

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年9月17日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 安倍 秀雄
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型（以下「ファンド」といいます。）

- ・愛称として「世界の財産3分法ファンド」、「世界の財産3分法」という名称を用いることがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

- ・追加型証券投資信託受益権です。（以下「受益権」といいます。）
- ・信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

### （５）【申込手数料】

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

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

<sup>\*</sup>消費税率が10%になった場合は、3.3%となります。

### （６）【申込単位】

販売会社の照会先にお問い合わせください。

### （７）【申込期間】

2019年9月18日から2020年9月15日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

### （８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

## &lt; 委託会社の照会先 &gt;

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス [www.nikkoam.com/](http://www.nikkoam.com/)

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

## ( 9 ) 【払込期日】

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

## ( 1 0 ) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

## ( 1 1 ) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

## ( 1 2 ) 【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

国内外の不動産、債券、株式に分散投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざします。

ファンドの基本的性格

##### 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

##### 2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券、不動産投信)))

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式、債券および不動産投信に投資を行いません。

よって、商品分類の「投資対象資産(収益の源泉)」においては、「資産複合」に分類されます。

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

年12回(毎月)

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

グローバル(含む日本)

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジなし

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

## ファンドの特色



## 1 主として国内外の不動産、債券および株式に投資を行ないます。

- 国内外の不動産、債券および株式の3つの異なる資産へ投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざします。



## 2 国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

- 投資信託証券(マザーファンド)への投資を通じて、原則として国内外の各3資産へそれぞれ純資産総額の6分の1を基本に国際分散投資を行ないます。



## 3 原則として、毎月、安定した収益分配を行なうことをめざします。

- インカム収益に加え、キャピタル収益を原資として、毎月の安定的な分配をめざします。
- 毎月15日(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

※毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として安定した分配を継続的に行なうことをめざします。

※分配金額は収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により分配金額を変更する場合や、分配を行なわない場合があります。



### 「財産3分法」とは？

財産を「不動産・現金(預金)・株式」の3つの資産に分けて保管・運用することを「財産3分法」といいます。

先達の知恵として、財産を3つの資産に分散することで、安定性・流動性・収益性を保ちながら資産形成が行なわれてきました。

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



主として国内外の不動産、債券および株式に投資を行ないます。

〔世界の財産3分法ファンド〕  
基本組入比率

国内の不動産投資信託市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

東証REIT指数(配当込み)

国内の株式市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

TOPIX(東証株価指数)

海外の不動産投資信託市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

S&P先進国REIT指数  
(除く日本、ヘッジなし・円ベース)

海外の株式市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

MSCI-KOKUSAI インデックス  
(円ヘッジなし・円ベース)



※「基本組入比率」および「連動をめざす指数(インデックス)」は、2019年6月末現在のものであり、将来変更となる場合があります。  
※市況動向および資金動向などにより左記のような運用ができない場合があります。

国内の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

NOMURA-BPI総合

海外の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

FTSE世界国債インデックス  
(除く日本、ヘッジなし・円ベース)





## 国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

それぞれの資産は、異なる値動きをする傾向があります。

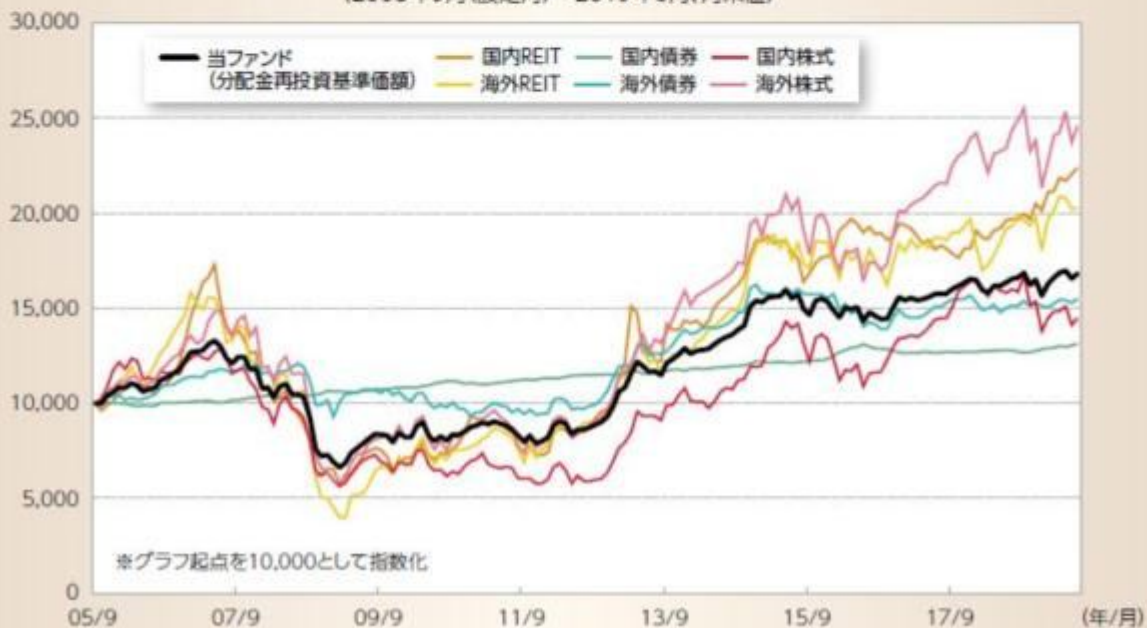
### 各資産の値動きの特徴

	REIT(不動産投資)	債券	株式
景気が良くなると	空室率や賃料水準が改善傾向 ↑ 価格は上がる傾向	金利が上がる傾向 ↓ 債券価格は下がる傾向	企業業績が改善する傾向 ↑ 株価は上がる傾向
景気が悪くなると	空室率や賃料水準が悪化の傾向 ↓ 価格は下がる傾向	金利が下がる傾向 ↑ 債券価格は上がる傾向	企業業績が悪化する傾向 ↓ 株価は下がる傾向

※価格変動などに関する説明は一般論であり、実際はこれと異なる動きをする場合があります。

### ご参考:設定来のファンドと各資産の推移(マザーファンドベース)

(2005年9月(設定月)~2019年6月、月末値)



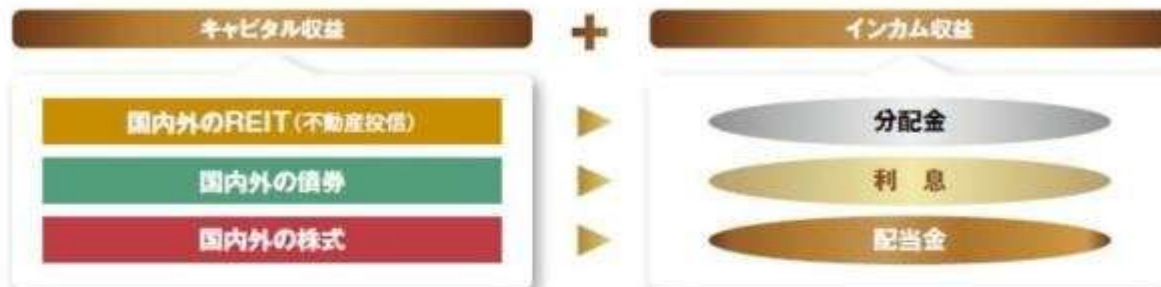
※基準価額は信託報酬(後述の「手続・手数料等」参照)控除後の1万口当たりの値です。  
 ※分配金再投資基準価額とは、税引前分配金を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。  
 ※各資産の値動きは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの値動きを示しています。  
 ※上記グラフは過去のものであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。





**インカム収益(投資した資産から生じる利息、配当金、分配金収入など)に加え、キャピタル収益(投資した資産自体の値上がり益)を原資として、毎月の安定的な分配をめざします。**

- 毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として安定した分配を継続的に行なうことをめざします。
- 分配金額は収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により分配金額を変更する場合や、分配を行わない場合があります。



### ご参考:各指数の利回り

(2019年6月末現在)



- ◆ REIT: 実績分配金利回り  
国内: 東証REIT指数(配当込み)  
海外: S&P先進国REIT指数(除く日本)
  - ◆ 債券: 最終利回りなど  
国内: NOMURA-BPI総合  
海外: FTSE世界国債インデックス(除く日本)
  - ◆ 株式: 実績配当利回りなど  
国内: TOPIX(東証株価指数)  
海外: MSCI-KOKUSAIインデックス
- ※利回りは切り捨てにて端数処理しています。

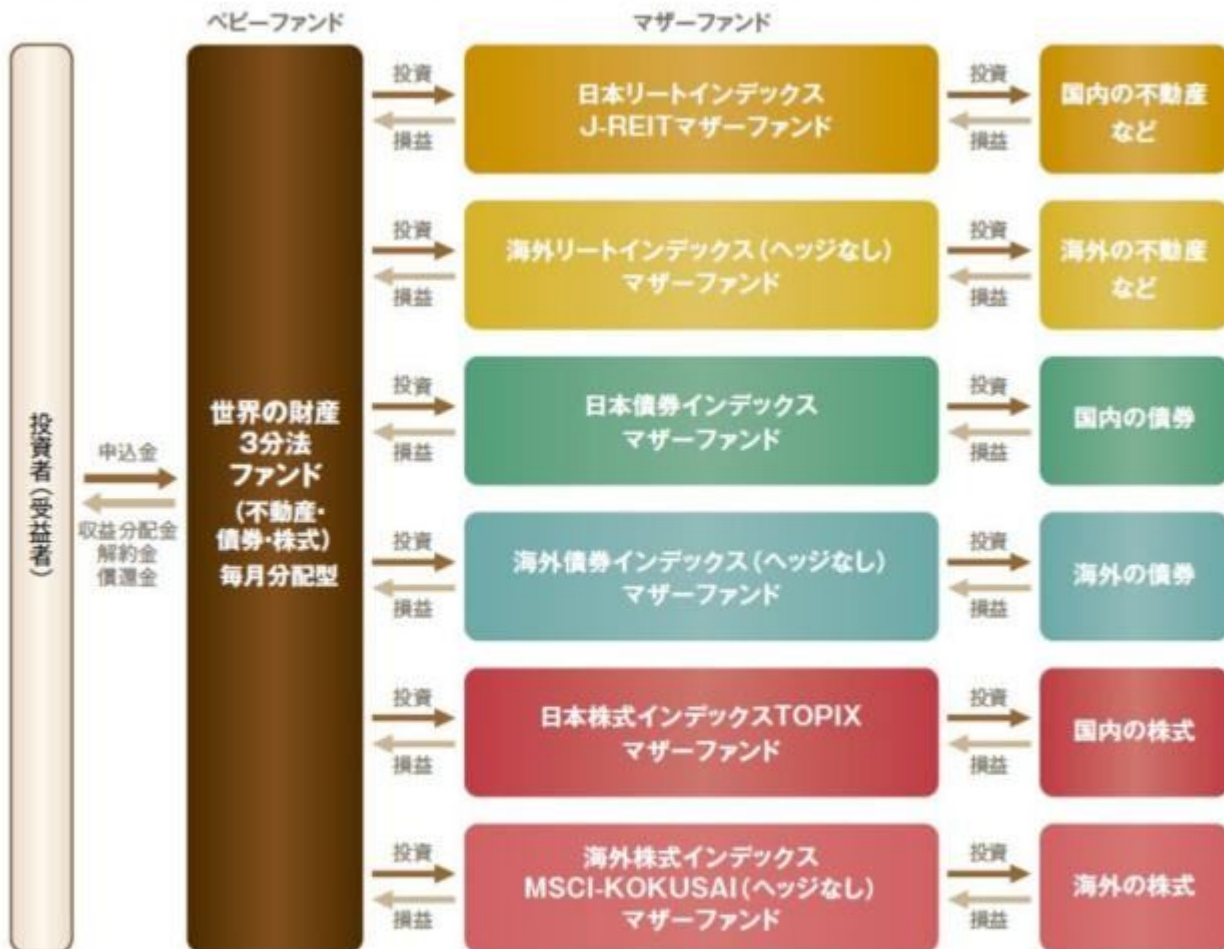
※各資産のリスク特性はそれぞれ異なるため、利回りだけで比較できるものではありません。  
※上記は過去の各指数の利回りであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。

### 各指数(インデックス)の著作権などの権利について

- **東証REIT指数(配当込み)** 同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社東京証券取引所に帰属します。また、株式会社東京証券取引所は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
- **S&P先進国REIT指数(除く日本、ヘッジなし・円ベース)** 同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はスタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービスズ エル エル シー(S&P)社に帰属します。また、S&P社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
- **NOMURA-BPI総合** 同指数は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行なわれる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- **FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)** 同指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- **TOPIX(東証株価指数)** TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。
- **MSCI-KOKUSAI インデックス(円ヘッジなし・円ベース)** 同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

## ■ファンドの仕組み

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



### (主な投資制限)

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

### (分配方針)

- ・毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。
- ※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。



## 収益分配金に関する留意事項

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

### 投資信託で分配金が支払われるイメージ



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

### 計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

#### 前期決算から基準価額が上昇した場合



#### 前期決算から基準価額が下落した場合



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

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

#### 分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



#### 分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

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

### 信託金限度額

- ・ 30兆円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ 委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

## (2) 【ファンドの沿革】

2005年 9月29日

- ・ ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

2006年3月9日

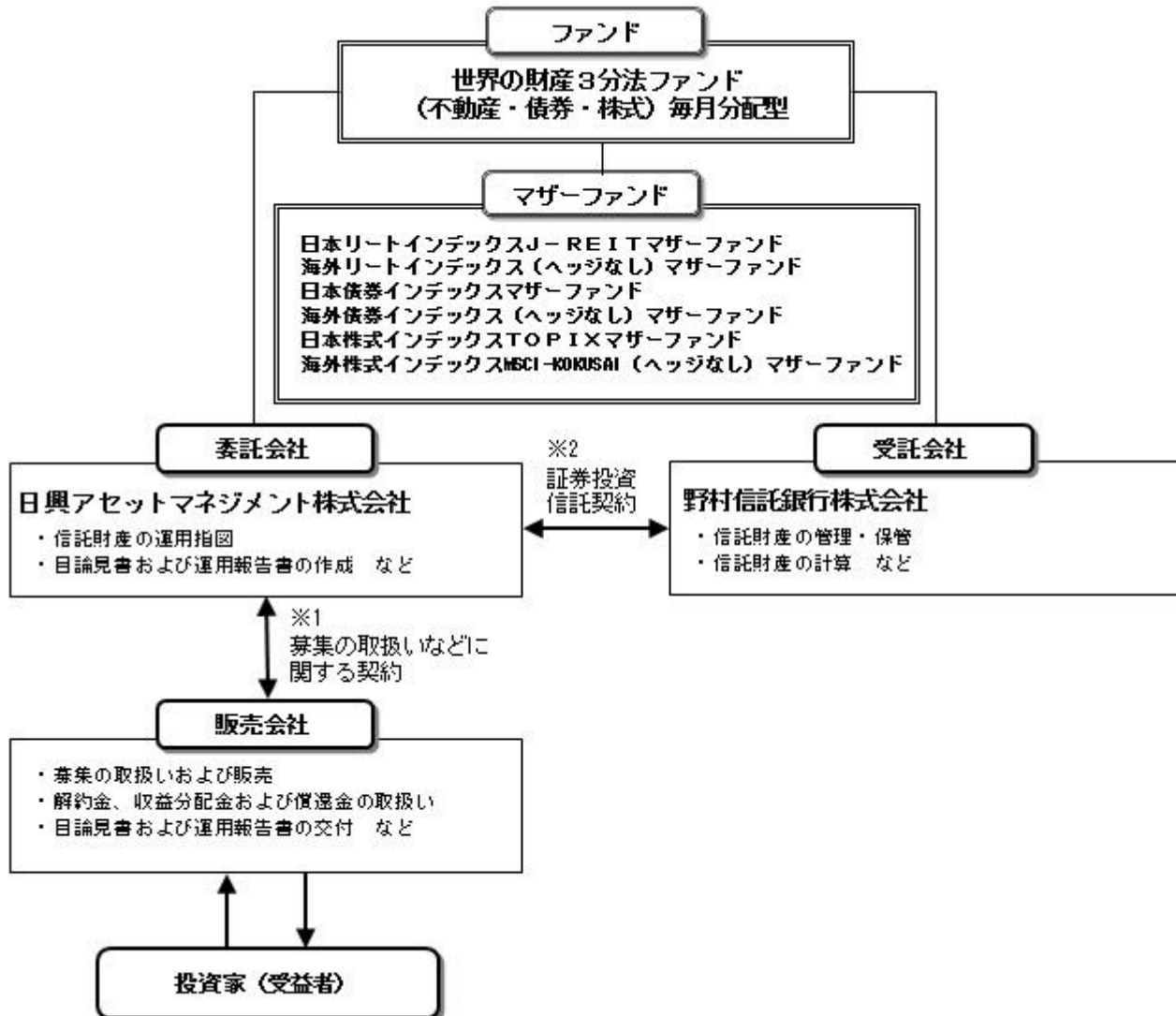
## ・ファンド名称変更

新名称：世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型

旧名称：世界の財産3分法ファンド（バランス重視）毎月分配型

## （3）【ファンドの仕組み】

## ファンドの仕組み



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

## 委託会社の概況（2019年6月末現在）

## 1) 資本金

17,363百万円

## 2) 沿革

1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更

## 3) 大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

- ・主として、以下に掲げる各投資信託証券に投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
- ・各マザーファンドへの投資比率は、原則として、信託財産の純資産総額の6分の1を基本としますが、資金動向やその見通しなどによっては5%から25%の範囲内で組入比率を変更する場合があります。
  - 証券投資信託「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」
  - 証券投資信託「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」
  - 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
  - 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」
  - 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
  - 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド」
- ・特に「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」や「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」においては、投資対象としている資産の流動性が他のマザーファンドと比べて相対的に低いため、資金の流出入に備える場合や純資産規模が大きくなった場合などには両マザーファンドの組入比率をそれぞれ5%を下限として引き下げ場合があります。両マザーファンドの組入比率を引き下げた場合には、現金の比率を高くする場合や他のマザーファンドの組入比率をそれぞれ25%を上限に引き上げる場合があります。また、組入比率はファンド全体として国内資産の実質組入比率と海外資産の実質組入比率が概ね50%程度ずつになるように決定します。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

### (2)【投資対象】

- <世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型>
- 投資信託証券(投資信託または外国投資信託の受益証券(振替投資信託受益権を含みます。))および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。)を主要投資対象とします。
- 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
  - 2) 金銭債権
  - 3) 約束手形
  - 4) 為替手形
- 主として次のマザーファンドの受益証券ならびに次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することができます。
- 1) 証券投資信託「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」
  - 2) 証券投資信託「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」
  - 3) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
  - 4) 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」
  - 5) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
  - 6) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド」
  - 7) 短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。)およびコマーシャル・ペーパー
  - 8) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)の証券の性質を有するもの
  - 9) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。)
  - 10) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)のうち投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)に類する証券

以外のもの

- 11) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

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

次の取引ができます。

- 1) 外国為替予約取引
- 2) 資金の借入

#### <日本リートインデックスJ-REITマザーファンド>

わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
- 2) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 3) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）のうち投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）に類する証券以外のもの
- 4) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

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

#### <海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
- 2) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)の証券の性質を有するもの
- 3) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 4) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）の



うち投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)に類する証券以外のもの

- 5) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

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

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

次の取引ができます。

- 1) 外国為替予約取引

#### <日本債券インデックスマザーファンド>

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

- 9) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

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

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

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

次の取引ができます。

- 1) 先物取引等

- 2) スワップ取引
  - 3) 金利先渡取引
  - 4) 有価証券の貸付
  - 5) 公社債の空売
  - 6) 公社債の借入
- < 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限りま。
- 5) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの
- 8) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
- 9) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 11) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りま。
- 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの

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

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

次の取引ができます。

- 1) 先物取引等
- 2) スワップ取引
- 3) 金利先渡取引
- 4) 為替先渡取引

- 5) 有価証券の貸付
- 6) 公社債の空売
- 7) 公社債の借入
- 8) 外国為替予約取引

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)～8)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
- 11) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- 12) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 13) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 14) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

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

## 7) 公社債の借入

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証券
  - 2) 国債証券
  - 3) 地方債証券
  - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
  - 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
  - 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
  - 7) コマーシャル・ペーパー
  - 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
  - 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)~7)の証券の性質を有するもの
  - 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
  - 11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))で12)に定めるもの以外のもの
  - 12) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
  - 13) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
  - 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。)
  - 15) 預託証券(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証券
  - 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)
  - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  - 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
- 次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。))により運用することができます。
- 1) 預金
  - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
  - 3) コール・ローン
  - 4) 手形割引市場において売買される手形
  - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
- 次の取引ができます。
- 1) 信用取引
  - 2) 先物取引等

- 3) スワップ取引
- 4) 金利先渡取引
- 5) 為替先渡取引
- 6) 有価証券の貸付
- 7) 公社債の空売
- 8) 公社債の借入
- 9) 外国為替予約取引

## 投資対象とする投資信託証券の概要

## &lt;日本リートインデックスJ - REITマザーファンド&gt;

運用の基本方針	
基本方針	わが国の金融商品取引所に上場する不動産投信（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。）の投資信託証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）に投資を行ない、東証REIT指数（配当込み） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果を目標として運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として、東京証券取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動した投資成果をめざします。</li> <li>・不動産投資信託証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。</li> <li>・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。</li> <li>・有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。</li> <li>・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2005年6月30日設定）

決算日	毎年6月15日（休業日の場合は翌営業日）
-----	----------------------

\* 東証REIT指数（配当込み）は、株式会社東京証券取引所が発表している、東京証券取引所に上場しているJ-REIT全銘柄に投資した場合の投資成果（市場における価格の変動と分配金の受取りを合わせた投資成果）を表す指数です。東京証券取引所に上場しているJ-REIT全銘柄の時価総額加重平均を2003年3月31日を1,000として指数化したものです。  
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社東京証券取引所に帰属します。また、株式会社東京証券取引所は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

#### < 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投信（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。）の投資信託証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）に投資を行ない、S & P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果を目標として運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>主として、日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、S &amp; P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動した投資成果をめざします。</li> <li>不動産投資信託証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。</li> <li>外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジは行ないません。</li> <li>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。</li> <li>有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。</li> <li>投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社



受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2005年6月30日設定）
決算日	毎年6月15日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

#### <日本債券インデックスマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、NOMURA-BPI総合 <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>運用の効率化をはかるため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式への投資は行ないません。</li> <li>外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.1%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

\* NOMURA-BPI総合は、野村証券株式会社が公表している、わが国の債券市場の動きを示す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出され

ます。国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債、MBS、ABSなど、国内で発行された円建公募利付債で構成されています。対象となる債券は残存期間1年以上、残存額面10億円以上で、事業債、円建外債、MBS、ABSについては、A格相当以上の格付を取得しているものに限られます。

同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行なわれる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

#### <海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

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

信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

#### < 日本株式インデックス T O P I X マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、T O P I X（東証株価指数）* の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>主としてわが国の株式に投資し、T O P I X（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。</li> <li>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1999年10月29日設定）

決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）
-----	-----------------------

\* T O P I X（東証株価指数）は、東京証券取引所第一部に上場されている普通株式全銘柄（算出対象除外後の整理ポスト割当銘柄および算出対象組入前の新規上場銘柄を除きます。）の浮動株調整後の時価総額を指数化したもので、市場全体の動向を反映するものです。

T O P I Xの指数値およびT O P I Xの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびT O P I Xの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

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

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース） <sup>*</sup> に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカンントリーファンド等を含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。</li> <li>・投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、株価指数先物取引や外国為替予約取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社

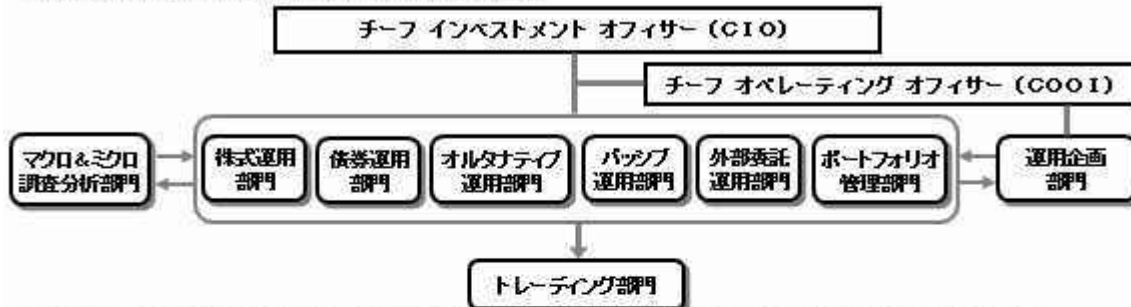
信託期間	無期限（2000年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

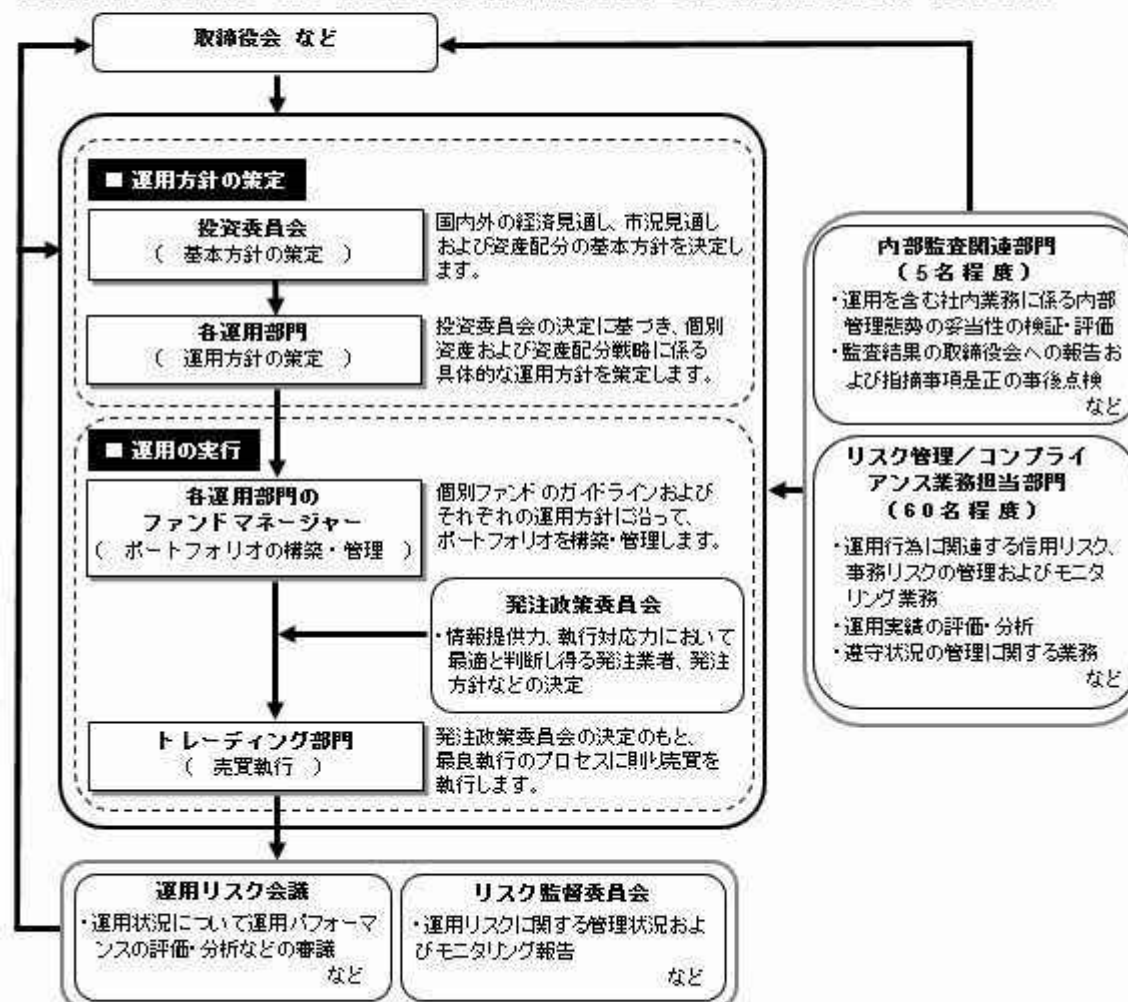
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

### （３）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



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

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

上記体制は2019年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

### （４）【配分方針】

## 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

- 1) 分配対象額の範囲  
経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。
  - 2) 分配対象額についての分配方針  
分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。
  - 3) 留保益の運用方針  
収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行ないます。
- 収益分配金の支払い
- <分配金再投資コース>  
原則として、収益分配金は税金を差し引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。
- <分配金受取りコース>  
毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日まで）から収益分配金を支払います。支払いは販売会社において行なわれます。

## (5) 【投資制限】

### 約款に定める投資制限

- <世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型>
- 1) 投資信託証券、短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
  - 2) 有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。
  - 3) 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
  - 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
  - 5) 信託財産に属する外貨建資産の時価総額と投資信託証券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との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
  - 6) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
    - イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
    - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
  - ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
    - ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
    - ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が弁済される日からその翌営業日までとします。
  - 7) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこ



とします。

<日本リートインデックスJ - REITマザーファンド>

- 1) 投資信託証券、短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
- 2) 有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。
- 3) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- 4) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 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およびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

- 1) 投資信託証券、短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
- 2) 有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。
- 3) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 5) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<日本債券インデックスマザーファンド>

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 3) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとし、
- 4) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 7) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとし、

- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 10) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 11) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

< 海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド >

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 3) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。 )および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。 )ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 4) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。 )を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 13) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

## &lt;日本株式インデックスTOPIXマザーファンド&gt;

- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 4) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 5) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 6) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 8) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
  - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 13) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

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

- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

- 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 9) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
  - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 15) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 16) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

### 3【投資リスク】

## （１）ファンドのリスク

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

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

投資対象とする投資信託証券の主なリスクは以下の通りです。

### 価格変動リスク

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

### 流動性リスク

市場規模や取引量が少ない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは、価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。

### 信用リスク

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

### 為替変動リスク

外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、

ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。

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

< その他の留意事項 >

・ システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

・ 投資対象とする投資信託証券に関する事項

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

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

・ 解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。

・ 基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。

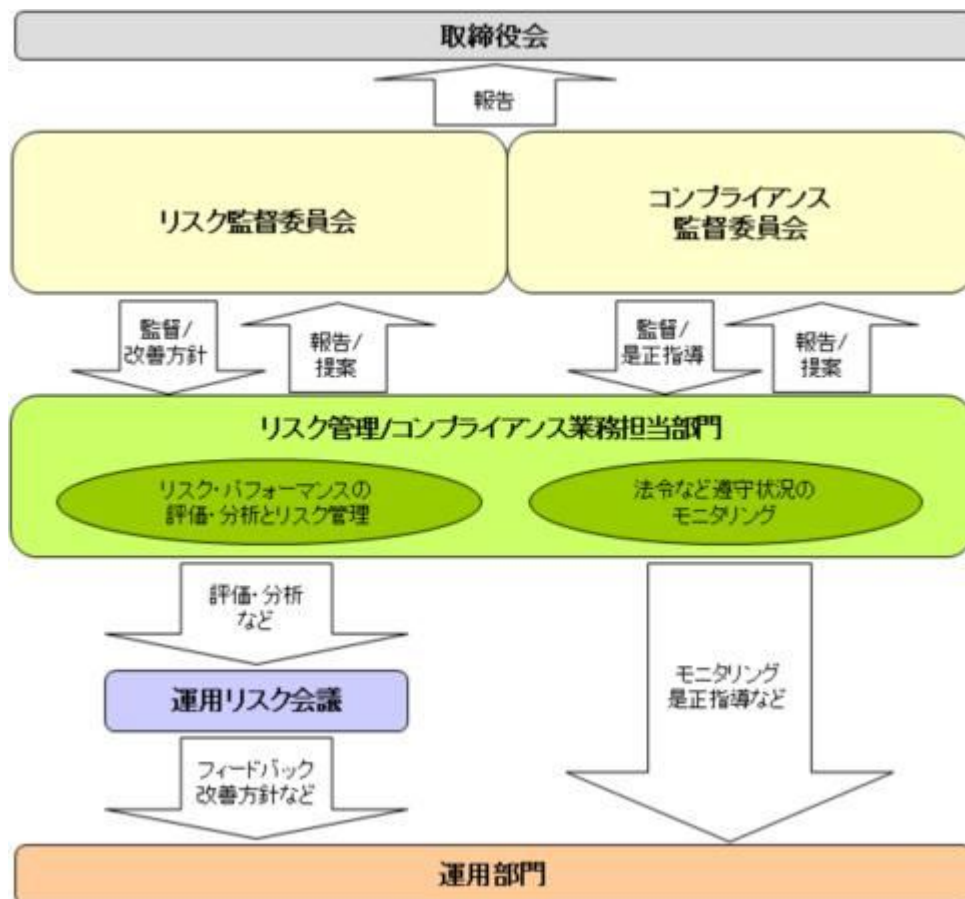
・ 運用制限や規制上の制限に関する事項

関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。

・ 法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

（２）リスク管理体制



### 全社リスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理/コンプライアンス業務担当部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況についてはコンプライアンス部門が事務局を務めるコンプライアンス監督委員会、リスク管理状況についてはリスク管理部門が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。両委員会およびそれに関連する部門別会議においては、法令遵守状況や各種リスク（運用リスク、事務リスク、システムリスクなど）に関するモニタリングとその報告に加えて、重要事故への対応と各種リスク対応、事故防止のための施策やその管理手法の構築などの支援に努めております。

### 運用状況の評価・分析および運用リスク管理

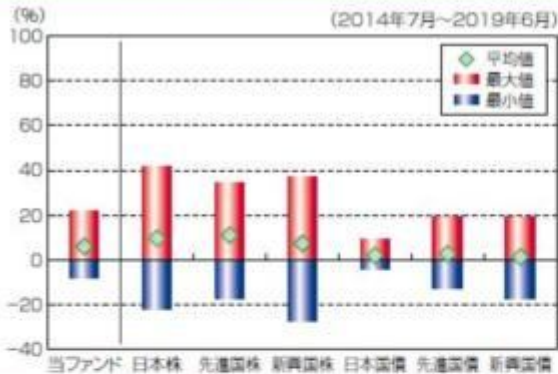
ファンド財産について運用状況の評価・分析および運用リスクの管理状況をモニタリングします。運用パフォーマンスおよび運用リスクに係る評価と分析の結果については運用リスク会議に報告し、運用リスクの管理状況についてはリスク監督委員会へ報告され、問題点の原因の究明や改善策の策定が図られます。加えて外部委託運用部門は、外部委託ファンドの運用管理を行ない、投資方針に沿った運用が行なわれているかなどのモニタリングを行なっています。

### 法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は2019年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。



**（参考情報）****当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較****（当ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大騰落率および最小騰落率(%)）**

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	6.0%	9.7%	11.0%	7.3%	2.0%	2.8%	1.4%
最大値	22.0%	41.9%	34.1%	37.2%	9.3%	19.3%	19.3%
最小値	-7.8%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2014年7月から2019年6月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

**<各資産クラスの指数>**

日本株 ……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株 ……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

**当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移**

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2014年7月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

日本国債 ……NOMURA-BPI国債

先進国債 ……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

**代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について****東証株価指数(TOPIX、配当込)**

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

**MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)**

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

**MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)**

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

**NOMURA-BPI国債**

当指数は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

**FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)**

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



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

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

### 4【手数料等及び税金】

#### (1)【申込手数料】

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

- ・販売会社における申込手数料率は3.24%<sup>\*</sup>（税抜3%）が上限となっております。  
\*消費税率が10%になった場合は、3.3%となります。
  - ・申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
  - ・＜分配金再投資コース＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
  - ・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- 申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

#### (2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

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

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

#### (3)【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年1.026%<sup>\*</sup>（税抜0.95%）の率を乗じて得た額とします。

\*消費税率が10%になった場合は、1.045%となります。

この他に、投資対象とする「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」および「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」の主要投資対象である不動産投信には運用などに係る費用がかかりますが、投資する不動産投信の銘柄は固定されていないため、事前に料率、上限額などを表示することができません。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.95%	0.40%	0.50%	0.05%

委託会社	委託した資金の運用の対価
販売会社	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価

受託会社	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価
------	-------------------------

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

#### (4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

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

格付の取得に要する費用。

ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。

ファンドの主要投資対象の1つである「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」の運用の基本方針に規定する「東証REIT指数(配当込み)」その他これに類する標章の使用料。

ファンドの主要投資対象の1つである「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」の運用の基本方針に規定する「S&P先進国REIT指数(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」その他これに類する標章の使用料。

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

組入る有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料。

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

<投資対象とする投資信託証券に係る費用>

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

#### (5)【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

##### 1) 収益分配金に対する課税

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

##### 2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

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

法人受益者の場合

##### 1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

##### 2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

##### 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

##### 2) 受益者が収益分配金を受け取る際

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

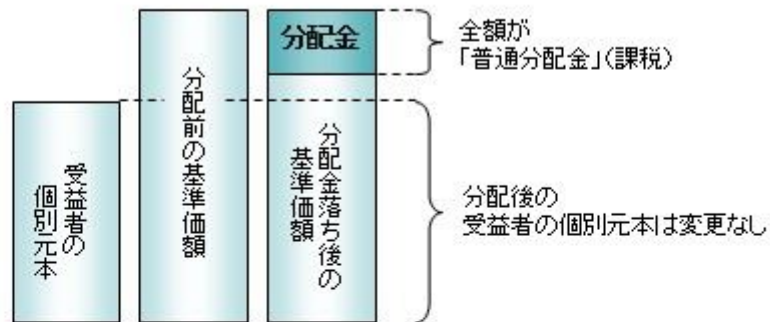
ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から

元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。

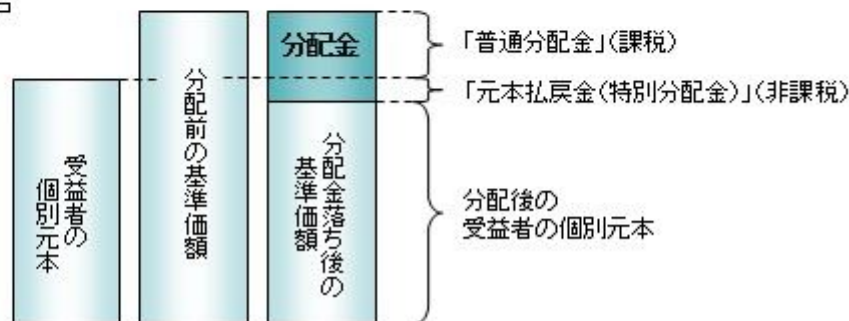
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

#### <分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は2019年9月17日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

### 【世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型】

以下の運用状況は2019年6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### (1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	31,287,691,122	98.21
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		570,651,268	1.79
合計(純資産総額)		31,858,342,390	100.00

#### (2)【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	2,384,612,598	2.2341	5,327,463,006	2.2418	5,345,824,522	16.78
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	2,079,812,033	2.5038	5,207,433,369	2.5281	5,257,972,800	16.50
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	2,265,138,517	2.2851	5,176,291,599	2.2962	5,201,211,062	16.33
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	3,617,315,192	1.4313	5,177,464,406	1.4338	5,186,506,522	16.28
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	3,625,396,161	1.4107	5,114,658,337	1.4233	5,160,026,355	16.20
日本	親投資信託受益証券	海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド	2,420,200,670	2.1714	5,255,223,735	2.1222	5,136,149,861	16.12

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.21
合計	98.21

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

### 【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第9特定期間末 (2009年12月15日)	99,747	100,783	0.5778	0.5838
第10特定期間末 (2010年6月15日)	96,496	97,363	0.5569	0.5619
第11特定期間末 (2010年12月15日)	88,713	89,187	0.5612	0.5642
第12特定期間末 (2011年6月15日)	76,898	77,323	0.5427	0.5457
第13特定期間末 (2011年12月15日)	59,790	60,171	0.4709	0.4739
第14特定期間末 (2012年6月15日)	55,918	56,146	0.4910	0.4930
第15特定期間末 (2012年12月17日)	55,668	55,874	0.5402	0.5422
第16特定期間末 (2013年6月17日)	57,765	57,856	0.6378	0.6388
第17特定期間末 (2013年12月16日)	55,238	55,317	0.6910	0.6920
第18特定期間末 (2014年6月16日)	52,281	52,353	0.7290	0.7300
第19特定期間末 (2014年12月15日)	52,113	52,176	0.8237	0.8247

第20特定期間末	(2015年 6月15日)	48,576	48,632	0.8576	0.8586
第21特定期間末	(2015年12月15日)	42,709	42,762	0.8131	0.8141
第22特定期間末	(2016年 6月15日)	39,155	39,206	0.7769	0.7779
第23特定期間末	(2016年12月15日)	39,745	39,793	0.8277	0.8287
第24特定期間末	(2017年 6月15日)	36,443	36,487	0.8278	0.8288
第25特定期間末	(2017年12月15日)	34,568	34,608	0.8629	0.8639
第26特定期間末	(2018年 6月15日)	32,895	32,934	0.8573	0.8583
第27特定期間末	(2018年12月17日)	31,635	31,672	0.8421	0.8431
第28特定期間末	(2019年 6月17日)	31,844	31,881	0.8638	0.8648
	2018年 6月末日	32,673		0.8535	
	7月末日	32,820		0.8611	
	8月末日	32,902		0.8641	
	9月末日	33,164		0.8760	
	10月末日	31,730		0.8413	
	11月末日	32,244		0.8554	
	12月末日	30,433		0.8107	
	2019年 1月末日	31,566		0.8416	
	2月末日	32,054		0.8580	
	3月末日	32,234		0.8699	
	4月末日	32,210		0.8748	
	5月末日	31,415		0.8523	
	6月末日	31,858		0.8643	

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間末の分配金を加算した金額です。

### 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第9特定期間	2009年 6月16日～2009年12月15日	0.0360
第10特定期間	2009年12月16日～2010年 6月15日	0.0310
第11特定期間	2010年 6月16日～2010年12月15日	0.0240
第12特定期間	2010年12月16日～2011年 6月15日	0.0180
第13特定期間	2011年 6月16日～2011年12月15日	0.0180
第14特定期間	2011年12月16日～2012年 6月15日	0.0130
第15特定期間	2012年 6月16日～2012年12月17日	0.0120
第16特定期間	2012年12月18日～2013年 6月17日	0.0070
第17特定期間	2013年 6月18日～2013年12月16日	0.0060
第18特定期間	2013年12月17日～2014年 6月16日	0.0060
第19特定期間	2014年 6月17日～2014年12月15日	0.0060
第20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	0.0060
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	0.0060
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	0.0060

第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	0.0060
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	0.0060
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	0.0060
第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	0.0060
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	0.0060
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	0.0060

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第9特定期間	2009年 6月16日～2009年12月15日	3.30
第10特定期間	2009年12月16日～2010年 6月15日	1.75
第11特定期間	2010年 6月16日～2010年12月15日	5.08
第12特定期間	2010年12月16日～2011年 6月15日	0.09
第13特定期間	2011年 6月16日～2011年12月15日	9.91
第14特定期間	2011年12月16日～2012年 6月15日	7.03
第15特定期間	2012年 6月16日～2012年12月17日	12.46
第16特定期間	2012年12月18日～2013年 6月17日	19.36
第17特定期間	2013年 6月18日～2013年12月16日	9.28
第18特定期間	2013年12月17日～2014年 6月16日	6.37
第19特定期間	2014年 6月17日～2014年12月15日	13.81
第20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	4.84
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	4.49
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	3.71
第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	7.31
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	0.74
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	4.96
第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	0.05
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	1.07
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	3.29

(注)各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落ち）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落ち。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

## (4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第9特定期間	2009年 6月16日～2009年12月15日	14,406,774,226	5,986,832,540
第10特定期間	2009年12月16日～2010年 6月15日	10,739,262,952	10,086,629,772
第11特定期間	2010年 6月16日～2010年12月15日	3,738,112,212	18,933,404,132
第12特定期間	2010年12月16日～2011年 6月15日	1,451,825,844	17,852,733,674

第13特定期間	2011年 6月16日～2011年12月15日	1,137,780,912	15,842,664,215
第14特定期間	2011年12月16日～2012年 6月15日	787,842,918	13,892,127,349
第15特定期間	2012年 6月16日～2012年12月17日	645,492,480	11,463,657,624
第16特定期間	2012年12月18日～2013年 6月17日	755,347,566	13,250,917,932
第17特定期間	2013年 6月18日～2013年12月16日	381,538,280	11,009,976,725
第18特定期間	2013年12月17日～2014年 6月16日	548,220,875	8,763,039,619
第19特定期間	2014年 6月17日～2014年12月15日	848,123,250	9,300,633,130
第20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	1,077,889,968	7,702,577,651
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	822,766,387	4,936,873,357
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	559,222,913	2,691,021,175
第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	788,561,373	3,167,580,874
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	535,316,706	4,530,717,126
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	675,282,245	4,636,099,733
第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	900,474,282	2,591,559,940
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	1,657,593,437	2,463,297,514
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	1,553,018,779	2,252,941,131

（参考）

## 日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド

以下の運用状況は2019年 6月28日現在です。

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

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	31,364,157,080	99.14
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		272,103,733	0.86
合計（純資産総額）		31,636,260,813	100.00

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	3,131	758,664.96	2,375,380,000	738,000	2,310,678,000	7.30
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	3,233	657,627.89	2,126,111,000	656,000	2,120,848,000	6.70
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	10,060	165,209.87	1,662,011,300	165,700	1,666,942,000	5.27



日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人 投資証券	6,111	217,980.06	1,332,076,200	218,000	1,332,198,000	4.21
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	7,259	180,258.52	1,308,496,600	180,600	1,310,975,400	4.14
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	6,442	197,800.18	1,274,228,800	196,600	1,266,497,200	4.00
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	4,645	243,165.81	1,129,505,200	248,900	1,156,140,500	3.65
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	4,338	256,378.56	1,112,170,200	260,100	1,128,313,800	3.57
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,151	314,974.29	992,484,000	320,500	1,009,895,500	3.19
日本	投資証券	G L P 投資法人 投資証券	8,012	121,748.05	975,445,400	122,800	983,873,600	3.11
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,047	484,222.03	991,202,500	467,000	955,949,000	3.02
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	10,407	87,014.6	905,561,000	86,800	903,327,600	2.86
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	1,699	473,702.47	804,820,500	469,000	796,831,000	2.52
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,000	768,586	768,586,000	771,000	771,000,000	2.44
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	9,454	79,833.7	754,747,800	80,600	761,992,400	2.41
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,074	591,044.69	634,782,000	604,000	648,696,000	2.05
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	11,154	59,277.64	661,182,800	55,800	622,393,200	1.97
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	746	776,288.2	579,111,000	773,000	576,658,000	1.82
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	3,708	152,660.97	566,066,900	152,600	565,840,800	1.79
日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	3,968	133,622.93	530,215,800	134,000	531,712,000	1.68
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,113	248,090.96	524,216,200	246,700	521,277,100	1.65
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,100	473,514.09	520,865,500	460,000	506,000,000	1.60
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	2,614	184,107.65	481,257,400	187,100	489,079,400	1.55
日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	3,319	136,854.47	454,220,000	138,000	458,022,000	1.45
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	2,895	161,335.06	467,065,000	158,200	457,989,000	1.45
日本	投資証券	日本リート投資法人 投資証券	1,044	429,551.72	448,452,000	419,000	437,436,000	1.38
日本	投資証券	プレミア投資法人 投資証券	3,074	136,906.31	420,850,000	141,800	435,893,200	1.38
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,341	305,151.37	409,208,000	309,500	415,039,500	1.31
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,168	187,249.03	405,955,900	187,200	405,849,600	1.28
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	2,311	175,399.95	405,349,300	175,200	404,887,200	1.28

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.14
合計	99.14

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2019年 6月28日現在です。

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

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	19,837,036,843	68.70
	カナダ	539,834,598	1.87
	ドイツ	77,536,211	0.27
	イタリア	6,629,894	0.02
	フランス	1,051,302,288	3.64
	オランダ	75,951,508	0.26
	スペイン	192,336,840	0.67
	ベルギー	259,942,507	0.90
	アイルランド	72,686,595	0.25
	イギリス	1,292,346,258	4.48
	オーストラリア	1,984,507,164	6.87
	ニュージーランド	76,510,995	0.26
	香港	698,823,281	2.42
	シンガポール	1,110,433,754	3.85
	韓国	5,094,180	0.02
	イスラエル	20,231,385	0.07
	ガーンジー	49,279,824	0.17
マン島	8,542,699	0.03	
	小計	27,359,026,824	94.74
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,517,794,069	5.26
合計（純資産総額）		28,876,820,893	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		699,149,000	2.42

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	131,835	8,625.05	1,137,083,659	8,554.21	1,127,744,855	3.91
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	64,621	17,558.56	1,134,652,260	17,238.85	1,113,992,030	3.86
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	31,388	26,181.83	821,795,562	25,550.54	801,980,400	2.78
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	84,711	8,888.53	752,956,424	8,798.89	745,363,423	2.58
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	29,162	22,405.77	653,397,227	21,713.21	633,200,852	2.19
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	77,474	8,426.17	652,809,742	8,150.00	631,413,247	2.19
香港	投資証券	LINK REIT	441,300	1,323.54	584,081,877	1,345.90	593,947,435	2.06
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	77,270	7,243.40	559,698,279	7,482.78	578,194,550	2.00
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	43,529	12,934.94	563,045,263	12,676.10	551,778,131	1.91
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	65,877	7,871.43	518,546,714	7,482.78	492,943,217	1.71
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	28,792	16,588.51	477,616,450	15,586.85	448,776,657	1.55
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	32,320	14,550.55	470,273,785	13,800.35	446,027,432	1.54
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	13,756	32,223.01	443,259,846	31,083.40	427,583,282	1.48
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	335,550	1,111.16	372,852,520	1,151.22	386,292,710	1.34
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	23,611	16,219.95	382,969,412	15,097.06	356,456,858	1.23
アメリカ	投資証券	HCP INC	100,071	3,465.97	346,843,164	3,427.72	343,015,568	1.19
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	1,115,212	284.94	317,775,411	299.69	334,223,795	1.16
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	35,705	9,207.47	328,752,967	8,776.26	313,356,428	1.09
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	26,656	11,635.90	310,166,563	11,383.70	303,443,958	1.05
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	154,769	1,969.75	304,857,407	1,941.29	300,452,735	1.04
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	23,872	12,701.47	303,209,493	12,538.13	299,310,306	1.04
アメリカ	投資証券	UDR INC	59,022	4,991.94	294,634,283	4,805.27	283,617,130	0.98
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	18,878	13,919.86	262,779,205	13,646.21	257,613,228	0.89
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORPORATION	75,150	3,420.54	257,053,845	3,364.12	252,814,061	0.88
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	34,977	7,421.58	259,584,651	7,211.15	252,224,429	0.87
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	36,332	7,128.62	258,997,264	6,864.06	249,385,290	0.86
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	18,852	13,335.46	251,400,157	12,900.30	243,196,591	0.84
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	80,087	2,941.35	235,564,009	2,859.66	229,022,287	0.79
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	20,239	11,440.98	231,554,042	11,172.43	226,118,882	0.78
オーストラリア	投資証券	DEXUS	227,341	1,029.44	234,034,190	990.42	225,165,074	0.78

