【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年10月17日提出
【計算期間】	第3期(自 2018年7月18日至 2019年7月17日)
【ファンド名】	時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１６－１１
【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
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目７番１号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

① ファンドの目的

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

② ファンドの基本的性格

１）商品分類

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

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

◇年１回

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

◇グローバル（含む日本）

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

◇ファンド・オブ・ファンズ

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

◇為替ヘッジあり（部分ヘッジ）

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。
上記以外の商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）をご参照ください。

③　ファンドの特色

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

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

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

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

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

*2 その他の資産については、低リスク資産による安定的な運用を行ないます。

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

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

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

繰上償還について

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

※基準価額や1万口当たり償還価額が13,000円以上になることを保証するものではありません。
※安定運用への移行後も、繰上償還するまでは、基準価額は市況動向などの影響を受けるため、基準価額や償還価額が13,000円を下回ることがあります。

※市況動向および資金動向などにより、上記のような運用が行なえない場合があります。

資産分散について

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

投資対象資産と期待される収益・効果

※投資対象資産は今後、追加・変更される可能性があります。
※各資産への投資は、投資信託証券を通じて行ないます。

（2016年9月末現在）

投資タイミングの分散について

■資産価格は市況動向などにより変動するため、投資タイミングを分散する「エントリー分散」により、投資資産の短期的な価格変動の影響を小さくすることをめざします。

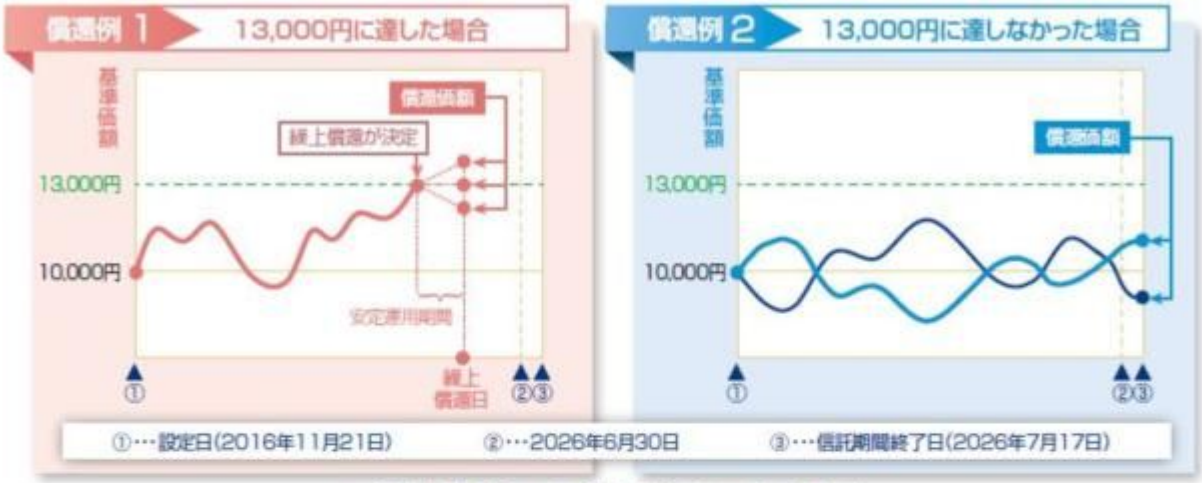
■当ファンドでは、世界の資産への分散投資を、設定当初に純資産総額の25%程度から開始し、約3ヵ月ごとに25%程度ずつ段階的に引き上げることで、投資タイミングの分散を図ります。

「エントリー分散」の仕組み

※「エントリー分散」の仕組みは、「安定指向」「成長指向」とも同様です。なお、世界の資産への分散投資における資産配分比率は、「安定指向」と「成長指向」で異なります。
※低リスク資産は、内外のソブリン債を投資対象とし、外貨建資産については為替ヘッジを行なうことで為替変動リスクの低減を図ります。ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。また、為替ヘッジを行なうことに伴ない、為替ヘッジコストがかかります。
※上記は「エントリー分散」の仕組みについて説明するためのイメージ図です。
※市況動向および資金動向などにより、上記のような運用が行なえない場合があります。

繰上償還について

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



※上記は繰上償還について説明するためのイメージ図です。

※13,000円の基準価額水準は、あくまで安定運用に切り替えるための水準であり、基準価額が13,000円以上となることを示唆あるいは保証するものではありません。

※基準価額が13,000円以上となった場合には、安定運用に移行します。安定運用への移行後も繰上償還するまでは、基準価額は市況動向などの影響を受けるため、基準価額や1万口当たり償還価額が13,000円を下回ることがあります。

資産配分の決定プロセス

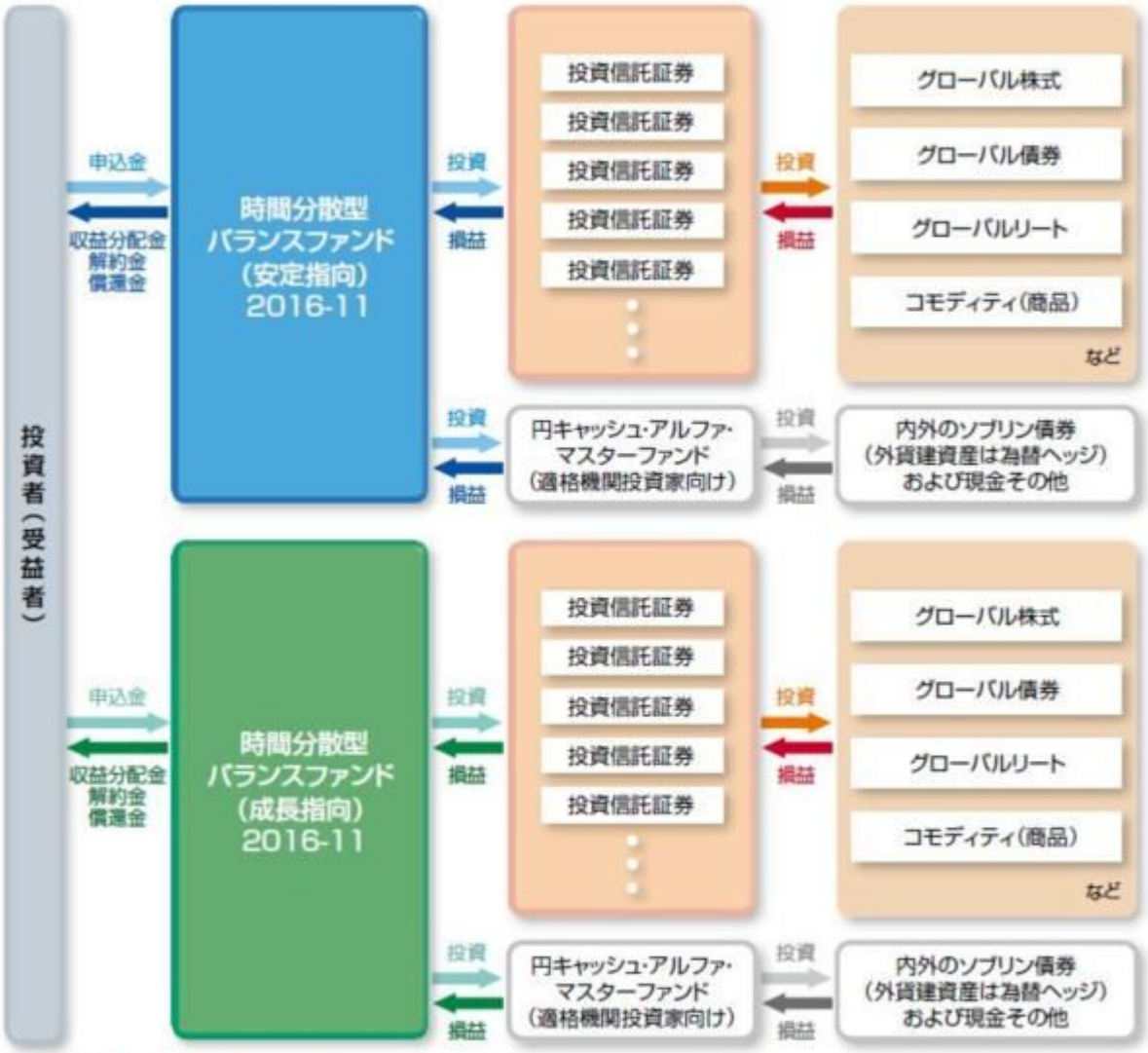
■当ファンドにおいて、世界の資産への分散投資における資産配分比率の決定および変更は、年金運用などで豊富な運用ノウハウを持つ三井住友信託銀行株式会社からの投資助言に基づき行ないます。

※各資産への投資は、投資信託証券を通じて行ない、各投資信託証券は、追加・変更される場合があります。

※上記は、2016年9月末現在のものであり、将来変更される場合があります。

ファンドの仕組み

■当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



※投資先投資信託証券は適宜見直しを行ないます。
※投資先投資信託証券の詳細については、後述の追加的記載事項をご覧ください。

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

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

追加的記載事項

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

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

（有価証券報告書提出日現在）

④　信託金限度額

・1兆円を限度として信託金を追加することができます。

・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

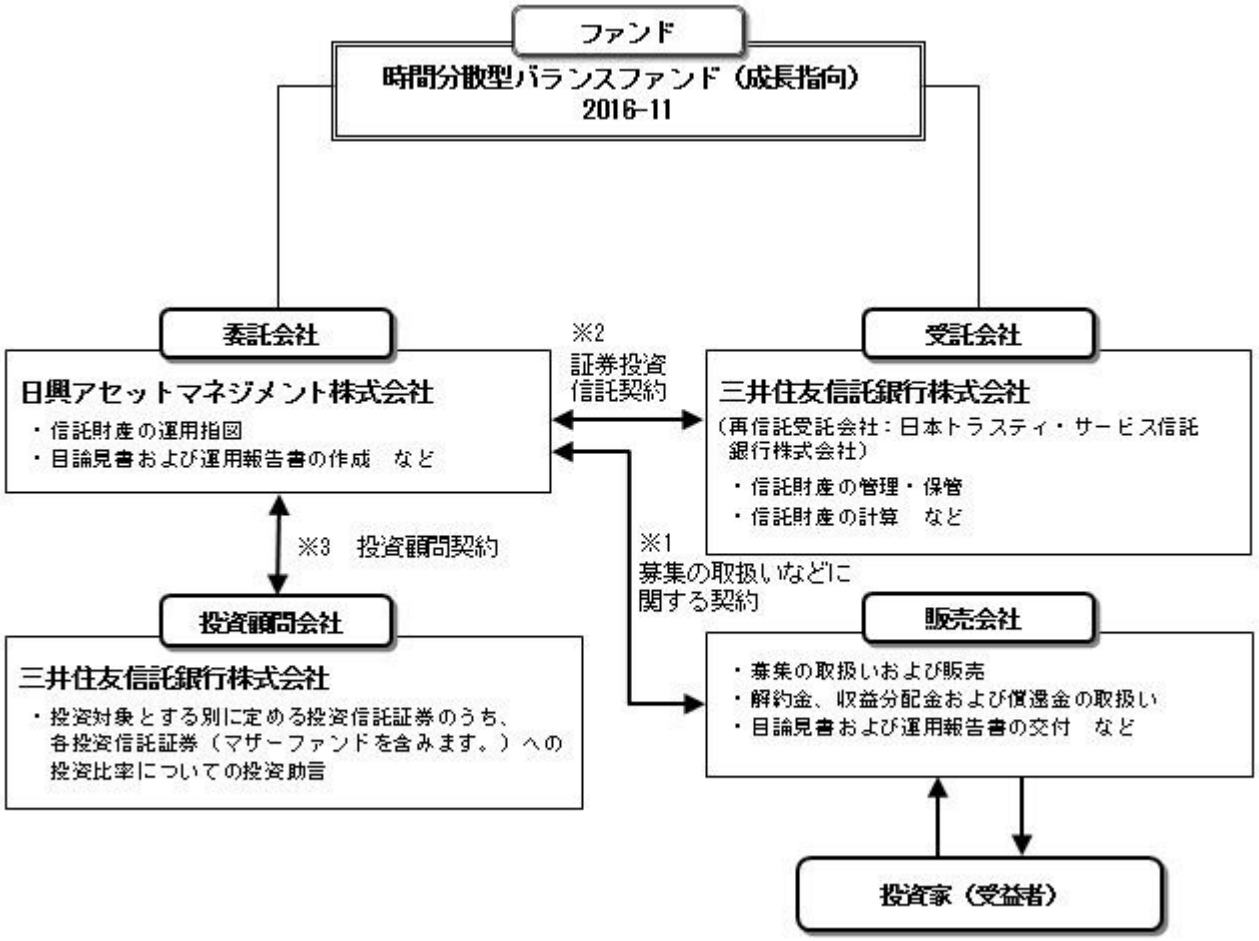
（２）【ファンドの沿革】

2016年11月21日

・ファンドの信託契約締結、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】

①　ファンドの仕組み



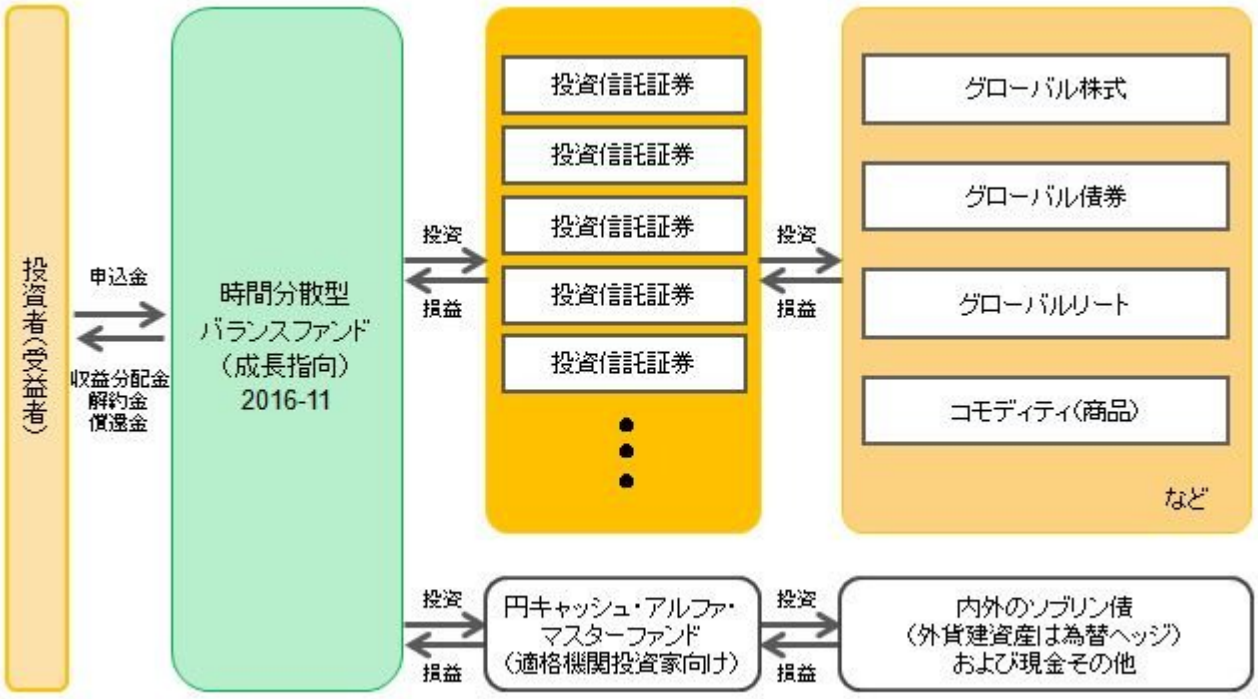
※1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したもの。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。

※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。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

※3 投資顧問会社から株式、債券などの有価証券に対する投資判断についての助言（有価証券の種類、銘柄、数量、売買時期の判断など）を受けるルールを委託会社と投資顧問会社との間で規定したもの。投資助言を受ける対象資産、助言の内容、報酬の取決めの内容などが含まれています。

＜ファンド・オブ・ファンズの仕組み＞

当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



※投資先投資信託証券は適宜見直しを行ないます。
※投資先投資信託証券の詳細については、前述の追加的記載事項をご覧ください。

② 委託会社の概況（2019年7月末現在）

1）資本金

17,363百万円

2）沿革

1959年：日興證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
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目４番１号	179,869,100株	91.29%
DBS Bank Ltd.	6 Shenton Way, #46-00, DBS Building Tower One, Singapore 068809	14,283,400株	7.24%

2【投資方針】

（1）【投資方針】

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

当初設定時からの約３ヵ月間において、以下の投資比率を目指します。

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

2017年２月下旬以降の約３ヵ月間において、以下の投資比率を目指します。

別に定める投資信託証券への投資比率の合計　…　50%
円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）…　50%
2017年５月下旬以降の約３ヵ月間において、以下の投資比率を目指します。
別に定める投資信託証券への投資比率の合計　…　75%
円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）…　25%
2017年８月下旬以降の信託期間中において、以下の投資比率を目指します。
別に定める投資信託証券への投資比率の合計　… 100%
円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）…　０%

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

（２）【投資対象】

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

①　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

②　主として、別に定めるマザーファンドの受益証券および別に定めるマザーファンドを除く投資信託証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
１）追加型証券投資信託 円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け） 受益証券
２）短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第１号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
３）外国または外国の者の発行する証券または証書で、２）の証券の性質を有するもの
４）指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

③　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

④　次の取引ができます。
１）外国為替予約取引
２）資金の借入

◆投資対象とする投資信託証券の概要
＜インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ＞

運用の基本方針

	基本方針	わが国の長期成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）＊の動きに連動する投資成果をめざします。
	主な投資対象	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。
	投資方針	・投資成果をＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の動きにできるだけ連動させるため、「バーラ日本株式モデル」に従い次のポートフォリオ管理を行ないます。 ①東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とし、分散投資を行ないます。 ②資金の流出入に伴なう売買にあたっては、最適ポートフォリオと信託財産のポートフォリオのカイ離を縮小するように売買を行ないます。 ③株式の組入比率は、高位を保ちます。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	ありません。
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
	受託会社	三井住友信託銀行株式会社
	信託期間	無期限（2001年10月26日設定）
	決算日	毎年２月12日（休業日の場合は翌営業日）

＊ＴＯＰＩＸ（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。
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。

＜ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド＞

運用の基本方針		
	基本方針	内外の公社債に投資を行ない、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
	主な投資対象	内外のソブリン債券（国債、州政府債、政府保証債、政府機関債、国際機関債などをいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
	投資方針	・原則として、日本および世界の高格付け国の中から、為替ヘッジコスト考慮後の利回りや信用力などを勘案して複数国を選定し、当該国通貨建てのソブリン債券に分散投資するとともに、外貨建て資産については為替ヘッジを行なうことにより、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざします。 ・ポートフォリオの構築にあたっては、為替ヘッジコスト考慮後の利回りの水準や方向性、信用力、流動性などの分析を行ない、組入国やその配分比率、および組入銘柄を決定します。なお、金利動向などによっては、組入債券の一部売却や先物取引などの活用により、実質的な債券組入比率を調整することがあります。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。 ・投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の５%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	ありません。
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
	受託会社	三井住友信託銀行株式会社
	信託期間	無期限（2011年２月28日設定）
	決算日	毎年２月10日（休業日の場合は翌営業日）

＜インデックス マザーファンド Ｊリート＞

運用の基本方針		
	基本方針	わが国の金融商品取引所に上場する不動産投信（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。）の投資信託証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）に投資を行ない、別に定める日本の不動産投資信託証券市場の動きをとらえる指数（東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）（有価証券届出書提出日現在）以下同じ。）に連動する投資成果を目標として運用を行ないます。
	主な投資対象	わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
	投資方針	・主として、わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、別に定める日本の不動産投資信託証券市場の動きをとらえる指数に連動する投資成果を目標として運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し委託会社の判断により決定するものとします。 ・運用にあたって、運用目的を達成するために有用であると判断される場合は、有価証券指数等先物取引（別に定める日本の不動産投資信託証券市場の動きをとらえる指数を対象とする先物取引とします。）を活用したり、対象指数に採用されていない不動産投資信託証券について投資を行なうことがあります。また、対象指数に採用されている不動産投資信託証券の一部または全部の値動きに連動を目指す上場投資信託証券や債券等に投資する場合もあります。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の５％以下とします。 ・外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	ありません。
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		

	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
	受託会社	三井住友信託銀行株式会社
	信託期間	無期限（2015年３月17日設定）
	決算日	毎年６月15日（休業日の場合は翌営業日）

＜インデックス マザーファンド 海外先進国債券＞

運用の基本方針		
	基本方針	日本を除く先進国の債券に投資を行ない、別に定める日本を除く先進国債券市場を代表する指数（FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）（有価証券届出書提出日現在）以下同じ。）に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
	主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
	投資方針	・主として日本を除く先進国の債券に投資を行ない、別に定める日本を除く先進国債券市場を代表する指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し委託会社の判断により決定するものとします。 ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。 ・投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の５%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（１口当たり）
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		

	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
	受託会社	三井住友信託銀行株式会社
	信託期間	無期限（2016年８月22日設定）
	決算日	毎年７月17日（休業日の場合は翌営業日）

＜先進国資本エマージング株式マザーファンド＞

運用の基本方針		
	基本方針	主として、世界の金融商品取引所上場株式に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
	主な投資対象	世界の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
	投資方針	・主として、世界の金融商品取引所に上場されており、先進国企業が資本参加している新興国企業の株式（預託証券を含みます。以下同じ。）に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。 ・株式の銘柄選定にあたっては、各企業の成長性、収益性、流動性等を勘案して行ないます。 ・株式の組入比率は、高位を維持することを基本とします。なお、ファンドの状況等によっては、上場投資信託証券等に投資する場合があります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の５％以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	ありません。
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		

	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
	受託会社	三井住友信託銀行株式会社
	投資顧問会社	日興アセットマネジメント アジア リミテッド（投資助言）
	信託期間	無期限（2016年 6月30日設定）
	決算日	毎年 6月21日（休業日の場合は翌営業日）

＜インデックス マザーファンド コモディティ＞

運用の基本方針		
	基本方針	コモディティに関連する上場投資信託証券に投資し、別に定める商品市場を代表する指数（ブルームバーグ・コモディティ・インデックス・トータルリターン（円換算ベース）（有価証券届出書提出日現在）以下同じ。）に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
	主な投資対象	コモディティに関連する上場投資信託証券を主要投資対象とします。
	投資方針	・主として、日本または海外の金融商品取引所に上場されている投資信託証券であって、コモディティ商品指数への連動を目指す投資信託証券に投資し、別に定める商品市場を代表する指数に連動する投資成果を目標として運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し委託会社の判断により決定するものとします。 ・また、ファンドの状況に応じて、コモディティに関連する上場投資信託証券以外の有価証券に投資を行なう場合があります。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。 ・投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の５%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	ありません。
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		

委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2016年8月22日設定）
決算日	毎年７月17日（休業日の場合は翌営業日）

＜インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）＞

運用の基本方針	
基本方針	別に定める日本を除く先進国株式市場を代表する指数（MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）（有価証券届出書提出日現在）以下同じ。）に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
投資方針	・主として、海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド受益証券に投資を行ない、別に定める日本を除く先進国株式市場を代表する指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し、委託会社の判断により決定するものとします。 ・マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の５％以下とします。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。

ファンドに係る費用	
信託報酬	純資産総額に対し年率0.099%（税抜0.09%）
その他報酬	・有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額 ・投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限ります。他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）
申込手数料	ファンドで買い付ける場合はありません。
信託財産留保額	ありません。

	その他の費用など	・運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用、「別に定める日本を除く先進国株式市場を代表する指数」その他これに類する標章の使用料などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。 ・組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税などについては、その都度、信託財産から支払われます。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
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（2016年8月23日設定）
	決算日	毎月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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）*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	・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。 ・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。 ・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。
	主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。

	信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（１口当たり）
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
	受託会社	野村信託銀行株式会社
	信託期間	無期限（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なわずに円換算したものです。
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

＜インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）＞

運用の基本方針		
	基本方針	別に定める日本を除く先進国リート市場を代表する指数（Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）（有価証券届出書提出日現在）以下同じ。）に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
	主な投資対象	海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	投資方針	・主として、海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド受益証券に投資を行ない、別に定める日本を除く先進国リート市場を代表する指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し、委託者の判断により決定するものとします。 ・マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の５％以下とします。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	純資産総額に対し年率0.099%（税抜0.09%）

	その他報酬	・有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額 ・投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限ります。他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）
	申込手数料	ファンドで買い付ける場合はありません。
	信託財産留保額	ありません。
	その他の費用など	・運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用、「別に定める日本を除く先進国リート市場を代表する指数」その他これに類する標章の使用料などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。 ・組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税などについては、その都度、信託財産から支払われます。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
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（2016年8月23日設定）
	決算日	毎月15日（休業日の場合は翌営業日）

（ご参考）＜海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド＞

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）＊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	・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＆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。 ・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。 ・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。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	・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。 ・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。 ・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（１口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（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 サービシーズ 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なわずに円換算したものです。
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はＳ＆Ｐ社に帰属します。また、Ｓ＆Ｐ社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

＜インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）＞

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

	主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。 ・投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の５%以下とします。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	純資産総額に対し年率0.099%（税抜0.09%）
	その他報酬	・有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額 ・投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限ります。他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）
	申込手数料	ファンドで買い付ける場合はありません。
	信託財産留保額	ありません。
	その他の費用など	・運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用、「別に定める新興国債券市場を代表する指数」その他これに類する標章の使用料などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。 ・組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税などについては、その都度、信託財産から支払われます。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
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（2016年8月23日設定）
	決算日	毎月16日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

	投資方針	・主として、新興国の現地通貨建債券に投資し、ＪＰモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ グローバル・ディバーシファイド（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。なお、新興国の現地通貨建債券の騰落率に償還価額などが連動する債券を活用することもあります。 ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式（新株引受権証券、新株予約権証券および新株引受権付社債券を含みます。）への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（１口当たり）
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
	受託会社	野村信託銀行株式会社
	信託期間	無期限（2008年３月31日設定）
	決算日	毎年５月16日（休業日の場合は翌営業日）

＊ＪＰモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ グローバル・ディバーシファイドは、ＪＰモルガンが発表している、エマージング・カントリーの債券市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（円ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行なわずに円換算したものです。
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はJPMorgan Chase & Co.に帰属します。また、JPMorgan Chase & Co.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

＜円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）＞

運用の基本方針		
	基本方針	インカム収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行ないます。

主な投資対象	ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
投資方針	・主として、ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド受益証券に投資を行ない、インカム収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行ないます。 ・マザーファンド受益証券の組入比率は、この信託の純資産総額に対して50%以上となることを原則とし、金利動向等に応じて機動的に変更できるものとします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。 ・投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の５%以下とします。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。
ファンドに係る費用	
信託報酬	純資産総額に対し年率0.088%（税抜0.08%）
その他報酬	・有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額 ・投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限ります。他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）
申込手数料	ファンドで買い付ける場合はありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	・運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。 ・組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税などについては、その都度、信託財産から支払われます。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

	信託期間	無期限（2016年８月22日設定）
	決算日	毎年８月10日（休業日の場合は翌営業日）

＜ＦＯＦｓ用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）＞

運用の基本方針		
	基本方針	信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
	主な投資対象	ゴールド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	投資方針	・主として、ゴールド・マザーファンド受益証券に投資を行ない、信託財産の成長を目指して運用を行ないます。 ・マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 ・実質外貨建資産については、為替変動リスクの低減を図るため、原則として対円での為替ヘッジを行ないます。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。 ・投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の５%以下とします。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	純資産総額に対し年率0.143%（税抜0.13%）
	その他報酬	・有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額 ・投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限ります。他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）
	申込手数料	ファンドで買い付ける場合はありません。
	信託財産留保額	ありません。

	その他の費用など	・運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。 ・組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税などについては、その都度、信託財産から支払われます。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
	受託会社	三井住友信託銀行株式会社
	信託期間	2027年７月８日まで（2017年９月29日設定）
	決算日	毎年７月８日（休業日の場合は翌営業日）

（ご参考）＜ゴールド・マザーファンド＞

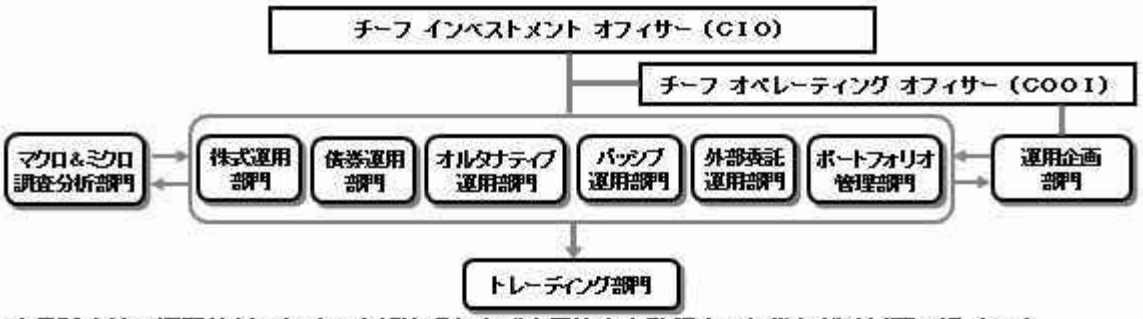
運用の基本方針		
	基本方針	主に金地金価格への連動をめざす上場投資信託証券に投資を行ない、信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
	主な投資対象	金地金価格への連動をめざす上場投資信託証券を主要投資対象とします。
	投資方針	・主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場されている投資信託証券であって、金地金価格への連動をめざす投資信託証券に投資を行ない、信託財産の成長をめざして運用を行ないます。なお、ファンドの状況や投資環境に応じて、金地金価格への連動をめざすために、金先物価格への連動をめざす上場投資信託証券や上場投資信託証券以外の有価証券に投資を行なう場合があります。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。 ・投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の５%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	ありません。

	その他の費用など	**組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。**
その他		
	委託会社	**日興アセットマネジメント株式会社**
	受託会社	**三井住友信託銀行株式会社**
	信託期間	**無期限（2013年３月25日設定）**
	決算日	**毎年３月８日（休業日の場合は翌営業日）**

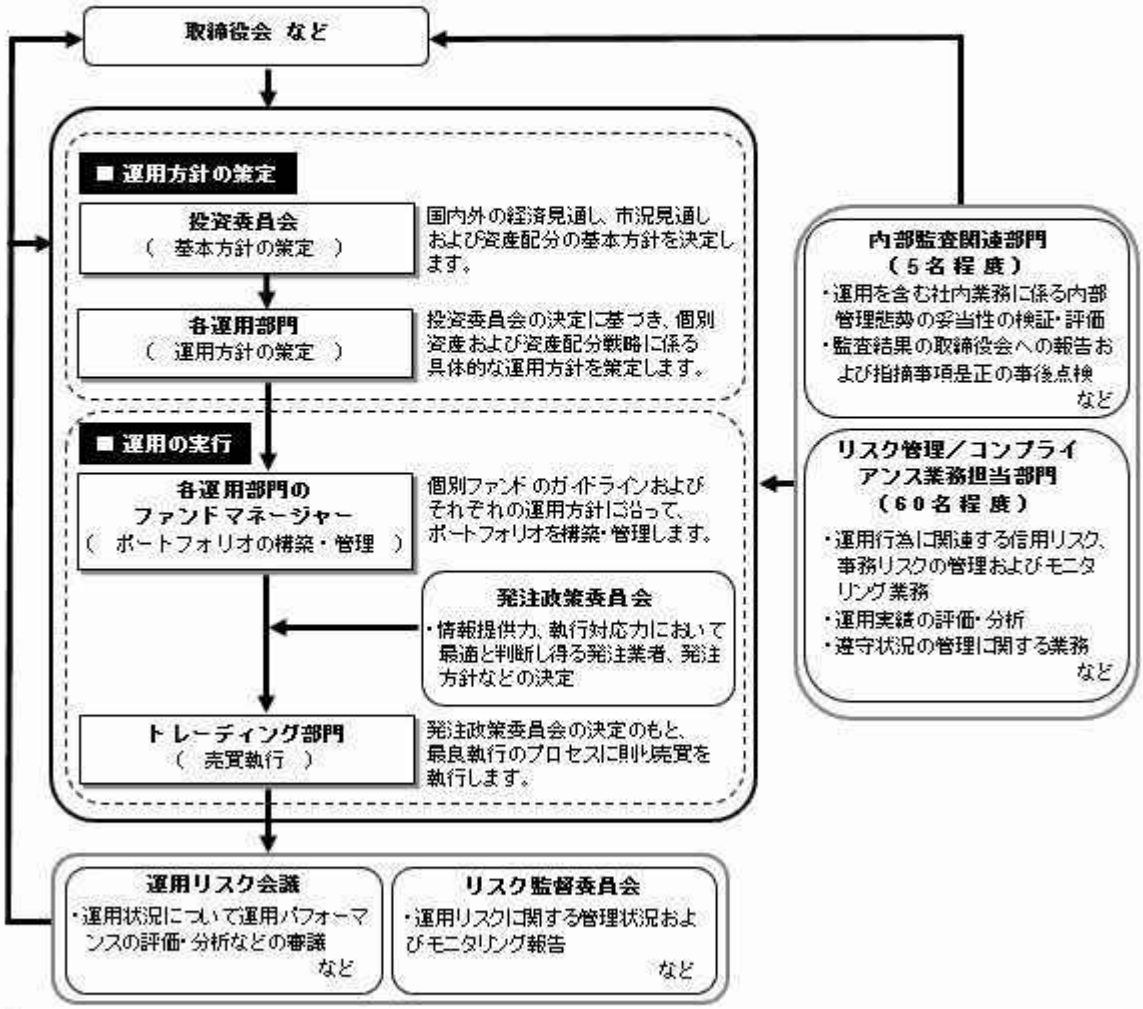
（３）【運用体制】

＜日興アセットマネジメント株式会社（委託会社）における運用体制＞

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

「投資顧問会社」については、投資顧問会社の管理体制およびリスク管理状況のモニタリングをリスク管理業務担当部門にて行ないます。また、外部委託運用部門では外部委託ファンドの運用管理を行ない、投資方針に沿った運用が行なわれているかなどのモニタリングを行なっています。

※上記体制は2019年7月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（4）【分配方針】

①　収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

1）分配対象額の範囲

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

2）分配対象額についての分配方針

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

3）留保益の運用方針

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

② 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】

① 約款に定める投資制限

１）投資信託証券、短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第１号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。

２）有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。

３）投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

４）外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

５）信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴なう支払資金の手当て（解約に伴な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）解約に伴なう支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内

ロ）再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内

ハ）借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の範囲内

ニ）解約に伴なう支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とします。

ホ）再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。

６）一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

3【投資リスク】

（１）ファンドのリスク

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

・投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者（受益者）の皆様に帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。

・当ファンドは、主に債券、株式、不動産投信およびコモディティ連動証券を実質的な投資対象としま

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

投資対象とする投資信託証券の主なリスクは以下の通りです。

①　価格変動リスク

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

②　流動性リスク

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

③　信用リスク

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

・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

④　為替変動リスク

・一部の資産を除き、原則として、為替ヘッジを行なわないため、外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。

・一部の資産において、為替ヘッジを行なうにあたっては、円の金利が為替ヘッジを行なう通貨の金利より低い場合、この金利差に相当するヘッジコストが発生します。為替および金利の動向によっては、為替ヘッジに伴なうヘッジコストが予想以上に発生する場合があります。

・一般に新興国の通貨は、先進国の通貨に比べて為替変動が大きくなる場合があります。

⑤　カントリー・リスク

・投資対象国における非常事態など（金融危機、財政上の理由による国自体のデフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）を含む市況動向や資金動向などによっては、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあり、投資方針に従った運用ができない場合があります。

・一般に新興国は、情報の開示などが先進国に比べて充分でない、あるいは正確な情報の入手が遅延する場合があります。

・ファンドの投資対象資産が上場または取引されている諸国の税制は各国によって異なります。また、それらの諸国における税制が一方的に変更されたり、新たな税制が適用されたりすることもあります。以上のような要因は、ファンドの信託財産の価値に影響を与える可能性があります。

⑥　有価証券の貸付などにおけるリスク

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

＜繰上償還に関する事項＞

・１万口当たり基準価額が13,000円以上となった場合には、信託約款の規定に基づき、繰上償還します（償還価額が13,000円以上であることを保証するものではありません。）。

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

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

＜その他の留意事項＞

・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

・投資対象とする投資信託証券に関する事項

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

◇ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴な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なう基準価額変動に関する事項
一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。

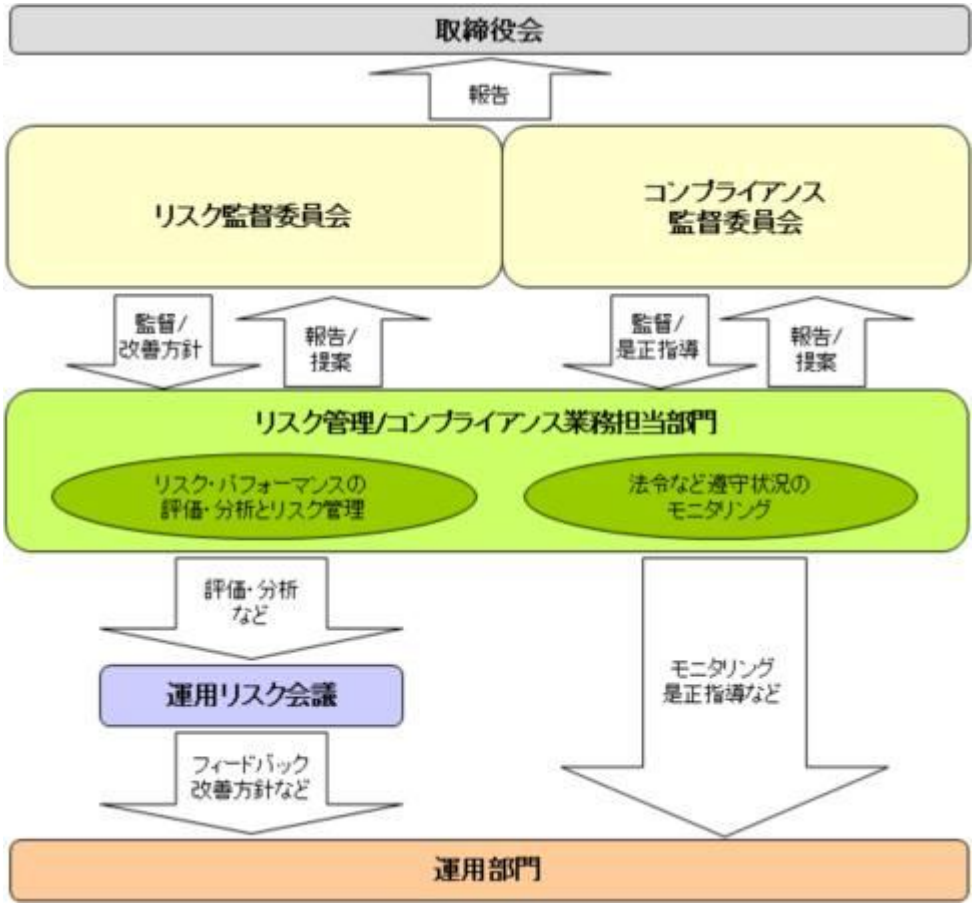
・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。

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

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

（2）リスク管理体制

＜日興アセットマネジメント株式会社（委託会社）におけるリスク管理体制＞



■全社的リスク管理

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7月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

本書提出日現在、取得申込みの受付は行なっておりません。

（2）【換金（解約）手数料】

① 換金手数料
ありません。

② 信託財産留保額
ありません。

（3）【信託報酬等】

① 信託報酬

信託報酬率（年率）＜純資産総額に対し＞	
当ファンド	0.913%（税抜0.83%）
投資対象とする投資信託証券	0.099%（税抜0.09%）以内＊1
実質的負担	1.012%（税抜0.92%）以内＊2

・当ファンドの信託報酬は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.913%（税抜0.83%）の率を乗じて得た額とします。

・投資対象とする投資信託証券の組入れに係る信託報酬率（年率）0.099%（税抜0.09%）以内＊1がかかり、受益者が実質的に負担する信託報酬率（年率）は1.012%（税抜0.92%）以内＊2となります。

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

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

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

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

② 信託報酬の配分

当ファンドの信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

合　計	委託会社	販売会社	受託会社
0.83%	0.40%	0.40%	0.03%

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

※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。
※投資顧問会社が受ける報酬は、上記委託会社が受ける信託報酬の中から支払います。

③　支払時期

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

（４）【その他の手数料等】

以下の諸費用およびそれに付随する消費税等相当額について、委託会社は、その支払いをファンドのために行ない、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、支払金額の支弁を信託財産から受けることができます。（以下「実費方式」といいます。）なお、①から⑦までに該当する業務を委託する場合は、その委託費用を含みます。また、実際に支払う金額の支弁を受ける代わりに、その金額をあらかじめ合理的に見積もった上で、見積額に基づいて見積率を算出し、かかる見積率を信託財産の純資産総額に乗じて得た額をかかる諸費用の合計額とみなして、信託財産から支弁を受けることができます。（以下「見積方式」といいます。）ただし、委託会社は、信託財産の規模などを考慮して、信託の設定時または期中に、かかる諸費用の見積率を見直し、年率0.1%を上限として、これを変更することができます。委託会社は、実費方式または見積方式のいずれを用いるかについて、信託期間を通じて随時、見直すことができます。これら諸費用は、委託会社が定めた時期に、信託財産から支払います。

①　ファンドの計理業務（設定解約処理、約定処理、基準価額算出、決算処理等）およびこれに付随する業務（法定帳簿管理、法定報告等）に係る費用。
②　振替受益権に係る費用ならびにやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合における発行および管理事務に係る費用。
③　有価証券届出書、有価証券報告書、半期報告書および臨時報告書（これらの訂正に係る書類を含みます。）の作成、印刷および提出に係る費用。
④　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。）。
⑤　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。）。
⑥　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。）。
⑦　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。
⑧　格付の取得に要する費用。
⑨　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。
⑩　別に定める投資信託証券の１つである「インデックス マザーファンド Ｊリート」の運用の基本方針に規定する「別に定める日本の不動産投資信託証券市場の動きをとらえる指数」その他これに類する標章の使用料。

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

①　組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料。
②　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

約に伴な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。

③ 投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合に限り、その対価としての品貸料（マザーファンド（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限ります。）における品貸料については、他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）に0.55（税抜0.5）を乗じて得た貸付有価証券関連報酬。委託会社と受託会社の配分は４：１とし、信託報酬と同時期に支払います。

＜投資対象とする投資信託証券に係る費用＞

「円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）」
「ＦＯＦｓ用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）」
・運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。
・組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税などについては、その都度、信託財産から支払われます。
※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

「インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け)」
「インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け)」
「インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け)」
・運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用、「各信託約款に定めるベンチマーク指数」その他これに類する標章の使用料などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。
・組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税などについては、その都度、信託財産から支払われます。
※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

「インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ」
「ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド」
「インデックス マザーファンド Ｊリート」
「インデックス マザーファンド 海外先進国債券」
「先進国資本エマージング株式マザーファンド」
「インデックス マザーファンド コモディティ」
・組入有価証券の売買時の売買委託手数料
・信託事務の処理に要する諸費用
・信託財産に関する租税　など

※監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。
＊売買委託手数料などは、保有期間や運用の状況などに応じて異なり、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。

① 個人受益者の場合

１）収益分配金に対する課税

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

２）解約金および償還金に対する課税

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

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

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

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

②　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。

③　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。

④　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

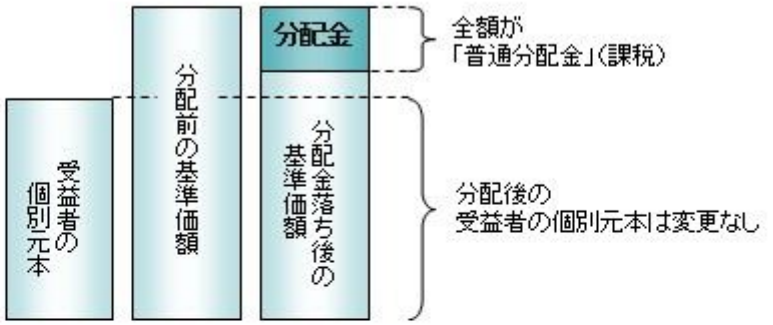
イ）収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の１口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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。

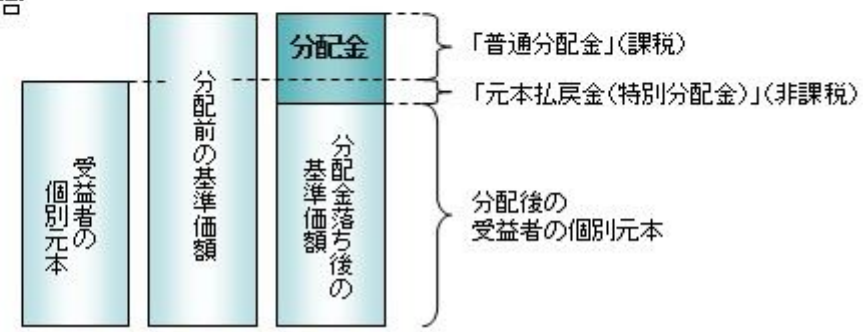
ハ）収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

＜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10月17日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１６－１１】

以下の運用状況は2019年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（1）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	日本	75,559,236	31.92
親投資信託受益証券	日本	154,119,119	65.10
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	7,051,986	2.98
合計（純資産総額）		236,730,341	100.00

（2）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	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	インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ	27,881,999	1.9535	54,467,485	1.9509	54,394,991	22.98
日本	投資信託受益証券	インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）	30,863,757	1.4588	45,024,048	1.4608	45,085,776	19.05
日本	親投資信託受益証券	ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド	27,091,349	1.3523	36,635,632	1.3669	37,031,164	15.64
日本	親投資信託受益証券	インデックス　マザーファンド　海外先進国債券	26,215,920	1.1028	28,910,917	1.1081	29,049,860	12.27
日本	親投資信託受益証券	インデックス　マザーファンド　Ｊリート	17,951,845	1.2971	23,285,339	1.3004	23,344,579	9.86
日本	投資信託受益証券	インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）	15,450,739	1.1989	18,523,890	1.1946	18,457,452	7.80
日本	投資信託受益証券	ＦＯＦｓ用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	8,379,113	1.0302	8,632,162	1.049	8,789,689	3.71
日本	親投資信託受益証券	先進国資本エマージング株式マザーファンド	6,380,998	1.2004	7,659,749	1.1838	7,553,825	3.19
日本	投資信託受益証券	インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）	2,781,550	1.1579	3,220,756	1.1599	3,226,319	1.36
日本	親投資信託受益証券	インデックス　マザーファンド　コモディティ	3,014,498	0.9263	2,792,329	0.9105	2,744,700	1.16

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	31.92
親投資信託受益証券	65.10
合　　計	97.02

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末　(2017年 7月18日)	1,096	1,096	1.0239	1.0239
第2計算期間末　(2018年 7月17日)	326	326	1.0797	1.0797
第3計算期間末　(2019年 7月17日)	239	239	1.0906	1.0906
2018年 7月末日	312	—	1.0726	—
8月末日	311	—	1.0746	—
9月末日	293	—	1.0937	—
10月末日	278	—	1.0429	—

11月末日	282	—	1.0605	—
12月末日	259	—	1.0046	—
2019年 1月末日	256	—	1.0414	—
2月末日	259	—	1.0653	—
3月末日	245	—	1.0764	—
4月末日	241	—	1.0869	—
5月末日	233	—	1.0534	—
6月末日	236	—	1.0770	—
7月末日	236	—	1.0926	—

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2016年11月21日～2017年 7月18日	0.0000
第2期	2017年 7月19日～2018年 7月17日	0.0000
第3期	2018年 7月18日～2019年 7月17日	0.0000

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第1期	2016年11月21日～2017年 7月18日	2.39
第2期	2017年 7月19日～2018年 7月17日	5.45
第3期	2018年 7月18日～2019年 7月17日	1.01

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2016年11月21日～2017年 7月18日	1,316,815,991	246,262,241
第2期	2017年 7月19日～2018年 7月17日	0	767,718,692
第3期	2018年 7月18日～2019年 7月17日	0	83,230,998

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

（参考）

インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）

以下の運用状況は2019年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	197,642,598	99.00
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	1,994,494	1.00
合計（純資産総額）		199,637,092	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジなし）マザーファンド	76,095,406	2.6012	197,939,371	2.5973	197,642,598	99.00

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.00
合　　計	99.00

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2019年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
出資金	アメリカ	15,108,009	0.01
株式	アメリカ	91,938,153,240	63.25
	カナダ	5,339,214,403	3.67

	モーリシャス	3,194,178	0.00
	ドイツ	4,417,812,857	3.04
	イタリア	974,616,357	0.67
	フランス	5,208,502,154	3.58
	オランダ	2,492,202,993	1.71
	スペイン	1,508,921,016	1.04
	ベルギー	530,747,639	0.37
	オーストリア	123,507,803	0.08
	ルクセンブルク	171,218,991	0.12
	フィンランド	593,014,164	0.41
	アイルランド	2,701,158,334	1.86
	ポルトガル	69,155,977	0.05
	イギリス	8,356,875,709	5.75
	スイス	5,283,473,596	3.63
	スウェーデン	1,208,520,014	0.83
	ノルウェー	330,643,342	0.23
	デンマーク	857,928,712	0.59
	ケイマン	328,344,968	0.23
	オーストラリア	3,386,213,661	2.33
	バミューダ	296,894,699	0.20
	ニュージーランド	132,947,144	0.09
	香港	1,560,859,717	1.07
	シンガポール	654,809,857	0.45
	イスラエル	296,353,797	0.20
	ジャージー	415,402,118	0.29
	英ヴァージン諸島	22,927,244	0.02
	アラブ首長国連邦	12,191,177	0.01
	マン島	12,906,009	0.01
	小計	139,228,711,870	95.78
投資証券	アメリカ	3,138,643,425	2.16
	カナダ	24,227,030	0.02
	フランス	147,464,663	0.10
	イギリス	82,897,208	0.06
	オーストラリア	291,780,847	0.20
	香港	87,131,970	0.06
	シンガポール	62,591,415	0.04
	小計	3,834,736,558	2.64
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	2,278,524,644	1.57
合計（純資産総額）		145,357,081,081	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	2,127,165,768	1.46
	買建	ドイツ	498,951,349	0.34

