

【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12月24日提出 |
| 【計算期間】 | 第2特定期間(自 2019年3月23日至 2019年9月24日) |
| 【ファンド名】 | グローバル3倍3分法ファンド（隔月分配型） |
| 【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】

ファンドの目的

主として、日本を含む世界各国の株式、不動産投信（REIT）および債券などを実質的な投資対象とする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て運用を行ないます。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

資産複合 資産配分固定型(その他資産(投資信託証券(株式、不動産投信、その他資産(株価指数先物取引、国債先物取引))))

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式、不動産投信およびその他資産(株価指数先物取引、国債先物取引)に投資を行ないます。

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

年6回(隔月)

目論見書または投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。

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。

為替ヘッジなし

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1

実質的に、世界の株式、REITおよび債券などに分散投資を行ない、収益の獲得をめざします。

■主要投資信託証券(グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け))を通じて、主として、世界(日本を含む)の資産(株式、REIT、債券)に投資を行ないます。

2

世界の株式やREITに加えて、株価指数先物取引や国債先物取引などを活用することで、信託財産の純資産総額の3倍相当額の投資を行ないます。

■主要投資信託証券は、各資産に投資を行なうマザーファンドの受益証券のほか、株価指数先物および国債先物の取引に係る権利などに投資を行ないます。

■世界の株式やREITなどの現物の組入総額と株価指数先物取引や国債先物取引の買建総額の組入合計額が、信託財産の純資産総額の3倍相当額となるように投資を行ないます。

3

奇数月の年6回、決算を行ないます。

■奇数月の各月21日(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

※原則として、決算日前営業日の基準価額に対し予め委託会社が定める比率を乗じて得た額を分配金額とします。ただし、委託会社の判断により当該比率は変更される場合がありますので、同じ比率が継続することを保証するものではありません。

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

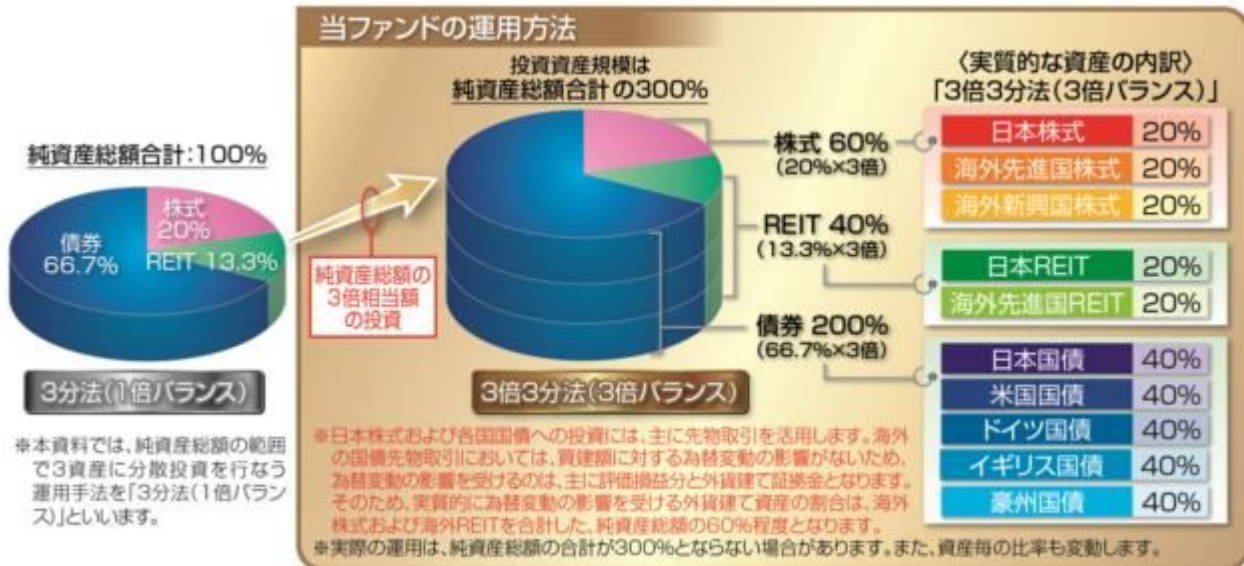
世界の株式、REIT、債券の3つの資産に対し、純資産総額の3倍相当額の投資を行なう運用手法を「3倍3分法」としています。

基準価額変動リスクの大きいファンドですので、ご投資の際には慎重にご判断ください。

※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。

投資対象資産と実質的な資産の内訳について

■当ファンドは、世界の株式やREITに加えて、日本株式および各国国債への投資には先物取引などを活用することで、純資産総額の3倍相当額の投資を行ないます。投資対象資産は世界の株式、REIT、債券の3資産とし、幅広く分散投資を行ないます。



※上記はイメージ図です。

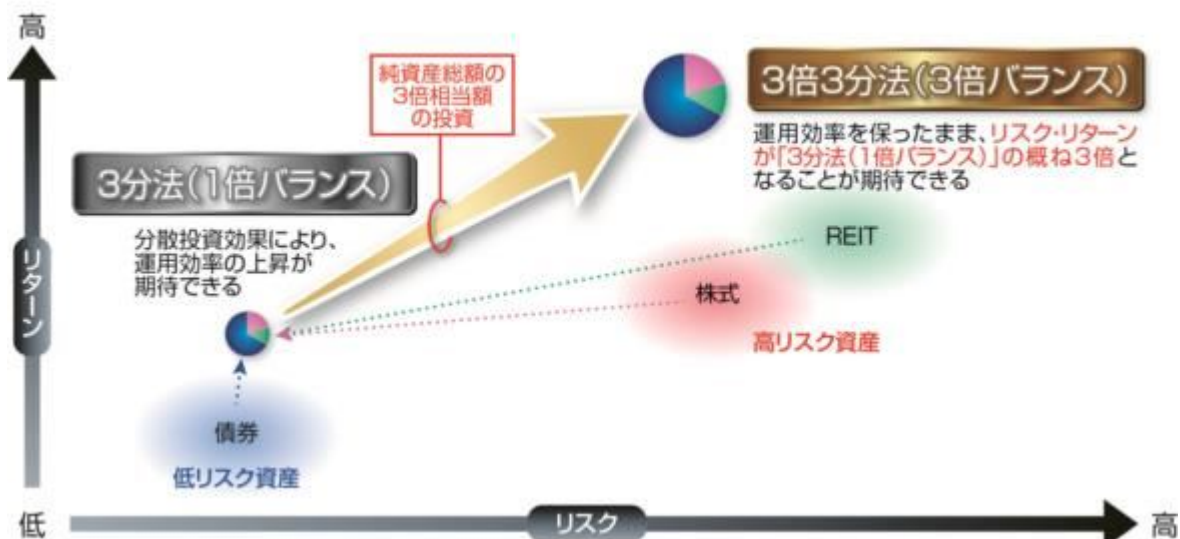
※上記の「3分法(1倍バランス)」の資産配分比率は、「3倍3分法(3倍バランス)」の実質的な資産配分比率の1/3(端数は四捨五入)として計算したものであり、実在するポートフォリオではありません。

※上記は資料作成時現在のものであり、投資対象資産および資産配分比率は、今後変更される可能性があります。

「3倍3分法(3倍バランス)」のリスク・リターンイメージ

- 一般に、値動きの異なる複数の資産に分散投資を行なうことで、運用効率(リスクあたりのリターン)が上昇し、価格変動リスクの低減とリターンの安定化が期待できます。さらに、当ファンドでは、実質的に先物取引などを活用して純資産総額の3倍相当額の投資を行なうことにより、運用効率を保ったまま、より高いリスク・リターンが期待できます。

