【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】	2019年10月25日提出
【計算期間】	第9期(自 2018年7月26日至 2019年7月25日)
【ファンド名】	インデックスコレクション（バランス株式３０） インデックスコレクション（バランス株式５０） インデックスコレクション（バランス株式７０）
【発行者名】	三井住友トラスト・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 菱田　賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目１番１号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長　民野　誠
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目１番１号
【電話番号】	03-6453-3610
【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＞

当ファンドは、確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、長期的な信託財産の成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。

＜信託金限度額＞

各ファンドについて、1兆円を上限とします。

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜基本的性格＞

一般社団法人投資信託協会が定める分類方法における、当ファンドの商品分類及び属性区分は下記の通りです。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 （収益の源泉）	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	ＭＭＦ	インデックス型
追加型	海外	債券	ＭＲＦ	特殊型
	内外	不動産投信	ＥＴＦ	
		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。

属性区分表

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	対象 インデックス	特殊型

株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券（資産複合（株式、債券）資産配分固定型）） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　）	グローバル （日本を含む） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東（中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり （　）	日経225 ＴＯＰＩＸ その他 （　　）	ブル・ベア型 条件付運用型 ロング・ショート型/絶対収益追求型 その他 （　　）

（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。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。
なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ（http://www.toushin.or.jp/）でもご覧いただけます。

◆一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。

＜商品分類表定義＞

［単位型投信・追加型投信の区分］

(1)単位型投信…当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。

(2)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われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

［投資対象地域による区分］

(1)国内…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(2)海外…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)内外…目論見書又は投資信託約款において、国内及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う。

［投資対象資産(収益の源泉)による区分］

(1)株式…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(2)債券…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)不動産投信(リート)…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(4)その他資産…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。

(5)資産複合…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち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う。

［独立した区分］

(1)MMF(マネー・マネージメント・ファンド)…「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。

(2)MRF(マネー・リザーブ・ファンド)…「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。

(3)ETF…投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

［補足分類］

(1)インデックス型…目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。

(2)特殊型…目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

＜属性区分表定義＞

［投資対象資産による属性区分］

(1)株式

①一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

②大型株…目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

③中小型株…目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)債券

①一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

②公債…目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

③社債…目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

④その他債券…目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

⑤格付等クレジットによる属性…目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

(5)資産複合…以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

①資産配分固定型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

②資産配分変更型…目論見書又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う。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

[決算頻度による属性区分]

(1)年1回…目論見書又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う。

(2)年2回…目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。

(3)年4回…目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。

(4)年6回(隔月)…目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。

(5)年12回(毎月)…目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。

(6)日々…目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。

(7)その他…上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

(1)グローバル…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

(2)日本…目論見書又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の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)北米…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(4)欧州…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(5)アジア…目論見書又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除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
(6)オセアニア…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
(7)中南米…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
(8)アフリカ…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
(9)中近東(中東)…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
(10)エマージング…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]
(1)ファミリーファンド…目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
(2)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・ファンズをいう。

[為替ヘッジによる属性区分]
(1)為替ヘッジあり…目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
(2)為替ヘッジなし…目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]
(1)日経225
(2)TOPIX
(3)その他の指数…前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

[特殊型]
(1)ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
(2)条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
(3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
(4)その他型…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

＜ファンドの特色＞

資産配分の異なる3つのファンドからご選択いただけます。

●資産配分の異なる3つのファンドから、皆様のライフサイクルやリスク許容度に応じてご選択いただけます。
インデックスコレクション(バランス株式30)(以下「バランス株式30」という場合があります。)
インデックスコレクション(バランス株式50)(以下「バランス株式50」という場合があります。)
インデックスコレクション(バランス株式70)(以下「バランス株式70」という場合があります。)

国内外の株式・公社債へ分散投資します。

●日本株式マザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド及び外国債券マザーファンド(以下これらを「マザーファンド」という場合があります。)への投資を通じて、国内外の株式・公社債へ分散投資します。
●各マザーファンドは、それぞれの資産の市場全体の動きと連動することを目指すインデックス運用を行います。
●実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。
●基本配分比率は以下の通りとします。

基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設けます。

<投資対象とするマザーファンド>

国内株式	日本株式マザーファンド	「TOPIX(東証株価指数、配当込み)」に連動する投資成果を目標とします。
国内債券	日本債券マザーファンド	「NOMURA-BPI総合」に連動する投資成果を目標とします。
外国株式	外国株式マザーファンド	「MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)」に連動する投資成果を目標とします。
外国債券	外国債券マザーファンド	「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」に連動する投資成果を目標とします。

ポートフォリオ構築プロセス

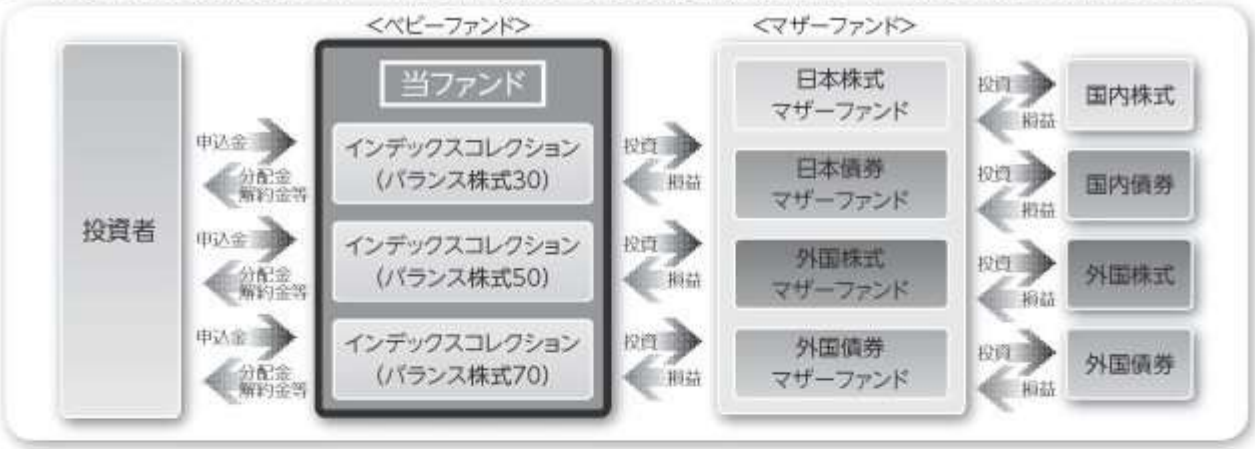
ファンドマネジャーは各ファンドの基本配分比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。

ポートフォリオ構築	ファンドマネジャー	●基本配分比率に従って、各資産のマザーファンドへ資金を配分
リバランス実施	ファンドマネジャー	●資産配分比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合、リバランスを実施

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

ファンドのしくみ

ファミリーファンド方式で運用します。ファミリーファンド方式とは、投資者の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。



分配方針

●年1回、毎決算時に原則として収益分配を行う方針です。
●分配対象額は、経費控除後の配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
●分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等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があります。
●収益分配金は、自動的にファンドの受益権に再投資されます。
※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

●株式への投資割合 … 株式への実質投資割合は、取得時において以下のとおりとします。

バランス株式30	信託財産の純資産総額の40%以下
バランス株式50	信託財産の純資産総額の60%以下
バランス株式70	信託財産の純資産総額の80%以下

●外貨建資産への投資割合 … 外貨建資産への実質投資割合は、取得時において以下のとおりとします。

バランス株式30	信託財産の純資産総額の30%以下
バランス株式50	信託財産の純資産総額の40%以下
バランス株式70	信託財産の純資産総額の45%以下

◆各マザーファンドが対象とする指数は次のとおりです。

日本株式マザーファンド「TOPIX（東証株価指数、配当込み）」
「TOPIX（東証株価指数、配当込み）」とは、株式会社東京証券取引所（以下「東証」）が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

日本債券マザーファンド「NOMURA-BPI総合」
「NOMURA-BPI総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

外国株式マザーファンド「MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）」
「MSCIコクサイ・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

外国債券マザーファンド「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）」
「FTSE世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

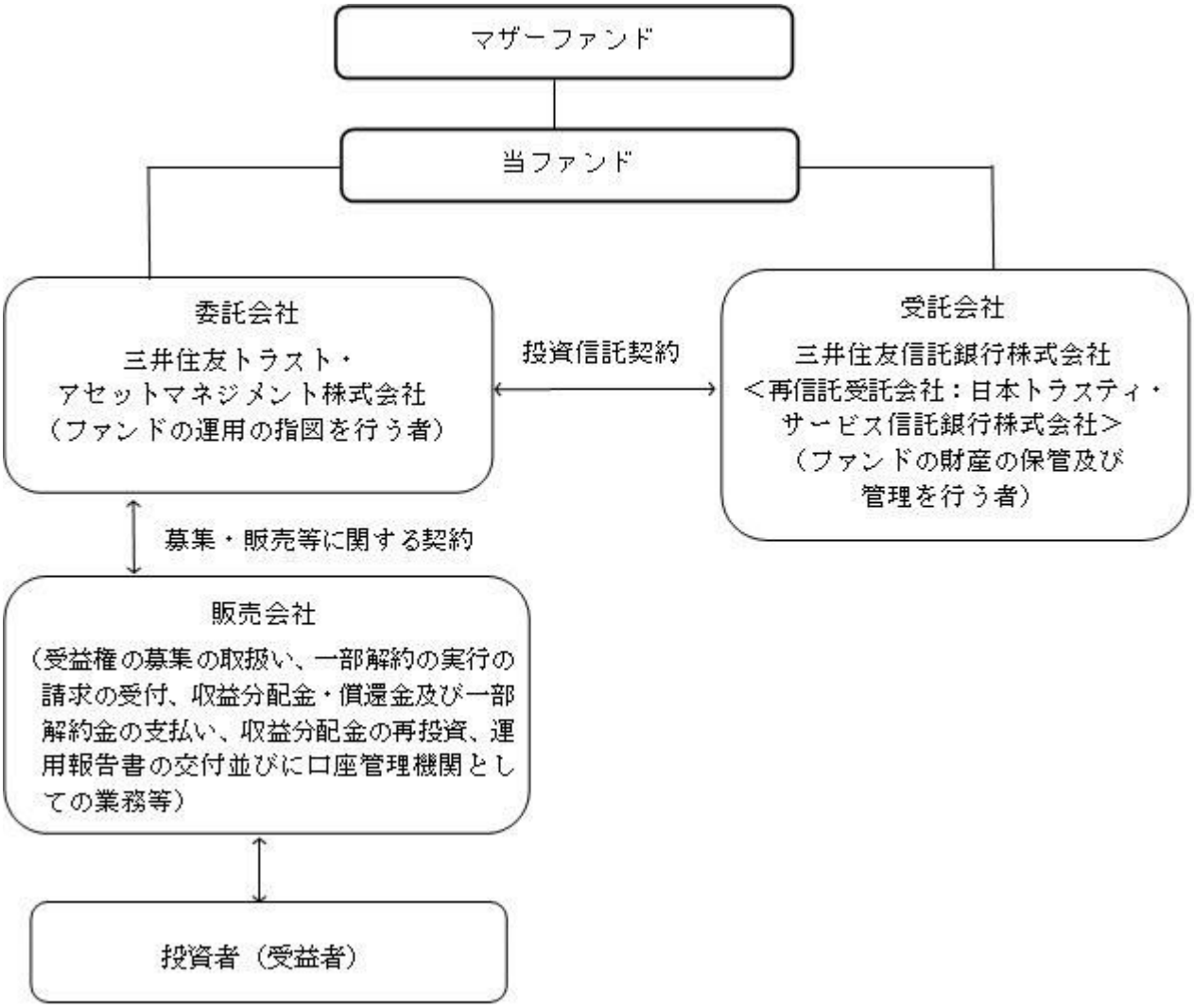
（２）【ファンドの沿革】

2010年10月20日　信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始
2012年４月１日　当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継
ファンドの名称を中央三井インデックスコレクション（バランス株式３０）からインデックスコレクション（バランス株式３０）、中央三井インデックスコレクション（バランス株式５０）からインデックスコレクション（バランス株式５

０）、中央三井インデックスコレクション（バランス株式７０）からインデックスコレクション（バランス株式７０）に変更
当ファンドの主要投資対象である中央三井日本株式マザーファンドの名称を日本株式マザーファンド、中央三井日本債券マザーファンドの名称を日本債券マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンドの名称を外国株式マザーファンド、中央三井外国債券マザーファンドの名称を外国債券マザーファンドに変更

（３）【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2019年 8月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

1986年11月1日：	**住信キャピタルマネジメント株式会社設立**
1987年2月20日：	**投資顧問業の登録**
1987年9月9日：	**投資一任契約に係る業務の認可**
1990年10月1日：	**住信投資顧問株式会社に商号変更**
1999年2月15日：	**住信アセットマネジメント株式会社に商号変更**
1999年3月25日：	**証券投資信託委託業の認可**
2007年9月30日：	**金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）**

2012年4月1日：　　中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更

2018年10月1日：　　三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継

ハ．大株主の状況

株　主　名	住　　所	持株数	持株比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	3,000株	100%

2【投資方針】

（1）【投資方針】

① 運用方針

当ファンドは、日本株式マザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド及び外国債券マザーファンドを主要投資対象とし、確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、長期的な信託財産の成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。なお、国内外の株式・公社債等に直接投資することもあります。

② 投資態度

A．主として、マザーファンド受益証券に投資し、実質的に国内外の株式・公社債へ分散投資を行うことにより、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

B．各資産への基本配分比率は以下のとおりです。資産配分の異なる３つのファンドから、皆様のライフサイクルやリスク許容度に応じてご選択いただけます。

	国内株式	国内債券	外国株式	外国債券
バランス株式３０	２０％	６０％	１０％	１０％
バランス株式５０	３０％	４０％	２０％	１０％
バランス株式７０	４０％	２５％	３０％	５％

C．上記B．の基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設けます。

D．実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上を図るため、為替予約取引等を活用する場合があります。

E．運用の効率化を図るため、株価指数先物取引及び債券先物取引等を活用することがあります。このため、株式及び債券の組入総額と株価指数先物取引及び債券先物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。

F．ただし、資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。

G．国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

H．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」という場合があります。）を行うことができます。

I．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

（２）【投資対象】

①　投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて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。

Ａ．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいいます。以下同じ。）

１．有価証券

２．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限ります。）

３．金銭債権（上記１．、２．及び下記４．に掲げるものに該当するものを除きます。）

４．約束手形（上記１．に掲げるものに該当するものを除きます。）

Ｂ．次に掲げる特定資産以外の資産

１．為替手形

②　運用指図できる投資対象である有価証券

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「日本株式マザーファンド」、「日本債券マザーファンド」、「外国株式マザーファンド」及び「外国債券マザーファンド」の各受益証券並びに次に掲げる有価証券（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。）に投資することを指図します。

１．株券又は新株引受権証書

２．国債証券

３．地方債証券

４．特別の法律により法人の発行する債券

５．社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

６．資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）

７．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）

８．協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券又は優先出資引受権を表示する証書

９．資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）

10．コマーシャル・ペーパー

11．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券

12．外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記１．から11．までの証券又は証書の性質を有するもの

13．投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。）

14．投資証券又は外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）

15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）

16．オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）

17．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）

18．外国法人が発行する譲渡性預金証書

19．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。）

20．抵当証券（金融商品取引法第２条第１項第16号で定めるものをいいます。）

21．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

22．外国の者に対する権利で上記21．の有価証券の性質を有するもの

なお、上記１．の証券又は証書並びに上記12．及び17．の証券又は証書のうち上記１．の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記２．から６．までの証券並びに上記12．及び17．の証券又は証書のうち上記２．から６．までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、上記13．の証券及び上記14．の証券を以下「投資信託証券」といいます。

③　運用指図できる金融商品

Ａ．委託会社は、信託金を、上記②に掲げる有価証券のほか、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を指図することができます。

１．預金

２．指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

３．コール・ローン

４．手形割引市場において売買される手形

５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの

６．外国の者に対する権利で上記５．の権利の性質を有するもの

Ｂ．金融商品による運用の特例

上記②の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記Ａ．に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

（参考）マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

１．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

２．運用方法

（１）投資対象

わが国の金融商品取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

（２）投資態度

①　株式への投資は、原則として東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

②　株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

③　運用の効率化を図るため、株価指数先物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が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

④　ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並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。

⑤　国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

⑥　信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

⑦　信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。

３．投資制限

①　株式への投資割合には制限を設けません。
②　外貨建資産への投資は、行いません。
③　新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
④　同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
⑤　同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ３第１項第７号及び第８号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５％以下とします。
⑥　同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５％以下とします。
⑦　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。
⑧　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及びデリバティブ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10%、合計で20%以内とすることとし、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したがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
⑨　デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める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ることとなる投資の指図をしません。

「日本債券マザーファンド」の概要

１．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

２．運用方法

（１）投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

（２）投資態度

①　わが国の公社債に投資を行い、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。
②　運用の効率化をはかるため、債券先物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が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
③　ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並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。
④　国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
⑤　信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
⑥　信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。

３．投資制限

①　株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ３第１項第７号及び第８号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②　同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５%以下とします。

③　外貨建資産への投資は、行いません。

④　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。

⑤　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及びデリバティブ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10%、合計で20%以内とすることとし、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したがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑥　デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める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ることとなる投資の指図をしません。

「外国株式マザーファンド」の概要

１．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

２．運用方法

（１）投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

（２）投資態度

①　ＭＳＣＩコクサイ・インデックスに採用されている国の株式に投資を行い、同インデックス（配当込み、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

②　株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

③　外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

④　運用の効率化を図るため、株価指数先物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が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

⑤　ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並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。

⑥　国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引を行うことができます。

⑦　信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

⑧　信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

３．投資制限

①　外貨建資産への投資には、制限を設けません。
②　株式への投資割合には制限を設けません。
③　新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
④　同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
⑤　同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ３第１項第７号及び第８号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５%以下とします。
⑥　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。
⑦　同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５%以下とします。
⑧　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及びデリバティブ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10%、合計で20%以内とすることとし、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したがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
⑨　デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める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ることとなる投資の指図をしません。

「外国債券マザーファンド」の概要

１．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

２．運用方法

（１）投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

（２）投資態度

①　FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。
②　外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。
③　運用の効率化をはかるため、債券先物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が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
④　ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並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。
⑤　国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引を行うことができます。

⑥　信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

⑦　信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

３．投資制限

①　株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ３第１項第７号及び第８号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②　同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５%以下とします。

③　外貨建資産への投資には、制限を設けません。

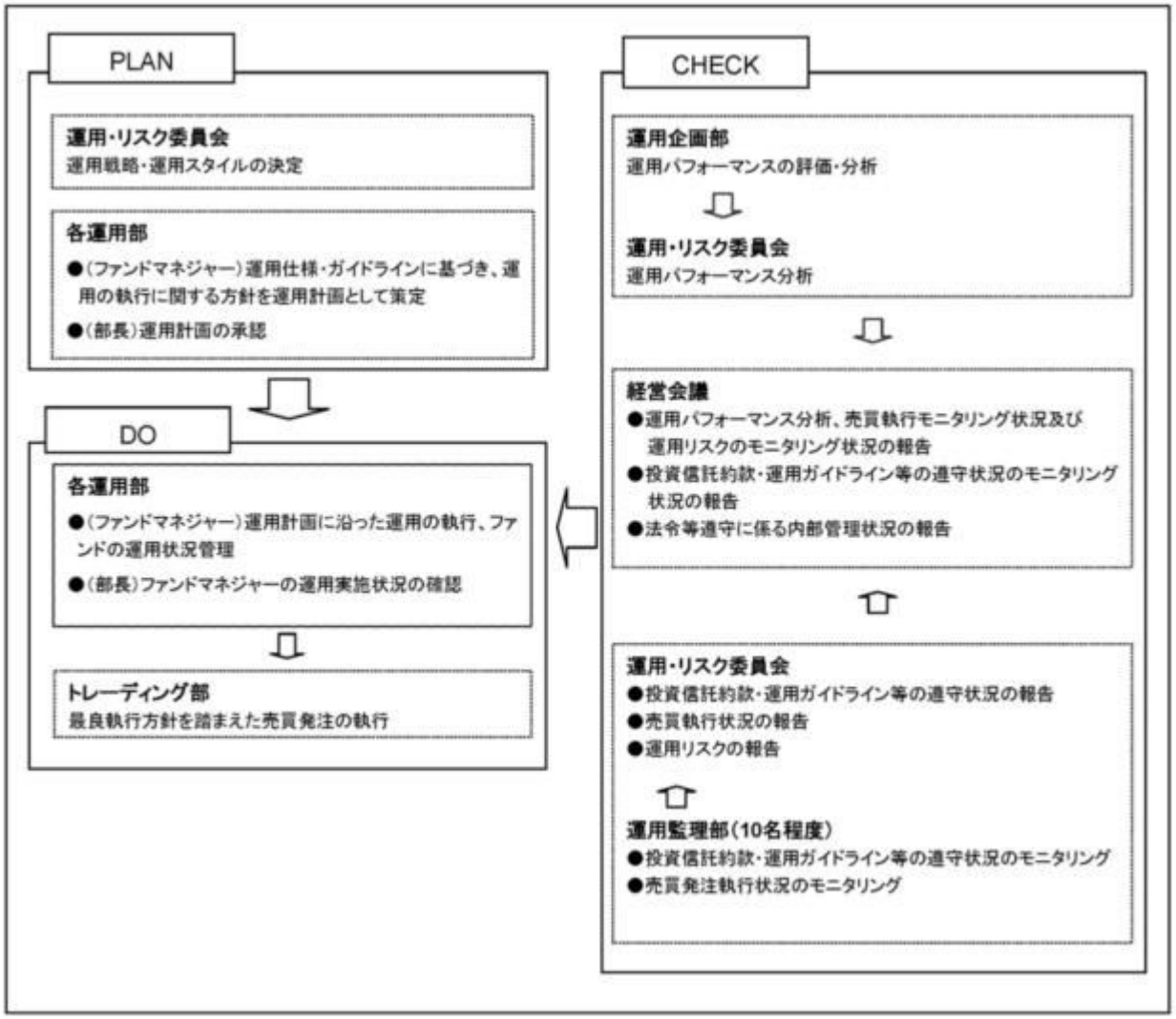
④　投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

⑤　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及びデリバティブ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10%、合計で20%以内とすることとし、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したがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑥　デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める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ることとなる投資の指図をしません。

（３）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、今後変更されることがあります。



委託会社では社内規定を定めて運用に係る組織及びその権限と責任を明示するとともに、運用を行うに当たって遵守すべき基本的な事項を含め、運用とリスク管理を適正に行うことを目的とした運用等に係る業務規則を定めています。

委託会社は、受託会社又は再信託受託会社に対して、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、外部監査法人による内部統制の整備及び運用状況の報告書を再信託受託会社より受け取っております。

（４）【分配方針】

年１回の毎決算時（決算日は７月25日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

・分配対象額は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）及び売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額。）等の全額とします。なお、前期から繰り越された分配準備積立金及び収益調整金は、全額分配に使用することがあります。
・分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等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があります。

・収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

①　約款に定める投資制限

Ａ．株式への投資割合

株式への実質投資割合は、取得時において以下のとおりとします。

○バランス株式３０……信託財産の純資産総額の40%以下

○バランス株式５０……信託財産の純資産総額の60%以下

○バランス株式７０……信託財産の純資産総額の80%以下

Ｂ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合は、取得時において以下のとおりとします。

○バランス株式３０……信託財産の純資産総額の30%以下

○バランス株式５０……信託財産の純資産総額の40%以下

○バランス株式７０……信託財産の純資産総額の45%以下

Ｃ．新株引受権証券等への投資割合

新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

Ｄ．同一銘柄の株式への投資割合

同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

Ｅ．同一銘柄の転換社債等への投資割合

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ３第１項第７号及び第８号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の５%以下とします。

Ｆ．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の５%以下とします。

Ｇ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券（マザーファンド及び上場投資信託を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

Ｈ．投資する株式等の範囲

イ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等（金融商品取引所（金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所で有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第８項第３号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場で有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第８項第５号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。）をいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

ロ．上記イ．の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投

資することを指図することができるものとします。

Ⅰ．信用取引の指図範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

ロ．上記イ．の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額が、信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

Ｊ．先物取引等の運用指図

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

ロ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことの指図をすることができます。

ハ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

Ｋ．スワップ取引の運用指図

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。

ロ．スワップ取引の指図に当たっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

ニ．委託会社は、スワップ取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

Ｌ．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

ロ．金利先渡取引及び為替先渡取引の指図に当たっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．金利先渡取引及び為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

ニ．委託会社は、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

Ｍ．有価証券の貸付の指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次のａ．及びｂ．の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

ａ．株式の貸付は、貸付時点において貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価

合計額を超えないものとします。

ｂ．公社債の貸付は、貸付時点において貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ．ａ．及びｂ．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

N．公社債の空売りの指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債又は下記O．の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

ロ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

O．公社債の借入れの指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。

ロ．上記イ．の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

P．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

Q．外国為替予約取引の指図

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

ロ．上記イ．の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

R．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図

委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

S．再投資の指図

委託会社は、上記Ｒ．の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。

Ｔ．資金の借入れ

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は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わないものとします。

ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、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又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、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金、解約代金及び償還金の合計額を限度とします。

ハ．収益分配金の再投資に係る借入期間は、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、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

Ｕ．受託会社による資金の立替え

イ．信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行又は株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。

ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

ハ．上記イ．及びロ．の立替金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。

Ｖ．利害関係人等との取引等

イ．受託会社は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、委託会社の指図により、信託財産と、受託会社（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託会社が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）及び受託会社の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第２条第１項にて準用する信託業法第29条第２項第１号に規定する利害関係人をいいます。以下イ．及び下記ロ．において同じ。）、信託業務の委託先及びその利害関係人又は受託会社における他の信託財産との間で、前記（２）に掲げる資産への投資等並びに上記Ｉ．からＯ．まで及びＱ．からＴ．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

ロ．受託会社は、受託会社が当ファンドの受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託会社又は受託会社の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託会社の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

ハ．委託会社は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託会社、その取締役、執行役及び委託会社の利害関係人等（金融商品取引法第31条の４に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）又は委託会社が運用の指図を行う他の信託財産との間で、前記（２）に掲げる資産への投資等並びに上記Ｉ．からＯ．まで及びＱ．からＴ．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託会社は、委託会社の指図により、当該投資等並びに当該取引、当該行為を行うことができます。

ニ．上記イ．からハ．までの場合、委託会社及び受託会社は、受益者に対して信託法第31条第３項

及び同法第32条第３項の通知は行いません。

W．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及びデリバティブ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10%、合計で20%以内とすることとし、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したがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

X．デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める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ることとなる投資の指図をしません。

＜関連法令に基づく投資制限＞

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

3【投資リスク】

（１）ファンドのリスク

●当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様の投資元本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、投資元本を割り込むことがあります。

●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

●投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

① 株価変動リスク

株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

② 為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。

③ 金利変動リスク

債券の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。また、発行者の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

④ 信用リスク

有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

⑤ 流動性リスク

時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

⑥ カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

① 同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

② 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

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

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

③ ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の６の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

④ 確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

（２）リスクの管理体制

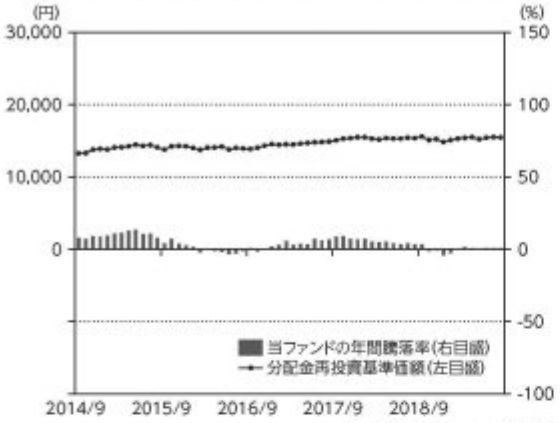
委託会社におけるリスク管理体制

・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

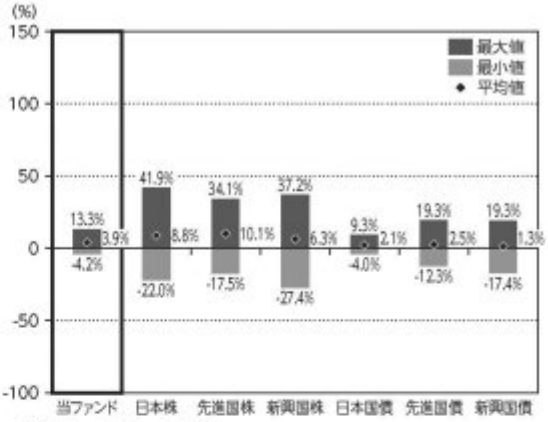
〔参考情報〕

インデックスコレクション（バランス株式30）

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



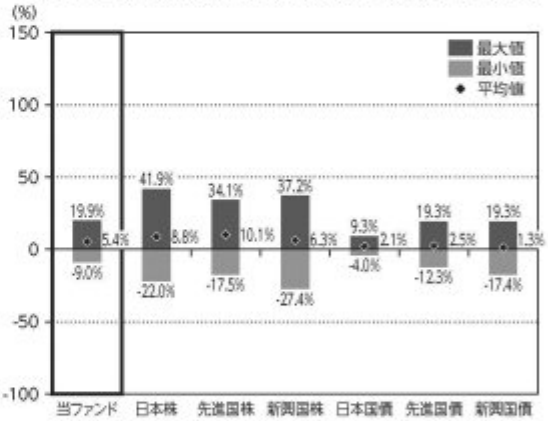
当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



インデックスコレクション（バランス株式50）

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

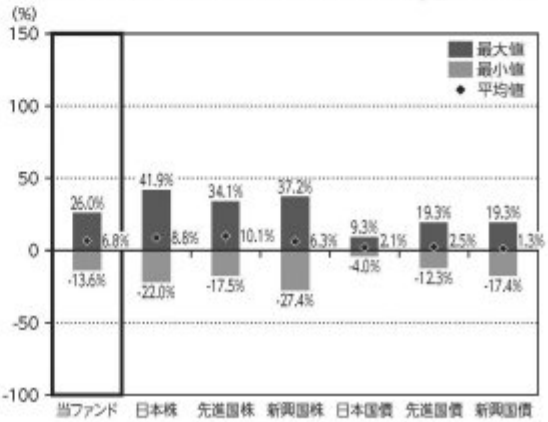
当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



インデックスコレクション（バランス株式70）

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



〔参考情報〕

＊当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

＊当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

＊2014年9月～2019年8月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

＊当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・ インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 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(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・債布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベース指数を使用しております。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞

ありません。

＜信託財産留保額＞

当ファンドは、ご解約時に信託財産留保額（※）の控除はありません。ただし、当ファンドが保有するマザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

※「信託財産留保額」とは、償還時まで投資を続ける投資者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、信託期間満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をいい、投資信託財産に繰り入れられます。

（3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.154%（税抜　0.14%）（※）を乗じて得た額とします（信託報酬 ＝ 運用期間中の基準価額×信

託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率　0.099%　（税抜　0.09%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率　0.033%　（税抜　0.03%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率　0.022%　（税抜　0.02%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

※「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます。

②信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

③信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

（4）【その他の手数料等】

①投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

②借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。

③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（※）、先物取引・オプション取引に要する費用（※）、組入資産の保管に要する費用（※）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

⑤これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料
先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料
組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料
財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。

（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。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が

適用されます。

※上記は、2019年 8月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

※税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

５【運用状況】

以下は、2019年8月30日現在の状況について記載してあります。

【インデックスコレクション（バランス株式３０）】

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	59,987,044,979	99.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	185,031,701	0.31
合計(純資産総額)		60,172,076,680	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（２）【投資資産】

①【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	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	25,483,251,871	1.3984	35,635,779,417	1.4176	36,125,057,852	60.04
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	7,284,029,724	1.6829	12,258,293,623	1.6151	11,764,436,407	19.55
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	2,334,382,941	2.8184	6,579,224,881	2.6761	6,247,042,188	10.38
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	2,420,466,068	2.3966	5,800,888,979	2.4171	5,850,508,532	9.72

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.69
合計	99.69

(注)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2011年 7月25日)	1,646,934,722	1,646,934,722	10,215	10,215
第2期計算期間末 (2012年 7月25日)	1,826,441,025	1,826,441,025	10,014	10,014
第3期計算期間末 (2013年 7月25日)	3,055,855,651	3,055,855,651	12,198	12,198
第4期計算期間末 (2014年 7月25日)	4,778,573,004	4,778,573,004	12,984	12,984
第5期計算期間末 (2015年 7月27日)	7,218,074,538	7,218,074,538	14,344	14,344
第6期計算期間末 (2016年 7月25日)	26,094,390,333	26,094,390,333	14,066	14,066
第7期計算期間末 (2017年 7月25日)	36,940,752,492	36,940,752,492	14,836	14,836
第8期計算期間末 (2018年 7月25日)	47,046,612,483	47,046,612,483	15,400	15,400
第9期計算期間末 (2019年 7月25日)	58,853,542,284	58,853,542,284	15,526	15,526
2018年 8月末日	48,420,475,982	—	15,350	—
9月末日	49,808,040,925	—	15,561	—
10月末日	49,297,294,246	—	15,099	—
11月末日	50,399,696,958	—	15,222	—
12月末日	49,003,419,084	—	14,812	—
2019年 1月末日	51,456,812,308	—	15,084	—
2月末日	52,924,600,695	—	15,296	—
3月末日	53,971,318,664	—	15,390	—
4月末日	54,234,084,597	—	15,482	—
5月末日	54,878,490,860	—	15,206	—
6月末日	58,446,087,355	—	15,418	—
7月末日	59,571,083,331	—	15,503	—
8月末日	60,172,076,680	—	15,444	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）

第1期計算期間	2010年10月20日～2011年 7月25日	0
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	0
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	0
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	0
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	0
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	0
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	0
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	0
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第1期計算期間	2010年10月20日～2011年 7月25日	2.2
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	△2.0
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	21.8
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	6.4
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	10.5
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	△1.9
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	5.5
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	3.8
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0.8

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配付)から前計算期間末の基準価額(分配落)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2010年10月20日～2011年 7月25日	1,616,687,950	4,495,116	1,612,192,834
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	297,421,058	85,659,240	1,823,954,652
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	946,841,759	265,501,127	2,505,295,284
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	1,384,516,621	209,546,149	3,680,265,756
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	1,662,961,851	310,939,646	5,032,287,961
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	14,070,621,585	551,965,479	18,550,944,067
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	7,358,731,907	1,010,990,195	24,898,685,779
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	7,713,381,660	2,062,382,166	30,549,685,273
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	8,500,605,703	1,144,421,624	37,905,869,352

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。
(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

【インデックスコレクション（バランス株式５０）】

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	11,745,794,522	99.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	38,276,783	0.32
合計(純資産総額)		11,784,071,305	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（２）【投資資産】

①【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	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	3,385,571,814	1.3983	4,734,361,728	1.4176	4,799,386,603	40.73
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	2,134,522,749	1.6824	3,591,189,495	1.6151	3,447,467,691	29.26
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	886,848,206	2.8184	2,499,537,403	2.6761	2,373,294,484	20.14
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	465,700,941	2.3969	1,116,253,266	2.4171	1,125,645,744	9.55

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.68
合計	99.68

(注)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2011年 7月25日)	2,376,072,910	2,376,072,910	10,376	10,376
第2期計算期間末 (2012年 7月25日)	2,308,448,560	2,308,448,560	9,855	9,855
第3期計算期間末 (2013年 7月25日)	3,298,797,421	3,298,797,421	13,348	13,348
第4期計算期間末 (2014年 7月25日)	4,273,661,874	4,273,661,874	14,552	14,552
第5期計算期間末 (2015年 7月27日)	5,112,201,159	5,112,201,159	16,776	16,776
第6期計算期間末 (2016年 7月25日)	5,810,707,419	5,810,707,419	15,725	15,725
第7期計算期間末 (2017年 7月25日)	6,724,648,904	6,724,648,904	17,405	17,405
第8期計算期間末 (2018年 7月25日)	8,658,183,416	8,658,183,416	18,451	18,451
第9期計算期間末 (2019年 7月25日)	11,669,771,032	11,669,771,032	18,409	18,409
2018年 8月末日	8,814,328,189	—	18,417	—
9月末日	9,089,748,889	—	18,828	—
10月末日	8,728,119,880	—	17,926	—
11月末日	8,883,268,278	—	18,122	—
12月末日	8,434,817,008	—	17,227	—
2019年 1月末日	8,825,630,321	—	17,723	—
2月末日	9,056,042,028	—	18,114	—
3月末日	9,181,334,606	—	18,214	—
4月末日	9,281,463,720	—	18,444	—
5月末日	9,337,924,546	—	17,866	—
6月末日	11,503,721,005	—	18,202	—
7月末日	11,783,665,628	—	18,363	—
8月末日	11,784,071,305	—	18,096	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2010年10月20日～2011年 7月25日	0
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	0
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	0
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	0
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	0
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	0
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	0
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	0

第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第1期計算期間	2010年10月20日～2011年 7月25日	3.8
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	△5.0
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	35.4
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	9.0
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	15.3
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	△6.3
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	10.7
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	6.0
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	△0.2

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配付)から前計算期間末の基準価額(分配落)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2010年10月20日～2011年 7月25日	2,297,761,646	7,893,955	2,289,867,691
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	190,420,353	137,880,635	2,342,407,409
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	416,815,707	287,930,717	2,471,292,399
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	658,340,834	192,744,346	2,936,888,887
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	449,877,581	339,477,441	3,047,289,027
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	961,565,392	313,575,798	3,695,278,621
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	603,139,592	434,776,876	3,863,641,337
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	1,120,338,164	291,368,383	4,692,611,118
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	2,005,968,696	359,477,733	6,339,102,081

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。
(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

【インデックスコレクション（バランス株式７０）】

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	6,610,473,743	99.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	20,619,886	0.31
合計(純資産総額)		6,631,093,629	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（２）【投資資産】

①【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	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	1,612,703,966	1.6827	2,713,847,000	1.6151	2,604,678,175	39.28
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	746,680,841	2.8179	2,104,082,322	2.6761	1,998,192,598	30.13
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	1,197,409,997	1.3984	1,674,539,709	1.4176	1,697,448,411	25.60
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	128,316,809	2.3968	307,554,387	2.4171	310,154,559	4.68

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.69
合計	99.69

(注)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2011年 7月25日)	1,465,295,824	1,465,295,824	10,550	10,550
第2期計算期間末 (2012年 7月25日)	1,392,591,169	1,392,591,169	9,716	9,716

第3期計算期間末	(2013年 7月25日)	2,374,954,327	2,374,954,327	14,377	14,377
第4期計算期間末	(2014年 7月25日)	3,063,861,342	3,063,861,342	15,968	15,968
第5期計算期間末	(2015年 7月27日)	3,890,683,336	3,890,683,336	19,106	19,106
第6期計算期間末	(2016年 7月25日)	3,517,186,547	3,517,186,547	17,198	17,198
第7期計算期間末	(2017年 7月25日)	4,084,827,402	4,084,827,402	19,885	19,885
第8期計算期間末	(2018年 7月25日)	5,289,106,724	5,289,106,724	21,519	21,519
第9期計算期間末	(2019年 7月25日)	6,627,304,937	6,627,304,937	21,241	21,241
	2018年 8月末日	5,389,010,863	—	21,513	—
	9月末日	5,572,628,302	—	22,155	—
	10月末日	5,277,646,041	—	20,701	—
	11月末日	5,402,923,389	—	20,980	—
	12月末日	5,027,906,424	—	19,496	—
	2019年 1月末日	5,294,171,050	—	20,275	—
	2月末日	5,491,157,109	—	20,879	—
	3月末日	5,552,663,334	—	20,976	—
	4月末日	5,625,093,255	—	21,382	—
	5月末日	5,587,786,449	—	20,428	—
	6月末日	6,484,282,255	—	20,911	—
	7月末日	6,695,184,928	—	21,164	—
	8月末日	6,631,093,629	—	20,631	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2010年10月20日～2011年 7月25日	0
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	0
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	0
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	0
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	0
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	0
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	0
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	0
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第1期計算期間	2010年10月20日～2011年 7月25日	5.5
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	△7.9
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	48.0
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	11.1

第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	19.7
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	△10.0
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	15.6
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	8.2
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	△1.3

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配付)から前計算期間末の基準価額(分配落)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2010年10月20日～2011年 7月25日	1,395,188,638	6,298,452	1,388,890,186
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	201,368,030	156,966,363	1,433,291,853
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	664,273,333	445,609,632	1,651,955,554
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	635,433,541	368,605,971	1,918,783,124
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	672,066,846	554,506,519	2,036,343,451
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	442,910,032	434,101,250	2,045,152,233
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	508,202,695	499,147,088	2,054,207,840
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	778,728,051	375,069,629	2,457,866,262
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	1,031,236,687	369,101,257	3,120,001,692

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。
(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

（参考）

日本株式マザーファンド

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	211,870,208,455	98.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	2,448,646,805	1.14
合計(純資産総額)		214,318,855,260	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）

株価指数先物取引	買建	日本	2,340,500,000	1.09

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、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。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

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	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,090,500	6,780.53	7,394,172,474	6,960.00	7,589,880,000	3.54
日本	株式	ソニー	電気機器	656,800	5,355.63	3,517,582,528	6,042.00	3,968,385,600	1.85
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	761,900	3,958.29	3,015,827,824	4,824.00	3,675,405,600	1.71
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	6,644,100	575.04	3,820,686,680	510.40	3,391,148,640	1.58
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	656,800	4,562.00	2,996,325,885	5,096.00	3,347,052,800	1.56
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	854,300	4,461.85	3,811,764,909	3,590.00	3,066,937,000	1.43
日本	株式	キーエンス	電気機器	48,000	54,132.57	2,598,363,533	62,900.00	3,019,200,000	1.41
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	680,200	3,923.43	2,668,719,822	3,484.00	2,369,816,800	1.11
日本	株式	任天堂	その他製品	56,000	33,863.92	1,896,379,662	40,290.00	2,256,240,000	1.05
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	787,200	2,701.91	2,126,947,536	2,835.00	2,231,712,000	1.04
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	669,900	2,876.09	1,926,694,650	3,219.00	2,156,408,100	1.01
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	825,500	3,223.95	2,661,371,242	2,523.50	2,083,149,250	0.97
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	13,115,000	176.23	2,311,300,785	154.70	2,028,890,500	0.95
日本	株式	第一三共	医薬品	280,000	3,826.17	1,071,327,670	7,018.00	1,965,040,000	0.92
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	345,100	5,326.53	1,838,188,117	5,472.00	1,888,387,200	0.88
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	87,600	23,375.15	2,047,663,971	21,015.00	1,840,914,000	0.86
日本	株式	信越化学工業	化学	168,900	8,573.97	1,448,144,022	10,715.00	1,809,763,500	0.84
日本	株式	花王	化学	234,300	7,624.55	1,786,434,265	7,674.00	1,798,018,200	0.84
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	174,000	10,062.75	1,750,918,638	10,115.00	1,760,010,000	0.82
日本	株式	ダイキン工業	機械	133,600	11,843.55	1,582,299,153	13,155.00	1,757,508,000	0.82
日本	株式	三菱商事	卸売業	676,300	3,117.29	2,108,226,141	2,585.00	1,748,235,500	0.82
日本	株式	ファナック	電気機器	93,000	18,222.80	1,694,720,535	18,455.00	1,716,315,000	0.80
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	110,500	11,150.62	1,232,143,793	15,470.00	1,709,435,000	0.80
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	197,000	6,334.47	1,247,891,286	8,649.00	1,703,853,000	0.80
日本	株式	資生堂	化学	194,400	6,300.89	1,224,894,300	8,690.00	1,689,336,000	0.79
日本	株式	日本電産	電気機器	117,800	12,480.30	1,470,179,788	13,855.00	1,632,119,000	0.76
日本	株式	ＮＴＴドコモ	情報・通信業	608,100	2,577.29	1,567,250,169	2,682.00	1,630,924,200	0.76
日本	株式	日立製作所	電気機器	440,600	3,463.07	1,525,830,730	3,629.00	1,598,937,400	0.75

日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	404,000	4,768.66	1,926,539,468	3,757.00	1,517,828,000	0.71
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,018,200	1,365.53	1,390,386,114	1,490.50	1,517,627,100	0.71

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.27
		建設業	2.81
		食料品	4.03
		繊維製品	0.63
		パルプ・紙	0.25
		化学	7.17
		医薬品	5.65
		石油・石炭製品	0.53
		ゴム製品	0.76
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.77
		非鉄金属	0.70
		金属製品	0.54
		機械	4.83
		電気機器	13.55
		輸送用機器	7.68
		精密機器	2.16
		その他製品	2.22
		電気・ガス業	1.70
		陸運業	4.75
		海運業	0.15
		空運業	0.55
		倉庫・運輸関連業	0.19
		情報・通信業	8.97
		卸売業	4.83
		小売業	4.74
		銀行業	5.65
		証券、商品先物取引業	0.76
		保険業	2.26
		その他金融業	1.11
		不動産業	2.53
		サービス業	5.21

小計	98.86
合計	98.86

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

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	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ先物	買建	155	円	2,370,616,500	2,340,500,000	1.09

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、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。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

日本債券マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	264,482,132,890	83.38
地方債証券	日本	17,106,212,592	5.39
特殊債券	日本	21,031,298,341	6.63
社債券	日本	11,760,644,000	3.71
	フランス	1,103,148,000	0.35
	オーストラリア	301,722,000	0.10
	イギリス	100,667,000	0.03
	スペイン	100,521,000	0.03
	カナダ	100,235,000	0.03
	小計	13,466,937,000	4.25
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,108,994,462	0.35
合計(純資産総額)		317,195,575,285	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

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	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第１３８回利付国債（５年）	4,120,000,000	101.29	4,173,464,200	101.96	4,200,875,600	0.100	2023/12/20	1.32
日本	国債証券	第１２７回利付国債（５年）	3,650,000,000	100.58	3,671,170,000	100.60	3,672,082,500	0.100	2021/3/20	1.16
日本	国債証券	第３３９回利付国債（１０年）	3,415,000,000	103.77	3,543,990,700	104.56	3,570,758,150	0.400	2025/6/20	1.13
日本	国債証券	第３４０回利付国債（１０年）	3,190,000,000	103.94	3,315,716,700	104.76	3,341,971,600	0.400	2025/9/20	1.05
日本	国債証券	第１３９回利付国債（５年）	3,050,000,000	101.52	3,096,548,700	102.07	3,113,379,000	0.100	2024/3/20	0.98
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	2,840,000,000	102.01	2,897,104,700	103.87	2,950,163,600	0.100	2029/3/20	0.93
日本	国債証券	第１２６回利付国債（５年）	2,870,000,000	100.52	2,885,096,200	100.48	2,884,005,600	0.100	2020/12/20	0.91
日本	国債証券	第３３４回利付国債（１０年）	2,620,000,000	104.11	2,727,682,000	104.66	2,742,092,000	0.600	2024/6/20	0.86
日本	国債証券	第３４９回利付国債（１０年）	2,605,000,000	101.47	2,643,501,900	103.97	2,708,652,950	0.100	2027/12/20	0.85
日本	国債証券	第３３３回利付国債（１０年）	2,580,000,000	103.92	2,681,136,000	104.36	2,692,565,400	0.600	2024/3/20	0.85
日本	国債証券	第３４８回利付国債（１０年）	2,500,000,000	101.56	2,539,000,000	103.94	2,598,550,000	0.100	2027/9/20	0.82
日本	国債証券	第３３８回利付国債（１０年）	2,480,000,000	103.44	2,565,312,000	104.35	2,588,103,200	0.400	2025/3/20	0.82
日本	国債証券	第３３５回利付国債（１０年）	2,465,000,000	103.73	2,557,141,700	104.42	2,574,002,300	0.500	2024/9/20	0.81
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	2,420,000,000	101.33	2,452,234,400	103.96	2,515,904,600	0.100	2028/3/20	0.79
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	2,420,000,000	101.40	2,453,906,500	103.92	2,514,985,000	0.100	2028/12/20	0.79
日本	国債証券	第３４５回利付国債（１０年）	2,370,000,000	101.77	2,412,073,500	103.64	2,456,315,400	0.100	2026/12/20	0.77
日本	国債証券	第３３７回利付国債（１０年）	2,350,000,000	102.71	2,413,732,000	103.59	2,434,435,500	0.300	2024/12/20	0.77
日本	国債証券	第３４７回利付国債（１０年）	2,315,000,000	101.65	2,353,197,500	103.85	2,404,266,400	0.100	2027/6/20	0.76
日本	国債証券	第１３５回利付国債（５年）	2,340,000,000	101.10	2,365,927,200	101.59	2,377,369,800	0.100	2023/3/20	0.75
日本	国債証券	第３３２回利付国債（１０年）	2,270,000,000	103.75	2,355,125,000	104.12	2,363,592,100	0.600	2023/12/20	0.75
日本	国債証券	第１３４回利付国債（５年）	2,320,000,000	101.04	2,344,174,400	101.45	2,353,640,000	0.100	2022/12/20	0.74
日本	国債証券	第１２８回利付国債（５年）	2,330,000,000	100.63	2,344,888,700	100.71	2,346,612,900	0.100	2021/6/20	0.74
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	2,255,000,000	101.72	2,293,943,850	103.76	2,339,968,400	0.100	2027/3/20	0.74
日本	国債証券	第３２５回利付国債（１０年）	2,245,000,000	103.52	2,324,243,350	103.46	2,322,766,800	0.800	2022/9/20	0.73
日本	国債証券	第３４１回利付国債（１０年）	2,150,000,000	103.20	2,218,985,000	104.32	2,242,880,000	0.300	2025/12/20	0.71
日本	国債証券	第３５１回利付国債（１０年）	2,130,000,000	101.22	2,156,113,800	103.94	2,213,985,900	0.100	2028/6/20	0.70
日本	国債証券	第３５２回利付国債（１０年）	2,070,000,000	101.16	2,094,012,000	103.96	2,152,013,400	0.100	2028/9/20	0.68
日本	国債証券	第３２９回利付国債（１０年）	2,035,000,000	104.25	2,121,670,650	104.40	2,124,641,750	0.800	2023/6/20	0.67
日本	国債証券	第３４３回利付国債（１０年）	2,055,000,000	101.79	2,091,784,500	103.31	2,123,082,150	0.100	2026/6/20	0.67

日本	国債証券	第３１２回利付国債（１０年）	2,037,000,000	102.62	2,090,369,400	101.92	2,076,151,140	1.200	2020/12/20	0.65

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.38
地方債証券	5.39
特殊債券	6.63
社債券	4.25
合計	99.65

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

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。

外国株式マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	113,163,375,454	60.80
	イギリス	10,330,417,268	5.55
	カナダ	6,803,364,169	3.65
	スイス	6,735,396,197	3.62
	フランス	6,588,142,375	3.54
	ドイツ	5,448,072,859	2.93
	オーストラリア	3,989,904,071	2.14
	アイルランド	3,292,150,676	1.77
	オランダ	3,163,239,441	1.70
	スペイン	1,831,640,436	0.98
	香港	1,601,522,434	0.86
	スウェーデン	1,501,700,794	0.81