(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	—	2,038,289,500	1.40

(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	250,024	12,341.82	3,085,751,924	15,247.62	3,812,271,943	2.62
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	161,762	22,929.00	3,709,042,178	22,681.85	3,669,062,908	2.52
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	14,325	195,152.39	2,795,558,056	206,256.29	2,954,621,486	2.03
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	81,880	17,384.69	1,423,458,446	21,406.42	1,752,758,128	1.21
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	10,802	120,233.61	1,298,763,511	133,099.20	1,437,737,662	0.99
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	112,160	11,567.65	1,297,428,198	12,557.69	1,408,471,363	0.97
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	10,290	121,004.08	1,245,132,051	133,409.92	1,372,788,077	0.94
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	91,241	15,004.51	1,369,026,951	14,349.17	1,309,232,729	0.90
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	105,163	9,652.45	1,015,080,915	11,537.01	1,213,266,814	0.83
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	145,471	8,433.21	1,226,788,044	8,186.02	1,190,829,097	0.82
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	60,092	16,024.80	962,962,294	19,721.41	1,185,099,523	0.82
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	85,669	10,243.68	877,565,920	13,081.34	1,120,665,522	0.77
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	314,199	2,958.79	929,649,646	3,355.88	1,054,417,156	0.73
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	44,780	22,179.40	993,193,901	22,576.47	1,010,974,703	0.70
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	61,692	12,713.81	784,340,687	15,745.19	971,352,582	0.67
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェア・サービス	31,350	23,661.92	741,801,288	30,219.30	947,375,130	0.65
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	250,187	3,325.99	832,121,041	3,713.31	929,023,190	0.64

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	151,150	5,180.37	783,014,085	6,134.90	927,290,256	0.64
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	38,800	20,131.41	781,098,794	23,613.99	916,222,828	0.63
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	32,950	28,154.29	927,684,002	27,695.59	912,569,862	0.63
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	65,261	12,455.44	812,854,538	13,508.29	881,565,010	0.61
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	141,457	6,158.22	871,123,432	6,152.28	870,283,525	0.60
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	154,472	4,965.50	767,031,363	5,616.68	867,621,029	0.60
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	139,022	5,173.55	719,237,997	5,836.14	811,351,966	0.56
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	190,620	4,701.39	896,179,597	4,214.14	803,300,434	0.55
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	88,673	7,943.45	704,370,423	9,046.45	802,176,109	0.55
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	147,910	5,504.88	814,227,314	5,274.47	780,147,153	0.54
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	155,174	4,087.71	634,307,443	4,788.85	743,105,196	0.51
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	74,493	8,590.93	639,964,642	9,956.90	741,719,367	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	24,138	26,924.55	649,904,880	29,221.09	705,338,888	0.49

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	5.72
		素材	4.35
		資本財	6.87
		商業・専門サービス	1.26
		運輸	1.95
		自動車・自動車部品	1.06
		耐久消費財・アパレル	1.86
		消費者サービス	1.94
		メディア・娯楽	6.00
		小売	4.77
		食品・生活必需品小売り	1.48
		食品・飲料・タバコ	4.93
		家庭用品・パーソナル用品	2.14
		ヘルスケア機器・サービス	4.84

		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.64
		銀行	7.72
		各種金融	4.27
		保険	3.85
		不動産	0.52
		ソフトウェア・サービス	9.61
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.27
		電気通信サービス	2.31
		公益事業	3.40
		半導体・半導体製造装置	3.04
投資証券	—	—	2.64
合　　計			98.43

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 EMINI1909	買建	130	米ドル	19,552,112.5	2,124,141,502	19,579,950	2,127,165,768	1.46
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1909	買建	130	ユーロ	4,150,780	503,033,028	4,117,100	498,951,349	0.34

(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	15,500,000.00	1,677,309,590	1,680,770,500	1.16
	ユーロ	買建	2,950,000.00	358,044,700	357,519,000	0.25

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）

以下の運用状況は2019年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	92,637,014	99.08
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	857,507	0.92

合計（純資産総額）	93,494,521	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
日本	親投資信託受益証券	海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド	42,652,523	2.1774	92,871,604	2.1719	92,637,014	99.08

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.08
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

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 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	アメリカ	29,129,327,389	71.35
	カナダ	787,074,031	1.93
	ドイツ	110,607,835	0.27
	イタリア	9,827,624	0.02
	フランス	1,495,247,836	3.66
	オランダ	106,511,593	0.26
	スペイン	283,237,222	0.69
	ベルギー	406,376,490	1.00
	アイルランド	105,833,018	0.26
	イギリス	1,831,153,690	4.49

	オーストラリア	2,861,382,362	7.01
	ニュージーランド	111,378,209	0.27
	香港	938,152,963	2.30
	シンガポール	1,568,862,907	3.84
	韓国	5,344,625	0.01
	イスラエル	31,976,896	0.08
	ガーンジー	67,407,159	0.17
	マン島	12,437,759	0.03
	小計	39,862,139,608	97.63
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	965,641,995	2.37
合計（純資産総額）		40,827,781,603	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	—	567,084,200	1.39

(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	186,953	8,752.59	1,636,324,504	8,909.56	1,665,670,167	4.08
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	91,616	17,630.44	1,615,231,148	17,405.21	1,594,596,122	3.91
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	44,511	26,421.26	1,176,037,137	26,410.38	1,175,552,602	2.88
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	120,112	9,005.66	1,081,688,163	9,120.32	1,095,460,837	2.68
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	109,833	8,492.27	932,732,488	8,641.22	949,091,731	2.32
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	41,352	22,586.60	934,001,117	22,907.83	947,284,603	2.32
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	109,582	7,343.70	804,738,242	7,354.92	805,967,720	1.97
香港	投資証券	LINK REIT	625,800	1,332.77	834,051,160	1,281.35	801,870,395	1.96
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	61,734	12,961.23	800,148,778	12,384.96	764,573,121	1.87
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	93,425	7,827.77	731,310,346	7,606.97	710,681,434	1.74
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	45,805	14,535.96	665,820,041	14,450.20	661,891,704	1.62
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	19,503	32,520.96	634,256,304	33,317.71	649,795,400	1.59
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	40,802	16,220.76	661,839,752	15,179.04	619,335,496	1.52
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	33,489	16,130.63	540,198,817	16,080.89	538,533,019	1.32
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	475,855	1,107.66	527,086,930	1,109.89	528,151,084	1.29
アメリカ	投資証券	HCP INC	141,867	3,499.28	496,432,913	3,503.64	497,050,896	1.22
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	50,661	9,228.32	467,516,385	9,385.40	475,474,236	1.16
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	1,580,245	284.72	449,936,717	295.37	466,767,079	1.14

アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	37,802	11,776.37	445,170,624	12,156.81	459,551,958	1.13
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	33,863	12,868.92	435,780,334	12,952.06	438,595,635	1.07
アメリカ	投資証券	UDR INC	83,667	5,020.63	420,061,725	5,062.62	423,574,562	1.04
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	219,382	1,976.90	433,698,433	1,920.75	421,379,117	1.03
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORPORATION	106,532	3,482.34	370,981,456	3,658.99	389,800,077	0.95
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	26,795	14,141.25	378,914,795	14,498.00	388,474,124	0.95
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	124,638	2,975.44	370,854,087	3,015.84	375,889,064	0.92
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	49,617	7,424.22	368,367,772	7,271.27	360,778,862	0.88
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	51,466	7,138.73	367,402,039	7,008.36	360,692,585	0.88
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	26,738	13,465.26	360,034,387	13,453.97	359,732,453	0.88
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	321,174	966.82	310,520,492	1,032.26	331,538,072	0.81
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	28,676	11,555.73	331,372,284	11,525.61	330,508,610	0.81

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.63
合　　計	97.63

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	4,000,000.00	434,393,200	434,520,000	1.06
	ユーロ	買建	700,000.00	84,825,300	84,833,000	0.21
	豪ドル	買建	640,000.00	47,764,992	47,731,200	0.12

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）

以下の運用状況は2019年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	19,571,971	99.00
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	197,781	1.00
合計（純資産総額）		19,769,752	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
日本	親投資信託受益証券	海外新興国債券インデックスＬｏｃａｌ（ヘッジなし）マザーファンド	14,654,067	1.3344	19,554,388	1.3356	19,571,971	99.00

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.00
合　　計	99.00

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外新興国債券インデックスＬｏｃａｌ（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2019年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アルゼンチン	15,877,923	0.31
	メキシコ	505,362,896	9.84
	ブラジル	516,938,500	10.07
	チリ	166,778,503	3.25
	コロンビア	325,458,421	6.34
	ペルー	177,417,441	3.46
	ウルグアイ	7,944,872	0.15
	ドミニカ共和国	17,217,818	0.34
	トルコ	200,684,344	3.91
	チェコ	211,770,389	4.12
	ハンガリー	215,088,537	4.19

	ポーランド	437,643,264	8.52
	ロシア	399,794,704	7.79
	ルーマニア	120,357,019	2.34
	マレーシア	297,942,321	5.80
	タイ	444,355,963	8.65
	フィリピン	10,767,762	0.21
	インドネシア	507,200,420	9.88
	南アフリカ	427,866,432	8.33
	小計	5,006,467,529	97.51
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	127,881,464	2.49
合計（純資産総額）		5,134,348,993	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	—	7,575,540	0.15

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	3,250,000	3,074.63	99,925,486	3,176.02	103,220,754	10.000	2023/1/1	2.01
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,650,000	853.23	73,804,691	855.02	73,959,232	10.500	2026/12/21	1.44
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	2,280,000	3,000.50	68,411,445	3,032.07	69,131,385	10.000	2021/1/1	1.35
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	2,010,000	3,087.42	62,057,334	3,264.40	65,614,609	10.000	2025/1/1	1.28
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	1,790,000	3,123.11	55,903,692	3,330.92	59,623,578	10.000	2027/1/1	1.16
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,700,000	697.08	60,646,510	679.54	59,120,155	8.750	2048/2/28	1.15
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	1,585,000,000	3.44	54,585,652	3.47	55,074,266	7.000	2022/5/4	1.07
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,610,000	625.62	53,866,575	637.95	54,928,277	10.000	2024/12/5	1.07
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	2,180,000	2,366.85	51,597,442	2,495.22	54,395,796	—	2022/1/1	1.06
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,230,000	553.28	51,067,866	571.10	52,712,878	7.500	2027/6/3	1.03
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	1,580,000,000	3.20	50,707,638	3.31	52,317,544	6.000	2028/4/28	1.02
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	1,305,000,000	3.88	50,741,924	3.97	51,863,588	10.000	2024/7/24	1.01
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	1,950,000	2,482.80	48,414,639	2,578.87	50,288,050	—	2021/7/1	0.98

コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	1,360,000,000	3.51	47,863,552	3.64	49,538,320	7.500	2026/8/26	0.96
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,700,000	555.36	48,316,559	561.59	48,858,632	6.500	2021/6/10	0.95
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,500,000	549.08	46,672,329	558.43	47,467,066	6.500	2022/6/9	0.92
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	1,630,000	2,819.16	45,952,321	2,902.16	47,305,216	2.500	2026/7/25	0.92
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	1,950,000	2,265.97	44,186,577	2,410.81	47,010,894	—	2022/7/1	0.92
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,530,000	711.10	46,435,170	714.26	46,641,765	8.000	2030/1/31	0.91
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	5,400,000,000	0.80	43,514,406	0.82	44,731,440	8.375	2024/3/15	0.87
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,530,000	573.68	43,198,494	584.85	44,039,341	8.000	2023/12/7	0.86
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	11,620,000	368.97	42,875,434	368.98	42,876,414	3.650	2021/12/17	0.84
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,000,000	395.87	39,587,091	425.07	42,507,872	3.775	2032/6/25	0.83
チリ	国債証券	BONOS TESORERIA PESOS	210,000,000	16.92	35,549,857	19.15	40,217,163	5.000	2035/3/1	0.78
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	4,800,000,000	0.78	37,644,672	0.83	39,873,600	8.375	2034/3/15	0.78
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	8,680,000	425.67	36,948,553	447.57	38,849,361	4.875	2029/6/22	0.76
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	1,260,000	2,815.47	35,475,000	2,958.11	37,272,282	2.750	2028/4/25	0.73
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,500,000	562.38	36,554,957	568.81	36,973,239	7.250	2021/12/9	0.72
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	1,270,000	2,788.75	35,417,237	2,902.72	36,864,599	2.500	2027/7/25	0.72
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	1,260,000	2,868.19	36,139,214	2,889.47	36,407,385	2.500	2023/1/25	0.71

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.51
合　　計	97.51

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	トルコリラ	買建	272,000.00	5,268,640	5,309,440	0.10
	ロシアルーブル	買建	1,333,000.00	2,280,896	2,266,100	0.04

(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。

ＦＯＦｓ用ゴールド・ファンド　為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

以下の運用状況は2019年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	3,465,323,178	100.09
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	△3,007,421	△0.09
合計（純資産総額）		3,462,315,757	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建	―	3,469,445,230	△100.21

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
日本	親投資信託受益証券	ゴールド・マザーファンド	3,498,559,494	0.9685	3,388,601,580	0.9905	3,465,323,178	100.09

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.09
合　　計	100.09

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	米ドル	売建	32,003,000.00	3,449,050,181	3,469,445,230	△100.21

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

ゴールド・マザーファンド

以下の運用状況は2019年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	アメリカ	116,894,258,176	100.04
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	△47,128,293	△0.04
合計（純資産総額）		116,847,129,883	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	―	96,028,022	0.08

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST-ETF	73,950,000	1,337.35	98,897,653,680	1,487.28	109,984,474,320	94.13
アメリカ	投資信託受益証券	SPDR GOLD TRUST-ETF	471,200	13,358.64	6,294,591,387	14,664.22	6,909,783,856	5.91

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	100.04
合　　計	100.04

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	883,991.74	96,000,000	96,028,022	0.08

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ

以下の運用状況は2019年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	38,427,541,360	99.79
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	80,263,671	0.21
合計（純資産総額）		38,507,805,031	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	78,300,000	0.20

(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	191,100	6,606.55	1,262,513,300	7,024.00	1,342,286,400	3.49
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	133,700	5,128.98	685,744,626	5,628.00	752,463,600	1.95
日本	株式	ソニー	電気機器	115,200	4,865.16	560,466,756	6,170.00	710,784,000	1.85
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	1,164,100	579.96	675,132,940	524.20	610,221,220	1.58
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	115,200	4,606.71	530,693,900	4,922.00	567,014,400	1.47
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	149,700	4,381.83	655,961,000	3,635.00	544,159,500	1.41
日本	株式	キーエンス	電気機器	8,400	62,018.33	520,954,000	63,130.00	530,292,000	1.38
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	119,200	3,929.14	468,354,400	3,807.00	453,794,400	1.18
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	117,400	2,967.55	348,391,000	3,718.00	436,493,200	1.13
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	138,100	2,672.16	369,025,777	2,853.50	394,068,350	1.02

日本	株式	任天堂	その他製品	9,800	29,345.35	287,584,500	40,100.00	392,980,000	1.02
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	144,600	2,947.85	426,259,900	2,710.50	391,938,300	1.02
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,297,600	173.14	397,806,830	154.40	354,749,440	0.92
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	60,500	5,350.64	323,714,100	5,797.00	350,718,500	0.91
日本	株式	三菱商事	卸売業	118,500	3,116.76	369,337,100	2,936.50	347,975,250	0.90
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	15,400	23,956.26	368,926,500	21,920.00	337,568,000	0.88
日本	株式	花王	化学	41,600	8,043.28	334,600,800	7,979.00	331,926,400	0.86
日本	株式	信越化学工業	化学	29,600	9,271.82	274,446,000	11,155.00	330,188,000	0.86
日本	株式	第一三共	医薬品	49,100	3,776.66	185,434,100	6,647.00	326,367,700	0.85
日本	株式	ファナック	電気機器	16,300	18,855.92	307,351,500	19,530.00	318,339,000	0.83
日本	株式	ダイキン工業	機械	23,400	11,837.75	277,003,500	13,585.00	317,889,000	0.83
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	30,500	10,165.93	310,061,000	10,005.00	305,152,500	0.79
日本	株式	日本電産	電気機器	20,600	13,324.00	274,474,500	14,715.00	303,129,000	0.79
日本	株式	日立製作所	電気機器	77,200	3,431.77	264,933,400	3,892.00	300,462,400	0.78
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	34,500	6,765.38	233,405,900	8,405.00	289,972,500	0.75
日本	株式	ＮＴＴドコモ	情報・通信業	106,700	2,562.32	273,399,650	2,615.00	279,020,500	0.72
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	19,300	11,982.69	231,266,000	14,440.00	278,692,000	0.72
日本	株式	資生堂	化学	34,100	6,930.79	236,340,000	8,046.00	274,368,600	0.71
日本	株式	キヤノン	電気機器	92,300	3,169.41	292,536,700	2,970.50	274,177,150	0.71
日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	70,800	4,824.68	341,588,000	3,728.00	263,942,400	0.69

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	2.76
		食料品	4.02
		繊維製品	0.63
		パルプ・紙	0.27
		化学	7.32
		医薬品	5.58
		石油・石炭製品	0.59
		ゴム製品	0.76
		ガラス・土石製品	0.84
		鉄鋼	0.85
		非鉄金属	0.75
		金属製品	0.58
		機械	5.04
		電気機器	13.84
		輸送用機器	7.73
		精密機器	2.14

		その他製品	2.19
		電気・ガス業	1.70
		陸運業	4.66
		海運業	0.17
		空運業	0.55
		倉庫・運輸関連業	0.20
		情報・通信業	9.02
		卸売業	4.93
		小売業	4.64
		銀行業	5.80
		証券、商品先物取引業	0.72
		保険業	2.38
		その他金融業	1.09
		不動産業	2.42
		サービス業	5.26
合　　計			99.79

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	5	日本円	77,123,700	78,300,000	0.20

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

ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド

以下の運用状況は2019年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	5,805,848,665	5.30
	フランス	9,222,466,350	8.42
	ベルギー	35,218,664,300	32.14
	イギリス	13,167,330,541	12.02
	スウェーデン	247,439,080	0.23
	小計	63,661,748,936	58.09
地方債証券	カナダ	6,103,804,190	5.57

特殊債券	アメリカ	1,131,080,590	1.03
	オーストリア	2,432,963,300	2.22
	スウェーデン	1,283,332,900	1.17
	国際機関	14,746,803,279	13.46
	小計	19,594,180,069	17.88
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	20,229,847,361	18.46
合計（純資産総額）		109,589,580,556	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	—	387,808,000	0.35
	売建	—	88,687,711,000	△80.93

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（%）	償還期限	投資比率（%）
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	87,000,000	13,017.77	11,325,459,998	13,305.57	11,575,847,022	0.900	2029/6/22	10.56
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	82,000,000	12,446.35	10,206,007,973	13,179.57	10,807,247,439	0.800	2028/6/22	9.86
イギリス	国債証券	UK TREASURY	53,490,000	13,957.26	7,465,741,000	14,366.67	7,684,732,437	1.625	2028/10/22	7.01
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	52,000,000	11,213.20	5,830,865,819	11,165.09	5,805,848,665	2.375	2029/5/15	5.30
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	28,000,000	17,520.82	4,905,831,310	18,183.35	5,091,340,721	5.500	2028/3/28	4.65
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	300,000,000	1,438.84	4,316,539,952	1,541.56	4,624,680,875	3.750	2032/6/1	4.22
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	32,500,000	12,338.75	4,010,094,994	13,195.88	4,288,661,722	0.750	2028/11/25	3.91
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	302,000,000	1,218.96	3,681,284,330	1,267.55	3,828,001,202	1.750	2026/11/12	3.49
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	25,000,000	13,258.79	3,314,697,987	13,453.62	3,363,406,975	1.000	2031/6/22	3.07
イギリス	国債証券	UK TREASURY	18,000,000	16,834.95	3,030,292,501	17,209.01	3,097,623,595	4.250	2027/12/7	2.83
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	18,500,000	14,494.09	2,681,408,463	15,519.63	2,871,133,377	2.500	2030/5/25	2.62
オーストリア	特殊債券	OEKB OEST. KONTROLLBANK	200,000,000	1,216.48	2,432,963,300	1,216.48	2,432,963,300	1.370	2028/11/13	2.22
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	16,000,000	12,474.17	1,995,867,446	13,147.18	2,103,550,093	0.800	2027/6/22	1.92
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	16,000,000	12,283.93	1,965,430,334	12,891.69	2,062,671,251	0.500	2029/5/25	1.88
イギリス	国債証券	UK TREASURY	10,000,000	19,135.81	1,913,581,892	19,672.76	1,967,276,790	6.000	2028/12/7	1.80
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	14,000,000	12,945.06	1,812,309,192	13,863.21	1,940,850,093	1.250	2033/4/22	1.77
国際機関	特殊債券	NORDIC INVESTMENT BANK	132,500,000	1,371.26	1,816,921,279	1,426.11	1,889,602,094	2.940	2031/10/17	1.72
カナダ	地方債証券	PROVINCE OF ALBERTA	15,000,000	11,008.29	1,651,244,021	11,619.60	1,742,940,798	3.300	2028/3/15	1.59
カナダ	地方債証券	PROVINCE OF ALBERTA	14,500,000	10,160.46	1,473,267,923	10,703.00	1,551,936,413	2.050	2026/8/17	1.42
カナダ	地方債証券	PROVINCE OF QUEBEC	12,500,000	10,535.90	1,316,988,400	11,065.15	1,383,144,049	2.500	2026/4/20	1.26

国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	10,000,000	12,819.53	1,281,953,940	13,334.82	1,333,482,946	1.000	2026/9/21	1.22
スウェーデン	特殊債券	KOMMUNINVEST I SVERIGE	110,000,000	1,140.67	1,254,742,500	1,166.66	1,283,332,900	0.625	2023/11/13	1.17
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	100,000,000	1,218.07	1,218,070,650	1,239.00	1,239,000,050	1.375	2028/5/12	1.13
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	100,000,000	1,196.51	1,196,517,000	1,217.34	1,217,345,044	1.250	2029/11/12	1.11
アメリカ	特殊債券	TENN VALLEY AUTHORITY	10,000,000	10,785.45	1,078,545,328	11,310.80	1,131,080,590	2.875	2027/2/1	1.03
カナダ	地方債証券	PROVINCE OF QUEBEC	4,500,000	15,094.08	679,233,739	15,687.04	705,917,152	7.500	2029/9/15	0.64
イギリス	国債証券	UK TREASURY	3,000,000	13,385.05	401,551,717	13,923.25	417,697,719	1.250	2027/7/22	0.38
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	2,300,000	12,072.40	277,665,257	14,627.04	336,421,957	1.600	2047/6/22	0.31
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	25,000,000	1,192.95	298,238,815	1,242.96	310,742,003	1.500	2027/3/2	0.28
カナダ	地方債証券	ONTARIO (PROVINCE OF)	2,500,000	10,494.11	262,352,982	11,036.59	275,914,828	2.500	2026/4/27	0.25

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	58.09
地方債証券	5.57
特殊債券	17.88
合　　計	81.54

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率(%)
為替予約取引	ユーロ	買建	3,200,000.00	387,775,360	387,808,000	0.35
	米ドル	売建	122,200,000.00	13,074,176,290	13,213,907,000	△12.06
	ユーロ	売建	364,600,000.00	44,427,445,000	44,191,404,000	△40.32
	英ポンド	売建	108,700,000.00	15,044,244,820	14,332,310,000	△13.08
	スウェーデンクローナ	売建	1,493,400,000.00	17,202,408,010	16,950,090,000	△15.47

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

インデックス　マザーファンド　Ｊリート

以下の運用状況は2019年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	日本	4,274,099,820	98.28
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	74,806,423	1.72
合計（純資産総額）		4,348,906,243	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	68,204,000	1.57

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人　投資証券	407	756,992.66	308,096,012	764,000	310,948,000	7.15
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	420	659,598.1	277,031,202	681,000	286,020,000	6.58
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人　投資証券	1,310	165,810.72	217,212,043	172,900	226,499,000	5.21
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人　投資証券	837	198,652.61	166,272,234	211,300	176,858,100	4.07
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人　投資証券	794	218,056.94	173,137,210	218,800	173,727,200	3.99
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人　投資証券	943	180,587.67	170,294,172	184,100	173,606,300	3.99
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人　投資証券	603	244,682.86	147,543,764	261,700	157,805,100	3.63
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人　投資証券	566	258,593.12	146,363,705	266,500	150,839,000	3.47
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人　投資証券	389	318,843.44	124,030,098	337,500	131,287,500	3.02
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	266	482,516.79	128,349,466	481,500	128,079,000	2.95
日本	投資証券	ＧＬＰ投資法人　投資証券	1,046	122,283.85	127,908,907	121,400	126,984,400	2.92
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人　投資証券	1,353	87,336.25	118,165,946	90,800	122,852,400	2.82
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人　投資証券	1,842	60,042.34	110,598,000	62,500	115,125,000	2.65
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人　投資証券	210	473,797.29	99,497,430	499,500	104,895,000	2.41
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人　投資証券	1,228	80,242.15	98,537,360	84,400	103,643,200	2.38
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人　投資証券	130	769,480.91	100,032,518	782,000	101,660,000	2.34
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	140	596,950	83,573,000	641,000	89,740,000	2.06
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人　投資証券	97	775,897.95	75,262,101	805,000	78,085,000	1.80
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人　投資証券	483	153,888.24	74,328,019	160,300	77,424,900	1.78

日本	投資証券	産業ファンド投資法人　投資証券	517	134,961.84	69,775,271	142,400	73,620,800	1.69
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人　投資証券	274	250,451.44	68,623,694	261,300	71,596,200	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	143	471,218.75	67,384,281	469,000	67,067,000	1.54
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人　投資証券	341	185,194.44	63,151,304	194,200	66,222,200	1.52
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人　投資証券	376	161,117.19	60,580,063	162,000	60,912,000	1.40
日本	投資証券	イオンリート投資法人　投資証券	431	137,508.29	59,266,072	141,300	60,900,300	1.40
日本	投資証券	日本リート投資法人　投資証券	136	431,029.41	58,620,000	437,000	59,432,000	1.37
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	175	308,217.14	53,938,000	325,500	56,962,500	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	282	189,102.82	53,326,995	197,300	55,638,600	1.28
日本	投資証券	プレミア投資法人　投資証券	379	137,961.94	52,287,575	146,700	55,599,300	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	300	175,979.13	52,793,739	181,100	54,330,000	1.25

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.28
合　　計	98.28

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証ＲＥＩＴ指数先物　２０１９年０９月	買建	34	日本円	66,109,570	68,204,000	1.57

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

インデックス　マザーファンド　海外先進国債券

以下の運用状況は2019年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	85,371,152	46.62
	カナダ	3,451,754	1.89
	メキシコ	1,397,351	0.76
	ドイツ	11,681,016	6.38

	イタリア	16,047,908	8.76
	フランス	18,199,384	9.94
	オランダ	3,549,634	1.94
	スペイン	10,601,489	5.79
	ベルギー	4,587,865	2.51
	オーストリア	2,737,394	1.49
	フィンランド	1,081,735	0.59
	アイルランド	1,276,816	0.70
	イギリス	11,351,357	6.20
	スウェーデン	623,366	0.34
	ノルウェー	461,883	0.25
	デンマーク	1,006,043	0.55
	ポーランド	1,116,298	0.61
	オーストラリア	3,629,977	1.98
	シンガポール	760,032	0.42
	マレーシア	876,639	0.48
	南アフリカ	1,026,238	0.56
	小計	180,835,331	98.76
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	2,276,504	1.24
合計（純資産総額）		183,111,835	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	—	469,863	△0.26

(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	184,000	10,897.67	20,051,728	10,902.40	20,060,425	2.000	2021/10/31	10.96
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	143,000	10,771.06	15,402,617	10,785.06	15,422,643	1.625	2023/4/30	8.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	101,000	11,114.80	11,225,952	11,133.05	11,244,383	2.375	2024/8/15	6.14
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	100,000	11,134.75	11,134,751	11,178.46	11,178,462	2.375	2027/5/15	6.10
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	92,000	10,934.23	10,059,495	10,933.38	10,058,714	2.625	2020/8/15	5.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	76,000	10,600.25	8,056,190	10,695.31	8,128,436	2.500	2046/2/15	4.44
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	32,000	14,090.22	4,508,873	14,064.60	4,500,674	5.500	2022/11/1	2.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	38,000	11,205.12	4,257,949	11,295.79	4,292,403	2.750	2042/8/15	2.34
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	21,000	18,726.28	3,932,519	18,915.91	3,972,343	5.500	2029/4/25	2.17

フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	30,000	12,774.15	3,832,246	12,847.54	3,854,264	0.500	2025/5/25	2.10
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	18,000	20,301.14	3,654,206	20,644.83	3,716,071	4.750	2035/4/25	2.03
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,000	12,793.68	3,710,170	12,797.32	3,711,223	2.000	2025/12/1	2.03
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	26,000	14,157.56	3,680,968	14,255.38	3,706,400	4.375	2038/2/15	2.02
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	21,000	16,239.46	3,410,287	16,257.50	3,414,075	5.250	2029/11/1	1.86
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	19,000	17,416.06	3,309,053	17,560.62	3,336,518	5.150	2028/10/31	1.82
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	14,000	21,673.27	3,034,259	22,211.58	3,109,622	4.500	2041/4/25	1.70
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	17,000	16,978.86	2,886,406	16,940.44	2,879,876	4.750	2044/9/1	1.57
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,000	20,662.50	2,686,125	21,018.79	2,732,443	4.900	2040/7/30	1.49
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	19,000	13,368.83	2,540,078	13,365.75	2,539,493	3.000	2022/4/25	1.39
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,000	18,951.16	2,463,652	19,073.20	2,479,517	6.500	2027/7/4	1.35
イギリス	国債証券	UK TREASURY	9,000	24,080.30	2,167,227	24,342.78	2,190,851	4.250	2055/12/7	1.20
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,000	23,727.96	2,135,517	24,295.93	2,186,634	4.750	2040/7/4	1.19
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	12,000	18,006.21	2,160,745	18,183.35	2,182,002	5.500	2028/3/28	1.19
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,000	13,272.91	1,858,208	13,343.26	1,868,057	1.600	2025/4/30	1.02
イギリス	国債証券	UK TREASURY	9,000	20,271.52	1,824,437	20,525.56	1,847,301	4.250	2040/12/7	1.01
イギリス	国債証券	UK TREASURY	13,000	13,692.94	1,780,083	13,753.78	1,787,992	1.750	2022/9/7	0.98
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	14,000	12,707.98	1,779,118	12,696.84	1,777,558	2.500	2021/1/4	0.97
イギリス	国債証券	UK TREASURY	9,000	18,670.40	1,680,336	18,943.31	1,704,898	4.750	2030/12/7	0.93
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,000	12,880.25	1,674,434	12,940.53	1,682,269	0.500	2025/2/15	0.92
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	12,000	12,871.95	1,544,634	12,850.50	1,542,060	3.750	2021/3/1	0.84

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.76
合　　計	98.76

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	売建	1,700.00	184,884	184,664	△0.10
	ユーロ	売建	1,700.00	206,096	206,023	△0.11
	英ポンド	売建	600.00	79,176	79,176	△0.04

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

先進国資本エマージング株式マザーファンド

以下の運用状況は2019年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アルゼンチン	184,583,706	1.16
	メキシコ	1,261,696,228	7.92
	ブラジル	1,405,172,272	8.82
	チリ	674,202,825	4.23
	ギリシャ	193,782,810	1.22
	トルコ	180,520,427	1.13
	チェコ	262,332,299	1.65
	ポーランド	545,692,435	3.42
	ロシア	190,015,019	1.19
	ケイマン	1,125,124,588	7.06
	バミューダ	161,389,855	1.01
	香港	140,844,600	0.88
	マレーシア	672,905,963	4.22
	タイ	1,095,723,401	6.88
	インドネシア	1,605,302,283	10.07
	韓国	381,220,942	2.39
	台湾	463,289,050	2.91
	中国	1,627,335,404	10.21
	インド	2,319,966,594	14.56
	南アフリカ	1,046,897,085	6.57
	サウジアラビア	230,687,520	1.45
	小計	15,768,685,306	98.96
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	165,372,629	1.04
合計（純資産総額）		15,934,057,935	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（%）

インドネシア	株式	PT UNILEVER INDONESIA TBK	家庭用品・パーソナル用品	1,549,100	359.58	557,025,378	335.79	520,172,289	3.26
タイ	株式	TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	電気通信サービス	2,280,000	180.19	410,854,369	204.74	466,807,200	2.93
インドネシア	株式	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	自動車・自動車部品	8,160,000	59.28	483,724,800	56.74	463,039,200	2.91
インド	株式	HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	家庭用品・パーソナル用品	160,315	2,870.02	460,108,779	2,734.64	438,403,972	2.75
インド	株式	NESTLE INDIA LIMITED	食品・飲料・タバコ	22,998	18,631.69	428,491,825	18,343.11	421,854,947	2.65
メキシコ	株式	WALMART DE MEXICO -SER V	食品・生活必需品小売り	1,219,200	304.37	371,100,095	322.44	393,129,820	2.47
インドネシア	株式	HM SAMPOERNA TBK PT	食品・飲料・タバコ	16,849,400	25.50	429,760,796	23.01	387,704,694	2.43
南アフリカ	株式	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	素材	57,350	6,188.40	354,904,740	6,627.24	380,072,306	2.39
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP-ADR	小売	19,947	18,278.68	364,604,830	18,914.22	377,282,026	2.37
中国	株式	HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	食品・飲料・タバコ	975,677	391.16	381,648,938	384.38	375,036,970	2.35
タイ	株式	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	電気通信サービス	484,500	720.12	348,898,140	755.42	366,000,990	2.30
ブラジル	株式	TIM PARTICIPACOES SA-ADR	電気通信サービス	207,146	1,646.98	341,165,816	1,719.77	356,243,725	2.24
中国	株式	BAIC MOTOR CORP LTD-H	自動車・自動車部品	4,909,500	65.42	321,188,818	72.36	355,285,296	2.23
南アフリカ	株式	KUMBA IRON ORE LTD	素材	89,007	3,715.86	330,738,156	3,804.49	338,626,312	2.13
メキシコ	株式	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	公益事業	765,700	473.78	362,776,409	417.86	319,960,762	2.01
インド	株式	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	自動車・自動車部品	36,048	10,520.63	379,247,761	8,756.36	315,649,572	1.98
メキシコ	株式	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	家庭用品・パーソナル用品	1,300,000	207.15	269,297,925	226.06	293,880,600	1.84
南アフリカ	株式	VODACOM GROUP LTD	電気通信サービス	297,262	959.35	285,179,727	898.38	267,056,495	1.68
チェコ	株式	KOMERCNI BANKA AS	銀行	61,823	4,240.91	262,186,397	4,243.27	262,332,299	1.65
メキシコ	株式	BANCO SANTANDER MEXICO -ADR	銀行	327,926	818.05	268,262,881	776.77	254,725,046	1.60
ポーランド	株式	SANTANDER BANK POLSKA SA	銀行	26,925	10,695.28	287,970,576	9,291.42	250,171,591	1.57
インド	株式	AMBUJA CEMENTS LIMITED	素材	778,192	339.78	264,416,412	321.33	250,063,439	1.57
ブラジル	株式	TELEF BRASIL-ADR	電気通信サービス	162,400	1,419.92	230,595,787	1,493.80	242,593,120	1.52
ブラジル	株式	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	公益事業	171,450	1,242.26	212,986,163	1,399.55	239,953,276	1.51
ブラジル	株式	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	食品・生活必需品小売り	357,700	647.20	231,504,692	668.40	239,088,290	1.50
ケイマン	株式	51JOB INC-ADR	商業・専門サービス	27,200	8,389.18	228,185,718	8,647.74	235,218,637	1.48
インドネシア	株式	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	素材	1,340,000	156.58	209,823,900	174.91	234,386,100	1.47

インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	411,136	554.19	227,849,309	549.74	226,018,932	1.42
マレーシア	株式	IHH HEALTHCARE BHD	ヘルスケア機器・サービス	1,438,000	151.60	218,005,402	151.34	217,626,920	1.37
チリ	株式	BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	銀行	68,235	3,198.36	218,240,204	3,182.06	217,128,246	1.36

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	1.19
		素材	10.51
		商業・専門サービス	2.17
		運輸	1.07
		自動車・自動車部品	9.39
		小売	3.38
		食品・生活必需品小売り	5.33
		食品・飲料・タバコ	10.08
		家庭用品・パーソナル用品	8.77
		ヘルスケア機器・サービス	1.37
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.69
		銀行	16.59
		各種金融	1.83
		保険	0.58
		電気通信サービス	15.35
		公益事業	7.01
		半導体・半導体製造装置	2.65
合　　計			98.96

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

インデックス　マザーファンド　コモディティ

以下の運用状況は2019年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	ドイツ	13,459,934	99.66

コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	46,585	0.34
合計（純資産総額）		13,506,519	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(%)
ドイツ	投資信託受益証券	ISH DIV COMDTY SWAP DE-ETF	6,145	2,216.56	13,620,792	2,190.38	13,459,934	99.66

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.66
合　　計	99.66

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。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

本書提出日現在、取得申込みの受付は行なっておりません。

２【換金（解約）手続等】

＜解約請求による換金＞

（１）解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（２）取扱時間

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

（３）解約請求不可日

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

●ニューヨーク証券取引所の休業日

●英国証券取引所の休業日

●ニューヨークの銀行休業日

●ロンドンの銀行休業日

（４）解約制限

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

（５）解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

＜委託会社の照会先＞
日興アセットマネジメント株式会社
ホームページ アドレス　www.nikkoam.com/
コールセンター 電話番号　0120-25-1404
午前９時～午後５時　土、日、祝・休日は除きます。

（６）手取額

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

※税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。
詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

（７）解約単位

1口単位

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

（８）解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して7営業日目からお支払いします。

（９）受付の中止および取消

・委託会社は、投資対象とする投資信託証券からの換金ができない場合、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少など、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。

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

3【資産管理等の概要】

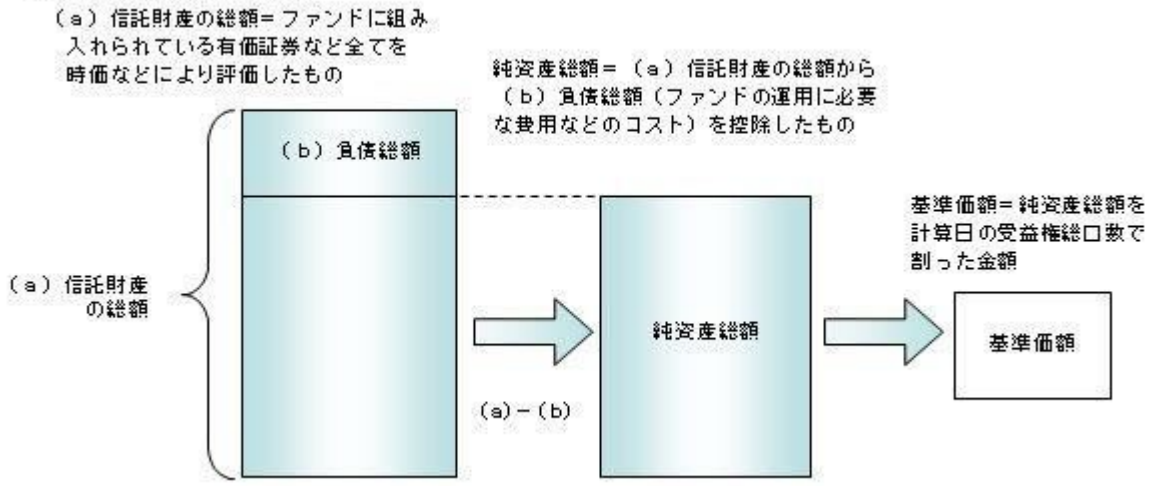
（１）【資産の評価】

① 基準価額の算出

・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。

・基準価額とは、信託財産に属する資産を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは１万口当たりに換算した価額で表示することがあります。

<基準価額算出の流れ>



② 有価証券などの評価基準

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

＜主な資産の評価方法＞

◇投資信託証券（国内籍）

原則として、基準価額計算日の基準価額で評価します。

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

③ 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

＜委託会社の照会先＞
日興アセットマネジメント株式会社
ホームページ アドレス　www.nikkoam.com/
コールセンター 電話番号　0120-25-1404
午前９時～午後５時　土、日、祝・休日は除きます。

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

2026年7月17日までとします（2016年11月21日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

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

（５）【その他】

① 信託の終了（繰上償還）

１）委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。

イ）受益者の解約により純資産総額が10億円を下回ることとなった場合

ロ）繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ハ）やむを得ない事情が発生したとき

２）この場合、委託会社は書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。（後述の

「書面決議」をご覧ください。）

３）委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。

イ）2026年6月30日以前の毎営業日において、この信託の１万口当たり基準価額が13,000円以上となった場合

ロ）信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、書面決議が困難な場合

ハ）監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

ニ）委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。）

ホ）受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき

４）繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

② 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。

③ 信託約款の変更など

１）委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（以下「併合」といいます。）を行なうことができます。信託約款の変更または併合を行なう際には、委託会社は、その旨および内容をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

２）この変更事項のうち、その内容が重大なものまたは併合（受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものを除きます。）については、書面決議を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）

３）委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「書面決議」の規定を適用します。

④ 書面決議

１）繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に対して、委託会社は書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにその内容および理由などの事項を定め、決議の日の２週間前までに知れている受益者に対し書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

２）受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、書面決議について賛成するものとみなします。

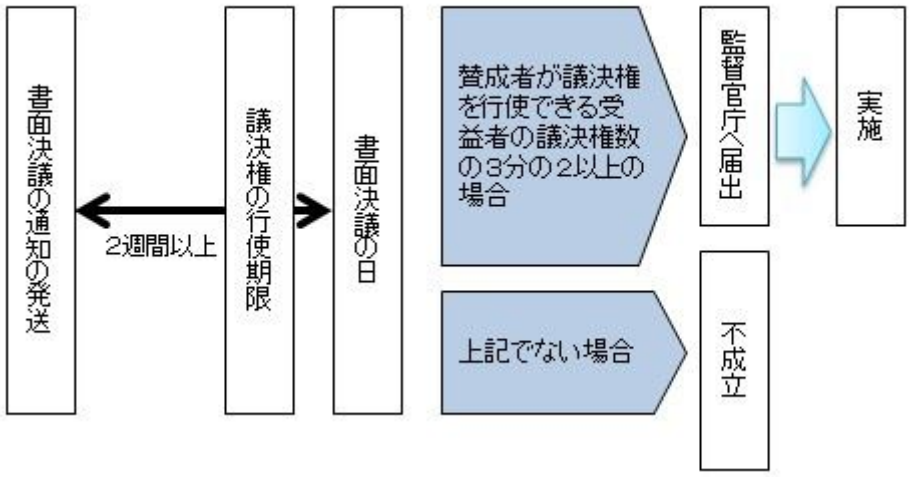
３）書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上にあたる多数をもって行ないます。

４）繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に関する委託会社の提案に対して、すべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときは、書面決議を行ないません。

５）当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、併合にかかる他のファンドにおいて併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。

６）当ファンドは、受益者からの換金請求に対して、投資信託契約の一部を解約することにより応じることができるため、受益者の保護に欠けるおそれがないものとして、書面決議において反対した受益者からの買取請求は受け付けません。

＜書面決議の主な流れ＞



⑤　公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

ホームページ アドレス　　www.nikkoam.com/

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

⑥　運用報告書の作成

・委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。

・交付運用報告書は、原則として知れている受益者に対して交付されます。

・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

ホームページ アドレス　　www.nikkoam.com/

⑦　関係法人との契約について

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

・投資顧問会社との投資顧問契約は、当ファンドの信託期間終了まで存続します。ただし、投資顧問会社、委託会社が重大な契約違反を行なったとき、その他契約を継続し難い重大な事由があるときは、相手方に通知をなすことにより契約を終了することができます。

⑧　他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

１．他の受益者の氏名または名称および住所

２．他の受益者が有する受益権の内容

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

（１）収益分配金・償還金受領権

・受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を、自己に帰属する受益権の口数に応じて受領する権利を有します。

・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から５年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行なわない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

（２）解約請求権

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

（３）帳簿閲覧権

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

第３【ファンドの経理状況】

（１）　当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（２）　当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2018年 7月18日から2019年 7月17日まで）の財務諸表について、ＰｗＣあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１６－１１】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 2018年 7月17日現在	第3期 2019年 7月17日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	2,479,332	-
コール・ローン	8,907,001	8,059,146
投資信託受益証券	98,052,502	76,634,186
親投資信託受益証券	219,475,479	156,018,017
流動資産合計	328,914,314	240,711,349
資産合計	328,914,314	240,711,349
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	63,049	39,427
未払委託者報酬	1,682,987	1,052,934
未払利息	16	12
その他未払費用	194,670	121,738
流動負債合計	1,940,722	1,214,111
負債合計	1,940,722	1,214,111
純資産の部		
元本等		
元本	302,835,058	219,604,060
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	24,138,534	19,893,178
（分配準備積立金）	22,425,795	18,651,165
元本等合計	326,973,592	239,497,238
純資産合計	326,973,592	239,497,238
負債純資産合計	328,914,314	240,711,349

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期 自　2017年 7月19日 至　2018年 7月17日	第3期 自　2018年 7月18日 至　2019年 7月17日
営業収益		
受取利息	51	23
有価証券売買等損益	38,215,207	3,304,132
営業収益合計	38,215,258	3,304,155
営業費用		
支払利息	10,557	4,241
受託者報酬	168,992	86,460
委託者報酬	4,509,757	2,308,691
その他費用	522,267	267,449
営業費用合計	5,211,573	2,666,841
営業利益又は営業損失（△）	33,003,685	637,314
経常利益又は経常損失（△）	33,003,685	637,314
当期純利益又は当期純損失（△）	33,003,685	637,314
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（△）	16,109,123	△1,751,593
期首剰余金又は期首欠損金（△）	25,608,203	24,138,534
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
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	18,364,231	6,634,263
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	18,364,231	6,634,263
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	24,138,534	19,893,178

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		第2期 2018年 7月17日現在	第3期 2019年 7月17日現在
１．	期首元本額	1,070,553,750円	302,835,058円
	期中追加設定元本額	－円	－円
	期中一部解約元本額	767,718,692円	83,230,998円
２．	受益権の総数	302,835,058口	219,604,060口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第2期 自 2017年 7月19日 至 2018年 7月17日		第3期 自 2018年 7月18日 至 2019年 7月17日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 計算期末における費用控除後の配当等収益	3,866,485円	A 計算期末における費用控除後の配当等収益	1,870,413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	13,028,077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	518,494円
C 信託約款に定める収益調整金	1,712,739円	C 信託約款に定める収益調整金	1,242,013円
D 信託約款に定める分配準備積立金	5,531,233円	D 信託約款に定める分配準備積立金	16,262,258円
E 分配対象収益（A+B+C+D）	24,138,534円	E 分配対象収益（A+B+C+D）	19,893,178円
F 分配対象収益(1万口当たり)	797円	F 分配対象収益(1万口当たり)	905円
G 分配金額	0円	G 分配金額	0円
H 分配金額(1万口当たり)	0円	H 分配金額(1万口当たり)	0円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	第2期 自 2017年 7月19日 至 2018年 7月17日	第3期 自 2018年 7月18日 至 2019年 7月17日

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	第2期 2018年 7月17日現在	第3期 2019年 7月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

第2期（2018年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	7,768,151
親投資信託受益証券	10,820,667
合計	18,588,818

第3期（2019年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	2,823,333
親投資信託受益証券	1,094,490
合計	3,917,823

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（１口当たり情報）

第2期 2018年 7月17日現在		第3期 2019年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	1.0797円	1口当たり純資産額	1.0906円
(1万口当たり純資産額)	(10,797円)	(1万口当たり純資産額)	(10,906円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ＦＯＦｓ用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	8,973,233	9,244,224	
	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）	31,200,415	45,515,165	
	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）	15,477,710	18,556,226	
	インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）	2,866,026	3,318,571	
投資信託受益証券 合計		58,517,384	76,634,186	
親投資信託受益証券	インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ	27,881,999	54,467,485	
	ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド	27,703,394	37,463,299	
	インデックス　マザーファンド　Ｊリート	18,889,962	24,502,169	
	先進国資本エマージング株式マザーファンド	6,380,998	7,659,749	
	インデックス　マザーファンド　海外先進国債券	26,417,289	29,132,986	
	インデックス　マザーファンド　コモディティ	3,014,498	2,792,329	
親投資信託受益証券 合計		110,288,140	156,018,017	
合計		168,805,524	232,652,203	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

当ファンドは、「インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）」「インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）」「インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）」「ＦＯＦｓ用ゴールド・ファンド　為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は同投資信託です。なお、同投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