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	94.74
合計	94.74

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	米ドル	買建	4,550,000.00	490,124,180	490,262,500	1.70
	ユーロ	買建	570,000.00	69,814,170	69,813,600	0.24
	英ポンド	買建	510,000.00	69,628,005	69,640,500	0.24
	豪ドル	買建	920,000.00	69,408,940	69,432,400	0.24

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2019年 6月28日現在です。

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

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	31,663,242,802	78.06
地方債証券	日本	3,075,678,000	7.58
特殊債証券	日本	2,864,102,853	7.06
社債券	日本	2,766,397,070	6.82
	オーストラリア	100,298,000	0.25
	小計	2,866,695,070	7.07
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		93,259,087	0.23
合計（純資産総額）		40,562,977,812	100.00

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（%）	償還期限	投資比率（%）
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	700,000,000	102.32	716,240,000	103.68	725,795,000	0.300	2025/12/20	1.79
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	610,000,000	100.65	613,965,000	102.74	626,726,200	0.100	2026/12/20	1.55
日本	国債証券	第140回利付国債（20年）	458,000,000	119.01	545,070,500	122.72	562,057,600	1.700	2032/9/20	1.39
日本	国債証券	第124回利付国債（5年）	560,000,000	100.30	561,698,064	100.30	561,698,064	0.100	2020/6/20	1.38

日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	490,000,000	103.28	506,076,900	104.02	509,712,700	0.500	2024/9/20	1.26
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	490,000,000	100.27	491,332,800	102.85	503,969,900	0.100	2027/12/20	1.24
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	490,000,000	100.54	492,660,700	102.79	503,690,600	0.100	2027/3/20	1.24
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	480,000,000	100.13	480,667,200	102.79	493,430,400	0.100	2028/3/20	1.22
日本	国債証券	第144回利付国債(20年)	380,000,000	119.00	452,210,300	120.49	457,877,200	1.500	2033/3/20	1.13
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	435,000,000	100.04	435,204,450	102.74	446,919,000	0.100	2028/6/20	1.10
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	420,000,000	102.97	432,474,000	104.17	437,526,600	0.400	2025/9/20	1.08
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	390,000,000	102.85	401,118,900	103.83	404,937,000	0.400	2025/3/20	1.00
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	390,000,000	99.97	389,885,200	102.67	400,424,700	0.100	2028/9/20	0.99
日本	国債証券	第29回利付国債(30年)	276,000,000	132.93	366,897,840	141.11	389,474,640	2.400	2038/9/20	0.96
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	370,000,000	102.89	380,711,500	104.00	384,807,400	0.400	2025/6/20	0.95
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	370,000,000	103.42	382,676,200	102.61	379,664,400	1.300	2021/3/20	0.94
日本	国債証券	第117回利付国債(20年)	293,000,000	122.23	358,147,590	124.03	363,425,480	2.100	2030/3/20	0.90
日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	290,000,000	120.96	350,795,600	123.16	357,178,500	2.100	2029/9/20	0.88
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	300,000,000	117.57	352,722,000	118.04	354,138,000	2.300	2026/6/20	0.87
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	340,000,000	100.18	340,622,316	100.18	340,622,316	0.100	2020/3/20	0.84
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	325,000,000	100.44	326,449,500	100.36	326,192,750	0.100	2020/9/20	0.80
日本	国債証券	第43回利付国債(30年)	235,000,000	121.08	284,540,350	133.60	313,976,450	1.700	2044/6/20	0.77
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	295,000,000	106.23	313,405,050	105.72	311,879,900	1.400	2022/12/20	0.77
日本	国債証券	第164回利付国債(20年)	285,000,000	97.92	279,077,700	105.60	300,968,550	0.500	2038/3/20	0.74
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	250,000,000	118.06	295,152,500	118.71	296,775,000	2.300	2026/9/20	0.73
日本	国債証券	第34回利付国債(30年)	200,000,000	130.67	261,354,000	140.89	281,788,000	2.200	2041/3/20	0.69
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	208,000,000	129.84	270,067,200	134.43	279,618,560	2.400	2034/3/20	0.69
日本	国債証券	第149回利付国債(20年)	215,000,000	116.44	250,365,350	121.45	261,126,100	1.500	2034/6/20	0.64
日本	国債証券	第145回利付国債(20年)	205,000,000	119.13	244,222,650	123.48	253,152,450	1.700	2033/6/20	0.62
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	245,000,000	100.80	246,964,900	102.55	251,259,750	0.100	2026/6/20	0.62

## □.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	78.06
地方債証券	7.58
特殊債券	7.06
社債券	7.07

合 計	99.77
-----	-------

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

### 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2019年 6月28日現在です。

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

### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	70,732,714,029	46.55
	カナダ	2,961,474,233	1.95
	メキシコ	1,248,850,834	0.82
	ドイツ	10,020,084,803	6.59
	イタリア	13,244,132,057	8.72
	フランス	15,051,894,417	9.91
	オランダ	3,028,182,733	1.99
	スペイン	8,792,032,049	5.79
	ベルギー	3,801,333,277	2.50
	オーストリア	2,232,386,711	1.47
	フィンランド	889,410,794	0.59
	アイルランド	1,113,993,018	0.73
	イギリス	9,625,046,517	6.33
	スウェーデン	536,510,213	0.35
	ノルウェー	375,722,440	0.25
	デンマーク	775,430,179	0.51
	ポーランド	918,369,133	0.60
	オーストラリア	3,037,395,279	2.00
	シンガポール	619,088,613	0.41
	マレーシア	697,490,169	0.46
南アフリカ	864,716,038	0.57	
	小計	150,566,257,536	99.08
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,391,882,880	0.92
合計（純資産総額）		151,958,140,416	100.00

### その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		146,438,620	0.10

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,000,000	9,956.88	1,095,257,424	10,569.94	1,162,694,100	1.250	2023/7/31	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,250,000	12,375.63	1,144,746,642	12,333.53	1,140,851,836	8.000	2021/11/15	0.75
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,860,000	10,551.12	1,040,341,393	10,860.68	1,070,863,475	2.125	2021/8/15	0.70
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,700,000	10,368.05	1,005,700,911	10,824.68	1,049,994,305	1.875	2022/7/31	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,840,000	10,467.11	925,293,054	10,718.57	947,522,351	1.500	2022/1/31	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,150,000	10,220.68	832,985,431	10,783.84	878,883,117	1.750	2023/5/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,100,000	10,037.52	612,288,925	11,027.63	672,685,596	2.250	2027/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,120,000	11,292.89	578,196,460	13,018.79	666,562,542	3.625	2043/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,050,000	10,563.20	639,073,867	10,857.52	656,880,328	2.125	2021/6/30	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,940,000	10,221.52	607,158,341	11,033.52	655,391,484	2.250	2025/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	10,605.45	636,327,486	10,794.57	647,674,733	2.000	2020/9/30	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	10,498.99	608,941,647	11,148.47	646,611,551	2.500	2024/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	10,773.61	624,869,409	11,131.00	645,598,068	2.500	2024/1/31	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	9,882.35	523,765,062	11,529.52	611,065,085	2.875	2045/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	9,785.89	557,795,788	10,615.42	605,078,955	1.625	2026/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,450,000	10,312.26	562,018,676	11,027.21	600,983,013	2.250	2024/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,500,000	11,521.53	518,468,984	13,276.69	597,451,314	3.750	2043/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	10,551.00	559,203,138	11,104.89	588,559,463	2.500	2023/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	9,989.05	549,398,229	10,614.79	583,813,635	1.375	2023/9/30	0.38
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,930,000	14,867.87	584,307,407	14,847.73	583,516,009	4.250	2023/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,050,000	9,936.08	501,772,151	11,534.79	582,507,007	2.875	2043/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,370,000	10,624.05	570,511,586	10,786.15	579,216,645	2.000	2020/7/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	10,590.15	561,278,052	10,886.36	576,977,533	2.250	2021/7/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	10,359.69	549,063,936	10,880.05	576,642,816	2.000	2023/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	10,729.25	536,462,611	11,511.42	575,571,221	3.000	2025/9/30	0.38
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,605,000	19,579.19	510,037,992	21,980.38	572,589,147	4.500	2041/4/25	0.38
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,730,000	14,609.18	544,922,529	15,288.85	570,274,434	2.750	2027/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,220,000	10,077.52	526,046,766	10,877.10	567,784,885	2.000	2025/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,250,000	10,311.01	541,328,305	10,742.99	564,007,493	1.625	2022/8/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,180,000	10,736.89	556,171,277	10,864.47	562,779,709	2.625	2020/8/15	0.37

#### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
----	---------

国債証券	99.08
合 計	99.08

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	買建	900,000.00	96,903,000	96,975,000	0.06
	ユーロ	買建	341,000.00	41,749,312	41,765,680	0.03
	豪ドル	買建	102,000.00	7,677,846	7,697,940	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2019年 6月28日現在です。

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

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	30,276,315,450	98.83
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		359,281,092	1.17
合計(純資産総額)		30,635,596,542	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	139,590,000	0.46

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	151,700	6,532.48	990,978,284	6,688.00	1,014,569,600	3.31



日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	111,700	4,326.11	483,227,584	5,165.00	576,930,500	1.88
日本	株式	ソニー	電気機器	91,600	5,777.02	529,175,830	5,648.00	517,356,800	1.69
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	924,200	639.97	591,460,460	512.00	473,190,400	1.54
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	91,400	4,851.58	443,435,012	5,017.00	458,553,800	1.50
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	118,900	4,414.12	524,839,228	3,823.00	454,554,700	1.48
日本	株式	キーエンス	電気機器	6,700	52,344.24	350,706,427	66,130.00	443,071,000	1.45
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	94,600	4,194.38	396,789,123	3,806.00	360,047,600	1.18
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	93,200	2,868.37	267,332,544	3,594.00	334,960,800	1.09
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	114,800	2,972.56	341,250,085	2,785.00	319,718,000	1.04
日本	株式	任天堂	その他製品	7,800	34,472.46	268,885,207	39,490.00	308,022,000	1.01
日本	株式	KDDI	情報・通信業	109,600	2,805.50	307,482,800	2,743.50	300,687,600	0.98
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,824,400	186.21	339,732,286	156.10	284,788,840	0.93
日本	株式	花王	化学	33,000	7,383.55	243,657,361	8,210.00	270,930,000	0.88
日本	株式	三菱商事	卸売業	94,000	3,135.17	294,706,792	2,840.00	266,960,000	0.87
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	12,200	21,265.52	259,439,347	21,580.00	263,276,000	0.86
日本	株式	ダイキン工業	機械	18,600	12,620.24	234,736,491	14,065.00	261,609,000	0.85
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	48,000	5,178.46	248,566,257	5,399.00	259,152,000	0.85
日本	株式	ファナック	電気機器	12,900	17,687.12	228,163,875	19,930.00	257,097,000	0.84
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	24,200	9,585.45	231,968,053	10,080.00	243,936,000	0.80
日本	株式	日立製作所	電気機器	61,300	3,264.84	200,134,966	3,949.00	242,073,700	0.79
日本	株式	日本電産	電気機器	16,400	13,671.01	224,204,650	14,725.00	241,490,000	0.79
日本	株式	信越化学工業	化学	23,500	8,554.44	201,029,486	10,035.00	235,822,500	0.77
日本	株式	キヤノン	電気機器	73,300	3,190.16	233,838,996	3,146.00	230,601,800	0.75
日本	株式	HOYA	精密機器	27,400	6,187.93	169,549,370	8,254.00	226,159,600	0.74
日本	株式	第一三共	医薬品	39,000	4,376.22	170,672,697	5,635.00	219,765,000	0.72
日本	株式	資生堂	化学	27,000	6,846.70	184,860,981	8,121.00	219,267,000	0.72
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	84,700	2,832.75	239,934,726	2,512.50	212,808,750	0.69
日本	株式	村田製作所	電気機器	42,800	5,178.88	221,656,085	4,840.00	207,152,000	0.68
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	15,400	10,360.37	159,549,740	13,340.00	205,436,000	0.67

## ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.27
		建設業	2.77
		食料品	4.07
		繊維製品	0.65
		パルプ・紙	0.28
		化学	7.31
		医薬品	5.43

	石油・石炭製品	0.62
	ゴム製品	0.77
	ガラス・土石製品	0.86
	鉄鋼	0.89
	非鉄金属	0.77
	金属製品	0.55
	機械	5.11
	電気機器	13.44
	輸送用機器	7.74
	精密機器	2.11
	その他製品	2.14
	電気・ガス業	1.64
	陸運業	4.67
	海運業	0.16
	空運業	0.54
	倉庫・運輸関連業	0.20
	情報・通信業	8.80
	卸売業	4.90
	小売業	4.49
	銀行業	5.79
	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	2.40
	サービス業	5.22
合 計		98.83

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2019年09月	買建		9日本円	139,414,860	139,590,000	0.46

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

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

以下の運用状況は2019年 6月28日現在です。

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

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）	
出資金	アメリカ	15,144,401	0.01	
株式	アメリカ	80,655,142,808	61.64	
	カナダ	4,849,060,555	3.71	
	モーリシャス	3,211,104	0.00	
	ドイツ	4,067,971,171	3.11	
	イタリア	877,085,252	0.67	
	フランス	4,822,050,845	3.68	
	オランダ	2,225,523,449	1.70	
	スペイン	1,378,913,777	1.05	
	ベルギー	450,258,667	0.34	
	オーストリア	96,692,740	0.07	
	ルクセンブルク	129,058,257	0.10	
	フィンランド	534,378,097	0.41	
	アイルランド	2,356,398,537	1.80	
	ポルトガル	68,660,219	0.05	
	イギリス	7,645,584,680	5.84	
	スイス	4,799,841,631	3.67	
	スウェーデン	1,156,952,774	0.88	
	ノルウェー	320,493,137	0.24	
	デンマーク	803,218,990	0.61	
	ケイマン	317,792,246	0.24	
	オーストラリア	3,085,560,467	2.36	
	バミューダ	264,905,532	0.20	
	ニュージーランド	115,665,021	0.09	
	香港	1,451,032,057	1.11	
	シンガポール	572,151,327	0.44	
	イスラエル	281,323,325	0.21	
	ジャージー	349,839,130	0.27	
	英ヴァージン諸島	21,586,025	0.02	
	アラブ首長国連邦	12,001,307	0.01	
	マン島	14,050,248	0.01	
		小計	123,726,403,375	94.55
	投資証券	アメリカ	2,772,840,270	2.12
カナダ		24,323,501	0.02	
フランス		148,189,509	0.11	
イギリス		82,643,386	0.06	
オーストラリア		259,227,375	0.20	
香港		91,521,472	0.07	

	シンガポール	63,686,662	0.05
	小計	3,442,432,175	2.63
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		3,675,028,250	2.81
合計(純資産総額)		130,859,008,201	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,554,119,248	2.72
	買建	ドイツ	866,494,260	0.66

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		3,897,693,500	2.98

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	227,724	11,992.16	2,730,903,241	14,460.02	3,292,895,530	2.52
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	147,322	22,826.85	3,362,897,843	21,529.97	3,171,838,918	2.42
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	13,055	191,924.56	2,505,575,247	205,262.34	2,679,699,864	2.05
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	74,580	16,847.18	1,256,462,742	20,426.20	1,523,386,369	1.16
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	83,321	14,905.53	1,241,944,171	15,164.97	1,263,560,890	0.97
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	102,450	11,395.00	1,167,417,985	11,731.86	1,201,929,426	0.92
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	9,842	118,822.84	1,169,454,487	115,983.11	1,141,505,846	0.87
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	9,350	119,671.11	1,118,924,919	116,049.94	1,085,067,011	0.83
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	132,591	8,384.36	1,111,690,897	8,172.63	1,083,618,219	0.83
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	95,863	9,563.04	916,742,494	11,106.85	1,064,736,153	0.81
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	54,662	15,569.31	851,050,060	18,456.88	1,008,890,067	0.77
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	40,820	21,912.53	894,469,881	22,853.63	932,885,413	0.71

アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	78,259	9,970.97	780,318,849	11,833.18	926,053,319	0.71
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	287,229	2,911.44	836,250,711	3,040.75	873,393,276	0.67
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	56,282	12,345.98	694,856,613	15,015.14	845,082,503	0.65
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	137,410	5,049.17	693,807,206	6,007.13	825,440,654	0.63
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	173,770	4,664.12	810,485,789	4,681.31	813,472,924	0.62
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	227,327	3,266.93	742,661,533	3,554.91	808,127,980	0.62
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェア・サービス	28,490	22,867.94	651,507,829	28,143.96	801,821,677	0.61
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	30,040	28,023.80	841,835,028	26,552.98	797,651,778	0.61
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	129,197	6,108.12	789,151,089	6,170.97	797,271,780	0.61
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	59,481	12,258.12	729,125,624	13,270.02	789,314,470	0.60
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	35,290	19,670.92	694,186,993	22,314.68	787,485,262	0.60
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	80,813	7,775.25	628,341,436	9,036.03	730,229,153	0.56
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	140,502	4,891.01	687,197,495	5,115.71	718,767,964	0.55
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	127,192	5,085.85	646,880,382	5,505.91	700,308,112	0.54
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	135,420	5,492.43	743,786,103	4,989.59	675,691,510	0.52
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	67,663	8,511.14	575,889,755	9,853.24	666,700,083	0.51
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	21,948	26,792.40	588,039,666	30,213.59	663,128,038	0.51
アメリカ	株式	BOEING CO/THE	資本財	16,752	39,226.05	657,114,851	39,237.71	657,310,215	0.50

## ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
出資金			0.01
株式	国外	エネルギー	5.85
		素材	4.36
		資本財	6.91
		商業・専門サービス	1.20
		運輸	1.89
		自動車・自動車部品	1.09
		耐久消費財・アパレル	1.84

	消費者サービス	1.86
	メディア・娯楽	5.74
	小売	4.74
	食品・生活必需品小売り	1.46
	食品・飲料・タバコ	4.80
	家庭用品・パーソナル用品	2.07
	ヘルスケア機器・サービス	4.65
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.90
	銀行	7.59
	各種金融	4.16
	保険	3.92
	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	4.18
	電気通信サービス	2.31
	公益事業	3.35
	半導体・半導体製造装置	2.81
投資証券		2.63
合計		97.19

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI 1909	買建	225	米ドル	32,945,712.5	3,551,218,350	32,972,625	3,554,119,248	2.72
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1909	買建	225	ユーロ	7,099,500	869,617,755	7,074,000	866,494,260	0.66

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	29,600,000.00	3,189,881,575	3,181,266,500	2.43
	ユーロ	買建	5,850,000.00	715,919,125	716,427,000	0.55

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 参考情報

## 運用実績

2019年6月28日現在

## 基準価額・純資産の推移



基準価額……………8,643円

純資産総額……………318.58億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。  
 ※分配金再投資基準価額は、2009年6月末の基準価額を起点として指数化しています。  
 ※分配金再投資基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものである点にご留意ください。

## 分配の推移(税引前、1万口当たり)

2019年2月	2019年3月	2019年4月	2019年5月	2019年6月	最近1年間累計	設定以来累計
10円	10円	10円	10円	10円	120円	4,880円

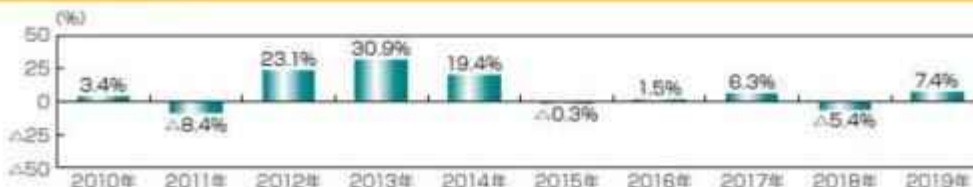
## 主要な資産の状況

組入資産	投資対象	比率*	組入上位の銘柄名	国名	比率*2
日本リートインデックス J-REITマザーファンド	日本リート	16.8%	日本ビルファンド投資法人 投資証券	日本	7.3%
			ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	日本	6.7%
			野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	日本	5.3%
			日本リテールファンド投資法人 投資証券	日本	4.2%
			ユナイテッドアーバン投資法人 投資証券	日本	4.1%
海外リートインデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外リート	16.1%	PROLOGIS INC	アメリカ	3.9%
			SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	3.9%
			PUBLIC STORAGE	アメリカ	2.8%
			WELL TOWER INC	アメリカ	2.6%
			AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	2.2%
日本債券インデックス マザーファンド	日本債券	16.3%	第341回利付国債(10年)	日本	1.8%
			第345回利付国債(10年)	日本	1.6%
			第140回利付国債(20年)	日本	1.4%
			第124回利付国債(5年)	日本	1.4%
			第335回利付国債(10年)	日本	1.3%
海外債券インデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外債券	16.3%	US TREASURY N/B(1.25%)	アメリカ	0.8%
			US TREASURY N/B(8%)	アメリカ	0.8%
			US TREASURY N/B(2.125%)	アメリカ	0.7%
			US TREASURY N/B(1.875%)	アメリカ	0.7%
			US TREASURY N/B(1.5%)	アメリカ	0.6%
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	日本株式	16.2%	トヨタ自動車	日本	3.3%
			ソフトバンクグループ	日本	1.9%
			ソニー	日本	1.7%
			三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	1.5%
			日本電信電話	日本	1.5%
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	海外株式	16.5%	MICROSOFT CORP	アメリカ	2.5%
			APPLE INC	アメリカ	2.4%
			AMAZON.COM INC	アメリカ	2.0%
			FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	1.2%
			JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	1.0%
現金その他		1.8%			

\*1:当ファンドの対純資産総額比です。また、合計の比率が四捨五入の関係で100%にならない場合があります。

\*2:各マザーファンドの対純資産総額比です。

## 年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2019年は、2019年6月末までの騰落率です。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込(販売)手続等】



- (1) 申込方法  
販売会社所定の方法でお申し込みください。
- (2) コースの選択  
収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース＞と＜分配金受取りコース＞の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。  
＜分配金再投資コース＞  
収益分配金を自動的に再投資するコースです。なお、販売会社によっては、収益分配金を定期的に受け取るための「定期引出契約」を結ぶことができる場合があります。  
＜分配金受取りコース＞  
収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。
- (3) 申込みの受付  
販売会社の営業日に受け付けます。
- (4) 取扱時間  
原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
- (5) 取得申込不可日  
販売会社の営業日であっても、取得申込日が下記のいずれかに該当する場合は、取得の申込みの受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。  
ニューヨーク証券取引所の休業日  
ニューヨークの銀行休業日
- (6) 申込金額  
取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。
- (7) 申込単位  
販売会社の照会先にお問い合わせください。
- (8) 申込代金の支払い  
取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。
- (9) 受付の中止および取消  
委託会社は、投資対象とする投資信託証券（マザーファンドが投資対象とする投資信託証券を含みます。）への投資ができない場合、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。  
金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。
- (10) 償還乗換  
・受益者は、証券投資信託の償還金額（手取額）の範囲内（単位型証券投資信託については、償還金額（手取額）とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する口数に係る申込手数料を徴収されない措置の適用を受けることができる場合があります。この償還乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。  
・この措置の適用を受ける受益者は、販売会社から、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求められることがあります。
- (11) 乗換優遇  
受益者は、信託期間終了日の1年前以内などの一定の要件を満たした証券投資信託を解約または買取請求により換金した際の代金をもって、換金を行なった販売会社において、取得申込みをする場合の手数料率が割引となる措置の適用を受けることができます。この乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

## 2【換金（解約）手続等】

### <解約請求による換金>

#### (1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約請求不可日

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

(4) 解約制限

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

(5) 解約価額

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

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス [www.nikkoam.com/](http://www.nikkoam.com/)

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(6) 手取額

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

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

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(7) 解約単位

1口単位

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

(8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(9) 受付の中止および取消

- ・委託会社は、投資対象とする投資信託証券(マザーファンドが投資対象とする投資信託証券を含みます。)からの換金ができない場合、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
- ・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日(この計算日が解約請求を受け付けられない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。)に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

## &lt;基準価額算出の流れ&gt;



## 有価証券などの評価基準

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

## &lt;主な資産の評価方法&gt;

## マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

## 国内上場株式

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

## 外国株式

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

## 公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日<sup>\*</sup>における以下のいずれかの価額で評価します。

- 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
- 金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）
- 価格情報会社の提供する価額

残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。

\* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

## 国内上場不動産投信

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

## 海外上場不動産投信

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

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

## 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

## &lt;委託会社の照会先&gt;

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス [www.nikkoam.com/](http://www.nikkoam.com/)

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

## (2) 【保管】

該当事項はありません。

### （３）【信託期間】

無期限とします（2005年9月29日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

### （４）【計算期間】

毎月16日から翌月15日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

### （５）【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
  - イ) 受益者の解約により受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合
  - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
  - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内（1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。）に異議を述べるすることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
  - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
  - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
  - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。）
  - 二) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

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

信託約款の変更

- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べるすることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
- 4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

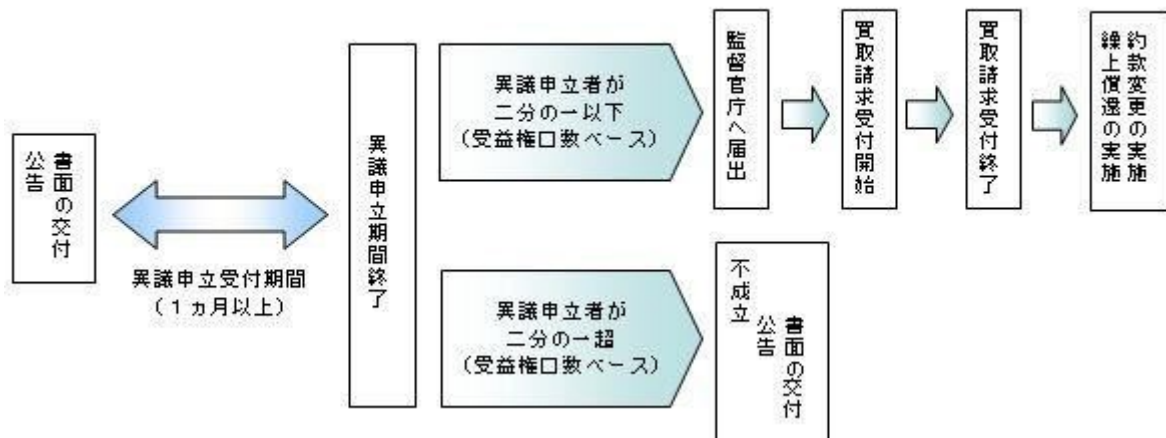
異議の申立て

- 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べるすることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。
- 2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行なわない場合は、その旨およびその理由などを公告

し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。

- 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



#### 公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

#### 運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス [www.nikkoam.com/](http://www.nikkoam.com/)

#### 関係法人との契約について

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

## 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

### (1) 収益分配金・償還金受領権

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

### (2) 解約請求権

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

### (3) 帳簿閲覧権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づき作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は、6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、2018年12月18日から2019年6月17日までの特定期間の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2018年12月17日現在	当期 2019年 6月17日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	26,179,743
コール・ローン	652,811,507	631,730,033
親投資信託受益証券	31,019,285,142	31,266,589,154
未収入金	62,257,288	3,626,718
流動資産合計	31,734,353,937	31,928,125,648
資産合計	31,734,353,937	31,928,125,648
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	37,565,004	36,865,082
未払解約金	29,478,485	10,407,630
未払受託者報酬	1,512,537	1,548,925
未払委託者報酬	27,225,866	27,880,840
未払利息	804	979
その他未払費用	3,476,919	6,689,275
流動負債合計	99,259,615	83,392,731
負債合計	99,259,615	83,392,731
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	37,565,004,411	36,865,082,059
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	5,929,910,089	5,020,349,142
(分配準備積立金)	1,301,702,837	1,408,745,547
元本等合計	31,635,094,322	31,844,732,917
純資産合計	31,635,094,322	31,844,732,917
負債純資産合計	31,734,353,937	31,928,125,648



## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期		当期	
	自 至	2018年 6月16日 2018年12月17日	自 至	2018年 12月18日 2019年 6月17日
営業収益				
受取利息		87		389
有価証券売買等損益		170,218,905		1,200,019,771
営業収益合計		170,218,818		1,200,020,160
営業費用				
支払利息		168,822		123,323
受託者報酬		8,892,143		8,531,115
委託者報酬		160,059,694		153,561,087
その他費用		4,124,827		3,908,441
営業費用合計		173,245,486		166,123,966
営業利益又は営業損失( )		343,464,304		1,033,896,194
経常利益又は経常損失( )		343,464,304		1,033,896,194
当期純利益又は当期純損失( )		343,464,304		1,033,896,194
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		1,654,674		7,576,638
期首剰余金又は期首欠損金( )		5,474,750,026		5,929,910,089
剰余金増加額又は欠損金減少額		354,824,076		330,328,063
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		354,824,076		330,328,063
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		237,579,306		224,179,299
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		237,579,306		224,179,299
分配金		227,285,855		222,907,373
期末剰余金又は期末欠損金( )		5,929,910,089		5,020,349,142

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎月16日から翌月15日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当特定期間は2018年12月18日から2019年 6月17日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

		前期 2018年12月17日現在	当期 2019年 6月17日現在
1.	期首元本額	38,370,708,488円	37,565,004,411円
	期中追加設定元本額	1,657,593,437円	1,553,018,779円
	期中一部解約元本額	2,463,297,514円	2,252,941,131円
2.	受益権の総数	37,565,004,411口	36,865,082,059口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	5,929,910,089円	5,020,349,142円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2018年 6月16日 至 2018年12月17日		当期 自 2018年12月18日 至 2019年 6月17日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
自 2018年 6月16日 至 2018年 7月17日		自 2018年12月18日 至 2019年 1月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	68,796,616円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 52,681,395円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金	366,206,113円	C 信託約款に定める収益調整金 414,990,544円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	1,291,811,117円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 1,297,156,134円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	1,726,813,846円	E 分配対象収益 (A+B+C+D) 1,764,828,073円
F	分配対象収益(1万口当たり)	451円	F 分配対象収益(1万口当たり) 469円
G	分配金額	38,230,399円	G 分配金額 37,588,456円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり) 10円
自 2018年 7月18日 至 2018年 8月15日		自 2019年 1月16日 至 2019年 2月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	23,744,423円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 51,057,029円

B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	377,688,374円	C	信託約款に定める収益調整金	421,420,826円
D	信託約款に定める分配準備積立金	1,306,275,253円	D	信託約款に定める分配準備積立金	1,300,779,199円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,707,708,050円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,773,257,054円
F	分配対象収益(1万口当たり)	448円	F	分配対象収益(1万口当たり)	473円
G	分配金額	38,102,837円	G	分配金額	37,468,765円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自 2018年 8月16日			自 2019年 2月16日	
	至 2018年 9月18日			至 2019年 3月15日	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	74,274,099円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	72,517,486円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	387,265,519円	C	信託約款に定める収益調整金	424,556,349円
D	信託約款に定める分配準備積立金	1,277,932,115円	D	信託約款に定める分配準備積立金	1,299,147,493円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,739,471,733円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,796,221,328円
F	分配対象収益(1万口当たり)	457円	F	分配対象収益(1万口当たり)	482円
G	分配金額	37,981,132円	G	分配金額	37,192,500円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自 2018年 9月19日			自 2019年 3月16日	
	至 2018年10月15日			至 2019年 4月15日	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	67,696,775円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	110,898,964円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	45,514,998円
C	信託約款に定める収益調整金	393,577,862円	C	信託約款に定める収益調整金	431,454,873円
D	信託約款に定める分配準備積立金	1,296,076,940円	D	信託約款に定める分配準備積立金	1,316,018,504円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,757,351,577円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,903,887,339円
F	分配対象収益(1万口当たり)	466円	F	分配対象収益(1万口当たり)	515円
G	分配金額	37,694,753円	G	分配金額	36,924,384円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自 2018年10月16日			自 2019年 4月16日	
	至 2018年11月15日			至 2019年 5月15日	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	45,954,524円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	24,351,130円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	403,424,315円	C	信託約款に定める収益調整金	445,145,826円
D	信託約款に定める分配準備積立金	1,317,461,331円	D	信託約款に定める分配準備積立金	1,419,890,880円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,766,840,170円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,889,387,836円
F	分配対象収益(1万口当たり)	468円	F	分配対象収益(1万口当たり)	512円
G	分配金額	37,711,730円	G	分配金額	36,868,186円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円

自 2018年11月16日 至 2018年12月17日		自 2019年 5月16日 至 2019年 6月17日		
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	25,275,382円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	51,461,086円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	409,037,675円	C 信託約款に定める収益調整金	458,973,505円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	1,313,992,459円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	1,394,149,543円
E	分配対象収益（A+B+C+D）	1,748,305,516円	E 分配対象収益（A+B+C+D）	1,904,584,134円
F	分配対象収益(1万口当たり)	465円	F 分配対象収益(1万口当たり)	516円
G	分配金額	37,565,004円	G 分配金額	36,865,082円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり)	10円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

	前期 自 2018年 6月16日 至 2018年12月17日	当期 自 2018年12月18日 至 2019年 6月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	前期 2018年12月17日現在	当期 2019年 6月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

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

（有価証券に関する注記）

前期（2018年12月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	171,958,014
合計	171,958,014

当期（2019年 6月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	296,366,296
合計	296,366,296

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

前期 2018年12月17日現在		当期 2019年 6月17日現在	
1口当たり純資産額	0.8421円	1口当たり純資産額	0.8638円
(1万口当たり純資産額)	(8,421円)	(1万口当たり純資産額)	(8,638円)

## (4)【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益 証券	海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	2,081,523,584	5,211,718,749	
	日本債券インデックスマザーファンド	3,615,640,173	5,175,065,779	
	海外債券インデックス(ヘッジなし)マザー ファンド	2,264,049,892	5,173,806,813	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	3,620,389,631	5,107,645,691	
	日本リートインデックスJ - REITマザーファン ド	2,390,678,281	5,341,014,347	
	海外リートインデックス(ヘッジなし)マザー ファンド	2,421,174,254	5,257,337,775	
合計		16,393,455,815	31,266,589,154	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

（参考）

## 日本リートインデックス」-REITマザーファンド

### 貸借対照表

	（単位：円）	
	2018年12月17日現在	2019年 6月17日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	40,376,227
コール・ローン	118,851,842	974,298,155
投資証券	7,963,391,690	27,400,876,000
未収配当金	39,001,454	89,188,590
流動資産合計	8,121,244,986	28,504,738,972
資産合計	8,121,244,986	28,504,738,972
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	-	929,330,350
未払解約金	20,342,286	2,652,495
未払利息	146	1,510
流動負債合計	20,342,432	931,984,355
負債合計	20,342,432	931,984,355
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,940,100,434	12,341,578,634
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,160,802,120	15,231,175,983
元本等合計	8,100,902,554	27,572,754,617
純資産合計	8,100,902,554	27,572,754,617
負債純資産合計	8,121,244,986	28,504,738,972

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券</p>
-----------------	--



	<p>当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>（3）時価が入手できなかった有価証券</p> <p>適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
--	--

## （貸借対照表に関する注記）

		2018年12月17日現在	2019年 6月17日現在
1.	期首	2018年 6月16日	2018年12月18日
	期首元本額	3,787,119,953円	3,940,100,434円
	期首からの追加設定元本額	307,802,243円	8,672,066,510円
	期首からの一部解約元本額	154,821,762円	270,588,310円
	元本の内訳		
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,641,894,254円	2,390,678,281円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型 インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	1,071,552,871円 185,049,517円	1,311,044,408円 167,326,722円
グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	41,603,792円	8,472,529,223円	
計	3,940,100,434円	12,341,578,634円	
2.	受益権の総数	3,940,100,434口	12,341,578,634口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

	自 2018年 6月16日 至 2018年12月17日	自 2018年12月18日 至 2019年 6月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。当該有価証券の性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左
----------------	---	----

## 金融商品の時価等に関する事項

	2018年12月17日現在	2019年 6月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2018年12月17日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	326,841,813
合計	326,841,813

(2019年 6月17日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	1,194,558,989

合計	1,194,558,989
----	---------------

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2018年12月17日現在		2019年 6月17日現在	
1口当たり純資産額	2.0560円	1口当たり純資産額	2.2341円
(1万口当たり純資産額)	(20,560円)	(1万口当たり純資産額)	(22,341円)

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

###### (1)株式

該当事項はありません。

###### (2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	291	30,904,200	
	サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	280	30,604,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	941	555,190,000	
	MCUBS MidCity投資法人 投資証券	3,193	331,114,100	
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	3,249	496,122,300	
	産業ファンド投資法人 投資証券	3,477	464,527,200	
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	2,761	868,334,500	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	1,751	323,759,900	
	アクティブア・プロパティーズ投資法人 投資証券	1,488	706,056,000	
	GLP投資法人 投資証券	7,021	855,157,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,175	358,375,000	
	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	3,800	921,500,000	
	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	431	234,464,000	
	Oneリート投資法人 投資証券	413	114,979,200	
	イオンリート投資法人 投資証券	2,908	397,814,400	
ヒューリックリート投資法人 投資証券	2,290	421,131,000		

日本リート投資法人 投資証券	915	393,450,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	17,268	302,190,000	
日本ヘルスケア投資法人 投資証券	130	22,659,000	
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	8,285	661,143,000	
トーセイ・リート投資法人 投資証券	545	63,983,000	
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1,038	275,381,400	
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	593	72,642,500	
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	567	61,462,800	
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	8,815	1,458,001,000	
いちごホテルリート投資法人 投資証券	495	63,261,000	
ラサールロジポート投資法人 投資証券	2,341	297,775,200	
スターアジア不動産投資法人 投資証券	880	102,256,000	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	244	29,109,200	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	688	247,680,000	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	457	38,662,200	
さくら総合リート投資法人 投資証券	613	56,334,700	
投資法人みらい 投資証券	3,052	149,853,200	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	665	92,501,500	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	300	82,110,000	
CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	284	33,909,600	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	261	32,677,200	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	424	41,424,800	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	438	43,843,800	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	2,744	2,082,696,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	2,833	1,861,281,000	
日本リテールファンド投資法人 投資証券	5,355	1,167,925,500	
オリックス不動産投資法人 投資証券	5,645	1,116,581,000	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	1,793	868,708,500	
プレミアム投資法人 投資証券	2,694	367,192,200	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	1,900	356,060,000	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	1,960	261,856,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	6,249	1,126,069,800	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	2,025	355,185,000	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	9,775	580,635,000	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	964	456,936,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	1,764	222,793,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	1,851	459,418,200	
福岡リート投資法人 投資証券	1,465	256,521,500	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	876	672,768,000	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	2,351	238,626,500	

大和証券オフィス投資法人 投資証券	654	506,850,000	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	1,275	189,592,500	
スターツプロシード投資法人 投資証券	441	76,910,400	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	3,801	974,196,300	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	9,120	793,440,000	
日本賃貸住宅投資法人 投資証券	3,187	267,070,600	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	2,537	409,218,100	
合計	158,026	27,400,876,000	

(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。

## 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

	2018年12月17日現在	2019年 6月17日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	106,936,783	1,295,750,099
金銭信託	-	376,949
コール・ローン	19,284,339	9,095,954
投資証券	6,227,397,430	25,013,611,804
派生商品評価勘定	-	1,920
未収入金	2,596	306,740
未収配当金	10,066,905	40,037,873
流動資産合計	6,363,688,053	26,359,181,339
資産合計	6,363,688,053	26,359,181,339
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	37,907
未払金	-	1,205,815,163
未払解約金	14,763,479	1,465,371
未払利息	23	14
流動負債合計	14,763,502	1,207,318,455
負債合計	14,763,502	1,207,318,455
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,092,199,662	11,583,284,463
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	3,256,724,889	13,568,578,421
元本等合計	6,348,924,551	25,151,862,884
純資産合計	6,348,924,551	25,151,862,884
負債純資産合計	6,363,688,053	26,359,181,339

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

		2018年12月17日現在	2019年 6月17日現在
1.	期首	2018年 6月16日	2018年12月18日
	期首元本額	3,296,876,765円	3,092,199,662円
	期首からの追加設定元本額	63,615,267円	8,731,249,790円
	期首からの一部解約元本額	268,292,370円	240,164,989円
	元本の内訳		
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,561,615,589円	2,421,174,254円
	インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）	53,499,501円	44,221,444円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	40,780,584円	8,716,439,955円
	海外先進国REITインデックスファンド（適格機関投資家向け）	436,303,988円	401,448,810円
	計	3,092,199,662円	11,583,284,463円
2.	受益権の総数	3,092,199,662口	11,583,284,463口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

	自 2018年 6月16日 至 2018年12月17日	自 2018年12月18日 至 2019年 6月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、為替予約取引があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	2018年12月17日現在	2019年 6月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 同左

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

(有価証券に関する注記)

(2018年12月17日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	14,434,764
合計	14,434,764

(2019年 6月17日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	908,397,581
合計	908,397,581

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(2018年12月17日現在)

該当事項はありません。

(2019年 6月17日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益



市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	231,318,387	-	231,282,400	35,987
	米ドル	130,378,080	-	130,380,000	1,920
	加ドル	24,298,410	-	24,297,000	1,410
	ニュージーランドドル	2,825,372	-	2,824,400	972
	香港ドル	32,603,665	-	32,571,000	32,665
	シンガポールドル	41,212,860	-	41,210,000	2,860
	合計	231,318,387	-	231,282,400	35,987

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

2018年12月17日現在		2019年 6月17日現在	
1口当たり純資産額	2.0532円	1口当たり純資産額	2.1714円
(1万口当たり純資産額)	(20,532円)	(1万口当たり純資産額)	(21,714円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ACADIA REALTY TRUST	15,388	433,633.84	
		AGREE REALTY CORPORATION	7,056	477,267.84	
		ALEXANDER'S INC	702	271,266.84	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	21,078	3,189,101.40	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	6,924	327,159.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	25,662	1,206,114.00	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	11,229	120,936.33	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	48,204	1,191,602.88	
		AMERICOLD REALTY TRUST	34,529	1,141,183.45	
		APARTMENT INVT&MGMT CO -A	29,133	1,489,570.29	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	40,123	632,338.48	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	16,393	59,834.45	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	25,917	5,393,068.53	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,737	45,030.85	
		BOSTON PROPERTIES INC	28,900	3,907,280.00	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	5,173	52,143.84	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	33,036	502,807.92	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	55,958	1,018,435.60	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	18,884	349,920.52	
		BRT APARTMENTS CORP	1,202	15,565.90	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	18,074	1,918,735.84	
		CARETRUST REIT INC	17,772	432,925.92	
		CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	22,130	24,343.00	
		CEDAR REALTY TRUST INC	14,008	39,922.80	
		CHATHAM LODGING TRUST	8,216	157,418.56	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	10,889	314,147.65	
		CITY OFFICE REIT INC	7,856	96,471.68	
		CLIPPER REALTY INC	2,104	27,267.84	
		COLONY CAPITAL INC-A	92,292	470,689.20	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	21,804	476,635.44	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,342	125,893.14	
		CORECIVIC INC	22,207	528,526.60	

CORESITE REALTY CORP	6,850	787,339.00	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST	20,620	588,701.00	
COUSINS PROPERTIES INC	78,414	763,752.36	
CUBESMART	34,862	1,184,610.76	
CYRUSONE INC	20,239	1,192,279.49	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	38,021	379,449.58	
DIGITAL REALTY TRUST INC	38,868	4,654,831.68	
DOUGLAS EMMETT INC	30,251	1,249,063.79	
DUKE REALTY CORPORATION	67,141	2,131,726.75	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	12,822	238,232.76	
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,804	785,249.64	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	26,584	403,279.28	
EPR PROPERTIES	14,032	1,094,496.00	
EQUITY COMMONWEALTH	22,736	768,249.44	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	16,842	2,088,913.26	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	69,193	5,415,044.18	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	9,088	193,756.16	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	12,296	3,678,840.24	
EXTRA SPACE STORAGE INC	23,815	2,573,448.90	
FARMLAND PARTNERS INC	5,026	32,467.96	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	13,921	1,853,441.94	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	23,598	863,450.82	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	13,032	371,802.96	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	20,377	156,291.59	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	9,381	114,729.63	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	37,747	1,501,575.66	
GEO GROUP INC/THE	22,568	524,480.32	
GETTY REALTY CORPORATION	6,129	191,469.96	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	5,813	123,816.90	
GLADSTONE LAND CORP	2,077	25,443.25	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	4,094	44,624.60	
GLOBAL NET LEASE INC	15,301	299,746.59	
HCP INC	89,476	2,873,969.12	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	23,486	765,173.88	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	38,473	1,109,946.05	

HERSHA HOSPITALITY TRUST	6,967	117,742.30	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	19,354	856,027.42	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	30,727	754,040.58	
HOST HOTELS & RESORTS INC	138,382	2,533,774.42	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	28,835	984,138.55	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	17,095	203,772.40	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	12,421	241,961.08	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	1,820	197,433.60	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,129	127,782.58	
INVITATION HOMES INC	71,115	1,942,150.65	
IRON MOUNTAIN INC	53,559	1,699,427.07	
JBG SMITH PROPERTIES	22,319	908,383.30	
KILROY REALTY CORPORATION	18,869	1,459,705.84	
KIMCO REALTY CORPORATION	78,939	1,478,527.47	
KITE REALTY GROUP TRUST	15,878	254,206.78	
LEXINGTON REALTY TRUST	40,073	376,686.20	
LIBERTY PROPERTY TRUST	27,657	1,389,487.68	
LIFE STORAGE INC	8,729	856,402.19	
LTC PROPERTIES INC	7,204	329,583.00	
MACERICH CO/THE	19,809	684,004.77	
MACK-CALI REALTY CORPORATION	17,106	411,912.48	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	261,333	227,359.71	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	71,360	1,287,334.40	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	21,327	2,512,107.33	
MONMOUTH RE INVST CORP	17,479	240,161.46	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	30,279	1,673,823.12	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	10,993	328,250.98	
NATL HEALTH INVESTORS INC	8,007	629,670.48	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	15,223	101,385.18	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,961	160,182.84	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	9,116	145,856.00	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	9,358	224,404.84	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	39,630	1,446,891.30	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,417	74,927.00	
PARAMOUNT GROUP INC	37,685	556,230.60	

PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	37,568	1,058,290.56	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	24,350	694,218.50	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	12,653	83,383.27	
PHYSICIANS REALTY TRUST	34,205	619,794.60	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	23,509	485,460.85	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	7,772	118,911.60	
PROLOGIS INC	117,869	9,424,805.24	
PS BUSINESS PARKS INC	3,734	636,273.60	
PUBLIC STORAGE	28,076	6,831,171.56	
QTS REALTY TRUST INC-CL-A	10,300	472,667.00	
REALTY INCOME CORP	56,855	4,165,765.85	
REGENCY CENTERS CORP	31,364	2,160,038.68	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	21,869	377,458.94	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	40,001	489,612.24	
RETAIL VALUE INC	2,964	102,495.12	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	19,380	775,200.00	
RLJ LODGING TRUST	32,698	578,754.60	
RPT REALTY	15,392	195,632.32	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	9,581	761,976.93	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	33,379	648,553.97	
SAFEHOLD INC	1,128	33,298.56	
SAUL CENTERS INC	2,281	130,017.00	
SENIOR HOUSING PROPERTIES TRUST	45,253	362,929.06	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	5,395	231,607.35	
SIMON PROPERTY GROUP INC	57,804	9,417,427.68	
SITE CENTERS CORP	27,561	369,868.62	
SL GREEN REALTY CORP	15,644	1,369,475.76	
SPIRIT MTA REIT	6,663	57,368.43	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	16,063	719,140.51	
STAG INDUSTRIAL INC	23,182	721,655.66	
STORE CAPITAL CORP	36,954	1,299,672.18	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	19,999	232,988.35	
SUN COMMUNITIES INC	16,167	2,087,483.04	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	42,538	579,367.56	
TANGER FACTORY OUTLET CENTERS INC	17,121	277,531.41	

		TAUBMAN CENTERS INC	11,451	501,553.80	
		TERRENO REALTY CORP	11,374	539,696.30	
		TIER REIT INC	9,913	286,287.44	
		UDR INC	51,589	2,395,793.16	
		UMH PROPERTIES INC	5,648	75,344.32	
		UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	2,311	203,737.76	
		URBAN EDGE PROPERTIES	22,824	397,822.32	
		URSTADT BIDDLE PROPERTIES- CL A	5,725	122,515.00	
		VENTAS INC	66,679	4,451,490.04	
		VEREIT INC	181,182	1,726,664.46	
		VICI PROPERTIES INC	67,326	1,530,319.98	
		VORNADO REALTY TRUST	32,444	2,147,792.80	
		WASHINGTON PRIME GROUP INC	34,515	137,024.55	
		WASHINGTON REIT	15,081	413,521.02	
		WEINGARTEN REALTY INVESTORS	22,418	637,343.74	
		WELLTOWER INC	72,314	5,949,995.92	
		WHITESTONE REIT	7,847	99,735.37	
		WP CAREY INC	31,828	2,721,294.00	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	21,043	444,638.59	
米ドル小計			4,297,838	168,229,537.90	(18,279,821,588)
加ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	10,286	496,196.64	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,381	172,284.38	
		BOARDWALK EQUITIES INC	4,112	169,455.52	
		CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	13,936	676,732.16	
		CHOICE PROPERTIES REIT	28,101	390,884.91	
		COMINAR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,049	213,112.50	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,002	138,000.66	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	9,582	138,939.00	
		DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	18,353	250,885.51	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	11,680	143,664.00	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,513	132,036.35	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,369	266,814.83	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	26,674	606,300.02	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	9,305	133,526.75	