	イタリア	1,268,229,970	0.68
	デンマーク	1,185,334,277	0.64
	シンガポール	750,410,157	0.40
	フィンランド	724,073,317	0.39
	バミューダ	718,883,731	0.39
	ベルギー	650,436,361	0.35
	ジャージー	476,676,788	0.26
	ケイマン	414,114,567	0.22
	ノルウェー	409,468,734	0.22
	イスラエル	381,657,723	0.21
	キュラソー	213,678,040	0.11
	ルクセンブルク	174,462,508	0.09
	ニュージーランド	160,136,610	0.09
	オーストリア	145,090,267	0.08
	ポルトガル	105,699,183	0.06
	パナマ	85,801,224	0.05
	リベリア	82,686,837	0.04
	パプアニューギニア	24,503,840	0.01
	英ヴァージン諸島	19,138,320	0.01
	マン島	16,742,855	0.01
	モーリシャス	9,703,639	0.01
	小計	172,465,855,122	92.65
投資信託受益証券	オーストラリア	107,904,808	0.06
	香港	43,860,954	0.02
	小計	151,765,762	0.08
投資証券	アメリカ	4,100,805,980	2.20
	オーストラリア	331,959,329	0.18
	フランス	187,979,947	0.10
	香港	116,528,304	0.06
	イギリス	108,601,977	0.06
	シンガポール	86,629,766	0.05
	カナダ	40,431,640	0.02
	小計	4,972,936,943	2.67
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	8,548,420,142	4.59
合計(純資産総額)		186,138,977,969	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	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	5,795,322,565	3.11
	買建	カナダ	329,228,067	0.18
	買建	ドイツ	1,413,353,274	0.76
	買建	イギリス	558,428,016	0.30
	買建	オーストラリア	359,530,234	0.19

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、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。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	999,862,240	0.54
	売建	—	65,309,300	△0.04

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の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によって評価しております。発表されていない場合は、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先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

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	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	327,570	11,340.74	3,714,886,743	14,704.25	4,816,672,876	2.59

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	207,231	18,549.59	3,844,050,168	22,251.20	4,611,139,380	2.48
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	18,833	174,907.43	3,294,031,811	190,180.14	3,581,662,652	1.92
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	108,163	18,180.53	1,966,461,620	19,755.78	2,136,844,670	1.15
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	14,113	118,819.93	1,676,905,755	126,990.81	1,792,221,316	0.96
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	13,483	119,643.63	1,613,155,134	127,138.79	1,714,212,311	0.92
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	146,376	11,046.80	1,616,987,076	11,627.56	1,701,995,898	0.91
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	138,380	9,440.56	1,306,385,393	11,898.06	1,646,453,681	0.88
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	119,559	14,153.31	1,692,156,666	13,652.43	1,632,270,926	0.88
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	78,317	15,115.63	1,183,811,504	19,287.35	1,510,528,032	0.81
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	113,472	10,488.97	1,190,204,666	12,900.82	1,463,882,165	0.79
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	191,067	7,994.26	1,527,439,759	7,285.05	1,391,934,139	0.75
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	58,854	21,914.95	1,289,782,560	21,632.67	1,273,169,278	0.68
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	328,760	3,158.86	1,038,507,187	3,742.06	1,230,242,604	0.66
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	40,944	23,022.77	942,644,378	29,955.71	1,226,506,787	0.66
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	49,691	19,665.29	977,187,985	24,200.48	1,202,546,409	0.65
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	81,079	11,835.76	959,632,315	14,674.44	1,189,789,440	0.64
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	405,160	3,058.59	1,239,220,674	2,909.55	1,178,834,007	0.63
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	186,333	5,733.97	1,068,428,288	6,168.29	1,149,356,428	0.62
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	86,132	12,647.48	1,089,352,791	12,511.17	1,077,612,887	0.58
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	116,010	8,254.35	957,588,276	9,232.21	1,071,028,821	0.58
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	182,617	5,254.81	959,618,897	5,860.62	1,070,249,390	0.57
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	42,822	28,637.49	1,226,314,633	24,551.80	1,051,357,402	0.56
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	201,750	5,305.32	1,070,349,950	4,989.78	1,006,688,155	0.54
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	194,349	5,054.72	982,379,933	5,032.36	978,034,950	0.53
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	204,130	3,973.09	811,027,877	4,702.33	959,888,297	0.52
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	250,220	4,489.00	1,123,238,060	3,761.23	941,135,421	0.51
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	190,876	5,239.96	1,000,182,834	4,917.38	938,611,237	0.50
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	24,191	43,643.23	1,055,773,597	38,617.30	934,191,114	0.50

スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	31,603	28,954.85	915,060,213	29,195.01	922,650,075	0.50

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	5.18
		素材	4.06
		資本財	6.58
		商業・専門サービス	1.23
		運輸	1.86
		自動車・自動車部品	1.00
		耐久消費財・アパレル	1.82
		消費者サービス	1.89
		メディア・娯楽	5.83
		小売	4.70
		食品・生活必需品小売り	1.50
		食品・飲料・タバコ	4.93
		家庭用品・パーソナル用品	2.17
		ヘルスケア機器・サービス	4.70
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.72
		銀行	7.08
		各種金融	4.08
		保険	3.68
		不動産	0.54
		ソフトウェア・サービス	9.35
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.05
		電気通信サービス	2.33
		公益事業	3.53
		半導体・半導体製造装置	2.87
		小計	92.65
投資信託受益証券	—	—	0.08
投資証券	—	—	2.67
合計			95.41

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

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	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	簿価金額(現地通貨)	帳簿価額(円)	評価金額(現地通貨)	評価金額(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	S&P 500 EMIN	買建	372	アメリカドル	54,150,001.5	5,764,809,159	54,436,620	5,795,322,565	3.11
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	21	カナダドル	4,101,402.5	328,563,354	4,109,700	329,228,067	0.18
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	30	スイスフラン	2,973,250	320,724,478	2,947,800	317,979,186	0.17
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	273	ユーロ	9,354,408.5	1,100,359,071	9,312,030	1,095,374,088	0.59
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	31	オーストラリアドル	5,044,292	361,070,421	5,022,775	359,530,234	0.19
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	60	イギリスポンド	4,409,645	571,842,764	4,306,200	558,428,016	0.30

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、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。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	7,300,400.00	767,936,376	776,397,540	0.42
	ユーロ	買建	1,200,000.00	141,814,200	141,156,000	0.08
	イギリスポンド	買建	635,000.00	80,786,605	82,308,700	0.04
	アメリカドル	売建	470,000.00	50,020,079	50,017,400	△0.03
	ユーロ	売建	130,000.00	15,292,485	15,291,900	△0.01

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の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によって評価しております。発表されていない場合は、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先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

外国債券マザーファンド

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	62,791,197,357	47.38
	フランス	12,979,700,539	9.79
	イタリア	11,737,155,983	8.86
	ドイツ	8,328,124,688	6.28

	イギリス	8,153,123,813	6.15
	スペイン	7,318,289,141	5.52
	ベルギー	3,284,643,822	2.48
	オーストラリア	2,537,452,569	1.91
	カナダ	2,513,123,039	1.90
	オランダ	2,436,203,717	1.84
	オーストリア	1,833,425,815	1.38
	メキシコ	963,768,434	0.73
	アイルランド	943,792,556	0.71
	フィンランド	752,623,112	0.57
	ポーランド	734,069,576	0.55
	デンマーク	693,418,651	0.52
	南アフリカ	685,387,984	0.52
	マレーシア	591,791,559	0.45
	シンガポール	523,224,990	0.39
	スウェーデン	429,401,730	0.32
	ノルウェー	302,282,041	0.23
	小計	130,532,201,116	98.50
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,989,132,578	1.50
合計(純資産総額)		132,521,333,694	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
債券先物取引	買建	アメリカ	171,392,281	0.13
	買建	ドイツ	200,814,407	0.15

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、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。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	251,006,500	0.19

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の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によって評価しております。発表されていない場合は、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先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

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	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/24	8,900,000	10,785.83	959,939,425	11,252.73	1,001,493,758	2.750	2024/2/15	0.76
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/44	7,200,000	10,853.21	781,431,788	13,141.98	946,223,137	3.125	2044/8/15	0.71
アメリカ	国債証券	T 1.25% 03/31/21	8,500,000	10,370.17	881,464,813	10,582.58	899,519,423	1.250	2021/3/31	0.68
アメリカ	国債証券	T 2.25% 01/31/24	8,100,000	10,516.23	851,815,349	11,019.02	892,541,092	2.250	2024/1/31	0.67
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	7,500,000	9,603.38	720,253,671	11,832.86	887,464,703	2.500	2046/2/15	0.67
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	8,300,000	9,835.78	816,370,076	10,676.77	886,172,212	1.500	2026/8/15	0.67
アメリカ	国債証券	T 2% 04/30/24	8,000,000	10,671.97	853,758,100	10,920.88	873,670,642	2.000	2024/4/30	0.66
アメリカ	国債証券	T 1.625% 04/30/23	8,100,000	10,272.12	832,042,041	10,717.52	868,119,752	1.625	2023/4/30	0.66
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	6,830,000	10,357.49	707,416,800	12,648.77	863,911,589	2.875	2045/8/15	0.65
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	7,060,000	11,278.69	796,275,817	12,130.61	856,421,631	3.125	2028/11/15	0.65
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	7,450,000	9,087.26	677,000,969	11,280.60	840,404,809	2.250	2046/8/15	0.63
アメリカ	国債証券	T 3% 09/30/25	7,000,000	10,916.31	764,142,030	11,606.63	812,464,465	3.000	2025/9/30	0.61
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/25	7,250,000	10,369.07	751,758,121	11,046.05	800,839,116	2.125	2025/5/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 3% 08/15/48	5,950,000	10,620.47	631,918,241	13,085.43	778,583,152	3.000	2048/8/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	7,050,000	10,876.92	766,823,133	10,949.16	771,915,882	3.625	2021/2/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 1.375% 09/30/23	7,100,000	10,120.94	718,586,975	10,623.95	754,301,122	1.375	2023/9/30	0.57
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	6,700,000	10,557.60	707,359,526	11,127.98	745,574,729	2.375	2024/8/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/25	6,500,000	10,421.58	677,402,802	11,151.26	724,832,496	2.250	2025/11/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 8.75% 08/15/20	6,340,000	11,623.37	736,921,777	11,356.91	720,028,192	8.750	2020/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	6,330,000	10,316.21	653,016,397	11,267.29	713,219,707	2.250	2027/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	6,500,000	10,442.74	678,778,534	10,847.69	705,099,965	2.000	2023/2/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 3% 10/31/25	5,950,000	10,916.76	649,547,539	11,617.86	691,262,868	3.000	2025/10/31	0.52
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/21	6,250,000	10,788.59	674,286,900	10,917.55	682,347,259	3.125	2021/5/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	6,050,000	10,311.60	623,852,146	10,965.38	663,405,490	2.000	2025/2/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.625% 05/15/21	6,000,000	10,671.55	640,293,024	10,829.39	649,763,637	2.625	2021/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.125% 01/31/21	6,000,000	10,566.47	633,988,463	10,714.82	642,889,481	2.125	2021/1/31	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.375% 10/31/20	6,000,000	10,434.47	626,068,261	10,603.79	636,227,419	1.375	2020/10/31	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/45	5,350,000	9,636.92	515,575,644	11,815.39	632,123,716	2.500	2045/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	5,390,000	11,069.27	596,633,906	11,699.78	630,618,557	2.625	2029/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.625% 02/15/26	5,750,000	9,981.92	573,960,625	10,757.86	618,577,303	1.625	2026/2/15	0.47

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	98.50
合計	98.50

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

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	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	簿価金額(現地通貨)	帳簿価額(円)	評価金額(現地通貨)	評価金額(円)	投資比率(%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	6	アメリカドル	719,883.36	76,638,783	719,296.86	76,576,344	0.06
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	3	アメリカドル	395,402.64	42,094,564	394,875	42,038,392	0.03
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	3	アメリカドル	497,355.75	52,948,493	495,750	52,777,545	0.04
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	2	ユーロ	225,083	26,476,513	225,110	26,479,689	0.02
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	3	ユーロ	408,072	48,001,510	408,420	48,042,445	0.04
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	6	ユーロ	1,072,374	126,143,353	1,073,640	126,292,273	0.10

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、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。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	1,800,000.00	191,276,034	191,430,000	0.14
	カナダドル	買建	200,000.00	15,987,636	16,008,000	0.01
	ユーロ	買建	150,000.00	17,582,340	17,644,500	0.01
	イギリスポンド	買建	200,000.00	25,868,200	25,924,000	0.02

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の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によって評価しております。発表されていない場合は、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先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

≪参考情報≫

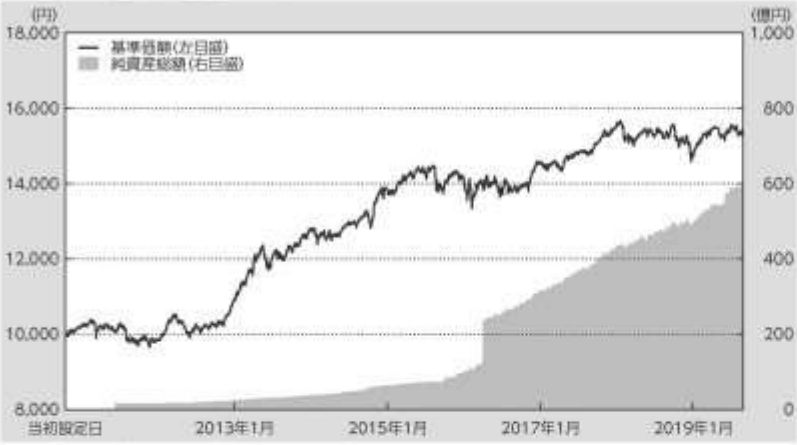
交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2010年10月20日
作成基準日：2019年 8 月30日

インデックスコレクション(バランス株式30)

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額	15,444円
純資産総額	601.72億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2015年 7 月	0円
2016年 7 月	0円
2017年 7 月	0円
2018年 7 月	0円
2019年 7 月	0円
設定来分配金合計額	0円

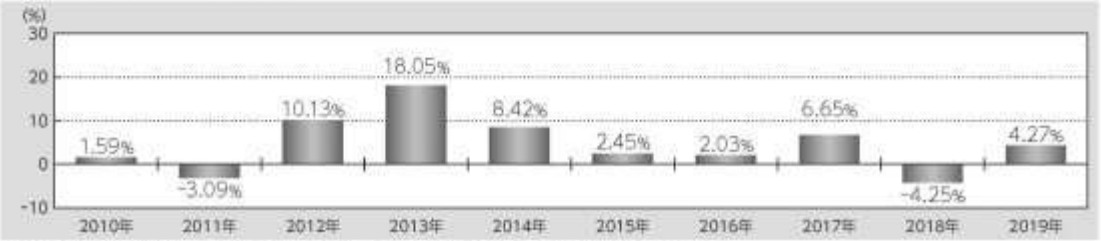
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本債券マザーファンド	60.0%	第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/12/20	0.8%
		第127回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2021/03/20	0.7%
		第339回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.4%	2025/06/20	0.7%
日本株式マザーファンド	19.6%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.7%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.4%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.3%
外国株式マザーファンド	10.4%	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.3%
		APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	-	-	0.3%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.2%
外国債券マザーファンド	9.7%	T 2.75% 02/15/24	アメリカ	国債	-	2.750%	2024/02/15	0.1%
		T 3.125% 08/15/44	アメリカ	国債	-	3.125%	2044/08/15	0.1%
		T 1.25% 03/31/21	アメリカ	国債	-	1.250%	2021/03/31	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2010年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2019年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

運用実績

当初設定日：2010年10月20日
作成基準日：2019年 8 月30日

インデックスコレクション(バランス株式50)

基準価額・純資産の推移

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額	18,096円
純資産総額	117.84億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2015年 7 月	0円
2016年 7 月	0円
2017年 7 月	0円
2018年 7 月	0円
2019年 7 月	0円
設定来分配金合計額	0円

※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本債券マザーファンド	40.7%	第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/12/20	0.5%
		第127回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2021/03/20	0.5%
		第339回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.4%	2025/06/20	0.5%
日本株式マザーファンド	29.3%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.0%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.5%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.5%
外国株式マザーファンド	20.1%	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.5%
		APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	-	-	0.5%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.4%
外国債券マザーファンド	9.6%	T 2.75% 02/15/24	アメリカ	国債	-	2.750%	2024/02/15	0.1%
		T 3.125% 08/15/44	アメリカ	国債	-	3.125%	2044/08/15	0.1%
		T 1.25% 03/31/21	アメリカ	国債	-	1.250%	2021/03/31	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

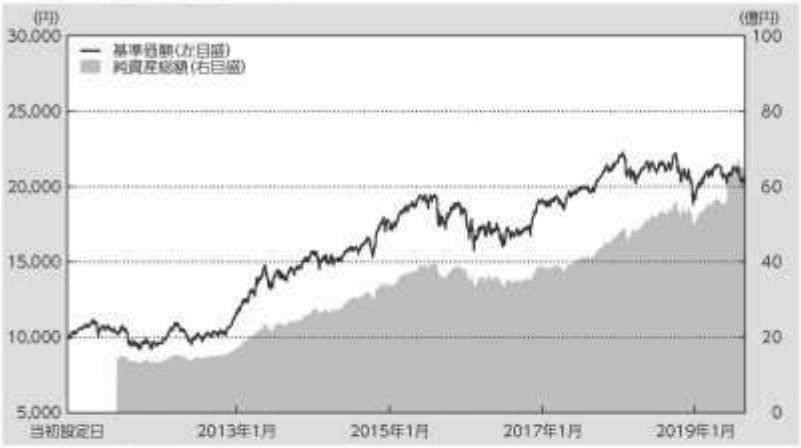
※2010年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2019年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

当初設定日：2010年10月20日
作成基準日：2019年 8 月30日

インデックスコレクション(バランス株式70)

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額	20,631円
純資産総額	66.31億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2015年 7 月	0円
2016年 7 月	0円
2017年 7 月	0円
2018年 7 月	0円
2019年 7 月	0円
設定来分配金合計額	0円

※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本株式マザーファンド	39.3%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.4%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.7%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.7%
外国株式マザーファンド	30.1%	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.8%
		APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	-	-	0.7%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.6%
日本債券マザーファンド	25.6%	第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/12/20	0.3%
		第127回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2021/03/20	0.3%
		第339回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.4%	2025/06/20	0.3%
外国債券マザーファンド	4.7%	T 2.75% 02/15/24	アメリカ	国債	-	2.750%	2024/02/15	0.0%
		T 3.125% 08/15/44	アメリカ	国債	-	3.125%	2044/08/15	0.0%
		T 1.25% 03/31/21	アメリカ	国債	-	1.250%	2021/03/31	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

※2010年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2019年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

＜申込手続＞

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に

規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。
受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

＜申込コース＞
当ファンドは、「分配金再投資コース」（※）専用ファンドです。
※「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

＜申込みの受付＞
お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

＜申込単位＞
1円以上1円単位とします。

＜申込価額＞
取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。
（注）分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の申込価額は、各計算期間終了日の基準価額とします。

＜申込手数料＞
ありません。

＜申込代金の支払い＞
販売会社が定める期日までにお支払いください。

＜受付不可日＞
収益分配金を再投資する場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。
ニューヨーク証券取引所の休業日
ロンドン証券取引所の休業日

＜申込受付の中止等＞
収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付けを中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

＜その他＞
取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委

託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

＜問い合わせ先＞

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

＜一部解約手続＞

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。

＜一部解約の受付＞

一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。なお、当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

＜一部解約単位＞

1口以上1口単位とします。

＜解約価額＞

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。

＜一部解約代金の支払い＞

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めに拠ることとなります。

＜受付不可日＞

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

＜一部解約受付の中止等＞

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止すること、及びすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消すことができます。

一部解約の実行の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以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記＜解約価額＞の規定に準じて計算された価額とします。

＜一部解約の制限＞

当ファンドの規模及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、大口の一部解約には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

＜その他＞

一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。

＜問い合わせ先＞

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）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。ただし、便宜上1万口当たりに換算した価額で表示することがあります。

＜基準価額の算出頻度＞

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。

＜主要な投資対象資産の評価方法＞

Ａ．親投資信託受益証券（日本株式マザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド及び外国債券マザーファンド）

計算日の基準価額で評価します。

Ｂ．国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

Ｃ．外国上場株式、外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）

原則として計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。

Ｄ．公社債等

計算日（※）における次のイ．からハ．までに掲げるいずれかの価額で評価します。

イ．日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

ロ．金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

ハ．価格情報会社の提供する価額

※　外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産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電信売買相場の仲値によって計算します。

＜基準価額の照会方法＞

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（2010年10月20日設定）

ただし、下記「(5)その他　＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞」の事項に該当する場合は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年７月26日から翌年７月25日までとすることを原則とします。ただし、第１計算期間は2010年10月20日から2011年７月25日までとします。

なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

①委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

・受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合

・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合

・やむを得ない事情が発生した場合

②委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。

③委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

④委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

委託会社は上記（1）①によりファンドの繰上償還を行おうとする場合、以下の手続きで行います。

①委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る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発します。

②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）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、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

③上記①の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以上に当たる多数をもって行います。

④上記①から③までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資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あって、上記①から③までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞

(1)投資信託約款の変更等

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託約款に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託約款を変更すること又は受託会社を同一とする他のファンドとの併合を行うことができます。

・受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

委託会社は、投資信託約款の変更又はファンドの併合を行う場合は、あらかじめ、その旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。

委託会社は、監督官庁の命令に基いて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続に従います。

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

委託会社はファンドの約款変更のうち重大な内容の変更（以下「重大な約款変更」といいま

す。）又はファンドの併合について、以下の手続きで行います。

①委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る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発します。

②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）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、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

③上記①の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以上に当たる多数をもって行います。

④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

⑤上記①から④までの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

⑥当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞

①受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

②委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

＜運用報告書＞

委託会社は、毎決算時及び償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用報告書を販売会社を通じて知れている受益者に対して交付します。

＜関係法人との契約の更改手続き＞

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

当該契約の有効期間は、契約満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

＜公告＞

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜混蔵寄託＞

金融機関又は第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者及び外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下同

じ。）から、売買代金及び償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書又はコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞

①信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

②上記①ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

③投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

①受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

②収益分配金は、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。
販売会社は、毎決算日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

(2)償還金に対する請求権

①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

②償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

④受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3)換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることにより換金する権利を有します。

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの投資信託財産に関する帳簿書類の閲覧又は謄写を請求することができます。

第３【ファンドの経理状況】

１【財務諸表】

【インデックスコレクション（バランス株式３０）】

(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)」に基づいて作成しております。
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9期計算期間(2018年7月26日から2019年7月25日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 （2018年 7月25日現在）	第9期 （2019年 7月25日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	4,208,904	-
コール・ローン	149,910,888	210,113,901
親投資信託受益証券	46,898,193,466	58,665,789,982
未収入金	47,755,503	55,938,508
流動資産合計	47,100,068,761	58,931,842,391
資産合計	47,100,068,761	58,931,842,391
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,630,054	27,700,015
未払受託者報酬	4,821,378	5,850,634
未払委託者報酬	36,160,252	43,879,730
未払利息	395	486
その他未払費用	844,199	869,242
流動負債合計	53,456,278	78,300,107
負債合計	53,456,278	78,300,107
純資産の部		
元本等		
元本	30,549,685,273	37,905,869,352
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	16,496,927,210	20,947,672,932
（分配準備積立金）	4,004,853,737	4,547,594,885
元本等合計	47,046,612,483	58,853,542,284
純資産合計	47,046,612,483	58,853,542,284
負債純資産合計	47,100,068,761	58,931,842,391

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期 自　2017年 7月26日 至　2018年 7月25日	第9期 自　2018年 7月26日 至　2019年 7月25日
営業収益		
受取利息	119	93
有価証券売買等損益	1,597,037,206	676,907,107
営業収益合計	1,597,037,325	676,907,200
営業費用		
支払利息	100,725	139,753
受託者報酬	9,213,809	11,177,013
委託者報酬	69,103,396	83,827,440
その他費用	1,692,418	1,745,619
営業費用合計	80,110,348	96,889,825
営業利益又は営業損失（△）	1,516,926,977	580,017,375
経常利益又は経常損失（△）	1,516,926,977	580,017,375
当期純利益又は当期純損失（△）	1,516,926,977	580,017,375
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（△）	77,565,155	△11,356,500
期首剰余金又は期首欠損金（△）	12,042,066,713	16,496,927,210
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,022,902,902	4,475,423,518
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,022,902,902	4,475,423,518
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,007,404,227	616,051,671
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,007,404,227	616,051,671
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	16,496,927,210	20,947,672,932

（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	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、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8期 (2018年 7月25日現在)	第9期 (2019年 7月25日現在)
１．計算期間の末日における受益権の総数	30,549,685,273口	37,905,869,352口
２．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.5400円 (1万口当たり純資産額) (15,400円)	1口当たり純資産額 1.5526円 (1万口当たり純資産額) (15,526円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第8期 自 2017年 7月26日 至 2018年 7月25日	第9期 自 2018年 7月26日 至 2019年 7月25日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	583,973,951円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	855,387,871円
収益調整金額	C	12,492,073,473円
分配準備積立金額	D	2,565,491,915円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	16,496,927,210円
当ファンドの期末残存口数	F	30,549,685,273口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	5,400円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	674,815,560円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	16,400,078,047円
分配準備積立金額	D	3,872,779,325円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	20,947,672,932円
当ファンドの期末残存口数	F	37,905,869,352口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	5,526円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	第9期 自 2018年 7月26日 至 2019年 7月25日
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	第9期 (2019年 7月25日現在)
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .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)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .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。

（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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第8期 自 2017年 7月26日 至 2018年 7月25日	第9期 自 2018年 7月26日 至 2019年 7月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	24,898,685,779円	30,549,685,273円
期中追加設定元本額	7,713,381,660円	8,500,605,703円
期中一部解約元本額	2,062,382,166円	1,144,421,624円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第8期 (2018年 7月25日現在)	第9期 (2019年 7月25日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,476,490,675	736,471,552
合計	1,476,490,675	736,471,552

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（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

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考

親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	7,089,844,624	11,945,679,206	
	日本債券マザーファンド	24,782,911,663	34,653,945,378	
	外国株式マザーファンド	2,276,093,581	6,422,453,257	
	外国債券マザーファンド	2,354,489,838	5,643,712,141	
合計		36,503,339,706	58,665,789,982	

(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。

【インデックスコレクション（バランス株式５０）】

(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)」に基づいて作成しております。
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9期計算期間(2018年7月26日から2019年7月25日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 （2018年 7月25日現在）	第9期 （2019年 7月25日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	839,827	-
コール・ローン	29,912,594	41,614,289
親投資信託受益証券	8,629,484,156	11,630,883,047
未収入金	9,648,503	30,642,730
流動資産合計	8,669,885,080	11,703,140,066
資産合計	8,669,885,080	11,703,140,066
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,587,228	23,716,942
未払受託者報酬	877,219	1,043,473
未払委託者報酬	7,017,712	8,347,710
未払利息	78	96
その他未払費用	219,427	260,813
流動負債合計	11,701,664	33,369,034
負債合計	11,701,664	33,369,034
純資産の部		
元本等		
元本	4,692,611,118	6,339,102,081
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,965,572,298	5,330,668,951
（分配準備積立金）	1,864,527,188	1,880,510,728
元本等合計	8,658,183,416	11,669,771,032
純資産合計	8,658,183,416	11,669,771,032
負債純資産合計	8,669,885,080	11,703,140,066

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期 自　2017年 7月26日 至　2018年 7月25日	第9期 自　2018年 7月26日 至　2019年 7月25日
営業収益		
受取利息	17	15
有価証券売買等損益	455,017,363	64,622,871
営業収益合計	455,017,380	64,622,886
営業費用		
支払利息	19,138	26,408
受託者報酬	1,676,283	1,993,048
委託者報酬	13,410,175	15,944,249
その他費用	419,834	499,775
営業費用合計	15,525,430	18,463,480
営業利益又は営業損失（△）	439,491,950	46,159,406
経常利益又は経常損失（△）	439,491,950	46,159,406
当期純利益又は当期純損失（△）	439,491,950	46,159,406
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（△）	20,609,296	△12,860,824
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,861,007,567	3,965,572,298
剰余金増加額又は欠損金減少額	903,300,699	1,608,393,762
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	903,300,699	1,608,393,762
剰余金減少額又は欠損金増加額	217,618,622	302,317,339
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	217,618,622	302,317,339
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,965,572,298	5,330,668,951

（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	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、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8期 (2018年 7月25日現在)	第9期 (2019年 7月25日現在)
１．計算期間の末日における受益権の総数	4,692,611,118口	6,339,102,081口
２．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.8451円 (1万口当たり純資産額) (18,451円)	1口当たり純資産額 1.8409円 (1万口当たり純資産額) (18,409円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第8期 自 2017年 7月26日 至 2018年 7月25日	第9期 自 2018年 7月26日 至 2019年 7月25日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	124,855,853円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	294,026,801円
収益調整金額	C	2,101,045,110円
分配準備積立金額	D	1,445,644,534円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,965,572,298円
当ファンドの期末残存口数	F	4,692,611,118口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	8,450円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	143,138,228円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	3,450,158,223円
分配準備積立金額	D	1,737,372,500円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,330,668,951円
当ファンドの期末残存口数	F	6,339,102,081口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	8,409円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	第9期 自 2018年 7月26日 至 2019年 7月25日
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	第9期 (2019年 7月25日現在)
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .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)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .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。

（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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第8期 自 2017年 7月26日 至 2018年 7月25日	第9期 自 2018年 7月26日 至 2019年 7月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	3,863,641,337円	4,692,611,118円
期中追加設定元本額	1,120,338,164円	2,005,968,696円
期中一部解約元本額	291,368,383円	359,477,733円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第8期 (2018年 7月25日現在)	第9期 (2019年 7月25日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	444,135,902	82,641,416
合計	444,135,902	82,641,416

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（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

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考

親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	2,061,326,285	3,473,128,657	
	日本債券マザーファンド	3,315,871,451	4,636,583,049	
	外国株式マザーファンド	863,488,618	2,436,505,833	
	外国債券マザーファンド	452,509,599	1,084,665,508	
合計		6,693,195,953	11,630,883,047	

(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。

【インデックスコレクション（バランス株式７０）】

(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)」に基づいて作成しております。
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9期計算期間(2018年7月26日から2019年7月25日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 （2018年 7月25日現在）	第9期 （2019年 7月25日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	652,466	-
コール・ローン	23,239,248	27,032,067
親投資信託受益証券	5,270,899,369	6,606,504,116
未収入金	10,996,973	779,213
流動資産合計	5,305,788,056	6,634,315,396
資産合計	5,305,788,056	6,634,315,396
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,504,419	994,022
未払受託者報酬	530,962	617,076
未払委託者報酬	4,513,115	5,245,088
未払利息	61	62
その他未払費用	132,775	154,211
流動負債合計	16,681,332	7,010,459
負債合計	16,681,332	7,010,459
純資産の部		
元本等		
元本	2,457,866,262	3,120,001,692
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,831,240,462	3,507,303,245
（分配準備積立金）	1,050,298,032	1,009,233,149
元本等合計	5,289,106,724	6,627,304,937
純資産合計	5,289,106,724	6,627,304,937
負債純資産合計	5,305,788,056	6,634,315,396

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期 自　2017年 7月26日 至　2018年 7月25日	第9期 自　2018年 7月26日 至　2019年 7月25日
営業収益		
受取利息	10	10
有価証券売買等損益	363,818,611	△21,215,652
営業収益合計	363,818,621	△21,215,642
営業費用		
支払利息	13,279	17,410
受託者報酬	1,011,529	1,193,124
委託者報酬	8,597,868	10,141,487
その他費用	253,292	299,263
営業費用合計	9,875,968	11,651,284
営業利益又は営業損失（△）	353,942,653	△32,866,926
経常利益又は経常損失（△）	353,942,653	△32,866,926
当期純利益又は当期純損失（△）	353,942,653	△32,866,926
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（△）	39,066,468	△21,837,008
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,030,619,562	2,831,240,462
剰余金増加額又は欠損金減少額	861,977,299	1,109,346,256
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	861,977,299	1,109,346,256
剰余金減少額又は欠損金増加額	376,232,584	422,253,555
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	376,232,584	422,253,555
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,831,240,462	3,507,303,245

（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	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、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8期 (2018年 7月25日現在)		第9期 (2019年 7月25日現在)	
１．計算期間の末日における受益権の総数		2,457,866,262口		3,120,001,692口
２．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額	2.1519円	1口当たり純資産額	2.1241円
	(1万口当たり純資産額)	(21,519円)	(1万口当たり純資産額)	(21,241円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第8期
自 2017年 7月26日
至 2018年 7月25日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	82,233,253円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	232,642,932円
収益調整金額	C	1,780,942,430円
分配準備積立金額	D	735,421,847円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,831,240,462円
当ファンドの期末残存口数	F	2,457,866,262口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	11,519円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

第9期
自 2018年 7月26日
至 2019年 7月25日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	96,553,106円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	2,498,070,096円
分配準備積立金額	D	912,680,043円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,507,303,245円
当ファンドの期末残存口数	F	3,120,001,692口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	11,241円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	第9期 自 2018年 7月26日 至 2019年 7月25日
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	第9期 (2019年 7月25日現在)
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .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)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .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。

（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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第8期 自 2017年 7月26日 至 2018年 7月25日	第9期 自 2018年 7月26日 至 2019年 7月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,054,207,840円	2,457,866,262円
期中追加設定元本額	778,728,051円	1,031,236,687円
期中一部解約元本額	375,069,629円	369,101,257円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第8期 (2018年 7月25日現在)	第9期 (2019年 7月25日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	351,659,388	△10,239,504
合計	351,659,388	△10,239,504

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（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

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考

親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	1,561,609,617	2,631,156,043	
	日本債券マザーファンド	1,170,023,162	1,636,043,387	
	外国株式マザーファンド	723,731,997	2,042,154,575	
	外国債券マザーファンド	123,967,506	297,150,111	
合計		3,579,332,282	6,606,504,116	

(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。

（参考）

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。
なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2019年 7月25日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,825,635,236
株式	220,561,307,530
派生商品評価勘定	37,130,020
未収入金	3,398,290
未収配当金	324,488,494
差入委託証拠金	61,625,830
流動資産合計	222,813,585,400
資産合計	222,813,585,400
負債の部	
流動負債	
前受金	37,137,040
未払金	83,440
未払解約金	169,896,546
未払利息	4,223
その他未払費用	518
流動負債合計	207,121,767
負債合計	207,121,767
純資産の部	
元本等	
元本	132,121,145,523
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	90,485,318,110

	2019年 7月25日現在
項目	金額（円）
元本等合計	222,606,463,633
純資産合計	222,606,463,633
負債純資産合計	222,813,585,400

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 7月25日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2019年 7月25日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	132,121,145,523口
2．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.6849円 (1万口当たり純資産額) (16,849円)

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2019年 7月25日現在
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2019年 7月25日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .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)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2019年 7月25日現在
３.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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2019年 7月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 7月26日
期首元本額	129,074,910,769円
期中追加設定元本額	14,626,131,754円
期中一部解約元本額	11,579,897,000円
期末元本額	132,121,145,523円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	763,125,282円
ＤＣ日本株式インデックスファンド	337,219,882円
ＤＣ日本株式インデックスファンドＬ	53,966,871,423円
ＤＣ日本株式インデックスファンドＡ	1,157,255,213円
ＤＣバランスファンド３０	2,271,073,347円
ＤＣバランスファンド５０	3,341,218,121円
ＤＣバランスファンド７０	1,738,229,420円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	623,729,660円
日本株式インデックスｅ	1,832,744,496円
インデックスコレクション（国内株式）	11,340,998,115円

区分	2019年 7月25日現在
インデックスコレクション（バランス株式３０）	7,089,844,624円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	2,061,326,285円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	1,561,609,617円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,417,984,330円
日本株式パッシブファンド私募Ａ（適格機関投資家専用）	2,291,813,622円
日本株式インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	1,672,639,934円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	127,481,985円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	1,257,699,890円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	135,583,395円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	725,574,041円
ＶＡバランス株式３０（適格機関投資家専用）	4,591,192円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	880,417,586円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	1,379,974,040円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	648,793,863円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	11,005,079,208円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	903,489,587円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	161,625,610円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	1,819,573,975円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	49,277,886円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	219,695,790円
バランスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	2,775,759,281円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	87,874,358円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	87,640,685円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	1,233,468,803円
バランスファンドＶＡ２（適格機関投資家専用）	972,521,351円
バランスＶＡ２０Ｌ（適格機関投資家専用）	19,497,089円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	465,311,084円
バランスファンドＶＡ３（適格機関投資家専用）	7,290,425,933円
世界バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	128,278,703円
国内バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	65,186,884円
国内バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	11,933,163円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	190,678,951円
私募日本株式インデックスファンドＡＬ（適格機関投資家専用）	6,027,819円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2019年 7月25日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	2,957,284,567
合計	2,957,284,567

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本株式マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2019年 7月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,872,242,960	－	1,909,380,000	37,137,040
合計		1,872,242,960	－	1,909,380,000	37,137,040

(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、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2.株価指数先物取引の残高は、契約金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。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	4,300	3,060.00	13,158,000	
日本水産	132,400	690.00	91,356,000	
マルハニチロ	19,100	3,135.00	59,878,500	
カネコ種苗	4,000	1,290.00	5,160,000	
サカタのタネ	16,100	3,485.00	56,108,500	
ホクト	11,100	1,846.00	20,490,600	
ホクリヨウ	1,800	611.00	1,099,800	
住石ホールディングス	28,500	133.00	3,790,500	
日鉄鉱業	3,000	4,785.00	14,355,000	
三井松島ホールディングス	5,500	1,307.00	7,188,500	
国際石油開発帝石	531,200	970.50	515,529,600	
石油資源開発	19,000	2,451.00	46,569,000	
K＆Oエナジーグループ	6,400	1,463.00	9,363,200	
ヒノキヤグループ	3,700	2,034.00	7,525,800	
ショーボンドホールディングス	18,900	3,765.00	71,158,500	
ミライト・ホールディングス	37,300	1,639.00	61,134,700	
タマホーム	6,400	1,499.00	9,593,600	

サンヨーホームズ	1,900	698.00	1,326,200	
日本アクア	4,200	606.00	2,545,200	
ファーストコーポレーション	4,000	634.00	2,536,000	
ベステラ	2,500	1,358.00	3,395,000	
ＴＡＴＥＲＵ	16,100	194.00	3,123,400	
スペースバリューホールディングス	16,100	519.00	8,355,900	
ダイセキ環境ソリューション	2,500	660.00	1,650,000	
第一カッター興業	1,600	1,762.00	2,819,200	
安藤・間	85,600	769.00	65,826,400	
東急建設	39,500	751.00	29,664,500	
コムシスホールディングス	47,000	2,797.00	131,459,000	
ミサワホーム	10,900	1,099.00	11,979,100	
ビーアールホールディングス	14,400	347.00	4,996,800	
高松コンストラクショングループ	8,500	2,270.00	19,295,000	
東建コーポレーション	4,200	6,280.00	26,376,000	
ソネック	1,400	807.00	1,129,800	
ヤマウラ	5,700	828.00	4,719,600	
大成建設	108,900	3,770.00	410,553,000	
大林組	328,100	1,053.00	345,489,300	
清水建設	334,800	882.00	295,293,600	
飛島建設	9,700	1,307.00	12,677,900	
長谷工コーポレーション	137,000	1,152.00	157,824,000	
松井建設	12,800	689.00	8,819,200	
錢高組	1,300	4,595.00	5,973,500	
鹿島建設	256,400	1,443.00	369,985,200	
不動テトラ	7,900	1,333.00	10,530,700	
大末建設	4,400	960.00	4,224,000	
鉄建建設	6,800	2,945.00	20,026,000	
西松建設	23,800	2,114.00	50,313,200	
三井住友建設	78,800	569.00	44,837,200	
大豊建設	7,600	2,759.00	20,968,400	
前田建設工業	78,500	831.00	65,233,500	
佐田建設	8,300	386.00	3,203,800	
ナカノフドー建設	9,500	433.00	4,113,500	
奥村組	18,100	3,325.00	60,182,500	
東鉄工業	13,100	3,030.00	39,693,000	
イチケン	2,300	1,710.00	3,933,000	
富士ピー・エス	4,500	469.00	2,110,500	
淺沼組	3,800	3,535.00	13,433,000	
戸田建設	127,800	605.00	77,319,000	
熊谷組	15,700	2,928.00	45,969,600	
青木あすなろ建設	6,000	838.00	5,028,000	

北野建設	2,500	2,598.00	6,495,000	
植木組	1,600	2,266.00	3,625,600	
矢作建設工業	14,900	712.00	10,608,800	
ピーエス三菱	12,300	623.00	7,662,900	
日本ハウスホールディングス	20,900	447.00	9,342,300	
大東建託	39,000	14,420.00	562,380,000	
新日本建設	13,600	897.00	12,199,200	
ＮＩＰＰＯ	28,900	2,128.00	61,499,200	
東亜道路工業	2,100	3,330.00	6,993,000	
前田道路	34,200	2,339.00	79,993,800	
日本道路	3,000	6,100.00	18,300,000	
東亜建設工業	9,500	1,451.00	13,784,500	
日本国土開発	17,800	527.00	9,380,600	
若築建設	5,500	1,462.00	8,041,000	
東洋建設	40,000	442.00	17,680,000	
五洋建設	129,900	535.00	69,496,500	
世紀東急工業	15,900	630.00	10,017,000	
福田組	3,700	4,490.00	16,613,000	
住友林業	77,800	1,338.00	104,096,400	
日本基礎技術	11,200	341.00	3,819,200	
巴コーポレーション	14,900	404.00	6,019,600	
大和ハウス工業	302,700	3,123.00	945,332,100	
ライト工業	21,000	1,465.00	30,765,000	
積水ハウス	334,800	1,895.50	634,613,400	
日特建設	9,300	602.00	5,598,600	
北陸電気工事	5,300	879.00	4,658,700	
ユアテック	17,500	760.00	13,300,000	
四電工	1,700	2,677.00	4,550,900	
中電工	14,100	2,394.00	33,755,400	
関電工	49,700	938.00	46,618,600	
きんでん	72,600	1,648.00	119,644,800	
東京エネシス	11,300	935.00	10,565,500	
トーエネック	3,100	3,225.00	9,997,500	
住友電設	7,600	1,812.00	13,771,200	
日本電設工業	18,600	2,132.00	39,655,200	
協和エクシオ	42,800	2,629.00	112,521,200	
新日本空調	9,100	1,819.00	16,552,900	
九電工	21,500	3,305.00	71,057,500	
三機工業	25,100	1,276.00	32,027,600	
日揮	94,500	1,440.00	136,080,000	
中外炉工業	3,400	1,626.00	5,528,400	
ヤマト	10,700	578.00	6,184,600	

太平電業	7,400	2,232.00	16,516,800	
高砂熱学工業	26,900	1,740.00	46,806,000	
三晃金属工業	1,500	2,446.00	3,669,000	
朝日工業社	2,400	2,719.00	6,525,600	
明星工業	19,800	762.00	15,087,600	
大氣社	15,000	3,330.00	49,950,000	
ダイダン	7,500	2,250.00	16,875,000	
日比谷総合設備	9,800	1,948.00	19,090,400	
東芝プラントシステム	23,900	1,930.00	46,127,000	
ＯＳＪＢホールディングス	48,200	251.00	12,098,200	
東洋エンジニアリング	12,800	545.00	6,976,000	
レイズネクスト	19,600	1,169.00	22,912,400	
日本製粉	31,000	1,771.00	54,901,000	
日清製粉グループ本社	110,600	2,439.00	269,753,400	
日東富士製粉	700	5,770.00	4,039,000	
昭和産業	9,000	3,065.00	27,585,000	
鳥越製粉	8,700	815.00	7,090,500	
中部飼料	12,000	1,255.00	15,060,000	
フィード・ワン	65,700	183.00	12,023,100	
東洋精糖	1,500	1,020.00	1,530,000	
日本甜菜製糖	5,600	2,052.00	11,491,200	
三井製糖	7,700	2,302.00	17,725,400	
塩水港精糖	10,600	211.00	2,236,600	
日新製糖	4,600	1,985.00	9,131,000	
森永製菓	24,600	5,130.00	126,198,000	
中村屋	2,500	4,290.00	10,725,000	
江崎グリコ	29,400	4,790.00	140,826,000	
名糖産業	4,700	1,395.00	6,556,500	
井村屋グループ	4,200	2,108.00	8,853,600	
不二家	5,500	1,972.00	10,846,000	
山崎製パン	80,000	1,684.00	134,720,000	
第一屋製パン	1,700	984.00	1,672,800	
モロゾフ	1,700	4,885.00	8,304,500	
亀田製菓	6,100	4,995.00	30,469,500	
寿スピリッツ	10,400	6,180.00	64,272,000	
カルビー	44,600	2,976.00	132,729,600	
森永乳業	19,600	4,275.00	83,790,000	
六甲バター	7,100	1,785.00	12,673,500	
ヤクルト本社	72,500	6,340.00	459,650,000	
明治ホールディングス	69,300	7,510.00	520,443,000	
雪印メグミルク	23,600	2,340.00	55,224,000	
プリマハム	13,800	2,112.00	29,145,600	

日本ハム	40,500	4,200.00	170,100,000	
林兼産業	3,200	660.00	2,112,000	
丸大食品	10,400	2,103.00	21,871,200	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	8,800	3,460.00	30,448,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	63,000	728.00	45,864,000	
サッポロホールディングス	35,800	2,410.00	86,278,000	
アサヒグループホールディングス	205,000	4,641.00	951,405,000	
キリンホールディングス	442,700	2,353.00	1,041,673,100	
宝ホールディングス	73,300	1,113.00	81,582,900	
オエノンホールディングス	27,800	375.00	10,425,000	
養命酒製造	3,000	1,949.00	5,847,000	
コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	74,900	2,706.00	202,679,400	
サントリー食品インターナショナル	65,500	4,345.00	284,597,500	
ダイドーグループホールディングス	5,500	4,310.00	23,705,000	
伊藤園	29,700	4,770.00	141,669,000	
キーコーヒー	9,600	2,101.00	20,169,600	
ユニカフェ	2,700	981.00	2,648,700	
ジャパンフーズ	1,400	1,219.00	1,706,600	
日清オイリオグループ	12,600	3,180.00	40,068,000	
不二製油グループ本社	23,900	3,340.00	79,826,000	
かどや製油	1,100	4,040.00	4,444,000	
Ｊ－オイルミルズ	5,100	4,030.00	20,553,000	
キッコーマン	64,600	5,180.00	334,628,000	
味の素	216,100	1,795.50	388,007,550	
キユーピー	54,500	2,469.00	134,560,500	
ハウス食品グループ本社	36,600	4,045.00	148,047,000	
カゴメ	39,200	2,505.00	98,196,000	
焼津水産化学工業	4,700	1,085.00	5,099,500	
アリアケジャパン	8,900	6,740.00	59,986,000	
ピエトロ	1,300	1,608.00	2,090,400	
エバラ食品工業	2,400	2,115.00	5,076,000	
ニチレイ	50,800	2,604.00	132,283,200	
東洋水産	50,400	4,625.00	233,100,000	
イートアンド	3,400	1,684.00	5,725,600	
大冷	1,100	1,974.00	2,171,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	2,700	794.00	2,143,800	
日清食品ホールディングス	41,600	6,990.00	290,784,000	
永谷園ホールディングス	5,200	2,095.00	10,894,000	
一正蒲鉾	3,800	1,030.00	3,914,000	
フジッコ	10,600	2,020.00	21,412,000	
ロック・フィールド	10,500	1,418.00	14,889,000	
日本たばこ産業	565,100	2,427.00	1,371,497,700	

ケンコーマヨネーズ	5,500	2,432.00	13,376,000	
わらべや日洋ホールディングス	6,400	1,740.00	11,136,000	
なとり	5,500	1,588.00	8,734,000	
イフジ産業	1,700	674.00	1,145,800	
ピックルスコーポレーション	2,300	2,317.00	5,329,100	
北の達人コーポレーション	38,400	669.00	25,689,600	
ユーグレナ	41,700	1,041.00	43,409,700	
ミヨシ油脂	3,700	1,085.00	4,014,500	
理研ビタミン	4,600	3,385.00	15,571,000	
片倉工業	12,000	1,290.00	15,480,000	
グンゼ	6,500	4,930.00	32,045,000	
東洋紡	40,700	1,385.00	56,369,500	
ユニチカ	28,800	442.00	12,729,600	
富士紡ホールディングス	5,100	2,394.00	12,209,400	
倉敷紡績	9,300	2,043.00	18,999,900	
シキボウ	5,000	1,012.00	5,060,000	
日本毛織	31,800	898.00	28,556,400	
トーア紡コーポレーション	4,100	458.00	1,877,800	
帝国繊維	10,900	1,999.00	21,789,100	
帝人	78,100	1,885.00	147,218,500	
東レ	741,300	782.20	579,844,860	
サカイオーベックス	2,500	1,766.00	4,415,000	
住江織物	2,800	2,969.00	8,313,200	
日本フエルト	6,100	465.00	2,836,500	
イチカワ	1,500	1,585.00	2,377,500	
日東製網	1,100	1,437.00	1,580,700	
アツギ	8,000	932.00	7,456,000	
ダイニック	3,900	753.00	2,936,700	
セーレン	23,700	1,557.00	36,900,900	
ソトー	3,900	981.00	3,825,900	
東海染工	1,400	1,130.00	1,582,000	
小松マテーレ	15,800	811.00	12,813,800	
ワコールホールディングス	27,000	2,855.00	77,085,000	
ホギメディカル	11,900	3,060.00	36,414,000	
レナウン	27,600	124.00	3,422,400	
クラウディアホールディングス	2,500	527.00	1,317,500	
ＴＳＩホールディングス	35,400	621.00	21,983,400	
マツオカコーポレーション	3,100	2,659.00	8,242,900	
ワールド	12,500	2,170.00	27,125,000	
三陽商会	5,800	1,544.00	8,955,200	
ナイガイ	3,700	445.00	1,646,500	
オンワードホールディングス	57,500	585.00	33,637,500	