〈各資産のリスク・リターンのイメージ〉



※上記は「3倍3分法(3倍バランス)」についてのご理解を深めていただくためのイメージであり、実際のリスク・リターンなどの運用成果を保証するものではありません。

※実際の累積のパフォーマンスが3倍になる訳ではありません。

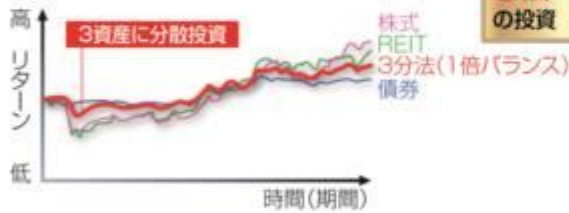
当ファンドの値動きのイメージ

- 当ファンドは、世界の株式やREITに加えて、日本株式および各国国債への投資には先物取引などを活用することで、純資産総額の3倍相当額の投資を行ないます。そのため、「3分法(1倍バランス)」の運用手法に比べて、日々の基準価額の変動が大きくなります。

「3分法(1倍バランス)」の値動きのイメージ



値動きの異なる資産を組み合わせることで、リスク(値動きのブレ)が抑制され、リターン(安定化)が期待される



純資産総額の
3倍相当額
の投資

「3倍3分法(3倍バランス)」に期待される運用成果



先物取引を活用することで、「3分法(1倍バランス)」に比べて、リスク(値動きのブレ)が大きくなる一方、リターン(向上)が期待される



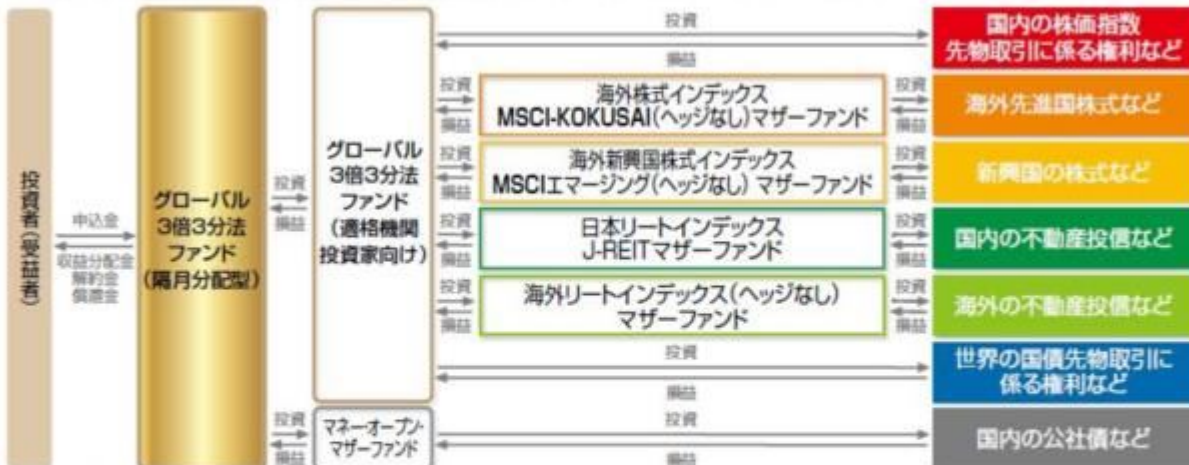
※市況動向および設定・解約による資金動向、収益分配などから、日々の値動きが、「3分法(1倍バランス)」の3倍になるとは限りません。
※中長期で見ると、複利の効果により、「3分法(1倍バランス)」のパフォーマンスとのかい離がプラスにもマイナスにも大きくなる傾向があります。そのため、累積のパフォーマンスが3倍になる訳ではありません。

※当ファンドのリスクについては、後述の「投資リスク」をご覧ください。

※上記は当ファンドの値動きについてのご理解を深めていただくためのイメージであり、実際の運用成果などを保証するものではありません。

ファンドの仕組み

■当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



※投資先投資信託証券は適宜見直しを行いません。

(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いません。
- 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(分配方針)

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

※原則として、決算日前営業日の基準価額に対し予め委託会社が定める比率を乗じて得た額を分配金額とします。ただし、委託会社の判断により当該比率は変更される場合がありますので、同じ比率が継続することを保証するものではありません。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

収益分配金に関する留意事項

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

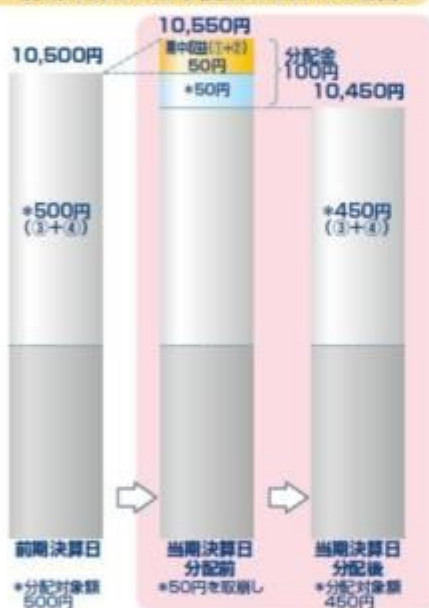
投資信託で分配金が支払われるイメージ



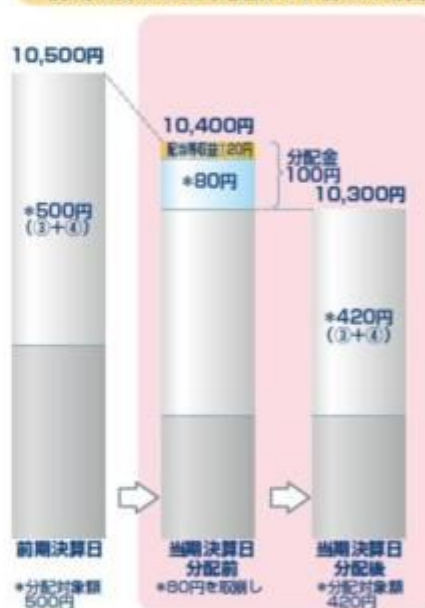
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算から基準価額が上昇した場合



