
	BCE INC	2,930	55.97	163,992.10	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	7,185	66.29	476,293.65	
	TELUS CORP	4,366	48.18	210,353.88	
	ATCO LTD -CLASS I	1,920	40.64	78,028.80	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,590	32.93	85,288.70	
	EMERA INC	1,270	42.54	54,025.80	
	FORTIS INC	8,665	42.67	369,735.55	
	HYDRO ONE LTD	6,290	19.24	121,019.60	
加ドル小計		843,700		38,417,853.33	(3,288,568,245)
ユーロ	ENAGAS SA	4,790	24.31	116,444.90	
	ENI SPA	51,366	16.05	824,629.76	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	10,915	16.88	184,245.20	
	NESTE OYJ	2,740	65.94	180,675.60	
	OMV AG	2,950	47.21	139,269.50	
	REPSOL SA	28,019	16.80	470,719.20	
	SNAM SPA	46,120	3.63	167,415.60	
	TENARIS SA	9,355	15.92	148,978.37	
	TOTAL SA	50,457	52.79	2,663,625.03	
	VOPAK	1,270	39.97	50,761.90	
	AIR LIQUIDE SA	8,919	108.95	971,725.05	
	AKZO NOBEL	5,728	74.32	425,704.96	
	ARCELORMITTAL	13,632	25.11	342,367.68	
	ARKEMA	1,335	101.85	135,969.75	
	BASF SE	19,305	81.59	1,575,094.95	
	COVESTRO AG	4,320	76.90	332,208.00	
	CRH PLC	17,110	30.70	525,277.00	
	EVONIK INDUSTRIES AG	3,580	29.88	106,970.40	
	FUCHS PETROLUB SE-PRF	1,720	43.14	74,200.80	
	HEIDELBERGCEMENT AG	3,095	70.28	217,516.60	
	IMERYS SA	830	65.65	54,489.50	

K+S AG	3,880	21.09	81,829.20
KONINKLIJKE DSM NV	3,842	88.46	339,863.32
LANXESS AG	1,935	67.66	130,922.10
LINDE AG	3,855	178.60	688,503.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	4,600	35.42	162,932.00
SOLVAY SA	1,581	107.00	169,167.00
STORA ENSO OYJ-R SHS	11,535	16.68	192,403.80
SYMRISE AG	2,640	77.94	205,761.60
THYSSENKRUPP AG	8,755	20.60	180,353.00
UMICORE	4,240	50.78	215,307.20
UPM-KYMMENE OYJ	11,058	30.22	334,172.76
VOESTALPINE AG	2,509	39.57	99,281.13
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	6,086	35.77	217,696.22
AIRBUS GROUP SE	12,208	106.94	1,305,523.52
ALSTOM	3,220	38.37	123,551.40
ANDRITZ AG	1,420	45.80	65,036.00
BOUYGUES SA	4,210	37.64	158,464.40
BRENTAG AG	3,095	50.48	156,235.60
CNH INDUSTRIAL NV	21,030	8.78	184,769.58
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	10,106	36.98	373,719.88
DASSAULT AVIATION SA	50	1,690.00	84,500.00
EIFFAGE	1,580	96.16	151,932.80
FERROVIAL SA	9,975	17.77	177,255.75
GEA GROUP AG	3,940	28.90	113,866.00
HOCHTIEF AG	440	157.00	69,080.00
KION GROUP AG	1,400	63.86	89,404.00
KONE OYJ-B	6,984	44.47	310,578.48
LEGRAND SA	5,628	63.72	358,616.16
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	8,130	9.12	74,194.38
MAN SE	824	96.10	79,186.40
METSO OYJ	2,420	28.44	68,824.80
MTU AERO ENGINES AG	1,110	166.20	184,482.00
OSRAM LICHT AG	2,002	34.12	68,308.24
PRYSMIAN SPA	4,255	21.80	92,759.00
REXEL SA	6,250	12.14	75,875.00

SAFRAN SA	6,810	106.90	727,989.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	11,448	70.12	802,733.76
SIEMENS AG-REG	16,066	116.66	1,874,259.56
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	4,180	11.40	47,672.90
THALES SA	2,165	114.40	247,676.00
VINCI SA	10,390	86.10	894,579.00
WARTSILA OYJ ABP	8,820	17.36	153,159.30
BUREAU VERITAS SA	5,650	23.21	131,136.50
EDENRED	4,646	28.58	132,782.68
RANDSTAD NV	3,115	51.22	159,550.30
RELX NV	21,999	19.18	421,940.82
SOCIETE BIC SA	565	81.15	45,849.75
TELEPERFORMANCE	1,430	157.90	225,797.00
WOLTERS KLUWER	6,297	51.00	321,147.00
ADP	650	199.10	129,415.00
AENA SA	1,380	155.35	214,383.00
ATLANTIA SPA	10,860	25.22	273,889.20
BOLLORE	20,400	3.86	78,866.40
DEUTCHE LUFTHANSA	4,950	20.60	101,970.00
DEUTSCHE POST AG-REG	20,143	28.20	568,032.60
FRAPORT AG	980	82.66	81,006.80
GETLINK	11,810	11.95	141,129.50
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	12,822	7.60	97,447.20
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	6,645	79.29	526,882.05
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,190	68.80	81,872.00
CONTINENTAL AG	2,235	200.30	447,670.50
DAIMLER AG	19,142	57.08	1,092,625.36
FAURECIA	1,630	60.84	99,169.20
FERRARI NV	2,554	120.60	308,012.40
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	22,237	16.53	367,666.55
MICHELIN (CGDE)-B	3,879	106.15	411,755.85
NOKIAN RENKAAT OYJ	2,565	34.22	87,774.30
PEUGEOT SA	13,890	20.95	290,995.50
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	3,150	54.14	170,541.00
RENAULT SA	3,867	73.64	284,765.88

SCHAEFFLER AG-PRF	3,550	11.06	39,280.75
VALEO SA	4,860	48.51	235,758.60
VOLKSWAGEN AG	631	141.30	89,160.30
VOLKSWAGEN AG-PFD	3,853	142.72	549,900.16
ADIDAS AG	4,051	188.75	764,626.25
HERMES INTERNATIONAL	697	536.00	373,592.00
HUGO BOSS AG -ORD	1,230	77.28	95,054.40
KERING	1,557	490.20	763,241.40
LUXOTTICA GROUP SPA	3,486	56.24	196,052.64
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	5,864	292.95	1,717,858.80
MONCLER SPA	3,650	38.51	140,561.50
PUMA SE	219	478.00	104,682.00
SEB SA	480	148.40	71,232.00
ACCOR SA	3,926	44.63	175,217.38
PADDY POWER BETFAIR PLC	2,150	96.05	206,507.50
SODEXO	1,880	91.34	171,719.20
AXEL SPRINGER SE	995	65.55	65,222.25
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	18.85	71,535.75
JC DECAUX SA	1,580	29.10	45,978.00
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	4,805	22.47	107,968.35
PUBLICIS GROUPE	4,275	60.14	257,098.50
RTL GROUP	860	63.30	54,438.00
SES	7,520	16.99	127,764.80
TELENET GROUP HOLDING NV	1,240	41.94	52,005.60
VIVENDI	21,300	21.39	455,607.00
INDITEX	22,045	29.19	643,493.55
ZALANDO SE	2,160	47.52	102,643.20
CARREFOUR SA	12,213	13.28	162,188.64
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,344	33.90	45,561.60
COLRUYT SA	1,375	49.42	67,952.50
JERONIMO MARTINS	5,075	12.65	64,224.12
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	26,448	21.27	562,548.96
METRO WHOLESALE & FOOD SPECI	4,140	10.24	42,393.60
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	16,041	88.52	1,419,949.32
DANONE	13,104	65.20	854,380.80

DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	10,800	7.36	79,542.00
HEINEKEN HOLDING NV	2,255	87.05	196,297.75
HEINEKEN NV	5,293	91.00	481,663.00
KERRY GROUP PLC-A	3,330	92.85	309,190.50
PERNOD-RICARD SA	4,406	137.60	606,265.60
REMY COINTREAU	470	113.90	53,533.00
BEIERSDORF AG	2,015	99.14	199,767.10
HENKEL AG & CO KGAA	2,200	95.35	209,770.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	3,563	109.50	390,148.50
L'OREAL	5,306	209.70	1,112,668.20
UNILEVER NV-CVA	32,425	47.95	1,554,940.87
BIOMERIEUX	750	77.30	57,975.00
ESSILOR INTERNATIONAL	4,585	123.20	564,872.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	4,523	85.10	384,907.30
FRESENIUS SE & CO KGAA	8,605	67.80	583,419.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	19,211	37.21	714,841.31
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	730	143.90	105,047.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	3,400	37.75	128,350.00
BAYER AG-REG	18,874	93.17	1,758,490.58
EUROFINS SCIENTIFIC	220	468.20	103,004.00
GRIFOLS SA	6,260	25.60	160,256.00
IPSEN	780	142.25	110,955.00
MERCK KGAA	2,630	85.62	225,180.60
ORION OYJ-CLASS B	1,830	23.54	43,078.20
QIAGEN N.V.	4,364	31.48	137,378.72
RECORDATI SPA	2,530	30.74	77,772.20
SANOFI	23,706	71.66	1,698,771.96
UCB SA	2,588	70.36	182,091.68
ABN AMRO GROUP NV-CVA	8,570	21.90	187,683.00
AIB GROUP PLC	15,300	4.94	75,582.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	138,753	5.99	831,546.72
BANCO DE SABADELL SA	133,052	1.39	185,740.59
BANCO SANTANDER SA	339,019	4.63	1,569,996.98
BANK OF IRELAND GROUP PLC	18,619	6.65	123,909.44
BANKIA SA	23,750	3.13	74,337.50

BANKINTER SA	13,960	8.59	120,000.16
BNP PARIBAS	23,542	52.53	1,236,661.26
CAIXABANK S.A	81,100	3.74	303,314.00
COMMERZBANK AG	21,334	8.49	181,210.99
CREDIT AGRICOLE SA	23,362	11.47	267,962.14
ERSTE GROUP BANK AG	6,438	35.07	225,780.66
ING GROEP NV-CVA	81,605	12.50	1,020,062.50
INTESA SANPAOLO	275,553	2.45	676,620.39
INTESA SANPAOLO-RSP	20,000	2.55	51,140.00
KBC GROEP NV	5,119	66.36	339,696.84
MEDIOBANCA SPA	12,760	8.07	103,049.76
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	2,770	27.31	75,648.70
SOCIETE GENERALE	15,729	36.36	571,985.08
UNICREDIT SPA	41,136	14.31	588,902.97
AMUNDI SA	1,140	58.74	66,963.60
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	42,465	10.30	437,644.29
DEUTSCHE BOERSE AG	4,000	118.95	475,800.00
EURAZEO SE	1,055	67.85	71,581.75
EXOR NV	2,264	57.60	130,406.40
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,632	91.04	148,577.28
NATIXIS	19,150	6.00	114,900.00
WENDEL	600	123.60	74,160.00
AEGON NV	38,139	5.24	200,000.91
AGEAS	4,044	42.94	173,649.36
ALLIANZ SE-REG	9,188	180.08	1,654,575.04
ASSICURAZIONI GENERALI	25,628	14.51	371,990.42
AXA	39,542	20.75	820,496.50
CNP ASSURANCES	3,530	19.44	68,623.20
HANNOVER RUECK SE-REG	1,275	111.30	141,907.50
MAPFRE SA	20,814	2.60	54,241.28
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,216	187.20	602,035.20
NN GROUP NV	6,340	36.02	228,366.80
POSTE ITALIANE SPA	10,260	7.68	78,817.32
SAMPO OYJ-A SHS	9,109	42.30	385,310.70
SCOR SE	3,562	32.64	116,263.68



DEUTSCHE WOHNEN SE	7,500	41.44	310,800.00
VONOVIA SE	10,248	41.14	421,602.72
AMADEUS IT GROUP SA	8,910	72.22	643,480.20
ATOS SE	1,920	123.20	236,544.00
CAP GEMINI SA	3,279	117.00	383,643.00
DASSAULT SYSTEMES SA	2,930	128.75	377,237.50
DELIVERY HERO AG	1,880	48.96	92,044.80
SAP SE	20,632	102.64	2,117,668.48
UBISOFT ENTERTAINMENT	1,920	99.82	191,654.40
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2,400	48.01	115,224.00
WIRECARD AG	2,440	153.70	375,028.00
INGENICO GROUP	1,160	78.56	91,129.60
NOKIA OYJ	119,986	5.00	600,409.94
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	68,656	13.72	942,303.60
DRILLISCH AG	980	49.90	48,902.00
ELISA OYJ	3,045	36.09	109,894.05
ILIAD SA	520	138.65	72,098.00
KONINKLIJKE KPN NV	65,606	2.46	161,390.76
ORANGE S.A.	41,574	14.57	605,733.18
PROXIMUS	3,040	20.23	61,499.20
TELECOM ITALIA SPA	233,203	0.60	141,647.50
TELECOM ITALIA-RSP	125,887	0.53	66,971.88
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16,270	3.58	58,327.95
TELEFONICA SA	95,499	7.51	717,961.48
E.ON SE	44,659	9.60	429,083.67
EDF	11,785	12.19	143,659.15
ENDESA SA	6,840	19.71	134,850.60
ENEL SPA	173,657	4.84	841,715.47
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	54,991	3.46	190,433.83
ENGIE	37,224	13.40	498,801.60
FORTUM OYJ	8,865	22.00	195,030.00
GAS NATURAL SDG SA	7,722	23.50	181,467.00
IBERDROLA SA	117,842	6.66	785,299.08
INNOGY SE	2,850	36.63	104,395.50
RED ELECTRICA CORPORACION SA	9,010	18.16	163,666.65

	RWE AG	10,685	21.63	231,116.55	
	SUEZ	7,629	11.52	87,924.22	
	TERNA SPA	35,697	4.73	169,060.99	
	UNIPER SE	3,800	26.40	100,320.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	12,624	19.24	242,948.88	
	ASML HOLDING NV	8,602	171.10	1,471,802.20	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	23,445	22.15	519,306.75	
	STMICROELECTRONICS NV	15,063	19.49	293,653.18	
ユーロ小計		4,085,856		83,217,240.29	(10,958,046,201)
英ポンド	BP PLC	417,738	5.57	2,328,889.35	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	96,478	25.93	2,502,156.93	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	78,459	26.72	2,096,816.77	
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	13,000	6.14	79,872.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	21,904	16.40	359,400.83	
	ANTOFAGASTA PLC	8,730	9.38	81,887.40	
	BHP BILLITON PLC	45,881	16.09	738,317.05	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	2,751	49.21	135,376.71	
	FRESNILLO PLC	4,710	10.96	51,645.15	
	GLENCORE PLC	243,033	3.09	751,215.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	4,199	36.79	154,481.21	
	MONDI PLC	7,400	20.35	150,590.00	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	1,840	54.70	100,648.00	
	RIO TINTO PLC	25,275	40.04	1,012,011.00	
	ASHTREAD GROUP PLC	9,930	23.43	232,659.90	
	BAE SYSTEMS PLC ORD	65,595	6.72	441,191.97	
	BUNZL PLC	7,276	22.99	167,275.24	
	DCC PLC	1,810	70.80	128,148.00	
	FERGUSON PLC	4,882	61.89	302,146.98	
	MEGGITT PLC	16,205	5.55	90,002.57	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	100,000	2.20	220,700.00	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	33,045	9.83	325,096.71	
	SMITHS GROUP PLC	8,233	17.40	143,254.20	
	TRAVIS PERKINS PLC	5,250	13.70	71,925.00	
	WEIR GROUP PLC/THE	4,490	19.43	87,240.70	

BABCOCK INTL GROUP PLC	6,275	8.00	50,200.00
EXPERIAN PLC	20,468	18.98	388,482.64
G4S PLC	34,639	2.72	94,218.08
INTERTEK GROUP PLC	3,365	57.58	193,756.70
RELX PLC	21,976	16.98	373,262.36
EASYJET PLC	3,840	16.38	62,918.40
ROYAL MAIL PLC	19,950	4.80	95,919.60
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	20,690	5.19	107,381.10
BERKELEY GROUP HOLDINGS	2,600	35.94	93,444.00
BURBERRY GROUP PLC	8,904	21.00	186,984.00
PERSIMMON PLC	7,470	24.74	184,807.80
TAYLOR WIMPEY PLC	66,880	1.74	116,939.68
CARNIVAL PLC	3,850	43.19	166,281.50
COMPASS GROUP PLC	32,678	16.54	540,494.12
GVC HOLDINGS PLC	11,000	10.94	120,340.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	3,859	48.64	187,701.76
MERLIN ENTERTAINME	15,550	4.00	62,231.10
TUI AG-DI	9,213	16.39	151,047.13
WHITBREAD PLC	3,820	40.06	153,029.20
INFORMA PLC	28,840	8.53	246,178.24
ITV PLC	77,235	1.73	133,848.25
PEARSON PLC	17,749	9.04	160,521.95
SKY PLC	21,334	15.24	325,130.16
WPP PLC	25,954	12.16	315,600.64
KINGFISHER PLC	45,257	3.05	138,214.87
MARKS & SPENCER GROUP PLC	34,970	3.10	108,511.91
NEXT PLC	2,987	60.40	180,414.80
SAINSBURY (J) PLC	42,801	3.29	140,815.29
TESCO PLC	208,124	2.54	530,299.95
WM MORRISON SUPERMARKETS	49,255	2.56	126,289.82
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	7,335	24.46	179,414.10
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	48,137	38.72	1,864,105.32
COCA-COLA HBC AG-CDI	5,140	27.36	140,630.40
DIAGEO PLC	51,742	27.69	1,432,735.98
IMPERIAL BRANDS PLC	20,582	28.53	587,307.37

RECKITT BENCKISER GROUP PLC	14,085	65.03	915,947.55
UNILEVER PLC	25,637	41.95	1,075,472.15
CONVATEC GROUP PLC	27,730	2.08	57,761.59
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	7,000	5.27	36,918.00
NMC HEALTH PLC	2,120	37.00	78,440.00
SMITH & NEPHEW PLC	18,346	13.32	244,368.72
ASTRAZENECA PLC	26,603	54.67	1,454,386.01
GLAXOSMITHKLINE PLC	104,111	15.58	1,622,257.60
SHIRE PLC	18,565	43.24	802,750.60
BARCLAYS PLC	349,341	1.91	669,057.88
HSBC HOLDINGS PLC	417,851	7.06	2,953,370.86
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,501,586	0.62	938,341.09
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	95,080	2.43	231,709.96
STANDARD CHARTERED PLC	58,190	6.75	392,957.07
3I GROUP PLC	20,499	9.09	186,335.91
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,720	20.19	115,486.80
INVESTEC PLC	13,185	5.38	71,014.41
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	6,577	44.80	294,649.60
SCHRODERS PLC	2,621	31.64	82,928.44
ST JAMES'S PLACE PLC	11,000	11.85	130,350.00
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	53,130	3.06	162,896.58
ADMIRAL GROUP PLC	4,245	19.39	82,310.55
AVIVA PLC	82,385	4.89	403,192.19
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	29,333	3.38	99,292.20
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	122,761	2.65	325,562.17
PRUDENTIAL PLC	54,462	17.20	937,018.71
RSA INSURANCE GROUP PLC	21,498	6.40	137,630.19
AUTO TRADER GROUP PLC	20,690	4.21	87,208.35
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	8,700	12.41	108,010.50
SAGE GROUP PLC/THE	22,180	6.23	138,181.40
BT GROUP PLC	173,382	2.21	384,041.13
VODAFONE GROUP PLC	559,138	1.80	1,011,256.98
CENTRICA PLC	111,175	1.57	175,100.62
NATIONAL GRID PLC	68,318	8.45	577,287.10
SEVERN TRENT PLC	4,423	18.95	83,815.85

	SSE PLC	20,977	13.67	286,755.59	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	13,325	7.17	95,540.25	
英ボンド小計		6,308,552		40,142,011.49	(5,973,532,729)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	4,430	23.62	104,636.60	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	170	645.00	109,650.00	
	GIVAUDAN-REG	213	2,371.00	505,023.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	10,939	47.53	519,930.67	
	SIKA AG-REG	2,640	137.30	362,472.00	
	ABB LTD-REG	37,695	21.70	817,981.50	
	GEBERIT AG-REG	760	436.00	331,360.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	360	221.60	79,776.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	840	227.40	191,016.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	3,327	58.44	194,429.88	
	SGS SA-REG	113	2,637.00	297,981.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,150	151.40	174,110.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	11,309	83.80	947,694.20	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	680	463.60	315,248.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	930	85.50	79,515.00	
	DUFREY AG-REG	690	129.95	89,665.50	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	45	1,758.00	79,110.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	23	6,645.00	152,835.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	78,500.00	157,000.00	
	NESTLE SA-REG	65,243	79.70	5,199,867.10	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,160	182.95	212,222.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	230	754.00	173,420.00	
	LONZA GROUP AG-REG	1,698	288.40	489,703.20	
	NOVARTIS AG-REG	46,633	78.66	3,668,151.78	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	14,738	232.25	3,422,900.50	
	VIFOR PHARMA AG	1,070	181.30	193,991.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	53,758	15.11	812,552.17	
	JULIUS BAER GROUP LTD	4,600	57.56	264,776.00	
	PARGESA HOLDING SA-BR	775	84.90	65,797.50	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	370	747.00	276,390.00	
	UBS GROUP AG-REG	81,122	15.13	1,227,375.86	

	BALOISE HOLDING AG - REG	1,080	147.40	159,192.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	830	346.20	287,346.00	
	SWISS RE AG	6,569	88.78	583,195.82	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,291	297.40	978,743.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,460	90.30	131,838.00	
	TEMENOS AG	1,230	158.20	194,586.00	
	SWISSCOM AG-REG	504	449.10	226,346.40	
	スイスフラン小計	362,677		24,077,829.08	(2,715,497,563)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	4,320	282.30	1,219,536.00	
	BOLIDEN AB	5,920	271.15	1,605,208.00	
	ALFA LAVAL AB	6,030	229.90	1,386,297.00	
	ASSA ABLOY AB-B	20,660	179.25	3,703,305.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	13,705	249.30	3,416,656.50	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	9,100	226.35	2,059,785.00	
	EPIROC AB-A	13,705	94.53	1,295,533.65	
	EPIROC AB-B	9,100	84.20	766,220.00	
	SANDVIK AB	23,320	153.80	3,586,616.00	
	SKANSKA AB-B SHS	7,170	166.45	1,193,446.50	
	SKF AB-B SHARES-B	7,829	167.80	1,313,706.20	
	VOLVO AB-B SHS-B	31,980	148.65	4,753,827.00	
	SECURITAS AB-B SHS	5,849	146.20	855,123.80	
	ELECTROLUX AB - B	4,825	199.20	961,140.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	8,480	85.66	726,396.80	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	18,788	136.42	2,563,058.96	
	ICA GRUPPEN AB	1,450	282.80	410,060.00	
	SWEDISH MATCH AB	4,040	455.80	1,841,432.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	12,875	219.30	2,823,487.50	
	NORDEA BANK AB	60,808	86.88	5,282,999.04	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	34,730	85.28	2,961,774.40	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	31,220	100.00	3,122,000.00	
SWEDBANK AB - A SHARES	18,460	193.60	3,573,856.00		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	3,370	178.45	601,376.50		
INVESTOR AB-B SHS	9,135	363.30	3,318,745.50		
KINNEVIK AB - B	4,885	315.10	1,539,263.50		

	LUNDBERGS AB-B SHS	1,400	280.40	392,560.00	
	ERICSSON LM-B SHS	64,235	67.74	4,351,278.90	
	HEXAGON AB-B SHS	5,260	497.10	2,614,746.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,370	539.00	738,430.00	
	TELE2 AB-B SHS	7,555	102.55	774,765.25	
	TELIA CO AB	57,340	40.94	2,347,499.60	
スウェーデンクローナ小計		508,914		68,100,130.60	(868,957,666)
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	2,200	288.80	635,360.00	
	EQUINOR ASA	23,294	214.20	4,989,574.80	
	NORSK HYDRO A S	26,460	46.81	1,238,592.60	
	YARA INTERNATIONAL ASA	3,780	318.60	1,204,308.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	2,070	243.00	503,010.00	
	MARINE HARVEST	8,740	166.20	1,452,588.00	
	ORKLA ASA	17,310	65.98	1,142,113.80	
	DNB ASA	19,945	155.55	3,102,444.75	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,200	123.30	517,860.00	
	TELENOR ASA	14,895	163.40	2,433,843.00	
ノルウェークローネ小計		122,894		17,219,694.95	(239,353,759)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,890	662.20	1,251,558.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	4,845	331.40	1,605,633.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	4,440	389.70	1,730,268.00	
	ISS A/S	3,100	223.00	691,300.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	80	7,480.00	598,400.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	138	7,836.00	1,081,368.00	
	DSV A/S	3,870	507.00	1,962,090.00	
	PANDORA A/S	2,190	441.00	965,790.00	
	CARLSBERG AS-B	2,180	777.60	1,695,168.00	
	COLOPLAST-B	2,545	664.80	1,691,916.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	2,610	288.60	753,246.00	
	GENMAB A/S	1,180	1,090.00	1,286,200.00	
	H LUNDBECK A/S	1,460	444.00	648,240.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	37,115	315.90	11,724,628.50	
DANSKE BANK A/S	16,415	193.75	3,180,406.25		

	TRYG A/S	2,575	154.10	396,807.50	
	ORSTED A/S	3,870	412.90	1,597,923.00	
デンマーククローネ小計		90,503		32,860,942.25	(580,324,240)
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	5,335	31.06	165,705.10	
	OIL SEARCH LTD	28,830	9.05	260,911.50	
	ORIGIN ENERGY LTD	35,950	9.61	345,479.50	
	SANTOS LTD	39,755	6.09	242,107.95	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	18,013	35.59	641,082.67	
	ALUMINA LTD	46,512	2.83	131,628.96	
	AMCOR LIMITED	23,840	14.37	342,580.80	
	BHP BILLITON LTD	67,566	33.07	2,234,407.62	
	BLUESCOPE STEEL LTD	11,500	18.51	212,865.00	
	BORAL LTD	25,275	6.50	164,287.50	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	29,665	4.38	129,932.70	
	INCITEC PIVOT LTD	31,550	3.71	117,050.50	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	8,505	22.73	193,318.65	
	NEWCREST MINING LTD	15,439	21.00	324,219.00	
	ORICA LIMITED	7,605	17.77	135,140.85	
	RIO TINTO LTD	8,718	79.41	692,296.38	
	SOUTH32 LTD	106,097	3.63	385,132.11	
	CIMIC GROUP LTD	1,867	42.44	79,235.48	
	BRAMBLES LTD	32,868	9.52	312,903.36	
	SEEK LTD	6,920	21.56	149,195.20	
	AURIZON HOLDINGS LTD	41,770	4.39	183,370.30	
	SYDNEY AIRPORT	24,156	7.10	171,507.60	
	TRANSURBAN GROUP	45,855	11.89	545,215.95	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	12,980	31.36	407,052.80	
	CROWN RESORTS LTD	6,745	13.52	91,192.40	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,180	48.42	57,135.60	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	970	67.00	64,990.00		
TABCORP HOLDINGS LTD	39,384	4.79	188,649.36		
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	10,760	3.52	37,875.20		
WESFARMERS LTD	24,135	49.65	1,198,302.75		
WOOLWORTHS GROUP LTD	26,772	31.08	832,073.76		



	COCA-COLA AMATIL LTD	10,650	9.71	103,411.50	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	15,946	17.62	280,968.52	
	COCHLEAR LTD	1,277	202.61	258,732.97	
	HEALTHSCOPE LTD	33,080	2.19	72,445.20	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,935	55.09	161,689.15	
	SONIC HEALTHCARE LTD	8,110	26.36	213,779.60	
	CSL LTD	9,512	198.64	1,889,463.68	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	61,009	28.94	1,765,600.46	
	BANK OF QUEENSLAND LIMITED	8,120	10.70	86,884.00	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	10,478	11.25	117,877.50	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	36,777	74.24	2,730,324.48	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	56,683	27.84	1,578,054.72	
	WESTPAC BANKING CORP	71,221	29.47	2,098,882.87	
	AMP LTD	59,627	3.60	214,657.20	
	ASX LTD	4,035	65.20	263,082.00	
	CHALLENGER LTD	12,110	12.15	147,136.50	
	MACQUARIE GROUP LTD	6,494	122.52	795,644.88	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	50,298	8.10	407,413.80	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	62,000	3.11	192,820.00	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	29,260	9.85	288,211.00	
	SUNCORP GROUP LTD	27,180	14.89	404,710.20	
	COMPUTERSHARE LTD	9,430	18.09	170,588.70	
	REA GROUP LTD	1,150	89.07	102,430.50	
	TELSTRA CORPORATION LTD	88,954	2.79	248,181.66	
	TPG TELECOM LTD	7,840	5.53	43,355.20	
	AGL ENERGY LTD	12,851	21.75	279,509.25	
	AUSNET SERVICES	40,750	1.60	65,403.75	
豪ドル小計		1,524,294		26,018,105.84	(2,168,609,121)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	18,583	7.05	131,010.15	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	21,455	6.85	146,966.75	
	A2 MILK CO LTD	15,000	11.29	169,350.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	10,700	14.53	155,471.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	8,500	12.25	104,125.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	35,157	3.79	133,245.03	

	MERIDIAN ENERGY LTD	28,000	3.14	87,920.00	
ニュージーランドドル小計		137,395		928,087.93	(70,803,828)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	55,708	84.30	4,696,184.40	
	NWS HOLDINGS LTD	28,500	14.02	399,570.00	
	MTR CORP	34,000	42.40	1,441,600.00	
	MINTH GROUP LTD	14,000	32.25	451,500.00	
	LI & FUNG LTD	138,000	2.65	365,700.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	29,000	42.85	1,242,650.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	14,500	22.50	326,250.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	49,000	64.75	3,172,750.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	16,800	17.30	290,640.00	
	SANDS CHINA LTD	49,800	41.80	2,081,640.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	28,000	13.94	390,320.00	
	SJM HOLDINGS LTD	48,000	9.94	477,120.00	
	WYNN MACAU LTD	35,800	24.50	877,100.00	
	WH GROUP LTD	182,000	6.30	1,146,600.00	
	BANK OF EAST ASIA	26,040	31.40	817,656.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	77,000	36.25	2,791,250.00	
	HANG SENG BANK LTD	15,900	201.00	3,195,900.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	24,300	233.80	5,681,340.00	
	AIA GROUP LTD	253,590	68.80	17,446,992.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	53,708	61.10	3,281,558.80	
	HANG LUNG GROUP LTD	17,000	21.35	362,950.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	46,000	16.02	736,920.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	27,638	41.25	1,140,067.50	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	15,000	42.80	642,000.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	11,450	36.45	417,352.50	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	125,666	10.90	1,369,759.40	
	SINO LAND CO	63,050	12.56	791,908.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	34,480	117.60	4,054,848.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	10,517	83.95	882,902.15	
	SWIRE PROPERTIES LTD	23,200	29.20	677,440.00	
WHARF HOLDINGS LTD	24,800	25.85	641,080.00		
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	24,800	55.60	1,378,880.00		