また、当ファンドは、「インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ」「ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド」「インデックス　マザーファンド　Ｊリート」「インデックス　マザーファンド　海外先進国債券」

「先進国資本エマージング株式マザーファンド」「インデックス　マザーファンド　コモディティ」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

（参考）

インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）

貸借対照表

（単位：円）

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	954,307	-
コール・ローン	2,140,223	2,189,767
親投資信託受益証券	287,739,485	201,802,019
未収入金	575,141	-
流動資産合計	291,409,156	203,991,786
資産合計	291,409,156	203,991,786
負債の部		
流動負債		
未払解約金	535,529	-
未払受託者報酬	5,308	3,799
未払委託者報酬	10,629	7,609
未払利息	4	4
その他未払費用	254,864	152,664
流動負債合計	806,334	164,076
負債合計	806,334	164,076
純資産の部		
元本等		
元本	204,021,248	139,725,303
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	86,581,574	64,102,407
（分配準備積立金）	48,909,140	40,567,185
元本等合計	290,602,822	203,827,710
純資産合計	290,602,822	203,827,710
負債純資産合計	291,409,156	203,991,786

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
1．	期首	2017年 7月19日	2018年 7月18日
	期首元本額	459,725,262円	204,021,248円
	期首からの追加設定元本額	113,997,248円	3,496,820円

	期首からの一部解約元本額	369,701,262円	67,792,765円
2．	受益権の総数	204,021,248口	139,725,303口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2017年 7月19日 至 2018年 7月17日	自 2018年 7月18日 至 2019年 7月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）

（2018年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	14,718,744
合計	14,718,744

（2019年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	6,357,622
合計	6,357,622

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

2018年 7月17日現在		2019年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	1.4244円	1口当たり純資産額	1.4588円
(1万口当たり純資産額)	(14,244円)	(1万口当たり純資産額)	(14,588円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジなし）マザーファンド	77,816,689	201,802,019	
合計		77,816,689	201,802,019	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）」は、「海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジなし）マザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
資産の部		
流動資産		
預金	100,541,259	208,500,589
金銭信託	240,784,057	-
コール・ローン	540,006,374	2,670,925,763
出資金	8,742,434	15,604,154
株式	85,801,513,296	136,125,585,077

投資証券	2,130,214,696	3,756,393,267
派生商品評価勘定	45,434,244	5,078,539
未収入金	4,465,246	2,663,870
未収配当金	75,897,879	112,050,350
差入委託証拠金	239,882,601	524,768,841
流動資産合計	89,187,482,086	143,421,570,450
資産合計	89,187,482,086	143,421,570,450
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	348,771	4,052,060
未払金	-	2,506,175,538
未払解約金	34,813,722	51,308,323
未払利息	1,082	4,936
流動負債合計	35,163,575	2,561,540,857
負債合計	35,163,575	2,561,540,857
純資産の部		
元本等		
元本	35,324,568,583	54,317,132,526
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	53,827,749,928	86,542,897,067
元本等合計	89,152,318,511	140,860,029,593
純資産合計	89,152,318,511	140,860,029,593
負債純資産合計	89,187,482,086	143,421,570,450

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	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。 （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。 （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。 （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 7月17日現在	2019年 7月17日現在
１．	期首	2017年 7月19日	2018年 7月18日
	期首元本額	35,612,262,377円	35,324,568,583円
	期首からの追加設定元本額	3,350,271,901円	22,426,161,997円
	期首からの一部解約元本額	3,637,965,695円	3,433,598,054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）	16,639,822,213円	18,113,852,893円
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	72,844,871円	101,269,141円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	211,604,433円	271,504,581円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	414,152,909円	520,810,162円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	447,074,660円	539,622,699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	2,170,163,367円	2,067,160,357円
	日興五大陸株式ファンド	5,558,401,225円	5,201,954,796円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	23,381,245円	－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）	114,010,415円	77,816,689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）	155,261,740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）	－円	6,968,516,761円
	グローバル３倍３分法ファンド（適格機関投資家向け）	－円	11,554,226,626円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	5,393,742円	4,926,009円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	4,402,036円	4,143,857円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	6,747,744円	7,411,889円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	6,773,633円	5,938,453円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	4,868,477,400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）	26,978,569円	27,294,276円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	78,905,103円	78,595,471円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	117,308,896円	112,631,814円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	116,492,414円	110,506,809円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,286,371,968円	4,278,722,686円
	計	35,324,568,583円	54,317,132,526円
２．	受益権の総数	35,324,568,583口	54,317,132,526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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2017年 7月19日 至 2018年 7月17日	自 2018年 7月18日 至 2019年 7月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2018年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
出資金	1,431,388
株式	5,156,474,098
投資証券	35,287,461
合計	5,193,192,947

（2019年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
出資金	1,942,860
株式	11,394,565,965
投資証券	384,600,492
合計	11,781,109,317

(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 7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	1,156,470,072	－	1,185,079,860	28,609,788
合計		1,156,470,072	－	1,185,079,860	28,609,788

（2019年 7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	1,109,114,414	－	1,107,955,178	△1,159,236
合計		1,109,114,414	－	1,107,955,178	△1,159,236

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

（2019年 7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	2,878,216,455	－	2,880,402,170	2,185,715
	米ドル	2,036,250,190	－	2,039,694,000	3,443,810
	加ドル	100,109,350	－	100,091,200	△18,150

	ユーロ	371,537,350	—	370,350,000	△1,187,350
	英ポンド	139,780,160	—	139,765,600	△14,560
	スイスフラン	93,479,417	—	93,497,330	17,913
	スウェーデンクローナ	25,157,200	—	25,157,200	—
	ノルウェークローネ	11,174,644	—	11,156,080	△18,564
	デンマーククローネ	7,744,520	—	7,739,760	△4,760
	豪ドル	55,558,924	—	55,556,000	△2,924
	香港ドル	37,424,700	—	37,395,000	△29,700
合計		2,878,216,455	—	2,880,402,170	2,185,715

（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。

①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。

②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 7月17日現在		2019年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	2.5238円	1口当たり純資産額	2.5933円
(1万口当たり純資産額)	(25,238円)	(1万口当たり純資産額)	(25,933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	16,593	73.06	1,212,284.58	
	APACHE CORP	11,004	25.24	277,740.96	
	BAKER HUGHES A GE CO	18,095	24.09	435,908.55	
	CABOT OIL & GAS CORP	12,730	23.25	295,972.50	
	CHENIERE ENERGY INC	8,370	67.74	566,983.80	
	CHEVRON CORP	63,831	124.76	7,963,555.56	
	CIMAREX ENERGY CO	2,955	51.53	152,271.15	
	CONCHO RESOURCES INC	6,845	98.80	676,286.00	
	CONOCOPHILLIPS	38,300	59.75	2,288,425.00	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,310	37.53	124,224.30	
	DEVON ENERGY CORPORATION	13,141	26.80	352,178.80	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	5,610	104.11	584,057.10	
	EOG RESOURCES INC	18,872	87.00	1,641,864.00	
	EXXON MOBIL CORP	142,391	75.93	10,811,748.63	
	HALLIBURTON CO	28,847	22.88	660,019.36	
	HELMERICH & PAYNE	4,280	50.59	216,525.20	
	HESS CORP	8,310	61.70	512,727.00	
	HOLLYFRONTIER CORP	4,740	47.83	226,714.20	
	KINDER MORGAN INC	71,410	20.91	1,493,183.10	
	MARATHON OIL CORP	26,307	13.32	350,409.24	
	MARATHON PETROLEUM CORP	23,732	55.68	1,321,397.76	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	11,301	21.33	241,050.33	
	NOBLE ENERGY INC	19,222	21.10	405,584.20	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	24,601	51.10	1,257,111.10	
	ONEOK INC	13,330	70.15	935,099.50	
	PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	9,380	16.85	158,053.00	
	PHILLIPS 66	15,965	101.38	1,618,531.70	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	5,660	140.06	792,739.60	
	SCHLUMBERGER LTD	46,851	40.07	1,877,319.57	
	TARGA RESOURCES CORP	8,350	40.78	340,513.00	
	TECHNIPFMC PLC	11,861	25.12	297,948.32	
	VALERO ENERGY CORP	13,652	84.21	1,149,634.92	
	WILLIAMS COS INC	39,764	28.20	1,121,344.80	

AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	7,135	227.10	1,620,358.50	
ALBEMARLE CORP	3,010	73.05	219,880.50	
AMCOR PLC	56,620	10.90	617,158.00	
AVERY DENNISON CORP	3,270	115.91	379,025.70	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	5,850	30.67	179,419.50	
BALL CORP	11,570	69.07	799,139.90	
CELANESE CORP	4,240	108.05	458,132.00	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,120	47.71	387,405.20	
CHEMOURS CO/THE	5,470	20.41	111,642.70	
CORTEVA INC	26,982	27.86	751,718.52	
CROWN HOLDINGS INC	4,715	60.22	283,937.30	
DOW INC	26,505	52.32	1,386,741.60	
DUPONT DE NEMOURS INC	25,052	72.32	1,811,760.64	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,045	78.55	317,734.75	
ECOLAB INC	8,440	197.93	1,670,529.20	
FMC CORP	3,680	84.47	310,849.60	
FREEPORT-MCMORAN INC	44,968	11.12	500,044.16	
INTERNATIONAL PAPER CO	13,470	42.60	573,822.00	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,155	144.81	456,875.55	
LINDE PLC	18,560	202.59	3,760,070.40	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,520	87.80	923,656.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,015	230.13	463,711.95	
MOSAIC CO/THE	10,810	23.71	256,305.10	
NEWMONT GOLDCORP CORP	28,602	38.69	1,106,611.38	
NUCOR CORP	10,339	55.56	574,434.84	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,710	98.47	365,323.70	
PPG INDUSTRIES INC	7,884	117.85	929,129.40	
SEALED AIR CORP	3,966	43.63	173,036.58	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,827	467.54	1,321,735.58	
STEEL DYNAMICS INC	9,050	31.15	281,907.50	
VULCAN MATERIALS CO	4,803	137.63	661,036.89	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,360	69.35	94,316.00	
WESTROCK CO	9,359	35.81	335,145.79	
3M CO	19,406	176.49	3,424,964.94	
ACUITY BRANDS INC	1,510	132.93	200,724.30	

AERCAP HOLDINGS NV	4,190	51.46	215,617.40	
ALLEGION PLC	3,230	110.78	357,819.40	
AMETEK INC	8,033	91.30	733,412.90	
ARCONIC INC	12,213	25.78	314,851.14	
BOEING CO/THE	18,022	362.75	6,537,480.50	
CATERPILLAR INC	19,416	139.09	2,700,571.44	
CUMMINS INC	4,875	172.35	840,206.25	
DEERE & CO	10,400	166.15	1,727,960.00	
DOVER CORP	4,940	99.32	490,640.80	
EATON CORP PLC	13,566	81.15	1,100,880.90	
EMERSON ELECTRIC CO	21,630	66.24	1,432,771.20	
FASTENAL CO	20,396	31.28	637,986.88	
FLOWSERVE CORP	5,495	52.95	290,960.25	
FLUOR CORP	4,943	32.89	162,575.27	
FORTIVE CORP	9,844	81.41	801,400.04	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5,330	56.55	301,411.50	
GENERAL DYNAMICS CORP	8,422	186.89	1,573,987.58	
GENERAL ELECTRIC CO	293,453	10.38	3,046,042.14	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	5,570	40.50	225,585.00	
HEICO CORP	1,500	136.79	205,185.00	
HEICO CORP-CLASS A	2,200	107.34	236,148.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	24,416	174.78	4,267,428.48	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,440	236.15	340,056.00	
IDEX CORP	2,660	168.36	447,837.60	
ILLINOIS TOOL WORKS	10,730	153.45	1,646,518.50	
INGERSOLL-RAND PLC	8,486	128.13	1,087,311.18	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,490	85.75	385,017.50	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	7,070	64.59	456,651.30	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	6,400	38.45	246,080.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	27,564	42.06	1,159,341.84	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,555	192.57	1,454,866.35	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,050	292.36	306,978.00	
LOCKHEED MARTIN CORP	8,551	365.35	3,124,107.85	
MASCO CORP	8,659	39.40	341,164.60	
MIDDLEBY CORP	1,960	142.16	278,633.60	

NORTHROP GRUMMAN CORP	5,504	323.83	1,782,360.32	
OWENS CORNING	2,950	57.42	169,389.00	
PACCAR INC	11,334	72.57	822,508.38	
PARKER HANNIFIN CORP	4,280	171.04	732,051.20	
PENTAIR PLC	5,938	38.49	228,553.62	
RAYTHEON COMPANY	9,152	180.06	1,647,909.12	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,673	162.57	597,119.61	
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,520	384.24	1,352,524.80	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	4,410	47.40	209,034.00	
SMITH (A.O.) CORP	4,990	45.20	225,548.00	
SNAP-ON INC	2,170	160.04	347,286.80	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	2,760	75.45	208,242.00	
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,016	147.08	737,753.28	
TEXTRON INC	8,486	54.03	458,498.58	
TRANSDIGM GROUP INC	1,590	497.83	791,549.70	
UNITED RENTALS INC	2,810	137.59	386,627.90	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	27,578	133.19	3,673,113.82	
WABCO HOLDINGS INC	1,710	132.62	226,780.20	
WABTEC CORP	4,520	72.50	327,700.00	
WW GRAINGER INC	1,407	272.91	383,984.37	
XYLEM INC	5,338	82.62	441,025.56	
CINTAS CORP	3,137	239.44	751,123.28	
COPART INC	6,720	77.47	520,598.40	
COSTAR GROUP INC	1,295	581.92	753,586.40	
EQUIFAX INC	3,584	137.42	492,513.28	
IHS MARKIT LTD	13,233	65.56	867,555.48	
MANPOWERGROUP INC	2,437	91.24	222,351.88	
NIELSEN HOLDINGS PLC	9,945	23.39	232,613.55	
REPUBLIC SERVICES INC	7,060	87.68	619,020.80	
ROBERT HALF INTL INC	4,995	59.07	295,054.65	
ROLLINS INC	4,940	37.77	186,583.80	
TRANSUNION	7,110	75.30	535,383.00	
VERISK ANALYTICS INC	5,450	151.77	827,146.50	
WASTE CONNECTIONS INC	8,566	97.07	831,501.62	
WASTE MANAGEMENT INC	13,764	118.17	1,626,491.88	

AMERCO	225	380.73	85,664.25	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,860	34.22	132,089.20	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,840	84.95	411,158.00	
CSX CORP	26,123	79.55	2,078,084.65	
DELTA AIR LINES INC	6,135	63.16	387,486.60	
EXPEDITORS INTL WASH INC	5,977	75.10	448,872.70	
FEDEX CORP	8,168	169.79	1,386,844.72	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,430	97.73	237,483.90	
KANSAS CITY SOUTHERN	3,840	122.82	471,628.80	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	4,600	35.89	165,094.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,150	206.46	1,889,109.00	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,140	153.46	328,404.40	
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,770	53.28	200,865.60	
UBER TECHNOLOGIES INC	5,400	44.13	238,302.00	
UNION PACIFIC CORP	24,186	175.15	4,236,177.90	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	1,715	93.92	161,072.80	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	23,457	105.61	2,477,293.77	
XPO LOGISTICS INC	3,850	62.21	239,508.50	
APTIV PLC	8,010	79.99	640,719.90	
AUTOLIV INC	2,540	70.00	177,800.00	
BORGWARNER INC	5,980	40.39	241,532.20	
FORD MOTOR COMPANY	137,505	10.51	1,445,177.55	
GENERAL MOTORS CORP	43,485	39.43	1,714,613.55	
HARLEY-DAVIDSON INC	6,229	36.60	227,981.40	
LEAR CORP	1,660	129.74	215,368.40	
TESLA INC	4,320	252.38	1,090,281.60	
CAPRI HOLDINGS LTD	5,890	37.06	218,283.40	
DR HORTON INC	13,126	45.44	596,445.44	
GARMIN LTD	5,265	81.06	426,780.90	
HANESBRANDS INC	12,690	16.93	214,841.70	
HASBRO INC	3,898	109.85	428,195.30	
LEGGETT & PLATT INC	4,778	39.29	187,727.62	
LENNAR CORP-CL A	10,970	47.77	524,036.90	
LULULEMON ATHLETICA INC	4,060	190.18	772,130.80	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,488	150.04	373,299.52	

NEWELL BRANDS INC	13,866	15.15	210,069.90	
NIKE INC -CL B	42,108	88.60	3,730,768.80	
NVR INC	100	3,497.10	349,710.00	
POLARIS INDUSTRIES INC	1,930	87.37	168,624.10	
PULTE GROUP INC	8,230	33.58	276,363.40	
PVH CORP	2,150	92.50	198,875.00	
RALPH LAUREN CORP	1,725	115.20	198,720.00	
TAPESTRY INC	10,656	31.20	332,467.20	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	5,960	27.36	163,065.60	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	5,672	24.26	137,602.72	
VF CORP	11,580	88.31	1,022,629.80	
WHIRLPOOL CORP	2,054	148.57	305,162.78	
ARAMARK	9,390	35.84	336,537.60	
CARNIVAL CORP	13,847	46.45	643,193.15	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	945	761.85	719,948.25	
DARDEN RESTAURANTS INC	3,643	123.21	448,854.03	
DOMINO'S PIZZA INC	1,190	246.54	293,382.60	
H&R BLOCK INC	7,790	28.44	221,547.60	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	9,310	99.88	929,882.80	
LAS VEGAS SANDS CORP	11,000	64.73	712,030.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	9,573	143.96	1,378,129.08	
MCDONALD'S CORP	25,751	213.72	5,503,503.72	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	8,700	24.60	214,020.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	18,660	29.41	548,790.60	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	6,390	50.82	324,739.80	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	5,498	114.55	629,795.90	
STARBUCKS CORP	41,894	90.08	3,773,811.52	
VAIL RESORTS INC	1,110	232.25	257,797.50	
WYNN RESORTS LTD	3,430	139.34	477,936.20	
YUM! BRANDS INC	10,454	111.54	1,166,039.16	
ACTIVISION BLIZZARD INC	24,420	46.99	1,147,495.80	
ALPHABET INC-CL A	10,070	1,153.46	11,615,342.20	
ALPHABET INC-CL C	10,572	1,153.58	12,195,647.76	
ALTICE USA INC- A	8,400	25.67	215,628.00	
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	10,058	53.51	538,203.58	

CHARTER COMMUNICATION-A	5,326	414.84	2,209,437.84	
COMCAST CORP-CLASS A	151,514	45.09	6,831,766.26	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	5,730	32.57	186,626.10	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	13,040	30.03	391,591.20	
DISH NETWORK CORP-A	7,089	41.24	292,350.36	
ELECTRONIC ARTS INC	9,674	89.55	866,306.70	
FACEBOOK INC-CLASS A	80,150	203.84	16,337,776.00	
FOX CORP - CLASS A	11,014	36.69	404,103.66	
FOX CORP- CLASS B	6,316	36.69	231,734.04	
IAC/INTERACTIVECORP	2,420	231.39	559,963.80	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	10,826	23.69	256,467.94	
LIBERTY BROADBAND-C	3,820	107.95	412,369.00	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,585	26.11	198,044.35	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	15,461	25.50	394,255.50	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	7,470	38.70	289,089.00	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	5,150	40.00	206,000.00	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	3,315	39.79	131,903.85	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	4,470	70.55	315,358.50	
NETFLIX INC	14,690	365.99	5,376,393.10	
NEWS CORP - CLASS A	11,860	13.58	161,058.80	
OMNICOM GROUP	7,977	84.02	670,227.54	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	45,960	6.05	278,058.00	
SNAP INC - A	20,600	15.00	309,000.00	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	3,530	117.45	414,598.50	
THE WALT DISNEY CO.	60,392	144.30	8,714,565.60	
TRIPADVISOR INC	3,330	46.76	155,710.80	
TWITTER INC	23,560	37.99	895,044.40	
VIACOM INC-CLASS B	11,888	31.71	376,968.48	
ZILLOW GROUP INC - C	4,010	48.85	195,888.50	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,168	161.76	350,695.68	
AMAZON.COM INC	14,025	2,009.90	28,188,847.50	
AUTOZONE INC	862	1,180.00	1,017,160.00	
BEST BUY CO INC	7,664	74.78	573,113.92	
BOOKING HOLDINGS INC	1,518	1,888.90	2,867,350.20	
BURLINGTON STORES INC	2,590	180.18	466,666.20	

CARMAX INC	5,879	86.39	507,886.81	
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	8,540	144.20	1,231,468.00	
DOLLAR TREE INC	8,426	112.32	946,408.32	
EBAY INC	27,977	39.92	1,116,841.84	
EXPEDIA INC	4,542	136.37	619,392.54	
GAP INC/THE	8,676	19.23	166,839.48	
GENUINE PARTS CO	4,381	105.35	461,538.35	
GRUBHUB INC	3,200	75.02	240,064.00	
HOME DEPOT INC	37,980	217.26	8,251,534.80	
KOHLS CORP	5,412	49.84	269,734.08	
L BRANDS INC	6,608	26.41	174,517.28	
LKQ CORP	12,100	26.99	326,579.00	
LOWE'S COS INC	27,012	106.50	2,876,778.00	
MACY'S INC	7,939	22.03	174,896.17	
MERCADOLIBRE INC	1,390	633.95	881,190.50	
NORDSTROM INC	3,980	31.01	123,419.80	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,525	405.55	1,024,013.75	
QURATE RETAIL INC	10,830	12.88	139,490.40	
ROSS STORES INC	12,572	106.81	1,342,815.32	
TARGET CORP	18,180	88.31	1,605,475.80	
TIFFANY & CO	3,460	94.03	325,343.80	
TJX COMPANIES INC	41,656	56.22	2,341,900.32	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,500	112.31	393,085.00	
ULTA BEAUTY INC	1,860	360.54	670,604.40	
WAYFAIR INC- CLASS A	1,820	149.95	272,909.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	14,739	280.65	4,136,500.35	
KROGER CO	29,250	21.96	642,330.00	
SYSCO CORP	16,626	72.65	1,207,878.90	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	27,112	55.81	1,513,120.72	
WALMART INC	48,642	114.76	5,582,155.92	
ALTRIA GROUP INC	63,188	49.41	3,122,119.08	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	18,403	40.82	751,210.46	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	9,240	55.91	516,608.40	
BUNGE LTD	3,977	55.84	222,075.68	
CAMPBELL SOUP CO	5,105	41.29	210,785.45	

COCA-COLA CO/THE	136,192	52.14	7,101,050.88	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	6,900	57.04	393,576.00	
CONAGRA BRANDS INC	18,480	28.14	520,027.20	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	5,620	197.88	1,112,085.60	
GENERAL MILLS INC	20,289	52.86	1,072,476.54	
HERSHEY CO/THE	4,915	140.43	690,213.45	
HORMEL FOODS CORP	8,510	41.23	350,867.30	
INGREDION INC	1,840	79.82	146,868.80	
JM SMUCKER CO/THE	3,630	115.46	419,119.80	
KELLOGG CO	9,828	55.22	542,702.16	
KRAFT HEINZ CO/THE	22,261	30.32	674,953.52	
LAMB WESTON HOLDING INC	4,380	66.79	292,540.20	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,365	159.72	697,177.80	
MOLSON COORS BREWING CO -B	6,180	54.49	336,748.20	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	48,765	54.77	2,670,859.05	
MONSTER BEVERAGE CORP	13,240	65.79	871,059.60	
PEPSICO INC	47,051	133.80	6,295,423.80	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	52,178	81.58	4,256,681.24	
TYSON FOODS INC-CL A	9,896	79.13	783,070.48	
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,130	75.35	687,945.50	
CLOROX COMPANY	4,546	159.94	727,087.24	
COLGATE-PALMOLIVE CO	27,670	74.50	2,061,415.00	
COTY INC-CL A	10,350	11.14	115,299.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	7,450	189.11	1,408,869.50	
KIMBERLY-CLARK CORP	11,093	138.52	1,536,602.36	
PROCTER & GAMBLE CO	83,859	115.89	9,718,419.51	
ABBOTT LABORATORIES	58,806	83.16	4,890,306.96	
ABIOMED INC	1,570	253.75	398,387.50	
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,480	281.07	697,053.60	
AMERISOURCEBERGEN CORP	6,044	89.00	537,916.00	
ANTHEM INC	8,576	305.41	2,619,196.16	
BAXTER INTERNATIONAL INC	16,489	82.07	1,353,252.23	
BECTON DICKINSON AND CO	9,097	251.38	2,286,803.86	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	46,818	41.86	1,959,801.48	
CARDINAL HEALTH INC	9,265	46.79	433,509.35	

CENTENE CORP	13,510	53.74	726,027.40	
CERNER CORP	11,550	74.48	860,244.00	
CIGNA CORP	12,820	179.96	2,307,087.20	
COOPER COS INC/THE	1,720	328.19	564,486.80	
CVS HEALTH CORP	43,628	57.38	2,503,374.64	
DANAHER CORP	21,119	139.83	2,953,069.77	
DAVITA INC	5,038	57.70	290,692.60	
DENTSPLY SIRONA INC	6,592	56.47	372,250.24	
DEXCOM INC	2,660	149.85	398,601.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7,200	187.53	1,350,216.00	
HCA HEALTHCARE INC	9,075	139.70	1,267,777.50	
HENRY SCHEIN INC	4,490	69.93	313,985.70	
HOLOGIC INC	10,138	47.08	477,297.04	
HUMANA INC	4,605	284.30	1,309,201.50	
IDEXX LABORATORIES INC	2,900	283.66	822,614.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	3,870	515.56	1,995,217.20	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,035	175.05	531,276.75	
MCKESSON CORP	6,434	142.96	919,804.64	
MEDTRONIC PLC	44,868	99.87	4,480,967.16	
QUEST DIAGNOSTICS	4,946	101.47	501,870.62	
RESMED INC	5,140	123.37	634,121.80	
STERIS PLC	2,500	148.36	370,900.00	
STRYKER CORP	11,323	205.40	2,325,744.20	
TELEFLEX INC	1,360	331.52	450,867.20	
UNITEDHEALTH GROUP INC	32,160	264.66	8,511,465.60	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,380	133.97	318,848.60	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	3,454	134.90	465,944.60	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	4,500	171.04	769,680.00	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	1,610	290.20	467,222.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	6,842	122.09	835,339.78	
ABBVIE INC	49,696	69.16	3,436,975.36	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	10,740	69.95	751,263.00	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	7,710	122.82	946,942.20	
ALKERMES PLC	5,060	23.38	118,302.80	
ALLERGAN PLC	11,095	164.26	1,822,464.70	

ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,360	74.24	249,446.40	
AMGEN INC	20,831	177.47	3,696,877.57	
BEIGENE LTD-ADR	1,160	121.17	140,557.20	
BIOGEN INC	6,603	231.55	1,528,924.65	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	5,450	82.37	448,916.50	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	55,081	44.45	2,448,350.45	
CELGENE CORP	23,704	91.53	2,169,627.12	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	10,636	33.35	354,710.60	
ELI LILLY & CO	29,884	108.82	3,251,976.88	
EXACT SCIENCES CORP	4,640	114.95	533,368.00	
GILEAD SCIENCES INC	43,004	66.94	2,878,687.76	
ILLUMINA INC	4,970	302.30	1,502,431.00	
INCYTE CORP	6,870	79.88	548,775.60	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	3,900	67.61	263,679.00	
IQVIA HOLDINGS INC	5,503	156.57	861,604.71	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,330	136.61	318,301.30	
JOHNSON & JOHNSON	89,301	132.50	11,832,382.50	
MERCK & CO. INC.	86,493	81.59	7,056,963.87	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	895	821.85	735,555.75	
MYLAN NV	18,705	18.43	344,733.15	
NEKTAR THERAPEUTICS	5,400	32.49	175,446.00	
PERKINELMER INC	3,250	95.30	309,725.00	
PERRIGO CO PLC	5,039	50.37	253,814.43	
PFIZER INC	186,060	42.85	7,972,671.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,620	298.37	781,729.40	
SEATTLE GENETICS INC	3,440	63.18	217,339.20	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	32,880	8.20	269,616.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	13,354	286.21	3,822,048.34	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	8,680	176.16	1,529,068.80	
WATERS CORP	2,186	214.81	469,574.66	
ZOETIS INC	16,190	113.48	1,837,241.20	
BANK OF AMERICA CORP	308,079	28.99	8,931,210.21	
BB&T CORP	25,638	49.64	1,272,670.32	
CIT GROUP INC	2,655	50.92	135,192.60	
CITIGROUP INC	78,897	71.32	5,626,934.04	

CITIZENS FINANCIAL GROUP	15,590	34.94	544,714.60	
COMERICA INC	5,590	71.75	401,082.50	
EAST WEST BANCORP INC	4,480	45.46	203,660.80	
FIFTH THIRD BANCORP	28,379	27.85	790,355.15	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	5,280	94.23	497,534.40	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	31,560	13.70	432,372.00	
JPMORGAN CHASE & CO	109,840	115.12	12,644,780.80	
KEYCORP	30,878	17.38	536,659.64	
M & T BANK CORP	4,623	171.11	791,041.53	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	16,360	16.37	267,813.20	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	15,440	138.76	2,142,454.40	
REGIONS FINANCIAL CORP	33,384	14.94	498,756.96	
SIGNATURE BANK	2,310	125.40	289,674.00	
SUNTRUST BANKS INC	14,337	63.93	916,564.41	
SVB FINANCIAL GROUP	2,030	217.64	441,809.20	
US BANCORP	51,291	53.04	2,720,474.64	
WELLS FARGO & CO	145,200	45.30	6,577,560.00	
ZIONS BANCORP NA	5,800	45.49	263,842.00	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,330	87.71	116,654.30	
ALLY FINANCIAL INC	12,230	31.70	387,691.00	
AMERICAN EXPRESS CO	24,034	128.06	3,077,794.04	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,800	150.89	724,272.00	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	11,900	22.65	269,535.00	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	28,922	43.11	1,246,827.42	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	43,720	212.88	9,307,113.60	
BLACKROCK INC	4,015	477.17	1,915,837.55	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	15,235	89.93	1,370,083.55	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,180	114.08	362,774.40	
CME GROUP INC	12,090	203.48	2,460,073.20	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	11,030	80.94	892,768.20	
E*TRADE FINANCIAL CORP	7,540	46.40	349,856.00	
EATON VANCE CORP	3,200	44.21	141,472.00	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,200	283.06	339,672.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	11,655	35.32	411,654.60	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	11,188	215.52	2,411,237.76	

INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	19,090	91.77	1,751,889.30	
INVESCO LTD	10,627	19.90	211,477.30	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	6,485	21.34	138,389.90	
KKR & CO INC -A	17,080	26.05	444,934.00	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,100	363.11	399,421.00	
MOODY'S CORP	5,867	204.98	1,202,617.66	
MORGAN STANLEY	43,315	44.43	1,924,485.45	
MSCI INC	3,100	241.57	748,867.00	
NASDAQ INC	4,125	103.29	426,071.25	
NORTHERN TRUST CORP	6,460	89.49	578,105.40	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	4,130	85.87	354,643.10	
S&P GLOBAL INC	8,412	240.03	2,019,132.36	
SCHWAB (CHARLES) CORP	39,784	41.63	1,656,207.92	
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,385	56.39	303,660.15	
STATE STREET CORP	13,877	54.82	760,737.14	
SYNCHRONY FINANCIAL	20,960	36.03	755,188.80	
T ROWE PRICE GROUP INC	7,935	110.36	875,706.60	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	10,670	50.94	543,529.80	
VOYA FINANCIAL INC	6,040	56.84	343,313.60	
AFLAC INC	25,364	56.11	1,423,174.04	
ALLEGHANY CORP	440	697.00	306,680.00	
ALLSTATE CORP	10,643	104.85	1,115,918.55	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,960	105.15	206,094.00	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	29,825	56.03	1,671,094.75	
AON PLC	7,807	197.08	1,538,603.56	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	13,815	38.52	532,153.80	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	5,810	92.19	535,623.90	
ASSURANT INC	2,080	112.06	233,084.80	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	6,320	42.49	268,536.80	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	2,874	37.95	109,068.30	
CHUBB LTD	15,485	151.44	2,345,048.40	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,660	108.67	506,402.20	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	710	264.13	187,532.30	
EVEREST RE GROUP LTD	1,154	255.27	294,581.58	
FNF GROUP	9,791	41.58	407,109.78	

HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12,962	58.05	752,444.10	
LINCOLN NATIONAL CORP	7,573	66.81	505,952.13	
LOEWS CORP	10,195	54.80	558,686.00	
MARKEL CORP	520	1,100.56	572,291.20	
MARSH & MCLENNAN COS	16,393	102.59	1,681,757.87	
METLIFE INC	26,175	50.50	1,321,837.50	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	8,620	58.99	508,493.80	
PROGRESSIVE CORP	20,370	84.12	1,713,524.40	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,362	102.09	1,466,216.58	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,440	159.16	388,350.40	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,297	185.35	240,398.95	
TORCHMARK CORP	2,866	91.91	263,414.06	
TRAVELERS COS INC/THE	8,624	154.59	1,333,184.16	
UNUM GROUP	8,138	32.96	268,228.48	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,658	197.49	919,908.42	
WR BERKLEY CORP	5,004	68.39	342,223.56	
CBRE GROUP INC - A	11,880	52.56	624,412.80	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	34,300	6.64	227,752.00	
JONES LANG LASALLE INC	2,120	140.23	297,287.60	
ACCENTURE PLC-CL A	21,328	194.25	4,142,964.00	
ADOBE INC	16,359	305.70	5,000,946.30	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	4,860	83.37	405,178.20	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,270	150.75	191,452.50	
ANSYS INC	3,060	209.74	641,804.40	
AUTODESK INC	7,730	171.01	1,321,907.30	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	14,716	164.20	2,416,367.20	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	3,740	132.25	494,615.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	10,090	74.69	753,622.10	
CDK GLOBAL INC	3,490	50.93	177,745.70	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,960	116.25	460,350.00	
CITRIX SYSTEMS INC	3,888	100.85	392,104.80	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	20,298	65.95	1,338,653.10	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,230	139.59	171,695.70	
DOCUSIGN INC	3,320	53.62	178,018.40	
DROPBOX INC-CLASS A	6,480	25.45	164,916.00	

DXC TECHNOLOGY CO	9,803	56.88	557,594.64	
EPAM SYSTEMS INC	1,600	195.90	313,440.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	10,935	129.71	1,418,378.85	
FIRST DATA CORP- CLASS-A	19,730	27.91	550,664.30	
FISERV INC	13,826	93.91	1,298,399.66	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,990	291.00	870,090.00	
FORTINET INC	4,130	84.77	350,100.10	
GARTNER INC	2,760	169.02	466,495.20	
GLOBAL PAYMENTS INC	5,290	164.73	871,421.70	
GODADDY INC-CLASS A	6,500	73.62	478,530.00	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	29,792	143.53	4,276,045.76	
INTUIT INC	8,756	280.88	2,459,385.28	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,840	140.46	398,906.40	
LEIDOS HOLDINGS INC	5,260	82.04	431,530.40	
MASTERCARD INC	30,600	276.62	8,464,572.00	
MICROSOFT CORP	244,564	137.08	33,524,833.12	
MONGODB INC	960	151.79	145,718.40	
OKTA INC	3,030	134.85	408,595.50	
ORACLE CORP	84,323	58.61	4,942,171.03	
PALO ALTO NETWORKS INC	3,100	219.87	681,597.00	
PAYCHEX INC	10,432	85.66	893,605.12	
PAYCOM SOFTWARE INC	1,620	239.97	388,751.40	
PAYPAL HOLDINGS INC	37,407	119.71	4,477,991.97	
PTC INC	3,690	89.50	330,255.00	
SABRE CORP	10,440	23.18	241,999.20	
SALESFORCE.COM INC	25,760	157.13	4,047,668.80	
SERVICENOW INC	6,170	295.50	1,823,235.00	
SPLUNK INC	4,590	136.51	626,580.90	
SQUARE INC - A	10,760	80.59	867,148.40	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,540	58.89	502,920.60	
SYMANTEC CORP	22,205	23.57	523,371.85	
SYNOPSYS INC	5,327	135.91	723,992.57	
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	2,770	172.46	477,714.20	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	5,686	133.01	756,294.86	
TWILIO INC - A	3,560	142.59	507,620.40	

VERISIGN INC	3,340	217.54	726,583.60	
VISA INC-CLASS A SHARES	58,672	179.31	10,520,476.32	
VMWARE INC	2,805	172.29	483,273.45	
WESTERN UNION CO	12,691	20.53	260,546.23	
WIX.COM LTD	1,350	139.47	188,284.50	
WORKDAY INC-CLASS A	5,340	213.50	1,140,090.00	
WORLDPAY INC-CLASS A	10,050	131.21	1,318,660.50	
AMPHENOL CORP-CL A	9,660	97.85	945,231.00	
APPLE INC	158,342	204.50	32,380,939.00	
ARISTA NETWORKS INC	1,570	275.51	432,550.70	
ARROW ELECTRONICS INC	3,320	67.65	224,598.00	
CDW CORP/DE	4,510	114.36	515,763.60	
CISCO SYSTEMS INC	147,990	57.62	8,527,183.80	
COGNEX CORP	5,790	43.03	249,143.70	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	6,760	15.35	103,766.00	
CORNING INC	25,918	33.30	863,069.40	
DELL TECHNOLOGIES -C	4,782	56.01	267,839.82	
F5 NETWORKS INC	1,755	146.52	257,142.60	
FLEX LTD	18,516	9.65	178,679.40	
FLIR SYSTEMS INC	5,685	54.02	307,103.70	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	49,555	14.81	733,909.55	
HP INC	49,285	21.31	1,050,263.35	
IPG PHOTONICS CORP	1,160	132.86	154,117.60	
JUNIPER NETWORKS INC	11,503	27.29	313,916.87	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	6,890	89.42	616,103.80	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	5,475	171.53	939,126.75	
NETAPP INC	8,396	58.95	494,944.20	
SEAGATE TECHNOLOGY	8,964	47.36	424,535.04	
TE CONNECTIVITY LTD	11,205	90.05	1,009,010.25	
TRIMBLE INC	8,980	44.43	398,981.40	
WESTERN DIGITAL CORP	10,018	51.49	515,826.82	
XEROX CORP	8,148	35.31	287,705.88	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,690	199.32	336,850.80	
AT&T INC	244,547	33.58	8,211,888.26	
CENTURYLINK INC	30,316	12.16	368,642.56	

SPRINT CORP	24,810	7.22	179,128.20	
T-MOBILE US INC	11,852	79.04	936,782.08	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	138,857	57.41	7,971,780.37	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	7,450	33.49	249,500.50	
AES CORP	25,998	17.29	449,505.42	
ALLIANT ENERGY CORP	9,050	49.95	452,047.50	
AMEREN CORPORATION	8,722	76.23	664,878.06	
AMERICAN ELECTRIC POWER	16,068	90.51	1,454,314.68	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5,965	115.76	690,508.40	
ATMOS ENERGY CORP	3,530	107.10	378,063.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	15,042	28.90	434,713.80	
CMS ENERGY CORP	8,490	58.40	495,816.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	11,076	87.82	972,694.32	
DOMINION ENERGY INC	27,011	77.48	2,092,812.28	
DTE ENERGY COMPANY	6,598	129.55	854,770.90	
DUKE ENERGY CORP	24,256	89.03	2,159,511.68	
EDISON INTERNATIONAL	11,129	70.10	780,142.90	
ENTERGY CORP	5,817	104.88	610,086.96	
EVERGY INC	7,740	61.06	472,604.40	
EVERSOURCE ENERGY	10,350	77.09	797,881.50	
EXELON CORP	32,606	48.40	1,578,130.40	
FIRSTENERGY CORP	18,925	43.55	824,183.75	
NEXTERA ENERGY INC	15,985	207.88	3,322,961.80	
NISOURCE INC	12,390	29.14	361,044.60	
NRG ENERGY INC	8,860	34.09	302,037.40	
OGE ENERGY CORP	7,900	43.03	339,937.00	
PINNACLE WEST CAPITAL	4,109	93.30	383,369.70	
PPL CORP	26,288	30.36	798,103.68	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	17,358	60.51	1,050,332.58	
SEMPRA ENERGY	9,497	139.26	1,322,552.22	
SOUTHERN CO	34,615	55.66	1,926,670.90	
UGI CORP	5,860	52.60	308,236.00	
VISTRA ENERGY CORP	11,390	21.97	250,238.30	
WEC ENERGY GROUP INC	11,150	86.14	960,461.00	
XCEL ENERGY INC	17,644	61.00	1,076,284.00	

	ADVANCED MICRO DEVICES	33,090	33.85	1,120,096.50	
	ANALOG DEVICES INC	11,850	115.46	1,368,201.00	
	APPLIED MATERIALS INC	33,213	46.01	1,528,130.13	
	BROADCOM INC	13,340	284.13	3,790,294.20	
	INTEL CORP	151,152	49.17	7,432,143.84	
	KLA CORP	5,499	122.50	673,627.50	
	LAM RESEARCH CORP	4,937	189.81	937,091.97	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	22,674	25.73	583,402.02	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	8,680	61.52	533,993.60	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	7,754	90.75	703,675.50	
	MICRON TECHNOLOGY INC	38,927	43.06	1,676,196.62	
	NVIDIA CORP	19,405	167.08	3,242,187.40	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	10,217	97.01	991,151.17	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	12,520	20.35	254,782.00	
	QORVO INC	3,530	70.55	249,041.50	
	QUALCOMM INC	40,792	75.67	3,086,730.64	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	5,160	81.31	419,559.60	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	31,622	118.68	3,752,898.96	
	XILINX INC	8,205	121.23	994,692.15	
米ドル小計		10,165,341		862,217,208.20 (93,395,367,991)	
加ドル	CAMECO CORP	11,792	13.16	155,182.72	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	40,234	35.25	1,418,248.50	
	CENOVUS ENERGY INC	38,273	12.33	471,906.09	
	ENBRIDGE INC	68,247	47.00	3,207,609.00	
	ENCANA CORP	48,808	6.08	296,752.64	
	HUSKY ENERGY INC	10,473	11.80	123,581.40	
	IMPERIAL OIL LTD	7,132	37.01	263,955.32	
	INTER PIPELINE LTD	16,700	22.56	376,752.00	
	KEYERA CORP	7,360	35.65	262,384.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	17,482	49.98	873,750.36	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	6,890	18.71	128,911.90	
	SUNCOR ENERGY INC	52,799	41.27	2,179,014.73	
	TC ENERGY CORP	31,653	65.83	2,083,716.99	
	TOURMALINE OIL CORP	6,635	17.52	116,245.20	

VERMILION ENERGY INC	3,840	28.21	108,326.40	
AGNICO EAGLE MINES LTD	9,115	67.41	614,442.15	
BARRICK GOLD CORP	57,254	21.03	1,204,051.62	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	4,870	67.24	327,458.80	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	20,680	12.69	262,429.20	
FRANCO-NEVADA CORP	6,395	110.98	709,717.10	
KINROSS GOLD CORP	38,165	5.27	201,129.55	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	6,200	57.65	357,430.00	
LUNDIN MINING CORP	21,110	7.19	151,780.90	
METHANEX CORP	2,760	55.87	154,201.20	
NUTRIEN LTD	19,418	66.65	1,294,209.70	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	16,595	28.80	477,936.00	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,460	55.00	80,300.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	13,045	32.27	420,962.15	
BOMBARDIER INC 'B'	54,436	2.24	121,936.64	
CAE INC	8,775	35.87	314,759.25	
SNC-LAVALIN GROUP INC	6,175	25.63	158,265.25	
WSP GLOBAL INC	3,500	74.58	261,030.00	
THOMSON REUTERS CORP	7,436	88.38	657,193.68	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	24,458	124.57	3,046,733.06	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	4,495	322.25	1,448,513.75	
MAGNA INTERNATIONAL INC	10,818	63.22	683,913.96	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,590	52.73	347,490.70	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	8,618	94.17	811,557.06	
STARS GROUP INC/THE	7,400	22.17	164,058.00	
QUEBECOR INC -CL B	6,060	31.07	188,284.20	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	14,905	26.28	391,703.40	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,670	145.20	242,484.00	
DOLLARAMA INC	10,260	50.28	515,872.80	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	15,400	82.92	1,276,968.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	5,090	33.54	170,718.60	
LOBLAW COMPANIES LTD	6,039	66.86	403,767.54	
METRO INC	9,270	49.67	460,440.90	
WESTON (GEORGE) LTD	2,998	100.87	302,408.26	
SAPUTO INC	6,060	39.28	238,036.80	

AURORA CANNABIS INC	22,780	9.37	213,448.60	
BAUSCH HEALTH COS INC	9,574	30.34	290,475.16	
CANOPY GROWTH CORP	6,180	46.56	287,740.80	
CRONOS GROUP INC	4,900	19.57	95,893.00	
BANK OF MONTREAL	22,261	99.43	2,213,411.23	
BANK OF NOVA SCOTIA	41,379	69.42	2,872,530.18	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	14,405	102.34	1,474,207.70	
NATIONAL BANK OF CANADA	10,100	63.23	638,623.00	
ROYAL BANK OF CANADA	48,309	104.42	5,044,425.78	
TORONTO-DOMINION BANK	61,670	76.71	4,730,705.70	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	27,153	63.68	1,729,103.04	
CI FINANCIAL CORP	9,570	21.58	206,520.60	
IGM FINANCIAL INC	3,295	37.72	124,287.40	
ONEX CORPORATION	2,315	80.66	186,727.90	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	860	624.05	536,683.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	9,944	29.85	296,828.40	
IA FINANCIAL CORP INC	3,855	53.77	207,283.35	
INTACT FINANCIAL CORP	4,855	126.00	611,730.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	66,801	24.17	1,614,580.17	
POWER CORP OF CANADA	12,630	28.34	357,934.20	
POWER FINANCIAL CORP	9,665	29.75	287,533.75	
SUN LIFE FINANCIAL INC	19,494	55.43	1,080,552.42	
FIRST CAPITAL REALTY INC	5,720	21.95	125,554.00	
BLACKBERRY LTD	16,618	9.34	155,212.12	
CGI INC	9,060	102.34	927,200.40	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	715	1,244.12	889,545.80	
OPEN TEXT CORP	9,830	55.52	545,761.60	
SHOPIFY INC - CLASS-A	3,500	415.60	1,454,600.00	
BCE INC	4,170	60.00	250,200.00	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	13,145	70.33	924,487.85	
TELUS CORP	7,466	48.32	360,757.12	
ALTAGAS LTD	7,050	19.90	140,295.00	
ATCO LTD -CLASS I	1,920	43.45	83,424.00	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,330	36.26	157,005.80	
EMERA INC	2,130	53.80	114,594.00	

	FORTIS INC	13,445	51.79	696,316.55	
	HYDRO ONE LTD	9,070	23.15	209,970.50	
加ドル小計		1,326,002		62,664,671.59 (5,184,248,280)	
ユーロ	ENI SPA	89,326	14.66	1,310,055.11	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	14,375	14.00	201,321.87	
	NESTE OYJ	15,690	30.72	481,996.80	
	OMV AG	3,940	43.79	172,532.60	
	REPSOL SA	50,799	13.78	700,010.22	
	TENARIS SA	19,815	12.01	238,077.22	
	TOTAL SA	80,047	49.96	3,999,548.35	
	VOPAK	2,090	43.36	90,622.40	
	AIR LIQUIDE SA	14,519	123.05	1,786,562.95	
	AKZO NOBEL	8,177	83.66	684,087.82	
	ARCELORMITTAL	26,232	15.60	409,376.59	
	ARKEMA	1,885	84.44	159,169.40	
	BASF SE	31,095	61.71	1,918,872.45	
	COVESTRO AG	6,340	42.92	272,112.80	
	CRH PLC	26,340	30.20	795,468.00	
	EVONIK INDUSTRIES AG	6,800	25.83	175,644.00	
	FUCHS PETROLUB SE-PRF	2,920	35.92	104,886.40	
	HEIDELBERGCEMENT AG	5,395	68.38	368,910.10	
	IMERYS SA	830	44.98	37,333.40	
	KONINKLIJKE DSM NV	6,482	114.65	743,161.30	
	LANXESS AG	3,295	55.96	184,388.20	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	9,140	29.00	265,060.00	
	SOLVAY SA	2,241	90.98	203,886.18	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	17,535	10.13	177,717.22	
	SYMRISE AG	4,770	83.82	399,821.40	
	THYSSENKRUPP AG	11,595	11.59	134,444.02	
	UMICORE	5,130	26.94	138,202.20	
	UPM-KYMMENE OYJ	19,978	22.83	456,097.74	
	VOESTALPINE AG	4,239	24.17	102,456.63	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,926	39.25	350,345.50	
	AIRBUS GROUP SE	19,638	131.14	2,575,327.32	