前期決算から基準価額が下落した場合



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

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

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

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

信託金限度額

- ・ 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。

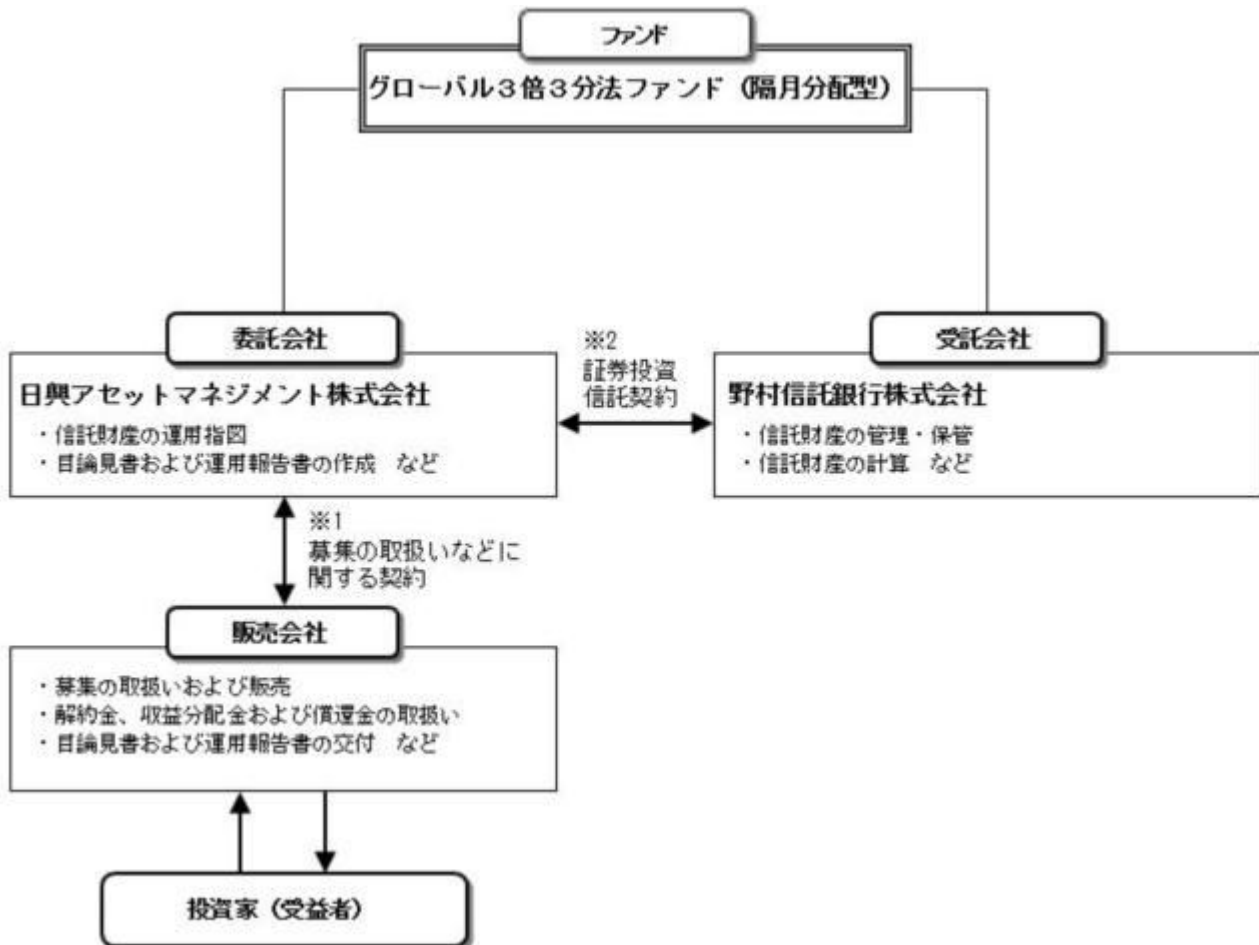
(2) 【ファンドの沿革】

2018年10月 4日

- ・ ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

<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。

委託会社の概況（2019年9月末現在）

1) 資本金

17,363百万円

2) 沿革

1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

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

3) 大株主の状況

| 名 称 | 住 所 | 所有株数 | 所有比率 |
|-----------------------|---|--------------|--------|
| 三井住友トラスト・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株式、不動産投信および債券等を実質的な投資対象とする別に定める投資信託証券の一部、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。
- ・投資信託証券の合計組入率は、高位を保つことを原則とします。各投資信託証券への投資比率は、原則として、市況環境および投資対象ファンドの収益性等を勘案して決定します。なお、資金動向等によっては、各投資信託証券への投資比率を引き下げることもあります。
- ・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。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

(2)【投資対象】

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

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

次の取引ができます。

- 1) 外国為替予約取引
- 2) 資金の借入

投資対象とする投資信託証券の概要

<グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）>

| 運用の基本方針 | |
|-----------|---|
| 基本方針 | インカム収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行いません。 |
| 主な投資対象 | 以下に掲げる各マザーファンドの受益証券のほか、株価指数先物取引に係る権利および国債先物取引に係る権利等を主要投資対象とします。 証券投資信託 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド 証券投資信託 海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド 証券投資信託 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド 証券投資信託 日本リートインデックスJ-REITマザーファンド |
| 投資方針 | <ul style="list-style-type: none"> ・主として、上に掲げる各マザーファンドの受益証券に投資を行なうとともに、株価指数先物取引に係る権利および国債先物取引に係る権利に投資を行なうことで、実質的に日本を含む世界各国の株式、不動産投信および債券に投資し、インカム収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行いません。 ・各投資対象資産の組入比率は、原則として、市況環境および投資対象資産のリスク水準等を勘案して決定します。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき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 | <ul style="list-style-type: none"> ・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 | 純資産総額に対して年率0.088%（税抜0.08%） |

| | |
|------------|--|
| その他の報酬 | <ul style="list-style-type: none"> ・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、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 | <ul style="list-style-type: none"> ・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、主要投資対象である各マザーファンドの運用において利用する指数の標章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。 <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p> |
| 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（2018年10月5日設定） |
| 決算日 | 毎月21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 | <ul style="list-style-type: none"> ・主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびコントリーファンド等を含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。 ・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 | <ul style="list-style-type: none"> ・ 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。

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

| | |
|----------------|---|
| 運用の基本方針 | |
| 基本方針 | 主として金融商品取引所に上場されている新興国の株式に投資し、MSCI エマージング・マーケット・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。 |
| 主な投資対象 | 新興国の株式（DR（預託証券）およびカントリーファンド等を含みます。）を主要投資対象とします。 |

| | |
|---|---|
| 投資方針 | <ul style="list-style-type: none"> ・主として、新興国の株式（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 エマージング・マーケット・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いません。 ・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、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 | <ul style="list-style-type: none"> ・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0.3%（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（2006年5月17日設定） |
| 決算日 | 毎年5月16日（休業日の場合は翌営業日） |
| <p>* MSCI エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が発表している、世界の新興国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（円ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。 同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。</p> | |
| （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 | <ul style="list-style-type: none"> ・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 | <ul style="list-style-type: none"> ・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 | 組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。 |
| その他 | |
| 委託会社 | 日興アセットマネジメント株式会社 |
| 受託会社 | 野村信託銀行株式会社 |
| 信託期間 | 無期限（2005年6月30日設定） |
| 決算日 | 毎年6月15日（休業日の場合は翌営業日） |

^{*} S & P先進国REIT指数（除く日本）は、スタンダード&プアーズファイナンシャルサービ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。

（ご参考）＜日本リートインデックスJ - REITマザーファンド＞

| 運用の基本方針 | |
|-----------|--|
| 基本方針 | わが国の金融商品取引所に上場する不動産投信（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。）の投資信託証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）に投資を行ない、東証REIT指数（配当込み） [*] の動きに連動する投資成果を目標として運用を行ないます。 |
| 主な投資対象 | わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。 |
| 投資方針 | <ul style="list-style-type: none"> ・主として、東京証券取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動した投資成果をめざします。 ・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。 ・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 | <ul style="list-style-type: none"> ・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は行ないません。 ・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） |

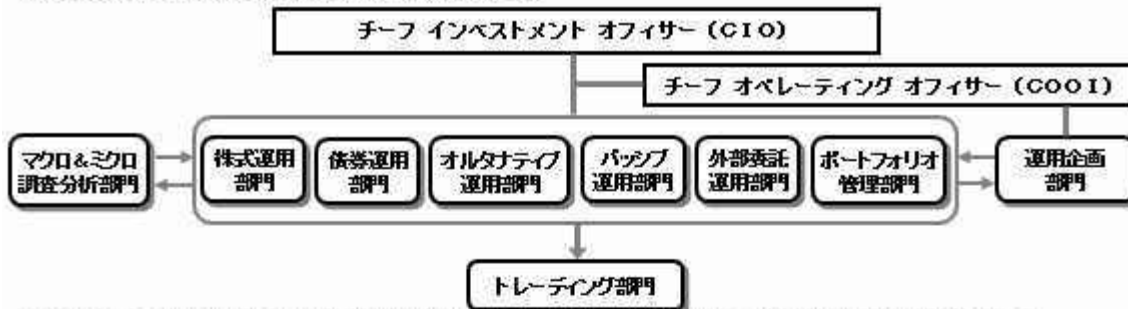
^{*}東証REIT指数（配当込み）は、株式会社東京証券取引所が発表している、東京証券取引所に上場しているJ-REIT全銘柄に投資した場合の投資成果（市場における価格の変動と分配金の受取りを合わせた投資成果）を表す指数です。東京証券取引所に上場しているJ-REIT全銘柄の時価総額加重平均を2003年3月31日を1,000として指数化したものです。