	WHEELLOCK & CO LTD	17,600	54.20	953,920.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	70,000	10.32	722,400.00	
	PCCW LTD	80,000	4.53	362,400.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	13,000	61.20	795,600.00	
	CLP HOLDINGS LTD	34,500	88.45	3,051,525.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	56,000	7.93	444,080.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	188,668	15.36	2,897,940.48	
	POWER ASSETS HOLDINGS	28,500	57.80	1,647,300.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,200	98.40	610,080.00	
香港ドル小計		2,091,715		75,155,674.23 (1,076,980,811)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	29,060	6.65	193,249.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	21,000	2.59	54,390.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,000	3.37	111,210.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	50,900	0.88	44,792.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,000	2.35	108,100.00	
	SATS LTD	13,000	5.06	65,780.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	12,800	10.38	132,864.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	125,000	1.25	156,250.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	32,550	2.77	90,163.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,000	32.06	64,120.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	130,000	0.27	35,100.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	49,660	3.01	149,476.60	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	36,715	25.87	949,817.05	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	63,840	11.14	711,177.60	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	27,100	26.04	705,684.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	15,800	7.44	117,552.00	
	CAPITALAND LTD	51,800	3.05	157,990.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	10,000	9.64	96,400.00	
	UOL GROUP LTD	9,350	6.79	63,486.50	
	VENTURE CORP LTD	5,600	16.45	92,120.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	172,180	3.26	561,306.80	
シンガポールドル小計		937,355		4,661,029.05 (384,721,337)	
イスラエルシュ	FRUTAROM	810	360.10	291,681.00	

ケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	13,070	17.26	225,588.20	
	ELBIT SYSTEMS LTD	500	439.90	219,950.00	
	BANK HAPOALIM BM	21,225	25.35	538,053.75	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	30,255	21.75	658,046.25	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	2,900	68.50	198,650.00	
	AZRIELI GROUP LTD	940	179.20	168,448.00	
	NICE LTD	1,385	398.10	551,368.50	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	48,790	3.93	191,744.70	
イスラエルシュケル小計		119,875		3,043,530.40	(94,349,442)
合 計		23,539,474		85,801,513,296	(85,801,513,296)

(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	3,327.00	77,751.99	
	出資金小計		3,327.00	77,751.99	(8,742,434)
	投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	10,210	194,602.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	2,050	260,268.00	
		AMERICAN TOWER CORP	9,289	1,316,808.64	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	27,640	286,903.20	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,825	487,736.25	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,147	399,448.71	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,940	176,831.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	8,410	929,893.70	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	4,135	478,254.10	
		DUKE REALTY CORPORATION	6,875	198,206.25	
		EQUINIX INC	1,618	711,564.04	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	7,530	485,157.90	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,400	330,596.00			
EXTRA SPACE STORAGE INC	3,020	292,064.20			

		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,415	176,492.95	
		GGP INC	15,475	322,034.75	
		HCP INC	9,285	239,367.30	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	15,169	318,852.38	
		INVITATION HOMES INC	6,200	144,274.00	
		IRON MOUNTAIN INC	5,515	200,525.40	
		KIMCO REALTY CORPORATION	8,795	145,117.50	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	138,341.72	
		MACERICH CO/THE	2,460	141,474.60	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,270	225,047.80	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	2,990	131,290.90	
		PROLOGIS INC	10,932	711,017.28	
		PUBLIC STORAGE	3,259	735,034.86	
		REALTY INCOME CORP	6,660	365,700.60	
		REGENCY CENTERS CORP	3,175	193,770.25	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	2,390	389,880.70	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	6,754	1,152,637.64	
		SL GREEN REALTY CORP	2,040	207,998.40	
		UDR INC	5,820	216,795.00	
		VENTAS INC	7,285	424,642.65	
		VEREIT INC	19,554	147,241.62	
		VORNADO REALTY TRUST	3,491	257,216.88	
		WELLTOWER INC	8,360	523,252.40	
		WEYERHAEUSER CO	15,508	562,165.00	
		投資証券小計	258,004	14,618,507.17	(1,643,704,946)
		米ドル小計	261,331	14,696,259.16	(1,652,447,380)
加ドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2,340	46,940.40	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,380	83,317.00	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1,690	51,156.30	
		加ドル小計	7,410	181,413.70	(15,529,012)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	595	52,449.25	
		GECINA SA	970	142,105.00	

		ICADE	685	57,608.50	
		KLEPIERRE	4,732	151,282.04	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,770	517,020.50	
ユーロ小計			9,752	920,465.29	(121,206,869)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	20,201	131,670.11	
		HAMMERSON PLC	15,295	81,430.58	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	15,214	142,342.18	
		SEGRO PLC	21,263	143,057.46	
英ポンド小計			71,973	498,500.33	(74,181,834)
豪ドル	投資証券	APA GROUP	22,538	219,520.12	
		DEXUS	21,247	210,557.77	
		GOODMAN GROUP	37,672	368,055.44	
		GPT GROUP	37,975	195,951.00	
		LENDLEASE GROUP	12,197	242,110.45	
		MIRVAC GROUP	78,535	175,133.05	
		SCENTRE GROUP	107,261	473,021.01	
		STOCKLAND	50,500	207,050.00	
		VICINITY CENTRES	72,862	193,084.30	
豪ドル小計			440,787	2,284,483.14	(190,411,669)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	46,000	3,424,700.00	
香港ドル小計			46,000	3,424,700.00	(49,075,951)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	51,900	140,130.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	54,940	95,046.20	
		CAPITALAND MALL TRUST	48,100	103,415.00	
		SUNTEC REIT	54,600	98,826.00	
シンガポールドル小計			209,540	437,417.20	(36,104,415)
合計				2,138,957,130	(2,138,957,130)

(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 596銘柄	97.2%			65.2%
	投資証券 38銘柄			2.8%	1.9%
加ドル	株式 87銘柄	99.5%			3.7%
	投資証券 3銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 239銘柄	98.9%			12.5%
	投資証券 5銘柄			1.1%	0.1%
英ポンド	株式 97銘柄	98.8%			6.8%
	投資証券 4銘柄			1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%			3.1%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	100.0%			1.0%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0%			0.7%
豪ドル	株式 58銘柄	91.9%			2.5%
	投資証券 9銘柄			8.1%	0.2%
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%			1.2%
	投資証券 1銘柄			4.4%	0.1%
シンガポールドル	株式 21銘柄	91.4%			0.4%
	投資証券 4銘柄			8.6%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 9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。

## インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）

### 貸借対照表

（単位：円）

	平成29年 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	448,621
コール・ローン	2,856,188	1,006,123
親投資信託受益証券	272,309,688	134,412,330
未収入金	961,617	700,933
流動資産合計	276,127,493	136,568,007
資産合計	276,127,493	136,568,007
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	974,722	705,411
未払受託者報酬	8,328	3,875
未払委託者報酬	16,674	7,766
未払利息	4	2
その他未払費用	127,133	92,085
流動負債合計	1,126,861	809,139
負債合計	1,126,861	809,139
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	250,856,740	119,028,065
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	24,143,892	16,730,803
（分配準備積立金）	11,897,626	13,193,707
元本等合計	275,000,632	135,758,868
純資産合計	275,000,632	135,758,868
負債純資産合計	276,127,493	136,568,007

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
-----------------	--

（貸借対照表に関する注記）

		平成29年 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
1.	期首	平成28年 8月23日	平成29年 7月19日
	期首元本額	13,490,839円	250,856,740円
	期首からの追加設定元本額	302,398,266円	58,630,874円
	期首からの一部解約元本額	65,032,365円	190,459,549円
2.	受益権の総数	250,856,740口	119,028,065口



期首は当該投資信託の期首日であります。

（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 8月23日 至 平成29年 7月18日	自 平成29年 7月19日 至 平成30年 7月17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 7月18日現在	平成30年 7月17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 7月18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
親投資信託受益証券	4,564,002
合計	4,564,002

(平成30年 7月17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
親投資信託受益証券	5,498,035
合計	5,498,035

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、当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 7月18日現在		平成30年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	1.0962円	1口当たり純資産額	1.1406円
(1万口当たり純資産額)	(10,962円)	(1万口当たり純資産額)	(11,406円)

附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド	65,065,510	134,412,330	
合計		65,065,510	134,412,330	

(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。

「インデックスファンド海外先進国リート(適格機関投資家向け)」は、「海外リートインデックス(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。

## 海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

	平成29年 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
資産の部		
流動資産		
預金	148,635,050	132,865,429
金銭信託	-	20,751,580
コール・ローン	6,211,516	46,539,565
投資証券	7,410,161,694	6,529,978,447
派生商品評価勘定	6,200	-

未収入金	-	6,929,270
未収配当金	11,336,701	11,334,731
流動資産合計	7,576,351,161	6,748,399,022
資産合計	7,576,351,161	6,748,399,022
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	20	3,640
未払金	2,284,083	1,107,879
未払解約金	5,132,370	65,568,158
未払利息	9	93
流動負債合計	7,416,482	66,679,770
負債合計	7,416,482	66,679,770
純資産の部		
元本等		
元本	3,832,492,331	3,234,483,853
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	3,736,442,348	3,447,235,399
元本等合計	7,568,934,679	6,681,719,252
純資産合計	7,568,934,679	6,681,719,252
負債純資産合計	7,576,351,161	6,748,399,022

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>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 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
--	---------------	---------------

1.	期首	平成28年 8月23日	平成29年 7月19日
	期首元本額	4,332,732,467円	3,832,492,331円
	期首からの追加設定元本額	238,440,112円	62,678,900円
	期首からの一部解約元本額	738,680,248円	660,687,378円
	元本の内訳		
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	3,027,950,399円	2,667,944,455円
	インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）	137,885,305円	65,065,510円
	海外先進国REITインデックスファンド（適格機関投資家向け）	666,656,627円	501,473,888円
	計	3,832,492,331円	3,234,483,853円
2.	受益権の総数	3,832,492,331口	3,234,483,853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 8月23日 至 平成29年 7月18日	自 平成29年 7月19日 至 平成30年 7月17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、為替予約取引があり、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 7月18日現在	平成30年 7月17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 7月18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
投資証券	137,683,348
合計	137,683,348

（平成30年 7月17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
投資証券	140,672,712
合計	140,672,712

(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 7月18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	3,405,780	-	3,399,600	6,180
	ユーロ	2,588,000	-	2,581,800	6,200
	ニュージーランドドル	817,780	-	817,800	20
	合計	3,405,780	-	3,399,600	6,180

(平成30年 7月17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	18,699,760	-	18,703,400	3,640
	米ドル	10,117,800	-	10,117,800	-
	ユーロ	2,630,000	-	2,633,600	3,600
	英ポンド	5,951,960	-	5,952,000	40
	合計	18,699,760	-	18,703,400	3,640

## (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 7月18日現在		平成30年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	1.9749円	1口当たり純資産額	2.0658円
(1万口当たり純資産額)	(19,749円)	(1万口当たり純資産額)	(20,658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	投資証券	ACADIA REALTY TRUST	4,098	109,662.48	
		AGREE REALTY CORPORATION	1,566	84,235.14	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	3,451	84,894.60	
		ALEXANDER'S INC	192	73,637.76	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	5,183	658,033.68	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	2,073	78,587.43	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	6,856	293,573.92	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	13,119	297,145.35	
		AMERICOLD REALTY TRUST	2,416	52,282.24	
		APARTMENT INVT&MGMT CO -A	7,937	337,163.76	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	10,851	195,969.06	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	2,411	36,864.19	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4,613	37,826.60	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,949	1,199,744.85	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	1,064	9,693.04	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,770	986,246.10	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	1,499	17,598.26	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	8,912	149,276.00	



BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	15,278	263,851.06	
CAMDEN PROPERTY TRUST	4,667	425,397.05	
CARETRUST REIT INC	3,770	63,826.10	
CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	8,250	44,055.00	
CEDAR REALTY TRUST INC	4,052	19,692.72	
CHATHAM LODGING TRUST	2,340	50,544.00	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	3,003	96,756.66	
CITY OFFICE REIT INC	1,829	23,594.10	
CLIPPER REALTY INC	560	5,605.60	
COLONY CAPITAL INC-A	25,106	152,644.48	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	5,999	136,237.29	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	878	26,059.04	
CORECIVIC INC	6,000	148,380.00	
CORESITE REALTY CORP	1,744	197,246.40	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST	5,156	151,277.04	
COUSINS PROPERTIES INC	21,138	200,388.24	
CUBESMART	9,177	289,075.50	
CYRUSONE INC	5,010	309,317.40	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	4,745	314,356.25	
DDR CORP	7,768	111,082.40	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	10,072	123,986.32	
DIGITAL REALTY TRUST INC	10,362	1,198,468.92	
DOUGLAS EMMETT INC	8,062	321,996.28	
DUKE REALTY CORPORATION	17,959	517,757.97	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	3,037	59,889.64	
EASTGROUP PROPERTIES INC	1,745	169,334.80	
EDUCATION REALTY TRUST INC	4,053	168,442.68	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	6,809	117,795.70	
EPR PROPERTIES	3,257	214,343.17	
EQUITY COMMONWEALTH	6,094	191,717.24	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	4,468	415,658.04	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	18,515	1,192,921.45	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,321	784,220.94	
EXTRA SPACE STORAGE INC	6,345	613,624.95	
FARMLAND PARTNERS INC	1,521	9,278.10	

FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	3,688	460,004.24	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	6,288	208,510.08	
FOREST CITY REALTY TRUST- A	13,417	303,626.71	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	3,094	76,762.14	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	5,546	48,804.80	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	10,108	363,483.68	
GEO GROUP INC/THE	6,164	165,133.56	
GETTY REALTY CORPORATION	1,662	47,283.90	
GGP INC	31,829	662,361.49	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	1,465	29,724.85	
GLADSTONE LAND CORP	565	6,717.85	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	697	5,980.26	
GLOBAL NET LEASE INC	3,382	70,007.40	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	5,110	80,073.70	
GRAMERCY PROPERTY TRUST	8,133	222,600.21	
HCP INC	23,659	609,929.02	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	6,331	182,902.59	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	10,293	275,337.75	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,817	40,827.99	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	5,211	263,259.72	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	8,272	237,654.56	
HOST HOTELS & RESORTS INC	37,300	784,046.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	7,905	275,568.30	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	4,291	43,467.83	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	996	23,027.52	
INFREIT INC	2,062	44,972.22	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	6,450	35,281.50	
INVITATION HOMES INC	14,419	335,530.13	
IRON MOUNTAIN INC	14,184	515,730.24	
ISTAR INC	3,479	36,912.19	
JBG SMITH PROPERTIES	4,709	173,244.11	
KILROY REALTY CORPORATION	4,981	375,716.83	
KIMCO REALTY CORPORATION	21,423	353,479.50	
KITE REALTY GROUP TRUST	4,268	71,360.96	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	5,577	193,744.98	

LEXINGTON REALTY TRUST	11,028	96,936.12	
LIBERTY PROPERTY TRUST	7,433	330,322.52	
LIFE STORAGE INC	2,328	225,350.40	
LTC PROPERTIES INC	1,973	82,491.13	
MACERICH CO/THE	5,472	314,694.72	
MACK-CALI REALTY CORPORATION	4,513	89,673.31	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	59,933	51,542.38	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	1,587	17,806.14	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	18,322	262,737.48	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,726	567,675.64	
MONMOUTH RE INVST CORP	4,045	67,794.20	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	7,713	338,677.83	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	2,563	78,453.43	
NATL HEALTH INVESTORS INC	2,091	156,511.35	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	4,389	32,566.38	
NEXPOINT RESIDENTIAL	899	25,333.82	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	2,504	34,730.48	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	9,996	313,074.72	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	842	23,155.00	
PARAMOUNT GROUP INC	10,344	160,849.20	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	10,097	313,007.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	3,453	134,839.65	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	3,741	40,926.54	
PHYSICIANS REALTY TRUST	9,210	146,070.60	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	6,471	129,161.16	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	1,880	33,031.60	
PROLOGIS INC	26,815	1,744,047.60	
PS BUSINESS PARKS INC	1,005	129,283.20	
PUBLIC STORAGE	7,531	1,698,541.74	
QTS REALTY TRUST INC-CL-A	2,579	105,481.10	
QUALITY CARE PROPERTIES	4,754	96,886.52	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES TRUST	3,883	49,702.40	
REALTY INCOME CORP	14,307	785,597.37	
REGENCY CENTERS CORP	7,420	452,842.60	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	5,670	107,843.40	

RETAIL PROPERTIES OF AME - A	11,086	141,789.94	
RETAIL VALUE INC	776	27,540.24	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	4,086	125,440.20	
RLJ LODGING TRUST	8,787	199,113.42	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2,573	214,125.06	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	9,042	202,269.54	
SAUL CENTERS INC	651	34,828.50	
SELECT INCOME REIT	3,282	73,648.08	
SENIOR HOUSING PROPERTIES TRUST	12,021	218,181.15	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	1,358	58,258.20	
SIMON PROPERTY GROUP INC	15,578	2,658,541.48	
SL GREEN REALTY CORP	4,456	454,333.76	
SPIRIT MTA REIT	2,234	24,663.36	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	21,644	176,615.04	
STAG INDUSTRIAL INC	4,879	132,708.80	
STORE CAPITAL CORP	8,668	237,156.48	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	5,276	74,655.40	
SUN COMMUNITIES INC	4,018	397,701.64	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	11,309	189,538.84	
TANGER FACTORY OUTLET CENTERS INC	4,755	110,601.30	
TAUBMAN CENTERS INC	3,087	182,719.53	
TERRENO REALTY CORP	2,767	103,707.16	
TIER REIT INC	2,322	55,147.50	
UDR INC	13,469	501,720.25	
UMH PROPERTIES INC	1,802	28,291.40	
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	669	43,852.95	
URBAN EDGE PROPERTIES	5,340	121,538.40	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES- CL A	1,610	36,112.30	
VENTAS INC	17,931	1,045,197.99	
VEREIT INC	48,813	367,561.89	
VORNADO REALTY TRUST	8,718	642,342.24	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	9,216	70,686.72	
WASHINGTON REIT	3,990	120,897.00	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	6,029	182,799.28	
WELLTOWER INC	18,718	1,171,559.62	

		WHEELER REAL ESTATE INVESTME	103	452.17	
		WHITESTONE REIT	2,039	26,078.81	
		WP CAREY INC	5,412	357,679.08	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	5,347	130,573.74	
米ドル小計			1,188,203	41,632,592.99	(4,681,168,755)
加ドル	投資証券	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	574	7,921.20	
		ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	2,419	102,178.56	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,174	54,512.44	
		BOARDWALK EQUITIES INC	1,206	54,897.12	
		CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	3,630	158,812.50	
		CHOICE PROPERTIES REIT	7,010	86,924.00	
		COMINAR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,831	61,546.94	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,435	31,630.65	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	1,237	15,660.42	
		DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	4,760	68,353.60	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	1,940	20,544.60	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	1,523	35,988.49	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,080	59,454.00	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	7,196	144,351.76	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	1,761	19,353.39	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	2,155	33,230.10	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	682	10,359.58	
		MORGUARD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,005	13,175.55	
		NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	1,386	37,311.12	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	2,652	30,126.72	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,027	197,865.55	
		SLATE OFFICE REIT	1,116	8,481.60	
SLATE RETAIL REIT	912	11,609.76			
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	3,276	99,164.52			
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	1,576	13,963.36			
加ドル小計			68,563	1,377,417.53	(117,906,940)
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	890	70,933.00	
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	7,175	91,911.75	

		ALTAREA	193	37,673.60	
		BEFIMMO S.C.A.	1,131	58,698.90	
		BENI STABILI SPA	49,297	37,416.42	
		COFINIMMO	1,076	118,144.80	
		COVIVIO	2,727	240,385.05	
		CROMWELL EUROPEAN REIT	19,300	11,194.00	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	2,492	92,253.84	
		GECINA SA	2,428	355,702.00	
		GREEN REIT PLC	35,316	54,033.48	
		HAMBORNER REIT AG	4,232	38,341.92	
		HIBERNIA REIT PLC	34,112	50,144.64	
		HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	5,471	99,517.49	
		ICADE	2,286	192,252.60	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	2,553	18,192.67	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	17,304	167,243.16	
		INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	928	20,137.60	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	19,113	26,681.74	
		KLEPIERRE	10,419	333,095.43	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	4,687	44,151.54	
		MERCIALYS	2,872	43,194.88	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	16,759	207,392.62	
		NSI NV	960	33,456.00	
		RETAIL ESTATES	375	29,025.00	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,788	1,266,980.20	
		VASTNED RETAIL	844	33,928.80	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	858	96,610.80	
		WERELDHAVE NV	2,062	67,592.36	
		ユーロ小計	254,648	3,936,286.29 (518,330,178)	
英債券	投資証券	AEW UK LONG LEASE REIT PLC	2,098	1,812.67	
		ASSURA PLC	122,751	70,090.82	
		BIG YELLOW GROUP PLC	7,298	70,024.31	
		BRITISH LAND COMPANY PLC	50,075	326,388.85	
		CAPITAL & REGIONAL PLC	25,207	12,427.05	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	8,816	9,036.40	

		DERWENT LONDON PLC	5,595	169,360.65	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	30,277	27,794.28	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	14,094	99,221.76	
		HAMMERSON PLC	39,774	211,756.77	
		HANSTEEN HOLDINGS PLC	21,879	23,651.19	
		INTU PROPERTIES PLC	43,793	78,411.36	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	37,831	353,946.83	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	35,069	64,737.37	
		LXI REIT PLC	8,380	9,134.20	
		NEWRIVER REIT PLC	15,163	41,167.54	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	37,726	43,762.16	
		REDEFINE INTERNATIONAL PLC	72,207	25,705.69	
		REGIONAL REIT LTD	15,688	14,809.47	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	10,476	58,194.18	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	29,709	18,300.74	
		SEGRO PLC	50,825	341,950.60	
		SHAFTESBURY PLC	12,248	112,559.12	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	73,232	112,337.88	
		UNITE GROUP PLC	13,069	109,648.91	
		WORKSPACE GROUP PLC	6,677	72,979.61	
英債券小計			789,957	2,479,210.41	(368,931,301)
豪ドル	投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	16,934	63,841.18	
		ARENA REIT	14,357	31,298.26	
		BWP TRUST	26,096	85,594.88	
		CHARTER HALL GROUP	23,668	156,918.84	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	9,625	40,521.25	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	17,825	74,865.00	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	83,019	93,811.47	
		DEXUS	51,253	507,917.23	
		FOLKESTONE EDUCATION TRUST	12,897	33,790.14	
		GDI PROPERTY GROUP	29,145	36,868.42	
		GOODMAN GROUP	81,054	791,897.58	
		GPT GROUP	91,286	471,035.76	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	14,463	53,223.84	

		INDUSTRIA REIT	3,970	10,322.00	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	11,640	36,782.40	
		INVESTA OFFICE FUND	25,675	131,712.75	
		MIRVAC GROUP	187,707	418,586.61	
		NATIONAL STORAGE REIT	28,961	49,812.92	
		RURAL FUNDS GROUP	13,249	26,762.98	
		RURAL FUNDS GROUP-RTS(N)	4,541	317.87	
		SCENTRE GROUP	269,060	1,186,554.60	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	38,507	94,727.22	
		STOCKLAND	124,124	508,908.40	
		VICINITY CENTRES	163,061	432,111.65	
		VIVA ENERGY REIT	24,842	54,652.40	
豪ドル小計			1,366,959	5,392,835.65	(449,492,851)
ニュー ジーラン ドドル	投資証券	GOODMAN PROPERTY TRUST	65,032	95,922.20	
		STRIDE STAPLED GROUP	27,914	51,640.90	
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	24,690	51,849.00	
ニュージーランドドル小計			117,636	199,412.10	(15,213,149)
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	103,000	540,750.00	
		FORTUNE REIT	68,000	639,200.00	
		LINK REIT	108,300	8,062,935.00	
		PROSPERITY REIT	55,000	176,000.00	
		RREEF CHINA COMMERCIAL TRUST	201,000	874,350.00	
		SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	51,000	169,830.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	53,000	282,490.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	57,000	306,660.00	
香港ドル小計			696,300	11,052,215.00	(158,378,240)
シンガ ポールド ドル	投資証券	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	33,325	46,655.00	
		ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	42,040	33,632.00	
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	121,313	327,545.10	
		ASCOTT RESIDENCE TRUST	62,142	69,599.04	
		CACHE LOGISTICS TRUST	57,258	44,374.95	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	134,150	232,079.50	



		CAPITALAND MALL TRUST	135,900	292,185.00	
		CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	30,440	45,355.60	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	40,400	65,044.00	
		ESR REIT	70,518	36,669.36	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	50,200	32,881.00	
		FIRST REAL ESTATE INVNT TRUST	30,500	39,955.00	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	27,500	60,775.00	
		FRASERS COMMERCIAL TRUST	33,200	47,144.00	
		FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	76,610	81,206.60	
		KEPPEL DC REIT	48,154	64,526.36	
		KEPPEL REIT	88,300	100,662.00	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	109,900	35,168.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	95,840	153,344.00	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	61,860	122,482.80	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	110,344	139,033.44	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	110,100	128,817.00	
		QUE HOSPITALITY TRUST	60,526	47,210.28	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	21,100	57,814.00	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	36,100	15,884.00	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	29,050	19,173.00	
		SPH REIT	35,200	34,848.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	72,700	47,618.50	
		SUNTEC REIT	112,500	203,625.00	
シンガポールドドル小計			1,937,170	2,625,307.53 (216,692,883)	
イスラエル シュケ ル	投資証券	REIT 1 LTD	9,000	124,650.00	
イスラエルシュケル小計			9,000	124,650.00 (3,864,150)	
合計				6,529,978,447 (6,529,978,447)	

(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	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 162銘柄	100.0%	71.8%
加ドル	投資証券 25銘柄	100.0%	1.8%
ユーロ	投資証券 29銘柄	100.0%	7.9%
英ポンド	投資証券 26銘柄	100.0%	5.6%
豪ドル	投資証券 25銘柄	100.0%	6.9%
ニュージーランドドル	投資証券 3銘柄	100.0%	0.2%
香港ドル	投資証券 8銘柄	100.0%	2.4%
シンガポールドル	投資証券 29銘柄	100.0%	3.3%
イスラエルシェケル	投資証券 1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。

## 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）

### 貸借対照表

	平成29年 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
（単位：円）		
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	86,996
コール・ローン	649,759	195,107
親投資信託受益証券	61,121,303	26,340,229
未収入金	577,497	80,385
流動資産合計	62,348,559	26,702,717
資産合計	62,348,559	26,702,717
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	578,639	87,122
未払受託者報酬	1,788	668
未払委託者報酬	3,603	1,345
未払利息	1	-
その他未払費用	35,848	23,416
流動負債合計	619,879	112,551

	平成29年 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
負債合計	619,879	112,551
純資産の部		
元本等		
元本	53,092,741	23,683,281
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	8,635,939	2,906,885
(分配準備積立金)	4,404,556	3,478,824
元本等合計	61,728,680	26,590,166
純資産合計	61,728,680	26,590,166
負債純資産合計	62,348,559	26,702,717

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
-----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

		平成29年 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
1.	期首	平成28年 8月23日	平成29年 7月19日
	期首元本額	14,663,355円	53,092,741円
	期首からの追加設定元本額	107,675,693円	11,732,952円
	期首からの一部解約元本額	69,246,307円	41,142,412円
2.	受益権の総数	53,092,741口	23,683,281口

期首は当該投資信託の期首日であります。

(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 8月23日 至 平成29年 7月18日	自 平成29年 7月19日 至 平成30年 7月17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 7月18日現在	平成30年 7月17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 7月18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
親投資信託受益証券	1,415,440
合計	1,415,440

（平成30年 7月17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
親投資信託受益証券	674,499
合計	674,499

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、当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 7月18日現在		平成30年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	1.1627円	1口当たり純資産額	1.1227円
(1万口当たり純資産額)	(11,627円)	(1万口当たり純資産額)	(11,227円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド	20,439,380	26,340,229	

合計	20,439,380	26,340,229	
----	------------	------------	--

(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。

「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）」は、「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。

### 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 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
預金	15,694,715	18,533,459
金銭信託	-	7,209,880
コール・ローン	19,822,688	16,169,598
国債証券	3,105,757,043	3,827,572,454
派生商品評価勘定	111,948	-
未収利息	49,176,883	64,399,179
前払費用	5,935,543	6,300,053
流動資産合計	3,196,498,820	3,940,184,623
資産合計	3,196,498,820	3,940,184,623
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	127,960	21,785
未払金	14,141,675	24,823,622
未払解約金	2,700,727	2,944,280
未払利息	31	32
流動負債合計	16,970,393	27,789,719
負債合計	16,970,393	27,789,719
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	2,390,565,710	3,035,999,563
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	788,962,717	876,395,341
元本等合計	3,179,528,427	3,912,394,904

純資産合計	3,179,528,427	3,912,394,904
負債純資産合計	3,196,498,820	3,940,184,623

## 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 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
1.	期首	平成28年 8月23日	平成29年 7月19日
	期首元本額	1,955,779,307円	2,390,565,710円
	期首からの追加設定元本額	590,220,714円	813,229,052円
	期首からの一部解約元本額	155,434,311円	167,795,199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	34,772,776円	33,770,435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）	2,309,837,067円	2,981,789,748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）	45,955,867円	20,439,380円
	計	2,390,565,710円	3,035,999,563円
2.	受益権の総数	2,390,565,710口	3,035,999,563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 8月23日 至 平成29年 7月18日	自 平成29年 7月19日 至 平成30年 7月17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 7月18日現在	平成30年 7月17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 7月18日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	5,483,998
合計	5,483,998

(平成30年 7月17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	59,795,819
合計	59,795,819

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(平成29年 7月18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	14,854,934	-	14,726,974	127,960
	米ドル	3,405,000	-	3,372,600	32,400
	ブラジルリアル	11,449,934	-	11,354,374	95,560
	売建	11,449,934	-	11,337,986	111,948

	米ドル	11,449,934	-	11,337,986	111,948
	合計	26,304,868	-	26,064,960	16,012

(平成30年 7月17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	18,037,334	-	18,015,549	21,785
	トルコリラ	3,288,010	-	3,284,460	3,550
	チェココルナ	4,306,218	-	4,295,648	10,570
	マレーシアリング	5,287,864	-	5,284,441	3,423
	南アフリカランド	5,155,242	-	5,151,000	4,242
	合計	18,037,334	-	18,015,549	21,785

## (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 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
1口当たり純資産額	1.3300円	1.2887円

(1万口当たり純資産額)

(13,300円)

(1万口当たり純資産額)

(12,887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	1,699,844.40	
		REPUBLIC OF ARGENTINA-16.0%-23/10/17	4,200,000.00	3,738,000.00	
		REPUBLIC OF ARGENTINA-15.5%-26/10/17	2,700,000.00	2,423,250.00	
アルゼンチンペソ小計			8,900,000.00	7,861,094.40 (32,309,097)	
メキシコペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11	5,370,000.00	5,180,937.60	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	8,980,000.00	9,041,780.60	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	7,800,000.00	7,557,458.22	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%-21/12/09	700,000.00	689,584.07	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	6,550,000.00	6,277,700.45	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	3,330,000.00	3,371,886.56	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	6,610,000.00	7,368,090.65	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%-26/03/05	4,100,000.00	3,632,988.27	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	5,030,000.00	4,949,989.54	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	2,360,000.00	2,485,408.27	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	3,650,000.00	3,625,416.33	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-34/11/23	2,000,000.00	1,973,951.10	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	2,480,000.00	2,977,466.05	
MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	2,390,000.00	2,525,221.65			