		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,751	171,869.64	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,778	35,151.06	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	2,635	48,484.00	
		NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	5,750	156,285.00	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	11,925	146,677.50	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28,146	755,438.64	
		SLATE OFFICE REIT	4,643	28,043.72	
		SLATE RETAIL REIT	4,881	61,842.27	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,891	438,551.82	
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	16,334	213,158.70	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	3,041	20,222.65	
加ドル小計			283,118	6,004,558.23	(486,369,216)
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	4,671	393,298.20	
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	29,976	431,354.64	
		ALTAREA	633	113,940.00	
		BEFIMMO S.C.A.	4,421	229,449.90	
		COFINIMMO	4,031	453,890.60	
		COVIVIO	11,719	1,112,719.05	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	7,386	177,116.28	
		GECINA SA	10,290	1,378,860.00	
		GREEN REIT PLC	126,517	221,657.78	
		HAMBORNER REIT AG	15,433	138,742.67	
		HIBERNIA REIT PLC	127,042	174,047.54	
		ICADE	8,466	677,280.00	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	9,300	55,614.00	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	51,819	526,999.23	
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	4,403	111,175.75	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	68,531	111,431.40	
		KLEPIERRE	38,931	1,153,525.53	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	12,012	82,882.80	
		MERCIALYS	9,818	112,710.64	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	69,165	846,579.60	
		MONTEA	1,857	143,360.40	
		NSI NV	3,807	141,049.35	

		RETAIL ESTATES	1,374	110,881.80
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	25,775	3,501,533.75
		VASTNED RETAIL	3,478	102,079.30
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	3,266	468,997.60
		WERELDHAVE NV	7,719	179,852.70
ユーロ小計			661,840	13,151,030.51 (1,602,716,088)
英ポンド	投資証券	ASSURA PLC	456,026	290,488.56
		BIG YELLOW GROUP PLC	29,761	304,455.03
		BRITISH LAND COMPANY PLC	180,510	973,309.92
		CAPITAL & REGIONAL PLC	56,053	8,307.05
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	112,390	86,203.13
		DERWENT LONDON PLC	20,776	665,663.04
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	104,311	94,610.07
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	51,442	366,678.57
		HAMMERSON PLC	144,149	407,220.92
		HANSTEEN HOLDINGS PLC	80,508	77,931.74
		INTU PROPERTIES PLC	159,307	136,812.85
		LAND SECURITIES GROUP PLC	140,692	1,184,063.87
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	135,242	278,057.55
		LXI REIT PLC	59,005	74,818.34
		LXI REIT PLC(N)	11,935	15,133.58
		NEWRIVER REIT PLC	56,041	105,693.32
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	102,938	97,996.97
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	219,315	304,409.22
		RDI REIT PLC	40,908	41,153.44
		REGIONAL REIT LTD	52,257	57,064.64
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	37,788	248,078.22
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	90,135	50,746.00
		SEGRO PLC	202,890	1,458,779.10
		SHAFTESBURY PLC	43,502	356,063.87
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	69,001	58,512.84
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	320,438	480,977.43
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	132,728	119,189.74
		UNITE GROUP PLC	49,207	467,466.50



		WORKSPACE GROUP PLC	23,818	207,216.60
英ポンド小計			3,183,073	9,017,102.11 (1,233,088,713)
豪ドル	投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	60,865	256,241.65
		APN INDUSTRIA REIT	18,236	53,978.56
		ARENA REIT	58,575	168,110.25
		BWP TRUST	95,074	358,428.98
		CHARTER HALL EDUCATION TRUST	48,367	185,729.28
		CHARTER HALL GROUP	86,905	1,001,145.60
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	47,336	244,253.76
		CHARTER HALL RETAIL REIT	65,075	309,106.25
		CROMWELL PROPERTY GROUP	318,690	382,428.00
		DEXUS	203,235	2,772,125.40
		GDI PROPERTY GROUP	103,966	147,111.89
		GOODMAN GROUP	300,159	4,397,329.35
		GPT GROUP	337,697	2,083,590.49
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	53,279	230,165.28
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	30,312	105,788.88
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	45,713	145,824.47
		MIRVAC GROUP	741,793	2,381,155.53
		NATIONAL STORAGE REIT	127,708	235,621.26
		RURAL FUNDS GROUP	61,071	141,684.72
		SCENTRE GROUP	997,440	3,750,374.40
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	164,259	428,715.99		
STOCKLAND	455,920	1,987,811.20		
VICINITY CENTRES	604,615	1,559,906.70		
VIVA ENERGY REIT	89,957	243,783.47		
豪ドル小計			5,116,247	23,570,411.36 (1,761,416,840)
ニュー ジーラン ドル	投資証券	GOODMAN PROPERTY TRUST	237,665	447,998.52
		STRIDE STAPLED GROUP	117,219	253,193.04
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	101,487	243,061.36
ニュージーランドドル小計			456,371	944,252.92 (66,683,141)
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	365,000	2,379,800.00

		FORTUNE REIT	272,000	2,877,760.00	
		LINK REIT	394,800	37,841,580.00	
		PROSPERITY REIT	237,000	786,840.00	
		RREEF CHINA COMMERCIAL TRUST	201,000	874,350.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	204,000	1,199,520.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	271,000	1,439,010.00	
香港ドル小計			1,944,800	47,398,860.00	(657,422,188)
シンガ ポールド ル	投資証券	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	119,325	168,248.25	
		ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	148,240	143,051.60	
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	478,313	1,425,372.74	
		ASCOTT RESIDENCE TRUST	223,542	290,604.60	
		CACHE LOGISTICS TRUST	223,758	172,293.66	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	519,350	1,069,861.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	525,400	1,366,040.00	
		CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	114,140	172,351.40	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	136,600	219,926.00	
		ESR REIT	339,418	191,771.17	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	157,900	102,635.00	
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	95,400	96,354.00	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	132,100	339,497.00	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST(N)	2,489	6,396.73	
		FRASERS COMMERCIAL TRUST	139,900	222,441.00	
		FRASERS HOSPITALITY TRUST	172,300	122,333.00	
		FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	302,110	362,532.00	
		KEPPEL DC REIT	172,154	282,332.56	
		KEPPEL REIT	330,800	416,808.00	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	347,000	79,810.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	353,640	714,352.80	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	253,360	544,724.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	438,844	693,373.52	
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	405,800	568,120.00			
QUE HOSPITALITY TRUST	239,426	168,795.33			
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	73,100	222,955.00			
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	135,900	59,796.00			

		SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	148,950	90,114.75	
		SPH REIT	128,500	136,210.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	272,600	205,813.00	
		SUNTEC REIT	422,400	798,336.00	
シンガポールドドル小計			7,552,759	11,453,250.11	(907,784,603)
韓国ウォン	投資証券	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	3,668	23,731,960.00	
韓国ウォン小計			3,668	23,731,960.00	(2,176,220)
イスラエルシェケル	投資証券	REIT 1 LTD	30,918	535,808.94	
イスラエルシェケル小計			30,918	535,808.94	(16,133,207)
合計				25,013,611,804	(25,013,611,804)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 156銘柄	100.0%	73.2%
加ドル	投資証券 25銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 27銘柄	100.0%	6.4%
英ポンド	投資証券 29銘柄	100.0%	4.9%
豪ドル	投資証券 24銘柄	100.0%	7.0%
ニュージーランドドル	投資証券 3銘柄	100.0%	0.3%
香港ドル	投資証券 7銘柄	100.0%	2.6%
シンガポールドドル	投資証券 31銘柄	100.0%	3.6%
韓国ウォン	投資証券 1銘柄	100.0%	0.0%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

#### 日本債券インデックスマザーファンド

#### 貸借対照表

（単位：円）

	2018年12月17日現在	2019年 6月17日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	5,591,970
コール・ローン	48,249,289	134,936,982
国債証券	30,146,760,100	31,303,086,934
地方債証券	2,790,346,000	3,075,030,000
特殊債券	3,106,031,000	2,863,632,022
社債券	2,561,108,000	2,866,012,000
未収利息	130,641,791	129,111,416
前払費用	1,238,161	3,500,791
流動資産合計	38,784,374,341	40,380,902,115
資産合計	38,784,374,341	40,380,902,115
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	19,501,454	2,474,426
未払利息	59	209
流動負債合計	19,501,513	2,474,635
負債合計	19,501,513	2,474,635
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	27,747,010,635	28,211,704,088
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	11,017,862,193	12,166,723,392
元本等合計	38,764,872,828	40,378,427,480
純資産合計	38,764,872,828	40,378,427,480
負債純資産合計	38,784,374,341	40,380,902,115

#### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券</p>
-----------------	---

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

## （貸借対照表に関する注記）

		2018年12月17日現在	2019年 6月17日現在
1.	期首	2018年 6月16日	2018年12月18日
	期首元本額	27,104,380,312円	27,747,010,635円
	期首からの追加設定元本額	1,665,424,610円	1,727,463,261円
	期首からの一部解約元本額	1,022,794,287円	1,262,769,808円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	1,919,669,079円	2,302,079,218円
	DCインデックスバランス（株式40）	1,928,551,989円	2,128,302,268円
	DCインデックスバランス（株式60）	1,379,531,765円	1,508,535,470円
	DCインデックスバランス（株式80）	220,581,528円	234,512,858円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	1,838,200,141円	1,897,346,809円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	3,798,566,813円	3,615,640,173円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	1,514,625,168円	1,482,831,594円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	4,673,801円	4,159,027円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	25,074,033円	24,933,474円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	121,692,397円	120,944,820円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	289,085,704円	283,137,318円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	4,841,643,615円	4,471,966,482円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	1,228,933,171円	1,255,544,051円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,233,447,583円	1,251,416,227円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	664,770,240円	665,963,180円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	101,132,380円	98,783,487円
	インデックスファンド日本債券（1年決算型）	6,368,421,761円	6,575,211,086円
	日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	268,409,467円	290,396,546円
	計	27,747,010,635円	28,211,704,088円
2.	受益権の総数	27,747,010,635口	28,211,704,088口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2018年 6月16日 至 2018年12月17日	自 2018年12月18日 至 2019年 6月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2018年12月17日現在	2019年 6月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

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

(有価証券に関する注記)

(2018年12月17日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	224,792,530
地方債証券	1,709,000
特殊債券	344,000
社債券	1,007,000
合計	223,746,530

(2019年 6月17日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	1,002,650,118
地方債証券	13,567,000
特殊債券	9,521,978
社債券	4,319,000
合計	975,242,140

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2018年12月17日現在		2019年 6月17日現在	
1口当たり純資産額	1.3971円	1口当たり純資産額	1.4313円
(1万口当たり純資産額)	(13,971円)	(1万口当たり純資産額)	(14,313円)

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第1 2 3 回利付国債(5年)	340,000,000	340,649,904	
	第1 2 4 回利付国債(5年)	560,000,000	561,579,200	
	第1 2 5 回利付国債(5年)	325,000,000	326,166,750	
	第1 2 6 回利付国債(5年)	220,000,000	220,963,600	
	第1 回利付国債(40年)	70,000,000	109,055,100	
	第2 回利付国債(40年)	145,000,000	219,653,250	
	第3 回利付国債(40年)	50,000,000	76,532,000	
	第4 回利付国債(40年)	95,000,000	146,691,400	
	第5 回利付国債(40年)	35,000,000	52,431,750	
	第6 回利付国債(40年)	70,000,000	103,534,200	
	第7 回利付国債(40年)	50,000,000	71,245,500	
	第8 回利付国債(40年)	95,000,000	126,899,100	
	第9 回利付国債(40年)	160,000,000	160,256,000	
	第1 0 回利付国債(40年)	125,000,000	146,945,000	
	第1 1 回利付国債(40年)	140,000,000	159,861,800	
	第3 0 8 回利付国債(10年)	140,000,000	142,086,000	
	第3 0 9 回利付国債(10年)	134,000,000	135,727,260	
	第3 1 0 回利付国債(10年)	78,000,000	79,164,540	
	第3 1 1 回利付国債(10年)	23,000,000	23,285,430	
	第3 1 2 回利付国債(10年)	205,000,000	209,305,000	
	第3 1 3 回利付国債(10年)	370,000,000	379,731,000	
	第3 1 5 回利付国債(10年)	65,000,000	66,831,700	
	第3 1 6 回利付国債(10年)	35,000,000	35,915,950	
	第3 1 7 回利付国債(10年)	105,000,000	108,106,950	
	第3 1 8 回利付国債(10年)	185,000,000	190,054,200	
	第3 1 9 回利付国債(10年)	5,000,000	5,164,400	
第3 2 0 回利付国債(10年)	190,000,000	195,768,400		
第3 2 1 回利付国債(10年)	175,000,000	180,864,250		



第3 2 2 回利付国債(10年)	75,000,000	77,305,500	
第3 2 3 回利付国債(10年)	45,000,000	46,517,400	
第3 2 4 回利付国債(10年)	25,000,000	25,767,500	
第3 2 5 回利付国債(10年)	210,000,000	216,990,900	
第3 2 6 回利付国債(10年)	30,000,000	30,975,300	
第3 2 7 回利付国債(10年)	65,000,000	67,342,600	
第3 2 8 回利付国債(10年)	115,000,000	118,590,300	
第3 2 9 回利付国債(10年)	230,000,000	239,526,600	
第3 3 0 回利付国債(10年)	210,000,000	219,252,600	
第3 3 1 回利付国債(10年)	80,000,000	82,836,800	
第3 3 3 回利付国債(10年)	210,000,000	218,374,800	
第3 3 4 回利付国債(10年)	120,000,000	125,042,400	
第3 3 5 回利付国債(10年)	490,000,000	509,031,600	
第3 3 6 回利付国債(10年)	80,000,000	83,256,800	
第3 3 7 回利付国債(10年)	30,000,000	30,886,800	
第3 3 8 回利付国債(10年)	390,000,000	404,207,700	
第3 3 9 回利付国債(10年)	370,000,000	384,074,800	
第3 4 0 回利付国債(10年)	420,000,000	436,657,200	
第3 4 1 回利付国債(10年)	700,000,000	724,262,000	
第3 4 2 回利付国債(10年)	130,000,000	132,896,400	
第3 4 3 回利付国債(10年)	245,000,000	250,666,850	
第3 4 4 回利付国債(10年)	50,000,000	51,198,500	
第3 4 5 回利付国債(10年)	610,000,000	624,896,200	
第3 4 6 回利付国債(10年)	490,000,000	502,166,700	
第3 4 7 回利付国債(10年)	160,000,000	163,971,200	
第3 4 8 回利付国債(10年)	90,000,000	92,227,500	
第3 4 9 回利付国債(10年)	490,000,000	502,068,700	
第3 5 0 回利付国債(10年)	480,000,000	491,731,200	
第3 5 1 回利付国債(10年)	435,000,000	445,535,700	
第3 5 2 回利付国債(10年)	390,000,000	399,149,400	
第3 5 3 回利付国債(10年)	200,000,000	204,624,000	
第1 4 回利付国債(30年)	208,000,000	279,177,600	
第1 5 回利付国債(30年)	147,000,000	200,043,480	
第1 6 回利付国債(30年)	35,000,000	47,766,950	
第1 8 回利付国債(30年)	110,000,000	147,532,000	
第2 1 回利付国債(30年)	20,000,000	27,057,000	
第2 2 回利付国債(30年)	40,000,000	55,589,200	
第2 3 回利付国債(30年)	55,000,000	76,623,250	
第2 4 回利付国債(30年)	68,000,000	95,040,880	
第2 5 回利付国債(30年)	20,000,000	27,335,200	
第2 6 回利付国債(30年)	170,000,000	235,941,300	
第2 7 回利付国債(30年)	29,000,000	40,965,110	

第28回利付国債(30年)	94,000,000	133,561,780
第29回利付国債(30年)	276,000,000	388,955,760
第30回利付国債(30年)	147,000,000	205,464,840
第31回利付国債(30年)	120,000,000	166,238,400
第32回利付国債(30年)	50,000,000	70,641,000
第33回利付国債(30年)	135,000,000	183,425,850
第34回利付国債(30年)	200,000,000	281,332,000
第35回利付国債(30年)	168,000,000	230,230,560
第36回利付国債(30年)	135,000,000	185,861,250
第37回利付国債(30年)	131,000,000	178,116,770
第38回利付国債(30年)	95,000,000	127,586,900
第39回利付国債(30年)	75,000,000	102,675,750
第40回利付国債(30年)	90,000,000	121,348,800
第41回利付国債(30年)	40,000,000	53,086,800
第42回利付国債(30年)	135,000,000	179,583,750
第43回利付国債(30年)	235,000,000	312,982,400
第44回利付国債(30年)	100,000,000	133,496,000
第45回利付国債(30年)	60,000,000	77,242,200
第46回利付国債(30年)	100,000,000	128,996,000
第47回利付国債(30年)	115,000,000	151,429,700
第48回利付国債(30年)	105,000,000	133,112,700
第49回利付国債(30年)	90,000,000	114,308,100
第50回利付国債(30年)	25,000,000	27,957,000
第51回利付国債(30年)	70,000,000	69,307,000
第52回利付国債(30年)	90,000,000	93,708,900
第53回利付国債(30年)	105,000,000	112,007,700
第54回利付国債(30年)	110,000,000	123,143,900
第55回利付国債(30年)	110,000,000	123,253,900
第56回利付国債(30年)	50,000,000	56,001,500
第57回利付国債(30年)	100,000,000	112,100,000
第58回利付国債(30年)	100,000,000	112,048,000
第59回利付国債(30年)	170,000,000	185,667,200
第60回利付国債(30年)	120,000,000	137,698,800
第61回利付国債(30年)	70,000,000	76,449,800
第62回利付国債(30年)	70,000,000	72,536,100
第47回利付国債(20年)	21,000,000	21,632,520
第48回利付国債(20年)	99,000,000	103,031,280
第49回利付国債(20年)	57,000,000	59,308,500
第50回利付国債(20年)	237,000,000	245,761,890
第51回利付国債(20年)	39,000,000	40,729,650
第54回利付国債(20年)	15,000,000	15,909,000
第55回利付国債(20年)	66,000,000	70,043,160

第57回利付国債(20年)	52,000,000	55,326,440
第58回利付国債(20年)	135,000,000	144,366,300
第59回利付国債(20年)	33,000,000	35,239,050
第60回利付国債(20年)	295,000,000	311,888,750
第61回利付国債(20年)	27,000,000	28,251,990
第63回利付国債(20年)	31,000,000	33,530,530
第64回利付国債(20年)	54,000,000	58,932,360
第65回利付国債(20年)	100,000,000	109,650,000
第66回利付国債(20年)	34,000,000	37,126,300
第67回利付国債(20年)	34,000,000	37,462,220
第68回利付国債(20年)	78,000,000	87,066,720
第70回利付国債(20年)	104,000,000	117,790,400
第72回利付国債(20年)	112,000,000	125,820,800
第73回利付国債(20年)	113,000,000	126,983,750
第74回利付国債(20年)	118,000,000	133,259,760
第75回利付国債(20年)	10,000,000	11,348,500
第76回利付国債(20年)	21,000,000	23,587,200
第77回利付国債(20年)	40,000,000	45,161,200
第79回利付国債(20年)	160,000,000	181,561,600
第82回利付国債(20年)	60,000,000	68,809,800
第87回利付国債(20年)	130,000,000	151,461,700
第88回利付国債(20年)	300,000,000	353,538,000
第90回利付国債(20年)	16,000,000	18,841,760
第91回利付国債(20年)	250,000,000	296,245,000
第92回利付国債(20年)	60,000,000	70,543,800
第93回利付国債(20年)	60,000,000	70,395,600
第94回利付国債(20年)	50,000,000	59,056,500
第95回利付国債(20年)	82,000,000	98,597,620
第96回利付国債(20年)	98,000,000	116,242,700
第97回利付国債(20年)	45,000,000	53,999,550
第98回利付国債(20年)	94,000,000	112,011,340
第99回利付国債(20年)	117,000,000	139,984,650
第100回利付国債(20年)	30,000,000	36,301,500
第101回利付国債(20年)	66,000,000	81,035,460
第102回利付国債(20年)	81,000,000	99,900,540
第103回利付国債(20年)	11,000,000	13,466,310
第104回利付国債(20年)	33,000,000	39,796,020
第105回利付国債(20年)	77,000,000	93,176,930
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,438,940
第107回利付国債(20年)	130,000,000	157,904,500
第108回利付国債(20年)	134,000,000	160,183,600
第109回利付国債(20年)	27,000,000	32,382,450

第110回利付国債(20年)	98,000,000	119,470,820
第111回利付国債(20年)	25,000,000	30,858,000
第112回利付国債(20年)	80,000,000	97,936,000
第113回利付国債(20年)	290,000,000	356,305,600
第114回利付国債(20年)	52,000,000	64,113,400
第115回利付国債(20年)	55,000,000	68,395,800
第116回利付国債(20年)	55,000,000	68,638,900
第117回利付国債(20年)	293,000,000	362,476,160
第118回利付国債(20年)	10,000,000	12,302,600
第119回利付国債(20年)	30,000,000	36,242,100
第120回利付国債(20年)	70,000,000	83,010,900
第121回利付国債(20年)	22,000,000	26,902,480
第122回利付国債(20年)	17,000,000	20,595,500
第123回利付国債(20年)	195,000,000	243,662,250
第124回利付国債(20年)	180,000,000	222,834,600
第125回利付国債(20年)	50,000,000	63,300,500
第126回利付国債(20年)	105,000,000	130,447,800
第128回利付国債(20年)	65,000,000	80,211,950
第129回利付国債(20年)	50,000,000	61,098,000
第130回利付国債(20年)	170,000,000	208,273,800
第131回利付国債(20年)	12,000,000	14,553,960
第132回利付国債(20年)	35,000,000	42,547,750
第133回利付国債(20年)	30,000,000	36,845,700
第134回利付国債(20年)	50,000,000	61,556,500
第135回利付国債(20年)	30,000,000	36,550,800
第136回利付国債(20年)	180,000,000	217,006,200
第137回利付国債(20年)	200,000,000	244,218,000
第138回利付国債(20年)	120,000,000	143,409,600
第139回利付国債(20年)	150,000,000	181,212,000
第140回利付国債(20年)	458,000,000	560,477,500
第141回利付国債(20年)	195,000,000	239,128,500
第142回利付国債(20年)	85,000,000	105,380,450
第143回利付国債(20年)	94,000,000	114,213,760
第144回利付国債(20年)	130,000,000	156,174,200
第145回利付国債(20年)	205,000,000	252,570,250
第146回利付国債(20年)	135,000,000	166,650,750
第147回利付国債(20年)	60,000,000	73,341,000
第148回利付国債(20年)	90,000,000	108,873,000
第149回利付国債(20年)	215,000,000	260,459,600
第150回利付国債(20年)	90,000,000	107,825,400
第151回利付国債(20年)	200,000,000	233,772,000
第152回利付国債(20年)	90,000,000	105,272,100

	第153回利付国債(20年)	120,000,000	142,459,200	
	第154回利付国債(20年)	120,000,000	140,666,400	
	第155回利付国債(20年)	140,000,000	159,682,600	
	第156回利付国債(20年)	110,000,000	114,587,000	
	第157回利付国債(20年)	50,000,000	50,372,500	
	第158回利付国債(20年)	170,000,000	179,705,300	
	第159回利付国債(20年)	150,000,000	161,101,500	
	第160回利付国債(20年)	140,000,000	152,786,200	
	第161回利付国債(20年)	120,000,000	128,788,800	
	第162回利付国債(20年)	70,000,000	75,063,800	
	第163回利付国債(20年)	165,000,000	176,936,100	
	第164回利付国債(20年)	285,000,000	300,181,950	
	第165回利付国債(20年)	60,000,000	63,121,800	
	第166回利付国債(20年)	100,000,000	108,968,000	
	第167回利付国債(20年)	160,000,000	168,220,800	
	第168回利付国債(20年)	100,000,000	103,114,000	
国債証券 合計		27,507,000,000	31,303,086,934	
地方債証券	第690回東京都公募公債	100,000,000	101,924,000	
	第694回東京都公募公債	200,000,000	204,700,000	
	第708回東京都公募公債	100,000,000	102,647,000	
	第709回東京都公募公債	100,000,000	102,315,000	
	第712回東京都公募公債	200,000,000	204,920,000	
	第730回東京都公募公債	100,000,000	103,078,000	
	第731回東京都公募公債	100,000,000	102,940,000	
	平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	205,414,000	
	平成27年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	102,875,000	
	平成22年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	102,149,000	
	平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	102,971,000	
	平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	102,994,000	
	平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	102,448,000	
	第10回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	102,905,000	
	平成25年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	103,405,000	
	第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,888,000	
	第99回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,345,000	
	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	102,641,000	
	平成27年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	102,936,000	
	第486回名古屋市公募公債(10年)	200,000,000	206,440,000	
	第3回川崎市公募公債(15年)	100,000,000	102,735,000	
	第51回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	100,016,000	
	第53回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	100,060,000	
	平成27年度第1回相模原市公募公債	100,000,000	102,931,000	
	平成22年度第2回福井県公募公債	100,000,000	102,570,000	

	平成23年度第2回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	102,783,000	
地方債証券 合計		3,000,000,000	3,075,030,000	
特殊債券	第1回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	102,715,000	
	第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	103,740,000	
	第5回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,668,000	
	第6回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,621,022	
	第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,606,000	
	第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,821,000	
	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,331,000	
	第31回株式会社日本政策投資銀行無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,496,000	
	第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,828,000	
	第17回道路債券	100,000,000	105,255,000	
	第86回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,541,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,628,000	
	第123回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,202,000	
	第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,579,000	
	第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,740,000	
	F223回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,520,000	
	F290回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,446,000	
	第35回株式会社日本政策金融公庫社債(一般担保付)	100,000,000	102,352,000	
	第38回関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,713,000	
	第39回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	103,091,000	
	第17回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	102,419,000	
	第19回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,417,000	
	第316回信金中金債(5年)	100,000,000	100,062,000	
	第318回信金中金債(5年)	100,000,000	99,990,000	
	第320回信金中金債(5年)	100,000,000	99,925,000	
	第322回信金中金債(5年)	200,000,000	199,926,000	
特殊債券 合計		2,800,000,000	2,863,632,022	
社債券	第15回成田国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,286,000	
	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	100,256,000	
	第14回森永乳業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,833,000	
	第6回サントリーホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,338,000	
	第5回不二製油グループ本社株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	200,000,000	202,560,000	
	第21回味の素株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	200,000,000	200,996,000	
	第10回日本たばこ産業株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,926,000	

第6回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,388,000	
第28回東レ株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,663,000	
第13回株式会社オリエントランド無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,338,000	
第9回三菱UFJ信託銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	102,877,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,021,000	
第24回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	105,472,000	
第29回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	108,310,000	
第43回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,773,000	
第87回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	200,000,000	205,464,000	
第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,139,000	
第11回東京地下鉄株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,825,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券(一般担保付)	200,000,000	205,068,000	
第26回KDDI株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,139,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,971,000	
第299回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,645,000	
第34回東京瓦斯株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	200,000,000	204,724,000	
社債券 合計	2,800,000,000	2,866,012,000	
合計	36,107,000,000	40,107,760,956	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド

### 貸借対照表

(単位:円)

2018年12月17日現在

2019年 6月17日現在

資産の部

流動資産

	2018年12月17日現在	2019年 6月17日現在
預金	67,143,408	94,828,477
金銭信託	-	7,318,467
コール・ローン	52,624,512	176,598,186
国債証券	148,258,051,831	149,804,065,535
派生商品評価勘定	106,875	213
未収入金	57,695,456	-
未収利息	1,150,124,756	1,090,695,764
前払費用	33,317,263	30,099,791
流動資産合計	149,619,064,101	151,203,606,433
資産合計	149,619,064,101	151,203,606,433
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	23,400	-
未払金	-	34,172,372
未払解約金	83,949,704	146,582,715
未払利息	64	273
流動負債合計	83,973,168	180,755,360
負債合計	83,973,168	180,755,360
純資産の部		
元本等		
元本	65,916,864,942	66,086,660,783
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	83,618,225,991	84,936,190,290
元本等合計	149,535,090,933	151,022,851,073
純資産合計	149,535,090,933	151,022,851,073
負債純資産合計	149,619,064,101	151,203,606,433

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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



## （貸借対照表に関する注記）

		2018年12月17日現在	2019年 6月17日現在
1.	期首	2018年 6月16日	2018年12月18日
	期首元本額	67,242,519,709円	65,916,864,942円
	期首からの追加設定元本額	1,372,371,785円	1,565,296,955円
	期首からの一部解約元本額	2,698,026,552円	1,395,501,114円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外債券ヘッジなし（DC専用）	12,049,560,577円	12,380,930,497円
	DCインデックスバランス（株式20）	181,353,280円	221,896,387円
	DCインデックスバランス（株式40）	264,170,821円	296,317,162円
	DCインデックスバランス（株式60）	340,775,105円	377,241,873円
	DCインデックスバランス（株式80）	271,326,949円	293,744,767円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	24,033,221,813円	24,573,457,856円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,346,714,484円	2,264,049,892円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	19,084,036,256円	18,247,208,364円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	579,297,119円	765,999,672円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	158,267,081円	152,697,699円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	2,882,434円	2,616,785円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	3,108,404円	3,096,581円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	8,304,012円	8,353,354円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	13,720,899円	13,601,818円
	世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	869,785,431円	859,421,327円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	996,692,644円	931,279,414円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	58,454,940円	60,517,415円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	84,906,842円	87,024,232円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	82,333,858円	82,843,151円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	62,465,556円	61,533,798円
	インデックスファンド海外債券（ヘッジなし）1年決算型	4,170,586,316円	4,137,426,531円
	海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	254,900,121円	265,402,208円
	計	65,916,864,942円	66,086,660,783円
2.	受益権の総数	65,916,864,942口	66,086,660,783口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

	自 2018年 6月16日 至 2018年12月17日	自 2018年12月18日 至 2019年 6月17日
--	--------------------------------	--------------------------------

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

## 金融商品の時価等に関する事項

	2018年12月17日現在	2019年 6月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品            短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>(1)有価証券            同左</p> <p>(2)デリバティブ取引            同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品            同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2018年12月17日現在)

## 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	1,781,580,544
合計	1,781,580,544

（2019年 6月17日現在）

## 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	7,822,411,227
合計	7,822,411,227

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（2018年12月17日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	55,796,105	-	55,712,630	83,475
	米ドル	34,011,600	-	34,035,000	23,400
	ユーロ	21,784,505	-	21,677,630	106,875
	合計	55,796,105	-	55,712,630	83,475

（2019年 6月17日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外	為替予約取引				

の取引	買建	21,467,477	-	21,467,690	213
	米ドル	10,864,840	-	10,865,000	160
	ユーロ	10,602,637	-	10,602,690	53
合計		21,467,477	-	21,467,690	213

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

2018年12月17日現在		2019年 6月17日現在	
1口当たり純資産額	2.2685円	1口当たり純資産額	2.2852円
(1万口当たり純資産額)	(22,685円)	(1万口当たり純資産額)	(22,852円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-1.375%-20/05/31	2,440,000.00	2,424,511.70	

US TREASURY N/B-1.5%-20/05/31	5,100,000.00	5,073,603.52	
US TREASURY N/B-1.875%-20/06/30	3,510,000.00	3,504,447.07	
US TREASURY N/B-1.625%-20/06/30	4,000,000.00	3,983,671.88	
US TREASURY N/B-2.0%-20/07/31	5,370,000.00	5,369,475.56	
US TREASURY N/B-1.625%-20/07/31	4,000,000.00	3,982,968.76	
US TREASURY N/B-2.625%-20/07/31	620,000.00	624,238.25	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	4,810,000.00	5,180,144.41	
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	5,180,000.00	5,217,332.26	
US TREASURY N/B-1.5%-20/08/15	800,000.00	795,531.24	
US TREASURY N/B-2.125%-20/08/31	1,450,000.00	1,452,492.11	
US TREASURY N/B-1.375%-20/08/31	2,300,000.00	2,283,558.58	
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/31	2,800,000.00	2,821,333.48	
US TREASURY N/B-1.375%-20/09/15	4,750,000.00	4,716,044.91	
US TREASURY N/B-2.0%-20/09/30	6,000,000.00	6,002,929.20	
US TREASURY N/B-1.375%-20/09/30	3,700,000.00	3,671,960.95	
US TREASURY N/B-1.625%-20/10/15	2,000,000.00	1,991,328.12	
US TREASURY N/B-1.75%-20/10/31	2,000,000.00	1,994,414.06	
US TREASURY N/B-1.375%-20/10/31	1,290,000.00	1,280,047.85	
US TREASURY N/B-2.875%-20/10/31	4,550,000.00	4,606,430.46	
US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	3,500,000.00	3,532,743.90	
US TREASURY N/B-1.75%-20/11/15	1,400,000.00	1,396,199.22	
US TREASURY N/B-2.0%-20/11/30	2,000,000.00	2,001,875.00	
US TREASURY N/B-1.625%-20/11/30	1,120,000.00	1,114,968.74	
US TREASURY N/B-2.75%-20/11/30	3,400,000.00	3,439,312.50	
US TREASURY N/B-1.875%-20/12/15	2,400,000.00	2,397,984.38	
US TREASURY N/B-2.375%-20/12/31	3,000,000.00	3,020,331.90	
US TREASURY N/B-1.75%-20/12/31	2,000,000.00	1,994,687.50	
US TREASURY N/B-2.0%-21/01/15	1,900,000.00	1,902,449.10	
US TREASURY N/B-2.125%-21/01/31	2,400,000.00	2,408,109.36	
US TREASURY N/B-1.375%-21/01/31	2,000,000.00	1,982,890.62	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	4,510,000.00	4,636,226.78	
US TREASURY N/B-2.25%-21/02/15	2,500,000.00	2,513,916.00	
US TREASURY N/B-2.0%-21/02/28	2,370,000.00	2,373,980.65	
US TREASURY N/B-1.125%-21/02/28	2,000,000.00	1,974,140.62	
US TREASURY N/B-2.25%-21/03/31	340,000.00	342,164.81	

US TREASURY N/B-1.25%-21/03/31	1,270,000.00	1,255,935.74	
US TREASURY N/B-2.25%-21/04/30	4,180,000.00	4,209,145.46	
US TREASURY N/B-1.375%-21/04/30	2,000,000.00	1,981,875.00	
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	4,320,000.00	4,421,165.32	
US TREASURY N/B-2.625%-21/05/15	3,030,000.00	3,072,609.37	
US TREASURY N/B-1.375%-21/05/31	2,060,000.00	2,040,767.96	
US TREASURY N/B-2.625%-21/06/15	1,900,000.00	1,929,242.14	
US TREASURY N/B-2.125%-21/06/30	6,050,000.00	6,082,849.08	
US TREASURY N/B-1.125%-21/06/30	3,900,000.00	3,844,546.87	
US TREASURY N/B-2.625%-21/07/15	3,000,000.00	3,047,226.30	
US TREASURY N/B-2.25%-21/07/31	5,300,000.00	5,343,890.36	
US TREASURY N/B-1.125%-21/07/31	5,000,000.00	4,925,781.25	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	9,860,000.00	9,917,772.69	
US TREASURY N/B-1.125%-21/08/31	4,400,000.00	4,332,367.20	
US TREASURY N/B-2.75%-21/09/15	300,000.00	306,134.76	
US TREASURY N/B-2.125%-21/09/30	2,400,000.00	2,416,031.04	
US TREASURY N/B-1.125%-21/09/30	1,500,000.00	1,476,797.53	
US TREASURY N/B-2.0%-21/10/31	3,830,000.00	3,845,259.86	
US TREASURY N/B-1.25%-21/10/31	2,000,000.00	1,972,851.56	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	9,250,000.00	10,578,422.10	
US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	4,000,000.00	4,017,812.40	
US TREASURY N/B-1.75%-21/11/30	600,000.00	598,792.96	
US TREASURY N/B-2.125%-21/12/31	3,120,000.00	3,143,704.51	
US TREASURY N/B-1.5%-22/01/31	8,840,000.00	8,768,520.28	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,500,000.00	2,511,962.75	
US TREASURY N/B-1.75%-22/02/28	2,500,000.00	2,495,605.47	
US TREASURY N/B-2.375%-22/03/15	2,000,000.00	2,030,898.40	
US TREASURY N/B-1.75%-22/03/31	1,800,000.00	1,796,871.09	
US TREASURY N/B-2.25%-22/04/15	2,000,000.00	2,023,867.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/04/30	3,000,000.00	2,994,843.75	
US TREASURY N/B-1.875%-22/04/30	3,800,000.00	3,805,937.50	
US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	2,000,000.00	1,996,328.12	
US TREASURY N/B-1.875%-22/05/31	3,420,000.00	3,426,345.46	
US TREASURY N/B-2.125%-22/06/30	2,500,000.00	2,522,753.75	
US TREASURY N/B-2.0%-22/07/31	3,930,000.00	3,951,645.65	

US TREASURY N/B-1.875%-22/07/31	9,700,000.00	9,715,723.70	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	2,000,000.00	1,987,968.76	
US TREASURY N/B-1.875%-22/08/31	1,900,000.00	1,903,191.24	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/31	5,250,000.00	5,217,802.74	
US TREASURY N/B-1.75%-22/09/30	3,550,000.00	3,541,541.02	
US TREASURY N/B-1.875%-22/09/30	2,000,000.00	2,003,671.80	
US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	3,000,000.00	3,005,097.60	
US TREASURY N/B-2.0%-22/10/31	2,400,000.00	2,413,593.60	
US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	2,000,000.00	1,986,757.82	
US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	3,410,000.00	3,429,514.06	
US TREASURY N/B-2.125%-22/12/31	3,900,000.00	3,940,218.75	
US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	2,000,000.00	1,994,531.24	
US TREASURY N/B-2.375%-23/01/31	1,580,000.00	1,610,149.56	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	5,300,000.00	5,332,607.19	
US TREASURY N/B-1.5%-23/02/28	3,100,000.00	3,063,671.87	
US TREASURY N/B-2.625%-23/02/28	570,000.00	586,153.68	
US TREASURY N/B-1.5%-23/03/31	2,000,000.00	1,975,898.44	
US TREASURY N/B-2.5%-23/03/31	2,130,000.00	2,182,085.10	
US TREASURY N/B-1.625%-23/04/30	1,160,000.00	1,151,277.34	
US TREASURY N/B-2.75%-23/04/30	3,600,000.00	3,722,343.48	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	8,150,000.00	8,124,849.58	
US TREASURY N/B-1.625%-23/05/31	1,500,000.00	1,488,134.76	
US TREASURY N/B-2.75%-23/05/31	1,300,000.00	1,345,093.75	
US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	4,000,000.00	3,928,828.12	
US TREASURY N/B-2.625%-23/06/30	1,000,000.00	1,030,683.50	
US TREASURY N/B-1.25%-23/07/31	11,000,000.00	10,746,054.66	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,300,000.00	5,441,505.76	
US TREASURY N/B-1.375%-23/08/31	1,850,000.00	1,815,457.83	
US TREASURY N/B-1.375%-23/09/30	5,500,000.00	5,393,654.75	
US TREASURY N/B-2.875%-23/09/30	380,000.00	396,053.48	
US TREASURY N/B-1.625%-23/10/31	1,700,000.00	1,684,460.94	
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	4,153,281.20	
US TREASURY N/B-2.125%-23/11/30	2,910,000.00	2,944,726.48	
US TREASURY N/B-2.875%-23/11/30	1,810,000.00	1,889,717.64	
US TREASURY N/B-2.25%-23/12/31	2,500,000.00	2,543,261.50	

US TREASURY N/B-2.625%-23/12/31	3,000,000.00	3,100,898.40	
US TREASURY N/B-2.25%-24/01/31	2,000,000.00	2,035,000.00	
US TREASURY N/B-2.5%-24/01/31	5,800,000.00	5,966,070.24	
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	3,300,000.00	3,432,773.19	
US TREASURY N/B-2.125%-24/02/29	1,500,000.00	1,518,456.90	
US TREASURY N/B-2.375%-24/02/29	1,630,000.00	1,668,871.58	
US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	4,240,000.00	4,292,834.21	
US TREASURY N/B-2.0%-24/04/30	2,000,000.00	2,013,085.80	
US TREASURY N/B-2.25%-24/04/30	3,000,000.00	3,055,898.40	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	5,800,000.00	5,975,925.60	
US TREASURY N/B-2.0%-24/05/31	3,430,000.00	3,455,122.00	
US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	4,100,000.00	4,127,466.72	
US TREASURY N/B-2.125%-24/07/31	3,180,000.00	3,219,750.00	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,733,604.87	
US TREASURY N/B-1.875%-24/08/31	1,420,000.00	1,420,443.75	
US TREASURY N/B-2.125%-24/09/30	2,400,000.00	2,429,718.72	
US TREASURY N/B-2.25%-24/10/31	1,090,000.00	1,110,543.88	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	5,450,000.00	5,552,506.32	
US TREASURY N/B-2.125%-24/11/30	1,200,000.00	1,214,695.20	
US TREASURY N/B-2.25%-24/12/31	1,900,000.00	1,935,699.10	
US TREASURY N/B-2.5%-25/01/31	1,500,000.00	1,548,251.85	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,970,000.00	4,996,596.95	
US TREASURY N/B-2.75%-25/02/28	2,060,000.00	2,154,269.10	
US TREASURY N/B-2.625%-25/03/31	4,400,000.00	4,572,905.92	
US TREASURY N/B-2.875%-25/04/30	2,200,000.00	2,317,433.58	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	4,856,905.92	
US TREASURY N/B-2.875%-25/05/31	1,150,000.00	1,211,969.70	
US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	4,000,000.00	4,189,374.80	
US TREASURY N/B-2.875%-25/07/31	4,000,000.00	4,219,296.80	
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	5,220,000.00	5,242,531.60	
US TREASURY N/B-3.0%-25/09/30	5,000,000.00	5,315,136.50	
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	5,940,000.00	6,049,286.49	
US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,100,000.00	1,162,068.27	
US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,250,000.00	1,302,319.23	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	2,252,671.74	



US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	5,700,000.00	5,582,214.85	
US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,370,000.00	1,417,173.89	
US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	2,070,000.00	2,108,691.19	
US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	2,000,000.00	2,053,945.20	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	3,400,000.00	3,325,226.55	
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,872,970.48	
US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,450,000.00	3,209,069.29	
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	5,040,000.00	5,046,300.00	
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	4,800,000.00	4,888,124.64	
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,030,000.00	3,112,614.76	
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	5,090,000.00	5,178,279.43	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	3,860,000.00	5,076,578.20	
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	6,100,000.00	6,201,626.61	
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	4,223,906.00	
US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	2,580,000.00	2,751,529.49	
US TREASURY N/B-5.5%-28/08/15	500,000.00	642,607.40	
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,800,000.00	5,121,749.76	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	2,000,000.00	2,539,843.60	
US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	3,300,000.00	3,593,648.19	
US TREASURY N/B-5.25%-29/02/15	1,000,000.00	1,275,664.00	
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	3,500,000.00	3,662,900.15	
US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	1,000,000.00	1,025,078.10	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,485,366.34	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	1,460,000.00	1,946,248.32	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	1,250,000.00	1,747,802.62	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	1,170,000.00	1,533,179.81	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	1,220,000.00	1,624,625.32	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,850,000.00	2,398,423.80	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,820,000.00	2,436,418.34	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	1,750,000.00	2,306,992.10	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	1,680,000.00	2,285,620.17	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	2,098,147.78	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	1,781,324.92	
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	2,010,000.00	2,612,882.21	
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	2,079,960.90	

		US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	1,150,812.85
		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	1,960,000.00	2,382,931.15
		US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	830,531.20
		US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	2,073,945.20
		US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	2,206,914.00
		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	5,050,000.00	5,343,432.27
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	5,120,000.00	6,116,800.00
		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	4,500,000.00	5,482,265.40
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	3,000,000.00	3,587,167.80
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	3,400,000.00	3,908,804.56
		US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	4,050,000.00	4,468,921.87
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	3,300,000.00	3,565,159.95
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	3,250,113.27
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	3,200,000.00	3,460,749.76
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	5,300,000.00	5,600,816.34
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	3,900,000.00	4,219,464.60
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	2,800,000.00	2,751,328.13
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	2,500,000.00	2,455,566.40
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	2,005,798.83
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	2,000,000.00	2,113,750.00
		US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	2,800,000.00	3,032,476.44
		US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	2,680,000.00	2,899,320.21
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	2,000,000.00	2,060,156.20
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	2,840,000.00	2,925,532.56
		US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	2,972,148.30
		US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	2,657,296.80
		US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	4,100,000.00	4,435,447.24
		US TREASURY N/B-3.375%-48/11/15	2,950,000.00	3,426,839.77
		US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	3,576,116.94
		US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	900,000.00	952,751.88
	米ドル小計		628,280,000.00	652,595,046.73 (70,910,977,777)
加ドル	国債証券	CANADA GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	450,950.20
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	1,150,000.00	1,170,205.50
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-20/08/01	690,000.00	692,187.30

		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-20/09/01	2,020,000.00	2,000,527.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-20/11/01	670,000.00	674,549.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-21/02/01	575,000.00	582,613.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/03/01	2,140,000.00	2,115,903.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-21/05/01	890,000.00	896,185.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	950,000.00	984,114.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/09/01	1,470,000.00	1,450,375.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-22/03/01	1,640,000.00	1,602,870.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	980,000.00	1,019,445.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-22/09/01	1,310,000.00	1,295,524.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-23/03/01	1,140,000.00	1,156,929.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,300,000.00	1,308,086.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-23/09/01	760,000.00	780,603.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-24/03/01	790,000.00	823,725.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,120,000.00	1,183,000.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-24/09/01	440,000.00	443,766.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	1,030,000.00	1,082,931.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	1,100,000.00	1,108,360.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	370,000.00	552,014.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	1,060,000.00	1,027,776.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	1,037,000.00	1,087,242.65	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	1,060,000.00	1,477,989.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	674,000.00	724,448.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	1,015,000.00	1,548,453.55	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	940,000.00	1,427,784.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	1,225,000.00	1,739,634.75	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,315,000.00	1,821,551.15	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	1,055,000.00	1,310,943.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	403,000.00	434,047.12	
			32,654,000.00	35,974,739.12	
				(2,913,953,868)	
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	24,300,000.00	24,328,674.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	24,700,000.00	24,153,309.96	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%- 21/12/09	5,600,000.00	5,542,670.56	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	21,400,000.00	20,750,083.07	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	16,100,000.00	16,355,178.56	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-24/09/05	2,800,000.00	2,851,803.08	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	21,500,000.00	23,861,122.47	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	10,650,000.00	9,631,839.76	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	20,200,000.00	20,079,448.42	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	11,650,000.00	12,329,199.66	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	11,900,000.00	11,918,347.42	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	7,000,000.00	6,990,505.20	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	7,800,000.00	9,405,471.27	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	9,400,000.00	9,968,390.27	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	15,500,000.00	15,211,705.42	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	7,670,000.00	7,708,765.33	
メキシコペソ小計			218,170,000.00	221,086,514.45	(1,253,560,536)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	1,438,000.00	1,517,990.47	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	1,285,000.00	1,428,678.54	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	1,080,000.00	1,219,321.08	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,250,000.00	1,450,116.25	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	1,080,000.00	1,201,660.92	
		BELGIUM KINGDOM-0.2%-23/10/22	490,000.00	504,194.32	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	1,200,000.00	1,381,729.20	
		BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	630,000.00	658,233.45	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,330,000.00	1,416,710.68	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	850,000.00	1,123,178.95	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	1,142,000.00	1,236,572.44	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	1,070,000.00	1,144,388.00	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,715,000.00	2,541,936.98	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	965,000.00	1,030,378.75	
		BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	550,000.00	590,550.60	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	750,000.00	809,650.50	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	660,000.00	961,465.56	

BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	320,000.00	354,119.68	
BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	590,000.00	801,490.81	
BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,475,000.00	2,461,196.80	
BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	320,000.00	358,993.28	
BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	530,000.00	636,265.53	
BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,370,000.00	2,295,643.24	
BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	815,000.00	1,341,123.25	
BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	870,000.00	989,397.06	
BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	340,000.00	390,538.96	
BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	345,000.00	444,315.15	
BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	386,000.00	489,666.39	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.15%- 20/07/30	1,180,000.00	1,200,840.57	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%- 20/10/31	1,790,000.00	1,919,434.18	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.05%- 21/01/31	770,000.00	775,148.06	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	2,080,000.00	2,308,233.82	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.75%- 21/07/30	1,725,000.00	1,765,741.91	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.05%- 21/10/31	200,000.00	201,772.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	1,790,000.00	2,080,092.77	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.4%- 22/04/30	1,630,000.00	1,663,004.72	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.45%- 22/10/31	1,420,000.00	1,453,563.12	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%- 23/01/31	1,675,000.00	2,017,180.39	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.35%- 23/07/30	1,290,000.00	1,317,319.62	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	1,750,000.00	2,099,210.92	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	1,330,000.00	1,634,198.93	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	1,680,000.00	2,000,780.71	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%-	200,000.00	203,308.22	

24/07/30			
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	1,820,000.00	2,093,847.93	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	1,900,000.00	2,078,037.78	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,750,000.00	2,244,498.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	1,690,000.00	1,912,657.66	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 26/04/30	1,585,000.00	1,780,384.53	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,750,000.00	2,459,439.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%- 26/10/31	1,760,000.00	1,901,020.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%- 27/04/30	1,415,000.00	1,551,208.18	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 27/10/31	1,705,000.00	1,864,702.23	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/04/30	1,740,000.00	1,897,708.38	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/07/30	1,720,000.00	1,871,408.16	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,455,000.00	2,086,726.08	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	2,110,000.00	3,219,984.49	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 29/04/30	1,360,000.00	1,484,712.79	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,630,000.00	1,865,507.12	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,700,000.00	2,774,879.23	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%- 33/07/30	1,450,000.00	1,734,587.71	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%- 35/07/30	630,000.00	705,737.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,560,000.00	2,352,146.16	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,420,000.00	2,388,484.02	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-	1,570,000.00	2,603,276.66	