ルックホールディングス	3,600	1,235.00	4,446,000	
ゴールドウイン	8,700	14,950.00	130,065,000	
デサント	23,300	1,711.00	39,866,300	
キング	5,200	670.00	3,484,000	
ヤマトインターナショナル	6,000	424.00	2,544,000	
特種東海製紙	6,100	3,775.00	23,027,500	
王子ホールディングス	429,900	582.00	250,201,800	
日本製紙	45,800	1,967.00	90,088,600	
三菱製紙	15,600	586.00	9,141,600	
北越コーポレーション	63,400	563.00	35,694,200	
中越パルプ工業	4,000	1,581.00	6,324,000	
巴川製紙所	3,100	946.00	2,932,600	
大王製紙	46,500	1,302.00	60,543,000	
阿波製紙	2,500	433.00	1,082,500	
レンゴー	98,500	839.00	82,641,500	
トーモク	5,900	1,781.00	10,507,900	
ザ・パック	7,200	3,430.00	24,696,000	
クラレ	161,100	1,312.00	211,363,200	
旭化成	679,400	1,133.00	769,760,200	
共和レザー	5,900	824.00	4,861,600	
昭和電工	63,500	3,005.00	190,817,500	
住友化学	751,800	494.00	371,389,200	
住友精化	4,700	3,415.00	16,050,500	
日産化学	58,200	4,680.00	272,376,000	
ラサ工業	3,400	1,523.00	5,178,200	
クレハ	8,800	7,190.00	63,272,000	
多木化学	2,800	4,275.00	11,970,000	
テイカ	7,800	2,381.00	18,571,800	
石原産業	18,300	1,214.00	22,216,200	
片倉コープアグリ	2,800	1,080.00	3,024,000	
日本曹達	15,100	2,840.00	42,884,000	
東ソー	147,600	1,563.00	230,698,800	
トクヤマ	27,500	2,881.00	79,227,500	
セントラル硝子	20,800	2,587.00	53,809,600	
東亞合成	59,900	1,187.00	71,101,300	
大阪ソーダ	10,300	2,649.00	27,284,700	
関東電化工業	22,600	729.00	16,475,400	
デンカ	37,500	3,150.00	118,125,000	
信越化学工業	168,300	11,035.00	1,857,190,500	
日本カーバイド工業	3,200	1,351.00	4,323,200	
堺化学工業	6,400	2,529.00	16,185,600	
第一稀元素化学工業	10,300	891.00	9,177,300	

エア・ウォーター	78,200	1,817.00	142,089,400	
大陽日酸	78,700	2,156.00	169,677,200	
日本化学工業	3,200	2,210.00	7,072,000	
東邦アセチレン	1,400	1,299.00	1,818,600	
日本パーカライジング	52,200	1,237.00	64,571,400	
高圧ガス工業	15,100	834.00	12,593,400	
チタン工業	1,200	3,180.00	3,816,000	
四国化成工業	16,100	1,122.00	18,064,200	
戸田工業	2,000	2,326.00	4,652,000	
ステラ　ケミファ	5,600	2,885.00	16,156,000	
保土谷化学工業	3,300	2,851.00	9,408,300	
日本触媒	16,100	7,260.00	116,886,000	
大日精化工業	7,900	2,944.00	23,257,600	
カネカ	24,700	4,100.00	101,270,000	
三菱瓦斯化学	97,100	1,463.00	142,057,300	
三井化学	86,700	2,559.00	221,865,300	
ＪＳＲ	95,800	1,716.00	164,392,800	
東京応化工業	16,400	3,560.00	58,384,000	
大阪有機化学工業	8,800	1,027.00	9,037,600	
三菱ケミカルホールディングス	638,400	745.80	476,118,720	
ＫＨネオケム	14,500	2,823.00	40,933,500	
ダイセル	140,700	956.00	134,509,200	
住友ベークライト	16,500	3,815.00	62,947,500	
積水化学工業	205,400	1,598.00	328,229,200	
日本ゼオン	86,100	1,235.00	106,333,500	
アイカ工業	28,600	3,550.00	101,530,000	
宇部興産	48,200	2,299.00	110,811,800	
積水樹脂	15,800	2,122.00	33,527,600	
タキロンシーアイ	20,700	699.00	14,469,300	
旭有機材	6,600	1,412.00	9,319,200	
日立化成	44,200	2,990.00	132,158,000	
ニチバン	5,000	1,923.00	9,615,000	
リケンテクノス	26,000	524.00	13,624,000	
大倉工業	4,900	1,792.00	8,780,800	
積水化成品工業	14,200	753.00	10,692,600	
群栄化学工業	2,500	2,465.00	6,162,500	
タイガースポリマー	5,000	565.00	2,825,000	
ミライアル	2,800	1,497.00	4,191,600	
ダイキアクシス	3,400	853.00	2,900,200	
ダイキョーニシカワ	20,100	930.00	18,693,000	
竹本容器	3,400	1,212.00	4,120,800	
森六ホールディングス	5,100	2,544.00	12,974,400	

日本化薬	59,100	1,362.00	80,494,200	
カーリットホールディングス	10,200	639.00	6,517,800	
日本精化	7,700	1,234.00	9,501,800	
扶桑化学工業	9,700	2,270.00	22,019,000	
トリケミカル研究所	2,100	5,550.00	11,655,000	
ＡＤＥＫＡ	47,100	1,642.00	77,338,200	
日油	36,000	3,900.00	140,400,000	
新日本理化	17,300	213.00	3,684,900	
ハリマ化成グループ	7,900	1,145.00	9,045,500	
花王	236,700	8,244.00	1,951,354,800	
第一工業製薬	3,600	3,325.00	11,970,000	
石原ケミカル	2,400	1,700.00	4,080,000	
日華化学	3,200	838.00	2,681,600	
ニイタカ	1,500	1,474.00	2,211,000	
三洋化成工業	6,400	5,410.00	34,624,000	
有機合成薬品工業	7,300	239.00	1,744,700	
大日本塗料	10,800	1,006.00	10,864,800	
日本ペイントホールディングス	78,800	4,615.00	363,662,000	
関西ペイント	107,300	2,101.00	225,437,300	
神東塗料	7,500	172.00	1,290,000	
中国塗料	31,400	943.00	29,610,200	
日本特殊塗料	7,100	1,351.00	9,592,100	
藤倉化成	12,900	617.00	7,959,300	
太陽ホールディングス	7,900	3,320.00	26,228,000	
ＤＩＣ	43,200	2,962.00	127,958,400	
サカタインクス	20,800	1,066.00	22,172,800	
東洋インキＳＣホールディングス	20,200	2,412.00	48,722,400	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	7,400	985.00	7,289,000	
富士フイルムホールディングス	202,500	5,351.00	1,083,577,500	
資生堂	193,800	8,102.00	1,570,167,600	
ライオン	135,800	2,164.00	293,871,200	
高砂香料工業	6,700	2,968.00	19,885,600	
マンダム	21,900	2,660.00	58,254,000	
ミルボン	12,000	5,520.00	66,240,000	
ファンケル	43,400	2,692.00	116,832,800	
コーセー	16,500	19,240.00	317,460,000	
コタ	5,100	1,162.00	5,926,200	
シーボン	1,200	2,410.00	2,892,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	41,600	2,930.00	121,888,000	
ノエビアホールディングス	9,300	5,810.00	54,033,000	
アジュバンコスメジャパン	2,200	916.00	2,015,200	
エステー	7,000	1,680.00	11,760,000	

アグロ　カネショウ	4,000	1,609.00	6,436,000	
コニシ	17,300	1,570.00	27,161,000	
長谷川香料	12,900	1,994.00	25,722,600	
星光ＰＭＣ	6,500	761.00	4,946,500	
小林製薬	27,300	7,980.00	217,854,000	
荒川化学工業	8,800	1,510.00	13,288,000	
メック	6,700	1,066.00	7,142,200	
日本高純度化学	2,700	2,345.00	6,331,500	
タカラバイオ	25,500	2,103.00	53,626,500	
ＪＣＵ	12,600	2,093.00	26,371,800	
新田ゼラチン	6,100	710.00	4,331,000	
ＯＡＴアグリオ	1,300	1,329.00	1,727,700	
デクセリアルズ	25,100	730.00	18,323,000	
アース製薬	7,300	4,645.00	33,908,500	
北興化学工業	10,000	489.00	4,890,000	
大成ラミック	3,200	2,839.00	9,084,800	
クミアイ化学工業	40,300	880.00	35,464,000	
日本農薬	17,400	446.00	7,760,400	
アキレス	7,100	2,088.00	14,824,800	
有沢製作所	15,400	930.00	14,322,000	
日東電工	67,300	5,289.00	355,949,700	
レック	10,400	1,273.00	13,239,200	
三光合成	11,100	371.00	4,118,100	
きもと	16,600	185.00	3,071,000	
藤森工業	8,700	2,959.00	25,743,300	
前澤化成工業	6,700	1,140.00	7,638,000	
未来工業	5,200	2,041.00	10,613,200	
ウェーブロックホールディングス	2,700	710.00	1,917,000	
ＪＳＰ	5,700	1,990.00	11,343,000	
エフピコ	10,700	6,700.00	71,690,000	
天馬	6,700	1,880.00	12,596,000	
信越ポリマー	17,500	778.00	13,615,000	
東リ	24,300	254.00	6,172,200	
ニフコ	39,100	2,679.00	104,748,900	
バルカー	7,900	2,221.00	17,545,900	
ユニ・チャーム	206,700	3,195.00	660,406,500	
ショーエイコーポレーション	800	803.00	642,400	
協和キリン	114,400	1,774.00	202,945,600	
武田薬品工業	851,300	3,689.00	3,140,445,700	
アステラス製薬	857,700	1,531.00	1,313,138,700	
大日本住友製薬	72,300	1,905.00	137,731,500	
塩野義製薬	124,700	6,105.00	761,293,500	

田辺三菱製薬	102,000	1,211.00	123,522,000	
わかもと製薬	11,600	261.00	3,027,600	
あすか製薬	12,000	1,281.00	15,372,000	
日本新薬	25,500	7,870.00	200,685,000	
ビオフェルミン製薬	1,700	2,162.00	3,675,400	
中外製薬	101,700	7,200.00	732,240,000	
科研製薬	16,700	5,410.00	90,347,000	
エーザイ	116,700	5,835.00	680,944,500	
ロート製薬	50,000	3,165.00	158,250,000	
小野薬品工業	230,300	1,911.50	440,218,450	
久光製薬	28,800	4,345.00	125,136,000	
持田製薬	14,800	4,650.00	68,820,000	
参天製薬	181,600	1,799.00	326,698,400	
扶桑薬品工業	3,400	1,906.00	6,480,400	
日本ケミファ	1,300	2,875.00	3,737,500	
ツムラ	30,200	2,987.00	90,207,400	
日医工	25,600	1,217.00	31,155,200	
キッセイ薬品工業	17,300	2,695.00	46,623,500	
生化学工業	18,900	1,224.00	23,133,600	
栄研化学	17,100	1,860.00	31,806,000	
日水製薬	4,100	1,202.00	4,928,200	
鳥居薬品	5,200	2,705.00	14,066,000	
ＪＣＲファーマ	6,900	7,180.00	49,542,000	
東和薬品	14,000	2,790.00	39,060,000	
富士製薬工業	6,600	1,422.00	9,385,200	
沢井製薬	20,000	5,930.00	118,600,000	
ゼリア新薬工業	19,300	2,014.00	38,870,200	
第一三共	279,000	6,149.00	1,715,571,000	
キョーリン製薬ホールディングス	21,500	1,804.00	38,786,000	
大幸薬品	4,300	2,197.00	9,447,100	
ダイト	5,700	3,045.00	17,356,500	
大塚ホールディングス	185,800	3,866.00	718,302,800	
大正製薬ホールディングス	21,800	8,200.00	178,760,000	
ペプチドリーム	48,800	5,920.00	288,896,000	
日本コークス工業	82,400	94.00	7,745,600	
ニチレキ	12,500	1,078.00	13,475,000	
ユシロ化学工業	5,000	1,334.00	6,670,000	
ビーピー・カストロール	3,500	1,337.00	4,679,500	
富士石油	23,700	257.00	6,090,900	
ＭＯＲＥＳＣＯ	3,500	1,485.00	5,197,500	
出光興産	112,600	3,100.00	349,060,000	
ＪＸＴＧホールディングス	1,640,100	522.40	856,788,240	

コスモエネルギーホールディングス	28,200	2,303.00	64,944,600	
横浜ゴム	56,500	2,091.00	118,141,500	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	50,100	1,466.00	73,446,600	
ブリヂストン	299,700	4,258.00	1,276,122,600	
住友ゴム工業	87,600	1,249.00	109,412,400	
藤倉コンポジット	8,500	432.00	3,672,000	
オカモト	6,500	5,170.00	33,605,000	
フコク	4,300	742.00	3,190,600	
ニッタ	11,000	3,040.00	33,440,000	
住友理工	18,900	861.00	16,272,900	
三ツ星ベルト	12,800	2,038.00	26,086,400	
バンドー化学	18,600	956.00	17,781,600	
日東紡績	14,500	2,558.00	37,091,000	
ＡＧＣ	96,400	3,740.00	360,536,000	
日本板硝子	46,600	717.00	33,412,200	
石塚硝子	1,600	2,081.00	3,329,600	
日本山村硝子	4,100	1,406.00	5,764,600	
日本電気硝子	42,200	2,787.00	117,611,400	
オハラ	3,900	1,503.00	5,861,700	
住友大阪セメント	19,700	4,190.00	82,543,000	
太平洋セメント	61,600	3,160.00	194,656,000	
日本ヒューム	9,800	719.00	7,046,200	
日本コンクリート工業	21,100	289.00	6,097,900	
三谷セキサン	4,500	2,936.00	13,212,000	
アジアパイルホールディングス	13,900	554.00	7,700,600	
東海カーボン	88,600	1,087.00	96,308,200	
日本カーボン	4,700	4,270.00	20,069,000	
東洋炭素	5,700	2,237.00	12,750,900	
ノリタケカンパニーリミテド	5,800	4,455.00	25,839,000	
ＴＯＴＯ	75,000	4,385.00	328,875,000	
日本碍子	119,000	1,581.00	188,139,000	
日本特殊陶業	82,200	2,038.00	167,523,600	
ＭＡＲＵＷＡ	3,400	5,970.00	20,298,000	
品川リフラクトリーズ	2,600	2,974.00	7,732,400	
黒崎播磨	1,900	6,180.00	11,742,000	
ヨータイ	8,600	594.00	5,108,400	
イソライト工業	5,100	467.00	2,381,700	
東京窯業	12,500	308.00	3,850,000	
ニッカトー	4,500	691.00	3,109,500	
フジミインコーポレーテッド	8,700	2,367.00	20,592,900	
クニミネ工業	4,400	877.00	3,858,800	
エーアンドエーマテリアル	1,900	1,020.00	1,938,000	

ニチアス	26,700	1,940.00	51,798,000	
ニチハ	13,600	3,020.00	41,072,000	
日本製鉄	448,100	1,746.50	782,606,650	
神戸製鋼所	176,600	694.00	122,560,400	
中山製鋼所	13,500	487.00	6,574,500	
合同製鐵	4,700	2,043.00	9,602,100	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	260,500	1,493.00	388,926,500	
東京製鐵	51,700	809.00	41,825,300	
共英製鋼	10,900	1,806.00	19,685,400	
大和工業	20,500	2,843.00	58,281,500	
東京鐵鋼	4,000	1,347.00	5,388,000	
大阪製鐵	6,400	1,683.00	10,771,200	
淀川製鋼所	13,000	2,037.00	26,481,000	
丸一鋼管	34,200	2,903.00	99,282,600	
モリ工業	2,900	1,995.00	5,785,500	
大同特殊鋼	15,800	3,960.00	62,568,000	
日本高周波鋼業	3,600	458.00	1,648,800	
日本冶金工業	80,000	227.00	18,160,000	
山陽特殊製鋼	12,200	1,443.00	17,604,600	
愛知製鋼	5,400	3,295.00	17,793,000	
日立金属	103,900	1,169.00	121,459,100	
日本金属	2,200	913.00	2,008,600	
大平洋金属	6,500	2,271.00	14,761,500	
新日本電工	57,900	198.00	11,464,200	
栗本鐵工所	4,900	1,500.00	7,350,000	
虹技	1,500	1,338.00	2,007,000	
三菱製鋼	7,200	1,241.00	8,935,200	
日亜鋼業	14,200	332.00	4,714,400	
日本精線	1,400	2,646.00	3,704,400	
エンビプロ・ホールディングス	3,700	738.00	2,730,600	
シンニッタン	15,100	348.00	5,254,800	
新家工業	2,200	1,487.00	3,271,400	
大紀アルミニウム工業所	16,000	802.00	12,832,000	
日本軽金属ホールディングス	263,300	221.00	58,189,300	
三井金属鉱業	26,100	2,558.00	66,763,800	
東邦亜鉛	5,400	2,515.00	13,581,000	
三菱マテリアル	63,700	3,070.00	195,559,000	
住友金属鉱山	132,100	3,223.00	425,758,300	
ＤＯＷＡホールディングス	22,600	3,520.00	79,552,000	
古河機械金属	16,000	1,442.00	23,072,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,200	1,848.00	20,697,600	
東邦チタニウム	17,400	1,036.00	18,026,400	

ＵＡＣＪ	14,700	1,808.00	26,577,600	
ＣＫサンエツ	1,900	2,776.00	5,274,400	
古河電気工業	27,800	3,130.00	87,014,000	
住友電気工業	360,600	1,387.50	500,332,500	
フジクラ	116,700	424.00	49,480,800	
昭和電線ホールディングス	11,200	890.00	9,968,000	
東京特殊電線	1,300	1,880.00	2,444,000	
タツタ電線	19,300	495.00	9,553,500	
カナレ電気	1,700	1,879.00	3,194,300	
平河ヒューテック	4,100	1,268.00	5,198,800	
リョービ	11,900	2,083.00	24,787,700	
アーレスティ	12,100	580.00	7,018,000	
アサヒホールディングス	18,200	2,254.00	41,022,800	
稲葉製作所	5,400	1,463.00	7,900,200	
宮地エンジニアリンググループ	2,900	1,743.00	5,054,700	
トーカロ	24,900	831.00	20,691,900	
アルファＣｏ	3,400	1,312.00	4,460,800	
ＳＵＭＣＯ	106,600	1,514.00	161,392,400	
川田テクノロジーズ	2,100	7,340.00	15,414,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	1,900	3,695.00	7,020,500	
信和	5,100	926.00	4,722,600	
東洋製罐グループホールディングス	61,400	1,937.00	118,931,800	
ホッカンホールディングス	4,900	1,710.00	8,379,000	
コロナ	5,300	1,025.00	5,432,500	
横河ブリッジホールディングス	17,900	1,719.00	30,770,100	
駒井ハルテック	1,800	1,652.00	2,973,600	
高田機工	900	2,531.00	2,277,900	
三和ホールディングス	99,600	1,142.00	113,743,200	
文化シヤッター	28,400	900.00	25,560,000	
三協立山	13,400	1,264.00	16,937,600	
アルインコ	7,700	981.00	7,553,700	
東洋シヤッター	2,400	712.00	1,708,800	
ＬＩＸＩＬグループ	142,300	1,882.00	267,808,600	
日本フイルコン	7,400	481.00	3,559,400	
ノーリツ	21,500	1,346.00	28,939,000	
長府製作所	9,800	2,340.00	22,932,000	
リンナイ	17,200	7,300.00	125,560,000	
ダイニチ工業	5,200	633.00	3,291,600	
日東精工	13,400	584.00	7,825,600	
三洋工業	1,300	1,820.00	2,366,000	
岡部	19,600	898.00	17,600,800	
ジーテクト	10,700	1,581.00	16,916,700	

東プレ	18,000	1,749.00	31,482,000	
高周波熱錬	18,600	878.00	16,330,800	
東京製綱	5,900	938.00	5,534,200	
サンコール	5,500	522.00	2,871,000	
モリテック　スチール	7,600	376.00	2,857,600	
パイオラックス	15,500	1,931.00	29,930,500	
エイチワン	9,500	747.00	7,096,500	
日本発條	96,100	883.00	84,856,300	
中央発條	1,200	2,878.00	3,453,600	
アドバネクス	1,300	1,707.00	2,219,100	
立川ブラインド工業	4,300	1,356.00	5,830,800	
三益半導体工業	8,600	1,843.00	15,849,800	
日本ドライケミカル	2,700	1,132.00	3,056,400	
日本製鋼所	29,300	1,985.00	58,160,500	
三浦工業	41,800	3,090.00	129,162,000	
タクマ	35,200	1,322.00	46,534,400	
ツガミ	21,700	988.00	21,439,600	
オークマ	12,300	6,090.00	74,907,000	
東芝機械	10,900	2,489.00	27,130,100	
アマダホールディングス	145,000	1,237.00	179,365,000	
アイダエンジニアリング	26,100	896.00	23,385,600	
滝澤鉄工所	3,000	1,423.00	4,269,000	
ＦＵＪＩ	38,600	1,493.00	57,629,800	
牧野フライス製作所	11,300	4,710.00	53,223,000	
オーエスジー	47,500	2,216.00	105,260,000	
ダイジェット工業	1,100	1,606.00	1,766,600	
旭ダイヤモンド工業	25,400	695.00	17,653,000	
ＤＭＧ森精機	61,100	1,662.00	101,548,200	
ソディック	21,100	992.00	20,931,200	
ディスコ	13,100	21,630.00	283,353,000	
日東工器	5,300	2,129.00	11,283,700	
日進工具	2,900	2,048.00	5,939,200	
パンチ工業	6,800	593.00	4,032,400	
冨士ダイス	4,400	636.00	2,798,400	
豊和工業	5,400	855.00	4,617,000	
ＯＫＫ	4,100	809.00	3,316,900	
東洋機械金属	7,000	594.00	4,158,000	
津田駒工業	2,100	1,434.00	3,011,400	
エンシュウ	2,600	1,214.00	3,156,400	
島精機製作所	13,300	3,280.00	43,624,000	
オプトラン	9,400	2,831.00	26,611,400	
ＮＣホールディングス	3,300	475.00	1,567,500	

イワキポンプ	4,200	1,183.00	4,968,600	
フリュー	7,800	1,075.00	8,385,000	
ヤマシンフィルタ	16,900	621.00	10,494,900	
日阪製作所	12,000	868.00	10,416,000	
やまびこ	18,800	943.00	17,728,400	
平田機工	4,600	6,730.00	30,958,000	
ペガサスミシン製造	9,200	570.00	5,244,000	
マルマエ	4,100	919.00	3,767,900	
タツモ	4,100	940.00	3,854,000	
ナブテスコ	53,100	3,035.00	161,158,500	
三井海洋開発	10,300	2,950.00	30,385,000	
レオン自動機	9,500	1,879.00	17,850,500	
ＳＭＣ	28,600	42,510.00	1,215,786,000	
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	7,300	453.00	3,306,900	
ホソカワミクロン	3,400	4,450.00	15,130,000	
ユニオンツール	4,200	3,195.00	13,419,000	
オイレス工業	13,600	1,610.00	21,896,000	
日精エー・エス・ビー機械	3,300	2,766.00	9,127,800	
サトーホールディングス	11,700	2,684.00	31,402,800	
技研製作所	8,500	3,220.00	27,370,000	
日本エアーテック	3,200	594.00	1,900,800	
カワタ	2,700	1,076.00	2,905,200	
日精樹脂工業	8,200	1,112.00	9,118,400	
オカダアイヨン	3,400	1,304.00	4,433,600	
ワイエイシイホールディングス	3,800	1,024.00	3,891,200	
小松製作所	441,500	2,481.00	1,095,361,500	
住友重機械工業	55,800	3,595.00	200,601,000	
日立建機	39,100	2,686.00	105,022,600	
日工	2,700	2,932.00	7,916,400	
巴工業	4,200	2,384.00	10,012,800	
井関農機	9,800	1,509.00	14,788,200	
ＴＯＷＡ	8,400	880.00	7,392,000	
丸山製作所	2,200	1,159.00	2,549,800	
北川鉄工所	4,400	2,194.00	9,653,600	
ローツェ	4,300	2,727.00	11,726,100	
タカキタ	3,500	578.00	2,023,000	
クボタ	522,500	1,697.50	886,943,750	
荏原実業	2,900	1,989.00	5,768,100	
三菱化工機	3,400	1,639.00	5,572,600	
月島機械	19,400	1,297.00	25,161,800	
帝国電機製作所	6,900	1,214.00	8,376,600	
新東工業	23,200	946.00	21,947,200	

澁谷工業	8,600	2,946.00	25,335,600	
アイチ　コーポレーション	17,000	715.00	12,155,000	
小森コーポレーション	24,800	1,194.00	29,611,200	
鶴見製作所	7,600	1,848.00	14,044,800	
住友精密工業	1,600	2,773.00	4,436,800	
酒井重工業	1,900	2,941.00	5,587,900	
荏原製作所	43,300	3,080.00	133,364,000	
石井鐵工所	1,500	2,015.00	3,022,500	
酉島製作所	10,000	1,043.00	10,430,000	
北越工業	10,100	1,225.00	12,372,500	
ダイキン工業	133,100	13,905.00	1,850,755,500	
オルガノ	3,500	3,960.00	13,860,000	
トーヨーカネツ	3,700	1,993.00	7,374,100	
栗田工業	52,800	2,833.00	149,582,400	
椿本チエイン	12,800	3,715.00	47,552,000	
大同工業	4,700	900.00	4,230,000	
木村化工機	8,400	366.00	3,074,400	
アネスト岩田	15,200	970.00	14,744,000	
ダイフク	53,700	6,150.00	330,255,000	
サムコ	2,800	945.00	2,646,000	
加藤製作所	5,000	1,961.00	9,805,000	
油研工業	1,700	1,731.00	2,942,700	
タダノ	47,100	1,025.00	48,277,500	
フジテック	35,500	1,391.00	49,380,500	
ＣＫＤ	27,200	1,315.00	35,768,000	
キトー	7,400	1,619.00	11,980,600	
平和	27,200	2,183.00	59,377,600	
理想科学工業	8,700	1,737.00	15,111,900	
ＳＡＮＫＹＯ	24,400	3,785.00	92,354,000	
日本金銭機械	10,800	1,108.00	11,966,400	
マースグループホールディングス	6,200	1,986.00	12,313,200	
福島工業	6,000	3,380.00	20,280,000	
オーイズミ	4,300	381.00	1,638,300	
ダイコク電機	4,500	1,348.00	6,066,000	
竹内製作所	16,400	1,712.00	28,076,800	
アマノ	27,900	3,030.00	84,537,000	
ＪＵＫＩ	13,600	1,032.00	14,035,200	
蛇の目ミシン工業	9,000	470.00	4,230,000	
マックス	14,900	1,630.00	24,287,000	
グローリー	27,000	2,968.00	80,136,000	
新晃工業	9,100	1,597.00	14,532,700	
大和冷機工業	14,200	1,054.00	14,966,800	

セガサミーホールディングス	96,800	1,290.00	124,872,000	
日本ピストンリング	3,600	1,445.00	5,202,000	
リケン	4,500	4,325.00	19,462,500	
ＴＰＲ	13,200	1,960.00	25,872,000	
ツバキ・ナカシマ	14,900	1,892.00	28,190,800	
ホシザキ	28,500	7,690.00	219,165,000	
大豊工業	8,000	822.00	6,576,000	
日本精工	200,400	982.00	196,792,800	
ＮＴＮ	209,800	327.00	68,604,600	
ジェイテクト	93,600	1,349.00	126,266,400	
不二越	9,100	4,820.00	43,862,000	
日本トムソン	29,100	525.00	15,277,500	
ＴＨＫ	60,800	2,893.00	175,894,400	
ユーシン精機	7,600	1,001.00	7,607,600	
前澤給装工業	3,900	1,978.00	7,714,200	
イーグル工業	12,100	1,119.00	13,539,900	
前澤工業	6,700	351.00	2,351,700	
日本ピラー工業	9,900	1,070.00	10,593,000	
キッツ	39,600	746.00	29,541,600	
マキタ	118,700	3,670.00	435,629,000	
日立造船	77,500	407.00	31,542,500	
三菱重工業	163,400	4,622.00	755,234,800	
ＩＨＩ	75,000	2,742.00	205,650,000	
スター精密	16,700	1,468.00	24,515,600	
日清紡ホールディングス	54,300	846.00	45,937,800	
イビデン	59,900	1,987.00	119,021,300	
コニカミノルタ	213,300	1,025.00	218,632,500	
ブラザー工業	127,200	2,030.00	258,216,000	
ミネベアミツミ	181,200	1,882.00	341,018,400	
日立製作所	439,000	3,977.00	1,745,903,000	
三菱電機	975,200	1,469.50	1,433,056,400	
富士電機	63,300	3,635.00	230,095,500	
東洋電機製造	3,900	1,585.00	6,181,500	
安川電機	113,100	3,790.00	428,649,000	
シンフォニアテクノロジー	13,600	1,296.00	17,625,600	
明電舎	19,400	1,729.00	33,542,600	
オリジン	2,700	1,503.00	4,058,100	
山洋電気	4,800	4,555.00	21,864,000	
デンヨー	9,100	1,587.00	14,441,700	
東芝テック	12,300	3,185.00	39,175,500	
芝浦メカトロニクス	1,800	3,085.00	5,553,000	
マブチモーター	27,100	3,805.00	103,115,500	

日本電産	117,400	14,865.00	1,745,151,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	5,500	1,144.00	6,292,000	
トレックス・セミコンダクター	4,600	1,206.00	5,547,600	
東光高岳	5,200	1,188.00	6,177,600	
ダブル・スコープ	14,200	1,178.00	16,727,600	
ダイヘン	10,700	3,115.00	33,330,500	
ヤーマン	14,500	926.00	13,427,000	
ＪＶＣケンウッド	75,800	249.00	18,874,200	
ミマキエンジニアリング	9,200	625.00	5,750,000	
第一精工	4,300	1,417.00	6,093,100	
日新電機	23,000	1,262.00	29,026,000	
大崎電気工業	19,600	686.00	13,445,600	
オムロン	103,700	5,770.00	598,349,000	
日東工業	15,700	2,117.00	33,236,900	
ＩＤＥＣ	13,100	2,102.00	27,536,200	
正興電機製作所	2,100	837.00	1,757,700	
不二電機工業	1,300	1,249.00	1,623,700	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	35,200	2,061.00	72,547,200	
サクサホールディングス	2,500	2,000.00	5,000,000	
メルコホールディングス	4,100	3,235.00	13,263,500	
テクノメディカ	2,300	2,227.00	5,122,100	
日本電気	126,200	4,330.00	546,446,000	
富士通	94,000	7,863.00	739,122,000	
沖電気工業	42,300	1,391.00	58,839,300	
岩崎通信機	4,600	785.00	3,611,000	
電気興業	5,200	3,120.00	16,224,000	
サンケン電気	11,500	2,443.00	28,094,500	
ナカヨ	2,000	1,630.00	3,260,000	
アイホン	5,600	1,697.00	9,503,200	
ルネサスエレクトロニクス	103,000	639.00	65,817,000	
セイコーエプソン	121,100	1,723.00	208,655,300	
ワコム	71,500	384.00	27,456,000	
アルバック	19,500	4,520.00	88,140,000	
アクセル	4,500	705.00	3,172,500	
ＥＩＺＯ	9,000	4,060.00	36,540,000	
日本信号	24,900	1,236.00	30,776,400	
京三製作所	21,300	380.00	8,094,000	
能美防災	13,000	2,269.00	29,497,000	
ホーチキ	6,400	1,319.00	8,441,600	
星和電機	5,800	522.00	3,027,600	
エレコム	9,300	3,910.00	36,363,000	
パナソニック	1,114,100	914.30	1,018,621,630	

シャープ	96,800	1,367.00	132,325,600	
アンリツ	62,800	2,032.00	127,609,600	
富士通ゼネラル	29,900	1,635.00	48,886,500	
ソニー	654,400	5,905.00	3,864,232,000	
ＴＤＫ	51,000	8,520.00	434,520,000	
帝国通信工業	4,600	1,149.00	5,285,400	
タムラ製作所	37,800	640.00	24,192,000	
アルプスアルパイン	101,700	1,925.00	195,772,500	
池上通信機	3,100	1,050.00	3,255,000	
鈴木	5,700	658.00	3,750,600	
日本トリム	1,900	4,645.00	8,825,500	
ローランド　ディー．ジー．	5,100	2,566.00	13,086,600	
フォスター電機	11,100	1,796.00	19,935,600	
ＳＭＫ	2,800	2,879.00	8,061,200	
ヨコオ	7,100	2,379.00	16,890,900	
ホシデン	29,000	1,240.00	35,960,000	
ヒロセ電機	14,000	11,920.00	166,880,000	
日本航空電子工業	22,400	1,556.00	34,854,400	
ＴＯＡ	10,600	1,201.00	12,730,600	
マクセルホールディングス	21,200	1,498.00	31,757,600	
古野電気	12,900	973.00	12,551,700	
ユニデンホールディングス	2,900	1,956.00	5,672,400	
スミダコーポレーション	8,600	1,187.00	10,208,200	
アイコム	5,400	2,236.00	12,074,400	
リオン	4,600	2,155.00	9,913,000	
本多通信工業	9,000	515.00	4,635,000	
横河電機	97,700	2,025.00	197,842,500	
新電元工業	3,500	3,670.00	12,845,000	
アズビル	61,600	2,636.00	162,377,600	
東亜ディーケーケー	5,200	829.00	4,310,800	
日本光電工業	43,100	2,991.00	128,912,100	
チノー	3,500	1,395.00	4,882,500	
共和電業	10,500	416.00	4,368,000	
日本電子材料	4,100	562.00	2,304,200	
堀場製作所	19,300	6,190.00	119,467,000	
アドバンテスト	66,500	4,160.00	276,640,000	
小野測器	5,000	518.00	2,590,000	
エスペック	8,800	2,287.00	20,125,600	
キーエンス	47,900	67,270.00	3,222,233,000	
日置電機	5,200	3,625.00	18,850,000	
シスメックス	76,000	7,465.00	567,340,000	
日本マイクロニクス	17,300	1,060.00	18,338,000	

メガチップス	7,900	1,667.00	13,169,300	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	5,100	3,835.00	19,558,500	
澤藤電機	1,400	1,752.00	2,452,800	
原田工業	4,300	841.00	3,616,300	
コーセル	12,700	1,119.00	14,211,300	
イリソ電子工業	9,000	5,310.00	47,790,000	
オプテックスグループ	17,400	1,414.00	24,603,600	
千代田インテグレ	4,200	2,167.00	9,101,400	
アイ・オー・データ機器	3,900	938.00	3,658,200	
レーザーテック	20,100	5,200.00	104,520,000	
スタンレー電気	68,900	2,782.00	191,679,800	
岩崎電気	4,000	1,332.00	5,328,000	
ウシオ電機	56,900	1,454.00	82,732,600	
岡谷電機産業	7,800	392.00	3,057,600	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	9,500	657.00	6,241,500	
エノモト	3,100	853.00	2,644,300	
日本セラミック	10,000	2,892.00	28,920,000	
遠藤照明	5,300	764.00	4,049,200	
古河電池	7,400	652.00	4,824,800	
双信電機	5,300	535.00	2,835,500	
山一電機	7,400	1,215.00	8,991,000	
図研	6,500	1,875.00	12,187,500	
日本電子	19,400	2,483.00	48,170,200	
カシオ計算機	86,400	1,263.00	109,123,200	
ファナック	92,700	19,900.00	1,844,730,000	
日本シイエムケイ	25,300	649.00	16,419,700	
エンプラス	4,500	3,600.00	16,200,000	
大真空	3,800	1,193.00	4,533,400	
ローム	46,700	7,830.00	365,661,000	
浜松ホトニクス	70,000	4,245.00	297,150,000	
三井ハイテック	11,000	1,363.00	14,993,000	
新光電気工業	33,100	1,002.00	33,166,200	
京セラ	148,700	7,076.00	1,052,201,200	
太陽誘電	43,500	2,301.00	100,093,500	
村田製作所	307,000	4,924.00	1,511,668,000	
双葉電子工業	16,200	1,446.00	23,425,200	
北陸電気工業	3,900	1,057.00	4,122,300	
ニチコン	31,100	939.00	29,202,900	
日本ケミコン	6,900	1,735.00	11,971,500	
ＫＯＡ	14,900	1,396.00	20,800,400	
市光工業	15,000	700.00	10,500,000	
小糸製作所	58,500	6,020.00	352,170,000	

ミツバ	18,400	678.00	12,475,200	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	16,900	6,060.00	102,414,000	
キヤノン電子	9,100	1,866.00	16,980,600	
キヤノン	525,000	3,036.00	1,593,900,000	
リコー	293,300	1,029.00	301,805,700	
象印マホービン	24,400	1,325.00	32,330,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,500	1,721.00	2,581,500	
東京エレクトロン	65,000	18,550.00	1,205,750,000	
トヨタ紡織	34,300	1,478.00	50,695,400	
芦森工業	2,200	1,580.00	3,476,000	
ユニプレス	19,000	1,829.00	34,751,000	
豊田自動織機	79,000	5,930.00	468,470,000	
モリタホールディングス	17,200	1,796.00	30,891,200	
三櫻工業	12,900	516.00	6,656,400	
デンソー	214,700	4,892.00	1,050,312,400	
東海理化電機製作所	25,800	1,842.00	47,523,600	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	35,200	1,002.00	35,270,400	
川崎重工業	75,900	2,647.00	200,907,300	
名村造船所	29,300	283.00	8,291,900	
日本車輌製造	3,600	2,520.00	9,072,000	
三菱ロジスネクスト	11,600	1,134.00	13,154,400	
近畿車輛	1,500	1,699.00	2,548,500	
日産自動車	1,150,000	765.60	880,440,000	
いすゞ自動車	308,200	1,246.00	384,017,200	
トヨタ自動車	1,086,600	7,222.00	7,847,425,200	
日野自動車	121,800	867.00	105,600,600	
三菱自動車工業	360,900	496.00	179,006,400	
エフテック	7,100	754.00	5,353,400	
レシップホールディングス	3,500	791.00	2,768,500	
ＧＭＢ	2,200	827.00	1,819,400	
ファルテック	2,000	822.00	1,644,000	
武蔵精密工業	23,800	1,485.00	35,343,000	
日産車体	19,000	1,011.00	19,209,000	
新明和工業	40,900	1,354.00	55,378,600	
極東開発工業	19,400	1,381.00	26,791,400	
日信工業	18,000	1,548.00	27,864,000	
トピー工業	8,100	2,363.00	19,140,300	
ティラド	3,700	1,924.00	7,118,800	
タチエス	16,200	1,440.00	23,328,000	
ＮＯＫ	52,600	1,646.00	86,579,600	
フタバ産業	27,500	703.00	19,332,500	
ＫＹＢ	10,100	3,160.00	31,916,000	

大同メタル工業	16,200	667.00	10,805,400	
プレス工業	48,800	486.00	23,716,800	
ミクニ	13,000	381.00	4,953,000	
太平洋工業	20,600	1,603.00	33,021,800	
ケーヒン	22,600	1,550.00	35,030,000	
河西工業	12,300	881.00	10,836,300	
アイシン精機	80,400	3,670.00	295,068,000	
マツダ	306,000	1,112.00	340,272,000	
今仙電機製作所	9,300	928.00	8,630,400	
本田技研工業	822,600	2,843.00	2,338,651,800	
スズキ	178,400	4,437.00	791,560,800	
ＳＵＢＡＲＵ	302,700	2,683.50	812,295,450	
安永	4,900	1,463.00	7,168,700	
ヤマハ発動機	137,700	1,939.00	267,000,300	
ショーワ	23,200	1,444.00	33,500,800	
ＴＢＫ	12,200	410.00	5,002,000	
エクセディ	13,400	2,336.00	31,302,400	
豊田合成	31,600	2,161.00	68,287,600	
愛三工業	15,600	700.00	10,920,000	
盟和産業	1,700	1,058.00	1,798,600	
日本プラスト	8,000	723.00	5,784,000	
ヨロズ	9,300	1,456.00	13,540,800	
エフ・シー・シー	17,600	2,182.00	38,403,200	
シマノ	39,300	15,410.00	605,613,000	
テイ・エス　テック	22,700	3,045.00	69,121,500	
ジャムコ	5,000	2,029.00	10,145,000	
テルモ	275,900	3,155.00	870,464,500	
クリエートメディック	3,200	923.00	2,953,600	
日機装	31,500	1,408.00	44,352,000	
島津製作所	125,500	2,699.00	338,724,500	
ＪＭＳ	9,000	774.00	6,966,000	
長野計器	7,700	813.00	6,260,100	
ブイ・テクノロジー	4,600	5,390.00	24,794,000	
東京計器	6,200	992.00	6,150,400	
愛知時計電機	1,300	4,190.00	5,447,000	
インターアクション	5,200	1,849.00	9,614,800	
オーバル	9,600	254.00	2,438,400	
東京精密	17,700	3,180.00	56,286,000	
マニー	13,000	8,050.00	104,650,000	
ニコン	169,900	1,542.00	261,985,800	
トプコン	52,400	1,318.00	69,063,200	
オリンパス	581,000	1,179.00	684,999,000	

理研計器	8,600	1,957.00	16,830,200	
タムロン	8,700	2,477.00	21,549,900	
ＨＯＹＡ	196,300	8,330.00	1,635,179,000	
シード	4,200	1,096.00	4,603,200	
ノーリツ鋼機	7,700	1,938.00	14,922,600	
エー・アンド・デイ	8,900	812.00	7,226,800	
朝日インテック	82,700	2,884.00	238,506,800	
シチズン時計	106,700	562.00	59,965,400	
リズム時計工業	3,300	1,268.00	4,184,400	
大研医器	7,800	624.00	4,867,200	
メニコン	13,400	3,900.00	52,260,000	
シンシア	1,500	660.00	990,000	
松風	4,800	1,374.00	6,595,200	
セイコーホールディングス	15,100	2,259.00	34,110,900	
ニプロ	67,500	1,217.00	82,147,500	
中本パックス	2,700	1,481.00	3,998,700	
スノーピーク	3,800	1,369.00	5,202,200	
パラマウントベッドホールディングス	11,200	4,210.00	47,152,000	
トランザクション	6,200	1,018.00	6,311,600	
ＳＨＯ－ＢＩ	2,800	371.00	1,038,800	
ニホンフラッシュ	4,200	2,829.00	11,881,800	
前田工繊	10,700	2,000.00	21,400,000	
永大産業	12,700	352.00	4,470,400	
アートネイチャー	10,400	661.00	6,874,400	
バンダイナムコホールディングス	100,800	5,880.00	592,704,000	
アイフィスジャパン	2,200	619.00	1,361,800	
共立印刷	16,200	190.00	3,078,000	
ＳＨＯＥＩ	4,700	4,770.00	22,419,000	
フランスベッドホールディングス	13,800	994.00	13,717,200	
パイロットコーポレーション	17,000	4,165.00	70,805,000	
萩原工業	5,400	1,366.00	7,376,400	
トッパン・フォームズ	20,900	945.00	19,750,500	
フジシールインターナショナル	21,900	3,280.00	71,832,000	
タカラトミー	40,800	1,363.00	55,610,400	
廣済堂	9,100	707.00	6,433,700	
エステールホールディングス	2,600	628.00	1,632,800	
アーク	37,200	102.00	3,794,400	
タカノ	3,800	797.00	3,028,600	
プロネクサス	8,400	1,069.00	8,979,600	
ホクシン	6,000	134.00	804,000	
ウッドワン	3,300	996.00	3,286,800	
大建工業	7,400	2,133.00	15,784,200	

凸版印刷	137,600	1,781.00	245,065,600	
大日本印刷	137,400	2,373.00	326,050,200	
図書印刷	9,100	1,421.00	12,931,100	
共同印刷	3,000	2,836.00	8,508,000	
ＮＩＳＳＨＡ	20,000	1,275.00	25,500,000	
光村印刷	800	1,950.00	1,560,000	
宝印刷	4,700	1,666.00	7,830,200	
アシックス	92,000	1,177.00	108,284,000	
ツツミ	3,000	2,100.00	6,300,000	
小松ウオール工業	3,000	1,963.00	5,889,000	
ヤマハ	58,000	5,180.00	300,440,000	
河合楽器製作所	3,000	3,110.00	9,330,000	
クリナップ	9,100	554.00	5,041,400	
ピジョン	58,900	4,120.00	242,668,000	
兼松サステック	600	1,711.00	1,026,600	
キングジム	8,100	824.00	6,674,400	
リンテック	23,200	2,316.00	53,731,200	
イトーキ	17,900	465.00	8,323,500	
任天堂	55,800	40,180.00	2,242,044,000	
三菱鉛筆	16,100	1,691.00	27,225,100	
タカラスタンダード	20,100	1,734.00	34,853,400	
コクヨ	46,800	1,507.00	70,527,600	
ナカバヤシ	9,600	542.00	5,203,200	
グローブライド	4,700	3,230.00	15,181,000	
オカムラ	34,000	1,038.00	35,292,000	
美津濃	9,700	2,462.00	23,881,400	
東京電力ホールディングス	778,400	511.00	397,762,400	
中部電力	298,300	1,493.50	445,511,050	
関西電力	397,900	1,236.00	491,804,400	
中国電力	134,800	1,357.00	182,923,600	
北陸電力	95,500	750.00	71,625,000	
東北電力	228,400	1,055.00	240,962,000	
四国電力	87,800	973.00	85,429,400	
九州電力	201,000	1,029.00	206,829,000	
北海道電力	91,200	591.00	53,899,200	
沖縄電力	18,100	1,724.00	31,204,400	
電源開発	77,600	2,482.00	192,603,200	
エフオン	4,600	815.00	3,749,000	
イーレックス	16,900	1,098.00	18,556,200	
レノバ	16,000	816.00	13,056,000	
東京瓦斯	191,300	2,659.00	508,666,700	
大阪瓦斯	189,200	1,948.00	368,561,600	

東邦瓦斯	48,300	3,930.00	189,819,000	
北海道瓦斯	5,200	1,477.00	7,680,400	
広島ガス	20,100	334.00	6,713,400	
西部瓦斯	11,000	2,209.00	24,299,000	
静岡ガス	30,000	832.00	24,960,000	
メタウォーター	4,700	3,515.00	16,520,500	
ＳＢＳホールディングス	9,600	1,629.00	15,638,400	
東武鉄道	102,800	3,105.00	319,194,000	
相鉄ホールディングス	33,400	2,896.00	96,726,400	
東京急行電鉄	264,800	1,906.00	504,708,800	
京浜急行電鉄	133,600	1,821.00	243,285,600	
小田急電鉄	156,200	2,503.00	390,968,600	
京王電鉄	54,500	6,690.00	364,605,000	
京成電鉄	73,100	3,950.00	288,745,000	
富士急行	13,300	4,130.00	54,929,000	
新京成電鉄	2,500	2,032.00	5,080,000	
東日本旅客鉄道	173,400	9,923.00	1,720,648,200	
西日本旅客鉄道	87,400	8,815.00	770,431,000	
東海旅客鉄道	87,300	21,945.00	1,915,798,500	
西武ホールディングス	120,800	1,708.00	206,326,400	
鴻池運輸	15,500	1,707.00	26,458,500	
西日本鉄道	27,000	2,341.00	63,207,000	
ハマキョウレックス	7,500	4,030.00	30,225,000	
サカイ引越センター	5,100	6,790.00	34,629,000	
近鉄グループホールディングス	92,400	5,180.00	478,632,000	
阪急阪神ホールディングス	123,200	3,810.00	469,392,000	
南海電気鉄道	41,200	2,603.00	107,243,600	
京阪ホールディングス	41,100	4,505.00	185,155,500	
神戸電鉄	2,400	3,960.00	9,504,000	
名古屋鉄道	75,900	3,015.00	228,838,500	
山陽電気鉄道	7,100	2,124.00	15,080,400	
日本通運	35,600	5,760.00	205,056,000	
ヤマトホールディングス	161,900	2,192.50	354,965,750	
山九	25,700	5,700.00	146,490,000	
丸運	5,300	279.00	1,478,700	
丸全昭和運輸	7,500	3,295.00	24,712,500	
センコーグループホールディングス	50,900	877.00	44,639,300	
トナミホールディングス	2,200	5,610.00	12,342,000	
ニッコンホールディングス	35,100	2,588.00	90,838,800	
日本石油輸送	1,100	2,892.00	3,181,200	
福山通運	11,800	4,090.00	48,262,000	
セイノーホールディングス	69,200	1,366.00	94,527,200	

エスライン	2,800	973.00	2,724,400	
神奈川中央交通	2,300	3,715.00	8,544,500	
日立物流	20,300	3,425.00	69,527,500	
丸和運輸機関	4,900	4,700.00	23,030,000	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	9,300	1,345.00	12,508,500	
九州旅客鉄道	77,500	3,130.00	242,575,000	
ＳＧホールディングス	87,200	3,010.00	262,472,000	
日本郵船	77,600	1,867.00	144,879,200	
商船三井	55,000	2,741.00	150,755,000	
川崎汽船	28,400	1,420.00	40,328,000	
ＮＳユナイテッド海運	5,300	2,484.00	13,165,200	
飯野海運	45,400	372.00	16,888,800	
共栄タンカー	1,200	1,454.00	1,744,800	
乾汽船	8,300	883.00	7,328,900	
日本航空	169,100	3,449.00	583,225,900	
ＡＮＡホールディングス	168,800	3,637.00	613,925,600	
パスコ	1,800	892.00	1,605,600	
トランコム	2,600	6,010.00	15,626,000	
日新	8,000	1,728.00	13,824,000	
三菱倉庫	32,000	3,035.00	97,120,000	
三井倉庫ホールディングス	11,300	1,561.00	17,639,300	
住友倉庫	34,000	1,414.00	48,076,000	
澁澤倉庫	5,100	1,777.00	9,062,700	
東陽倉庫	16,700	323.00	5,394,100	
日本トランスシティ	20,300	519.00	10,535,700	
ケイヒン	1,800	1,240.00	2,232,000	
中央倉庫	5,600	1,070.00	5,992,000	
川西倉庫	1,900	1,058.00	2,010,200	
安田倉庫	7,600	902.00	6,855,200	
ファイズ	1,600	733.00	1,172,800	
東洋埠頭	2,800	1,394.00	3,903,200	
宇徳	7,900	482.00	3,807,800	
上組	57,000	2,541.00	144,837,000	
サンリツ	2,200	653.00	1,436,600	
キムラユニティー	2,500	1,083.00	2,707,500	
キユーソー流通システム	2,300	1,963.00	4,514,900	
近鉄エクスプレス	17,400	1,462.00	25,438,800	
東海運	5,300	294.00	1,558,200	
エーアイテイー	6,000	1,023.00	6,138,000	
内外トランスライン	2,900	1,343.00	3,894,700	
日本コンセプト	3,400	1,230.00	4,182,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	10,600	2,724.00	28,874,400	

クロスキャット	2,700	966.00	2,608,200	
システナ	34,200	1,826.00	62,449,200	
デジタルアーツ	5,200	11,010.00	57,252,000	
日鉄ソリューションズ	14,400	3,420.00	49,248,000	
キューブシステム	5,300	846.00	4,483,800	
エイジア	2,000	1,259.00	2,518,000	
コア	4,200	1,638.00	6,879,600	
ソリトンシステムズ	5,600	1,094.00	6,126,400	
ソフトクリエイトホールディングス	4,300	1,698.00	7,301,400	
ＴＩＳ	31,900	5,620.00	179,278,000	
ネオス	3,800	808.00	3,070,400	
電算システム	3,700	3,400.00	12,580,000	
グリー	66,400	519.00	34,461,600	
コーエーテクモホールディングス	19,700	2,077.00	40,916,900	
三菱総合研究所	4,200	3,680.00	15,456,000	
電算	1,100	2,030.00	2,233,000	
ＡＧＳ	5,700	671.00	3,824,700	
ファインデックス	8,300	1,018.00	8,449,400	
ブレインパッド	1,900	6,700.00	12,730,000	
ＫＬａｂ	17,100	874.00	14,945,400	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	12,900	1,158.00	14,938,200	
イーブックイニシアティブジャパン	1,600	2,394.00	3,830,400	
ネクソン	244,300	1,727.00	421,906,100	
アイスタイル	24,800	837.00	20,757,600	
エムアップ	3,400	2,289.00	7,782,600	
エイチーム	6,700	1,122.00	7,517,400	
エニグモ	3,500	2,325.00	8,137,500	
テクノスジャパン	8,400	583.00	4,897,200	
コロプラ	31,600	662.00	20,919,200	
ブロードリーフ	47,800	565.00	27,007,000	
クロス・マーケティンググループ	4,000	374.00	1,496,000	
デジタルハーツホールディングス	4,500	1,074.00	4,833,000	
システム情報	5,000	1,118.00	5,590,000	
メディアドゥホールディングス	3,000	3,470.00	10,410,000	
じげん	13,800	796.00	10,984,800	
エンカレッジ・テクノロジ	1,500	847.00	1,270,500	
サイバーリンクス	1,600	1,190.00	1,904,000	
フィックスターズ	10,300	1,817.00	18,715,100	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,800	1,243.00	5,966,400	
オプティム	4,200	3,040.00	12,768,000	
セレス	3,200	1,693.00	5,417,600	
ティーガイア	6,900	2,079.00	14,345,100	