同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社東京証券取引所に帰属します。また、株式会社東京証券取引所は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

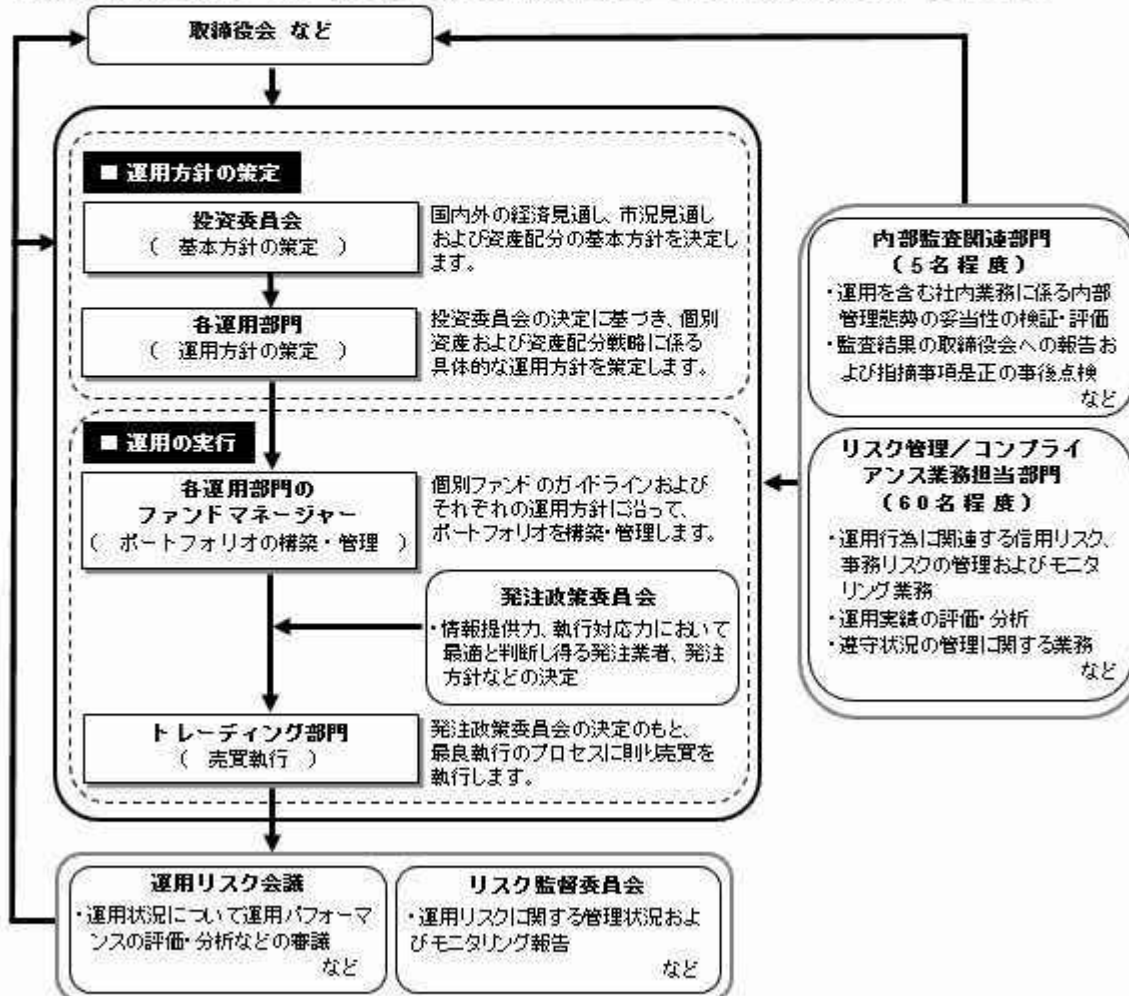
| 運用の基本方針 | |
|-----------|---|
| 基本方針 | 公社債への投資により、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。 |
| 主な投資対象 | わが国の国債および格付の高い公社債を主要投資対象とします。 |
| 投資方針 | <ul style="list-style-type: none"> わが国の国債および格付の高い公社債に投資を行ない、利息等収益の確保をめざして運用を行ないます。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。 |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> 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 | <p>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。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p> |
| 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（2003年3月28日設定） |
| 決算日 | 毎年1月15日（休業日の場合は翌営業日） |

(3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

上記体制は2019年9月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

- 1) 分配対象額の範囲
経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。
- 2) 分配対象額についての分配方針
分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。
- 3) 留保益の運用方針
収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行いません。

収益分配金の支払い

< 分配金再投資コース >

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

< 分配金受取りコース >

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

（ 5 ）【投資制限】

約款に定める投資制限

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

3【投資リスク】

（ 1 ）ファンドのリスク

当ファンドの投資にあたっては、主に以下のリスクを伴いません。基準価額変動リスクの大きいファンドですので、お申込みの際は、当ファンドのリスクを十分に認識・検討し、慎重に投資のご判断を行なっていただく必要があります。

- ・ 投資者の皆様は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）の皆様へ帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。

- ・当ファンドは、主に株式、不動産投信、株価指数先物取引および国債先物取引にかかる権利を実質的な投資対象としますので、株式、不動産投信、株価指数先物取引および国債先物取引にかかる権利の価格の下落や、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、不動産の市況の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

投資対象とする投資信託証券の主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

- ・一般に株式の価格は、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。
- ・一般に新興国の株式は、先進国の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。
- ・一般に不動産投信は、不動産や不動産証券化商品に投資して得られる収入や売却益などを収益源としており、不動産を取り巻く環境や規制、賃料水準、稼働率、不動産市況や長短の金利動向、マクロ経済の変化など様々な要因により価格が変動します。また、不動産の老朽化や立地条件の変化、火災、自然災害などに伴う不動産の滅失・毀損などにより、その価格が影響を受ける可能性もあります。不動産投信の財務状況、業績や市況環境が悪化する場合、不動産投信の分配金や価格は下がり、ファンドに損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。
- ・一般に株価指数先物取引および国債先物取引にかかる権利の価格は、投資対象となる原資産の値動きや先物市場の需給および金利の動きなどの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、当該先物取引にかかる権利の値動きに予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。

流動性リスク

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

信用リスク

- ・一般に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。
- ・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト（債務不履行）が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。
- ・格付を有する有価証券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。
- ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

為替変動リスク

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

カントリー・リスク

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

デリバティブリスク

金融契約に基づくデリバティブとよばれる金融派生商品を用いることがあり、その価値は基礎となる原資産価値などに依存し、またそれらによって変動します。デリバティブの価値は、種類によっては、基礎となる原資産の価値以上に変動することがあります。