41/07/30		
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	1,180,000.00	2,122,381.04
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%- 46/10/31	1,260,000.00	1,658,342.70
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%- 48/10/31	685,000.00	870,671.30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%- 66/07/30	560,000.00	832,503.84
BUNDESobligation-0.25%-20/10/16	1,000,000.00	1,012,335.00
BUNDESobligation-0.0%-21/04/09	1,200,000.00	1,215,278.40
BUNDESobligation-0.0%-21/10/08	740,000.00	752,190.76
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%- 20/07/04	2,720,000.00	2,824,102.56
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 20/09/04	1,520,000.00	1,574,133.28
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 21/01/04	1,410,000.00	1,481,340.78
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	1,730,000.00	1,870,664.57
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 21/09/04	1,580,000.00	1,684,547.33
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	2,000,000.00	2,139,450.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 22/07/04	2,470,000.00	2,656,862.91
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	1,600,000.00	1,714,992.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	1,900,000.00	2,054,065.30
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	1,720,000.00	1,868,692.28
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	1,850,000.00	2,058,356.25
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	790,000.00	1,041,998.15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	1,230,000.00	1,368,752.61
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	1,950,000.00	2,156,109.15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	1,830,000.00	1,983,962.84

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	1,770,000.00	1,879,162.44
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	2,540,000.00	2,785,915.18
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	2,760,000.00	2,949,278.59
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 26/08/15	2,800,000.00	2,896,558.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15	2,525,000.00	2,660,044.57
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,130,000.00	1,770,009.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 27/08/15	2,420,000.00	2,600,682.04
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,150,000.00	1,752,882.90
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 28/02/15	1,645,000.00	1,769,342.26
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	1,310,000.00	1,925,143.25
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 28/08/15	2,170,000.00	2,282,677.25
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 29/02/15	1,160,000.00	1,217,757.56
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	1,280,000.00	2,176,839.68
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,110,000.00	1,853,516.85
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,730,000.00	2,983,954.86
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	2,005,000.00	3,390,274.55
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,440,000.00	2,616,788.16
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,230,000.00	2,408,890.05
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	1,220,000.00	2,061,582.84
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,690,000.00	2,614,580.41
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	1,700,000.00	2,685,138.10



BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%- 48/08/15	500,000.00	629,752.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 20/06/15	400,000.00	401,460.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	2,550,000.00	2,670,059.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.2%- 20/10/15	380,000.00	380,519.08	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 20/11/01	1,180,000.00	1,188,262.36	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	2,000,000.00	2,116,870.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.05%- 21/04/15	1,170,000.00	1,163,502.99	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/05/01	1,200,000.00	1,274,419.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%- 21/06/01	1,620,000.00	1,621,801.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	2,700,000.00	2,882,309.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 21/09/01	2,270,000.00	2,474,971.92	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.3%- 21/10/15	880,000.00	913,374.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 21/11/01	770,000.00	765,596.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 21/12/15	1,060,000.00	1,097,412.91	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	1,950,000.00	2,166,260.85	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.2%- 22/04/01	1,390,000.00	1,402,437.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 22/04/15	970,000.00	982,017.33	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.0%- 22/07/15	600,000.00	599,929.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 22/08/01	1,270,000.00	1,266,232.86	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,800,000.00	2,051,384.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 22/09/15	1,310,000.00	1,327,544.83	

BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	2,000,000.00	2,288,250.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/01	910,000.00	902,100.29	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/15	1,200,000.00	1,189,665.42	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	1,365,000.00	1,532,017.85	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,700,000.00	1,934,967.54	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 23/10/01	960,000.00	1,002,963.84	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 23/10/15	380,000.00	370,229.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	2,190,000.00	2,896,509.33	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,650,000.00	1,874,730.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 24/05/15	995,000.00	1,012,339.86	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,500,000.00	1,659,987.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 24/11/15	1,050,000.00	1,041,950.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,400,000.00	1,464,128.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	2,900,000.00	3,419,540.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 25/05/15	675,000.00	666,763.65	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	1,400,000.00	1,385,034.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 25/11/15	1,300,000.00	1,355,408.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	2,060,000.00	2,090,170.76	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,430,000.00	1,670,115.59	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	1,230,000.00	1,214,719.71	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	1,560,000.00	2,127,718.32	

BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	1,470,000.00	1,412,820.91	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%- 27/06/01	860,000.00	875,544.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	1,035,000.00	1,040,448.24	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	2,880,000.00	3,859,899.84	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 28/02/01	1,035,000.00	1,035,277.38	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	1,690,000.00	2,069,786.94	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 28/12/01	1,435,000.00	1,512,337.89	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	2,870,000.00	3,633,072.73	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	1,740,000.00	1,922,008.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	2,680,000.00	3,642,444.28	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,485,000.00	1,360,519.47	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,740,000.00	2,351,622.18	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	610,000.00	600,588.92	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	2,080,000.00	2,662,316.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%- 35/03/01	550,000.00	590,835.35	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	900,000.00	845,343.78	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	2,710,000.00	3,138,716.58	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%- 38/09/01	680,000.00	682,311.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,850,000.00	2,389,386.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	1,820,000.00	2,338,536.38	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,310,000.00	1,653,309.60	

BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,320,000.00	1,356,393.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	1,270,000.00	1,184,603.85	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 48/03/01	1,135,000.00	1,194,948.43	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 49/09/01	785,000.00	867,071.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 67/03/01	680,000.00	607,158.40	
FINNISH GOVERNMENT-0.375%-20/09/15	300,000.00	303,693.90	
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	700,000.00	753,041.10	
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	300,000.00	321,496.50	
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	550,000.00	593,353.75	
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-23/09/15	250,000.00	255,349.75	
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	520,000.00	582,683.92	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	520,000.00	659,392.76	
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	320,000.00	344,182.40	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	410,000.00	431,477.03	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	345,000.00	362,814.41	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	477,721.18	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	420,000.00	441,131.88	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	200,000.00	209,112.00	
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	340,000.00	363,044.35	
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	330,000.00	368,333.79	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	355,000.00	521,041.41	
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	200,000.00	239,351.60	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	3,480,000.00	3,627,893.04	
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-20/11/25	2,450,000.00	2,480,899.40	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	3,900,000.00	4,218,953.70	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	3,920,000.00	4,280,055.92	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	3,770,000.00	4,161,220.44	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	2,750,000.00	3,013,371.62	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-23/03/25	180,000.00	183,694.68	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	960,000.00	1,299,234.72	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	3,160,000.00	3,447,970.80	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	3,930,000.00	4,757,732.67	

FRANCE (GOVT OF) -2.25%-24/05/25	3,140,000.00	3,562,157.30	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-24/11/25	3,678,000.00	4,111,088.17	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-25/05/25	3,410,000.00	3,580,523.87	
FRANCE (GOVT OF) -6.0%-25/10/25	2,980,000.00	4,184,423.62	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-25/11/25	3,245,000.00	3,515,873.13	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-26/04/25	3,430,000.00	4,329,682.14	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-26/05/25	3,000,000.00	3,153,030.00	
FRANCE (GOVT OF) -0.25%-26/11/25	2,960,000.00	3,054,749.00	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-27/05/25	3,910,000.00	4,261,912.90	
FRANCE (GOVT OF) -2.75%-27/10/25	3,730,000.00	4,630,720.40	
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/05/25	2,870,000.00	3,068,512.16	
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/11/25	2,920,000.00	3,116,676.60	
FRANCE (GOVT OF) -5.5%-29/04/25	2,745,000.00	4,223,984.04	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-29/05/25	1,670,000.00	1,737,346.09	
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-30/05/25	2,880,000.00	3,609,906.31	
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-31/05/25	3,965,000.00	4,548,219.78	
FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	2,520,000.00	4,323,246.48	
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-34/05/25	680,000.00	757,496.13	
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	2,670,000.00	4,429,973.22	
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-36/05/25	1,530,000.00	1,694,787.12	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	2,220,000.00	3,589,562.40	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-39/06/25	1,425,000.00	1,704,908.19	
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	2,605,000.00	4,598,121.97	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	2,030,000.00	3,147,718.00	
FRANCE (GOVT OF) -2.0%-48/05/25	1,740,000.00	2,187,505.38	
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-50/05/25	300,000.00	336,169.80	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	1,120,000.00	2,084,642.56	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	930,000.00	1,794,395.94	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-66/05/25	825,000.00	977,336.25	
IRISH TREASURY -5.0%-20/10/18	640,000.00	687,677.95	
IRISH TREASURY -0.8%-22/03/15	480,000.00	496,638.24	
IRISH TREASURY -0.0%-22/10/18	35,000.00	35,489.39	
IRISH TREASURY -3.9%-23/03/20	570,000.00	663,031.18	
IRISH TREASURY -3.4%-24/03/18	670,000.00	789,627.42	
IRISH TREASURY -5.4%-25/03/13	965,000.00	1,274,988.88	

IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	1,025,000.00	1,101,038.90	
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	615,000.00	655,525.24	
IRISH TREASURY-1.1%-29/05/15	200,000.00	215,768.80	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	790,000.00	959,923.70	
IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	110,000.00	121,145.12	
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	255,000.00	277,130.22	
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	545,000.00	621,718.88	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	685,000.00	835,018.42	
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	270,000.00	289,481.85	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	1,250,000.00	1,305,815.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	1,460,000.00	1,579,990.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-22/01/15	700,000.00	711,767.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	1,230,000.00	1,341,209.22	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	500,000.00	579,559.75	
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	910,000.00	1,178,639.82	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	950,000.00	1,041,237.05	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-24/01/15	180,000.00	184,397.76	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	1,580,000.00	1,783,281.22	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	1,275,000.00	1,327,545.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	1,195,000.00	1,266,735.85	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	1,225,000.00	1,324,584.16	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	1,195,000.00	1,791,854.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	906,000.00	982,821.55	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	495,000.00	511,736.94	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	1,090,000.00	1,448,547.87	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,230,000.00	2,045,057.04	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	390,000.00	404,806.35	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,165,000.00	2,053,657.34	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,073,000.00	1,747,510.97	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	205,000.00	247,047.96	
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	361,000.00	554,635.34	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	1,121,000.00	1,175,043.41	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	1,260,000.00	1,377,873.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	695,000.00	779,489.06	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	940,000.00	1,069,286.66	

		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/07/15	450,000.00	459,308.70	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	1,070,000.00	1,175,823.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	855,000.00	949,782.73	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	900,000.00	988,090.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	700,000.00	945,625.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	960,000.00	1,028,356.99	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	721,084.43	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	740,000.00	1,127,099.92	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	550,000.00	589,917.17	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	545,000.00	569,906.42	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	570,000.00	737,953.92	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,074,000.00	1,751,269.77	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	559,000.00	885,383.33	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	375,000.00	447,797.25	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	273,000.00	558,470.09	
			394,041,000.00	470,602,900.14	
				(57,352,375,440)	
ユーロ小計					
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	495,000.00	552,107.16	
		UK TREASURY-2.0%-20/07/22	1,870,000.00	1,897,021.50	
		UK TREASURY-3.75%-20/09/07	1,530,000.00	1,587,375.00	
		UK TREASURY-1.5%-21/01/22	2,030,000.00	2,059,215.76	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	1,020,000.00	1,169,172.55	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	1,110,000.00	1,187,988.37	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	1,100,000.00	1,202,670.26	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	2,130,000.00	2,210,765.34	
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	1,610,000.00	1,721,307.35	
		UK TREASURY-1.0%-24/04/22	650,000.00	661,459.50	
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	935,000.00	1,036,927.43	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,305,000.00	1,624,522.72	
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	1,490,000.00	1,573,812.50	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	1,410,000.00	1,464,535.98	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	1,190,000.00	1,533,652.24	
		UK TREASURY-1.625%-28/10/22	1,180,000.00	1,262,600.00	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	1,000,000.00	1,472,769.00	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,195,000.00	1,690,353.79	

		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,260,000.00	1,747,687.03	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	1,870,000.00	2,737,493.00	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,670,000.00	2,429,990.28	
		UK TREASURY-1.75%-37/09/07	425,000.00	454,623.77	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,410,000.00	2,246,752.79	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,240,000.00	1,880,169.34	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	1,415,000.00	2,173,553.20	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,465,000.00	2,375,885.72	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,665,000.00	2,292,438.60	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,740,000.00	2,508,384.00	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,560,000.00	2,555,663.76	
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,610,000.00	1,634,179.94	
		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	290,000.00	312,122.23	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	1,145,000.00	1,946,694.65	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,327,000.00	2,156,728.77	
		UK TREASURY-1.625%-54/10/22	145,000.00	154,749.80	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,580,000.00	2,882,804.80	
		UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	1,199,136.70	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,220,000.00	2,229,123.00	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	1,660,000.00	2,942,267.00	
		UNITED KINGDOM GILT-0.5%-22/07/22	1,665,000.00	1,661,971.46	
		UNITED KINGDOM GILT-0.75%-23/07/22	1,625,000.00	1,635,045.75	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	885,000.00	958,431.99	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	1,142,000.00	1,597,281.14	
		英債券小計	54,339,000.00	70,621,435.17 (9,657,481,259)	
スウェーデン デンク ローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	7,410,000.00	8,018,734.46	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	7,700,000.00	8,640,324.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	6,260,000.00	6,826,231.39	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	4,750,000.00	5,568,470.60	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	4,690,000.00	5,115,214.16	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,550,000.00	3,816,014.28	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	2,550,000.00	2,738,572.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	3,490,000.00	5,450,158.50	
			40,400,000.00	46,173,719.89	



スウェーデンクローナ小計				(528,689,092)
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	6,270,000.00	6,581,619.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	5,370,000.00	5,541,211.71
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	3,420,000.00	3,705,690.38
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	3,270,000.00	3,371,324.22
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	3,250,000.00	3,300,050.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,840,000.00	2,928,150.76
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	2,540,000.00	2,670,810.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	1,600,000.00	1,648,752.00
ノルウェークローネ小計			28,560,000.00	29,747,608.07 (371,547,624)
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	6,930,000.00	7,554,420.72
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	6,640,000.00	7,275,507.76
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	8,040,000.00	9,238,450.44
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	4,160,000.00	4,481,380.80
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	9,770,000.00	18,549,361.08
デンマーククローネ小計			35,540,000.00	47,099,120.80 (768,657,651)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-20/07/25	220,000.00	216,612.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	1,590,000.00	1,670,136.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25	2,310,000.00	2,328,711.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-21/05/25	540,000.00	524,520.88
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-21/07/25	2,430,000.00	2,437,897.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	1,410,000.00	1,544,373.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-22/04/25	2,280,000.00	2,314,656.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	2,070,000.00	2,330,095.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-23/01/25	2,100,000.00	2,151,345.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	2,270,000.00	2,468,171.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-24/04/25	2,030,000.00	2,080,851.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,580,000.00	2,748,216.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	2,900,000.00	2,951,040.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,590,000.00	2,625,094.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	2,110,000.00	2,176,359.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	855,000.00	1,111,258.03
POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	200,000.00	206,600.00		

ポーランドズロチ小計			30,485,000.00	31,885,937.41 (912,894,388)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-20/11/21	1,920,000.00	1,939,147.00
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	2,270,000.00	2,473,269.87
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.0%-21/12/21	1,355,000.00	1,389,069.84
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	1,940,000.00	2,219,580.77
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-22/11/21	920,000.00	958,983.89
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	1,920,000.00	2,245,430.97
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	1,990,000.00	2,150,114.80
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	2,200,000.00	2,463,533.38
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	2,560,000.00	3,072,029.44
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	2,330,000.00	2,934,914.83
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	2,240,000.00	2,497,311.04
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	2,080,000.00	2,238,366.20
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	1,900,000.00	2,131,646.29
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	2,090,000.00	2,450,412.34
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	1,570,000.00	1,776,880.62
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	1,110,000.00	1,232,991.88
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,145,000.00	1,570,663.36
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	640,000.00	740,903.86
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	930,000.00	1,221,237.96
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	662,000.00	822,098.47
AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	280,000.00	322,325.44		
AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	990,000.00	1,200,101.26		
豪ドル小計			35,042,000.00	40,051,013.51 (2,993,012,239)
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-20/07/01	320,000.00	320,766.11
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	585,000.00	595,703.74
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	610,000.00	616,464.10
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-21/10/01	240,000.00	237,610.80
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-22/04/01	210,000.00	210,257.14
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	470,000.00	490,633.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-23/02/01	320,000.00	320,320.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	655,000.00	681,069.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-24/02/01	100,000.00	101,172.18

		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	572,832.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	200,000.00	206,700.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	300,000.00	306,060.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	540,000.00	603,180.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	325,000.00	343,198.37	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	200,000.00	216,300.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	330,000.00	356,730.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	415,000.00	476,395.10	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	220,000.00	220,700.70	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	375,000.00	401,437.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	510,000.00	541,660.80	
シンガポールドル小計			7,465,000.00	7,819,190.54	(619,749,042)
マレーシア アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.659%-20/10/15	1,010,000.00	1,015,302.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	460,000.00	466,883.76	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.62%-21/11/30	850,000.00	855,227.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-22/03/10	550,000.00	557,480.44	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	760,000.00	769,474.08	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	800,000.00	810,000.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	430,000.00	440,642.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	120,000.00	122,161.09	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	980,000.00	996,954.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	480,000.00	488,400.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	450,000.00	456,075.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	650,000.00	655,850.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	300,000.00	304,350.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	747,984.92	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	600,000.00	612,499.20	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,140,000.00	1,224,930.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	300,000.00	327,827.16	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	590,000.00	637,302.60	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	920,000.00	957,901.33	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	400,000.00	429,175.68	
MALAYSIAN GOVERNMENT-3.889%-20/07/31	800,000.00	805,636.00			
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	1,780,000.00	1,808,925.00			

		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	850,000.00	850,732.02	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,750,000.00	1,755,142.02	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	968,200.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,270,000.00	1,325,383.43	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	455,128.11	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	650,000.00	639,590.52	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	600,000.00	598,620.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000.00	833,479.42	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	1,210,000.00	1,275,708.32	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,068,744.31	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	450,000.00	456,941.16	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	980,000.00	963,842.78	
マレーシアリングット小計			26,005,000.00	26,682,494.85	(694,545,340)
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	4,650,000.00	4,668,443.29	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	7,280,000.00	7,363,127.40	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	16,800,000.00	18,778,791.36	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	9,000,000.00	8,338,912.20	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	9,600,000.00	8,072,359.20	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	8,920,000.00	8,166,685.48	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	7,310,000.00	6,833,732.30	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	8,300,000.00	5,975,394.51	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	9,200,000.00	8,217,252.78	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%- 40/01/31	6,910,000.00	6,356,908.39	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	7,450,000.00	5,195,786.07	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	10,650,000.00	9,475,419.48	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	16,900,000.00	15,022,667.72	

南アフリカランド小計	122,970,000.00	112,465,480.18 (826,621,279)	
合計		149,804,065,535 (149,804,065,535)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 206銘柄	100.0%	47.4%
加ドル	国債証券 32銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 287銘柄	100.0%	38.3%
英ポンド	国債証券 42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 5銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 17銘柄	100.0%	0.6%
豪ドル	国債証券 22銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	国債証券 20銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 34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%

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

## 貸借対照表

(単位：円)

	2018年12月17日現在	2019年 6月17日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	8,004,779
コール・ローン	215,598,377	193,159,238
株式	28,680,547,430	29,914,270,770
派生商品評価勘定	253,380	59,460
未収配当金	3,970,760	247,384,871
前払金	75,000	2,745,000
流動資産合計	28,900,444,947	30,365,624,118
資産合計	28,900,444,947	30,365,624,118
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	250,540	3,764,720
未払金	160,327,240	150,710,990
未払解約金	5,137,766	769,129
未払利息	265	299
流動負債合計	165,715,811	155,245,138
負債合計	165,715,811	155,245,138
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	19,938,824,885	21,413,574,101
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,795,904,251	8,796,804,879
元本等合計	28,734,729,136	30,210,378,980
純資産合計	28,734,729,136	30,210,378,980
負債純資産合計	28,900,444,947	30,365,624,118

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## （貸借対照表に関する注記）

		2018年12月17日現在	2019年 6月17日現在
1.	期首	2018年 6月16日	2018年12月18日
	期首元本額	18,506,621,192円	19,938,824,885円
	期首からの追加設定元本額	1,940,816,962円	2,201,140,786円
	期首からの一部解約元本額	508,613,269円	726,391,570円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	422,734,829円	537,962,214円
	DCインデックスバランス（株式40）	1,226,363,834円	1,436,530,547円
	DCインデックスバランス（株式60）	2,350,067,898円	2,741,591,469円
	DCインデックスバランス（株式80）	2,486,704,388円	2,845,499,503円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,495,881,930円	1,378,167,811円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	3,353,484,649円	3,620,389,631円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	685,436,046円	736,772,435円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	51,280,746円	51,344,781円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	42,696,555円	43,939,510円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	77,720,110円	79,323,480円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	62,535,914円	64,911,156円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	4,374,639,542円	4,377,295,747円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	270,196,375円	293,334,909円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	784,052,894円	842,546,956円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,134,351,383円	1,189,483,652円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,120,677,792円	1,174,480,300円
	計	19,938,824,885円	21,413,574,101円
2.	受益権の総数	19,938,824,885口	21,413,574,101口
3.	担保資産		
	デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。		
	株式	408,320,000円	391,935,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

	自 2018年 6月16日 至 2018年12月17日	自 2018年12月18日 至 2019年 6月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

## 金融商品の時価等に関する事項

	2018年12月17日現在	2019年 6月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2018年12月17日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)



種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	59,713,701
合計	59,713,701

(2019年 6月17日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	951,998,984
合計	951,998,984

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2018年12月17日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	63,515,000	-	63,520,000	5,000
合計		63,515,000	-	63,520,000	5,000

(2019年 6月17日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	295,345,000	-	291,650,000	3,695,000
合計		295,345,000	-	291,650,000	3,695,000

(注) 1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

2018年12月17日現在		2019年 6月17日現在	
1口当たり純資産額	1.4411円	1口当たり純資産額	1.4108円
(1万口当たり純資産額)	(14,411円)	(1万口当たり純資産額)	(14,108円)

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	600	2,696.00	1,617,600	
日本水産	18,400	667.00	12,272,800	
マルハニチロ	2,700	3,165.00	8,545,500	
カネコ種苗	600	1,277.00	766,200	
サカタのタネ	2,200	3,265.00	7,183,000	
ホクト	1,600	1,816.00	2,905,600	
ホクリヨウ	300	599.00	179,700	
住石ホールディングス	4,200	120.00	504,000	
日鉄鉱業	400	4,510.00	1,804,000	
三井松島ホールディングス	800	1,327.00	1,061,600	
国際石油開発帝石	73,700	923.50	68,061,950	
石油資源開発	2,600	2,313.00	6,013,800	
K&Oエナジーグループ	900	1,614.00	1,452,600	
ヒノキヤグループ	500	2,196.00	1,098,000	
ショーボンドホールディングス	1,300	7,770.00	10,101,000	
ミライト・ホールディングス	5,200	1,669.00	8,678,800	
サンヨーホームズ	300	657.00	197,100	
日本アクア	600	500.00	300,000	

ファーストコーポレーション	600	775.00	465,000
ベステラ	400	1,295.00	518,000
スペースバリューホールディングス	2,300	498.00	1,145,400
ダイセキ環境ソリューション	400	617.00	246,800
第一カッター興業	300	1,777.00	533,100
安藤・間	11,800	756.00	8,920,800
東急建設	5,400	741.00	4,001,400
コムシスホールディングス	6,500	2,710.00	17,615,000
ミサワホーム	1,500	1,021.00	1,531,500
ピーアールホールディングス	2,100	330.00	693,000
高松コンストラクショングループ	1,100	2,270.00	2,497,000
東建コーポレーション	600	6,640.00	3,984,000
ソネック	200	782.00	156,400
ヤマウラ	700	848.00	593,600
大成建設	15,100	4,050.00	61,155,000
大林組	45,500	1,037.00	47,183,500
清水建設	46,400	915.00	42,456,000
飛鳥建設	1,300	1,324.00	1,721,200
長谷工コーポレーション	18,900	1,096.00	20,714,400
松井建設	1,700	632.00	1,074,400
銭高組	200	4,325.00	865,000
鹿島建設	35,500	1,507.00	53,498,500
不動テトラ	1,100	1,344.00	1,478,400
大末建設	600	923.00	553,800
鉄建建設	900	3,030.00	2,727,000
西松建設	3,300	2,132.00	7,035,600
三井住友建設	11,000	610.00	6,710,000
大豊建設	1,000	2,727.00	2,727,000
前田建設工業	10,800	872.00	9,417,600
ナカノフドー建設	1,200	432.00	518,400
奥村組	2,500	3,345.00	8,362,500
東鉄工業	1,800	3,020.00	5,436,000
イチケン	300	1,636.00	490,800
富士ピー・エス	700	454.00	317,800
浅沼組	600	3,485.00	2,091,000
戸田建設	17,600	597.00	10,507,200
熊谷組	2,200	3,065.00	6,743,000
青木あすなろ建設	800	811.00	648,800
北野建設	300	2,661.00	798,300
植木組	200	2,135.00	427,000
矢作建設工業	2,100	736.00	1,545,600
ピーエス三菱	1,600	621.00	993,600

日本ハウスホールディングス	2,900	409.00	1,186,100	
大東建託	5,400	13,910.00	75,114,000	
新日本建設	1,800	897.00	1,614,600	
N I P P O	4,000	2,139.00	8,556,000	
東亜道路工業	300	3,135.00	940,500	
前田道路	4,800	2,169.00	10,411,200	
日本道路	400	6,310.00	2,524,000	
東亜建設工業	1,300	1,507.00	1,959,100	
日本国土開発	2,500	508.00	1,270,000	
若築建設	800	1,334.00	1,067,200	
東洋建設	5,600	421.00	2,357,600	
五洋建設	18,100	513.00	9,285,300	
福田組	500	4,575.00	2,287,500	
住友林業	10,700	1,254.00	13,417,800	
日本基礎技術	1,600	355.00	568,000	
巴コーポレーション	1,900	366.00	695,400	
大和ハウス工業	42,000	3,352.00	140,784,000	
ライト工業	3,000	1,434.00	4,302,000	
積水ハウス	46,400	1,797.00	83,380,800	
日特建設	1,400	596.00	834,400	
北陸電気工事	800	879.00	703,200	
ユアテック	2,500	753.00	1,882,500	
四電工	300	2,685.00	805,500	
中電工	2,000	2,277.00	4,554,000	
関電工	6,900	894.00	6,168,600	
きんでん	10,100	1,661.00	16,776,100	
東京エネシス	1,500	917.00	1,375,500	
トーエネック	400	3,020.00	1,208,000	
住友電設	1,100	1,735.00	1,908,500	
日本電設工業	2,600	2,216.00	5,761,600	
協和エクシオ	5,900	2,675.00	15,782,500	
新日本空調	1,300	1,714.00	2,228,200	
九電工	3,000	3,195.00	9,585,000	
三機工業	3,500	1,248.00	4,368,000	
日揮	13,100	1,423.00	18,641,300	
中外炉工業	400	1,630.00	652,000	
ヤマト	1,400	571.00	799,400	
太平電業	1,000	2,087.00	2,087,000	
高砂熱学工業	3,700	1,747.00	6,463,900	
三晃金属工業	200	2,430.00	486,000	
朝日工業社	300	2,657.00	797,100	
明星工業	2,800	663.00	1,856,400	

大気社	2,100	3,265.00	6,856,500
ダイダン	1,000	2,188.00	2,188,000
日比谷総合設備	1,400	1,864.00	2,609,600
東芝プラントシステム	3,300	2,043.00	6,741,900
O S J Bホールディングス	6,900	269.00	1,856,100
東洋エンジニアリング	1,800	468.00	842,400
千代田化工建設	11,000	322.00	3,542,000
新興プランテック	2,700	1,338.00	3,612,600
日本製粉	4,300	1,766.00	7,593,800
日清製粉グループ本社	15,300	2,521.00	38,571,300
日東富士製粉	100	5,610.00	561,000
昭和産業	1,200	3,080.00	3,696,000
鳥越製粉	1,200	838.00	1,005,600
中部飼料	1,700	1,195.00	2,031,500
フィード・ワン	9,200	179.00	1,646,800
東洋精糖	300	985.00	295,500
日本甜菜製糖	800	1,916.00	1,532,800
三井製糖	1,100	2,329.00	2,561,900
塩水港精糖	1,600	207.00	331,200
日新製糖	600	1,830.00	1,098,000
森永製菓	3,400	5,230.00	17,782,000
中村屋	400	4,200.00	1,680,000
江崎グリコ	4,100	4,845.00	19,864,500
名糖産業	700	1,421.00	994,700
井村屋グループ	600	2,096.00	1,257,600
不二家	700	1,971.00	1,379,700
山崎製パン	11,100	1,535.00	17,038,500
第一屋製パン	300	1,010.00	303,000
モロゾフ	200	4,860.00	972,000
亀田製菓	800	4,795.00	3,836,000
寿スピリッツ	1,400	5,220.00	7,308,000
カルビー	6,200	2,971.00	18,420,200
森永乳業	2,700	4,380.00	11,826,000
六甲バター	1,000	1,942.00	1,942,000
ヤクルト本社	10,100	6,370.00	64,337,000
明治ホールディングス	9,600	7,680.00	73,728,000
雪印メグミルク	3,300	2,349.00	7,751,700
プリマハム	1,900	2,012.00	3,822,800
日本ハム	5,600	4,700.00	26,320,000
林兼産業	500	606.00	303,000
丸大食品	1,500	1,911.00	2,866,500
S Foods	1,200	3,675.00	4,410,000

伊藤ハム米久ホールディングス	8,700	692.00	6,020,400
サッポロホールディングス	5,000	2,276.00	11,380,000
アサヒグループホールディングス	28,400	4,917.00	139,642,800
麒麟ホールディングス	61,400	2,292.50	140,759,500
宝ホールディングス	10,200	1,135.00	11,577,000
オエノンホールディングス	3,900	362.00	1,411,800
養命酒製造	400	2,017.00	806,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	10,400	2,711.00	28,194,400
サントリー食品インターナショナル	9,100	4,575.00	41,632,500
ダイドーグループホールディングス	800	4,590.00	3,672,000
伊藤園	4,100	5,230.00	21,443,000
キーコーヒー	1,300	2,102.00	2,732,600
ユニカフェ	400	982.00	392,800
ジャパンフーズ	200	1,197.00	239,400
日清オイリオグループ	1,700	3,130.00	5,321,000
不二製油グループ本社	3,300	3,115.00	10,279,500
J - オイルミルズ	700	4,075.00	2,852,500
キッコーマン	9,000	4,640.00	41,760,000
味の素	30,000	1,892.50	56,775,000
キューピー	7,600	2,396.00	18,209,600
ハウス食品グループ本社	5,100	4,200.00	21,420,000
カゴメ	5,400	2,463.00	13,300,200
焼津水産化学工業	700	1,096.00	767,200
アリアケジャパン	1,200	6,960.00	8,352,000
ピエトロ	200	1,610.00	322,000
エバラ食品工業	300	2,133.00	639,900
ニチレイ	7,100	2,754.00	19,553,400
東洋水産	7,000	4,355.00	30,485,000
イトアンド	500	1,652.00	826,000
大冷	200	1,823.00	364,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	400	940.00	376,000
日清食品ホールディングス	5,800	6,750.00	39,150,000
永谷園ホールディングス	700	2,134.00	1,493,800
一正蒲鉾	600	1,131.00	678,600
フジッコ	1,500	2,054.00	3,081,000
ロック・フィールド	1,500	1,442.00	2,163,000
日本たばこ産業	78,400	2,499.00	195,921,600
ケンコーマヨネーズ	800	2,237.00	1,789,600
わらべや日洋ホールディングス	900	1,669.00	1,502,100
なとり	800	1,558.00	1,246,400
イフジ産業	300	656.00	196,800
ピクルスコーポレーション	300	1,922.00	576,600

北の達人コーポレーション	5,300	574.00	3,042,200
ユーグレナ	5,800	964.00	5,591,200
ミヨシ油脂	500	1,055.00	527,500
理研ビタミン	600	3,450.00	2,070,000
片倉工業	1,600	1,290.00	2,064,000
ゲンゼ	900	4,805.00	4,324,500
東洋紡	5,600	1,221.00	6,837,600
ユニチカ	4,000	364.00	1,456,000
富士紡ホールディングス	700	2,292.00	1,604,400
倉敷紡績	1,200	1,952.00	2,342,400
シキボウ	700	958.00	670,600
日本毛織	4,300	864.00	3,715,200
ダイトウボウ	2,900	82.00	237,800
トーア紡コーポレーション	600	456.00	273,600
ダイドーリミテッド	1,700	303.00	515,100
帝国繊維	1,500	2,267.00	3,400,500
帝人	10,800	1,795.00	19,386,000
東レ	102,800	808.70	83,134,360
サカイオーベックス	300	1,666.00	499,800
住江織物	400	2,917.00	1,166,800
日本フェルト	800	470.00	376,000
イチカワ	200	1,572.00	314,400
日東製網	200	1,482.00	296,400
アツギ	1,100	905.00	995,500
ダイニック	600	725.00	435,000
セーレン	3,300	1,470.00	4,851,000
ソトー	600	976.00	585,600
東海染工	200	1,141.00	228,200
小松マテーレ	2,200	788.00	1,733,600
ワコールホールディングス	3,800	2,776.00	10,548,800
ホギメディカル	1,700	3,355.00	5,703,500
レナウン	4,000	99.00	396,000
クラウディアホールディングス	300	501.00	150,300
T S Iホールディングス	4,900	654.00	3,204,600
マツオカコーポレーション	400	2,600.00	1,040,000
ワールド	1,700	2,112.00	3,590,400
三陽商会	800	1,551.00	1,240,800
ナイガイ	500	476.00	238,000
オンワードホールディングス	7,900	589.00	4,653,100
ルックホールディングス	500	1,308.00	654,000
キムラタン	7,600	36.00	273,600
ゴールドウイン	1,200	13,640.00	16,368,000

デサント	3,200	1,902.00	6,086,400
キング	700	610.00	427,000
ヤマトインターナショナル	800	413.00	330,400
特種東海製紙	800	3,785.00	3,028,000
王子ホールディングス	59,600	601.00	35,819,600
日本製紙	6,400	1,866.00	11,942,400
三菱製紙	2,200	542.00	1,192,400
北越コーポレーション	8,800	555.00	4,884,000
中越パルプ工業	600	1,460.00	876,000
巴川製紙所	500	938.00	469,000
大王製紙	6,400	1,229.00	7,865,600
阿波製紙	400	433.00	173,200
レンゴー	13,700	863.00	11,823,100
トモク	800	1,673.00	1,338,400
ザ・パック	1,000	3,095.00	3,095,000
クラレ	22,400	1,273.00	28,515,200
旭化成	94,300	1,126.00	106,181,800
共和レザー	800	778.00	622,400
昭和電工	8,800	3,060.00	26,928,000
住友化学	104,300	480.00	50,064,000
住友精化	700	3,220.00	2,254,000
日産化学	8,100	4,775.00	38,677,500
ラサ工業	500	1,322.00	661,000
クレハ	1,200	7,450.00	8,940,000
多木化学	400	4,315.00	1,726,000
テイカ	1,100	2,445.00	2,689,500
石原産業	2,600	1,252.00	3,255,200
片倉コープアグリ	400	1,071.00	428,400
日東エフシー	1,000	1,201.00	1,201,000
日本曹達	2,100	2,622.00	5,506,200
東ソー	20,500	1,431.00	29,335,500
トクヤマ	3,800	2,483.00	9,435,400
セントラル硝子	2,900	2,355.00	6,829,500
東亜合成	8,300	1,182.00	9,810,600
大阪ソーダ	1,400	2,694.00	3,771,600
関東電化工業	3,200	734.00	2,348,800
デンカ	5,200	3,145.00	16,354,000
信越化学工業	23,400	9,217.00	215,677,800
日本カーバイド工業	500	1,312.00	656,000
堺化学工業	900	2,467.00	2,220,300
第一稀元素化学工業	1,400	829.00	1,160,600
エア・ウォーター	10,800	1,803.00	19,472,400



大陽日酸	10,900	2,296.00	25,026,400
日本化学工業	500	1,833.00	916,500
東邦アセチレン	200	1,332.00	266,400
日本パーカラライジング	7,200	1,205.00	8,676,000
高压ガス工業	2,100	802.00	1,684,200
四国化成工業	2,200	1,090.00	2,398,000
戸田工業	300	2,118.00	635,400
ステラ ケミファ	800	2,998.00	2,398,400
保土谷化学工業	500	2,563.00	1,281,500
日本触媒	2,200	7,030.00	15,466,000
大日精化工業	1,100	2,821.00	3,103,100
カネカ	3,400	3,930.00	13,362,000
三菱瓦斯化学	13,600	1,364.00	18,550,400
三井化学	12,000	2,578.00	30,936,000
J S R	13,300	1,641.00	21,825,300
東京応化工業	2,300	3,325.00	7,647,500
大阪有機化学工業	1,200	972.00	1,166,400
三菱ケミカルホールディングス	88,600	731.70	64,828,620
K Hネオケム	2,000	2,689.00	5,378,000
ダイセル	19,500	957.00	18,661,500
住友ベークライト	2,300	3,710.00	8,533,000
積水化学工業	28,900	1,599.00	46,211,100
日本ゼオン	11,900	1,155.00	13,744,500
アイカ工業	4,000	3,705.00	14,820,000
宇部興産	6,700	2,103.00	14,090,100
積水樹脂	2,200	2,092.00	4,602,400
タキロンシーアイ	2,900	664.00	1,925,600
旭有機材	900	1,345.00	1,210,500
日立化成	6,100	2,985.00	18,208,500
ニチバン	700	2,227.00	1,558,900
リケンテクノス	3,600	487.00	1,753,200
大倉工業	700	1,702.00	1,191,400
積水化成成品工業	2,000	718.00	1,436,000
群栄化学工業	300	2,481.00	744,300
タイガースポリマー	700	573.00	401,100
ミライアル	400	1,196.00	478,400
ダイキアクシス	500	892.00	446,000
ダイキョーニシカワ	2,800	829.00	2,321,200
竹本容器	500	1,203.00	601,500
森六ホールディングス	700	2,421.00	1,694,700
日本化薬	8,400	1,287.00	10,810,800
カーリットホールディングス	1,400	647.00	905,800

日本精化	1,100	1,225.00	1,347,500
扶桑化学工業	1,400	2,066.00	2,892,400
トリケミカル研究所	300	4,460.00	1,338,000
A D E K A	6,500	1,576.00	10,244,000
日油	5,000	4,075.00	20,375,000
新日本理化	2,500	212.00	530,000
ハリマ化成グループ	1,100	993.00	1,092,300
花王	32,900	8,475.00	278,827,500
第一工業製薬	500	3,480.00	1,740,000
石原ケミカル	300	1,582.00	474,600
日華化学	500	859.00	429,500
ニイタカ	200	1,445.00	289,000
三洋化成工業	900	5,690.00	5,121,000
有機合成薬品工業	1,100	219.00	240,900
大日本塗料	1,500	1,062.00	1,593,000
日本ペイントホールディングス	10,900	4,255.00	46,379,500
関西ペイント	14,900	2,197.00	32,735,300
神東塗料	1,100	170.00	187,000
中国塗料	4,400	917.00	4,034,800
日本特殊塗料	1,000	1,245.00	1,245,000
藤倉化成	1,800	560.00	1,008,000
太陽ホールディングス	1,100	3,250.00	3,575,000
D I C	6,000	2,783.00	16,698,000
サカタインクス	2,900	973.00	2,821,700
東洋インキ S C ホールディングス	2,800	2,300.00	6,440,000
T & K T O K A	1,000	961.00	961,000
富士フイルムホールディングス	28,100	5,384.00	151,290,400
資生堂	26,900	8,553.00	230,075,700
ライオン	18,800	2,036.00	38,276,800
高砂香料工業	900	2,912.00	2,620,800
マンダム	3,000	2,638.00	7,914,000
ミルボン	1,700	5,270.00	8,959,000
ファンケル	6,000	2,893.00	17,358,000
コーセー	2,300	17,950.00	41,285,000
コタ	700	1,182.00	827,400
ポーラ・オルビスホールディングス	5,800	3,035.00	17,603,000
ノエビアホールディングス	1,300	5,790.00	7,527,000
アジュバンコスメジャパン	300	933.00	279,900
エステー	1,000	1,704.00	1,704,000
アグロ カネショウ	600	2,059.00	1,235,400
コニシ	2,400	1,552.00	3,724,800
長谷川香料	1,800	1,820.00	3,276,000

星光PMC	1,000	761.00	761,000	
小林製薬	3,800	7,830.00	29,754,000	
荒川化学工業	1,200	1,308.00	1,569,600	
メック	900	1,038.00	934,200	
日本高純度化学	400	2,359.00	943,600	
タカラバイオ	3,500	2,022.00	7,077,000	
JCU	1,800	1,953.00	3,515,400	
新田ゼラチン	900	684.00	615,600	
OATアグリオ	200	1,342.00	268,400	
デクセリアルズ	3,500	696.00	2,436,000	
アース製薬	1,000	4,820.00	4,820,000	
北興化学工業	1,400	474.00	663,600	
大成ラミック	400	2,797.00	1,118,800	
クミアイ化学工業	5,600	705.00	3,948,000	
日本農薬	2,400	408.00	979,200	
アキレス	1,000	1,968.00	1,968,000	
有沢製作所	2,100	818.00	1,717,800	
日東電工	9,300	5,043.00	46,899,900	
レック	1,400	1,200.00	1,680,000	
三光合成	1,600	321.00	513,600	
きもと	2,400	158.00	379,200	
藤森工業	1,200	2,782.00	3,338,400	
前澤化成工業	900	1,095.00	985,500	
未来工業	700	2,041.00	1,428,700	
ウェーブロックホールディングス	400	662.00	264,800	
JSP	800	2,039.00	1,631,200	
エフピコ	1,500	6,730.00	10,095,000	
天馬	900	1,765.00	1,588,500	
信越ポリマー	2,400	766.00	1,838,400	
東リ	3,400	247.00	839,800	
ニフコ	5,400	2,754.00	14,871,600	
バルカー	1,100	2,163.00	2,379,300	
ユニ・チャーム	28,700	3,391.00	97,321,700	
ショーエイコーポレーション	100	751.00	75,100	
協和発酵キリン	15,900	2,027.00	32,229,300	
武田薬品工業	118,100	3,697.00	436,615,700	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	124,800	1,460.50	182,270,400	
大日本住友製薬	10,000	2,060.00	20,600,000	
塩野義製薬	17,300	6,110.00	105,703,000	
田辺三菱製薬	14,100	1,250.00	17,625,000	
わかもと製薬	1,700	262.00	445,400	
あすか製薬	1,700	1,198.00	2,036,600	

日本新薬	3,500	8,260.00	28,910,000
ピオフェルミン製薬	200	2,282.00	456,400
中外製薬	14,100	7,010.00	98,841,000
科研製薬	2,400	5,190.00	12,456,000
エーザイ	16,200	6,263.00	101,460,600
ロート製薬	6,900	3,005.00	20,734,500
小野薬品工業	31,900	1,951.00	62,236,900
久光製薬	4,000	4,320.00	17,280,000
持田製薬	2,000	4,740.00	9,480,000
参天製薬	25,200	1,676.00	42,235,200
扶桑薬品工業	500	1,968.00	984,000
日本ケミファ	200	2,922.00	584,400
ツムラ	4,200	2,985.00	12,537,000
日医工	3,600	1,193.00	4,294,800
キッセイ薬品工業	2,400	2,616.00	6,278,400
生化学工業	2,600	1,226.00	3,187,600
栄研化学	2,400	1,782.00	4,276,800
日水製薬	600	1,193.00	715,800
鳥居薬品	700	2,521.00	1,764,700
JCRファーマ	1,000	6,340.00	6,340,000
東和薬品	2,000	2,784.00	5,568,000
富士製薬工業	900	1,402.00	1,261,800
沢井製薬	2,800	5,880.00	16,464,000
ゼリア新薬工業	2,700	2,164.00	5,842,800
第一三共	38,700	6,093.00	235,799,100
キョーリン製薬ホールディングス	3,000	1,860.00	5,580,000
大幸薬品	600	2,146.00	1,287,600
ダイト	800	3,510.00	2,808,000
大塚ホールディングス	25,800	3,589.00	92,596,200
大正製薬ホールディングス	3,000	8,300.00	24,900,000
ペプチドリーム	6,800	5,570.00	37,876,000
日本コークス工業	11,300	92.00	1,039,600
ニチレキ	1,700	1,013.00	1,722,100
ユシロ化学工業	700	1,336.00	935,200
ビーピー・カストロール	500	1,462.00	731,000
富士石油	3,300	259.00	854,700
MORESCO	500	1,493.00	746,500
出光興産	15,600	3,020.00	47,112,000
JXTGホールディングス	227,600	510.90	116,280,840
コスモエネルギーホールディングス	3,900	2,184.00	8,517,600
横浜ゴム	7,800	1,958.00	15,272,400
TOYO TIRE	7,000	1,501.00	10,507,000

ブリヂストン	41,600	4,224.00	175,718,400
住友ゴム工業	12,100	1,231.00	14,895,100
藤倉コンポジット	1,200	397.00	476,400
オカモト	900	4,805.00	4,324,500
フコク	600	735.00	441,000
ニッタ	1,500	2,993.00	4,489,500
住友理工	2,600	800.00	2,080,000
三ツ星ベルト	1,800	1,882.00	3,387,600
バンドー化学	2,600	932.00	2,423,200
日東紡績	2,000	2,141.00	4,282,000
A G C	13,400	3,590.00	48,106,000
日本板硝子	6,500	711.00	4,621,500
石塚硝子	200	2,195.00	439,000
日本山村硝子	600	1,409.00	845,400
日本電気硝子	5,800	2,633.00	15,271,400
オハラ	500	1,420.00	710,000
住友大阪セメント	2,700	4,380.00	11,826,000
太平洋セメント	8,500	3,245.00	27,582,500
日本ヒューム	1,400	726.00	1,016,400
日本コンクリート工業	3,000	289.00	867,000
三谷セキサン	600	2,891.00	1,734,600
アジアパイルホールディングス	2,000	593.00	1,186,000
東海カーボン	12,300	1,118.00	13,751,400
日本カーボン	700	4,200.00	2,940,000
東洋炭素	800	2,100.00	1,680,000
ノリタケカンパニーリミテド	800	4,510.00	3,608,000
T O T O	10,400	4,175.00	43,420,000
日本碍子	16,500	1,492.00	24,618,000
日本特殊陶業	11,400	1,937.00	22,081,800
ダントーホールディングス	1,400	111.00	155,400
M A R U W A	500	4,900.00	2,450,000
品川リフラクトリーズ	400	2,961.00	1,184,400
黒崎播磨	300	5,960.00	1,788,000
ヨータイ	1,200	556.00	667,200
イソライト工業	700	449.00	314,300
東京窯業	1,800	294.00	529,200
ニッカトー	600	655.00	393,000
フジインコーポレーテッド	1,200	2,142.00	2,570,400
クニミネ工業	600	795.00	477,000
エーアンドエーマテリアル	300	1,010.00	303,000
ニチアス	3,700	1,880.00	6,956,000
ニチハ	1,900	2,884.00	5,479,600

日本製鉄	62,200	1,828.50	113,732,700
神戸製鋼所	24,500	679.00	16,635,500
合同製鐵	700	1,984.00	1,388,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	36,100	1,510.00	54,511,000
東京製鐵	7,200	833.00	5,997,600
共英製鋼	1,500	1,796.00	2,694,000
大和工業	2,800	3,050.00	8,540,000
東京鐵鋼	600	1,237.00	742,200
大阪製鐵	900	1,587.00	1,428,300
淀川製鋼所	1,800	2,043.00	3,677,400
丸一鋼管	4,800	2,855.00	13,704,000
モリ工業	400	1,897.00	758,800
大同特殊鋼	2,200	3,955.00	8,701,000
日本高周波鋼業	500	447.00	223,500
日本冶金工業	11,200	211.00	2,363,200
山陽特殊製鋼	1,700	1,453.00	2,470,100
愛知製鋼	700	3,100.00	2,170,000
日立金属	14,400	1,222.00	17,596,800
日本金属	300	884.00	265,200
大平洋金属	900	2,101.00	1,890,900
新日本電工	8,100	196.00	1,587,600
栗本鐵工所	700	1,328.00	929,600
虹技	200	1,244.00	248,800
日本鑄鉄管	200	626.00	125,200
三菱製鋼	1,000	1,160.00	1,160,000
日亜鋼業	2,000	331.00	662,000
日本精線	200	2,588.00	517,600
エンビプロ・ホールディングス	500	611.00	305,500
シンニッタン	2,100	321.00	674,100
新家工業	300	1,455.00	436,500
大紀アルミニウム工業所	2,200	738.00	1,623,600
日本軽金属ホールディングス	36,600	234.00	8,564,400
三井金属鉱業	3,600	2,432.00	8,755,200
東邦亜鉛	800	2,378.00	1,902,400
三菱マテリアル	8,900	2,961.00	26,352,900
住友金属鉱山	18,300	2,900.00	53,070,000
D O W A ホールディングス	3,100	3,465.00	10,741,500
古河機械金属	2,200	1,387.00	3,051,400
エス・サイエンス	6,200	61.00	378,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,600	1,733.00	2,772,800
東邦チタニウム	2,400	1,126.00	2,702,400
U A C J	2,000	1,686.00	3,372,000

C Kサンエツ	300	2,766.00	829,800
古河電気工業	3,900	3,025.00	11,797,500
住友電気工業	50,000	1,357.00	67,850,000
フジクラ	16,200	368.00	5,961,600
昭和電線ホールディングス	1,600	782.00	1,251,200
タツタ電線	2,700	468.00	1,263,600
カナレ電気	200	1,908.00	381,600
平河ヒューテック	600	1,147.00	688,200
リョービ	1,700	2,028.00	3,447,600
アーレスティ	1,600	525.00	840,000
アサヒホールディングス	2,500	2,204.00	5,510,000
稲葉製作所	700	1,458.00	1,020,600
宮地エンジニアリンググループ	400	1,785.00	714,000
トーカロ	3,500	753.00	2,635,500
アルファC o	500	1,237.00	618,500
SUMCO	14,800	1,201.00	17,774,800
川田テクノロジーズ	300	8,420.00	2,526,000
RS Technologies	300	2,534.00	760,200
信和	700	952.00	666,400
東洋製罐グループホールディングス	8,500	2,237.00	19,014,500
ホッカンホールディングス	700	1,721.00	1,204,700
コロナ	700	979.00	685,300
横河ブリッジホールディングス	2,500	1,668.00	4,170,000
駒井ハルテック	300	1,631.00	489,300
高田機工	100	2,493.00	249,300
三和ホールディングス	13,800	1,107.00	15,276,600
文化シャッター	4,000	810.00	3,240,000
三協立山	1,900	1,134.00	2,154,600
アルインコ	1,000	942.00	942,000
東洋シャッター	400	641.00	256,400
LIXILグループ	19,700	1,498.00	29,510,600
日本フィルコン	1,100	504.00	554,400
ノーリツ	3,000	1,347.00	4,041,000
長府製作所	1,400	2,167.00	3,033,800
リンナイ	2,400	6,870.00	16,488,000
ダイニチ工業	700	594.00	415,800
日東精工	1,900	568.00	1,079,200
三洋工業	200	1,772.00	354,400
岡部	2,700	963.00	2,600,100
ジーテクト	1,500	1,506.00	2,259,000
中国工業	200	513.00	102,600
東プレ	2,500	1,743.00	4,357,500