セック	1,600	3,625.00	5,800,000	
日本アジアグループ	10,100	343.00	3,464,300	
豆蔵ホールディングス	6,600	1,391.00	9,180,600	
テクマトリックス	6,800	2,156.00	14,660,800	
プロシップ	2,900	1,249.00	3,622,100	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	23,100	2,904.00	67,082,400	
GMOペイメントゲートウェイ	15,800	7,890.00	124,662,000	
ザッパラス	5,500	344.00	1,892,000	
システムリサーチ	1,300	3,710.00	4,823,000	
インターネットイニシアティブ	15,700	2,118.00	33,252,600	
さくらインターネット	11,700	576.00	6,739,200	
ヴィンクス	3,400	1,122.00	3,814,800	
GMOクラウド	2,200	3,215.00	7,073,000	
ＳＲＡホールディングス	5,200	2,492.00	12,958,400	
Ｍｉｎｏｒｉソリューションズ	2,000	1,912.00	3,824,000	
システムインテグレータ	2,900	689.00	1,998,100	
朝日ネット	8,000	698.00	5,584,000	
ｅＢＡＳＥ	5,900	1,193.00	7,038,700	
アバント	3,500	1,968.00	6,888,000	
アドソル日進	3,500	1,908.00	6,678,000	
フリービット	5,800	1,153.00	6,687,400	
コムチュア	5,400	3,920.00	21,168,000	
サイバーコム	1,800	1,965.00	3,537,000	
アステリア	6,500	999.00	6,493,500	
マークラインズ	4,500	1,852.00	8,334,000	
メディカル・データ・ビジョン	8,600	1,110.00	9,546,000	
ショーケース	2,400	599.00	1,437,600	
モバイルファクトリー	2,800	1,369.00	3,833,200	
テラスカイ	1,600	2,005.00	3,208,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,300	1,702.00	7,318,600	
ＰＣＩホールディングス	2,000	2,247.00	4,494,000	
パイプドＨＤ	1,600	1,129.00	1,806,400	
アイビーシー	1,900	1,306.00	2,481,400	
ネオジャパン	2,000	1,020.00	2,040,000	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	900	3,355.00	3,019,500	
ランドコンピュータ	1,600	1,089.00	1,742,400	
ダブルスタンダード	900	4,615.00	4,153,500	
オープンドア	4,800	2,739.00	13,147,200	
マイネット	3,300	666.00	2,197,800	
アカツキ	3,400	7,150.00	24,310,000	
ベネフィットジャパン	900	890.00	801,000	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	1,800	1,727.00	3,108,600	

ＬＩＮＥ	29,200	3,415.00	99,718,000	
カナミックネットワーク	2,000	2,213.00	4,426,000	
ノムラシステムコーポレーション	1,300	929.00	1,207,700	
チェンジ	2,000	2,255.00	4,510,000	
シンクロ・フード	4,400	610.00	2,684,000	
オークネット	5,200	1,283.00	6,671,600	
エイトレッド	1,100	1,885.00	2,073,500	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	10,700	702.00	7,511,400	
マクロミル	17,100	1,280.00	21,888,000	
ビーグリー	2,600	886.00	2,303,600	
オロ	2,600	2,610.00	6,786,000	
テモナ	1,600	477.00	763,200	
サインポスト	1,500	2,381.00	3,571,500	
ソルクシーズ	4,300	970.00	4,171,000	
フェイス	3,900	775.00	3,022,500	
プロトコーポレーション	8,800	1,045.00	9,196,000	
ハイマックス	1,200	1,822.00	2,186,400	
野村総合研究所	182,700	1,774.00	324,109,800	
サイバネットシステム	8,100	656.00	5,313,600	
ＣＥホールディングス	2,900	1,180.00	3,422,000	
日本システム技術	1,600	1,680.00	2,688,000	
インテージホールディングス	12,200	941.00	11,480,200	
東邦システムサイエンス	3,000	1,013.00	3,039,000	
ソースネクスト	37,600	401.00	15,077,600	
インフォコム	10,500	2,510.00	26,355,000	
ＦＩＧ	9,100	347.00	3,157,700	
アルテリア・ネットワークス	10,800	1,231.00	13,294,800	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,300	1,849.00	4,252,700	
フォーカスシステムズ	6,600	856.00	5,649,600	
クレスコ	3,000	3,780.00	11,340,000	
フジ・メディア・ホールディングス	99,400	1,457.00	144,825,800	
オービック	33,200	11,770.00	390,764,000	
ジャストシステム	13,700	3,605.00	49,388,500	
ＴＤＣソフト	8,600	871.00	7,490,600	
ヤフー	624,300	327.00	204,146,100	
トレンドマイクロ	51,100	4,825.00	246,557,500	
ＩＤホールディングス	3,800	1,204.00	4,575,200	
日本オラクル	19,400	9,260.00	179,644,000	
アルファシステムズ	3,000	2,738.00	8,214,000	
フューチャー	13,100	2,093.00	27,418,300	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	7,000	1,370.00	9,590,000	
ソフトバンク・テクノロジー	4,200	2,308.00	9,693,600	

トーセ	2,800	849.00	2,377,200	
オービックビジネスコンサルタント	9,800	4,450.00	43,610,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	43,700	2,744.00	119,912,800	
アイティフォー	11,800	914.00	10,785,200	
東計電算	1,500	3,005.00	4,507,500	
エックスネット	1,900	932.00	1,770,800	
大塚商会	51,800	4,245.00	219,891,000	
サイボウズ	11,300	1,283.00	14,497,900	
ソフトブレーン	7,900	513.00	4,052,700	
電通国際情報サービス	6,000	3,715.00	22,290,000	
デジタルガレージ	18,700	3,655.00	68,348,500	
ＥＭシステムズ	7,900	1,716.00	13,556,400	
ウェザーニューズ	3,300	3,130.00	10,329,000	
ＣＩＪ	7,700	981.00	7,553,700	
東洋ビジネスエンジニアリング	1,000	2,153.00	2,153,000	
日本エンタープライズ	10,900	175.00	1,907,500	
WOWOW	4,700	2,598.00	12,210,600	
スカラ	6,900	935.00	6,451,500	
インテリジェント　ウェイブ	3,800	932.00	3,541,600	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	8,400	525.00	4,410,000	
ネットワンシステムズ	33,900	2,874.00	97,428,600	
システムソフト	24,300	114.00	2,770,200	
アルゴグラフィックス	8,200	2,437.00	19,983,400	
マーベラス	14,900	798.00	11,890,200	
エイベックス	16,500	1,407.00	23,215,500	
日本ユニシス	29,900	3,490.00	104,351,000	
兼松エレクトロニクス	5,300	3,040.00	16,112,000	
東京放送ホールディングス	63,600	1,896.00	120,585,600	
日本テレビホールディングス	88,000	1,670.00	146,960,000	
朝日放送グループホールディングス	9,800	730.00	7,154,000	
テレビ朝日ホールディングス	26,400	1,855.00	48,972,000	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	63,400	441.00	27,959,400	
テレビ東京ホールディングス	7,900	2,333.00	18,430,700	
日本ＢＳ放送	3,400	1,068.00	3,631,200	
ビジョン	3,000	5,160.00	15,480,000	
スマートバリュー	3,100	735.00	2,278,500	
ワイヤレスゲート	4,500	550.00	2,475,000	
コネクシオ	6,900	1,390.00	9,591,000	
クロップス	2,000	606.00	1,212,000	
日本電信電話	654,500	5,041.00	3,299,334,500	
ＫＤＤＩ	784,400	2,890.00	2,266,916,000	
ソフトバンク	1,014,600	1,451.50	1,472,691,900	

光通信	11,300	24,600.00	277,980,000	
ＮＴＴドコモ	605,900	2,644.50	1,602,302,550	
エムティーアイ	9,500	789.00	7,495,500	
GMOインターネット	35,000	1,779.00	62,265,000	
アイドママーケティングコミュニケーション	2,400	679.00	1,629,600	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	28,000	1,396.00	39,088,000	
学研ホールディングス	3,200	4,940.00	15,808,000	
ゼンリン	19,200	1,940.00	37,248,000	
昭文社	4,900	372.00	1,822,800	
インプレスホールディングス	7,900	139.00	1,098,100	
アイネット	5,600	1,182.00	6,619,200	
松竹	6,300	11,540.00	72,702,000	
東宝	63,000	4,195.00	264,285,000	
東映	4,000	15,020.00	60,080,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	254,900	1,390.00	354,311,000	
ピー・シー・エー	1,300	3,615.00	4,699,500	
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	2,286.00	3,886,200	
ＤＴＳ	21,500	2,314.00	49,751,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	44,600	3,625.00	161,675,000	
シーイーシー	10,300	2,443.00	25,162,900	
カプコン	41,100	2,206.00	90,666,600	
アイ・エス・ビー	2,000	1,687.00	3,374,000	
ジャステック	5,700	1,087.00	6,195,900	
ＳＣＳＫ	25,300	5,280.00	133,584,000	
日本システムウエア	3,200	2,615.00	8,368,000	
アイネス	12,300	1,170.00	14,391,000	
ＴＫＣ	8,100	4,660.00	37,746,000	
富士ソフト	14,300	4,930.00	70,499,000	
ＮＳＤ	15,800	3,300.00	52,140,000	
コナミホールディングス	39,100	4,520.00	176,732,000	
福井コンピュータホールディングス	3,200	2,286.00	7,315,200	
ＪＢＣＣホールディングス	7,700	1,472.00	11,334,400	
ミロク情報サービス	9,500	3,340.00	31,730,000	
ソフトバンクグループ	799,800	5,604.00	4,482,079,200	
ホウスイ	800	829.00	663,200	
高千穂交易	3,700	1,070.00	3,959,000	
伊藤忠食品	2,400	4,445.00	10,668,000	
エレマテック	9,000	1,067.00	9,603,000	
ＪＡＬＵＸ	2,700	2,639.00	7,125,300	
あらた	7,100	3,570.00	25,347,000	
トーメンデバイス	1,400	2,298.00	3,217,200	
東京エレクトロン　デバイス	3,500	2,054.00	7,189,000	

フィールズ	8,400	497.00	4,174,800	
双日	530,400	346.00	183,518,400	
アルフレッサ　ホールディングス	106,700	2,619.00	279,447,300	
横浜冷凍	26,900	1,035.00	27,841,500	
神栄	1,300	829.00	1,077,700	
ラサ商事	5,100	810.00	4,131,000	
ラクーンホールディングス	4,600	626.00	2,879,600	
アルコニックス	10,200	1,338.00	13,647,600	
神戸物産	14,500	5,810.00	84,245,000	
あい　ホールディングス	13,700	1,728.00	23,673,600	
ディーブイエックス	3,800	799.00	3,036,200	
ダイワボウホールディングス	8,800	5,190.00	45,672,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	26,600	1,632.00	43,411,200	
ラクト・ジャパン	4,200	3,165.00	13,293,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18,100	1,045.00	18,914,500	
八洲電機	7,400	868.00	6,423,200	
メディアスホールディングス	5,500	680.00	3,740,000	
レスターホールディングス	10,500	1,706.00	17,913,000	
ジューテックホールディングス	2,200	1,003.00	2,206,600	
大光	4,100	674.00	2,763,400	
ＯＣＨＩホールディングス	2,800	1,178.00	3,298,400	
ＴＯＫＡＩホールディングス	50,800	932.00	47,345,600	
黒谷	2,200	475.00	1,045,000	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1,700	834.00	1,417,800	
三洋貿易	4,800	2,435.00	11,688,000	
ビューティガレージ	1,600	1,836.00	2,937,600	
ウイン・パートナーズ	6,200	1,162.00	7,204,400	
ミタチ産業	2,900	714.00	2,070,600	
シップヘルスケアホールディングス	20,000	4,745.00	94,900,000	
明治電機工業	3,000	1,406.00	4,218,000	
デリカフーズホールディングス	1,700	1,470.00	2,499,000	
スターティアホールディングス	1,900	556.00	1,056,400	
コメダホールディングス	22,200	2,018.00	44,799,600	
富士興産	3,700	896.00	3,315,200	
協栄産業	1,200	1,424.00	1,708,800	
小野建	8,600	1,370.00	11,782,000	
南陽	2,000	1,635.00	3,270,000	
佐鳥電機	7,100	911.00	6,468,100	
エコートレーディング	2,200	543.00	1,194,600	
伯東	6,600	1,263.00	8,335,800	
コンドーテック	7,400	925.00	6,845,000	
中山福	5,500	536.00	2,948,000	

ナガイレーベン	13,900	2,317.00	32,206,300	
三菱食品	10,600	2,807.00	29,754,200	
松田産業	7,000	1,492.00	10,444,000	
第一興商	14,300	4,625.00	66,137,500	
メディパルホールディングス	103,600	2,352.00	243,667,200	
ＳＰＫ	2,100	2,529.00	5,310,900	
萩原電気ホールディングス	3,600	2,897.00	10,429,200	
アズワン	6,900	8,990.00	62,031,000	
スズデン	3,300	1,342.00	4,428,600	
尾家産業	3,100	1,301.00	4,033,100	
シモジマ	5,900	1,115.00	6,578,500	
ドウシシャ	9,100	1,691.00	15,388,100	
小津産業	2,100	1,725.00	3,622,500	
高速	5,700	1,247.00	7,107,900	
たけびし	3,400	1,445.00	4,913,000	
リックス	2,200	1,566.00	3,445,200	
丸文	8,500	600.00	5,100,000	
ハピネット	8,000	1,323.00	10,584,000	
橋本総業ホールディングス	1,900	1,548.00	2,941,200	
日本ライフライン	28,500	1,903.00	54,235,500	
タカショー	4,700	453.00	2,129,100	
エクセル	3,600	1,601.00	5,763,600	
マルカ	3,100	1,962.00	6,082,200	
ＩＤＯＭ	32,400	411.00	13,316,400	
日本エム・ディ・エム	5,600	1,414.00	7,918,400	
進和	5,700	2,281.00	13,001,700	
エスケイジャパン	2,300	449.00	1,032,700	
ダイトロン	4,400	1,319.00	5,803,600	
シークス	12,200	1,435.00	17,507,000	
田中商事	3,200	633.00	2,025,600	
オーハシテクニカ	5,400	1,490.00	8,046,000	
白銅	3,100	1,397.00	4,330,700	
伊藤忠商事	671,700	2,101.50	1,411,577,550	
丸紅	947,100	722.60	684,374,460	
高島	1,500	1,685.00	2,527,500	
長瀬産業	54,000	1,632.00	88,128,000	
蝶理	6,100	1,722.00	10,504,200	
豊田通商	107,200	3,255.00	348,936,000	
三共生興	16,400	517.00	8,478,800	
兼松	38,400	1,246.00	47,846,400	
ツカモトコーポレーション	1,700	1,056.00	1,795,200	
三井物産	791,200	1,783.50	1,411,105,200	

日本紙パルプ商事	5,500	3,715.00	20,432,500	
日立ハイテクノロジーズ	29,200	5,780.00	168,776,000	
カメイ	12,500	1,085.00	13,562,500	
東都水産	1,300	2,595.00	3,373,500	
ＯＵＧホールディングス	1,500	2,657.00	3,985,500	
スターゼン	3,500	4,210.00	14,735,000	
山善	37,500	1,055.00	39,562,500	
椿本興業	2,200	3,315.00	7,293,000	
住友商事	568,000	1,628.50	924,988,000	
内田洋行	4,100	3,490.00	14,309,000	
三菱商事	673,900	2,943.00	1,983,287,700	
第一実業	4,400	3,070.00	13,508,000	
キヤノンマーケティングジャパン	27,500	2,181.00	59,977,500	
西華産業	5,400	1,370.00	7,398,000	
佐藤商事	8,600	921.00	7,920,600	
菱洋エレクトロ	9,700	1,853.00	17,974,100	
東京産業	9,600	504.00	4,838,400	
ユアサ商事	9,800	3,130.00	30,674,000	
神鋼商事	2,200	2,293.00	5,044,600	
小林産業	5,800	298.00	1,728,400	
阪和興業	16,700	2,974.00	49,665,800	
正栄食品工業	6,700	3,155.00	21,138,500	
カナデン	8,700	1,430.00	12,441,000	
菱電商事	7,600	1,632.00	12,403,200	
フルサト工業	5,300	1,470.00	7,791,000	
岩谷産業	21,300	3,595.00	76,573,500	
すてきナイスグループ	4,100	628.00	2,574,800	
昭光通商	3,400	665.00	2,261,000	
ニチモウ	1,500	1,763.00	2,644,500	
極東貿易	3,000	1,795.00	5,385,000	
イワキ	11,500	498.00	5,727,000	
三愛石油	25,800	1,055.00	27,219,000	
稲畑産業	23,100	1,404.00	32,432,400	
ＧＳＩクレオス	2,600	1,281.00	3,330,600	
明和産業	8,900	390.00	3,471,000	
クワザワ	3,400	492.00	1,672,800	
ワキタ	20,500	1,094.00	22,427,000	
東邦ホールディングス	28,400	2,387.00	67,790,800	
サンゲツ	28,500	2,013.00	57,370,500	
ミツウロコグループホールディングス	12,800	847.00	10,841,600	
シナネンホールディングス	4,000	1,828.00	7,312,000	
伊藤忠エネクス	21,300	865.00	18,424,500	

サンリオ	29,700	2,233.00	66,320,100	
サンワテクノス	5,800	892.00	5,173,600	
リョーサン	10,600	2,610.00	27,666,000	
新光商事	9,000	1,962.00	17,658,000	
トーホー	4,300	1,999.00	8,595,700	
三信電気	6,600	1,839.00	12,137,400	
東陽テクニカ	11,100	1,043.00	11,577,300	
モスフードサービス	12,600	2,456.00	30,945,600	
加賀電子	9,600	1,651.00	15,849,600	
ソーダニッカ	9,900	586.00	5,801,400	
立花エレテック	7,100	1,725.00	12,247,500	
フォーバル	4,200	931.00	3,910,200	
ＰＡＬＴＡＣ	17,300	5,860.00	101,378,000	
三谷産業	11,300	284.00	3,209,200	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2,200	3,740.00	8,228,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	800	1,226.00	980,800	
国際紙パルプ商事	22,500	332.00	7,470,000	
ヤマタネ	4,800	1,422.00	6,825,600	
丸紅建材リース	900	1,728.00	1,555,200	
日鉄物産	6,900	4,445.00	30,670,500	
泉州電業	3,200	2,781.00	8,899,200	
トラスコ中山	20,000	2,280.00	45,600,000	
オートバックスセブン	38,200	1,784.00	68,148,800	
モリト	7,000	805.00	5,635,000	
加藤産業	15,000	3,210.00	48,150,000	
北恵	1,800	858.00	1,544,400	
イノテック	5,700	932.00	5,312,400	
イエローハット	18,100	1,384.00	25,050,400	
ＪＫホールディングス	8,700	559.00	4,863,300	
日伝	8,000	1,898.00	15,184,000	
北沢産業	7,300	260.00	1,898,000	
杉本商事	5,200	2,101.00	10,925,200	
因幡電機産業	13,700	4,740.00	64,938,000	
東テク	3,200	2,370.00	7,584,000	
ミスミグループ本社	120,300	2,554.00	307,246,200	
アルテック	7,100	214.00	1,519,400	
タキヒヨー	2,900	1,860.00	5,394,000	
蔵王産業	1,600	1,330.00	2,128,000	
スズケン	43,800	6,070.00	265,866,000	
ジェコス	6,600	970.00	6,402,000	
グローセル	8,800	438.00	3,854,400	
ローソン	24,300	5,380.00	130,734,000	

サンエー	7,300	4,410.00	32,193,000	
カワチ薬品	7,500	2,017.00	15,127,500	
エービーシー・マート	15,000	6,880.00	103,200,000	
ハードオフコーポレーション	4,000	728.00	2,912,000	
アスクル	10,100	2,704.00	27,310,400	
ゲオホールディングス	14,700	1,458.00	21,432,600	
アダストリア	13,300	2,188.00	29,100,400	
ジーフット	6,000	651.00	3,906,000	
くら寿司	5,700	4,415.00	25,165,500	
キャンドゥ	4,600	1,612.00	7,415,200	
パルグループホールディングス	4,900	3,500.00	17,150,000	
エディオン	40,800	1,068.00	43,574,400	
サーラコーポレーション	19,700	589.00	11,603,300	
ワッツ	4,400	701.00	3,084,400	
ハローズ	3,700	2,245.00	8,306,500	
フジオフードシステム	4,100	2,574.00	10,553,400	
あみやき亭	2,100	3,490.00	7,329,000	
ひらまつ	19,400	360.00	6,984,000	
大黒天物産	2,300	3,285.00	7,555,500	
ハニーズホールディングス	8,500	1,352.00	11,492,000	
ファーマライズホールディングス	2,400	555.00	1,332,000	
アルペン	7,400	1,549.00	11,462,600	
ハブ	3,200	1,182.00	3,782,400	
クオールホールディングス	14,200	1,613.00	22,904,600	
ジンズホールディングス	5,100	5,960.00	30,396,000	
ビックカメラ	57,100	1,102.00	62,924,200	
ＤＣＭホールディングス	51,900	1,047.00	54,339,300	
ペッパーフードサービス	7,700	1,691.00	13,020,700	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	60,700	2,294.00	139,245,800	
東京一番フーズ	2,600	609.00	1,583,400	
ＤＤホールディングス	2,100	2,975.00	6,247,500	
きちりホールディングス	2,700	717.00	1,935,900	
アークランドサービスホールディングス	7,100	1,918.00	13,617,800	
Ｊ．フロント　リテイリング	123,000	1,279.00	157,317,000	
ドトール・日レスホールディングス	16,900	2,022.00	34,171,800	
マツモトキヨシホールディングス	39,700	3,660.00	145,302,000	
ブロンコビリー	5,100	2,260.00	11,526,000	
ＺＯＺＯ	103,800	1,869.00	194,002,200	
トレジャー・ファクトリー	2,900	1,216.00	3,526,400	
物語コーポレーション	2,400	9,100.00	21,840,000	
ココカラファイン	10,800	5,900.00	63,720,000	
三越伊勢丹ホールディングス	179,800	883.00	158,763,400	

Ｈａｍｅｅ	3,100	760.00	2,356,000	
ウエルシアホールディングス	25,400	5,110.00	129,794,000	
クリエイトＳＤホールディングス	14,200	2,518.00	35,755,600	
丸善ＣＨＩホールディングス	11,200	385.00	4,312,000	
ティーライフ	1,400	905.00	1,267,000	
エー・ピーカンパニー	2,000	543.00	1,086,000	
チムニー	3,000	2,417.00	7,251,000	
シュッピン	6,700	750.00	5,025,000	
ネクステージ	16,000	1,280.00	20,480,000	
ジョイフル本田	28,200	1,241.00	34,996,200	
鳥貴族	3,200	2,148.00	6,873,600	
キリン堂ホールディングス	3,800	1,913.00	7,269,400	
ホットランド	5,100	1,514.00	7,721,400	
すかいらーくホールディングス	89,700	1,888.00	169,353,600	
ＳＦＰホールディングス	4,100	2,097.00	8,597,700	
綿半ホールディングス	3,600	2,550.00	9,180,000	
ヨシックス	1,600	2,537.00	4,059,200	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	28,000	952.00	26,656,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,000	574.00	2,296,000	
ＢＥＥＮＯＳ	3,400	1,507.00	5,123,800	
あさひ	8,000	1,263.00	10,104,000	
日本調剤	3,400	3,235.00	10,999,000	
コスモス薬品	4,200	19,720.00	82,824,000	
トーエル	4,800	714.00	3,427,200	
オンリー	1,800	873.00	1,571,400	
セブン&アイ・ホールディングス	402,600	3,795.00	1,527,867,000	
薬王堂	4,200	2,415.00	10,143,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	25,900	1,623.00	42,035,700	
ツルハホールディングス	20,900	10,950.00	228,855,000	
サンマルクホールディングス	7,600	2,316.00	17,601,600	
フェリシモ	2,200	1,018.00	2,239,600	
トリドールホールディングス	11,900	2,465.00	29,333,500	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	8,800	797.00	7,013,600	
ウイルプラスホールディングス	1,600	805.00	1,288,000	
ジャパンミート	4,900	1,878.00	9,202,200	
サツドラホールディングス	1,500	1,898.00	2,847,000	
デファクトスタンダード	1,100	358.00	393,800	
アレンザホールディングス	5,300	842.00	4,462,600	
バロックジャパンリミテッド	7,900	1,119.00	8,840,100	
クスリのアオキホールディングス	9,600	7,170.00	68,832,000	
力の源ホールディングス	3,700	956.00	3,537,200	

スシローグローバルホールディングス	10,600	6,650.00	70,490,000	
ＬＩＸＩＬビバ	8,200	1,279.00	10,487,800	
メディカルシステムネットワーク	10,400	548.00	5,699,200	
はるやまホールディングス	4,600	815.00	3,749,000	
ノジマ	17,100	1,782.00	30,472,200	
カッパ・クリエイト	13,500	1,392.00	18,792,000	
ライトオン	7,200	718.00	5,169,600	
良品計画	13,600	19,480.00	264,928,000	
三城ホールディングス	12,200	340.00	4,148,000	
アドヴァン	14,800	1,110.00	16,428,000	
アルビス	3,700	2,766.00	10,234,200	
コナカ	11,600	433.00	5,022,800	
ハウス　オブ　ローゼ	1,200	1,610.00	1,932,000	
Ｇ－７ホールディングス	2,900	2,872.00	8,328,800	
イオン北海道	9,800	727.00	7,124,600	
コジマ	16,700	492.00	8,216,400	
ヒマラヤ	3,500	825.00	2,887,500	
コーナン商事	12,600	2,389.00	30,101,400	
エコス	3,600	1,472.00	5,299,200	
ワタミ	12,700	1,522.00	19,329,400	
マルシェ	2,700	771.00	2,081,700	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	57,500	6,900.00	396,750,000	
西松屋チェーン	21,200	865.00	18,338,000	
ゼンショーホールディングス	45,300	2,340.00	106,002,000	
幸楽苑ホールディングス	6,100	2,947.00	17,976,700	
ハークスレイ	2,100	1,061.00	2,228,100	
サイゼリヤ	15,900	2,587.00	41,133,300	
ＶＴホールディングス	43,600	425.00	18,530,000	
魚力	2,700	1,518.00	4,098,600	
フジ・コーポレーション	2,600	2,015.00	5,239,000	
ユナイテッドアローズ	11,000	3,165.00	34,815,000	
ハイデイ日高	13,900	2,097.00	29,148,300	
京都きもの友禅	6,400	339.00	2,169,600	
コロワイド	32,000	2,112.00	67,584,000	
ピーシーデポコーポレーション	13,000	463.00	6,019,000	
壱番屋	6,800	4,980.00	33,864,000	
ＰＬＡＮＴ	2,600	762.00	1,981,200	
スギホールディングス	21,100	5,230.00	110,353,000	
スクロール	15,100	347.00	5,239,700	
ヨンドシーホールディングス	10,700	2,623.00	28,066,100	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	107,500	2,466.00	265,095,000	
木曽路	11,800	2,621.00	30,927,800	

ＳＲＳホールディングス	11,400	1,010.00	11,514,000	
タカキュー	8,000	180.00	1,440,000	
ケーヨー	18,000	478.00	8,604,000	
上新電機	11,400	2,107.00	24,019,800	
日本瓦斯	15,200	2,965.00	45,068,000	
ロイヤルホールディングス	16,800	2,709.00	45,511,200	
いなげや	10,800	1,416.00	15,292,800	
島忠	20,300	2,479.00	50,323,700	
チヨダ	10,100	1,591.00	16,069,100	
ライフコーポレーション	7,300	2,300.00	16,790,000	
リンガーハット	11,900	2,573.00	30,618,700	
ＭｒＭａｘＨＤ	13,400	457.00	6,123,800	
テンアライド	8,900	425.00	3,782,500	
ＡＯＫＩホールディングス	19,300	1,060.00	20,458,000	
オークワ	13,800	1,092.00	15,069,600	
コメリ	14,900	2,262.00	33,703,800	
青山商事	16,800	2,057.00	34,557,600	
しまむら	11,200	7,860.00	88,032,000	
はせがわ	5,400	405.00	2,187,000	
高島屋	75,400	1,269.00	95,682,600	
松屋	19,500	815.00	15,892,500	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	49,400	1,283.00	63,380,200	
近鉄百貨店	3,700	3,140.00	11,618,000	
パルコ	9,300	1,228.00	11,420,400	
丸井グループ	81,300	2,348.00	190,892,400	
アクシアル　リテイリング	8,000	3,830.00	30,640,000	
イオン	369,600	1,887.50	697,620,000	
イズミ	19,600	4,220.00	82,712,000	
平和堂	19,600	1,988.00	38,964,800	
フジ	11,700	1,876.00	21,949,200	
ヤオコー	10,900	4,930.00	53,737,000	
ゼビオホールディングス	11,700	1,233.00	14,426,100	
ケーズホールディングス	99,900	1,011.00	100,998,900	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	5,800	658.00	3,816,400	
日産東京販売ホールディングス	14,500	280.00	4,060,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	4,700	2,202.00	10,349,400	
総合メディカルホールディングス	8,400	1,691.00	14,204,400	
ブックオフグループホールディングス	5,000	1,267.00	6,335,000	
アインホールディングス	12,900	6,040.00	77,916,000	
元気寿司	2,700	3,150.00	8,505,000	
ヤマダ電機	292,800	493.00	144,350,400	
アークランドサカモト	16,400	1,334.00	21,877,600	

ニトリホールディングス	41,600	14,720.00	612,352,000	
グルメ杵屋	6,900	1,154.00	7,962,600	
愛眼	7,700	262.00	2,017,400	
ケーユーホールディングス	5,100	897.00	4,574,700	
吉野家ホールディングス	33,600	2,171.00	72,945,600	
松屋フーズホールディングス	4,600	3,415.00	15,709,000	
サガミホールディングス	12,900	1,341.00	17,298,900	
関西スーパーマーケット	7,300	1,094.00	7,986,200	
王将フードサービス	7,100	6,390.00	45,369,000	
プレナス	10,800	1,782.00	19,245,600	
ミニストップ	7,200	1,495.00	10,764,000	
アークス	18,100	2,211.00	40,019,100	
バローホールディングス	20,800	2,297.00	47,777,600	
ベルク	4,800	5,210.00	25,008,000	
大庄	5,200	1,611.00	8,377,200	
ファーストリテイリング	12,800	67,260.00	860,928,000	
サンドラッグ	36,200	3,035.00	109,867,000	
サックスバー　ホールディングス	8,200	967.00	7,929,400	
ヤマザワ	2,100	1,661.00	3,488,100	
やまや	1,700	2,202.00	3,743,400	
ベルーナ	23,700	701.00	16,613,700	
島根銀行	2,900	708.00	2,053,200	
じもとホールディングス	65,000	99.00	6,435,000	
めぶきフィナンシャルグループ	502,000	274.00	137,548,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,400	1,498.00	20,073,200	
九州フィナンシャルグループ	159,300	425.00	67,702,500	
ゆうちょ銀行	273,100	1,078.00	294,401,800	
富山第一銀行	25,000	309.00	7,725,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	604,900	402.00	243,169,800	
西日本フィナンシャルホールディングス	61,300	782.00	47,936,600	
関西みらいフィナンシャルグループ	46,000	746.00	34,316,000	
三十三フィナンシャルグループ	8,700	1,610.00	14,007,000	
第四北越フィナンシャルグループ	16,900	2,851.00	48,181,900	
新生銀行	70,600	1,683.00	118,819,800	
あおぞら銀行	53,700	2,554.00	137,149,800	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	6,620,500	528.80	3,500,920,400	
りそなホールディングス	1,055,400	447.90	472,713,660	
三井住友トラスト・ホールディングス	189,100	3,900.00	737,490,000	
三井住友フィナンシャルグループ	677,800	3,845.00	2,606,141,000	
千葉銀行	331,900	549.00	182,213,100	
群馬銀行	194,000	377.00	73,138,000	
武蔵野銀行	14,600	2,097.00	30,616,200	

千葉興業銀行	28,700	309.00	8,868,300	
筑波銀行	40,000	173.00	6,920,000	
七十七銀行	30,600	1,603.00	49,051,800	
青森銀行	7,700	2,715.00	20,905,500	
秋田銀行	6,500	2,047.00	13,305,500	
山形銀行	11,200	1,622.00	18,166,400	
岩手銀行	6,900	2,735.00	18,871,500	
東邦銀行	86,000	265.00	22,790,000	
東北銀行	4,900	1,045.00	5,120,500	
みちのく銀行	6,200	1,678.00	10,403,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	85,000	2,020.00	171,700,000	
静岡銀行	238,900	806.00	192,553,400	
十六銀行	13,200	2,375.00	31,350,000	
八十二銀行	233,600	437.00	102,083,200	
山梨中央銀行	12,100	1,170.00	14,157,000	
大垣共立銀行	20,500	2,401.00	49,220,500	
福井銀行	8,700	1,418.00	12,336,600	
北國銀行	10,100	3,010.00	30,401,000	
清水銀行	4,300	1,868.00	8,032,400	
富山銀行	2,100	2,696.00	5,661,600	
滋賀銀行	19,500	2,437.00	47,521,500	
南都銀行	15,300	2,356.00	36,046,800	
百五銀行	88,500	325.00	28,762,500	
京都銀行	34,600	4,235.00	146,531,000	
紀陽銀行	34,500	1,434.00	49,473,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	64,600	1,148.00	74,160,800	
広島銀行	143,200	530.00	75,896,000	
山陰合同銀行	58,000	689.00	39,962,000	
中国銀行	83,400	964.00	80,397,600	
鳥取銀行	3,700	1,422.00	5,261,400	
伊予銀行	128,600	544.00	69,958,400	
百十四銀行	10,500	2,178.00	22,869,000	
四国銀行	14,300	943.00	13,484,900	
阿波銀行	15,000	2,528.00	37,920,000	
大分銀行	6,100	3,075.00	18,757,500	
宮崎銀行	6,700	2,563.00	17,172,100	
佐賀銀行	6,200	1,548.00	9,597,600	
沖縄銀行	9,000	3,410.00	30,690,000	
琉球銀行	22,800	1,135.00	25,878,000	
セブン銀行	327,100	295.00	96,494,500	
みずほフィナンシャルグループ	13,068,500	158.00	2,064,823,000	
高知銀行	3,500	758.00	2,653,000	

山口フィナンシャルグループ	120,900	764.00	92,367,600	
長野銀行	3,500	1,736.00	6,076,000	
名古屋銀行	8,000	3,385.00	27,080,000	
北洋銀行	147,500	250.00	36,875,000	
愛知銀行	3,700	3,730.00	13,801,000	
中京銀行	4,200	2,224.00	9,340,800	
大光銀行	3,700	1,758.00	6,504,600	
愛媛銀行	14,000	1,101.00	15,414,000	
トマト銀行	4,300	1,063.00	4,570,900	
京葉銀行	42,000	675.00	28,350,000	
栃木銀行	53,300	180.00	9,594,000	
北日本銀行	3,400	1,826.00	6,208,400	
東和銀行	16,900	726.00	12,269,400	
福島銀行	8,400	250.00	2,100,000	
大東銀行	4,600	555.00	2,553,000	
トモニホールディングス	76,100	357.00	27,167,700	
フィデアホールディングス	93,400	121.00	11,301,400	
池田泉州ホールディングス	105,200	203.00	21,355,600	
ＦＰＧ	30,300	949.00	28,754,700	
マーキュリアインベストメント	3,900	763.00	2,975,700	
ＳＢＩホールディングス	114,600	2,632.00	301,627,200	
ジャフコ	15,800	4,140.00	65,412,000	
大和証券グループ本社	772,000	477.80	368,861,600	
野村ホールディングス	1,692,600	359.60	608,658,960	
岡三証券グループ	82,300	402.00	33,084,600	
丸三証券	28,800	557.00	16,041,600	
東洋証券	35,400	129.00	4,566,600	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	115,100	331.00	38,098,100	
光世証券	2,500	638.00	1,595,000	
水戸証券	28,500	210.00	5,985,000	
いちよし証券	20,400	742.00	15,136,800	
松井証券	47,200	964.00	45,500,800	
だいこう証券ビジネス	4,100	505.00	2,070,500	
マネックスグループ	89,000	341.00	30,349,000	
極東証券	13,000	900.00	11,700,000	
岩井コスモホールディングス	10,000	1,180.00	11,800,000	
藍澤證券	17,500	692.00	12,110,000	
マネーパートナーズグループ	11,700	285.00	3,334,500	
スパークス・グループ	38,600	228.00	8,800,800	
かんぽ生命保険	34,100	1,823.00	62,164,300	
ＳＯＭＰＯホールディングス	169,500	4,409.00	747,325,500	
アニコム　ホールディングス	7,900	3,735.00	29,506,500	

ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	251,500	3,601.00	905,651,500	
ソニーフィナンシャルホールディングス	79,000	2,589.00	204,531,000	
第一生命ホールディングス	544,100	1,596.50	868,655,650	
東京海上ホールディングス	343,900	5,716.00	1,965,732,400	
Ｔ＆Ｄホールディングス	297,400	1,223.00	363,720,200	
アドバンスクリエイト	2,200	1,843.00	4,054,600	
全国保証	27,100	4,255.00	115,310,500	
ジェイリース	2,700	337.00	909,900	
イントラスト	2,700	649.00	1,752,300	
日本モーゲージサービス	1,700	1,143.00	1,943,100	
Ｃａｓａ	4,300	1,223.00	5,258,900	
アルヒ	8,700	2,050.00	17,835,000	
プレミアグループ	5,500	1,974.00	10,857,000	
クレディセゾン	67,400	1,296.00	87,350,400	
芙蓉総合リース	11,000	6,460.00	71,060,000	
興銀リース	18,100	2,720.00	49,232,000	
東京センチュリー	19,400	4,520.00	87,688,000	
日本証券金融	42,400	546.00	23,150,400	
アイフル	146,700	217.00	31,833,900	
リコーリース	7,600	3,320.00	25,232,000	
イオンフィナンシャルサービス	61,400	1,758.00	107,941,200	
アコム	193,300	376.00	72,680,800	
ジャックス	10,600	2,191.00	23,224,600	
オリエントコーポレーション	260,100	122.00	31,732,200	
日立キャピタル	22,700	2,293.00	52,051,100	
アプラスフィナンシャル	46,100	70.00	3,227,000	
オリックス	641,600	1,658.00	1,063,772,800	
三菱ＵＦＪリース	217,000	597.00	129,549,000	
九州リースサービス	4,700	615.00	2,890,500	
日本取引所グループ	259,800	1,684.00	437,503,200	
イー・ギャランティ	9,000	1,235.00	11,115,000	
アサックス	4,000	583.00	2,332,000	
ＮＥＣキャピタルソリューション	3,900	1,985.00	7,741,500	
いちご	124,500	396.00	49,302,000	
日本駐車場開発	109,400	180.00	19,692,000	
スター・マイカ・ホールディングス	4,800	1,605.00	7,704,000	
ヒューリック	201,500	914.00	184,171,000	
三栄建築設計	4,300	1,529.00	6,574,700	
野村不動産ホールディングス	64,400	2,379.00	153,207,600	
三重交通グループホールディングス	20,700	565.00	11,695,500	
サムティ	14,100	1,687.00	23,786,700	
ディア・ライフ	13,800	473.00	6,527,400	

コーセーアールイー	3,800	751.00	2,853,800	
エー・ディー・ワークス	297,400	34.00	10,111,600	
日本商業開発	6,500	1,514.00	9,841,000	
プレサンスコーポレーション	15,700	1,531.00	24,036,700	
ユニゾホールディングス	15,000	3,285.00	49,275,000	
日本管理センター	7,000	1,141.00	7,987,000	
サンセイランディック	3,500	753.00	2,635,500	
エストラスト	1,300	722.00	938,600	
フージャースホールディングス	20,900	619.00	12,937,100	
オープンハウス	14,100	4,770.00	67,257,000	
東急不動産ホールディングス	259,800	642.00	166,791,600	
飯田グループホールディングス	80,600	1,816.00	146,369,600	
イーグランド	2,400	703.00	1,687,200	
ムゲンエステート	7,900	577.00	4,558,300	
ファーストブラザーズ	3,300	1,065.00	3,514,500	
ハウスドゥ	5,300	1,628.00	8,628,400	
シーアールイー	3,000	1,186.00	3,558,000	
ケイアイスター不動産	3,000	1,676.00	5,028,000	
グッドコムアセット	2,700	1,525.00	4,117,500	
ジェイ・エス・ビー	600	4,835.00	2,901,000	
テンポイノベーション	1,500	1,625.00	2,437,500	
パーク２４	56,500	2,446.00	138,199,000	
パラカ	2,800	2,073.00	5,804,400	
三井不動産	510,500	2,491.50	1,271,910,750	
三菱地所	674,100	1,981.50	1,335,729,150	
平和不動産	18,000	2,334.00	42,012,000	
東京建物	105,700	1,293.00	136,670,100	
ダイビル	29,000	1,046.00	30,334,000	
京阪神ビルディング	17,500	1,079.00	18,882,500	
住友不動産	216,400	3,951.00	854,996,400	
テーオーシー	23,100	704.00	16,262,400	
東京楽天地	1,500	5,170.00	7,755,000	
スターツコーポレーション	13,400	2,662.00	35,670,800	
フジ住宅	13,200	748.00	9,873,600	
空港施設	12,600	510.00	6,426,000	
明和地所	6,500	563.00	3,659,500	
ゴールドクレスト	8,000	1,972.00	15,776,000	
日本エスリード	4,200	1,691.00	7,102,200	
日神不動産	15,700	462.00	7,253,400	
日本エスコン	18,400	681.00	12,530,400	
タカラレーベン	45,800	397.00	18,182,600	
サンヨーハウジング名古屋	6,200	950.00	5,890,000	

イオンモール	48,600	1,697.00	82,474,200	
毎日コムネット	3,000	748.00	2,244,000	
ファースト住建	4,200	1,258.00	5,283,600	
カチタス	10,900	4,225.00	46,052,500	
トーセイ	13,900	1,179.00	16,388,100	
穴吹興産	1,300	2,858.00	3,715,400	
サンフロンティア不動産	13,900	1,099.00	15,276,100	
エフ・ジェー・ネクスト	9,000	1,057.00	9,513,000	
インテリックス	3,800	721.00	2,739,800	
ランドビジネス	4,100	779.00	3,193,900	
グランディハウス	9,900	488.00	4,831,200	
日本空港ビルデング	30,900	4,395.00	135,805,500	
日本工営	6,300	2,393.00	15,075,900	
ＬＩＦＵＬＬ	32,700	519.00	16,971,300	
ジェイエイシーリクルートメント	7,500	2,533.00	18,997,500	
日本M&Aセンター	69,500	2,778.00	193,071,000	
メンバーズ	3,200	2,003.00	6,409,600	
中広	1,100	610.00	671,000	
アイティメディア	2,000	551.00	1,102,000	
タケエイ	9,800	956.00	9,368,800	
Ｅ・Ｊホールディングス	1,300	1,235.00	1,605,500	
トラスト・テック	10,300	1,573.00	16,201,900	
コシダカホールディングス	22,500	1,484.00	33,390,000	
アルトナー	2,400	786.00	1,886,400	
パソナグループ	11,400	1,702.00	19,402,800	
ＣＤＳ	2,400	1,342.00	3,220,800	
リンクアンドモチベーション	17,300	556.00	9,618,800	
ＧＣＡ	9,600	727.00	6,979,200	
エス・エム・エス	34,300	2,556.00	87,670,800	
サニーサイドアップ	2,200	991.00	2,180,200	
パーソルホールディングス	93,200	2,628.00	244,929,600	
リニカル	5,400	1,021.00	5,513,400	
クックパッド	29,600	312.00	9,235,200	
エスクリ	2,700	748.00	2,019,600	
アイ・ケイ・ケイ	4,700	704.00	3,308,800	
学情	3,900	1,222.00	4,765,800	
スタジオアリス	4,700	2,045.00	9,611,500	
シミックホールディングス	5,200	2,069.00	10,758,800	
ＮＪＳ	2,100	1,702.00	3,574,200	
綜合警備保障	37,100	4,970.00	184,387,000	
カカクコム	69,800	2,268.00	158,306,400	
アイロムグループ	3,500	1,730.00	6,055,000	

セントケア・ホールディング	7,000	510.00	3,570,000	
サイネックス	1,700	652.00	1,108,400	
ルネサンス	5,200	1,683.00	8,751,600	
ディップ	15,100	2,206.00	33,310,600	
オプトホールディング	5,800	1,666.00	9,662,800	
ツクイ	22,200	513.00	11,388,600	
キャリアデザインセンター	2,400	1,592.00	3,820,800	
ベネフィット・ワン	25,900	1,882.00	48,743,800	
エムスリー	196,200	1,973.00	387,102,600	
ツカダ・グローバルホールディング	6,100	568.00	3,464,800	
ブラス	1,200	748.00	897,600	
アウトソーシング	49,200	1,381.00	67,945,200	
ウェルネット	8,900	909.00	8,090,100	
ワールドホールディングス	2,600	1,566.00	4,071,600	
ディー・エヌ・エー	50,300	2,116.00	106,434,800	
博報堂ＤＹホールディングス	129,600	1,738.00	225,244,800	
ぐるなび	13,400	672.00	9,004,800	
タカミヤ	9,800	778.00	7,624,400	
ジャパンベストレスキューシステム	6,300	1,412.00	8,895,600	
ファンコミュニケーションズ	25,800	543.00	14,009,400	
ライク	3,700	1,754.00	6,489,800	
ビジネス・ブレークスルー	4,200	370.00	1,554,000	
ＷＤＢホールディングス	4,300	2,806.00	12,065,800	
ティア	5,600	650.00	3,640,000	
ＣＤＧ	900	1,391.00	1,251,900	
バリューコマース	6,300	2,321.00	14,622,300	
インフォマート	51,100	1,538.00	78,591,800	
ＪＰホールディングス	27,000	275.00	7,425,000	
エコナックホールディングス	17,700	128.00	2,265,600	
ＥＰＳホールディングス	14,100	1,660.00	23,406,000	
レッグス	2,400	1,954.00	4,689,600	
プレステージ・インターナショナル	17,500	1,668.00	29,190,000	
アミューズ	5,700	2,446.00	13,942,200	
ドリームインキュベータ	2,900	1,495.00	4,335,500	
クイック	5,900	1,574.00	9,286,600	
ＴＡＣ	5,600	197.00	1,103,200	
ケネディクス	82,000	570.00	46,740,000	
電通	113,500	3,650.00	414,275,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,700	1,068.00	3,951,600	
ぴあ	2,700	4,580.00	12,366,000	
イオンファンタジー	3,000	2,988.00	8,964,000	
シーティーエス	10,700	667.00	7,136,900	

ネクシィーズグループ	3,300	2,037.00	6,722,100	
みらかホールディングス	26,100	2,468.00	64,414,800	
アルプス技研	9,000	1,685.00	15,165,000	
ダイオーズ	2,200	1,459.00	3,209,800	
日本空調サービス	10,700	724.00	7,746,800	
オリエンタルランド	110,100	14,070.00	1,549,107,000	
ダスキン	24,000	2,937.00	70,488,000	
明光ネットワークジャパン	11,100	933.00	10,356,300	
ファルコホールディングス	5,200	1,611.00	8,377,200	
ラウンドワン	29,000	1,652.00	47,908,000	
リゾートトラスト	39,500	1,578.00	62,331,000	
ビー・エム・エル	12,000	3,015.00	36,180,000	
ワタベウェディング	1,700	632.00	1,074,400	
りらいあコミュニケーションズ	16,900	1,263.00	21,344,700	
リソー教育	47,500	507.00	24,082,500	
早稲田アカデミー	2,800	749.00	2,097,200	
ユー・エス・エス	113,900	2,189.00	249,327,100	
東京個別指導学院	3,400	918.00	3,121,200	
サイバーエージェント	53,600	4,415.00	236,644,000	
楽天	434,400	1,135.00	493,044,000	
クリーク・アンド・リバー社	5,600	1,288.00	7,212,800	
テー・オー・ダブリュー	8,300	753.00	6,249,900	
山田コンサルティンググループ	4,600	1,940.00	8,924,000	
セントラルスポーツ	3,500	3,085.00	10,797,500	
フルキャストホールディングス	9,400	2,248.00	21,131,200	
エン・ジャパン	13,600	4,545.00	61,812,000	
リソルホールディングス	1,000	4,030.00	4,030,000	
テクノプロ・ホールディングス	18,700	6,200.00	115,940,000	
アトラ	2,300	280.00	644,000	
インターワークス	1,900	727.00	1,381,300	
アイ・アールジャパンホールディングス	3,800	2,822.00	10,723,600	
ＫｅｅＰｅｒ技研	3,500	1,276.00	4,466,000	
ファーストロジック	2,300	595.00	1,368,500	
三機サービス	2,000	975.00	1,950,000	
Ｇｕｎｏｓｙ	6,500	1,647.00	10,705,500	
デザインワン・ジャパン	2,200	312.00	686,400	
イー・ガーディアン	4,800	1,955.00	9,384,000	
リブセンス	5,600	255.00	1,428,000	
ジャパンマテリアル	25,500	1,520.00	38,760,000	
ベクトル	11,700	896.00	10,483,200	
ウチヤマホールディングス	4,800	517.00	2,481,600	
チャーム・ケア・コーポレーション	3,000	1,795.00	5,385,000	