		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	4,760,000.00	4,662,290.52	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	2,000,000.00	2,012,045.00	
メキシコペソ小計			68,110,000.00	68,332,214.88	(407,943,322)
ブラジル リアル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL-10.25%-28/01/10	250,000.00	261,250.00	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-19/10/01	1,100,000.00	1,003,750.00	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-20/01/01	1,350,000.00	1,204,335.00	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-20/04/01	1,290,000.00	1,123,719.00	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-20/07/01	2,660,000.00	2,261,532.00	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-21/07/01	1,450,000.00	1,108,670.00	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-22/01/01	1,280,000.00	921,600.00	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-21/01/01	1,380,000.00	1,404,479.69	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-23/01/01	1,700,000.00	1,670,826.14	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-25/01/01	1,040,000.00	989,600.46	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-27/01/01	1,020,000.00	948,537.68	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-29/01/01	350,000.00	320,368.61	
ブラジルリアル小計			14,870,000.00	13,218,668.58	(384,927,629)
チリペソ	国債証券	REPUBLIC OF CHILE-5.5%-20/08/05	560,000,000.00	581,700,000.00	
チリペソ小計			560,000,000.00	581,700,000.00	(100,575,930)
コロンビア アペソ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA-7.75%-21/04/14	140,000,000.00	147,253,022.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA-4.375%-23/03/21	30,000,000.00	28,445,928.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA-9.85%-27/06/28	97,000,000.00	122,269,329.35	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-19/09/11	437,000,000.00	447,815,750.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-11.0%-20/07/24	625,000,000.00	693,378,125.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-22/05/04	1,335,000,000.00	1,388,753,775.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-10.0%-24/07/24	1,105,000,000.00	1,312,552,150.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-6.25%-25/11/26	280,000,000.00	275,399,600.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.5%-26/08/26	1,360,000,000.00	1,438,159,200.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-6.0%-28/04/28	730,000,000.00	696,912,750.00	

		TITULOS DE TESORERIA B-7.75%-30/09/18	855,000,000.00	915,418,575.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-32/06/30	250,000,000.00	246,946,250.00	
コロンビアペソ小計			7,244,000,000.00	7,713,304,454.35	(301,590,204)
ペルーヌ エボソル	国債証券	BONOS DE TESORERIA-5.7%-24/08/12	580,000.00	608,566.16	
		BONOS DE TESORERIA-6.35%-28/08/12	710,000.00	756,564.99	
		BONOS DE TESORERIA-6.15%-32/08/12	550,000.00	566,543.72	
		PERU BONO SOBERANO-7.84%-20/08/12	125,000.00	137,565.37	
		PERU BONO SOBERANO-8.2%-26/08/12	440,000.00	525,794.06	
		PERU BONO SOBERANO-6.95%-31/08/12	520,000.00	575,570.58	
		PERU BONO SOBERANO-6.9%-37/08/12	200,000.00	216,497.20	
ペルーヌエボソル小計			3,125,000.00	3,387,102.08	(116,550,182)
ウルグアイ ペソ	国債証券	REPUBLICA ORIENT URUGUAY-9.875%- 22/06/20	1,300,000.00	1,284,400.00	
		REPUBLICA ORIENT URUGUAY-8.5%- 28/03/15	1,300,000.00	1,108,900.00	
ウルグアイペソ小計			2,600,000.00	2,393,300.00	(8,591,947)
トルコリ ラ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND-10.5%-20/01/15	495,000.00	439,065.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-7.4%-20/02/05	580,000.00	487,200.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.4%-20/07/08	550,000.00	459,112.50	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.7%-21/02/17	610,000.00	500,200.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.2%-21/09/22	580,000.00	442,540.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.5%-22/01/12	480,000.00	363,000.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-11.0%-22/03/02	690,000.00	542,340.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.7%-22/08/17	650,000.00	495,625.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.5%-22/09/14	490,000.00	344,470.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-12.2%-23/01/18	570,000.00	454,290.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-7.1%-23/03/08	860,000.00	549,540.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.8%-23/09/27	470,000.00	320,305.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.4%-24/03/20	270,000.00	195,615.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.0%-24/07/24	660,000.00	450,780.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.0%-25/03/12	620,000.00	386,260.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.6%-26/02/11	810,000.00	566,190.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-11.0%-27/02/24	660,000.00	462,330.00	

		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.5%-27/08/11	810,000.00	550,395.00	
トルコリラ小計			10,855,000.00	8,009,257.50	(185,494,403)
チェココ ルナ	国債証券	CZECH REPUBLIC-1.5%-19/10/29	2,980,000.00	3,003,124.80	
		CZECH REPUBLIC-0.0%-20/02/10	1,700,000.00	1,674,500.00	
		CZECH REPUBLIC-3.75%-20/09/12	3,050,000.00	3,227,449.00	
		CZECH REPUBLIC-3.85%-21/09/29	3,240,000.00	3,519,450.00	
		CZECH REPUBLIC-4.7%-22/09/12	2,870,000.00	3,254,594.35	
		CZECH REPUBLIC-0.45%-23/10/25	2,100,000.00	1,984,500.00	
		CZECH REPUBLIC-5.7%-24/05/25	3,020,000.00	3,734,245.10	
		CZECH REPUBLIC-2.4%-25/09/17	3,400,000.00	3,524,117.00	
		CZECH REPUBLIC-1.0%-26/06/26	2,600,000.00	2,410,213.00	
		CZECH REPUBLIC-0.25%-27/02/10	1,600,000.00	1,388,008.00	
		CZECH REPUBLIC-2.5%-28/08/25	3,860,000.00	3,998,979.30	
		CZECH REPUBLIC-0.95%-30/05/15	2,500,000.00	2,143,775.00	
チェココルナ小計			32,920,000.00	33,862,955.55	(172,362,443)
ハンガ リーフォ リント	国債証券	HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.0%-19/10/30	13,500,000.00	13,725,315.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.5%-20/06/24	28,000,000.00	29,157,800.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-1.0%-20/09/23	19,000,000.00	18,801,260.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-7.5%-20/11/12	32,200,000.00	36,537,984.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-0.5%-21/04/21	15,000,000.00	14,467,800.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.5%-21/10/27	25,000,000.00	25,455,000.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-7.0%-22/06/24	41,800,000.00	49,333,614.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-1.75%- 22/10/26	46,000,000.00	44,997,660.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.0%-23/11/24	45,000,000.00	53,065,800.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-24/06/26	35,000,000.00	35,683,550.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-5.5%-25/06/24	49,800,000.00	58,132,536.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.75%- 26/12/22	17,000,000.00	16,380,010.00	
HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-27/10/27	35,000,000.00	34,060,600.00			
ハンガリーフォリント小計			402,300,000.00	429,798,929.00	(175,143,063)
ポーラン ドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	590,000.00	620,267.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.5%-20/04/25	870,000.00	869,217.00	

		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-20/07/25	300,000.00	290,520.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	520,000.00	561,158.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25	810,000.00	813,159.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-21/07/25	970,000.00	964,131.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	450,000.00	503,955.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-22/04/25	890,000.00	892,314.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	700,000.00	796,705.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-23/01/25	870,000.00	875,437.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	760,000.00	815,670.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	880,000.00	898,348.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	1,150,000.00	1,104,575.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	990,000.00	940,945.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	330,000.00	318,945.00	
ポーランドズロチ小計			11,080,000.00	11,265,347.50 (344,606,980)	
ロシア ルーブル	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.8%-19/12/11	5,000,000.00	5,001,250.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.4%-20/05/27	7,900,000.00	7,828,110.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.6%-21/04/14	6,900,000.00	7,010,400.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.5%-21/08/18	10,800,000.00	10,962,000.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.0%-21/12/15	11,500,000.00	11,465,500.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.6%-22/07/20	6,800,000.00	6,922,400.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.4%-22/12/07	13,400,000.00	13,527,300.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.0%-23/01/25	5,400,000.00	5,383,800.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.0%-23/08/16	9,900,000.00	9,870,300.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.5%-24/02/28	2,000,000.00	1,926,000.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.1%-24/10/16	13,200,000.00	13,081,200.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.75%-26/09/16	13,700,000.00	13,974,000.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-8.15%-27/02/03	13,400,000.00	14,023,100.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.05%-28/01/19	14,900,000.00	14,572,200.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-8.5%-31/09/17	8,750,000.00	9,406,250.00	
RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.7%-33/03/23	14,500,000.00	14,659,500.00			
RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.25%-34/05/10	2,000,000.00	1,931,000.00			
ロシアルーブル小計			160,050,000.00	161,544,310.00 (292,395,201)	
ルーマニア アレ	国債証券	ROMANIA GOVERNMENT BOND-2.25%- 20/02/26	405,000.00	395,601.97	

		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.75%- 20/04/29	370,000.00	382,004.65	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.25%- 21/03/22	320,000.00	312,366.40	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.95%- 21/06/11	370,000.00	386,015.45	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.4%-22/03/08	180,000.00	173,602.80	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.5%-22/12/19	400,000.00	382,522.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.85%- 23/04/26	480,000.00	505,087.20	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.25%- 24/04/29	250,000.00	231,925.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.75%- 25/02/24	340,000.00	340,498.10	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.8%-27/07/26	400,000.00	425,000.00	
		ルーマニアレイ小計	3,515,000.00	3,534,623.57 (99,923,808)	
マレーシ アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.654%-19/10/31	410,000.00	411,306.26	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.659%-20/10/15	500,000.00	501,843.20	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.62%-21/11/30	400,000.00	400,489.95	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	500,000.00	497,706.04	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	500,000.00	502,031.90	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	600,000.00	594,989.74	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	350,000.00	342,214.44	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	620,000.00	607,565.75	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	450,000.00	444,773.60	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.226%- 20/04/15	300,000.00	298,295.82	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.948%- 22/04/14	430,000.00	432,164.40	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.258%- 27/07/26	480,000.00	478,995.86	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	580,000.00	587,414.31	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.492%-20/03/31	560,000.00	560,091.16	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	550,000.00	557,951.51	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	480,000.00	484,586.78	
		マレーシアリングット小計	7,710,000.00	7,702,420.72 (214,127,296)	



タイバーツ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND-2.55%-20/06/26	7,100,000.00	7,210,520.73	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.65%-21/12/17	11,620,000.00	12,289,199.28	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-1.875%-22/06/17	7,000,000.00	6,954,128.51	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.0%-22/12/17	8,500,000.00	8,462,599.74	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.625%-23/06/16	7,800,000.00	8,326,169.28	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.85%-25/12/12	7,570,000.00	8,252,586.14	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.125%-26/12/17	6,900,000.00	6,659,201.38	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-4.875%-29/06/22	8,680,000.00	10,307,077.28	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.65%-31/06/20	7,300,000.00	7,775,891.38	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.775%-32/06/25	4,500,000.00	4,837,263.30	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.4%-36/06/17	6,750,000.00	6,906,232.80	
		タイバーツ小計			83,720,000.00
フィリピンペソ	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES-4.95%-21/01/15	5,000,000.00	4,991,750.00	
フィリピンペソ小計			5,000,000.00	4,991,750.00	(10,482,675)
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-20/11/15	800,000,000.00	867,247,120.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-12.8%-21/06/15	500,000,000.00	573,309,950.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-21/07/15	2,930,000,000.00	3,020,585,345.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-22/05/15	3,020,000,000.00	2,986,780,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-5.625%-23/05/15	1,850,000,000.00	1,714,025,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-24/03/15	4,250,000,000.00	4,439,000,050.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-25/09/15	760,000,000.00	904,538,776.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-26/09/15	3,790,000,000.00	3,988,241,635.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-27/05/15	3,400,000,000.00	3,278,195,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.125%-28/05/15	2,000,000,000.00	1,815,000,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.0%-29/03/15	2,650,000,000.00	2,900,142,245.00	

		INDONESIA GOVERNMENT-10.5%-30/08/15	810,000,000.00	971,288,415.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.75%-31/05/15	1,900,000,000.00	2,032,860,730.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.5%-31/07/15	820,000,000.00	922,163,062.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-32/06/15	1,100,000,000.00	1,126,983,770.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.5%-32/08/15	1,100,000,000.00	1,059,426,500.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.625%-33/05/15	2,280,000,000.00	2,056,560,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-34/03/15	2,600,000,000.00	2,671,500,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-36/05/15	2,560,000,000.00	2,621,127,680.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.5%-38/05/15	1,650,000,000.00	1,577,812,500.00	
		PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-8.25%- 20/09/15	750,000,000.00	773,081,250.00	
		PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-8.75%- 23/08/15	500,000,000.00	550,467,950.00	
		PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-8.875%- 31/11/15	1,090,000,000.00	1,163,366,483.00	
		インドネシアルピア小計	43,110,000,000.00	44,013,703,461.00 (347,708,257)	
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	1,300,000.00	1,297,361.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	1,490,000.00	1,455,948.13	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	2,050,000.00	2,020,875.03	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	5,900,000.00	6,525,631.28	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	3,330,000.00	3,075,769.48	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	3,640,000.00	3,051,523.92	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	2,650,000.00	2,437,972.44	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	2,500,000.00	2,385,436.87	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	2,890,000.00	2,112,322.67	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	3,210,000.00	2,935,916.39	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%- 40/01/31	2,320,000.00	2,202,842.90	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	2,540,000.00	1,825,295.30	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	3,480,000.00	3,199,250.30	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	5,340,000.00	4,893,910.54	
南アフリカランド小計		42,640,000.00	39,420,056.25 (335,464,678)	
合計			3,827,572,454 (3,827,572,454)	

(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%	0.8%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	10.7%
ブラジルリアル	国債証券 12銘柄	100.0%	10.1%
チリペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	2.6%
コロンビアペソ	国債証券 12銘柄	100.0%	7.9%
ペルーヌエボソル	国債証券 7銘柄	100.0%	3.0%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
トルコリラ	国債証券 18銘柄	100.0%	4.8%
チェココルナ	国債証券 12銘柄	100.0%	4.5%
ハンガリーフォリント	国債証券 13銘柄	100.0%	4.6%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	9.0%
ロシアルーブル	国債証券 17銘柄	100.0%	7.6%
ルーマニアレイ	国債証券 10銘柄	100.0%	2.6%
マレーシアリングット	国債証券 16銘柄	100.0%	5.6%
タイバーツ	国債証券 11銘柄	100.0%	7.8%
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%	9.1%
南アフリカランド	国債証券 14銘柄	100.0%	8.8%

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

F O F s用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

#### 貸借対照表

（単位：円）

平成30年 7月17日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	2,598,731
コール・ローン	9,335,943
親投資信託受益証券	2,334,632,649
流動資産合計	2,346,567,323
資産合計	
2,346,567,323	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	45,937,567
未払解約金	50,000
未払受託者報酬	16,141
未払委託者報酬	53,811
未払利息	17
その他未払費用	13,582
流動負債合計	46,071,118
負債合計	
46,071,118	
純資産の部	
元本等	
元本	2,427,290,047
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	126,793,842
元本等合計	2,300,496,205
純資産合計	
2,300,496,205	
負債純資産合計	
2,346,567,323	

#### 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. 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。

## （貸借対照表に関する注記）

		平成30年 7月17日現在
1.	期首	平成29年 9月29日
	期首元本額	10,000,000円
	期首からの追加設定元本額	2,619,137,538円
	期首からの一部解約元本額	201,847,491円
2.	受益権の総数	2,427,290,047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	126,793,842円

期首は当該投資信託の期首日であります。

## （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29年 9月29日 至 平成30年 7月17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。
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。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成30年 7月17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。
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。
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。

## （有価証券に関する注記）

（平成30年 7月17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
親投資信託受益証券	16,525,554
合計	16,525,554

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、当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30年 7月17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	2,285,644,793	-	2,331,582,360	45,937,567
	米ドル	2,285,644,793	-	2,331,582,360	45,937,567
合計		2,285,644,793	-	2,331,582,360	45,937,567

## （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30年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	0.9478円
(1万口当たり純資産額)	(9,478円)

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	ゴールド・マザーファンド	2,611,445,917	2,334,632,649	
合計		2,611,445,917	2,334,632,649	

(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

「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。

「FOFs用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）」は、「ゴールド・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。

## ゴールド・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

平成30年 7月17日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	122,502,163
金銭信託	8,497,233
コール・ローン	30,526,315
投資信託受益証券	77,101,256,012
流動資産合計	77,262,781,723
資産合計	77,262,781,723
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,775
未払金	204,189,916
未払解約金	1,801,175
未払利息	56
流動負債合計	206,003,922
負債合計	206,003,922
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	86,190,065,636
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	9,133,287,835
元本等合計	77,056,777,801
純資産合計	77,056,777,801
負債純資産合計	77,262,781,723

## 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>投資信託受益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	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30年 7月17日現在
1.	期首	平成29年 9月29日
	期首元本額	39,306,033,894円
	期首からの追加設定元本額	84,496,129,410円
	期首からの一部解約元本額	37,612,097,668円
	元本の内訳	
	ファイン・ブレンド（毎月分配型）	3,204,666,035円
	ファイン・ブレンド（資産成長型）	1,746,382,618円
	スマート・ファイブ（毎月決算型）	32,909,477,338円
	スマート・ファイブ（1年決算型）	3,628,530,030円
	ゴールド・ファンド（適格機関投資家向け）	3,109,339,839円
	ゴールド・ファンド（為替ヘッジあり）	6,657,310,043円
	ゴールド・ファンド（為替ヘッジなし）	4,113,351,685円
	ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（SMA専用）	28,148,993,920円
	FOFs用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	2,611,445,917円
	ファイン・ブレンド（適格機関投資家向け）	60,568,211円
	計	86,190,065,636円
2.	受益権の総数	86,190,065,636口
3.	元本の欠損	
	純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	9,133,287,835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29年 9月29日 至 平成30年 7月17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。
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。

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。
----------------	---

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成30年 7月17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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

(平成30年 7月17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
投資信託受益証券	4,757,956,057
合計	4,757,956,057

(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30年 7月17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	85,000,000	-	84,987,225	12,775
	米ドル	85,000,000	-	84,987,225	12,775
合計		85,000,000	-	84,987,225	12,775

## (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30年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	0.8940円
(1万口当たり純資産額)	(8,940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	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST-ETF	48,650,000	579,421,500.00	
		SPDR GOLD TRUST-ETF	904,200	106,288,710.00	
米ドル小計			49,554,200	685,710,210.00	(77,101,256,012)
合計				77,101,256,012	(77,101,256,012)

(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	組入投資信託 受益証券時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資信託受益証券 2銘柄	100.0%	100.0%

#### 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。

#### インデックス マザーファンド TOPIX

#### 貸借対照表

(単位:円)

	平成29年 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	8,898,559
コール・ローン	60,009,009	31,968,078
株式	39,815,375,130	41,990,477,680
派生商品評価勘定	1,306,760	897,840
未収入金	256,004,957	73,305
未収配当金	46,598,620	52,641,341
流動資産合計	40,179,294,476	42,084,956,803
資産合計	40,179,294,476	42,084,956,803

平成29年 7月18日現在

平成30年 7月17日現在

負債の部		
流動負債		
前受金	1,580,000	160,000
未払金	724,655	-
未払解約金	268,086,853	27,506,026
未払利息	97	59
流動負債合計	270,391,605	27,666,085
負債合計	270,391,605	27,666,085
純資産の部		
元本等		
元本	20,657,286,888	19,797,670,625
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	19,251,615,983	22,259,620,093
元本等合計	39,908,902,871	42,057,290,718
純資産合計	39,908,902,871	42,057,290,718
負債純資産合計	40,179,294,476	42,084,956,803

## 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 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
1.	期首	平成28年 8月22日	平成29年 7月19日
	期首元本額	23,178,272,677円	20,657,286,888円
	期首からの追加設定元本額	1,978,782,446円	2,657,614,476円
	期首からの一部解約元本額	4,499,768,235円	3,517,230,739円
	元本の内訳		
	インデックスファンドT S P	12,393,951,752円	11,211,592,326円
	財形株投（一般財形30）	- 円	13,998,305円

財形株投(一般財形50)	-円	53,898,661円
財形株投(年金・住宅財形30)	-円	29,304,773円
インデックスファンドTOPIX(日本株式)	7,507,333,407円	7,884,268,362円
TOPIXインデックスファンド(個人型年金向け)	449,908,377円	445,115,533円
時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-08	67,675,431円	38,111,193円
時間分散型バランスファンド(成長指向)2016-08	65,453,533円	26,055,415円
時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-11	52,634,537円	17,708,562円
時間分散型バランスファンド(成長指向)2016-11	82,582,703円	34,670,748円
時間分散型バランスファンド(安定指向)2017-02	13,511,449円	17,890,363円
時間分散型バランスファンド(成長指向)2017-02	24,235,699円	25,056,384円
計	20,657,286,888円	19,797,670,625円
2. 受益権の総数	20,657,286,888口	19,797,670,625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	269,784,000円	291,236,000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8月22日 至平成29年7月18日	自平成29年7月19日 至平成30年7月17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 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品            短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>(1)有価証券            同左</p> <p>(2)デリバティブ取引            同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品            同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成29年 7月18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	1,635,268,866
合計	1,635,268,866

(平成30年 7月17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	662,511,155
合計	662,511,155

(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 7月18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	95,890,000	-	97,200,000	1,310,000
	合計	95,890,000	-	97,200,000	1,310,000

(平成30年 7月17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	69,020,000	-	69,920,000	900,000
	合計	69,020,000	-	69,920,000	900,000

(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 7月18日現在		平成30年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	1.9320円	1口当たり純資産額	2.1244円
(1万口当たり純資産額)	(19,320円)	(1万口当たり純資産額)	(21,244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	800	3,485.00	2,788,000	
日本水産	21,300	538.00	11,459,400	
マルハニチロ	3,600	4,090.00	14,724,000	
カネコ種苗	600	1,679.00	1,007,400	
サカタのタネ	2,800	4,245.00	11,886,000	
ホクト	1,900	1,973.00	3,748,700	
ホクリヨウ	300	854.00	256,200	
住石ホールディングス	5,200	145.00	754,000	
日鉄鉱業	500	5,150.00	2,575,000	
三井松島産業	1,000	1,606.00	1,606,000	
国際石油開発帝石	91,800	1,141.00	104,743,800	
石油資源開発	3,000	2,647.00	7,941,000	
K&Oエナジーグループ	1,100	1,880.00	2,068,000	
ヒノキヤグループ	500	3,060.00	1,530,000	
ショーボンドホールディングス	1,800	7,860.00	14,148,000	
ミライト・ホールディングス	5,800	1,648.00	9,558,400	
サンヨーホームズ	400	1,064.00	425,600	
日本アクア	600	343.00	205,800	
ファーストコーポレーション	700	1,133.00	793,100	
ベステラ	400	1,575.00	630,000	
TATERU	1,800	1,688.00	3,038,400	
ダイセキ環境ソリューション	500	978.00	489,000	
第一カッター興業	300	2,394.00	718,200	
安藤・間	14,700	1,041.00	15,302,700	
東急建設	7,300	1,118.00	8,161,400	
コムシスホールディングス	6,700	2,806.00	18,800,200	
ミサワホーム	1,600	920.00	1,472,000	
高松コンストラクショングループ	1,200	3,265.00	3,918,000	
東建コーポレーション	700	8,700.00	6,090,000	
ソネック	300	890.00	267,000	
ヤマウラ	900	884.00	795,600	
大成建設	18,800	6,160.00	115,808,000	
大林組	56,600	1,126.00	63,731,600	
清水建設	57,800	1,172.00	67,741,600	

飛島建設	17,500	209.00	3,657,500
長谷工コーポレーション	22,000	1,490.00	32,780,000
松井建設	2,100	939.00	1,971,900
銭高組	300	5,360.00	1,608,000
鹿島建設	83,000	868.00	72,044,000
不動テトラ	14,900	208.00	3,099,200
大末建設	700	1,295.00	906,500
鉄建建設	1,100	3,000.00	3,300,000
西松建設	4,400	3,155.00	13,882,000
三井住友建設	13,700	833.00	11,412,100
大豊建設	7,000	671.00	4,697,000
前田建設工業	13,500	1,260.00	17,010,000
ナカノフドー建設	1,500	687.00	1,030,500
奥村組	3,100	3,450.00	10,695,000
東鉄工業	2,300	3,390.00	7,797,000
イチケン	400	2,531.00	1,012,400
浅沼組	7,000	403.00	2,821,000
戸田建設	22,000	952.00	20,944,000
熊谷組	3,000	3,890.00	11,670,000
青木あすなろ建設	1,200	997.00	1,196,400
北野建設	4,000	415.00	1,660,000
植木組	300	2,642.00	792,600
三井ホーム	3,000	664.00	1,992,000
矢作建設工業	2,600	888.00	2,308,800
ピーエス三菱	2,300	605.00	1,391,500
日本ハウスホールディングス	3,700	573.00	2,120,100
大東建託	6,700	18,475.00	123,782,500
新日本建設	2,300	1,285.00	2,955,500
N I P P O	4,400	2,039.00	8,971,600
東亜道路工業	400	3,685.00	1,474,000
前田道路	5,900	2,135.00	12,596,500
日本道路	500	6,020.00	3,010,000
東亜建設工業	1,500	2,617.00	3,925,500
若築建設	1,000	1,679.00	1,679,000
東洋建設	6,000	469.00	2,814,000
五洋建設	22,200	695.00	15,429,000
世紀東急工業	2,600	717.00	1,864,200
福田組	600	6,560.00	3,936,000
住友林業	12,100	1,746.00	21,126,600
日本基礎技術	2,200	391.00	860,200
日成ビルド工業	2,800	1,190.00	3,332,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	10,000	74.00	740,000

バコーポレーション	2,400	468.00	1,123,200
大和ハウス工業	55,700	3,937.00	219,290,900
ライト工業	3,700	1,237.00	4,576,900
積水ハウス	61,400	1,927.50	118,348,500
日特建設	1,700	679.00	1,154,300
北陸電気工事	1,100	1,086.00	1,194,600
ユアテック	2,700	896.00	2,419,200
西部電気工業	300	3,780.00	1,134,000
四電工	300	2,617.00	785,100
中電工	2,400	2,797.00	6,712,800
関電工	7,500	1,239.00	9,292,500
きんでん	12,600	1,825.00	22,995,000
東京エネシス	2,100	1,243.00	2,610,300
トーエネック	600	3,375.00	2,025,000
住友電設	1,500	2,001.00	3,001,500
日本電設工業	2,900	2,354.00	6,826,600
協和エクシオ	6,800	2,960.00	20,128,000
新日本空調	1,500	1,669.00	2,503,500
N D S	300	5,760.00	1,728,000
九電工	3,700	5,240.00	19,388,000
三機工業	4,000	1,124.00	4,496,000
日揮	16,300	2,046.00	33,349,800
中外炉工業	600	2,714.00	1,628,400
ヤマト	1,600	695.00	1,112,000
太平電業	1,300	2,844.00	3,697,200
高砂熱学工業	5,200	1,969.00	10,238,800
三晃金属工業	200	3,320.00	664,000
朝日工業社	400	3,495.00	1,398,000
明星工業	3,500	796.00	2,786,000
大気社	2,400	3,200.00	7,680,000
ダイダン	1,300	2,435.00	3,165,500
日比谷総合設備	2,100	2,138.00	4,489,800
東芝プラントシステム	4,100	2,550.00	10,455,000
東洋エンジニアリング	2,200	703.00	1,546,600
千代田化工建設	12,300	900.00	11,070,000
新興プランテック	3,600	1,052.00	3,787,200
日本製粉	5,600	1,923.00	10,768,800
日清製粉グループ本社	20,700	2,262.00	46,823,400
日東富士製粉	100	5,000.00	500,000
昭和産業	1,500	2,821.00	4,231,500
鳥越製粉	1,500	959.00	1,438,500
中部飼料	2,100	1,723.00	3,618,300

フィード・ワン	11,400	225.00	2,565,000
東洋精糖	300	1,226.00	367,800
日本甜菜製糖	1,000	2,392.00	2,392,000
三井製糖	1,300	3,435.00	4,465,500
塩水港精糖	2,100	258.00	541,800
日新製糖	800	2,087.00	1,669,600
森永製菓	4,000	4,960.00	19,840,000
中村屋	400	4,775.00	1,910,000
江崎グリコ	4,700	5,200.00	24,440,000
名糖産業	800	1,705.00	1,364,000
井村屋グループ	700	3,610.00	2,527,000
不二家	1,100	2,410.00	2,651,000
山崎製パン	13,800	2,862.00	39,495,600
第一屋製パン	300	1,123.00	336,900
モロゾフ	300	6,570.00	1,971,000
亀田製菓	1,000	5,880.00	5,880,000
寿スピリッツ	1,600	5,390.00	8,624,000
カルビー	7,700	4,115.00	31,685,500
森永乳業	3,400	3,830.00	13,022,000
六甲バター	1,100	2,477.00	2,724,700
ヤクルト本社	9,900	7,800.00	77,220,000
明治ホールディングス	11,200	9,300.00	104,160,000
雪印メグミルク	4,100	2,863.00	11,738,300
プリマハム	12,000	583.00	6,996,000
日本ハム	7,300	4,310.00	31,463,000
林兼産業	700	741.00	518,700
丸大食品	9,000	487.00	4,383,000
S Foods	1,200	4,305.00	5,166,000
伊藤ハム米久ホールディングス	10,800	921.00	9,946,800
サッポロホールディングス	6,200	2,726.00	16,901,200
アサヒグループホールディングス	35,400	5,729.00	202,806,600
キリンホールディングス	81,300	2,997.50	243,696,750
宝ホールディングス	12,700	1,361.00	17,284,700
オエノンホールディングス	4,900	446.00	2,185,400
養命酒製造	500	2,325.00	1,162,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	11,900	4,525.00	53,847,500
サントリー食品インターナショナル	12,900	4,765.00	61,468,500
ダイドーグループホールディングス	900	6,500.00	5,850,000
伊藤園	5,600	5,180.00	29,008,000
キーコーヒー	1,700	2,138.00	3,634,600
ユニカフェ	600	1,115.00	669,000
ジャパンフーズ	300	1,542.00	462,600

日清オイリオグループ	2,000	3,215.00	6,430,000
不二製油グループ本社	4,600	3,840.00	17,664,000
かどや製油	200	5,810.00	1,162,000
J・オイルミルズ	900	3,835.00	3,451,500
キッコーマン	12,200	5,500.00	67,100,000
味の素	38,900	2,142.00	83,323,800
キューピー	9,400	2,995.00	28,153,000
ハウス食品グループ本社	6,400	3,815.00	24,416,000
カゴメ	6,800	3,610.00	24,548,000
焼津水産化学工業	800	1,202.00	961,600
アリアケジャパン	1,600	9,610.00	15,376,000
ピエトロ	200	1,646.00	329,200
エバラ食品工業	400	2,290.00	916,000
ニチレイ	8,000	2,665.00	21,320,000
東洋水産	9,300	3,945.00	36,688,500
イトアンド	500	2,044.00	1,022,000
大冷	200	1,995.00	399,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	400	929.00	371,600
日清食品ホールディングス	6,600	7,710.00	50,886,000
永谷園ホールディングス	2,000	1,455.00	2,910,000
一正蒲鉾	700	1,293.00	905,100
フジッコ	1,800	2,768.00	4,982,400
ロック・フィールド	1,800	1,833.00	3,299,400
日本たばこ産業	104,600	3,035.00	317,461,000
ケンコーマヨネーズ	1,100	3,885.00	4,273,500
わらべや日洋ホールディングス	1,100	2,272.00	2,499,200
なとり	1,000	1,811.00	1,811,000
イフジ産業	300	762.00	228,600
ピクルスコーポレーション	400	2,143.00	857,200
北の達人コーポレーション	5,200	754.00	3,920,800
ユーグレナ	6,700	780.00	5,226,000
ミヨシ油脂	700	1,354.00	947,800
理研ビタミン	600	4,315.00	2,589,000
片倉工業	2,000	1,292.00	2,584,000
ゲンゼ	1,300	6,920.00	8,996,000
東洋紡	6,500	1,825.00	11,862,500
ユニチカ	5,200	623.00	3,239,600
富士紡ホールディングス	1,000	3,565.00	3,565,000
倉敷紡績	18,000	363.00	6,534,000
シキボウ	900	1,279.00	1,151,100
日本毛織	5,000	976.00	4,880,000
ダイトウボウ	3,700	96.00	355,200