高周波熱錬	2,600	823.00	2,139,800
東京製鋼	800	1,012.00	809,600
サンコール	800	507.00	405,600
モリテック スチール	1,100	393.00	432,300
パイオラックス	2,100	1,854.00	3,893,400
エイチワン	1,300	754.00	980,200
日本発條	13,300	818.00	10,879,400
中央発條	200	2,897.00	579,400
アドバネクス	200	1,605.00	321,000
立川ブラインド工業	600	1,269.00	761,400
三益半導体工業	1,200	1,552.00	1,862,400
日本ドライケミカル	400	1,101.00	440,400
日本製鋼所	4,100	1,801.00	7,384,100
三浦工業	5,800	3,285.00	19,053,000
タクマ	4,900	1,372.00	6,722,800
ツガミ	3,000	829.00	2,487,000
オークマ	1,700	5,270.00	8,959,000
東芝機械	1,500	2,413.00	3,619,500
アマダホールディングス	20,100	1,160.00	23,316,000
アイダエンジニアリング	3,600	761.00	2,739,600
滝澤鉄工所	400	1,395.00	558,000
F U J I	5,300	1,206.00	6,391,800
牧野フライス製作所	1,600	3,980.00	6,368,000
オーエスジー	6,600	2,091.00	13,800,600
ダイジェット工業	200	1,233.00	246,600
旭ダイヤモンド工業	3,600	624.00	2,246,400
D M G 森精機	8,500	1,525.00	12,962,500
ソディック	2,900	902.00	2,615,800
ディスコ	1,800	15,140.00	27,252,000
日東工器	700	2,148.00	1,503,600
日進工具	400	2,059.00	823,600
パンチ工業	900	472.00	424,800
富士ダイス	600	564.00	338,400
豊和工業	700	831.00	581,700
O K K	600	717.00	430,200
東洋機械金属	1,000	576.00	576,000
津田駒工業	300	1,534.00	460,200
島精機製作所	1,800	3,005.00	5,409,000
オプトラン	1,300	2,130.00	2,769,000
N C ホールディングス	500	493.00	246,500
イワキポンプ	600	1,054.00	632,400
フリー	1,100	1,122.00	1,234,200



ヤマシンフィルタ	2,300	611.00	1,405,300
日阪製作所	1,600	886.00	1,417,600
やまびこ	2,600	921.00	2,394,600
平田機工	600	5,210.00	3,126,000
ペガサスミシン製造	1,300	540.00	702,000
マルマエ	600	673.00	403,800
タツモ	600	749.00	449,400
ナブテスコ	7,400	2,885.00	21,349,000
三井海洋開発	1,400	2,793.00	3,910,200
レオン自動機	1,300	1,754.00	2,280,200
S M C	4,000	37,500.00	150,000,000
新川	1,100	355.00	390,500
ホソカワミクロン	500	4,450.00	2,225,000
ユニオンツール	600	2,722.00	1,633,200
オイレス工業	1,900	1,521.00	2,889,900
日精エー・エス・ビー機械	500	2,454.00	1,227,000
サトーホールディングス	1,600	2,652.00	4,243,200
技研製作所	1,200	3,290.00	3,948,000
日本エアーテック	400	580.00	232,000
カワタ	400	1,004.00	401,600
日精樹脂工業	1,100	892.00	981,200
オカダアイヨン	500	1,209.00	604,500
ワイエイシイホールディングス	600	821.00	492,600
小松製作所	61,300	2,430.00	148,959,000
住友重機械工業	7,700	3,515.00	27,065,500
日立建機	5,400	2,818.00	15,217,200
日工	400	2,695.00	1,078,000
巴工業	600	2,427.00	1,456,200
井関農機	1,300	1,435.00	1,865,500
T O W A	1,200	751.00	901,200
丸山製作所	300	1,073.00	321,900
北川鉄工所	600	2,068.00	1,240,800
ローツェ	600	2,134.00	1,280,400
タカキタ	500	553.00	276,500
クボタ	72,500	1,757.50	127,418,750
荏原実業	400	1,998.00	799,200
三菱化工機	500	1,684.00	842,000
月島機械	2,700	1,224.00	3,304,800
帝国電機製作所	1,000	1,264.00	1,264,000
新東工業	3,200	935.00	2,992,000
澁谷工業	1,200	2,811.00	3,373,200
アイチ コーポレーション	2,300	675.00	1,552,500

小森コーポレーション	3,600	1,152.00	4,147,200
鶴見製作所	1,000	1,934.00	1,934,000
住友精密工業	200	2,763.00	552,600
酒井重工業	200	2,500.00	500,000
荏原製作所	6,000	2,869.00	17,214,000
石井鐵工所	200	1,985.00	397,000
西島製作所	1,400	1,050.00	1,470,000
北越工業	1,400	1,214.00	1,699,600
ダイキン工業	18,500	13,855.00	256,317,500
オルガノ	500	3,475.00	1,737,500
トーヨーカネツ	500	2,015.00	1,007,500
栗田工業	7,300	2,539.00	18,534,700
椿本チエイン	1,800	3,305.00	5,949,000
大同工業	600	827.00	496,200
木村化工機	1,100	337.00	370,700
アネスト岩田	2,100	942.00	1,978,200
ダイフク	7,400	5,760.00	42,624,000
サムコ	400	785.00	314,000
加藤製作所	700	1,946.00	1,362,200
油研工業	300	1,604.00	481,200
タダノ	6,500	1,056.00	6,864,000
フジテック	4,900	1,415.00	6,933,500
C K D	3,800	997.00	3,788,600
キトー	1,000	1,680.00	1,680,000
平和	3,800	2,223.00	8,447,400
理想科学工業	1,200	1,673.00	2,007,600
S A N K Y O	3,400	4,140.00	14,076,000
日本金銭機械	1,500	1,115.00	1,672,500
マースグループホールディングス	900	2,043.00	1,838,700
福島工業	800	3,460.00	2,768,000
オーイズミ	600	383.00	229,800
ダイコク電機	600	1,276.00	765,600
竹内製作所	2,300	1,842.00	4,236,600
アマノ	3,900	2,937.00	11,454,300
J U K I	1,900	920.00	1,748,000
サンデンホールディングス	1,700	502.00	853,400
蛇の目ミシン工業	1,200	437.00	524,400
マックス	2,100	1,529.00	3,210,900
グローリー	3,700	2,805.00	10,378,500
新晃工業	1,300	1,603.00	2,083,900
大和冷機工業	2,000	1,110.00	2,220,000
セガサミーホールディングス	13,400	1,295.00	17,353,000

日本ピストンリング	500	1,375.00	687,500
リケン	600	4,055.00	2,433,000
T P R	1,800	1,749.00	3,148,200
ツバキ・ナカシマ	2,100	1,687.00	3,542,700
ホシザキ	3,900	7,780.00	30,342,000
大豊工業	1,100	782.00	860,200
日本精工	27,800	897.00	24,936,600
N T N	29,100	301.00	8,759,100
ジェイテクト	13,000	1,217.00	15,821,000
不二越	1,300	4,185.00	5,440,500
日本トムソン	4,000	449.00	1,796,000
T H K	8,400	2,430.00	20,412,000
ユーシン精機	1,100	963.00	1,059,300
前澤給装工業	500	1,941.00	970,500
イーグル工業	1,700	995.00	1,691,500
前澤工業	900	350.00	315,000
日本ピラー工業	1,400	1,050.00	1,470,000
キッツ	5,500	712.00	3,916,000
マキタ	16,500	3,390.00	55,935,000
日立造船	10,800	357.00	3,855,600
三菱重工業	22,700	4,646.00	105,464,200
I H I	10,400	2,578.00	26,811,200
スター精密	2,300	1,357.00	3,121,100
日清紡ホールディングス	7,500	807.00	6,052,500
イビデン	8,300	1,781.00	14,782,300
コニカミノルタ	29,600	1,014.00	30,014,400
ブラザー工業	17,600	1,881.00	33,105,600
ミネベアミツミ	25,100	1,659.00	41,640,900
日立製作所	60,900	3,967.00	241,590,300
三菱電機	135,300	1,363.00	184,413,900
富士電機	8,800	3,675.00	32,340,000
東洋電機製造	500	1,362.00	681,000
安川電機	15,700	3,275.00	51,417,500
シンフォニアテクノロジー	1,900	1,170.00	2,223,000
明電舎	2,700	1,571.00	4,241,700
オリジン	400	1,414.00	565,600
山洋電気	600	4,125.00	2,475,000
デンヨー	1,300	1,421.00	1,847,300
東芝テック	1,700	2,728.00	4,637,600
芝浦メカトロニクス	200	2,576.00	515,200
マブチモーター	3,700	3,645.00	13,486,500
日本電産	16,300	13,915.00	226,814,500

ユー・エム・シー・エレクトロニクス	700	1,235.00	864,500
トレックス・セミコンダクター	600	1,166.00	699,600
東光高岳	700	1,177.00	823,900
ダブル・スコープ	2,000	1,605.00	3,210,000
ダイヘン	1,500	3,200.00	4,800,000
ヤーマン	2,000	877.00	1,754,000
JVCケンウッド	10,400	234.00	2,433,600
ミマキエンジニアリング	1,200	630.00	756,000
第一精工	600	1,297.00	778,200
日新電機	3,200	1,141.00	3,651,200
大崎電気工業	2,700	665.00	1,795,500
オムロン	14,400	5,310.00	76,464,000
日東工業	2,200	1,972.00	4,338,400
I D E C	1,800	1,949.00	3,508,200
正興電機製作所	300	774.00	232,200
不二電機工業	200	1,226.00	245,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	4,900	2,004.00	9,819,600
サクサホールディングス	300	1,907.00	572,100
メルコホールディングス	600	3,045.00	1,827,000
テクノメディカ	300	2,164.00	649,200
日本電気	17,500	4,040.00	70,700,000
富士通	13,100	7,555.00	98,970,500
沖電気工業	5,900	1,297.00	7,652,300
岩崎通信機	700	785.00	549,500
電気興業	700	3,180.00	2,226,000
サンケン電気	1,600	2,215.00	3,544,000
ナカヨ	300	1,557.00	467,100
アイホン	800	1,742.00	1,393,600
ルネサスエレクトロニクス	14,200	501.00	7,114,200
セイコーエプソン	16,800	1,649.00	27,703,200
ワコム	9,800	337.00	3,302,600
アルバック	2,700	3,080.00	8,316,000
アクセル	600	542.00	325,200
E I Z O	1,300	3,790.00	4,927,000
日本信号	3,500	1,144.00	4,004,000
京三製作所	2,900	349.00	1,012,100
能美防災	1,800	2,222.00	3,999,600
ホーチキ	900	1,216.00	1,094,400
星和電機	800	496.00	396,800
エレコム	1,300	3,415.00	4,439,500
パナソニック	154,600	857.60	132,584,960
シャープ	13,400	1,066.00	14,284,400

アンリツ	8,700	1,843.00	16,034,100
富士通ゼネラル	4,100	1,611.00	6,605,100
ソニー	90,800	5,635.00	511,658,000
T D K	7,100	7,570.00	53,747,000
帝国通信工業	600	1,139.00	683,400
タムラ製作所	5,200	549.00	2,854,800
アルプスアルパイン	14,100	1,796.00	25,323,600
池上通信機	500	1,070.00	535,000
日本電波工業	1,300	456.00	592,800
鈴木	800	614.00	491,200
日本トリム	300	5,160.00	1,548,000
ローランド ディー . ジー .	700	2,378.00	1,664,600
フォスター電機	1,500	1,446.00	2,169,000
S M K	400	2,640.00	1,056,000
ヨコオ	1,000	2,082.00	2,082,000
ホシデン	4,000	1,107.00	4,428,000
ヒロセ電機	2,000	11,570.00	23,140,000
日本航空電子工業	3,100	1,496.00	4,637,600
T O A	1,500	1,289.00	1,933,500
マクセルホールディングス	2,900	1,768.00	5,127,200
古野電気	1,700	939.00	1,596,300
ユニデンホールディングス	400	1,796.00	718,400
スミダコーポレーション	1,200	1,115.00	1,338,000
アイコム	800	2,388.00	1,910,400
リオン	600	2,125.00	1,275,000
本多通信工業	1,200	504.00	604,800
船井電機	1,400	786.00	1,100,400
横河電機	13,500	2,040.00	27,540,000
新電元工業	500	3,455.00	1,727,500
アズビル	8,700	2,539.00	22,089,300
東亜ディーケーケー	700	838.00	586,600
日本光電工業	6,000	3,135.00	18,810,000
チノー	500	1,144.00	572,000
共和電業	1,400	416.00	582,400
日本電子材料	600	496.00	297,600
堀場製作所	2,700	5,150.00	13,905,000
アドバンテスト	9,200	2,529.00	23,266,800
小野測器	600	555.00	333,000
エスベック	1,200	2,190.00	2,628,000
キーエンス	6,600	61,970.00	409,002,000
日置電機	700	3,465.00	2,425,500
シスメックス	10,600	7,742.00	82,065,200

日本マイクロニクス	2,400	915.00	2,196,000
メガチップス	1,100	1,279.00	1,406,900
O B A R A G R O U P	700	3,740.00	2,618,000
澤藤電機	200	1,615.00	323,000
原田工業	600	787.00	472,200
コーセル	1,700	1,049.00	1,783,300
イリソ電子工業	1,200	5,260.00	6,312,000
オブテックスグループ	2,400	1,248.00	2,995,200
千代田インテグレ	600	2,001.00	1,200,600
アイ・オー・データ機器	500	1,060.00	530,000
レーザーテック	2,800	3,670.00	10,276,000
スタンレー電気	9,600	2,497.00	23,971,200
岩崎電気	600	1,302.00	781,200
ウシオ電機	7,800	1,348.00	10,514,400
岡谷電機産業	1,000	372.00	372,000
ヘリオス テクノ ホールディング	1,300	590.00	767,000
エノモト	400	739.00	295,600
日本セラミック	1,400	2,768.00	3,875,200
遠藤照明	700	738.00	516,600
古河電池	1,000	643.00	643,000
双信電機	700	514.00	359,800
山一電機	1,000	893.00	893,000
図研	900	1,572.00	1,414,800
日本電子	2,700	2,426.00	6,550,200
カシオ計算機	12,000	1,324.00	15,888,000
ファナック	12,900	19,280.00	248,712,000
日本シイエムケイ	3,500	623.00	2,180,500
エンプラス	600	3,090.00	1,854,000
大真空	500	1,072.00	536,000
ローム	6,500	6,770.00	44,005,000
浜松ホトニクス	9,700	3,975.00	38,557,500
三井ハイテック	1,500	1,043.00	1,564,500
新光電気工業	4,600	903.00	4,153,800
京セラ	20,600	6,898.00	142,098,800
太陽誘電	6,000	1,795.00	10,770,000
村田製作所	42,600	4,616.00	196,641,600
ユーシン	800	983.00	786,400
双葉電子工業	2,200	1,375.00	3,025,000
北陸電気工業	500	944.00	472,000
ニチコン	4,300	795.00	3,418,500
日本ケミコン	1,000	1,470.00	1,470,000
K O A	2,000	1,280.00	2,560,000

市光工業	2,000	617.00	1,234,000	
小糸製作所	8,100	5,440.00	44,064,000	
ミツバ	2,500	583.00	1,457,500	
S C R E E Nホールディングス	2,400	3,910.00	9,384,000	
キャノン電子	1,200	1,831.00	2,197,200	
キャノン	72,800	3,149.00	229,247,200	代用有価証券 10,000株
リコー	40,700	1,070.00	43,549,000	
象印マホービン	3,400	1,162.00	3,950,800	
M U T O Hホールディングス	200	1,725.00	345,000	
東京エレクトロン	9,000	14,265.00	128,385,000	
トヨタ紡織	4,700	1,389.00	6,528,300	
芦森工業	300	1,625.00	487,500	
ユニプレス	2,600	1,743.00	4,531,800	
豊田自動織機	10,900	5,780.00	63,002,000	
モリタホールディングス	2,400	1,859.00	4,461,600	
三櫻工業	1,800	405.00	729,000	
デンソー	29,800	4,460.00	132,908,000	
東海理化電機製作所	3,500	1,685.00	5,897,500	
三井E & Sホールディングス	4,900	929.00	4,552,100	
川崎重工業	10,500	2,485.00	26,092,500	
名村造船所	4,100	313.00	1,283,300	
サノヤスホールディングス	1,900	228.00	433,200	
日本車輛製造	500	2,487.00	1,243,500	
三菱ロジスネクスト	1,600	1,162.00	1,859,200	
近畿車輛	200	1,772.00	354,400	
日産自動車	159,600	757.90	120,960,840	
いすゞ自動車	42,800	1,225.00	52,430,000	
トヨタ自動車	150,800	6,727.00	1,014,431,600	代用有価証券 35,000株
日野自動車	16,900	883.00	14,922,700	
三菱自動車工業	50,200	500.00	25,100,000	
エフテック	1,000	726.00	726,000	
レシップホールディングス	600	798.00	478,800	
G M B	300	817.00	245,100	
ファルテック	300	784.00	235,200	
武蔵精密工業	3,300	1,349.00	4,451,700	
日産車体	2,600	1,037.00	2,696,200	
新明和工業	5,700	1,312.00	7,478,400	
極東開発工業	2,700	1,284.00	3,466,800	
日信工業	2,500	1,396.00	3,490,000	
トビー工業	1,100	2,414.00	2,655,400	
ティラド	500	1,812.00	906,000	

タチエス	2,200	1,281.00	2,818,200
NOK	7,200	1,458.00	10,497,600
フタバ産業	3,800	549.00	2,086,200
KYB	1,400	2,894.00	4,051,600
大同メタル工業	2,200	639.00	1,405,800
プレス工業	6,700	467.00	3,128,900
ミクニ	1,800	375.00	675,000
太平洋工業	2,800	1,432.00	4,009,600
ケーヒン	3,100	1,486.00	4,606,600
河西工業	1,700	740.00	1,258,000
アイシン精機	11,100	3,610.00	40,071,000
マツダ	42,500	1,104.00	46,920,000
今仙電機製作所	1,300	913.00	1,186,900
本田技研工業	114,200	2,775.00	316,905,000
スズキ	24,800	5,177.00	128,389,600
SUBARU	42,000	2,568.50	107,877,000
安永	700	1,430.00	1,001,000
ヤマハ発動機	19,100	1,882.00	35,946,200
ショーワ	3,200	1,378.00	4,409,600
TBK	1,600	385.00	616,000
エクセディ	1,800	2,168.00	3,902,400
豊田合成	4,400	1,986.00	8,738,400
愛三工業	2,100	673.00	1,413,300
盟和産業	200	1,034.00	206,800
日本プラスト	1,100	668.00	734,800
ヨロズ	1,300	1,307.00	1,699,100
エフ・シー・シー	2,400	2,293.00	5,503,200
シマノ	5,400	16,530.00	89,262,000
テイ・エス テック	3,100	2,801.00	8,683,100
ジャムコ	700	2,156.00	1,509,200
テルモ	38,300	3,237.00	123,977,100
クリエートメディック	500	926.00	463,000
日機装	4,400	1,433.00	6,305,200
島津製作所	17,400	2,806.00	48,824,400
JMS	1,200	680.00	816,000
長野計器	1,100	715.00	786,500
ブイ・テクノロジー	600	4,460.00	2,676,000
東京計器	900	908.00	817,200
愛知時計電機	200	4,130.00	826,000
インターアクション	700	1,374.00	961,800
オーバル	1,400	235.00	329,000
東京精密	2,400	2,492.00	5,980,800



マニー	1,800	6,750.00	12,150,000
ニコン	23,600	1,498.00	35,352,800
トプコン	7,300	1,280.00	9,344,000
オリンパス	80,600	1,233.00	99,379,800
理研計器	1,200	1,962.00	2,354,400
タムロン	1,200	2,162.00	2,594,400
H O Y A	27,300	8,010.00	218,673,000
シード	600	1,057.00	634,200
ノーリツ鋼機	1,100	1,936.00	2,129,600
エー・アンド・デイ	1,200	777.00	932,400
朝日インテック	5,700	5,290.00	30,153,000
シチズン時計	14,800	525.00	7,770,000
リズム時計工業	500	1,270.00	635,000
大研医器	1,100	645.00	709,500
メニコン	1,900	3,700.00	7,030,000
シンシア	200	593.00	118,600
松風	700	1,315.00	920,500
セイコーホールディングス	2,100	2,118.00	4,447,800
ニプロ	9,300	1,190.00	11,067,000
中本パックス	400	1,479.00	591,600
スノーピーク	500	1,362.00	681,000
パラマウントベッドホールディングス	1,500	4,275.00	6,412,500
トランザクション	900	843.00	758,700
S H O - B I	500	370.00	185,000
ニホンフラッシュ	600	2,660.00	1,596,000
前田工織	1,500	1,964.00	2,946,000
永大産業	1,800	333.00	599,400
アートネイチャー	1,400	620.00	868,000
バンダイナムコホールディングス	14,000	5,400.00	75,600,000
アイフィスジャパン	300	623.00	186,900
共立印刷	2,300	186.00	427,800
S H O E I	700	4,430.00	3,101,000
フランスベッドホールディングス	1,900	981.00	1,863,900
パイロットコーポレーション	2,400	4,170.00	10,008,000
萩原工業	800	1,325.00	1,060,000
トッパン・フォームズ	2,900	874.00	2,534,600
フジシールインターナショナル	3,000	3,290.00	9,870,000
タカラトミー	5,700	1,330.00	7,581,000
廣済堂	1,300	664.00	863,200
エステールホールディングス	400	603.00	241,200
アーク	5,300	103.00	545,900
タカノ	500	779.00	389,500

プロネクサス	1,100	1,149.00	1,263,900
ホクシン	1,200	130.00	156,000
ウッドワン	500	996.00	498,000
大建工業	1,000	2,173.00	2,173,000
凸版印刷	19,100	1,639.00	31,304,900
大日本印刷	19,100	2,406.00	45,954,600
図書印刷	1,300	1,307.00	1,699,100
共同印刷	400	2,770.00	1,108,000
N I S S H A	2,800	1,072.00	3,001,600
光村印刷	100	2,079.00	207,900
宝印刷	600	1,586.00	951,600
アシックス	12,800	1,214.00	15,539,200
ツツミ	400	2,051.00	820,400
小松ウオール工業	400	1,770.00	708,000
ヤマハ	8,100	5,120.00	41,472,000
河合楽器製作所	400	2,994.00	1,197,600
クリナップ	1,200	534.00	640,800
ピジョン	8,200	4,275.00	35,055,000
兼松サステック	100	1,628.00	162,800
キングジム	1,100	848.00	932,800
リンテック	3,200	2,213.00	7,081,600
イトーキ	2,500	426.00	1,065,000
任天堂	7,700	37,450.00	288,365,000
三菱鉛筆	2,200	1,789.00	3,935,800
タカラスタンド	2,800	1,671.00	4,678,800
コクヨ	6,500	1,456.00	9,464,000
ナカバヤシ	1,300	505.00	656,500
グローブライド	700	3,385.00	2,369,500
オカムラ	4,700	1,024.00	4,812,800
美津濃	1,300	2,504.00	3,255,200
東京電力ホールディングス	108,100	569.00	61,508,900
中部電力	41,400	1,531.50	63,404,100
関西電力	55,200	1,245.00	68,724,000
中国電力	18,700	1,367.00	25,562,900
北陸電力	13,300	797.00	10,600,100
東北電力	31,700	1,110.00	35,187,000
四国電力	12,200	989.00	12,065,800
九州電力	27,900	1,066.00	29,741,400
北海道電力	12,700	607.00	7,708,900
沖縄電力	2,500	1,693.00	4,232,500
電源開発	10,800	2,460.00	26,568,000
エフオン	600	755.00	453,000

イーレックス	2,400	1,157.00	2,776,800
レノバ	2,200	815.00	1,793,000
東京瓦斯	26,500	2,638.50	69,920,250
大阪瓦斯	26,200	1,901.00	49,806,200
東邦瓦斯	6,700	4,150.00	27,805,000
北海道瓦斯	800	1,497.00	1,197,600
広島ガス	2,900	332.00	962,800
西部瓦斯	1,500	2,181.00	3,271,500
静岡ガス	4,200	815.00	3,423,000
メタウォーター	700	3,280.00	2,296,000
SBSホールディングス	1,300	1,515.00	1,969,500
東武鉄道	14,300	3,145.00	44,973,500
相鉄ホールディングス	4,600	3,015.00	13,869,000
東京急行電鉄	36,800	1,952.00	71,833,600
京浜急行電鉄	18,500	1,876.00	34,706,000
小田急電鉄	21,700	2,688.00	58,329,600
京王電鉄	7,600	7,330.00	55,708,000
京成電鉄	10,200	4,035.00	41,157,000
富士急行	1,900	4,010.00	7,619,000
東日本旅客鉄道	24,100	10,265.00	247,386,500
西日本旅客鉄道	12,100	8,780.00	106,238,000
東海旅客鉄道	12,100	22,740.00	275,154,000
西武ホールディングス	16,800	1,817.00	30,525,600
鴻池運輸	2,100	1,699.00	3,567,900
西日本鉄道	3,700	2,352.00	8,702,400
ハマキョウレックス	1,000	3,805.00	3,805,000
サカイ引越センター	700	6,490.00	4,543,000
近鉄グループホールディングス	12,800	5,210.00	66,688,000
阪急阪神ホールディングス	17,100	3,830.00	65,493,000
南海電気鉄道	5,700	2,731.00	15,566,700
京阪ホールディングス	5,700	4,790.00	27,303,000
神戸電鉄	400	3,955.00	1,582,000
名古屋鉄道	10,500	3,030.00	31,815,000
山陽電気鉄道	1,000	2,171.00	2,171,000
日本通運	4,900	5,500.00	26,950,000
ヤマトホールディングス	22,500	2,221.00	49,972,500
山九	3,600	5,530.00	19,908,000
丸運	700	277.00	193,900
丸全昭和運輸	1,000	3,410.00	3,410,000
センコーグループホールディングス	7,100	870.00	6,177,000
トナミホールディングス	300	5,430.00	1,629,000
ニッコンホールディングス	4,800	2,551.00	12,244,800

日本石油輸送	200	2,819.00	563,800
福山通運	1,600	3,945.00	6,312,000
セイノーホールディングス	9,600	1,437.00	13,795,200
エスライン	400	961.00	384,400
神奈川中央交通	300	3,825.00	1,147,500
日立物流	2,800	3,415.00	9,562,000
丸和運輸機関	700	4,950.00	3,465,000
C & F ロジホールディングス	1,300	1,314.00	1,708,200
九州旅客鉄道	10,700	3,515.00	37,610,500
S Gホールディングス	12,100	3,145.00	38,054,500
日本郵船	10,700	1,598.00	17,098,600
商船三井	7,600	2,365.00	17,974,000
川崎汽船	4,000	1,149.00	4,596,000
N S ユナイテッド海運	700	2,196.00	1,537,200
明治海運	1,400	305.00	427,000
飯野海運	6,100	360.00	2,196,000
共栄タンカー	100	1,456.00	145,600
乾汽船	1,200	831.00	997,200
日本航空	23,500	3,517.00	82,649,500
A N Aホールディングス	23,400	3,641.00	85,199,400
パスコ	300	821.00	246,300
トランコム	400	6,130.00	2,452,000
日新	1,100	1,778.00	1,955,800
三菱倉庫	4,400	3,110.00	13,684,000
三井倉庫ホールディングス	1,600	1,566.00	2,505,600
住友倉庫	4,700	1,387.00	6,518,900
澁澤倉庫	700	1,734.00	1,213,800
東陽倉庫	2,400	319.00	765,600
日本トランスシティ	2,800	446.00	1,248,800
ケイヒン	300	1,182.00	354,600
中央倉庫	800	1,038.00	830,400
川西倉庫	300	1,057.00	317,100
安田倉庫	1,000	871.00	871,000
ファイズ	200	691.00	138,200
東洋埠頭	400	1,363.00	545,200
宇徳	1,100	500.00	550,000
上組	7,900	2,515.00	19,868,500
サンリツ	300	634.00	190,200
キムラユニティー	400	1,068.00	427,200
キューソー流通システム	300	2,080.00	624,000
近鉄エクスプレス	2,400	1,390.00	3,336,000
東海運	800	247.00	197,600

エーアイティー	900	914.00	822,600
内外トランスライン	400	1,177.00	470,800
日本コンセプト	500	1,220.00	610,000
NEC ネットエスアイ	1,500	2,830.00	4,245,000
クロスキャット	400	954.00	381,600
システナ	4,700	1,761.00	8,276,700
デジタルアーツ	700	9,180.00	6,426,000
日鉄ソリューションズ	2,000	3,415.00	6,830,000
キューブシステム	700	800.00	560,000
エイジア	300	1,198.00	359,400
コア	600	1,619.00	971,400
ソリトンシステムズ	800	1,020.00	816,000
ソフトクリエイトホールディングス	600	1,587.00	952,200
T I S	4,400	5,390.00	23,716,000
ネオス	600	868.00	520,800
電算システム	500	3,600.00	1,800,000
グリー	9,200	495.00	4,554,000
コーエーテクモホールディングス	2,700	1,993.00	5,381,100
三菱総合研究所	600	3,260.00	1,956,000
ボルテージ	300	503.00	150,900
電算	200	1,985.00	397,000
A G S	800	675.00	540,000
ファインデックス	1,100	851.00	936,100
ブレインパッド	300	6,950.00	2,085,000
K L a b	2,400	827.00	1,984,800
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,800	1,275.00	2,295,000
イーブックイニシアティブジャパン	200	2,348.00	469,600
ネクソン	33,900	1,580.00	53,562,000
アイスタイル	3,400	720.00	2,448,000
エムアップ	500	2,224.00	1,112,000
エイチーム	900	1,246.00	1,121,400
エニグモ	500	3,085.00	1,542,500
テクノスジャパン	1,100	574.00	631,400
コロプラ	4,400	715.00	3,146,000
ブロードリーフ	6,600	542.00	3,577,200
クロス・マーケティンググループ	500	355.00	177,500
デジタルハーツホールディングス	600	1,084.00	650,400
システム情報	700	825.00	577,500
メディアドゥホールディングス	400	3,420.00	1,368,000
じげん	1,900	802.00	1,523,800
ブイキューブ	800	569.00	455,200
エンカレッジ・テクノロジー	200	865.00	173,000

サイバーリンクス	200	1,148.00	229,600
フィックスターズ	1,400	1,990.00	2,786,000
CARTA HOLDINGS	600	1,380.00	828,000
オブティム	600	3,590.00	2,154,000
セレス	400	1,770.00	708,000
ティーガイア	1,300	1,965.00	2,554,500
セック	200	3,355.00	671,000
日本アジアグループ	1,400	346.00	484,400
豆蔵ホールディングス	900	1,311.00	1,179,900
テクマトリックス	900	2,077.00	1,869,300
プロシップ	400	1,148.00	459,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	32,100	303.00	9,726,300
GMOペイメントゲートウェイ	2,200	6,900.00	15,180,000
ザッパラス	800	373.00	298,400
システムリサーチ	200	3,075.00	615,000
インターネットイニシアティブ	2,100	2,021.00	4,244,100
さくらインターネット	1,600	534.00	854,400
ヴィンクス	500	1,199.00	599,500
GMOクラウド	300	3,060.00	918,000
SRAホールディングス	700	2,400.00	1,680,000
Minor iソリューションズ	300	1,827.00	548,100
システムインテグレータ	400	715.00	286,000
朝日ネット	1,100	661.00	727,100
eBASE	800	1,149.00	919,200
アバント	500	2,235.00	1,117,500
アドソル日進	500	1,578.00	789,000
フリービット	800	1,300.00	1,040,000
コムチュア	700	4,065.00	2,845,500
サイバーコム	200	2,005.00	401,000
アステリア	900	1,015.00	913,500
マークライنز	600	1,966.00	1,179,600
メディカル・データ・ビジョン	1,200	1,174.00	1,408,800
gumi	1,700	531.00	902,700
ショーケース	300	528.00	158,400
モバイルファクトリー	400	1,414.00	565,600
テラスカイ	200	1,575.00	315,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	600	1,857.00	1,114,200
PCIホールディングス	300	2,021.00	606,300
パイブドHD	200	1,229.00	245,800
アイビーシー	200	1,259.00	251,800
ネオジャパン	300	912.00	273,600
PR TIMES	100	3,080.00	308,000

ランドコンピュータ	200	1,167.00	233,400
ダブルスタンダード	100	4,695.00	469,500
オープンドア	700	2,990.00	2,093,000
マイネット	400	718.00	287,200
アカツキ	500	5,510.00	2,755,000
ベネフィットジャパン	100	848.00	84,800
U b i c o mホールディングス	300	1,740.00	522,000
L I N E	4,000	2,940.00	11,760,000
カナミックネットワーク	300	2,314.00	694,200
ノムラシステムコーポレーション	100	744.00	74,400
チェンジ	200	2,736.00	547,200
シンクロ・フード	600	619.00	371,400
オークネット	700	1,291.00	903,700
エイトレッド	100	2,063.00	206,300
A O I T Y O H o l d i n g s	1,500	740.00	1,110,000
マクロミル	2,400	1,154.00	2,769,600
ビーグリー	300	807.00	242,100
オロ	400	2,571.00	1,028,400
テモナ	200	461.00	92,200
ソルクシーズ	600	869.00	521,400
フェイス	600	930.00	558,000
プロトコーポレーション	600	1,994.00	1,196,400
ハイマックス	200	1,848.00	369,600
野村総合研究所	8,400	5,200.00	43,680,000
サイバネットシステム	1,100	655.00	720,500
C Eホールディングス	400	973.00	389,200
日本システム技術	200	1,747.00	349,400
インテージホールディングス	1,700	1,000.00	1,700,000
東邦システムサイエンス	400	911.00	364,400
ソースネクスト	5,200	410.00	2,132,000
インフォコム	1,400	2,511.00	3,515,400
F I G	1,200	315.00	378,000
アルテリア・ネットワークス	1,500	1,177.00	1,765,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	300	1,749.00	524,700
フォーカスシステムズ	900	881.00	792,900
クレスコ	400	3,375.00	1,350,000
フジ・メディア・ホールディングス	13,800	1,470.00	20,286,000
オービック	4,600	12,960.00	59,616,000
ジャストシステム	1,900	3,595.00	6,830,500
T D Cソフト	1,200	823.00	987,600
ヤフー	86,500	306.00	26,469,000
トレンドマイクロ	7,100	4,945.00	35,109,500

I Dホールディングス	500	1,087.00	543,500
日本オラクル	2,700	7,660.00	20,682,000
アルファシステムズ	400	2,998.00	1,199,200
フューチャー	1,800	2,075.00	3,735,000
C A C Holdings	1,000	1,569.00	1,569,000
ソフトバンク・テクノロジー	600	2,461.00	1,476,600
トーセ	400	831.00	332,400
オービックビジネスコンサルタント	1,300	5,150.00	6,695,000
伊藤忠テクノソリューションズ	6,000	2,712.00	16,272,000
アイティフォー	1,600	821.00	1,313,600
東計電算	200	3,080.00	616,000
エクスネット	200	911.00	182,200
大塚商会	7,200	4,340.00	31,248,000
サイボウズ	1,600	1,294.00	2,070,400
ソフトブレーン	1,100	487.00	535,700
電通国際情報サービス	800	3,435.00	2,748,000
デジタルガレージ	2,600	3,440.00	8,944,000
E Mシステムズ	1,100	1,588.00	1,746,800
ウェザーニューズ	400	3,215.00	1,286,000
C I J	1,000	976.00	976,000
東洋ビジネスエンジニアリング	100	2,045.00	204,500
日本エンタープライズ	1,600	170.00	272,000
WOWOW	600	2,614.00	1,568,400
スカラ	900	998.00	898,200
インテリジェント ウェイブ	500	873.00	436,500
I M A G I C A GROUP	1,100	556.00	611,600
ネットワンシステムズ	4,700	3,125.00	14,687,500
システムソフト	3,500	92.00	322,000
アルゴグラフィックス	1,100	2,299.00	2,528,900
マーベラス	2,000	830.00	1,660,000
エイベックス	2,300	1,420.00	3,266,000
日本ユニシス	4,100	3,645.00	14,944,500
兼松エレクトロニクス	700	2,983.00	2,088,100
東京放送ホールディングス	8,800	1,835.00	16,148,000
日本テレビホールディングス	12,200	1,550.00	18,910,000
朝日放送グループホールディングス	1,300	719.00	934,700
テレビ朝日ホールディングス	3,600	1,707.00	6,145,200
スカパーJ S A Tホールディングス	10,100	416.00	4,201,600
テレビ東京ホールディングス	1,100	2,391.00	2,630,100
日本BS放送	500	1,064.00	532,000
ビジョン	400	4,930.00	1,972,000
スマートバリュー	400	711.00	284,400



USEN - NEXT HOLDINGS	600	765.00	459,000
コネクシオ	1,000	1,334.00	1,334,000
クロップス	300	620.00	186,000
日本電信電話	90,900	5,040.00	458,136,000
KDDI	117,100	2,731.50	319,858,650
ソフトバンク	141,000	1,406.00	198,246,000
光通信	1,600	23,210.00	37,136,000
NTTドコモ	84,200	2,486.00	209,321,200
エムティーアイ	1,300	732.00	951,600
GMOインターネット	4,800	1,873.00	8,990,400
アйдママーケティングコミュニケーション	300	596.00	178,800
カドカワ	3,900	1,415.00	5,518,500
学研ホールディングス	500	5,160.00	2,580,000
ゼンリン	2,600	1,989.00	5,171,400
昭文社	700	350.00	245,000
インプレスホールディングス	1,300	139.00	180,700
アイネット	700	1,183.00	828,100
松竹	900	13,080.00	11,772,000
東宝	8,700	4,875.00	42,412,500
東映	600	14,980.00	8,988,000
エヌ・ティ・ティ・データ	35,300	1,347.00	47,549,100
ピー・シー・エー	200	3,375.00	675,000
ビジネスブレイン太田昭和	200	2,064.00	412,800
DTS	1,500	4,520.00	6,780,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6,200	3,445.00	21,359,000
シーイーシー	1,400	2,377.00	3,327,800
カブコン	5,700	2,172.00	12,380,400
アイ・エス・ビー	300	1,672.00	501,600
ジャステック	800	960.00	768,000
SCSK	3,500	5,340.00	18,690,000
日本システムウエア	400	2,763.00	1,105,200
アイネス	1,700	1,110.00	1,887,000
TKC	1,100	4,705.00	5,175,500
富士ソフト	2,000	4,715.00	9,430,000
NSD	2,200	3,195.00	7,029,000
コナミホールディングス	5,400	5,130.00	27,702,000
福井コンピュータホールディングス	400	2,551.00	1,020,400
JBCホールディングス	1,000	1,371.00	1,371,000
ミロク情報サービス	1,300	3,415.00	4,439,500
ソフトバンクグループ	55,500	10,190.00	565,545,000
ハウスイ	100	842.00	84,200
高千穂交易	500	1,030.00	515,000

伊藤忠食品	300	4,620.00	1,386,000
エレマテック	1,200	998.00	1,197,600
JALUX	400	2,840.00	1,136,000
あらた	1,000	3,780.00	3,780,000
トーメンデバイス	200	2,260.00	452,000
東京エレクトロン デバイス	500	1,889.00	944,500
フィールズ	1,200	511.00	613,200
双日	73,700	347.00	25,573,900
アルフレッサ ホールディングス	14,800	2,714.00	40,167,200
横浜冷凍	3,800	961.00	3,651,800
神栄	200	765.00	153,000
ラサ商事	700	793.00	555,100
ラクーンホールディングス	700	684.00	478,800
アルコニックス	1,400	1,331.00	1,863,400
神戸物産	2,000	5,420.00	10,840,000
あい ホールディングス	1,900	1,768.00	3,359,200
ディーブイエックス	500	806.00	403,000
ダイワボウホールディングス	1,200	4,980.00	5,976,000
マクニカ・富士エレホールディングス	3,700	1,326.00	4,906,200
ラクト・ジャパン	600	3,865.00	2,319,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,500	1,044.00	2,610,000
八洲電機	1,000	816.00	816,000
メディアスホールディングス	700	719.00	503,300
レスターホールディングス	1,500	1,448.00	2,172,000
ジューテックホールディングス	300	919.00	275,700
大光	600	638.00	382,800
OCHIホールディングス	400	1,193.00	477,200
TOKAIホールディングス	7,000	902.00	6,314,000
黒谷	300	448.00	134,400
Cominix	200	836.00	167,200
三洋貿易	700	2,385.00	1,669,500
ビューティガレージ	200	1,586.00	317,200
ウイン・パートナーズ	900	1,108.00	997,200
ミタチ産業	400	692.00	276,800
シップヘルスケアホールディングス	2,800	4,735.00	13,258,000
明治電機工業	400	1,405.00	562,000
デリカフーズホールディングス	300	1,452.00	435,600
スターティアホールディングス	300	537.00	161,100
コメダホールディングス	3,100	2,134.00	6,615,400
富士興産	500	963.00	481,500
協栄産業	100	1,414.00	141,400
小野建	1,200	1,401.00	1,681,200

南陽	300	1,527.00	458,100
佐島電機	1,000	859.00	859,000
エコートレーディング	300	522.00	156,600
伯東	900	1,136.00	1,022,400
コンドーテック	1,000	947.00	947,000
中山福	800	557.00	445,600
ナガイレーベン	1,900	2,507.00	4,763,300
三菱食品	1,500	2,877.00	4,315,500
松田産業	1,000	1,483.00	1,483,000
第一興商	2,000	5,020.00	10,040,000
メディパルホールディングス	14,400	2,372.00	34,156,800
S P K	300	2,362.00	708,600
萩原電気ホールディングス	500	2,626.00	1,313,000
アズワン	1,000	9,470.00	9,470,000
スズデン	500	1,303.00	651,500
シモジマ	800	1,122.00	897,600
ドウシシャ	1,300	1,800.00	2,340,000
小津産業	300	1,718.00	515,400
高速	800	1,135.00	908,000
たけびし	500	1,302.00	651,000
リックス	300	1,416.00	424,800
丸文	1,100	549.00	603,900
ハピネット	1,100	1,291.00	1,420,100
橋本総業ホールディングス	300	1,502.00	450,600
日本ライフライン	4,200	1,763.00	7,404,600
タカショー	700	464.00	324,800
エクセル	500	1,576.00	788,000
マルカ	400	1,879.00	751,600
I D O M	4,500	272.00	1,224,000
日本エム・ディ・エム	800	1,512.00	1,209,600
進和	800	2,203.00	1,762,400
エスケイジャパン	300	526.00	157,800
ダイترون	600	1,184.00	710,400
シークス	1,700	1,209.00	2,055,300
田中商事	500	583.00	291,500
オーハシテクニカ	800	1,421.00	1,136,800
白銅	400	1,333.00	533,200
伊藤忠商事	93,200	2,022.50	188,497,000
丸紅	131,400	714.10	93,832,740
高島	200	1,690.00	338,000
長瀬産業	7,500	1,592.00	11,940,000
蝶理	800	1,668.00	1,334,400

豊田通商	14,900	3,240.00	48,276,000
三共生興	2,300	516.00	1,186,800
兼松	5,400	1,213.00	6,550,200
ツカモトコーポレーション	200	1,028.00	205,600
三井物産	109,800	1,750.00	192,150,000
日本紙パルプ商事	800	3,580.00	2,864,000
日立ハイテクノロジーズ	4,000	5,530.00	22,120,000
カメイ	1,700	1,134.00	1,927,800
東都水産	200	2,535.00	507,000
OUGホールディングス	200	2,624.00	524,800
スターゼン	500	3,940.00	1,970,000
山善	5,200	1,036.00	5,387,200
椿本興業	300	3,245.00	973,500
住友商事	78,900	1,601.50	126,358,350
内田洋行	600	3,380.00	2,028,000
三菱商事	93,500	2,877.00	268,999,500
第一実業	600	2,925.00	1,755,000
キャノンマーケティングジャパン	3,800	2,396.00	9,104,800
西華産業	700	1,271.00	889,700
佐藤商事	1,200	922.00	1,106,400
菱洋エレクトロ	1,400	1,692.00	2,368,800
東京産業	1,300	470.00	611,000
ユアサ商事	1,400	3,050.00	4,270,000
神鋼商事	300	2,323.00	696,900
小林産業	800	324.00	259,200
阪和興業	2,300	2,866.00	6,591,800
正栄食品工業	900	3,410.00	3,069,000
カナデン	1,200	1,300.00	1,560,000
菱電商事	1,100	1,586.00	1,744,600
フルサト工業	700	1,447.00	1,012,900
岩谷産業	3,000	3,715.00	11,145,000
すてきナイスグループ	700	587.00	410,900
昭光通商	600	620.00	372,000
ニチモウ	200	1,733.00	346,600
極東貿易	400	1,476.00	590,400
イワキ	1,600	503.00	804,800
三愛石油	3,600	1,016.00	3,657,600
稲畑産業	3,200	1,357.00	4,342,400
G S Iクレオス	400	1,109.00	443,600
明和産業	1,300	359.00	466,700
クワザワ	500	481.00	240,500
ワキタ	2,800	1,030.00	2,884,000

東邦ホールディングス	3,900	2,524.00	9,843,600
サンゲツ	3,900	2,109.00	8,225,100
ミツウロコグループホールディングス	1,800	766.00	1,378,800
シナネンホールディングス	500	1,788.00	894,000
伊藤忠エネクス	2,900	871.00	2,525,900
サンリオ	4,100	2,581.00	10,582,100
サンワテクノス	800	828.00	662,400
リョーサン	1,500	2,582.00	3,873,000
新光商事	1,300	1,871.00	2,432,300
トーヨー	600	2,023.00	1,213,800
三信電気	900	1,763.00	1,586,700
東陽テクニカ	1,500	896.00	1,344,000
モスフードサービス	1,800	2,378.00	4,280,400
加賀電子	1,300	1,537.00	1,998,100
ソーダニッカ	1,400	571.00	799,400
立花エレテック	1,000	1,670.00	1,670,000
フォーバル	600	948.00	568,800
PALTAC	2,400	5,800.00	13,920,000
三谷産業	1,600	276.00	441,600
太平洋興発	500	747.00	373,500
西本Wismettacホールディングス	300	3,750.00	1,125,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,215.00	121,500
国際紙パルプ商事	3,100	266.00	824,600
ヤマタネ	700	1,353.00	947,100
丸紅建材リース	100	1,682.00	168,200
日鉄物産	1,000	4,245.00	4,245,000
泉州電業	500	2,799.00	1,399,500
トラスコ中山	2,800	2,302.00	6,445,600
オートバックスセブン	5,300	1,821.00	9,651,300
モリト	1,000	803.00	803,000
加藤産業	2,100	3,385.00	7,108,500
北恵	200	833.00	166,600
イノテック	800	806.00	644,800
イエローハット	2,500	1,475.00	3,687,500
JKホールディングス	1,200	559.00	670,800
日伝	1,100	1,743.00	1,917,300
北沢産業	1,000	277.00	277,000
杉本商事	700	2,082.00	1,457,400
因幡電機産業	1,900	4,345.00	8,255,500
東テク	400	2,253.00	901,200
ミスミグループ本社	16,700	2,618.00	43,720,600
アルテック	1,000	211.00	211,000

タキヒヨー	400	1,866.00	746,400
蔵王産業	200	1,344.00	268,800
スズケン	6,100	6,550.00	39,955,000
ジェコス	900	953.00	857,700
ルネサスイーストン	1,200	454.00	544,800
ローソン	3,400	5,130.00	17,442,000
サンエー	1,000	4,335.00	4,335,000
カワチ薬品	1,000	1,900.00	1,900,000
エービーシー・マート	2,100	7,050.00	14,805,000
ハードオフコーポレーション	600	699.00	419,400
アスクル	1,400	2,546.00	3,564,400
ゲオホールディングス	2,000	1,405.00	2,810,000
アダストリア	1,800	2,523.00	4,541,400
ジーフット	800	664.00	531,200
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	200	660.00	132,000
くら寿司	800	4,560.00	3,648,000
キャンドウ	600	1,650.00	990,000
パルグループホールディングス	700	3,315.00	2,320,500
エディオン	5,600	1,004.00	5,622,400
サーラコーポレーション	2,700	580.00	1,566,000
ワッツ	600	685.00	411,000
ハローズ	500	2,297.00	1,148,500
フジオフードシステム	600	2,901.00	1,740,600
あみやき亭	300	3,460.00	1,038,000
ひらまつ	2,700	342.00	923,400
大黒天物産	300	3,470.00	1,041,000
ハニーズホールディングス	1,200	1,007.00	1,208,400
ファーマライズホールディングス	300	526.00	157,800
アルペン	1,000	1,593.00	1,593,000
ハブ	500	1,194.00	597,000
クオールホールディングス	2,000	1,517.00	3,034,000
ジーンズ	700	6,390.00	4,473,000
ビックカメラ	7,900	1,132.00	8,942,800
D C Mホールディングス	7,200	1,077.00	7,754,400
ペッパーフードサービス	1,100	1,891.00	2,080,100
Monotaro	8,400	2,562.00	21,520,800
東京一番フーズ	400	603.00	241,200
DDホールディングス	300	2,081.00	624,300
きちりホールディングス	400	726.00	290,400
アーランドサービスホールディングス	1,000	1,880.00	1,880,000
J.フロント リテイリング	17,100	1,143.00	19,545,300
ドトール・日レスホールディングス	2,300	2,085.00	4,795,500