レバレッジリスク

株価指数先物取引および国債先物取引などを積極的に用いてレバレッジ取引を行いません。したがって、株式や債券の影響を大きく受けません。

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

<その他の留意事項>

・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

・投資対象とする投資信託証券に関する事項

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

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

・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

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

・運用制限や規制上の制限に関する事項

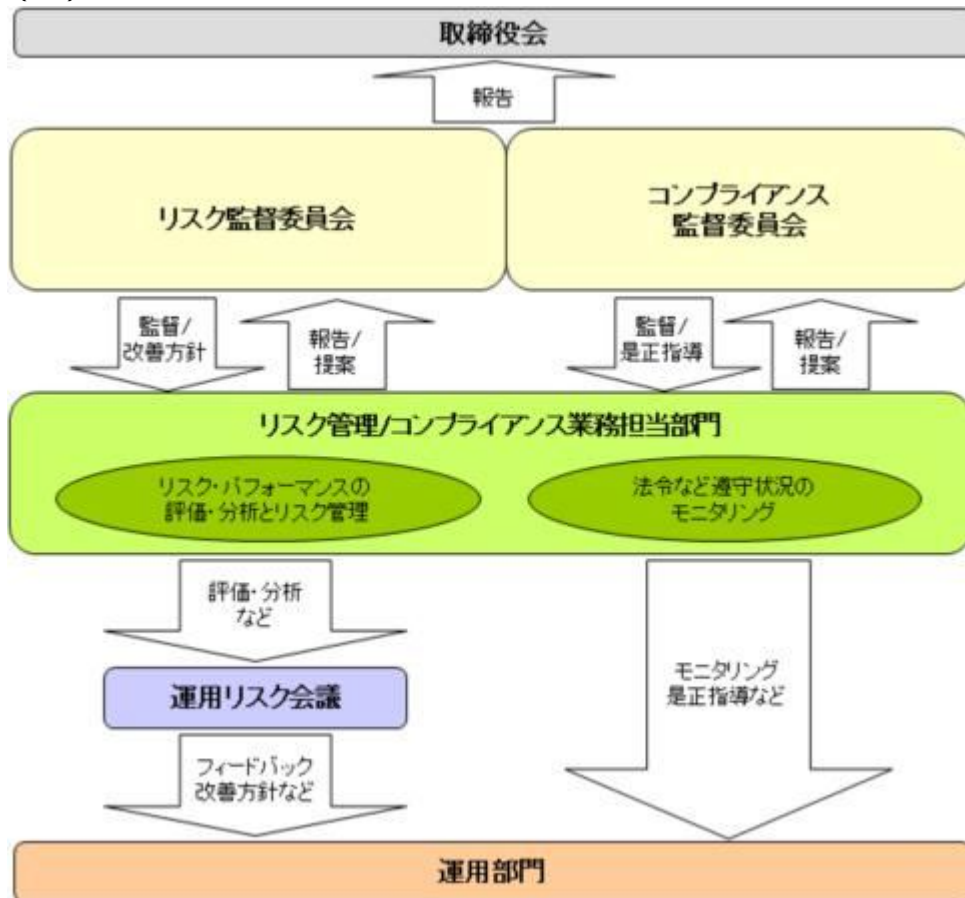
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連し

て、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。

- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

(2) リスク管理体制



全社的リスク管理

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。

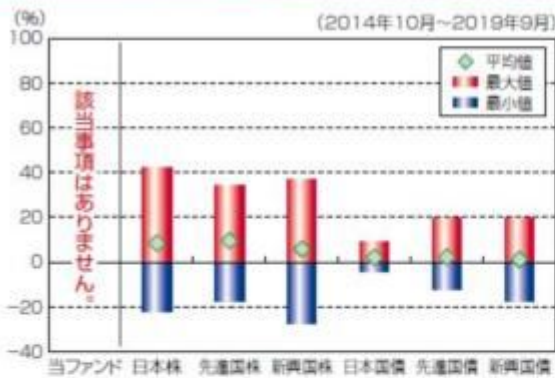
運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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9月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

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

| | 当ファンド | 日本株 | 先進国株 | 新興国株 | 日本国債 | 先進国債 | 新興国債 |
|-----|-------|--------|--------|--------|-------|--------|--------|
| 平均値 | - | 8.4% | 9.6% | 5.9% | 2.1% | 2.3% | 1.2% |
| 最大値 | - | 41.9% | 34.1% | 37.2% | 9.3% | 19.3% | 19.3% |
| 最小値 | - | -22.0% | -17.5% | -27.4% | -4.0% | -12.3% | -17.4% |

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2014年10月から2019年9月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。ただし、当ファンドは直近1年間の騰落率が不明のため、表示していません。

<各資産クラスの指数>

日本株 ……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株 ……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

日本国債 ……NOMURA-BPI国債

先進国債 ……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

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

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

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

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

NOMURA-BPI国債

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

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)**当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移**

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2018年10月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

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

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

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

4【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

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

- ・販売会社における申込手数料率は3.3%（税抜3%）が上限となっております。
- ・申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
- ・＜分配金再投資コース＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
- ・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができます場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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

（２）【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

（３）【信託報酬等】

信託報酬

| 信託報酬率（年率）＜純資産総額に対し＞ | |
|---------------------|--------------------------------|
| 当ファンド | 0.396%（税抜0.36%） |
| 投資対象とする投資信託証券 | 0.088%（税抜0.08%）程度 [*] |
| 実質的負担 | 0.484%（税抜0.44%）程度 |

・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0.396%（税抜0.36%）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）0.088%（税抜0.08%）程度^{*}がかかり、受益者が実質的に負担する信託報酬率（年率）は0.484%（税抜0.44%）程度となります。

*この他に、実質的に不動産投信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。

*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。

受益者が実質的に負担する信託報酬率（年率）は、投資対象とする投資信託証券の組入比率や当該投資信託証券の変更などにより変動します。

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 |

| | | | |
|-------|-------|-------|-------|
| 0.36% | 0.14% | 0.20% | 0.02% |
|-------|-------|-------|-------|

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

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

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

格付の取得に要する費用。

ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。

ファンドおよび投資対象である「別に定めるマザーファンド」の運用において利用する指数の標章使用料。

ファンドおよび投資対象である「別に定めるマザーファンド」の運用において利用する指数の指数値、構成銘柄、構成比率等の情報および投資対象市場の動向や特性等に関する情報の入手に要する費用。

ファンドおよび投資対象である「別に定めるマザーファンド」の運用において、クリアリング機構を利用した場合に生じる諸費用（当該関連費用を受託会社から請求された場合も含みます。）

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

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料。

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

「グローバル3倍3分法ファンド（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、主要投資対象である各マザーファンドの運用において利用する指数の標章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。
- ・組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税などについては、その都度、信託財産から支払われます。
上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

「マネー・オープン・マザーファンド」

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

2) 解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益（譲渡益）*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。

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

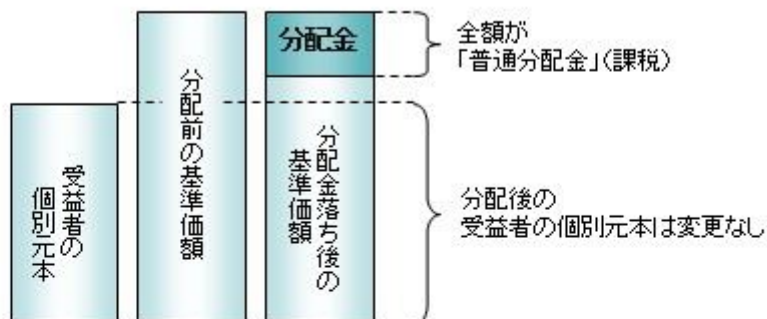
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

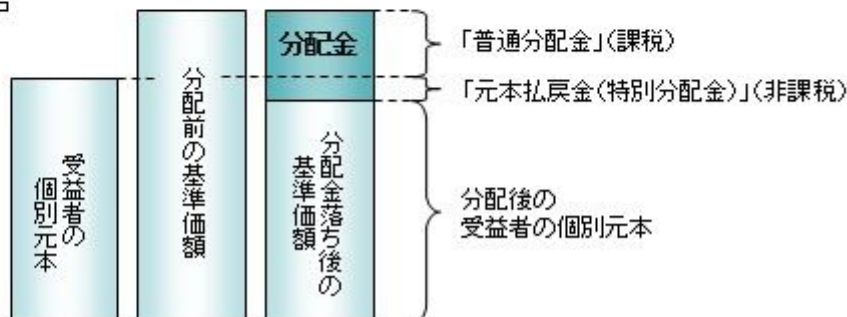
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



2020年1月1日以降の分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は2019年12月24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】