トーア紡コーポレーション	800	554.00	443,200
ダイドーリミテッド	2,000	423.00	846,000
帝国繊維	1,900	2,272.00	4,316,800
帝人	14,500	2,043.00	29,623,500
東レ	128,000	879.60	112,588,800
サカイオーベックス	500	2,280.00	1,140,000
住江織物	500	2,769.00	1,384,500
日本フェルト	1,000	512.00	512,000
日東製網	200	1,774.00	354,800
アツギ	1,200	1,185.00	1,422,000
ダイニック	700	1,014.00	709,800
セーレン	4,100	1,790.00	7,339,000
ソトー	600	1,005.00	603,000
東海染工	300	1,433.00	429,900
小松精練	2,700	908.00	2,451,600
ワコールホールディングス	4,800	3,195.00	15,336,000
ホギメディカル	2,200	4,090.00	8,998,000
レナウン	5,000	135.00	675,000
クラウディアホールディングス	500	595.00	297,500
T S Iホールディングス	6,100	803.00	4,898,300
マツオカコーポレーション	400	3,050.00	1,220,000
三陽商会	1,000	2,136.00	2,136,000
ナイガイ	700	524.00	366,800
オンワードホールディングス	10,200	732.00	7,466,400
ルックホールディングス	600	1,382.00	829,200
キムラタン	9,600	36.00	345,600
ゴールドウイン	1,000	8,450.00	8,450,000
デサント	4,000	2,090.00	8,360,000
キング	900	503.00	452,700
ヤマトインターナショナル	1,100	585.00	643,500
特種東海製紙	1,000	4,245.00	4,245,000
王子ホールディングス	74,000	685.00	50,690,000
日本製紙	7,900	1,745.00	13,785,500
三菱製紙	2,600	620.00	1,612,000
北越コーポレーション	9,900	607.00	6,009,300
中越パルプ工業	700	1,654.00	1,157,800
巴川製紙所	3,000	258.00	774,000
大王製紙	7,100	1,556.00	11,047,600
阿波製紙	500	607.00	303,500
レンゴー	17,100	1,021.00	17,459,100
トーモク	1,000	2,023.00	2,023,000
ザ・パックス	1,200	3,300.00	3,960,000

クラレ	29,700	1,528.00	45,381,600
旭化成	110,000	1,455.00	160,050,000
共和レザー	1,000	974.00	974,000
昭和電工	11,800	5,330.00	62,894,000
住友化学	130,000	623.00	80,990,000
住友精化	700	5,400.00	3,780,000
日産化学	10,200	5,160.00	52,632,000
ラサ工業	600	2,736.00	1,641,600
クレハ	1,500	7,650.00	11,475,000
多木化学	200	4,605.00	921,000
テイカ	1,400	2,405.00	3,367,000
石原産業	3,200	1,401.00	4,483,200
片倉コープアグリ	400	1,166.00	466,400
日東エフシー	1,100	776.00	853,600
日本曹達	12,000	613.00	7,356,000
東ソー	25,500	1,721.00	43,885,500
トクヤマ	5,100	3,470.00	17,697,000
セントラル硝子	3,600	2,805.00	10,098,000
東亜合成	10,300	1,271.00	13,091,300
大阪ソーダ	1,700	3,270.00	5,559,000
関東電化工業	4,200	964.00	4,048,800
デンカ	6,500	3,715.00	24,147,500
信越化学工業	29,100	10,405.00	302,785,500
日本カーバイド工業	600	1,910.00	1,146,000
堺化学工業	1,200	3,190.00	3,828,000
エア・ウォーター	14,600	2,043.00	29,827,800
大陽日酸	13,600	1,866.00	25,377,600
日本化学工業	700	4,555.00	3,188,500
東邦アセチレン	300	1,505.00	451,500
日本パーカライズン	9,000	1,594.00	14,346,000
高压ガス工業	2,600	966.00	2,511,600
四国化成工業	2,500	1,571.00	3,927,500
戸田工業	300	2,858.00	857,400
ステラ ケミファ	900	3,625.00	3,262,500
保土谷化学工業	600	3,185.00	1,911,000
日本触媒	2,800	8,280.00	23,184,000
大日精化工業	1,400	3,500.00	4,900,000
カネカ	24,000	984.00	23,616,000
三菱瓦斯化学	14,600	2,524.00	36,850,400
三井化学	16,100	2,944.00	47,398,400
J S R	17,700	1,947.00	34,461,900
東京応化工業	3,100	4,065.00	12,601,500

大阪有機化学工業	1,500	1,405.00	2,107,500
三菱ケミカルホールディングス	118,200	953.50	112,703,700
KHネオケム	2,700	3,415.00	9,220,500
ダイセル	23,800	1,209.00	28,774,200
住友ベークライト	14,000	1,127.00	15,778,000
積水化学工業	36,100	1,956.00	70,611,600
日本ゼオン	14,900	1,437.00	21,411,300
アイカ工業	5,000	3,925.00	19,625,000
宇部興産	8,900	2,931.00	26,085,900
積水樹脂	2,700	2,174.00	5,869,800
タキロンシーアイ	3,600	575.00	2,070,000
旭有機材	1,100	2,152.00	2,367,200
日立化成	8,700	2,202.00	19,157,400
ニチバン	900	2,958.00	2,662,200
リケンテクノス	3,800	538.00	2,044,400
大倉工業	900	2,357.00	2,121,300
積水化成成品工業	2,200	1,104.00	2,428,800
群栄化学工業	400	3,420.00	1,368,000
タイガースポリマー	900	759.00	683,100
ミライアル	600	1,120.00	672,000
ダイキアクシス	600	1,206.00	723,600
ダイキョーニシカワ	3,500	1,563.00	5,470,500
竹本容器	300	3,015.00	904,500
森六ホールディングス	900	2,963.00	2,666,700
日本化薬	11,400	1,233.00	14,056,200
カーリットホールディングス	1,700	1,058.00	1,798,600
日本精化	1,500	1,287.00	1,930,500
扶桑化学工業	1,700	2,698.00	4,586,600
トリケミカル研究所	400	4,120.00	1,648,000
ADEKA	7,600	1,808.00	13,740,800
日油	6,800	3,685.00	25,058,000
新日本理化	3,000	226.00	678,000
ハリマ化成グループ	1,300	829.00	1,077,700
花王	41,400	8,414.00	348,339,600
第一工業製薬	3,000	735.00	2,205,000
石原ケミカル	400	2,245.00	898,000
日華化学	600	1,131.00	678,600
三洋化成工業	1,100	5,120.00	5,632,000
有機合成薬品工業	1,200	263.00	315,600
大日本塗料	2,000	1,357.00	2,714,000
日本ペイントホールディングス	13,600	4,685.00	63,716,000
関西ペイント	18,500	2,355.00	43,567,500



神東塗料	1,400	225.00	315,000
中国塗料	5,100	1,185.00	6,043,500
日本特殊塗料	1,100	2,240.00	2,464,000
藤倉化成	2,200	638.00	1,403,600
太陽ホールディングス	1,300	4,580.00	5,954,000
D I C	7,000	3,530.00	24,710,000
サカタインクス	3,600	1,530.00	5,508,000
東洋インキS Cホールディングス	3,500	3,010.00	10,535,000
T & K T O K A	1,200	1,222.00	1,466,400
富士フィルムホールディングス	35,000	4,394.00	153,790,000
資生堂	31,400	8,876.00	278,706,400
ライオン	23,500	2,021.00	47,493,500
高砂香料工業	1,100	3,605.00	3,965,500
マンダム	3,300	3,780.00	12,474,000
ミルボン	2,200	5,020.00	11,044,000
ファンケル	4,100	6,220.00	25,502,000
コーセー	2,800	24,340.00	68,152,000
コタ	800	1,460.00	1,168,000
シーズ・ホールディングス	2,000	5,220.00	10,440,000
シーボン	200	2,802.00	560,400
ポーラ・オルビスホールディングス	7,200	4,925.00	35,460,000
ノエビアホールディングス	1,100	8,070.00	8,877,000
アジュバンコスメジャパン	500	1,024.00	512,000
エステー	1,200	3,205.00	3,846,000
アグロ カネショウ	700	2,744.00	1,920,800
コニシ	2,800	1,756.00	4,916,800
長谷川香料	2,000	2,295.00	4,590,000
星光P M C	1,000	1,049.00	1,049,000
小林製薬	4,700	10,160.00	47,752,000
荒川化学工業	1,500	1,798.00	2,697,000
メック	1,200	2,214.00	2,656,800
日本高純度化学	400	2,372.00	948,800
タカラバイオ	4,400	2,331.00	10,256,400
J C U	2,000	2,912.00	5,824,000
新田ゼラチン	1,200	798.00	957,600
O A Tアグリオ	300	3,585.00	1,075,500
デクセリアルズ	4,400	1,113.00	4,897,200
アース製薬	1,300	5,770.00	7,501,000
北興化学工業	1,700	579.00	984,300
大成ラミック	500	3,140.00	1,570,000
クミアイ化学工業	7,700	890.00	6,853,000
日本農薬	4,100	689.00	2,824,900

アキレス	1,300	2,261.00	2,939,300
有沢製作所	2,800	1,156.00	3,236,800
日東電工	12,700	7,960.00	101,092,000
レック	1,000	5,160.00	5,160,000
きもと	3,000	290.00	870,000
藤森工業	1,400	3,660.00	5,124,000
前澤化成工業	1,200	1,223.00	1,467,600
ウェーブロックホールディングス	400	1,033.00	413,200
JSP	1,000	3,210.00	3,210,000
エフピコ	1,400	6,260.00	8,764,000
天馬	1,300	2,025.00	2,632,500
信越ポリマー	3,400	1,015.00	3,451,000
東リ	4,300	367.00	1,578,100
ニフコ	6,200	3,375.00	20,925,000
日本バルカー工業	1,400	3,050.00	4,270,000
ユニ・チャーム	35,700	3,627.00	129,483,900
協和発酵キリン	21,100	2,243.00	47,327,300
武田薬品工業	62,100	4,730.00	293,733,000
アステラス製薬	165,700	1,809.50	299,834,150
大日本住友製薬	12,500	2,436.00	30,450,000
塩野義製薬	23,700	5,688.00	134,805,600
田辺三菱製薬	20,500	1,939.00	39,749,500
わかもと製薬	2,100	295.00	619,500
あすか製薬	2,000	1,242.00	2,484,000
日本新薬	4,400	6,220.00	27,368,000
バイオフェルミン製薬	300	2,799.00	839,700
中外製薬	17,600	5,710.00	100,496,000
科研製薬	3,000	5,770.00	17,310,000
エーザイ	20,200	10,925.00	220,685,000
ロート製薬	9,300	3,470.00	32,271,000
小野薬品工業	39,800	2,618.50	104,216,300
久光製薬	5,000	8,400.00	42,000,000
持田製薬	1,200	8,080.00	9,696,000
参天製薬	31,900	1,872.00	59,716,800
扶桑薬品工業	600	2,827.00	1,696,200
日本ケミファ	200	4,455.00	891,000
ツムラ	6,000	3,565.00	21,390,000
日医工	4,400	1,610.00	7,084,000
キッセイ薬品工業	3,000	3,105.00	9,315,000
生化学工業	3,300	1,479.00	4,880,700
栄研化学	2,700	2,431.00	6,563,700
日水製薬	700	1,410.00	987,000

鳥居薬品	1,100	2,642.00	2,906,200
JCRファーマ	1,200	6,050.00	7,260,000
東和薬品	800	6,000.00	4,800,000
富士製薬工業	1,200	1,835.00	2,202,000
沢井製薬	3,400	5,250.00	17,850,000
ゼリア新薬工業	3,600	2,357.00	8,485,200
第一三共	48,200	4,577.00	220,611,400
キョーリン製薬ホールディングス	4,700	2,274.00	10,687,800
大幸薬品	900	2,066.00	1,859,400
ダイト	1,000	3,565.00	3,565,000
大塚ホールディングス	35,000	5,170.00	180,950,000
大正製薬ホールディングス	3,800	13,260.00	50,388,000
ペプチドリーム	7,700	4,335.00	33,379,500
日本コークス工業	14,400	116.00	1,670,400
昭和シェル石油	15,800	1,707.00	26,970,600
ニチレキ	2,200	1,184.00	2,604,800
ユシロ化学工業	900	1,613.00	1,451,700
ピーピー・カストロール	700	1,540.00	1,078,000
富士石油	4,200	367.00	1,541,400
MORESCO	600	1,639.00	983,400
出光興産	14,200	4,575.00	64,965,000
JXTGホールディングス	268,900	760.70	204,552,230
コスモエネルギーホールディングス	4,900	3,630.00	17,787,000
横浜ゴム	9,700	2,299.00	22,300,300
東洋ゴム工業	10,000	1,634.00	16,340,000
ブリヂストン	55,700	4,148.00	231,043,600
住友ゴム工業	17,300	1,747.00	30,223,100
藤倉ゴム工業	1,500	598.00	897,000
オカモト	6,000	1,248.00	7,488,000
フコク	700	956.00	669,200
ニッタ	1,700	4,360.00	7,412,000
住友理工	3,300	1,152.00	3,801,600
三ツ星ベルト	4,000	1,404.00	5,616,000
バンドー化学	3,200	1,193.00	3,817,600
日東紡績	2,500	2,664.00	6,660,000
AGC	17,000	4,400.00	74,800,000
日本板硝子	8,300	1,101.00	9,138,300
石塚硝子	200	2,160.00	432,000
日本山村硝子	7,000	187.00	1,309,000
日本電気硝子	7,300	3,115.00	22,739,500
オハラ	700	2,872.00	2,010,400
住友大阪セメント	33,000	550.00	18,150,000

太平洋セメント	10,700	3,540.00	37,878,000
日本ヒューム	1,800	894.00	1,609,200
日本コンクリート工業	3,800	326.00	1,238,800
三谷セキサン	900	2,686.00	2,417,400
アジアパイルホールディングス	2,200	792.00	1,742,400
東海カーボン	15,300	2,144.00	32,803,200
日本カーボン	900	6,170.00	5,553,000
東洋炭素	1,100	3,075.00	3,382,500
ノリタケカンパニーリミテド	900	5,780.00	5,202,000
TOTO	13,000	5,270.00	68,510,000
日本碍子	20,500	1,962.00	40,221,000
日本特殊陶業	14,400	3,100.00	44,640,000
ダントーホールディングス	1,800	129.00	232,200
MARUWA	600	8,900.00	5,340,000
品川リフラクトリーズ	400	3,745.00	1,498,000
黒崎播磨	300	7,070.00	2,121,000
ヨータイ	1,400	687.00	961,800
イソライト工業	900	644.00	579,600
東京窯業	2,200	383.00	842,600
ニッカトー	800	1,510.00	1,208,000
フジミインコーポレーテッド	1,500	2,516.00	3,774,000
クニミネ工業	500	1,055.00	527,500
エーアンドエーマテリアル	400	1,143.00	457,200
ニチアス	9,000	1,312.00	11,808,000
ニチハ	2,500	3,890.00	9,725,000
新日鐵住金	74,600	2,145.50	160,054,300
神戸製鋼所	30,500	1,022.00	31,171,000
合同製鐵	900	2,225.00	2,002,500
ジェイ エフ イー ホールディングス	45,000	2,139.50	96,277,500
日新製鋼	4,600	1,518.00	6,982,800
東京製鐵	9,000	979.00	8,811,000
共英製鋼	1,900	1,977.00	3,756,300
大和工業	3,500	3,375.00	11,812,500
東京鐵鋼	700	1,583.00	1,108,100
大阪製鐵	1,100	1,968.00	2,164,800
淀川製鋼所	2,400	2,812.00	6,748,800
丸一鋼管	5,900	3,745.00	22,095,500
モリ工業	600	3,120.00	1,872,000
大同特殊鋼	3,000	5,010.00	15,030,000
日本高周波鋼業	700	783.00	548,100
日本冶金工業	13,900	310.00	4,309,000
山陽特殊製鋼	1,900	2,821.00	5,359,900

愛知製鋼	900	4,150.00	3,735,000
日立金属	17,900	1,125.00	20,137,500
日本金属	500	1,891.00	945,500
大太平洋金属	1,000	3,310.00	3,310,000
新日本電工	10,100	304.00	3,070,400
栗本鐵工所	900	2,056.00	1,850,400
虹技	300	1,826.00	547,800
日本鑄鉄管	2,000	158.00	316,000
三菱製鋼	1,200	2,208.00	2,649,600
日亜鋼業	2,500	344.00	860,000
日本精線	300	4,115.00	1,234,500
シンニッタン	2,600	431.00	1,120,600
新家工業	400	1,969.00	787,600
大紀アルミニウム工業所	2,800	664.00	1,859,200
日本軽金属ホールディングス	48,800	243.00	11,858,400
三井金属鉱業	4,500	4,250.00	19,125,000
東邦亜鉛	900	3,780.00	3,402,000
三菱マテリアル	11,000	2,957.00	32,527,000
住友金属鉱山	21,300	3,963.00	84,411,900
D O W Aホールディングス	4,200	3,370.00	14,154,000
古河機械金属	2,800	1,607.00	4,499,600
エス・サイエンス	8,500	70.00	595,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,800	1,541.00	2,773,800
東邦チタニウム	3,000	1,026.00	3,078,000
U A C J	2,500	2,371.00	5,927,500
C Kサンエツ	300	3,415.00	1,024,500
古河電気工業	5,500	3,710.00	20,405,000
住友電気工業	62,300	1,657.50	103,262,250
フジクラ	20,200	688.00	13,897,600
昭和電線ホールディングス	2,200	677.00	1,489,400
タツタ電線	3,300	559.00	1,844,700
カナレ電気	300	2,115.00	634,500
平河ヒューテック	800	1,323.00	1,058,400
リョービ	2,000	3,490.00	6,980,000
アーレスティ	2,100	957.00	2,009,700
アサヒホールディングス	2,900	2,055.00	5,959,500
稲葉製作所	1,000	1,445.00	1,445,000
宮地エンジニアリンググループ	500	1,978.00	989,000
トーカロ	4,600	1,189.00	5,469,400
アルファC o	600	1,528.00	916,800
S U M C O	15,400	2,327.00	35,835,800
川田テクノロジーズ	400	6,840.00	2,736,000

RS Technologies	300	6,160.00	1,848,000
東洋製罐グループホールディングス	11,400	2,028.00	23,119,200
ホッカンホールディングス	4,000	363.00	1,452,000
コロナ	900	1,246.00	1,121,400
横河ブリッジホールディングス	3,100	2,560.00	7,936,000
駒井ハルテック	400	2,322.00	928,800
高田機工	200	3,385.00	677,000
三和ホールディングス	16,000	1,185.00	18,960,000
文化シャッター	4,900	906.00	4,439,400
三協立山	2,300	1,476.00	3,394,800
アルインコ	1,200	1,053.00	1,263,600
東洋シャッター	500	638.00	319,000
LIXILグループ	24,600	2,327.00	57,244,200
日本フィルコン	1,300	549.00	713,700
ノーリツ	3,700	1,780.00	6,586,000
長府製作所	1,900	2,396.00	4,552,400
リンナイ	3,000	9,670.00	29,010,000
ダイニチ工業	1,000	798.00	798,000
日東精工	2,300	691.00	1,589,300
三洋工業	200	2,194.00	438,800
岡部	3,400	955.00	3,247,000
ジーテクト	1,800	1,871.00	3,367,800
中国工業	300	649.00	194,700
東プレ	3,100	2,746.00	8,512,600
高周波熱錬	3,200	984.00	3,148,800
東京製綱	1,200	1,679.00	2,014,800
サンコール	900	682.00	613,800
モリテック スチール	1,300	526.00	683,800
パイオラックス	2,500	2,566.00	6,415,000
エイチワン	1,700	1,192.00	2,026,400
日本発條	16,600	1,086.00	18,027,600
中央発條	200	3,740.00	748,000
アドバネクス	300	2,139.00	641,700
立川ブラインド工業	700	1,383.00	968,100
三益半導体工業	1,300	1,854.00	2,410,200
日本ドライケミカル	200	2,325.00	465,000
日本製綱所	5,300	2,738.00	14,511,400
三浦工業	7,200	2,759.00	19,864,800
タクマ	5,600	1,342.00	7,515,200
ツガミ	4,000	953.00	3,812,000
オークマ	1,900	5,800.00	11,020,000
東芝機械	9,000	521.00	4,689,000

アマダホールディングス	25,700	1,060.00	27,242,000
アイダエンジニアリング	4,300	1,051.00	4,519,300
滝澤鉄工所	500	1,727.00	863,500
F U J I	5,000	1,946.00	9,730,000
牧野フライス製作所	9,000	844.00	7,596,000
オーエスジー	7,700	2,381.00	18,333,700
ダイジェット工業	200	1,785.00	357,000
旭ダイヤモンド工業	5,000	788.00	3,940,000
D M G 森精機	9,200	1,534.00	14,112,800
ソディック	3,700	981.00	3,629,700
ディスコ	2,300	19,740.00	45,402,000
日東工器	1,000	2,639.00	2,639,000
日進工具	500	2,954.00	1,477,000
パンチ工業	1,400	1,002.00	1,402,800
富士ダイス	800	847.00	677,600
豊和工業	1,000	895.00	895,000
O K K	700	1,105.00	773,500
東洋機械金属	1,300	693.00	900,900
津田駒工業	400	1,868.00	747,200
島精機製作所	2,100	6,130.00	12,873,000
オプトラン	1,600	3,975.00	6,360,000
N C ホールディングス	600	722.00	433,200
フリー	1,200	939.00	1,126,800
ヤマシンフィルタ	2,600	1,066.00	2,771,600
日阪製作所	2,400	1,054.00	2,529,600
やまびこ	3,300	1,368.00	4,514,400
平田機工	600	7,080.00	4,248,000
ペガサスミシン製造	1,600	967.00	1,547,200
ナブテスコ	9,200	3,190.00	29,348,000
三井海洋開発	1,800	2,883.00	5,189,400
レオン自動機	1,500	1,801.00	2,701,500
S M C	5,300	35,820.00	189,846,000
新川	1,400	831.00	1,163,400
ホソカワミクロン	600	6,710.00	4,026,000
ユニオンツール	800	3,710.00	2,968,000
オイレス工業	2,200	2,140.00	4,708,000
日精エー・エス・ビー機械	500	5,850.00	2,925,000
サトーホールディングス	2,200	3,295.00	7,249,000
技研製作所	1,100	2,454.00	2,699,400
日本エアータック	600	811.00	486,600
カワタ	300	1,734.00	520,200
日精樹脂工業	1,400	1,243.00	1,740,200

オカダアイヨン	600	1,558.00	934,800
ワイエイシイホールディングス	600	868.00	520,800
小松製作所	81,400	3,147.00	256,165,800
住友重機械工業	9,600	3,735.00	35,856,000
日立建機	7,900	3,555.00	28,084,500
日工	400	2,507.00	1,002,800
巴工業	700	2,368.00	1,657,600
井関農機	1,700	1,929.00	3,279,300
TOWA	1,300	1,080.00	1,404,000
丸山製作所	400	1,728.00	691,200
北川鉄工所	800	2,546.00	2,036,800
ローツェ	800	2,310.00	1,848,000
タカキタ	600	675.00	405,000
クボタ	90,300	1,802.50	162,765,750
荏原実業	500	2,214.00	1,107,000
三菱化工機	600	1,996.00	1,197,600
月島機械	3,300	1,528.00	5,042,400
帝国電機製作所	1,200	1,335.00	1,602,000
新東工業	4,000	999.00	3,996,000
澁谷工業	1,500	3,405.00	5,107,500
アイチ コーポレーション	2,900	668.00	1,937,200
小森コーポレーション	4,200	1,304.00	5,476,800
鶴見製作所	1,400	1,917.00	2,683,800
住友精密工業	3,000	352.00	1,056,000
酒井重工業	300	3,415.00	1,024,500
荏原製作所	6,900	3,435.00	23,701,500
石井鐵工所	300	1,931.00	579,300
西島製作所	1,700	997.00	1,694,900
北越工業	1,900	998.00	1,896,200
ダイキン工業	23,000	13,015.00	299,345,000
オルガノ	600	2,958.00	1,774,800
トーヨーカネツ	700	4,020.00	2,814,000
栗田工業	9,100	3,165.00	28,801,500
椿本チエイン	10,000	922.00	9,220,000
大同工業	600	1,226.00	735,600
木村化工機	1,500	433.00	649,500
アネスト岩田	2,900	1,120.00	3,248,000
ダイフク	8,600	4,485.00	38,571,000
サムコ	500	1,275.00	637,500
加藤製作所	800	2,812.00	2,249,600
油研工業	300	2,427.00	728,100
タダノ	8,200	1,365.00	11,193,000



フジテック	5,300	1,452.00	7,695,600
C K D	4,700	1,641.00	7,712,700
キトー	1,300	2,060.00	2,678,000
平和	5,200	2,662.00	13,842,400
理想科学工業	1,700	2,320.00	3,944,000
S A N K Y O	4,200	4,415.00	18,543,000
日本金銭機械	1,600	1,187.00	1,899,200
マースエンジニアリング	1,100	2,443.00	2,687,300
福島工業	1,000	5,120.00	5,120,000
オーイズミ	800	549.00	439,200
ダイコク電機	800	1,782.00	1,425,600
竹内製作所	2,800	2,601.00	7,282,800
アマノ	5,200	2,581.00	13,421,200
J U K I	2,500	1,090.00	2,725,000
サンデンホールディングス	2,100	1,326.00	2,784,600
蛇の目マシン工業	1,600	695.00	1,112,000
マックス	2,600	1,355.00	3,523,000
グローリー	5,000	3,150.00	15,750,000
新晃工業	1,700	1,838.00	3,124,600
大和冷機工業	2,700	1,242.00	3,353,400
セガサミーホールディングス	16,700	1,918.00	32,030,600
日本ピストンリング	600	2,163.00	1,297,800
リケン	800	5,610.00	4,488,000
T P R	1,900	2,699.00	5,128,100
ツバキ・ナカシマ	1,700	2,584.00	4,392,800
ホシザキ	5,300	11,310.00	59,943,000
大豊工業	1,400	1,194.00	1,671,600
日本精工	34,600	1,157.00	40,032,200
N T N	39,100	459.00	17,946,900
ジェイテクト	18,000	1,510.00	27,180,000
不二越	1,600	4,805.00	7,688,000
日本トムソン	5,400	807.00	4,357,800
T H K	10,500	2,969.00	31,174,500
ユーシン精機	1,500	1,178.00	1,767,000
前澤給装工業	700	2,034.00	1,423,800
イーグル工業	2,100	1,779.00	3,735,900
前澤工業	1,300	480.00	624,000
日本ピラー工業	1,700	1,441.00	2,449,700
キッツ	6,800	886.00	6,024,800
マキタ	22,000	5,080.00	111,760,000
日立造船	13,400	514.00	6,887,600
三菱重工業	28,200	4,093.00	115,422,600

I H I	13,000	3,875.00	50,375,000
スター精密	2,700	1,896.00	5,119,200
日清紡ホールディングス	10,300	1,196.00	12,318,800
イビデン	10,300	1,756.00	18,086,800
コニカミノルタ	39,500	974.00	38,473,000
ブラザー工業	20,600	2,177.00	44,846,200
ミネベアミツミ	31,000	1,894.00	58,714,000
日立製作所	404,000	792.60	320,210,400
三菱電機	168,500	1,413.50	238,174,750
富士電機	51,000	795.00	40,545,000
東洋電機製造	700	1,623.00	1,136,100
安川電機	19,400	3,605.00	69,937,000
シンフォニアテクノロジー	11,000	378.00	4,158,000
明電舎	14,000	396.00	5,544,000
オリジン電気	500	2,174.00	1,087,000
山洋電気	800	7,160.00	5,728,000
デンヨー	1,600	1,652.00	2,643,200
東芝テック	12,000	667.00	8,004,000
芝浦メカトロニクス	3,000	366.00	1,098,000
マブチモーター	4,600	5,250.00	24,150,000
日本電産	20,300	16,895.00	342,968,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	700	2,474.00	1,731,800
トレックス・セミコンダクター	500	1,435.00	717,500
東光高岳	900	1,896.00	1,706,400
ダブル・スコープ	2,500	1,421.00	3,552,500
ダイヘン	9,000	666.00	5,994,000
ヤーマン	2,500	1,795.00	4,487,500
JVCケンウッド	12,500	312.00	3,900,000
ミマキエンジニアリング	1,500	856.00	1,284,000
第一精工	800	1,722.00	1,377,600
日新電機	3,900	957.00	3,732,300
大崎電気工業	3,600	837.00	3,013,200
オムロン	17,900	5,020.00	89,858,000
日東工業	2,700	2,081.00	5,618,700
I D E C	2,100	2,224.00	4,670,400
不二電機工業	200	1,415.00	283,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	30,000	503.00	15,090,000
サクサホールディングス	400	2,305.00	922,000
メルコホールディングス	800	4,155.00	3,324,000
テクノメディカ	400	1,997.00	798,800
日本電気	21,800	3,015.00	65,727,000
富士通	173,000	743.00	128,539,000

沖電気工業	6,800	1,258.00	8,554,400
岩崎通信機	700	815.00	570,500
電気興業	1,000	3,235.00	3,235,000
サンケン電気	10,000	605.00	6,050,000
ナカヨ	300	1,709.00	512,700
アイホン	1,000	1,683.00	1,683,000
ルネサスエレクトロニクス	8,700	1,030.00	8,961,000
セイコーエプソン	25,100	1,957.00	49,120,700
ワコム	13,100	585.00	7,663,500
アルバック	3,900	4,250.00	16,575,000
アクセル	800	823.00	658,400
E I Z O	1,500	5,080.00	7,620,000
ジャパンディスプレイ	35,000	133.00	4,655,000
日本信号	4,700	1,068.00	5,019,600
京三製作所	4,000	709.00	2,836,000
能美防災	2,200	2,266.00	4,985,200
ホーチキ	1,200	2,118.00	2,541,600
星和電機	600	528.00	316,800
エレコム	1,500	2,634.00	3,951,000
パナソニック	192,500	1,443.00	277,777,500
シャープ	15,700	2,764.00	43,394,800
アンリツ	12,300	1,507.00	18,536,100
富士通ゼネラル	5,100	1,781.00	9,083,100
ソニー	112,800	6,006.00	677,476,800
T D K	8,800	11,560.00	101,728,000
帝国通信工業	700	1,246.00	872,200
タムラ製作所	6,500	710.00	4,615,000
アルプス電気	14,500	3,065.00	44,442,500
池上通信機	6,000	148.00	888,000
パイオニア	28,500	150.00	4,275,000
日本電波工業	1,600	510.00	816,000
鈴木	900	888.00	799,200
日本トリム	400	4,905.00	1,962,000
ローランド ディー . ジー .	900	2,344.00	2,109,600
フォスター電機	2,000	1,556.00	3,112,000
クラリオン	9,000	309.00	2,781,000
S M K	4,000	361.00	1,444,000
ヨコオ	1,100	1,848.00	2,032,800
ホシデン	4,300	923.00	3,968,900
ヒロセ電機	2,800	13,690.00	38,332,000
日本航空電子工業	4,000	1,808.00	7,232,000
T O A	1,800	1,182.00	2,127,600