ALSTOM	5,240	37.77	197,914.80	
ANDRITZ AG	2,250	31.62	71,145.00	
BOUYGUES SA	8,880	32.90	292,152.00	
BRENNTAG AG	3,925	43.74	171,679.50	
CNH INDUSTRIAL NV	34,270	9.34	320,081.80	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	17,476	34.67	605,892.92	
DASSAULT AVIATION SA	80	1,213.00	97,040.00	
EIFFAGE	2,300	92.26	212,198.00	
FERROVIAL SA	18,505	23.67	438,013.35	
GEA GROUP AG	3,940	22.09	87,034.60	
HOCHTIEF AG	870	111.90	97,353.00	
KINGSPAN GROUP PLC	5,770	47.04	271,420.80	
KION GROUP AG	2,380	53.30	126,854.00	
KNORR-BREMSE AG	1,770	95.70	169,389.00	
KONE OYJ-B	11,864	50.92	604,114.88	
LEGRAND SA	8,238	63.68	524,595.84	
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	13,210	11.66	154,094.65	
METSO OYJ	4,110	35.66	146,562.60	
MTU AERO ENGINES AG	1,940	220.20	427,188.00	
PRYSMIAN SPA	6,315	19.09	120,553.35	
SAFRAN SA	11,430	130.20	1,488,186.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	19,208	77.98	1,497,839.84	
SIEMENS AG-REG	25,796	100.34	2,588,370.64	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	6,990	15.16	106,003.35	
THALES SA	3,425	105.20	360,310.00	
VINCI SA	17,700	94.30	1,669,110.00	
WARTSILA OYJ ABP	12,830	12.47	160,054.25	
BUREAU VERITAS SA	8,660	21.91	189,740.60	
EDENRED	7,456	44.93	334,998.08	
RANDSTAD NV	3,115	46.07	143,508.05	
SOCIETE BIC SA	955	70.15	66,993.25	
TELEPERFORMANCE	2,030	177.80	360,934.00	
WOLTERS KLUWER	9,257	64.84	600,223.88	
ADP	1,130	162.10	183,173.00	
AENA SA	2,200	175.55	386,210.00	

ATLANTIA SPA	14,220	24.08	342,417.60	
BOLLORE	34,310	4.02	138,063.44	
DEUTCHE LUFTHANSA	7,050	15.26	107,583.00	
DEUTSCHE POST AG-REG	33,373	29.54	985,838.42	
FRAPORT AG	1,680	73.98	124,286.40	
GETLINK	11,810	13.69	161,678.90	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	10,805	67.12	725,231.60	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,720	56.55	97,266.00	
CONTINENTAL AG	3,975	119.92	476,682.00	
DAIMLER AG	31,132	46.82	1,457,600.24	
FAURECIA	2,770	39.27	108,777.90	
FERRARI NV	3,974	151.30	601,266.20	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	36,917	12.18	449,649.06	
MICHELIN (CGDE)-B	5,789	110.00	636,790.00	
NOKIAN RENKAAT OYJ	4,535	27.89	126,481.15	
PEUGEOT SA	17,790	22.32	397,072.80	
PIRELLI & C SPA	14,070	5.55	78,144.78	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	6,110	61.42	375,276.20	
RENAULT SA	6,187	52.59	325,374.33	
VALEO SA	9,660	25.86	249,807.60	
VOLKSWAGEN AG	1,041	157.50	163,957.50	
VOLKSWAGEN AG-PFD	6,003	154.94	930,104.82	
ADIDAS AG	6,101	280.70	1,712,550.70	
ESSILORLUXOTTICA	9,595	118.25	1,134,608.75	
HERMES INTERNATIONAL	1,157	634.00	733,538.00	
HUGO BOSS AG -ORD	2,070	57.40	118,818.00	
KERING	2,627	530.60	1,393,886.20	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	9,304	385.30	3,584,831.20	
MONCLER SPA	5,420	38.50	208,670.00	
PUMA SE	2,190	59.45	130,195.50	
SEB SA	770	166.60	128,282.00	
ACCOR SA	5,426	39.85	216,226.10	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,150	77.52	166,668.00	
SODEXO	3,380	102.50	346,450.00	
AXEL SPRINGER SE	1,705	62.05	105,795.25	

EUTELSAT COMMUNICATIONS	5,925	17.36	102,887.62	
JC DECAUX SA	2,720	26.02	70,774.40	
PUBLICIS GROUPE	6,385	48.28	308,267.80	
RTL GROUP	1,470	46.14	67,825.80	
SES	15,290	13.77	210,543.30	
TELENET GROUP HOLDING NV	1,240	45.70	56,668.00	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,000	73.70	221,100.00	
VIVENDI	29,120	24.91	725,379.20	
DELIVERY HERO SE	3,270	40.70	133,089.00	
INDITEX	38,355	27.59	1,058,214.45	
ZALANDO SE	3,330	42.14	140,326.20	
CARREFOUR SA	20,853	18.00	375,354.00	
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,304	33.23	76,561.92	
COLRUYT SA	2,315	49.05	113,550.75	
JERONIMO MARTINS	8,855	14.87	131,718.12	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	38,278	20.54	786,230.12	
METRO WHOLESALE & FOOD SPECI	7,040	15.95	112,288.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	25,721	78.75	2,025,528.75	
DANONE	19,964	75.68	1,510,875.52	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	14,820	8.66	128,341.20	
HEINEKEN HOLDING NV	3,265	94.05	307,073.25	
HEINEKEN NV	8,923	100.05	892,746.15	
KERRY GROUP PLC-A	5,630	108.00	608,040.00	
PERNOD-RICARD SA	6,956	157.05	1,092,439.80	
REMY COINTREAU	810	127.30	103,113.00	
BEIERSDORF AG	3,645	106.55	388,374.75	
HENKEL AG & CO KGAA	4,100	82.25	337,225.00	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	5,993	89.60	536,972.80	
L'OREAL	8,431	251.30	2,118,710.30	
UNILEVER NV	49,135	54.31	2,668,521.85	
BIOMERIEUX	1,070	72.55	77,628.50	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,280	95.30	121,984.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	7,903	70.60	557,951.80	
FRESENIUS SE & CO KGAA	14,825	46.77	693,439.37	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	29,971	39.87	1,195,093.62	

SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,050	184.10	193,305.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	5,680	35.91	203,968.80	
BAYER AG-REG	31,494	59.08	1,860,665.52	
EUROFINS SCIENTIFIC	470	393.80	185,086.00	
GRIFOLS SA	8,040	28.47	228,898.80	
IPSEN	1,330	114.50	152,285.00	
MERCK KGAA	4,270	92.66	395,658.20	
ORION OYJ-CLASS B	3,080	33.67	103,703.60	
QIAGEN N.V.	7,264	35.25	256,056.00	
RECORDATI SPA	4,230	39.33	166,365.90	
SANOFI	37,706	74.32	2,802,309.92	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,120	138.60	155,232.00	
UCB SA	4,528	71.30	322,846.40	
ABN AMRO BANK NV-CVA	16,560	19.52	323,251.20	
AIB GROUP PLC	25,300	3.66	92,598.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	218,893	4.97	1,088,117.10	
BANCO DE SABADELL SA	227,252	0.96	218,161.92	
BANCO SANTANDER SA	547,789	4.22	2,311,943.47	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	40,719	4.59	186,900.21	
BANKIA SA	33,700	2.13	72,016.90	
BANKINTER SA	23,710	6.56	155,537.60	
BNP PARIBAS	37,832	43.20	1,634,531.56	
CAIXABANK S.A	106,970	2.60	278,122.00	
COMMERZBANK AG	30,914	6.63	205,145.30	
CREDIT AGRICOLE SA	34,822	11.12	387,220.64	
ERSTE GROUP BANK AG	11,618	33.97	394,663.46	
FINECOBANK SPA	15,600	10.22	159,510.00	
ING GROEP NV-CVA	125,735	10.48	1,318,708.68	
INTESA SANPAOLO	482,693	2.06	995,312.96	
KBC GROEP NV	8,939	60.14	537,591.46	
MEDIOBANCA SPA	20,820	9.42	196,166.04	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	4,580	21.96	100,576.80	
SOCIETE GENERALE	25,449	23.10	587,871.90	
UNICREDIT SPA	66,956	11.73	785,795.61	
AMUNDI SA	1,940	62.20	120,668.00	

DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	71,665	7.18	514,769.69	
DEUTSCHE BOERSE AG	6,700	127.55	854,585.00	
EURAZEO SE	1,107	61.05	67,582.35	
EXOR NV	3,474	63.34	220,043.16	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,672	85.80	229,257.60	
NATIXIS	29,240	3.73	109,152.92	
WENDEL	1,010	122.20	123,422.00	
AEGON NV	52,759	4.59	242,216.56	
AGEAS	6,154	48.77	300,130.58	
ALLIANZ SE-REG	14,188	217.55	3,086,599.40	
ASSICURAZIONI GENERALI	35,808	17.16	614,644.32	
AXA	62,942	23.88	1,503,054.96	
CNP ASSURANCES	6,040	20.42	123,336.80	
HANNOVER RUECK SE-REG	1,725	144.00	248,400.00	
MAPFRE SA	35,184	2.70	95,172.72	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	4,886	223.50	1,092,021.00	
NN GROUP NV	11,090	36.06	399,905.40	
POSTE ITALIANE SPA	16,160	9.61	155,394.56	
SAMPO OYJ-A SHS	14,249	42.25	602,020.25	
SCOR SE	4,762	39.37	187,479.94	
AROUNDTOWN SA	30,870	7.39	228,129.30	
DEUTSCHE WOHNEN SE	11,050	32.31	357,025.50	
VONOVIA SE	15,968	43.47	694,128.96	
ADYEN NV	300	686.00	205,800.00	
AMADEUS IT GROUP SA	14,970	73.60	1,101,792.00	
ATOS SE	3,460	79.24	274,170.40	
CAP GEMINI SA	5,619	114.60	643,937.40	
DASSAULT SYSTEMES SA	4,300	138.35	594,905.00	
SAP SE	32,962	120.98	3,987,742.76	
WIRECARD AG	3,760	146.95	552,532.00	
WORLDLINE SA	3,120	64.55	201,396.00	
INGENICO GROUP	1,960	78.70	154,252.00	
NOKIA OYJ	190,396	4.57	871,918.48	
CELLNEX TELECOM SAU	5,700	32.89	187,473.00	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	112,616	15.00	1,689,240.00	

	DRILLISCH AG	1,640	30.24	49,593.60	
	ELISA OYJ	4,405	40.98	180,516.90	
	ILIAD SA	890	94.30	83,927.00	
	KONINKLIJKE KPN NV	108,506	2.62	284,285.72	
	ORANGE S.A.	63,984	13.33	852,906.72	
	PROXIMUS	4,970	25.11	124,796.70	
	TELECOM ITALIA SPA	352,713	0.50	177,555.72	
	TELECOM ITALIA-RSP	211,957	0.47	100,552.40	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	32,570	2.22	72,305.40	
	TELEFONICA SA	152,069	7.41	1,128,199.91	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,020	28.55	114,771.00	
	E.ON SE	78,269	9.40	735,728.60	
	EDF	21,825	11.05	241,275.37	
	ENAGAS SA	7,610	19.12	145,503.20	
	ENDESA SA	9,620	22.54	216,834.80	
	ENEL SPA	271,167	6.45	1,749,298.31	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	72,391	3.37	243,957.67	
	ENGIE	59,244	13.76	815,493.66	
	FORTUM OYJ	16,625	20.42	339,482.50	
	IBERDROLA SA	202,902	8.56	1,738,058.53	
	IBERDROLA SA-RTS	190,852	0.20	38,170.40	
	INNOGY SE	4,300	42.65	183,395.00	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	10,262	22.53	231,202.86	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	16,720	17.45	291,764.00	
	RWE AG	18,745	23.44	439,382.80	
	SNAM SPA	59,280	4.64	275,296.32	
	SUEZ	12,499	13.03	162,861.97	
	TERNA SPA	54,797	5.73	314,425.18	
	UNIPER SE	5,900	27.43	161,837.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	17,364	22.59	392,252.76	
	VERBUND AG	1,750	48.26	84,455.00	
	ASML HOLDING NV	14,352	184.46	2,647,369.92	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	43,955	16.31	717,169.78	
	STMICROELECTRONICS NV	26,033	15.88	413,534.20	
		6,716,212		131,441,722.06	

ユーロ小計				(15,959,653,892)	
英ポンド	BP PLC	682,018	5.43	3,707,449.84	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	148,288	25.93	3,845,107.84	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	126,159	25.94	3,273,195.25	
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	17,360	5.28	91,730.24	
	ANGLO AMERICAN PLC	34,164	22.03	752,803.74	
	ANTOFAGASTA PLC	14,940	9.21	137,657.16	
	BHP GROUP PLC	69,071	20.30	1,402,141.30	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	3,661	48.76	178,510.36	
	EVRAZ PLC	16,000	6.45	103,296.00	
	FRESNILLO PLC	8,070	9.21	74,340.84	
	GLENCORE PLC	376,813	2.72	1,027,569.05	
	JOHNSON MATTHEY PLC	6,669	33.87	225,879.03	
	MONDI PLC	15,280	18.14	277,255.60	
	RIO TINTO PLC	38,475	48.50	1,866,037.50	
	ASHTEAD GROUP PLC	14,210	22.89	325,266.90	
	BAE SYSTEMS PLC ORD	113,035	5.16	584,164.88	
	BUNZL PLC	9,666	21.78	210,525.48	
	DCC PLC	3,950	69.90	276,105.00	
	FERGUSON PLC	6,992	59.14	413,506.88	
	MEGGITT PLC	27,315	5.57	152,199.18	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	139,600	1.87	262,099.00	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	55,415	8.65	479,783.07	
	SMITHS GROUP PLC	13,793	16.10	222,136.26	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,460	88.45	217,587.00	
	WEIR GROUP PLC/THE	10,140	15.19	154,026.60	
	EXPERIAN PLC	32,078	23.90	766,664.20	
	G4S PLC	58,799	1.95	114,893.24	
	INTERTEK GROUP PLC	6,335	56.22	356,153.70	
	RELX PLC	63,645	19.65	1,250,624.25	
	RENTOKIL INITIAL PLC	57,540	4.19	241,207.68	
	EASYJET PLC	6,550	10.49	68,742.25	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	33,500	6.25	209,576.00	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS	4,010	38.27	153,462.70	
	BURBERRY GROUP PLC	11,654	22.77	265,361.58	

PERSIMMON PLC	11,260	19.28	217,149.10	
TAYLOR WIMPEY PLC	92,590	1.63	151,477.24	
CARNIVAL PLC	6,090	35.95	218,935.50	
COMPASS GROUP PLC	51,618	19.68	1,016,100.33	
GVC HOLDINGS PLC	16,090	6.08	97,955.92	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	6,273	55.75	349,719.75	
MERLIN ENTERTAINME	25,700	4.50	115,650.00	
TUI AG-DI	14,113	7.91	111,746.73	
WHITBREAD PLC	7,010	48.77	341,877.70	
AUTO TRADER GROUP PLC	33,020	5.50	181,610.00	
INFORMA PLC	40,340	8.42	339,824.16	
ITV PLC	118,275	1.11	131,640.07	
PEARSON PLC	29,059	8.93	259,554.98	
WPP PLC	46,704	9.60	448,358.40	
KINGFISHER PLC	69,577	2.23	155,435.01	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	64,664	2.07	134,371.79	
NEXT PLC	4,087	54.60	223,150.20	
OCADO GROUP PLC	13,430	11.47	154,109.25	
SAINSBURY (J) PLC	72,601	2.01	146,000.61	
TESCO PLC	337,874	2.38	807,180.98	
WM MORRISON SUPERMARKETS	86,455	2.07	179,480.58	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	10,755	23.13	248,763.15	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	77,347	29.51	2,282,896.70	
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,420	27.01	227,424.20	
DIAGEO PLC	80,992	34.20	2,769,926.40	
IMPERIAL BRANDS PLC	34,092	20.51	699,226.92	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	23,915	66.39	1,587,716.85	
UNILEVER PLC	37,427	50.91	1,905,408.57	
NMC HEALTH PLC	3,660	22.94	83,960.40	
SMITH & NEPHEW PLC	31,716	17.55	556,615.80	
ASTRAZENECA PLC	42,373	64.11	2,716,533.03	
GLAXOSMITHKLINE PLC	166,131	16.65	2,766,081.15	
BARCLAYS PLC	585,791	1.58	926,018.41	
HSBC HOLDINGS PLC	672,731	6.70	4,510,661.35	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,438,836	0.57	1,414,037.11	

	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	140,780	2.29	323,653.22	
	STANDARD CHARTERED PLC	99,590	7.21	718,243.08	
	3I GROUP PLC	35,779	11.36	406,628.33	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	8,340	20.57	171,553.80	
	INVESTEC PLC	21,805	5.17	112,862.68	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	9,637	57.54	554,512.98	
	SCHRODERS PLC	4,101	30.16	123,686.16	
	ST JAMES'S PLACE PLC	20,690	11.42	236,279.80	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	85,115	3.04	259,090.06	
	ADMIRAL GROUP PLC	6,455	22.78	147,044.90	
	AVIVA PLC	124,545	4.25	529,689.88	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	44,053	3.36	148,194.29	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	193,301	2.72	525,972.02	
	PRUDENTIAL PLC	87,642	17.56	1,539,431.73	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	34,438	5.97	205,594.86	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	10,079	16.84	169,810.99	
	SAGE GROUP PLC/THE	38,650	8.15	314,997.50	
	HALMA PLC	12,580	20.14	253,361.20	
	BT GROUP PLC	277,752	1.90	527,728.80	
	VODAFONE GROUP PLC	919,388	1.28	1,177,552.15	
	CENTRICA PLC	163,175	0.88	143,757.17	
	NATIONAL GRID PLC	112,178	8.30	931,077.40	
	SEVERN TRENT PLC	6,043	20.07	121,283.01	
	SSE PLC	38,947	11.51	448,474.70	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	28,615	7.63	218,389.68	
英ポンド小計		10,112,349		62,472,528.33 (8,396,307,807)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	7,550	19.62	148,168.75	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	290	613.00	177,770.00	
	GIVAUDAN-REG	303	2,760.00	836,280.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	17,629	48.75	859,413.75	
	SIKA AG-REG	4,480	155.25	695,520.00	
	ABB LTD-REG	63,935	18.77	1,200,379.62	
	GEBERIT AG-REG	1,110	461.60	512,376.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	760	209.80	159,448.00	

	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,150	214.60	246,790.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	4,787	53.44	255,817.28	
	SGS SA-REG	198	2,504.00	495,792.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,650	143.95	237,517.50	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	18,299	84.16	1,540,043.84	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,040	289.40	300,976.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,870	54.05	101,073.50	
	DUFRY AG-REG	1,570	85.36	134,015.20	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	75	1,952.00	146,400.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	33	7,045.00	232,485.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	79,000.00	237,000.00	
	NESTLE SA-REG	102,943	101.90	10,489,891.70	
	ALCON INC	15,314	59.88	917,002.32	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,670	222.80	372,076.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	320	837.80	268,096.00	
	LONZA GROUP AG-REG	2,438	337.00	821,606.00	
	NOVARTIS AG-REG	72,673	88.03	6,397,404.19	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	23,598	266.05	6,278,247.90	
	VIFOR PHARMA AG	1,840	144.95	266,708.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	84,848	12.39	1,051,690.96	
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,370	42.89	358,989.30	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,295	74.60	96,607.00	
	PARTNERS GROUP HOLDIING AG	575	788.80	453,560.00	
	UBS GROUP AG-REG	132,412	12.05	1,596,226.66	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,580	180.50	285,190.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,080	492.50	531,900.00	
	SWISS RE AG	10,869	96.24	1,046,032.56	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,141	343.60	1,766,447.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,551	86.25	220,023.75	
	TEMENOS AG	1,980	174.90	346,302.00	
	SWISSCOM AG-REG	904	479.20	433,196.80	
スイスフラン小計		599,133		42,514,465.18 (4,660,010,528)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	7,310	307.90	2,250,749.00	
	BOLIDEN AB	9,430	222.20	2,095,346.00	

	ALFA LAVAL AB	13,200	205.10	2,707,320.00	
	ASSA ABLOY AB-B	32,720	216.10	7,070,792.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	22,345	285.20	6,372,794.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	12,020	256.20	3,079,524.00	
	EPIROC AB-A	20,385	95.50	1,946,767.50	
	EPIROC AB-B	14,810	90.96	1,347,117.60	
	SANDVIK AB	36,080	158.85	5,731,308.00	
	SKANSKA AB-B SHS	11,960	178.20	2,131,272.00	
	SKF AB-B SHARES-B	11,729	160.65	1,884,263.85	
	VOLVO AB-B SHS-B	48,450	146.95	7,119,727.50	
	SECURITAS AB-B SHS	8,769	167.20	1,466,176.80	
	ELECTROLUX AB - B	8,065	238.40	1,922,696.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	14,680	80.36	1,179,684.80	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	24,438	169.78	4,149,083.64	
	ICA GRUPPEN AB	2,490	413.90	1,030,611.00	
	SWEDISH MATCH AB	6,040	405.80	2,451,032.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	21,305	289.20	6,161,406.00	
	NORDEA BANK ABP	110,598	71.00	7,852,458.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	51,240	93.72	4,802,212.80	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	51,010	98.06	5,002,040.60	
	SWEDBANK AB - A SHARES	28,560	145.00	4,141,200.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,870	216.00	1,267,920.00	
	INVESTOR AB-B SHS	15,045	454.80	6,842,466.00	
	KINNEVIK AB - B	8,115	245.80	1,994,667.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,350	355.80	836,130.00	
	ERICSSON LM-B SHS	96,675	90.38	8,737,486.50	
	HEXAGON AB-B SHS	7,700	474.50	3,653,650.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2,330	542.50	1,264,025.00	
	TELE2 AB-B SHS	14,755	129.00	1,903,395.00	
	TELIA CO AB	104,170	42.59	4,436,600.30	
スウェーデンクローナ小計		824,644		114,831,922.89 (1,325,160,390)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	3,800	259.00	984,200.00	
	EQUINOR ASA	36,894	167.70	6,187,123.80	
	NORSK HYDRO A S	36,870	31.20	1,150,344.00	

	YARA INTERNATIONAL ASA	5,780	407.50	2,355,350.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,020	216.60	654,132.00	
	MOWI ASA	15,540	215.30	3,345,762.00	
	ORKLA ASA	26,610	76.00	2,022,360.00	
	DNB ASA	32,415	159.95	5,184,779.25	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,030	179.90	1,264,697.00	
	TELENOR ASA	23,395	174.40	4,080,088.00	
ノルウェークローネ小計		191,354		27,228,836.05 (343,900,199)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,230	595.00	1,921,850.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	6,325	312.80	1,978,460.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	6,570	588.60	3,867,102.00	
	ISS A/S	4,720	194.05	915,916.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	125	7,460.00	932,500.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	253	7,884.00	1,994,652.00	
	DSV A/S	5,430	647.60	3,516,468.00	
	PANDORA A/S	2,900	264.10	765,890.00	
	CARLSBERG AS-B	3,650	896.00	3,270,400.00	
	COLOPLAST-B	4,445	789.20	3,507,994.00	
	DEMANT A/S	4,440	198.95	883,338.00	
	GENMAB A/S	1,770	1,219.50	2,158,515.00	
	H LUNDBECK A/S	2,450	260.00	637,000.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	58,035	319.05	18,516,066.75	
	DANSKE BANK A/S	21,315	105.05	2,239,140.75	
	TRYG A/S	3,635	218.20	793,157.00	
	ORSTED A/S	6,480	615.00	3,985,200.00	
デンマーククローネ小計		135,773		51,883,649.50 (843,628,140)	
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	8,355	25.40	212,217.00	
	OIL SEARCH LTD	43,280	7.18	310,750.40	
	ORIGIN ENERGY LTD	68,720	7.42	509,902.40	
	SANTOS LTD	53,355	7.09	378,286.95	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	30,583	35.06	1,072,239.98	
	WORLEYPARSONS LTD	12,600	14.71	185,346.00	
	ALUMINA LTD	75,722	2.19	165,831.18	

BHP GROUP LTD	99,336	41.16	4,088,669.76	
BLUESCOPE STEEL LTD	18,750	12.08	226,500.00	
BORAL LTD	42,795	5.34	228,525.30	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	48,165	8.99	433,003.35	
INCITEC PIVOT LTD	44,370	3.17	140,652.90	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	18,225	18.52	337,527.00	
NEWCREST MINING LTD	23,029	31.85	733,473.65	
ORICA LIMITED	12,155	19.91	242,006.05	
RIO TINTO LTD	13,348	103.25	1,378,181.00	
SOUTH32 LTD	194,147	3.04	590,206.88	
CIMIC GROUP LTD	2,897	45.27	131,147.19	
BRAMBLES LTD	51,068	12.22	624,050.96	
SEEK LTD	11,730	21.63	253,719.90	
AURIZON HOLDINGS LTD	64,970	5.53	359,284.10	
SYDNEY AIRPORT	33,726	7.87	265,423.62	
TRANSURBAN GROUP	86,269	14.85	1,281,094.65	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	19,040	29.19	555,777.60	
CROWN RESORTS LTD	11,245	12.73	143,148.85	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,010	38.58	77,545.80	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	1,630	43.45	70,823.50	
TABCORP HOLDINGS LTD	61,274	4.64	284,311.36	
REA GROUP LTD	1,800	98.10	176,580.00	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	11,392	4.22	48,074.24	
WESFARMERS LTD	39,035	38.03	1,484,501.05	
COLES GROUP LTD	40,685	13.86	563,894.10	
WOOLWORTHS GROUP LTD	44,962	34.06	1,531,405.72	
COCA-COLA AMATIL LTD	17,820	10.40	185,328.00	
TREASURY WINE ESTATES LTD	26,956	15.95	429,948.20	
COCHLEAR LTD	1,807	221.28	399,852.96	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	4,375	72.50	317,187.50	
SONIC HEALTHCARE LTD	14,020	27.70	388,354.00	
CSL LTD	15,292	222.59	3,403,846.28	
AUST AND NZ BANKING GROUP	96,569	26.99	2,606,397.31	
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	14,130	9.24	130,561.20	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	17,778	11.40	202,669.20	

	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	59,657	80.85	4,823,268.45	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	93,003	26.84	2,496,200.52	
	WESTPAC BANKING CORP	116,391	27.66	3,219,375.06	
	AMP LTD	86,827	1.78	154,552.06	
	ASX LTD	5,545	86.02	476,980.90	
	CHALLENGER LTD	20,840	6.73	140,253.20	
	MACQUARIE GROUP LTD	10,144	126.50	1,283,216.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	68,875	8.38	577,172.50	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	104,360	3.58	373,608.80	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	38,980	11.66	454,506.80	
	SUNCORP GROUP LTD	45,280	13.16	595,884.80	
	COMPUTERSHARE LTD	14,790	16.27	240,633.30	
	TELSTRA CORPORATION LTD	117,984	3.74	441,260.16	
	TPG TELECOM LTD	7,840	6.46	50,646.40	
	AGL ENERGY LTD	19,021	20.47	389,359.87	
	APA GROUP	37,738	10.82	408,325.16	
	AUSNET SERVICES	69,210	1.86	129,076.65	
豪ドル小計		2,415,900		43,402,567.72 (3,299,029,172)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	30,583	5.17	158,114.11	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	36,555	9.48	346,541.40	
	A2 MILK CO LTD	20,800	16.40	341,120.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	15,790	15.46	244,113.40	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	14,200	12.56	178,352.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	52,077	3.89	202,839.91	
	MERIDIAN ENERGY LTD	37,050	4.78	177,099.00	
ニュージーランドドル小計		207,055		1,648,179.82 (119,674,336)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	86,708	76.85	6,663,509.80	
	NWS HOLDINGS LTD	48,500	15.54	753,690.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	40,000	59.55	2,382,000.00	
	MTR CORP	52,000	55.20	2,870,400.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	24,500	22.05	540,225.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	65,000	57.30	3,724,500.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	28,400	14.12	401,008.00	

	SANDS CHINA LTD	85,000	41.40	3,519,000.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	28,000	9.96	278,880.00	
	SJM HOLDINGS LTD	82,000	9.43	773,260.00	
	WYNN MACAU LTD	55,800	19.16	1,069,128.00	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	24,000	37.75	906,000.00	
	WH GROUP LTD	283,000	7.95	2,249,850.00	
	BANK OF EAST ASIA	45,040	22.30	1,004,392.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	126,500	31.15	3,940,475.00	
	HANG SENG BANK LTD	25,200	195.10	4,916,520.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	41,700	273.60	11,409,120.00	
	AIA GROUP LTD	406,590	85.40	34,722,786.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	81,208	60.35	4,900,902.80	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	79,000	19.22	1,518,380.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	46,901	43.40	2,035,503.40	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	25,000	40.45	1,011,250.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	18,950	34.15	647,142.50	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	169,666	12.46	2,114,038.36	
	SINO LAND CO	85,050	13.46	1,144,773.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	51,480	135.80	6,990,984.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	17,517	94.10	1,648,349.70	
	SWIRE PROPERTIES LTD	39,200	32.05	1,256,360.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	42,800	20.55	879,540.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	47,800	52.75	2,521,450.00	
	WHEELOCK & CO LTD	29,600	55.85	1,653,160.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	153,000	12.50	1,912,500.00	
	PCCW LTD	136,000	4.57	621,520.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	27,000	62.85	1,696,950.00	
	CLP HOLDINGS LTD	61,000	87.65	5,346,650.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	93,500	8.06	753,610.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	362,434	17.68	6,407,833.12	
	POWER ASSETS HOLDINGS	44,000	57.55	2,532,200.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	10,700	81.65	873,655.00	
香港ドル小計		3,169,744		130,591,495.68 (1,809,998,130)	
シンガポールド	KEPPEL CORP LTD	39,560	6.66	263,469.60	

ル	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	21,000	2.39	50,190.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	51,000	4.28	218,280.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	83,500	1.52	126,920.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	71,300	2.82	201,066.00	
	SATS LTD	22,000	5.42	119,240.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	21,800	9.49	206,882.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	212,600	0.92	196,655.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	56,250	2.31	129,937.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	3,500	36.49	127,715.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	130,000	0.30	39,000.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	49,660	3.83	190,197.80	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	60,815	25.99	1,580,581.85	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	103,640	11.50	1,191,860.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	44,800	26.60	1,191,680.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	22,000	8.00	176,000.00	
	CAPITALAND LTD	72,500	3.66	265,350.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	17,200	9.57	164,604.00	
	UOL GROUP LTD	15,650	7.59	118,783.50	
	VENTURE CORP LTD	9,700	15.00	145,500.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	286,980	3.52	1,010,169.60	
シンガポールドル小計		1,395,455		7,714,081.85 (614,966,605)	
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	21,770	17.93	390,336.10	
	ELBIT SYSTEMS LTD	770	563.70	434,049.00	
	BANK HAPOALIM BM	41,745	27.34	1,141,308.30	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	53,225	25.19	1,340,737.75	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	41,400	14.89	616,446.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,900	82.20	402,780.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,610	232.80	374,808.00	
	NICE LTD	1,915	516.40	988,906.00	
イスラエルシュケル小計		167,335		5,689,371.15 (173,639,607)	
合　　計		37,426,297		136,125,585,077 (136,125,585,077)	

(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	144,056.07	
	出資金小計		5,737.00	144,056.07 (15,604,154)	
	投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	14,530	252,386.10	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	4,080	583,603.20	
		AMERICAN TOWER CORP	14,739	3,085,020.09	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	48,540	451,422.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,775	1,007,572.75	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,957	651,448.94	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,830	415,593.30	
		CROWN CASTLE INTL CORP	14,040	1,863,388.80	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	6,765	809,094.00	
		DUKE REALTY CORPORATION	12,685	421,649.40	
		EQUINIX INC	2,788	1,433,645.36	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	2,720	342,692.80	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	11,940	941,469.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,010	611,622.90	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	4,080	454,512.00	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	2,755	361,015.20	
		HCP INC	17,975	580,053.25	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	21,789	398,738.70	
		INVITATION HOMES INC	14,410	402,903.60	
		IRON MOUNTAIN INC	9,375	286,593.75	
		KIMCO REALTY CORPORATION	14,815	271,114.50	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	5,203	265,353.00	
		MACERICH CO/THE	4,120	138,638.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,690	446,748.30	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	6,390	339,117.30	
		PROLOGIS INC	21,492	1,750,738.32	
		PUBLIC STORAGE	5,409	1,346,732.82	

		REALTY INCOME CORP	10,000	698,600.00	
		REGENCY CENTERS CORP	5,965	401,026.95	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	3,650	847,931.50	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	10,174	1,648,391.48	
		SL GREEN REALTY CORP	3,450	282,279.00	
		SUN COMMUNITIES INC	2,740	366,475.00	
		UDR INC	7,910	367,340.40	
		VENTAS INC	12,645	862,009.65	
		VEREIT INC	31,824	289,916.64	
		VORNADO REALTY TRUST	5,581	365,499.69	
		WELLTOWER INC	13,240	1,120,766.00	
		WEYERHAEUSER CO	23,938	616,164.12	
		WP CAREY INC	5,770	487,968.90	
	投資証券小計		416,789	28,267,236.71 (3,061,907,080)	
米ドル小計			422,526	28,411,292.78 (3,077,511,234)	
加ドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	4,000	92,040.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,660	147,216.60	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1,690	55,888.30	
加ドル小計			11,350	295,144.90 (24,417,337)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,665	156,177.00	
		GECINA SA	1,490	192,955.00	
		ICADE	1,175	93,647.50	
		KLEPIERRE	7,522	220,695.48	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,370	554,990.00	
ユーロ小計			16,222	1,218,464.98 (147,946,017)	
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	34,331	184,220.14	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	22,294	186,912.89	
		SEGRO PLC	33,703	252,637.68	
英ポンド小計			90,328	623,770.71 (83,834,783)	
豪ドル	投資証券	DEXUS	42,687	579,262.59	
		GOODMAN GROUP	52,182	797,340.96	

		GPT GROUP	57,415	354,250.55	
		LENDLEASE GROUP	18,967	269,521.07	
		MIRVAC GROUP	128,775	415,943.25	
		SCENTRE GROUP	156,031	608,520.90	
		STOCKLAND	78,000	361,920.00	
		VICINITY CENTRES	123,402	322,079.22	
豪ドル小計			657,459	3,708,838.54 (281,908,817)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	68,000	6,657,200.00	
香港ドル小計			68,000	6,657,200.00 (92,268,792)	
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	88,600	272,888.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	92,140	200,865.20	
		CAPITALAND MALL TRUST	84,200	223,972.00	
		SUNTEC REIT	54,600	106,470.00	
シンガポールドル小計			319,540	804,195.20 (64,110,441)	
合計				3,771,997,421 (3,771,997,421)	

(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　612銘柄	96.8%	—	—	66.9%
	投資証券　40銘柄	—	—	3.2%	2.2%
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　240銘柄	99.1%	—	—	11.4%
	投資証券　5銘柄	—	—	0.9%	0.1%
英ポンド	株式　94銘柄	99.0%	—	—	6.0%

	投資証券	3銘柄	—	—	1.0%	0.1%
スイスフラン	株式	39銘柄	100.0%	—	—	3.3%
スウェーデンクローナ	株式	32銘柄	100.0%	—	—	0.9%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	100.0%	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式	17銘柄	100.0%	—	—	0.6%
豪ドル	株式	59銘柄	92.1%	—	—	2.4%
	投資証券	8銘柄	—	—	7.9%	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	39銘柄	95.1%	—	—	1.3%
	投資証券	1銘柄	—	—	4.9%	0.1%
シンガポールドル	株式	21銘柄	90.6%	—	—	0.4%
	投資証券	4銘柄	—	—	9.4%	0.0%
イスラエルシュケル	株式	8銘柄	100.0%	—	—	0.1%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）

貸借対照表

（単位：円）

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	448,621	-
コール・ローン	1,006,123	1,020,854
親投資信託受益証券	134,412,330	94,437,848
未収入金	700,933	-
流動資産合計	136,568,007	95,458,702
資産合計	136,568,007	95,458,702
負債の部		
流動負債		
未払解約金	705,411	-

未払受託者報酬	3,875	84
未払委託者報酬	7,766	169
未払利息	2	1
その他未払費用	92,085	57,816
流動負債合計	809,139	58,070
負債合計	809,139	58,070
純資産の部		
元本等		
元本	119,028,065	79,574,737
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	16,730,803	15,825,895
（分配準備積立金）	13,193,707	14,050,725
元本等合計	135,758,868	95,400,632
純資産合計	135,758,868	95,400,632
負債純資産合計	136,568,007	95,458,702

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
1．	期首	2017年 7月19日	2018年 7月18日
	期首元本額	250,856,740円	119,028,065円
	期首からの追加設定元本額	58,630,874円	2,638,592円
	期首からの一部解約元本額	190,459,549円	42,091,920円
2．	受益権の総数	119,028,065口	79,574,737口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 2017年 7月19日 至 2018年 7月17日	自 2018年 7月18日 至 2019年 7月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2018年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	5,498,035
合計	5,498,035

（2019年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	90,993
合計	90,993

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

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（１口当たり情報）

2018年 7月17日現在		2019年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	1.1406円	1口当たり純資産額	1.1989円
(1万口当たり純資産額)	(11,406円)	(1万口当たり純資産額)	(11,989円)

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド	43,330,052	94,437,848	

合計	43,330,052	94,437,848	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）」は、「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
資産の部		
流動資産		
預金	132,865,429	1,948,964,010
金銭信託	20,751,580	-
コール・ローン	46,539,565	12,776,478
投資証券	6,529,978,447	35,418,788,187
派生商品評価勘定	-	106,952
未収入金	6,929,270	141,265
未収配当金	11,334,731	42,012,178
流動資産合計	6,748,399,022	37,422,789,070
資産合計	6,748,399,022	37,422,789,070
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,640	17,670
未払金	1,107,879	1,714,243,265
未払解約金	65,568,158	1,529,693
未払利息	93	23
流動負債合計	66,679,770	1,715,790,651
負債合計	66,679,770	1,715,790,651
純資産の部		
元本等		
元本	3,234,483,853	16,383,427,395
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	3,447,235,399	19,323,571,024

元本等合計	6,681,719,252	35,706,998,419
純資産合計	6,681,719,252	35,706,998,419
負債純資産合計	6,748,399,022	37,422,789,070

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

（貸借対照表に関する注記）

		2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
1．	期首	2017年 7月19日	2018年 7月18日
	期首元本額	3,832,492,331円	3,234,483,853円
	期首からの追加設定元本額	62,678,900円	13,604,972,955円
	期首からの一部解約元本額	660,687,378円	456,029,413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	2,667,944,455円	2,415,812,287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）	65,065,510円	43,330,052円
	グローバル３倍３分法ファンド（適格機関投資家向け）	－円	13,523,230,661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）	501,473,888円	401,054,395円
	計	3,234,483,853円	16,383,427,395円
2．	受益権の総数	3,234,483,853口	16,383,427,395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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2017年 7月19日 至 2018年 7月17日	自 2018年 7月18日 至 2019年 7月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、為替予約取引があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）

（2018年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	140,672,712
合計	140,672,712

（2019年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	41,320,449
合計	41,320,449

(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 7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				
	売建	18,699,760	－	18,703,400	△3,640
	米ドル	10,117,800	－	10,117,800	－
	ユーロ	2,630,000	－	2,633,600	△3,600
	英ポンド	5,951,960	－	5,952,000	△40

合計	18,699,760	－	18,703,400	△3,640

（2019年 7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	531,081,518	－	531,170,800	89,282
	米ドル	387,657,078	－	387,749,800	92,722
	加ドル	33,085,880	－	33,088,000	2,120
	ニュージーランドドル	3,629,730	－	3,630,000	270
	香港ドル	42,952,670	－	42,935,000	△17,670
	シンガポールドル	63,756,160	－	63,768,000	11,840
合計		531,081,518	－	531,170,800	89,282

（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。

①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。

②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 7月17日現在		2019年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	2.0658円	1口当たり純資産額	2.1795円
(1万口当たり純資産額)	(20,658円)	(1万口当たり純資産額)	(21,795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	21,999	604,752.51	
		AGREE REALTY CORPORATION	10,152	658,052.64	
		ALEXANDER'S INC	998	377,743.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	29,700	4,248,288.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	12,591	590,517.90	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	36,142	1,759,392.56	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	13,621	155,824.24	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	68,361	1,745,256.33	
		AMERICOLD REALTY TRUST	50,351	1,708,409.43	
		APARTMENT INVT&MGMT CO -A	39,254	2,020,010.84	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	55,214	871,829.06	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	16,393	43,277.52	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	36,655	7,734,571.55	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	5,956	69,863.88	
		BOSTON PROPERTIES INC	40,647	5,341,828.74	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,024	76,548.96	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	46,377	669,683.88	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	78,493	1,427,002.74	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	25,258	475,102.98	
		BRT APARTMENTS CORP	1,202	16,214.98	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	25,450	2,761,579.50	
		CARETRUST REIT INC	25,288	602,360.16	
		CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	42,761	49,602.76	
		CEDAR REALTY TRUST INC	23,846	59,615.00	
		CHATHAM LODGING TRUST	12,699	235,693.44	

CHESAPEAKE LODGING TRUST	15,877	442,650.76	
CITY OFFICE REIT INC	10,030	121,463.30	
CLIPPER REALTY INC	4,436	48,441.12	
COLONY CAPITAL INC-A	127,696	651,249.60	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	30,734	639,574.54	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	4,770	190,990.80	
CORECIVIC INC	31,624	552,471.28	
CORESITE REALTY CORP	9,678	1,122,938.34	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST	29,388	787,598.40	
COUSINS PROPERTIES INC	38,090	1,408,187.30	
CUBESMART	49,624	1,710,043.04	
CYRUSONE INC	29,723	1,725,420.15	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	51,187	519,036.18	
DIGITAL REALTY TRUST INC	54,762	6,549,535.20	
DOUGLAS EMMETT INC	42,504	1,714,611.36	
DUKE REALTY CORPORATION	94,520	3,141,844.80	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	17,420	322,095.80	
EASTGROUP PROPERTIES INC	9,667	1,149,502.97	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	38,245	566,026.00	
EPR PROPERTIES	19,900	1,491,306.00	
EQUITY COMMONWEALTH	32,067	1,056,286.98	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	23,693	2,985,081.07	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	97,449	7,683,853.65	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	13,312	267,438.08	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	17,295	5,262,695.55	
EXTRA SPACE STORAGE INC	33,531	3,735,353.40	
FARMLAND PARTNERS INC	8,724	56,357.04	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	19,730	2,585,419.20	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	33,232	1,244,538.40	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	17,375	475,380.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	27,908	211,821.72	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	11,711	141,585.99	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	53,080	2,064,281.20	
GEO GROUP INC/THE	32,033	597,735.78	
GETTY REALTY CORPORATION	8,811	268,999.83	

GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	7,119	152,204.22	
GLADSTONE LAND CORP	4,318	50,434.24	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	6,302	67,053.28	
GLOBAL NET LEASE INC	22,636	430,763.08	
HCP INC	125,854	4,061,308.58	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	34,078	1,098,333.94	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	54,039	1,501,743.81	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	8,642	140,864.60	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	27,287	1,166,246.38	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	43,194	1,074,234.78	
HOST HOTELS & RESORTS INC	194,636	3,561,838.80	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	40,584	1,409,482.32	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	24,292	290,289.40	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	16,495	345,075.40	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	2,482	318,862.54	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	3,083	185,164.98	
INVITATION HOMES INC	110,409	3,087,035.64	
IRON MOUNTAIN INC	75,409	2,305,253.13	
JBG SMITH PROPERTIES	31,741	1,243,294.97	
KILROY REALTY CORPORATION	26,564	2,032,146.00	
KIMCO REALTY CORPORATION	111,125	2,033,587.50	
KITE REALTY GROUP TRUST	21,424	331,000.80	
LEXINGTON REALTY TRUST	56,480	542,208.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST	39,027	1,990,377.00	
LIFE STORAGE INC	12,286	1,231,180.06	
LTC PROPERTIES INC	10,466	492,111.32	
MACERICH CO/THE	27,833	936,580.45	
MACK-CALI REALTY CORPORATION	24,233	568,263.85	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	358,733	317,478.70	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	103,800	1,853,868.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	30,002	3,632,342.14	
MONMOUTH RE INVST CORP	23,564	325,890.12	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	42,866	2,274,898.62	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	14,921	447,779.21	
NATL HEALTH INVESTORS INC	11,394	903,886.02	

		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	19,275	134,154.00	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	5,225	221,383.25	
		NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	12,332	209,644.00	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	12,516	335,303.64	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	56,449	2,076,194.22	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,382	123,265.66	
		PARAMOUNT GROUP INC	53,264	741,434.88	
		PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	52,898	1,426,659.06	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	34,228	936,135.80	
		PENN REAL ESTATE INVEST TST	17,726	116,459.82	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	48,806	844,343.80	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	33,178	668,536.70	
		PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	11,564	170,569.00	
		PROLOGIS INC	165,813	13,507,126.98	
		PS BUSINESS PARKS INC	5,273	918,240.22	
		PUBLIC STORAGE	39,462	9,825,248.76	
		QTS REALTY TRUST INC-CL-A	14,558	656,711.38	
		REALTY INCOME CORP	82,844	5,787,481.84	
		REGENCY CENTERS CORP	43,983	2,956,977.09	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	30,906	554,453.64	
		RETAIL PROPERTIES OF AME - A	56,265	661,676.40	
		RETAIL VALUE INC	3,768	134,442.24	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	27,218	1,149,143.96	
		RLJ LODGING TRUST	45,517	796,092.33	
		RPT REALTY	22,403	261,891.07	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	13,495	1,032,637.40	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	47,202	963,864.84	
		SAFEHOLD INC	2,002	64,304.24	
		SAUL CENTERS INC	2,795	152,327.50	
		SENIOR HOUSING PROPERTIES TRUST	63,838	536,239.20	
		SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	7,384	305,845.28	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	81,265	13,166,555.30	
		SITE CENTERS CORP	38,748	512,636.04	
		SL GREEN REALTY CORP	22,194	1,815,913.08	
		SPIRIT MTA REIT	9,485	80,148.25	

		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	22,987	1,013,496.83	
		STAG INDUSTRIAL INC	33,039	1,015,949.25	
		STORE CAPITAL CORP	53,257	1,806,477.44	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	27,362	315,757.48	
		SUN COMMUNITIES INC	23,733	3,174,288.75	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	59,910	811,181.40	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTERS INC	24,318	402,706.08	
		TAUBMAN CENTERS INC	16,117	668,371.99	
		TERRENO REALTY CORP	16,504	818,928.48	
		UDR INC	74,189	3,445,337.16	
		UMH PROPERTIES INC	9,958	123,977.10	
		UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	3,273	289,202.28	
		URBAN EDGE PROPERTIES	32,451	552,640.53	
		URSTADT BIDDLE PROPERTIES- CL A	8,570	181,512.60	
		VENTAS INC	97,176	6,624,487.92	
		VEREIT INC	256,435	2,336,122.85	
		VICI PROPERTIES INC	96,060	2,135,413.80	
		VORNADO REALTY TRUST	45,693	2,992,434.57	
		WASHINGTON PRIME GROUP INC	49,219	184,079.06	
		WASHINGTON REIT	21,290	591,436.20	
		WEINGARTEN REALTY INVESTORS	31,561	868,243.11	
		WELLTOWER INC	106,525	9,017,341.25	
		WHITESTONE REIT	9,901	124,950.62	
		WP CAREY INC	44,887	3,796,093.59	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	29,614	629,889.78	
米ドル小計			5,996,866	237,962,280.30 (25,776,074,202)	
加ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	15,224	730,599.76	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,429	200,956.37	
		BOARDWALK EQUITIES INC	5,764	235,747.60	
		CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	20,570	1,003,610.30	
		CHOICE PROPERTIES REIT	41,600	567,840.00	
		COMINAR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	22,537	281,261.76	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11,264	174,254.08	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	11,978	169,728.26	

		DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	26,352	371,563.20	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	14,567	174,075.65	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	7,010	168,450.30	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6,159	376,068.54	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	37,444	861,586.44	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	14,801	210,618.23	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	12,707	246,769.94	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	3,919	77,008.35	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4,594	90,088.34	
		NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	8,675	234,398.50	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	14,817	176,470.47	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	39,732	1,033,429.32	
		SLATE OFFICE REIT	10,622	62,351.14	
		SLATE RETAIL REIT	4,881	61,012.50	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	18,372	607,562.04	
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	14,525	188,679.75	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	8,185	54,430.25	
加ドル小計			393,728	8,358,561.09 (691,503,758)	
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	6,551	610,553.20	
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	42,175	617,442.00	
		ALTAREA	879	158,220.00	
		BEFIMMO S.C.A.	5,889	290,916.60	
		COFINIMMO	5,720	665,808.00	
		COVIVIO	17,346	1,627,054.80	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	10,511	255,207.08	
		GECINA SA	14,472	1,874,124.00	
		GREEN REIT PLC	184,842	338,260.86	
		HAMBORNER REIT AG	20,549	185,084.84	
		HIBERNIA REIT PLC	178,176	270,471.16	
		ICADE	11,927	950,581.90	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	13,862	84,142.34	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	72,835	713,418.82	
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	6,451	165,790.70	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	95,928	165,955.44	

		KLEPIERRE	53,539	1,570,834.26	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	18,545	134,451.25	
		MERCIALYS	13,699	156,031.61	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	97,089	1,205,845.38	
		MONTEA	2,838	221,647.80	
		NSI NV	5,219	199,887.70	
		RETAIL ESTATES	1,924	156,036.40	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	36,227	4,600,829.00	
		VASTNED RETAIL	4,284	120,166.20	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	4,645	732,052.00	
		WERELDHAVE NV	10,968	246,341.28	
ユーロ小計			937,090	18,317,154.62 (2,224,068,913)	
英ポンド	投資証券	ASSURA PLC	623,763	401,079.60	
		BIG YELLOW GROUP PLC	40,353	415,635.90	
		BRITISH LAND COMPANY PLC	253,289	1,359,148.77	
		CAPITAL & REGIONAL PLC	211,579	37,068.64	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	166,942	143,904.00	
		DERWENT LONDON PLC	29,130	890,212.80	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	154,305	141,960.60	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	71,453	490,739.20	
		HAMMERSON PLC	202,135	560,318.22	
		HANSTEEN HOLDINGS PLC	102,808	98,490.06	
		INTU PROPERTIES PLC	213,135	165,222.25	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	197,439	1,655,328.57	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	221,560	461,287.92	
		LXI REIT PLC	144,145	183,064.15	
		NEWRIVER REIT PLC	81,114	133,513.64	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	152,598	145,120.69	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	311,410	426,008.88	
		RDI REIT PLC	58,900	65,379.00	
		REGIONAL REIT LTD	70,518	74,890.11	
		REGIONAL REIT LTD-ENT-RTS	8,814	—	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	56,351	356,420.07	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	126,902	71,699.63	