ライクキッズネクスト	2,300	1,050.00	2,415,000	
キャリアリンク	3,600	585.00	2,106,000	
ＩＢＪ	6,400	909.00	5,817,600	
アサンテ	3,800	2,007.00	7,626,600	
Ｎ・フィールド	6,200	694.00	4,302,800	
バリューＨＲ	2,100	3,525.00	7,402,500	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	3,300	6,750.00	22,275,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,000	1,369.00	5,476,000	
ＥＲＩホールディングス	2,700	799.00	2,157,300	
アビスト	1,500	2,743.00	4,114,500	
シグマクシス	4,500	1,421.00	6,394,500	
ウィルグループ	6,200	894.00	5,542,800	
エスクロー・エージェント・ジャパン	13,200	239.00	3,154,800	
日本ビューホテル	3,000	1,429.00	4,287,000	
リクルートホールディングス	667,500	3,731.00	2,490,442,500	
エラン	6,500	1,735.00	11,277,500	
土木管理総合試験所	4,300	464.00	1,995,200	
ネットマーケティング	3,500	550.00	1,925,000	
日本郵政	763,800	1,096.00	837,124,800	
ベルシステム２４ホールディングス	15,700	1,563.00	24,539,100	
鎌倉新書	6,900	1,487.00	10,260,300	
ソネット・メディア・ネットワークス	1,300	876.00	1,138,800	
一蔵	1,200	719.00	862,800	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	2,200	1,904.00	4,188,800	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	1,500	1,016.00	1,524,000	
エボラブルアジア	4,200	2,568.00	10,785,600	
アトラエ	2,500	2,508.00	6,270,000	
ストライク	3,600	2,499.00	8,996,400	
ソラスト	22,900	1,166.00	26,701,400	
セラク	3,100	747.00	2,315,700	
インソース	3,700	2,975.00	11,007,500	
ベイカレント・コンサルティング	6,600	5,000.00	33,000,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,700	1,283.00	2,181,100	
アイモバイル	3,100	750.00	2,325,000	
キャリアインデックス	3,300	762.00	2,514,600	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	3,800	1,700.00	6,460,000	
船場	1,600	964.00	1,542,400	
グレイステクノロジー	3,400	2,884.00	9,805,600	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	7,400	2,659.00	19,676,600	
フルテック	1,400	1,154.00	1,615,600	
グリーンズ	3,600	1,501.00	5,403,600	
ツナググループ・ホールディングス	1,300	626.00	813,800	

ソウルドアウト	1,000	1,997.00	1,997,000	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	1,600	1,040.00	1,664,000	
日総工産	6,200	1,508.00	9,349,600	
キュービーネットホールディングス	5,700	2,299.00	13,104,300	
ＲＰＡホールディングス	4,000	1,626.00	6,504,000	
スプリックス	3,200	1,673.00	5,353,600	
アドバンテッジリスクマネジメント	3,800	737.00	2,800,600	
リログループ	51,000	2,846.00	145,146,000	
東祥	5,800	2,487.00	14,424,600	
エイチ・アイ・エス	16,600	2,625.00	43,575,000	
ラックランド	1,900	2,265.00	4,303,500	
共立メンテナンス	14,300	4,725.00	67,567,500	
イチネンホールディングス	9,800	1,140.00	11,172,000	
建設技術研究所	6,500	1,600.00	10,400,000	
スペース	6,100	1,170.00	7,137,000	
長大	3,600	784.00	2,822,400	
燦ホールディングス	2,100	2,271.00	4,769,100	
スバル興業	700	6,310.00	4,417,000	
東京テアトル	3,700	1,362.00	5,039,400	
タナベ経営	1,900	1,215.00	2,308,500	
ナガワ	2,600	5,000.00	13,000,000	
よみうりランド	2,000	4,715.00	9,430,000	
東京都競馬	6,100	3,080.00	18,788,000	
カナモト	14,000	2,770.00	38,780,000	
東京ドーム	34,900	1,009.00	35,214,100	
西尾レントオール	9,500	3,025.00	28,737,500	
トランス・コスモス	10,400	2,287.00	23,784,800	
乃村工藝社	43,600	1,465.00	63,874,000	
藤田観光	3,700	2,824.00	10,448,800	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	5,000	1,301.00	6,505,000	
日本管財	10,000	1,836.00	18,360,000	
トーカイ	9,100	2,215.00	20,156,500	
白洋舎	1,100	2,845.00	3,129,500	
セコム	98,900	8,566.00	847,177,400	
セントラル警備保障	4,500	4,750.00	21,375,000	
丹青社	17,700	1,315.00	23,275,500	
メイテック	11,600	5,780.00	67,048,000	
応用地質	10,100	1,114.00	11,251,400	
船井総研ホールディングス	19,300	2,484.00	47,941,200	
進学会ホールディングス	4,400	567.00	2,494,800	
オオバ	7,500	614.00	4,605,000	
いであ	2,000	1,203.00	2,406,000	

学究社	3,100	1,325.00	4,107,500	
ベネッセホールディングス	34,200	2,572.00	87,962,400	
イオンディライト	11,500	3,145.00	36,167,500	
ナック	6,000	975.00	5,850,000	
ニチイ学館	13,300	1,709.00	22,729,700	
ダイセキ	15,700	2,614.00	41,039,800	
ステップ	3,500	1,496.00	5,236,000	
合　計	113,706,400		220,561,307,530	

(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(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

日本債券マザーファンド

貸借対照表

	2019年 7月25日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	327,762,925
国債証券	261,149,887,590
地方債証券	17,087,693,674
特殊債券	21,121,936,485
社債券	13,269,421,000
未収入金	393,790,600
未収利息	627,267,332
前払費用	8,035,741
流動資産合計	313,985,795,347
資産合計	313,985,795,347
負債の部	
流動負債	
未払金	100,000,000
未払解約金	200,364,232
未払利息	758
その他未払費用	133
流動負債合計	300,365,123
負債合計	300,365,123
純資産の部	
元本等	

	2019年 7月25日現在
項目	金額（円）
元本	224,331,028,299
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	89,354,401,925
元本等合計	313,685,430,224
純資産合計	313,685,430,224
負債純資産合計	313,985,795,347

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 7月25日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3.収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2019年 7月25日現在	
1． 計算期間の末日における受益権の総数		224,331,028,299口
2． 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。	
	有価証券	102,730,000円
3． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額	1.3983円
	(1万口当たり純資産額)	(13,983円)

（注）担保資産の有価証券は、「国債証券」であります。上記金額には、約定未受渡債券を含んでおります。

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2019年 7月25日現在
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2019年 7月25日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .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)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .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。

（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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2019年 7月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 7月26日
期首元本額	224,971,791,920円
期中追加設定元本額	19,650,874,969円
期中一部解約元本額	20,291,638,590円
期末元本額	224,331,028,299円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	910,601,994円
ＤＣ日本債券インデックスファンド	2,767,639,876円
ＤＣ日本債券インデックスファンドＬ	37,697,299,643円
ＤＣバランスファンド３０	8,101,758,643円
ＤＣバランスファンド５０	5,430,521,463円
ＤＣバランスファンド７０	1,310,500,425円
日本債券インデックスｅ	1,401,180,695円
インデックスコレクション（国内債券）	18,310,297,758円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	24,782,911,663円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	3,315,871,451円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	1,170,023,162円
私募日本債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	45,368,580,770円
日本債券パッシブファンド私募Ａ（適格機関投資家専用）	2,763,401,723円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	351,421,911円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	1,484,718,595円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	184,590,155円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	323,423,910円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	1,550,610,174円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	4,277,167,504円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	1,140,365,736円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	12,665,137,641円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	140,590,166円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	474,351,258円

区分	2019年 7月25日現在
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	3,203,682,102円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	231,335,266円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	383,362,300円
バランスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	3,343,088,389円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	412,646,156円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	925,968,765円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	2,895,459,640円
バランスファンドＶＡ２（適格機関投資家専用）	4,017,696,126円
バランスＶＡ２０Ｌ（適格機関投資家専用）	158,987,190円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	1,804,996,274円
バランスファンドＶＡ３（適格機関投資家専用）	29,595,118,760円
世界バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	526,600,664円
国内バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	185,454,364円
国内バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	44,218,339円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	671,531,765円
私募日本債券インデックスファンドＡＬ（適格機関投資家専用）	7,915,883円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 7月25日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	4,769,073,890
地方債証券	49,317,759
特殊債券	86,396,403
社債券	80,577,000
合計	4,985,365,052

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本債券マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第３９１回利付国債（２年）	1,390,000,000	1,394,170,000	
	第３９２回利付国債（２年）	310,000,000	311,007,500	
	第３９４回利付国債（２年）	1,200,000,000	1,204,572,000	
	第３９５回利付国債（２年）	1,440,000,000	1,445,846,400	
	第３９６回利付国債（２年）	670,000,000	672,887,700	
	第３９７回利付国債（２年）	1,340,000,000	1,346,123,800	
	第３９８回利付国債（２年）	820,000,000	823,936,000	
	第３９９回利付国債（２年）	1,220,000,000	1,226,173,200	
	第４００回利付国債（２年）	400,000,000	402,160,000	
	第４０１回利付国債（２年）	1,010,000,000	1,015,807,500	
	第４０２回利付国債（２年）	490,000,000	492,989,000	
	第１２５回利付国債（５年）	2,200,000,000	2,207,370,000	
	第１２６回利付国債（５年）	2,870,000,000	2,881,881,800	
	第１２７回利付国債（５年）	3,650,000,000	3,668,104,000	
	第１２８回利付国債（５年）	2,330,000,000	2,343,560,600	
	第１２９回利付国債（５年）	1,980,000,000	1,993,266,000	
	第１３０回利付国債（５年）	1,880,000,000	1,894,062,400	
	第１３１回利付国債（５年）	1,910,000,000	1,926,024,900	
	第１３２回利付国債（５年）	1,325,000,000	1,337,375,500	
	第１３３回利付国債（５年）	1,670,000,000	1,687,234,400	
	第１３４回利付国債（５年）	2,320,000,000	2,346,239,200	
	第１３５回利付国債（５年）	2,340,000,000	2,368,852,200	
	第１３６回利付国債（５年）	1,620,000,000	1,641,691,800	
	第１３７回利付国債（５年）	1,880,000,000	1,906,808,800	
	第１３８回利付国債（５年）	4,220,000,000	4,282,878,000	
	第１３９回利付国債（５年）	3,050,000,000	3,098,007,000	
	第１回利付国債（４０年）	230,000,000	359,795,900	
	第２回利付国債（４０年）	350,000,000	532,511,000	
	第３回利付国債（４０年）	410,000,000	629,534,500	
	第４回利付国債（４０年）	595,000,000	921,768,050	
	第５回利付国債（４０年）	415,000,000	623,861,200	
	第６回利付国債（４０年）	610,000,000	905,532,800	
	第７回利付国債（４０年）	570,000,000	815,345,100	
	第８回利付国債（４０年）	920,000,000	1,233,986,800	
	第９回利付国債（４０年）	830,000,000	835,336,900	
	第１０回利付国債（４０年）	940,000,000	1,110,130,600	
	第１１回利付国債（４０年）	860,000,000	986,703,800	
	第１２回利付国債（４０年）	140,000,000	145,287,800	

第３１０回利付国債（１０年）	1,400,000,000	1,419,250,000	
第３１１回利付国債（１０年）	670,000,000	677,664,800	
第３１２回利付国債（１０年）	2,037,000,000	2,076,965,940	
第３１３回利付国債（１０年）	910,000,000	932,586,200	
第３１４回利付国債（１０年）	250,000,000	255,377,500	
第３１５回利付国債（１０年）	1,020,000,000	1,047,254,400	
第３１６回利付国債（１０年）	360,000,000	368,931,600	
第３１７回利付国債（１０年）	280,000,000	287,901,600	
第３１８回利付国債（１０年）	1,050,000,000	1,077,363,000	
第３１９回利付国債（１０年）	560,000,000	577,645,600	
第３２０回利付国債（１０年）	1,270,000,000	1,306,944,300	
第３２１回利付国債（１０年）	1,540,000,000	1,589,634,200	
第３２２回利付国債（１０年）	860,000,000	885,430,200	
第３２３回利付国債（１０年）	690,000,000	712,459,500	
第３２４回利付国債（１０年）	1,000,000,000	1,029,630,000	
第３２５回利付国債（１０年）	2,205,000,000	2,276,397,900	
第３２６回利付国債（１０年）	560,000,000	577,757,600	
第３２７回利付国債（１０年）	1,010,000,000	1,045,491,400	
第３２８回利付国債（１０年）	1,930,000,000	1,988,942,200	
第３２９回利付国債（１０年）	2,035,000,000	2,117,926,250	
第３３０回利付国債（１０年）	1,820,000,000	1,899,006,200	
第３３１回利付国債（１０年）	970,000,000	1,003,969,400	
第３３２回利付国債（１０年）	2,270,000,000	2,354,307,800	
第３３３回利付国債（１０年）	2,580,000,000	2,681,265,000	
第３３４回利付国債（１０年）	2,660,000,000	2,770,815,600	
第３３５回利付国債（１０年）	2,465,000,000	2,560,839,200	
第３３６回利付国債（１０年）	270,000,000	281,013,300	
第３３７回利付国債（１０年）	2,350,000,000	2,420,100,500	
第３３８回利付国債（１０年）	2,480,000,000	2,571,611,200	
第３３９回利付国債（１０年）	2,795,000,000	2,902,942,900	
第３４０回利付国債（１０年）	2,570,000,000	2,673,545,300	
第３４１回利付国債（１０年）	2,150,000,000	2,226,217,500	
第３４２回利付国債（１０年）	1,490,000,000	1,524,746,800	
第３４３回利付国債（１０年）	2,055,000,000	2,105,491,350	
第３４４回利付国債（１０年）	1,770,000,000	1,815,117,300	
第３４５回利付国債（１０年）	2,370,000,000	2,431,643,700	
第３４６回利付国債（１０年）	2,255,000,000	2,314,734,950	
第３４７回利付国債（１０年）	2,315,000,000	2,377,435,550	
第３４８回利付国債（１０年）	2,500,000,000	2,568,550,000	
第３４９回利付国債（１０年）	2,605,000,000	2,677,497,150	
第３５０回利付国債（１０年）	2,420,000,000	2,486,066,000	代用有価証券 100,000,000円
第３５１回利付国債（１０年）	2,130,000,000	2,187,893,400	

第３５２回利付国債（１０年）	2,170,000,000	2,227,570,100	
第３５３回利付国債（１０年）	2,620,000,000	2,688,879,800	
第３５４回利付国債（１０年）	2,890,000,000	2,965,082,200	
第１回利付国債（３０年）	50,000,000	64,973,000	
第２回利付国債（３０年）	100,000,000	126,985,000	
第３回利付国債（３０年）	140,000,000	176,933,400	
第４回利付国債（３０年）	190,000,000	254,972,400	
第５回利付国債（３０年）	180,000,000	228,819,600	
第６回利付国債（３０年）	270,000,000	352,441,800	
第７回利付国債（３０年）	190,000,000	247,275,500	
第９回利付国債（３０年）	180,000,000	214,349,400	
第１０回利付国債（３０年）	170,000,000	195,790,700	
第１１回利付国債（３０年）	280,000,000	346,169,600	
第１２回利付国債（３０年）	370,000,000	479,290,600	
第１３回利付国債（３０年）	350,000,000	449,844,500	
第１４回利付国債（３０年）	350,000,000	471,327,500	
第１５回利付国債（３０年）	500,000,000	682,705,000	
第１６回利付国債（３０年）	250,000,000	342,630,000	
第１７回利付国債（３０年）	420,000,000	570,859,800	
第１８回利付国債（３０年）	340,000,000	458,428,800	
第１９回利付国債（３０年）	300,000,000	405,525,000	
第２０回利付国債（３０年）	290,000,000	402,238,700	
第２１回利付国債（３０年）	360,000,000	488,995,200	
第２２回利付国債（３０年）	380,000,000	530,221,600	
第２３回利付国債（３０年）	370,000,000	517,589,300	
第２４回利付国債（３０年）	335,000,000	470,189,250	
第２５回利付国債（３０年）	335,000,000	459,881,300	
第２６回利付国債（３０年）	610,000,000	850,370,500	
第２７回利付国債（３０年）	490,000,000	695,334,500	
第２８回利付国債（３０年）	1,050,000,000	1,497,646,500	
第２９回利付国債（３０年）	520,000,000	735,779,200	
第３０回利付国債（３０年）	845,000,000	1,186,092,700	
第３１回利付国債（３０年）	670,000,000	932,298,300	
第３２回利付国債（３０年）	715,000,000	1,014,763,750	
第３３回利付国債（３０年）	1,340,000,000	1,829,502,000	
第３４回利付国債（３０年）	920,000,000	1,300,466,000	
第３５回利付国債（３０年）	1,050,000,000	1,446,333,000	
第３６回利付国債（３０年）	1,080,000,000	1,494,741,600	
第３７回利付国債（３０年）	1,255,000,000	1,715,723,050	
第３８回利付国債（３０年）	865,000,000	1,168,286,300	
第３９回利付国債（３０年）	670,000,000	922,449,300	
第４０回利付国債（３０年）	335,000,000	454,306,900	

第４１回利付国債（３０年）	685,000,000	914,488,700	
第４２回利付国債（３０年）	600,000,000	801,996,000	
第４３回利付国債（３０年）	775,000,000	1,038,422,500	
第４４回利付国債（３０年）	730,000,000	979,331,500	
第４５回利付国債（３０年）	750,000,000	971,602,500	
第４６回利付国債（３０年）	810,000,000	1,050,246,000	
第４７回利付国債（３０年）	795,000,000	1,052,238,150	
第４８回利付国債（３０年）	760,000,000	969,790,400	
第４９回利付国債（３０年）	840,000,000	1,072,612,800	
第５０回利付国債（３０年）	830,000,000	933,559,100	
第５１回利付国債（３０年）	895,000,000	891,670,600	
第５２回利付国債（３０年）	950,000,000	995,201,000	
第５３回利付国債（３０年）	510,000,000	547,352,400	
第５４回利付国債（３０年）	635,000,000	715,143,350	
第５５回利付国債（３０年）	840,000,000	946,915,200	
第５６回利付国債（３０年）	500,000,000	563,435,000	
第５７回利付国債（３０年）	750,000,000	845,932,500	
第５８回利付国債（３０年）	1,060,000,000	1,195,086,400	
第５９回利付国債（３０年）	670,000,000	736,376,900	
第６０回利付国債（３０年）	1,180,000,000	1,362,498,800	
第６１回利付国債（３０年）	710,000,000	780,403,600	
第６２回利付国債（３０年）	580,000,000	604,992,200	
第４７回利付国債（２０年）	470,000,000	483,014,300	
第４８回利付国債（２０年）	230,000,000	238,735,400	
第４９回利付国債（２０年）	280,000,000	290,690,400	
第５０回利付国債（２０年）	590,000,000	610,567,400	
第５１回利付国債（２０年）	240,000,000	250,092,000	
第５２回利付国債（２０年）	430,000,000	451,465,600	
第５３回利付国債（２０年）	350,000,000	369,477,500	
第５４回利付国債（２０年）	280,000,000	296,259,600	
第５５回利付国債（２０年）	490,000,000	518,875,700	
第５６回利付国債（２０年）	410,000,000	436,510,600	
第５７回利付国債（２０年）	360,000,000	382,226,400	
第５８回利付国債（２０年）	250,000,000	266,827,500	
第５９回利付国債（２０年）	440,000,000	469,040,000	
第６０回利付国債（２０年）	570,000,000	601,760,400	
第６１回利付国債（２０年）	390,000,000	407,651,400	
第６２回利付国債（２０年）	250,000,000	260,187,500	
第６３回利付国債（２０年）	570,000,000	615,548,700	
第６４回利付国債（２０年）	410,000,000	446,621,200	
第６５回利付国債（２０年）	370,000,000	405,142,600	
第６６回利付国債（２０年）	330,000,000	359,874,900	
第６７回利付国債（２０年）	310,000,000	341,031,000	

第６８回利付国債（２０年）	230,000,000	256,263,700	
第６９回利付国債（２０年）	530,000,000	588,029,700	
第７０回利付国債（２０年）	490,000,000	553,881,300	
第７１回利付国債（２０年）	400,000,000	448,184,000	
第７２回利付国債（２０年）	710,000,000	796,478,000	
第７３回利付国債（２０年）	540,000,000	606,042,000	
第７４回利付国債（２０年）	310,000,000	349,608,700	
第７５回利付国債（２０年）	360,000,000	408,124,800	
第７６回利付国債（２０年）	340,000,000	381,558,200	
第７７回利付国債（２０年）	290,000,000	327,108,400	
第７８回利付国債（２０年）	20,000,000	22,555,200	
第７９回利付国債（２０年）	100,000,000	113,375,000	
第８０回利付国債（２０年）	250,000,000	284,932,500	
第８１回利付国債（２０年）	180,000,000	205,117,200	
第８２回利付国債（２０年）	485,000,000	555,708,150	
第８３回利付国債（２０年）	70,000,000	80,624,600	
第８４回利付国債（２０年）	190,000,000	217,603,200	
第８５回利付国債（２０年）	360,000,000	416,638,800	
第８６回利付国債（２０年）	240,000,000	281,001,600	
第８７回利付国債（２０年）	170,000,000	197,893,600	
第８８回利付国債（２０年）	340,000,000	400,462,200	
第８９回利付国債（２０年）	320,000,000	374,659,200	
第９０回利付国債（２０年）	420,000,000	494,407,200	
第９１回利付国債（２０年）	310,000,000	367,173,300	
第９２回利付国債（２０年）	790,000,000	928,621,300	
第９３回利付国債（２０年）	260,000,000	305,024,200	
第９４回利付国債（２０年）	445,000,000	525,527,200	
第９５回利付国債（２０年）	400,000,000	481,052,000	
第９６回利付国債（２０年）	200,000,000	237,310,000	
第９７回利付国債（２０年）	210,000,000	252,086,100	
第９８回利付国債（２０年）	370,000,000	441,080,700	
第９９回利付国債（２０年）	460,000,000	550,886,800	
第１００回利付国債（２０年）	760,000,000	920,132,000	
第１０１回利付国債（２０年）	360,000,000	442,188,000	
第１０２回利付国債（２０年）	370,000,000	456,561,500	
第１０３回利付国債（２０年）	335,000,000	410,341,500	
第１０４回利付国債（２０年）	260,000,000	313,768,000	
第１０５回利付国債（２０年）	500,000,000	605,815,000	
第１０６回利付国債（２０年）	270,000,000	329,651,100	
第１０７回利付国債（２０年）	270,000,000	328,406,400	
第１０８回利付国債（２０年）	725,000,000	867,984,500	
第１０９回利付国債（２０年）	290,000,000	348,377,000	

第１１０回利付国債（２０年）	515,000,000	628,758,350	
第１１１回利付国債（２０年）	450,000,000	556,002,000	
第１１２回利付国債（２０年）	550,000,000	674,036,000	
第１１３回利付国債（２０年）	905,000,000	1,113,222,400	
第１１４回利付国債（２０年）	610,000,000	753,051,100	
第１１５回利付国債（２０年）	270,000,000	336,163,500	
第１１６回利付国債（２０年）	260,000,000	324,890,800	
第１１７回利付国債（２０年）	580,000,000	718,504,000	
第１１８回利付国債（２０年）	450,000,000	554,764,500	
第１１９回利付国債（２０年）	320,000,000	387,436,800	
第１２０回利付国債（２０年）	590,000,000	701,315,300	
第１２１回利付国債（２０年）	750,000,000	919,185,000	
第１２２回利付国債（２０年）	490,000,000	595,007,000	
第１２３回利付国債（２０年）	730,000,000	914,179,000	
第１２４回利付国債（２０年）	320,000,000	397,049,600	
第１２５回利付国債（２０年）	500,000,000	634,420,000	
第１２６回利付国債（２０年）	450,000,000	560,389,500	
第１２７回利付国債（２０年）	400,000,000	493,420,000	
第１２８回利付国債（２０年）	710,000,000	878,383,600	
第１２９回利付国債（２０年）	290,000,000	355,296,400	
第１３０回利付国債（２０年）	700,000,000	859,922,000	
第１３１回利付国債（２０年）	320,000,000	389,187,200	
第１３２回利付国債（２０年）	600,000,000	731,496,000	
第１３３回利付国債（２０年）	690,000,000	849,838,500	
第１３４回利付国債（２０年）	260,000,000	321,230,000	
第１３５回利付国債（２０年）	495,000,000	605,271,150	
第１３６回利付国債（２０年）	450,000,000	544,518,000	
第１３７回利付国債（２０年）	460,000,000	563,794,400	
第１３８回利付国債（２０年）	450,000,000	539,869,500	
第１３９回利付国債（２０年）	530,000,000	642,720,400	
第１４０回利付国債（２０年）	1,155,000,000	1,418,859,750	
第１４１回利付国債（２０年）	780,000,000	960,289,200	
第１４２回利付国債（２０年）	450,000,000	560,061,000	
第１４３回利付国債（２０年）	1,110,000,000	1,354,255,500	
第１４４回利付国債（２０年）	340,000,000	410,169,200	
第１４５回利付国債（２０年）	1,210,000,000	1,495,947,200	
第１４６回利付国債（２０年）	1,150,000,000	1,424,677,500	
第１４７回利付国債（２０年）	1,140,000,000	1,399,680,600	
第１４８回利付国債（２０年）	1,090,000,000	1,324,655,200	
第１４９回利付国債（２０年）	1,220,000,000	1,484,947,400	
第１５０回利付国債（２０年）	1,520,000,000	1,829,973,600	
第１５１回利付国債（２０年）	1,190,000,000	1,398,095,300	
第１５２回利付国債（２０年）	1,300,000,000	1,529,762,000	

	第１５３回利付国債（２０年）	1,180,000,000	1,408,247,400	
	第１５４回利付国債（２０年）	1,420,000,000	1,673,626,200	
	第１５５回利付国債（２０年）	1,280,000,000	1,468,275,200	
	第１５６回利付国債（２０年）	1,130,000,000	1,184,545,100	
	第１５７回利付国債（２０年）	1,330,000,000	1,348,739,700	
	第１５８回利付国債（２０年）	1,060,000,000	1,127,691,600	
	第１５９回利付国債（２０年）	1,340,000,000	1,447,173,200	
	第１６０回利付国債（２０年）	1,160,000,000	1,272,972,400	
	第１６１回利付国債（２０年）	985,000,000	1,063,199,150	
	第１６２回利付国債（２０年）	1,250,000,000	1,348,212,500	
	第１６３回利付国債（２０年）	955,000,000	1,030,110,750	
	第１６４回利付国債（２０年）	860,000,000	911,299,000	
	第１６５回利付国債（２０年）	770,000,000	815,037,300	
	第１６６回利付国債（２０年）	1,340,000,000	1,467,648,400	
	第１６７回利付国債（２０年）	1,130,000,000	1,194,432,600	
	第１６８回利付国債（２０年）	1,100,000,000	1,141,591,000	
国債証券合計		234,972,000,000	261,149,887,590	
地方債証券	第１回東京都公募公債（東京グリーンボンド（３０年））	100,000,000	113,435,000	
	第３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	110,484,000	
	第７回東京都公募公債（３０年）	200,000,000	279,756,000	
	第１１回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	233,426,000	
	第１７回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	119,271,000	
	第１８回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	242,016,000	
	第２０回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	120,803,000	
	第２１回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	122,343,000	
	第６９６回東京都公募公債	100,000,000	102,259,000	
	第７０３回東京都公募公債	100,000,000	102,381,000	
	第７１４回東京都公募公債	100,000,000	102,511,000	
	第７２２回東京都公募公債	200,000,000	206,246,000	
	第７４０回東京都公募公債	100,000,000	102,502,000	
	第７５１回東京都公募公債	100,000,000	102,369,000	
	平成２２年度第８回北海道公募公債	100,000,000	101,178,000	
	平成２３年度第４回北海道公募公債	100,000,000	102,287,000	
	平成２７年度第１５回北海道公募公債	300,000,000	303,447,000	
	第１６回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	123,052,000	
	第２１回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	120,703,000	
	第１８４回神奈川県公募公債	100,000,000	101,936,000	
	第１９０回神奈川県公募公債	100,000,000	102,555,000	
	第１９６回神奈川県公募公債	100,000,000	102,476,000	
	第３５６回大阪府公募公債（１０年）	130,000,000	133,325,400	
	第３６３回大阪府公募公債（１０年）	114,000,000	116,701,800	

第３７１回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	204,318,000	
第３７６回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	103,402,000	
第４０３回大阪府公募公債（１０年）	300,000,000	308,796,000	
第４１５回大阪府公募公債（１０年）	108,000,000	108,854,280	
第４１７回大阪府公募公債（１０年）	108,000,000	109,740,960	
平成２７年度第４回京都府公募公債	100,000,000	103,264,000	
平成２７年度第１３回京都府公募公債	105,860,000	106,455,991	
第３回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	118,509,000	
第４回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	110,743,000	
平成２２年度第１９回兵庫県公募公債	100,000,000	101,870,000	
平成２５年度第１４回兵庫県公募公債	100,000,000	103,260,000	
平成２６年度第２回兵庫県公募公債	100,000,000	103,013,000	
平成２８年度第３０回兵庫県公募公債	100,000,000	101,373,000	
第１２回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	109,306,000	
平成２３年度第１回静岡県公募公債	100,000,000	102,409,000	
平成２３年度第５回静岡県公募公債	100,000,000	102,301,000	
平成２４年度第１０回静岡県公募公債	100,000,000	102,479,000	
平成２５年度第１回静岡県公募公債	100,000,000	102,164,000	
平成２７年度第６回静岡県公募公債	100,000,000	102,916,000	
平成２２年度第１４回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	122,860,000	
平成２３年度第４回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	102,276,000	
平成２３年度第８回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	102,277,000	
平成２４年度第２回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	102,706,000	
平成２５年度第１６回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	102,889,000	
平成２７年度第１７回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	204,612,000	
平成２９年度第６回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,517,000	
平成２９年度第１６回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	102,006,000	
平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	121,039,000	
平成２３年度第１回広島県公募公債	272,000,000	277,948,640	
平成２４年度第２回広島県公募公債	100,000,000	102,520,000	
平成２７年度第２回広島県公募公債	162,000,000	167,840,100	
平成２９年度第７回広島県公募公債	131,440,000	133,426,058	
第９回埼玉県公募公債（３０年）	100,000,000	109,888,000	
平成２３年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	102,484,000	
平成２４年度第２回埼玉県公募公債	100,000,000	102,560,000	
平成２４年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	102,569,000	
平成２７年度第８回埼玉県公募公債	200,000,000	205,004,000	

平成２９年度第５回埼玉県公募公債	100,000,000	101,516,000	
平成１９年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	141,257,000	
平成２０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	200,000,000	273,414,000	
平成２２年度第２回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	111,301,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	110,713,000	
平成２８年度第１回福岡県公募公債	100,000,000	100,310,000	
第６回千葉県公募公債（２０年）	200,000,000	243,172,000	
第８回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	122,806,000	
平成２６年度第９回千葉県公募公債	100,000,000	102,634,000	
平成２８年度第１回千葉県公募公債	100,000,000	100,375,000	
平成２９年度第５回千葉県公募公債	120,000,000	121,914,000	
平成２７年度第３回新潟県公募公債	200,000,000	201,264,000	
平成２４年度第１回岐阜県公募公債（１０年）	139,630,000	143,268,757	
第９５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,032,000	
第９６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,148,000	
第９８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,162,000	
第９９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,282,000	
第１００回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,414,000	
第１０１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,192,000	
第１０２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,238,000	
第１０３回共同発行市場公募地方債	177,400,000	181,396,822	
第１０５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,585,000	
第１１０回共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,563,000	
第１１１回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,188,000	
第１１６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,658,000	
第１１７回共同発行市場公募地方債	500,000,000	512,215,000	
第１１８回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,844,000	
第１２０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,490,000	
第１２５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,686,000	
第１３３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,263,000	
第１４０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,695,000	
第１４５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,331,000	
第１５３回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,030,000	
第１６１回共同発行市場公募地方債	300,000,000	300,741,000	
第１６７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,627,000	
第１７５回共同発行市場公募地方債	150,000,000	152,307,000	
第１８１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,353,000	
平成２４年度第２回熊本県公募公債（１０年）	100,000,000	102,552,000	
平成２３年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	102,459,000	

	第７回大阪市公募公債（３０年）	100,000,000	113,210,000	
	第１回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	108,786,000	
	第１３回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	112,747,000	
	第４８２回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	102,333,000	
	第４８８回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	103,083,000	
	第４９５回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	100,564,000	
	第２回京都市公募公債（２０年）	100,000,000	113,106,000	
	平成２７年度第５回京都市公募公債	200,000,000	202,366,000	
	平成２０年度第１回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	120,758,000	
	第５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	112,811,000	
	平成２３年度第１回横浜市公募公債	100,000,000	102,176,000	
	平成２５年度第６回横浜市公募公債	100,000,000	103,167,000	
	第２５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	120,593,000	
	第２６回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	121,774,000	
	平成２３年度第４回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	101,936,000	
	平成２４年度第７回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	102,367,000	
	第８８回川崎市公募公債	100,000,000	102,970,000	
	平成２９年度第１２回福岡市公募公債	130,000,000	131,968,200	
	平成３０年度第９回福岡市公募公債（１０年）	100,000,000	102,349,000	
	平成２３年度第５回広島市公募公債	151,900,000	155,870,666	
	平成２７年度第２回広島市公募公債	100,000,000	102,978,000	
	平成２３年度第１回千葉市公募公債	100,000,000	102,383,000	
	平成２７年度第１回三重県公募公債	100,000,000	102,978,000	
	平成２４年度第１回福井県公募公債	100,000,000	102,552,000	
	平成２４年度第１回山梨県公募公債（１０年）	100,000,000	102,605,000	
	平成２７年度第１回山梨県公募公債（１０年）	100,000,000	103,101,000	
	平成２３年度第２回岡山県公募公債（１０年）	100,000,000	102,706,000	
地方債証券合計		16,100,230,000	17,087,693,674	
特殊債券	第２回政府保証新関西国際空港債券	200,000,000	207,374,000	
	第１５回政府保証日本政策投資銀行債券	210,000,000	220,416,000	
	第６９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	299,685,000	
	第７５回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,930,000	
	第１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	161,109,000	
	第８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	173,566,500	
	第１７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	581,095,000	
	第２０回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,826,000	

第２１回道路債券	100,000,000	135,309,000	
第２２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	311,050,000	
第２７回道路債券	100,000,000	111,158,000	
第２７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,657,000	
第２８回道路債券	300,000,000	412,173,000	
第３３回道路債券	100,000,000	139,511,000	
第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,844,000	
第３８回道路債券	100,000,000	111,250,000	
第３９回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,307,000	
第４３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,270,000	
第４９回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,667,000	
第８６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,089,000	
第９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	242,876,000	
第９９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	246,416,000	
第１０１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	138,947,000	
第１０４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,593,000	
第１０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	137,167,000	
第１１１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,783,000	
第１２３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	135,866,000	
第１３３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,392,000	
第１３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,327,000	
第１４７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,389,000	
第１４９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	125,000,000	128,102,500	
第１５７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,483,000	
第１６１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,851,000	
第１６３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,727,000	
第１６８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,696,000	
第１７５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,540,000	
	100,000,000	120,975,000	

第１７８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第１８２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,272,000	
第１８３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,769,000	
第１８６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	209,000,000	214,515,510	
第１８９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,492,000	
第１９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,548,000	
第１９５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,890,000	
第２００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,586,000	
第２６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,418,000	
第２７１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,938,000	
第２７３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,474,000	
第３００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,618,000	
第３３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	243,000,000	247,709,340	
第３６３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,080,000	
第２回政府保証公営企業債券（１５年）	100,000,000	103,722,000	
第２回地方公営企業等金融機構債券（２０年）	100,000,000	121,565,000	
第４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	121,347,000	
第５回公営企業債券（２０年）	100,000,000	108,747,000	
第５回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	245,256,000	
第７回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	122,884,000	
第９回公営企業債券（２０年）	100,000,000	111,806,000	
第１１回公営企業債券（２０年）	100,000,000	111,695,000	
第１２回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	122,784,000	
第１５回公営企業債券（２０年）	100,000,000	112,978,000	
第１５回地方公共団体金融機構債券（２０年）	300,000,000	368,226,000	
第１７回公営企業債券（２０年）	200,000,000	230,692,000	
第１７回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	121,148,000	
第２０回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,866,000	
第２２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,209,000	
第２３回地方公共団体金融機構債券（２０年）	300,000,000	359,244,000	
第２４回公営企業債券（２０年）	100,000,000	119,356,000	

第２６回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,283,000	
第２７回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,166,000	
第３４回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,040,000	
第３７回政府保証地方公共団体金融機構債券	217,000,000	222,978,350	
第４３回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,452,000	
第４６回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,639,000	
第４９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,659,000	
第５０回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,883,450	
第５６回政府保証地方公共団体金融機構債券	193,000,000	199,965,370	
第７９回政府保証地方公共団体金融機構債券	421,000,000	432,560,660	
第８２回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,930,000	
第９１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,966,000	
第９６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,210,000	
第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,860,000	
第１０７回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,311,000	
第１１０回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	152,160,000	
第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,938,000	
第１１３回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,069,000	
第４３回都市再生債券	100,000,000	101,469,000	
第３８回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	102,613,000	
第１８回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	102,649,000	
第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	12,501,000	12,771,521	
第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,880,000	76,010,196	
第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	29,598,000	31,020,775	
第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	15,167,000	16,035,765	
第３回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	37,875,000	38,946,105	
第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	13,149,000	13,526,902	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	13,537,000	14,123,287	
第６回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,680,000	
第７回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	54,228,000	56,548,416	
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	14,292,000	14,956,863	
第８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,436,000	34,083,100	
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	14,239,000	14,926,031	
第１０回貸付債権担保住宅金融公庫債券	21,212,000	21,362,180	
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	14,726,000	15,442,567	
第１１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,631,000	11,727,072	
第１２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,442,000	11,628,275	
第１２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	18,042,000	19,299,527	

第１７回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	53,874,000	55,322,133	
第１８回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,395,000	11,601,363	
第１８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	18,154,000	18,622,554	
第２０回貸付債権担保住宅金融公庫債券	25,632,000	26,536,809	
第２３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	123,462,000	
第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,332,000	24,137,318	
第２５回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,080,000	13,453,303	
第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,678,000	26,839,299	
第２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,420,000	50,001,303	
第２８回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,715,000	15,347,009	
第２９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	41,577,000	42,929,084	
第３１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,470,000	14,988,894	
第３２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	46,236,000	48,016,548	
第３４回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,244,000	18,095,163	
第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,614,000	35,166,045	
第３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,647,000	34,991,707	
第３６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,640,000	15,229,845	
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,619,000	34,811,322	
第３７回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,328,000	16,034,007	
第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	43,875,000	45,621,225	
第３９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,150,000	74,276,223	
第４０回貸付債権担保住宅金融公庫債券	33,378,000	35,268,196	
第４１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,989,000	16,881,505	
第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,493,000	15,247,505	
第４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,220,000	47,002,764	
第４３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,729,000	45,686,701	
第４３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	123,422,000	
第４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	126,357,000	135,970,240	
第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	142,700,000	152,811,722	
第４７回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,755,000	15,528,899	
第４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,782,000	34,982,655	
第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,228,000	35,368,215	
第５１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	42,963,000	45,169,579	
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,143,000	38,543,618	
第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,051,000	15,805,958	
第５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,705,000	43,257,203	
第５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,082,000	45,837,524	
第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,275,000	50,281,217	
第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,955,000	47,833,468	
第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,199,000	54,852,797	
第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,204,000	56,405,284	

第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,815,000	49,411,359	
第７１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,185,000	47,310,502	
第７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,827,000	49,077,973	
第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,693,000	55,976,827	
第８５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	120,751,000	
第８７回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,386,000	
第８８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	121,165,000	
第１０２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,221,000	
第１０４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,717,000	83,230,128	
第１０９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	172,274,000	174,816,764	
第１１１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,697,000	88,041,649	
第１１３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,499,000	89,872,504	
第１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,766,000	89,953,689	
第１１５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,853,000	90,439,914	
第１１６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,339,000	91,350,020	
第１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,914,000	91,806,689	
第１１８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,101,000	92,061,597	
第１２１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,230,000	92,964,282	
第１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,286,000	95,158,250	
第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,819,000	95,499,298	
第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,593,000	95,438,653	
第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,666,000	97,548,706	
第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,616,000	98,326,103	
第１３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,854,000	98,932,486	
第１３９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,845,000	100,098,370	
第１４０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,094,000	99,756,693	
第１４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,435,000	100,767,429	
第１４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,840,000	101,004,134	
第１４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,322,000	
い第７８６号商工債	100,000,000	100,246,000	

	い第７８７号商工債	100,000,000	100,259,000	
	第３２２回信金中金債（５年）	100,000,000	100,035,000	
	第３２７回信金中金債（５年）	200,000,000	200,242,000	
	第３２８回信金中金債（５年）	100,000,000	100,125,000	
	第３３１回信金中金債（５年）	100,000,000	100,195,000	
	第３３９回信金中金債（５年）	100,000,000	100,345,000	
	第３４２回信金中金債（５年）	100,000,000	100,370,000	
	第２１８号商工債（３年）	400,000,000	400,580,000	
	第２２１号商工債（３年）	200,000,000	200,296,000	
	第４５回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,837,000	
	第１８回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	206,258,000	
	第２９回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,400,000	
	第３２回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,742,000	
	第３４回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,535,000	
特殊債券合計		19,396,801,000	21,121,936,485	
社債券	第２０回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	100,000,000	100,073,000	
	第２４回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	100,000,000	100,809,000	
	第１回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	200,076,000	
	第１１回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,450,000	
	第１５回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,392,000	
	第１７回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,814,000	
	第９回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	200,114,000	
	第１２回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,888,000	
	第１回ＨＳＢＣ・ホールディングス・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	100,611,000	
	第１回バンコ・サンタンデール・エセ・アー非上位円貨社債	100,000,000	100,330,000	
	第１１回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,270,000	
	第１２回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	200,000,000	200,958,000	
	第３回ロイヤルバンク・オブ・カナダ円貨社債	100,000,000	100,232,000	
	第２０回株式会社大林組無担保社債	100,000,000	103,443,000	
	第２４回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	101,347,000	
	第３回高砂熱学工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,062,000	
	第２回株式会社伊藤園無担保社債	100,000,000	100,925,000	
	第２１回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,659,000	
	第２４回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,808,000	

第１０回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,294,000	
第１８回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,883,000	
第９回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	102,135,000	
第２２回レンゴー株式会社無担保社債	100,000,000	101,447,000	
第４５回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,460,000	
第１回株式会社ツムラ無担保社債	100,000,000	100,470,000	
第２回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,548,000	
第１３回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第５回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,089,000	
第１回ＪＸＴＧホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,075,000	
第１４回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	101,227,000	
第９回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	101,753,000	
第１４回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	103,657,000	
第１１回日本電気硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,601,000	
第６７回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	102,012,000	
第２１回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,233,000	
第９回株式会社ＬＩＸＩＬグループ無担保社債	100,000,000	99,705,000	
第２２回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	102,300,000	
第１６回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	103,248,000	
第１３回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	101,220,000	
第１５回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,255,000	
第１６回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,666,000	
第４回株式会社堀場製作所無担保社債	100,000,000	100,629,000	
第１２回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,923,000	
第１回株式会社東海理化電機製作所無担保社債	100,000,000	101,470,000	
第３２回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,967,000	
第１回明治安田生命２０１７基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,210,000	
第６２回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,413,000	
第１回ユニー・ファミリーマートホールディングス無担保社債	100,000,000	100,217,000	
第６９回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	121,151,000	
第３９回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,248,000	
第９回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	113,421,000	
第２５回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	101,575,000	
第２８回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,114,000	

第３２回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,794,000	
第３５回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	103,369,000	
第５７回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	106,970,000	
第１回三井住友ＦＧ無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	102,558,000	
第１１回株式会社りそな銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	104,145,000	
第２２回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	101,551,000	
第２３回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,091,000	
第２４回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,704,000	
第２５回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	112,701,000	
第３回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,021,000	
第１回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,070,000	
第４１回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	99,698,000	
第４２回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,941,000	
第５７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,129,000	
第２５回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,166,000	
第５０回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	103,251,000	
第５５回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	105,038,000	
第２１回三井住友ファイナンス＆リース株式会社無担保社債	200,000,000	200,706,000	
第３９回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,100,000	
第４８回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,186,000	
第６９回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,925,000	
第４７回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	120,685,000	
第８３回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	118,027,000	
第１０４回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	102,490,000	
第９７回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,351,000	
第１３回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	104,032,000	
第７５回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,669,000	
第８４回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,594,000	
第２１回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,308,000	
第４９回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	116,293,000	
	100,000,000	122,082,000	

	第６７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債			
	第８５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,553,000	
	第１２９回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	119,165,000	
	第１３３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,696,000	
	第１１回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	109,952,000	
	第４６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	109,772,000	
	第５１回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	112,388,000	
	第５１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	121,932,000	
	第８回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	118,270,000	
	第１０回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	121,931,000	
	第１３回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	118,718,000	
	第３１回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	116,593,000	
	第４６回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,072,000	
	第４回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	101,056,000	
	第５回関西高速鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	101,293,000	
	第２５回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	200,000,000	202,996,000	
	第５００回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,552,000	
	第５１８回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,280,000	
	第４９５回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,416,000	
	第５０５回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,468,000	
	第５０９回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,456,000	
	第５１０回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,522,000	
	第３７７回中国電力株式会社社債	100,000,000	104,069,000	
	第３９３回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,480,000	
	第３０７回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,869,000	
	第３２１回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,181,000	
	第４７９回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,704,000	
	第２５３回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,470,000	
	第３７１回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,487,000	
	第４３１回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,275,000	
	第４３６回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,724,000	
	第４６８回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,194,000	
	第３２３回北海道電力株式会社社債	100,000,000	109,365,000	
	第３５７回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,996,000	
	第１３回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	110,629,000	
	第３８回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,654,000	
	第５７回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,254,000	
	第６回ＳＣＳＫ株式会社無担保社債	100,000,000	99,999,000	
		100,000,000	101,468,000	

	第７回株式会社ファーストリテイリング無担保社債			
社債券合計		12,800,000,000	13,269,421,000	
合計			312,628,938,749	

(注)備考欄の代用有価証券の数値は額面を表示しております。代用有価証券の担保差入額面には、約定未受渡券面額を含んでおります。

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。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

	2019年 7月25日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	5,992,284,141
コール・ローン	1,111,344,848
株式	179,784,550,123
投資信託受益証券	149,534,685
投資証券	4,766,035,149
派生商品評価勘定	320,497,885
未収入金	2,822,545
未収配当金	176,260,244
差入委託証拠金	2,711,084,918
流動資産合計	195,014,414,538
資産合計	195,014,414,538
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,439,870
前受金	317,185,505
未払解約金	100,403,564
未払利息	2,571
その他未払費用	347
流動負債合計	428,031,857
負債合計	428,031,857
純資産の部	
元本等	
元本	68,961,764,192
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	125,624,618,489
元本等合計	194,586,382,681
純資産合計	194,586,382,681
負債純資産合計	195,014,414,538

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 7月25日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「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条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金

	2019年 7月25日現在
	株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2019年 7月25日現在
1． 計算期間の末日における受益権の総数		68,961,764,192口
2． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額	2.8217円
	(1万口当たり純資産額)	(28,217円)

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2019年 7月25日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	2019年 7月25日現在
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2019年 7月25日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .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)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2019年 7月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 7月26日
期首元本額	79,731,717,234円
期中追加設定元本額	8,284,174,357円
期中一部解約元本額	19,054,127,399円
期末元本額	68,961,764,192円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,782,370,670円
ＤＣ外国株式インデックスファンド	4,467,111,644円
ＤＣ外国株式インデックスファンドＬ	20,510,562,038円
ＤＣバランスファンド３０	719,185,572円
ＤＣバランスファンド５０	1,416,849,358円
ＤＣバランスファンド７０	812,580,922円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	389,196,177円
外国株式インデックスｅ	5,718,679,361円
インデックスコレクション（外国株式）	5,415,960,969円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	2,276,093,581円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	863,488,618円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	723,731,997円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,842,016,578円
外国株式パッシブファンド私募Ａ（適格機関投資家専用）	1,335,681,468円
外国株式インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	905,705,013円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	76,970,147円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	760,660,622円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	81,564,502円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	436,431,715円
ＶＡバランス株式３０（適格機関投資家専用）	1,454,244円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	2,648,301,946円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	577,643,588円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	351,540,131円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	6,774,571,078円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	642,403,034円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	291,690,287円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	1,094,631,255円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	29,644,714円

区分	2019年 7月25日現在
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	135,351,711円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	158,618,268円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	474,574,671円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	742,374,964円
バランスＶＡ２０Ｌ（適格機関投資家専用）	12,058,694円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	130,236,394円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	344,183,573円
私募外国株式インデックスファンドＡＬ（適格機関投資家専用）	17,644,688円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 7月25日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	15,698,772,793
投資信託受益証券	19,370,487
投資証券	335,807,651
合計	16,053,950,931

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2019年 7月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	9,566,324,128	－	9,883,509,633	317,185,505
合計		9,566,324,128	－	9,883,509,633	317,185,505

(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、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2019年 7月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,027,952,392	－	1,020,824,902	△7,127,490
	アメリカドル	795,251,266	－	790,493,552	△4,757,714
	ユーロ	146,577,600	－	144,600,000	△1,977,600
	イギリスポンド	86,123,526	－	85,731,350	△392,176
合計		1,027,952,392	－	1,020,824,902	△7,127,490

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

①計算日又は計算日に知りうる直近の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によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の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、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先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	22,664	73.64	1,668,976.96	
	APACHE CORP	17,138	24.79	424,851.02	
	BAKER HUGHES A GE CO	23,189	24.86	576,478.54	
	CABOT OIL & GAS CORP	18,624	22.11	411,776.64	
	CHENIERE ENERGY INC	9,583	67.51	646,948.33	
	CHEVRON CORP	83,878	126.54	10,613,922.12	
	CIMAREX ENERGY CO	4,237	50.50	213,968.50	
	CONCHO RESOURCES INC	9,073	102.26	927,804.98	
	CONOCOPHILLIPS	50,046	60.08	3,006,763.68	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	4,103	36.77	150,867.31	
	DEVON ENERGY CORPORATION	20,829	26.51	552,176.79	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	7,107	104.45	742,326.15	
	EOG RESOURCES INC	26,047	87.68	2,283,800.96	
	EXXON MOBIL	187,081	75.36	14,098,424.16	
	HALLIBURTON CO	37,650	23.79	895,693.50	
	HELMERICH & PAYNE	4,776	50.90	243,098.40	
	HESS CORP	11,835	60.60	717,201.00	
	HOLLYFRONTIER CORP	7,524	49.51	372,513.24	
	KINDER MORGAN INC	89,708	20.65	1,852,470.20	
	MARATHON OIL CORP	38,194	13.97	533,570.18	

MARATHON PETROLEUM CORP	29,676	57.62	1,709,931.12	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	17,063	22.03	375,897.89	
NOBLE ENERGY INC	20,854	21.50	448,361.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	33,027	52.05	1,719,055.35	
ONEOK INC	17,621	68.43	1,205,805.03	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	10,081	17.00	171,377.00	
PHILLIPS 66	19,621	102.42	2,009,582.82	
PIONEER NATURAL RESOURCES	7,721	139.64	1,078,160.44	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	6,331	24.85	157,325.35	
SCHLUMBERGER	62,217	40.33	2,509,211.61	
TARGA RESOURCES CORP	8,989	40.29	362,166.81	
TECHNIPFMC PLC	19,859	26.39	524,079.01	
VALERO ENERGY CORP	18,564	86.17	1,599,659.88	
WILLIAMS COS	51,953	26.90	1,397,535.70	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	9,771	224.86	2,197,107.06	
ALBEMARLE CORP	4,921	75.53	371,683.13	
AMCOR PLC	71,648	10.79	773,081.92	
AVERY DENNISON CORP	3,332	116.61	388,544.52	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,844	30.19	327,380.36	
BALL CORP	13,962	72.03	1,005,682.86	
CELANESE CORP-SERIES A	6,085	112.26	683,102.10	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,379	48.92	507,740.68	
CHEMOURS CO/THE	8,553	19.28	164,901.84	
CORTEVA INC	33,149	28.32	938,779.68	
CROWN HOLDINGS INC	5,436	64.45	350,350.20	
DOW INC	34,393	52.79	1,815,606.47	
DUPONT DE NEMOURS INC	33,149	74.23	2,460,650.27	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,407	81.74	523,708.18	
ECOLAB INC	11,460	197.95	2,268,507.00	
FMC CORP	5,380	85.79	461,550.20	
FREEPORT-MCMORAN INC	61,991	11.94	740,172.54	
INT'L PAPER CO	17,669	44.12	779,556.28	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,164	145.96	607,777.44	
LINDE PLC	24,333	202.75	4,933,515.75	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	13,063	86.36	1,128,120.68	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,699	226.75	611,998.25	
MOSAIC CO/THE	14,763	24.83	366,565.29	
NEWMONT GOLDCORP CORP	37,580	39.30	1,476,894.00	
NUCOR CORP	14,326	56.58	810,565.08	
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,206	102.24	430,021.44	
PPG INDUSTRIES INC	10,386	118.10	1,226,586.60	
SEALED AIR CORP	7,368	43.86	323,160.48	

SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,620	501.13	1,814,090.60	
STEEL DYNAMICS INC	9,144	32.00	292,608.00	
VULCAN MATERIALS CO	5,948	137.54	818,087.92	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	2,000	69.34	138,680.00	
WESTROCK CO	11,037	36.79	406,051.23	
3 M COMPANY	25,452	179.42	4,566,597.84	
ACUITY BRANDS INC	1,559	135.17	210,730.03	
AERCAP HOLDINGS NV	5,656	51.92	293,659.52	
ALLEGION PLC	3,778	108.22	408,855.16	
AMETEK INC	10,392	89.98	935,072.16	
ARCONIC INC	18,227	25.65	467,522.55	
BOEING CO	23,693	361.43	8,563,360.99	
CATERPILLAR	25,385	131.91	3,348,535.35	
CUMMINS INC	6,641	175.37	1,164,632.17	
DEERE&CO	13,918	167.18	2,326,811.24	
DOVER CORP	6,899	97.71	674,101.29	
EATON CORP	18,804	82.73	1,555,654.92	
EMERSON ELECTRIC CO	27,236	67.26	1,831,893.36	
FASTENAL CO	25,828	31.93	824,688.04	
FLOWSERVE CORP	5,872	52.64	309,102.08	
FLUOR CORP	6,155	33.18	204,222.90	
FORTIVE CORP	12,820	82.25	1,054,445.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	6,720	54.83	368,457.60	
GENERAL DYNAMICS CORP	10,796	187.64	2,025,761.44	
GENERAL ELECTRIC CO	393,285	10.68	4,200,283.80	
GRAINGER (WW) INC	2,090	304.07	635,506.30	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	7,789	40.53	315,688.17	
HEICO CORP	1,482	138.95	205,923.90	
HEICO CORP-CLASS A	2,850	108.50	309,225.00	
HONEYWELL INTL INC	32,175	173.96	5,597,163.00	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	1,993	233.67	465,704.31	
IDEX CORP	3,126	166.65	520,947.90	
ILLINOIS TOOL WORKS	14,198	158.71	2,253,364.58	
INGERSOLL-RAND PLC	10,620	124.09	1,317,835.80	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,604	85.65	479,982.60	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,500	64.59	613,605.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	9,400	36.61	344,134.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	39,771	41.40	1,646,519.40	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	9,647	197.95	1,909,623.65	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,551	260.36	403,818.36	
LOCKHEED MARTIN CORP	11,243	368.90	4,147,542.70	
MASCO CORP	13,089	39.20	513,088.80	

MIDDLEBY CORP	2,145	139.65	299,549.25	
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,109	342.97	2,438,173.73	
OWENS CORNING	4,925	58.54	288,309.50	
PACCAR INC	15,406	72.14	1,111,388.84	
PARKER HANNIFIN CORP	5,754	178.25	1,025,650.50	
PENTAIR PLC	7,018	39.28	275,667.04	
RAYTHEON COMPANY	12,494	184.19	2,301,269.86	
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,373	168.88	907,392.24	
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,427	374.64	1,658,531.28	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,602	48.73	370,445.46	
SMITH (A.O.) CORP	6,846	45.14	309,028.44	
SNAP-ON INC	2,319	154.76	358,888.44	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	5,095	78.50	399,957.50	
STANLEY BLACK&DECKER	6,944	152.51	1,059,029.44	
TEXTRON	10,911	52.11	568,572.21	
TRANSDIGM GROUP INC	2,064	494.66	1,020,978.24	
UNITED RENTALS INC	3,773	126.63	477,774.99	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	36,493	134.25	4,899,185.25	
WABCO HOLDINGS INC	2,071	132.88	275,194.48	
WABTEC CORP	6,306	73.00	460,338.00	
XYLEM INC	8,037	82.34	661,766.58	
CINTAS CORP	3,912	261.91	1,024,591.92	
COPART INC	9,323	79.37	739,966.51	
COSTAR GROUP INC	1,619	627.95	1,016,651.05	
EQUIFAX INC	5,386	142.25	766,158.50	
IHS MARKIT LTD	16,714	64.81	1,083,234.34	
MANPOWER GROUP	2,894	91.31	264,251.14	
NIELSEN HOLDINGS PLC	15,880	23.80	377,944.00	
REPUBLIC SERVICES INC	10,405	86.70	902,113.50	
ROBERT HALF INTL INC	4,993	62.71	313,111.03	
ROLLINS INC	7,140	34.16	243,902.40	
TRANSUNION	8,217	81.50	669,685.50	
VERISK ANALYTICS INC	7,047	150.77	1,062,476.19	
WASTE CONNECTIONS INC	11,869	94.10	1,116,872.90	
WASTE MANAGEMENT INC	18,594	115.80	2,153,185.20	
AMERCO	376	381.70	143,519.20	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	4,122	34.59	142,579.98	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,245	85.89	536,383.05	
CSX CORP	34,167	69.22	2,365,039.74	
DELTA AIR LINES INC	7,841	63.16	495,237.56	
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,487	76.54	573,054.98	
FEDEX CORP	11,407	176.01	2,007,746.07	

HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,908	102.75	401,547.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	4,597	123.23	566,488.31	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,000	37.93	265,510.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	11,838	184.99	2,189,911.62	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,480	164.03	406,794.40	
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,089	54.72	333,190.08	
UBER TECHNOLOGIES INC	7,121	43.76	311,614.96	
UNION PACIFIC CORP	31,901	174.37	5,562,577.37	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	2,649	95.11	251,946.39	
UNITED PARCEL SERVICE B	31,006	114.39	3,546,776.34	
XPO LOGISTICS INC	5,355	67.16	359,641.80	
APTIV PLC	11,109	83.68	929,601.12	
AUTOLIV INC	3,858	77.03	297,181.74	
BORGWARNER INC	9,348	42.48	397,103.04	
FORD MOTOR COMPANY	166,310	10.33	1,717,982.30	
GENERAL MOTORS CO	57,189	40.88	2,337,886.32	
HARLEY-DAVIDSON	7,429	35.69	265,141.01	
LEAR CORP	2,989	136.91	409,223.99	
TESLA INC	5,765	264.88	1,527,033.20	
CAPRI HOLDINGS LTD	6,771	36.71	248,563.41	
DR HORTON INC	16,002	43.90	702,487.80	
GARMIN LTD	4,973	79.49	395,303.77	
HANESBRANDS INC	15,911	16.56	263,486.16	
HASBRO INC	5,071	121.83	617,799.93	
LEGGETT & PLATT INC	5,338	39.71	211,971.98	
LENNAR CORP-CL A	12,416	46.77	580,696.32	
LULULEMON ATHLETICA INC	4,723	192.21	907,807.83	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,830	154.44	437,065.20	
NEWELL BRANDS INC	20,391	14.39	293,426.49	
NIKE B	55,034	86.70	4,771,447.80	
NVR INC	171	3,382.06	578,332.26	
POLARIS INDUSTRIES INC	2,942	95.02	279,548.84	
PULTE GROUP INC	12,739	30.90	393,635.10	
PVH CORP	3,435	89.21	306,436.35	
RALPH LAUREN CORPORATION	2,566	109.73	281,567.18	
TAPESTRY INC	12,753	30.80	392,792.40	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	7,197	27.34	196,765.98	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	7,301	24.23	176,903.23	
VF CORP	14,390	89.33	1,285,458.70	
WHIRLPOOL CORP	3,060	146.57	448,504.20	
ARAMARK	11,643	36.72	427,530.96	
BLOCK H & R INC	10,235	27.99	286,477.65	

CARNIVAL CORPORATION	18,317	47.12	863,097.04	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,083	777.96	842,530.68	
DARDEN RESTAURANTS INC	5,327	124.24	661,826.48	
DOMINO'S PIZZA INC	1,716	262.21	449,952.36	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	12,868	95.31	1,226,449.08	
LAS VEGAS SANDS CORP	14,684	64.93	953,432.12	
MARRIOTT INTL A	12,913	139.79	1,805,108.27	
MCDONALD'S CORP	34,118	212.78	7,259,628.04	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	10,511	25.00	262,775.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	24,157	29.71	717,704.47	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	9,482	49.46	468,979.72	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,513	115.34	866,549.42	
STARBUCKS CORP	55,225	90.65	5,006,146.25	
VAIL RESORTS INC	1,670	243.41	406,494.70	
WYNN RESORTS LTD	4,366	140.88	615,082.08	
YUM BRANDS INC	14,173	112.66	1,596,730.18	
ACTIVISION BLIZZARD INC	33,382	46.86	1,564,280.52	
ALPHABET INC-CL A	13,217	1,139.73	15,063,811.41	
ALPHABET INC-CL C	13,880	1,137.81	15,792,802.80	
ALTICE USA INC- A	6,423	26.12	167,768.76	
CBS CORP-CL B	15,534	51.05	793,010.70	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	6,956	409.67	2,849,664.52	
COMCAST CORP-CL A	199,367	44.87	8,945,597.29	
DISCOVERY INC - A	7,886	31.49	248,330.14	
DISCOVERY INC-C	14,253	29.28	417,327.84	
DISH NETWORK CORPORATION-A	9,561	41.56	397,355.16	
ELECTRONIC ARTS INC	13,186	89.78	1,183,839.08	
FACEBOOK INC-A	105,329	204.66	21,556,633.14	
FOX CORP - CLASS A	15,812	36.60	578,719.20	
FOX CORP- CLASS B	6,589	36.89	243,068.21	
IAC/INTERACTIVECORP	3,234	244.31	790,098.54	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	16,191	22.77	368,669.07	
LIBERTY BROADBAND-C	4,295	105.49	453,079.55	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,831	27.85	218,093.35	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	23,297	27.31	636,241.07	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	9,885	38.92	384,724.20	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	6,975	40.48	282,348.00	
LIBERTY SIRIUSXM-A	3,171	40.19	127,442.49	
LIVE NATION ENTERTAINMENT	5,790	70.87	410,337.30	
NETFLIX INC	19,270	317.94	6,126,703.80	
NEWS CORP-CLASS A	16,730	13.57	227,026.10	
OMNICOM GROUP	10,331	80.70	833,711.70	

SIRIUS XM HOLDINGS INC	70,068	6.10	427,414.80	
SNAP INC - A	26,226	17.61	461,839.86	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	5,126	118.90	609,481.40	
THE WALT DISNEY CO	79,458	141.29	11,226,620.82	
TRIPADVISOR INC	4,286	46.86	200,841.96	
TWITTER INC	31,034	38.73	1,201,946.82	
VIACOM INC-CLASS B	15,680	30.76	482,316.80	
ZILLOW GROUP INC-C	5,057	48.96	247,590.72	
ADVANCE AUTO PARTS	3,293	158.50	521,940.50	
AMAZON.COM	18,418	2,000.81	36,850,918.58	
AUTOZONE INC	1,056	1,172.94	1,238,624.64	
BEST BUY COMPANY INC	10,819	77.86	842,367.34	
BOOKING HOLDINGS INC	1,959	1,919.25	3,759,810.75	
BURLINGTON STORES INC	3,121	182.00	568,022.00	
CARMAX INC	7,647	88.84	679,359.48	
DOLLAR GENERAL CORP	11,473	139.15	1,596,467.95	
DOLLAR TREE INC	10,680	106.24	1,134,643.20	
EBAY	37,152	41.03	1,524,346.56	
EXPEDIA GROUP INC	5,616	137.82	773,997.12	
GAP	10,261	19.32	198,242.52	
GENUINE PARTS CO	6,575	97.30	639,747.50	
GRUBHUB INC	4,540	73.74	334,779.60	
HOME DEPOT	49,691	214.71	10,669,154.61	
KOHLS CORP	7,505	51.62	387,408.10	
L BRANDS INC	9,728	25.85	251,468.80	
LKQ CORP	13,137	26.24	344,714.88	
LOWES COMPANIES	35,779	102.80	3,678,081.20	
MACY'S INC	13,046	23.25	303,319.50	
MERCADOLIBRE INC	1,832	660.00	1,209,120.00	
NORDSTROM INC	5,106	30.02	153,282.12	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,464	396.50	1,373,476.00	
QURATE RETAIL INC	18,532	13.69	253,703.08	
ROSS STORES INC	16,274	105.95	1,724,230.30	
TARGET (DAYTON HUDSON)	22,382	89.09	1,994,012.38	
TIFFANY & CO	4,819	94.43	455,058.17	
TJX COMPANIES INC	53,617	55.00	2,948,935.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,562	112.49	625,669.38	
ULTA BEAUTY INC	2,528	352.94	892,232.32	
WAYFAIR INC- CLASS A	2,697	140.15	377,984.55	
COSTCO WHOLESALE CORP	19,457	280.83	5,464,109.31	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	17,000	7.47	126,990.00	
KROGER CO	35,590	21.24	755,931.60	

SYSCO CORP	21,272	70.12	1,491,592.64	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	35,312	55.20	1,949,222.40	
WALMART INC	64,166	112.00	7,186,592.00	
ALTRIA GROUP INC	82,704	49.78	4,117,005.12	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	23,973	40.57	972,584.61	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	12,795	55.38	708,587.10	
BUNGE LIMITED	6,250	56.87	355,437.50	
CAMPBELL SOUP CO (US)	7,946	40.52	321,971.92	
COCA-COLA CO	179,289	53.78	9,642,162.42	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	9,654	56.55	545,933.70	
CONAGRA BRANDS INC	22,174	28.63	634,841.62	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,321	204.09	1,494,142.89	
GENERAL MILLS INC	25,674	52.84	1,356,614.16	
HERSHEY FOODS CORPORATION	6,369	146.76	934,714.44	
HORMEL FOODS CORP	12,393	40.41	500,801.13	
INGREDION INC	2,843	78.57	223,374.51	
JM SMUCKER CO	5,075	112.10	568,907.50	
KELLOGG CO	11,660	58.26	679,311.60	
KRAFT HEINZ CO/THE	28,278	32.07	906,875.46	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	6,742	63.49	428,049.58	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,226	158.83	830,045.58	
MOLSON COORS BREWING CO -B	8,447	56.65	478,522.55	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	63,702	54.42	3,466,662.84	
MONSTER BEVERAGE CORP	17,658	64.74	1,143,178.92	
PEPSICO INC	62,004	129.21	8,011,536.84	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	68,608	85.02	5,833,052.16	
TYSON FOODS INC	13,383	81.04	1,084,558.32	
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,915	74.01	807,819.15	
CLOROX COMPANY	5,812	163.59	950,785.08	
COLGATE-PALMOLIVE CO	36,096	71.28	2,572,922.88	
COTY INC-CL A	15,799	11.01	173,946.99	
ESTEE LAUDER CO-CL A	9,618	189.45	1,822,130.10	
KIMBERLY-CLARK CORP	15,181	134.65	2,044,121.65	
PROCTER & GAMBLE CO	110,439	112.60	12,435,431.40	
ABBOTT LABORATORIES	77,563	88.59	6,871,306.17	
ABIOMED INC	1,891	275.94	521,802.54	
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,394	275.16	933,893.04	
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,377	86.89	640,987.53	
ANTHEM INC	11,336	288.91	3,275,083.76	
BAXTER INTERNATIONAL	21,878	83.93	1,836,220.54	
BECTON DICKINSON & CO	12,026	256.25	3,081,662.50	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	62,264	42.87	2,669,257.68	

CARDINAL HEALTH	13,433	44.75	601,126.75	
CENTENE CORP	18,310	53.73	983,796.30	
CERNER CORP	13,721	72.21	990,793.41	
CIGNA CORP	16,758	171.28	2,870,310.24	
CVS HEALTH CORP	57,565	55.99	3,223,064.35	
DANAHER CORP	27,852	142.69	3,974,201.88	
DAVITA INC	6,479	59.56	385,889.24	
DENTSPLY SIRONA INC	10,232	56.60	579,131.20	
DEXCOM INC	4,071	152.96	622,700.16	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	9,054	214.88	1,945,523.52	
HCA HEALTHCARE INC	12,016	143.29	1,721,772.64	
HENRY SCHEIN INC	6,861	67.63	464,009.43	
HOLOGIC INC	11,102	49.44	548,882.88	
HUMANA INC	5,972	276.09	1,648,809.48	
IDEXX LABORATORIES INC	3,926	285.40	1,120,480.40	
INTUITIVE SURGICAL INC	5,117	543.04	2,778,735.68	
LABORATORY CRP OF AMER	4,584	178.10	816,410.40	
MCKESSON CORP	8,657	140.37	1,215,183.09	
MEDTRONIC PLC	59,487	102.33	6,087,304.71	
QUEST DIAGNOSTICS	6,077	103.36	628,118.72	
RESMED INC	6,412	125.46	804,449.52	
STERIS PLC	3,424	148.36	507,984.64	
STRYKER CORP	14,791	213.57	3,158,913.87	
TELEFLEX INC	1,940	346.08	671,395.20	
THE COOPER COS INC	2,123	336.62	714,644.26	
UNITEDHEALTH GROUP INC	42,360	251.13	10,637,866.80	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,898	137.00	534,026.00	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,067	133.81	544,205.27	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,351	166.06	888,587.06	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	2,296	291.65	669,628.40	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	9,231	125.83	1,161,536.73	
ABBVIE INC	65,102	67.46	4,391,780.92	
AGILENT TECHNOLOGIES	13,682	69.58	951,993.56	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	9,546	120.97	1,154,779.62	
ALKERMES PLC	6,874	22.89	157,345.86	
ALLERGAN PLC	14,661	160.98	2,360,127.78	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,367	76.48	333,988.16	
AMGEN	27,459	175.77	4,826,468.43	
BEIGENE LTD-ADR	1,700	129.00	219,300.00	
BIOGEN INC	8,670	241.24	2,091,550.80	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,661	81.10	621,307.10	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	72,019	43.23	3,113,381.37	

CELGENE CORP	31,275	89.94	2,812,873.50	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	12,191	33.40	407,179.40	
EXACT SCIENCES CORP	5,107	117.51	600,123.57	
GILEAD SCIENCES INC	56,290	66.64	3,751,165.60	
ILLUMINA INC	6,620	304.01	2,012,546.20	
INCYTE CORP	7,617	79.15	602,885.55	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	5,182	62.96	326,258.72	
IQVIA HOLDINGS INC	7,572	160.61	1,216,138.92	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,663	136.19	362,673.97	
JOHNSON & JOHNSON	117,597	129.78	15,261,738.66	
LILLY (ELI) & CO	39,427	108.52	4,278,618.04	
MERCK & CO	113,944	81.75	9,314,922.00	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,064	812.17	864,148.88	
MYLAN NV	23,155	18.91	437,861.05	
NEKTAR THERAPEUTICS	7,098	32.12	227,987.76	
PERKINELMER INC	4,410	95.06	419,214.60	
PERRIGO CO PLC	5,954	55.11	328,124.94	
PFIZER	245,086	42.89	10,511,738.54	
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,411	313.63	1,069,791.93	
SEATTLE GENETICS INC	5,163	73.57	379,841.91	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	43,857	8.00	350,856.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	17,607	288.36	5,077,154.52	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,513	173.34	1,995,663.42	
WATERS CORP	3,288	218.50	718,428.00	
ZOETIS INC	21,111	115.44	2,437,053.84	
BANK OF AMERICA CORP	405,160	30.67	12,426,257.20	
BB&T CORP	33,523	51.54	1,727,775.42	
CIT GROUP INC	5,078	51.52	261,618.56	
CITIGROUP	103,787	73.01	7,577,488.87	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,232	37.62	761,127.84	
COMERICA INC	7,447	72.37	538,939.39	
EAST WEST BANCORP INC	6,421	48.28	310,005.88	
FIFTH THIRD BANCORP	34,171	29.66	1,013,511.86	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,006	98.35	689,040.10	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	49,512	14.34	710,002.08	
JPMORGAN CHASE & CO	144,562	116.83	16,889,178.46	
KEY CORP	44,407	18.44	818,865.08	
M & T BANK CORP	6,028	163.72	986,904.16	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	15,184	16.65	252,813.60	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	20,539	141.33	2,902,776.87	
REGIONS FINL CORP	46,000	15.95	733,700.00	
SIGNATURE BANK	2,135	126.93	270,995.55	

SUNTRUST BANKS	19,945	66.38	1,323,949.10	
SVB FINANCIAL GROUP	2,318	226.07	524,030.26	
US BANCORP	67,142	56.59	3,799,565.78	
WELLS FARGO & CO	190,876	48.45	9,247,942.20	
ZIONS BANCORPORATION	8,203	43.51	356,912.53	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,299	91.58	210,542.42	
ALLY FINANCIAL INC	18,129	34.09	618,017.61	
AMERICAN EXPRESS	31,625	127.95	4,046,418.75	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,178	151.47	935,781.66	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	11,436	22.80	260,740.80	
BANK NEW YORK CO	37,952	47.10	1,787,539.20	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	57,635	207.97	11,986,350.95	
BLACKROCK INC	5,288	477.15	2,523,169.20	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	20,946	96.92	2,030,086.32	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,031	111.65	561,711.15	
CME GROUP INC	15,780	201.64	3,181,879.20	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,954	92.00	1,375,768.00	
E*TRADE FINANCIAL CORP	10,854	49.72	539,660.88	
EATON VANCE CORP	5,267	45.71	240,754.57	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,538	278.87	428,902.06	
FRANKLIN RESOURCES INC	14,748	35.05	516,917.40	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	14,617	222.03	3,245,412.51	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	24,929	89.25	2,224,913.25	
INVESCO LTD	19,405	20.06	389,264.30	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	12,843	21.56	276,895.08	
KKR & CO INC -A	21,470	27.29	585,916.30	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,520	334.25	508,060.00	
MOODY'S CORP	7,406	203.03	1,503,640.18	
MORGAN STANLEY	57,267	45.50	2,605,648.50	
MSCI INC	3,844	232.25	892,769.00	
NASDAQ INC	5,565	98.22	546,594.30	
NORTHERN TRUST CORP	9,149	99.46	909,959.54	
PRICE T ROWE GROUP INC	10,375	113.27	1,175,176.25	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,365	86.60	464,609.00	
S&P GLOBAL INC	11,118	243.09	2,702,674.62	
SCHWAB (CHARLES) CORP	54,100	44.28	2,395,548.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,289	58.77	369,604.53	
STATE STREET CORP	16,655	59.60	992,638.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	28,151	36.59	1,030,045.09	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	12,743	52.45	668,370.35	
VOYA FINANCIAL INC	6,370	57.14	363,981.80	
AFLAC	33,273	53.92	1,794,080.16	

ALLEGHANY CORP	620	692.72	429,486.40	
ALLSTATE CORP	15,101	102.08	1,541,510.08	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,005	103.57	311,227.85	
AMERICAN INT'L GROUP	38,661	57.39	2,218,754.79	
AON PLC	10,514	195.89	2,059,587.46	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	17,198	37.79	649,912.42	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,112	92.37	749,305.44	
ASSURANT INC	2,482	113.80	282,451.60	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	6,517	42.65	277,950.05	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	4,534	39.10	177,279.40	
CHUBB LTD	20,512	151.58	3,109,208.96	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,944	107.26	744,813.44	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	919	266.78	245,170.82	
EVEREST RE GROUP LTD	1,724	255.00	439,620.00	
FNF GROUP	12,232	42.69	522,184.08	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	16,057	57.53	923,759.21	
LINCOLN NATIONAL CORP	9,779	66.76	652,846.04	
LOEWS CORP	12,517	54.74	685,180.58	
MARKEL CORP	609	1,097.33	668,273.97	
MARSH & MCLENNAN COS	21,834	102.08	2,228,814.72	
METLIFE INC	35,850	50.37	1,805,764.50	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,999	60.58	787,479.42	
PROGRESSIVE CORP	25,056	81.02	2,030,037.12	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	18,074	102.55	1,853,488.70	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,601	158.81	413,064.81	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,736	180.00	312,480.00	
TORCHMARK CORP	4,553	90.88	413,776.64	
TRAVELERS COS INC/THE	11,612	148.85	1,728,446.20	
UNUM GROUP	9,797	33.13	324,574.61	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,957	197.18	1,174,601.26	
WR BERKLEY CORP	5,743	68.60	393,969.80	
CBRE GROUP INC-A	14,472	52.99	766,871.28	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	47,400	6.51	308,574.00	
JONES LANG LASALLE INC	2,230	143.66	320,361.80	
WEYERHAEUSER CO	34,135	25.54	871,807.90	
ACCENTURE PLC-CL A	28,129	194.47	5,470,246.63	
ADOBE INC	21,525	310.27	6,678,561.75	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	7,570	83.42	631,489.40	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,154	157.34	338,910.36	
ANSYS INC	3,623	214.95	778,763.85	
AUTODESK INC	9,411	173.51	1,632,902.61	
AUTOMATIC DATA PROCESS	19,589	167.21	3,275,476.69	

BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	5,223	134.16	700,717.68	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	12,649	75.79	958,667.71	
CDK GLOBAL INC	5,199	53.06	275,858.94	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,591	113.25	633,180.75	
CITRIX SYSTEMS INC	5,700	100.72	574,104.00	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	25,224	65.76	1,658,730.24	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,300	144.86	188,318.00	
DOCUSIGN INC	4,516	54.35	245,444.60	
DROPBOX INC-CLASS A	8,461	24.68	208,817.48	
DXC TECHNOLOGY CO	12,201	56.50	689,356.50	
EPAM SYSTEMS INC	2,341	196.91	460,966.31	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	14,224	130.12	1,850,826.88	
FIRST DATA CORP- CLASS A	23,472	28.40	666,604.80	
FISERV INC	17,584	94.17	1,655,885.28	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,777	288.34	1,089,060.18	
FORTINET INC	5,865	86.58	507,791.70	
GARTNER INC	3,870	168.98	653,952.60	
GLOBAL PAYMENTS INC	7,160	161.89	1,159,132.40	
GODADDY INC - CLASS A	7,097	75.33	534,617.01	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	39,269	150.03	5,891,528.07	
INTUIT INC	11,263	281.36	3,168,957.68	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,199	136.49	436,631.51	
LEIDOS HOLDINGS	6,384	81.60	520,934.40	
MASTERCARD INC-CLASS A	40,305	280.25	11,295,476.25	
MICROSOFT CORP	322,104	140.72	45,326,474.88	
MONGODB INC	1,494	156.02	233,093.88	
OKTA INC	4,484	137.02	614,397.68	
ORACLE CORP	110,872	58.11	6,442,771.92	
PALO ALTO NETWORKS INC	4,133	225.02	930,007.66	
PAYCHEX INC	14,576	85.05	1,239,688.80	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,192	235.13	515,404.96	
PAYPAL HOLDINGS INC	49,185	121.30	5,966,140.50	
PTC INC	5,381	91.60	492,899.60	
SABRE CORP	10,169	23.65	240,496.85	
SALESFORCE.COM INC	34,054	159.75	5,440,126.50	
SERVICENOW INC	8,181	297.21	2,431,475.01	
SPLUNK INC	6,291	139.96	880,488.36	
SQUARE INC - A	13,794	80.43	1,109,451.42	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	9,353	59.07	552,481.71	
SYMANTEC CORP	26,285	22.69	596,406.65	
SYNOPSYS INC	6,658	137.62	916,273.96	
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	3,182	175.93	559,809.26	

TOTAL SYSTEM SERVICES INC	7,332	130.10	953,893.20	
TWILIO INC - A	4,129	147.61	609,481.69	
VERISIGN INC	4,738	216.84	1,027,387.92	
VISA INC-CLASS A SHARES	77,268	183.33	14,165,542.44	
VMWARE INC-CLASS A	3,606	180.57	651,135.42	
WESTERN UNION CO	20,387	20.88	425,680.56	
WIX.COM LTD	2,000	151.52	303,040.00	
WORKDAY INC-CLASS A	6,462	214.59	1,386,680.58	
WORLDPAY INC-CLASS A	13,494	131.60	1,775,810.40	
AMPHENOL CORPORATION	12,924	92.38	1,193,919.12	
APPLE INC	208,225	208.67	43,450,310.75	
ARISTA NETWORKS INC	2,252	279.19	628,735.88	
ARROW ELECTRONICS INC	3,851	71.81	276,540.31	
CDW CORP/DE	6,846	113.60	777,705.60	
CISCO SYSTEMS	194,349	57.23	11,122,593.27	
COGNEX CORP	8,111	44.55	361,345.05	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	6,775	14.84	100,541.00	
CORNING	36,416	33.82	1,231,589.12	
DELL TECHNOLOGIES -C	6,194	56.22	348,226.68	
F5 NETWORKS INC	2,755	148.67	409,585.85	
FLEX LTD	21,868	10.31	225,459.08	
FLIR SYSTEMS INC	5,527	52.04	287,625.08	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	65,377	14.74	963,656.98	
HP INC	70,636	21.57	1,523,618.52	
IPG PHOTONICS CORP	1,782	143.68	256,037.76	
JUNIPER NETWORKS INC	16,308	27.15	442,762.20	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	8,361	93.71	783,509.31	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,260	167.59	1,216,703.40	
NETAPP INC	10,843	58.82	637,785.26	
SEAGATE TECHNOLOGY	11,767	48.93	575,759.31	
TE CONNECTIVITY LTD	15,023	91.38	1,372,801.74	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	10,999	45.23	497,484.77	
WESTERN DIGITAL CORP	13,413	57.36	769,369.68	
XEROX CORP	9,091	35.09	319,003.19	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,538	187.94	476,991.72	
AT&T INC	321,638	33.24	10,691,247.12	
CENTURYLINK INC	43,253	11.47	496,111.91	
SPRINT CORP	39,898	7.66	305,618.68	
T-MOBILE US INC	15,154	80.61	1,221,563.94	
VERIZON COMMUNICATIONS	182,469	55.97	10,212,789.93	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	9,950	33.58	334,121.00	
AES CORP	27,865	16.87	470,082.55	

ALLIANT ENERGY CORPORATION	10,283	49.51	509,111.33	
AMEREN CORPORATION	10,875	76.43	831,176.25	
AMERICAN ELECTRIC POWER	21,740	89.61	1,948,121.40	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,011	114.01	913,334.11	
ATMOS ENERGY CORP	4,707	107.64	506,661.48	
CENTERPOINT ENERGY INC	22,540	28.43	640,812.20	
CMS ENERGY CORP	12,638	58.01	733,130.38	
CONSOLIDATED EDISON INC	14,002	86.53	1,211,593.06	
DOMINION ENERGY INC	34,747	75.18	2,612,279.46	
DTE ENERGY COMPANY	8,072	127.71	1,030,875.12	
DUKE ENERGY CORP	32,025	87.18	2,791,939.50	
EDISON INTL	14,680	71.02	1,042,573.60	
ENTERGY CORP	8,099	104.66	847,641.34	
EVERGY INC	11,198	60.73	680,054.54	
EVERSOURCE ENERGY	14,253	76.42	1,089,214.26	
EXELON CORP	43,521	45.48	1,979,335.08	
FIRSTENERGY CORP	22,434	43.62	978,571.08	
NEXTERA ENERGY INC	21,173	210.06	4,447,600.38	
NISOURCE INC	16,007	29.46	471,566.22	
NRG ENERGY INC	12,298	34.76	427,478.48	
OGE ENERGY CORP	8,794	42.65	375,064.10	
PINNACLE WEST CAPITAL	4,956	91.80	454,960.80	
PPL CORPORATION	31,240	30.32	947,196.80	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	21,647	59.38	1,285,398.86	
SEMPRA ENERGY	12,361	139.76	1,727,573.36	
SOUTHERN CO	45,673	55.64	2,541,245.72	
UGI CORP	7,302	50.60	369,481.20	
VISTRA ENERGY CORP	14,141	21.56	304,879.96	
WEC ENERGY GROUP INC	14,208	85.80	1,219,046.40	
XCEL ENERGY INC	22,910	60.46	1,385,138.60	
ADVANCED MICRO DEVICES	41,274	34.11	1,407,856.14	
ANALOG DEVICES	16,620	124.64	2,071,516.80	
APPLIED MATERIALS	41,828	52.14	2,180,911.92	
BROADCOM INC	17,478	303.77	5,309,292.06	
INTEL CORP	198,509	52.92	10,505,096.28	
KLA CORP	7,032	142.65	1,003,114.80	
LAM RESEARCH CORP	6,718	216.98	1,457,671.64	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	25,681	27.17	697,752.77	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	12,629	65.34	825,178.86	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	10,561	99.84	1,054,410.24	
MICRON TECHNOLOGY	49,463	47.99	2,373,729.37	
NVIDIA CORP	25,398	178.66	4,537,606.68	

	NXP SEMICONDUCTORS NV	12,849	105.50	1,355,569.50	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	19,013	22.32	424,370.16	
	QORVO INC	5,629	75.33	424,032.57	
	QUALCOMM	53,957	75.87	4,093,717.59	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,199	86.35	707,983.65	
	TEXAS INSTRUMENTS	41,459	129.00	5,348,211.00	
	XILINX INC	11,010	132.14	1,454,861.40	
アメリカドル 小計		13,444,377		1,142,819,810.51 (123,675,959,893)	
カナダドル	CAMECO CORP	19,186	13.08	250,952.88	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	54,225	33.92	1,839,312.00	
	CENOVUS ENERGY INC	50,155	12.29	616,404.95	
	ENBRIDGE	90,282	46.01	4,153,874.82	
	ENCANA CORP	56,301	6.12	344,562.12	
	HUSKY ENERGY INC	12,746	11.42	145,559.32	
	IMPERIAL OIL	11,645	37.36	435,057.20	
	INTER PIPELINE LTD	18,856	22.54	425,014.24	
	KEYERA CORP	7,525	34.75	261,493.75	
	PEMBINA PIPELINE CORP	23,276	49.45	1,150,998.20	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,703	18.07	175,333.21	
	SUNCOR ENERGY	68,780	40.10	2,758,078.00	
	TC ENERGY CORP	40,558	65.26	2,646,815.08	
	TOURMALINE OIL CORP	12,981	17.26	224,052.06	
	VERMILION ENERGY INC	6,153	25.88	159,239.64	
	AGNICO EAGLE MINES	11,064	70.59	781,007.76	
	BARRICK GOLD CORP	73,767	22.82	1,683,362.94	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,302	67.98	496,389.96	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	32,625	12.88	420,210.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	8,688	117.98	1,025,010.24	
	KINROSS GOLD CORP	60,197	5.59	336,501.23	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	7,500	59.69	447,675.00	
	LUNDIN MINING CORP	30,173	6.75	203,667.75	
	METHANEX CORP	2,991	55.87	167,107.17	
	NUTRIEN LTD	26,842	68.20	1,830,624.40	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	21,579	30.03	648,017.37	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,615	54.05	141,340.75	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	16,916	36.02	609,314.32	
	BOMBARDIER B	104,404	2.17	226,556.68	
	CAE INC	9,539	35.90	342,450.10	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	8,775	21.24	186,381.00	
	WSP GLOBAL INC	5,400	74.44	401,976.00	
	THOMSON REUTERS CORP	9,046	88.86	803,827.56	

CANADIAN NATL RAILWAY CO	31,711	123.46	3,915,040.06	
CP RAILWAY LIMITED	6,333	313.99	1,988,498.67	
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,849	66.36	985,379.64	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,000	51.74	517,400.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	11,055	97.88	1,082,063.40	
STARS GROUP INC/THE	9,180	21.56	197,920.80	
QUEBECOR INC -CL B	6,100	30.65	186,965.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	21,409	25.84	553,208.56	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,526	145.42	367,330.92	
DOLLARAMA INC	12,978	48.65	631,379.70	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	18,698	81.73	1,528,187.54	
EMPIRE CO LTD 'A'	7,330	34.50	252,885.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	9,068	66.41	602,205.88	
METRO INC	11,606	50.21	582,737.26	
WESTON (GEORGE) LTD	3,705	99.63	369,129.15	
SAPUTO INC	10,742	39.97	429,357.74	
AURORA CANNABIS INC	30,000	8.59	257,700.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	14,544	31.27	454,790.88	
CANOPY GROWTH CORP	8,800	46.55	409,640.00	
CRONOS GROUP INC	8,200	20.25	166,050.00	
BANK MONTREAL	28,847	99.79	2,878,642.13	
BANK NOVA SCOTIA	53,557	70.29	3,764,521.53	
CANADIAN IMPERIAL BANK	19,509	103.87	2,026,399.83	
NATIONAL BANK OF CANADA	14,068	64.01	900,492.68	
ROYAL BANK OF CANADA	63,082	105.04	6,626,133.28	
TORONTO-DOMINION BANK	80,093	77.53	6,209,610.29	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	37,208	64.62	2,404,380.96	
CI FINANCIAL CORP	9,872	21.19	209,187.68	
IGM FINANCIAL INC	3,890	37.11	144,357.90	
ONEX CORP	3,102	80.11	248,501.22	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,189	618.00	734,802.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	11,567	29.52	341,457.84	
IA FINANCIAL CORP INC	3,734	53.68	200,441.12	
INTACT FINANCIAL CORP	6,633	124.45	825,476.85	
MANULIFE FINANCIAL CORP	87,856	24.51	2,153,350.56	
POWER CORP OF CANADA	13,509	28.52	385,276.68	
POWER FINANCIAL CORP	12,518	29.36	367,528.48	
SUN LIFE FINANCIAL INC	26,701	55.46	1,480,837.46	
FIRST CAPITAL REALTY INC	7,000	22.12	154,840.00	
BLACKBERRY LIMITED	25,075	9.60	240,720.00	
CGI INC - CL A	10,929	104.44	1,141,424.76	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	862	1,282.08	1,105,152.96	

	OPEN TEXT CORP	10,909	57.51	627,376.59	
	SHOPIFY INC - CLASS A	4,154	433.34	1,800,094.36	
	BCE INC	7,663	60.17	461,082.71	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	15,589	70.43	1,097,933.27	
	TELUS CORP	11,560	47.85	553,146.00	
	ALTAGAS INCOME LTD	8,078	20.71	167,295.38	
	ATCO LTD -CLASS I	4,372	43.23	189,001.56	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	5,978	35.69	213,354.82	
	EMERA INC	1,710	53.88	92,134.80	
	FORTIS INC	19,700	51.88	1,022,036.00	
	HYDRO ONE LTD	14,740	23.24	342,557.60	
カナダドル 小計		1,795,883		82,925,587.20 (6,829,751,361)	
ユーロ	ENI	113,983	14.41	1,642,950.96	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	23,722	14.17	336,259.35	
	NESTE OIL OYJ	17,466	31.56	551,226.96	
	OMV AG	5,641	44.17	249,162.97	
	REPSOL SA	63,452	14.29	906,729.08	
	TENARIS SA	19,529	11.72	228,977.52	
	TOTAL SA	106,930	48.45	5,180,758.50	
	VOPAK	3,661	43.05	157,606.05	
	AIR LIQUIDE	18,583	124.20	2,308,008.60	
	AKZO NOBEL	9,943	85.71	852,214.53	
	ARCELORMITTAL	30,928	15.67	484,889.18	
	ARKEMA	3,446	86.36	297,596.56	
	BASF SE	41,168	63.86	2,628,988.48	
	COVESTRO AG	8,327	44.82	373,216.14	
	CRH PLC	36,044	29.45	1,061,495.80	
	EVONIK INDUSTRIES AG	6,772	27.02	182,979.44	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	3,246	36.04	116,985.84	
	HEIDELBERGCEMENT AG	6,759	69.62	470,561.58	
	IMERYS SA	2,111	45.66	96,388.26	
	KONINKLIJKE DSM NV	7,836	115.65	906,233.40	
	LANXESS	3,921	57.44	225,222.24	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	10,350	30.10	311,535.00	
	SOLVAY SA	2,897	95.54	276,779.38	
	STORA ENSO OYJ R	23,291	11.04	257,132.64	
	SYMRISE AG	5,350	84.26	450,791.00	
	THYSSEN KRUPP	18,959	11.97	226,939.23	
	UMICORE	9,946	27.86	277,095.56	
	UPM KYMMENE OYJ	23,447	25.20	590,864.40	
	VOESTALPINE AG	5,948	25.32	150,603.36	

ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	10,774	37.53	404,348.22	
AIRBUS SE	26,294	131.96	3,469,756.24	
ALSTOM	6,679	37.99	253,735.21	
ANDRITZ AG	3,617	31.84	115,165.28	
BOUYGUES ORD	9,144	33.00	301,752.00	
BRENNTAG AG	7,062	46.83	330,713.46	
CNH INDUSTRIAL NV	43,124	9.63	415,370.36	
DASSAULT AVIATION SA	121	1,266.00	153,186.00	
EIFFAGE	3,707	91.30	338,449.10	
FERROVIAL SA	20,441	24.38	498,351.58	
GEA GROUP AG	7,649	22.06	168,736.94	
HOCHTIEF AG	998	102.20	101,995.60	
KINGSPAN GROUP PLC	5,706	46.50	265,329.00	
KION GROUP AG	3,430	49.48	169,716.40	
KNORR-BREMSE AG	1,738	93.00	161,634.00	
KONE OYJ-B	14,855	51.70	768,003.50	
LEGRAND SA	12,078	64.84	783,137.52	
LEONARDO SPA	22,011	11.70	257,528.70	
METSO OYJ	4,950	35.98	178,101.00	
MTU AERO ENGINES AG	2,433	224.40	545,965.20	
PRYSMIAN SPA	11,275	19.95	224,992.62	
SAFRAN SA	14,464	135.95	1,966,380.80	
SAINT-GOBAIN	22,629	35.16	795,748.78	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	23,645	77.54	1,833,433.30	
SIEMENS	33,595	102.24	3,434,752.80	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	12,322	15.55	191,607.10	
THALES SA	4,691	103.25	484,345.75	
VINCI S.A.	21,944	92.80	2,036,403.20	
WARTSILA OYJ	18,738	11.68	218,953.53	
BUREAU VERITAS SA	13,374	21.67	289,814.58	
EDENRED	10,133	45.55	461,558.15	
RANDSTAD NV	5,866	46.80	274,528.80	
SOCIETE BIC SA	1,751	67.25	117,754.75	
TELEPERFORMANCE	2,616	181.20	474,019.20	
WOLTERS KLUWER	12,729	66.02	840,368.58	
ADP	1,532	163.50	250,482.00	
AENA SME SA	2,696	174.00	469,104.00	
ATLANTIA SPA	21,349	23.78	507,679.22	
BOLLORE	37,200	3.96	147,535.20	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,748	15.38	149,972.98	
DEUTSCHE POST AG-REG	44,062	30.45	1,341,908.21	
FRAPORT AG	1,934	78.00	150,852.00	

GETLINK	18,631	13.50	251,518.50	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	14,831	70.01	1,038,318.31	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,582	57.65	148,852.30	
CONTINENTAL AG	4,832	130.70	631,542.40	
DAIMLER AG	40,787	49.21	2,007,332.20	
FAURECIA	3,558	47.02	167,297.16	
FERRARI NV	5,161	150.00	774,150.00	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	50,762	12.61	640,311.86	
MICHELIN	7,746	110.00	852,060.00	
NOKIAN RENKAAT OYJ	6,157	28.37	174,674.09	
PEUGEOT SA	26,059	23.06	600,920.54	
PIRELLI & C SPA	20,549	5.80	119,266.39	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	7,141	63.18	451,168.38	
RENAULT SA	8,523	53.17	453,167.91	
VALEO SA	10,585	29.26	309,717.10	
VOLKSWAGEN AG-PFD	8,341	158.62	1,323,049.42	
VOLKSWAGEN STAMM	1,238	161.35	199,751.30	
ADIDAS AG	7,731	282.25	2,182,074.75	
ESSILORLUXOTTICA	13,066	119.15	1,556,813.90	
HERMES INTERNATIONAL	1,412	643.80	909,045.60	
HUGO BOSS AG	3,285	57.70	189,544.50	
KERING	3,286	519.50	1,707,077.00	
LVMH	12,385	380.30	4,710,015.50	
MONCLER SPA	7,343	38.95	286,009.85	
PUMA SE	3,490	59.75	208,527.50	
SEB SA	1,191	151.70	180,674.70	
ACCOR	7,846	41.07	322,235.22	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,702	77.96	210,647.92	
SODEXO	3,785	101.80	385,313.00	
AXEL SPRINGER SE	2,214	62.00	137,268.00	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,675	17.01	147,561.75	
JC DECAUX SA	3,750	26.14	98,025.00	
PUBLICIS GROUPE	9,131	44.23	403,864.13	
RTL GROUP	2,176	45.00	97,920.00	
SES	16,206	13.30	215,539.80	
TELENET GROUP HOLDING NV	2,831	44.88	127,055.28	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,479	75.94	264,195.26	
VIVENDI	42,396	24.82	1,052,268.72	
DELIVERY HERO SE	4,800	41.12	197,376.00	
INDITEX	48,248	27.50	1,326,820.00	
ZALANDO SE	4,976	42.29	210,435.04	
CARREFOUR	25,231	17.64	445,074.84	

CASINO GUICHARD PERRACHON	3,298	33.12	109,229.76	
COLRUYT SA	2,228	47.57	105,985.96	
JERONIMO MARTINS	13,062	14.83	193,774.77	
KONINKLIJKE AHOLD NV	51,403	20.38	1,047,593.14	
METRO AG	8,880	15.40	136,752.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	33,377	86.33	2,881,436.41	
DANONE (GROUPE)	26,663	75.32	2,008,257.16	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	26,648	8.61	229,439.28	
HEINEKEN HOLDING NV	4,955	95.55	473,450.25	
HEINEKEN NV	11,372	101.65	1,155,963.80	
KERRY GROUP PLC-A	6,639	107.90	716,348.10	
PERNOD-RICARD	9,206	158.40	1,458,230.40	
REMY COINTREAU	1,020	131.00	133,620.00	
BEIERSDORF AG	4,768	105.85	504,692.80	
HENKEL AG & CO KGAA	4,514	85.05	383,915.70	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	7,927	92.52	733,406.04	
LOREAL	10,959	247.10	2,707,968.90	
UNILEVER NV	64,041	53.89	3,451,169.49	
BIOMERIEUX	1,835	73.30	134,505.50	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,352	97.50	131,820.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	9,583	68.94	660,652.02	
FRESENIUS SE&CO KGAA	18,774	45.62	856,563.75	
KONINKLIJKE PHILIPS	41,751	42.14	1,759,387.14	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,250	190.20	237,750.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	6,294	36.30	228,472.20	
BAYER	41,799	60.10	2,512,119.90	
EUROFINS SCIENTIFIC	389	410.40	159,645.60	
GRIFOLS SA	11,921	29.30	349,285.30	
IPSEN	1,866	113.70	212,164.20	
MERCK KGAA	5,323	95.12	506,323.76	
ORION OYJ-CLASS B	5,393	31.08	167,614.44	
QIAGEN N.V.	11,006	35.77	393,684.62	
RECORDATI SPA	5,195	40.39	209,826.05	
SANOFI	50,194	75.73	3,801,191.62	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,200	147.20	176,640.00	
UCB (GROUPE)	5,104	75.12	383,412.48	
ABN AMRO BANK NV-CVA	19,718	18.78	370,402.63	
AIB GROUP PLC	37,786	3.63	137,314.32	
BANCO BILBAO VIZCAYA	286,929	4.87	1,399,639.66	
BANCO DE SABADELL SA	216,777	0.89	194,405.61	
BANCO SANTANDER SA	707,738	4.13	2,927,912.10	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	46,790	4.33	202,600.70	

BANKIA SA	59,546	1.93	115,489.46	
BANKINTER SA	24,407	6.25	152,641.37	
BNP PARIBAS	49,994	42.93	2,146,242.42	
CAIXABANK	152,587	2.44	373,075.21	
COMMERZBANK AG	46,733	6.46	302,035.37	
CREDIT AGRICOLE SA	51,640	11.04	570,105.60	
ERSTE GROUP BANK AG	14,009	34.21	479,247.89	
FINECOBANK SPA	18,971	10.01	189,994.56	
ING GROEP NV-CVA	170,047	10.28	1,749,443.53	
INTESA SANPAOLO	647,852	2.03	1,318,378.82	
KBC GROEP NV	10,861	59.72	648,618.92	
MEDIOBANCA	29,447	9.30	273,974.88	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,866	22.23	174,861.18	
SOCIETE GENERALE	33,271	23.16	770,722.71	
UNICREDIT SPA	89,297	11.44	1,022,272.05	
AMUNDI SA	2,812	63.00	177,156.00	
DEUTSCHE BANK NAMEN	87,471	7.00	612,471.94	
DEUTSCHE BOERSE	8,615	126.70	1,091,520.50	
EURAZEO SA	2,340	60.15	140,751.00	
EXOR NV	4,379	64.90	284,197.10	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,728	86.18	321,279.04	
NATIXIS	40,748	3.77	153,619.96	
WENDEL	1,047	123.40	129,199.80	
AEGON	76,385	4.58	350,530.76	
AGEAS	7,693	48.99	376,880.07	
ALLIANZ SE-REG	18,665	215.10	4,014,841.50	
ASSICURAZIONI GENERALI	51,245	16.99	870,908.77	
AXA	84,125	23.54	1,980,302.50	
CNP ASSURANCES	8,406	19.75	166,018.50	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,358	143.00	337,194.00	
MAPFRE SA	56,454	2.71	153,329.06	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	6,824	223.90	1,527,893.60	
NN GROUP NV	14,216	35.12	499,265.92	
POSTE ITALIANE SPA	25,777	9.40	242,303.80	
SAMPO OYJ-A SHS	19,591	39.20	767,967.20	
SCOR SE	6,580	38.95	256,291.00	
AROUNDTOWN SA	35,430	7.27	257,717.82	
DEUTSCHE WOHNEN SE	16,109	33.24	535,463.16	
VONOVIA SE	21,618	44.28	957,245.04	
ADYEN NV	400	703.00	281,200.00	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	19,420	73.88	1,434,749.60	
ATOS SE	4,174	77.94	325,321.56	