マツモトキヨシホールディングス	5,500	3,195.00	17,572,500
ブロンコピリー	700	2,227.00	1,558,900
Z O Z O	14,400	1,909.00	27,489,600
トレジャー・ファクトリー	400	901.00	360,400
物語コーポレーション	300	8,330.00	2,499,000
ココカラファイン	1,500	5,750.00	8,625,000
三越伊勢丹ホールディングス	24,900	891.00	22,185,900
H a m e e	400	689.00	275,600
ウエルシアホールディングス	3,500	4,310.00	15,085,000
クリエイトSDホールディングス	2,000	2,478.00	4,956,000
丸善CHIホールディングス	1,500	377.00	565,500
ミサワ	300	445.00	133,500
ティーライフ	200	865.00	173,000
エー・ピーカンパニー	300	460.00	138,000
チムニー	400	2,450.00	980,000
シュッピン	900	766.00	689,400
ネクステージ	2,100	1,238.00	2,599,800
ジョイフル本田	3,900	1,202.00	4,687,800
鳥貴族	500	2,176.00	1,088,000
キリン堂ホールディングス	500	1,742.00	871,000
ホットランド	700	1,583.00	1,108,100
すかいらーくホールディングス	12,400	1,959.00	24,291,600
SFPホールディングス	600	1,796.00	1,077,600
綿半ホールディングス	500	2,483.00	1,241,500
ヨシックス	200	2,360.00	472,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3,800	926.00	3,518,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	600	667.00	400,200
B E E N O S	500	1,863.00	931,500
あさひ	1,100	1,264.00	1,390,400
日本調剤	500	3,640.00	1,820,000
コスモス薬品	600	18,000.00	10,800,000
トーエル	700	710.00	497,000
オンリー	200	811.00	162,200
セブン&アイ・ホールディングス	55,900	3,703.00	206,997,700
薬王堂	600	2,317.00	1,390,200
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	3,600	1,419.00	5,108,400
ツルハホールディングス	2,900	9,060.00	26,274,000
サンマルクホールディングス	1,000	2,335.00	2,335,000
フェリシモ	300	973.00	291,900
トリドールホールディングス	1,700	1,977.00	3,360,900
T O K Y O B A S E	1,200	827.00	992,400

ウイルプラスホールディングス	200	847.00	169,400
ジャパンミート	700	1,690.00	1,183,000
サツドラホールディングス	200	1,908.00	381,600
デファクトスタンダード	200	342.00	68,400
アレンザホールディングス	700	840.00	588,000
パロックジャパンリミテッド	1,100	882.00	970,200
クスリのアオキホールディングス	1,300	7,440.00	9,672,000
力の源ホールディングス	500	733.00	366,500
スシログローバルホールディングス	1,500	7,770.00	11,655,000
LIXILビバ	1,100	1,193.00	1,312,300
メディカルシステムネットワーク	1,500	496.00	744,000
はるやまホールディングス	600	826.00	495,600
ノジマ	2,400	1,767.00	4,240,800
カッパ・クリエイト	1,900	1,375.00	2,612,500
ライトオン	1,000	728.00	728,000
ジーンズメイト	400	326.00	130,400
良品計画	1,900	19,220.00	36,518,000
三城ホールディングス	1,600	332.00	531,200
アドヴァン	2,100	1,095.00	2,299,500
アルビス	500	2,473.00	1,236,500
コナカ	1,500	411.00	616,500
ハウス オブ ローゼ	200	1,672.00	334,400
G-7ホールディングス	400	3,060.00	1,224,000
イオン北海道	1,300	724.00	941,200
コジマ	2,300	487.00	1,120,100
ヒマラヤ	500	862.00	431,000
コーナン商事	1,700	2,257.00	3,836,900
エコス	500	1,392.00	696,000
ワタミ	1,800	1,535.00	2,763,000
マルシェ	500	781.00	390,500
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	8,000	6,910.00	55,280,000
西松屋チェーン	2,900	877.00	2,543,300
ゼンショーホールディングス	6,300	2,177.00	13,715,100
幸楽苑ホールディングス	900	2,855.00	2,569,500
ハークスレイ	300	1,025.00	307,500
サイゼリヤ	2,200	2,419.00	5,321,800
V Tホールディングス	6,100	443.00	2,702,300
魚力	400	1,483.00	593,200
ポブラ	400	483.00	193,200
フジ・コーポレーション	300	2,115.00	634,500
ユナイテッドアローズ	1,500	3,645.00	5,467,500
ハイデイ日高	1,900	1,995.00	3,790,500



京都きもの友禅	900	360.00	324,000
コロワイド	4,400	2,086.00	9,178,400
ピーシーデポコーポレーション	1,800	436.00	784,800
壱番屋	900	4,530.00	4,077,000
P L A N T	300	807.00	242,100
スギホールディングス	2,900	5,190.00	15,051,000
ヴィア・ホールディングス	1,700	599.00	1,018,300
スクロール	2,100	337.00	707,700
ヨンドシーホールディングス	1,500	2,517.00	3,775,500
ユニー・ファミリーマートホールディングス	14,900	2,665.00	39,708,500
木曽路	1,600	2,530.00	4,048,000
S R Sホールディングス	1,600	1,005.00	1,608,000
千趣会	2,500	278.00	695,000
タカキュー	1,100	172.00	189,200
ケーヨー	2,500	486.00	1,215,000
上新電機	1,600	2,123.00	3,396,800
日本瓦斯	2,200	2,679.00	5,893,800
ロイヤルホールディングス	2,300	2,773.00	6,377,900
東天紅	100	1,200.00	120,000
いなげや	1,500	1,368.00	2,052,000
島忠	2,800	2,350.00	6,580,000
チヨダ	1,400	1,619.00	2,266,600
ライフコーポレーション	1,000	2,108.00	2,108,000
リンガーハット	1,700	2,219.00	3,772,300
M r M a x H D	1,800	447.00	804,600
テンアライド	1,300	417.00	542,100
A O K Iホールディングス	2,700	1,046.00	2,824,200
オークワ	1,900	1,160.00	2,204,000
コメリ	2,000	2,202.00	4,404,000
青山商事	2,300	2,072.00	4,765,600
しまむら	1,500	7,810.00	11,715,000
はせがわ	800	403.00	322,400
高島屋	10,500	1,108.00	11,634,000
松屋	2,700	886.00	2,392,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	6,800	1,181.00	8,030,800
近鉄百貨店	500	3,310.00	1,655,000
パルコ	1,300	1,051.00	1,366,300
丸井グループ	11,300	2,327.00	26,295,100
アクシアル リテイリング	1,100	3,615.00	3,976,500
イオン	51,300	1,857.50	95,289,750
イズミ	2,700	4,500.00	12,150,000
平和堂	2,700	1,935.00	5,224,500

フジ	1,600	1,802.00	2,883,200
ヤオコー	1,500	4,950.00	7,425,000
ゼビオホールディングス	1,600	1,249.00	1,998,400
ケーズホールディングス	13,900	1,036.00	14,400,400
Olympicグループ	800	694.00	555,200
日産東京販売ホールディングス	2,000	271.00	542,000
Genky DrugStores	600	2,521.00	1,512,600
総合メディカルホールディングス	1,100	1,671.00	1,838,100
ブックオフグループホールディングス	700	1,014.00	709,800
アインホールディングス	1,800	6,610.00	11,898,000
元気寿司	400	3,775.00	1,510,000
ヤマダ電機	40,600	490.00	19,894,000
アークランドサカモト	2,200	1,339.00	2,945,800
ニトリホールディングス	5,800	13,250.00	76,850,000
愛眼	1,100	239.00	262,900
ケーユーホールディングス	700	857.00	599,900
吉野家ホールディングス	4,700	1,869.00	8,784,300
松屋フーズホールディングス	600	3,330.00	1,998,000
サガミホールディングス	1,800	1,335.00	2,403,000
関西スーパーマーケット	1,000	1,096.00	1,096,000
王将フードサービス	1,000	6,700.00	6,700,000
プレナス	1,500	1,868.00	2,802,000
ミニストップ	1,000	1,594.00	1,594,000
アークス	2,500	2,212.00	5,530,000
パローホールディングス	2,900	2,238.00	6,490,200
藤久	100	719.00	71,900
ベルク	600	5,350.00	3,210,000
大庄	700	1,577.00	1,103,900
ファーストリテイリング	1,800	66,930.00	120,474,000
サンドラッグ	5,000	2,789.00	13,945,000
サックスパーホールディングス	1,100	967.00	1,063,700
ヤマザワ	300	1,625.00	487,500
やまや	200	2,050.00	410,000
ベルーナ	3,300	739.00	2,438,700
島根銀行	300	706.00	211,800
じもとホールディングス	9,300	97.00	902,100
めぶきフィナンシャルグループ	69,300	270.00	18,711,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,800	1,676.00	3,016,800
九州フィナンシャルグループ	21,900	430.00	9,417,000
ゆうちょ銀行	37,700	1,078.00	40,640,600
富山第一銀行	3,100	306.00	948,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	83,700	395.00	33,061,500

西日本フィナンシャルホールディングス	8,400	789.00	6,627,600	
関西みらいフィナンシャルグループ	6,200	719.00	4,457,800	
三十三フィナンシャルグループ	1,200	1,545.00	1,854,000	
第四北越フィナンシャルグループ	2,300	2,807.00	6,456,100	
新生銀行	9,800	1,655.00	16,219,000	
あおぞら銀行	7,500	2,555.00	19,162,500	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	918,700	503.70	462,749,190	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	146,500	440.00	64,460,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	26,100	3,880.00	101,268,000	
三井住友フィナンシャルグループ	94,100	3,766.00	354,380,600	代用有価証券 10,000株
千葉銀行	45,900	531.00	24,372,900	
群馬銀行	26,700	389.00	10,386,300	
武蔵野銀行	2,000	2,073.00	4,146,000	
千葉興業銀行	3,700	279.00	1,032,300	
筑波銀行	5,700	171.00	974,700	
七十七銀行	4,200	1,614.00	6,778,800	
青森銀行	1,000	2,759.00	2,759,000	
秋田銀行	900	2,041.00	1,836,900	
山形銀行	1,500	1,681.00	2,521,500	
岩手銀行	900	2,990.00	2,691,000	
東邦銀行	11,800	247.00	2,914,600	
東北銀行	700	1,085.00	759,500	
みちのく銀行	900	1,648.00	1,483,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	11,800	1,921.00	22,667,800	
静岡銀行	33,600	802.00	26,947,200	
十六銀行	1,800	2,338.00	4,208,400	
スルガ銀行	13,700	414.00	5,671,800	
八十二銀行	32,200	460.00	14,812,000	
山梨中央銀行	1,600	1,206.00	1,929,600	
大垣共立銀行	2,800	2,477.00	6,935,600	
福井銀行	1,100	1,538.00	1,691,800	
北國銀行	1,400	3,115.00	4,361,000	
清水銀行	600	1,801.00	1,080,600	
富山銀行	300	2,598.00	779,400	
滋賀銀行	2,700	2,544.00	6,868,800	
南都銀行	2,100	2,300.00	4,830,000	
百五銀行	12,000	341.00	4,092,000	
京都銀行	4,800	4,170.00	20,016,000	
紀陽銀行	4,700	1,467.00	6,894,900	
ほくほくフィナンシャルグループ	8,900	1,173.00	10,439,700	
広島銀行	19,700	549.00	10,815,300	

山陰合同銀行	7,900	690.00	5,451,000
中国銀行	11,500	1,009.00	11,603,500
鳥取銀行	400	1,407.00	562,800
伊予銀行	17,600	563.00	9,908,800
百十四銀行	1,400	2,338.00	3,273,200
四国銀行	1,900	938.00	1,782,200
阿波銀行	2,000	2,680.00	5,360,000
大分銀行	800	3,130.00	2,504,000
宮崎銀行	900	2,653.00	2,387,700
佐賀銀行	800	1,563.00	1,250,400
沖縄銀行	1,200	3,515.00	4,218,000
琉球銀行	3,100	1,111.00	3,444,100
セブン銀行	45,100	280.00	12,628,000
みずほフィナンシャルグループ	1,813,400	151.40	274,548,760
高知銀行	600	762.00	457,200
山口フィナンシャルグループ	16,700	745.00	12,441,500
長野銀行	500	1,689.00	844,500
名古屋銀行	1,100	3,390.00	3,729,000
北洋銀行	20,100	256.00	5,145,600
愛知銀行	500	3,775.00	1,887,500
中京銀行	500	2,186.00	1,093,000
大光銀行	400	1,602.00	640,800
愛媛銀行	1,900	1,102.00	2,093,800
トマト銀行	500	1,025.00	512,500
京葉銀行	5,900	636.00	3,752,400
栃木銀行	7,000	182.00	1,274,000
北日本銀行	400	1,726.00	690,400
東和銀行	2,400	708.00	1,699,200
福島銀行	1,300	258.00	335,400
大東銀行	700	565.00	395,500
トモニホールディングス	10,300	367.00	3,780,100
フィデアホールディングス	13,000	116.00	1,508,000
池田泉州ホールディングス	14,200	215.00	3,053,000
F P G	4,200	873.00	3,666,600
マーキュリアインベストメント	600	711.00	426,600
S B Iホールディングス	15,900	2,602.00	41,371,800
ジャフコ	2,200	3,825.00	8,415,000
大和証券グループ本社	107,000	469.50	50,236,500
野村ホールディングス	234,800	348.70	81,874,760
岡三証券グループ	11,400	404.00	4,605,600
丸三証券	4,000	579.00	2,316,000
東洋証券	5,100	116.00	591,600

東海東京フィナンシャル・ホールディングス	15,900	330.00	5,247,000
光世証券	400	657.00	262,800
水戸証券	4,000	198.00	792,000
いちよし証券	2,800	743.00	2,080,400
松井証券	6,500	1,026.00	6,669,000
だいこう証券ビジネス	600	452.00	271,200
マネックスグループ	12,400	350.00	4,340,000
カブドットコム証券	10,000	557.00	5,570,000
極東証券	1,800	902.00	1,623,600
岩井コスモホールディングス	1,400	1,136.00	1,590,400
藍澤証券	2,400	678.00	1,627,200
マネーパートナーズグループ	1,700	288.00	489,600
スパークス・グループ	5,300	227.00	1,203,100
かんぽ生命保険	5,000	2,016.00	10,080,000
S O M P Oホールディングス	23,500	4,237.00	99,569,500
アニコム ホールディングス	1,100	3,805.00	4,185,500
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	34,900	3,496.00	122,010,400
ソニーフィナンシャルホールディングス	11,000	2,606.00	28,666,000
第一生命ホールディングス	75,500	1,623.00	122,536,500
東京海上ホールディングス	47,700	5,538.00	264,162,600
T & Dホールディングス	41,300	1,136.00	46,916,800
アドバンスクリエイト	300	1,750.00	525,000
全国保証	3,800	4,230.00	16,074,000
ジェイリース	400	321.00	128,400
イントラスト	400	482.00	192,800
日本モーゲージサービス	200	1,126.00	225,200
C a s a	600	1,064.00	638,400
アルヒ	1,200	1,783.00	2,139,600
プレミアグループ	800	1,939.00	1,551,200
クレディセゾン	9,300	1,242.00	11,550,600
芙蓉総合リース	1,500	5,700.00	8,550,000
興銀リース	2,500	2,639.00	6,597,500
東京センチュリー	2,700	4,530.00	12,231,000
日本証券金融	5,900	543.00	3,203,700
アイフル	20,500	212.00	4,346,000
リコーリース	1,000	3,330.00	3,330,000
イオンフィナンシャルサービス	8,500	1,698.00	14,433,000
アコム	26,800	378.00	10,130,400
ジャックス	1,500	2,020.00	3,030,000
オリエントコーポレーション	36,400	108.00	3,931,200
日立キャピタル	3,100	2,432.00	7,539,200
アプラスフィナンシャル	6,700	70.00	469,000

オリックス	89,000	1,560.00	138,840,000
三菱UFJリース	30,100	542.00	16,314,200
九州リースサービス	700	614.00	429,800
日本取引所グループ	36,100	1,726.00	62,308,600
イー・ギャランティ	1,300	1,369.00	1,779,700
アサックス	600	558.00	334,800
NECキャピタルソリューション	500	1,765.00	882,500
いちご	17,000	330.00	5,610,000
日本駐車場開発	14,800	172.00	2,545,600
スター・マイカ・ホールディングス	600	1,570.00	942,000
ヒューリック	27,900	864.00	24,105,600
三栄建築設計	600	1,489.00	893,400
野村不動産ホールディングス	8,900	2,348.00	20,897,200
三重交通グループホールディングス	2,700	588.00	1,587,600
サムティ	1,900	1,532.00	2,910,800
ディア・ライフ	1,700	457.00	776,900
コーセーアールイー	400	805.00	322,000
エー・ディー・ワークス	22,200	39.00	865,800
日本商業開発	900	1,476.00	1,328,400
プレサンスコーポレーション	2,100	1,603.00	3,366,300
ユニゾホールディングス	2,000	1,876.00	3,752,000
THEグローバル社	700	603.00	422,100
日本管理センター	900	1,174.00	1,056,600
サンセイランディック	400	740.00	296,000
エストラスト	200	712.00	142,400
フージャースホールディングス	2,900	615.00	1,783,500
オープンハウス	1,900	4,730.00	8,987,000
東急不動産ホールディングス	36,000	601.00	21,636,000
飯田グループホールディングス	11,100	1,755.00	19,480,500
イーランド	200	672.00	134,400
ムゲンエステート	1,000	582.00	582,000
ビーロッド	300	2,208.00	662,400
ファーストブラザーズ	400	1,001.00	400,400
ハウスドゥ	700	1,579.00	1,105,300
シーアールイー	400	1,026.00	410,400
プロパティエージェント	200	959.00	191,800
ケイアイスター不動産	400	1,535.00	614,000
アグレ都市デザイン	300	456.00	136,800
グッドコムアセット	300	1,409.00	422,700
ジェイ・エス・ビー	100	4,055.00	405,500
テンポイノベーション	100	1,505.00	150,500
グローバル・リンク・マネジメント	100	596.00	59,600

パーク24	7,800	2,478.00	19,328,400
パラカ	400	1,986.00	794,400
三井不動産	70,800	2,650.00	187,620,000
三菱地所	93,600	2,046.00	191,505,600
平和不動産	2,500	2,290.00	5,725,000
東京建物	14,600	1,178.00	17,198,800
ダイビル	3,900	986.00	3,845,400
京阪神ビルディング	2,400	1,050.00	2,520,000
住友不動産	30,000	4,054.00	121,620,000
テオーシー	3,100	600.00	1,860,000
東京楽天地	200	5,160.00	1,032,000
レオパレス21	16,500	281.00	4,636,500
スターツコーポレーション	1,800	2,566.00	4,618,800
フジ住宅	1,700	730.00	1,241,000
空港施設	1,500	508.00	762,000
明和地所	800	544.00	435,200
ゴールドクレスト	1,100	1,964.00	2,160,400
日本エスリード	500	1,602.00	801,000
日神不動産	2,000	442.00	884,000
日本エスコン	2,400	679.00	1,629,600
タカラレーベン	6,200	380.00	2,356,000
サンヨーハウジング名古屋	800	895.00	716,000
イオンモール	6,700	1,659.00	11,115,300
毎日コムネット	300	721.00	216,300
ファースト住建	500	1,120.00	560,000
カチタス	1,500	4,080.00	6,120,000
トーセイ	1,900	909.00	1,727,100
サンフロンティア不動産	1,900	1,026.00	1,949,400
エフ・ジェー・ネクスト	1,200	1,119.00	1,342,800
インテリックス	400	664.00	265,600
ランドビジネス	600	783.00	469,800
グランディハウス	1,200	450.00	540,000
日本空港ビルデング	4,300	4,440.00	19,092,000
日本工営	900	2,375.00	2,137,500
LIFULL	4,500	514.00	2,313,000
ジェイエイシーリクルートメント	1,000	2,503.00	2,503,000
日本M&Aセンター	9,600	2,601.00	24,969,600
メンバーズ	500	1,999.00	999,500
中広	200	583.00	116,600
アイティメディア	300	528.00	158,400
タケエイ	1,300	884.00	1,149,200
E・Jホールディングス	200	1,052.00	210,400

トラスト・テック	700	3,235.00	2,264,500
コシダカホールディングス	3,100	1,402.00	4,346,200
アルトナー	300	722.00	216,600
パソナグループ	1,600	1,657.00	2,651,200
C D S	300	1,302.00	390,600
リンクアンドモチベーション	2,400	593.00	1,423,200
G C A	1,300	722.00	938,600
エス・エム・エス	4,800	2,622.00	12,585,600
サニーサイドアップ	100	2,258.00	225,800
パーソルホールディングス	12,900	2,463.00	31,772,700
リニカル	800	1,045.00	836,000
クックパッド	4,100	328.00	1,344,800
エスクリ	400	780.00	312,000
アイ・ケイ・ケイ	700	691.00	483,700
学情	500	1,193.00	596,500
スタジオアリス	700	2,118.00	1,482,600
シミックホールディングス	700	2,024.00	1,416,800
N J S	300	1,749.00	524,700
総合警備保障	5,200	5,200.00	27,040,000
カカクコム	9,700	2,040.00	19,788,000
アイロムグループ	500	1,543.00	771,500
セントケア・ホールディング	1,000	465.00	465,000
サイネックス	200	634.00	126,800
ルネサンス	700	1,828.00	1,279,600
ディップ	2,100	1,795.00	3,769,500
オプトホールディング	800	1,568.00	1,254,400
新日本科学	1,800	697.00	1,254,600
ツクイ	3,000	545.00	1,635,000
キャリアデザインセンター	300	1,621.00	486,300
ベネフィット・ワン	3,600	1,905.00	6,858,000
エムスリー	27,200	2,022.00	54,998,400
ツカダ・グローバルホールディング	800	607.00	485,600
プラス	200	635.00	127,000
アウトソーシング	6,800	1,228.00	8,350,400
ウェルネット	1,200	1,002.00	1,202,400
ワールドホールディングス	400	1,698.00	679,200
ディー・エヌ・エー	7,000	2,191.00	15,337,000
博報堂D Yホールディングス	18,000	1,827.00	32,886,000
ぐるなび	1,900	623.00	1,183,700
タカミヤ	1,300	777.00	1,010,100
ジャパンベストレスキューシステム	900	1,451.00	1,305,900
ファンコミュニケーションズ	3,600	560.00	2,016,000



ライク	500	1,350.00	675,000
ビジネス・ブレイクスルー	600	357.00	214,200
WDBホールディングス	600	2,780.00	1,668,000
ティア	800	645.00	516,000
CDG	100	1,341.00	134,100
バリューコマース	900	2,556.00	2,300,400
インフォマート	7,100	1,863.00	13,227,300
J Pホールディングス	3,700	291.00	1,076,700
エコナックホールディングス	2,400	126.00	302,400
E P Sホールディングス	1,900	1,750.00	3,325,000
レグス	400	1,620.00	648,000
プレステージ・インターナショナル	2,400	1,586.00	3,806,400
アミューズ	800	2,505.00	2,004,000
ドリームインキュベータ	400	1,636.00	654,400
クイック	800	1,594.00	1,275,200
T A C	700	193.00	135,100
ケネディクス	11,400	531.00	6,053,400
電通	15,700	3,775.00	59,267,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	1,093.00	546,500
ぴあ	400	4,925.00	1,970,000
イオンファンタジー	400	2,233.00	893,200
シーティーエス	1,500	632.00	948,000
ネクシィーズグループ	500	2,161.00	1,080,500
みらかホールディングス	3,600	2,640.00	9,504,000
アルプス技研	1,100	1,826.00	2,008,600
ダイオーズ	300	1,372.00	411,600
日本空調サービス	1,500	680.00	1,020,000
オリエンタルランド	15,300	13,410.00	205,173,000
ダスキン	3,300	2,902.00	9,576,600
明光ネットワークジャパン	1,500	964.00	1,446,000
ファルコホールディングス	700	1,780.00	1,246,000
秀英予備校	300	432.00	129,600
田谷	300	608.00	182,400
ラウンドワン	4,000	1,483.00	5,932,000
リゾートトラスト	5,500	1,644.00	9,042,000
ビー・エム・エル	1,700	3,230.00	5,491,000
ワタベウェディング	200	651.00	130,200
りらいあコミュニケーションズ	2,300	1,244.00	2,861,200
リソー教育	6,600	454.00	2,996,400
早稲田アカデミー	400	766.00	306,400
ユー・エス・エス	15,800	2,180.00	34,444,000
東京個別指導学院	500	886.00	443,000

サイバーエージェント	7,400	4,110.00	30,414,000
楽天	60,300	1,276.00	76,942,800
クリーク・アンド・リバー社	800	1,268.00	1,014,400
テー・オー・ダブリュー	1,100	813.00	894,300
山田コンサルティンググループ	600	2,068.00	1,240,800
セントラルスポーツ	500	3,190.00	1,595,000
フルキャストホールディングス	1,300	2,247.00	2,921,100
エン・ジャパン	1,900	4,005.00	7,609,500
リソルホールディングス	100	3,815.00	381,500
テクノプロ・ホールディングス	2,600	5,840.00	15,184,000
アトラ	300	283.00	84,900
インターワークス	300	606.00	181,800
アイ・アールジャパンホールディングス	500	2,906.00	1,453,000
K e e P e r 技研	500	1,400.00	700,000
ファーストロジック	300	639.00	191,700
三機サービス	300	1,215.00	364,500
G u n o s y	900	1,901.00	1,710,900
デザインワン・ジャパン	300	298.00	89,400
イー・ガーディアン	600	1,818.00	1,090,800
リブセンス	800	255.00	204,000
ジャパンマテリアル	3,500	1,375.00	4,812,500
ベクトル	1,600	1,055.00	1,688,000
ウチヤマホールディングス	700	551.00	385,700
チャーム・ケア・コーポレーション	400	1,702.00	680,800
ライクキッズネクスト	300	940.00	282,000
キャリアリンク	500	436.00	218,000
I B J	900	890.00	801,000
アサンテ	500	2,224.00	1,112,000
N・フィールド	800	686.00	548,800
バリューHR	300	3,560.00	1,068,000
M&Aキャピタルパートナーズ	500	6,570.00	3,285,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	500	1,207.00	603,500
E R Iホールディングス	400	943.00	377,200
アビスト	200	2,626.00	525,200
シグマクシス	600	1,209.00	725,400
ウィルグループ	800	889.00	711,200
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,800	269.00	484,200
日本ビューホテル	500	1,323.00	661,500
リクルートホールディングス	92,600	3,486.00	322,803,600
エラン	900	1,994.00	1,794,600
土木管理総合試験所	600	483.00	289,800
ネットマーケティング	500	506.00	253,000

日本郵政	105,900	1,191.00	126,126,900
ベルシステム24ホールディングス	2,200	1,502.00	3,304,400
鎌倉新書	900	1,416.00	1,274,400
ソネット・メディア・ネットワークス	200	802.00	160,400
一蔵	200	645.00	129,000
LITALICO	300	1,701.00	510,300
グローバルキッズCOMPANY	200	914.00	182,800
エボラブルアジア	600	2,646.00	1,587,600
アトラエ	300	2,824.00	847,200
ストライク	500	2,131.00	1,065,500
ソラスト	3,200	984.00	3,148,800
セラク	400	618.00	247,200
インソース	500	2,474.00	1,237,000
ベिकाレント・コンサルティング	900	4,010.00	3,609,000
Orchestra Holdings	200	1,418.00	283,600
アイモバイル	400	880.00	352,000
キャリアインデックス	500	807.00	403,500
MS-Japan	500	1,543.00	771,500
船場	200	950.00	190,000
グレイステクノロジー	500	2,930.00	1,465,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,000	2,599.00	2,599,000
フルテック	200	1,168.00	233,600
グリーンズ	500	1,486.00	743,000
ツナググループ・ホールディングス	200	584.00	116,800
ソウルドアウト	100	2,302.00	230,200
MS&Consulting	200	1,168.00	233,600
日総工産	900	1,460.00	1,314,000
キュービーネットホールディングス	800	2,496.00	1,996,800
RPAホールディングス	300	5,230.00	1,569,000
スプリックス	400	1,944.00	777,600
アドバンテッジリスクマネジメント	500	691.00	345,500
リログループ	7,100	2,880.00	20,448,000
東祥	800	2,771.00	2,216,800
エイチ・アイ・エス	2,300	2,745.00	6,313,500
ラックランド	300	2,441.00	732,300
共立メンテナンス	2,000	5,260.00	10,520,000
イチネンホールディングス	1,300	1,091.00	1,418,300
建設技術研究所	900	1,505.00	1,354,500
スペース	800	1,230.00	984,000
長大	500	724.00	362,000
燦ホールディングス	300	2,362.00	708,600
スバル興業	100	6,020.00	602,000

東京テアトル	500	1,319.00	659,500	
タナベ経営	300	1,190.00	357,000	
ナガワ	400	5,640.00	2,256,000	
よみうりランド	300	5,430.00	1,629,000	
東京都競馬	900	3,525.00	3,172,500	
常磐興産	600	1,664.00	998,400	
カナモト	1,900	2,702.00	5,133,800	
東京ドーム	4,800	1,079.00	5,179,200	
西尾レントオール	1,300	2,951.00	3,836,300	
トランス・コスモス	1,400	2,363.00	3,308,200	
乃村工藝社	6,000	1,355.00	8,130,000	
藤田観光	500	2,791.00	1,395,500	
KNT-CTホールディングス	700	1,409.00	986,300	
日本管財	1,400	1,860.00	2,604,000	
トーカイ	1,200	2,321.00	2,785,200	
白洋舎	200	2,985.00	597,000	
セコム	13,700	9,413.00	128,958,100	
セントラル警備保障	600	5,410.00	3,246,000	
丹青社	2,500	1,231.00	3,077,500	
メイテック	1,600	5,630.00	9,008,000	
応用地質	1,400	1,068.00	1,495,200	
船井総研ホールディングス	2,700	2,656.00	7,171,200	
進学会ホールディングス	600	606.00	363,600	
オオバ	1,000	637.00	637,000	
いであ	300	1,167.00	350,100	
学究社	400	1,296.00	518,400	
ベネッセホールディングス	4,700	2,489.00	11,698,300	
イオンディライト	1,600	3,170.00	5,072,000	
ナック	800	934.00	747,200	
ニチイ学館	1,900	1,554.00	2,952,600	
ダイセキ	2,200	2,740.00	6,028,000	
ステップ	500	1,485.00	742,500	
合 計	15,794,000		29,914,270,770	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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

### 貸借対照表

	（単位：円）	
	2018年12月17日現在	2019年 6月17日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	248,061,820	145,237,307
金銭信託	-	87,190,501
コール・ローン	1,180,554,233	2,103,949,507
出資金	8,456,329	15,104,556
株式	88,405,725,491	118,809,162,527
投資証券	2,386,096,539	3,394,632,713
派生商品評価勘定	6,541,478	79,991,679
未収入金	393,595	3,051,084
未収配当金	118,952,175	186,858,836
差入委託証拠金	217,816,689	472,191,905
流動資産合計	92,572,598,349	125,297,370,615
資産合計	92,572,598,349	125,297,370,615
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	39,490,664	10,166,676
未払金	-	12,623,324
未払解約金	46,222,646	24,761,992
未払利息	1,455	3,260
流動負債合計	85,714,765	47,555,252
負債合計	85,714,765	47,555,252
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	39,566,377,247	50,023,894,747
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	52,920,506,337	75,225,920,616
元本等合計	92,486,883,584	125,249,815,363
純資産合計	92,486,883,584	125,249,815,363
負債純資産合計	92,572,598,349	125,297,370,615

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

	(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1) デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 (2) 為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。

## (貸借対照表に関する注記)

		2018年12月17日現在	2019年 6月17日現在
1.	期首	2018年 6月16日	2018年12月18日
	期首元本額	35,040,030,859円	39,566,377,247円
	期首からの追加設定元本額	6,023,310,754円	12,496,514,600円
	期首からの一部解約元本額	1,496,964,366円	2,038,997,100円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外株式ヘッジなし（DC専用）	17,536,459,780円	17,854,644,176円
	DCインデックスバランス（株式20）	86,657,188円	101,931,648円
	DCインデックスバランス（株式40）	251,395,549円	270,453,423円
	DCインデックスバランス（株式60）	482,269,178円	516,401,157円
	DCインデックスバランス（株式80）	509,944,008円	539,060,037円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,081,212,921円	2,081,523,584円
	日興五大陸株式ファンド	5,396,086,887円	5,215,211,662円
	インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）	93,020,748円	79,477,525円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	147,464,472円	149,883,088円
	インデックスファンド先進国株式（適格機関投資家向け）	3,763,150,015円	6,970,502,622円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	35,857,568円	7,505,308,494円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	5,230,513円	4,927,820円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	4,356,067円	4,247,998円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	7,982,678円	7,619,790円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	6,320,203円	6,156,373円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	4,512,298,631円	4,120,343,469円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	27,674,134円	27,728,167円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	80,321,145円	79,735,404円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	116,147,413円	113,117,510円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 80）	114,784,797円	111,654,745円
インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,307,743,352円	4,263,966,055円
計	39,566,377,247円	50,023,894,747円
2. 受益権の総数	39,566,377,247口	50,023,894,747口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2018年 6月16日 至 2018年12月17日	自 2018年12月18日 至 2019年 6月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2018年12月17日現在	2019年 6月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品

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

（有価証券に関する注記）

（2018年12月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
出資金	279,361
株式	3,106,749,127
投資証券	41,697,446
合計	3,064,772,320

（2019年 6月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
出資金	1,400,382
株式	6,856,710,382
投資証券	370,865,136
合計	7,228,975,900

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（2018年12月17日現在）

（単位：円）



区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,694,013,362	-	1,655,966,571	38,046,791
合計		1,694,013,362	-	1,655,966,571	38,046,791

(2019年 6月17日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,243,726,286	-	3,319,647,459	75,921,173
合計		3,243,726,286	-	3,319,647,459	75,921,173

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

また契約額等及び時価の邦貨換算は、本書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(2018年12月17日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,243,440,395	-	1,248,538,000	5,097,605
	米ドル	1,005,374,620	-	1,011,297,500	5,922,880
	ユーロ	238,065,775	-	237,240,500	825,275
合計		1,243,440,395	-	1,248,538,000	5,097,605

(2019年 6月17日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,705,020,670	-	2,698,924,500	6,096,170
	米ドル	2,233,589,175	-	2,229,606,500	3,982,675
	ユーロ	471,431,495	-	469,318,000	2,113,495
合計		2,705,020,670	-	2,698,924,500	6,096,170

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2018年12月17日現在		2019年 6月17日現在	
1口当たり純資産額	2.3375円	1口当たり純資産額	2.5038円
(1万口当たり純資産額)	(23,375円)	(1万口当たり純資産額)	(25,038円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	14,773	69.83	1,031,598.59	
	APACHE CORP	11,004	27.49	302,499.96	
	BAKER HUGHES A GE CO	13,685	22.15	303,122.75	
	CABOT OIL & GAS CORP	12,730	23.77	302,592.10	
	CHENIERE ENERGY INC	6,440	65.41	421,240.40	
	CHEVRON CORP	57,511	120.81	6,947,903.91	
	CIMAREX ENERGY CO	2,955	54.60	161,343.00	
	CONCHO RESOURCES INC	5,915	98.36	581,799.40	
	CONOCOPHILLIPS	34,570	58.82	2,033,407.40	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,310	36.72	121,543.20	
	DEVON ENERGY CORPORATION	13,141	25.77	338,643.57	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	4,460	98.95	441,317.00	
	EOG RESOURCES INC	17,992	85.17	1,532,378.64	
	EXXON MOBIL CORP	128,301	74.35	9,539,179.35	
	HALLIBURTON CO	28,847	21.38	616,748.86	
	HELMERICH & PAYNE	2,660	48.40	128,744.00	
	HESS CORP	8,310	57.25	475,747.50	
	HOLLYFRONTIER CORP	4,740	40.30	191,022.00	
	KINDER MORGAN INC	64,530	20.53	1,324,800.90	
	MARATHON OIL CORP	26,307	12.98	341,464.86	
	MARATHON PETROLEUM CORP	21,542	47.96	1,033,154.32	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	11,301	20.00	226,020.00	
	NOBLE ENERGY INC	14,112	19.73	278,429.76	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	22,101	49.31	1,089,800.31	
	ONEOK INC	13,330	64.46	859,251.80	
	PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	9,380	17.05	159,929.00	
	PHILLIPS 66	13,925	85.59	1,191,840.75	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	4,830	141.58	683,831.40	
	SCHLUMBERGER LTD	42,931	35.93	1,542,510.83	
	TARGA RESOURCES CORP	8,350	36.59	305,526.50	
TECHNIPFMC PLC	11,861	22.74	269,719.14		
VALERO ENERGY CORP	12,542	76.76	962,723.92		
WILLIAMS COS INC	35,904	26.99	969,048.96		

AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	6,445	219.25	1,413,066.25	
ALBEMARLE CORP	3,010	70.88	213,348.80	
AMCOR PLC	46,500	10.93	508,245.00	
AVERY DENNISON CORP	2,270	110.39	250,585.30	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	5,850	26.08	152,568.00	
BALL CORP	9,630	65.41	629,898.30	
CELANESE CORP	4,240	104.19	441,765.60	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,530	46.00	254,380.00	
CHEMOURS CO/THE	5,470	23.84	130,404.80	
CORTEVA INC	22,292	25.19	561,535.48	
CROWN HOLDINGS INC	4,715	57.94	273,187.10	
DOW INC	22,465	51.15	1,149,084.75	
DUPONT DE NEMOURS INC	23,152	75.08	1,738,252.16	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,045	72.09	291,604.05	
ECOLAB INC	7,620	198.87	1,515,389.40	
FMC CORP	3,680	79.91	294,068.80	
FREEPORT-MCMORAN INC	44,968	10.65	478,909.20	
INTERNATIONAL PAPER CO	10,610	42.99	456,123.90	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,155	148.79	469,432.45	
LINDE PLC	16,770	202.71	3,399,446.70	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	9,000	86.50	778,500.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,015	223.98	451,319.70	
MOSAIC CO/THE	10,810	22.36	241,711.60	
NEWMONT GOLDCORP CORP	25,072	35.93	900,836.96	
NUCOR CORP	10,339	51.70	534,526.30	
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,490	95.32	237,346.80	
PPG INDUSTRIES INC	6,684	116.55	779,020.20	
SEALED AIR CORP	3,966	44.32	175,773.12	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,487	473.65	1,177,967.55	
STEEL DYNAMICS INC	5,580	26.43	147,479.40	
VULCAN MATERIALS CO	3,883	132.59	514,846.97	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,360	63.76	86,713.60	
WESTROCK CO	9,359	36.05	337,391.95	
3M CO	17,566	166.69	2,928,076.54	
ACUITY BRANDS INC	1,510	133.50	201,585.00	

AERCAP HOLDINGS NV	4,190	48.78	204,388.20
ALLEGION PLC	3,230	106.02	342,444.60
AMETEK INC	6,563	84.99	557,789.37
ARCONIC INC	12,213	22.98	280,654.74
BOEING CO/THE	16,302	347.16	5,659,402.32
CATERPILLAR INC	17,956	127.23	2,284,541.88
CUMMINS INC	4,875	163.86	798,817.50
DEERE & CO	8,920	151.51	1,351,469.20
DOVER CORP	3,810	96.07	366,026.70
EATON CORP PLC	13,566	78.37	1,063,167.42
EMERSON ELECTRIC CO	19,530	62.77	1,225,898.10
FASTENAL CO	16,206	31.65	512,919.90
FLOWSERVE CORP	3,265	48.76	159,201.40
FLUOR CORP	4,943	29.31	144,879.33
FORTIVE CORP	9,844	77.33	761,236.52
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5,330	54.01	287,873.30
GENERAL DYNAMICS CORP	7,762	171.25	1,329,242.50
GENERAL ELECTRIC CO	265,173	10.23	2,712,719.79
HARRIS CORP	3,360	190.60	640,416.00
HD SUPPLY HOLDINGS INC	5,570	39.51	220,070.70
HEICO CORP	1,500	126.17	189,255.00
HEICO CORP-CLASS A	2,200	100.67	221,474.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	22,226	172.81	3,840,875.06
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,440	214.79	309,297.60
IDEX CORP	2,660	159.68	424,748.80
ILLINOIS TOOL WORKS	9,940	149.05	1,481,557.00
INGERSOLL-RAND PLC	7,376	124.68	919,639.68
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,490	78.30	351,567.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	7,070	64.80	458,136.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	6,400	37.10	237,440.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	27,564	39.95	1,101,181.80
L3 TECHNOLOGIES INC	2,281	246.76	562,859.56
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,050	275.84	289,632.00
LOCKHEED MARTIN CORP	7,741	350.14	2,710,433.74
MASCO CORP	8,659	38.29	331,553.11

MIDDLEBY CORP	1,960	131.10	256,956.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	4,834	309.43	1,495,784.62
OWENS CORNING	2,950	50.22	148,149.00
PACCAR INC	11,334	70.02	793,606.68
PARKER HANNIFIN CORP	4,280	164.21	702,818.80
PENTAIR PLC	5,938	35.62	211,511.56
RAYTHEON COMPANY	8,782	177.35	1,557,487.70
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,673	156.53	574,934.69
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,180	364.62	1,159,491.60
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	4,410	45.84	202,154.40
SMITH (A.O.) CORP	4,990	45.53	227,194.70
SNAP-ON INC	1,430	164.09	234,648.70
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	2,760	78.53	216,742.80
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,016	141.51	709,814.16
TEXTRON INC	6,126	49.45	302,930.70
TRANSDIGM GROUP INC	1,350	472.86	638,361.00
UNITED RENTALS INC	2,020	122.87	248,197.40
UNITED TECHNOLOGIES CORP	24,908	125.30	3,120,972.40
WABCO HOLDINGS INC	1,710	130.79	223,650.90
WABTEC CORP	4,520	68.00	307,360.00
WW GRAINGER INC	1,407	272.36	383,210.52
XYLEM INC	5,338	81.08	432,805.04
CINTAS CORP	2,607	236.37	616,216.59
COPART INC	6,720	73.81	496,003.20
COSTAR GROUP INC	1,045	549.66	574,394.70
EQUIFAX INC	3,584	132.04	473,231.36
IHS MARKIT LTD	10,903	59.32	646,765.96
MANPOWERGROUP INC	1,447	90.80	131,387.60
NIELSEN HOLDINGS PLC	9,945	23.06	229,331.70
REPUBLIC SERVICES INC	7,060	86.99	614,149.40
ROBERT HALF INTL INC	3,075	56.25	172,968.75
ROLLINS INC	4,940	37.65	185,991.00
TRANSUNION	5,280	70.92	374,457.60
VERISK ANALYTICS INC	4,570	145.83	666,443.10
WASTE CONNECTIONS INC	8,566	94.46	809,144.36

WASTE MANAGEMENT INC	12,564	114.58	1,439,583.12
AMERCO	225	389.06	87,538.50
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,860	32.68	126,144.80
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,840	83.70	405,108.00
CSX CORP	23,633	77.17	1,823,758.61
DELTA AIR LINES INC	4,175	55.99	233,758.25
EXPEDITORS INTL WASH INC	5,977	73.97	442,118.69
FEDEX CORP	7,488	164.55	1,232,150.40
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,430	90.85	220,765.50
KANSAS CITY SOUTHERN	2,810	116.91	328,517.10
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	4,600	32.22	148,212.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	8,200	194.74	1,596,868.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,140	142.04	303,965.60
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,770	51.82	195,361.40
UBER TECHNOLOGIES INC	5,400	43.23	233,442.00
UNION PACIFIC CORP	21,906	166.99	3,658,082.94
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	1,715	87.12	149,410.80
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	21,167	101.62	2,150,990.54
XPO LOGISTICS INC	3,850	56.74	218,449.00
APTIV PLC	8,010	75.33	603,393.30
AUTOLIV INC	2,540	65.98	167,589.20
BORGWARNER INC	5,980	40.95	244,881.00
FORD MOTOR COMPANY	124,085	9.98	1,238,368.30
GENERAL MOTORS CORP	37,075	35.66	1,322,094.50
HARLEY-DAVIDSON INC	3,709	34.64	128,479.76
LEAR CORP	1,660	133.70	221,942.00
TESLA INC	3,840	214.92	825,292.80
CAPRI HOLDINGS LTD	3,490	33.51	116,949.90
DR HORTON INC	10,256	45.96	471,365.76
GARMIN LTD	3,605	79.79	287,642.95
HANESBRANDS INC	12,690	16.59	210,527.10
HASBRO INC	3,898	107.46	418,879.08
LEGGETT & PLATT INC	4,778	37.39	178,649.42
LENNAR CORP-CL A	8,230	53.55	440,716.50
LULULEMON ATHLETICA INC	3,320	176.71	586,677.20

MOHAWK INDUSTRIES INC	1,628	152.29	247,928.12
NEWELL BRANDS INC	13,866	14.50	201,057.00
NIKE INC -CL B	38,138	83.44	3,182,234.72
NVR INC	100	3,459.62	345,962.00
POLARIS INDUSTRIES INC	1,930	89.60	172,928.00
PULTE GROUP INC	8,230	32.85	270,355.50
PVH CORP	2,150	88.05	189,307.50
RALPH LAUREN CORP	1,725	112.13	193,424.25
TAPESTRY INC	10,656	29.54	314,778.24
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	5,960	27.07	161,337.20
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	5,672	23.85	135,277.20
VF CORP	9,850	87.26	859,511.00
WHIRLPOOL CORP	2,054	135.68	278,686.72
ARAMARK	5,980	34.47	206,130.60
CARNIVAL CORP	11,977	53.12	636,218.24
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	785	740.59	581,363.15
DARDEN RESTAURANTS INC	3,643	119.68	435,994.24
DOMINO'S PIZZA INC	1,190	280.65	333,973.50
H&R BLOCK INC	7,790	28.69	223,495.10
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	7,950	93.42	742,689.00
LAS VEGAS SANDS CORP	11,000	57.28	630,080.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	8,733	133.68	1,167,427.44
MCDONALD'S CORP	23,261	205.29	4,775,250.69
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	8,700	20.04	174,348.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	14,310	27.66	395,814.60
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	6,390	54.28	346,849.20
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	5,498	124.13	682,466.74
STARBUCKS CORP	37,844	84.24	3,187,978.56
VAIL RESORTS INC	1,110	235.98	261,937.80
WYNN RESORTS LTD	2,570	115.61	297,117.70
YUM! BRANDS INC	9,304	109.79	1,021,486.16
ACTIVISION BLIZZARD INC	24,420	45.62	1,114,040.40
ALPHABET INC-CL A	9,090	1,086.30	9,874,467.00
ALPHABET INC-CL C	9,542	1,085.35	10,356,409.70
ALTICE USA INC- A	8,400	23.80	199,920.00



CBS CORP-CLASS B NON VOTING	10,058	48.99	492,741.42
CHARTER COMMUNICATION-A	4,811	392.08	1,886,296.88
COMCAST CORP-CLASS A	137,184	42.31	5,804,255.04
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	5,730	29.02	166,284.60
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	13,040	26.84	349,993.60
DISH NETWORK CORP-A	7,089	37.54	266,121.06
ELECTRONIC ARTS INC	9,674	92.73	897,070.02
FACEBOOK INC-CLASS A	72,260	181.33	13,102,905.80
FOX CORP - CLASS A	9,264	35.24	326,463.36
FOX CORP- CLASS B	6,316	34.96	220,807.36
IAC/INTERACTIVECORP	2,420	228.42	552,776.40
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	10,826	22.07	238,929.82
LIBERTY BROADBAND-C	2,700	100.59	271,593.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,115	26.71	136,621.65
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	15,461	25.92	400,749.12
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	4,700	36.54	171,738.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	5,150	36.72	189,108.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	3,315	36.49	120,964.35
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	4,470	63.99	286,035.30
NETFLIX INC	13,270	339.73	4,508,217.10
NEWS CORP - CLASS A	11,860	11.83	140,303.80
OMNICOM GROUP	6,347	79.36	503,697.92
SIRIUS XM HOLDINGS INC	45,960	5.56	255,537.60
SNAP INC - A	20,600	13.96	287,576.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	3,530	110.36	389,570.80
THE WALT DISNEY CO.	54,652	141.65	7,741,455.80
TRIPADVISOR INC	3,330	45.55	151,681.50
TWITTER INC	23,560	36.15	851,694.00
VIACOM INC-CLASS B	9,058	29.39	266,214.62
ZILLOW GROUP INC - C	4,010	45.39	182,013.90
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,168	151.80	329,102.40
AMAZON.COM INC	12,665	1,869.67	23,679,370.55
AUTOZONE INC	732	1,119.87	819,744.84
BEST BUY CO INC	7,664	66.03	506,053.92
BOOKING HOLDINGS INC	1,373	1,775.50	2,437,761.50

BURLINGTON STORES INC	1,990	168.69	335,693.10
CARMAX INC	5,879	83.54	491,131.66
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	7,740	135.69	1,050,240.60
DOLLAR TREE INC	7,176	110.31	791,584.56
EBAY INC	25,437	38.91	989,753.67
EXPEDIA INC	3,612	126.81	458,037.72
GAP INC/THE	8,676	18.18	157,729.68
GENUINE PARTS CO	4,381	102.93	450,936.33
GRUBHUB INC	2,120	70.16	148,739.20
HOME DEPOT INC	34,190	205.77	7,035,276.30
KOHL'S CORP	5,412	47.77	258,531.24
L BRANDS INC	6,608	22.51	148,746.08
LKQ CORP	7,600	26.24	199,424.00
LOWE'S COS INC	24,402	99.63	2,431,171.26
MACY'S INC	7,939	21.56	171,164.84
MERCADOLIBRE INC	1,390	616.00	856,240.00
NORDSTROM INC	3,980	32.61	129,787.80
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,525	387.96	979,599.00
QURATE RETAIL INC	10,830	12.83	138,948.90
ROSS STORES INC	11,042	100.97	1,114,910.74
TARGET CORP	16,500	87.79	1,448,535.00
TIFFANY & CO	3,460	91.02	314,929.20
TJX COMPANIES INC	37,606	53.34	2,005,904.04
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,500	106.14	371,490.00
ULTA BEAUTY INC	1,590	354.62	563,845.80
WAYFAIR INC- CLASS A	1,820	158.21	287,942.20
COSTCO WHOLESALE CORP	13,409	260.15	3,488,351.35
KROGER CO	22,980	24.26	557,494.80
SYSCO CORP	14,646	72.25	1,058,173.50
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	23,692	52.57	1,245,488.44
WALMART INC	44,142	109.07	4,814,567.94
ALTRIA GROUP INC	56,608	50.86	2,879,082.88
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	18,403	40.79	750,658.37
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	9,240	56.26	519,842.40
BUNGE LTD	3,977	57.86	230,109.22