		SEGRO PLC	284,775	2,134,673.40	
		SHAFTESBURY PLC	61,575	497,526.00	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	93,800	77,854.00	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	448,731	710,789.90	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	185,570	163,301.60	
		UNITE GROUP PLC	76,128	785,640.96	
		WORKSPACE GROUP PLC	34,123	298,235.02	
英ポンド小計			4,683,345	12,944,513.58 (1,739,742,625)	
豪ドル	投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	89,355	374,397.45	
		APN INDUSTRIA REIT	31,090	89,228.30	
		ARENA REIT	72,133	201,251.07	
		BWP TRUST	126,740	484,146.80	
		CHARTER HALL EDUCATION TRUST	70,078	259,989.38	
		CHARTER HALL GROUP	122,343	1,427,742.81	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	71,386	365,496.32	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	101,834	458,253.00	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	489,835	568,208.60	
		DEXUS	285,906	3,879,744.42	
		GDI PROPERTY GROUP	131,224	185,681.96	
		GOODMAN GROUP	421,893	6,446,525.04	
		GPT GROUP	509,539	3,143,855.63	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	81,883	355,372.22	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	43,774	153,209.00	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	57,179	186,403.54	
		MIRVAC GROUP	1,043,429	3,370,275.67	
		NATIONAL STORAGE REIT	209,754	363,923.19	
		RURAL FUNDS GROUP	96,669	229,105.53	
		SCENTRE GROUP	1,402,127	5,468,295.30	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	228,602	562,360.92	
		STOCKLAND	641,087	2,974,643.68	
		VICINITY CENTRES	849,661	2,217,615.21	
		VIVA ENERGY REIT	135,878	356,000.36	
豪ドル小計			7,313,399	34,121,725.40 (2,593,592,347)	

ニュージーランドドル	投資証券	GOODMAN PROPERTY TRUST	332,519	661,712.81	
		STRIDE STAPLED GROUP	163,012	365,146.88	
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	139,591	357,352.96	
ニュージーランドドル小計			635,122	1,384,212.65 (100,507,680)	
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	535,000	3,477,500.00	
		FORTUNE REIT	369,000	4,014,720.00	
		LINK REIT	555,300	54,363,870.00	
		PROSPERITY REIT	370,000	1,306,100.00	
		RREEF CHINA COMMERCIAL TRUST	201,000	874,350.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	277,000	1,736,790.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	354,000	1,932,840.00	
香港ドル小計			2,661,300	67,706,170.00 (938,407,516)	
シンガポールドル	投資証券	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	143,625	212,565.00	
		ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	185,940	191,518.20	
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	672,613	2,071,648.04	
		ASCOTT RESIDENCE TRUST	338,942	437,235.18	
		CACHE LOGISTICS TRUST	268,358	213,344.61	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	729,550	1,590,419.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	738,300	1,963,878.00	
		CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	158,440	251,919.60	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	205,400	334,802.00	
		ESR REIT	555,118	299,763.72	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	271,500	184,620.00	
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	170,000	183,600.00	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	177,789	462,251.40	
		FRASERS COMMERCIAL TRUST	187,000	312,290.00	
		FRASERS HOSPITALITY TRUST	230,700	162,643.50	
		FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	423,810	517,048.20	
		KEPPEL DC REIT	262,854	449,480.34	
		KEPPEL REIT	478,400	607,568.00	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	500,400	120,096.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	497,040	1,013,961.60	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	354,460	815,258.00	

		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	616,444	998,639.28	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	568,100	812,383.00	
		OUE HOSPITALITY TRUST	291,326	214,124.61	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	110,900	341,572.00	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	216,300	98,416.50	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	220,950	135,884.25	
		SPH REIT	161,800	179,598.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	374,400	295,776.00	
		SUNTEC REIT	594,100	1,158,495.00	
シンガポールドル小計			10,704,559	16,630,799.03 (1,325,807,298)	
韓国ウォン	投資証券	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8,125	57,118,750.00	
韓国ウォン小計			8,125	57,118,750.00 (5,249,213)	
イスラエルシュケル	投資証券	REIT 1 LTD	42,168	780,951.36	
イスラエルシュケル小計			42,168	780,951.36 (23,834,635)	
合計				35,418,788,187 (35,418,788,187)	

(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　155銘柄	100.0%	72.8%
加ドル	投資証券　25銘柄	100.0%	2.0%
ユーロ	投資証券　27銘柄	100.0%	6.3%
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%	7.3%
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%

シンガポールドル	投資証券	30銘柄	100.0%	3.7%
韓国ウォン	投資証券	1銘柄	100.0%	0.0%
イスラエルシュケル	投資証券	1銘柄	100.0%	0.1%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）

貸借対照表

（単位：円）

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	86,996	-
コール・ローン	195,107	216,934
親投資信託受益証券	26,340,229	20,161,316
未収入金	80,385	-
流動資産合計	26,702,717	20,378,250
資産合計	26,702,717	20,378,250
負債の部		
流動負債		
未払解約金	87,122	-
未払受託者報酬	668	18
未払委託者報酬	1,345	36
その他未払費用	23,416	13,637
流動負債合計	112,551	13,691
負債合計	112,551	13,691
純資産の部		
元本等		
元本	23,683,281	17,586,949
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	2,906,885	2,777,610
（分配準備積立金）	3,478,824	3,475,583
元本等合計	26,590,166	20,364,559
純資産合計	26,590,166	20,364,559
負債純資産合計	26,702,717	20,378,250

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
1．	期首	2017年 7月19日	2018年 7月18日
	期首元本額	53,092,741円	23,683,281円
	期首からの追加設定元本額	11,732,952円	1,477,061円
	期首からの一部解約元本額	41,142,412円	7,573,393円
2．	受益権の総数	23,683,281口	17,586,949口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2017年 7月19日 至 2018年 7月17日	自 2018年 7月18日 至 2019年 7月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左

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

（有価証券に関する注記）

（2018年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	674,499
合計	674,499

（2019年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	△19,661
合計	△19,661

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

2018年 7月17日現在		2019年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	1.1227円	1口当たり純資産額	1.1579円
(1万口当たり純資産額)	(11,227円)	(1万口当たり純資産額)	(11,579円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外新興国債券インデックスＬｏｃａｌ（ヘッジなし）マザーファンド	15,123,634	20,161,316	
合計		15,123,634	20,161,316	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）」は、「海外新興国債券インデックスＬｏｃａｌ（ヘッジなし）マザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監

査の対象外であります。

海外新興国債券インデックスＬｏｃａｌ（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
資産の部		
流動資産		
預金	18,533,459	33,534,958
金銭信託	7,209,880	-
コール・ローン	16,169,598	14,330,226
国債証券	3,827,572,454	4,948,406,182
派生商品評価勘定	-	2,000
未収利息	64,399,179	75,470,972
前払費用	6,300,053	8,726,095
流動資産合計	3,940,184,623	5,080,470,433
資産合計	3,940,184,623	5,080,470,433
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	21,785	11,961
未払金	24,823,622	26,357,005
未払解約金	2,944,280	2,763,657
未払利息	32	26
流動負債合計	27,789,719	29,132,649
負債合計	27,789,719	29,132,649
純資産の部		
元本等		
元本	3,035,999,563	3,789,304,628
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	876,395,341	1,262,033,156
元本等合計	3,912,394,904	5,051,337,784
純資産合計	3,912,394,904	5,051,337,784
負債純資産合計	3,940,184,623	5,080,470,433

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

（貸借対照表に関する注記）

		2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
1.	期首	2017年 7月19日	2018年 7月18日
	期首元本額	2,390,565,710円	3,035,999,563円
	期首からの追加設定元本額	813,229,052円	892,299,992円
	期首からの一部解約元本額	167,795,199円	138,994,927円
	元本の内訳　※		
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	33,770,435円	－円
	インデックスファンド海外新興国（エマージング）債券（１年決算型）	2,981,789,748円	3,774,180,994円
	インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）	20,439,380円	15,123,634円
	計	3,035,999,563円	3,789,304,628円
2.	受益権の総数	3,035,999,563口	3,789,304,628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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2017年 7月19日 至 2018年 7月17日	自 2018年 7月18日 至 2019年 7月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2018年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	△59,795,819
合計	△59,795,819

（2019年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	156,264,072
合計	156,264,072

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

（2019年 7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	為替予約取引				

の取引	買建	22,961,871	－	22,951,910	△9,961
	米ドル	10,828,000	－	10,830,000	2,000
	メキシコペソ	6,230,231	－	6,220,340	△9,891
	ポーランドズロチ	5,903,640	－	5,901,570	△2,070
合計		22,961,871	－	22,951,910	△9,961

（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。

①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。

②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 7月17日現在		2019年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	1.2887円	1口当たり純資産額	1.3331円
(1万口当たり純資産額)	(12,887円)	(1万口当たり純資産額)	(13,331円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
アルゼンチンペソ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA-18.2%-21/10/03	2,000,000.00	1,328,833.40	
		REPUBLIC OF ARGENTINA-16.0%-23/10/17	4,200,000.00	2,833,133.52	
		REPUBLIC OF ARGENTINA-15.5%-26/10/17	3,500,000.00	2,347,867.90	
アルゼンチンペソ小計			9,700,000.00	6,509,834.82 (16,534,980)	
メキシコペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	8,700,000.00	8,555,020.59	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%-21/12/09	6,500,000.00	6,468,070.70	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	8,500,000.00	8,294,107.90	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	7,530,000.00	7,692,187.16	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-24/09/05	2,200,000.00	2,251,120.19	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	8,610,000.00	9,585,636.55	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%-26/03/05	5,000,000.00	4,530,261.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	9,230,000.00	9,147,366.11	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	5,460,000.00	5,756,470.62	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	5,050,000.00	5,029,959.83	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-34/11/23	3,000,000.00	2,961,073.20	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	2,980,000.00	3,548,271.99	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	4,340,000.00	4,528,300.22	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	6,260,000.00	6,036,528.64	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	3,500,000.00	3,460,828.00	
メキシコペソ小計			86,860,000.00	87,845,202.70 (498,082,299)	
ブラジルレアル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL-12.5%-22/01/05	250,000.00	285,703.12	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL-8.5%-24/01/05	350,000.00	370,726.56	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL-10.25%-28/01/10	250,000.00	292,148.43	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-21/07/01	1,950,000.00	1,747,872.83	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-22/01/01	2,180,000.00	1,889,282.34	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-22/07/01	1,950,000.00	1,632,695.26	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-23/07/01	1,100,000.00	854,506.64	

		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-21/01/01	2,280,000.00	2,411,587.27	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-23/01/01	2,900,000.00	3,211,456.25	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-25/01/01	2,010,000.00	2,282,280.20	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-27/01/01	1,790,000.00	2,069,638.35	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-29/01/01	550,000.00	647,088.43	
ブラジルレアル小計			17,560,000.00	17,694,985.68 (508,376,938)	
チリペソ	国債証券	BONOS TESORERIA PESOS-4.5%-21/02/28	30,000,000.00	30,987,582.00	
		BONOS TESORERIA PESOS-4.5%-21/03/01	95,000,000.00	98,105,497.75	
		BONOS TESORERIA PESOS-4.0%-23/03/01	115,000,000.00	120,428,615.25	
		BONOS TESORERIA PESOS-4.5%-26/03/01	150,000,000.00	163,323,105.00	
		BONOS TESORERIA PESOS-4.7%-30/09/01	95,000,000.00	107,977,836.00	
		BONOS TESORERIA PESOS-5.0%-35/03/01	210,000,000.00	250,069,113.00	
		BONOS TESORERIA PESOS-6.0%-43/01/01	150,000,000.00	208,119,885.00	
		REPUBLIC OF CHILE-5.5%-20/08/05	70,000,000.00	71,892,187.50	
チリペソ小計			915,000,000.00	1,050,903,821.50 (166,988,617)	
コロンビアペソ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA-7.75%-21/04/14	140,000,000.00	146,314,287.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA-4.375%-23/03/21	30,000,000.00	29,328,505.50	
		REPUBLIC OF COLOMBIA-9.85%-27/06/28	97,000,000.00	122,854,840.75	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-22/05/04	1,585,000,000.00	1,674,370,225.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-10.0%-24/07/24	1,305,000,000.00	1,578,860,775.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-6.25%-25/11/26	900,000,000.00	935,086,500.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.5%-26/08/26	1,360,000,000.00	1,507,124,800.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-6.0%-28/04/28	1,580,000,000.00	1,592,260,800.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.75%-30/09/18	855,000,000.00	969,604,200.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-32/06/30	910,000,000.00	970,164,650.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.25%-34/10/18	340,000,000.00	369,207,700.00	
コロンビアペソ小計			9,102,000,000.00	9,895,177,283.25 (334,456,992)	
ペルーヌエボソル	国債証券	BONOS DE TESORERIA-5.7%-24/08/12	580,000.00	640,103.37	
		BONOS DE TESORERIA-6.35%-28/08/12	810,000.00	932,341.99	

		BONOS DE TESORERIA-5.94%-29/02/12	600,000.00	669,557.09	
		BONOS DE TESORERIA-6.15%-32/08/12	700,000.00	787,690.74	
		PERU BONO SOBERANO-8.2%-26/08/12	540,000.00	682,555.41	
		PERU BONO SOBERANO-6.95%-31/08/12	770,000.00	924,605.99	
		PERU BONO SOBERANO-6.9%-37/08/12	580,000.00	696,790.54	
ペルーヌエボソル小計			4,580,000.00	5,333,645.13 (175,690,270)	
ウルグアイペソ	国債証券	REPUBLICA ORIENT URUGUAY-9.875%-22/06/20	1,300,000.00	1,303,575.00	
		REPUBLICA ORIENT URUGUAY-8.5%-28/03/15	1,300,000.00	1,147,250.00	
ウルグアイペソ小計			2,600,000.00	2,450,825.00 (7,548,541)	
ドミニカペソ	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC-8.9%-23/02/15	8,000,000.00	8,059,474.40	
ドミニカペソ小計			8,000,000.00	8,059,474.40 (17,086,085)	
トルコリラ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND-10.7%-21/02/17	710,000.00	639,710.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.2%-21/09/22	780,000.00	663,000.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.5%-22/01/12	480,000.00	400,320.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-11.0%-22/03/02	740,000.00	635,290.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.7%-22/08/17	850,000.00	712,300.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.5%-22/09/14	490,000.00	391,020.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-12.2%-23/01/18	770,000.00	670,285.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-7.1%-23/03/08	860,000.00	625,650.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-16.2%-23/06/14	450,000.00	436,500.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.8%-23/09/27	770,000.00	577,115.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.4%-24/03/20	270,000.00	212,220.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.0%-24/07/24	660,000.00	485,100.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.0%-25/03/12	820,000.00	555,550.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.6%-26/02/11	1,010,000.00	764,065.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-11.0%-27/02/24	810,000.00	604,665.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.5%-27/08/11	810,000.00	588,870.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-12.4%-28/03/08	450,000.00	363,150.00	
トルコリラ小計			11,730,000.00	9,324,810.00 (176,891,645)	

チェココルナ	国債証券	CZECH REPUBLIC-3.75%-20/09/12	3,350,000.00	3,438,775.00	
		CZECH REPUBLIC-3.85%-21/09/29	3,540,000.00	3,725,850.00	
		CZECH REPUBLIC-4.7%-22/09/12	3,620,000.00	3,983,828.10	
		CZECH REPUBLIC-0.45%-23/10/25	2,500,000.00	2,402,512.50	
		CZECH REPUBLIC-5.7%-24/05/25	3,820,000.00	4,605,029.10	
		CZECH REPUBLIC-2.4%-25/09/17	4,700,000.00	4,965,573.50	
		CZECH REPUBLIC-1.0%-26/06/26	3,400,000.00	3,301,417.00	
		CZECH REPUBLIC-0.25%-27/02/10	3,000,000.00	2,743,515.00	
		CZECH REPUBLIC-2.5%-28/08/25	4,610,000.00	5,038,776.10	
		CZECH REPUBLIC-2.75%-29/07/23	4,900,000.00	5,515,023.50	
		CZECH REPUBLIC-0.95%-30/05/15	4,150,000.00	3,917,641.50	
チェココルナ小計			41,590,000.00	43,637,941.30 (206,843,841)	
ハンガリーフォリント	国債証券	HUNGARY GOVERNMENT BOND-7.5%-20/11/12	27,200,000.00	29,854,692.80	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-0.5%-21/04/21	37,000,000.00	37,064,694.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.5%-21/10/27	31,000,000.00	32,406,950.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-7.0%-22/06/24	47,800,000.00	56,376,084.80	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-1.75%-22/10/26	53,000,000.00	54,394,244.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.0%-23/11/24	45,000,000.00	54,341,280.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-24/06/26	44,000,000.00	47,446,520.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.5%-24/10/24	40,000,000.00	42,052,560.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-5.5%-25/06/24	59,800,000.00	72,712,524.30	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.75%-26/12/22	36,000,000.00	38,022,966.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-27/10/27	61,000,000.00	65,366,990.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.75%-28/10/22	29,300,000.00	40,388,570.35	
ハンガリーフォリント小計			511,100,000.00	570,428,077.75 (212,427,416)	
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	740,000.00	776,929.70	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25	1,080,000.00	1,089,671.40	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-21/07/25	1,170,000.00	1,174,978.35	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	690,000.00	754,173.45	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-22/04/25	1,110,000.00	1,127,654.55	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	800,000.00	898,964.00	

		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-23/01/25	1,260,000.00	1,291,122.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	1,110,000.00	1,207,458.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-24/04/25	1,120,000.00	1,150,408.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	1,110,000.00	1,185,591.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	1,630,000.00	1,666,593.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	1,270,000.00	1,297,495.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	1,260,000.00	1,311,660.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	320,000.00	334,096.00	
ポーランドズロチ小計			14,670,000.00	15,266,795.45 (435,409,006)	
ロシア ルーブル	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.6%-21/04/14	6,900,000.00	6,972,450.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.5%-21/08/18	12,300,000.00	12,423,000.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.0%-21/12/15	15,600,000.00	15,592,200.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.6%-22/07/20	9,500,000.00	9,652,000.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.4%-22/12/07	14,700,000.00	14,869,050.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.0%-23/01/25	7,400,000.00	7,396,300.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.0%-23/08/16	9,900,000.00	9,875,200.50	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.5%-24/02/28	12,400,000.00	12,139,662.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.4%-24/07/17	13,100,000.00	13,279,535.50	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.1%-24/10/16	15,400,000.00	15,392,300.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.75%-26/09/16	16,700,000.00	17,212,940.50	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.95%-26/10/07	10,500,000.00	10,922,047.50	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-8.15%-27/02/03	15,400,000.00	16,250,003.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.05%-28/01/19	14,900,000.00	14,761,504.50	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.9%-29/05/23	13,800,000.00	13,491,087.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-8.5%-31/09/17	11,650,000.00	12,762,866.25	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.7%-33/03/23	16,000,000.00	16,448,080.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.25%-34/05/10	9,000,000.00	8,891,775.00	
ロシアルーブル小計			225,150,000.00	228,332,001.75 (392,731,043)	
ルーマニア レイ	国債証券	ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.25%-21/03/22	440,000.00	438,534.80	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.95%-21/06/11	440,000.00	459,025.60	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.0%-21/10/27	380,000.00	382,977.30	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.4%-22/03/08	450,000.00	446,820.75	

		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.5%-22/12/19	560,000.00	554,439.20	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.85%-23/04/26	480,000.00	512,517.60	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.25%-23/06/28	480,000.00	485,668.80	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.25%-24/04/29	450,000.00	434,961.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.75%-25/02/24	450,000.00	463,167.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.8%-27/07/26	450,000.00	491,514.75	
ルーマニアレイ小計			4,580,000.00	4,669,626.80 (119,869,319)	
マレーシアリンギット	**国債証券**	MALAYSIA GOVERNMENT-3.659%-20/10/15	500,000.00	502,775.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.62%-21/11/30	420,000.00	423,129.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-23/04/20	470,000.00	475,640.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	500,000.00	506,575.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	500,000.00	513,400.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	700,000.00	715,750.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	330,000.00	337,095.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	500,000.00	509,250.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	690,000.00	701,385.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	490,000.00	501,123.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	530,000.00	579,820.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.729%-22/03/31	450,000.00	454,612.50	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.948%-22/04/14	530,000.00	538,347.50	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.094%-23/11/30	500,000.00	512,500.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.128%-25/08/15	500,000.00	515,750.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.258%-27/07/26	580,000.00	604,360.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.369%-28/10/31	550,000.00	579,975.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.13%-29/07/09	300,000.00	311,625.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	650,000.00	661,147.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	580,000.00	598,270.00	

		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	600,000.00	602,850.00	
マレーシアリンギット小計			10,870,000.00	11,145,379.50 (293,457,842)	
タイバーツ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND-3.65%-21/12/17	11,620,000.00	12,153,521.84	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-1.875%-22/06/17	8,000,000.00	8,029,800.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.0%-22/12/17	8,200,000.00	8,264,296.20	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.625%-23/06/16	7,800,000.00	8,345,067.90	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.4%-23/12/17	8,700,000.00	8,931,741.90	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.85%-25/12/12	8,570,000.00	9,602,278.78	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.125%-26/12/17	8,800,000.00	8,941,864.80	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.875%-28/12/17	5,500,000.00	5,923,472.50	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-4.875%-29/06/22	8,680,000.00	10,900,579.66	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.65%-31/06/20	7,300,000.00	8,476,022.33	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.775%-32/06/25	10,000,000.00	11,808,184.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.4%-36/06/17	7,550,000.00	8,745,982.66	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.3%-38/06/17	3,400,000.00	3,899,905.40	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.875%-46/06/17	8,200,000.00	8,732,821.24	
タイバーツ小計			112,320,000.00	122,755,539.21 (429,644,387)	
フィリピンペソ	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES-4.95%-21/01/15	5,000,000.00	5,060,212.50	
フィリピンペソ小計			5,000,000.00	5,060,212.50 (10,778,252)	
インドネシアルピア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-20/11/15	1,050,000,000.00	1,115,625,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-12.8%-21/06/15	500,000,000.00	558,750,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-21/07/15	3,330,000,000.00	3,461,535,000.00	

		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-22/05/15	3,970,000,000.00	4,055,355,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-5.625%-23/05/15	3,050,000,000.00	2,979,850,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-24/03/15	5,400,000,000.00	5,788,800,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.125%-24/05/15	2,700,000,000.00	2,880,900,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-25/09/15	1,060,000,000.00	1,280,215,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-26/09/15	3,890,000,000.00	4,220,650,194.50	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-27/05/15	3,900,000,000.00	3,929,250,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.125%-28/05/15	3,600,000,000.00	3,389,400,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.0%-29/03/15	2,950,000,000.00	3,323,175,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-29/05/15	3,000,000,000.00	3,247,500,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-10.5%-30/08/15	810,000,000.00	1,005,412,500.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.75%-31/05/15	2,300,000,000.00	2,553,614,100.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.5%-31/07/15	1,620,000,000.00	1,893,375,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-32/06/15	1,400,000,000.00	1,494,500,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.5%-32/08/15	1,600,000,000.00	1,612,000,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.625%-33/05/15	2,730,000,000.00	2,545,725,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-34/03/15	4,200,000,000.00	4,554,900,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-36/05/15	2,960,000,000.00	3,156,840,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.5%-38/05/15	2,300,000,000.00	2,285,050,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-39/04/15	1,350,000,000.00	1,449,225,000.00	
		PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-8.25%-20/09/15	750,000,000.00	765,596,250.00	
		PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-8.75%-23/08/15	500,000,000.00	526,917,550.00	
		PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-8.875%-31/11/15	1,090,000,000.00	1,166,300,000.00	
インドネシアルピア小計			62,010,000,000.00	65,240,460,594.50 (508,875,592)	
南アフリカランド	**国債証券**	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%-21/03/31	1,690,000.00	1,703,939.12	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%-23/02/28	3,950,000.00	4,030,462.68	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%-26/12/21	8,300,000.00	9,441,340.05	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%-30/01/31	6,530,000.00	6,233,439.07	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%-31/02/28	3,640,000.00	3,147,753.51	

		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%-32/03/31	3,750,000.00	3,529,179.56	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%-35/02/28	3,700,000.00	3,556,901.19	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%-36/03/31	3,690,000.00	2,730,488.19	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%-37/01/31	4,310,000.00	3,955,131.18	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%-40/01/31	2,970,000.00	2,807,221.86	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%-41/02/28	3,590,000.00	2,570,948.69	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%-44/01/31	5,080,000.00	4,639,134.23	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%-48/02/28	8,700,000.00	7,931,524.21	
南アフリカランド小計			59,900,000.00	56,277,463.54 (436,713,117)	
合計				4,948,406,182 (4,948,406,182)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

外貨建有価証券の内訳

種　類	銘柄数		組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アルゼンチンペソ	国債証券	3銘柄	100.0%	0.3%
メキシコペソ	国債証券	15銘柄	100.0%	10.1%
ブラジルレアル	国債証券	12銘柄	100.0%	10.2%
チリペソ	国債証券	8銘柄	100.0%	3.4%
コロンビアペソ	国債証券	11銘柄	100.0%	6.8%
ペルーヌエボソル	国債証券	7銘柄	100.0%	3.6%
ウルグアイペソ	国債証券	2銘柄	100.0%	0.2%
ドミニカペソ	国債証券	1銘柄	100.0%	0.3%
トルコリラ	国債証券	17銘柄	100.0%	3.6%
チェココルナ	国債証券	11銘柄	100.0%	4.2%
ハンガリーフォリント	国債証券	12銘柄	100.0%	4.3%

ポーランドズロチ	国債証券	14銘柄	100.0%	8.8%
ロシアルーブル	国債証券	18銘柄	100.0%	7.9%
ルーマニアレイ	国債証券	10銘柄	100.0%	2.4%
マレーシアリンギット	国債証券	21銘柄	100.0%	5.9%
タイバーツ	国債証券	14銘柄	100.0%	8.7%
フィリピンペソ	国債証券	1銘柄	100.0%	0.2%
インドネシアルピア	国債証券	26銘柄	100.0%	10.3%
南アフリカランド	国債証券	13銘柄	100.0%	8.8%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

ＦＯＦｓ用ゴールド・ファンド　為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

貸借対照表

（単位：円）

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	2,598,731	-
コール・ローン	9,335,943	18,831,191
親投資信託受益証券	2,334,632,649	3,457,093,325
流動資産合計	2,346,567,323	3,475,924,516
資産合計	2,346,567,323	3,475,924,516
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	45,937,567	29,640,911
未払解約金	50,000	1,239,999
未払受託者報酬	16,141	27,527
未払委託者報酬	53,811	91,765
未払利息	17	30
その他未払費用	13,582	14,922
流動負債合計	46,071,118	31,015,154
負債合計	46,071,118	31,015,154
純資産の部		
元本等		
元本	2,427,290,047	3,344,017,513
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	△126,793,842	100,891,849

（分配準備積立金）	-	165,694,234
元本等合計	2,300,496,205	3,444,909,362
純資産合計	2,300,496,205	3,444,909,362
負債純資産合計	2,346,567,323	3,475,924,516

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
1．	期首	※2017年 9月29日	2018年 7月18日
	期首元本額	10,000,000円	2,427,290,047円
	期首からの追加設定元本額	2,619,137,538円	2,002,744,408円
	期首からの一部解約元本額	201,847,491円	1,086,016,942円
2．	受益権の総数	2,427,290,047口	3,344,017,513口
3．	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	126,793,842円	－円

※期首は当該投資信託の期首日であります。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2017年 9月29日 至 2018年 7月17日	自 2018年 7月18日 至 2019年 7月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2018年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	16,525,554
合計	16,525,554

（2019年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,023,332
合計	1,023,332

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

（2018年 7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				
	売建	2,285,644,793	－	2,331,582,360	△45,937,567
	米ドル	2,285,644,793	－	2,331,582,360	△45,937,567
合計		2,285,644,793	－	2,331,582,360	△45,937,567

（2019年 7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				
	売建	3,444,545,749	－	3,474,186,660	△29,640,911
	米ドル	3,444,545,749	－	3,474,186,660	△29,640,911
合計		3,444,545,749	－	3,474,186,660	△29,640,911

（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。

①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。

②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 7月17日現在		2019年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	0.9478円	1口当たり純資産額	1.0302円
(1万口当たり純資産額)	(9,478円)	(1万口当たり純資産額)	(10,302円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	ゴールド・マザーファンド	3,568,428,288	3,457,093,325	
合計		3,568,428,288	3,457,093,325	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

「ＦＯＦｓ用ゴールド・ファンド　為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）」は、「ゴールド・マザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

ゴールド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
資産の部		
流動資産		
預金	122,502,163	4,679,250
金銭信託	8,497,233	-
コール・ローン	30,526,315	119,541,628
投資信託受益証券	77,101,256,012	115,054,104,918
未収入金	-	65,067,018
流動資産合計	77,262,781,723	115,243,392,814
資産合計	77,262,781,723	115,243,392,814
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	12,775	216,767
未払金	204,189,916	-
未払解約金	1,801,175	135,011,478
未払利息	56	191
流動負債合計	206,003,922	135,228,436
負債合計	206,003,922	135,228,436
純資産の部		
元本等		
元本	86,190,065,636	118,814,505,273
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	△9,133,287,835	△3,706,340,895
元本等合計	77,056,777,801	115,108,164,378
純資産合計	77,056,777,801	115,108,164,378
負債純資産合計	77,262,781,723	115,243,392,814

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	投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 （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。 （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。 （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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
1．	期首	2017年 9月29日	2018年 7月18日
	期首元本額	39,306,033,894円	86,190,065,636円
	期首からの追加設定元本額	84,496,129,410円	86,497,175,347円
	期首からの一部解約元本額	37,612,097,668円	53,872,735,710円
	元本の内訳　※		
	ファイン・ブレンド（毎月分配型）	3,204,666,035円	4,210,854,855円
	ファイン・ブレンド（資産成長型）	1,746,382,618円	2,150,533,624円
	スマート・ファイブ（毎月決算型）	32,909,477,338円	46,097,500,047円
	スマート・ファイブ（１年決算型）	3,628,530,030円	6,019,551,174円
	ゴールド・ファンド（適格機関投資家向け）	3,109,339,839円	5,072,483,640円
	ゴールド・ファンド（為替ヘッジあり）	6,657,310,043円	5,428,321,544円
	ゴールド・ファンド（為替ヘッジなし）	4,113,351,685円	3,376,135,866円
	ゴールド・ファンド　為替ヘッジあり（ＳＭＡ専用）	28,148,993,920円	42,820,108,793円
	ＦＯＦｓ用ゴールド・ファンド　為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	2,611,445,917円	3,568,428,288円
	ファイン・ブレンド（適格機関投資家向け）	60,568,211円	70,587,442円
	計	86,190,065,636円	118,814,505,273円
2．	受益権の総数	86,190,065,636口	118,814,505,273口
3．	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	9,133,287,835円	3,706,340,895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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2017年 9月29日 至 2018年 7月17日	自 2018年 7月18日 至 2019年 7月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）

（2018年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	△4,757,956,057
合計	△4,757,956,057

（2019年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	9,517,533,659
合計	9,517,533,659

(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 7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	85,000,000	－	84,987,225	△12,775
	米ドル	85,000,000	－	84,987,225	△12,775
合計		85,000,000	－	84,987,225	△12,775

（2019年 7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				
	売建	65,000,000	－	65,216,767	△216,767
	米ドル	65,000,000	－	65,216,767	△216,767
合計		65,000,000	－	65,216,767	△216,767

（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。

①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。

②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 7月17日現在		2019年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	0.8940円	1口当たり純資産額	0.9688円
(1万口当たり純資産額)	(8,940円)	(1万口当たり純資産額)	(9,688円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST-ETF	73,950,000	993,148,500.00	
		SPDR GOLD TRUST-ETF	521,300	69,020,120.00	
米ドル小計			74,471,300	1,062,168,620.00 (115,054,104,918)	
合計				115,054,104,918 (115,054,104,918)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ

貸借対照表

（単位：円）

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在

資産の部		
流動資産		
金銭信託	8,898,559	-
コール・ローン	31,968,078	63,921,456
株式	41,990,477,680	38,535,688,870
派生商品評価勘定	897,840	1,094,760
未収入金	73,305	-
未収配当金	52,641,341	57,405,468
流動資産合計	42,084,956,803	38,658,110,554
資産合計	42,084,956,803	38,658,110,554
負債の部		
流動負債		
前受金	160,000	1,218,000
未払解約金	27,506,026	29,401,738
未払利息	59	102
流動負債合計	27,666,085	30,619,840
負債合計	27,666,085	30,619,840
純資産の部		
元本等		
元本	19,797,670,625	19,773,090,141
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	22,259,620,093	18,854,400,573
元本等合計	42,057,290,718	38,627,490,714
純資産合計	42,057,290,718	38,627,490,714
負債純資産合計	42,084,956,803	38,658,110,554

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式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。 （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。 （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。 （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	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。

（貸借対照表に関する注記）

		2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
1．	期首	2017年 7月19日	2018年 7月18日

	期首元本額	20,657,286,888円	19,797,670,625円
	期首からの追加設定元本額	2,657,614,476円	2,622,610,401円
	期首からの一部解約元本額	3,517,230,739円	2,647,190,885円
	元本の内訳　※		
	インデックスファンドＴＳＰ	11,211,592,326円	10,945,599,598円
	財形株投（一般財形３０）	13,998,305円	14,912,242円
	財形株投（一般財形５０）	53,898,661円	53,075,317円
	財形株投（年金・住宅財形３０）	29,304,773円	29,943,229円
	インデックスファンドＴＯＰＩＸ（日本株式）	7,884,268,362円	8,127,813,961円
	ＴＯＰＩＸインデックスファンド（個人型年金向け）	445,115,533円	472,059,785円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１６－０８	38,111,193円	33,073,710円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１６－０８	26,055,415円	20,490,637円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１６－１１	17,708,562円	15,026,467円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１６－１１	34,670,748円	27,881,999円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１７－０２	17,890,363円	12,778,732円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１７－０２	25,056,384円	20,434,464円
	計	19,797,670,625円	19,773,090,141円
２．	受益権の総数	19,797,670,625口	19,773,090,141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	291,236,000円	263,842,000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）

Ｉ金融商品の状況に関する事項

	自 2017年 7月19日 至 2018年 7月17日	自 2018年 7月18日 至 2019年 7月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2018年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	662,511,155
合計	662,511,155

（2019年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	△138,376,462
合計	△138,376,462

(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 7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	69,020,000	－	69,920,000	900,000
合計		69,020,000	－	69,920,000	900,000

（2019年 7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	92,682,000	－	93,780,000	1,098,000
合計		92,682,000	－	93,780,000	1,098,000

（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 7月17日現在		2019年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	2.1244円	1口当たり純資産額	1.9535円
(1万口当たり純資産額)	(21,244円)	(1万口当たり純資産額)	(19,535円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	800	3,050.00	2,440,000	
日本水産	23,300	704.00	16,403,200	
マルハニチロ	3,400	3,240.00	11,016,000	
カネコ種苗	700	1,295.00	906,500	
サカタのタネ	2,800	3,460.00	9,688,000	
ホクト	2,000	1,875.00	3,750,000	
ホクリヨウ	300	609.00	182,700	
住石ホールディングス	5,400	133.00	718,200	
日鉄鉱業	500	4,530.00	2,265,000	
三井松島ホールディングス	1,000	1,351.00	1,351,000	
国際石油開発帝石	93,400	971.10	90,700,740	
石油資源開発	3,400	2,491.00	8,469,400	
K＆Oエナジーグループ	1,100	1,530.00	1,683,000	
ヒノキヤグループ	700	2,038.00	1,426,600	

ショーボンドホールディングス	3,400	3,685.00	12,529,000	
ミライト・ホールディングス	6,500	1,648.00	10,712,000	
サンヨーホームズ	400	685.00	274,000	
日本アクア	800	640.00	512,000	
ファーストコーポレーション	800	640.00	512,000	
ベステラ	500	1,284.00	642,000	
スペースバリューホールディングス	3,000	503.00	1,509,000	
ダイセキ環境ソリューション	500	645.00	322,500	
第一カッター興業	300	1,761.00	528,300	
安藤・間	15,000	733.00	10,995,000	
東急建設	6,800	748.00	5,086,400	
コムシスホールディングス	8,300	2,802.00	23,256,600	
ミサワホーム	1,900	1,064.00	2,021,600	
ビーアールホールディングス	2,700	345.00	931,500	
高松コンストラクショングループ	1,400	2,286.00	3,200,400	
東建コーポレーション	700	6,360.00	4,452,000	
ソネック	300	806.00	241,800	
ヤマウラ	900	834.00	750,600	
大成建設	19,100	3,815.00	72,866,500	
大林組	57,600	1,070.00	61,632,000	
清水建設	58,800	894.00	52,567,200	
飛島建設	1,700	1,277.00	2,170,900	
長谷工コーポレーション	24,000	1,157.00	27,768,000	
松井建設	2,100	652.00	1,369,200	
錢高組	300	4,485.00	1,345,500	
鹿島建設	45,000	1,463.00	65,835,000	
不動テトラ	1,400	1,311.00	1,835,400	
大末建設	700	943.00	660,100	
鉄建建設	1,200	2,998.00	3,597,600	
西松建設	4,200	2,113.00	8,874,600	
三井住友建設	13,900	588.00	8,173,200	
大豊建設	1,300	2,729.00	3,547,700	
前田建設工業	13,700	850.00	11,645,000	
ナカノフドー建設	1,500	431.00	646,500	
奥村組	3,200	3,305.00	10,576,000	
東鉄工業	2,300	2,998.00	6,895,400	

イチケン	400	1,723.00	689,200	
富士ピー・エス	800	477.00	381,600	
淺沼組	700	3,550.00	2,485,000	
戸田建設	22,300	598.00	13,335,400	
熊谷組	2,700	3,010.00	8,127,000	
青木あすなろ建設	1,000	841.00	841,000	
北野建設	400	2,633.00	1,053,200	
植木組	300	2,236.00	670,800	
矢作建設工業	2,600	760.00	1,976,000	
ピーエス三菱	2,100	605.00	1,270,500	
日本ハウスホールディングス	3,800	446.00	1,694,800	
大東建託	6,900	14,420.00	99,498,000	
新日本建設	2,300	918.00	2,111,400	
ＮＩＰＰＯ	5,100	2,103.00	10,725,300	
東亜道路工業	400	3,295.00	1,318,000	
前田道路	6,000	2,315.00	13,890,000	
日本道路	500	6,230.00	3,115,000	
東亜建設工業	1,800	1,491.00	2,683,800	
日本国土開発	3,200	562.00	1,798,400	
若築建設	1,000	1,439.00	1,439,000	
東洋建設	7,100	419.00	2,974,900	
五洋建設	22,900	530.00	12,137,000	
世紀東急工業	2,900	627.00	1,818,300	
福田組	600	4,530.00	2,718,000	
住友林業	13,600	1,324.00	18,006,400	
日本基礎技術	2,100	337.00	707,700	
巴コーポレーション	2,500	386.00	965,000	
大和ハウス工業	53,200	3,146.00	167,367,200	
ライト工業	3,700	1,427.00	5,279,900	
積水ハウス	58,800	1,908.00	112,190,400	
日特建設	1,800	603.00	1,085,400	
北陸電気工事	1,000	888.00	888,000	
ユアテック	3,100	753.00	2,334,300	
四電工	300	2,660.00	798,000	
中電工	2,500	2,344.00	5,860,000	
関電工	8,800	940.00	8,272,000	

きんでん	12,800	1,656.00	21,196,800	
東京エネシス	2,000	929.00	1,858,000	
トーエネック	600	3,320.00	1,992,000	
住友電設	1,400	1,811.00	2,535,400	
日本電設工業	3,300	2,132.00	7,035,600	
協和エクシオ	7,500	2,666.00	19,995,000	
新日本空調	1,500	1,791.00	2,686,500	
九電工	3,800	3,360.00	12,768,000	
三機工業	4,400	1,224.00	5,385,600	
日揮	16,600	1,420.00	23,572,000	
中外炉工業	600	1,622.00	973,200	
ヤマト	1,800	586.00	1,054,800	
太平電業	1,300	2,244.00	2,917,200	
高砂熱学工業	4,700	1,769.00	8,314,300	
三晃金属工業	300	2,420.00	726,000	
朝日工業社	400	2,679.00	1,071,600	
明星工業	3,500	733.00	2,565,500	
大氣社	2,600	3,360.00	8,736,000	
ダイダン	1,300	2,464.00	3,203,200	
日比谷総合設備	1,700	1,901.00	3,231,700	
東芝プラントシステム	4,100	1,967.00	8,064,700	
東洋エンジニアリング	2,300	536.00	1,232,800	
千代田化工建設	14,100	304.00	4,286,400	
レイズネクスト	3,500	1,217.00	4,259,500	
日本製粉	5,400	1,752.00	9,460,800	
日清製粉グループ本社	19,400	2,501.00	48,519,400	
日東富士製粉	100	5,820.00	582,000	
昭和産業	1,600	3,175.00	5,080,000	
鳥越製粉	1,600	834.00	1,334,400	
中部飼料	2,100	1,257.00	2,639,700	
フィード・ワン	11,500	193.00	2,219,500	
東洋精糖	300	1,020.00	306,000	
日本甜菜製糖	1,000	2,044.00	2,044,000	
三井製糖	1,300	2,266.00	2,945,800	
塩水港精糖	2,100	211.00	443,100	
日新製糖	800	2,017.00	1,613,600	

森永製菓	4,300	5,330.00	22,919,000	
中村屋	500	4,400.00	2,200,000	
江崎グリコ	5,200	4,835.00	25,142,000	
名糖産業	800	1,418.00	1,134,400	
井村屋グループ	700	2,138.00	1,496,600	
不二家	1,000	1,975.00	1,975,000	
山崎製パン	14,100	1,661.00	23,420,100	
第一屋製パン	400	981.00	392,400	
モロゾフ	300	5,010.00	1,503,000	
亀田製菓	1,100	5,000.00	5,500,000	
寿スピリッツ	1,800	6,130.00	11,034,000	
カルビー	7,800	3,025.00	23,595,000	
森永乳業	3,400	4,385.00	14,909,000	
六甲バター	1,300	1,816.00	2,360,800	
ヤクルト本社	12,700	6,290.00	79,883,000	
明治ホールディングス	12,200	7,570.00	92,354,000	
雪印メグミルク	4,100	2,368.00	9,708,800	
プリマハム	2,400	2,108.00	5,059,200	
日本ハム	7,100	4,515.00	32,056,500	
林兼産業	600	654.00	392,400	
丸大食品	1,800	2,104.00	3,787,200	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	1,600	3,475.00	5,560,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	11,000	731.00	8,041,000	
サッポロホールディングス	6,300	2,421.00	15,252,300	
アサヒグループホールディングス	36,000	5,020.00	180,720,000	
キリンホールディングス	77,900	2,331.00	181,584,900	
宝ホールディングス	12,900	1,124.00	14,499,600	
オエノンホールディングス	5,000	375.00	1,875,000	
養命酒製造	500	1,985.00	992,500	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	13,200	2,698.00	35,613,600	
サントリー食品インターナショナル	11,500	4,500.00	51,750,000	
ダイドーグループホールディングス	1,000	4,600.00	4,600,000	
伊藤園	5,200	4,900.00	25,480,000	
キーコーヒー	1,700	2,138.00	3,634,600	
ユニカフェ	500	979.00	489,500	

ジャパンフーズ	300	1,205.00	361,500	
日清オイリオグループ	2,200	3,165.00	6,963,000	
不二製油グループ本社	4,200	3,380.00	14,196,000	
かどや製油	200	4,050.00	810,000	
Ｊ－オイルミルズ	900	4,035.00	3,631,500	
キッコーマン	11,300	4,785.00	54,070,500	
味の素	38,000	1,827.00	69,426,000	
キユーピー	9,600	2,478.00	23,788,800	
ハウス食品グループ本社	6,400	4,055.00	25,952,000	
カゴメ	6,900	2,476.00	17,084,400	
焼津水産化学工業	800	1,104.00	883,200	
アリアケジャパン	1,600	6,730.00	10,768,000	
ピエトロ	200	1,600.00	320,000	
エバラ食品工業	400	2,094.00	837,600	
ニチレイ	8,900	2,686.00	23,905,400	
東洋水産	8,900	4,640.00	41,296,000	
イートアンド	600	1,669.00	1,001,400	
大冷	200	1,939.00	387,800	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	500	840.00	420,000	
日清食品ホールディングス	7,300	6,850.00	50,005,000	
永谷園ホールディングス	900	2,116.00	1,904,400	
一正蒲鉾	700	1,026.00	718,200	
フジッコ	1,900	2,032.00	3,860,800	
ロック・フィールド	1,900	1,423.00	2,703,700	
日本たばこ産業	99,300	2,440.00	242,292,000	
ケンコーマヨネーズ	1,000	2,421.00	2,421,000	
わらべや日洋ホールディングス	1,200	1,737.00	2,084,400	
なとり	1,000	1,633.00	1,633,000	
イフジ産業	400	673.00	269,200	
ピックルスコーポレーション	400	2,292.00	916,800	
北の達人コーポレーション	6,800	666.00	4,528,800	
ユーグレナ	7,400	1,087.00	8,043,800	
ミヨシ油脂	700	1,090.00	763,000	
理研ビタミン	800	3,450.00	2,760,000	
片倉工業	2,100	1,317.00	2,765,700	
グンゼ	1,100	5,000.00	5,500,000	

東洋紡	7,100	1,351.00	9,592,100	
ユニチカ	5,100	417.00	2,126,700	
富士紡ホールディングス	900	2,303.00	2,072,700	
倉敷紡績	1,600	2,037.00	3,259,200	
シキボウ	900	1,008.00	907,200	
日本毛織	5,500	888.00	4,884,000	
ダイトウボウ	3,700	83.00	307,100	
トーア紡コーポレーション	800	458.00	366,400	
ダイドーリミテッド	2,200	294.00	646,800	
帝国繊維	1,900	2,050.00	3,895,000	
帝人	13,700	1,860.00	25,482,000	
東レ	130,300	772.40	100,643,720	
サカイオーベックス	400	1,742.00	696,800	
住江織物	500	2,918.00	1,459,000	
日本フエルト	1,000	454.00	454,000	
日東製網	200	1,444.00	288,800	
アツギ	1,400	914.00	1,279,600	
ダイニック	700	751.00	525,700	
セーレン	4,100	1,546.00	6,338,600	
ソトー	600	974.00	584,400	
東海染工	200	1,117.00	223,400	
小松マテーレ	2,800	803.00	2,248,400	
ワコールホールディングス	4,800	2,873.00	13,790,400	
ホギメディカル	2,100	3,150.00	6,615,000	
レナウン	5,200	136.00	707,200	
クラウディアホールディングス	400	521.00	208,400	
ＴＳＩホールディングス	6,200	627.00	3,887,400	
マツオカコーポレーション	500	2,614.00	1,307,000	
ワールド	2,200	2,170.00	4,774,000	
三陽商会	1,100	1,497.00	1,646,700	
ナイガイ	600	460.00	276,000	
オンワードホールディングス	10,100	593.00	5,989,300	
ルックホールディングス	600	1,211.00	726,600	
キムラタン	9,300	39.00	362,700	
ゴールドウイン	1,500	14,110.00	21,165,000	
デサント	4,100	1,699.00	6,965,900	

キング	900	601.00	540,900	
ヤマトインターナショナル	1,100	419.00	460,900	
特種東海製紙	1,100	3,915.00	4,306,500	
王子ホールディングス	75,600	583.00	44,074,800	
日本製紙	8,100	1,933.00	15,657,300	
三菱製紙	2,900	578.00	1,676,200	
北越コーポレーション	11,100	562.00	6,238,200	
中越パルプ工業	700	1,551.00	1,085,700	
巴川製紙所	600	904.00	542,400	
大王製紙	8,200	1,275.00	10,455,000	
阿波製紙	500	434.00	217,000	
レンゴー	17,400	829.00	14,424,600	
トーモク	1,000	1,800.00	1,800,000	
ザ・パック	1,300	3,375.00	4,387,500	
クラレ	28,300	1,290.00	36,507,000	
旭化成	119,400	1,141.00	136,235,400	
共和レザー	1,100	829.00	911,900	
昭和電工	11,200	3,015.00	33,768,000	
住友化学	132,100	491.00	64,861,100	
住友精化	800	3,365.00	2,692,000	
日産化学	10,200	4,670.00	47,634,000	
ラサ工業	600	1,402.00	841,200	
クレハ	1,500	7,020.00	10,530,000	
多木化学	500	4,195.00	2,097,500	
テイカ	1,400	2,337.00	3,271,800	
石原産業	3,300	1,237.00	4,082,100	
片倉コープアグリ	500	1,057.00	528,500	
日東エフシー	1,200	1,198.00	1,437,600	
日本曹達	2,700	2,700.00	7,290,000	
東ソー	25,900	1,513.00	39,186,700	
トクヤマ	4,800	2,722.00	13,065,600	
セントラル硝子	3,700	2,498.00	9,242,600	
東亞合成	10,500	1,182.00	12,411,000	
大阪ソーダ	1,800	2,630.00	4,734,000	
関東電化工業	4,000	710.00	2,840,000	
デンカ	6,600	3,135.00	20,691,000	