マクセルホールディングス	3,400	1,813.00	6,164,200
古野電気	2,000	1,114.00	2,228,000
ユニデンホールディングス	5,000	313.00	1,565,000
アルパイン	4,000	2,536.00	10,144,000
スミダコーポレーション	1,700	1,218.00	2,070,600
アイコム	900	2,675.00	2,407,500
リオン	700	2,479.00	1,735,300
本多通信工業	1,300	917.00	1,192,100
船井電機	1,800	642.00	1,155,600
横河電機	16,900	1,965.00	33,208,500
新電元工業	600	5,220.00	3,132,000
アズビル	5,000	4,860.00	24,300,000
東亜ディーケーケー	800	1,046.00	836,800
日本光電工業	7,000	3,220.00	22,540,000
チノー	600	1,562.00	937,200
共和電業	1,900	407.00	773,300
日本電子材料	700	752.00	526,400
堀場製作所	3,300	7,420.00	24,486,000
アドバンテスト	9,400	2,406.00	22,616,400
小野測器	800	789.00	631,200
エスベック	1,500	2,241.00	3,361,500
キーエンス	8,300	59,670.00	495,261,000
日置電機	900	4,625.00	4,162,500
シスメックス	13,100	10,710.00	140,301,000
日本マイクロニクス	2,700	976.00	2,635,200
メガチップス	1,300	2,761.00	3,589,300
O B A R A G R O U P	1,000	5,970.00	5,970,000
澤藤電機	200	2,128.00	425,600
コーセル	2,300	1,345.00	3,093,500
イリソ電子工業	1,400	6,710.00	9,394,000
新日本無線	1,100	774.00	851,400
オブテックスグループ	3,000	3,225.00	9,675,000
千代田インテグレ	800	2,410.00	1,928,000
アイ・オー・データ機器	700	1,183.00	828,100
レーザーテック	3,500	3,080.00	10,780,000
スタンレー電気	12,800	3,705.00	47,424,000
岩崎電気	700	1,552.00	1,086,400
ウシオ電機	10,200	1,424.00	14,524,800
岡谷電機産業	1,200	501.00	601,200
ヘリオス テクノ ホールディング	1,400	709.00	992,600
日本セラミック	1,700	2,865.00	4,870,500
遠藤照明	900	837.00	753,300

古河電池	1,200	869.00	1,042,800
双信電機	800	489.00	391,200
山一電機	1,200	1,409.00	1,690,800
図研	1,100	1,660.00	1,826,000
日本電子	6,000	1,127.00	6,762,000
カシオ計算機	13,600	1,859.00	25,282,400
ファナック	16,000	21,170.00	338,720,000
日本シイエムケイ	3,000	706.00	2,118,000
エンプラス	800	3,180.00	2,544,000
大真空	600	1,223.00	733,800
ローム	7,600	9,680.00	73,568,000
浜松ホトニクス	12,100	5,000.00	60,500,000
三井ハイテック	2,200	1,437.00	3,161,400
新光電気工業	6,400	1,076.00	6,886,400
京セラ	27,600	6,277.00	173,245,200
太陽誘電	7,600	3,350.00	25,460,000
村田製作所	17,700	19,555.00	346,123,500
ユーシン	2,500	734.00	1,835,000
双葉電子工業	2,700	1,985.00	5,359,500
北陸電気工業	700	1,205.00	843,500
ニチコン	5,300	1,383.00	7,329,900
日本ケミコン	1,400	4,225.00	5,915,000
K O A	2,300	2,804.00	6,449,200
市光工業	2,500	1,419.00	3,547,500
小糸製作所	10,100	7,300.00	73,730,000
ミツバ	3,100	875.00	2,712,500
S C R E E Nホールディングス	3,200	7,900.00	25,280,000
キャノン電子	1,500	2,246.00	3,369,000
キャノン	90,700	3,577.00	324,433,900
リコー	50,700	1,031.00	52,271,700
象印マホービン	3,200	1,395.00	4,464,000
M U T O Hホールディングス	200	2,325.00	465,000
東京エレクトロン	11,200	18,855.00	211,176,000
トヨタ紡織	4,900	2,091.00	10,245,900
芦森工業	400	2,285.00	914,000
ユニプレス	3,300	2,183.00	7,203,900
豊田自動織機	13,600	6,040.00	82,144,000
モリタホールディングス	2,700	2,171.00	5,861,700
三櫻工業	2,100	686.00	1,440,600
デンソー	37,400	5,430.00	203,082,000
東海理化電機製作所	4,400	2,057.00	9,050,800
三井E & Sホールディングス	6,100	1,457.00	8,887,700

川崎重工業	13,100	3,215.00	42,116,500	
名村造船所	5,100	487.00	2,483,700	
サノヤホールディングス	2,300	220.00	506,000	
日本車輛製造	6,000	269.00	1,614,000	
三菱ロジスネクスト	2,000	1,199.00	2,398,000	
近畿車輛	300	2,317.00	695,100	
日産自動車	198,500	1,037.00	205,844,500	
いすゞ自動車	48,800	1,464.00	71,443,200	
トヨタ自動車	204,800	7,373.00	1,509,990,400	代用有価証券 23,000株
日野自動車	24,000	1,206.00	28,944,000	
三菱自動車工業	62,400	895.00	55,848,000	
エフテック	1,100	1,303.00	1,433,300	
レシップホールディングス	600	822.00	493,200	
G M B	300	1,333.00	399,900	
ファルテック	300	1,139.00	341,700	
武蔵精密工業	1,800	3,620.00	6,516,000	
日産車体	6,600	988.00	6,520,800	
新明和工業	7,300	1,312.00	9,577,600	
極東開発工業	3,100	1,808.00	5,604,800	
日信工業	3,400	1,924.00	6,541,600	
トピー工業	1,400	2,867.00	4,013,800	
ティラド	600	3,210.00	1,926,000	
曙ブレーキ工業	8,100	248.00	2,008,800	
タチエス	2,900	1,892.00	5,486,800	
N O K	9,000	2,115.00	19,035,000	
フタバ産業	5,200	702.00	3,650,400	
K Y B	1,700	4,955.00	8,423,500	
大同メタル工業	2,100	1,101.00	2,312,100	
プレス工業	9,000	674.00	6,066,000	
ミクニ	2,200	579.00	1,273,800	
太平洋工業	3,500	1,663.00	5,820,500	
ケーヒン	3,900	2,189.00	8,537,100	
河西工業	2,100	1,353.00	2,841,300	
アイシン精機	13,900	5,120.00	71,168,000	
マツダ	52,900	1,349.50	71,388,550	
今仙電機製作所	1,600	1,129.00	1,806,400	
本田技研工業	151,600	3,323.00	503,766,800	
スズキ	33,400	6,504.00	217,233,600	
S U B A R U	52,300	3,179.00	166,261,700	
安永	800	1,644.00	1,315,200	
ヤマハ発動機	23,800	2,931.00	69,757,800	
ショーワ	4,400	1,877.00	8,258,800	

T B K	2,000	487.00	974,000
エクセディ	2,000	3,490.00	6,980,000
豊田合成	6,100	2,676.00	16,323,600
愛三工業	3,000	927.00	2,781,000
盟和産業	300	1,262.00	378,600
日本プラスト	900	991.00	891,900
ヨロズ	1,700	1,678.00	2,852,600
エフ・シー・シー	2,800	3,165.00	8,862,000
シマノ	6,800	16,230.00	110,364,000
テイ・エス テック	3,900	4,580.00	17,862,000
ジャムコ	900	2,389.00	2,150,100
テルモ	25,800	6,360.00	164,088,000
クリエートメディック	600	1,377.00	826,200
日機装	5,800	1,113.00	6,455,400
島津製作所	20,100	3,360.00	67,536,000
J M S	1,500	684.00	1,026,000
長野計器	1,300	1,221.00	1,587,300
ブイ・テクノロジー	400	19,890.00	7,956,000
東京計器	1,100	1,136.00	1,249,600
愛知時計電機	200	4,210.00	842,000
インターアクション	900	1,258.00	1,132,200
オーバル	1,800	301.00	541,800
東京精密	3,000	3,665.00	10,995,000
マニー	2,100	5,170.00	10,857,000
ニコン	29,400	1,849.00	54,360,600
トプコン	9,100	1,824.00	16,598,400
オリンパス	25,100	4,410.00	110,691,000
理研計器	1,600	2,354.00	3,766,400
タムロン	1,400	2,001.00	2,801,400
H O Y A	33,900	6,437.00	218,214,300
シード	700	2,141.00	1,498,700
ノーリツ鋼機	1,700	1,972.00	3,352,400
エー・アンド・デイ	1,600	965.00	1,544,000
シチズン時計	20,100	705.00	14,170,500
リズム時計工業	600	2,019.00	1,211,400
大研医器	1,500	781.00	1,171,500
メニコン	2,300	3,010.00	6,923,000
シンシア	200	649.00	129,800
松風	800	1,360.00	1,088,000
セイコーホールディングス	2,600	2,371.00	6,164,600
ニプロ	11,700	1,335.00	15,619,500
中本パックス	400	1,883.00	753,200

スノーピーク	500	1,517.00	758,500
パラマウントベッドホールディングス	1,800	4,780.00	8,604,000
トランザクション	900	921.00	828,900
S H O - B I	600	422.00	253,200
ニホンフラッシュ	800	2,541.00	2,032,800
前田工織	1,800	1,985.00	3,573,000
永大産業	2,200	518.00	1,139,600
アートネイチャー	1,800	699.00	1,258,200
バンダイナムコホールディングス	17,400	4,525.00	78,735,000
アイフィスジャパン	400	716.00	286,400
共立印刷	2,700	369.00	996,300
S H O E I	800	4,025.00	3,220,000
フランスベッドホールディングス	2,100	952.00	1,999,200
パイロットコーポレーション	2,900	6,180.00	17,922,000
萩原工業	900	1,970.00	1,773,000
トッパン・フォームズ	3,600	1,139.00	4,100,400
フジシールインターナショナル	3,800	4,145.00	15,751,000
タカラトミー	7,100	867.00	6,155,700
廣濟堂	1,600	522.00	835,200
A s - m e エステール	600	798.00	478,800
アーク	8,900	112.00	996,800
タカノ	800	1,026.00	820,800
プロネクサス	1,600	1,275.00	2,040,000
ホクシン	1,500	172.00	258,000
ウッドワン	600	1,358.00	814,800
大建工業	1,300	2,332.00	3,031,600
凸版印刷	47,000	835.00	39,245,000
大日本印刷	22,000	2,373.00	52,206,000
図書印刷	1,100	980.00	1,078,000
共同印刷	500	2,791.00	1,395,500
N I S S H A	3,500	2,220.00	7,770,000
光村印刷	200	2,244.00	448,800
宝印刷	900	1,920.00	1,728,000
アシックス	16,800	1,845.00	30,996,000
ツツミ	600	1,906.00	1,143,600
小松ウオール工業	600	2,147.00	1,288,200
ヤマハ	11,400	5,410.00	61,674,000
河合楽器製作所	600	4,855.00	2,913,000
クリナップ	1,600	800.00	1,280,000
ピジョン	10,200	6,010.00	61,302,000
兼松サステック	100	1,971.00	197,100
キングジム	1,400	1,012.00	1,416,800



リンテック	4,000	3,235.00	12,940,000
イトーキ	3,600	634.00	2,282,400
任天堂	10,400	37,390.00	388,856,000
三菱鉛筆	2,800	2,295.00	6,426,000
タカラスタANDARD	3,500	1,904.00	6,664,000
コクヨ	8,100	1,937.00	15,689,700
ナカバヤシ	1,700	646.00	1,098,200
オカムラ	5,900	1,635.00	9,646,500
美津濃	1,700	3,705.00	6,298,500
東京電力ホールディングス	134,600	516.00	69,453,600
中部電力	51,500	1,712.00	88,168,000
関西電力	68,800	1,621.00	111,524,800
中国電力	23,300	1,460.00	34,018,000
北陸電力	16,500	1,120.00	18,480,000
東北電力	39,400	1,370.00	53,978,000
四国電力	15,200	1,489.00	22,632,800
九州電力	37,200	1,261.00	46,909,200
北海道電力	16,900	702.00	11,863,800
沖縄電力	3,400	2,362.00	8,030,800
電源開発	13,400	2,948.00	39,503,200
エフオン	900	1,268.00	1,141,200
イーレックス	2,700	1,150.00	3,105,000
レノバ	900	1,699.00	1,529,100
東京瓦斯	36,000	2,949.50	106,182,000
大阪瓦斯	32,700	2,271.00	74,261,700
東邦瓦斯	8,300	4,120.00	34,196,000
北海道瓦斯	5,000	309.00	1,545,000
広島ガス	3,500	376.00	1,316,000
西部瓦斯	2,000	2,806.00	5,612,000
静岡ガス	4,800	1,096.00	5,260,800
メタウォーター	900	3,085.00	2,776,500
SBSホールディングス	1,700	1,303.00	2,215,100
東武鉄道	17,800	3,285.00	58,473,000
相鉄ホールディングス	5,400	3,435.00	18,549,000
東京急行電鉄	45,800	1,880.00	86,104,000
京浜急行電鉄	23,100	1,750.00	40,425,000
小田急電鉄	25,100	2,316.00	58,131,600
京王電鉄	9,400	5,420.00	50,948,000
京成電鉄	11,800	3,735.00	44,073,000
富士急行	2,300	3,230.00	7,429,000
東日本旅客鉄道	30,300	10,345.00	313,453,500
西日本旅客鉄道	15,200	8,029.00	122,040,800

東海旅客鉄道	15,100	22,885.00	345,563,500
西武ホールディングス	21,500	1,831.00	39,366,500
鴻池運輸	2,400	1,696.00	4,070,400
西日本鉄道	4,700	2,918.00	13,714,600
ハマキョウレックス	1,200	3,140.00	3,768,000
サカイ引越センター	900	5,730.00	5,157,000
近鉄グループホールディングス	16,000	4,415.00	70,640,000
阪急阪神ホールディングス	21,300	4,345.00	92,548,500
南海電気鉄道	7,600	3,025.00	22,990,000
京阪ホールディングス	7,100	4,005.00	28,435,500
神戸電鉄	400	4,005.00	1,602,000
名古屋鉄道	12,700	2,793.00	35,471,100
山陽電気鉄道	1,200	2,651.00	3,181,200
日本通運	6,300	7,510.00	47,313,000
ヤマトホールディングス	28,000	3,284.00	91,952,000
山九	4,100	5,670.00	23,247,000
丸運	900	346.00	311,400
丸全昭和運輸	6,000	502.00	3,012,000
センコーグループホールディングス	9,600	851.00	8,169,600
トナミホールディングス	400	5,990.00	2,396,000
ニッコンホールディングス	6,100	2,885.00	17,598,500
日本石油輸送	200	3,130.00	626,000
福山通運	2,300	5,690.00	13,087,000
セイノーホールディングス	11,900	1,912.00	22,752,800
エスライン	500	1,110.00	555,000
神奈川中央交通	400	3,755.00	1,502,000
日立物流	3,500	2,822.00	9,877,000
丸和運輸機関	800	3,750.00	3,000,000
C & F ロジホールディングス	1,700	1,318.00	2,240,600
九州旅客鉄道	13,400	3,370.00	45,158,000
S Gホールディングス	15,100	2,373.00	35,832,300
日本郵船	13,400	2,138.00	28,649,200
商船三井	10,100	2,662.00	26,886,200
川崎汽船	7,400	1,921.00	14,215,400
N S ユナイテッド海運	800	2,113.00	1,690,400
明治海運	1,700	396.00	673,200
飯野海運	8,200	505.00	4,141,000
共栄タンカー	100	1,782.00	178,200
乾汽船	1,200	1,050.00	1,260,000
日本航空	29,200	4,037.00	117,880,400
A N A ホールディングス	31,000	4,033.00	125,023,000
パスコ	2,000	280.00	560,000

トランコム	500	7,590.00	3,795,000
日新	1,400	2,438.00	3,413,200
三菱倉庫	5,500	2,467.00	13,568,500
三井倉庫ホールディングス	9,000	342.00	3,078,000
住友倉庫	11,000	692.00	7,612,000
澁澤倉庫	900	1,642.00	1,477,800
東陽倉庫	2,900	337.00	977,300
日本トランスシティ	3,900	509.00	1,985,100
ケイヒン	300	1,548.00	464,400
中央倉庫	900	1,195.00	1,075,500
川西倉庫	300	1,510.00	453,000
安田倉庫	1,400	892.00	1,248,800
東洋埠頭	500	1,670.00	835,000
宇徳	1,300	490.00	637,000
上組	9,800	2,267.00	22,216,600
サンリツ	400	785.00	314,000
キムラユニティー	400	1,123.00	449,200
キューソー流通システム	400	2,984.00	1,193,600
近鉄エクスプレス	3,000	2,151.00	6,453,000
東海運	1,000	340.00	340,000
エーアイティー	1,100	1,074.00	1,181,400
内外トランスライン	600	1,469.00	881,400
日本コンセプト	300	1,371.00	411,300
NEC ネットエスアイ	1,800	2,397.00	4,314,600
システナ	5,300	1,231.00	6,524,300
デジタルアーツ	800	6,290.00	5,032,000
新日鉄住金ソリューションズ	2,500	2,955.00	7,387,500
キューブシステム	1,000	890.00	890,000
エイジア	400	1,522.00	608,800
コア	700	1,381.00	966,700
ソリトンシステムズ	800	1,002.00	801,600
ソフトクリエイトホールディングス	800	1,768.00	1,414,400
T I S	5,500	5,570.00	30,635,000
ネオス	600	524.00	314,400
電算システム	600	1,960.00	1,176,000
グリー	9,000	604.00	5,436,000
コーエーテクモホールディングス	2,800	2,157.00	6,039,600
三菱総合研究所	600	5,300.00	3,180,000
ボルテージ	400	775.00	310,000
電算	200	2,238.00	447,600
A G S	900	862.00	775,800
ファインデックス	1,400	788.00	1,103,200

ヒト・コミュニケーションズ	400	1,897.00	758,800
ブレインパッド	400	4,435.00	1,774,000
K L a b	3,100	1,257.00	3,896,700
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,200	2,780.00	3,336,000
イーブックイニシアティブジャパン	300	1,214.00	364,200
ネクソン	37,300	1,775.00	66,207,500
アイスタイル	4,200	1,349.00	5,665,800
エムアップ	600	2,425.00	1,455,000
エイチーム	1,000	2,318.00	2,318,000
テクノスジャパン	1,500	951.00	1,426,500
コロプラ	4,700	764.00	3,590,800
オルトプラス	1,000	760.00	760,000
ブロードリーフ	8,200	649.00	5,321,800
クロス・マーケティンググループ	500	611.00	305,500
デジタルハーツホールディングス	900	1,527.00	1,374,300
メディアドゥホールディングス	600	2,075.00	1,245,000
バイキューブ	1,000	589.00	589,000
サイバーリンクス	300	1,011.00	303,300
ディー・エル・イー	1,100	495.00	544,500
フィックスターズ	1,600	1,480.00	2,368,000
VOYAGE GROUP	900	1,181.00	1,062,900
オブティム	300	2,921.00	876,300
セレス	500	1,602.00	801,000
ベリサーブ	200	3,825.00	765,000
ティーガイア	1,700	2,699.00	4,588,300
セック	200	2,971.00	594,200
日本アジアグループ	1,800	458.00	824,400
豆蔵ホールディングス	1,200	1,021.00	1,225,200
テクマトリックス	900	2,093.00	1,883,700
プロシップ	200	2,482.00	496,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	45,000	262.00	11,790,000
GMOペイメントゲートウェイ	1,400	13,690.00	19,166,000
ザッパラス	1,000	372.00	372,000
システムリサーチ	200	3,305.00	661,000
インターネットイニシアティブ	2,700	2,131.00	5,753,700
さくらインターネット	2,000	758.00	1,516,000
ヴィンクス	500	1,160.00	580,000
GMOクラウド	400	3,215.00	1,286,000
SRAホールディングス	900	3,200.00	2,880,000
Minor iソリューションズ	300	1,526.00	457,800
システムインテグレータ	200	1,130.00	226,000
朝日ネット	1,500	514.00	771,000

e B A S E	500	1,883.00	941,500
アバント	500	1,024.00	512,000
アドソル日進	600	1,571.00	942,600
フリービット	1,100	1,088.00	1,196,800
コムチュア	900	3,020.00	2,718,000
サイバーコム	300	1,828.00	548,400
インフォテリア	800	1,010.00	808,000
メディカル・データ・ビジョン	1,300	1,577.00	2,050,100
g u m i	1,900	709.00	1,347,100
ショーケース・ティービー	400	1,207.00	482,800
モバイルファクトリー	400	1,468.00	587,200
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	700	1,098.00	768,600
P C Iホールディングス	300	3,010.00	903,000
パイプドHD	300	1,072.00	321,600
アイビーシー	300	2,417.00	725,100
ネオジャパン	400	1,427.00	570,800
ランドコンピュータ	200	1,211.00	242,200
オープンドア	700	2,298.00	1,608,600
マイネット	500	1,386.00	693,000
アカツキ	400	4,155.00	1,662,000
ベネフィットジャパン	100	1,211.00	121,100
U b i c o mホールディングス	200	917.00	183,400
L I N E	5,000	5,010.00	25,050,000
シンクロ・フード	600	875.00	525,000
オークネット	700	1,951.00	1,365,700
A O I T Y O H o l d i n g s	1,400	1,627.00	2,277,800
マクロミル	1,500	2,670.00	4,005,000
ビーグリー	400	1,428.00	571,200
オロ	200	4,305.00	861,000
ソルクシーズ	600	1,180.00	708,000
フェイス	600	1,419.00	851,400
ハイマックス	200	1,839.00	367,800
野村総合研究所	10,500	5,790.00	60,795,000
サイバネットシステム	1,400	808.00	1,131,200
C Eホールディングス	400	807.00	322,800
日本システム技術	300	1,554.00	466,200
インテージホールディングス	2,000	1,198.00	2,396,000
東邦システムサイエンス	500	872.00	436,000
ソースネクスト	2,400	874.00	2,097,600
F I G	1,300	345.00	448,500
フォーカスシステムズ	1,000	846.00	846,000
クレスコ	400	3,190.00	1,276,000

フジ・メディア・ホールディングス	17,100	1,866.00	31,908,600
オービック	5,200	9,530.00	49,556,000
ジャストシステム	2,700	2,324.00	6,274,800
TDCソフト	700	1,615.00	1,130,500
ヤフー	119,000	361.00	42,959,000
トレンドマイクロ	8,100	6,590.00	53,379,000
インフォメーション・ディベロプメント	500	1,307.00	653,500
日本オラクル	2,700	9,490.00	25,623,000
アルファシステムズ	500	2,286.00	1,143,000
フューチャー	2,200	1,413.00	3,108,600
CAC Holdings	1,200	1,066.00	1,279,200
ソフトバンク・テクノロジー	700	1,600.00	1,120,000
トーセ	500	1,032.00	516,000
オービックビジネスコンサルタント	800	8,190.00	6,552,000
伊藤忠テクノソリューションズ	7,500	2,075.00	15,562,500
アイティフォー	2,000	1,336.00	2,672,000
東計電算	300	2,904.00	871,200
エクスネット	200	892.00	178,400
大塚商会	9,900	4,300.00	42,570,000
サイボウズ	2,200	502.00	1,104,400
ソフトブレーン	1,300	563.00	731,900
電通国際情報サービス	1,000	3,310.00	3,310,000
デジタルガレージ	3,000	4,325.00	12,975,000
EMシステムズ	1,100	1,249.00	1,373,900
ウェザーニューズ	600	3,280.00	1,968,000
C I J	1,300	635.00	825,500
東洋ビジネスエンジニアリング	100	1,960.00	196,000
日本エンタープライズ	1,800	236.00	424,800
WOWOW	800	3,390.00	2,712,000
スカラ	1,400	1,139.00	1,594,600
イマジカ・ロボットホールディングス	1,400	928.00	1,299,200
ネットワンシステムズ	6,800	1,984.00	13,491,200
システムソフト	4,100	135.00	553,500
アルゴグラフィックス	800	3,520.00	2,816,000
マーベラス	2,800	888.00	2,486,400
エイベックス	3,100	1,484.00	4,600,400
日本ユニシス	4,600	2,705.00	12,443,000
兼松エレクトロニクス	1,000	3,985.00	3,985,000
東京放送ホールディングス	9,100	2,363.00	21,503,300
日本テレビホールディングス	15,100	1,803.00	27,225,300
朝日放送グループホールディングス	1,600	811.00	1,297,600
テレビ朝日ホールディングス	4,500	2,307.00	10,381,500

スカパーJ S A Tホールディングス	12,500	554.00	6,925,000
テレビ東京ホールディングス	1,300	3,300.00	4,290,000
日本BS放送	600	1,336.00	801,600
ビジョン	400	4,185.00	1,674,000
USEN-NEXT HOLDINGS	500	1,431.00	715,500
ワイヤレスゲート	800	1,243.00	994,400
コネクシオ	1,300	1,885.00	2,450,500
クロップス	400	824.00	329,600
日本電信電話	118,800	5,124.00	608,731,200
KDDI	145,800	3,155.00	459,999,000
光通信	2,000	19,810.00	39,620,000
NTTドコモ	118,900	2,858.50	339,875,650
エムティーアイ	1,900	619.00	1,176,100
GMOインターネット	6,000	2,539.00	15,234,000
アйдママーケティングコミュニケーション	400	910.00	364,000
カドカワ	4,800	1,183.00	5,678,400
学研ホールディングス	600	4,700.00	2,820,000
ゼンリン	3,000	2,740.00	8,220,000
昭文社	800	745.00	596,000
インプレスホールディングス	1,500	162.00	243,000
アイネット	900	1,899.00	1,709,100
松竹	1,100	13,680.00	15,048,000
東宝	10,900	3,260.00	35,534,000
東映	600	10,710.00	6,426,000
エヌ・ティ・ティ・データ	51,300	1,304.00	66,895,200
ピー・シー・エー	300	1,674.00	502,200
ビジネスブレイン太田昭和	300	1,999.00	599,700
D T S	1,700	4,190.00	7,123,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,700	5,400.00	41,580,000
シーイーシー	1,000	4,115.00	4,115,000
カブコン	7,100	2,688.00	19,084,800
アイ・エス・ビー	300	1,853.00	555,900
ジャステック	1,000	1,037.00	1,037,000
S C S K	3,800	5,260.00	19,988,000
日本システムウエア	600	2,226.00	1,335,600
アイネス	2,100	1,062.00	2,230,200
T K C	1,400	4,035.00	5,649,000
富士ソフト	2,300	4,585.00	10,545,500
N S D	2,700	2,511.00	6,779,700
コナミホールディングス	6,800	5,660.00	38,488,000
福井コンピュータホールディングス	500	1,805.00	902,500
J B C Cホールディングス	1,300	1,124.00	1,461,200

ミロク情報サービス	1,400	2,828.00	3,959,200
ソフトバンクグループ	74,900	9,604.00	719,339,600
ハウスイ	100	1,030.00	103,000
高千穂交易	600	1,140.00	684,000
伊藤忠食品	400	5,830.00	2,332,000
エレマテック	800	2,737.00	2,189,600
J A L U X	500	2,849.00	1,424,500
あらた	800	5,440.00	4,352,000
トーメンデバイス	300	2,737.00	821,100
東京エレクトロン デバイス	600	1,977.00	1,186,200
フィールズ	1,300	1,165.00	1,514,500
双日	98,400	405.00	39,852,000
アルフレッサ ホールディングス	18,400	2,653.00	48,815,200
横浜冷凍	4,200	1,003.00	4,212,600
神栄	200	1,389.00	277,800
ラサ商事	700	954.00	667,800
ラクーン	1,100	531.00	584,100
アルコニックス	1,800	1,666.00	2,998,800
神戸物産	1,100	5,720.00	6,292,000
ペッパーフードサービス	1,200	3,780.00	4,536,000
あい ホールディングス	2,700	2,326.00	6,280,200
ディーブイエックス	600	1,400.00	840,000
ダイワボウホールディングス	1,400	5,800.00	8,120,000
マクニカ・富士エレホールディングス	3,200	1,882.00	6,022,400
ラクト・ジャパン	300	5,680.00	1,704,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,100	1,148.00	3,558,800
八洲電機	1,300	927.00	1,205,100
メディアスホールディングス	900	948.00	853,200
U K C ホールディングス	1,100	2,338.00	2,571,800
ジューテックホールディングス	400	1,057.00	422,800
大光	400	734.00	293,600
O C H I ホールディングス	500	1,333.00	666,500
T O K A I ホールディングス	8,800	1,054.00	9,275,200
C o m i n i x	300	891.00	267,300
三洋貿易	800	2,032.00	1,625,600
ビューティガレージ	200	2,140.00	428,000
ウイン・パートナーズ	1,200	1,569.00	1,882,800
ミタチ産業	500	847.00	423,500
シップヘルスケアホールディングス	3,400	4,365.00	14,841,000
明治電機工業	600	1,832.00	1,099,200
デリカフーズホールディングス	300	1,533.00	459,900
スターティアホールディングス	400	705.00	282,000



コメダホールディングス	3,100	2,163.00	6,705,300
富士興産	700	630.00	441,000
協栄産業	200	1,934.00	386,800
小野建	1,500	1,883.00	2,824,500
佐島電機	1,200	910.00	1,092,000
エコートレーディング	400	691.00	276,400
伯東	1,000	1,551.00	1,551,000
コンドーテック	1,300	1,010.00	1,313,000
中山福	1,000	709.00	709,000
ナガイレーベン	2,400	2,721.00	6,530,400
三菱食品	1,800	2,941.00	5,293,800
松田産業	1,200	1,600.00	1,920,000
第一興商	2,500	5,360.00	13,400,000
メディバルホールディングス	16,600	2,238.00	37,150,800
S P K	300	2,639.00	791,700
萩原電気ホールディングス	600	2,999.00	1,799,400
アズワン	1,300	7,670.00	9,971,000
スズデン	600	1,526.00	915,600
シモジマ	1,000	1,116.00	1,116,000
ドウシシャ	1,800	2,476.00	4,456,800
小津産業	400	1,958.00	783,200
高速	1,000	1,337.00	1,337,000
たけびし	600	1,602.00	961,200
リックス	400	1,849.00	739,600
丸文	1,500	812.00	1,218,000
ハピネット	1,200	1,438.00	1,725,600
橋本総業ホールディングス	300	1,684.00	505,200
日本ライフライン	4,700	2,911.00	13,681,700
エクセル	700	2,515.00	1,760,500
マルカキカイ	500	1,820.00	910,000
I D O M	5,000	425.00	2,125,000
日本エム・ディ・エム	1,100	1,083.00	1,191,300
進和	1,000	2,426.00	2,426,000
エスケイジャパン	500	548.00	274,000
ダイترون	800	2,094.00	1,675,200
シークス	2,100	2,469.00	5,184,900
田中商事	600	685.00	411,000
オーハシテクニカ	900	1,783.00	1,604,700
白銅	600	2,122.00	1,273,200
伊藤忠商事	121,800	1,970.50	240,006,900
丸紅	136,400	857.20	116,922,080
高島	300	2,066.00	619,800