	CAPGEMINI SA	7,143	114.15	815,373.45	
	DASSAULT SYSTEMES SA	5,884	140.95	829,349.80	
	SAP SE	43,230	113.78	4,918,709.40	
	WIRECARD AG	5,219	152.60	796,419.40	
	WORLDLINE SA	2,854	65.65	187,365.10	
	INGENICO GROUP	3,351	82.42	276,189.42	
	NOKIA OYJ	251,415	4.63	1,164,805.69	
	1&1 DRILLISCH AG	2,406	27.26	65,587.56	
	CELLNEX TELECOM SA	7,114	33.30	236,896.20	
	DEUTSCHE TELEKOM	149,447	14.81	2,213,907.85	
	ELISA A	7,434	41.42	307,916.28	
	ILIAD SA	1,337	93.64	125,196.68	
	KPN (KON.)	142,629	2.65	377,966.85	
	ORANGE	86,416	13.15	1,136,802.48	
	PROXIMUS	7,531	25.64	193,094.84	
	TELECOM ITALIA ORD	534,432	0.49	266,360.90	
	TELECOM ITALIA RNC	345,204	0.46	161,797.11	
	TELEFONICA	207,234	7.28	1,509,077.98	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,879	2.24	91,568.96	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,889	26.65	156,941.85	
	E.ON SE	98,112	9.53	935,792.25	
	ELECTRICITE DE FRANCE	24,433	11.02	269,251.66	
	ENAGAS	8,653	19.46	168,430.64	
	ENDESA	12,358	22.84	282,256.72	
	ENEL	363,911	6.33	2,303,556.63	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	118,885	3.37	400,642.45	
	ENGIE	83,020	14.03	1,165,185.70	
	FORTUM OYJ	19,008	21.12	401,448.96	
	IBERDROLA SA	260,558	8.64	2,251,221.12	
	INNOGY SE	6,865	43.42	298,078.30	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	14,147	23.05	326,088.35	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	17,346	17.32	300,519.45	
	RWE STAMM	21,261	24.15	513,453.15	
	SNAM SPA	91,077	4.64	422,597.28	
	SUEZ	17,194	12.97	223,006.18	
	TERNA SPA	66,644	5.66	377,738.19	
	UNIPER SE	8,984	28.42	255,325.28	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	24,851	22.45	557,904.95	
	VERBUND AG	3,100	51.00	158,100.00	
	ASML HOLDING NV	18,482	209.45	3,871,054.90	
	INFINEON TECHNOLOGIES	50,873	18.10	920,903.04	
	STMICROELECTRONICS	29,889	17.60	526,046.40	

ユーロ 小計		8,724,642		173,695,064.12 (20,928,518,275)	
イギリスポンド	BP PLC	890,579	5.23	4,662,181.06	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	196,886	25.41	5,003,857.69	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	166,963	25.45	4,250,043.16	
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	33,000	5.53	182,688.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	46,963	21.87	1,027,080.81	
	ANTOFAGASTA PLC	16,971	9.54	161,903.34	
	BHP GROUP PLC	91,562	19.60	1,795,347.69	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	5,497	46.62	256,270.14	
	EVRAZ PLC	16,686	6.53	109,059.69	
	FRESNILLO PLC	10,869	7.82	85,060.79	
	GLENCORE PLC	509,769	2.77	1,413,589.43	
	JOHNSON MATTHEY PLC	8,385	31.84	266,978.40	
	MONDI PLC	15,660	18.45	289,005.30	
	RIO TINTO PLC REG	51,066	46.06	2,352,355.29	
	ASHTEAD GROUP PLC	22,351	22.50	502,897.50	
	BAE SYSTEMS PLC	144,528	5.32	770,045.18	
	BUNZL PLC	14,890	21.57	321,177.30	
	DCC PLC	4,508	68.22	307,535.76	
	FERGUSON PLC	10,326	59.82	617,701.32	
	MEGGITT PLC	31,622	5.72	181,130.81	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	208,890	1.96	409,842.18	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	74,095	8.73	647,442.11	
	SMITHS GROUP PLC	20,046	16.26	325,947.96	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,872	87.70	251,874.40	
	WEIR GROUP PLC/THE	12,587	15.40	193,839.80	
	EXPERIAN PLC	38,764	24.52	950,493.28	
	G4S PLC	77,964	1.95	152,107.76	
	INTERTEK GROUP PLC	7,061	56.52	399,087.72	
	RELX PLC	85,706	19.39	1,661,839.34	
	RENTOKIL INITIAL PLC	72,952	4.23	309,243.52	
	EASYJET PLC	9,909	10.94	108,454.00	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	50,978	6.53	333,294.16	
	BURBERRY GROUP PLC	18,236	22.51	410,492.36	
	PERSIMMON PLC	13,492	20.65	278,609.80	
	TAYLOR WIMPEY PLC	166,048	1.73	288,093.28	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,550	38.55	252,502.50	
	CARNIVAL PLC	8,185	35.69	292,122.65	
	COMPASS GROUP PLC	68,629	19.64	1,348,216.70	
	GVC HOLDINGS PLC	20,500	6.31	129,355.00	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	7,472	55.30	413,201.60	

MERLIN ENTERTAINME	30,924	4.50	139,219.84	
TUI AG-DI	17,558	8.57	150,612.52	
WHITBREAD PLC	7,881	44.60	351,492.60	
AUTO TRADER GROUP PLC	42,371	5.35	226,939.07	
INFORMA PLC	54,925	8.81	483,889.25	
ITV PLC	154,979	1.13	175,513.71	
PEARSON	33,153	8.79	291,547.48	
WPP PLC	56,653	9.36	530,611.99	
KINGFISHER PLC	90,095	2.21	199,740.61	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	82,369	2.11	174,375.17	
NEXT PLC	6,461	56.58	365,563.38	
OCADO GROUP PLC	16,600	12.11	201,026.00	
MORRISON SUPERMARKETS	111,872	2.01	225,310.20	
SAINSBURY (J) PLC	82,018	2.03	166,660.57	
TESCO	441,556	2.28	1,006,747.68	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	15,323	23.93	366,679.39	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	102,261	30.20	3,088,793.50	
COCA-COLA HBC AG-CDI	9,115	27.41	249,842.15	
DIAGEO	107,795	33.53	3,614,905.32	
IMPERIAL BRANDS PLC	41,332	21.35	882,644.86	
RECKITT BENCKISER PLC	30,716	64.75	1,988,861.00	
UNILEVER PLC	49,297	49.98	2,463,864.06	
NMC HEALTH PLC	4,750	24.79	117,752.50	
SMITH & NEPHEW PLC	39,534	17.59	695,600.73	
ASTRAZENECA	56,458	63.59	3,590,164.22	
GLAXOSMITHKLINE	221,189	16.53	3,657,581.30	
BARCLAYS	741,595	1.59	1,185,958.72	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	887,685	6.56	5,826,764.34	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,125,749	0.56	1,780,739.20	
ROYAL BANK OF SCOTLAND	205,762	2.28	469,548.88	
STANDARD CHARTERED PLC	125,164	6.82	854,119.13	
3I GROUP PLC	42,422	11.34	481,065.48	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	11,976	21.00	251,496.00	
INVESTEC PLC	32,355	5.11	165,463.47	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	13,833	56.28	778,521.24	
SCHRODERS PLC	5,525	30.18	166,744.50	
ST JAMES'S PLACE PLC	26,728	10.87	290,667.00	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	105,646	3.10	327,925.18	
ADMIRAL GROUP PLC	9,872	22.21	219,257.12	
AVIVA PIC	181,949	4.14	753,632.75	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	68,857	3.31	227,916.67	
LEGAL & GENERAL GROUP	269,808	2.69	726,592.94	

	PRUDENTIAL	112,358	17.18	1,930,310.44	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	51,693	5.74	296,821.20	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	15,136	17.00	257,312.00	
	SAGE GROUP PLC	46,955	8.16	383,434.53	
	HALMA PLC	16,936	20.05	339,566.80	
	BT GROUP PLC	382,244	1.89	725,652.00	
	VODAFONE GROUP PLC	1,191,443	1.31	1,569,845.29	
	CENTRICA PLC	239,385	0.89	213,052.65	
	NATIONAL GRID PLC	145,466	8.40	1,222,932.66	
	SEVERN TRENT PLC	11,927	20.40	243,310.80	
	SSE PLC	45,896	11.65	534,688.40	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,716	7.89	274,117.53	
イギリスポンド 小計		13,316,283		81,615,364.80 (11,025,419,630)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	8,748	19.92	174,260.16	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	408	626.00	255,408.00	
	GIVAUDAN-REG	401	2,640.00	1,058,640.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	21,140	50.00	1,057,000.00	
	SIKA AG-BR	5,812	152.90	888,654.80	
	ABB LTD	81,841	18.95	1,551,296.15	
	GEBERIT AG-REG	1,662	458.70	762,359.40	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	911	221.60	201,877.60	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,651	226.60	374,116.60	
	ADECCO GROUP AG-REG	6,618	54.44	360,283.92	
	SGS SA	225	2,433.00	547,425.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,431	147.95	359,666.45	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	23,231	85.94	1,996,472.14	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,228	304.40	373,803.20	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,004	56.80	170,627.20	
	DUFRY AG-REG	1,811	87.82	159,042.02	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	100	1,951.00	195,100.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	80,900.00	404,500.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	48	7,210.00	346,080.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	135,009	102.72	13,868,124.48	
	ALCON INC	19,395	57.98	1,124,522.10	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,672	224.20	599,062.40	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	480	832.20	399,456.00	
	LONZA GROUP AG-REG	3,226	342.20	1,103,937.20	
	NOVARTIS	95,440	91.60	8,742,304.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	30,931	263.80	8,159,597.80	
	VIFOR PHARMA AG	2,126	150.00	318,900.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	113,429	12.24	1,388,938.10	

	JULIUS BAER GROUP LTD	10,752	41.97	451,261.44	
	PARGESA HOLDING SA-BR	2,289	75.05	171,789.45	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	766	795.40	609,276.40	
	UBS GROUP AG	172,537	11.64	2,008,330.68	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,334	181.00	422,454.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,587	488.20	774,773.40	
	SWISS RE LTD	13,799	95.96	1,324,152.04	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,775	348.10	2,358,377.50	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,622	87.95	318,554.90	
	TEMENOS AG - REG	2,443	172.50	421,417.50	
	SWISSCOM	1,063	478.60	508,751.80	
スイスフラン 小計		781,950		56,310,593.83 (6,184,592,520)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	9,250	309.30	2,861,025.00	
	BOLIDEN AB	13,081	225.65	2,951,727.65	
	ALFA LAVAL AB	14,233	187.30	2,665,840.90	
	ASSA ABLOY AB-B	43,306	223.50	9,678,891.00	
	ATLAS COPCO A	28,978	297.00	8,606,466.00	
	ATLAS COPCO B	18,786	266.30	5,002,711.80	
	EPIROC AB-A	26,536	105.80	2,807,508.80	
	EPIROC AB-B	12,127	100.45	1,218,157.15	
	SANDVIK AB	48,851	156.20	7,630,526.20	
	SKANSKA B	13,987	174.35	2,438,633.45	
	SKF AB-B	18,340	167.30	3,068,282.00	
	VOLVO B	63,885	149.40	9,544,419.00	
	SECURITAS B	15,577	167.75	2,613,041.75	
	ELECTROLUX AB-SER B	8,955	231.20	2,070,396.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,841	84.66	1,849,059.06	
	HENNES & MAURITZ B	32,859	168.04	5,521,626.36	
	ICA GRUPPEN AB	4,719	421.10	1,987,170.90	
	SWEDISH MATCH AB	6,770	389.10	2,634,207.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	25,364	284.70	7,221,130.80	
	NORDEA BANK ABP	134,014	63.00	8,442,882.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	69,722	93.10	6,491,118.20	
	SVENSKA HANDELSBK A	65,730	89.60	5,889,408.00	
	SWEDBANK AB-A	39,241	134.50	5,277,914.50	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	212.70	1,835,813.70	
	INVESTOR AB-B SHS	19,673	461.10	9,071,220.30	
	KINNEVIK AB - B	11,182	250.00	2,795,500.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,030	362.20	735,266.00	
	ERICSSON (LM) B	134,339	82.52	11,085,654.28	
	HEXAGON AB-B SHS	12,400	493.60	6,120,640.00	

	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,225	502.50	1,620,562.50	
	TELE2 AB-B SHS	18,919	136.25	2,577,713.75	
	TELIA CO AB	133,145	42.65	5,678,634.25	
スウェーデンクローナ 小計		1,079,696		149,993,148.30 (1,721,921,342)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	5,500	259.90	1,429,450.00	
	EQUINOR ASA	42,951	165.20	7,095,505.20	
	NORSK HYDRO	61,358	33.23	2,038,926.34	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,407	416.60	3,085,756.20	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	4,706	223.60	1,052,261.60	
	MOWI ASA	18,884	221.50	4,182,806.00	
	ORKLA	33,665	76.06	2,560,559.90	
	DNB ASA	43,059	158.00	6,803,322.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,153	173.90	1,939,506.70	
	TELENOR ASA	32,710	174.85	5,719,343.50	
ノルウェークローネ 小計		261,393		35,907,437.44 (449,561,116)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,151	596.20	2,474,826.20	
	NOVOZYMES A/S	9,595	317.90	3,050,250.50	
	VESTAS WIND SYSYEMS	9,068	588.80	5,339,238.40	
	ISS A/S	6,102	192.65	1,175,550.30	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	199	7,390.00	1,470,610.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	270	7,766.00	2,096,820.00	
	DSV A/S	8,200	636.00	5,215,200.00	
	PANDORA A/S	5,549	262.30	1,455,502.70	
	CARLSBERG AS-B	5,005	901.80	4,513,509.00	
	COLOPLAST-B	5,071	793.20	4,022,317.20	
	DEMANT A/S	4,463	195.05	870,508.15	
	GENMAB A/S	2,406	1,238.50	2,979,831.00	
	H LUNDBECK A/S	3,647	260.90	951,502.30	
	NOVO NORDISK A/S-B	75,451	331.05	24,978,053.55	
	DANSKE BANK A/S	32,879	103.00	3,386,537.00	
	TRYG A/S	5,192	208.40	1,082,012.80	
	ORSTED A/S	8,810	634.80	5,592,588.00	
デンマーククローネ 小計		186,058		70,654,857.10 (1,140,369,393)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	12,821	26.24	336,423.04	
	OIL SEARCH LTD	52,747	7.00	369,229.00	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	72,570	7.75	562,417.50	
	SANTOS	83,906	7.00	587,342.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	4,845	22.30	108,043.50	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	41,887	34.17	1,431,278.79	

WORLEYPARSONS LTD	14,417	15.41	222,165.97	
ALUMINA LIMITED	75,453	2.34	176,560.02	
BHP GROUP LTD	131,644	41.33	5,440,846.52	
BLUESCOPE STEEL LTD	21,549	13.07	281,645.43	
BORAL LIMITED	42,845	5.61	240,360.45	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	57,536	8.73	502,289.28	
INCITEC PIVOT LTD	81,242	3.46	281,097.32	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	15,221	18.91	287,829.11	
NEWCREST MINING LIMITED	30,755	34.02	1,046,285.10	
ORICA LTD	19,570	20.42	399,619.40	
RIO TINTO LTD	15,767	100.51	1,584,741.17	
SOUTH32 LTD	216,184	3.13	676,655.92	
CIMIC GROUP LIMITED	2,943	34.80	102,416.40	
BRAMBLES LTD	63,458	12.65	802,743.70	
SEEK LTD	17,113	21.35	365,362.55	
AURIZON HOLDINGS LTD	93,604	5.66	529,798.64	
TRANSURBAN GROUP	112,078	15.27	1,711,431.06	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	25,733	30.47	784,084.51	
CROWN RESORTS LTD	18,801	12.80	240,652.80	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,974	38.28	113,844.72	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,988	45.62	136,312.56	
TABCORP HOLDINGS LTD	90,583	4.59	415,775.97	
REA GROUP LTD	3,000	97.99	293,970.00	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	37,021	4.45	164,743.45	
WESFARMERS LTD	50,229	39.30	1,973,999.70	
COLES GROUP LTD	50,229	13.98	702,201.42	
WOOLWORTHS GROUP LTD	57,160	34.93	1,996,598.80	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	22,146	10.51	232,754.46	
TREASURY WINE ESTATES LTD	34,480	16.92	583,401.60	
COCHLEAR LIMITED	2,282	221.28	504,960.96	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	5,371	71.92	386,282.32	
SONIC HEALTHCARE LTD	19,089	27.87	532,010.43	
CSL LIMITED	20,235	223.34	4,519,284.90	
AUST AND NZ BANKING GROUP	124,005	27.65	3,428,738.25	
BANK OF QUEENSLAND LTD	19,098	9.19	175,510.62	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	23,879	11.58	276,518.82	
COMMONWEALTH BANK OF AUST	77,408	82.35	6,374,548.80	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	123,216	28.33	3,490,709.28	
WESTPAC BANKING	150,107	28.39	4,261,537.73	
AMP LTD	113,052	1.80	203,493.60	
ASX LTD	7,739	86.64	670,506.96	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	30,531	6.92	211,274.52	

	MACQUARIE GROUP LIMITED	14,169	129.31	1,832,193.39	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	96,651	8.63	834,098.13	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	102,821	3.64	374,268.44	
	QBE INSURANCE GROUP	54,883	11.88	652,010.04	
	SUNCORP GROUP LIMITED	60,266	13.40	807,564.40	
	COMPUTERSHARE LIMITED	21,970	16.15	354,815.50	
	TELSTRA CORP	186,467	3.86	719,762.62	
	TPG TELECOM LTD	22,697	6.80	154,339.60	
	AGL ENERGY LTD	26,594	21.00	558,474.00	
	AUSNET SERVICES	47,066	1.81	85,424.79	
オーストラリアドル 小計		3,025,095		57,093,249.96 (4,311,111,304)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	49,092	4.91	241,041.72	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	49,114	9.64	473,458.96	
	A2 MILK CO LTD	28,382	17.02	483,061.64	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	26,518	16.15	428,265.70	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,000	12.99	285,780.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	66,673	3.88	259,024.60	
	MERIDIAN ENERGY LTD	64,034	4.99	319,529.66	
ニュージーランドドル 小計		305,813		2,490,162.28 (180,636,371)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	120,448	76.10	9,166,092.80	
	NWS HOLDINGS LTD	73,500	15.30	1,124,550.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	57,500	61.20	3,519,000.00	
	MTR CORP	68,000	53.60	3,644,800.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	47,000	22.65	1,064,550.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	88,000	56.20	4,945,600.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	60,400	13.82	834,728.00	
	SANDS CHINA LTD	104,600	40.55	4,241,530.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	38,000	9.86	374,680.00	
	SJM HOLDINGS LTD	42,000	9.35	392,700.00	
	WYNN MACAU LTD	60,800	19.02	1,156,416.00	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	24,000	38.50	924,000.00	
	WH GROUP LTD	363,500	8.02	2,915,270.00	
	BANK EAST ASIA	46,964	22.00	1,033,208.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	162,500	31.05	5,045,625.00	
	HANG SENG BANK	33,700	195.00	6,571,500.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	52,500	266.80	14,007,000.00	
	AIA GROUP LTD	537,000	86.80	46,611,600.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	113,948	62.10	7,076,170.80	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	72,000	19.14	1,378,080.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	56,761	42.70	2,423,694.70	

	HYSAN DEVELOPMENT CO	31,000	39.60	1,227,600.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	37,000	32.15	1,189,550.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	305,000	12.06	3,678,300.00	
	SINO LAND CO	128,600	13.30	1,710,380.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	70,000	130.60	9,142,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	20,000	96.40	1,928,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	40,600	30.75	1,248,450.00	
	WHARF HOLDINGS	61,000	20.35	1,241,350.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	61,000	50.35	3,071,350.00	
	WHEELOCK & CO LTD	40,000	53.60	2,144,000.00	
	PCCW LTD	212,000	4.56	966,720.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	32,000	61.90	1,980,800.00	
	CLP HOLDINGS	72,500	86.85	6,296,625.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	446,457	17.54	7,830,855.78	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	59,000	57.95	3,419,050.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	11,700	94.40	1,104,480.00	
香港ドル 小計		3,850,978		166,630,306.08 (2,307,829,739)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	57,500	6.53	375,475.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	62,000	2.44	151,280.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	74,800	4.29	320,892.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	117,400	1.49	174,926.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	113,900	2.77	315,503.00	
	SINGAPORE AIRLINES	17,500	9.63	168,525.00	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	14,600	4.93	71,978.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	319,700	0.93	298,919.50	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	84,550	2.25	190,237.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,600	36.19	166,474.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	486,720	0.30	146,016.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	76,800	3.97	304,896.00	
	DBS GROUP	79,000	26.65	2,105,350.00	
	OCBC BANK	136,050	11.74	1,597,227.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	58,100	26.80	1,557,080.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	8.03	341,275.00	
	CAPITALAND LTD	118,900	3.63	431,607.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	22,000	9.50	209,000.00	
	UOL GROUP LIMITED	24,800	7.52	186,496.00	
	VENTURE CORP LTD	14,300	15.78	225,654.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	347,180	3.46	1,201,242.80	
シンガポールドル 小計		2,272,900		10,540,053.80 (835,826,266)	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	28,484	18.25	519,833.00	

イスラエルシェケル	ELBIT SYSTEMS LTD	732	566.00	414,312.00	
	BANK HAPOALIM BM	43,070	27.30	1,175,811.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	59,200	25.40	1,503,680.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	38,227	15.19	580,668.13	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,272	84.50	529,984.00	
	AZRIELI GROUP	1,471	243.40	358,041.40	
	NICE LTD	2,295	526.40	1,208,088.00	
イスラエルシェケル 小計		179,751		6,290,417.53 (193,052,913)	
合　計		49,224,819		179,784,550,123 (179,784,550,123)	

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	46,179	511,201.53	
		LENDLEASE GROUP	27,483	413,893.98	
		SYDNEY AIRPORT	53,915	440,485.55	
	オーストラリアドル 小計		127,577	1,365,581.06 (103,115,025)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	130,000	1,046,500.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	185,000	2,305,100.00	
	香港ドル 小計		315,000	3,351,600.00 (46,419,660)	
投資信託受益証券合計			442,577	149,534,685 (149,534,685)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	23,507	409,962.08	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4,686	669,441.96	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	19,462	3,985,622.98	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	55,661	531,005.94	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,260	1,294,881.00	
		BOSTON PROPERTIES	6,944	904,872.64	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,103	439,185.12	
		CROWN CASTLE INTL CORP	18,686	2,414,418.06	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	9,268	1,089,175.36	
		DUKE REALTY CORP	15,871	528,504.30	
		EQUINIX INC	3,545	1,801,994.40	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	3,424	423,069.44	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	16,603	1,285,570.29	
		ESSEX PROPERTY TRUST	2,962	870,087.50	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,625	617,737.50	

	FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,090	403,677.60	
	HCP INC	20,968	669,927.60	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,932	587,836.20	
	INVITATION HOMES INC	15,261	414,793.98	
	IRON MOUNTAIN INC	12,039	364,420.53	
	KIMCO REALTY CORP	17,599	330,861.20	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	5,658	299,421.36	
	MACERICH CO/THE	4,623	154,130.82	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,069	601,639.61	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	7,300	383,980.00	
	PROLOGIS INC	28,374	2,334,045.24	
	PUBLIC STORAGE	7,084	1,715,815.64	
	REALTY INCOME CORP	12,818	888,287.40	
	REGENCY CENTERS CORP	6,825	451,473.75	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	4,947	1,157,993.76	
	SIMON PROPERTY GROUP	13,909	2,213,895.53	
	SL GREEN REALTY CORP	4,007	328,654.14	
	SUN COMMUNITIES INC	3,481	457,194.54	
	UDR INC	11,920	544,148.00	
	VENTAS INC	16,040	1,088,795.20	
	VEREIT INC	40,232	366,111.20	
	VORNADO REALTY TRUST	7,639	488,055.71	
	WELLTOWER INC	16,702	1,387,769.18	
	WP CAREY INC	6,973	591,868.24	
アメリカドル 小計		502,097	35,490,325.00 (3,840,762,971)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	7,812	179,129.16	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,945	234,806.25	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2,942	97,056.58	
カナダドル 小計		19,699	510,991.99 (42,085,300)	
ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584	—	
	COVIVIO(FP)	1,902	179,263.50	
	GECINA SA	1,960	269,892.00	
	ICADE	1,843	146,057.75	
	KLEPIERRE	8,356	245,749.96	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,283	807,679.65	
ユーロ 小計		1,625,928	1,648,642.86 (198,644,978)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	39,175	212,406.85	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,132	271,258.34	
	SEGRO PLC	43,067	334,544.45	

	イギリスポンド 小計		114,374	818,209.64 (110,531,940)	
	オーストラリアドル	DEXUS	47,933	647,574.83	
		GOODMAN GROUP	73,073	1,115,093.98	
		GPT GROUP	84,564	524,296.80	
		MIRVAC GROUP	176,235	574,526.10	
		SCENTRE GROUP	228,183	892,195.53	
		STOCKLAND	121,481	564,886.65	
		VICINITY CENTERS	163,023	418,969.11	
	オーストラリアドル 小計		894,492	4,737,543.00 (357,731,871)	
	香港ドル	LINK REIT	96,000	9,163,200.00	
	香港ドル 小計		96,000	9,163,200.00 (126,910,320)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	120,300	363,306.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	110,000	236,500.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	117,100	306,802.00	
		SUNTEC REIT	113,000	220,350.00	
	シンガポールドル 小計		460,400	1,126,958.00 (89,367,769)	
投資証券合計			3,712,990	4,766,035,149 (4,766,035,149)	
合計				4,915,569,834 (4,915,569,834)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式　615銘柄	97.0%	—	—	67.0%
	投資証券　39銘柄	—	—	3.0%	2.1%
カナダドル	株式　86銘柄	99.4%	—	—	3.7%
	投資証券　3銘柄	—	—	0.6%	0.0%
ユーロ	株式　239銘柄	99.1%	—	—	11.3%
	投資証券　6銘柄	—	—	0.9%	0.1%
イギリスポンド	株式　94銘柄	99.0%	—	—	6.0%
	投資証券　3銘柄	—	—	1.0%	0.1%

スイスフラン	株式　39銘柄	100.0%	—	—	3.3%
スウェーデンクローナ	株式　32銘柄	100.0%	—	—	0.9%
ノルウェークローネ	株式　10銘柄	100.0%	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式　17銘柄	100.0%	—	—	0.6%
オーストラリアドル	株式　58銘柄	90.3%	—	—	2.3%
	投資信託受益証券　3銘柄	—	2.2%	—	0.1%
	投資証券　7銘柄	—	—	7.5%	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　37銘柄	93.0%	—	—	1.2%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	1.9%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	5.1%	0.1%
シンガポールドル	株式　21銘柄	90.3%	—	—	0.5%
	投資証券　4銘柄	—	—	9.7%	0.0%
イスラエルシェケル	株式　8銘柄	100.0%	—	—	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

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(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

	2019年 7月25日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	130,616,906
コール・ローン	1,321,104,766
国債証券	132,668,535,232
派生商品評価勘定	5,290,907
未収入金	736,282
未収利息	1,072,080,687
前払費用	34,744,491
差入委託証拠金	213,821,196
流動資産合計	135,446,930,467
資産合計	135,446,930,467
負債の部	
流動負債	

	2019年 7月25日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	3,810,831
前受金	4,425,172
未払金	3,021,196
未払解約金	390,324,544
未払利息	3,056
その他未払費用	611
流動負債合計	401,585,410
負債合計	401,585,410
純資産の部	
元本等	
元本	56,338,276,909
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	78,707,068,148
元本等合計	135,045,345,057
純資産合計	135,045,345,057
負債純資産合計	135,446,930,467

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 7月25日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「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条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。

	2019年 7月25日現在
4 .収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2019年 7月25日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	56,338,276,909口
2．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.3970円 (1万口当たり純資産額) (23,970円)

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2019年 7月25日現在
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2019年 7月25日現在
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.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)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 7月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2019年 7月25日現在
期首	2018年 7月26日
期首元本額	58,950,215,356円
期中追加設定元本額	5,087,053,579円
期中一部解約元本額	7,698,992,026円
期末元本額	56,338,276,909円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	2,279,302,174円
ＤＣ外国債券インデックスファンド	2,051,587,652円
ＤＣ外国債券インデックスファンドＬ	12,321,217,031円
ＤＣバランスファンド３０	742,027,129円
ＤＣバランスファンド５０	725,023,477円
ＤＣバランスファンド７０	140,388,696円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	439,376,421円
外国債券インデックスｅ	1,349,434,020円
インデックスコレクション（外国債券）	3,609,835,707円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	2,354,489,838円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	452,509,599円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	123,967,506円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	3,876,662,329円
外国債券パッシブファンド私募Ａ（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	2,156,102,741円
外国債券インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	705,944,185円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	200,608,642円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	869,061,176円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	447,100,099円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	797,244,994円
ＶＡバランス株式３０（適格機関投資家専用）	834,613円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	1,512,059,754円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	2,158,326,057円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	724,772,155円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	7,594,178,688円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	372,808,709円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	388,605,270円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	1,875,103,224円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	135,401,831円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	225,583,574円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	120,763,147円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	60,220,322円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	3,385,796,166円
バランスＶＡ２０Ｌ（適格機関投資家専用）	8,653,484円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	307,778,075円
世界バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	92,976,321円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	1,703,057,742円

区分	2019年 7月25日現在
私募外国債券インデックスファンドＡＬ（適格機関投資家専用）	29,474,361円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 7月25日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	5,598,618,863
合計	5,598,618,863

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国債券マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2019年 7月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	784,344,969	－	788,770,141	4,425,172
合計		784,344,969	－	788,770,141	4,425,172

(注)1.時価の算定方法

債券先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2019年 7月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	886,557,296	－	883,612,200	△2,945,096
	アメリカドル	442,308,408	－	442,964,000	655,592
	カナダドル	43,774,935	－	43,597,800	△177,135
	ユーロ	327,514,703	－	324,145,000	△3,369,703
	イギリスポンド	72,959,250	－	72,905,400	△53,850
合計		886,557,296	－	883,612,200	△2,945,096

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

①計算日又は計算日に知りうる直近の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によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の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、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先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 1.125% 02/28/21	4,550,000.00	4,495,613.30	
		T 1.125% 06/30/21	4,000,000.00	3,945,781.24	
		T 1.25% 03/31/21	8,500,000.00	8,412,509.75	
		T 1.25% 07/31/23	3,950,000.00	3,866,062.50	
		T 1.25% 10/31/21	4,950,000.00	4,887,931.65	
		T 1.375% 01/31/21	1,600,000.00	1,587,562.49	
		T 1.375% 04/30/21	3,000,000.00	2,974,863.27	
		T 1.375% 08/31/20	1,750,000.00	1,738,823.24	
		T 1.375% 08/31/23	3,450,000.00	3,392,320.31	
		T 1.375% 09/30/20	2,950,000.00	2,930,179.68	
		T 1.375% 09/30/23	7,100,000.00	6,977,414.09	
		T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,957,695.32	
		T 1.5% 01/31/22	3,000,000.00	2,978,320.32	
		T 1.5% 02/28/23	4,200,000.00	4,156,851.55	
		T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,957,812.52	
		T 1.5% 08/15/26	8,300,000.00	8,064,617.22	
		T 1.625% 02/15/26	5,750,000.00	5,648,925.81	
		T 1.625% 04/30/23	8,100,000.00	8,049,058.61	
		T 1.625% 05/15/26	5,400,000.00	5,297,484.40	
		T 1.625% 05/31/23	4,350,000.00	4,322,302.72	
		T 1.625% 07/31/20	1,200,000.00	1,195,664.06	
		T 1.625% 08/15/22	1,400,000.00	1,392,890.63	
		T 1.625% 08/31/22	500,000.00	497,382.81	
		T 1.625% 10/15/20	5,270,000.00	5,249,722.83	

		T 1.625% 11/15/22	4,000,000.00	3,978,593.76	
		T 1.625% 11/30/20	5,000,000.00	4,980,566.40	
		T 1.75% 01/31/23	2,650,000.00	2,645,859.37	
		T 1.75% 02/28/22	3,650,000.00	3,645,722.67	
		T 1.75% 03/31/22	2,500,000.00	2,497,167.97	
		T 1.75% 04/30/22	2,000,000.00	1,997,890.62	
		T 1.75% 05/15/22	4,600,000.00	4,594,789.07	
		T 1.75% 05/15/23	1,750,000.00	1,746,582.04	
		T 1.75% 05/31/22	2,650,000.00	2,646,480.48	
		T 1.75% 06/30/22	2,500,000.00	2,497,949.22	
		T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	3,990,390.64	
		T 1.75% 12/31/20	3,000,000.00	2,993,085.93	
		T 1.875% 01/31/22	1,550,000.00	1,552,542.97	
		T 1.875% 03/31/22	5,100,000.00	5,111,953.12	
		T 1.875% 04/30/22	2,800,000.00	2,805,578.13	
		T 1.875% 05/31/22	2,350,000.00	2,355,783.20	
		T 1.875% 06/30/20	3,200,000.00	3,196,250.01	
		T 1.875% 08/31/22	2,600,000.00	2,606,195.30	
		T 1.875% 09/30/22	1,500,000.00	1,504,042.96	
		T 1.875% 10/31/22	2,000,000.00	2,005,156.26	
		T 1.875% 11/30/21	3,500,000.00	3,505,332.04	
		T 2.125% 01/31/21	6,000,000.00	6,019,921.86	
		T 2.125% 03/31/24	1,200,000.00	1,216,593.75	
		T 2.125% 05/15/25	7,250,000.00	7,349,970.68	
		T 2.125% 06/30/21	3,000,000.00	3,016,875.00	
		T 2.125% 06/30/22	1,100,000.00	1,110,699.21	
		T 2.125% 07/31/24	1,500,000.00	1,521,269.53	
		T 2.125% 08/15/21	2,900,000.00	2,917,105.47	
		T 2.125% 08/31/20	1,000,000.00	1,001,777.34	
		T 2.125% 09/30/21	2,000,000.00	2,013,046.88	
		T 2.125% 09/30/24	2,200,000.00	2,231,195.31	
		T 2.125% 11/30/23	2,700,000.00	2,735,437.50	
		T 2.125% 11/30/24	1,400,000.00	1,419,851.56	
		T 2.125% 12/31/22	3,800,000.00	3,842,007.82	
		T 2.25% 01/31/24	8,100,000.00	8,252,824.23	
		T 2.25% 02/15/27	3,900,000.00	3,982,570.33	
		T 2.25% 03/31/21	900,000.00	905,554.69	
		T 2.25% 04/30/21	4,700,000.00	4,731,486.33	
		T 2.25% 07/31/21	4,500,000.00	4,537,089.85	
		T 2.25% 08/15/27	6,330,000.00	6,459,072.68	
		T 2.25% 08/15/46	7,450,000.00	6,969,242.18	
		T 2.25% 10/31/24	2,500,000.00	2,551,074.22	

		T 2.25% 11/15/24	5,000,000.00	5,101,953.15	
		T 2.25% 11/15/25	6,500,000.00	6,635,332.01	
		T 2.25% 11/15/27	6,800,000.00	6,935,468.78	
		T 2.25% 12/31/23	3,500,000.00	3,564,804.70	
		T 2.25% 12/31/24	3,700,000.00	3,776,746.10	
		T 2.375% 04/30/26	1,820,000.00	1,873,035.94	
		T 2.375% 05/15/27	3,600,000.00	3,708,843.76	
		T 2.375% 08/15/24	6,700,000.00	6,875,613.29	
		T 2.375% 12/31/20	4,300,000.00	4,328,218.75	
		T 2.5% 01/31/25	4,000,000.00	4,135,468.76	
		T 2.5% 02/15/45	5,350,000.00	5,282,707.05	
		T 2.5% 02/15/46	7,500,000.00	7,392,187.50	
		T 2.5% 05/15/24	3,700,000.00	3,815,769.52	
		T 2.5% 08/15/23	3,450,000.00	3,544,201.18	
		T 2.625% 01/31/26	1,350,000.00	1,408,957.03	
		T 2.625% 02/15/29	5,390,000.00	5,660,763.30	
		T 2.625% 03/31/25	2,500,000.00	2,602,148.45	
		T 2.625% 05/15/21	6,000,000.00	6,081,914.04	
		T 2.625% 08/15/20	2,400,000.00	2,416,265.61	
		T 2.625% 11/15/20	2,350,000.00	2,370,975.58	
		T 2.75% 02/15/24	8,900,000.00	9,265,734.36	
		T 2.75% 02/15/28	4,670,000.00	4,945,457.05	
		T 2.75% 04/30/23	4,200,000.00	4,344,046.89	
		T 2.75% 08/15/42	2,100,000.00	2,185,968.75	
		T 2.75% 08/15/47	4,700,000.00	4,856,421.87	
		T 2.75% 09/30/20	1,400,000.00	1,412,906.25	
		T 2.75% 11/15/23	4,450,000.00	4,623,480.49	
		T 2.75% 11/15/42	2,740,000.00	2,848,529.70	
		T 2.75% 11/15/47	4,700,000.00	4,856,421.87	
		T 2.875% 04/30/25	2,300,000.00	2,426,140.62	
		T 2.875% 05/15/28	2,260,000.00	2,416,964.07	
		T 2.875% 05/15/43	1,250,000.00	1,326,074.22	
		T 2.875% 08/15/28	4,200,000.00	4,494,328.14	
		T 2.875% 08/15/45	8,130,000.00	8,610,178.12	
		T 2.875% 10/15/21	4,250,000.00	4,347,617.18	
		T 2% 02/15/22	3,100,000.00	3,116,226.57	
		T 2% 02/15/23	6,500,000.00	6,545,195.34	
		T 2% 02/15/25	6,050,000.00	6,095,138.68	
		T 2% 02/28/21	3,150,000.00	3,155,414.06	
		T 2% 04/30/24	8,000,000.00	8,065,937.52	
		T 2% 05/31/21	5,500,000.00	5,514,824.20	
		T 2% 05/31/24	1,500,000.00	1,513,359.37	
		T 2% 06/30/24	1,000,000.00	1,008,164.06	

		T 2% 07/31/20	4,000,000.00	4,000,312.52	
		T 2% 07/31/22	6,000,000.00	6,036,562.50	
		T 2% 08/15/25	3,750,000.00	3,774,609.37	
		T 2% 08/31/21	4,200,000.00	4,214,929.69	
		T 2% 09/30/20	4,000,000.00	4,002,343.76	
		T 2% 10/31/21	4,200,000.00	4,217,226.55	
		T 2% 11/15/21	1,300,000.00	1,306,093.75	
		T 2% 11/15/26	2,700,000.00	2,711,390.62	
		T 2% 11/30/20	2,800,000.00	2,803,007.81	
		T 2% 11/30/22	5,500,000.00	5,536,093.75	
		T 2% 12/31/21	3,380,000.00	3,396,239.85	
		T 3.125% 02/15/42	1,300,000.00	1,442,593.75	
		T 3.125% 02/15/43	2,100,000.00	2,323,617.19	
		T 3.125% 05/15/21	6,250,000.00	6,389,892.56	
		T 3.125% 08/15/44	7,200,000.00	7,962,750.00	
		T 3.125% 11/15/28	4,940,000.00	5,395,020.33	
		T 3.125% 11/15/41	870,000.00	966,039.84	
		T 3.375% 05/15/44	3,000,000.00	3,456,796.88	
		T 3.5% 02/15/39	1,100,000.00	1,297,398.44	
		T 3.625% 02/15/21	7,050,000.00	7,236,852.56	
		T 3.625% 02/15/44	2,650,000.00	3,175,238.29	
		T 3.625% 08/15/43	1,600,000.00	1,916,000.00	
		T 3.75% 08/15/41	1,100,000.00	1,340,453.12	
		T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	3,663,515.64	
		T 3.875% 08/15/40	1,550,000.00	1,922,121.10	
		T 3% 02/15/49	1,140,000.00	1,238,503.12	
		T 3% 05/15/42	1,100,000.00	1,195,390.62	
		T 3% 05/15/45	200,000.00	216,718.75	
		T 3% 05/15/47	3,400,000.00	3,689,000.00	
		T 3% 08/15/48	5,950,000.00	6,459,468.75	
		T 3% 09/30/25	7,000,000.00	7,450,898.42	
		T 3% 10/31/25	5,950,000.00	6,336,517.59	
		T 3% 11/15/44	2,050,000.00	2,219,125.00	
		T 4.25% 05/15/39	850,000.00	1,104,402.34	
		T 4.25% 11/15/40	900,000.00	1,172,390.62	
		T 4.375% 02/15/38	500,000.00	656,835.94	
		T 4.375% 05/15/40	1,600,000.00	2,115,625.00	
		T 4.375% 05/15/41	1,350,000.00	1,789,699.22	
		T 4.375% 11/15/39	1,050,000.00	1,386,656.25	
		T 4.5% 02/15/36	1,000,000.00	1,311,875.00	
		T 4.5% 08/15/39	1,250,000.00	1,677,050.78	
		T 4.625% 02/15/40	1,500,000.00	2,044,804.69	

	T 4.75% 02/15/41	350,000.00	486,226.56	
	T 5.0% 05/15/37	650,000.00	910,964.84	
	T 5.25% 02/15/29	500,000.00	639,921.87	
	T 5.25% 11/15/28	900,000.00	1,146,304.69	
	T 5.375% 02/15/31	750,000.00	1,003,593.75	
	T 5.5% 08/15/28	250,000.00	322,148.43	
	T 6.0% 02/15/26	600,000.00	751,734.37	
	T 6.125% 11/15/27	1,050,000.00	1,385,179.68	
	T 6.25% 05/15/30	720,000.00	1,011,937.50	
	T 6.25% 08/15/23	1,350,000.00	1,584,931.64	
	T 6.5% 11/15/26	450,000.00	590,132.81	
	T 8.0% 11/15/21	2,600,000.00	2,959,734.38	
	T 8.75% 08/15/20	6,340,000.00	6,788,257.84	
アメリカドル 小計		560,400,000.00	577,239,403.10 (62,468,848,203)	
カナダドル	CAN 0.5% 03/01/22	850,000.00	830,161.00	
	CAN 0.75% 03/01/21	1,980,000.00	1,956,418.20	
	CAN 0.75% 09/01/20	1,750,000.00	1,733,418.75	
	CAN 0.75% 09/01/21	2,400,000.00	2,366,316.00	
	CAN 1.5% 06/01/23	2,440,000.00	2,450,357.80	
	CAN 1.5% 06/01/26	1,450,000.00	1,459,838.25	
	CAN 1% 06/01/27	1,060,000.00	1,027,150.60	
	CAN 1% 09/01/22	1,150,000.00	1,135,791.75	
	CAN 2.25% 02/01/21	1,580,000.00	1,597,506.40	
	CAN 2.25% 03/01/24	670,000.00	695,945.75	
	CAN 2.25% 06/01/25	970,000.00	1,017,660.95	
	CAN 2.25% 06/01/29	390,000.00	418,828.80	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,530,000.00	1,611,181.80	
	CAN 2.75% 06/01/22	1,100,000.00	1,141,063.00	
	CAN 2.75% 12/01/48	870,000.00	1,080,165.90	
	CAN 2.75% 12/01/64	350,000.00	470,328.25	
	CAN 2% 06/01/28	350,000.00	366,429.00	
	CAN 3.25% 06/01/21	1,400,000.00	1,445,633.00	
	CAN 3.5% 12/01/45	1,500,000.00	2,068,177.50	
	CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,487,776.50	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,110,000.00	1,543,704.75	
	CAN 5.75% 06/01/33	590,000.00	898,469.70	
	CAN 5% 06/01/37	1,000,000.00	1,515,725.00	
	CAN 8.0% 06/01/27	480,000.00	713,486.40	
カナダドル 小計		28,020,000.00	31,031,535.05 (2,555,757,226)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	6,400,000.00	7,785,248.00	
	MBONO 10% 12/05/24	25,400,000.00	28,522,295.00	

		MBONO 5.75% 03/05/26	8,450,000.00	7,756,466.25	
		MBONO 6.5% 06/09/22	17,400,000.00	17,062,875.00	
		MBONO 6.5% 06/10/21	25,200,000.00	24,838,506.00	
		MBONO 7.25% 12/09/21	9,500,000.00	9,489,312.50	
		MBONO 7.5% 06/03/27	15,950,000.00	16,069,066.75	
		MBONO 7.75% 05/29/31	11,850,000.00	12,058,323.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	15,500,000.00	15,388,632.50	
		MBONO 7.75% 11/23/34	7,650,000.00	7,722,828.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	8,000,000.00	8,591,640.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	8,200,000.00	8,787,776.00	
		MBONO 8% 11/07/47	5,830,000.00	5,936,805.60	
		MBONO 8% 12/07/23	10,250,000.00	10,533,873.75	
	メキシコペソ 小計		175,580,000.00	180,543,648.35 (1,023,682,486)	
	ユーロ	BGB 0.2% 10/22/23	180,000.00	186,279.30	
		BGB 0.5% 10/22/24	350,000.00	368,791.50	
		BGB 0.8% 06/22/25	1,100,000.00	1,182,324.00	
		BGB 0.8% 06/22/27	750,000.00	812,857.50	
		BGB 0.8% 06/22/28	970,000.00	1,052,556.70	
		BGB 0.9% 06/22/29	790,000.00	864,943.35	
		BGB 1.45% 06/22/37	400,000.00	464,942.00	
		BGB 1.6% 06/22/47	710,000.00	843,984.10	
		BGB 1.7% 06/22/50	430,000.00	518,369.30	
		BGB 1.9% 06/22/38	330,000.00	410,691.60	
		BGB 1% 06/22/26	1,200,000.00	1,314,060.00	
		BGB 1% 06/22/31	1,360,000.00	1,503,031.20	
		BGB 2.15% 06/22/66	350,000.00	473,264.75	
		BGB 2.25% 06/22/23	970,000.00	1,082,262.95	
		BGB 2.25% 06/22/57	290,000.00	394,282.55	
		BGB 2.6% 06/22/24	1,200,000.00	1,388,952.00	
		BGB 3.75% 06/22/45	620,000.00	1,058,467.10	
		BGB 3.75% 09/28/20	1,130,000.00	1,188,816.50	
		BGB 3% 06/22/34	500,000.00	697,097.50	
		BGB 4.25% 03/28/41	1,240,000.00	2,147,704.80	
		BGB 4.25% 09/28/21	1,250,000.00	1,386,081.25	
		BGB 4.25% 09/28/22	1,330,000.00	1,542,407.65	
		BGB 4.5% 03/28/26	750,000.00	998,422.50	
		BGB 4% 03/28/22	790,000.00	890,780.30	
		BGB 4% 03/28/32	450,000.00	669,363.75	
		BGB 5.5% 03/28/28	1,350,000.00	2,022,954.75	
		BGB 5% 03/28/35	1,340,000.00	2,290,843.90	
		BTPS 0.05% 04/15/21	1,720,000.00	1,724,343.00	
		BTPS 0.35% 11/01/21	800,000.00	805,616.00	

		BTPS 0.45% 06/01/21	820,000.00	827,941.70	
		BTPS 0.65% 10/15/23	560,000.00	563,505.60	
		BTPS 0.65% 11/01/20	1,200,000.00	1,213,014.00	
		BTPS 0.95% 03/01/23	2,750,000.00	2,799,073.75	
		BTPS 1.25% 12/01/26	1,600,000.00	1,620,800.00	
		BTPS 1.35% 04/15/22	2,400,000.00	2,471,688.00	
		BTPS 1.45% 05/15/25	1,070,000.00	1,102,982.75	
		BTPS 1.45% 09/15/22	1,550,000.00	1,603,521.50	
		BTPS 1.45% 11/15/24	600,000.00	620,640.00	
		BTPS 1.5% 06/01/25	1,500,000.00	1,551,532.50	
		BTPS 1.6% 06/01/26	1,350,000.00	1,401,104.25	
		BTPS 1.65% 03/01/32	450,000.00	447,675.75	
		BTPS 2.05% 08/01/27	2,350,000.00	2,501,492.75	
		BTPS 2.1% 07/15/26	300,000.00	320,109.00	
		BTPS 2.15% 12/15/21	1,700,000.00	1,782,305.50	
		BTPS 2.2% 06/01/27	2,530,000.00	2,721,925.80	
		BTPS 2.25% 09/01/36	1,170,000.00	1,210,534.65	
		BTPS 2.45% 09/01/33	500,000.00	536,070.00	
		BTPS 2.45% 10/01/23	870,000.00	936,807.30	
		BTPS 2.5% 12/01/24	1,800,000.00	1,958,562.00	
		BTPS 2.7% 03/01/47	1,700,000.00	1,792,964.50	
		BTPS 2.8% 03/01/67	520,000.00	527,532.20	
		BTPS 2.8% 12/01/28	1,100,000.00	1,237,087.50	
		BTPS 2.95% 09/01/38	550,000.00	612,590.00	
		BTPS 2% 12/01/25	1,050,000.00	1,115,772.00	
		BTPS 3.1% 03/01/40	210,000.00	236,215.35	
		BTPS 3.25% 09/01/46	450,000.00	520,164.00	
		BTPS 3.35% 03/01/35	650,000.00	764,211.50	
		BTPS 3.45% 03/01/48	1,160,000.00	1,383,479.80	
		BTPS 3.5% 03/01/30	1,950,000.00	2,311,900.50	
		BTPS 3.75% 03/01/21	1,030,000.00	1,094,014.50	
		BTPS 3.75% 05/01/21	1,550,000.00	1,654,183.25	
		BTPS 3.75% 08/01/21	1,900,000.00	2,042,386.00	
		BTPS 3.75% 09/01/24	1,740,000.00	1,997,998.50	
		BTPS 3.85% 09/01/49	600,000.00	755,280.00	
		BTPS 3% 08/01/29	600,000.00	684,306.00	
		BTPS 4.5% 03/01/24	2,040,000.00	2,393,062.80	
		BTPS 4.5% 03/01/26	2,250,000.00	2,748,060.00	
		BTPS 4.5% 05/01/23	1,050,000.00	1,206,891.00	
		BTPS 4.75% 08/01/23	1,610,000.00	1,878,998.80	
		BTPS 4.75% 09/01/21	2,630,000.00	2,888,660.50	
		BTPS 4.75% 09/01/28	1,650,000.00	2,139,538.50	