信越化学工業	29,600	9,731.00	288,037,600	
日本カーバイド工業	600	1,335.00	801,000	
堺化学工業	1,100	2,589.00	2,847,900	
第一稀元素化学工業	1,900	864.00	1,641,600	
エア・ウォーター	13,800	1,808.00	24,950,400	
大陽日酸	13,800	2,207.00	30,456,600	
日本化学工業	600	2,075.00	1,245,000	
東邦アセチレン	300	1,311.00	393,300	
日本パーカライジング	9,200	1,183.00	10,883,600	
高圧ガス工業	2,700	860.00	2,322,000	
四国化成工業	2,800	1,137.00	3,183,600	
戸田工業	400	2,316.00	926,400	
ステラ　ケミファ	1,000	2,871.00	2,871,000	
保土谷化学工業	600	2,717.00	1,630,200	
日本触媒	2,800	7,140.00	19,992,000	
大日精化工業	1,400	3,035.00	4,249,000	
カネカ	4,300	3,995.00	17,178,500	
三菱瓦斯化学	17,100	1,439.00	24,606,900	
三井化学	15,200	2,568.00	39,033,600	
ＪＳＲ	16,900	1,661.00	28,070,900	
東京応化工業	2,900	3,415.00	9,903,500	
大阪有機化学工業	1,600	978.00	1,564,800	
三菱ケミカルホールディングス	112,200	752.40	84,419,280	
ＫＨネオケム	2,600	2,701.00	7,022,600	
ダイセル	24,700	933.00	23,045,100	
住友ベークライト	2,900	3,580.00	10,382,000	
積水化学工業	36,100	1,601.00	57,796,100	
日本ゼオン	15,100	1,186.00	17,908,600	
アイカ工業	5,000	3,515.00	17,575,000	
宇部興産	8,500	2,240.00	19,040,000	
積水樹脂	2,800	2,146.00	6,008,800	
タキロンシーアイ	3,600	698.00	2,512,800	
旭有機材	1,200	1,363.00	1,635,600	
日立化成	7,800	3,005.00	23,439,000	
ニチバン	900	1,962.00	1,765,800	
リケンテクノス	4,600	524.00	2,410,400	

大倉工業	900	1,713.00	1,541,700	
積水化成品工業	2,500	741.00	1,852,500	
群栄化学工業	400	2,469.00	987,600	
タイガースポリマー	900	564.00	507,600	
ミライアル	500	1,327.00	663,500	
ダイキアクシス	600	836.00	501,600	
ダイキョーニシカワ	3,500	891.00	3,118,500	
竹本容器	600	1,234.00	740,400	
森六ホールディングス	900	2,489.00	2,240,100	
日本化薬	10,400	1,341.00	13,946,400	
カーリットホールディングス	1,800	628.00	1,130,400	
日本精化	1,400	1,253.00	1,754,200	
扶桑化学工業	1,700	2,033.00	3,456,100	
トリケミカル研究所	400	5,080.00	2,032,000	
ＡＤＥＫＡ	8,300	1,611.00	13,371,300	
日油	6,300	3,935.00	24,790,500	
新日本理化	3,300	208.00	686,400	
ハリマ化成グループ	1,400	1,109.00	1,552,600	
花王	41,600	8,210.00	341,536,000	
第一工業製薬	600	3,220.00	1,932,000	
石原ケミカル	400	1,663.00	665,200	
日華化学	600	842.00	505,200	
三洋化成工業	1,100	5,380.00	5,918,000	
有機合成薬品工業	1,500	235.00	352,500	
大日本塗料	1,900	1,024.00	1,945,600	
日本ペイントホールディングス	13,800	4,395.00	60,651,000	
関西ペイント	18,900	2,078.00	39,274,200	
神東塗料	1,500	174.00	261,000	
中国塗料	5,600	931.00	5,213,600	
日本特殊塗料	1,300	1,371.00	1,782,300	
藤倉化成	2,300	609.00	1,400,700	
太陽ホールディングス	1,400	3,245.00	4,543,000	
ＤＩＣ	7,600	2,899.00	22,032,400	
サカタインクス	3,700	1,024.00	3,788,800	
東洋インキＳＣホールディングス	3,600	2,355.00	8,478,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	1,300	985.00	1,280,500	

富士フイルムホールディングス	35,600	5,450.00	194,020,000	
資生堂	34,100	8,154.00	278,051,400	
ライオン	23,900	2,147.00	51,313,300	
高砂香料工業	1,200	2,921.00	3,505,200	
マンダム	3,900	2,620.00	10,218,000	
ミルボン	2,100	5,470.00	11,487,000	
ファンケル	7,600	2,721.00	20,679,600	
コーセー	2,900	18,070.00	52,403,000	
コタ	900	1,172.00	1,054,800	
シーボン	200	2,389.00	477,800	
ポーラ・オルビスホールディングス	7,300	2,898.00	21,155,400	
ノエビアホールディングス	1,600	5,810.00	9,296,000	
アジュバンコスメジャパン	400	913.00	365,200	
エステー	1,200	1,666.00	1,999,200	
アグロ　カネショウ	700	1,692.00	1,184,400	
コニシ	3,000	1,578.00	4,734,000	
長谷川香料	2,300	1,949.00	4,482,700	
星光ＰＭＣ	1,200	759.00	910,800	
小林製薬	4,800	7,760.00	37,248,000	
荒川化学工業	1,500	1,480.00	2,220,000	
メック	1,200	1,036.00	1,243,200	
日本高純度化学	500	2,335.00	1,167,500	
タカラバイオ	4,500	2,118.00	9,531,000	
ＪＣＵ	2,200	2,030.00	4,466,000	
新田ゼラチン	1,100	720.00	792,000	
ＯＡＴアグリオ	300	1,328.00	398,400	
デクセリアルズ	4,500	707.00	3,181,500	
アース製薬	1,300	4,690.00	6,097,000	
北興化学工業	1,800	485.00	873,000	
大成ラミック	600	2,900.00	1,740,000	
クミアイ化学工業	7,100	792.00	5,623,200	
日本農薬	3,100	426.00	1,320,600	
アキレス	1,300	2,107.00	2,739,100	
有沢製作所	2,700	883.00	2,384,100	
日東電工	11,800	5,200.00	61,360,000	
レック	1,900	1,220.00	2,318,000	

三光合成	2,000	348.00	696,000	
きもと	3,700	174.00	643,800	
藤森工業	1,500	2,954.00	4,431,000	
前澤化成工業	1,200	1,121.00	1,345,200	
未来工業	900	1,929.00	1,736,100	
ウェーブロックホールディングス	500	708.00	354,000	
ＪＳＰ	1,000	1,989.00	1,989,000	
エフピコ	1,900	6,580.00	12,502,000	
天馬	1,200	1,907.00	2,288,400	
信越ポリマー	3,100	738.00	2,287,800	
東リ	4,300	255.00	1,096,500	
ニフコ	6,900	2,670.00	18,423,000	
バルカー	1,400	2,208.00	3,091,200	
ユニ・チャーム	36,400	3,156.00	114,878,400	
ショーエイコーポレーション	100	789.00	78,900	
協和キリン	20,100	1,875.00	37,687,500	
武田薬品工業	149,700	3,790.00	567,363,000	
アステラス製薬	150,800	1,551.50	233,966,200	
大日本住友製薬	12,700	1,961.00	24,904,700	
塩野義製薬	21,900	6,215.00	136,108,500	
田辺三菱製薬	17,900	1,179.00	21,104,100	
わかもと製薬	2,200	262.00	576,400	
あすか製薬	2,100	1,282.00	2,692,200	
日本新薬	4,500	8,040.00	36,180,000	
ビオフェルミン製薬	300	2,264.00	679,200	
中外製薬	17,900	7,180.00	128,522,000	
科研製薬	2,900	5,440.00	15,776,000	
エーザイ	20,500	5,995.00	122,897,500	
ロート製薬	8,800	3,105.00	27,324,000	
小野薬品工業	40,500	1,954.00	79,137,000	
久光製薬	5,100	4,315.00	22,006,500	
持田製薬	2,600	4,765.00	12,389,000	
参天製薬	31,900	1,750.00	55,825,000	
扶桑薬品工業	600	1,930.00	1,158,000	
日本ケミファ	300	2,880.00	864,000	
ツムラ	5,300	3,090.00	16,377,000	

日医工	4,500	1,253.00	5,638,500	
キッセイ薬品工業	3,000	2,688.00	8,064,000	
生化学工業	3,300	1,257.00	4,148,100	
栄研化学	3,000	1,764.00	5,292,000	
日水製薬	700	1,225.00	857,500	
鳥居薬品	900	2,719.00	2,447,100	
ＪＣＲファーマ	1,200	6,720.00	8,064,000	
東和薬品	2,500	2,900.00	7,250,000	
富士製薬工業	1,200	1,447.00	1,736,400	
沢井製薬	3,500	6,140.00	21,490,000	
ゼリア新薬工業	3,400	2,052.00	6,976,800	
第一三共	49,100	6,270.00	307,857,000	
キョーリン製薬ホールディングス	3,800	1,841.00	6,995,800	
大幸薬品	800	2,210.00	1,768,000	
ダイト	1,000	3,190.00	3,190,000	
大塚ホールディングス	32,700	3,822.00	124,979,400	
大正製薬ホールディングス	3,800	8,260.00	31,388,000	
ペプチドリーム	8,600	5,730.00	49,278,000	
日本コークス工業	14,600	93.00	1,357,800	
ニチレキ	2,200	1,052.00	2,314,400	
ユシロ化学工業	900	1,322.00	1,189,800	
ビーピー・カストロール	600	1,353.00	811,800	
富士石油	4,400	261.00	1,148,400	
ＭＯＲＥＳＣＯ	600	1,480.00	888,000	
出光興産	19,800	3,170.00	62,766,000	
ＪＸＴＧホールディングス	288,400	529.30	152,650,120	
コスモエネルギーホールディングス	5,000	2,393.00	11,965,000	
横浜ゴム	9,900	2,067.00	20,463,300	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	8,800	1,468.00	12,918,400	
ブリヂストン	52,700	4,224.00	222,604,800	
住友ゴム工業	15,400	1,233.00	18,988,200	
藤倉コンポジット	1,600	433.00	692,800	
オカモト	1,100	5,040.00	5,544,000	
フコク	800	737.00	589,600	
ニッタ	1,900	2,994.00	5,688,600	
住友理工	3,400	830.00	2,822,000	

三ツ星ベルト	2,300	1,976.00	4,544,800	
バンドー化学	3,300	962.00	3,174,600	
日東紡績	2,500	2,337.00	5,842,500	
ＡＧＣ	17,000	3,695.00	62,815,000	
日本板硝子	8,300	696.00	5,776,800	
石塚硝子	300	2,093.00	627,900	
日本山村硝子	700	1,395.00	976,500	
日本電気硝子	7,400	2,694.00	19,935,600	
オハラ	700	1,406.00	984,200	
住友大阪セメント	3,500	4,160.00	14,560,000	
太平洋セメント	10,800	3,205.00	34,614,000	
日本ヒューム	1,800	706.00	1,270,800	
日本コンクリート工業	3,900	293.00	1,142,700	
三谷セキサン	800	2,971.00	2,376,800	
アジアパイルホールディングス	2,500	562.00	1,405,000	
東海カーボン	15,600	1,078.00	16,816,800	
日本カーボン	800	4,155.00	3,324,000	
東洋炭素	1,000	2,140.00	2,140,000	
ノリタケカンパニーリミテド	1,000	4,345.00	4,345,000	
ＴＯＴＯ	13,200	4,310.00	56,892,000	
日本碍子	20,900	1,553.00	32,457,700	
日本特殊陶業	14,500	1,959.00	28,405,500	
ダントーホールディングス	2,100	114.00	239,400	
ＭＡＲＵＷＡ	600	5,660.00	3,396,000	
品川リフラクトリーズ	500	2,970.00	1,485,000	
黒崎播磨	300	6,140.00	1,842,000	
ヨータイ	1,500	569.00	853,500	
イソライト工業	900	451.00	405,900	
東京窯業	2,200	299.00	657,800	
ニッカトー	800	659.00	527,200	
フジミインコーポレーテッド	1,500	2,220.00	3,330,000	
クニミネ工業	800	872.00	697,600	
エーアンドエーマテリアル	300	1,024.00	307,200	
ニチアス	4,700	1,946.00	9,146,200	
ニチハ	2,400	3,030.00	7,272,000	
日本製鉄	78,800	1,811.50	142,746,200	

神戸製鋼所	31,200	692.00	21,590,400	
合同製鐵	900	2,089.00	1,880,100	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	45,800	1,520.50	69,638,900	
東京製鐵	9,100	837.00	7,616,700	
共英製鋼	1,900	1,870.00	3,553,000	
大和工業	3,600	3,000.00	10,800,000	
東京鐵鋼	700	1,285.00	899,500	
大阪製鐵	1,100	1,688.00	1,856,800	
淀川製鋼所	2,300	2,053.00	4,721,900	
丸一鋼管	6,000	2,882.00	17,292,000	
モリ工業	500	1,984.00	992,000	
大同特殊鋼	2,800	3,970.00	11,116,000	
日本高周波鋼業	700	459.00	321,300	
日本冶金工業	14,500	228.00	3,306,000	
山陽特殊製鋼	2,100	1,430.00	3,003,000	
愛知製鋼	900	3,290.00	2,961,000	
日立金属	18,300	1,192.00	21,813,600	
日本金属	400	919.00	367,600	
大平洋金属	1,200	2,254.00	2,704,800	
新日本電工	10,300	200.00	2,060,000	
栗本鐵工所	900	1,494.00	1,344,600	
虹技	300	1,345.00	403,500	
日本鋳鉄管	200	1,147.00	229,400	
三菱製鋼	1,300	1,212.00	1,575,600	
日亜鋼業	2,600	331.00	860,600	
日本精線	300	2,610.00	783,000	
エンビプロ・ホールディングス	700	648.00	453,600	
シンニッタン	2,700	340.00	918,000	
新家工業	400	1,517.00	606,800	
大紀アルミニウム工業所	2,800	808.00	2,262,400	
日本軽金属ホールディングス	46,200	231.00	10,672,200	
三井金属鉱業	4,600	2,586.00	11,895,600	
東邦亜鉛	1,000	2,476.00	2,476,000	
三菱マテリアル	11,200	3,060.00	34,272,000	
住友金属鉱山	23,200	3,171.00	73,567,200	
ＤＯＷＡホールディングス	4,000	3,485.00	13,940,000	

古河機械金属	2,800	1,468.00	4,110,400	
エス・サイエンス	8,200	61.00	500,200	
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,000	1,816.00	3,632,000	
東邦チタニウム	3,100	1,012.00	3,137,200	
ＵＡＣＪ	2,600	1,829.00	4,755,400	
ＣＫサンエツ	300	2,818.00	845,400	
古河電気工業	4,900	3,110.00	15,239,000	
住友電気工業	63,400	1,391.00	88,189,400	
フジクラ	20,600	406.00	8,363,600	
昭和電線ホールディングス	2,100	867.00	1,820,700	
タツタ電線	3,400	512.00	1,740,800	
カナレ電気	300	1,876.00	562,800	
平河ヒューテック	700	1,232.00	862,400	
リョービ	2,100	1,992.00	4,183,200	
アーレスティ	2,200	560.00	1,232,000	
アサヒホールディングス	3,200	2,289.00	7,324,800	
稲葉製作所	1,000	1,459.00	1,459,000	
宮地エンジニアリンググループ	500	1,776.00	888,000	
トーカロ	4,400	792.00	3,484,800	
アルファＣｏ	600	1,296.00	777,600	
ＳＵＭＣＯ	18,700	1,334.00	24,945,800	
川田テクノロジーズ	400	7,560.00	3,024,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	300	3,090.00	927,000	
信和	1,000	936.00	936,000	
東洋製罐グループホールディングス	10,800	2,018.00	21,794,400	
ホッカンホールディングス	900	1,743.00	1,568,700	
コロナ	1,000	1,022.00	1,022,000	
横河ブリッジホールディングス	3,200	1,648.00	5,273,600	
駒井ハルテック	400	1,656.00	662,400	
高田機工	200	2,522.00	504,400	
三和ホールディングス	17,500	1,128.00	19,740,000	
文化シヤッター	5,000	897.00	4,485,000	
三協立山	2,400	1,289.00	3,093,600	
アルインコ	1,400	1,007.00	1,409,800	
東洋シヤッター	500	683.00	341,500	
ＬＩＸＩＬグループ	25,100	1,756.00	44,075,600	

日本フイルコン	1,300	480.00	624,000	
ノーリツ	3,800	1,298.00	4,932,400	
長府製作所	1,700	2,363.00	4,017,100	
リンナイ	3,000	7,100.00	21,300,000	
ダイニチ工業	1,000	624.00	624,000	
日東精工	2,400	571.00	1,370,400	
三洋工業	300	1,820.00	546,000	
岡部	3,500	918.00	3,213,000	
ジーテクト	1,900	1,576.00	2,994,400	
中国工業	400	588.00	235,200	
東プレ	3,100	1,685.00	5,223,500	
高周波熱錬	3,300	890.00	2,937,000	
東京製綱	1,100	972.00	1,069,200	
サンコール	1,000	511.00	511,000	
モリテック　スチール	1,400	384.00	537,600	
パイオラックス	2,700	1,885.00	5,089,500	
エイチワン	1,700	737.00	1,252,900	
日本発條	16,900	829.00	14,010,100	
中央発條	200	2,855.00	571,000	
アドバネクス	200	1,678.00	335,600	
立川ブラインド工業	800	1,363.00	1,090,400	
三益半導体工業	1,500	1,709.00	2,563,500	
日本ドライケミカル	500	1,114.00	557,000	
日本製鋼所	5,100	1,833.00	9,348,300	
三浦工業	7,300	3,110.00	22,703,000	
タクマ	6,200	1,380.00	8,556,000	
ツガミ	3,900	904.00	3,525,600	
オークマ	2,200	5,720.00	12,584,000	
東芝機械	1,900	2,391.00	4,542,900	
アマダホールディングス	25,500	1,207.00	30,778,500	
アイダエンジニアリング	4,600	869.00	3,997,400	
滝澤鉄工所	500	1,420.00	710,000	
ＦＵＪＩ	6,800	1,377.00	9,363,600	
牧野フライス製作所	2,000	4,405.00	8,810,000	
オーエスジー	8,400	2,203.00	18,505,200	
ダイジェット工業	200	1,536.00	307,200	

旭ダイヤモンド工業	4,500	658.00	2,961,000	
DMG森精機	10,800	1,599.00	17,269,200	
ソディック	3,700	971.00	3,592,700	
ディスコ	2,300	18,750.00	43,125,000	
日東工器	900	2,132.00	1,918,800	
日進工具	500	2,000.00	1,000,000	
パンチ工業	1,200	580.00	696,000	
冨士ダイス	800	633.00	506,400	
豊和工業	1,000	843.00	843,000	
ＯＫＫ	800	812.00	649,600	
東洋機械金属	1,200	591.00	709,200	
津田駒工業	400	1,489.00	595,600	
島精機製作所	2,300	3,105.00	7,141,500	
オプトラン	1,600	2,451.00	3,921,600	
ＮＣホールディングス	600	484.00	290,400	
イワキポンプ	700	1,121.00	784,700	
フリュー	1,400	1,140.00	1,596,000	
ヤマシンフィルタ	3,000	618.00	1,854,000	
日阪製作所	2,100	856.00	1,797,600	
やまびこ	3,300	924.00	3,049,200	
平田機工	800	6,180.00	4,944,000	
ペガサスミシン製造	1,600	555.00	888,000	
マルマエ	700	771.00	539,700	
タツモ	700	843.00	590,100	
ナブテスコ	9,300	2,960.00	27,528,000	
三井海洋開発	1,800	2,790.00	5,022,000	
レオン自動機	1,700	1,801.00	3,061,700	
ＳＭＣ	5,000	39,450.00	197,250,000	
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	1,400	408.00	571,200	
ホソカワミクロン	600	4,420.00	2,652,000	
ユニオンツール	700	3,080.00	2,156,000	
オイレス工業	2,400	1,567.00	3,760,800	
日精エー・エス・ビー機械	600	2,442.00	1,465,200	
サトーホールディングス	2,100	2,674.00	5,615,400	
技研製作所	1,500	3,185.00	4,777,500	

日本エアーテック	500	577.00	288,500	
カワタ	500	1,063.00	531,500	
日精樹脂工業	1,400	1,055.00	1,477,000	
オカダアイヨン	600	1,261.00	756,600	
ワイエイシイホールディングス	700	960.00	672,000	
小松製作所	77,600	2,490.50	193,262,800	
住友重機械工業	9,800	3,590.00	35,182,000	
日立建機	6,900	2,724.00	18,795,600	
日工	500	2,975.00	1,487,500	
巴工業	700	2,369.00	1,658,300	
井関農機	1,700	1,551.00	2,636,700	
ＴＯＷＡ	1,500	781.00	1,171,500	
丸山製作所	400	1,108.00	443,200	
北川鉄工所	800	2,170.00	1,736,000	
ローツェ	800	2,168.00	1,734,400	
タカキタ	600	570.00	342,000	
クボタ	91,800	1,713.50	157,299,300	
荏原実業	500	1,964.00	982,000	
三菱化工機	600	1,622.00	973,200	
月島機械	3,400	1,289.00	4,382,600	
帝国電機製作所	1,200	1,229.00	1,474,800	
新東工業	4,000	956.00	3,824,000	
澁谷工業	1,500	2,934.00	4,401,000	
アイチ　コーポレーション	2,900	711.00	2,061,900	
小森コーポレーション	4,400	1,159.00	5,099,600	
鶴見製作所	1,300	1,933.00	2,512,900	
住友精密工業	300	2,766.00	829,800	
酒井重工業	300	2,714.00	814,200	
荏原製作所	7,600	2,883.00	21,910,800	
石井鐵工所	300	2,009.00	602,700	
西島製作所	1,800	1,024.00	1,843,200	
北越工業	1,800	1,230.00	2,214,000	
ダイキン工業	23,400	14,285.00	334,269,000	
オルガノ	600	3,795.00	2,277,000	
トーヨーカネツ	700	2,039.00	1,427,300	
栗田工業	9,300	2,798.00	26,021,400	

椿本チエイン	2,200	3,500.00	7,700,000	
大同工業	800	890.00	712,000	
木村化工機	1,400	356.00	498,400	
アネスト岩田	2,700	974.00	2,629,800	
ダイフク	9,500	5,880.00	55,860,000	
サムコ	500	913.00	456,500	
加藤製作所	900	1,930.00	1,737,000	
油研工業	300	1,707.00	512,100	
タダノ	8,300	1,040.00	8,632,000	
フジテック	6,200	1,374.00	8,518,800	
ＣＫＤ	4,800	1,137.00	5,457,600	
キトー	1,300	1,624.00	2,111,200	
平和	4,800	2,186.00	10,492,800	
理想科学工業	1,600	1,727.00	2,763,200	
ＳＡＮＫＹＯ	4,300	3,920.00	16,856,000	
日本金銭機械	2,000	1,090.00	2,180,000	
マースグループホールディングス	1,100	2,026.00	2,228,600	
福島工業	1,100	3,430.00	3,773,000	
オーイズミ	800	386.00	308,800	
ダイコク電機	800	1,352.00	1,081,600	
竹内製作所	2,900	1,731.00	5,019,900	
アマノ	4,900	3,010.00	14,749,000	
ＪＵＫＩ	2,500	995.00	2,487,500	
サンデンホールディングス	2,200	531.00	1,168,200	
蛇の目ミシン工業	1,700	459.00	780,300	
マックス	2,600	1,578.00	4,102,800	
グローリー	4,800	2,912.00	13,977,600	
新晃工業	1,600	1,723.00	2,756,800	
大和冷機工業	2,500	1,025.00	2,562,500	
セガサミーホールディングス	17,000	1,315.00	22,355,000	
日本ピストンリング	700	1,400.00	980,000	
リケン	800	4,120.00	3,296,000	
ＴＰＲ	2,300	1,840.00	4,232,000	
ツバキ・ナカシマ	2,600	1,803.00	4,687,800	
ホシザキ	5,000	7,710.00	38,550,000	
大豊工業	1,400	820.00	1,148,000	

日本精工	35,300	941.00	33,217,300	
ＮＴＮ	37,100	317.00	11,760,700	
ジェイテクト	16,400	1,293.00	21,205,200	
不二越	1,600	4,455.00	7,128,000	
日本トムソン	5,200	483.00	2,511,600	
ＴＨＫ	10,700	2,590.00	27,713,000	
ユーシン精機	1,400	969.00	1,356,600	
前澤給装工業	700	1,996.00	1,397,200	
イーグル工業	2,100	1,059.00	2,223,900	
前澤工業	1,200	348.00	417,600	
日本ピラー工業	1,700	1,024.00	1,740,800	
キッツ	6,900	732.00	5,050,800	
マキタ	20,900	3,695.00	77,225,500	
日立造船	13,800	407.00	5,616,600	
三菱重工業	28,700	4,771.00	136,927,700	
ＩＨＩ	13,200	2,465.00	32,538,000	
スター精密	2,900	1,375.00	3,987,500	
日清紡ホールディングス	9,600	839.00	8,054,400	
イビデン	10,500	1,821.00	19,120,500	
コニカミノルタ	37,600	1,088.00	40,908,800	
ブラザー工業	22,400	2,046.00	45,830,400	
ミネベアミツミ	31,800	1,832.00	58,257,600	
日立製作所	77,200	3,967.00	306,252,400	
三菱電機	171,500	1,436.00	246,274,000	
富士電機	11,100	3,605.00	40,015,500	
東洋電機製造	700	1,523.00	1,066,100	
安川電機	19,900	3,525.00	70,147,500	
シンフォニアテクノロジー	2,400	1,233.00	2,959,200	
明電舎	3,400	1,661.00	5,647,400	
オリジン	500	1,441.00	720,500	
山洋電気	800	4,150.00	3,320,000	
デンヨー	1,600	1,538.00	2,460,800	
東芝テック	2,200	3,185.00	7,007,000	
芝浦メカトロニクス	300	2,712.00	813,600	
マブチモーター	4,800	3,715.00	17,832,000	
日本電産	20,600	14,195.00	292,417,000	

ユー・エム・シー・エレクトロニクス	900	1,324.00	1,191,600	
トレックス・セミコンダクター	800	1,193.00	954,400	
東光高岳	900	1,210.00	1,089,000	
ダブル・スコープ	2,500	1,199.00	2,997,500	
ダイヘン	1,900	3,025.00	5,747,500	
ヤーマン	2,500	917.00	2,292,500	
ＪＶＣケンウッド	13,700	252.00	3,452,400	
ミマキエンジニアリング	1,500	612.00	918,000	
第一精工	700	1,252.00	876,400	
日新電機	4,000	1,197.00	4,788,000	
大崎電気工業	3,500	695.00	2,432,500	
オムロン	18,200	5,350.00	97,370,000	
日東工業	2,700	2,134.00	5,761,800	
ＩＤＥＣ	2,300	1,995.00	4,588,500	
正興電機製作所	300	816.00	244,800	
不二電機工業	200	1,264.00	252,800	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	6,200	2,093.00	12,976,600	
サクサホールディングス	400	2,008.00	803,200	
メルコホールディングス	700	3,020.00	2,114,000	
テクノメディカ	400	2,171.00	868,400	
日本電気	22,200	4,385.00	97,347,000	
富士通	16,500	7,787.00	128,485,500	
沖電気工業	7,400	1,404.00	10,389,600	
岩崎通信機	900	792.00	712,800	
電気興業	900	2,919.00	2,627,100	
サンケン電気	2,000	2,283.00	4,566,000	
ナカヨ	300	1,619.00	485,700	
アイホン	1,000	1,629.00	1,629,000	
ルネサスエレクトロニクス	18,100	612.00	11,077,200	
セイコーエプソン	21,300	1,747.00	37,211,100	
ワコム	12,500	356.00	4,450,000	
アルバック	3,400	3,660.00	12,444,000	
アクセル	800	668.00	534,400	
ＥＩＺＯ	1,600	3,950.00	6,320,000	
日本信号	4,400	1,238.00	5,447,200	
京三製作所	3,700	360.00	1,332,000	

能美防災	2,300	2,313.00	5,319,900	
ホーチキ	1,100	1,339.00	1,472,900	
星和電機	1,000	520.00	520,000	
エレコム	1,600	3,880.00	6,208,000	
パナソニック	196,000	920.80	180,476,800	
シャープ	17,100	1,416.00	24,213,600	
アンリツ	11,100	1,823.00	20,235,300	
富士通ゼネラル	5,300	1,679.00	8,898,700	
ソニー	115,100	5,951.00	684,960,100	
ＴＤＫ	9,000	8,230.00	74,070,000	
帝国通信工業	800	1,173.00	938,400	
タムラ製作所	6,600	592.00	3,907,200	
アルプスアルパイン	17,900	1,857.00	33,240,300	
池上通信機	600	1,060.00	636,000	
日本電波工業	1,600	474.00	758,400	
鈴木	900	648.00	583,200	
日本トリム	300	4,850.00	1,455,000	
ローランド　ディー．ジー．	900	2,651.00	2,385,900	
フォスター電機	2,000	1,611.00	3,222,000	
ＳＭＫ	500	2,731.00	1,365,500	
ヨコオ	1,200	2,152.00	2,582,400	
ホシデン	5,100	1,225.00	6,247,500	
ヒロセ電機	2,500	11,790.00	29,475,000	
日本航空電子工業	3,900	1,509.00	5,885,100	
ＴＯＡ	1,900	1,213.00	2,304,700	
マクセルホールディングス	3,700	1,502.00	5,557,400	
古野電気	2,200	962.00	2,116,400	
ユニデンホールディングス	500	1,958.00	979,000	
スミダコーポレーション	1,500	1,140.00	1,710,000	
アイコム	1,000	2,341.00	2,341,000	
リオン	800	2,175.00	1,740,000	
本多通信工業	1,500	497.00	745,500	
船井電機	1,900	789.00	1,499,100	
横河電機	17,200	2,087.00	35,896,400	
新電元工業	600	3,475.00	2,085,000	
アズビル	10,800	2,652.00	28,641,600	

東亜ディーケーケー	800	806.00	644,800	
日本光電工業	7,500	2,964.00	22,230,000	
チノー	600	1,384.00	830,400	
共和電業	1,800	406.00	730,800	
日本電子材料	800	517.00	413,600	
堀場製作所	3,400	5,700.00	19,380,000	
アドバンテスト	11,700	3,060.00	35,802,000	
小野測器	800	552.00	441,600	
エスペック	1,500	2,278.00	3,417,000	
キーエンス	8,400	66,020.00	554,568,000	
日置電機	900	3,475.00	3,127,500	
シスメックス	13,400	7,383.00	98,932,200	
日本マイクロニクス	3,000	945.00	2,835,000	
メガチップス	1,400	1,451.00	2,031,400	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	900	3,570.00	3,213,000	
澤藤電機	200	1,750.00	350,000	
原田工業	800	817.00	653,600	
コーセル	2,200	1,144.00	2,516,800	
イリソ電子工業	1,600	5,100.00	8,160,000	
オプテックスグループ	3,000	1,324.00	3,972,000	
千代田インテグレ	700	2,191.00	1,533,700	
アイ・オー・データ機器	600	934.00	560,400	
レーザーテック	3,500	4,420.00	15,470,000	
スタンレー電気	12,100	2,614.00	31,629,400	
岩崎電気	700	1,301.00	910,700	
ウシオ電機	9,900	1,422.00	14,077,800	
岡谷電機産業	1,300	387.00	503,100	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	1,600	633.00	1,012,800	
エノモト	500	794.00	397,000	
日本セラミック	1,700	2,932.00	4,984,400	
遠藤照明	800	762.00	609,600	
古河電池	1,200	648.00	777,600	
双信電機	900	523.00	470,700	
山一電機	1,300	1,039.00	1,350,700	
図研	1,100	1,840.00	2,024,000	
日本電子	3,400	2,422.00	8,234,800	

カシオ計算機	15,300	1,266.00	19,369,800	
ファナック	16,300	18,820.00	306,766,000	
日本シイエムケイ	4,400	610.00	2,684,000	
エンプラス	800	3,180.00	2,544,000	
大真空	700	1,135.00	794,500	
ローム	8,200	7,280.00	59,696,000	
浜松ホトニクス	12,300	4,075.00	50,122,500	
三井ハイテック	1,900	1,299.00	2,468,100	
新光電気工業	5,800	940.00	5,452,000	
京セラ	26,100	7,080.00	184,788,000	
太陽誘電	7,600	2,093.00	15,906,800	
村田製作所	54,000	4,617.00	249,318,000	
双葉電子工業	2,800	1,417.00	3,967,600	
北陸電気工業	600	1,036.00	621,600	
ニチコン	5,400	874.00	4,719,600	
日本ケミコン	1,300	1,646.00	2,139,800	
ＫＯＡ	2,600	1,349.00	3,507,400	
市光工業	2,600	711.00	1,848,600	
小糸製作所	10,300	5,720.00	58,916,000	
ミツバ	3,300	630.00	2,079,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	3,000	5,080.00	15,240,000	
キヤノン電子	1,600	1,925.00	3,080,000	
キヤノン	92,300	3,163.00	291,944,900	
リコー	51,700	1,038.00	53,664,600	
象印マホービン	4,300	1,287.00	5,534,100	
ＭＵＴＯＨホールディングス	300	1,711.00	513,300	
東京エレクトロン	11,400	16,575.00	188,955,000	
トヨタ紡織	6,000	1,422.00	8,532,000	
芦森工業	400	1,626.00	650,400	
ユニプレス	3,300	1,765.00	5,824,500	
豊田自動織機	13,900	5,930.00	82,427,000	
モリタホールディングス	3,000	1,850.00	5,550,000	
三櫻工業	2,300	437.00	1,005,100	
デンソー	37,800	4,620.00	174,636,000	
東海理化電機製作所	4,500	1,776.00	7,992,000	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	6,300	932.00	5,871,600	

川崎重工業	13,300	2,541.00	33,795,300	
名村造船所	5,300	283.00	1,499,900	
サノヤスホールディングス	2,500	204.00	510,000	
日本車輌製造	600	2,504.00	1,502,400	
三菱ロジスネクスト	2,100	1,123.00	2,358,300	
近畿車輛	200	1,728.00	345,600	
日産自動車	202,200	768.00	155,289,600	
いすゞ自動車	54,200	1,213.50	65,771,700	
トヨタ自動車	191,100	7,027.00	1,342,859,700	代用有価証券 23,000株
日野自動車	21,400	858.00	18,361,200	
三菱自動車工業	63,500	499.00	31,686,500	
エフテック	1,200	742.00	890,400	
レシップホールディングス	700	801.00	560,700	
ＧＭＢ	400	822.00	328,800	
ファルテック	300	821.00	246,300	
武蔵精密工業	4,200	1,383.00	5,808,600	
日産車体	3,400	1,064.00	3,617,600	
新明和工業	7,200	1,340.00	9,648,000	
極東開発工業	3,400	1,347.00	4,579,800	
日信工業	3,200	1,470.00	4,704,000	
トピー工業	1,400	2,381.00	3,333,400	
ティラド	600	1,869.00	1,121,400	
タチエス	2,800	1,350.00	3,780,000	
ＮＯＫ	9,200	1,643.00	15,115,600	
フタバ産業	4,800	651.00	3,124,800	
ＫＹＢ	1,800	3,020.00	5,436,000	
大同メタル工業	2,900	659.00	1,911,100	
プレス工業	8,500	476.00	4,046,000	
ミクニ	2,200	384.00	844,800	
太平洋工業	3,600	1,531.00	5,511,600	
ケーヒン	4,000	1,480.00	5,920,000	
河西工業	2,100	805.00	1,690,500	
アイシン精機	14,100	3,660.00	51,606,000	
マツダ	53,900	1,111.00	59,882,900	
今仙電機製作所	1,600	918.00	1,468,800	

本田技研工業	144,600	2,806.00	405,747,600	
スズキ	31,400	4,533.00	142,336,200	
ＳＵＢＡＲＵ	53,200	2,680.50	142,602,600	
安永	900	1,405.00	1,264,500	
ヤマハ発動機	24,200	1,873.00	45,326,600	
ショーワ	4,100	1,423.00	5,834,300	
ＴＢＫ	2,100	400.00	840,000	
エクセディ	2,300	2,223.00	5,112,900	
豊田合成	5,500	2,070.00	11,385,000	
愛三工業	2,700	670.00	1,809,000	
盟和産業	300	1,041.00	312,300	
日本プラスト	1,400	702.00	982,800	
ヨロズ	1,600	1,369.00	2,190,400	
エフ・シー・シー	3,100	2,123.00	6,581,300	
シマノ	6,900	15,530.00	107,157,000	
テイ・エス　テック	4,000	2,922.00	11,688,000	
ジャムコ	900	2,063.00	1,856,700	
テルモ	48,500	3,138.00	152,193,000	
クリエートメディック	600	922.00	553,200	
日機装	5,600	1,390.00	7,784,000	
島津製作所	22,100	2,715.00	60,001,500	
ＪＭＳ	1,600	747.00	1,195,200	
長野計器	1,400	773.00	1,082,200	
ブイ・テクノロジー	800	4,940.00	3,952,000	
東京計器	1,100	941.00	1,035,100	
愛知時計電機	200	4,110.00	822,000	
インターアクション	1,000	1,669.00	1,669,000	
オーバル	1,700	250.00	425,000	
東京精密	3,100	2,752.00	8,531,200	
マニー	2,300	7,760.00	17,848,000	
ニコン	29,900	1,549.00	46,315,100	
トプコン	9,200	1,317.00	12,116,400	
オリンパス	102,200	1,191.00	121,720,200	
理研計器	1,500	1,968.00	2,952,000	
タムロン	1,500	2,270.00	3,405,000	
ＨＯＹＡ	34,500	8,163.00	281,623,500	

シード	700	1,121.00	784,700	
ノーリツ鋼機	1,400	1,953.00	2,734,200	
エー・アンド・デイ	1,600	752.00	1,203,200	
朝日インテック	14,500	2,740.00	39,730,000	
シチズン時計	18,900	555.00	10,489,500	
リズム時計工業	600	1,275.00	765,000	
大研医器	1,400	632.00	884,800	
メニコン	2,400	3,780.00	9,072,000	
シンシア	300	627.00	188,100	
松風	800	1,381.00	1,104,800	
セイコーホールディングス	2,700	2,260.00	6,102,000	
ニプロ	11,900	1,212.00	14,422,800	
中本パックス	500	1,498.00	749,000	
スノーピーク	700	1,436.00	1,005,200	
パラマウントベッドホールディングス	2,000	4,085.00	8,170,000	
トランザクション	1,100	980.00	1,078,000	
ＳＨＯ－ＢＩ	600	376.00	225,600	
ニホンフラッシュ	800	2,848.00	2,278,400	
前田工繊	1,900	1,951.00	3,706,900	
永大産業	2,400	354.00	849,600	
アートネイチャー	1,800	675.00	1,215,000	
バンダイナムコホールディングス	17,700	5,930.00	104,961,000	
アイフィスジャパン	400	619.00	247,600	
共立印刷	3,000	182.00	546,000	
ＳＨＯＥＩ	800	4,560.00	3,648,000	
フランスベッドホールディングス	2,500	993.00	2,482,500	
パイロットコーポレーション	3,000	4,080.00	12,240,000	
萩原工業	1,000	1,368.00	1,368,000	
トッパン・フォームズ	3,700	933.00	3,452,100	
フジシールインターナショナル	3,800	3,295.00	12,521,000	
タカラトミー	7,200	1,403.00	10,101,600	
廣済堂	1,700	695.00	1,181,500	
エステールホールディングス	600	628.00	376,800	
アーク	7,000	101.00	707,000	
タカノ	700	784.00	548,800	
プロネクサス	1,500	1,110.00	1,665,000	

ホクシン	1,400	133.00	186,200	
ウッドワン	600	1,001.00	600,600	
大建工業	1,300	2,193.00	2,850,900	
凸版印刷	24,200	1,758.00	42,543,600	
大日本印刷	24,100	2,343.00	56,466,300	
図書印刷	1,600	1,413.00	2,260,800	
共同印刷	500	2,840.00	1,420,000	
ＮＩＳＳＨＡ	3,500	1,143.00	4,000,500	
光村印刷	200	1,966.00	393,200	
宝印刷	800	1,685.00	1,348,000	
アシックス	16,300	1,165.00	18,989,500	
ツツミ	600	2,059.00	1,235,400	
小松ウオール工業	600	1,895.00	1,137,000	
ヤマハ	10,200	5,150.00	52,530,000	
河合楽器製作所	600	3,155.00	1,893,000	
クリナップ	1,700	568.00	965,600	
ピジョン	10,400	4,015.00	41,756,000	
兼松サステック	100	1,652.00	165,200	
キングジム	1,600	833.00	1,332,800	
リンテック	4,100	2,264.00	9,282,400	
イトーキ	3,300	451.00	1,488,300	
任天堂	9,800	41,350.00	405,230,000	
三菱鉛筆	2,800	1,673.00	4,684,400	
タカラスタンダード	3,500	1,736.00	6,076,000	
コクヨ	8,200	1,503.00	12,324,600	
ナカバヤシ	1,700	534.00	907,800	
オカムラ	6,000	1,039.00	6,234,000	
美津濃	1,700	2,481.00	4,217,700	
東京電力ホールディングス	136,900	532.00	72,830,800	
中部電力	52,400	1,513.50	79,307,400	
関西電力	70,000	1,257.50	88,025,000	
中国電力	23,700	1,357.00	32,160,900	
北陸電力	16,900	761.00	12,860,900	
東北電力	40,100	1,055.00	42,305,500	
四国電力	15,500	990.00	15,345,000	
九州電力	35,400	1,046.00	37,028,400	

北海道電力	16,100	594.00	9,563,400	
沖縄電力	3,200	1,716.00	5,491,200	
電源開発	13,600	2,463.00	33,496,800	
エフオン	900	807.00	726,300	
イーレックス	3,000	1,093.00	3,279,000	
レノバ	2,900	792.00	2,296,800	
東京瓦斯	33,600	2,671.00	89,745,600	
大阪瓦斯	33,300	1,942.00	64,668,600	
東邦瓦斯	8,500	3,980.00	33,830,000	
北海道瓦斯	900	1,472.00	1,324,800	
広島ガス	3,600	336.00	1,209,600	
西部瓦斯	1,900	2,187.00	4,155,300	
静岡ガス	5,300	822.00	4,356,600	
メタウォーター	800	3,555.00	2,844,000	
ＳＢＳホールディングス	1,700	1,515.00	2,575,500	
東武鉄道	18,100	3,095.00	56,019,500	
相鉄ホールディングス	5,900	2,943.00	17,363,700	
東京急行電鉄	46,600	1,962.00	91,429,200	
京浜急行電鉄	23,500	1,851.00	43,498,500	
小田急電鉄	27,500	2,553.00	70,207,500	
京王電鉄	9,600	7,000.00	67,200,000	
京成電鉄	12,900	4,005.00	51,664,500	
富士急行	2,300	4,105.00	9,441,500	
東日本旅客鉄道	30,500	10,150.00	309,575,000	
西日本旅客鉄道	15,400	8,903.00	137,106,200	
東海旅客鉄道	15,400	21,915.00	337,491,000	
西武ホールディングス	21,300	1,753.00	37,338,900	
鴻池運輸	2,700	1,733.00	4,679,100	
西日本鉄道	4,800	2,378.00	11,414,400	
ハマキョウレックス	1,300	3,915.00	5,089,500	
サカイ引越センター	900	6,860.00	6,174,000	
近鉄グループホールディングス	16,200	5,230.00	84,726,000	
阪急阪神ホールディングス	21,700	3,815.00	82,785,500	
南海電気鉄道	7,300	2,650.00	19,345,000	
京阪ホールディングス	7,200	4,640.00	33,408,000	
神戸電鉄	500	3,985.00	1,992,500	

名古屋鉄道	13,300	3,000.00	39,900,000	
山陽電気鉄道	1,300	2,147.00	2,791,100	
日本通運	6,200	5,780.00	35,836,000	
ヤマトホールディングス	28,500	2,185.50	62,286,750	
山九	4,500	5,770.00	25,965,000	
丸運	900	281.00	252,900	
丸全昭和運輸	1,300	3,430.00	4,459,000	
センコーグループホールディングス	8,900	885.00	7,876,500	
トナミホールディングス	400	5,770.00	2,308,000	
ニッコンホールディングス	6,100	2,603.00	15,878,300	
日本石油輸送	200	2,868.00	573,600	
福山通運	2,100	4,075.00	8,557,500	
セイノーホールディングス	12,100	1,391.00	16,831,100	
エスライン	500	967.00	483,500	
神奈川中央交通	400	3,760.00	1,504,000	
日立物流	3,600	3,430.00	12,348,000	
丸和運輸機関	800	4,560.00	3,648,000	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	1,600	1,331.00	2,129,600	
九州旅客鉄道	13,600	3,180.00	43,248,000	
ＳＧホールディングス	15,300	3,045.00	46,588,500	
日本郵船	13,700	1,809.00	24,783,300	
商船三井	9,700	2,632.00	25,530,400	
川崎汽船	5,000	1,371.00	6,855,000	
ＮＳユナイテッド海運	900	2,397.00	2,157,300	
明治海運	1,800	311.00	559,800	
飯野海運	7,900	371.00	2,930,900	
共栄タンカー	200	1,455.00	291,000	
乾汽船	1,500	885.00	1,327,500	
日本航空	29,800	3,468.00	103,346,400	
ＡＮＡホールディングス	29,700	3,633.00	107,900,100	
パスコ	300	824.00	247,200	
トランコム	500	6,200.00	3,100,000	
日新	1,400	1,787.00	2,501,800	
三菱倉庫	5,600	3,070.00	17,192,000	
三井倉庫ホールディングス	2,000	1,582.00	3,164,000	
住友倉庫	6,000	1,406.00	8,436,000	

澁澤倉庫	900	1,760.00	1,584,000	
東陽倉庫	2,900	324.00	939,600	
日本トランスシティ	3,600	524.00	1,886,400	
ケイヒン	300	1,251.00	375,300	
中央倉庫	1,000	1,077.00	1,077,000	
川西倉庫	300	1,059.00	317,700	
安田倉庫	1,300	903.00	1,173,900	
ファイズ	300	729.00	218,700	
東洋埠頭	500	1,413.00	706,500	
宇徳	1,400	490.00	686,000	
上組	10,000	2,576.00	25,760,000	
サンリツ	400	659.00	263,600	
キムラユニティー	400	1,105.00	442,000	
キユーソー流通システム	400	1,998.00	799,200	
近鉄エクスプレス	3,100	1,418.00	4,395,800	
東海運	1,000	275.00	275,000	
エーアイテイー	1,100	1,020.00	1,122,000	
内外トランスライン	500	1,351.00	675,500	
日本コンセプト	600	1,301.00	780,600	
ＮＥＣネッツエスアイ	1,900	2,737.00	5,200,300	
クロスキャット	400	984.00	393,600	
システナ	6,000	1,815.00	10,890,000	
デジタルアーツ	900	10,180.00	9,162,000	
日鉄ソリューションズ	2,500	3,510.00	8,775,000	
キューブシステム	900	820.00	738,000	
エイジア	400	1,188.00	475,200	
コア	700	1,605.00	1,123,500	
ソリトンシステムズ	1,000	1,061.00	1,061,000	
ソフトクリエイトホールディングス	700	1,624.00	1,136,800	
ＴＩＳ	5,600	5,750.00	32,200,000	
ネオス	700	859.00	601,300	
電算システム	700	3,340.00	2,338,000	
グリー	11,700	522.00	6,107,400	
コーエーテクモホールディングス	3,400	2,004.00	6,813,600	
三菱総合研究所	700	3,375.00	2,362,500	
ボルテージ	400	515.00	206,000	

電算	200	1,965.00	393,000	
ＡＧＳ	900	655.00	589,500	
ファインデックス	1,400	1,059.00	1,482,600	
ブレインパッド	300	6,190.00	1,857,000	
ＫＬａｂ	3,100	866.00	2,684,600	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2,300	1,113.00	2,559,900	
イーブックイニシアティブジャパン	300	2,306.00	691,800	
ネクソン	42,900	1,692.00	72,586,800	
アイスタイル	4,300	784.00	3,371,200	
エムアップ	600	2,475.00	1,485,000	
エイチーム	1,200	1,159.00	1,390,800	
エニグモ	600	2,421.00	1,452,600	
テクノスジャパン	1,400	570.00	798,000	
コロプラ	5,600	663.00	3,712,800	
ブロードリーフ	8,300	578.00	4,797,400	
クロス・マーケティンググループ	700	371.00	259,700	
デジタルハーツホールディングス	800	1,057.00	845,600	
システム情報	900	1,122.00	1,009,800	
メディアドゥホールディングス	500	3,290.00	1,645,000	
じげん	2,400	793.00	1,903,200	
ブイキューブ	1,000	600.00	600,000	
エンカレッジ・テクノロジ	200	816.00	163,200	
サイバーリンクス	300	1,172.00	351,600	
フィックスターズ	1,800	1,805.00	3,249,000	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	900	1,314.00	1,182,600	
オプティム	700	3,000.00	2,100,000	
セレス	500	1,659.00	829,500	
ティーガイア	1,200	2,045.00	2,454,000	
セック	300	3,705.00	1,111,500	
日本アジアグループ	1,900	341.00	647,900	
豆蔵ホールディングス	1,200	1,444.00	1,732,800	
テクマトリックス	1,200	2,193.00	2,631,600	
プロシップ	500	1,268.00	634,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,000	2,923.00	11,692,000	
GMOペイメントゲートウェイ	2,800	6,950.00	19,460,000	