CAMPBELL SOUP CO	5,105	42.26	215,737.30
COCA-COLA CO/THE	123,352	51.31	6,329,191.12
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	6,900	56.74	391,506.00
CONAGRA BRANDS INC	13,910	29.88	415,630.80
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4,950	187.63	928,768.50
GENERAL MILLS INC	17,629	53.41	941,564.89
HERSHEY CO/THE	4,915	138.32	679,842.80
HORMEL FOODS CORP	8,510	41.43	352,569.30
INGREDION INC	1,840	81.60	150,144.00
JM SMUCKER CO/THE	3,630	123.31	447,615.30
KELLOGG CO	7,418	56.63	420,081.34
KRAFT HEINZ CO/THE	18,771	30.31	568,949.01
LAMB WESTON HOLDING INC	4,380	61.71	270,289.80
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,525	156.60	552,015.00
MOLSON COORS BREWING CO -B	6,180	54.00	333,720.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	44,035	55.05	2,424,126.75
MONSTER BEVERAGE CORP	13,240	61.33	812,009.20
PEPSICO INC	42,671	132.73	5,663,721.83
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	46,998	77.20	3,628,245.60
TYSON FOODS INC-CL A	8,316	81.91	681,163.56
CHURCH & DWIGHT CO INC	7,330	77.16	565,582.80
CLOROX COMPANY	3,636	156.88	570,415.68
COLGATE-PALMOLIVE CO	24,970	73.35	1,831,549.50
COTY INC-CL A	10,350	13.58	140,553.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	6,950	176.88	1,229,316.00
KIMBERLY-CLARK CORP	10,123	137.65	1,393,430.95
PROCTER & GAMBLE CO	75,939	111.20	8,444,416.80
ABBOTT LABORATORIES	53,396	82.22	4,390,219.12
ABIOMED INC	1,570	250.96	394,007.20
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,480	305.70	758,136.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,564	85.05	388,168.20
ANTHEM INC	7,836	285.32	2,235,767.52
BAXTER INTERNATIONAL INC	14,919	77.93	1,162,637.67
BECTON DICKINSON AND CO	8,207	234.16	1,921,751.12
BOSTON SCIENTIFIC CORP	42,298	40.42	1,709,685.16

CARDINAL HEALTH INC	9,265	44.16	409,142.40
CENTENE CORP	13,510	53.55	723,460.50
CERNER CORP	9,690	72.23	699,908.70
CIGNA CORP	11,610	158.41	1,839,140.10
COOPER COS INC/THE	1,310	323.10	423,261.00
CVS HEALTH CORP	39,538	54.17	2,141,773.46
DANAHER CORP	19,229	139.63	2,684,945.27
DAVITA INC	2,978	48.88	145,564.64
DENTSPLY SIRONA INC	6,592	56.77	374,227.84
DEXCOM INC	2,660	148.04	393,786.40
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	6,060	183.93	1,114,615.80
HCA HEALTHCARE INC	8,175	126.63	1,035,200.25
HENRY SCHEIN INC	4,490	71.28	320,047.20
HOLOGIC INC	7,468	47.84	357,269.12
HUMANA INC	4,075	251.83	1,026,207.25
IDEXX LABORATORIES INC	2,440	267.74	653,285.60
INTUITIVE SURGICAL INC	3,495	496.54	1,735,407.30
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,035	166.39	504,993.65
MCKESSON CORP	5,474	133.13	728,753.62
MEDTRONIC PLC	40,678	97.50	3,966,105.00
QUEST DIAGNOSTICS	3,626	101.03	366,334.78
RESMED INC	4,030	118.09	475,902.70
STERIS PLC	2,500	140.43	351,075.00
STRYKER CORP	10,293	195.47	2,011,972.71
TELEFLEX INC	1,360	320.24	435,526.40
UNITEDHEALTH GROUP INC	29,040	245.37	7,125,544.80
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,380	122.75	292,145.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,494	130.88	326,414.72
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	3,670	164.63	604,192.10
WELLCARE HEALTH PLANS INC	1,610	287.10	462,231.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	5,712	117.45	670,874.40
ABBVIE INC	44,576	78.69	3,507,685.44
AGILENT TECHNOLOGIES INC	9,010	69.97	630,429.70
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	6,680	117.93	787,772.40
ALKERMES PLC	5,060	21.89	110,763.40

ALLERGAN PLC	9,865	115.92	1,143,550.80
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	2,400	70.03	168,072.00
AMGEN INC	18,931	176.08	3,333,370.48
BEIGENE LTD-ADR	1,160	117.62	136,439.20
BIOGEN INC	5,903	227.67	1,343,936.01
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	5,450	80.84	440,578.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	49,891	47.56	2,372,815.96
CELGENE CORP	21,404	96.51	2,065,700.04
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	7,356	31.95	235,024.20
ELI LILLY & CO	27,174	111.74	3,036,422.76
EXACT SCIENCES CORP	3,770	109.78	413,870.60
GILEAD SCIENCES INC	38,874	66.36	2,579,678.64
ILLUMINA INC	4,630	344.00	1,592,720.00
INCYTE CORP	5,460	77.71	424,296.60
IONIS PHARMACEUTICALS INC	3,900	62.09	242,151.00
IQVIA HOLDINGS INC	5,503	141.30	777,573.90
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,400	130.43	182,602.00
JOHNSON & JOHNSON	80,721	140.09	11,308,204.89
MERCK & CO. INC.	78,153	82.78	6,469,505.34
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	735	791.06	581,429.10
MYLAN NV	18,705	17.02	318,359.10
NEKTAR THERAPEUTICS	5,400	33.40	180,360.00
PERKINELMER INC	3,250	92.94	302,055.00
PERRIGO CO PLC	3,009	43.18	129,928.62
PFIZER INC	168,040	42.76	7,185,390.40
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,620	305.24	799,728.80
SEATTLE GENETICS INC	3,440	68.50	235,640.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	32,880	8.24	270,931.20
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	12,164	285.26	3,469,902.64
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	8,070	170.22	1,373,675.40
WATERS CORP	2,186	203.20	444,195.20
ZOETIS INC	14,220	110.79	1,575,433.80
BANK OF AMERICA CORP	278,569	28.04	7,811,074.76
BB&T CORP	22,748	50.06	1,138,764.88
CIT GROUP INC	2,655	50.19	133,254.45

CITIGROUP INC	71,457	67.48	4,821,918.36
CITIZENS FINANCIAL GROUP	15,590	34.97	545,182.30
COMERICA INC	5,590	70.21	392,473.90
EAST WEST BANCORP INC	4,480	44.25	198,240.00
FIFTH THIRD BANCORP	23,759	27.39	650,759.01
FIRST REPUBLIC BANK/CA	5,280	96.35	508,728.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	31,560	13.36	421,641.60
JPMORGAN CHASE & CO	99,360	109.82	10,911,715.20
KEYCORP	30,878	17.15	529,557.70
M & T BANK CORP	3,763	167.90	631,807.70
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	9,730	16.34	158,988.20
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	14,130	135.21	1,910,517.30
REGIONS FINANCIAL CORP	33,384	14.59	487,072.56
SIGNATURE BANK	1,370	116.30	159,331.00
SUNTRUST BANKS INC	14,337	64.57	925,740.09
SVB FINANCIAL GROUP	1,530	218.18	333,815.40
US BANCORP	46,441	52.62	2,443,725.42
WELLS FARGO & CO	131,340	45.59	5,987,790.60
ZIONS BANCORP NA	5,800	44.88	260,304.00
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,330	88.36	117,518.80
ALLY FINANCIAL INC	12,230	29.21	357,238.30
AMERICAN EXPRESS CO	21,854	122.00	2,666,188.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,010	153.53	615,655.30
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	7,110	21.27	151,229.70
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	28,922	44.49	1,286,739.78
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	39,590	205.16	8,122,284.40
BLACKROCK INC	3,655	446.97	1,633,675.35
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	13,925	90.57	1,261,187.25
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,180	107.74	342,613.20
CME GROUP INC	10,910	197.10	2,150,361.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	9,450	77.45	731,902.50
E*TRADE FINANCIAL CORP	7,540	45.31	341,637.40
EATON VANCE CORP	3,200	41.34	132,288.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,200	296.33	355,596.00
FRANKLIN RESOURCES INC	7,935	33.36	264,711.60

GOLDMAN SACHS GROUP INC	10,168	191.66	1,948,798.88
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	17,900	84.93	1,520,247.00
INVESCO LTD	10,627	20.64	219,341.28
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	6,485	17.98	116,600.30
KKR & CO INC -A	17,080	23.79	406,333.20
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,100	320.05	352,055.00
MOODY'S CORP	5,117	192.30	983,999.10
MORGAN STANLEY	39,265	42.82	1,681,327.30
MSCI INC	2,550	235.78	601,239.00
NASDAQ INC	4,125	95.71	394,803.75
NORTHERN TRUST CORP	6,460	87.17	563,118.20
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	4,130	82.56	340,972.80
S&P GLOBAL INC	7,592	224.90	1,707,440.80
SCHWAB (CHARLES) CORP	36,684	41.01	1,504,410.84
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,165	53.93	170,688.45
STATE STREET CORP	11,477	55.36	635,366.72
SYNCHRONY FINANCIAL	20,960	33.95	711,592.00
T ROWE PRICE GROUP INC	6,815	105.94	721,981.10
TD AMERITRADE HOLDING CORP	8,080	50.52	408,201.60
VOYA FINANCIAL INC	3,700	54.18	200,466.00
AFLAC INC	22,504	55.04	1,238,620.16
ALLEGHANY CORP	440	690.85	303,974.00
ALLSTATE CORP	10,643	102.14	1,087,076.02
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,960	104.43	204,682.80
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	26,045	53.31	1,388,458.95
AON PLC	7,077	190.76	1,350,008.52
ARCH CAPITAL GROUP LTD	13,815	35.56	491,261.40
ARTHUR J GALLAGHER & CO	5,810	87.70	509,537.00
ASSURANT INC	2,080	106.12	220,729.60
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	3,700	43.58	161,246.00
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	2,874	38.45	110,505.30
CHUBB LTD	13,975	150.26	2,099,883.50
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,660	103.54	482,496.40
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	710	247.23	175,533.30
EVEREST RE GROUP LTD	1,154	251.05	289,711.70

FNF GROUP	9,791	39.86	390,269.26
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	10,612	54.95	583,129.40
LINCOLN NATIONAL CORP	5,513	63.48	349,965.24
LOEWS CORP	7,825	53.54	418,950.50
MARKEL CORP	420	1,087.72	456,842.40
MARSH & MCLENNAN COS	14,903	98.18	1,463,176.54
METLIFE INC	24,775	48.81	1,209,267.75
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	8,620	55.91	481,944.20
PROGRESSIVE CORP	17,110	81.96	1,402,335.60
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	12,132	99.23	1,203,858.36
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,690	153.45	259,330.50
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,297	178.67	231,734.99
TORCHMARK CORP	2,866	89.17	255,561.22
TRAVELERS COS INC/THE	7,754	150.11	1,163,952.94
UNUM GROUP	8,138	33.05	268,960.90
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3,948	190.33	751,422.84
WR BERKLEY CORP	5,004	65.62	328,362.48
CBRE GROUP INC - A	9,450	49.56	468,342.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	34,300	6.62	227,066.00
JONES LANG LASALLE INC	1,160	133.13	154,430.80
ACCENTURE PLC-CL A	19,268	184.97	3,564,001.96
ADOBE INC	14,779	274.28	4,053,584.12
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	4,860	78.62	382,093.20
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,270	139.80	177,546.00
ANSYS INC	2,430	197.13	479,025.90
AUTODESK INC	6,440	158.16	1,018,550.40
AUTOMATIC DATA PROCESSING	13,386	165.54	2,215,918.44
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	3,740	130.15	486,761.00
CADENCE DESIGN SYS INC	8,250	67.72	558,690.00
CDK GLOBAL INC	3,490	48.59	169,579.10
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,430	113.32	388,687.60
CITRIX SYSTEMS INC	3,888	96.79	376,319.52
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	18,318	61.64	1,129,121.52
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,230	130.30	160,269.00
DOCUSIGN INC	3,320	50.78	168,589.60



DROPBOX INC-CLASS A	6,480	23.46	152,020.80
DXC TECHNOLOGY CO	7,723	51.72	399,433.56
EPAM SYSTEMS INC	1,600	174.50	279,200.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	9,685	121.40	1,175,759.00
FIRST DATA CORP- CLASS-A	15,640	26.57	415,554.80
FISERV INC	12,506	89.20	1,115,535.20
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,490	272.66	678,923.40
FORTINET INC	4,130	75.71	312,682.30
GARTNER INC	2,760	158.58	437,680.80
GLOBAL PAYMENTS INC	4,450	158.81	706,704.50
GODADDY INC-CLASS A	4,710	70.04	329,888.40
INTL BUSINESS MACHINES CORP	26,892	135.15	3,634,453.80
INTUIT INC	7,896	254.13	2,006,610.48
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,950	137.81	268,729.50
LEIDOS HOLDINGS INC	3,680	78.84	290,131.20
MASTERCARD INC	27,750	260.10	7,217,775.00
MICROSOFT CORP	221,144	132.45	29,290,522.80
MONGODB INC	960	165.68	159,052.80
OKTA INC	3,030	128.95	390,718.50
ORACLE CORP	77,273	53.28	4,117,105.44
PALO ALTO NETWORKS INC	3,100	203.29	630,199.00
PAYCHEX INC	10,432	86.68	904,245.76
PAYCOM SOFTWARE INC	1,620	214.34	347,230.80
PAYPAL HOLDINGS INC	33,947	116.17	3,943,622.99
PTC INC	3,690	83.90	309,591.00
RED HAT INC	5,260	185.20	974,152.00
SABRE CORP	10,440	22.29	232,707.60
SALESFORCE.COM INC	23,120	150.01	3,468,231.20
SERVICENOW INC	5,680	272.25	1,546,380.00
SPLUNK INC	4,590	118.24	542,721.60
SQUARE INC - A	10,760	71.59	770,308.40
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	6,230	56.58	352,493.40
SYMANTEC CORP	22,205	19.36	429,888.80
SYNOPSYS INC	4,297	124.80	536,265.60
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	2,770	163.25	452,202.50

TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,716	127.27	600,205.32	
TWILIO INC - A	2,790	140.17	391,074.30	
VERISIGN INC	3,340	205.20	685,368.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	53,302	169.66	9,043,217.32	
VMWARE INC	2,805	168.29	472,053.45	
WESTERN UNION CO	12,691	20.09	254,962.19	
WIX.COM LTD	1,350	142.94	192,969.00	
WORKDAY INC-CLASS A	4,320	208.00	898,560.00	
WORLDPAY INC-CLASS A	8,990	123.16	1,107,208.40	
AMPHENOL CORP-CL A	9,660	94.30	910,938.00	
APPLE INC	142,982	192.74	27,558,350.68	
ARISTA NETWORKS INC	1,570	236.08	370,645.60	
ARROW ELECTRONICS INC	1,930	67.10	129,503.00	
CDW CORP/DE	4,510	104.24	470,122.40	
CISCO SYSTEMS INC	133,250	54.75	7,295,437.50	
COGNEX CORP	5,790	43.69	252,965.10	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	6,760	15.90	107,484.00	
CORNING INC	22,588	30.91	698,195.08	
DELL TECHNOLOGIES -C	4,782	51.32	245,412.24	
F5 NETWORKS INC	1,755	136.93	240,312.15	
FLEX LTD	18,516	9.04	167,384.64	
FLIR SYSTEMS INC	3,355	51.12	171,507.60	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	41,035	14.15	580,645.25	
HP INC	49,285	19.91	981,264.35	
IPG PHOTONICS CORP	1,160	131.94	153,050.40	
JUNIPER NETWORKS INC	11,503	26.64	306,439.92	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	5,450	83.83	456,873.50	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4,605	160.35	738,411.75	
NETAPP INC	8,396	60.98	511,988.08	
SEAGATE TECHNOLOGY	7,154	44.26	316,636.04	
TE CONNECTIVITY LTD	9,815	90.66	889,827.90	
TRIMBLE INC	8,980	42.72	383,625.60	
WESTERN DIGITAL CORP	7,758	36.33	281,848.14	
XEROX CORP	4,938	34.42	169,965.96	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,690	190.81	322,468.90	

AT&T INC	220,497	32.35	7,133,077.95
CENTURYLINK INC	30,316	11.10	336,507.60
SPRINT CORP	24,810	7.01	173,918.10
T-MOBILE US INC	10,272	74.90	769,372.80
VERIZON COMMUNICATIONS INC	125,457	58.28	7,311,633.96
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	7,450	32.60	242,870.00
AES CORP	18,348	17.09	313,567.32
ALLIANT ENERGY CORP	6,390	50.00	319,500.00
AMEREN CORPORATION	6,912	76.71	530,219.52
AMERICAN ELECTRIC POWER	14,508	90.58	1,314,134.64
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5,965	118.27	705,480.55
ATMOS ENERGY CORP	3,530	104.99	370,614.70
CENTERPOINT ENERGY INC	15,042	29.62	445,544.04
CMS ENERGY CORP	8,490	58.75	498,787.50
CONSOLIDATED EDISON INC	9,396	88.54	831,921.84
DOMINION ENERGY INC	24,391	76.66	1,869,814.06
DTE ENERGY COMPANY	5,568	129.54	721,278.72
DUKE ENERGY CORP	22,166	87.87	1,947,726.42
EDISON INTERNATIONAL	9,159	59.44	544,410.96
ENERGY CORP	5,817	102.04	593,566.68
EVERGY INC	7,740	60.67	469,585.80
EVERSOURCE ENERGY	10,350	77.41	801,193.50
EXELON CORP	30,526	50.80	1,550,720.80
FIRSTENERGY CORP	15,955	43.97	701,541.35
NEXTERA ENERGY INC	14,555	206.96	3,012,302.80
NISOURCE INC	12,390	28.75	356,212.50
NRG ENERGY INC	8,860	34.78	308,150.80
OGE ENERGY CORP	4,980	43.40	216,132.00
PINNACLE WEST CAPITAL	2,849	97.48	277,720.52
PPL CORP	21,978	31.45	691,208.10
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	15,128	60.96	922,202.88
SEMPRA ENERGY	8,717	137.76	1,200,853.92
SOUTHERN CO	31,565	55.65	1,756,592.25
UGI CORP	5,860	53.05	310,873.00
VISTRA ENERGY CORP	11,390	23.77	270,740.30

	WEC ENERGY GROUP INC	9,490	84.31	800,101.90	
	XCEL ENERGY INC	15,414	60.03	925,302.42	
	ADVANCED MICRO DEVICES	30,850	30.36	936,606.00	
	ANALOG DEVICES INC	10,770	104.02	1,120,295.40	
	APPLIED MATERIALS INC	28,213	41.23	1,163,221.99	
	BROADCOM INC	11,970	265.93	3,183,182.10	
	INTEL CORP	136,082	46.19	6,285,627.58	
	KLA-TENCOR CORPORATION	5,499	109.70	603,240.30	
	LAM RESEARCH CORP	4,937	176.80	872,861.60	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	17,864	23.83	425,699.12	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	8,680	56.05	486,514.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6,624	83.19	551,050.56	
	MICRON TECHNOLOGY INC	33,307	32.66	1,087,806.62	
	NVIDIA CORP	17,505	144.64	2,531,923.20	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	10,217	90.89	928,623.13	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	12,520	19.05	238,506.00	
	QORVO INC	3,530	61.50	217,095.00	
	QUALCOMM INC	36,862	68.72	2,533,156.64	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	5,160	71.80	370,488.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	28,392	107.31	3,046,745.52	
	XILINX INC	7,245	105.42	763,767.90	
	米ドル小計	9,211,232		748,329,832.42	(81,313,519,590)
加ドル	CAMECO CORP	11,792	13.82	162,965.44	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	35,734	35.57	1,271,058.38	
	CENOVUS ENERGY INC	38,273	11.36	434,781.28	
	ENBRIDGE INC	61,027	46.25	2,822,498.75	
	ENCANA CORP	48,808	6.25	305,050.00	
	HUSKY ENERGY INC	10,473	12.70	133,007.10	
	IMPERIAL OIL LTD	7,132	36.14	257,750.48	
	INTER PIPELINE LTD	9,840	19.96	196,406.40	
	KEYERA CORP	7,360	32.25	237,360.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	14,242	48.36	688,743.12	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	6,890	17.32	119,334.80	
	SUNCOR ENERGY INC	47,599	41.59	1,979,642.41	

TC ENERGY CORP	28,773	65.66	1,889,235.18
TOURMALINE OIL CORP	6,635	15.56	103,240.60
VERMILION ENERGY INC	3,840	26.78	102,835.20
AGNICO EAGLE MINES LTD	6,595	62.06	409,285.70
BARRICK GOLD CORP	49,354	18.66	920,945.64
CCL INDUSTRIES INC - CL B	4,870	64.22	312,751.40
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	20,680	11.15	230,582.00
FRANCO-NEVADA CORP	6,395	104.81	670,259.95
KINROSS GOLD CORP	38,165	4.74	180,902.10
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	6,200	51.19	317,378.00
LUNDIN MINING CORP	21,110	6.73	142,070.30
METHANEX CORP	1,650	59.96	98,934.00
NUTRIEN LTD	19,418	71.42	1,386,833.56
TECK RESOURCES LTD-CLS B	16,595	29.14	483,578.30
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,460	62.21	90,826.60
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	13,045	30.82	402,046.90
BOMBARDIER INC 'B'	54,436	2.18	118,670.48
CAE INC	8,775	34.59	303,527.25
SNC-LAVALIN GROUP INC	6,175	25.52	157,586.00
WSP GLOBAL INC	3,500	70.35	246,225.00
THOMSON REUTERS CORP	5,496	87.30	479,800.80
CANADIAN NATL RAILWAY CO	22,078	122.57	2,706,100.46
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	4,495	311.10	1,398,394.50
MAGNA INTERNATIONAL INC	8,478	61.73	523,346.94
GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,590	52.02	342,811.80
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	6,648	90.94	604,569.12
STARS GROUP INC/THE	7,400	22.02	162,948.00
QUEBECOR INC -CL B	6,060	32.00	193,920.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	14,905	26.67	397,516.35
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,670	138.05	230,543.50
DOLLARAMA INC	10,260	46.78	479,962.80
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	13,210	85.80	1,133,418.00
EMPIRE CO LTD 'A'	5,090	31.84	162,065.60
LOBLAW COMPANIES LTD	6,039	69.42	419,227.38
METRO INC	9,270	50.52	468,320.40

WESTON (GEORGE) LTD	1,758	101.47	178,384.26
SAPUTO INC	6,060	39.79	241,127.40
AURORA CANNABIS INC	22,780	10.13	230,761.40
BAUSCH HEALTH COS INC	9,574	28.81	275,826.94
CANOPY GROWTH CORP	6,180	55.26	341,506.80
CRONOS GROUP INC	4,900	20.75	101,675.00
BANK OF MONTREAL	18,681	99.67	1,861,935.27
BANK OF NOVA SCOTIA	37,189	70.59	2,625,171.51
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	13,105	103.51	1,356,498.55
NATIONAL BANK OF CANADA	10,100	61.73	623,473.00
ROYAL BANK OF CANADA	43,379	103.55	4,491,895.45
TORONTO-DOMINION BANK	55,310	75.91	4,198,582.10
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	24,663	63.26	1,560,181.38
CI FINANCIAL CORP	5,700	21.05	119,985.00
IGM FINANCIAL INC	1,945	37.76	73,443.20
ONEX CORPORATION	2,315	75.33	174,388.95
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	860	633.33	544,663.80
GREAT-WEST LIFECO INC	9,944	30.00	298,320.00
IA FINANCIAL CORP INC	3,855	52.44	202,156.20
INTACT FINANCIAL CORP	4,855	120.31	584,105.05
MANULIFE FINANCIAL CORP	59,101	23.32	1,378,235.32
POWER CORP OF CANADA	7,800	27.85	217,230.00
POWER FINANCIAL CORP	9,665	29.73	287,340.45
SUN LIFE FINANCIAL INC	19,494	52.71	1,027,528.74
FIRST CAPITAL REALTY INC	5,720	22.21	127,041.20
BLACKBERRY LTD	16,618	11.47	190,608.46
CGI INC	7,410	102.27	757,820.70
CONSTELLATION SOFTWARE INC	575	1,202.50	691,437.50
OPEN TEXT CORP	6,900	55.36	381,984.00
SHOPIFY INC - CLASS-A	2,880	409.15	1,178,352.00
BCE INC	4,170	59.88	249,699.60
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	10,635	69.05	734,346.75
TELUS CORP	7,466	48.60	362,847.60
ALTAGAS LTD	7,050	19.18	135,219.00
ATCO LTD -CLASS I	1,920	45.12	86,630.40

	CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,330	37.95	164,323.50	
	EMERA INC	2,130	53.45	113,848.50	
	FORTIS INC	13,445	52.15	701,156.75	
	HYDRO ONE LTD	9,070	22.86	207,340.20	
加ドル小計		1,224,062		55,956,329.90 (4,532,462,721)	
ユーロ	ENAGAS SA	7,610	25.01	190,326.10	
	ENI SPA	80,626	13.94	1,124,248.94	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	14,375	13.15	189,031.25	
	NESTE OYJ	12,730	30.87	392,975.10	
	OMV AG	3,940	42.09	165,834.60	
	REPSOL SA	41,949	14.30	599,870.70	
	SNAM SPA	59,280	4.71	279,683.04	
	TENARIS SA	11,695	10.80	126,306.00	
	TOTAL SA	72,287	47.25	3,415,560.75	
	VOPAK	2,090	39.08	81,677.20	
	AIR LIQUIDE SA	13,109	118.75	1,556,693.75	
	AKZO NOBEL	6,787	82.09	557,144.83	
	ARCELORMITTAL	18,292	14.57	266,551.02	
	ARKEMA	1,885	76.28	143,787.80	
	BASF SE	28,075	60.48	1,697,976.00	
	COVESTRO AG	6,340	41.76	264,758.40	
	CRH PLC	26,340	28.36	747,002.40	
	EVONIK INDUSTRIES AG	6,800	24.31	165,308.00	
	FUCHS PETROLUB SE-PRF	1,720	34.86	59,959.20	
	HEIDELBERGCEMENT AG	3,825	68.80	263,160.00	
	IMERYS SA	830	44.60	37,018.00	
	KONINKLIJKE DSM NV	5,452	107.25	584,727.00	
	LANXESS AG	3,295	45.70	150,581.50	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	5,620	26.60	149,492.00	
	SOLVAY SA	2,241	86.76	194,429.16	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	17,535	9.41	165,144.63	
	SYMRISE AG	3,450	88.28	304,566.00	
	THYSSENKRUPP AG	11,595	11.77	136,473.15	
	UMICORE	5,130	26.91	138,048.30	

UPM-KYMMENE OYJ	15,178	23.22	352,433.16
VOESTALPINE AG	4,239	24.16	102,414.24
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,926	37.27	332,672.02
AIRBUS GROUP SE	17,738	122.42	2,171,485.96
ALSTOM	5,240	41.51	217,512.40
ANDRITZ AG	2,250	31.32	70,470.00
BOUYGUES SA	5,400	31.44	169,776.00
BRENNTAG AG	3,925	42.24	165,792.00
CNH INDUSTRIAL NV	25,270	8.43	213,026.10
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	14,036	33.26	466,907.54
DASSAULT AVIATION SA	80	1,200.00	96,000.00
EIFFAGE	2,300	85.46	196,558.00
FERROVIAL SA	13,505	22.14	299,000.70
GEA GROUP AG	3,940	25.05	98,697.00
HOCHTIEF AG	870	106.60	92,742.00
KINGSPAN GROUP PLC	3,590	46.54	167,078.60
KION GROUP AG	2,380	52.48	124,902.40
KNORR-BREMSE AG	1,770	99.10	175,407.00
KONE OYJ-B	9,564	50.10	479,156.40
LEGRAND SA	8,238	62.54	515,204.52
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	13,210	10.78	142,403.80
METSO OYJ	2,420	31.91	77,222.20
MTU AERO ENGINES AG	1,370	198.70	272,219.00
PRYSMIAN SPA	6,315	16.93	106,912.95
SAFRAN SA	9,760	122.90	1,199,504.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	16,098	75.06	1,208,315.88
SIEMENS AG-REG	23,356	104.02	2,429,491.12
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	6,990	14.82	103,626.75
THALES SA	3,425	105.45	361,166.25
VINCI SA	15,750	89.58	1,410,885.00
WARTSILA OYJ ABP	12,830	12.85	164,929.65
BUREAU VERITAS SA	8,660	21.30	184,458.00
EDENRED	7,456	42.96	320,309.76
RANDSTAD NV	3,115	48.21	150,174.15
SOCIETE BIC SA	955	67.60	64,558.00



TELEPERFORMANCE	2,030	173.90	353,017.00
WOLTERS KLUWER	9,257	64.34	595,595.38
ADP	1,130	153.50	173,455.00
AENA SA	2,200	173.20	381,040.00
ATLANTIA SPA	14,220	23.42	333,032.40
BOLLORE	20,400	3.91	79,804.80
DEUTCHE LUFTHANSA	7,050	17.69	124,714.50
DEUTSCHE POST AG-REG	29,903	27.38	818,744.14
FRAPORT AG	980	76.18	74,656.40
GETLINK	11,810	13.82	163,214.20
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	10,805	62.46	674,880.30
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,720	53.20	91,504.00
CONTINENTAL AG	3,115	124.40	387,506.00
DAIMLER AG	26,832	47.42	1,272,373.44
FAURECIA	2,770	35.34	97,891.80
FERRARI NV	3,364	136.00	457,504.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	36,917	11.84	437,097.28
MICHELIN (CGDE)-B	4,779	109.90	525,212.10
NOKIAN RENKAAT OYJ	4,535	26.57	120,494.95
PEUGEOT SA	17,790	20.72	368,608.80
PIRELLI & C SPA	14,070	5.29	74,458.44
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	4,160	56.18	233,708.80
RENAULT SA	6,187	55.74	344,863.38
VALEO SA	5,760	24.30	139,968.00
VOLKSWAGEN AG	1,041	144.10	150,008.10
VOLKSWAGEN AG-PFD	5,633	141.24	795,604.92
ADIDAS AG	5,501	260.60	1,433,560.60
ESSILORLUXOTTICA	8,545	106.40	909,188.00
HERMES INTERNATIONAL	967	612.20	591,997.40
HUGO BOSS AG -ORD	2,070	54.70	113,229.00
KERING	2,397	486.45	1,166,020.65
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	8,454	354.00	2,992,716.00
MONCLER SPA	5,420	35.05	189,971.00
PUMA SE	2,190	54.45	119,245.50
SEB SA	770	151.10	116,347.00

ACCOR SA	5,426	34.80	188,824.80
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,150	65.92	141,728.00
SODEXO	2,330	104.25	242,902.50
AXEL SPRINGER SE	1,705	62.20	106,051.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	5,925	16.34	96,814.50
JC DECAUX SA	2,720	26.28	71,481.60
PUBLICIS GROUPE	6,385	50.00	319,250.00
RTL GROUP	1,470	44.22	65,003.40
SES	9,080	14.30	129,844.00
TELENET GROUP HOLDING NV	1,240	49.14	60,933.60
UBISOFT ENTERTAINMENT	1,920	68.04	130,636.80
VIVENDI	29,120	24.48	712,857.60
DELIVERY HERO SE	3,270	37.59	122,919.30
INDITEX	31,675	25.00	791,875.00
ZALANDO SE	3,330	37.79	125,840.70
CARREFOUR SA	20,853	17.11	356,794.83
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,344	32.60	43,814.40
COLRUYT SA	1,375	62.48	85,910.00
JERONIMO MARTINS	8,855	14.38	127,379.17
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	38,278	20.57	787,569.85
METRO WHOLESALE & FOOD SPECI	4,140	15.06	62,369.10
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	23,291	75.38	1,755,675.58
DANONE	18,264	72.52	1,324,505.28
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	14,820	8.76	129,823.20
HEINEKEN HOLDING NV	3,265	89.50	292,217.50
HEINEKEN NV	7,793	96.42	751,401.06
KERRY GROUP PLC-A	4,600	106.20	488,520.00
PERNOD-RICARD SA	6,246	157.85	985,931.10
REMY COINTREAU	810	115.20	93,312.00
BEIERSDORF AG	2,615	106.95	279,674.25
HENKEL AG & CO KGAA	2,730	82.60	225,498.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	5,993	88.48	530,260.64
L'OREAL	7,686	248.00	1,906,128.00
UNILEVER NV-CVA	45,265	54.59	2,471,016.35
BIOMERIEUX	1,070	74.80	80,036.00

CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,280	89.55	114,624.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	6,253	66.70	417,075.10
FRESENIUS SE & CO KGAA	12,475	46.13	575,471.75
KONINKLIJKE PHILIPS NV	27,371	36.66	1,003,557.71
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,050	177.70	186,585.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	5,680	36.61	207,944.80
BAYER AG-REG	28,524	52.85	1,507,493.40
EUROFINS SCIENTIFIC	280	360.00	100,800.00
GRIFOLS SA	8,040	24.21	194,648.40
IPSEN	1,330	114.70	152,551.00
MERCK KGAA	3,620	91.80	332,316.00
ORION OYJ-CLASS B	3,080	31.43	96,804.40
QIAGEN N.V.	7,264	35.24	255,983.36
RECORDATI SPA	2,530	37.05	93,736.50
SANOFI	34,386	75.98	2,612,648.28
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	650	129.30	84,045.00
UCB SA	4,528	70.40	318,771.20
ABN AMRO GROUP NV-CVA	10,610	18.81	199,627.15
AIB GROUP PLC	25,300	3.58	90,675.20
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	195,953	4.87	955,956.71
BANCO DE SABADELL SA	133,052	0.91	122,381.22
BANCO SANTANDER SA	494,669	3.95	1,956,168.56
BANK OF IRELAND GROUP PLC	24,219	4.63	112,133.97
BANKIA SA	33,700	2.14	72,320.20
BANKINTER SA	23,710	6.15	145,911.34
BNP PARIBAS	34,432	40.86	1,406,891.52
CAIXABANK S.A	106,970	2.57	275,661.69
COMMERZBANK AG	30,914	6.11	188,977.28
CREDIT AGRICOLE SA	34,822	10.29	358,492.49
ERSTE GROUP BANK AG	8,098	32.07	259,702.86
FINECOBANK SPA	15,600	9.04	141,117.60
ING GROEP NV-CVA	115,195	9.82	1,131,330.09
INTESA SANPAOLO	430,253	1.83	790,546.86
KBC GROEP NV	7,039	57.80	406,854.20
MEDIOBANCA SPA	20,820	8.52	177,511.32

RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	4,580	21.45	98,241.00
SOCIETE GENERALE	25,449	21.23	540,409.51
UNICREDIT SPA	60,106	10.13	608,873.78
AMUNDI SA	1,940	59.10	114,654.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	53,665	6.02	323,438.95
DEUTSCHE BOERSE AG	5,740	125.70	721,518.00
EURAZEO SE	1,107	61.65	68,246.55
EXOR NV	3,474	59.20	205,660.80
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,672	85.00	227,120.00
NATIXIS	29,240	3.85	112,778.68
WENDEL	1,010	117.40	118,574.00
AEGON NV	52,759	4.19	221,271.24
AGEAS	6,154	44.02	270,899.08
ALLIANZ SE-REG	12,918	207.40	2,679,193.20
ASSICURAZIONI GENERALI	35,808	16.13	577,762.08
AXA	56,772	22.61	1,283,614.92
CNP ASSURANCES	6,040	19.79	119,531.60
HANNOVER RUECK SE-REG	1,725	140.20	241,845.00
MAPFRE SA	35,184	2.63	92,780.20
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	4,366	221.60	967,505.60
NN GROUP NV	8,020	35.13	281,742.60
POSTE ITALIANE SPA	16,160	9.26	149,770.88
SAMPO OYJ-A SHS	12,309	40.59	499,622.31
SCOR SE	4,762	38.81	184,813.22
AROUNDTOWN SA	18,120	7.68	139,234.08
DEUTSCHE WOHNEN SE	11,050	37.00	408,850.00
VONOVIA SE	15,968	46.05	735,326.40
ADYEN NV	300	700.20	210,060.00
AMADEUS IT GROUP SA	13,020	68.10	886,662.00
ATOS SE	2,250	71.48	160,830.00
CAP GEMINI SA	4,519	97.16	439,066.04
DASSAULT SYSTEMES SA	3,700	137.00	506,900.00
SAP SE	29,892	113.54	3,393,937.68
WIRECARD AG	3,260	149.45	487,207.00
WORLDLINE SA	3,120	61.00	190,320.00

INGENICO GROUP	1,960	76.72	150,371.20
NOKIA OYJ	165,596	4.38	726,304.05
CELLNEX TELECOM SAU	5,700	32.07	182,799.00
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	101,686	15.39	1,564,947.54
DRILLISCH AG	1,640	27.36	44,870.40
ELISA OYJ	4,405	42.10	185,450.50
ILIAD SA	890	101.50	90,335.00
KONINKLIJKE KPN NV	108,506	2.83	307,831.52
ORANGE S.A.	63,984	13.82	884,258.88
PROXIMUS	4,970	26.12	129,816.40
TELECOM ITALIA SPA	352,713	0.45	161,577.82
TELECOM ITALIA-RSP	211,957	0.44	93,790.97
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	32,570	2.47	80,610.75
TELEFONICA SA	135,899	7.44	1,011,632.15
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,020	31.65	127,233.00
E.ON SE	66,369	9.93	659,376.01
EDF	14,555	11.78	171,457.90
ENDESA SA	9,620	23.79	228,859.80
ENEL SPA	248,267	6.07	1,506,980.69
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	72,391	3.44	249,169.82
ENGIE	59,244	12.95	767,506.02
FORTUM OYJ	11,015	19.14	210,882.17
IBERDROLA SA	182,752	8.95	1,637,092.41
INNOGY SE	4,300	41.32	177,676.00
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,262	25.44	261,065.28
RED ELECTRICA CORPORACION SA	11,120	19.37	215,450.00
RWE AG	18,745	22.85	428,323.25
SUEZ	12,499	12.57	157,174.92
TERNA SPA	35,697	5.76	205,828.90
UNIPER SE	5,900	26.29	155,111.00
VEOLIA ENVIRONNEMENT	17,364	21.25	368,985.00
VERBUND AG	1,750	45.86	80,255.00
ASML HOLDING NV	12,962	171.04	2,217,020.48
INFINEON TECHNOLOGIES AG	34,205	14.39	492,209.95
STMICROELECTRONICS NV	19,733	14.14	279,024.62

ユーロ小計		5,852,965		113,364,634.72 (13,815,748,033)
英債券	BP PLC	612,138	5.38	3,298,811.68
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	133,858	25.15	3,366,528.70
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	113,199	25.16	2,848,652.83
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	17,360	3.97	69,058.08
	ANGLO AMERICAN PLC	34,164	21.10	721,031.22
	ANTOFAGASTA PLC	14,940	8.59	128,334.60
	BHP GROUP PLC	66,391	19.10	1,268,068.10
	CRODA INTERNATIONAL PLC	3,661	52.40	191,836.40
	EVRAZ PLC	16,000	6.96	111,360.00
	FRESNILLO PLC	8,070	8.39	67,771.86
	GLENCORE PLC	334,333	2.72	909,552.92
	JOHNSON MATTHEY PLC	6,669	30.93	206,272.17
	MONDI PLC	9,350	17.26	161,427.75
	RIO TINTO PLC	34,375	47.70	1,639,687.50
	ASHTED GROUP PLC	14,210	19.49	276,952.90
	BAE SYSTEMS PLC ORD	93,485	4.84	453,121.79
	BUNZL PLC	9,666	21.65	209,268.90
	DCC PLC	2,530	69.44	175,683.20
	FERGUSON PLC	6,992	55.66	389,174.72
	MEGGITT PLC	27,315	5.11	139,634.28
	MELROSE INDUSTRIES PLC	139,600	1.69	236,691.80
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	48,045	8.91	428,465.31
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENT-C	3,411,195	0.00	3,411.19
	SMITHS GROUP PLC	13,793	14.83	204,619.15
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,460	87.00	214,020.00
	WEIR GROUP PLC/THE	5,990	14.73	88,262.65
	EXPERIAN PLC	27,438	24.08	660,707.04
	G4S PLC	58,799	2.11	124,418.68
	INTERTEK GROUP PLC	4,475	55.34	247,646.50
	RELX PLC	57,625	19.08	1,099,773.12
RENTOKIL INITIAL PLC	57,540	3.89	224,290.92	
EASYJET PLC	3,840	9.29	35,673.60	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	33,500	5.61	188,136.00	

BERKELEY GROUP HOLDINGS	4,010	35.30	141,553.00
BURBERRY GROUP PLC	11,654	17.41	202,954.41
PERSIMMON PLC	7,470	19.45	145,328.85
TAYLOR WIMPEY PLC	92,590	1.55	144,070.04
CARNIVAL PLC	6,090	40.33	245,609.70
COMPASS GROUP PLC	46,948	19.11	897,411.02
GVC HOLDINGS PLC	16,090	6.24	100,465.96
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	4,483	52.29	234,416.07
MERLIN ENTERTAINME	25,700	3.77	97,094.60
TUI AG-DI	14,113	7.50	105,875.72
WHITBREAD PLC	4,820	47.15	227,263.00
AUTO TRADER GROUP PLC	33,020	5.61	185,374.28
INFORMA PLC	40,340	8.00	322,720.00
ITV PLC	118,275	1.05	124,484.43
PEARSON PLC	29,059	7.98	232,065.17
WPP PLC	36,204	9.60	347,703.21
KINGFISHER PLC	69,577	2.07	144,441.85
MARKS & SPENCER GROUP PLC	64,664	2.16	139,674.24
NEXT PLC	4,087	55.14	225,357.18
OCADO GROUP PLC	13,430	11.59	155,720.85
SAINSBURY (J) PLC	42,801	1.93	82,991.13
TESCO PLC	291,174	2.24	653,394.45
WM MORRISON SUPERMARKETS	86,455	1.97	171,007.99
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	10,755	24.63	264,895.65
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	69,367	28.85	2,001,584.78
COCA-COLA HBC AG-CDI	5,140	29.06	149,368.40
DIAGEO PLC	73,562	34.18	2,514,716.97
IMPERIAL BRANDS PLC	28,502	19.76	563,370.53
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	21,585	65.26	1,408,637.10
UNILEVER PLC	33,837	49.73	1,682,883.19
NMC HEALTH PLC	3,660	22.99	84,143.40
SMITH & NEPHEW PLC	25,936	17.03	441,819.76
ASTRAZENECA PLC	38,563	62.15	2,396,690.45
GLAXOSMITHKLINE PLC	151,071	15.84	2,393,568.92
BARCLAYS PLC	506,541	1.49	754,746.09

	HSBC HOLDINGS PLC	609,181	6.45	3,932,872.53
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,178,106	0.57	1,256,767.16
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	140,780	2.12	299,016.72
	STANDARD CHARTERED PLC	85,290	6.76	576,901.56
	3I GROUP PLC	26,499	10.25	271,614.75
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	8,340	18.70	155,958.00
	INVESTEC PLC	21,805	4.76	103,791.80
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	9,637	54.46	524,831.02
	SCHRODERS PLC	4,101	29.29	120,118.29
	ST JAMES'S PLACE PLC	12,080	10.42	125,934.00
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	85,115	2.71	231,427.68
	ADMIRAL GROUP PLC	6,455	20.78	134,134.90
	AVIVA PLC	108,565	4.08	443,596.59
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	44,053	3.23	142,423.34
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	166,011	2.66	442,751.33
	PRUDENTIAL PLC	79,152	16.01	1,267,619.28
	RSA INSURANCE GROUP PLC	34,438	5.69	195,952.22
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	10,079	19.74	198,999.77
	SAGE GROUP PLC/THE	38,650	7.60	293,894.60
	HALMA PLC	12,580	19.89	250,279.10
	BT GROUP PLC	277,752	2.06	573,002.37
	VODAFONE GROUP PLC	786,968	1.28	1,007,476.43
	CENTRICA PLC	163,175	0.91	149,337.76
	NATIONAL GRID PLC	100,418	8.33	836,883.61
	SEVERN TRENT PLC	6,043	20.40	123,277.20
	SSE PLC	29,797	11.22	334,322.34
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	17,085	8.24	140,814.57
英債券小計		12,516,734		54,505,746.87 (7,453,660,884)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	7,550	18.78	141,826.75
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	290	628.00	182,120.00
	GIVAUDAN-REG	303	2,776.00	841,128.00
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	14,829	48.65	721,430.85
	SIKA AG-REG	3,680	159.00	585,120.00
	ABB LTD-REG	56,655	18.83	1,066,813.65



GEBERIT AG-REG	1,110	464.10	515,151.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	760	211.80	160,968.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,150	217.10	249,665.00	
ADECCO GROUP AG-REG	4,787	57.52	275,348.24	
SGS SA-REG	148	2,582.00	382,136.00	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,650	134.00	221,100.00	
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	16,559	79.44	1,315,446.96	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,040	258.30	268,632.00	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,870	49.24	92,078.80	
DUFREY AG-REG	1,570	80.80	126,856.00	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	75	1,978.00	148,350.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	33	6,885.00	227,205.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	78,100.00	234,300.00	
NESTLE SA-REG	92,973	101.40	9,427,462.20	
ALCON INC	13,134	57.98	761,509.32	
SONOVA HOLDING AG-REG	1,670	230.60	385,102.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	320	841.00	269,120.00	
LONZA GROUP AG-REG	2,438	329.10	802,345.80	
NOVARTIS AG-REG	65,853	89.41	5,887,916.73	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	21,338	276.00	5,889,288.00	
VIFOR PHARMA AG	1,070	138.60	148,302.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	72,788	11.36	827,235.62	
JULIUS BAER GROUP LTD	5,550	40.87	226,828.50	
PARGESA HOLDING SA-BR	1,295	74.15	96,024.25	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	575	712.40	409,630.00	
UBS GROUP AG-REG	114,182	11.52	1,315,376.64	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,580	172.40	272,392.00	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,080	474.60	512,568.00	
SWISS RE AG	8,789	98.86	868,880.54	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,761	337.30	1,605,885.30	
SWISS PRIME SITE-REG	2,551	83.70	213,518.70	
TEMENOS AG	1,980	174.60	345,708.00	
SWISSCOM AG-REG	904	496.00	448,384.00	
スイスフラン小計	528,893		38,469,153.85	(4,184,289,864)

スウェーデンクローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	4,320	266.50	1,151,280.00	
	BOLIDEN AB	9,430	225.45	2,125,993.50	
	ALFA LAVAL AB	8,500	200.10	1,700,850.00	
	ASSA ABLOY AB-B	28,070	202.80	5,692,596.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	22,345	280.80	6,274,476.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	10,020	255.70	2,562,114.00	
	EPIROC AB-A	20,385	91.02	1,855,442.70	
	EPIROC AB-B	9,100	88.17	802,347.00	
	SANDVIK AB	31,770	161.60	5,134,032.00	
	SKANSKA AB-B SHS	11,960	167.25	2,000,310.00	
	SKF AB-B SHARES-B	11,729	157.65	1,849,076.85	
	VOLVO AB-B SHS-B	43,930	140.95	6,191,933.50	
	SECURITAS AB-B SHS	8,769	164.60	1,443,377.40	
	ELECTROLUX AB - B	8,065	229.20	1,848,498.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	14,680	86.88	1,275,398.40	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	24,438	154.04	3,764,429.52	
	ICA GRUPPEN AB	2,490	398.20	991,518.00	
	SWEDISH MATCH AB	6,040	424.90	2,566,396.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	17,535	296.00	5,190,360.00	
	NORDEA BANK ABP	85,268	69.29	5,908,219.72	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	51,240	87.06	4,460,954.40	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	43,110	91.88	3,960,946.80	
	SWEDBANK AB - A SHARES	28,560	140.35	4,008,396.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,870	201.30	1,181,631.00	
	INVESTOR AB-B SHS	15,045	439.40	6,610,773.00	
	KINNEVIK AB - B	8,115	242.10	1,964,641.50	
LUNDBERGS AB-B SHS	2,350	341.20	801,820.00		
ERICSSON LM-B SHS	88,915	89.28	7,938,331.20		
HEXAGON AB-B SHS	7,700	482.10	3,712,170.00		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2,330	506.00	1,178,980.00		
TELE2 AB-B SHS	14,755	134.10	1,978,645.50		
TELIA CO AB	75,170	41.26	3,101,514.20		
スウェーデンクローナ小計		722,004		101,227,452.19	(1,159,054,327)
ノルウェーク	AKER BP ASA	3,800	226.20	859,560.00	

ローネ	EQUINOR ASA	31,624	169.95	5,374,498.80	
	NORSK HYDRO A S	36,870	30.92	1,140,020.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	5,780	406.50	2,349,570.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,020	225.00	679,500.00	
	MOWI ASA	15,540	205.30	3,190,362.00	
	ORKLA ASA	26,610	76.14	2,026,085.40	
	DNB ASA	27,035	150.55	4,070,119.25	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,030	175.10	1,230,953.00	
	TELENOR ASA	19,845	189.05	3,751,697.25	
ノルウェークローネ小計		177,154		24,672,366.10	(308,157,852)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,230	735.00	2,374,050.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	6,325	305.00	1,929,125.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	6,570	569.00	3,738,330.00	
	ISS A/S	4,720	192.85	910,252.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	125	6,885.00	860,625.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	168	7,258.00	1,219,344.00	
	DSV A/S	5,430	619.80	3,365,514.00	
	PANDORA A/S	2,900	220.70	640,030.00	
	CARLSBERG AS-B	3,650	880.00	3,212,000.00	
	COLOPLAST-B	3,375	751.20	2,535,300.00	
	DEMANT A/S	2,610	216.60	565,326.00	
	GENMAB A/S	1,770	1,179.00	2,086,830.00	
	H LUNDBECK A/S	2,450	253.90	622,055.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	51,955	340.50	17,690,677.50	
	DANSKE BANK A/S	21,315	109.60	2,336,124.00	
TRYG A/S	3,635	218.00	792,430.00		
ORSTED A/S	5,130	566.80	2,907,684.00		
デンマーククローネ小計		125,358		47,785,696.50	(779,862,566)
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	8,355	26.47	221,156.85	
	OIL SEARCH LTD	43,280	7.00	302,960.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	43,120	7.02	302,702.40	
	SANTOS LTD	53,355	7.00	373,485.00	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	30,583	35.03	1,071,322.49	