長瀬産業	10,000	1,801.00	18,010,000
蝶理	1,100	1,953.00	2,148,300
豊田通商	18,500	3,755.00	69,467,500
三共生興	2,800	462.00	1,293,600
兼松	7,100	1,580.00	11,218,000
ツカモトコーポレーション	300	1,196.00	358,800
三井物産	136,700	1,888.50	258,157,950
日本紙パルプ商事	900	4,735.00	4,261,500
日立ハイテクノロジーズ	5,800	4,520.00	26,216,000
カメイ	2,200	1,491.00	3,280,200
東都水産	300	1,918.00	575,400
OUGホールディングス	300	2,743.00	822,900
スターゼン	600	5,850.00	3,510,000
山善	6,500	1,076.00	6,994,000
椿本興業	400	3,535.00	1,414,000
住友商事	104,700	1,849.50	193,642,650
内田洋行	800	3,605.00	2,884,000
三菱商事	116,400	3,109.00	361,887,600
第一実業	800	3,470.00	2,776,000
キャノンマーケティングジャパン	4,800	2,251.00	10,804,800
西華産業	1,000	2,332.00	2,332,000
佐藤商事	1,500	1,229.00	1,843,500
菱洋エレクトロ	1,500	1,763.00	2,644,500
東京産業	1,700	612.00	1,040,400
ユアサ商事	1,600	3,515.00	5,624,000
神鋼商事	400	2,828.00	1,131,200
小林産業	1,100	297.00	326,700
阪和興業	3,100	4,250.00	13,175,000
正栄食品工業	900	3,795.00	3,415,500
カナデン	1,600	1,328.00	2,124,800
菱電商事	1,200	1,719.00	2,062,800
フルサト工業	900	1,758.00	1,582,200
岩谷産業	3,700	3,815.00	14,115,500
すてきナイスグループ	700	1,313.00	919,100
昭光通商	600	869.00	521,400
ニチモウ	300	1,646.00	493,800
極東貿易	2,000	448.00	896,000
イワキ	2,400	459.00	1,101,600
三愛石油	4,500	1,344.00	6,048,000
稲畑産業	4,000	1,656.00	6,624,000
G S Iクレオス	400	1,537.00	614,800
明和産業	1,500	476.00	714,000

ワキタ	3,500	1,245.00	4,357,500
東邦ホールディングス	4,900	2,787.00	13,656,300
サンゲツ	5,500	2,208.00	12,144,000
ミツウロコグループホールディングス	2,400	829.00	1,989,600
シナネンホールディングス	700	2,703.00	1,892,100
伊藤忠エネクス	3,700	1,055.00	3,903,500
サンリオ	4,700	2,179.00	10,241,300
サンワテクノス	1,100	1,571.00	1,728,100
リョーサン	2,100	3,955.00	8,305,500
新光商事	1,800	1,644.00	2,959,200
トーヨー	800	2,437.00	1,949,600
三信電気	1,600	1,922.00	3,075,200
東陽テクニカ	1,900	881.00	1,673,900
モスフードサービス	2,200	3,180.00	6,996,000
加賀電子	1,500	2,481.00	3,721,500
ソーダニッカ	1,700	672.00	1,142,400
立花エレテック	1,100	1,921.00	2,113,100
フォーバル	700	897.00	627,900
PALTAC	2,300	6,270.00	14,421,000
三谷産業	1,900	332.00	630,800
太平洋興発	700	926.00	648,200
西本Wismettacホールディングス	500	5,420.00	2,710,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,528.00	152,800
ヤマタネ	900	2,096.00	1,886,400
丸紅建材リース	2,000	244.00	488,000
日鉄住金物産	1,300	5,690.00	7,397,000
泉州電業	600	3,005.00	1,803,000
トラスコ中山	3,400	2,587.00	8,795,800
オートバックスセブン	6,600	1,956.00	12,909,600
モリト	1,300	948.00	1,232,400
加藤産業	2,600	3,905.00	10,153,000
イノテック	1,500	1,418.00	2,127,000
イエローハット	1,600	3,225.00	5,160,000
J Kホールディングス	1,700	861.00	1,463,700
日伝	1,400	2,033.00	2,846,200
北沢産業	1,500	249.00	373,500
杉本商事	900	1,874.00	1,686,600
因幡電機産業	2,200	4,425.00	9,735,000
バイテックホールディングス	800	2,108.00	1,686,400
東テク	600	2,578.00	1,546,800
ミスミグループ本社	19,300	3,105.00	59,926,500
アルテック	1,600	350.00	560,000

タキヒヨー	500	2,388.00	1,194,000
蔵王産業	300	1,565.00	469,500
スズケン	7,600	4,770.00	36,252,000
ジェコス	1,100	1,090.00	1,199,000
ルネサスイーストン	1,500	541.00	811,500
ローソン	4,200	6,550.00	27,510,000
サンエー	1,300	5,250.00	6,825,000
カワチ薬品	1,300	2,253.00	2,928,900
エービーシー・マート	3,000	6,160.00	18,480,000
ハードオフコーポレーション	700	1,019.00	713,300
アスクル	1,400	3,060.00	4,284,000
ゲオホールディングス	3,000	1,435.00	4,305,000
アダストリア	2,600	1,350.00	3,510,000
ジーフット	1,000	780.00	780,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	300	770.00	231,000
くらコーポレーション	1,000	6,820.00	6,820,000
キャンドウ	800	1,712.00	1,369,600
パルグループホールディングス	900	2,559.00	2,303,100
エディオン	6,400	1,155.00	7,392,000
サーラコーポレーション	2,900	696.00	2,018,400
ワッツ	500	1,043.00	521,500
ハローズ	600	2,548.00	1,528,800
あみやき亭	400	4,540.00	1,816,000
ひらまつ	2,300	477.00	1,097,100
大黒天物産	400	4,745.00	1,898,000
ハニーズホールディングス	1,700	1,059.00	1,800,300
ファーマライズホールディングス	400	598.00	239,200
アルペン	1,300	2,359.00	3,066,700
ハブ	400	1,016.00	406,400
クオール	1,800	1,965.00	3,537,000
ジンズ	1,100	6,220.00	6,842,000
ビックカメラ	8,900	1,803.00	16,046,700
D C Mホールディングス	8,900	1,014.00	9,024,600
Monotaro	5,900	5,430.00	32,037,000
東京一番フーズ	400	658.00	263,200
D Dホールディングス	400	2,950.00	1,180,000
きちり	500	796.00	398,000
アーランドサービスホールディングス	1,400	2,050.00	2,870,000
J . フロント リテイリング	19,800	1,634.00	32,353,200
ドトール・日レスホールディングス	2,900	2,062.00	5,979,800
マツモトキヨシホールディングス	6,900	5,100.00	35,190,000
ブロンコビリー	900	3,810.00	3,429,000

スタートトゥデイ	16,300	4,675.00	76,202,500
トレジャー・ファクトリー	500	711.00	355,500
物語コーポレーション	500	10,170.00	5,085,000
ココカラファイン	1,700	7,000.00	11,900,000
三越伊勢丹ホールディングス	31,100	1,364.00	42,420,400
H a m e e	500	1,537.00	768,500
ウエルシアホールディングス	4,400	5,960.00	26,224,000
クリエイティブSDホールディングス	2,400	2,885.00	6,924,000
丸善C H Iホールディングス	2,000	395.00	790,000
ミサワ	400	480.00	192,000
ティーライフ	200	1,314.00	262,800
エー・ピーカンパニー	300	615.00	184,500
チムニー	500	2,872.00	1,436,000
シュッピン	1,000	1,700.00	1,700,000
ネクステージ	1,800	911.00	1,639,800
ジョイフル本田	4,900	1,649.00	8,080,100
鳥貴族	600	2,328.00	1,396,800
キリン堂ホールディングス	600	2,663.00	1,597,800
ホットランド	1,000	1,279.00	1,279,000
すかいらーくホールディングス	10,300	1,589.00	16,366,700
綿半ホールディングス	600	3,055.00	1,833,000
ヨシックス	300	3,395.00	1,018,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,500	1,327.00	7,298,500
ブックオフコーポレーション	1,000	786.00	786,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	700	922.00	645,400
B E E N O S	400	1,708.00	683,200
あさひ	1,300	1,340.00	1,742,000
日本調剤	600	2,912.00	1,747,200
コスモス薬品	800	25,740.00	20,592,000
トーエル	800	889.00	711,200
一六堂	400	394.00	157,600
オンリー	300	968.00	290,400
セブン&アイ・ホールディングス	69,500	4,623.00	321,298,500
薬王堂	700	3,480.00	2,436,000
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	4,500	1,415.00	6,367,500
ツルハホールディングス	3,600	14,230.00	51,228,000
サンマルクホールディングス	1,200	2,640.00	3,168,000
フェリシモ	500	1,318.00	659,000
トリドールホールディングス	2,000	2,444.00	4,888,000
T O K Y O B A S E	1,500	683.00	1,024,500
ウイルプラスホールディングス	100	1,114.00	111,400

サツドラホールディングス	300	2,086.00	625,800
ダイユー・リックホールディングス	800	1,164.00	931,200
パロックジャパンリミテッド	1,300	983.00	1,277,900
クスリのアオキホールディングス	1,300	8,860.00	11,518,000
力の源ホールディングス	400	1,353.00	541,200
スシローグローバルホールディングス	1,800	6,610.00	11,898,000
LIXILピバ	2,100	1,749.00	3,672,900
メディカルシステムネットワーク	2,000	451.00	902,000
総合メディカル	1,400	2,212.00	3,096,800
はるやまホールディングス	800	1,002.00	801,600
ノジマ	2,900	2,354.00	6,826,600
カッパ・クリエイト	2,100	1,370.00	2,877,000
ライトオン	1,400	1,074.00	1,503,600
ジーンズメイト	500	610.00	305,000
良品計画	2,200	35,050.00	77,110,000
三城ホールディングス	2,100	464.00	974,400
アドヴァン	1,700	965.00	1,640,500
アルビス	500	3,180.00	1,590,000
コナカ	2,200	515.00	1,133,000
ハウス オブ ローゼ	200	1,707.00	341,400
G-7ホールディングス	500	2,818.00	1,409,000
イオン北海道	1,700	801.00	1,361,700
コジマ	2,600	571.00	1,484,600
ヒマラヤ	600	1,011.00	606,600
コーナン商事	2,400	2,480.00	5,952,000
エコス	700	1,813.00	1,269,100
ワタミ	2,000	1,307.00	2,614,000
マルシェ	500	813.00	406,500
ドンキホーテホールディングス	10,800	5,430.00	58,644,000
西松屋チェーン	3,600	1,229.00	4,424,400
ゼンショーホールディングス	8,600	2,556.00	21,981,600
幸楽苑ホールディングス	1,100	1,575.00	1,732,500
ハークスレイ	400	1,046.00	418,400
サイゼリヤ	2,800	2,224.00	6,227,200
V Tホールディングス	5,600	547.00	3,063,200
魚力	500	1,492.00	746,000
ポブラ	500	810.00	405,000
フジ・コーポレーション	300	2,672.00	801,600
ユナイテッドアローズ	2,100	4,385.00	9,208,500
ハイデイ日高	2,200	2,376.00	5,227,200
京都きもの友禅	1,200	563.00	675,600
コロワイド	5,500	2,831.00	15,570,500

ピーシーデポコーポレーション	2,500	541.00	1,352,500
壱番屋	1,200	4,705.00	5,646,000
トップカルチャー	800	367.00	293,600
P L A N T	400	1,296.00	518,400
スギホールディングス	3,600	6,120.00	22,032,000
ヴィア・ホールディングス	2,100	738.00	1,549,800
スクロール	2,600	568.00	1,476,800
ヨンドシーホールディングス	1,700	2,543.00	4,323,100
ユニー・ファミリーマートホールディングス	5,300	10,750.00	56,975,000
木曽路	2,000	2,733.00	5,466,000
S R Sホールディングス	2,000	993.00	1,986,000
千趣会	3,100	587.00	1,819,700
タカキュー	1,500	213.00	319,500
ケーヨー	3,100	538.00	1,667,800
上新電機	2,000	3,235.00	6,470,000
日本瓦斯	3,100	6,100.00	18,910,000
ロイヤルホールディングス	3,000	2,842.00	8,526,000
東天紅	100	1,737.00	173,700
いなげや	1,800	1,818.00	3,272,400
島忠	3,800	3,565.00	13,547,000
チヨダ	1,900	2,285.00	4,341,500
ライフコーポレーション	1,200	2,575.00	3,090,000
リンガーハット	2,000	2,323.00	4,646,000
さが美グループホールディングス	2,000	149.00	298,000
M r M a x H D	2,100	627.00	1,316,700
テンアライド	1,600	465.00	744,000
A O K Iホールディングス	3,300	1,606.00	5,299,800
オークワ	2,000	1,054.00	2,108,000
コメリ	2,600	2,781.00	7,230,600
青山商事	3,200	3,630.00	11,616,000
しまむら	1,900	9,990.00	18,981,000
はせがわ	900	490.00	441,000
高島屋	26,000	929.00	24,154,000
松屋	3,400	1,497.00	5,089,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,900	1,742.00	13,761,800
近鉄百貨店	600	4,015.00	2,409,000
パルコ	1,600	1,238.00	1,980,800
丸井グループ	15,200	2,205.00	33,516,000
アクシアル リテイリング	1,400	4,240.00	5,936,000
イオン	63,900	2,250.00	143,775,000
イズミ	3,000	6,780.00	20,340,000
東武ストア	200	3,080.00	616,000

平和堂	3,400	2,775.00	9,435,000
フジ	2,000	2,006.00	4,012,000
ヤオコー	1,900	5,930.00	11,267,000
ゼビオホールディングス	2,200	1,629.00	3,583,800
ケーズホールディングス	14,600	1,283.00	18,731,800
Olympicグループ	1,100	1,282.00	1,410,200
日産東京販売ホールディングス	2,500	341.00	852,500
Genky DrugStores	700	4,240.00	2,968,000
アインホールディングス	2,200	8,070.00	17,754,000
元気寿司	400	3,385.00	1,354,000
ヤマダ電機	55,600	562.00	31,247,200
アークランドサカモト	2,800	1,583.00	4,432,400
ニトリホールディングス	6,600	16,955.00	111,903,000
愛眼	1,400	389.00	544,600
ケーユーホールディングス	900	921.00	828,900
吉野家ホールディングス	5,500	1,852.00	10,186,000
松屋フーズ	800	3,685.00	2,948,000
サガミチェーン	2,200	1,418.00	3,119,600
関西スーパーマーケット	1,300	1,190.00	1,547,000
王将フードサービス	1,200	6,130.00	7,356,000
プレナス	1,900	1,733.00	3,292,700
ミニストップ	1,200	2,121.00	2,545,200
アークス	3,100	2,951.00	9,148,100
パローホールディングス	3,900	2,445.00	9,535,500
藤久	100	1,410.00	141,000
ベルク	700	5,370.00	3,759,000
大庄	900	1,748.00	1,573,200
ファーストリテイリング	2,200	52,810.00	116,182,000
サンドラッグ	7,000	4,625.00	32,375,000
サクスパー ホールディングス	1,600	961.00	1,537,600
ヤマザワ	300	1,788.00	536,400
やまや	400	3,070.00	1,228,000
ベルーナ	4,100	1,392.00	5,707,200
島根銀行	400	1,228.00	491,200
じもとホールディングス	11,200	151.00	1,691,200
めぶきフィナンシャルグループ	86,200	365.00	31,463,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,200	2,336.00	5,139,200
九州フィナンシャルグループ	27,200	519.00	14,116,800
ゆうちょ銀行	46,900	1,281.00	60,078,900
富山第一銀行	4,100	458.00	1,877,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	99,200	518.00	51,385,600
西日本フィナンシャルホールディングス	10,600	1,263.00	13,387,800



関西みらいフィナンシャルグループ	7,300	878.00	6,409,400	
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,925.00	2,695,000	
新生銀行	13,600	1,695.00	23,052,000	
あおぞら銀行	9,900	4,220.00	41,778,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,163,500	656.40	763,721,400	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	182,500	607.30	110,832,250	
三井住友トラスト・ホールディングス	32,400	4,370.00	141,588,000	
三井住友フィナンシャルグループ	125,800	4,309.00	542,072,200	代用有価証券 13,000株
第四銀行	2,000	4,255.00	8,510,000	
北越銀行	1,700	2,147.00	3,649,900	
千葉銀行	58,900	730.00	42,997,000	
群馬銀行	33,800	568.00	19,198,400	
武蔵野銀行	2,600	3,095.00	8,047,000	
千葉興業銀行	4,600	449.00	2,065,400	
筑波銀行	7,100	244.00	1,732,400	
七十七銀行	5,200	2,433.00	12,651,600	
青森銀行	1,300	3,210.00	4,173,000	
秋田銀行	1,100	2,996.00	3,295,600	
山形銀行	1,900	2,330.00	4,427,000	
岩手銀行	1,200	4,285.00	5,142,000	
東邦銀行	14,800	405.00	5,994,000	
東北銀行	900	1,365.00	1,228,500	
みちのく銀行	1,100	1,764.00	1,940,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	67,000	552.00	36,984,000	
静岡銀行	41,800	969.00	40,504,200	
十六銀行	2,200	2,752.00	6,054,400	
スルガ銀行	17,100	971.00	16,604,100	
八十二銀行	30,100	450.00	13,545,000	
山梨中央銀行	10,000	391.00	3,910,000	
大垣共立銀行	2,600	2,790.00	7,254,000	
福井銀行	1,400	2,343.00	3,280,200	
北國銀行	1,900	4,315.00	8,198,500	
清水銀行	700	2,011.00	1,407,700	
富山銀行	300	4,010.00	1,203,000	
滋賀銀行	16,000	575.00	9,200,000	
南都銀行	1,900	2,708.00	5,145,200	
百五銀行	16,000	434.00	6,944,000	
京都銀行	6,300	5,040.00	31,752,000	
紀陽銀行	6,200	1,807.00	11,203,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	11,100	1,481.00	16,439,100	
広島銀行	24,500	705.00	17,272,500	

山陰合同銀行	9,800	981.00	9,613,800
中国銀行	11,500	1,118.00	12,857,000
鳥取銀行	500	1,648.00	824,000
伊予銀行	23,700	707.00	16,755,900
百十四銀行	18,000	335.00	6,030,000
四国銀行	2,500	1,267.00	3,167,500
阿波銀行	13,000	675.00	8,775,000
大分銀行	1,000	3,860.00	3,860,000
宮崎銀行	1,100	3,120.00	3,432,000
佐賀銀行	1,000	2,347.00	2,347,000
十八銀行	10,000	276.00	2,760,000
沖縄銀行	1,600	3,980.00	6,368,000
琉球銀行	3,200	1,656.00	5,299,200
セブン銀行	62,300	343.00	21,368,900
みずほフィナンシャルグループ	2,257,900	190.00	429,001,000
高知銀行	600	1,090.00	654,000
山口フィナンシャルグループ	20,700	1,234.00	25,543,800
長野銀行	500	1,803.00	901,500
名古屋銀行	1,300	3,930.00	5,109,000
北洋銀行	25,100	380.00	9,538,000
愛知銀行	600	4,795.00	2,877,000
中京銀行	700	2,321.00	1,624,700
大光銀行	600	2,079.00	1,247,400
愛媛銀行	2,300	1,254.00	2,884,200
トマト銀行	600	1,422.00	853,200
京葉銀行	15,000	466.00	6,990,000
栃木銀行	8,600	371.00	3,190,600
北日本銀行	500	2,510.00	1,255,000
東和銀行	2,900	1,065.00	3,088,500
福島銀行	1,600	634.00	1,014,400
大東銀行	800	1,138.00	910,400
トモニホールディングス	13,700	459.00	6,288,300
フィデアホールディングス	16,200	162.00	2,624,400
池田泉州ホールディングス	17,600	372.00	6,547,200
F P G	5,300	1,315.00	6,969,500
マーキュリアインベストメント	500	1,117.00	558,500
S B Iホールディングス	18,800	2,803.00	52,696,400
ジャフコ	2,400	4,270.00	10,248,000
大和証券グループ本社	142,200	664.30	94,463,460
野村ホールディングス	285,900	547.70	156,587,430
岡三証券グループ	14,000	524.00	7,336,000
丸三証券	5,300	998.00	5,289,400

東洋証券	6,000	253.00	1,518,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	18,400	707.00	13,008,800
光世証券	500	1,254.00	627,000
水戸証券	5,000	391.00	1,955,000
いちよし証券	3,500	1,147.00	4,014,500
松井証券	8,200	1,057.00	8,667,400
だいこう証券ビジネス	900	559.00	503,100
マネックスグループ	17,000	609.00	10,353,000
カブドットコム証券	10,600	366.00	3,879,600
極東証券	2,300	1,440.00	3,312,000
岩井コスモホールディングス	1,700	1,436.00	2,441,200
藍澤証券	3,100	797.00	2,470,700
マネーパートナーズグループ	2,300	377.00	867,100
かんぽ生命保険	6,300	2,270.00	14,301,000
S O M P Oホールディングス	32,600	4,529.00	147,645,400
アニコム ホールディングス	1,100	4,270.00	4,697,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	43,400	3,427.00	148,731,800
ソニーフィナンシャルホールディングス	13,700	2,126.00	29,126,200
第一生命ホールディングス	94,000	2,015.00	189,410,000
東京海上ホールディングス	62,600	5,316.00	332,781,600
アドバンテッジリスクマネジメント	600	1,144.00	686,400
T & Dホールディングス	51,500	1,626.50	83,764,750
アドバンスクリエイト	400	2,209.00	883,600
全国保証	4,700	5,080.00	23,876,000
ジェイリース	300	737.00	221,100
イントラスト	400	735.00	294,000
アルヒ	1,900	2,358.00	4,480,200
クレディセゾン	12,600	1,689.00	21,281,400
芙蓉総合リース	1,900	7,090.00	13,471,000
興銀リース	3,100	2,749.00	8,521,900
東京センチュリー	3,300	5,850.00	19,305,000
日本証券金融	6,900	580.00	4,002,000
アイフル	28,200	354.00	9,982,800
リコーリース	1,300	3,500.00	4,550,000
イオンフィナンシャルサービス	11,800	2,270.00	26,786,000
アコム	33,500	421.00	14,103,500
ジャックス	2,000	2,335.00	4,670,000
オリエントコーポレーション	36,100	148.00	5,342,800
日立キャピタル	4,600	2,875.00	13,225,000
アプラスフィナンシャル	8,500	104.00	884,000
オリックス	110,800	1,850.50	205,035,400
三菱UFJリース	42,200	669.00	28,231,800

九州リースサービス	800	742.00	593,600
日本取引所グループ	47,700	2,060.00	98,262,000
イー・ギャランティ	900	2,053.00	1,847,700
アサックス	700	636.00	445,200
N E C キャピタルソリューション	700	1,853.00	1,297,100
いちご	23,800	532.00	12,661,600
日本駐車場開発	20,000	183.00	3,660,000
ヒューリック	34,700	1,190.00	41,293,000
三栄建築設計	700	1,802.00	1,261,400
スター・マイカ	800	2,288.00	1,830,400
野村不動産ホールディングス	11,100	2,406.00	26,706,600
三重交通グループホールディングス	3,500	573.00	2,005,500
サムティ	1,400	2,026.00	2,836,400
ディア・ライフ	1,900	481.00	913,900
コーセーアールイー	400	882.00	352,800
エー・ディー・ワークス	23,100	39.00	900,900
日本商業開発	900	1,837.00	1,653,300
プレサンスコーポレーション	2,300	1,665.00	3,829,500
ユニゾホールディングス	2,300	2,098.00	4,825,400
T H E グローバル社	800	760.00	608,000
日本管理センター	1,100	1,329.00	1,461,900
サンセイランディック	500	1,071.00	535,500
エストラスト	200	862.00	172,400
フージャースホールディングス	4,100	798.00	3,271,800
オープンハウス	2,700	6,380.00	17,226,000
東急不動産ホールディングス	40,300	739.00	29,781,700
飯田グループホールディングス	13,900	2,257.00	31,372,300
イーランド	300	1,172.00	351,600
ムゲンエステート	1,000	1,055.00	1,055,000
ビーロッド	300	1,461.00	438,300
ファーストブラザーズ	400	1,387.00	554,800
ハウスドゥ	600	2,403.00	1,441,800
シーアールイー	300	2,078.00	623,400
ケイアイスター不動産	600	2,729.00	1,637,400
グッドコムアセット	200	1,612.00	322,400
パーク24	9,700	3,090.00	29,973,000
バラカ	400	2,578.00	1,031,200
三井不動産	83,000	2,728.00	226,424,000
三菱地所	123,700	1,928.50	238,555,450
平和不動産	3,000	1,985.00	5,955,000
東京建物	18,200	1,469.00	26,735,800
ダイビル	4,300	1,083.00	4,656,900

京阪神ビルディング	2,800	878.00	2,458,400
住友不動産	40,000	4,100.00	164,000,000
大京	2,700	2,453.00	6,623,100
テオーシー	5,800	785.00	4,553,000
東京楽天地	300	5,400.00	1,620,000
レオパレス21	19,900	604.00	12,019,600
スターツコーポレーション	2,200	2,615.00	5,753,000
フジ住宅	2,100	929.00	1,950,900
空港施設	1,700	619.00	1,052,300
明和地所	900	673.00	605,700
ゴールドクレスト	1,300	1,819.00	2,364,700
日本エスリード	700	1,828.00	1,279,600
日神不動産	2,200	648.00	1,425,600
日本エスコン	3,000	720.00	2,160,000
タカラレーベン	7,800	410.00	3,198,000
サンヨーハウジング名古屋	900	1,153.00	1,037,700
イオンモール	10,700	1,973.00	21,111,100
ファースト住建	600	1,342.00	805,200
カチタス	2,300	4,505.00	10,361,500
トーセイ	2,100	1,083.00	2,274,300
穴吹興産	200	3,045.00	609,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	10,400	1,161.00	12,074,400
サンフロンティア不動産	2,000	1,286.00	2,572,000
エフ・ジェー・ネクスト	1,300	1,005.00	1,306,500
インテリックス	500	854.00	427,000
ランドビジネス	1,000	320.00	320,000
グランディハウス	1,500	484.00	726,000
日本空港ビルデング	4,900	5,120.00	25,088,000
日本工営	1,100	2,960.00	3,256,000
LIFULL	5,600	698.00	3,908,800
ジェイエイシーリクルートメント	1,300	2,302.00	2,992,600
日本M&Aセンター	11,200	3,330.00	37,296,000
メンバーズ	500	1,473.00	736,500
中広	200	827.00	165,400
タケエイ	1,700	1,226.00	2,084,200
トラスト・テック	800	4,190.00	3,352,000
コシダカホールディングス	4,400	1,334.00	5,869,600
パソナグループ	1,600	1,924.00	3,078,400
CDS	500	1,246.00	623,000
リンクアンドモチベーション	3,000	1,316.00	3,948,000
GCA	1,900	846.00	1,607,400
エス・エム・エス	6,400	1,978.00	12,659,200

パーソルホールディングス	14,900	2,455.00	36,579,500
リニカル	1,000	2,352.00	2,352,000
クックパッド	5,100	501.00	2,555,100
エスクリ	600	790.00	474,000
アイ・ケイ・ケイ	1,000	791.00	791,000
学情	700	1,466.00	1,026,200
スタジオアリス	800	2,541.00	2,032,800
シミックホールディングス	900	2,235.00	2,011,500
N J S	400	1,768.00	707,200
総合警備保障	6,400	4,830.00	30,912,000
カカクコム	12,100	2,588.00	31,314,800
アイロムグループ	600	1,912.00	1,147,200
セントケア・ホールディング	700	687.00	480,900
サイネックス	200	823.00	164,600
ルネサンス	800	2,510.00	2,008,000
ディップ	2,300	3,095.00	7,118,500
オプトホールディング	1,100	2,605.00	2,865,500
新日本科学	2,000	477.00	954,000
ツクイ	3,800	976.00	3,708,800
キャリアデザインセンター	400	1,903.00	761,200
エムスリー	17,000	4,485.00	76,245,000
ツカダ・グローバルホールディング	1,200	607.00	728,400
プラス	100	916.00	91,600
アウトソーシング	4,800	2,218.00	10,646,400
ウェルネット	1,700	1,036.00	1,761,200
ワールドホールディングス	500	3,490.00	1,745,000
ディー・エヌ・エー	8,700	2,143.00	18,644,100
博報堂D Yホールディングス	22,400	1,726.00	38,662,400
ぐるなび	2,600	864.00	2,246,400
エスアールジータカミヤ	1,900	738.00	1,402,200
ジャパンベストレスキューシステム	1,300	853.00	1,108,900
ファンコミュニケーションズ	4,500	722.00	3,249,000
ライク	600	1,675.00	1,005,000
ビジネス・ブレークスルー	800	436.00	348,800
W D Bホールディングス	700	3,635.00	2,544,500
ティア	800	1,045.00	836,000
C D G	200	1,670.00	334,000
バリューコマース	1,500	1,850.00	2,775,000
インフォマート	8,200	1,349.00	11,061,800
J Pホールディングス	5,100	361.00	1,841,100
エコナックホールディングス	3,400	123.00	418,200
E P Sホールディングス	2,400	2,172.00	5,212,800

レッグス	400	1,087.00	434,800
プレステージ・インターナショナル	3,300	1,498.00	4,943,400
アミューズ	1,100	2,805.00	3,085,500
ドリームインキュベータ	600	2,091.00	1,254,600
クイック	1,000	1,727.00	1,727,000
T A C	1,000	317.00	317,000
ケネディクス	21,400	622.00	13,310,800
電通	19,600	5,150.00	100,940,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	800	1,627.00	1,301,600
ぴあ	500	5,700.00	2,850,000
イオンファンタジー	500	5,750.00	2,875,000
シーティーエス	1,600	1,134.00	1,814,400
みらかホールディングス	4,800	3,120.00	14,976,000
アルプス技研	1,400	2,335.00	3,269,000
日本空調サービス	1,700	817.00	1,388,900
オリエンタルランド	19,000	11,765.00	223,535,000
ダスキン	4,300	2,687.00	11,554,100
明光ネットワークジャパン	2,000	1,043.00	2,086,000
ファルコホールディングス	800	1,847.00	1,477,600
秀英予備校	400	489.00	195,600
田谷	300	676.00	202,800
ラウンドワン	5,000	1,786.00	8,930,000
リゾートトラスト	6,800	1,925.00	13,090,000
ビー・エム・エル	2,100	2,761.00	5,798,100
ワタベウェディング	300	556.00	166,800
りらいあコミュニケーションズ	2,600	1,593.00	4,141,800
リソー教育	2,700	819.00	2,211,300
早稲田アカデミー	300	2,400.00	720,000
ユー・エス・エス	19,600	2,091.00	40,983,600
東京個別指導学院	600	1,187.00	712,200
サイバーエージェント	9,900	6,650.00	65,835,000
楽天	82,600	800.80	66,146,080
クリーク・アンド・リバー社	800	1,116.00	892,800
テー・オー・ダブリュー	1,500	780.00	1,170,000
セントラルスポーツ	600	4,110.00	2,466,000
フルキャストホールディングス	1,400	2,540.00	3,556,000
リソルホールディングス	200	4,190.00	838,000
テクノプロ・ホールディングス	3,000	6,940.00	20,820,000
アトラ	300	752.00	225,600
インターワークス	400	980.00	392,000
K e e P e r 技研	500	1,171.00	585,500
ファーストロジック	300	646.00	193,800

三機サービス	300	2,402.00	720,600
Gunosy	1,000	1,898.00	1,898,000
デザインワン・ジャパン	300	1,050.00	315,000
イー・ガーディアン	800	2,688.00	2,150,400
リブセンス	1,100	499.00	548,900
ジャパンマテリアル	4,400	1,633.00	7,185,200
ベクトル	1,900	2,056.00	3,906,400
ウチヤマホールディングス	800	519.00	415,200
ライクキッズネクスト	400	1,258.00	503,200
キャリアリンク	600	525.00	315,000
I B J	1,300	631.00	820,300
アサンテ	600	2,156.00	1,293,600
N・フィールド	900	1,629.00	1,466,100
バリューHR	400	1,991.00	796,400
M&Aキャピタルパートナーズ	400	9,900.00	3,960,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	700	1,891.00	1,323,700
E R Iホールディングス	500	1,043.00	521,500
アビスト	200	4,555.00	911,000
シグマクシス	900	1,359.00	1,223,100
ウィルグループ	700	1,101.00	770,700
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,200	405.00	891,000
日本ビューホテル	500	1,388.00	694,000
リクルートホールディングス	124,200	3,179.00	394,831,800
エラン	400	2,640.00	1,056,000
土木管理総合試験所	500	600.00	300,000
日本郵政	91,200	1,214.00	110,716,800
ベルシステム24ホールディングス	2,700	1,917.00	5,175,900
鎌倉新書	300	4,155.00	1,246,500
一蔵	200	811.00	162,200
LITALICO	400	1,712.00	684,800
グローバルグループ	200	1,750.00	350,000
エボラブルアジア	400	2,733.00	1,093,200
ストライク	400	3,910.00	1,564,000
ソラスト	3,000	1,183.00	3,549,000
セラク	400	762.00	304,800
インソース	500	2,475.00	1,237,500
キャリアインデックス	200	3,015.00	603,000
MS - J a p a n	200	7,250.00	1,450,000
船場	300	1,152.00	345,600
フルテック	200	1,134.00	226,800
グリーンズ	400	1,535.00	614,000
日総工産	300	6,180.00	1,854,000