ザッパラス	1,000	332.00	332,000	
システムリサーチ	200	3,710.00	742,000	
インターネットイニシアティブ	2,700	2,102.00	5,675,400	
さくらインターネット	2,100	558.00	1,171,800	
ヴィンクス	600	1,108.00	664,800	
GMOクラウド	400	3,035.00	1,214,000	
ＳＲＡホールディングス	900	2,566.00	2,309,400	
Ｍｉｎｏｒｉソリューションズ	300	1,976.00	592,800	
システムインテグレータ	500	677.00	338,500	
朝日ネット	1,400	684.00	957,600	
ｅＢＡＳＥ	1,000	1,174.00	1,174,000	
アバント	600	2,030.00	1,218,000	
アドソル日進	600	1,766.00	1,059,600	
フリービット	1,100	1,081.00	1,189,100	
コムチュア	900	4,125.00	3,712,500	
サイバーコム	300	1,895.00	568,500	
アステリア	1,100	1,012.00	1,113,200	
マークラインズ	800	1,815.00	1,452,000	
メディカル・データ・ビジョン	1,500	1,146.00	1,719,000	
ｇｕｍｉ	2,300	551.00	1,267,300	
ショーケース	400	558.00	223,200	
モバイルファクトリー	500	1,585.00	792,500	
テラスカイ	300	2,077.00	623,100	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	800	1,724.00	1,379,200	
ＰＣＩホールディングス	300	2,234.00	670,200	
パイプドＨＤ	300	1,262.00	378,600	
アイビーシー	300	1,256.00	376,800	
ネオジャパン	300	1,012.00	303,600	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	100	3,270.00	327,000	
ランドコンピュータ	300	1,100.00	330,000	
ダブルスタンダード	200	4,590.00	918,000	
オープンドア	800	2,837.00	2,269,600	
マイネット	600	671.00	402,600	
アカツキ	600	7,390.00	4,434,000	
ベネフィットジャパン	100	875.00	87,500	

Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	300	1,763.00	528,900	
ＬＩＮＥ	5,100	3,015.00	15,376,500	
カナミックネットワーク	300	2,245.00	673,500	
ノムラシステムコーポレーション	200	977.00	195,400	
チェンジ	300	2,337.00	701,100	
シンクロ・フード	700	573.00	401,100	
オークネット	900	1,283.00	1,154,700	
エイトレッド	200	1,732.00	346,400	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,800	687.00	1,236,600	
マクロミル	3,000	1,293.00	3,879,000	
ビーグリー	500	878.00	439,000	
オロ	500	2,580.00	1,290,000	
サインポスト	300	2,569.00	770,700	
ソルクシーズ	700	962.00	673,400	
フェイス	700	794.00	555,800	
プロトコーポレーション	1,600	1,062.00	1,699,200	
ハイマックス	200	1,804.00	360,800	
野村総合研究所	32,100	1,797.00	57,683,700	
サイバネットシステム	1,400	667.00	933,800	
ＣＥホールディングス	500	1,143.00	571,500	
日本システム技術	300	1,636.00	490,800	
インテージホールディングス	2,200	936.00	2,059,200	
東邦システムサイエンス	500	1,043.00	521,500	
ソースネクスト	6,600	410.00	2,706,000	
インフォコム	1,800	2,434.00	4,381,200	
ＦＩＧ	1,600	339.00	542,400	
アルテリア・ネットワークス	1,900	1,209.00	2,297,100	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	1,791.00	716,400	
フォーカスシステムズ	1,100	859.00	944,900	
クレスコ	500	3,835.00	1,917,500	
フジ・メディア・ホールディングス	17,400	1,498.00	26,065,200	
オービック	5,800	11,700.00	67,860,000	
ジャストシステム	2,400	3,535.00	8,484,000	
ＴＤＣソフト	1,500	880.00	1,320,000	
ヤフー	109,500	329.00	36,025,500	

トレンドマイクロ	9,000	4,780.00	43,020,000	
ＩＤホールディングス	600	1,149.00	689,400	
日本オラクル	3,400	8,920.00	30,328,000	
アルファシステムズ	500	2,730.00	1,365,000	
フューチャー	2,300	2,088.00	4,802,400	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,200	1,312.00	1,574,400	
ソフトバンク・テクノロジー	700	2,262.00	1,583,400	
トーセ	500	855.00	427,500	
オービックビジネスコンサルタント	1,700	4,810.00	8,177,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	7,700	2,749.00	21,167,300	
アイティフォー	2,100	866.00	1,818,600	
東計電算	200	3,070.00	614,000	
エックスネット	300	912.00	273,600	
大塚商会	9,100	4,375.00	39,812,500	
サイボウズ	2,000	1,361.00	2,722,000	
ソフトブレーン	1,300	492.00	639,600	
電通国際情報サービス	1,000	3,550.00	3,550,000	
デジタルガレージ	3,300	3,580.00	11,814,000	
ＥＭシステムズ	1,400	1,644.00	2,301,600	
ウェザーニューズ	600	3,125.00	1,875,000	
ＣＩＪ	1,300	998.00	1,297,400	
東洋ビジネスエンジニアリング	200	2,178.00	435,600	
日本エンタープライズ	1,900	171.00	324,900	
WOWOW	800	2,658.00	2,126,400	
スカラ	1,200	954.00	1,144,800	
インテリジェント　ウェイブ	700	910.00	637,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	1,400	532.00	744,800	
ネットワンシステムズ	6,000	2,941.00	17,646,000	
システムソフト	4,200	119.00	499,800	
アルゴグラフィックス	1,400	2,423.00	3,392,200	
マーベラス	2,600	811.00	2,108,600	
エイベックス	2,900	1,399.00	4,057,100	
日本ユニシス	5,200	3,635.00	18,902,000	
兼松エレクトロニクス	900	3,075.00	2,767,500	
東京放送ホールディングス	11,200	1,859.00	20,820,800	
日本テレビホールディングス	15,400	1,660.00	25,564,000	

朝日放送グループホールディングス	1,700	723.00	1,229,100	
テレビ朝日ホールディングス	4,600	1,864.00	8,574,400	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	11,000	431.00	4,741,000	
テレビ東京ホールディングス	1,400	2,337.00	3,271,800	
日本ＢＳ放送	600	1,062.00	637,200	
ビジョン	500	4,990.00	2,495,000	
スマートバリュー	500	706.00	353,000	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	700	809.00	566,300	
コネクシオ	1,400	1,377.00	1,927,800	
クロップス	400	606.00	242,400	
日本電信電話	115,200	5,111.00	588,787,200	
ＫＤＤＩ	138,100	2,885.00	398,418,500	
ソフトバンク	178,600	1,423.50	254,237,100	
光通信	2,000	24,210.00	48,420,000	
ＮＴＴドコモ	106,700	2,626.50	280,247,550	
エムティーアイ	1,600	805.00	1,288,000	
GMOインターネット	6,100	1,727.00	10,534,700	
アイドママーケティングコミュニケーション	400	684.00	273,600	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	4,900	1,400.00	6,860,000	
学研ホールディングス	600	5,010.00	3,006,000	
ゼンリン	3,400	1,902.00	6,466,800	
昭文社	900	360.00	324,000	
インプレスホールディングス	1,600	139.00	222,400	
アイネット	900	1,179.00	1,061,100	
松竹	1,100	12,160.00	13,376,000	
東宝	11,100	4,780.00	53,058,000	
東映	700	15,030.00	10,521,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	44,700	1,446.00	64,636,200	
ピー・シー・エー	200	3,490.00	698,000	
ビジネスブレイン太田昭和	300	2,276.00	682,800	
ＤＴＳ	3,800	2,278.00	8,656,400	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,800	3,600.00	28,080,000	
シーイーシー	1,800	2,459.00	4,426,200	
カプコン	7,200	2,229.00	16,048,800	
アイ・エス・ビー	400	1,657.00	662,800	
ジャステック	900	1,118.00	1,006,200	

ＳＣＳＫ	4,400	5,370.00	23,628,000	
日本システムウエア	600	2,650.00	1,590,000	
アイネス	2,200	1,109.00	2,439,800	
ＴＫＣ	1,400	4,740.00	6,636,000	
富士ソフト	2,500	4,915.00	12,287,500	
ＮＳＤ	2,800	3,300.00	9,240,000	
コナミホールディングス	6,900	4,745.00	32,740,500	
福井コンピュータホールディングス	600	2,367.00	1,420,200	
ＪＢＣＣホールディングス	1,300	1,457.00	1,894,100	
ミロク情報サービス	1,700	3,295.00	5,601,500	
ソフトバンクグループ	140,700	5,069.00	713,208,300	
ホウスイ	100	845.00	84,500	
高千穂交易	600	1,089.00	653,400	
伊藤忠食品	400	4,680.00	1,872,000	
エレマテック	1,600	1,032.00	1,651,200	
ＪＡＬＵＸ	500	2,750.00	1,375,000	
あらた	1,300	3,630.00	4,719,000	
トーメンデバイス	200	2,337.00	467,400	
東京エレクトロン　デバイス	600	2,004.00	1,202,400	
フィールズ	1,500	513.00	769,500	
双日	93,600	348.00	32,572,800	
アルフレッサ　ホールディングス	18,800	2,695.00	50,666,000	
横浜冷凍	4,700	1,070.00	5,029,000	
神栄	300	800.00	240,000	
ラサ商事	900	829.00	746,100	
ラクーンホールディングス	900	640.00	576,000	
アルコニックス	1,800	1,344.00	2,419,200	
神戸物産	2,600	5,600.00	14,560,000	
あい　ホールディングス	2,400	1,663.00	3,991,200	
ディーブイエックス	700	794.00	555,800	
ダイワボウホールディングス	1,500	5,160.00	7,740,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	4,600	1,496.00	6,881,600	
ラクト・ジャパン	800	3,645.00	2,916,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,200	1,045.00	3,344,000	
八洲電機	1,300	851.00	1,106,300	
メディアスホールディングス	1,000	687.00	687,000	

レスターホールディングス	1,800	1,569.00	2,824,200	
ジューテックホールディングス	400	987.00	394,800	
大光	700	658.00	460,600	
ＯＣＨＩホールディングス	500	1,196.00	598,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	8,900	941.00	8,374,900	
黒谷	400	459.00	183,600	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	300	834.00	250,200	
三洋貿易	900	2,408.00	2,167,200	
ビューティガレージ	300	1,722.00	516,600	
ウイン・パートナーズ	1,100	1,184.00	1,302,400	
ミタチ産業	500	714.00	357,000	
シップヘルスケアホールディングス	3,500	4,865.00	17,027,500	
明治電機工業	500	1,402.00	701,000	
デリカフーズホールディングス	300	1,478.00	443,400	
スターティアホールディングス	300	549.00	164,700	
コメダホールディングス	3,900	2,034.00	7,932,600	
富士興産	700	914.00	639,800	
協栄産業	200	1,438.00	287,600	
小野建	1,500	1,420.00	2,130,000	
南陽	400	1,643.00	657,200	
佐鳥電機	1,300	889.00	1,155,700	
エコートレーディング	400	541.00	216,400	
伯東	1,100	1,225.00	1,347,500	
コンドーテック	1,300	926.00	1,203,800	
中山福	1,100	536.00	589,600	
ナガイレーベン	2,400	2,316.00	5,558,400	
三菱食品	1,800	2,902.00	5,223,600	
松田産業	1,200	1,510.00	1,812,000	
第一興商	2,500	4,885.00	12,212,500	
メディパルホールディングス	18,200	2,418.00	44,007,600	
ＳＰＫ	400	2,545.00	1,018,000	
萩原電気ホールディングス	600	2,886.00	1,731,600	
アズワン	1,200	9,450.00	11,340,000	
スズデン	600	1,334.00	800,400	
シモジマ	1,000	1,134.00	1,134,000	
ドウシシャ	1,600	1,694.00	2,710,400	

小津産業	400	1,756.00	702,400	
高速	1,000	1,226.00	1,226,000	
たけびし	600	1,402.00	841,200	
リックス	400	1,554.00	621,600	
丸文	1,500	588.00	882,000	
ハピネット	1,400	1,310.00	1,834,000	
橋本総業ホールディングス	400	1,557.00	622,800	
日本ライフライン	5,000	1,914.00	9,570,000	
タカショー	1,100	464.00	510,400	
エクセル	600	1,610.00	966,000	
マルカ	600	1,965.00	1,179,000	
ＩＤＯＭ	5,900	381.00	2,247,900	
日本エム・ディ・エム	1,000	1,415.00	1,415,000	
進和	1,000	2,266.00	2,266,000	
エスケイジャパン	500	438.00	219,000	
ダイトロン	800	1,180.00	944,000	
シークス	2,200	1,337.00	2,941,400	
田中商事	600	623.00	373,800	
オーハシテクニカ	1,000	1,517.00	1,517,000	
白銅	500	1,404.00	702,000	
伊藤忠商事	118,100	2,114.50	249,722,450	
丸紅	166,500	718.50	119,630,250	
高島	300	1,760.00	528,000	
長瀬産業	9,500	1,615.00	15,342,500	
蝶理	1,100	1,747.00	1,921,700	
豊田通商	18,800	3,310.00	62,228,000	
三共生興	2,900	531.00	1,539,900	
兼松	6,800	1,218.00	8,282,400	
ツカモトコーポレーション	300	1,018.00	305,400	
三井物産	139,100	1,807.00	251,353,700	
日本紙パルプ商事	1,000	3,730.00	3,730,000	
日立ハイテクノロジーズ	5,100	5,860.00	29,886,000	
カメイ	2,200	1,142.00	2,512,400	
東都水産	300	2,580.00	774,000	
ＯＵＧホールディングス	300	2,702.00	810,600	
スターゼン	600	4,265.00	2,559,000	

山善	6,600	1,046.00	6,903,600	
椿本興業	400	3,265.00	1,306,000	
住友商事	99,900	1,658.00	165,634,200	
内田洋行	700	3,740.00	2,618,000	
三菱商事	118,500	2,936.50	347,975,250	
第一実業	800	3,095.00	2,476,000	
キヤノンマーケティングジャパン	4,800	2,341.00	11,236,800	
西華産業	1,000	1,369.00	1,369,000	
佐藤商事	1,500	911.00	1,366,500	
菱洋エレクトロ	1,700	1,859.00	3,160,300	
東京産業	1,700	510.00	867,000	
ユアサ商事	1,700	3,185.00	5,414,500	
神鋼商事	400	2,344.00	937,600	
小林産業	1,100	309.00	339,900	
阪和興業	2,900	2,922.00	8,473,800	
正栄食品工業	1,200	3,285.00	3,942,000	
カナデン	1,500	1,470.00	2,205,000	
菱電商事	1,300	1,632.00	2,121,600	
フルサト工業	900	1,403.00	1,262,700	
岩谷産業	3,700	3,740.00	13,838,000	
すてきナイスグループ	900	592.00	532,800	
昭光通商	700	646.00	452,200	
ニチモウ	300	1,752.00	525,600	
極東貿易	500	1,712.00	856,000	
イワキ	2,100	475.00	997,500	
三愛石油	4,500	1,048.00	4,716,000	
稲畑産業	4,000	1,415.00	5,660,000	
ＧＳＩクレオス	500	1,301.00	650,500	
明和産業	1,600	390.00	624,000	
クワザワ	600	502.00	301,200	
ワキタ	3,600	1,089.00	3,920,400	
東邦ホールディングス	5,000	2,506.00	12,530,000	
サンゲツ	5,000	2,048.00	10,240,000	
ミツウロコグループホールディングス	2,200	833.00	1,832,600	
シナネンホールディングス	700	1,884.00	1,318,800	
伊藤忠エネクス	3,600	884.00	3,182,400	

サンリオ	5,300	2,378.00	12,603,400	
サンワテクノス	1,000	871.00	871,000	
リョーサン	1,900	2,555.00	4,854,500	
新光商事	1,600	1,915.00	3,064,000	
トーホー	800	2,030.00	1,624,000	
三信電気	1,200	1,791.00	2,149,200	
東陽テクニカ	1,900	1,007.00	1,913,300	
モスフードサービス	2,200	2,424.00	5,332,800	
加賀電子	1,700	1,646.00	2,798,200	
ソーダニッカ	1,800	594.00	1,069,200	
立花エレテック	1,200	1,696.00	2,035,200	
フォーバル	700	939.00	657,300	
ＰＡＬＴＡＣ	3,000	5,970.00	17,910,000	
三谷産業	2,000	283.00	566,000	
太平洋興発	700	753.00	527,100	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	400	3,815.00	1,526,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,225.00	122,500	
国際紙パルプ商事	4,100	318.00	1,303,800	
ヤマタネ	900	1,443.00	1,298,700	
丸紅建材リース	200	1,753.00	350,600	
日鉄物産	1,200	4,475.00	5,370,000	
泉州電業	600	2,801.00	1,680,600	
トラスコ中山	3,500	2,280.00	7,980,000	
オートバックスセブン	6,700	1,800.00	12,060,000	
モリト	1,200	810.00	972,000	
加藤産業	2,600	3,315.00	8,619,000	
北恵	400	856.00	342,400	
イノテック	1,000	876.00	876,000	
イエローハット	3,200	1,440.00	4,608,000	
ＪＫホールディングス	1,600	573.00	916,800	
日伝	1,400	1,937.00	2,711,800	
北沢産業	1,400	262.00	366,800	
杉本商事	900	2,108.00	1,897,200	
因幡電機産業	2,400	4,785.00	11,484,000	
東テク	500	2,363.00	1,181,500	
ミスミグループ本社	21,100	2,500.00	52,750,000	

アルテック	1,600	214.00	342,400	
タキヒヨー	500	1,832.00	916,000	
蔵王産業	300	1,328.00	398,400	
スズケン	7,700	6,400.00	49,280,000	
ジェコス	1,200	1,006.00	1,207,200	
グローセル	1,500	442.00	663,000	
ローソン	4,300	5,430.00	23,349,000	
サンエー	1,300	4,440.00	5,772,000	
カワチ薬品	1,300	2,056.00	2,672,800	
エービーシー・マート	2,600	6,770.00	17,602,000	
ハードオフコーポレーション	700	732.00	512,400	
アスクル	1,800	2,606.00	4,690,800	
ゲオホールディングス	2,600	1,498.00	3,894,800	
アダストリア	2,300	2,117.00	4,869,100	
ジーフット	1,000	657.00	657,000	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	300	708.00	212,400	
くら寿司	1,000	4,430.00	4,430,000	
キャンドゥ	800	1,616.00	1,292,800	
パルグループホールディングス	900	3,595.00	3,235,500	
エディオン	7,200	1,064.00	7,660,800	
サーラコーポレーション	3,400	613.00	2,084,200	
ワッツ	800	700.00	560,000	
ハローズ	600	2,325.00	1,395,000	
フジオフードシステム	700	2,548.00	1,783,600	
あみやき亭	400	3,545.00	1,418,000	
ひらまつ	3,500	364.00	1,274,000	
大黒天物産	400	3,325.00	1,330,000	
ハニーズホールディングス	1,500	1,366.00	2,049,000	
ファーマライズホールディングス	400	556.00	222,400	
アルペン	1,300	1,582.00	2,056,600	
ハブ	600	1,197.00	718,200	
クオールホールディングス	2,500	1,551.00	3,877,500	
ジンズホールディングス	900	6,100.00	5,490,000	
ビックカメラ	10,000	1,091.00	10,910,000	
ＤＣＭホールディングス	9,100	1,095.00	9,964,500	
ペッパーフードサービス	1,300	1,663.00	2,161,900	

ＭｏｎｏｔａＲＯ	10,700	2,343.00	25,070,100	
東京一番フーズ	500	609.00	304,500	
ＤＤホールディングス	400	2,678.00	1,071,200	
きちりホールディングス	500	713.00	356,500	
アークランドサービスホールディングス	1,200	1,939.00	2,326,800	
Ｊ．フロント　リテイリング	21,600	1,267.00	27,367,200	
ドトール・日レスホールディングス	3,000	2,125.00	6,375,000	
マツモトキヨシホールディングス	7,000	3,515.00	24,605,000	
ブロンコビリー	900	2,255.00	2,029,500	
ＺＯＺＯ	18,300	1,843.00	33,726,900	
トレジャー・ファクトリー	500	1,035.00	517,500	
物語コーポレーション	400	9,200.00	3,680,000	
ココカラファイン	1,900	5,920.00	11,248,000	
三越伊勢丹ホールディングス	31,600	889.00	28,092,400	
Ｈａｍｅｅ	500	827.00	413,500	
ウエルシアホールディングス	4,500	5,160.00	23,220,000	
クリエイトＳＤホールディングス	2,500	2,535.00	6,337,500	
丸善ＣＨＩホールディングス	2,000	388.00	776,000	
ミサワ	400	425.00	170,000	
ティーライフ	200	915.00	183,000	
エー・ピーカンパニー	400	502.00	200,800	
チムニー	500	2,440.00	1,220,000	
シュッピン	1,200	791.00	949,200	
ネクステージ	2,800	1,276.00	3,572,800	
ジョイフル本田	4,900	1,246.00	6,105,400	
鳥貴族	600	2,189.00	1,313,400	
キリン堂ホールディングス	700	1,860.00	1,302,000	
ホットランド	900	1,569.00	1,412,100	
すかいらーくホールディングス	15,800	1,959.00	30,952,200	
ＳＦＰホールディングス	700	2,037.00	1,425,900	
綿半ホールディングス	600	2,438.00	1,462,800	
ヨシックス	300	2,573.00	771,900	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,800	951.00	4,564,800	
ゴルフダイジェスト・オンライン	700	600.00	420,000	
ＢＥＥＮＯＳ	600	1,528.00	916,800	

あさひ	1,400	1,282.00	1,794,800	
日本調剤	600	3,325.00	1,995,000	
コスモス薬品	700	20,500.00	14,350,000	
トーエル	800	710.00	568,000	
オンリー	300	860.00	258,000	
セブン&アイ・ホールディングス	70,800	3,732.00	264,225,600	
薬王堂	700	2,471.00	1,729,700	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	4,500	1,598.00	7,191,000	
ツルハホールディングス	3,700	10,970.00	40,589,000	
サンマルクホールディングス	1,300	2,384.00	3,099,200	
フェリシモ	400	972.00	388,800	
トリドールホールディングス	2,100	2,467.00	5,180,700	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	1,500	843.00	1,264,500	
ウイルプラスホールディングス	300	781.00	234,300	
ジャパンミート	900	1,895.00	1,705,500	
サツドラホールディングス	300	1,888.00	566,400	
デファクトスタンダード	200	357.00	71,400	
アレンザホールディングス	900	879.00	791,100	
バロックジャパンリミテッド	1,400	1,077.00	1,507,800	
クスリのアオキホールディングス	1,700	7,530.00	12,801,000	
力の源ホールディングス	600	917.00	550,200	
スシローグローバルホールディングス	1,800	6,870.00	12,366,000	
ＬＩＸＩＬビバ	1,400	1,258.00	1,761,200	
メディカルシステムネットワーク	1,800	548.00	986,400	
はるやまホールディングス	800	806.00	644,800	
ノジマ	3,000	1,789.00	5,367,000	
カッパ・クリエイト	2,400	1,424.00	3,417,600	
ライトオン	1,300	730.00	949,000	
ジーンズメイト	600	362.00	217,200	
良品計画	2,400	19,750.00	47,400,000	
三城ホールディングス	2,100	334.00	701,400	
アドヴァン	2,600	1,114.00	2,896,400	
アルビス	700	2,676.00	1,873,200	
コナカ	2,100	431.00	905,100	
ハウス　オブ　ローゼ	200	1,618.00	323,600	

Ｇ－７ホールディングス	500	3,075.00	1,537,500	
イオン北海道	1,700	732.00	1,244,400	
コジマ	3,000	500.00	1,500,000	
ヒマラヤ	600	824.00	494,400	
コーナン商事	2,200	2,424.00	5,332,800	
エコス	600	1,505.00	903,000	
ワタミ	2,200	1,548.00	3,405,600	
マルシェ	600	772.00	463,200	
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	10,100	6,830.00	68,983,000	
西松屋チェーン	3,700	869.00	3,215,300	
ゼンショーホールディングス	8,000	2,309.00	18,472,000	
幸楽苑ホールディングス	1,100	2,947.00	3,241,700	
ハークスレイ	400	1,055.00	422,000	
サイゼリヤ	2,800	2,604.00	7,291,200	
ＶＴホールディングス	7,600	432.00	3,283,200	
魚力	500	1,516.00	758,000	
ポプラ	600	507.00	304,200	
フジ・コーポレーション	500	2,062.00	1,031,000	
ユナイテッドアローズ	1,900	3,185.00	6,051,500	
ハイデイ日高	2,400	2,086.00	5,006,400	
京都きもの友禅	1,200	330.00	396,000	
コロワイド	5,600	2,144.00	12,006,400	
ピーシーデポコーポレーション	2,300	442.00	1,016,600	
壱番屋	1,200	4,990.00	5,988,000	
ＰＬＡＮＴ	500	770.00	385,000	
スギホールディングス	3,700	5,270.00	19,499,000	
ヴィア・ホールディングス	2,200	623.00	1,370,600	
スクロール	2,700	344.00	928,800	
ヨンドシーホールディングス	1,900	2,541.00	4,827,900	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	18,900	2,531.00	47,835,900	
木曽路	2,100	2,620.00	5,502,000	
ＳＲＳホールディングス	2,000	1,022.00	2,044,000	
千趣会	3,300	282.00	930,600	
タカキュー	1,500	181.00	271,500	
ケーヨー	3,200	477.00	1,526,400	

上新電機	2,000	2,107.00	4,214,000	
日本瓦斯	2,700	2,799.00	7,557,300	
ロイヤルホールディングス	2,900	2,777.00	8,053,300	
東天紅	100	1,214.00	121,400	
いなげや	1,900	1,392.00	2,644,800	
島忠	3,600	2,457.00	8,845,200	
チヨダ	1,800	1,616.00	2,908,800	
ライフコーポレーション	1,300	2,320.00	3,016,000	
リンガーハット	2,100	2,502.00	5,254,200	
ＭｒＭａｘＨＤ	2,300	457.00	1,051,100	
テンアライド	1,700	425.00	722,500	
ＡＯＫＩホールディングス	3,300	1,059.00	3,494,700	
オークワ	2,400	1,082.00	2,596,800	
コメリ	2,600	2,265.00	5,889,000	
青山商事	3,000	2,102.00	6,306,000	
しまむら	2,000	8,110.00	16,220,000	
はせがわ	900	399.00	359,100	
高島屋	13,300	1,245.00	16,558,500	
松屋	3,400	825.00	2,805,000	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	8,700	1,253.00	10,901,100	
近鉄百貨店	600	3,240.00	1,944,000	
パルコ	1,600	1,191.00	1,905,600	
丸井グループ	14,300	2,358.00	33,719,400	
アクシアル　リテイリング	1,400	3,895.00	5,453,000	
イオン	65,000	1,862.00	121,030,000	
イズミ	3,400	4,275.00	14,535,000	
平和堂	3,400	1,997.00	6,789,800	
フジ	2,000	1,875.00	3,750,000	
ヤオコー	1,900	4,865.00	9,243,500	
ゼビオホールディングス	2,000	1,288.00	2,576,000	
ケーズホールディングス	17,500	1,040.00	18,200,000	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	1,000	667.00	667,000	
日産東京販売ホールディングス	2,600	285.00	741,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	800	2,607.00	2,085,600	
総合メディカルホールディングス	1,500	1,658.00	2,487,000	
ブックオフグループホールディングス	900	1,236.00	1,112,400	

アインホールディングス	2,300	6,400.00	14,720,000	
元気寿司	500	3,260.00	1,630,000	
ヤマダ電機	51,500	496.00	25,544,000	
アークランドサカモト	2,800	1,313.00	3,676,400	
ニトリホールディングス	7,300	14,760.00	107,748,000	
愛眼	1,400	263.00	368,200	
ケーユーホールディングス	900	897.00	807,300	
吉野家ホールディングス	5,900	2,196.00	12,956,400	
松屋フーズホールディングス	800	3,435.00	2,748,000	
サガミホールディングス	2,300	1,349.00	3,102,700	
関西スーパーマーケット	1,300	1,124.00	1,461,200	
王将フードサービス	1,200	6,490.00	7,788,000	
プレナス	1,900	1,800.00	3,420,000	
ミニストップ	1,300	1,537.00	1,998,100	
アークス	3,100	2,210.00	6,851,000	
バローホールディングス	3,600	2,319.00	8,348,400	
藤久	200	728.00	145,600	
ベルク	800	5,330.00	4,264,000	
大庄	900	1,623.00	1,460,700	
ファーストリテイリング	2,300	69,030.00	158,769,000	
サンドラッグ	6,300	3,070.00	19,341,000	
サックスバー　ホールディングス	1,400	999.00	1,398,600	
ヤマザワ	400	1,676.00	670,400	
やまや	300	2,199.00	659,700	
ベルーナ	4,100	712.00	2,919,200	
島根銀行	400	710.00	284,000	
じもとホールディングス	11,700	99.00	1,158,300	
めぶきフィナンシャルグループ	87,400	276.00	24,122,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,300	1,562.00	3,592,600	
九州フィナンシャルグループ	27,700	433.00	11,994,100	
ゆうちょ銀行	47,700	1,086.00	51,802,200	
富山第一銀行	3,900	308.00	1,201,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	106,000	409.00	43,354,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	10,600	796.00	8,437,600	
関西みらいフィナンシャルグループ	7,800	721.00	5,623,800	
三十三フィナンシャルグループ	1,500	1,586.00	2,379,000	

第四北越フィナンシャルグループ	2,900	2,797.00	8,111,300	
新生銀行	12,500	1,685.00	21,062,500	
あおぞら銀行	9,500	2,555.00	24,272,500	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	1,164,100	523.40	609,289,940	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	185,700	461.70	85,737,690	
三井住友トラスト・ホールディングス	33,200	3,899.00	129,446,800	
三井住友フィナンシャルグループ	119,200	3,837.00	457,370,400	代用有価証券 13,000株
千葉銀行	58,100	557.00	32,361,700	
群馬銀行	33,800	384.00	12,979,200	
武蔵野銀行	2,500	2,129.00	5,322,500	
千葉興業銀行	4,800	267.00	1,281,600	
筑波銀行	7,200	171.00	1,231,200	
七十七銀行	5,300	1,625.00	8,612,500	
青森銀行	1,300	2,746.00	3,569,800	
秋田銀行	1,100	2,045.00	2,249,500	
山形銀行	1,900	1,688.00	3,207,200	
岩手銀行	1,200	2,855.00	3,426,000	
東邦銀行	15,100	270.00	4,077,000	
東北銀行	900	1,068.00	961,200	
みちのく銀行	1,100	1,729.00	1,901,900	
ふくおかフィナンシャルグループ	14,900	1,990.00	29,651,000	
静岡銀行	41,900	814.00	34,106,600	
十六銀行	2,300	2,403.00	5,526,900	
スルガ銀行	17,700	413.00	7,310,100	
八十二銀行	40,800	450.00	18,360,000	
山梨中央銀行	2,100	1,159.00	2,433,900	
大垣共立銀行	3,600	2,459.00	8,852,400	
福井銀行	1,500	1,477.00	2,215,500	
北國銀行	1,700	2,989.00	5,081,300	
清水銀行	700	1,856.00	1,299,200	
富山銀行	300	2,600.00	780,000	
滋賀銀行	3,400	2,520.00	8,568,000	
南都銀行	2,600	2,387.00	6,206,200	
百五銀行	15,200	332.00	5,046,400	
京都銀行	6,100	4,205.00	25,650,500	

紀陽銀行	6,000	1,459.00	8,754,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	11,300	1,143.00	12,915,900	
広島銀行	25,000	535.00	13,375,000	
山陰合同銀行	10,000	701.00	7,010,000	
中国銀行	14,600	989.00	14,439,400	
鳥取銀行	600	1,438.00	862,800	
伊予銀行	22,400	569.00	12,745,600	
百十四銀行	1,800	2,287.00	4,116,600	
四国銀行	2,400	957.00	2,296,800	
阿波銀行	2,600	2,618.00	6,806,800	
大分銀行	1,000	3,150.00	3,150,000	
宮崎銀行	1,100	2,664.00	2,930,400	
佐賀銀行	1,000	1,602.00	1,602,000	
沖縄銀行	1,500	3,470.00	5,205,000	
琉球銀行	3,900	1,144.00	4,461,600	
セブン銀行	57,200	294.00	16,816,800	
みずほフィナンシャルグループ	2,297,600	158.00	363,020,800	
高知銀行	600	799.00	479,400	
山口フィナンシャルグループ	21,200	783.00	16,599,600	
長野銀行	600	1,736.00	1,041,600	
名古屋銀行	1,400	3,455.00	4,837,000	
北洋銀行	25,600	259.00	6,630,400	
愛知銀行	600	3,765.00	2,259,000	
中京銀行	700	2,259.00	1,581,300	
大光銀行	600	1,780.00	1,068,000	
愛媛銀行	2,300	1,090.00	2,507,000	
トマト銀行	600	1,069.00	641,400	
京葉銀行	7,200	655.00	4,716,000	
栃木銀行	9,000	179.00	1,611,000	
北日本銀行	500	1,816.00	908,000	
東和銀行	3,000	737.00	2,211,000	
福島銀行	1,600	252.00	403,200	
大東銀行	800	553.00	442,400	
トモニホールディングス	13,100	367.00	4,807,700	
フィデアホールディングス	16,300	117.00	1,907,100	
池田泉州ホールディングス	18,000	201.00	3,618,000	

ＦＰＧ	5,300	928.00	4,918,400	
マーキュリアインベストメント	700	784.00	548,800	
ＳＢＩホールディングス	20,200	2,668.00	53,893,600	
ジャフコ	2,800	4,100.00	11,480,000	
大和証券グループ本社	135,500	473.00	64,091,500	
野村ホールディングス	297,700	371.40	110,565,780	
岡三証券グループ	14,700	403.00	5,924,100	
丸三証券	5,200	569.00	2,958,800	
東洋証券	7,000	122.00	854,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	20,300	316.00	6,414,800	
光世証券	500	668.00	334,000	
水戸証券	5,300	208.00	1,102,400	
いちよし証券	3,600	746.00	2,685,600	
松井証券	8,300	1,018.00	8,449,400	
だいこう証券ビジネス	800	487.00	389,600	
マネックスグループ	15,900	349.00	5,549,100	
カブドットコム証券	3,600	558.00	2,008,800	
極東証券	2,300	904.00	2,079,200	
岩井コスモホールディングス	1,800	1,178.00	2,120,400	
藍澤證券	3,100	648.00	2,008,800	
マネーパートナーズグループ	2,200	290.00	638,000	
スパークス・グループ	6,700	225.00	1,507,500	
かんぽ生命保険	6,000	1,760.00	10,560,000	
ＳＯＭＰＯホールディングス	29,800	4,426.00	131,894,800	
アニコム　ホールディングス	1,400	3,805.00	5,327,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	44,200	3,568.00	157,705,600	
ソニーフィナンシャルホールディングス	13,900	2,564.00	35,639,600	
第一生命ホールディングス	95,700	1,635.50	156,517,350	
東京海上ホールディングス	60,500	5,670.00	343,035,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	52,400	1,203.00	63,037,200	
アドバンスクリエイト	400	1,835.00	734,000	
全国保証	4,800	4,280.00	20,544,000	
ジェイリース	600	338.00	202,800	
イントラスト	500	597.00	298,500	
日本モーゲージサービス	300	1,169.00	350,700	

Ｃａｓａ	800	1,177.00	941,600	
アルヒ	1,600	1,981.00	3,169,600	
プレミアグループ	1,000	1,900.00	1,900,000	
クレディセゾン	11,900	1,285.00	15,291,500	
芙蓉総合リース	1,900	6,300.00	11,970,000	
興銀リース	3,200	2,754.00	8,812,800	
東京センチュリー	3,400	4,590.00	15,606,000	
日本証券金融	7,500	564.00	4,230,000	
アイフル	26,200	223.00	5,842,600	
リコーリース	1,300	3,310.00	4,303,000	
イオンフィナンシャルサービス	10,800	1,775.00	19,170,000	
アコム	34,000	385.00	13,090,000	
ジャックス	1,800	2,165.00	3,897,000	
オリエントコーポレーション	45,700	120.00	5,484,000	
日立キャピタル	4,000	2,334.00	9,336,000	
アプラスフィナンシャル	8,500	73.00	620,500	
オリックス	112,800	1,677.00	189,165,600	
三菱ＵＦＪリース	38,000	590.00	22,420,000	
九州リースサービス	900	618.00	556,200	
日本取引所グループ	45,700	1,723.00	78,741,100	
イー・ギャランティ	1,600	1,263.00	2,020,800	
アサックス	700	589.00	412,300	
ＮＥＣキャピタルソリューション	700	2,036.00	1,425,200	
いちご	21,300	387.00	8,243,100	
日本駐車場開発	18,600	183.00	3,403,800	
スター・マイカ・ホールディングス	800	1,682.00	1,345,600	
ヒューリック	35,300	913.00	32,228,900	
三栄建築設計	700	1,558.00	1,090,600	
野村不動産ホールディングス	11,300	2,432.00	27,481,600	
三重交通グループホールディングス	3,500	578.00	2,023,000	
サムティ	2,400	1,671.00	4,010,400	
ディア・ライフ	2,200	472.00	1,038,400	
コーセーアールイー	500	761.00	380,500	
エー・ディー・ワークス	52,100	35.00	1,823,500	
日本商業開発	1,100	1,518.00	1,669,800	
プレサンスコーポレーション	2,700	1,572.00	4,244,400	

ユニゾホールディングス	2,600	3,300.00	8,580,000	
ＴＨＥグローバル社	1,000	519.00	519,000	
日本管理センター	1,100	1,154.00	1,269,400	
サンセイランディック	500	761.00	380,500	
エストラスト	300	720.00	216,000	
フージャースホールディングス	3,700	625.00	2,312,500	
オープンハウス	2,400	4,665.00	11,196,000	
東急不動産ホールディングス	45,500	650.00	29,575,000	
飯田グループホールディングス	14,000	1,798.00	25,172,000	
イーグランド	300	710.00	213,000	
ムゲンエステート	1,200	572.00	686,400	
ビーロット	400	2,183.00	873,200	
ファーストブラザーズ	500	1,041.00	520,500	
ハウスドゥ	1,000	1,532.00	1,532,000	
シーアールイー	400	1,133.00	453,200	
プロパティエージェント	200	1,129.00	225,800	
ケイアイスター不動産	500	1,747.00	873,500	
アグレ都市デザイン	300	498.00	149,400	
グッドコムアセット	400	1,533.00	613,200	
ジェイ・エス・ビー	100	4,700.00	470,000	
テンポイノベーション	200	1,674.00	334,800	
グローバル・リンク・マネジメント	200	587.00	117,400	
パーク２４	9,900	2,460.00	24,354,000	
パラカ	400	2,082.00	832,800	
三井不動産	89,700	2,532.00	227,120,400	
三菱地所	118,500	2,032.00	240,792,000	
平和不動産	3,100	2,337.00	7,244,700	
東京建物	18,500	1,316.00	24,346,000	
ダイビル	5,000	1,023.00	5,115,000	
京阪神ビルディング	3,000	1,018.00	3,054,000	
住友不動産	38,000	3,998.00	151,924,000	
テーオーシー	3,900	697.00	2,718,300	
東京楽天地	200	5,210.00	1,042,000	
レオパレス２１	21,100	242.00	5,106,200	
スターツコーポレーション	2,300	2,691.00	6,189,300	
フジ住宅	2,200	755.00	1,661,000	

空港施設	2,000	509.00	1,018,000	
明和地所	1,000	559.00	559,000	
ゴールドクレスト	1,300	1,959.00	2,546,700	
日本エスリード	700	1,648.00	1,153,600	
日神不動産	2,500	468.00	1,170,000	
日本エスコン	3,100	685.00	2,123,500	
タカラレーベン	7,800	392.00	3,057,600	
サンヨーハウジング名古屋	1,000	951.00	951,000	
イオンモール	8,500	1,704.00	14,484,000	
毎日コムネット	400	731.00	292,400	
ファースト住建	700	1,251.00	875,700	
カチタス	1,900	4,215.00	8,008,500	
トーセイ	2,300	1,144.00	2,631,200	
穴吹興産	200	2,872.00	574,400	
サンフロンティア不動産	2,300	1,098.00	2,525,400	
エフ・ジェー・ネクスト	1,500	1,065.00	1,597,500	
インテリックス	500	676.00	338,000	
ランドビジネス	700	773.00	541,100	
グランディハウス	1,500	478.00	717,000	
日本空港ビルデング	5,400	4,235.00	22,869,000	
日本工営	1,100	2,388.00	2,626,800	
ＬＩＦＵＬＬ	5,800	519.00	3,010,200	
ジェイエイシーリクルートメント	1,300	2,507.00	3,259,100	
日本M&Aセンター	12,200	2,723.00	33,220,600	
メンバーズ	600	1,978.00	1,186,800	
中広	200	603.00	120,600	
アイティメディア	300	537.00	161,100	
タケエイ	1,700	924.00	1,570,800	
Ｅ・Ｊホールディングス	200	1,303.00	260,600	
トラスト・テック	1,800	1,534.00	2,761,200	
コシダカホールディングス	3,900	1,484.00	5,787,600	
アルトナー	400	773.00	309,200	
パソナグループ	2,000	1,673.00	3,346,000	
ＣＤＳ	400	1,321.00	528,400	
リンクアンドモチベーション	3,000	555.00	1,665,000	
ＧＣＡ	1,700	709.00	1,205,300	

エス・エム・エス	6,000	2,570.00	15,420,000	
サニーサイドアップ	400	1,004.00	401,600	
パーソルホールディングス	16,400	2,548.00	41,787,200	
リニカル	900	997.00	897,300	
クックパッド	5,300	311.00	1,648,300	
エスクリ	500	745.00	372,500	
アイ・ケイ・ケイ	800	705.00	564,000	
学情	600	1,165.00	699,000	
スタジオアリス	800	2,021.00	1,616,800	
シミックホールディングス	900	2,074.00	1,866,600	
ＮＪＳ	400	1,726.00	690,400	
綜合警備保障	6,500	4,895.00	31,817,500	
カカクコム	12,300	2,254.00	27,724,200	
アイロムグループ	600	1,749.00	1,049,400	
セントケア・ホールディング	1,200	510.00	612,000	
サイネックス	300	648.00	194,400	
ルネサンス	900	1,740.00	1,566,000	
ディップ	2,600	2,060.00	5,356,000	
オプトホールディング	1,000	1,606.00	1,606,000	
新日本科学	2,300	715.00	1,644,500	
ツクイ	3,900	527.00	2,055,300	
キャリアデザインセンター	400	1,594.00	637,600	
ベネフィット・ワン	4,500	1,876.00	8,442,000	
エムスリー	34,500	2,002.00	69,069,000	
ツカダ・グローバルホールディング	1,000	589.00	589,000	
ブラス	200	746.00	149,200	
アウトソーシング	8,700	1,357.00	11,805,900	
ウェルネット	1,600	935.00	1,496,000	
ワールドホールディングス	400	1,613.00	645,200	
ディー・エヌ・エー	8,800	2,202.00	19,377,600	
博報堂ＤＹホールディングス	22,800	1,734.00	39,535,200	
ぐるなび	2,400	640.00	1,536,000	
タカミヤ	1,700	776.00	1,319,200	
ジャパンベストレスキューシステム	1,200	1,398.00	1,677,600	
ファンコミュニケーションズ	4,500	557.00	2,506,500	
ライク	600	1,460.00	876,000	

ビジネス・ブレークスルー	700	373.00	261,100	
ＷＤＢホールディングス	800	2,696.00	2,156,800	
ティア	900	645.00	580,500	
ＣＤＧ	100	1,381.00	138,100	
バリューコマース	1,100	2,313.00	2,544,300	
インフォマート	9,000	1,580.00	14,220,000	
ＪＰホールディングス	4,700	289.00	1,358,300	
エコナックホールディングス	3,200	125.00	400,000	
ＥＰＳホールディングス	2,500	1,701.00	4,252,500	
レッグス	400	1,800.00	720,000	
プレステージ・インターナショナル	3,100	1,659.00	5,142,900	
アミューズ	1,000	2,446.00	2,446,000	
ドリームインキュベータ	500	1,403.00	701,500	
クイック	1,000	1,592.00	1,592,000	
ＴＡＣ	1,000	195.00	195,000	
ケネディクス	14,500	576.00	8,352,000	
電通	20,000	3,670.00	73,400,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	700	1,057.00	739,900	
ぴあ	500	4,770.00	2,385,000	
イオンファンタジー	600	2,624.00	1,574,400	
シーティーエス	1,900	675.00	1,282,500	
ネクシィーズグループ	600	2,073.00	1,243,800	
みらかホールディングス	4,600	2,491.00	11,458,600	
アルプス技研	1,500	1,624.00	2,436,000	
日本空調サービス	1,900	711.00	1,350,900	
オリエンタルランド	19,300	14,150.00	273,095,000	
ダスキン	4,200	2,969.00	12,469,800	
明光ネットワークジャパン	2,000	965.00	1,930,000	
ファルコホールディングス	900	1,628.00	1,465,200	
秀英予備校	500	433.00	216,500	
田谷	400	599.00	239,600	
ラウンドワン	5,100	1,635.00	8,338,500	
リゾートトラスト	6,900	1,633.00	11,267,700	
ビー・エム・エル	2,100	2,985.00	6,268,500	
ワタベウェディング	300	617.00	185,100	
りらいあコミュニケーションズ	3,000	1,283.00	3,849,000	

リソー教育	8,300	491.00	4,075,300	
早稲田アカデミー	500	755.00	377,500	
ユー・エス・エス	20,000	2,175.00	43,500,000	
東京個別指導学院	600	944.00	566,400	
サイバーエージェント	9,400	3,830.00	36,002,000	
楽天	76,400	1,162.00	88,776,800	
クリーク・アンド・リバー社	1,000	1,339.00	1,339,000	
テー・オー・ダブリュー	1,400	783.00	1,096,200	
山田コンサルティンググループ	800	1,973.00	1,578,400	
セントラルスポーツ	600	3,145.00	1,887,000	
フルキャストホールディングス	1,600	2,291.00	3,665,600	
エン・ジャパン	2,400	4,540.00	10,896,000	
リソルホールディングス	200	4,010.00	802,000	
テクノプロ・ホールディングス	3,300	6,110.00	20,163,000	
アトラ	300	281.00	84,300	
インターワークス	300	699.00	209,700	
アイ・アールジャパンホールディングス	700	2,711.00	1,897,700	
ＫｅｅＰｅｒ技研	600	1,287.00	772,200	
ファーストロジック	400	579.00	231,600	
三機サービス	400	1,044.00	417,600	
Ｇｕｎｏｓｙ	1,200	1,879.00	2,254,800	
デザインワン・ジャパン	400	286.00	114,400	
イー・ガーディアン	900	1,900.00	1,710,000	
リブセンス	1,000	256.00	256,000	
ジャパンマテリアル	4,400	1,530.00	6,732,000	
ベクトル	2,100	826.00	1,734,600	
ウチヤマホールディングス	900	520.00	468,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	600	1,731.00	1,038,600	
ライクキッズネクスト	400	1,086.00	434,400	
キャリアリンク	700	550.00	385,000	
ＩＢＪ	1,100	943.00	1,037,300	
アサンテ	700	2,103.00	1,472,100	
Ｎ・フィールド	1,100	713.00	784,300	
バリューＨＲ	400	3,390.00	1,356,000	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	600	6,410.00	3,846,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	700	1,222.00	855,400	

ＥＲＩホールディングス	500	793.00	396,500	
アビスト	200	2,614.00	522,800	
シグマクシス	800	1,352.00	1,081,600	
ウィルグループ	1,100	872.00	959,200	
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,400	245.00	588,000	
日本ビューホテル	500	1,428.00	714,000	
リクルートホールディングス	117,400	3,568.00	418,883,200	
エラン	1,100	1,642.00	1,806,200	
土木管理総合試験所	700	463.00	324,100	
ネットマーケティング	700	541.00	378,700	
日本郵政	134,200	1,127.00	151,243,400	
ベルシステム２４ホールディングス	2,700	1,619.00	4,371,300	
鎌倉新書	1,200	1,500.00	1,800,000	
ソネット・メディア・ネットワークス	200	831.00	166,200	
一蔵	200	705.00	141,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	400	1,875.00	750,000	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	200	1,005.00	201,000	
エボラブルアジア	700	2,513.00	1,759,100	
アトラエ	400	2,524.00	1,009,600	
ストライク	600	2,561.00	1,536,600	
ソラスト	4,000	1,113.00	4,452,000	
セラク	500	714.00	357,000	
インソース	700	2,785.00	1,949,500	
ベイカレント・コンサルティング	1,100	4,470.00	4,917,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	300	1,274.00	382,200	
アイモバイル	500	770.00	385,000	
キャリアインデックス	600	782.00	469,200	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	700	1,612.00	1,128,400	
船場	300	953.00	285,900	
グレイステクノロジー	600	2,699.00	1,619,400	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,300	2,617.00	3,402,100	
フルテック	200	1,150.00	230,000	
グリーンズ	600	1,510.00	906,000	
ツナググループ・ホールディングス	200	623.00	124,600	
ソウルドアウト	200	2,053.00	410,600	

ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	300	1,072.00	321,600	
日総工産	1,100	1,509.00	1,659,900	
キュービーネットホールディングス	1,000	2,306.00	2,306,000	
ＲＰＡホールディングス	700	1,772.00	1,240,400	
スプリックス	600	1,646.00	987,600	
アドバンテッジリスクマネジメント	700	722.00	505,400	
リログループ	8,900	2,887.00	25,694,300	
東祥	1,000	2,673.00	2,673,000	
エイチ・アイ・エス	2,900	2,611.00	7,571,900	
ラックランド	300	2,221.00	666,300	
共立メンテナンス	2,500	4,710.00	11,775,000	
イチネンホールディングス	1,700	1,148.00	1,951,600	
建設技術研究所	1,100	1,557.00	1,712,700	
スペース	1,000	1,179.00	1,179,000	
長大	700	766.00	536,200	
燦ホールディングス	400	2,313.00	925,200	
スバル興業	100	6,250.00	625,000	
東京テアトル	700	1,368.00	957,600	
タナベ経営	300	1,200.00	360,000	
ナガワ	500	4,975.00	2,487,500	
よみうりランド	400	4,895.00	1,958,000	
東京都競馬	1,100	3,205.00	3,525,500	
常磐興産	700	1,651.00	1,155,700	
カナモト	2,400	2,795.00	6,708,000	
東京ドーム	6,100	1,014.00	6,185,400	
西尾レントオール	1,600	3,090.00	4,944,000	
トランス・コスモス	1,800	2,328.00	4,190,400	
乃村工藝社	7,600	1,451.00	11,027,600	
藤田観光	700	2,902.00	2,031,400	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	900	1,342.00	1,207,800	
日本管財	1,700	1,831.00	3,112,700	
トーカイ	1,600	2,279.00	3,646,400	
白洋舎	200	2,899.00	579,800	
セコム	17,400	8,865.00	154,251,000	
セントラル警備保障	800	5,120.00	4,096,000	
丹青社	3,100	1,297.00	4,020,700	

メイテック	2,000	5,550.00	11,100,000	
応用地質	1,800	1,092.00	1,965,600	
船井総研ホールディングス	3,400	2,496.00	8,486,400	
進学会ホールディングス	800	594.00	475,200	
オオバ	1,400	611.00	855,400	
いであ	400	1,184.00	473,600	
学究社	500	1,329.00	664,500	
ベネッセホールディングス	6,000	2,510.00	15,060,000	
イオンディライト	2,000	3,165.00	6,330,000	
ナック	1,000	966.00	966,000	
ニチイ学館	2,300	1,694.00	3,896,200	
ダイセキ	2,800	2,548.00	7,134,400	
ステップ	600	1,483.00	889,800	
合　　計	20,080,700		38,535,688,870	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
資産の部		
流動資産		
預金	4,497,600	-
金銭信託	606,812,641	-
コール・ローン	2,179,974,741	17,429,987,544

国債証券	63,653,984,771	62,757,568,822
地方債証券	9,800,137,439	6,059,551,470
特殊債券	23,552,323,814	19,608,408,799
派生商品評価勘定	107,438,343	627,864,278
未収入金	-	13,579,367,931
未収利息	589,139,585	451,067,762
前払費用	102,918,663	48,248,085
差入委託証拠金	45,168,260	104,763,573
流動資産合計	100,642,395,857	120,666,828,264
資産合計	100,642,395,857	120,666,828,264
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,000,041,263	135,962,590
未払金	-	13,979,108,884
未払解約金	10,986,578	12,097,986
未払利息	4,047	27,959
流動負債合計	2,011,031,888	14,127,197,419
負債合計	2,011,031,888	14,127,197,419
純資産の部		
元本等		
元本	76,630,624,911	78,784,276,148
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	22,000,739,058	27,755,354,697
元本等合計	98,631,363,969	106,539,630,845
純資産合計	98,631,363,969	106,539,630,845
負債純資産合計	100,642,395,857	120,666,828,264

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	国債証券、地方債証券及び特殊債券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 （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。 （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。 （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 7月17日現在	2019年 7月17日現在
１．	期首	2017年 7月19日	2018年 7月18日
	期首元本額	70,468,997,878円	76,630,624,911円
	期首からの追加設定元本額	21,132,873,411円	18,633,369,418円
	期首からの一部解約元本額	14,971,246,378円	16,479,718,181円
	元本の内訳　※		
	円サポート	2,408,844,851円	1,788,578,902円
	高格付債券ファンド（為替ヘッジ７０）毎月分配型	1,280,556,075円	1,213,383,592円
	高格付債券ファンド（為替ヘッジ７０）資産成長型	171,740,796円	130,276,457円
	スマート・ラップ・ジャパン（毎月分配型）	497,279,590円	－円
	スマート・ラップ・ジャパン（１年決算型）	593,293,700円	－円
	スマート・ラップ・グローバル・インカム（毎月分配型）	43,593,881円	26,407,517円
	スマート・ラップ・グローバル・インカム（１年決算型）	40,526,862円	33,663,646円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１６－０８	146,451,186円	88,297,455円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１６－０８	41,965,073円	19,494,311円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１６－１１	67,331,251円	39,788,258円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１６－１１	53,085,568円	27,703,394円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１７－０２	70,606,803円	33,926,283円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１７－０２	39,729,200円	19,671,662円
	高格付先進国ソブリン債券（円ヘッジ）ファンド（適格機関投資家向け）	9,302,056,966円	12,781,833,501円
	円キャッシュ・アルファ・ファンド（ＳＭＡ専用）	2,113,646,697円	3,003,257,905円
	高格付先進国ソブリン債券（円ヘッジ）ファンド（年２回決算型・適格機関投資家向け）	－円	1,152,242,724円
	高格付先進国ソブリンオープン・為替ヘッジあり（適格機関投資家向け）	7,586,325,547円	7,829,568,430円
	高格付先進国ソブリンファンド　２０１３－０５Ｍ（適格機関投資家向け）	2,329,858,236円	2,292,443,598円
	高格付先進国ソブリンファンド・為替ヘッジあり　２０１３－０７Ｑ（適格機関投資家転売制限付）	79,519,994円	78,141,451円
	高格付先進国ソブリンファンド・為替ヘッジあり　２０１６－０９Ｑ（適格機関投資家転売制限付）	3,402,051,308円	3,342,503,963円
	高格付先進国ソブリンファンド・為替ヘッジあり　２０１６－１０Ｑ（適格機関投資家転売制限付）	966,761,605円	949,408,927円

	ＰＦ　先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ７０　２０１３－１１Ｍ（適格機関投資家転売制限付）	2,088,656,905円	2,013,031,913円
	ＰＦ　先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ７０　２０１４－０５Ｍ（適格機関投資家転売制限付）	3,439,024,407円	3,352,860,847円
	ＰＦ　先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ７０　２０１４－０７（適格機関投資家転売制限付）	1,318,806,706円	1,276,808,181円
	ＰＦ　先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ７０　２０１４－０９Ｑ（適格機関投資家転売制限付）	837,148,315円	812,526,322円
	ＰＦ　先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ７０　２０１４－０９Ｑ－２（適格機関投資家向け）	2,662,856,663円	2,590,149,323円
	ＰＦ　先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ７０　２０１４－１０（適格機関投資家転売制限付）	1,375,628,852円	1,070,999,231円
	ＰＦ　先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ７０　２０１４－１１Ｑ（適格機関投資家転売制限付）	620,478,959円	601,869,959円
	ＰＦ　先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ７０　２０１５－０２Ｑ（適格機関投資家転売制限付）	1,792,057,965円	1,746,395,150円
	ＰＦ　先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ７０　２０１５－０３Ｑ（適格機関投資家転売制限付）	758,191,395円	735,198,512円
	ＰＦ　先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ７０　２０１５－０４Ｑ（適格機関投資家転売制限付）	1,839,391,003円	1,792,529,151円
	ＰＦ　先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ８０　２０１５－０６Ｑ（適格機関投資家向け）	3,031,631,611円	2,954,726,680円
	ＰＦ　先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ７０　２０１５－０９Ｑ（適格機関投資家転売制限付）	1,360,888,496円	1,321,036,934円
	ＰＦ　先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ９０　２０１５－１２Ｑ（適格機関投資家向け）	3,398,939,495円	3,319,618,366円
	ＰＦ　先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ９０　２０１６－０１Ｑ（適格機関投資家向け）	3,394,323,429円	3,316,855,208円
	ＰＦ　先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ７０　２０１６－０４Ｑ（適格機関投資家転売制限付）	2,653,527,114円	2,576,559,938円
	ＰＦ　先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ８０　２０１６－０７Ｑ（適格機関投資家向け）	2,984,169,645円	2,907,517,846円
	ＰＦ　先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ７０　２０１６－１０Ｑ（適格機関投資家向け）	2,659,461,340円	2,586,774,372円
	ＰＦ　先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ８０　２０１７－０６Ｑ（適格機関投資家向け）	3,055,323,355円	2,980,363,394円
	ＰＦ　先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ７０　２０１７－０７Ｑ（適格機関投資家向け）	2,690,204,581円	2,619,834,035円
	ＰＦ　先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ９０　２０１７－０９Ｑ（適格機関投資家向け）	3,434,689,486円	3,358,028,810円
	計	76,630,624,911円	78,784,276,148円
２．	受益権の総数	76,630,624,911口	78,784,276,148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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2017年 7月19日 至 2018年 7月17日	自 2018年 7月18日 至 2019年 7月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2018年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	936,193,562
地方債証券	△39,935,371
特殊債券	488,688,016
合計	1,384,946,207

（2019年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	1,479,908,751
地方債証券	272,166,264
特殊債券	451,198,819
合計	2,203,273,834

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(債券関連)

（2018年 7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	債券先物取引				
	売建	4,051,002,375	－	4,053,637,856	△2,635,481
合計		4,051,002,375	－	4,053,637,856	△2,635,481

（注）1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（2019年 7月17日現在）

該当事項はありません。

(通貨関連)

（2018年 7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				
	売建	95,849,221,770	－	97,739,189,209	△1,889,967,439
	米ドル	18,779,117,560	－	19,376,457,000	△597,339,440
	ユーロ	50,764,745,330	－	51,592,980,000	△828,234,670
	英ポンド	10,754,202,569	－	10,824,293,321	△70,090,752
	スウェーデンクローナ	15,551,156,311	－	15,945,458,888	△394,302,577
合計		95,849,221,770	－	97,739,189,209	△1,889,967,439

（2019年 7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	538,918,004	－	539,060,072	142,068
	ユーロ	538,918,004	－	539,060,072	142,068
	売建	89,385,342,620	－	88,893,583,000	491,759,620

	米ドル	13,074,176,290	―	13,162,583,000	△88,406,710
	ユーロ	44,064,513,500	―	43,917,633,000	146,880,500
	英ポンド	15,044,244,820	―	14,590,175,000	454,069,820
	スウェーデンクローナ	17,202,408,010	―	17,223,192,000	△20,783,990
合計		89,924,260,624	―	89,432,643,072	491,901,688

（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。

①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。

②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 7月17日現在		2019年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	1.2871円	1口当たり純資産額	1.3523円
(1万口当たり純資産額)	(12,871円)	(1万口当たり純資産額)	(13,523円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	52,000,000.00	53,170,000.00	
	国債証券小計		52,000,000.00	53,170,000.00 (5,759,374,400)	
	地方債証券	BRITISH COLUMBIA PROV OF-2.25%-26/06/02	2,000,000.00	2,003,702.80	
		ONTARIO (PROVINCE OF)-2.5%-26/04/27	2,500,000.00	2,530,556.00	
		PROVINCE OF ALBERTA-2.05%-26/08/17	14,500,000.00	14,244,352.09	
		PROVINCE OF ALBERTA-3.3%-28/03/15	15,000,000.00	15,941,205.00	
		PROVINCE OF QUEBEC-2.5%-26/04/20	12,500,000.00	12,680,277.50	
		PROVINCE OF QUEBEC-2.75%-27/04/12	2,000,000.00	2,060,172.00	
		PROVINCE OF QUEBEC-7.5%-29/09/15	4,500,000.00	6,480,940.95	
	地方債証券小計		53,000,000.00	55,941,206.34 (6,059,551,470)	
	特殊債券	INTER-AMERICAN DEVEL BK-4.375%-44/01/24	1,300,000.00	1,657,965.40	
		TENN VALLEY AUTHORITY-2.875%-27/02/01	10,000,000.00	10,373,799.00	
	特殊債券小計		11,300,000.00	12,031,764.40 (1,303,280,719)	
米ドル小計			116,300,000.00	121,142,970.74 (13,122,206,589)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	16,000,000.00	17,179,664.00	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	28,000,000.00	41,601,980.00	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	82,000,000.00	88,080,644.40	
		BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	84,000,000.00	90,902,070.00	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	25,000,000.00	27,258,675.00	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	14,000,000.00	15,679,340.60	
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	2,300,000.00	2,664,278.60	
		FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	32,500,000.00	34,951,026.50	
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-29/05/25	16,000,000.00	16,788,480.00	
		FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	18,500,000.00	23,382,501.50	
ユーロ小計			318,300,000.00	358,488,660.60 (43,527,693,170)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.25%-27/07/22	3,000,000.00	3,122,874.00	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	18,000,000.00	23,194,440.00	
		UK TREASURY-1.625%-28/10/22	53,490,000.00	57,351,978.00	

		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	10,000,000.00	14,724,200.00	
	国債証券小計		84,490,000.00	98,393,492.00 (13,224,085,324)	
	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK-1.0%-26/09/21	10,000,000.00	9,981,410.00	
	特殊債券小計		10,000,000.00	9,981,410.00 (1,341,501,504)	
英ポンド小計			94,490,000.00	108,374,902.00 (14,565,586,828)	
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	20,000,000.00	21,353,200.00	
	国債証券小計		20,000,000.00	21,353,200.00 (246,415,928)	
	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK-1.25%-25/05/12	10,000,000.00	10,602,850.00	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK-1.75%-26/11/12	302,000,000.00	332,791,497.20	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK-1.5%-27/03/02	25,000,000.00	27,010,175.00	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK-1.375%-28/05/12	100,000,000.00	107,302,000.00	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK-1.25%-29/11/12	100,000,000.00	104,992,270.00	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK-3.75%-32/06/01	300,000,000.00	397,805,490.00	
		KOMMUNINVEST I SVERIGE-0.625%-23/11/13	110,000,000.00	112,253,438.00	
		NORDIC INVESTMENT BANK-2.94%-31/10/17	132,500,000.00	162,869,251.75	
		OEKB OEST. KONTROLLBANK-1.37%-28/11/13	200,000,000.00	214,358,000.00	
	特殊債券小計		1,279,500,000.00	1,469,984,971.95 (16,963,626,576)	
スウェーデンクローナ小計			1,299,500,000.00	1,491,338,171.95 (17,210,042,504)	
合計				88,425,529,091 (88,425,529,091)	

(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	1銘柄	43.9%	6.5%
	地方債証券	7銘柄	46.2%	6.9%
	特殊債券	2銘柄	9.9%	1.5%
ユーロ	国債証券	10銘柄	100.0%	49.1%
英ポンド	国債証券	4銘柄	90.8%	15.0%
	特殊債券	1銘柄	9.2%	1.5%
スウェーデンクローナ	国債証券	1銘柄	1.4%	0.3%
	特殊債券	9銘柄	98.6%	19.2%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

インデックス　マザーファンド　Ｊリート

貸借対照表

（単位：円）

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	2,398,431	-
コール・ローン	8,616,363	320,352,746
投資証券	3,090,662,940	4,163,268,200
派生商品評価勘定	754,092	2,418,532
未収配当金	24,552,088	28,538,614
差入委託証拠金	684,000	840,000
流動資産合計	3,127,667,914	4,515,418,092
資産合計	3,127,667,914	4,515,418,092
負債の部		
流動負債		
前受金	604,980	2,326,580
未払金	-	286,127,500
未払解約金	187,917	1,935,822

未払利息	15	513
流動負債合計	792,912	290,390,415
負債合計	792,912	290,390,415
純資産の部		
元本等		
元本	2,847,204,720	3,257,212,494
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	279,670,282	967,815,183
元本等合計	3,126,875,002	4,225,027,677
純資産合計	3,126,875,002	4,225,027,677
負債純資産合計	3,127,667,914	4,515,418,092

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	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。 （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。 （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。 （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	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。

（貸借対照表に関する注記）

		2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
1．	期首	2017年 7月19日	2018年 7月18日
	期首元本額	3,058,681,990円	2,847,204,720円
	期首からの追加設定元本額	111,141,783円	3,144,849,644円
	期首からの一部解約元本額	322,619,053円	2,734,841,870円
	元本の内訳　※		
	上場インデックスファンドＪリート（東証ＲＥＩＴ指数）隔月分配型（ミニ）	－円	604,148,600円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１６－０８	42,062,940円	27,315,094円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１６－０８	22,537,223円	13,231,712円

	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１６－１１	19,275,750円	12,133,739円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１６－１１	28,509,835円	18,889,962円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１７－０２	20,408,724円	10,531,763円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１７－０２	21,502,475円	13,365,986円
	インデックス・Ｊリート・オープン（適格機関投資家向け）	946,522円	645,194,592円
	インデックスファンドＪリート　２０１５－０３（適格機関投資家向け）	2,691,961,251円	1,912,401,046円
	計	2,847,204,720円	3,257,212,494円
２．	受益権の総数	2,847,204,720口	3,257,212,494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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2017年 7月19日 至 2018年 7月17日	自 2018年 7月18日 至 2019年 7月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在

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

（有価証券に関する注記）

（2018年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	59,881,440
合計	59,881,440

（2019年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	149,445,380
合計	149,445,380

(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 7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	30,976,020	－	31,734,000	757,980
合計		30,976,020	－	31,734,000	757,980

（2019年 7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	53,589,420	－	56,014,000	2,424,580
合計		53,589,420	－	56,014,000	2,424,580

（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 7月17日現在		2019年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	1.0982円	1口当たり純資産額	1.2971円
(1万口当たり純資産額)	(10,982円)	(1万口当たり純資産額)	(12,971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	42	4,691,400	
	サンケイリアルエステート投資法人　投資証券	41	4,879,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人　投資証券	137	88,228,000	
	ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人　投資証券	464	50,761,600	
	森ヒルズリート投資法人　投資証券	473	77,288,200	
	産業ファンド投資法人　投資証券	506	73,521,800	
	アドバンス・レジデンス投資法人　投資証券	402	140,499,000	
	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	255	50,643,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人　投資証券	217	103,943,000	
	ＧＬＰ投資法人　投資証券	1,021	128,952,300	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人　投資証券	171	56,857,500	
	日本プロロジスリート投資法人　投資証券	592	151,788,800	
	星野リゾート・リート投資法人　投資証券	63	35,217,000	
	Ｏｎｅリート投資法人　投資証券	60	18,090,000	
	イオンリート投資法人　投資証券	423	60,446,700	
	ヒューリックリート投資法人　投資証券	333	64,735,200	
	日本リート投資法人　投資証券	133	59,251,500	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人　投資証券	2,512	48,858,400	
	日本ヘルスケア投資法人　投資証券	19	3,372,500	
	積水ハウス・リート投資法人　投資証券	1,205	100,135,500	
	トーセイ・リート投資法人　投資証券	79	9,622,200	
	ケネディクス商業リート投資法人　投資証券	151	40,739,800	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人　投資証券	86	11,481,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人　投資証券	82	9,700,600	
	野村不動産マスターファンド投資法人　投資証券	1,282	217,555,400	

いちごホテルリート投資法人　投資証券	72	9,309,600	
ラサールロジポート投資法人　投資証券	341	45,114,300	
スターアジア不動産投資法人　投資証券	128	15,347,200	
マリモ地方創生リート投資法人　投資証券	35	4,175,500	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人　投資証券	100	39,300,000	
大江戸温泉リート投資法人　投資証券	67	5,808,900	
さくら総合リート投資法人　投資証券	89	8,321,500	
投資法人みらい　投資証券	444	25,441,200	
森トラスト・ホテルリート投資法人　投資証券	97	13,793,400	
三菱地所物流リート投資法人　投資証券	44	13,376,000	
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人　投資証券	46	5,736,200	
ザイマックス・リート投資法人　投資証券	38	5,168,000	
タカラレーベン不動産投資法人　投資証券	62	6,609,200	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人　投資証券	64	6,713,600	
日本ビルファンド投資法人　投資証券	399	302,841,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人　投資証券	412	280,572,000	
日本リテールファンド投資法人　投資証券	779	172,314,800	
オリックス不動産投資法人　投資証券	821	170,521,700	
日本プライムリアルティ投資法人　投資証券	261	123,975,000	
プレミア投資法人　投資証券	392	57,820,000	
東急リアル・エステート投資法人　投資証券	276	55,641,600	
グローバル・ワン不動産投資法人　投資証券	285	39,700,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人　投資証券	925	170,477,500	
森トラスト総合リート投資法人　投資証券	295	53,542,500	
インヴィンシブル投資法人　投資証券	1,422	87,310,800	
フロンティア不動産投資法人　投資証券	140	65,170,000	
平和不動産リート投資法人　投資証券	257	34,181,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人　投資証券	269	72,145,800	
福岡リート投資法人　投資証券	213	38,276,100	
ケネディクス・オフィス投資法人　投資証券	128	100,736,000	
いちごオフィスリート投資法人　投資証券	342	36,388,800	
大和証券オフィス投資法人　投資証券	95	74,385,000	
阪急阪神リート投資法人　投資証券	185	28,305,000	
スターツプロシード投資法人　投資証券	64	11,660,800	
大和ハウスリート投資法人　投資証券	553	151,134,900	

	ジャパン・ホテル・リート投資法人　投資証券	1,327	119,695,400	
	日本賃貸住宅投資法人　投資証券	464	40,924,800	
	ジャパンエクセレント投資法人　投資証券	369	60,073,200	
合計		23,049	4,163,268,200	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

インデックス　マザーファンド　海外先進国債券

貸借対照表

（単位：円）

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
資産の部		
流動資産		
預金	209,413	709,415
金銭信託	41,199	-
コール・ローン	148,008	153,914
国債証券	240,728,556	182,201,295
派生商品評価勘定	521	618
未収入金	2,188,089	1,021,656
未収利息	2,030,281	1,424,288
前払費用	70,278	50,344
流動資産合計	245,416,345	185,561,530
資産合計	245,416,345	185,561,530
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	310	2,520
未払解約金	343,528	1,350,924
流動負債合計	343,838	1,353,444
負債合計	343,838	1,353,444
純資産の部		
元本等		
元本	221,922,043	167,030,141
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	23,150,464	17,177,945
元本等合計	245,072,507	184,208,086
純資産合計	245,072,507	184,208,086
負債純資産合計	245,416,345	185,561,530

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

（貸借対照表に関する注記）

		2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
1．	期首	2017年 7月19日	2018年 7月18日
	期首元本額	600,929,950円	221,922,043円
	期首からの追加設定元本額	111,133,148円	11,020,189円
	期首からの一部解約元本額	490,141,055円	65,912,091円
	元本の内訳　※		
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１６－０８	67,932,168円	53,172,036円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１６－０８	26,512,228円	18,858,904円
	インデックスファンド海外先進国債券（適格機関投資家向け）	4,960,403円	4,950,647円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１６－１１	30,964,968円	24,056,502円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１６－１１	33,600,858円	26,417,289円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１７－０２	32,589,666円	20,557,487円

	時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１７－０２	25,361,752円	19,017,276円
	計	221,922,043円	167,030,141円
２．	受益権の総数	221,922,043口	167,030,141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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2017年 7月19日 至 2018年 7月17日	自 2018年 7月18日 至 2019年 7月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品	(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 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	△3,799,078
合計	△3,799,078

（2019年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	6,835,395
合計	6,835,395

(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 7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 売建	2,007,383	－	2,007,172	211

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

（2019年 7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				
	売建	1,354,304	－	1,356,206	△1,902
	米ドル	755,580	－	758,100	△2,520
	ユーロ	522,717	－	522,106	611
	豪ドル	76,007	－	76,000	7
合計		1,354,304	－	1,356,206	△1,902

（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。

①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。

②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 7月17日現在	2019年 7月17日現在

1口当たり純資産額	1.1043円	1口当たり純資産額	1.1028円
(1万口当たり純資産額)	(11,043円)	(1万口当たり純資産額)	(11,028円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	92,000.00	92,594.76	
		US TREASURY N/B-2.0%-21/10/31	190,000.00	190,604.86	
		US TREASURY N/B-1.625%-23/04/30	143,000.00	141,776.67	
		US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	101,000.00	103,331.67	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	12,000.00	11,735.15	
		US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	100,000.00	102,492.18	
		US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	26,000.00	33,882.25	
		US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	40,000.00	41,257.81	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	76,000.00	74,154.92	
米ドル小計			780,000.00	791,830.27 (85,771,054)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	17,000.00	17,526.15	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	11,000.00	11,443.85	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	1,000.00	957.16	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	3,000.00	4,505.07	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	6,000.00	8,125.44	
加ドル小計			38,000.00	42,557.67 (3,520,796)	
メキシコペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	40,000.00	39,333.42	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	60,000.00	66,798.86	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	100,000.00	105,429.86	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	30,000.00	31,301.61	
			230,000.00	242,863.75	

メキシコペソ小計				(1,377,037)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	7,000.00	7,761.55	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	12,000.00	17,829.41	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	7,000.00	11,691.89	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-21/04/30	9,000.00	9,965.11	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%-23/01/31	10,000.00	12,029.84	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%-25/04/30	14,000.00	15,333.01	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-28/10/31	19,000.00	27,304.67	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%-40/07/30	13,000.00	22,164.58	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-21/01/04	15,000.00	15,729.95	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%-23/08/15	11,000.00	12,231.31	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-25/02/15	13,000.00	13,816.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%-27/07/04	13,000.00	20,328.84	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	6,000.00	10,022.92	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04	5,000.00	8,462.24	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-40/07/04	9,000.00	17,621.23	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-21/03/01	12,000.00	12,745.56	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%-22/11/01	32,000.00	37,204.99	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-25/12/01	29,000.00	30,614.49	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	24,000.00	32,160.38	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-44/09/01	17,000.00	23,817.20	
		FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	4,000.00	5,074.60	
		FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	3,000.00	3,786.16	
		FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	8,000.00	8,322.11	

		FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	19,000.00	20,959.47	
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	30,000.00	31,621.80	
		FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	22,000.00	33,995.50	
		FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	18,000.00	30,152.70	
		FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	14,000.00	25,037.20	
		IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	6,000.00	7,059.56	
		IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	3,000.00	3,470.94	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	7,000.00	7,630.09	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	12,000.00	12,516.67	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	5,000.00	8,813.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	8,000.00	10,819.68	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	7,000.00	11,478.92	
ユーロ小計			443,000.00	579,574.37 (70,371,920)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-2.0%-20/07/22	3,000.00	3,041.85	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	13,000.00	13,488.54	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	9,000.00	12,732.71	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	9,000.00	13,824.64	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	7,000.00	10,110.82	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	4,000.00	6,800.48	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	9,000.00	16,422.12	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	9,000.00	9,768.18	
英ポンド小計			63,000.00	86,189.34 (11,583,847)	
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	20,000.00	21,724.70	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	30,000.00	32,601.66	
スウェーデンクローナ小計			50,000.00	54,326.36 (626,926)	
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	26,000.00	26,655.53	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	10,000.00	10,436.00	
ノルウェークローネ小計			36,000.00	37,091.53 (468,466)	
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	37,000.00	42,467.52	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	10,000.00	18,914.80	
			47,000.00	61,382.32	

デンマーククローネ小計				(998,076)	
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25	4,000.00	4,035.82	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	17,000.00	19,102.98	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	16,000.00	16,359.20	
ポーランドズロチ小計			37,000.00	39,498.00 (1,126,482)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	12,000.00	13,037.35	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	18,000.00	19,995.69	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	11,000.00	15,029.68	
豪ドル小計			41,000.00	48,062.72 (3,653,247)	
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	7,000.00	7,420.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	2,000.00	2,161.00	
シンガポールドル小計			9,000.00	9,581.00 (763,797)	
マレーシアリンギット	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	6,000.00	6,014.73	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	26,000.00	27,220.00	
マレーシアリンギット小計			32,000.00	33,234.73 (875,070)	
南アフリカランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%-30/01/31	115,000.00	109,777.25	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%-40/01/31	29,000.00	27,410.57	
南アフリカランド小計			144,000.00	137,187.82 (1,064,577)	
合計				182,201,295 (182,201,295)	

(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　9銘柄	100.0%	47.1%
加ドル	国債証券　5銘柄	100.0%	1.9%

メキシコペソ	国債証券	4銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券	35銘柄	100.0%	38.6%
英ポンド	国債証券	8銘柄	100.0%	6.4%
スウェーデンクローナ	国債証券	2銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券	2銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券	2銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券	3銘柄	100.0%	0.6%
豪ドル	国債証券	3銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	国債証券	2銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券	2銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券	2銘柄	100.0%	0.6%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

先進国資本エマージング株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
資産の部		
流動資産		
預金	28,712,859	18,452,669
金銭信託	32,030,388	-
コール・ローン	115,069,188	144,400,244
株式	18,620,483,023	16,004,836,118
派生商品評価勘定	-	7,722
未収入金	53,385,872	-
未収配当金	67,561,733	81,417,944
流動資産合計	18,917,243,063	16,249,114,697
資産合計	18,917,243,063	16,249,114,697
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	74,441	8,641
未払解約金	111,589,260	48,247,252
未払利息	213	231
流動負債合計	111,663,914	48,256,124

負債合計	111,663,914	48,256,124
純資産の部		
元本等		
元本	15,505,362,614	13,495,667,757
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	3,300,216,535	2,705,190,816
元本等合計	18,805,579,149	16,200,858,573
純資産合計	18,805,579,149	16,200,858,573
負債純資産合計	18,917,243,063	16,249,114,697

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
1．	期首	2017年 7月19日	2018年 7月18日
	期首元本額	5,559,587,877円	15,505,362,614円
	期首からの追加設定元本額	14,477,254,937円	765,107,810円
	期首からの一部解約元本額	4,531,480,200円	2,774,802,667円
	元本の内訳　※		
	スマート・ラップ・グローバル・インカム（毎月分配型）	71,103,462円	37,898,202円
	スマート・ラップ・グローバル・インカム（１年決算型）	66,104,689円	48,537,133円
	先進国資本エマージング株式ファンド（１年決算型）	11,753,115,494円	10,127,078,126円

	先進国資本エマージング株式ファンド（年２回決算型）	37,598,696円	33,693,438円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１６－０８	5,837,117円	6,985,995円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１６－０８	4,362,048円	4,839,344円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１６－１１	2,709,957円	3,291,839円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１６－１１	5,819,720円	6,380,998円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１７－０２	2,742,224円	2,799,986円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１７－０２	4,196,575円	4,687,720円
	グローバル・メガピース	3,551,772,632円	3,219,474,976円
	計	15,505,362,614円	13,495,667,757円
２．	受益権の総数	15,505,362,614口	13,495,667,757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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2017年 7月19日 至 2018年 7月17日	自 2018年 7月18日 至 2019年 7月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2018年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	△217,414,296
合計	△217,414,296

（2019年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	△10,444,550
合計	△10,444,550

(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 7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				
	売建	5,865,780	－	5,940,221	△74,441
	インドネシアルピア	5,865,780	－	5,940,221	△74,441
合計		5,865,780	－	5,940,221	△74,441

（2019年 7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	504,347	－	504,256	△91
	米ドル	504,347	－	504,256	△91
	売建	13,273,499	－	13,274,327	△828
	ブラジルレアル	504,347	－	504,347	－
	ユーロ	6,564,402	－	6,556,680	7,722
	ポーランドズロチ	2,280,000	－	2,280,800	△800
	香港・オフショア人民元	3,924,750	－	3,932,500	△7,750
合計		13,777,846	－	13,778,583	△919

（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。

①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。

②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 7月17日現在		2019年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	1.2128円	1口当たり純資産額	1.2004円
(1万口当たり純資産額)	(12,128円)	(1万口当たり純資産額)	(12,004円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	3,895	206.80	805,486.00	
	ROSNEFT PJSC-REG S GDR	141,181	6.70	945,912.70	
	VALE SA-SP ADR	75,000	14.03	1,052,250.00	
	51JOB INC-ADR	27,200	78.71	2,140,912.00	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP-ADR	19,947	174.19	3,474,567.93	
	CIA BRASILEIRA-SP ADR PREF	42,000	24.31	1,021,020.00	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	56,700	22.16	1,256,472.00	
	BANCO SANTANDER MEXICO -ADR	327,926	7.75	2,541,426.50	
	BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	68,235	30.26	2,064,791.10	
	BBVA ARGENTINA SA-ADR	143,500	11.79	1,691,865.00	
	TELEF BRASIL-ADR	162,400	14.28	2,319,072.00	
	TIM PARTICIPACOES SA-ADR	207,146	16.36	3,388,908.56	
	ENEL AMERICAS SA-ADR	198,154	8.43	1,670,438.22	
	ENEL CHILE SA-ADR	381,617	4.69	1,789,783.73	
米ドル小計		1,854,901		26,162,905.74 (2,833,965,949)	

メキシコペソ	WALMART DE MEXICO -SER V	1,219,200	55.17	67,263,264.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	1,300,000	37.36	48,568,000.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	765,700	76.96	58,928,272.00	
メキシコペソ小計		3,284,900		174,759,536.00 (990,886,569)	
ブラジルレアル	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	357,700	22.94	8,205,638.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	116,280	33.72	3,920,961.60	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	171,450	46.40	7,955,280.00	
ブラジルレアル小計		645,430		20,081,879.60 (576,952,400)	
チリペソ	AGUAS ANDINAS SA-A	1,511,478	407.00	615,171,546.00	
チリペソ小計		1,511,478		615,171,546.00 (97,750,758)	
ユーロ	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	130,000	12.50	1,625,000.00	
ユーロ小計		130,000		1,625,000.00 (197,307,500)	
トルコリラ	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	95,500	7.37	703,835.00	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	104,132	25.12	2,615,795.84	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	39,484	60.50	2,388,782.00	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	361,050	9.10	3,285,555.00	
トルコリラ小計		600,166		8,993,967.84 (170,615,569)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	61,823	888.50	54,929,735.50	
チェココルナ小計		61,823		54,929,735.50 (260,366,946)	
ポーランドズロチ	MBANK	11,000	398.60	4,384,600.00	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	26,925	356.40	9,596,070.00	
	ORANGE POLSKA SA	966,000	6.51	6,293,490.00	
ポーランドズロチ小計		1,003,925		20,274,160.00 (578,219,043)	
香港ドル	CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	3,082,000	4.13	12,728,660.00	
	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	750,000	6.52	4,890,000.00	
	CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	904,000	4.55	4,113,200.00	
	BAIC MOTOR CORP LTD-H	4,909,500	5.27	25,873,065.00	
	BYD CO LTD-H	207,500	48.20	10,001,500.00	
	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	392,000	20.95	8,212,400.00	

	CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	1,200,000	8.84	10,608,000.00	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	2,493,000	5.89	14,683,770.00	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	355,000	18.98	6,737,900.00	
	TOWNGAS CHINA CO LTD	1,239,000	6.17	7,644,630.00	
香港ドル小計		15,532,000		105,493,125.00 (1,462,134,712)	
マレーシアリンギット	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	161,700	30.64	4,954,488.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	47,900	148.00	7,089,200.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	1,438,000	5.80	8,340,400.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	662,500	4.33	2,868,625.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	695,300	5.16	3,587,748.00	
マレーシアリンギット小計		3,005,400		26,840,461.00 (706,709,338)	
タイバーツ	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	22,807,000	1.91	43,561,370.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	484,500	215.00	104,167,500.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	500,000	63.50	31,750,000.00	
	TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	2,280,000	56.00	127,680,000.00	
タイバーツ小計		26,071,500		307,158,870.00 (1,075,056,045)	
インドネシアルピア	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	1,340,000	21,500.00	28,810,000,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	8,160,000	7,450.00	60,792,000,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	16,849,400	3,040.00	51,222,176,000.00	
	PT UNILEVER INDONESIA TBK	1,549,100	44,400.00	68,780,040,000.00	
インドネシアルピア小計		27,898,500		209,604,216,000.00 (1,634,912,884)	
韓国ウォン	POSCO	6,297	239,500.00	1,508,131,500.00	
	S1 CORPORATION	12,011	98,000.00	1,177,078,000.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	34,123	45,150.00	1,540,653,450.00	
韓国ウォン小計		52,431		4,225,862,950.00 (388,356,805)	
台湾ドル	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	26,000	488.00	12,688,000.00	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	335,400	137.50	46,117,500.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	44,000	322.00	14,168,000.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	549,000	80.50	44,194,500.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	220,000	224.00	49,280,000.00	
		1,174,400		166,448,000.00	

台湾ドル小計				(580,903,520)	
インドルピー	AMBUJA CEMENTS LIMITED	778,192	219.90	171,124,420.80	
	JSW STEEL LTD	155,298	273.90	42,536,122.20	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	36,048	6,158.05	221,985,386.40	
	MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	1,038,532	117.20	121,715,950.40	
	ITC LTD	311,706	271.95	84,768,446.70	
	NESTLE INDIA LIMITED	22,998	11,708.65	269,275,532.70	
	DABUR INDIA LTD	216,000	425.00	91,800,000.00	
	HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	160,315	1,741.30	279,156,509.50	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	82,700	1,084.15	89,659,205.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	411,136	350.75	144,205,952.00	
	VODAFONE IDEA LTD	3,300,000	11.80	38,940,000.00	
インドルピー小計		6,512,925		1,555,167,525.70 (2,472,716,365)	
南アフリカランド	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	57,350	805.95	46,221,232.50	
	KUMBA IRON ORE LTD	89,007	471.16	41,936,538.12	
	ABSA GROUP LTD	49,486	172.00	8,511,592.00	
	VODACOM GROUP LTD	297,262	118.73	35,293,917.26	
南アフリカランド小計		493,105		131,963,279.88 (1,024,035,051)	
香港・オフショア人民元	YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	680,200	9.91	6,740,782.00	
	HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	975,677	24.57	23,972,383.89	
	BANK OF BEIJING CO LTD -A	783,714	5.63	4,412,309.82	
	BANK OF NANJING CO LTD -A	596,421	8.46	5,045,721.66	
	BANK OF NINGBO CO LTD -A	229,272	22.40	5,135,692.80	
香港・オフショア人民元小計		3,265,284		45,306,890.17 (713,130,451)	
サウジアラビアリアル	BANQUE SAUDI FRANSI	62,000	42.00	2,604,000.00	
	SAUDI BRITISH BANK	138,000	41.45	5,720,100.00	
サウジアラビアリアル小計		200,000		8,324,100.00 (240,816,213)	
合　　計		93,298,168		16,004,836,118 (16,004,836,118)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

外貨建有価証券の内訳

種　類	銘柄数		組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式	14銘柄	100.0%	17.9%
メキシコペソ	株式	3銘柄	100.0%	6.2%
ブラジルレアル	株式	3銘柄	100.0%	3.6%
チリペソ	株式	1銘柄	100.0%	0.6%
ユーロ	株式	1銘柄	100.0%	1.2%
トルコリラ	株式	4銘柄	100.0%	1.1%
チェココルナ	株式	1銘柄	100.0%	1.6%
ポーランドズロチ	株式	3銘柄	100.0%	3.6%
香港ドル	株式	10銘柄	100.0%	9.1%
マレーシアリンギット	株式	5銘柄	100.0%	4.4%
タイバーツ	株式	4銘柄	100.0%	6.7%
インドネシアルピア	株式	4銘柄	100.0%	10.2%
韓国ウォン	株式	3銘柄	100.0%	2.4%
台湾ドル	株式	5銘柄	100.0%	3.6%
インドルピー	株式	11銘柄	100.0%	15.4%
南アフリカランド	株式	4銘柄	100.0%	6.4%
香港・オフショア人民元	株式	5銘柄	100.0%	4.5%
サウジアラビアリアル	株式	2銘柄	100.0%	1.5%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

インデックス　マザーファンド　コモディティ

貸借対照表

（単位：円）

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,049	967
金銭信託	9,255	-
コール・ローン	33,250	56,817
投資信託受益証券	8,079,527	13,782,902
派生商品評価勘定	-	92
未収入金	-	77,520
流動資産合計	8,123,081	13,918,298
資産合計	8,123,081	13,918,298
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	79,184
流動負債合計	-	79,184
負債合計	-	79,184
純資産の部		
元本等		
元本	7,944,959	14,940,087
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	178,122	△1,100,973
元本等合計	8,123,081	13,839,114
純資産合計	8,123,081	13,839,114
負債純資産合計	8,123,081	13,918,298

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	投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 （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。 （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。 （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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
１．	期首	2017年 7月19日	2018年 7月18日
	期首元本額	50,635,353円	7,944,959円
	期首からの追加設定元本額	10,517,004円	10,205,784円
	期首からの一部解約元本額	53,207,398円	3,210,656円
	元本の内訳　※		
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１６－０８	1,578,915円	3,978,392円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１６－０８	1,502,171円	2,226,710円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１６－１１	738,439円	1,882,090円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１６－１１	1,977,138円	3,014,498円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１７－０２	735,891円	1,646,666円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１７－０２	1,412,405円	2,191,731円
	計	7,944,959円	14,940,087円
２．	受益権の総数	7,944,959口	14,940,087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	－円	1,100,973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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2017年 7月19日 至 2018年 7月17日	自 2018年 7月18日 至 2019年 7月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2018年 7月17日現在	2019年 7月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 「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 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	△77,732
合計	△77,732

（2019年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	△79,862
合計	△79,862

(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 7月17日現在）

該当事項はありません。

（2019年 7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				
	売建	77,800	－	77,708	92
	ユーロ	77,800	－	77,708	92
合計		77,800	－	77,708	92

（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。

①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。

②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 7月17日現在		2019年 7月17日現在	
1口当たり純資産額	1.0224円	1口当たり純資産額	0.9263円
(1万口当たり純資産額)	(10,224円)	(1万口当たり純資産額)	(9,263円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
ユーロ	投資信託受益証券	ISH DIV COMDTY SWAP DE-ETF	6,205	113,514.27	
ユーロ小計			6,205	113,514.27 (13,782,902)	
合計				13,782,902 (13,782,902)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「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 7月31日現在です。

【時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１６－１１】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	239,089,413円
Ⅱ　負債総額	2,359,072円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	236,730,341円
Ⅳ　発行済口数	216,661,963口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0926円

（参考）

インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	200,586,286円
Ⅱ　負債総額	949,194円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	199,637,092円
Ⅳ　発行済口数	136,663,179口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4608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

Ⅰ　資産総額	145,506,357,260円
Ⅱ　負債総額	149,276,179円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	145,357,081,081円
Ⅳ　発行済口数	55,963,857,415口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.5973円

インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	93,629,734円
Ⅱ　負債総額	135,213円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	93,494,521円
Ⅳ　発行済口数	78,264,172口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1946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

Ⅰ　資産総額	42,832,618,326円
Ⅱ　負債総額	2,004,836,723円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	40,827,781,603円
Ⅳ　発行済口数	18,798,194,756口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.1719円

インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	19,875,013円
Ⅱ　負債総額	105,261円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	19,769,752円
Ⅳ　発行済口数	17,043,938口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1599円

海外新興国債券インデックスＬｏｃａｌ（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	5,157,383,562円
Ⅱ　負債総額	23,034,569円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	5,134,348,993円
Ⅳ　発行済口数	3,844,259,325口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3356円

ＦＯＦｓ用ゴールド・ファンド　為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	3,483,369,789円
Ⅱ　負債総額	21,054,032円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	3,462,315,757円
Ⅳ　発行済口数	3,300,667,313口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0490円

ゴールド・マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	117,064,289,937円
Ⅱ　負債総額	217,160,054円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	116,847,129,883円
Ⅳ　発行済口数	117,972,367,465口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9905円

インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	38,668,789,379円
Ⅱ　負債総額	160,984,348円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	38,507,805,031円
Ⅳ　発行済口数	19,738,855,045口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.9509円

ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	110,143,563,260円
Ⅱ　負債総額	553,982,704円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	109,589,580,556円
Ⅳ　発行済口数	80,174,777,887口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3669円

インデックス　マザーファンド　Ｊリート

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	4,387,985,824円
Ⅱ　負債総額	39,079,581円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	4,348,906,243円
Ⅳ　発行済口数	3,344,255,724口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3004円

インデックス　マザーファンド　海外先進国債券

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	183,319,026円
Ⅱ　負債総額	207,191円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	183,111,835円
Ⅳ　発行済口数	165,251,519口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1081円

先進国資本エマージング株式マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	15,934,077,008円
Ⅱ　負債総額	19,073円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	15,934,057,935円
Ⅳ　発行済口数	13,460,072,053口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1838円

インデックス　マザーファンド　コモディティ

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	13,506,519円
Ⅱ　負債総額	－円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	13,506,519円
Ⅳ　発行済口数	14,834,118口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9105円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）名義書換

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

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

（２）受益者に対する特典

該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容

①　譲渡制限はありません。

②　受益権の譲渡

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

③　受益権の譲渡の対抗要件

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

（４）受益証券の再発行

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

（５）受益権の再分割

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

2019年7月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

●過去５年間における主な資本金の増減　：　該当事項はありません。

（２）会社の意思決定機関（2019年7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7月末現在）

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

２【事業の内容及び営業の概況】

・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
・委託会社の運用する、2019年7月末現在の投資信託などは次の通りです。

種　類			ファンド本数	純資産額 （単位：億円）
投資信託総合計			830	183,708
	株式投資信託		783	156,726
		単位型	253	9,400
		追加型	530	147,325
	公社債投資信託		47	26,982
		単位型	33	850
		追加型	14	26,132

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				
ソフトウエア		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)
負債の部				
流動負債				
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
固定負債				
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
純資産の部				
株主資本				
資本金		17,363		17,363
資本剰余金				
資本準備金		5,220		5,220
資本剰余金合計		5,220		5,220
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		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
評価・換算差額等				
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	1,120	※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 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	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	(1) 有価証券 ①　子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 ②　その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(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 (2) デリバティブ 時価法
2　固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 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。 建物　３年～15年 器具備品　４年～20年 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウエア(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。
3　引当金の計上基準	(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。 (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。 (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。 ①　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。 ②　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。
4　ヘッジ会計の方法	(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 (2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。 (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。 (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。

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）
(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更) 「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号　平成30年２月16日）を当事業年度の期首から適用し、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。 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。

（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)
※１　有形固定資産の減価償却累計額 建物　1,260百万円 器具備品　612百万円	※１　有形固定資産の減価償却累計額 建物　1,281百万円 器具備品　655百万円
※２　信託資産 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。	※２　信託資産 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。
※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。 (流動資産) 現金・預金　3,189百万円 未収収益　592百万円 その他　345百万円 (流動負債) 預り金　419百万円 未払手数料　376百万円 未払費用　677百万円	※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。 (流動資産) 現金・預金　1,347百万円 未収収益　127百万円 (流動負債) 未払手数料　350百万円 未払費用　767百万円 その他　162百万円

※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。 ※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。	※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。 ※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。

（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）
※１　各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金　979百万円 デリバティブ収益　407百万円 支払利息　213百万円	※１　各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金　1,831百万円 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おりません。

4　配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	１株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
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おりません。

4　配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	１株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
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		オペレーティング・リース取引	
解約不能のものに係る未経過リース料		解約不能のものに係る未経過リース料	
１年内	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ードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「４　ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

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

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

りリスクをヘッジしております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

① 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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。

② 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、バリュー・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。

③ 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ードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「４　ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

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

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

① 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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。

② 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、バリュー・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。

③ 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

(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	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				
	売建				
	米ドル	投資有価証券	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　ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

	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) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

①　ストックオプション（新株予約権）の数

	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。

②　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　ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
　　当事業年度末における本源的価値の合計額　　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　ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

	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) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

①　ストックオプション（新株予約権）の数

	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。

②　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　ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
　　当事業年度末における本源的価値の合計額　　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		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)		(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

2　法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	2　法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳
法定実効税率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。	法定実効税率　30.6% （調整） 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(シンガポールドル貨建)(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(シンガポールドル貨建)(注1)	13(SGD 162 千)	未収収益	8(SGD 110 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
						―	増資の引受(注4)	2,466(SGD 30,369 千)	―	―
子会社	日本インスティテューショナル証券設立準備株式会社	日本	100(百万円)	金融商品取引業者として登録を受けるための準備会社	直接 100.00	―	増資の引受(注5)	100	―	―

(注)　取引条件及び取引条件の決定方針等

1　融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。

2　資金の貸付に係る取引金額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（米国ドル貸建）（注3）	17（USD 209 千）	未収収益	17（USD 209 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
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（米国ドル貸建）（注6）	5,364（USD 50,000 千）（注7）	―	―
							資金の借入の返済（米国ドル貸建）（注6）	5,526（USD 50,000 千）（注7）	―	―
							借入金利息（米国ドル貸建）（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
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

＜再信託受託会社の概要＞

名称　　：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額　：51,000百万円（2019年3月末現在）

事業の内容　：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

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

（２）販売会社

名　　称	資本金の額 （2019年3月末現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
日興アセットマネジメント株式会社	17,363百万円	証券投資信託の設定を行なうとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また金融商品取引法に定める投資助言業務を行なっています。

（３）投資顧問会社

名　　称	資本金の額 （2019年3月末現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

（１）受託会社
ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

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

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

3【資本関係】

（１）受託会社
三井住友信託銀行株式会社は、日興アセットマネジメント株式会社の発行済株式総数の91.29%を保有しております。（2019年3月末現在）

（２）販売会社
三井住友信託銀行株式会社は、日興アセットマネジメント株式会社の発行済株式総数の91.29%を保有しております。（2019年3月末現在）

（３）投資顧問会社
三井住友信託銀行株式会社は、日興アセットマネジメント株式会社の発行済株式総数の91.29%を保有しております。（2019年3月末現在）

第３【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2018年10月17日	有価証券報告書
2019年 4月17日	半期報告書

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

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.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2019年８月28日

日興アセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　佐々木　貴司
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　辻　村　　和之

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている時間分散型バランスファンド（成長指向）2016-11の2018年７月18日から2019年７月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、時間分散型バランスファンド（成長指向）2016-11の2019年７月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以　上

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

2.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。