WORLEYPARSONS LTD	7,530	13.74	103,462.20
ALUMINA LTD	75,722	2.43	184,004.46
BHP GROUP LTD	88,896	40.30	3,582,508.80
BLUESCOPE STEEL LTD	18,750	11.76	220,500.00
BORAL LTD	42,795	5.39	230,665.05
FORTESCUE METALS GROUP LTD	48,165	8.80	423,852.00
INCITEC PIVOT LTD	44,370	3.48	154,407.60
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	10,885	18.45	200,828.25
NEWCREST MINING LTD	23,029	30.12	693,633.48
ORICA LIMITED	12,155	20.45	248,569.75
RIO TINTO LTD	10,768	105.34	1,134,301.12
SOUTH32 LTD	147,847	3.31	489,373.57
CIMIC GROUP LTD	2,897	45.05	130,509.85
BRAMBLES LTD	51,068	12.97	662,351.96
SEEK LTD	11,730	21.09	247,385.70
AURIZON HOLDINGS LTD	64,970	5.34	346,939.80
SYDNEY AIRPORT	33,726	7.74	261,039.24
TRANSURBAN GROUP	77,569	14.51	1,125,526.19
ARISTOCRAT LEISURE LTD	19,040	30.62	583,004.80
CROWN RESORTS LTD	11,245	11.97	134,602.65
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,010	39.28	78,952.80
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	1,630	41.31	67,335.30
TABCORP HOLDINGS LTD	61,274	4.59	281,247.66
REA GROUP LTD	1,800	92.76	166,968.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	11,392	4.04	46,023.68
WESFARMERS LTD	33,275	35.66	1,186,586.50
COLES GROUP LTD	40,685	13.01	529,311.85
WOOLWORTHS GROUP LTD	38,902	32.29	1,256,145.58
COCA-COLA AMATIL LTD	17,820	10.01	178,378.20
TREASURY WINE ESTATES LTD	26,956	15.07	406,226.92
COCHLEAR LTD	1,807	204.23	369,043.61
RAMSAY HEALTH CARE LTD	4,375	71.67	313,556.25
SONIC HEALTHCARE LTD	14,020	27.50	385,550.00
CSL LTD	13,652	212.87	2,906,101.24
AUST AND NZ BANKING GROUP	87,179	28.22	2,460,191.38

	BANK OF QUEENSLAND LIMITED	14,130	9.54	134,800.20	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	17,778	11.48	204,091.44	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	53,457	79.77	4,264,264.89	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	85,003	26.73	2,272,130.19	
	WESTPAC BANKING CORP	103,951	27.88	2,898,153.88	
	AMP LTD	86,827	2.11	183,204.97	
	ASX LTD	5,545	81.00	449,145.00	
	CHALLENGER LTD	20,840	6.50	135,460.00	
	MACQUARIE GROUP LTD	9,204	122.09	1,123,716.36	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	68,875	7.79	536,536.25	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	104,360	3.38	352,736.80	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	38,980	12.23	476,725.40	
	SUNCORP GROUP LTD	45,280	13.37	605,393.60	
	COMPUTERSHARE LTD	14,790	16.63	245,957.70	
	TELSTRA CORPORATION LTD	117,984	3.87	456,598.08	
	TPG TELECOM LTD	7,840	6.52	51,116.80	
	AGL ENERGY LTD	19,021	19.57	372,240.97	
	APA GROUP	37,738	11.17	421,533.46	
	AUSNET SERVICES	69,210	1.94	134,613.45	
	豪ドル小計	2,259,440		39,379,131.62	(2,942,802,505)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	30,583	5.43	166,065.69	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	36,555	9.02	329,726.10	
	A2 MILK CO LTD	20,800	14.85	308,880.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	15,790	15.07	237,955.30	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	14,200	11.65	165,430.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	52,077	3.87	201,798.37	
	MERIDIAN ENERGY LTD	37,050	4.48	166,169.25	
	ニュージーランドドル小計	207,055		1,576,024.71	(111,298,865)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	77,208	75.10	5,798,320.80	
	NWS HOLDINGS LTD	48,500	15.56	754,660.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	40,000	55.30	2,212,000.00	
	MTR CORP	52,000	49.35	2,566,200.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	24,500	21.40	524,300.00	

GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	65,000	48.50	3,152,500.00	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	28,400	12.06	342,504.00	
SANDS CHINA LTD	85,000	36.00	3,060,000.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	28,000	9.45	264,600.00	
SJM HOLDINGS LTD	48,000	8.20	393,600.00	
WYNN MACAU LTD	35,800	16.00	572,800.00	
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	24,000	46.45	1,114,800.00	
WH GROUP LTD	283,000	7.35	2,080,050.00	
BANK OF EAST ASIA	45,040	21.95	988,628.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	126,500	30.20	3,820,300.00	
HANG SENG BANK LTD	21,500	194.20	4,175,300.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	34,900	260.40	9,087,960.00	
AIA GROUP LTD	367,390	73.80	27,113,382.00	
CK ASSET HOLDINGS LTD	71,708	58.90	4,223,601.20	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	46,000	17.22	792,120.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	42,638	40.30	1,718,311.40	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT(N)	4,263	40.30	171,798.90	
HYSAN DEVELOPMENT CO	15,000	39.60	594,000.00	
KERRY PROPERTIES LTD	18,950	30.90	585,555.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	169,666	11.50	1,951,159.00	
SINO LAND CO	85,050	12.50	1,063,125.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	51,480	125.90	6,481,332.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	17,517	93.80	1,643,094.60	
SWIRE PROPERTIES LTD	39,200	31.60	1,238,720.00	
WHARF HOLDINGS LTD	42,800	20.20	864,560.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	31,800	51.90	1,650,420.00	
WHEELLOCK & CO LTD	29,600	52.70	1,559,920.00	
HKT TRUST AND HKT LTD	91,000	12.54	1,141,140.00	
PCCW LTD	136,000	4.56	620,160.00	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	16,000	63.00	1,008,000.00	
CLP HOLDINGS LTD	49,000	89.05	4,363,450.00	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	93,500	7.80	729,300.00	
HONG KONG & CHINA GAS	301,434	17.18	5,178,636.12	
POWER ASSETS HOLDINGS	44,000	56.20	2,472,800.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	10,700	73.05	781,635.00	

香港ドル小計		2,842,044		108,854,743.02 (1,509,815,285)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	39,560	6.30	249,228.00
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	21,000	2.37	49,770.00
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	51,000	4.11	209,610.00
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	83,500	1.47	122,745.00
	COMFORTDELGRO CORP LTD	71,300	2.58	183,954.00
	SATS LTD	22,000	5.14	113,080.00
	SINGAPORE AIRLINES LTD	12,800	9.13	116,864.00
	GENTING SINGAPORE LTD	212,600	0.88	188,151.00
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	56,250	2.37	133,312.50
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	3,500	36.50	127,750.00
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	130,000	0.27	35,100.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	49,660	3.48	172,816.80
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	53,015	24.81	1,315,302.15
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	103,640	10.78	1,117,239.20
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	37,700	24.99	942,123.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	22,000	7.54	165,880.00
	CAPITALAND LTD	72,500	3.43	248,675.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	17,200	9.36	160,992.00
	UOL GROUP LTD	15,650	7.26	113,619.00
VENTURE CORP LTD	9,700	16.63	161,311.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	233,680	3.33	778,154.40	
シンガポールドル小計		1,318,255		6,705,677.05 (531,491,962)
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	21,770	19.12	416,242.40
	ELBIT SYSTEMS LTD	770	559.00	430,430.00
	BANK HAPOLIM BM	41,745	25.95	1,083,282.75
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	53,225	24.96	1,328,496.00
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	41,400	14.23	589,122.00
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,900	79.83	391,167.00
	AZRIELI GROUP LTD	1,610	220.50	355,005.00
	NICE LTD	1,915	497.40	952,521.00
イスラエルシュケル小計		167,335		5,546,266.15 (166,998,073)

合 計	37,152,531	118,809,162,527 (118,809,162,527)
-----	------------	--------------------------------------

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	出資金	PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A-LP	5,737.00	139,007.51	
	出資金小計		5,737.00	139,007.51 (15,104,556)	
	投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	14,530	245,266.40	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	3,160	478,108.00	
		AMERICAN TOWER CORP	13,429	2,836,607.67	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	48,540	442,684.80	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,155	864,613.95	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,317	583,658.40	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,640	280,262.40	
		CROWN CASTLE INTL CORP	12,690	1,691,703.90	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	6,765	810,176.40	
		DUKE REALTY CORPORATION	12,685	402,748.75	
		EQUINIX INC	2,378	1,212,589.76	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	2,720	337,361.60	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	11,940	934,424.40	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,010	601,371.90	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	4,080	440,884.80	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,875	249,637.50	
		HCP INC	14,045	451,125.40	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	21,789	398,956.59	
		INVITATION HOMES INC	10,010	273,373.10	
		IRON MOUNTAIN INC	6,925	219,730.25	
		KIMCO REALTY CORPORATION	14,815	277,484.95	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	5,203	261,398.72	
		MACERICH CO/THE	4,120	142,263.60	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,690	434,645.10	



		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	4,050	223,884.00	
		PROLOGIS INC	19,852	1,587,365.92	
		PUBLIC STORAGE	4,659	1,133,581.29	
		REALTY INCOME CORP	10,000	732,700.00	
		REGENCY CENTERS CORP	4,305	296,485.35	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	3,200	724,800.00	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	9,474	1,543,504.08	
		SL GREEN REALTY CORP	2,040	178,581.60	
		SUN COMMUNITIES INC	2,740	353,788.80	
		UDR INC	7,910	367,340.40	
		VENTAS INC	10,855	724,679.80	
		VEREIT INC	31,824	303,282.72	
		VORNADO REALTY TRUST	5,581	369,462.20	
		WELLTOWER INC	11,530	948,688.40	
		WEYERHAEUSER CO	23,938	615,445.98	
		WP CAREY INC	4,400	376,200.00	
		投資証券小計	384,869	25,350,868.88	(2,754,625,412)
		米ドル小計	390,606	25,489,876.39	(2,769,729,968)
加ドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	4,000	90,920.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,660	151,914.40	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1,690	57,493.80	
		加ドル小計	11,350	300,328.20	(24,326,584)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,665	158,091.75	
		GECINA SA	1,490	199,660.00	
		ICADE	1,175	94,000.00	
		KLEPIERRE	4,732	140,209.16	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,370	593,664.50	
		ユーロ小計	13,432	1,185,625.41	(144,492,168)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	34,331	185,112.75	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	22,294	187,626.30	
		SEGRO PLC	33,703	242,324.57	
			90,328	615,063.62	

英ポンド小計					(84,109,950)
豪ドル	投資証券	DEXUS		29,087	396,746.68
		GOODMAN GROUP		43,832	642,138.80
		GPT GROUP		57,415	354,250.55
		LENDLEASE GROUP		18,967	246,571.00
		MIRVAC GROUP		128,775	413,367.75
		SCENTRE GROUP		156,031	586,676.56
		STOCKLAND		78,000	340,080.00
		VICINITY CENTRES		123,402	318,377.16
豪ドル小計			635,509		3,298,208.50 (246,475,121)
香港ドル	投資証券	LINK REIT		59,500	5,703,075.00
香港ドル小計			59,500		5,703,075.00 (79,101,650)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		88,600	264,028.00
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		92,140	189,808.40
		CAPITALAND MALL TRUST		84,200	218,920.00
		SUNTEC REIT		54,600	103,194.00
シンガポールドル小計			319,540		775,950.40 (61,501,828)
合計					3,409,737,269 (3,409,737,269)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入出資金 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	出資金 1銘柄		0.0%		0.0%
	株式 614銘柄	96.7%			66.6%
	投資証券 40銘柄			3.3%	2.3%
加ドル	株式 86銘柄	99.5%			3.7%
	投資証券 3銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 239銘柄	99.0%			11.3%

	投資証券	5銘柄			1.0%	0.1%
英ポンド	株式	95銘柄	98.9%			6.1%
	投資証券	3銘柄			1.1%	0.1%
スイスフラン	株式	39銘柄	100.0%			3.4%
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%			0.3%
デンマーククローネ	株式	17銘柄	100.0%			0.6%
豪ドル	株式	59銘柄	92.3%			2.4%
	投資証券	8銘柄			7.7%	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	40銘柄	95.0%			1.2%
	投資証券	1銘柄			5.0%	0.1%
シンガポールドル	株式	21銘柄	89.6%			0.4%
	投資証券	4銘柄			10.4%	0.1%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.0%			0.1%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2019年 6月28日現在です。

### 【世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型】

#### 【純資産額計算書】

資産総額	31,885,439,578円
負債総額	27,097,188円
純資産総額( - )	31,858,342,390円
発行済口数	36,858,609,295口
1口当たり純資産額( / )	0.8643円

(参考)

### 日本リートインデックスJ-REITマザーファンド

#### 純資産額計算書

資産総額	33,278,880,421円
負債総額	1,642,619,608円
純資産総額( - )	31,636,260,813円
発行済口数	14,111,939,788口
1口当たり純資産額( / )	2.2418円

### 海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド

#### 純資産額計算書

資産総額	28,893,055,782円
負債総額	16,234,889円
純資産総額( - )	28,876,820,893円
発行済口数	13,606,930,803口
1口当たり純資産額( / )	2.1222円

### 日本債券インデックスマザーファンド

#### 純資産額計算書

資産総額	40,875,480,836円
負債総額	312,503,024円
純資産総額（ - ）	40,562,977,812円
発行済口数	28,289,712,651口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4338円

## 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	152,074,254,636円
負債総額	116,114,220円
純資産総額（ - ）	151,958,140,416円
発行済口数	66,178,769,432口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2962円

## 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	30,702,658,044円
負債総額	67,061,502円
純資産総額（ - ）	30,635,596,542円
発行済口数	21,524,471,271口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4233円

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

## 純資産額計算書

資産総額	130,905,236,933円
負債総額	46,228,732円
純資産総額（ - ）	130,859,008,201円
発行済口数	51,762,295,925口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5281円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1) 名義書換

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

いものとしてします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1) 資本金の額

2019年6月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

###### (2) 会社の意思決定機関（2019年6月末現在）

###### ・株主総会

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

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

###### ・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。また、取締役会の決議によって重要な業務執行（会社法第399条の13第5項各号に掲げる事項を除く。）の決定の全部又は一部を取締役に委任することができます。

当社の取締役会は10名以内の取締役（監査等委員である取締役を除く。）及び5名以内の監査等委員である取締役で構成され、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の終結の時までとします。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。

###### ・監査等委員会

当社の監査等委員会は、5名以内の監査等委員である取締役で構成され、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の終結の時までとします。監査等委員会は、その決議をもって、監査等委員の中から、常勤の監査等委員を選定します。

###### (3) 運用の意思決定プロセス（2019年6月末現在）

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

##### 2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、2019年6月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	826	181,845
株式投資信託	779	155,354
単位型	250	9,219
追加型	529	146,135
公社債投資信託	47	26,490
単位型	33	833
追加型	14	25,657

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第60期事業年度（2018年4月1日から2019年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### (1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第59期 (2018年3月31日)		第60期 (2019年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	14,024	3	20,680
有価証券		19		1
前払費用		551		495
未収入金		73		38
未収委託者報酬		15,873		16,867
未収収益	3	3,174	3	618
関係会社短期貸付金		1,128		2,408
立替金		2,776		791
その他	2,3	4,179	2	869
流動資産合計		41,800		42,769
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	68	1	136
器具備品	1	122	1	137
有形固定資産合計		191		274
無形固定資産				
ソフトウェア		99		107
無形固定資産合計		99		107
投資その他の資産				
投資有価証券		14,103		16,755
関係会社株式		25,769		25,769
長期差入保証金		490		447
長期前払費用		0		-



繰延税金資産		1,504		1,913
投資その他の資産合計		41,868		44,886
固定資産合計		42,159		45,268
資産合計		83,959		88,038

(単位：百万円)

		第59期 (2018年3月31日)		第60期 (2019年3月31日)
<b>負債の部</b>				
<b>流動負債</b>				
預り金	3	3,804		354
未払金		5,874		6,112
未払収益分配金		7		7
未払償還金		91		71
未払手数料	3	5,124	3	5,299
その他未払金		651		734
未払費用	3	4,634	3	3,897
未払法人税等		2,185		2,382
未払消費税等	4	788	4	621
賞与引当金		2,286		2,680
役員賞与引当金		198		210
その他		41	3	172
流動負債合計		19,813		16,431
<b>固定負債</b>				
退職給付引当金		1,316		1,405
その他		318		629
固定負債合計		1,634		2,035
負債合計		21,448		18,466
<b>純資産の部</b>				
<b>株主資本</b>				
資本金		17,363		17,363
資本剰余金				
資本準備金		5,220		5,220
資本剰余金合計		5,220		5,220
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		39,959		47,142
利益剰余金合計		39,959		47,142
自己株式		786		833
株主資本合計		61,756		68,891
<b>評価・換算差額等</b>				
その他有価証券評価差額金		408		493
繰延ヘッジ損益		346		185
評価・換算差額等合計		754		679
純資産合計		62,511		69,571
負債純資産合計		83,959		88,038

## (2) 【損益計算書】

	(単位：百万円)	
	第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	70,609	77,264
その他営業収益	5,398	3,063
営業収益合計	76,008	80,328
営業費用		
支払手数料	30,448	32,834
広告宣伝費	973	960
公告費	2	2
調査費	18,132	18,251
調査費	862	890
委託調査費	17,241	17,333
図書費	28	27
委託計算費	520	541
営業雑経費	740	794
通信費	173	128
印刷費	348	334
協会費	68	69
諸会費	24	19
その他	125	243
営業費用計	50,817	53,385
一般管理費		
給料	9,096	9,783
役員報酬	507	241
役員賞与引当金繰入額	198	210
給料・手当	6,083	6,589
賞与	20	61
賞与引当金繰入額	2,286	2,680
交際費	99	92
寄付金	16	13
旅費交通費	455	476
租税公課	424	428
不動産賃借料	890	888
退職給付費用	355	378
退職金	24	52
固定資産減価償却費	152	108
福利費	974	1,071
諸経費	3,175	3,106
一般管理費計	15,664	16,401
営業利益	9,526	10,540

	(単位：百万円)	
	第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業外収益		
受取利息	26	37
受取配当金	1	1,865
有価証券償還益	1	1

デリバティブ収益	-	1	142	
時効成立分配金・償還金	1		21	
為替差益	79		58	
その他	41		48	
営業外収益合計	1,272		2,176	
営業外費用				
支払利息	1	223	1	286
デリバティブ費用	1	295		-
時効成立後支払分配金・償還金		0		78
長期差入保証金償却額		212		-
その他		34		24
営業外費用合計		767		388
経常利益		10,030		12,328
特別利益				
投資有価証券売却益		199		218
特別利益合計		199		218
特別損失				
投資有価証券売却損		133		176
固定資産処分損		7		0
役員退職一時金		117		180
損害賠償損失		81		-
特別損失合計		340		357
税引前当期純利益		9,890		12,189
法人税、住民税及び事業税		3,217		3,741
法人税等調整額		307		375
法人税等合計		2,910		3,366
当期純利益		6,979		8,823

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第59期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	34,015	34,015	672	55,926
当期変動額							
剰余金の配当				1,036	1,036		1,036
当期純利益				6,979	6,979		6,979
自己株式の取得						113	113
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	5,943	5,943	113	5,830
当期末残高	17,363	5,220	5,220	39,959	39,959	786	61,756

評価・換算差額等

	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	純資産合計
当期首残高	282	266	548	56,475
当期変動額				
剰余金の配当				1,036
当期純利益				6,979
自己株式の取得				113
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	125	80	206	206
当期変動額合計	125	80	206	6,036
当期末残高	408	346	754	62,511

第60期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計		
				繰越利益 剰余金			
当期首残高	17,363	5,220	5,220	39,959	39,959	786	61,756
当期変動額							
剰余金の配当				1,640	1,640		1,640
当期純利益				8,823	8,823		8,823
自己株式の取得						47	47
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	7,182	7,182	47	7,135
当期末残高	17,363	5,220	5,220	47,142	47,142	833	68,891

	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	408	346	754	62,511
当期変動額				
剰余金の配当				1,640
当期純利益				8,823
自己株式の取得				47
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	85	160	75	75
当期変動額合計	85	160	75	7,060
当期末残高	493	185	679	69,571

[注記事項]

## （重要な会計方針）

項目	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)				
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定） 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(2) デリバティブ 時価法</p>				
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産</p> <p>定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <table border="0" data-bbox="528 835 1031 904"> <tr> <td>建物</td> <td>3年～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4年～20年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>	建物	3年～15年	器具備品	4年～20年
建物	3年～15年				
器具備品	4年～20年				
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>				
4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>				

5 その他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、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。
---------------------------	--

## (未適用の会計基準等)

- 「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日）
- 「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日）

## (1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

- ステップ1：顧客との契約を識別する。
- ステップ2：契約における履行義務を識別する。
- ステップ3：取引価格を算定する。
- ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。
- ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

## (2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

## (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

## (表示方法の変更)

第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
<p>(「『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)</p> <p>「『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、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しております。</p> <p>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」1,014百万円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,504百万円に含めて表示しております。</p>

## (貸借対照表関係)

第59期 (2018年3月31日)	第60期 (2019年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,260百万円</p> <p>器具備品 612百万円</p> <p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち3,030百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 3,189百万円</p> <p>未収収益 592百万円</p> <p>その他 345百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>預り金 419百万円</p> <p>未払手数料 376百万円</p> <p>未払費用 677百万円</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,281百万円</p> <p>器具備品 655百万円</p> <p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 1,347百万円</p> <p>未収収益 127百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 350百万円</p> <p>未払費用 767百万円</p> <p>その他 162百万円</p>

<p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務553百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソンタワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務103百万円に対して保証を行っております。</p>	<p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務468百万円に対して保証を行っております。</p>
--	---

## (損益計算書関係)

第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)												
<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">受取配当金</td> <td style="text-align: right;">979百万円</td> </tr> <tr> <td>デリバティブ収益</td> <td style="text-align: right;">407百万円</td> </tr> <tr> <td>支払利息</td> <td style="text-align: right;">213百万円</td> </tr> </table>	受取配当金	979百万円	デリバティブ収益	407百万円	支払利息	213百万円	<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">受取配当金</td> <td style="text-align: right;">1,831百万円</td> </tr> <tr> <td>デリバティブ収益</td> <td style="text-align: right;">54百万円</td> </tr> <tr> <td>支払利息</td> <td style="text-align: right;">75百万円</td> </tr> </table>	受取配当金	1,831百万円	デリバティブ収益	54百万円	支払利息	75百万円
受取配当金	979百万円												
デリバティブ収益	407百万円												
支払利息	213百万円												
受取配当金	1,831百万円												
デリバティブ収益	54百万円												
支払利息	75百万円												

## (株主資本等変動計算書関係)

第59期(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)	197,012,500	-	-	197,012,500

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,119,100	182,600	-	1,301,700

## 3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年 度末残高 (百万円)
		当事業年度 期首	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
2009年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,689,600	-	194,700	1,494,900	-
2009年度 ストックオプション(2)	普通株式	174,900	-	66,000	108,900	-
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,890,800	-	204,600	2,686,200	-
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,404,000	-	786,000	3,618,000	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	-	4,409,000	532,000	3,877,000	-
合計		9,159,300	4,409,000	1,783,300	11,785,000	-

(注) 1 2016年度ストックオプション(2)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。

2 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

- 3 2009年度ストックオプション(1)1,494,900株、2009年度ストックオプション(2)108,900株及び2011年度ストックオプション(1)2,686,200株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(1)及び2016年度ストックオプション(2)は、権利行使期間の初日が到来していません。

#### 4 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2017年5月25日 取締役会	普通株式	1,036	5.29	2017年3月31日	2017年6月22日

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年5月31日 取締役会	普通株式	利益剰余金	1,640	8.38	2018年3月31日	2018年6月23日

#### 第60期(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)	197,012,500	-	-	197,012,500

##### 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,301,700	64,000	-	1,365,700

##### 3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年 度末残高 (百万円)
		当事業年度 期首	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
2009年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,494,900	-	323,400	1,171,500	-
2009年度 ストックオプション(2)	普通株式	108,900	-	33,000	75,900	-
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,686,200	-	630,300	2,055,900	-
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	3,618,000	-	-	3,618,000	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	3,877,000	-	66,000	3,811,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	-	4,422,000	66,000	4,356,000	-
合計		11,785,000	4,422,000	1,118,700	15,088,300	-

(注) 1 2017年度ストックオプション(1)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。

2 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

3 2009年度ストックオプション(1)1,171,500株、2009年度ストックオプション(2)75,900株、2011年度ストックオプション(1)2,055,900株及び2016年度ストックオプション(1)1,206,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(1)2,412,000株、2016年度ストックオプション(2)及び2017年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来していません。

#### 4 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額



決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年5月31日 取締役会	普通株式	1,640	8.38	2018年3月31日	2018年6月23日

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年5月28日 取締役会	普通株式	利益剰余金	3,212	16.42	2019年3月31日	2019年6月24日

## (リース取引関係)

第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料		オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	866百万円	1年内	853百万円
1年超	923百万円	1年超	6,704百万円
合計	1,790百万円	合計	7,558百万円

## (金融商品関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

りリスクをヘッジしております。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

#### 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

#### 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

2018年3月31日（当事業年度の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

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

( 1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

##### (1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益並びに(4) 関係会社短期貸付金

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

##### (5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

（デリバティブ取引関係）注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないもののうち8百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、23百万円は流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されているものは貸借対照表上流動資産のその他に含まれております。

- 2 非上場株式等（貸借対照表計上額16百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。
- 3 子会社株式（貸借対照表計上額22,876百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。
- 4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	14,024	-	-	-
未収委託者報酬	15,873	-	-	-
未収収益	3,174	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	19	616	1,743	545
合計	33,090	616	1,743	545

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

上記以外の外貨建ての債権及び債務に関しては、為替変動リスクに晒されておりますが、一部為替予約  
によりリスクをヘッジしております。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### 信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

#### 市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

#### 流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

2019年3月31日(当事業年度の決算日)における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額につい  
ては、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含め  
ておりません。

(単位:百万円)

	貸借対照表 計上額( 1)	時価( 1)	差額
(1) 現金・預金	20,680	20,680	-
(2) 未収委託者報酬	16,867	16,867	-
(3) 未収収益	618	618	-
(4) 関係会社短期貸付金	2,408	2,408	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	16,740	16,740	-
(6) 未払金	(6,112)	(6,112)	-
(7) 未払費用	(3,897)	(3,897)	-
(8) デリバティブ取引( 2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(31)	(31)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(127)	(127)	-
デリバティブ取引計	(158)	(158)	-

( 1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

## (1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益並びに(4) 関係会社短期貸付金

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

## (5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

## (6) 未払金及び(7) 未払費用

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

## (8) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないもののうち3百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、35百万円は流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されているもののうち0百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、127百万円は流動負債のその他に含まれております。

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

3 子会社株式（貸借対照表計上額22,876百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

## 4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	20,680	-	-	-
未収委託者報酬	16,867	-	-	-
未収収益	618	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	1	163	6,929	1,363
合計	38,167	163	6,929	1,363

## (有価証券関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上 額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

## 2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額	投資信託	8,544	7,535	1,008

が取得原価を超えるもの	小計	8,544	7,535	1,008
貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの	投資信託	5,561	5,982	420
	小計	5,561	5,982	420
合計		14,106	13,518	588

- (注) 1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当事業年度については、該当ございません。
- 2 非上場株式等(貸借対照表計上額 16百万円)については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

### 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	2,792	199	133
合計	2,792	199	133

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

#### 1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

#### 2 その他有価証券

(単位:百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの	投資信託	9,340	8,440	900
	小計	9,340	8,440	900
貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの	投資信託	7,400	7,589	188
	小計	7,400	7,589	188
合計		16,740	16,029	711

- (注) 1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当事業年度については、該当ございません。
- 2 非上場株式等(貸借対照表計上額 16百万円)については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

#### 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	4,189	218	176
合計	4,189	218	176

(デリバティブ取引関係)

第59期(2018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  
株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引  
通貨関連

ヘッジ会計の 方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引	投資有価証券			
	売建				
	米ドル		4,447	-	196
	豪ドル		109	-	10
	シンガポール ドル		1,783	-	65
	香港ドル		541	-	25
	人民元		2,156	-	32
	ユーロ		154	-	6
合計			9,192	-	336

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第60期(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) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	2,407	-	3	3
	買建	-	-	-	-
合計		2,407	-	3	3

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,792	-	35	35
合計		1,792	-	35	35

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計の 方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引 売建 米ドル	投資有価証券	2,251	-	42
	豪ドル		63	-	0
	シンガポール ドル		975	-	18
	香港ドル		518	-	8
	人民元		2,149	-	58
	ユーロ		81	-	0
	合計		6,040	-	127

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位:百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位:百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額 3,008	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,010
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 10,409	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 10,668
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,827	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,704

(退職給付関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表



(百万円)

退職給付債務の期首残高	1,190
勤務費用	130
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	66
退職給付の支払額	76
退職給付債務の期末残高	1,313

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

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

退職給付引当金	1,316
貸借対照表に計上された負債の額	1,316

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%
-----	------

## 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、222百万円でありました。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1 採用している退職給付制度の概要

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

## 2 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)

退職給付債務の期首残高	1,313
勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	12
退職給付の支払額	59
退職給付債務の期末残高	1,411

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

退職給付債務	1,411
未積立退職給付債務	1,411
未認識数理計算上の差異	6
貸借対照表に計上された負債の額	1,405

退職給付引当金	1,405
貸借対照表に計上された負債の額	1,405

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	3
確定給付制度に係る退職給付費用	148

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%
-----	------

## 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、230百万円でありました。

## (ストックオプション等関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

## (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定条件	2012年1月22日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	同左
権利行使期間	2012年1月22日から 2020年1月21日まで	同左

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 186名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 16名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 6,101,700株	普通株式 4,437,000株
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日

権利確定条件	2013年10月7日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2018年7月15日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2013年10月7日から 2021年10月6日まで	2018年7月15日から 2026年7月31日まで

	2016年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)	普通株式 4,409,000株
付与日	2017年4月27日
権利確定条件	2019年4月27日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

## (2) スtockオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況 ストックオプション(新株予約権)の数

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定前(株)		
期首	1,689,600	174,900
付与	0	0
失効	194,700	66,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,494,900	108,900
権利確定後(株)		

期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定前(株)		
期首	2,890,800	4,404,000
付与	0	0
失効	204,600	786,000
権利確定	0	0
権利未確定残	2,686,200	3,618,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2016年度ストックオプション(2)
付与日	2017年4月27日
権利確定前(株)	
期首	-
付与	4,409,000
失効	532,000
権利確定	0
権利未確定残	3,877,000
権利確定後(株)	
期首	-
権利確定	-
権利行使	-
失効	-
権利未行使残	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

#### 単価情報

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利行使価格(円)	625	625
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利行使価格(円)	737(注)3	558
付与日における公正な評価単価(円)(注)1	0	0

	2016年度ストックオプション(2)
付与日	2017年4月27日
権利行使価格(円)	553
付与日における公正な評価単価(円)(注)1	0

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値(取引事例比準法等による評価額と行使価格との差額)の見積りによっております。
- 2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額  
当事業年度末における本源的価値の合計額 1,149百万円
- 3 株式公開価格が737円(割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するように調整される。)を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定条件	2012年1月22日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	同左
権利行使期間	2012年1月22日から 2020年1月21日まで	同左

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 186名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 16名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)	普通株式 6,101,700株	普通株式 4,437,000株
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日

権利確定条件	2013年10月7日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2018年7月15日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2013年10月7日から 2021年10月6日まで	2018年7月15日から 2026年7月31日まで

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 36名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)	普通株式 4,409,000株	普通株式 4,422,000株
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定条件	2019年4月27日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2020年4月27日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

## (2) スtockオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況 ストックオプション(新株予約権)の数

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定前(株)		
期首	1,494,900	108,900
付与	0	0
失効	323,400	33,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,171,500	75,900
権利確定後(株)		
期首	-	-

権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定前(株)		
期首	2,686,200	3,618,000
付与	0	0
失効	630,300	0
権利確定	0	0
権利未確定残	2,055,900	3,618,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定前(株)		
期首	3,877,000	-
付与	0	4,422,000
失効	66,000	66,000
権利確定	0	0
権利未確定残	3,811,000	4,356,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

#### 単価情報

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利行使価格(円)	625	625
付与日における公正な評価単価(円) (注)1	0	0

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
--	--------------------	--------------------

付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利行使価格(円)	737(注)3	558
付与日における公正な評価単価(円)(注)1	0	0

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利行使価格(円)	553	694
付与日における公正な評価単価(円)(注)1	0	0

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値(取引事例比準法等による評価額と行使価格との差額)の見積りによっております。
- 2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額  
当事業年度末における本源的価値の合計額 2,128百万円
- 3 株式公開価格が737円(割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するように調整される。)を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

## (税効果会計関係)

第59期 (2018年3月31日)		第60期 (2019年3月31日)	
1	繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 の主な原因別の内訳 (単位:百万円)	1	繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 の主な原因別の内訳 (単位:百万円)
	繰延税金資産		繰延税金資産
	賞与引当金 700		賞与引当金 820
	投資有価証券評価損 96		投資有価証券評価損 96
	関係会社株式評価損 1,430		関係会社株式評価損 1,430
	退職給付引当金 402		退職給付引当金 430
	固定資産減価償却費 111		固定資産減価償却費 103
	その他 526		その他 761
	繰延税金資産小計 3,268		繰延税金資産小計 3,643
	評価性引当金 1,430		評価性引当金 1,430
	繰延税金資産合計 1,838		繰延税金資産合計 2,212
	繰延税金負債		繰延税金負債
	その他有価証券評価差額金 180		その他有価証券評価差額金 217
	繰延ヘッジ利益 152		繰延ヘッジ利益 81
	繰延税金負債合計 333		繰延税金負債合計 299
	繰延税金資産の純額 1,504		繰延税金資産の純額 1,913



<p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <p>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。</p>	<p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 70%;">法定実効税率 (調整)</td> <td style="text-align: right;">30.6%</td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない 項目</td> <td style="text-align: right;">0.8%</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に参入されない 項目</td> <td style="text-align: right;">4.4%</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">0.6%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right;">27.6%</td> </tr> </table>	法定実効税率 (調整)	30.6%	交際費等永久に損金に算入されない 項目	0.8%	受取配当金等永久に益金に参入されない 項目	4.4%	その他	0.6%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.6%
法定実効税率 (調整)	30.6%										
交際費等永久に損金に算入されない 項目	0.8%										
受取配当金等永久に益金に参入されない 項目	4.4%										
その他	0.6%										
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.6%										

## ( 関連当事者情報 )

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	342,369 (SGD 千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	資金の貸付	資金の貸付 (シンガポールドル 貸建) (注1)	159 (SGD 2,000 千) (注2)	関係会社 短期 貸付金	550 (SGD 6,800 千)
							貸付金利息 (シンガポールドル 貸建) (注1)	13 (SGD 162 千)	未収収益	8 (SGD 110 千)
							資金の貸付 (円貸建) (注3)	-	関係会社 短期 貸付金	577
							貸付金利息 (円貸建) (注3)	12	未収収益	3
							増資の引受 (注4)	2,466 (SGD 30,369 千)	-	-
子会社	日本インステイテューショナル証券設立準備株式会社	日本	100 (百万円)	金融商品取引業者として登録を受けるための準備会社	直接 100.00	-	増資の引受 (注5)	100	-	-

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 資金の貸付に係る取引金額159百万円(SGD2,000千)の内訳は、貸付159百万円(SGD2,000千)であります。

- 3 融資枠5,000百万円、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 4 Nikko Asset Management International Limitedの行った30,369,000株の新株発行増資を、1株につき1シンガポールドルで当社が引受けたものであります。
- 5 日本インスティテューショナル証券設立準備株式会社の行った2,000株の新株発行を、1株につき50千円で当社が引受けたものであります。

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社(非上場)

### (2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2017年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	27,012百万円
負債合計	5,141百万円
純資産合計	21,871百万円

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

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

### 1 関連当事者との取引

#### (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

##### (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

##### (イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	342,369 (SGD 千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	資金の貸付	資金の貸付の返済 (シンガポールドル貨建) (注1)	554 (SGD 6,800 千) (注2)	-	-
							貸付金利息 (シンガポールドル貨建) (注1)	8 (SGD 104 千)	-	-
							資金の貸付 (米国ドル貨建) (注3)	1,807 (USD 16,500 千) (注4)	関係会社 短期貸付金	1,830 (USD 16,500 千)

							貸付金利息 (米国ドル 貨建) (注3)	17 (USD 209千)	未収収益	17 (USD 209千)
							資金の貸付 (円貨建) (注3)	-	関係会社 短期 貸付金	577
							貸付金利息 (円貨建) (注3)	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千) (注5)	アセット マネジメ ント業	直接 100.00	-	配当の受取	1,021 (USD 9,000千)	-	-
子会社	Nikko Asset Management Americas, Inc.	米国	181,542 (USD千) (注5)	アセット マネジメ ント業	間接 100.00	資金の 借入	資金の借入 (米国ドル 貨建) (注6)	5,364 (USD 50,000千) (注7)	-	-
							資金の借入 の返済 (米国ドル 貨建) (注6)	5,526 (USD 50,000千) (注7)	-	-
							借入金利息 (米国ドル 貨建) (注6)	65 (USD 593千)	-	-

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 2 取引金額554百万円 (SGD6,800千) の内訳は、貸付の返済554百万円 (SGD6,800千) であります。
- 3 融資枠5,000百万円 (若しくは5,000百万円相当額の外国通貨)、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 4 取引金額1,807百万円 (USD16,500千) の内訳は、貸付1,807百万円 (USD16,500千) であります。
- 5 Nikko AM Americas Holding Co., Inc.及びNikko Asset Management Americas, Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。
- 6 借入枠USD50,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 7 取引金額5,364百万円 (USD50,000千) 及び5,526百万円 (USD50,000千) の内訳は、借入5,364百万円 (USD50,000千) 及び借入の返済5,526百万円 (USD50,000千) であります。

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2018年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場場で円貨に換算したものであります。

資産合計 26,768百万円  
負債合計 5,586百万円

純資産合計	21,181百万円
営業収益	14,075百万円
税引前当期純利益	3,894百万円
当期純利益	2,730百万円

## (セグメント情報等)

### セグメント情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

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

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

### 関連情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

#### 1 製品及びサービスごとの情報

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

#### 2 地域ごとの情報

##### (1) 営業収益

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

##### (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

#### 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

#### 1 製品及びサービスごとの情報

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

#### 2 地域ごとの情報

##### (1) 営業収益

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

##### (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

#### 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

### 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	319円40銭	355円59銭
1株当たり当期純利益金額	35円64銭	45円08銭

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当期純利益(百万円)	6,979	8,823
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(百万円)	6,979	8,823
普通株式の期中平均株式数(千株)	195,794	195,677
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2009年度ストックオプション(1) 1,494,900株、2009年度ストックオプション(2) 108,900株、2011年度ストックオプション(1) 2,686,200株、2016年度ストックオプション(1) 3,618,000株、2016年度ストックオプション(2) 3,877,000株	2009年度ストックオプション(1) 1,171,500株、2009年度ストックオプション(2) 75,900株、2011年度ストックオプション(1) 2,055,900株、2016年度ストックオプション(1) 3,618,000株、2016年度ストックオプション(2) 3,811,000株、2017年度ストックオプション(1) 4,356,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第59期 (2018年3月31日)	第60期 (2019年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	62,511	69,571

純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	-	-
普通株式に係る期末の純資産額（百万円）	62,511	69,571
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数（千株）	195,711	195,647

#### （重要な後発事象）

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

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

#### 第2【その他の関係法人の概況】

##### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

###### （1）受託会社

名 称	資本金の額 （2019年3月末現在）	事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

###### （2）販売会社

名 称	資本金の額 (2019年3月末現在)	事業の内容	
エース証券株式会社	8,831百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。	
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円		
株式会社 S B I 証券	48,323百万円		
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円		
東洋証券株式会社 1	13,494百万円		
野村證券株式会社 1	10,000百万円		
八十二証券株式会社	3,000百万円		
フィデリティ証券株式会社	9,257百万円		
松井証券株式会社	11,945百万円		
マネックス証券株式会社	12,200百万円		
楽天証券株式会社	7,495百万円		
株式会社秋田銀行 1	14,100百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。	
株式会社イオン銀行	51,250百万円		
オーストラリア・アンド・ニュージージーランド・バンキング・グループ・リミテッド(銀行) 1	26,048百万豪ドル		
株式会社香川銀行	12,014百万円		
株式会社佐賀共栄銀行	2,679百万円		
株式会社滋賀銀行	33,076百万円		
株式会社四国銀行	25,000百万円		
株式会社新生銀行	512,204百万円		
スルガ銀行株式会社	30,043百万円		
株式会社第三銀行	37,461百万円		
株式会社東和銀行	38,653百万円		
株式会社鳥取銀行	9,061百万円		
株式会社富山銀行 1	6,730百万円		
株式会社八十二銀行	52,243百万円		
株式会社百十四銀行	37,322百万円		
株式会社南日本銀行	16,601百万円		
株式会社武蔵野銀行	45,743百万円		
株式会社琉球銀行	56,967百万円		
株式会社 S M B C 信託銀行	87,550百万円		銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
みずほ信託銀行株式会社	247,369百万円		
農林中央金庫	4,040,198百万円	全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。	

岩手県信用農業協同組合連合会	19,463百万円
埼玉県信用農業協同組合連合会	139,440百万円
東京都信用農業協同組合連合会	78,204百万円
神奈川県信用農業協同組合連合会	194,885百万円
長野県信用農業協同組合連合会	54,858百万円
新潟県信用農業協同組合連合会	56,296百万円
石川県信用農業協同組合連合会	17,468百万円
岐阜県信用農業協同組合連合会	70,118百万円
静岡県信用農業協同組合連合会	111,302百万円
愛知県信用農業協同組合連合会	198,402百万円
三重県信用農業協同組合連合会	39,124百万円
滋賀県信用農業協同組合連合会	34,697百万円
大阪府信用農業協同組合連合会	140,690百万円
兵庫県信用農業協同組合連合会	170,546百万円
和歌山県信用農業協同組合連合会	51,799百万円
山口県信用農業協同組合連合会	35,542百万円
徳島県信用農業協同組合連合会	32,546百万円
高知県信用農業協同組合連合会	19,870百万円
福岡県信用農業協同組合連合会	32,382百万円
きたそらち農業協同組合	3,396百万円
岩手中央農業協同組合	4,441百万円
岩手江刺農業協同組合	2,370百万円
仙台農業協同組合	3,434百万円
みやぎ亙理農業協同組合	1,554百万円
みやぎ登米農業協同組合	6,459百万円
新みやぎ農業協同組合	2,941百万円
いしのまき農業協同組合	4,497百万円
みやぎ仙南農業協同組合	4,041百万円
秋田しんせい農業協同組合	5,632百万円
山形農業協同組合	4,080百万円
さがえ西村山農業協同組合	3,757百万円
山形おきたま農業協同組合	4,965百万円
鶴岡市農業協同組合	1,488百万円
庄内たがわ農業協同組合	4,381百万円
ふくしま未来農業協同組合	15,932百万円
茨城みなみ農業協同組合	1,215百万円
北つくば農業協同組合	3,382百万円
はが野農業協同組合	3,648百万円
那須南農業協同組合	1,157百万円
高崎市農業協同組合	2,001百万円
佐波伊勢崎農業協同組合	2,545百万円
さいたま農業協同組合	8,181百万円



あさか野農業協同組合	871百万円
いるま野農業協同組合	5,963百万円
埼玉中央農業協同組合	2,335百万円
くまがや農業協同組合	2,768百万円
ほくさい農業協同組合	3,181百万円
越谷市農業協同組合	1,568百万円
南彩農業協同組合	2,847百万円
埼玉みずほ農業協同組合	1,437百万円
さいかつ農業協同組合	1,864百万円
ふかや農業協同組合	1,613百万円
横浜農業協同組合	12,402百万円
セレサ川崎農業協同組合	2,516百万円
よこすか葉山農業協同組合	1,454百万円
さがみ農業協同組合	5,363百万円
湘南農業協同組合	1,998百万円
伊勢原市農業協同組合	1,446百万円
秦野市農業協同組合	1,775百万円
かながわ西湘農業協同組合	2,531百万円
厚木市農業協同組合	2,589百万円
相模原市農業協同組合	881百万円
神奈川つくい農業協同組合	850百万円
佐久浅間農業協同組合	6,627百万円
信州うえだ農業協同組合	4,273百万円
信州諏訪農業協同組合	6,454百万円
上伊那農業協同組合	8,124百万円
みなみ信州農業協同組合	4,519百万円
松本ハイランド農業協同組合	6,213百万円
塩尻市農業協同組合	1,568百万円
大北農業協同組合	3,263百万円
グリーン長野農業協同組合	3,699百万円
中野市農業協同組合	2,504百万円
ながの農業協同組合	12,921百万円
北越後農業協同組合	3,088百万円
新潟みらい農業協同組合	4,830百万円
越後中央農業協同組合	5,313百万円
にいがた南蒲農業協同組合	4,950百万円
越後ながおか農業協同組合	5,506百万円
十日町農業協同組合	2,815百万円
ひすい農業協同組合	1,264百万円
にいがた岩船農業協同組合	2,498百万円
佐渡農業協同組合	2,505百万円
加賀農業協同組合	1,966百万円
小松市農業協同組合	1,744百万円

農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでおります。

能美農業協同組合	1,249百万円
金沢中央農業協同組合	1,058百万円
金沢市農業協同組合	3,158百万円
はくい農業協同組合	1,340百万円
能登わかば農業協同組合	2,667百万円
おおぞら農業協同組合	1,217百万円
ぎふ農業協同組合	7,218百万円
西美濃農業協同組合	4,658百万円
いび川農業協同組合	2,073百万円
めぐみの農業協同組合	4,704百万円
陶都信用農業協同組合	1,607百万円
東美濃農業協同組合	2,624百万円
飛騨農業協同組合	6,368百万円
伊豆太陽農業協同組合	1,818百万円
三島函南農業協同組合	1,049百万円
伊豆の国農業協同組合	913百万円
あいら伊豆農業協同組合	915百万円
南駿農業協同組合	3,158百万円
御殿場農業協同組合	1,234百万円
富士市農業協同組合	1,492百万円
富士宮農業協同組合	945百万円
清水農業協同組合	2,981百万円
静岡市農業協同組合	1,902百万円
大井川農業協同組合	3,433百万円
ハイナン農業協同組合	857百万円
掛川市農業協同組合	746百万円
遠州夢咲農業協同組合	3,579百万円
遠州中央農業協同組合	3,301百万円
とびあ浜松農業協同組合	3,715百万円
三ヶ日町農業協同組合	297百万円
なごや農業協同組合	2,454百万円
尾張中央農業協同組合	2,118百万円
西春日井農業協同組合	157百万円
あいち尾東農業協同組合	1,192百万円
愛知北農業協同組合	747百万円
愛知西農業協同組合	1,617百万円
あいち知多農業協同組合	7,183百万円
あいち中央農業協同組合	3,468百万円
西三河農業協同組合	1,301百万円
あいち三河農業協同組合	1,114百万円
あいち豊田農業協同組合	1,809百万円
愛知東農業協同組合	971百万円

蒲郡市農業協同組合	296百万円
豊橋農業協同組合	2,515百万円
鈴鹿農業協同組合	1,628百万円
津安芸農業協同組合	2,189百万円
伊勢農業協同組合	4,367百万円
伊賀ふるさと農業協同組合	2,846百万円
甲賀農業協同組合	2,478百万円
北大阪農業協同組合	1,887百万円
茨木市農業協同組合	1,237百万円
大阪泉州農業協同組合	2,009百万円
いずみの農業協同組合	2,884百万円
堺市農業協同組合	1,187百万円
大阪南農業協同組合	3,822百万円
グリーン大阪農業協同組合	1,507百万円
大阪中河内農業協同組合	4,263百万円
北河内農業協同組合	2,635百万円
大阪市農業協同組合	1,919百万円
兵庫南農業協同組合	3,763百万円
みのり農業協同組合	4,439百万円
兵庫西農業協同組合	12,416百万円
たじま農業協同組合	4,526百万円
丹波ひかみ農業協同組合	2,286百万円
淡路日の出農業協同組合	1,879百万円
奈良県農業協同組合	9,389百万円
わかやま農業協同組合	4,466百万円
ながみね農業協同組合	2,006百万円
紀の里農業協同組合	3,586百万円
紀北川上農業協同組合	4,269百万円
ありだ農業協同組合	2,098百万円
紀州農業協同組合	3,667百万円
紀南農業協同組合	4,717百万円
みくまの農業協同組合	1,002百万円
鳥取いなば農業協同組合	6,061百万円
鳥取中央農業協同組合	3,875百万円
鳥取西部農業協同組合	5,133百万円
島根県農業協同組合	22,681百万円
広島市農業協同組合	6,724百万円
広島中央農業協同組合	3,067百万円
山口県農業協同組合	2,362百万円
徳島市農業協同組合	3,026百万円
香川県農業協同組合	26,469百万円
越智今治農業協同組合	6,417百万円

高知市農業協同組合	4,109百万円	
高知県農業協同組合	1,565百万円	
福岡八女農業協同組合	3,556百万円	
宮崎中央農業協同組合	5,828百万円	
延岡農業協同組合	1,469百万円	
沖縄県農業協同組合	22,037百万円	
労働金庫連合会	120,000百万円 (出資の総額)	労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

1 募集の取扱いを行いません。

## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

### (2) 販売会社

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

## 3【資本関係】

### (1) 受託会社

該当事項はありません。

### (2) 販売会社

該当事項はありません。

## 第3【その他】

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

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

委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日

ファンドの基本的性格など

委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など

委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など

目論見書の使用開始日

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

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

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。

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

「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。

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

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

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

「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

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

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。

有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。

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

載。

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

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

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

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

## 独立監査人の監査報告書

2019年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第60期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の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、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2019年7月17日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

## P w Cあらた有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の2018年12月18日から2019年6月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の2019年6月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。