【グローバル3倍3分法ファンド（隔月分配型）】

以下の運用状況は2019年 9月30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 | 96,327,974,578 | 95.85 |
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 100,453,530 | 0.10 |
| コール・ローン等、その他資産（負債控除後） | | 4,071,695,015 | 4.05 |
| 合計（純資産総額） | | 100,500,123,123 | 100.00 |

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量又は 額面総額 | 簿価 単価 （円） | 簿価 金額 （円） | 評価 単価 （円） | 評価 金額 （円） | 投資 比率 （％） |
|------|-----------|---------------------------|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日本 | 投資信託受益証券 | グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け） | 76,058,408,668 | 1.2628 | 96,050,882,036 | 1.2665 | 96,327,974,578 | 95.85 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | マナー・オープン・マザーファンド | 98,852,126 | 1.0161 | 100,453,529 | 1.0162 | 100,453,530 | 0.10 |

ロ. 種類別の投資比率

| 種類 | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 95.85 |
| 親投資信託受益証券 | 0.10 |
| 合計 | 95.95 |

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

| 期別 | 純資産総額（百万円） | | 1口当たり純資産額(円) | |
|-----------------------|------------|--------|--------------|--------|
| | 分配落ち | 分配付き | 分配落ち | 分配付き |
| 第1特定期間末 (2019年 3月22日) | 218 | 220 | 1.1058 | 1.1168 |
| 第2特定期間末 (2019年 9月24日) | 92,413 | 93,334 | 1.2039 | 1.2159 |
| 2018年10月末日 | 152 | | 0.9840 | |
| 11月末日 | 161 | | 1.0256 | |
| 12月末日 | 153 | | 0.9679 | |
| 2019年 1月末日 | 164 | | 1.0389 | |
| 2月末日 | 188 | | 1.0760 | |
| 3月末日 | 255 | | 1.1179 | |
| 4月末日 | 12,423 | | 1.1198 | |
| 5月末日 | 22,734 | | 1.0886 | |
| 6月末日 | 38,445 | | 1.1408 | |
| 7月末日 | 58,094 | | 1.1659 | |
| 8月末日 | 73,684 | | 1.1834 | |
| 9月末日 | 100,500 | | 1.2074 | |

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

【分配の推移】

| 期 | 期間 | 1口当たりの分配金（円） |
|--------|-------------------------|--------------|
| 第1特定期間 | 2018年10月 4日～2019年 3月22日 | 0.0110 |
| 第2特定期間 | 2019年 3月23日～2019年 9月24日 | 0.0345 |

【収益率の推移】

| 期 | 期間 | 収益率（％） |
|--------|-------------------------|--------|
| 第1特定期間 | 2018年10月 4日～2019年 3月22日 | 11.68 |
| 第2特定期間 | 2019年 3月23日～2019年 9月24日 | 11.99 |

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

(4) 【設定及び解約の実績】

| 期 | 期間 | 設定口数（口） | 解約口数（口） |
|--------|-------------------------|----------------|---------------|
| 第1特定期間 | 2018年10月 4日～2019年 3月22日 | 208,721,302 | 11,528,300 |
| 第2特定期間 | 2019年 3月23日～2019年 9月24日 | 77,802,159,555 | 1,240,513,219 |

(注)第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

（参考）

グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）

以下の運用状況は2019年9月30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 | 229,814,267,439 | 80.37 |
| コール・ローン等、その他資産（負債控除後） | | 56,148,138,608 | 19.63 |
| 合計（純資産総額） | | 285,962,406,047 | 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 | 60,296,360,000 | 21.09 |
| 債券先物取引 | 買建 | 日本 | 121,070,620,000 | 42.34 |
| | 買建 | アメリカ | 118,019,824,194 | 41.27 |
| | 買建 | ドイツ | 117,440,229,110 | 41.07 |
| | 買建 | イギリス | 117,278,767,718 | 41.01 |
| | 買建 | オーストラリア | 117,685,889,737 | 41.15 |

（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 | 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 | 25,860,715,858 | 2.2184 | 57,371,834,997 | 2.2371 | 57,853,007,445 | 20.23 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 日本リートインデックスJ-REITマザーファンド | 22,724,492,813 | 2.4843 | 56,454,723,793 | 2.5388 | 57,692,942,353 | 20.18 |
| 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 | 22,502,040,954 | 2.5610 | 57,629,492,442 | 2.5480 | 57,335,200,350 | 20.05 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 海外新興国株式インデックスMSCIEマージング（ヘッジなし）マザーファンド | 33,828,352,520 | 1.7020 | 57,577,918,235 | 1.6830 | 56,933,117,291 | 19.91 |

ロ. 種類別の投資比率

| 種類 | 投資比率（％） |
|----|---------|
|----|---------|

| | |
|-----------|-------|
| 親投資信託受益証券 | 80.37 |
| 合計 | 80.37 |

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 | 日本 | 大阪取引所 | 東証株価指数先物 2019年12月 | 買建 | 3,797 | 日本円 | 61,046,814,120 | 61,046,814,120 | 60,296,360,000 | 60,296,360,000 | 21.09 |
| 債券先物取引 | 日本 | 大阪取引所 | 東証長期国債標準物先物 2019年12月 | 買建 | 781 | 日本円 | 121,088,539,880 | 121,088,539,880 | 121,070,620,000 | 121,070,620,000 | 42.34 |
| | アメリカ | シカゴ商品取引所 | TNOTE10Y1912 | 買建 | 8,387 | 米ドル | 1,091,168,382.71 | 117,758,891,862 | 1,093,586,213.81 | 118,019,824,194 | 41.27 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | BUND10Y 1912 | 買建 | 5,712 | ユーロ | 996,890,290 | 117,652,992,025 | 995,087,520 | 117,440,229,110 | 41.07 |
| | オーストラリア | シドニー先物取引所 | AUSTR10Y1912 | 買建 | 10,897 | 豪ドル | 1,608,157,987.22 | 117,202,554,108 | 1,614,789,925.05 | 117,685,889,737 | 41.15 |
| | イギリス | ロンドン国際金融先物オプション取引所 | GILT10Y 1912 | 買建 | 6,592 | 英ポンド | 881,598,650 | 116,979,324,868 | 883,855,360 | 117,278,767,718 | 41.01 |

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

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

以下の運用状況は2019年 9月30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 | 13,292,872 | 0.01 |
| 株式 | アメリカ | 104,287,351,295 | 62.37 |
| | カナダ | 6,341,448,534 | 3.79 |
| | モーリシャス | 2,334,592 | 0.00 |
| | ドイツ | 5,084,983,857 | 3.04 |
| | イタリア | 1,157,471,918 | 0.69 |
| | フランス | 6,147,899,491 | 3.68 |
| | オランダ | 3,026,212,088 | 1.81 |
| | スペイン | 1,743,214,748 | 1.04 |
| | ベルギー | 609,552,680 | 0.36 |
| | オーストリア | 128,573,732 | 0.08 |

| | | | |
|-----------------------|----------|-----------------|--------|
| | ルクセンブルク | 164,551,019 | 0.10 |
| | フィンランド | 681,025,792 | 0.41 |
| | アイルランド | 3,118,205,321 | 1.86 |
| | ポルトガル | 94,832,952 | 0.06 |
| | イギリス | 9,521,979,384 | 5.69 |
| | スイス | 6,259,138,721 | 3.74 |
| | スウェーデン | 1,413,586,415 | 0.85 |
| | ノルウェー | 390,463,553 | 0.23 |
| | デンマーク | 1,067,736,881 | 0.64 |
| | ケイマン | 326,260,867 | 0.20 |
| | オーストラリア | 3,856,091,396 | 2.31 |
| | バミューダ | 363,122,712 | 0.22 |
| | ニュージーランド | 144,297,809 | 0.09 |
| | 香港 | 1,610,365,850 | 0.96 |
| | シンガポール | 678,324,877 | 0.41 |
| | イスラエル | 320,543,080 | 0.19 |
| | ジャージー | 451,363,841 | 0.27 |
| | 英ヴァージン諸島 | 20,734,864 | 0.01 |
| | アラブ首長国連邦 | 13,462,090 | 0.01 |
| | マン島 | 26,770,181 | 0.02 |
| | 小計 | 159,051,900,540 | 95.12 |
| 投資証券 | アメリカ | 3,846,846,970 | 2.30 |
| | カナダ | 29,265,006 | 0.02 |
| | フランス | 165,672,058 | 0.10 |
| | イギリス | 113,483,988 | 0.07 |
| | オーストラリア | 318,097,162 | 0.19 |
| | 香港 | 94,228,480 | 0.06 |
| | シンガポール | 67,536,170 | 0.04 |
| | 小計 | 4,635,129,834 | 2.77 |
| コール・ローン等、その他資産（負債控除後） | | 3,510,186,856 | 2.10 |
| 合計（純資産総額） | | 167,210,510,102 | 100.00 |