キュービーネットホールディングス	800	2,251.00	1,800,800
リログループ	8,800	3,040.00	26,752,000
東祥	1,000	4,255.00	4,255,000
エイチ・アイ・エス	2,500	3,160.00	7,900,000
ラックランド	300	2,751.00	825,300
共立メンテナンス	2,900	5,780.00	16,762,000
イチネンホールディングス	1,800	1,352.00	2,433,600
建設技術研究所	1,100	1,502.00	1,652,200
スペース	1,100	1,351.00	1,486,100
長大	600	874.00	524,400
燦ホールディングス	400	2,402.00	960,800
スバル興業	100	6,310.00	631,000
東京テアトル	700	1,421.00	994,700
タナベ経営	300	2,146.00	643,800
ナガワ	300	4,435.00	1,330,500
よみうりランド	400	4,635.00	1,854,000
東京都競馬	1,200	4,670.00	5,604,000
常盤興産	600	1,811.00	1,086,600
カナモト	2,400	3,475.00	8,340,000
東京ドーム	6,500	952.00	6,188,000
西尾レントオール	1,600	3,610.00	5,776,000
トランス・コスモス	1,800	2,648.00	4,766,400
乃村工藝社	3,800	2,397.00	9,108,600
藤田観光	700	3,110.00	2,177,000
KNT-CTホールディングス	1,000	1,489.00	1,489,000
日本管財	1,700	2,106.00	3,580,200
トーカイ	1,600	2,337.00	3,739,200
白洋舎	200	3,195.00	639,000
セコム	17,100	8,583.00	146,769,300
セントラル警備保障	800	4,480.00	3,584,000
丹青社	3,300	1,422.00	4,692,600
メイテック	1,900	5,370.00	10,203,000
応用地質	1,700	1,387.00	2,357,900
船井総研ホールディングス	3,300	2,494.00	8,230,200
進学会ホールディングス	800	571.00	456,800
オオバ	1,400	596.00	834,400
いであ	300	1,076.00	322,800
学究社	600	1,750.00	1,050,000
ベネッセホールディングス	5,900	3,930.00	23,187,000
イオンディライト	2,000	4,135.00	8,270,000
ナック	1,100	955.00	1,050,500
ニチイ学館	3,100	1,234.00	3,825,400

ダイセキ	2,700	3,175.00	8,572,500	
ステップ	600	1,592.00	955,200	
合 計	20,377,500		41,990,477,680	

## (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。

## ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

	平成29年 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	1,032,188,363	4,497,600
金銭信託	-	606,812,641
コール・ローン	10,657,465,923	2,179,974,741
国債証券	44,324,849,412	63,653,984,771
地方債証券	9,391,675,058	9,800,137,439
特殊債券	27,447,527,328	23,552,323,814
派生商品評価勘定	155,545,260	107,438,343
未収利息	450,258,175	589,139,585
前払費用	81,225,089	102,918,663
差入委託証拠金	112,430,000	45,168,260
流動資産合計	93,653,164,608	100,642,395,857
資産合計	93,653,164,608	100,642,395,857
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,129,322,019	2,000,041,263
未払金	2,487,876,068	-
未払解約金	18,084,471	10,986,578
未払利息	17,276	4,047
流動負債合計	4,635,299,834	2,011,031,888
負債合計	4,635,299,834	2,011,031,888
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	70,468,997,878	76,630,624,911
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	18,548,866,896	22,000,739,058
元本等合計	89,017,864,774	98,631,363,969
純資産合計	89,017,864,774	98,631,363,969
負債純資産合計	93,653,164,608	100,642,395,857

## 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、地方債証券及び特殊債券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>（１）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>（２）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>（３）時価が入手できなかった有価証券 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 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
1.	期首	平成28年 8月22日	平成29年 7月19日
	期首元本額	47,964,950,758円	70,468,997,878円
	期首からの追加設定元本額	27,262,524,060円	21,132,873,411円
	期首からの一部解約元本額	4,758,476,940円	14,971,246,378円
	元本の内訳		
	円サポート	3,383,682,400円	2,408,844,851円
	高格付債券ファンド（為替ヘッジ70）毎月分配型	1,344,512,021円	1,280,556,075円
	高格付債券ファンド（為替ヘッジ70）資産成長型	220,379,327円	171,740,796円
	スマート・ラップ・ジャパン（毎月分配型）	106,986,749円	497,279,590円
	スマート・ラップ・ジャパン（1年決算型）	161,389,597円	593,293,700円
	スマート・ラップ・グローバル・インカム（毎月分配型）	- 円	43,593,881円
	スマート・ラップ・グローバル・インカム（1年決算型）	- 円	40,526,862円

時間分散型バランスファンド(安定指向) 2016-08	318,502,939円	146,451,186円
時間分散型バランスファンド(成長指向) 2016-08	126,008,178円	41,965,073円
円キャッシュ・アルファ・マスターファンド(適格機関投資家向け)	509,198,507円	-円
時間分散型バランスファンド(安定指向) 2016-11	245,615,149円	67,331,251円
時間分散型バランスファンド(成長指向) 2016-11	158,063,488円	53,085,568円
時間分散型バランスファンド(安定指向) 2017-02	63,662,965円	70,606,803円
時間分散型バランスファンド(成長指向) 2017-02	45,949,669円	39,729,200円
高格付先進国ソブリン債券(円ヘッジ)ファンド(適格機関投資家向け)	4,022,351,273円	9,302,056,966円
円キャッシュ・アルファ・ファンド(SMA専用)	1,523,104,678円	2,113,646,697円
高格付先進国ソブリンオープン・為替ヘッジあり(適格機関投資家向け)	6,199,374,738円	7,586,325,547円
高格付先進国ソブリンファンド 2013-05M(適格機関投資家向け)	2,368,490,282円	2,329,858,236円
高格付先進国ソブリンファンド・為替ヘッジあり 2013-07Q(適格機関投資家転売制限付)	81,858,946円	79,519,994円
高格付先進国ソブリンファンド・為替ヘッジあり 2016-09Q(適格機関投資家転売制限付)	3,461,939,537円	3,402,051,308円
高格付先進国ソブリンファンド・為替ヘッジあり 2016-10Q(適格機関投資家転売制限付)	983,988,555円	966,761,605円
PF 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2013-11M(適格機関投資家転売制限付)	2,154,164,755円	2,088,656,905円
PF 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2014-05M(適格機関投資家転売制限付)	3,529,380,977円	3,439,024,407円
PF 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2014-07(適格機関投資家転売制限付)	1,906,842,651円	1,318,806,706円
PF 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2014-09Q(適格機関投資家転売制限付)	860,094,019円	837,148,315円
PF 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2014-09Q-2(適格機関投資家向け)	2,729,554,116円	2,662,856,663円
PF 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2014-10(適格機関投資家転売制限付)	1,412,737,586円	1,375,628,852円
PF 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2014-11Q(適格機関投資家転売制限付)	637,879,240円	620,478,959円
PF 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2015-02Q(適格機関投資家転売制限付)	2,263,565,839円	1,792,057,965円
PF 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2015-03Q(適格機関投資家転売制限付)	779,756,570円	758,191,395円
PF 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2015-04Q(適格機関投資家転売制限付)	3,035,485,468円	1,839,391,003円
PF 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ80 2015-06Q(適格機関投資家向け)	3,103,761,116円	3,031,631,611円

P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70	20	1,398,021,424円	1,360,888,496円
15-09Q(適格機関投資家転売制限付)			
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ90	20	3,481,673,034円	3,398,939,495円
15-12Q(適格機関投資家向け)			
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ90	20	3,472,743,603円	3,394,323,429円
16-01Q(適格機関投資家向け)			
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70	20	2,725,160,460円	2,653,527,114円
16-04Q(適格機関投資家転売制限付)			
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ80	20	3,056,133,992円	2,984,169,645円
16-07Q(適格機関投資家向け)			
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70	20	2,726,065,659円	2,659,461,340円
16-10Q(適格機関投資家向け)			
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ80	20	3,105,493,134円	3,055,323,355円
17-06Q(適格機関投資家向け)			
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70	20	2,765,425,237円	2,690,204,581円
17-07Q(適格機関投資家向け)			
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ90	20	-円	3,434,689,486円
17-09Q(適格機関投資家向け)			
計		70,468,997,878円	76,630,624,911円
2. 受益権の総数		70,468,997,878口	76,630,624,911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 8月22日 至 平成29年 7月18日	自 平成29年 7月19日 至 平成30年 7月17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 7月18日現在	平成30年 7月17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 7月18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	241,947,580
地方債証券	123,399,402
特殊債券	86,593,509
合計	31,954,669

(平成30年 7月17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	936,193,562
地方債証券	39,935,371

特殊債券	488,688,016
合計	1,384,946,207

(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

(債券関連)

(平成29年 7月18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	債券先物取引				
	売建	6,492,288,091	-	6,503,513,350	11,225,259
	合計	6,492,288,091	-	6,503,513,350	11,225,259

(平成30年 7月17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	債券先物取引				
	売建	4,051,002,375	-	4,053,637,856	2,635,481
	合計	4,051,002,375	-	4,053,637,856	2,635,481

(注) 1.時価の算定方法

債券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.債券先物取引の残高は、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 7月18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	79,946,370,000	-	81,908,921,500	1,962,551,500
	米ドル	29,173,209,510	-	29,357,887,000	184,677,490
	ユーロ	32,149,134,690	-	33,481,134,500	1,331,999,810
	スウェーデンクローナ	18,624,025,800	-	19,069,900,000	445,874,200
合計		79,946,370,000	-	81,908,921,500	1,962,551,500

（平成30年 7月17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	95,849,221,770	-	97,739,189,209	1,889,967,439
	米ドル	18,779,117,560	-	19,376,457,000	597,339,440
	ユーロ	50,764,745,330	-	51,592,980,000	828,234,670
	英ポンド	10,754,202,569	-	10,824,293,321	70,090,752
スウェーデンクローナ	15,551,156,311	-	15,945,458,888	394,302,577	
合計		95,849,221,770	-	97,739,189,209	1,889,967,439

## （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 7月18日現在		平成30年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	1.2632円	1口当たり純資産額	1.2871円
(1万口当たり純資産額)	(12,632円)	(1万口当たり純資産額)	(12,871円)

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	2,400,000.00	2,377,780.80		
		US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	18,000,000.00	18,027,774.00		
		US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	8,000,000.00	8,054,064.00		
		国債証券小計		28,400,000.00	28,459,618.80 (3,199,999,537)	
	地方債証券	BRITISH COLUMBIA PROV OF-2.0%-22/10/23	2,000,000.00	1,919,538.00		
		BRITISH COLUMBIA PROV OF-2.25%-26/06/02	2,000,000.00	1,869,018.00		
		MANITOBA (PROVINCE OF)-3.05%-24/05/14	27,000,000.00	26,700,894.00		
		ONTARIO (PROVINCE OF)-2.45%-22/06/29	12,500,000.00	12,173,412.50		
		ONTARIO (PROVINCE OF)-3.2%-24/05/16	5,000,000.00	4,986,820.00		
		ONTARIO (PROVINCE OF)-2.5%-26/04/27	2,500,000.00	2,373,497.50		
		PROVINCE OF ALBERTA-2.05%-26/08/17	14,500,000.00	13,281,811.50		
		PROVINCE OF QUEBEC-2.5%-26/04/20	16,500,000.00	15,717,141.00		
		PROVINCE OF QUEBEC-2.75%-27/04/12	2,000,000.00	1,926,640.00		
		PROVINCE OF QUEBEC-7.5%-29/09/15	4,500,000.00	6,210,045.00		
		地方債証券小計	88,500,000.00	87,158,817.50 (9,800,137,439)		
	特殊債券	ASIAN DEVELOPMENT BANK-2.0%-25/01/22	7,500,000.00	7,079,850.00		
		ASIAN DEVELOPMENT BANK-2.0%-26/04/24	5,000,000.00	4,661,400.00		
		EUROPEAN INVESTMENT BANK-3.25%-24/01/29	10,000,000.00	10,128,520.00		
		INTER-AMERICAN DEVEL BK-4.375%-44/01/24	1,300,000.00	1,562,003.30		

		KFW-2.125%-23/01/17	2,000,000.00	1,933,752.00
		KFW-2.5%-24/11/20	5,000,000.00	4,859,725.00
		KOMMUNALBANKEN AS-2.125%-25/04/23	10,000,000.00	9,414,017.60
		LANDWIRTSCH. RENTENBANK-2.0%-25/01/13	4,000,000.00	3,770,200.00
		NEDER WATERSCHAPSBANK-2.375%-26/03/24	2,330,000.00	2,209,751.03
		TENN VALLEY AUTHORITY-2.875%-27/02/01	10,000,000.00	9,736,220.00
	特殊債券小計		57,130,000.00	55,355,438.93 (6,224,165,553)
米ドル小計			174,030,000.00	170,973,875.23 (19,224,302,529)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	73,170,000.00	96,546,132.09
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	27,000,000.00	28,303,398.00
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	11,000,000.00	11,251,372.00
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	28,000,000.00	41,087,516.40
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	20,000,000.00	20,256,500.00
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	8,000,000.00	8,193,040.00
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	2,300,000.00	2,301,269.60
		FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	5,000,000.00	5,281,425.00
		FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	25,000,000.00	31,297,025.00
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	5,000,000.00	5,075,910.00
		FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	23,500,000.00	24,593,925.00
		FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	33,000,000.00	39,793,512.00
		FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	20,000,000.00	20,295,400.00
		FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	13,000,000.00	13,122,980.00
		FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	26,500,000.00	31,710,774.50
		FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	5,600,000.00	9,262,850.80
ユーロ小計			326,070,000.00	388,373,030.39 (51,140,960,641)
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.5%-26/07/22	10,000,000.00	10,193,500.00
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	22,000,000.00	27,741,450.00
		UK TREASURY-1.625%-28/10/22	10,000,000.00	10,174,183.00
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	10,000,000.00	14,474,192.00
	国債証券小計		52,000,000.00	62,583,325.00 (9,313,024,593)
	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK-1.0%-26/09/21	10,000,000.00	9,543,860.00
	特殊債券小計		10,000,000.00	9,543,860.00 (1,420,221,806)
英ポンド小計			62,000,000.00	72,127,185.00 (10,733,246,399)
スウェーデンクローナ	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK-1.25%-25/05/12	200,000,000.00	206,828,400.00
		EUROPEAN INVESTMENT BANK-1.75%-26/11/12	302,000,000.00	320,547,934.00

	EUROPEAN INVESTMENT BANK-1.5%- 27/03/02	25,000,000.00	25,954,850.00	
	EUROPEAN INVESTMENT BANK-3.75%- 32/06/01	300,000,000.00	375,114,540.00	
	KOMMUNINVEST I SVERIGE-0.625%- 23/11/13	200,000,000.00	200,577,560.00	
	NORDIC INVESTMENT BANK-2.94%-31/10/17	100,000,000.00	117,680,200.00	
スウェーデンクローナ小計		1,127,000,000.00	1,246,703,484.00	(15,907,936,455)
合計			97,006,446,024	(97,006,446,024)

(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 3銘柄	16.6%	3.3%
	地方債証券 10銘柄	51.0%	10.1%
	特殊債券 10銘柄	32.4%	6.4%
ユーロ	国債証券 16銘柄	100.0%	52.7%
英ポンド	国債証券 4銘柄	86.8%	9.6%
	特殊債券 1銘柄	13.2%	1.5%
スウェーデンクローナ	特殊債券 6銘柄	100.0%	16.4%

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

#### インデックス マザーファンド リート

#### 貸借対照表

(単位:円)

	平成29年 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	2,398,431
コール・ローン	10,001,294	8,616,363
投資証券	2,921,262,200	3,090,662,940
派生商品評価勘定	-	754,092
未収配当金	22,242,489	24,552,088
差入委託証拠金	-	684,000

	平成29年 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
流動資産合計	2,953,505,983	3,127,667,914
資産合計	2,953,505,983	3,127,667,914
負債の部		
流動負債		
前受金	-	604,980
未払解約金	38,873	187,917
未払利息	16	15
流動負債合計	38,889	792,912
負債合計	38,889	792,912
純資産の部		
元本等		
元本	3,058,681,990	2,847,204,720
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	105,214,896	279,670,282
元本等合計	2,953,467,094	3,126,875,002
純資産合計	2,953,467,094	3,126,875,002
負債純資産合計	2,953,505,983	3,127,667,914

## 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>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>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 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
1. 期首	平成28年 8月22日	平成29年 7月19日
期首元本額	3,843,348,733円	3,058,681,990円
期首からの追加設定元本額	315,749,273円	111,141,783円
期首からの一部解約元本額	1,100,416,016円	322,619,053円
元本の内訳		

時間分散型バランスファンド(安定指向) 2016-08	68,898,095円	42,062,940円
時間分散型バランスファンド(成長指向) 2016-08	51,965,583円	22,537,223円
時間分散型バランスファンド(安定指向) 2016-11	54,212,523円	19,275,750円
時間分散型バランスファンド(成長指向) 2016-11	64,154,361円	28,509,835円
時間分散型バランスファンド(安定指向) 2017-02	14,107,454円	20,408,724円
時間分散型バランスファンド(成長指向) 2017-02	18,548,067円	21,502,475円
インデックス・Jリート・オープン(適格機関投資家向け)	-円	946,522円
インデックスファンドJリート 2015-03(適格機関投資家向け)	2,786,795,907円	2,691,961,251円
計	3,058,681,990円	2,847,204,720円
2. 受益権の総数	3,058,681,990口	2,847,204,720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	105,214,896円	-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 8月22日 至 平成29年 7月18日	自 平成29年 7月19日 至 平成30年 7月17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 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品            短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>(1)有価証券            同左</p> <p>(2)デリバティブ取引            「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品            同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（平成29年 7月18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
投資証券	219,367,100
合計	219,367,100

（平成30年 7月17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
投資証券	59,881,440
合計	59,881,440

(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 7月18日現在)

該当事項はありません。

(平成30年 7月17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	30,976,020	-	31,734,000	757,980
	合計	30,976,020	-	31,734,000	757,980

(注) 1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
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 7月18日現在		平成30年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	0.9656円	1口当たり純資産額	1.0982円
(1万口当たり純資産額)	(9,656円)	(1万口当たり純資産額)	(10,982円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	123	63,837,000	
	MCUBS MidCity投資法人 投資証券	413	33,246,500	
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	398	57,033,400	
	産業ファンド投資法人 投資証券	430	52,976,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	343	99,229,900	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	188	32,204,400	
	アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	167	85,838,000	
	GLP投資法人 投資証券	768	91,315,200	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	140	37,128,000	
	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	493	112,749,100	
	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	58	33,756,000	
	Oneリート投資法人 投資証券	40	10,288,000	
	イオンリート投資法人 投資証券	351	44,296,200	
	ヒューリックリート投資法人 投資証券	251	43,071,600	
	日本リート投資法人 投資証券	114	38,076,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	2,181	34,110,840	
	日本ヘルスケア投資法人 投資証券	18	3,096,000	
	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	927	67,114,800	
	トーセイ・リート投資法人 投資証券	60	6,876,000	
	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	135	33,250,500	
	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	46	5,156,600	
	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	64	6,278,400	
	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	1,095	172,243,500	
	いちごホテルリート投資法人 投資証券	58	8,218,600	
	ラサールロジポート投資法人 投資証券	279	30,662,100	
	スターアジア不動産投資法人 投資証券	87	9,570,000	
	マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	30	3,480,000	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	70	23,625,000	
	大江戸温泉リート投資法人 投資証券	62	5,456,000	
	さくら総合リート投資法人 投資証券	89	8,214,700	
	投資法人みらい 投資証券	54	10,389,600	
	森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	80	12,080,000	
	三菱地所物流リート投資法人 投資証券	34	9,156,200	
CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	37	4,099,600		
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	34	3,913,400		
日本ビルファンド投資法人 投資証券	358	226,614,000		



ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	368	218,960,000	
日本リートファンド投資法人 投資証券	699	141,897,000	
オリックス不動産投資法人 投資証券	734	129,257,400	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	234	95,355,000	
プレミア投資法人 投資証券	334	36,639,800	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	248	38,911,200	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	235	26,860,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	816	143,616,000	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	265	42,903,500	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	1,015	50,648,500	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	126	57,267,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	231	24,832,500	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	247	55,624,400	
福岡リート投資法人 投資証券	191	33,463,200	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	114	77,406,000	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	287	25,485,600	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	79	51,429,000	
阪急リート投資法人 投資証券	162	22,096,800	
スターツプロシード投資法人 投資証券	58	9,662,800	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	431	114,990,800	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	1,068	89,071,200	
日本賃貸住宅投資法人 投資証券	416	37,440,000	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	331	48,193,600	
合計	18,764	3,090,662,940	

(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

「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。

インデックス マザーファンド 海外先進国債券

## 貸借対照表

(単位：円)

	平成29年 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
資産の部		
流動資産		
預金	266,683	209,413
金銭信託	-	41,199
コール・ローン	289,736	148,008
国債証券	647,340,936	240,728,556

	平成29年 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
派生商品評価勘定	25,628	521
未収入金	5,634,468	2,188,089
未収利息	4,311,819	2,030,281
前払費用	1,724,456	70,278
流動資産合計	659,593,726	245,416,345
資産合計	659,593,726	245,416,345
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,720	310
未払解約金	5,505,012	343,528
流動負債合計	5,507,732	343,838
負債合計	5,507,732	343,838
純資産の部		
元本等		
元本	600,929,950	221,922,043
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	53,156,044	23,150,464
元本等合計	654,085,994	245,072,507
純資産合計	654,085,994	245,072,507
負債純資産合計	659,593,726	245,416,345

## 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 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
--	---------------	---------------

1.	期首	平成28年 8月22日	平成29年 7月19日
	期首元本額	127,420,538円	600,929,950円
	期首からの追加設定元本額	600,982,573円	111,133,148円
	期首からの一部解約元本額	127,473,161円	490,141,055円
	元本の内訳		
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-08	149,492,507円	67,932,168円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2016-08	78,177,174円	26,512,228円
	インデックスファンド海外先進国債券（適格機関投資家向け）	99,812,420円	4,960,403円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-11	116,357,977円	30,964,968円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2016-11	98,342,885円	33,600,858円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2017-02	29,729,645円	32,589,666円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2017-02	29,017,342円	25,361,752円
	計	600,929,950円	221,922,043円
2.	受益権の総数	600,929,950口	221,922,043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 8月22日 至 平成29年 7月18日	自 平成29年 7月19日 至 平成30年 7月17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 7月18日現在	平成30年 7月17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 7月18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	8,623,037
合計	8,623,037

(平成30年 7月17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	3,799,078
合計	3,799,078

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(平成29年 7月18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	5,707,843	-	5,684,935	22,908
	米ドル	2,346,151	-	2,327,010	19,141
	メキシコペソ	196,728	-	197,451	723
	ユーロ	2,277,724	-	2,271,984	5,740
	英ポンド	308,485	-	308,154	331
	デンマーククローネ	195,090	-	194,674	416
	ポーランドズロチ	183,416	-	184,320	904
	豪ドル	200,249	-	201,342	1,093
	合計	5,707,843	-	5,684,935	22,908

(平成30年 7月17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	2,007,383	-	2,007,172	211
	米ドル	899,464	-	899,280	184
	ユーロ	644,931	-	645,232	301
	英ポンド	297,591	-	297,600	9
	シンガポールドル	165,397	-	165,060	337
	合計	2,007,383	-	2,007,172	211

(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 7月18日現在		平成30年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	1.0885円	1口当たり純資産額	1.1043円
(1万口当たり純資産額)	(10,885円)	(1万口当たり純資産額)	(11,043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-1.625%-19/07/31	87,000.00	86,295.30	
		US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	187,000.00	186,963.53	
		US TREASURY N/B-2.0%-21/10/31	152,000.00	148,680.92	
		US TREASURY N/B-1.875%-22/03/31	56,000.00	54,340.77	
		US TREASURY N/B-1.625%-23/04/30	127,000.00	120,607.83	
		US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	59,000.00	57,569.95	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	87,000.00	79,832.67	
		US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	55,000.00	52,952.50	
		US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	8,000.00	9,757.81	
		US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	8,000.00	10,164.84	
		US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	61,000.00	58,842.36	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	79,000.00	72,072.09	

米ドル小計			966,000.00	938,080.57 (105,477,779)
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/09/01	9,000.00	8,992.26
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	19,000.00	19,657.59
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	11,000.00	11,094.49
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	4,000.00	3,636.64
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	5,000.00	7,256.55
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	6,000.00	7,588.74
加ドル小計			54,000.00	58,226.27 (4,984,168)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	120,000.00	116,268.58
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	80,000.00	89,175.07
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	100,000.00	105,313.91
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	30,000.00	31,697.34
メキシコペソ小計			330,000.00	342,454.90 (2,044,455)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	11,000.00	12,655.28
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	1,000.00	1,118.83
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	15,000.00	22,011.16
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	8,000.00	11,906.72
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	13,000.00	15,052.20
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%- 23/01/31	14,000.00	17,302.25
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	29,000.00	30,723.06
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	24,000.00	32,748.73
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	10,000.00	14,809.06
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 21/01/04	21,000.00	22,629.85
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	32,000.00	35,698.13
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	9,000.00	9,327.20
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	17,000.00	26,551.50
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	7,000.00	11,267.09
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	6,000.00	9,364.25
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	9,000.00	16,109.56
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 20/03/01	20,000.00	21,167.63

		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%-22/11/01	45,000.00	52,108.29	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-25/12/01	43,000.00	42,206.47	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	28,000.00	34,690.88	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-44/09/01	16,000.00	19,617.72	
		FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	9,000.00	11,385.92	
		FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	13,000.00	13,896.92	
		FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	44,000.00	49,553.24	
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	42,000.00	42,972.98	
		FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	18,000.00	27,132.97	
		FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	23,000.00	36,196.57	
		FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	13,000.00	21,183.44	
		IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	11,000.00	13,035.29	
		IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	1,000.00	1,039.51	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	3,000.00	3,250.55	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	11,000.00	12,164.39	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	16,000.00	16,169.53	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	6,000.00	9,618.97	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	14,000.00	18,942.09	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	5,000.00	7,650.14	
ユーロ小計			607,000.00	743,258.37 (97,872,262)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-2.0%-20/07/22	5,000.00	5,124.25	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	24,000.00	24,805.03	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	11,000.00	15,031.50	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	13,000.00	19,046.30	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	13,000.00	17,752.80	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	4,000.00	6,447.60	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	8,000.00	13,797.55	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	10,000.00	10,579.70	
英ポンド小計			88,000.00	112,584.73 (16,753,733)	
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	2,000.00	2,411.20	
スイスフラン小計			2,000.00	2,411.20 (271,935)	
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	40,000.00	43,435.86	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	30,000.00	31,760.68	
スウェーデンクローナ小計			70,000.00	75,196.54 (959,507)	



ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	41,000.00	42,269.55	
ノルウェークローネ小計			41,000.00	42,269.55 (587,546)	
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	63,000.00	70,682.22	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	8,000.00	13,823.02	
デンマーククローネ小計			71,000.00	84,505.24 (1,492,362)	
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25	17,000.00	17,066.30	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	21,000.00	23,901.15	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	12,000.00	11,526.00	
ポーランドズロチ小計			50,000.00	52,493.45 (1,605,774)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	23,000.00	25,318.04	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	23,000.00	23,236.54	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	11,000.00	13,255.09	
豪ドル小計			57,000.00	61,809.67 (5,151,835)	
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	8,000.00	8,364.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	2,000.00	2,068.00	
シンガポールドル小計			10,000.00	10,432.00 (861,057)	
マレーシアリングット	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	17,000.00	16,731.02	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	26,000.00	26,377.22	
マレーシアリングット小計			43,000.00	43,108.24 (1,198,409)	
南アフリカランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%-30/01/31	160,000.00	147,784.72	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%-40/01/31	26,000.00	24,687.03	
南アフリカランド小計			186,000.00	172,471.75 (1,467,734)	
合計				240,728,556 (240,728,556)	

(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 12銘柄	100.0%	43.8%
加ドル	国債証券 6銘柄	100.0%	2.1%

メキシコペソ	国債証券	4銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券	36銘柄	100.0%	40.7%
英ポンド	国債証券	8銘柄	100.0%	7.0%
スイスフラン	国債証券	1銘柄	100.0%	0.1%
スウェーデンクローナ	国債証券	2銘柄	100.0%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券	1銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	2銘柄	100.0%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券	3銘柄	100.0%	0.7%
豪ドル	国債証券	3銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	国債証券	2銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券	2銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券	2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。

## 先進国資本エマージング株式マザーファンド

### 貸借対照表

(単位:円)

	平成29年 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	-	28,712,859
金銭信託	-	32,030,388
コール・ローン	179,490,597	115,069,188
株式	7,149,453,872	18,620,483,023
派生商品評価勘定	15,253	-
未収入金	30,087,838	53,385,872
未収配当金	15,399,926	67,561,733
流動資産合計	7,374,447,486	18,917,243,063
<b>資産合計</b>	<b>7,374,447,486</b>	<b>18,917,243,063</b>
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	55,360	74,441
未払金	71,787,344	-
未払解約金	178,155,021	111,589,260
未払利息	290	213
流動負債合計	249,998,015	111,663,914
<b>負債合計</b>	<b>249,998,015</b>	<b>111,663,914</b>
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	5,559,587,877	15,505,362,614
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	1,564,861,594	3,300,216,535

	平成29年 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
元本等合計	7,124,449,471	18,805,579,149
純資産合計	7,124,449,471	18,805,579,149
負債純資産合計	7,374,447,486	18,917,243,063

## 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>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 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
1. 期首	平成28年 8月22日	平成29年 7月19日
期首元本額	254,752,035円	5,559,587,877円
期首からの追加設定元本額	5,665,991,202円	14,477,254,937円
期首からの一部解約元本額	361,155,360円	4,531,480,200円
元本の内訳		
スマート・ラップ・グローバル・インカム(毎月分配型)	34,353,405円	71,103,462円
スマート・ラップ・グローバル・インカム(1年決算型)	33,093,019円	66,104,689円
先進国資本エマージング株式ファンド(1年決算型)	5,416,074,092円	11,753,115,494円
先進国資本エマージング株式ファンド(年2回決算型)	24,234,447円	37,598,696円
時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-08	11,346,453円	5,837,117円

時間分散型バランスファンド（成長指向）2016-08	11,112,916円	4,362,048円
時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-11	8,936,931円	2,709,957円
時間分散型バランスファンド（成長指向）2016-11	13,992,795円	5,819,720円
時間分散型バランスファンド（安定指向）2017-02	2,244,083円	2,742,224円
時間分散型バランスファンド（成長指向）2017-02	4,199,736円	4,196,575円
グローバル・メガピース 計	- 円 5,559,587,877円	3,551,772,632円 15,505,362,614円
2. 受益権の総数	5,559,587,877口	15,505,362,614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 8月22日 至 平成29年 7月18日	自 平成29年 7月19日 至 平成30年 7月17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 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