		BTPS 4.75% 09/01/44	1,380,000.00	1,952,824.20	
		BTPS 4% 02/01/37	2,000,000.00	2,541,630.00	
		BTPS 4% 09/01/20	1,470,000.00	1,538,208.00	
		BTPS 5.0% 08/01/39	1,440,000.00	2,055,888.00	
		BTPS 5.25% 11/01/29	2,300,000.00	3,110,439.50	
		BTPS 5.5% 09/01/22	1,700,000.00	1,969,756.00	
		BTPS 5.5% 11/01/22	2,200,000.00	2,562,769.00	
		BTPS 5.75% 02/01/33	2,010,000.00	2,929,162.95	
		BTPS 5% 03/01/22	1,450,000.00	1,630,967.25	
		BTPS 5% 03/01/25	1,740,000.00	2,130,838.80	
		BTPS 5% 08/01/34	1,800,000.00	2,503,305.00	
		BTPS 5% 09/01/40	1,600,000.00	2,282,160.00	
		BTPS 6.5% 11/01/27	1,620,000.00	2,285,682.30	
		BTPS 6% 05/01/31	2,300,000.00	3,346,960.00	
		BTPS 7.25% 11/01/26	350,000.00	498,778.00	
		BTPS 9% 11/01/23	1,800,000.00	2,436,939.00	
		DBR 0.25% 02/15/27	2,930,000.00	3,118,662.70	
		DBR 0.25% 02/15/29	990,000.00	1,055,097.45	
		DBR 0.25% 08/15/28	1,300,000.00	1,386,164.00	
		DBR 0.5% 02/15/25	700,000.00	747,652.50	
		DBR 0.5% 02/15/26	2,300,000.00	2,477,238.00	
		DBR 0.5% 02/15/28	1,510,000.00	1,643,514.20	
		DBR 0.5% 08/15/27	900,000.00	977,647.50	
		DBR 0% 08/15/26	2,050,000.00	2,141,255.75	
		DBR 1.25% 08/15/48	1,090,000.00	1,410,394.60	
		DBR 1.5% 02/15/23	1,950,000.00	2,112,113.25	
		DBR 1.5% 05/15/23	1,360,000.00	1,480,298.80	
		DBR 1.5% 05/15/24	1,450,000.00	1,609,333.25	
		DBR 1.5% 09/04/22	2,050,000.00	2,199,691.00	
		DBR 1.75% 02/15/24	1,250,000.00	1,395,456.25	
		DBR 1.75% 07/04/22	1,650,000.00	1,775,886.75	
		DBR 1% 08/15/24	1,950,000.00	2,123,764.50	
		DBR 1% 08/15/25	760,000.00	838,922.20	
		DBR 2.25% 09/04/20	1,900,000.00	1,963,650.00	
		DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,076,984.00	
		DBR 2.5% 01/04/21	2,130,000.00	2,233,347.60	
		DBR 2.5% 07/04/44	1,800,000.00	2,844,585.00	
		DBR 2.5% 08/15/46	1,890,000.00	3,052,104.30	
		DBR 2% 01/04/22	1,370,000.00	1,465,379.40	
		DBR 2% 08/15/23	1,890,000.00	2,106,858.60	
		DBR 3.25% 07/04/21	1,700,000.00	1,834,614.50	
		DBR 3.25% 07/04/42	990,000.00	1,707,621.30	
		DBR 3% 07/04/20	2,240,000.00	2,319,262.40	

		DBR 4.0% 01/04/37	1,550,000.00	2,665,178.50	
		DBR 4.25% 07/04/39	970,000.00	1,795,911.35	
		DBR 4.75% 07/04/28	700,000.00	1,037,729.00	
		DBR 4.75% 07/04/34	1,330,000.00	2,327,972.15	
		DBR 4.75% 07/04/40	1,050,000.00	2,094,324.75	
		DBR 5.5% 01/04/31	1,160,000.00	1,957,795.80	
		DBR 5.625% 01/04/28	1,500,000.00	2,301,052.50	
		DBR 6.25% 01/04/24	1,370,000.00	1,805,022.95	
		DBR 6.25% 01/04/30	610,000.00	1,045,893.80	
		DBR 6.5% 07/04/27	200,000.00	314,768.00	
		FRTR 0.25% 11/25/20	1,350,000.00	1,366,942.50	
		FRTR 0.25% 11/25/26	2,050,000.00	2,143,141.75	
		FRTR 0.5% 05/25/25	1,800,000.00	1,906,713.00	
		FRTR 0.5% 05/25/26	2,250,000.00	2,391,603.75	
		FRTR 0.5% 05/25/29	870,000.00	923,126.55	
		FRTR 0.75% 05/25/28	3,280,000.00	3,563,244.40	
		FRTR 0.75% 11/25/28	1,450,000.00	1,575,548.25	
		FRTR 0% 02/25/22	1,400,000.00	1,426,068.00	
		FRTR 0% 03/25/23	1,880,000.00	1,928,363.00	
		FRTR 0% 03/25/24	950,000.00	976,818.50	
		FRTR 0% 03/25/25	300,000.00	308,451.00	
		FRTR 0% 05/25/21	550,000.00	557,185.75	
		FRTR 1.25% 05/25/34	1,350,000.00	1,545,574.50	
		FRTR 1.25% 05/25/36	2,010,000.00	2,294,766.75	
		FRTR 1.5% 05/25/31	3,200,000.00	3,750,800.00	
		FRTR 1.5% 05/25/50	230,000.00	269,817.60	
		FRTR 1.75% 05/25/23	2,600,000.00	2,846,142.00	
		FRTR 1.75% 05/25/66	540,000.00	682,362.90	
		FRTR 1.75% 06/25/39	1,100,000.00	1,360,183.00	
		FRTR 1.75% 11/25/24	3,000,000.00	3,374,115.00	
		FRTR 1% 05/25/27	2,900,000.00	3,202,397.50	
		FRTR 1% 11/25/25	2,240,000.00	2,450,380.80	
		FRTR 2.25% 05/25/24	2,390,000.00	2,724,552.20	
		FRTR 2.25% 10/25/22	2,900,000.00	3,183,518.50	
		FRTR 2.5% 05/25/30	2,450,000.00	3,129,532.00	
		FRTR 2.5% 10/25/20	3,450,000.00	3,588,138.00	
		FRTR 2.75% 10/25/27	2,400,000.00	3,015,324.00	
		FRTR 2% 05/25/48	1,360,000.00	1,780,994.80	
		FRTR 3.25% 05/25/45	2,710,000.00	4,350,471.40	
		FRTR 3.25% 10/25/21	4,120,000.00	4,492,509.80	
		FRTR 3.5% 04/25/26	3,120,000.00	3,969,950.40	
		FRTR 3.75% 04/25/21	3,200,000.00	3,451,920.00	

		FRTR 3% 04/25/22	3,750,000.00	4,139,212.50	
		FRTR 4.25% 10/25/23	4,000,000.00	4,851,640.00	
		FRTR 4.5% 04/25/41	2,450,000.00	4,455,496.50	
		FRTR 4.75% 04/25/35	1,950,000.00	3,307,814.25	
		FRTR 4% 04/25/55	1,090,000.00	2,116,905.35	
		FRTR 4% 04/25/60	920,000.00	1,859,655.80	
		FRTR 4% 10/25/38	1,800,000.00	2,992,176.00	
		FRTR 5.5% 04/25/29	2,500,000.00	3,896,462.50	
		FRTR 5.75% 10/25/32	2,220,000.00	3,877,318.80	
		FRTR 6.0% 10/25/25	1,450,000.00	2,046,377.75	
		FRTR 8.5% 04/25/23	1,100,000.00	1,485,781.00	
		IRISH 0.8% 03/15/22	750,000.00	777,251.25	
		IRISH 0.9% 05/15/28	440,000.00	475,697.20	
		IRISH 1.1% 05/15/29	240,000.00	263,354.40	
		IRISH 1.3% 05/15/33	60,000.00	66,509.40	
		IRISH 1.5% 05/15/50	260,000.00	289,036.80	
		IRISH 1.7% 05/15/37	590,000.00	689,606.75	
		IRISH 1% 05/15/26	740,000.00	801,087.00	
		IRISH 2.4% 05/15/30	820,000.00	1,013,138.70	
		IRISH 2% 02/18/45	620,000.00	776,739.10	
		IRISH 3.4% 03/18/24	420,000.00	495,276.60	
		IRISH 3.9% 03/20/23	580,000.00	674,319.60	
		IRISH 5.4% 03/13/25	950,000.00	1,258,279.75	
		IRISH 5% 10/18/20	440,000.00	470,643.80	
		NETHER 0.25% 07/15/25	630,000.00	661,279.50	
		NETHER 0.25% 07/15/29	340,000.00	357,618.80	
		NETHER 0.5% 01/15/40	420,000.00	447,060.60	
		NETHER 0.5% 07/15/26	1,450,000.00	1,553,573.50	
		NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	985,009.50	
		NETHER 0.75% 07/15/28	600,000.00	660,162.00	
		NETHER 0% 01/15/22	1,100,000.00	1,120,933.00	
		NETHER 1.75% 07/15/23	1,670,000.00	1,837,617.90	
		NETHER 2.25% 07/15/22	1,120,000.00	1,222,474.40	
		NETHER 2.5% 01/15/33	940,000.00	1,270,607.40	
		NETHER 2.75% 01/15/47	970,000.00	1,627,223.50	
		NETHER 2% 07/15/24	1,560,000.00	1,769,437.80	
		NETHER 3.25% 07/15/21	1,250,000.00	1,350,137.50	
		NETHER 3.5% 07/15/20	710,000.00	739,248.45	
		NETHER 3.75% 01/15/23	300,000.00	347,832.00	
		NETHER 3.75% 01/15/42	1,060,000.00	1,908,890.40	
		NETHER 4% 01/15/37	1,120,000.00	1,895,420.80	
		NETHER 5.5% 01/15/28	740,000.00	1,118,254.70	
		NETHER 7.5% 01/15/23	700,000.00	904,568.00	

		OBL 0.25% 10/16/20	1,800,000.00	1,822,032.00	
		OBL 0% 04/05/24	210,000.00	217,343.70	
		OBL 0% 04/08/22	1,270,000.00	1,298,295.60	
		OBL 0% 04/09/21	540,000.00	547,300.80	
		OBL 0% 04/14/23	600,000.00	618,042.00	
		RAGB 0.5% 02/20/29	280,000.00	298,198.60	
		RAGB 0.5% 04/20/27	150,000.00	160,098.00	
		RAGB 0.75% 02/20/28	190,000.00	207,053.45	
		RAGB 0.75% 10/20/26	1,800,000.00	1,949,994.00	
		RAGB 0% 07/15/23	650,000.00	666,822.00	
		RAGB 0% 09/20/22	270,000.00	275,929.20	
		RAGB 1.2% 10/20/25	760,000.00	841,285.80	
		RAGB 1.5% 02/20/47	380,000.00	471,994.20	
		RAGB 1.5% 11/02/86	190,000.00	246,304.60	
		RAGB 1.65% 10/21/24	650,000.00	726,654.50	
		RAGB 1.75% 10/20/23	750,000.00	827,051.25	
		RAGB 2.1% 09/20/17	290,000.00	473,761.40	
		RAGB 2.4% 05/23/34	560,000.00	743,192.80	
		RAGB 3.15% 06/20/44	450,000.00	735,286.50	
		RAGB 3.4% 11/22/22	670,000.00	762,051.30	
		RAGB 3.5% 09/15/21	1,100,000.00	1,200,474.00	
		RAGB 3.65% 04/20/22	570,000.00	638,770.50	
		RAGB 3.8% 01/26/62	260,000.00	555,327.50	
		RAGB 3.9% 07/15/20	880,000.00	919,168.80	
		RAGB 4.15% 03/15/37	1,000,000.00	1,668,795.00	
		RAGB 4.85% 03/15/26	950,000.00	1,291,244.75	
		RAGB 6.25% 07/15/27	370,000.00	568,549.40	
		RFGB 0.5% 04/15/26	420,000.00	446,909.40	
		RFGB 0.5% 09/15/27	470,000.00	501,421.85	
		RFGB 0.5% 09/15/28	140,000.00	149,559.20	
		RFGB 0.75% 04/15/31	530,000.00	579,112.45	
		RFGB 0.875% 09/15/25	190,000.00	206,206.05	
		RFGB 0% 04/15/22	250,000.00	254,925.00	
		RFGB 1.125% 04/15/34	260,000.00	298,201.80	
		RFGB 1.375% 04/15/47	170,000.00	212,174.45	
		RFGB 1.5% 04/15/23	720,000.00	779,328.00	
		RFGB 1.625% 09/15/22	380,000.00	408,234.00	
		RFGB 2.625% 07/04/42	310,000.00	469,420.60	
		RFGB 2.75% 07/04/28	380,000.00	483,892.00	
		RFGB 2% 04/15/24	420,000.00	472,770.90	
		RFGB 3.5% 04/15/21	720,000.00	773,175.60	
		RFGB 4% 07/04/25	360,000.00	459,084.60	

		SPGB 0.05% 01/31/21	500,000.00	504,300.00	
		SPGB 0.05% 10/31/21	890,000.00	900,969.25	
		SPGB 0.25% 07/30/24	380,000.00	389,653.90	
		SPGB 0.4% 04/30/22	1,770,000.00	1,813,188.00	
		SPGB 0.45% 10/31/22	800,000.00	823,272.00	
		SPGB 0.75% 07/30/21	500,000.00	512,810.00	
		SPGB 1.15% 07/30/20	950,000.00	966,055.00	
		SPGB 1.3% 10/31/26	1,750,000.00	1,912,452.50	
		SPGB 1.4% 04/30/28	1,420,000.00	1,570,136.60	
		SPGB 1.4% 07/30/28	540,000.00	596,567.70	
		SPGB 1.45% 04/30/29	1,000,000.00	1,110,635.00	
		SPGB 1.45% 10/31/27	2,000,000.00	2,215,730.00	
		SPGB 1.5% 04/30/27	1,200,000.00	1,330,920.00	
		SPGB 1.6% 04/30/25	1,250,000.00	1,377,637.50	
		SPGB 1.85% 07/30/35	530,000.00	613,215.30	
		SPGB 1.95% 04/30/26	1,340,000.00	1,519,365.70	
		SPGB 1.95% 07/30/30	1,560,000.00	1,818,234.60	
		SPGB 2.15% 10/31/25	1,550,000.00	1,768,697.25	
		SPGB 2.35% 07/30/33	1,290,000.00	1,582,688.10	
		SPGB 2.7% 10/31/48	600,000.00	798,939.00	
		SPGB 2.75% 10/31/24	1,900,000.00	2,198,946.00	
		SPGB 2.9% 10/31/46	1,100,000.00	1,509,849.00	
		SPGB 3.45% 07/30/66	700,000.00	1,109,531.50	
		SPGB 3.8% 04/30/24	1,500,000.00	1,793,212.50	
		SPGB 4.2% 01/31/37	1,420,000.00	2,203,847.10	
		SPGB 4.4% 10/31/23	1,320,000.00	1,588,065.60	
		SPGB 4.65% 07/30/25	1,410,000.00	1,817,983.50	
		SPGB 4.7% 07/30/41	1,390,000.00	2,384,711.80	
		SPGB 4.8% 01/31/24	1,150,000.00	1,416,702.25	
		SPGB 4.85% 10/31/20	1,000,000.00	1,068,275.00	
		SPGB 4.9% 07/30/40	1,220,000.00	2,123,074.50	
		SPGB 5.15% 10/31/28	750,000.00	1,088,610.00	
		SPGB 5.15% 10/31/44	1,040,000.00	1,940,166.80	
		SPGB 5.4% 01/31/23	2,870,000.00	3,459,971.55	
		SPGB 5.5% 04/30/21	2,740,000.00	3,032,344.30	
		SPGB 5.75% 07/30/32	1,450,000.00	2,406,739.00	
		SPGB 5.85% 01/31/22	2,020,000.00	2,344,311.00	
		SPGB 5.9% 07/30/26	1,850,000.00	2,617,019.25	
		SPGB 6.0% 01/31/29	2,350,000.00	3,627,142.75	
	ユーロ 小計		348,790,000.00	424,149,728.90 (51,105,800,835)	
	イギリスポンド	UKT 0.5% 07/22/22	1,650,000.00	1,653,852.75	
		UKT 0.75% 07/22/23	1,950,000.00	1,973,848.50	

	UKT 0.875% 10/22/29	210,000.00	212,271.15	
	UKT 1.25% 07/22/27	1,390,000.00	1,462,273.05	
	UKT 1.5% 01/22/21	1,360,000.00	1,380,780.80	
	UKT 1.5% 07/22/26	2,150,000.00	2,295,092.75	
	UKT 1.5% 07/22/47	1,480,000.00	1,543,936.00	
	UKT 1.625% 10/22/28	1,450,000.00	1,572,989.00	
	UKT 1.625% 10/22/71	110,000.00	127,388.25	
	UKT 1.75% 07/22/57	500,000.00	575,245.00	
	UKT 1.75% 09/07/22	1,640,000.00	1,707,486.00	
	UKT 1.75% 09/07/37	1,440,000.00	1,570,197.60	
	UKT 1% 04/22/24	1,540,000.00	1,578,815.70	
	UKT 2.25% 09/07/23	1,160,000.00	1,245,927.00	
	UKT 2.5% 07/22/65	1,350,000.00	1,950,520.50	
	UKT 2.75% 09/07/24	420,000.00	468,602.40	
	UKT 2% 07/22/20	2,220,000.00	2,252,289.90	
	UKT 2% 09/07/25	540,000.00	590,166.00	
	UKT 3.25% 01/22/44	1,550,000.00	2,179,439.50	
	UKT 3.5% 01/22/45	1,250,000.00	1,842,350.00	
	UKT 3.5% 07/22/68	1,880,000.00	3,438,698.60	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,110,000.00	1,846,718.10	
	UKT 3.75% 09/07/20	940,000.00	973,938.70	
	UKT 3.75% 09/07/21	620,000.00	663,427.90	
	UKT 4.25% 03/07/36	1,540,000.00	2,275,996.80	
	UKT 4.25% 06/07/32	1,100,000.00	1,545,709.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	930,000.00	1,433,009.10	
	UKT 4.25% 12/07/27	750,000.00	975,723.75	
	UKT 4.25% 12/07/40	1,130,000.00	1,765,732.35	
	UKT 4.25% 12/07/46	1,600,000.00	2,680,304.00	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,060,000.00	1,842,900.10	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,350,000.00	2,524,533.75	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,350,000.00	2,005,134.75	
	UKT 4.5% 12/07/42	1,340,000.00	2,212,641.50	
	UKT 4.75% 12/07/30	900,000.00	1,288,953.00	
	UKT 4.75% 12/07/38	620,000.00	1,003,566.10	
	UKT 4% 01/22/60	1,000,000.00	1,875,820.00	
	UKT 4% 03/07/22	1,750,000.00	1,913,485.00	
	UKT 5% 03/07/25	1,600,000.00	2,001,216.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	450,000.00	669,033.00	
	UKT 8% 06/07/21	50,000.00	57,052.75	
イギリスポンド 小計		48,430,000.00	63,177,066.10 (8,534,589,859)	
スウェーデンクローナ	SGB 0.75% 05/12/28	3,200,000.00	3,460,816.00	

	SGB 0.75% 11/12/29	2,180,000.00	2,353,898.60	
	SGB 1.5% 11/13/23	5,270,000.00	5,738,634.75	
	SGB 1% 11/12/26	3,560,000.00	3,900,247.00	
	SGB 2.5% 05/12/25	4,150,000.00	4,859,484.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	3,210,000.00	5,036,490.00	
	SGB 3.5% 06/01/22	7,450,000.00	8,332,080.00	
	SGB 5% 12/01/20	6,420,000.00	6,907,406.40	
スウェーデンクローナ 小計		35,440,000.00	40,589,056.75 (465,962,371)	
ノルウェークローネ	NGB 1.5% 02/19/26	3,540,000.00	3,583,754.40	
	NGB 1.75% 02/17/27	2,900,000.00	2,987,580.00	
	NGB 1.75% 03/13/25	2,040,000.00	2,091,571.20	
	NGB 1.75% 09/06/29	1,450,000.00	1,497,596.25	
	NGB 2% 04/26/28	1,640,000.00	1,725,534.20	
	NGB 2% 05/24/23	4,550,000.00	4,673,760.00	
	NGB 3.75% 05/25/21	5,520,000.00	5,766,882.00	
	NGB 3% 03/14/24	3,550,000.00	3,824,610.25	
ノルウェークローネ 小計		25,190,000.00	26,151,288.30 (327,414,129)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/20	4,010,000.00	4,066,019.70	
	DGB 0.5% 11/15/27	2,000,000.00	2,169,970.00	
	DGB 0.5% 11/15/29	1,550,000.00	1,685,578.50	
	DGB 1.5% 11/15/23	3,700,000.00	4,061,767.50	
	DGB 1.75% 11/15/25	5,460,000.00	6,297,345.60	
	DGB 3% 11/15/21	6,120,000.00	6,662,782.80	
	DGB 4.5% 11/15/39	9,590,000.00	18,461,709.00	
デンマーククローネ 小計		32,430,000.00	43,405,173.10 (700,559,493)	
ポーランドズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	2,050,000.00	2,059,389.00	
	POLGB 2.25% 04/25/22	2,000,000.00	2,034,260.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	1,280,000.00	1,315,686.40	
	POLGB 2.5% 04/25/24	330,000.00	341,619.30	
	POLGB 2.5% 07/25/26	3,150,000.00	3,273,464.25	
	POLGB 2.5% 07/25/27	1,910,000.00	1,987,832.50	
	POLGB 2.75% 04/25/28	1,560,000.00	1,656,298.80	
	POLGB 2.75% 10/25/29	430,000.00	459,171.20	
	POLGB 2% 04/25/21	2,630,000.00	2,654,932.40	
	POLGB 3.25% 07/25/25	3,250,000.00	3,513,705.00	
	POLGB 4% 10/25/23	2,870,000.00	3,137,469.65	
	POLGB 5.25% 10/25/20	2,300,000.00	2,413,022.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	900,000.00	1,203,480.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	1,300,000.00	1,462,838.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,130,000.00	1,235,287.75	

ポーランドズロチ 小計		27,090,000.00	28,748,456.25 (814,731,250)	
オーストラリアドル	ACGB 1.5% 06/21/31	300,000.00	305,229.00	
	ACGB 1.75% 11/21/20	1,750,000.00	1,768,891.25	
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,450,000.00	1,571,539.00	
	ACGB 2.5% 05/21/30	1,040,000.00	1,165,756.80	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,400,000.00	1,518,132.00	
	ACGB 2.75% 05/21/41	290,000.00	339,592.90	
	ACGB 2.75% 06/21/35	580,000.00	679,847.00	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,900,000.00	2,130,375.00	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,750,000.00	1,977,727.50	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,440,000.00	1,643,234.40	
	ACGB 2% 12/21/21	1,640,000.00	1,683,804.40	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,050,000.00	2,305,932.25	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,530,000.00	1,806,677.55	
	ACGB 3.25% 06/21/39	550,000.00	691,897.25	
	ACGB 3.75% 04/21/37	820,000.00	1,090,017.80	
	ACGB 3% 03/21/47	900,000.00	1,110,726.00	
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,150,000.00	2,589,965.25	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,220,000.00	1,690,950.50	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,400,000.00	3,035,616.00	
	ACGB 5.5% 04/21/23	1,820,000.00	2,128,753.90	
	ACGB 5.75% 05/15/21	1,940,000.00	2,108,168.90	
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,000,000.00	2,285,670.00	
オーストラリアドル 小計		30,920,000.00	35,628,504.65 (2,690,308,386)	
シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	290,000.00	287,366.80	
	SIGB 2.125% 06/01/26	200,000.00	203,716.00	
	SIGB 2.25% 06/01/21	790,000.00	798,026.40	
	SIGB 2.25% 08/01/36	210,000.00	211,659.00	
	SIGB 2.375% 06/01/25	350,000.00	361,707.50	
	SIGB 2.625% 05/01/28	230,000.00	242,814.45	
	SIGB 2.75% 03/01/46	480,000.00	509,762.40	
	SIGB 2.75% 04/01/42	380,000.00	409,052.90	
	SIGB 2.75% 07/01/23	650,000.00	674,999.00	
	SIGB 2.875% 07/01/29	100,000.00	108,154.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	370,000.00	400,053.25	
	SIGB 2% 02/01/24	220,000.00	222,407.90	
	SIGB 2% 07/01/20	320,000.00	320,782.40	
	SIGB 3.125% 09/01/22	320,000.00	333,619.20	
	SIGB 3.25% 09/01/20	600,000.00	609,741.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	270,000.00	309,735.90	
	SIGB 3.5% 03/01/27	530,000.00	590,814.85	

		SIGB 3% 09/01/24	470,000.00	498,265.80	
	シンガポールドル 小計		6,780,000.00	7,092,678.75 (562,449,424)	
	マレーシアリンギット	MGS 3.418% 08/15/22	2,200,000.00	2,204,554.00	
		MGS 3.48% 03/15/23	1,300,000.00	1,303,393.00	
		MGS 3.502% 05/31/27	670,000.00	663,675.20	
		MGS 3.62% 11/30/21	950,000.00	957,823.25	
		MGS 3.844% 04/15/33	860,000.00	862,515.50	
		MGS 3.889% 07/31/20	1,450,000.00	1,460,831.50	
		MGS 3.892% 03/15/27	1,200,000.00	1,220,238.00	
		MGS 3.9% 11/30/26	360,000.00	367,515.00	
		MGS 3.955% 09/15/25	150,000.00	153,506.25	
		MGS 4.059% 09/30/24	750,000.00	771,225.00	
		MGS 4.127% 04/15/32	690,000.00	710,934.60	
		MGS 4.16% 07/15/21	1,880,000.00	1,913,915.20	
		MGS 4.181% 07/15/24	1,650,000.00	1,703,328.00	
		MGS 4.232% 06/30/31	240,000.00	250,372.80	
		MGS 4.254% 05/31/35	1,050,000.00	1,092,561.75	
		MGS 4.392% 04/15/26	1,650,000.00	1,728,309.00	
		MGS 4.498% 04/15/30	1,900,000.00	2,030,530.00	
		MGS 4.642% 11/07/33	180,000.00	196,106.40	
		MGS 4.736% 03/15/46	1,090,000.00	1,172,681.95	
		MGS 4.762% 04/07/37	1,160,000.00	1,273,216.00	
		MGS 4.935% 09/30/43	640,000.00	714,579.20	
		MGS 5.248% 09/15/28	950,000.00	1,065,149.50	
	マレーシアリンギット 小計		22,970,000.00	23,816,961.10 (625,671,568)	
	南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	16,050,000.00	18,178,631.25	
		SAGB 6.25% 03/31/36	10,300,000.00	7,617,983.00	
		SAGB 6.5% 02/28/41	7,550,000.00	5,413,085.75	
		SAGB 6.75% 03/31/21	3,660,000.00	3,685,857.90	
		SAGB 7.75% 02/28/23	6,360,000.00	6,462,459.60	
		SAGB 7% 02/28/31	8,840,000.00	7,605,449.80	
		SAGB 8.25% 03/31/32	5,430,000.00	5,089,267.50	
		SAGB 8.5% 01/31/37	9,000,000.00	8,254,260.00	
		SAGB 8.75% 01/31/44	13,200,000.00	12,060,444.00	
		SAGB 8.75% 02/28/48	11,300,000.00	10,305,600.00	
		SAGB 8.875% 02/28/35	2,800,000.00	2,691,640.00	
		SAGB 8% 01/31/30	10,200,000.00	9,684,186.00	
		SAGB 9% 01/31/40	4,850,000.00	4,587,033.00	
	南アフリカランド 小計		109,540,000.00	101,635,897.80 (792,760,002)	

合計		132,668,535,232 (132,668,535,232)	

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券　164銘柄	100.0%	47.1%
カナダドル	国債証券　24銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券　14銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券　280銘柄	100.0%	38.5%
イギリスポンド	国債証券　41銘柄	100.0%	6.4%
スウェーデンクローナ	国債証券　8銘柄	100.0%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券　8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券　7銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券　15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券　22銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	国債証券　18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券　22銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券　13銘柄	100.0%	0.6%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

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(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【インデックスコレクション（バランス株式３０）】

【純資産額計算書】

（2019年 8月30日現在）

Ⅰ　資産総額	60,205,527,736円
Ⅱ　負債総額	33,451,056円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	60,172,076,680円
Ⅳ　発行済口数	38,960,429,432口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5444円
（1万口当たり純資産額）	（15,444円）

【インデックスコレクション（バランス株式５０）】

【純資産額計算書】

（2019年 8月30日現在）

Ⅰ　資産総額	11,792,256,566円
Ⅱ　負債総額	8,185,261円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	11,784,071,305円
Ⅳ　発行済口数	6,511,971,840口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8096円
（1万口当たり純資産額）	（18,096円）

【インデックスコレクション（バランス株式７０）】

【純資産額計算書】

（2019年 8月30日現在）

Ⅰ　資産総額	6,636,498,383円
Ⅱ　負債総額	5,404,754円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	6,631,093,629円
Ⅳ　発行済口数	3,214,205,275口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.0631円
（1万口当たり純資産額）	（20,631円）

（参考）

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

（2019年 8月30日現在）

Ⅰ　資産総額	**215,352,740,021円**
Ⅱ　負債総額	**1,033,884,761円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**214,318,855,260円**
Ⅳ　発行済口数	**132,699,524,487口**
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.6151円**
（1万口当たり純資産額）	**（16,151円）**

日本債券マザーファンド

純資産額計算書

（2019年 8月30日現在）

Ⅰ　資産総額	**323,250,521,988円**
Ⅱ　負債総額	**6,054,946,703円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**317,195,575,285円**
Ⅳ　発行済口数	**223,755,426,264口**
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.4176円**
（1万口当たり純資産額）	**（14,176円）**

外国株式マザーファンド

純資産額計算書

（2019年 8月30日現在）

Ⅰ　資産総額	**186,489,979,758円**
Ⅱ　負債総額	**351,001,789円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**186,138,977,969円**
Ⅳ　発行済口数	**69,556,729,637口**
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**2.6761円**
（1万口当たり純資産額）	**（26,761円）**

外国債券マザーファンド

純資産額計算書

（2019年 8月30日現在）

Ⅰ　資産総額	132,841,445,517円
Ⅱ　負債総額	320,111,823円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	132,521,333,694円
Ⅳ　発行済口数	54,827,103,441口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.4171円
（1万口当たり純資産額）	（24,171円）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

①受益証券の不発行

委託会社は、当ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合又は当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

②受益権の譲渡

イ．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又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。

ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及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又は記録するものとします。ただし、上記イ．の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。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。

ハ．上記イ．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又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等において、委託会社が必要と認めるとき又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。

③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又は記録によらなければ、委託会社及び受託会社に対抗することができません。

④受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、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。

⑤償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原

則として取得申込者とします。）に支払います。

⑥質権口記載又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又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従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（2019年 8月30日現在）

資本金の額　　：20億円
発行可能株式総数　：12,000株
発行済株式総数　　：3,000株
最近5年間における資本金の額の増減：2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

会社に取締役（監査等委員である取締役を除く。）を10名以内、監査等委員である取締役を5名以内おきます。取締役は、株主総会において選任され、又は解任されます。ただし、監査等委員である取締役は、それ以外の取締役と区別するものとします。
取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。
また、監査等委員以外の取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の３分の１以上を有する株主が出席し、その議決権の３分の２以上をもって行います。
取締役（監査等委員である取締役を除く。）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終結の時までとします。
監査等委員である取締役の任期は、選任後２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終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。
取締役会は、その決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長１名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。
取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。
取締役会を招集するには、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を発します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。
取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

②投資運用の意思決定機構

［PLAN（計画）］

運用企画部担当役員を委員長とする運用・リスク委員会において、ファンドの運用戦略や運用スタイルなどを決定します。運用・リスク委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部に

おいて、ファンドマネジャーが運用仕様・ガイドラインに基づき、運用の執行に関する方針を運用計画として策定します。

［DO（実行）］

各運用部のファンドマネジャーは、運用計画に沿った運用の執行、ファンドの運用状況管理を行います。

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

売買発注の執行は、各運用部からの運用の実行指図に基づき、各運用部から独立したトレーディング部のトレーダーが行います。

［CHECK（検証・評価）］

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

また、運用に関するリスク管理と法令等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運用監理部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告されます。

こうした牽制態勢のもと、PLAN－DO－CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2019年10月25日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

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）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

2019年8月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	517	12,293,215
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	88	343,157
単位型公社債投資信託	7	58,802
合計	612	12,695,174

3【委託会社等の経理状況】

(1)　委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）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年内閣府令第52号）により作成しております。

なお、財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）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：千円）

	前事業年度 （2018年3月31日現在）		当事業年度 （2019年3月31日現在）	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		23,973,152		23,830,484
有価証券		―		2,268,127
前払費用		157,614		197,843
未収委託者報酬		5,373,307		6,351,590
未収運用受託報酬		―		5,525,778
未収収益		896		212,722
その他		8,946		2,261,900
流動資産合計		29,513,917		40,648,447
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	36,782	※1	282,407
器具備品	※1	79,655	※1	564,981
その他	※1	1,912	※1	14,462
有形固定資産合計		118,350		861,851
無形固定資産				
ソフトウェア		210,679		1,487,265
その他		4,377		7,256
無形固定資産合計		215,056		1,494,522
投資その他の資産				
投資有価証券		42,802		11,334,053
関係会社株式		―		4,663,000
長期貸付金		17,088		―
繰延税金資産		248,633		141,789
その他		32,880		32,492
貸倒引当金		△17,088		―
投資その他の資産合計		324,317		16,171,335
固定資産合計		657,724		18,527,709
資産合計		30,171,641		59,176,157

（単位：千円）

	前事業年度 （2018年3月31日現在）	当事業年度 （2019年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	24,591	38,118
未払金	2,950,503	5,327,037
未払収益分配金	45	115
未払手数料	2,160,863	2,718,199
その他未払金	789,595	2,608,722
未払費用	74,279	178,529
未払法人税等	838,596	1,992,137
賞与引当金	106,177	132,159
その他	74,131	395,910
流動負債合計	4,068,279	8,063,893
固定負債		
退職給付引当金	496,696	537,798
資産除去債務	13,374	131,970
その他	1,074	82
固定負債合計	511,145	669,852
負債合計	4,579,425	8,733,745
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	2,000,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	17,239,438
資本剰余金合計	350,000	17,239,438
利益剰余金		
利益準備金	74,500	75,000
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	22,767,534	28,501,567
利益剰余金合計	24,942,034	30,676,567
株主資本合計	25,592,034	49,916,006
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	182	393,355
繰延ヘッジ損益	－	133,049
評価・換算差額等合計	182	526,404
純資産合計	25,592,216	50,442,411
負債・純資産合計	30,171,641	59,176,157

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自　2017年4月1日 至　2018年3月31日）	当事業年度 （自　2018年4月1日 至　2019年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	29,206,178	30,551,851
運用受託報酬	－	5,464,685
その他営業収益	－	283,013
営業収益合計	29,206,178	36,299,550
営業費用		
支払手数料	12,544,178	13,423,932
広告宣伝費	175,296	276,617
公告費	－	1,401
調査費	6,008,380	5,508,097
調査費	396,842	567,136
委託調査費	5,609,496	4,935,847
図書費	2,041	5,113
営業雑経費	1,474,361	2,315,373
通信費	33,158	45,767
印刷費	368,414	449,571
協会費	36,616	38,658
諸会費	105	5,270
情報機器関連費	942,093	1,657,735
その他営業雑経費	93,973	118,370
営業費用合計	20,202,216	21,525,421
一般管理費		
給料	2,006,157	3,931,172
役員報酬	84,130	161,977
給料・手当	1,649,268	3,425,725
賞与	272,758	343,470
退職給付費用	84,944	98,748
福利費	239,702	297,753
交際費	5,831	9,851
旅費交通費	73,807	141,173
租税公課	102,158	270,353
不動産賃借料	124,629	219,292
寄付金	－	8,000
減価償却費	119,300	152,281
業務委託費	484,841	657,473
諸経費	246,326	433,138
一般管理費合計	3,487,699	6,219,240
営業利益	5,516,262	8,554,888

（単位：千円）

	前事業年度	当事業年度

	（自　2017年4月1日 至　2018年3月31日）	（自　2018年4月1日 至　2019年3月31日）
営業外収益		
受取利息	2,136	11,327
収益分配金	116	8,610
投資有価証券売却益	499	46,789
デリバティブ利益	－	250,343
貸倒引当金戻入	2,750	17,088
その他	4,351	6,090
営業外収益合計	9,854	340,249
営業外費用		
投資有価証券売却損	2,224	34,437
固定資産除却損	7,891	7,868
為替差損	－	198,670
その他	1,182	4,509
営業外費用合計	11,298	245,485
経常利益	5,514,818	8,649,651
特別損失		
統合関連費用	51,569	335,911
特別損失合計	51,569	355,911
税引前当期純利益	5,463,248	8,313,740
法人税、住民税及び事業税	1,739,837	2,674,603
法人税等調整額	△50,178	△125,397
法人税等合計	1,689,659	2,549,206
当期純利益	3,773,589	5,764,533

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2017年4月1日　至　2018年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
その他資本剰余金から資本金への振替			
会社分割による増加			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			
当期変動額合計	－	－	－
当期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本		
	利益剰余金		
	その他利益剰余金		

	利益準備金	別途積立金	繰越利益剰余金	利益剰余金合計	株主資本合計
当期首残高	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444
当期変動額					
その他資本剰余金から資本金への振替					－
会社分割による増加					－
剰余金の配当	3,000		△33,000	△30,000	△30,000
当期純利益			3,773,589	3,773,589	3,773,589
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	－	3,740,589	3,743,589	3,743,589
当期末残高	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	△1,134	－	△1,134	21,847,309
当期変動額				
その他資本剰余金から資本金への振替				－
会社分割による増加				－
剰余金の配当				△30,000
当期純利益				3,773,589
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,317		1,317	1,317
当期変動額合計	1,317	－	1,317	3,744,907
当期末残高	182	－	182	25,592,216

当事業年度（自　2018年4月1日　至　2019年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
その他資本剰余金から資本金への振替	1,700,000	△1,700,000	△1,700,000
会社分割による増加		18,589,438	18,589,438
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			
当期変動額合計	1,700,000	16,889,438	16,889,438
当期末残高	2,000,000	17,239,438	17,239,438

	株主資本	
	利益剰余金	

	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	株主資本合計
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034
当期変動額					
その他資本剰余金から資本金への振替					－
会社分割による増加					18,589,438
剰余金の配当	500		△30,500	△30,000	△30,000
当期純利益			5,764,533	5,764,533	5,764,533
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	500	－	5,734,033	5,734,533	24,323,972
当期末残高	75,000	2,100,000	28,501,567	30,676,567	49,916,006

	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	182	－	182	25,592,216
当期変動額				
その他資本剰余金から資本金への振替				－
会社分割による増加				18,589,438
剰余金の配当				△30,000
当期純利益				5,764,533
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	393,172	133,049	526,222	526,222
当期変動額合計	393,172	133,049	526,222	24,850,194
当期末残高	393,355	133,049	526,404	50,442,411

重要な会計方針

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

（2）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によっております。（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

２．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

３．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

（2）無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、原則として社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却し

ております。

４．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

５．引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。

６．ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、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。

(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いて、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

７．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

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ます。

会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更

（有形固定資産の減価償却方法の変更）

有形固定資産（リース資産を除く。）の減価償却方法は、従来、定率法（ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については定額法）を採用しておりましたが、当事業年度より定額法へ変更しております。
この変更は、三井住友信託銀行株式会社の運用事業の統合予定、拠点の移転及びシステムの統合など大型の設備投資が計画されていることを契機に、有形固定資産の減価償却方法を検討した結果、有形固定資産は長期安定的に使用されると見込まれ、使用実態に即して耐用年数の全期間にわたり均等に費用按分する定額法が期間損益をより適正に示すとの判断に至ったものです。なお、この変更による当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に及ぼす影響は軽微であります。

表示方法の変更

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号　平成30年2月16日）を当事業年度の期首から適用しており、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。
この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」94,211千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」248,633千円に含めて表示しております。

（貸借対照表関係）

三井住友信託銀行株式会社の運用事業との統合を機に表示方法の見直しを行なった結果、以下の表示方法の変更を行なっております。

前事業年度において、「流動資産」の「その他」に含めて表示しておりました「未収収益」は、当事業年度より独立掲記しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行なっております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他」に表示していた9,842千円は、「流動資産」の「未収収益」896千円、「その他」8,946千円として組替えております。

前事業年度において、独立掲記しておりました「投資その他の資産」の「長期前払費用」及び「会員権」は、当事業年度より「投資その他の資産」の「その他」に含めて表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行なっております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「投資その他の資産」の「長期前払費用」7,810千円及び「会員権」25,000千円は、「投資その他の資産」の「その他」32,880千円に含めて表示しております。

前事業年度において、独立掲記しておりました「流動負債」の「未払消費税等」は、当事業年度より「流動負債」の「その他」に含めて表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行なっております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動負債」の「未払消費税等」72,890千円は、「流動負債」の「その他」74,131千円に含めて表示しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

※1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 （2018年3月31日）		当事業年度 （2019年3月31日）	
建　　物	63,830	千円	53,521	千円
器具備品	325,834	〃	351,328	〃
そ の 他	2,677	〃	3,595	〃
計	392,342	〃	408,445	〃

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2017年4月1日　至 2018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）	3,000	－	－	3,000

２．自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

３．剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2017年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	2017年3月31日	2017年6月30日

４．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	配当金の総額(千円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日

2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益 剰余金	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

当事業年度（自 2018年4月1日　至 2019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）	3,000	－	－	3,000

２．自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

３．剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

４．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

2019年6月27日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の 種類	配当金の 総額(千円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305,812	利益 剰余金	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

（リース取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

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、資金運用については、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いるほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、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。

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

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の軽減を図っております。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。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6.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリー毎に管理しております。

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

２．金融商品の時価に関する事項

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（（注2）を参照ください）。

前事業年度（2018年3月31日）　（単位:千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
(1) 現金及び預金	23,973,152	23,973,152	―
(2) 未収委託者報酬	5,373,307	5,373,307	―
(3) 未収運用受託報酬	―	―	―
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	42,799	42,799	―
(5) 未払金	(2,950,503)	(2,950,503)	―
(6) 未払法人税等	(838,596)	(838,596)	―
(7) デリバティブ取引			
ヘッジ会計が適用されていないもの	―	―	―
ヘッジ会計が適用されているもの	―	―	―
デリバティブ取引計	―	―	―

(*) 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。

当事業年度（2019年3月31日）　（単位:千円）

	貸借対照表計上額(*1)	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	23,830,484	23,830,484	―
(2) 未収委託者報酬	6,351,590	6,351,590	―
(3) 未収運用受託報酬	5,525,778	5,525,778	―
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	13,602,178	13,602,178	―
(5) 未払金	(5,327,037)	(5,327,037)	―
(6) 未払法人税等	(1,992,137)	(1,992,137)	―

（7）デリバティブ取引（*2）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(850)	(850)	－
ヘッジ会計が適用されているもの	82,081	82,081	－
デリバティブ取引計	81,231	81,231	－

（*1）負債に計上されているものについては、（　　）で示しております。
（*2）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。
（注1） 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

（1）現金及び預金、（2）未収委託者報酬、及び（3）未収運用受託報酬
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

（4）有価証券及び投資有価証券
これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

（5）未払金、及び（6）未払法人税等
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

（7）デリバティブ取引
（デリバティブ取引関係）注記をご参照ください。

（注2） 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

（単位:千円）

区分	前事業年度 2018年3月31日	当事業年度 2019年3月31日
非上場株式	3	3

これについては、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などができず、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。

（注3） 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

前事業年度（2018年3月31日）　（単位:千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,973,152	－	－	－
未収委託者報酬	5,373,307	－	－	－
未収運用受託報酬	－	－	－	－
有価証券及び投資有価証券 投資信託	－	12,846	21,065	496

当事業年度（2019年3月31日）　（単位:千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,830,484	－	－	－
未収委託者報酬	6,351,590	－	－	－
未収運用受託報酬	5,525,778	－	－	－
有価証券及び投資有価証券 投資信託	2,268,127	491,940	7,800,848	508

（有価証券関係）

１．子会社株式

前事業年度（2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2019年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

なお、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などができず、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位:千円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663,000

２．その他有価証券

前事業年度（2018年3月31日） **（単位:千円）**

区分	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			
その他	19,223	17,499	1,723
小計	19,223	17,499	1,723
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	23,576	25,037	△1,461
小計	23,576	25,037	△1,461
合計	42,799	42,536	262

当事業年度（2019年3月31日） **（単位:千円）**

区分	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			
その他	4,405,802	3,432,259	973,543
小計	4,405,802	3,432,259	973,543
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9,196,375	9,602,961	△406,585
小計	9,196,375	9,602,961	△406,585
合計	13,602,178	13,035,220	566,957

（注）非上場株式（貸借対照表計上額3千円）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などができず、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．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2018年3月31日） **（単位:千円）**

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
62,968	499	2,224

当事業年度（2019年3月31日）　（単位:千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,538,203	46,789	34,437

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2019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) 通貨関連

種類		契約額等（千円）	契約額等のうち1年超（千円）	時価（千円）	評価損益（千円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	887,121	－	3,257	3,257
	英ポンド	66,467	－	1,275	1,275
	カナダドル	3,344	－	42	42
	スイスフラン	7,802	－	△6	△6
	香港ドル	183,640	－	645	645
	ユーロ	183,228	－	2,601	2,601
	買建				
	米ドル	10,985	－	90	90
	スイスフラン	1,110	－	5	5
	香港ドル	560	－	4	4
	ユーロ	2,492	－	△0	△0
合計		1,346,753	－	7,916	7,916

（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います。

2．時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

種類		契約額等（千円）	契約額等のうち1年超（千円）	時価（千円）	評価損益（千円）
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	6,739,103	－	△8,766	△8,766
合計		6,739,103	－	△8,766	△8,766

（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います。

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（千円）	契約額等のうち1年超（千円）	時価（千円）

原則的処理方法	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	有価証券	3,432,867	－	13,731
	英ポンド	投資有価証券	2,575,513	－	50,256
	カナダドル	子会社株式	40,963	－	566
	スイスフラン		34,448	－	△132
	香港ドル		566,113	－	2,528
	人民元		1,725,146	－	9,137
	ユーロ		262,583	－	6,080
	買建				
	ユーロ		6,313	－	△86
合計			8,643,951	－	82,081

（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。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2．退職給付債務に関する事項　（単位：千円）

	前事業年度 （2018年3月31日）	当事業年度 （2019年3月31日）
（1）退職給付債務	496,696	537,798
（2）退職給付引当金	496,696	537,798

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。
2．当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3．退職給付費用に関する事項　（単位：千円）

	前事業年度 （2018年3月31日）	当事業年度 （2019年3月31日）
（1）退職給付費用	84,944	98,748

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。
2．金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で15,458千円、当事業年度で19,024千円であります。

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。

（税効果会計関係）

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

	前事業年度 （2018年3月31日）		当事業年度 （2019年3月31日）	
繰延税金資産				
未払事業税	42,041	千円	125,592	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	5,232	〃	－	
賞与引当金損金算入限度超過額	32,511	〃	40,467	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	152,088	〃	164,674	〃
その他	23,674	〃	82,358	〃
繰延税金資産 合計	255,547	〃	413,091	〃
繰延税金負債				
投資有価証券売却益益金不算入額	△6,833	〃	－	
有価証券評価差額	－		△173,602	〃
繰延ヘッジ損益	－		△58,719	〃
その他	△80	〃	△38,979	〃
繰延税金負債 合計	△6,913	〃	△271,302	〃
繰延税金資産の純額	248,633	〃	141,789	〃

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差異の原因となった主な項目別の内訳

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。

（企業結合等関係）

共通支配下の取引等

(1)取引の概要

①対象となった事業の名称及びその事業の内容

事業の名称：三井住友信託銀行株式会社の運用事業

事業の内容：法人・機関投資家向けの資産運用サービスの提供

②企業結合日

2018年10月1日

③企業結合の法的形式

三井住友信託銀行株式会社（当社の親会社の連結子会社）を吸収分割会社、当社を吸収分割承継会社とする吸収分割

④結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 （当社）

⑤その他取引の概要に関する事項

三井住友トラスト・グループの成長事業と位置づける資産運用ビジネスの強化を目的として、法人・機関投資家向けサービスを提供し、高いノウハウ・品質を有する三井住友信託銀行株式会社の運用機能を分割し、確定拠出年金・ファンドラップ・インデックス投信等を中心に個人顧客向けに業容拡大を図ってきた当社に発展的に統合するものであります。

(2)実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」に基づき、共通支配下の取引として処理しております。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

［関連情報］

１．製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

２．地域ごとの情報

（1）営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

３．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2017年4月1日　至 2018年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	2,945,175千円

（注）当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載しております。

当事業年度（自 2018年4月1日　至 2019年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,679,437千円

［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］

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］

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］

該当事項はありません。

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

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
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（ウ）財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 2017年4月1日　至 2018年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	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（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	―	営業上の取引 役員の兼任	投信販売代行手数料等	9,571,581	未払手数料	1,568,277
							投資助言費用	4,809,206	その他未払金	424,421

（注）１．上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
２．取引条件及び取引条件の決定方針等
① 投信販売代行手数料
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。
② 投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 2018年4月1日　至 2019年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	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（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	―	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	4,540,311	未収運用受託報酬	4,903,536
							投信販売代行手数料等	9,564,223	未払手数料	1,774,045
							投資助言費用	3,357,115	その他未払金	182,885
							吸収分割による承継 (承継資産合計) うち、投資有価証券 うち、関係会社株式 (承継負債合計) (差引純資産) (分割対価)	 18,603,427 13,907,536 4,663,000 13,989 18,589,438 無対価	―	―

（注）１．上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

① 運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

② 投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

③ 投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

④ 吸収分割

共通支配下の取引に該当するため、承継資産及び承継負債は、分割会社の適正な帳簿価額によって引き継いでおります。また、当該会社分割は、無対価取引であるため、差引純資産と同額のその他資本剰余金を増額しております。

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

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

前事業年度（2018年3月31日）

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、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2019年3月31日）

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、名古屋証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

	前事業年度 （自　2017年4月1日 至　2018年3月31日）	当事業年度 （自　2018年4月1日 至　2019年3月31日）
1株当たり純資産額	8,530,738円79銭	16,814,137円07銭
1株当たり当期純利益金額	1,257,863円25銭	1,921,511円21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、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

２．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 （自　2017年4月1日	当事業年度 （自　2018年4月1日

	至　2018年3月31日）	至　2019年3月31日）
当期純利益	3,773,589千円	5,764,533千円
普通株主に帰属しない金額	－	－
普通株式に係る当期純利益	3,773,589千円	5,764,533千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

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)自己又はその役員との取引

自己又はその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(2)運用財産相互間の取引

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（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又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行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うことを内容とした運用を行うこと。

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又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、又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

委託会社は、2019年6月27日に運用多様化のための投資対象資産拡大を図る（商品先物等投資を可能とする）べく事業目的の追加を行いました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2019年10月25日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

①名称　　：三井住友信託銀行株式会社

②資本金の額：342,037百万円（2019年3月末日現在）

③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。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円）（2019年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	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

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

３【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

①名称　　：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

②設立年月日　：2000年6月20日

③資本金の額　：51,000百万円（2019年3月末日現在）

④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。

⑤再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（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、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

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
2018年10月25日	有価証券届出書
2018年10月25日	有価証券報告書
2019年 4月25日	有価証券届出書
2019年 4月25日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2019年６月５日

三井住友トラスト・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 業務執行社員	公認会計士	藤　澤　　孝	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹　内　知　明	印

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」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2018年４月１日から2019年３月31日までの第33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、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2019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．ＸＢＲＬ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

２０１９年9月２５日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　中島紀子　　印

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」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式３０）の２０１８年7月２６日から２０１９年7月２５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、インデックスコレクション（バランス株式３０）の２０１９年7月２５日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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
三井住友トラスト・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．ＸＢＲＬ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

２０１９年9月２５日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　中島紀子　　印

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」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式５０）の２０１８年7月２６日から２０１９年7月２５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、インデックスコレクション（バランス株式５０）の２０１９年7月２５日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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
三井住友トラスト・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．ＸＢＲＬ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

２０１９年9月２５日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　中島紀子　　印

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」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式７０）の２０１８年7月２６日から２０１９年7月２５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、インデックスコレクション（バランス株式７０）の２０１９年7月２５日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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
三井住友トラスト・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．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。