その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 建別 | 国・地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|----------|----|------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 3,838,239,552 | 2.30 |
| | 買建 | ドイツ | 913,758,048 | 0.55 |

(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 | | 4,158,786,500 | 2.49 |

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量又は 額面総額 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------|----|-----------------------------|--|--------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| アメリカ | 株式 | APPLE INC | テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器 | 184,942 | 22,762.97 | 4,209,830,766 | 23,615.05 | 4,367,415,391 | 2.61 |
| アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェ ア・サービ ス | 292,514 | 12,628.12 | 3,693,902,205 | 14,863.82 | 4,347,875,912 | 2.60 |
| アメリカ | 株式 | AMAZON.COM INC | 小売 | 16,835 | 193,667.90 | 3,260,399,214 | 186,210.56 | 3,134,854,845 | 1.87 |
| アメリカ | 株式 | FACEBOOK INC-CLASS A | メディア・ 娯楽 | 96,690 | 17,666.83 | 1,708,205,915 | 19,112.63 | 1,848,000,388 | 1.11 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL C | メディア・ 娯楽 | 12,642 | 120,881.09 | 1,528,178,765 | 132,211.71 | 1,671,420,473 | 1.00 |
| アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO | 銀行 | 130,530 | 11,579.33 | 1,511,451,240 | 12,704.34 | 1,658,297,813 | 0.99 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL A | メディア・ 娯楽 | 12,030 | 121,535.85 | 1,462,076,319 | 132,304.52 | 1,591,623,424 | 0.95 |
| 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 | 106,831 | 14,782.90 | 1,579,273,000 | 13,878.51 | 1,482,655,315 | 0.89 |
| スイス | 株式 | NESTLE SA-REG | 食品・飲 料・タバコ | 122,983 | 9,893.81 | 1,216,770,569 | 11,726.37 | 1,442,144,900 | 0.86 |
| アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO | 家庭用品・ パーソナル 用品 | 100,699 | 10,598.03 | 1,067,211,862 | 13,443.59 | 1,353,756,512 | 0.81 |
| アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL CORP | エネルギー | 170,051 | 8,261.10 | 1,404,808,940 | 7,714.12 | 1,311,794,092 | 0.78 |
| アメリカ | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES | ソフトウェ ア・サービ ス | 69,812 | 16,366.75 | 1,142,596,245 | 18,778.08 | 1,310,935,321 | 0.78 |
| アメリカ | 株式 | AT&T INC | 電気通信 サービス | 292,947 | 3,384.16 | 991,382,324 | 4,039.44 | 1,183,343,470 | 0.71 |
| アメリカ | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 各種金融 | 52,270 | 22,016.27 | 1,150,790,674 | 22,388.00 | 1,170,220,969 | 0.70 |
| アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORP | 銀行 | 363,619 | 2,956.19 | 1,074,927,463 | 3,167.45 | 1,151,745,729 | 0.69 |
| アメリカ | 株式 | HOME DEPOT INC | 小売 | 44,300 | 20,478.91 | 907,216,087 | 24,806.49 | 1,098,927,560 | 0.66 |
| アメリカ | 株式 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | 電気通信 サービス | 165,987 | 6,138.40 | 1,018,895,601 | 6,507.57 | 1,080,173,018 | 0.65 |
| アメリカ | 株式 | MASTERCARD INC | ソフトウェ ア・サービ ス | 36,480 | 24,368.00 | 888,945,004 | 29,044.50 | 1,059,543,710 | 0.63 |
| アメリカ | 株式 | THE WALT DISNEY CO. | メディア・ 娯楽 | 72,332 | 12,928.74 | 935,161,960 | 14,025.28 | 1,014,476,784 | 0.61 |
| アメリカ | 株式 | INTEL CORP | 半導体・半 導体製造装 置 | 180,002 | 4,972.13 | 894,994,670 | 5,480.17 | 986,442,928 | 0.59 |
| アメリカ | 株式 | CHEVRON CORP | エネルギー | 76,451 | 12,454.64 | 952,170,382 | 12,799.31 | 978,520,202 | 0.59 |
| アメリカ | 株式 | COCA-COLA CO/THE | 食品・飲 料・タバコ | 162,632 | 5,241.35 | 852,411,914 | 5,861.13 | 953,208,140 | 0.57 |
| アメリカ | 株式 | WELLS FARGO & CO | 銀行 | 171,940 | 5,414.88 | 931,036,120 | 5,472.62 | 940,962,833 | 0.56 |

| | | | | | | | | | |
|------|----|------------------------------|------------------------|---------|-----------|---------------|-----------|-------------|------|
| 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 | 103,313 | 8,072.23 | 833,966,342 | 8,947.64 | 924,408,275 | 0.55 |
| アメリカ | 株式 | CISCO SYSTEMS INC | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 172,390 | 5,171.68 | 891,547,080 | 5,270.81 | 908,635,419 | 0.54 |
| アメリカ | 株式 | BOEING CO/THE | 資本財 | 21,522 | 39,101.97 | 841,552,642 | 41,318.25 | 889,251,402 | 0.53 |
| アメリカ | 株式 | UNITEDHEALTH GROUP INC | ヘルスケア機器・サービス | 38,200 | 27,596.51 | 1,054,186,959 | 23,230.85 | 887,418,821 | 0.53 |
| 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 | 28,218 | 27,186.01 | 767,134,871 | 31,422.76 | 886,687,667 | 0.53 |
| アメリカ | 株式 | COMCAST CORP-CLASS A | メディア・娯楽 | 181,994 | 4,165.13 | 758,029,929 | 4,835.89 | 880,103,911 | 0.53 |
| 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 | 223,590 | 4,554.86 | 1,018,422,898 | 3,908.86 | 873,982,544 | 0.52 |

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 | 5.51 |
| | | 素材 | 4.24 |
| | | 資本財 | 6.88 |
| | | 商業・専門サービス | 1.25 |
| | | 運輸 | 1.89 |
| | | 自動車・自動車部品 | 1.06 |
| | | 耐久消費財・アパレル | 1.89 |
| | | 消費者サービス | 1.85 |
| | | メディア・娯楽 | 5.77 |
| | | 小売 | 4.76 |
| | | 食品・生活必需品小売り | 1.55 |
| | | 食品・飲料・タバコ | 4.92 |
| | | 家庭用品・パーソナル用品 | 2.20 |
| | | ヘルスケア機器・サービス | 4.62 |
| | | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 7.81 |
| | | 銀行 | 7.72 |
| | | 各種金融 | 4.21 |
| | | 保険 | 3.88 |
| | | 不動産 | 0.49 |
| | | ソフトウェア・サービス | 9.23 |
| テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 4.25 | | |
| 電気通信サービス | 2.47 | | |
| 公益事業 | 3.68 | | |

| | | | |
|------|--|-------------|-------|
| | | 半導体・半導体製造装置 | 3.00 |
| 投資証券 | | | 2.77 |
| 合計 | | | 97.90 |