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

(有価証券に関する注記)

(平成29年 7月18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	268,370,219
合計	268,370,219

(平成30年 7月17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	217,414,296
合計	217,414,296

(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 7月18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	66,210,754	-	66,203,763	6,991
	米ドル	26,979,576	-	26,980,800	1,224
	メキシコペソ	12,406,300	-	12,396,600	9,700
	トルコリラ	4,873,968	-	4,869,990	3,978
	ポーランドズロチ	11,862,436	-	11,857,920	4,516
	マレーシアリンギット	6,055,695	-	6,056,388	693
	フィリピンペソ	4,032,779	-	4,042,065	9,286
	売建	21,636,729	-	21,669,845	33,116
	香港ドル	11,668,050	-	11,664,000	4,050
	インドネシアルピア	2,470,286	-	2,494,645	24,359
	韓国ウォン	7,498,393	-	7,511,200	12,807
	合計		87,847,483	-	87,873,608

（平成30年 7月17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	5,865,780	-	5,940,221	74,441
	インドネシアルピア	5,865,780	-	5,940,221	74,441
合計		5,865,780	-	5,940,221	74,441

## （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 7月18日現在		平成30年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	1.2815円	1口当たり純資産額	1.2128円
(1万口当たり純資産額)	(12,815円)	(1万口当たり純資産額)	(12,128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	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	6,925	151.10	1,046,367.50	
	ROSNEFT PJSC-REG S GDR	189,681	6.46	1,226,477.34	
	51JOB INC-ADR	26,700	90.45	2,415,015.00	
	BANCO SANTANDER MEXICO -ADR	365,126	7.82	2,855,285.32	
	BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	124,535	31.50	3,922,852.50	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP-ADR	21,367	190.35	4,067,208.45	
	TELEF BRASIL-ADR	217,900	11.53	2,512,387.00	
	TIM PARTICIPACOES SA-ADR	197,746	17.22	3,405,186.12	
	ENEL AMERICAS SA-SPONS ADR	316,054	8.51	2,689,619.54	
	ENEL CHILE SA-ADR	863,917	5.21	4,501,007.57	
米ドル小計		2,329,951		28,641,406.34 (3,220,439,728)	
メキシコペソ	WALMART DE MEXICO -SER V	1,343,200	52.53	70,558,296.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	753,900	90.98	68,589,822.00	
メキシコペソ小計		2,097,100		139,148,118.00 (830,714,264)	
ブラジルリアル	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	583,000	14.56	8,488,480.00	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	192,000	23.50	4,512,000.00	
	ENGIE BRASIL SA	242,600	36.21	8,784,546.00	

ブラジルリアル小計		1,017,600		21,785,026.00 (634,379,957)
チリペソ	EMBOTELLADORA ANDINA-PRF B	201,627	2,422.80	488,501,895.60
	AGUAS ANDINAS SA-A	2,925,478	361.49	1,057,531,042.22
チリペソ小計		3,127,105		1,546,032,937.82 (267,309,094)
ユーロ	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	159,300	10.89	1,734,777.00
ユーロ小計		159,300		1,734,777.00 (228,435,435)
トルコリラ	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	124,500	10.14	1,262,430.00
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	228,132	24.78	5,653,110.96
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	67,784	58.90	3,992,477.60
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	160,100	21.54	3,448,554.00
	COCA-COLA ICECEK URETIM AS	59,560	29.44	1,753,446.40
	TURKIYE GARANTI BANKASI	996,050	6.67	6,643,653.50
トルコリラ小計		1,636,126		22,753,672.46 (526,975,054)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	107,523	943.00	101,394,189.00
チェココルナ小計		107,523		101,394,189.00 (516,096,422)
ポーランドズロチ	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	25,738	71.60	1,842,840.80
	BANK ZACHODNI WBK SA	35,025	330.20	11,565,255.00
ポーランドズロチ小計		60,763		13,408,095.80 (410,153,650)
香港ドル	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	1,228,000	4.70	5,771,600.00
	SINOTRUK HONG KONG LTD	1,280,000	11.66	14,924,800.00
	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	600,000	8.76	5,256,000.00
	BAIC MOTOR CORP LTD-H	2,296,000	6.52	14,969,920.00
	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	447,000	22.40	10,012,800.00
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	1,430,000	11.22	16,044,600.00
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	3,636,000	5.53	20,107,080.00
	PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,886,000	3.45	6,506,700.00
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	230,000	42.95	9,878,500.00
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	1,450,000	9.83	14,253,500.00
	TOWNGAS CHINA CO LTD	2,350,000	7.99	18,776,500.00
香港ドル小計		16,833,000		136,502,000.00 (1,956,073,660)
マレーシアリンギット	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	237,700	33.10	7,867,870.00
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	92,400	148.10	13,684,440.00
	IHH HEALTHCARE BHD	1,565,000	6.01	9,405,650.00
	AMMB HOLDINGS BHD	1,246,500	3.95	4,923,675.00
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	1,032,300	5.66	5,842,818.00
		4,173,900		41,724,453.00



マレーシアリングット小計				(1,159,939,793)
タイバーツ	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	20,747,000	2.48	51,452,560.00
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	751,000	63.25	47,500,750.00
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	676,800	93.50	63,280,800.00
タイバーツ小計		22,174,800		162,234,110.00 (548,351,291)
フィリピンペソ	SECURITY BANK CORP	512,610	212.00	108,673,320.00
	AYALA CORPORATION	33,340	971.50	32,389,810.00
フィリピンペソ小計		545,950		141,063,130.00 (296,232,573)
インドネシアルピア	HM SAMPOERNA TBK PT	16,039,400	3,770.00	60,468,538,000.00
	PT UNILEVER INDONESIA TBK	1,694,100	45,750.00	77,505,075,000.00
インドネシアルピア小計		17,733,500		137,973,613,000.00 (1,089,991,542)
韓国ウォン	HYUNDAI STEEL CO	25,825	48,550.00	1,253,803,750.00
	POSCO	4,647	315,000.00	1,463,805,000.00
	S1 CORPORATION	14,711	99,300.00	1,460,802,300.00
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	37,973	45,150.00	1,714,480,950.00
韓国ウォン小計		83,156		5,892,892,000.00 (588,110,621)
台湾ドル	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	55,000	273.00	15,015,000.00
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	420,000	99.40	41,748,000.00
	PHISON ELECTRONICS CORP	51,000	238.50	12,163,500.00
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	498,000	87.30	43,475,400.00
台湾ドル小計		1,024,000		112,401,900.00 (413,638,992)
インドルピー	PETRONET LNG LTD	531,000	207.20	110,023,200.00
	AMBUJA CEMENTS LIMITED	1,142,192	190.55	217,644,685.60
	JSW STEEL LTD	194,298	307.65	59,775,779.70
	SIEMENS INDIA LIMITED	214,525	953.25	204,495,956.25
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	40,948	9,385.30	384,309,264.40
	MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	290,355	283.75	82,388,231.25
	ITC LTD	449,706	271.60	122,140,149.60
	NESTLE INDIA LIMITED	37,048	10,200.70	377,915,533.60
	HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	250,615	1,751.25	438,889,518.75
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	97,700	1,212.25	118,436,825.00
	BHARTI AIRTEL LTD	362,136	347.40	125,806,046.40
インドルピー小計		3,610,523		2,241,825,190.55 (3,699,011,564)
南アフリカランド	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	138,500	368.09	50,980,465.00
	KUMBA IRON ORE LTD	146,857	293.00	43,029,101.00
	ABSA GROUP LTD	53,186	156.08	8,301,270.88
	NEDBANK GROUP LTD	117,266	253.05	29,674,161.30

	VODACOM GROUP LTD	271,962	124.84	33,951,736.08
南アフリカランド小計		727,771		165,936,734.26 (1,412,121,608)
香港・オフショア人民元	HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	1,144,921	26.74	30,615,187.54
	BANK OF BEIJING CO LTD -A	1,019,914	5.71	5,823,708.94
	BANK OF NANJING CO LTD -A	719,921	7.57	5,449,801.97
	BANK OF NINGBO CO LTD -A	444,972	16.02	7,128,451.44
香港・オフショア人民元小計		3,329,728		49,017,149.89 (822,507,775)
合 計		80,771,796		18,620,483,023 (18,620,483,023)

(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

該当事項はありません。

## 外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 10銘柄	100.0%	17.3%
メキシコペソ	株式 2銘柄	100.0%	4.5%
ブラジルレアル	株式 3銘柄	100.0%	3.4%
チリペソ	株式 2銘柄	100.0%	1.4%
ユーロ	株式 1銘柄	100.0%	1.2%
トルコリラ	株式 6銘柄	100.0%	2.8%
チェココルナ	株式 1銘柄	100.0%	2.8%
ポーランドズロチ	株式 2銘柄	100.0%	2.2%
香港ドル	株式 11銘柄	100.0%	10.5%
マレーシアリングット	株式 5銘柄	100.0%	6.2%
タイバーツ	株式 3銘柄	100.0%	2.9%
フィリピンペソ	株式 2銘柄	100.0%	1.6%
インドネシアルピア	株式 2銘柄	100.0%	5.9%
韓国ウォン	株式 4銘柄	100.0%	3.2%
台湾ドル	株式 4銘柄	100.0%	2.2%
インドルピー	株式 11銘柄	100.0%	19.9%
南アフリカランド	株式 5銘柄	100.0%	7.6%
香港・オフショア人民元	株式 4銘柄	100.0%	4.4%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

インデックス マザーファンド コモディティ

## 貸借対照表

	（単位：円）	
	平成29年 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	497,234	1,049
金銭信託	-	9,255
コール・ローン	372,157	33,250
投資信託受益証券	53,132,406	8,079,527
派生商品評価勘定	1,132	-
流動資産合計	54,002,929	8,123,081
<b>資産合計</b>	<b>54,002,929</b>	<b>8,123,081</b>
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	822,565	-
流動負債合計	822,565	-
<b>負債合計</b>	<b>822,565</b>	<b>-</b>
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	50,635,353	7,944,959
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,545,011	178,122
元本等合計	53,180,364	8,123,081
<b>純資産合計</b>	<b>53,180,364</b>	<b>8,123,081</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>54,002,929</b>	<b>8,123,081</b>

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

	適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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 7月18日現在	平成30年 7月17日現在
1.	期首	平成28年 8月22日	平成29年 7月19日
	期首元本額	2,906,554円	50,635,353円
	期首からの追加設定元本額	56,222,333円	10,517,004円
	期首からの一部解約元本額	8,493,534円	53,207,398円
	元本の内訳		
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-08	9,544,859円	1,578,915円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2016-08	12,003,036円	1,502,171円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-11	7,612,049円	738,439円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2016-11	15,032,805円	1,977,138円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2017-02	1,894,433円	735,891円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2017-02	4,548,171円	1,412,405円
	計	50,635,353円	7,944,959円
2.	受益権の総数	50,635,353口	7,944,959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 8月22日 至 平成29年 7月18日	自 平成29年 7月19日 至 平成30年 7月17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 7月18日現在	平成30年 7月17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 該当事項はありません。 (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 7月18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
投資信託受益証券	5,024,653
合計	5,024,653

（平成30年 7月17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
投資信託受益証券	77,732
合計	77,732

(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 7月18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	498,366	-	497,234	1,132
	ユーロ	498,366	-	497,234	1,132
	合計	498,366	-	497,234	1,132

（注）1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（平成30年 7月17日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成29年 7月18日現在		平成30年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	1.0503円	1口当たり純資産額	1.0224円
(1万口当たり純資産額)	(10,503円)	(1万口当たり純資産額)	(10,224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
ユーロ	投資信託受益証券	ISH DIV COMDTY SWAP DE-ETF	3,432	61,357.29	
ユーロ小計			3,432	61,357.29 (8,079,527)	
合計				8,079,527 (8,079,527)	

(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	組入投資信託 受益証券時価比率	合計金額に 対する比率
ユーロ	投資信託受益証券 1銘柄	100.0%	100.0%

### 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。



## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2018年 7月31日現在です。

### 【時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-08】

#### 【純資産額計算書】

資産総額	524,569,473円
負債総額	7,618,370円
純資産総額( - )	516,951,103円
発行済口数	496,439,291口
1口当たり純資産額( / )	1.0413円

(参考)

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)

#### 純資産額計算書

資産総額	274,027,984円
負債総額	2,241,079円
純資産総額( - )	271,786,905円
発行済口数	192,314,981口
1口当たり純資産額( / )	1.4132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	88,142,003,944円
負債総額	27,221,693円
純資産総額( - )	88,114,782,251円
発行済口数	35,183,100,636口
1口当たり純資産額( / )	2.5045円

インデックスファンド海外先進国リート(適格機関投資家向け)

#### 純資産額計算書

資産総額	128,377,205円
負債総額	820,947円
純資産総額（ - ）	127,556,258円
発行済口数	114,352,883口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1155円

## 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	6,499,498,651円
負債総額	1,495,547円
純資産総額（ - ）	6,498,003,104円
発行済口数	3,216,365,828口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0203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）

## 純資産額計算書

資産総額	25,787,686円
負債総額	267,958円
純資産総額（ - ）	25,519,728円
発行済口数	22,865,014口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1161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	3,944,035,187円
負債総額	12,762,567円
純資産総額（ - ）	3,931,272,620円
発行済口数	3,068,517,549口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2812円

## FOFs用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

## 純資産額計算書

資産総額	2,324,550,534円
負債総額	1,734,100円
純資産総額( - )	2,322,816,434円
発行済口数	2,493,438,130口
1口当たり純資産額( / )	0.9316円

## ゴールド・マザーファンド

### 純資産額計算書

資産総額	77,720,104,318円
負債総額	215,540,672円
純資産総額( - )	77,504,563,646円
発行済口数	89,236,310,983口
1口当たり純資産額( / )	0.8685円

## インデックス マザーファンド TOPIX

### 純資産額計算書

資産総額	42,393,600,668円
負債総額	166,623,205円
純資産総額( - )	42,226,977,463円
発行済口数	19,782,888,818口
1口当たり純資産額( / )	2.1345円

## ソブリン(円ヘッジ)マザーファンド

### 純資産額計算書

資産総額	102,148,806,947円
負債総額	3,851,121,569円
純資産総額( - )	98,297,685,378円
発行済口数	76,851,596,691口
1口当たり純資産額( / )	1.2791円

## インデックス マザーファンド Jリート

### 純資産額計算書

資産総額	3,157,223,475円
負債総額	43,480,874円
純資産総額（ - ）	3,113,742,601円
発行済口数	2,842,329,806口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0955円

## インデックス マザーファンド 海外先進国債券

## 純資産額計算書

資産総額	232,373,735円
負債総額	287,147円
純資産総額（ - ）	232,086,588円
発行済口数	214,273,690口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0831円

## 先進国資本エマージング株式マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	18,902,861,755円
負債総額	3,809,923円
純資産総額（ - ）	18,899,051,832円
発行済口数	15,457,562,060口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2226円

## インデックス マザーファンド コモディティ

## 純資産額計算書

資産総額	8,161,865円
負債総額	30,875円
純資産総額（ - ）	8,130,990円
発行済口数	7,878,052口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0321円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1) 名義書換

受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券

から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求を行なわないものとします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額

2018年7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（2018年7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（2018年7月末現在）

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

### 2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、2018年7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	812	180,056

株式投資信託	770	152,822
単位型	232	8,569
追加型	538	144,252
公社債投資信託	42	27,234
単位型	28	479
追加型	14	26,754

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。)並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第59期事業年度(平成29年4月1日から平成30年3月31日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### (1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第58期 (平成29年3月31日)		第59期 (平成30年3月31日)	
<b>資産の部</b>				
<b>流動資産</b>				
現金・預金	3	16,761	3	14,024
金銭の信託	3	152		-
有価証券		10		19
前払費用		506		551
未収入金		136		73
未収委託者報酬		10,757		15,873
未収収益	3	2,799	3	3,174
関係会社短期貸付金		962		1,128
立替金		1,240		2,776
繰延税金資産		865		1,014
その他	2,3	385	2,3	4,179
流動資産合計		34,577		42,814
<b>固定資産</b>				
<b>有形固定資産</b>				
建物	1	93	1	68
器具備品	1	190	1	122
有形固定資産合計		283		191
<b>無形固定資産</b>				
ソフトウェア		138		99
無形固定資産合計		138		99
<b>投資その他の資産</b>				
投資有価証券		11,783		14,103
関係会社株式		23,203		25,769
関係会社長期貸付金		60		-
長期差入保証金		782		490

長期前払費用	0	0
繰延税金資産	423	489
投資その他の資産合計	36,253	40,854
固定資産合計	36,674	41,144
資産合計	71,252	83,959

(単位：百万円)

	第58期 (平成29年3月31日)	第59期 (平成30年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	3 589	3 3,804
未払金	4,043	5,874
未払収益分配金	7	7
未払償還金	91	91
未払手数料	3 3,499	3 5,124
その他未払金	445	651
未払費用	3 4,229	3 4,634
未払法人税等	1,808	2,185
未払消費税等	4 538	4 788
賞与引当金	2,077	2,286
役員賞与引当金	168	198
その他	3 62	41
流動負債合計	13,517	19,813
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	1,259	1,316
その他	-	318
固定負債合計	1,259	1,634
負債合計	14,777	21,448
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
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	34,015	39,959
利益剰余金合計	34,015	39,959
自己株式	672	786
株主資本合計	55,926	61,756
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	282	408
繰延ヘッジ損益	266	346
評価・換算差額等合計	548	754
純資産合計	56,475	62,511



負債純資産合計	71,252	83,959
---------	--------	--------

## (2) 【損益計算書】

	(単位：百万円)	
	第58期	第59期
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	64,680	70,609
その他営業収益	4,218	5,398
営業収益合計	68,898	76,008
営業費用		
支払手数料	28,675	30,448
広告宣伝費	969	973
公告費	2	2
調査費	17,322	18,132
調査費	841	862
委託調査費	16,456	17,241
図書費	24	28
委託計算費	498	520
営業雑経費	656	740
通信費	185	173
印刷費	276	348
協会費	66	68
諸会費	17	24
その他	111	125
営業費用計	48,124	50,817
一般管理費		
給料	8,243	9,096
役員報酬	360	507
役員賞与引当金繰入額	168	198
給料・手当	5,576	6,083
賞与	61	20
賞与引当金繰入額	2,077	2,286
交際費	99	99
寄付金	17	16
旅費交通費	412	455
租税公課	375	424
不動産賃借料	889	890
退職給付費用	390	355
退職金	20	24
固定資産減価償却費	192	152
福利費	959	974
諸経費	2,791	3,175
一般管理費計	14,394	15,664
営業利益	6,380	9,526

	(単位：百万円)	
	第58期	第59期
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

営業外収益				
受取利息		19		26
受取配当金	1	1,644	1	1,120
有価証券償還益		-		1
時効成立分配金・償還金		22		1
為替差益		177		79
その他		36		41
営業外収益合計		1,899		1,272
営業外費用				
支払利息	1	223	1	223
有価証券償還損		7		-
デリバティブ費用	1	146	1	295
時効成立後支払分配金・償還金		2		0
支払源泉所得税		155		-
長期差入保証金償却額		-		212
その他		73		34
営業外費用合計		608		767
経常利益		7,670		10,030
特別利益				
投資有価証券売却益		174		199
特別利益合計		174		199
特別損失				
投資有価証券売却損		120		133
固定資産処分損		13		7
役員退職一時金		-		117
損害賠償損失		-		81
特別損失合計		134		340
税引前当期純利益		7,710		9,890
法人税、住民税及び事業税		2,137		3,217
過年度法人税等	2	115		-
法人税等調整額		104		307
法人税等合計		2,147		2,910
当期純利益		5,562		6,979

## (3) 【株主資本等変動計算書】

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						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	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

第59期（自 平成29年4月1日 至 平成30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	34,015	34,015	672	55,926
当期変動額							
剰余金の配当				1,036	1,036		1,036
当期純利益				6,979	6,979		6,979
自己株式の取得						113	113
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計				5,943	5,943	113	5,830
当期末残高	17,363	5,220	5,220	39,959	39,959	786	61,756

	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
当期変動額				
剰余金の配当				1,036
当期純利益				6,979
自己株式の取得				113
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	125	80	206	206
当期変動額合計	125	80	206	6,036

当期末残高	408	346	754	62,511
-------	-----	-----	-----	--------

## [注記事項]

## (重要な会計方針)

項目	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(2) 金銭の信託 時価法</p> <p>(3) デリバティブ 時価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 3年～15年 器具備品 5年～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p>

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

## (貸借対照表関係)

<p>第58期 (平成29年3月31日)</p>	<p>第59期 (平成30年3月31日)</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>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,260百万円</p> <p>器具備品 612百万円</p>
<p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>	<p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち3,030百万円は、「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>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 3,189百万円</p> <p>未収収益 592百万円</p> <p>その他 345百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>預り金 419百万円</p> <p>未払手数料 376百万円</p> <p>未払費用 677百万円</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>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>	<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553百万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103百万円に対して保証を行っております。</p>

## (損益計算書関係)

<p>第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)</p>	<p>第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30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。	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。
受取配当金 1,550百万円	受取配当金 979百万円
デリバティブ収益 347百万円	デリバティブ収益 407百万円
支払利息 58百万円	支払利息 213百万円
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。	

## (株主資本等変動計算書関係)

第58期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	814,100	305,000	-	1,119,100

## 3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
平成21年度ストックオプション(1)	普通株式	1,762,200	-	72,600	1,689,600	-
平成21年度ストックオプション(2)	普通株式	174,900	-	-	174,900	-
平成23年度ストックオプション(1)	普通株式	4,738,800	-	1,848,000	2,890,800	-
平成28年度ストックオプション(1)	普通株式	-	4,437,000	33,000	4,404,000	-
合計		6,675,900	4,437,000	1,953,600	9,159,300	-

(注)1 平成28年度ストックオプション(1)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。

2 当事業年度の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

3 平成21年度ストックオプション(1)1,689,600株、平成21年度ストックオプション(2)174,900株及び平成23年度ストックオプション(1)2,890,800株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成28年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来していません。

## 4 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年5月25日取締役会	普通株式	利益剰余金	1,036	5.29	平成29年3月31日	平成29年6月22日

## 第59期（自 平成29年4月1日 至 平成30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）	1,119,100	182,600	-	1,301,700

## 3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
平成21年度ストックオプション(1)	普通株式	1,689,600	-	194,700	1,494,900	-
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	-	204,600	2,686,200	-
平成28年度ストックオプション(1)	普通株式	4,404,000	-	786,000	3,618,000	-
平成28年度ストックオプション(2)	普通株式	-	4,409,000	532,000	3,877,000	-
合計		9,159,300	4,409,000	1,783,300	11,785,000	-

(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 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)1,494,900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)2,686,200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)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30年5月31日取締役会	普通株式	利益剰余金	1,640	8.38	平成30年3月31日	平成30年6月23日

## (リース取引関係)

第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
オペレーティング・リース取引	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		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	866百万円
1年超	1,787百万円	1年超	923百万円
合計	2,653百万円	合計	1,790百万円

## (金融商品関係)

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

## 1 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

## 市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

当社は、原則、有価証券及び投資有価証券以外の為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また、有価証券及び投資有価証券に関しては、一部について、為替変動リスクや価格変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益(ヘッジ対象の有価証券及び投資有価証券は、ヘッジ損益考慮後の評価損



益)を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュ - ・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベ - 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 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

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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す。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシ・ドマネ・の投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針」4「ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

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

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

###### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

## 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

## 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

平成30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	14,024	14,024	-
(2) 未収委託者報酬	15,873	15,873	-
(3) 未収収益	3,174	3,174	-
(4) 関係会社短期貸付金	1,128	1,128	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	14,106	14,106	-
(6) 未払金	(5,874)	(5,874)	-
(7) 未払費用	(4,634)	(4,634)	-
(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	(14)	(14)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	336	336	-
デリバティブ取引計	321	321	-

( 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うち8百万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。また、ヘッジ会計が適用されているものは貸借対照表上流動資産のその他に含まれております。

- 2 非上場株式等（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22,876百万円）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	14,024	-	-	-
未収委託者報酬	15,873	-	-	-
未収収益	3,174	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	19	616	1,743	545
合計	33,090	616	1,743	545

#### （有価証券関係）

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

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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	22,876
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	8,544	7,535	1,008
	小計	8,544	7,535	1,008
貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの	投資信託	5,561	5,982	420
	小計	5,561	5,982	420
合計		14,106	13,518	588

- (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	2,792	199	133
合計	2,792	199	133

## (デリバティブ取引関係)

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				
	米ドル	投資	2,993	-	11
	豪ドル	有価証券	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。

第59期(平成30年3月31日)

## 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	2,422	-	14	14
	買建	-	-	-	-
合計		2,422	-	14	14

(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		4,447	-	196
	豪ドル		109	-	10
	シンガポールドル		1,783	-	65
	香港ドル		541	-	25
	人民元		2,156	-	32
	ユーロ		154	-	6
	合計		9,192	-	336

## (注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (持分法損益等)

第58期 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)	第59期 (自 平成29年 4月 1日 至 平成30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 3,030	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,008
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 9,455	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 10,409
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,092	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,827

## (退職給付関係)

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。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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	1,190
勤務費用	130
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	66
退職給付の支払額	76
退職給付債務の期末残高	1,313

## (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	1,313
未積立退職給付債務	1,313
未認識数理計算上の差異	2
貸借対照表に計上された負債の額	1,316

退職給付引当金	1,316
貸借対照表に計上された負債の額	1,316

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	130
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	0
確定給付制度に係る退職給付費用	132



## (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、222百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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

	平成28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	31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	4,409,000株
付与日	平成29年4月27日	
権利確定条件	平成31年4月27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	
権利行使期間	平成31年4月27日から 平成39年4月30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	1,689,600	174,900
付与	0	0
失効	194,700	66,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,494,900	108,900
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	2,890,800	4,404,000
付与	0	0
失効	204,600	786,000
権利確定	0	0
権利未確定残	2,686,200	3,618,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-

権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

平成28年度ストックオプション(2)	
付与日	平成29年4月27日
権利確定前(株)	
期首	-
付与	4,409,000
失効	532,000
権利確定	0
権利未確定残	3,877,000
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

平成28年度ストックオプション(2)	
付与日	平成29年4月27日
権利行使価格(円)	553
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	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tockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額  
当事業年度末における本源的価値の合計額 1,149百万円
- 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に調整される。)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58期 (平成29年3月31日)		第59期 (平成30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 641		賞与引当金 700
	その他 224		その他 314
	小計 865		小計 1,014
	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 385		退職給付引当金 402
	固定資産減価償却費 119		固定資産減価償却費 111
	その他 63		その他 211
	小計 2,095		小計 2,253
	繰延税金資産小計 2,961		繰延税金資産小計 3,268
	評価性引当金 1,430		評価性引当金 1,430
	繰延税金資産合計 1,530		繰延税金資産合計 1,838
	繰延税金負債(流動)		繰延税金負債(流動)
	その他有価証券評価差額金 0		その他有価証券評価差額金 -
	小計 0		小計 -
	繰延税金負債(固定)		繰延税金負債(固定)
	その他有価証券評価差額金 123		その他有価証券評価差額金 180
	繰延ヘッジ利益 117		繰延ヘッジ利益 152
	小計 241		小計 333
	繰延税金負債合計 242		繰延税金負債合計 333
	繰延税金資産の純額 1,288		繰延税金資産の純額 1,504
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 30.9% (調整)		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の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。
	交際費等永久に損金に算入されない項目 0.6%		
	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 5.3%		
	過年度法人税等 1.5%		
	海外子会社の留保利益の影響額等 0.2%		
	税効果会計適用後の法人税等の負担率 27.9%		

## ( 関連当事者情報 )

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 (シンガポールドル貨建) (注1)	65 (SGD 800 千) (注2)	関係会社 短期貸付 金	385 (SGD 4,800千)
							貸付金利息 (シンガポールドル貨建) (注1)	13 (SGD 177 千)	未収収益	8 (SGD 105千)
							資金の貸付 (円貨建) (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

- 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 資金の貸付に係る取引金額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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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	342,369 (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)	159 (SGD 2,000千) (注2)	関係会社 短期貸付 金	550 (SGD 6,800千)
							貸付金利息 (シンガポールドル貸建) (注1)	13 (SGD 162千)	未収収益	8 (SGD 110千)
							資金の貸付 (円貸建) (注3)	-	関係会社 短期貸付 金	577
							貸付金利息 (円貸建) (注3)	12	未収収益	3
						-	増資の引受 (注4)	2,466 (SGD 30,369千)	-	-
子会社	日本インスティテューショナル証券設立準備株式会社	日本	100 (百万円)	金融商品取引業者として登録を受けるための準備会社	直接 100.00	-	増資の引受 (注5)	100	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 資金の貸付に係る取引金額159百万円（SGD2,000千）の内訳は、貸付159百万円（SGD2,000千）であります。
- 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。
- Nikko Asset Management International Limitedの行った30,369,000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。
- 日本インスティテューショナル証券設立準備株式会社の行った2,000株の新株発行を、1株につき50千円で当社が引受けたものであります。

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記



## (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社(非上場)

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成29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	27,012百万円
負債合計	5,141百万円
純資産合計	21,871百万円

営業収益	15,830百万円
税引前当期純利益	5,266百万円
当期純利益	3,594百万円

## (セグメント情報等)

## セグメント情報

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。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

## 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	288円29銭	319円40銭
1株当たり当期純利益金額	28円38銭	35円64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58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
当期純利益(百万円)	5,562	6,979
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)	5,562	6,979
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,009	195,794
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) 1,689,600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	平成21年度ストックオプション(1) 1,494,900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) 2,686,200株、平成28年度ストックオプション(1) 3,618,000株、平成28年度ストックオプション(2) 3,877,000株

### 3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第58期 (平成29年3月31日)	第59期 (平成30年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	56,475	62,511
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)	56,475	62,511
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)	195,893	195,711

#### (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30年3月15日付の臨時株主総会及び平成30年3月20日開催の取締役会の決議に基づき、平成30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36名に付与いたしました。

新株予約権の数	4,422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 4,422,000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694円
新株予約権の行使期間	平成32年4月27日から平成40年4月30日まで

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記(3)、(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

## 5【その他】

### (1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2018年3月末現在)	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	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。

#### < 再信託受託会社の概要 >

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額 : 51,000百万円(2018年3月末現在)

事業の内容 : 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。

再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託業務の一部(信託財産の管理)を原信託受託者から再信託受託者(日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

#### (2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2018年3月末現在)	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	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。

#### (3) 投資顧問会社

名 称	資本金の額 (2018年3月末現在)	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

### (2) 販売会社

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

### (3) 投資顧問会社

投資対象とする別に定める投資信託証券のうち、各投資信託証券（マザーファンドを含みます。）への投資比率についての投資助言を行いません。

## 3【資本関係】

### (1) 受託会社

三井住友信託銀行株式会社は、日興アセットマネジメント株式会社の発行済株式総数の91.29%を保有しております。（2018年3月末現在）

### (2) 販売会社

三井住友信託銀行株式会社は、日興アセットマネジメント株式会社の発行済株式総数の91.29%を保有しております。（2018年3月末現在）

### (3) 投資顧問会社

三井住友信託銀行株式会社は、日興アセットマネジメント株式会社の発行済株式総数の91.29%を保有しております。（2018年3月末現在）

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2017年10月18日	有価証券報告書
2018年 4月18日	半期報告書

## 独立監査人の監査報告書

平成30年6月15日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 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30年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成30年8月22日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

### P w Cあらた有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-08の平成29年7月19日から平成30年7月17日までの計算期間の財務諸表、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、時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-08の平成30年7月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算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。