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 EMINI1912 | 買建 | 240 | 米ドル | 35,819,937.5 | 3,865,687,655 | 35,565,600 | 3,838,239,552 | 2.30 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | DJSTX5 1912 | 買建 | 240 | ユーロ | 7,693,980 | 908,043,520 | 7,742,400 | 913,758,048 | 0.55 |

(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 | 31,800,000.00 | 3,414,035,100 | 3,426,987,000 | 2.05 |
| | ユーロ | 買建 | 6,200,000.00 | 734,806,950 | 731,799,500 | 0.44 |

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2019年9月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

| 資産の種類 | 国・地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|-------|---------|---------------|---------|
| 株式 | アメリカ | 229,695,039 | 0.28 |
| | アルゼンチン | 142,010,428 | 0.17 |
| | メキシコ | 1,818,908,317 | 2.18 |
| | ブラジル | 5,664,663,710 | 6.79 |
| | チリ | 721,388,162 | 0.87 |
| | コロンビア | 312,702,936 | 0.38 |
| | ペルー | 289,349,358 | 0.35 |
| | オランダ | 59,550,245 | 0.07 |
| | ベルギー | 6,767,267 | 0.01 |
| | ルクセンブルク | 37,329,652 | 0.04 |
| | ギリシャ | 215,603,420 | 0.26 |

| | | | |
|-----------------------|----------|----------------|--------|
| | トルコ | 435,562,697 | 0.52 |
| | チェコ | 104,683,710 | 0.13 |
| | ハンガリー | 217,415,538 | 0.26 |
| | ポーランド | 742,526,364 | 0.89 |
| | ロシア | 2,892,310,496 | 3.47 |
| | ケイマン | 7,591,512,674 | 9.10 |
| | バミューダ | 440,996,992 | 0.53 |
| | 香港 | 2,908,489,969 | 3.49 |
| | シンガポール | 26,520,818 | 0.03 |
| | マレーシア | 1,519,910,179 | 1.82 |
| | タイ | 2,186,442,889 | 2.62 |
| | フィリピン | 819,018,768 | 0.98 |
| | インドネシア | 1,548,846,943 | 1.86 |
| | 韓国 | 8,964,329,131 | 10.75 |
| | 台湾 | 8,494,284,754 | 10.19 |
| | 中国 | 12,683,750,428 | 15.21 |
| | インド | 6,690,628,612 | 8.02 |
| | パキスタン | 21,064,911 | 0.03 |
| | カタール | 746,810,312 | 0.90 |
| | エジプト | 108,728,821 | 0.13 |
| | 南アフリカ | 3,393,849,920 | 4.07 |
| | ジャージー | 44,297,017 | 0.05 |
| | アラブ首長国連邦 | 542,738,543 | 0.65 |
| | サウジアラビア | 1,950,397,676 | 2.34 |
| | 小計 | 74,573,086,696 | 89.43 |
| 投資証券 | メキシコ | 59,027,754 | 0.07 |
| | 南アフリカ | 146,748,169 | 0.18 |
| | 小計 | 205,775,923 | 0.25 |
| コール・ローン等、その他資産（負債控除後） | | 8,606,421,938 | 10.32 |
| 合計（純資産総額） | | 83,385,284,557 | 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 | 9,791,257,840 | 11.74 |

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

| 資産の種類 | 建別 | 国・地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|--------|----|------|---------------|---------|
| 為替予約取引 | 買建 | | 3,182,717,104 | 3.82 |
| | 売建 | | 13,363,745 | 0.02 |

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量又は 額面総額 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|-----------|----|----------------------------------|--------------------------------|--------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 中国 | 株式 | TENCENT HOLDINGS LTD | メディア・ 娯楽 | 740,000 | 4,941.35 | 3,656,602,111 | 4,532.54 | 3,354,082,560 | 4.02 |
| ケイマン | 株式 | ALIBABA GROUP HOLDING-SP- ADR | 小売 | 184,050 | 18,630.99 | 3,429,034,126 | 17,912.56 | 3,296,806,963 | 3.95 |
| 台湾 | 株式 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 半導体・半 導体製造装 置 | 3,183,355 | 869.50 | 2,767,933,700 | 946.56 | 3,013,236,509 | 3.61 |
| 韓国 | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器 | 617,910 | 3,955.86 | 2,444,369,371 | 4,351.16 | 2,688,625,276 | 3.22 |
| 中国 | 株式 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 銀行 | 12,459,920 | 85.08 | 1,060,131,973 | 81.45 | 1,014,975,115 | 1.22 |
| 南アフリ カ | 株式 | NASPERS LTD-N SHS | 小売 | 56,860 | 17,501.51 | 995,136,309 | 16,515.05 | 939,045,948 | 1.13 |
| 中国 | 株式 | PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 保険 | 719,000 | 1,242.64 | 893,460,620 | 1,236.33 | 888,925,584 | 1.07 |
| インド | 株式 | RELIANCE INDUSTRIES LTD | エネルギー | 369,592 | 1,938.28 | 716,373,485 | 2,015.93 | 745,074,188 | 0.89 |
| 香港 | 株式 | CHINA MOBILE LTD | 電気通信 サービス | 797,700 | 959.87 | 765,688,499 | 880.64 | 702,486,528 | 0.84 |
| インド | 株式 | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE | 銀行 | 212,725 | 3,177.27 | 675,885,755 | 3,135.28 | 666,953,714 | 0.80 |
| 中国 | 株式 | IND & COMM BK OF CHINA - H | 銀行 | 8,481,575 | 74.36 | 630,738,561 | 71.41 | 605,706,590 | 0.73 |
| ロシア | 株式 | SBERBANK-SPONSORED ADR | 銀行 | 354,960 | 1,571.97 | 557,989,356 | 1,548.11 | 549,517,978 | 0.66 |
| インド | 株式 | INFOSYS LTD | ソフトウ ェア・サー ビス | 449,708 | 1,150.70 | 517,481,285 | 1,204.58 | 541,712,860 | 0.65 |
| ロシア | 株式 | GAZPROM PAO-SPON ADR | エネルギー | 700,660 | 713.24 | 499,743,560 | 764.07 | 535,355,809 | 0.64 |
| 韓国 | 株式 | SK HYNIX INC | 半導体・半 導体製造装 置 | 71,150 | 6,682.73 | 475,476,468 | 7,317.86 | 520,665,739 | 0.62 |
| ロシア | 株式 | LUKOIL PJSC-SPON-ADR | エネルギー | 51,975 | 8,586.11 | 446,263,217 | 9,119.24 | 473,972,499 | 0.57 |
| ブラジル | 株式 | ITAU UNIBANCO HOLDING S- PREF | 銀行 | 480,854 | 864.91 | 415,895,647 | 922.00 | 443,349,071 | 0.53 |
| 中国 | 株式 | BANK OF CHINA LTD - H | 銀行 | 10,325,000 | 45.50 | 469,857,542 | 41.96 | 433,319,600 | 0.52 |
| ブラジル | 株式 | VALE SA | 素材 | 345,039 | 1,259.93 | 434,727,356 | 1,236.77 | 426,736,299 | 0.51 |
| 台湾 | 株式 | HON HAI PRECISION INDUSTRY | テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器 | 1,618,212 | 266.15 | 430,696,610 | 254.73 | 412,216,852 | 0.49 |
| ケイマン | 株式 | BAIDU INC - SPON ADR | メディア・ 娯楽 | 36,460 | 13,915.91 | 507,374,142 | 10,922.58 | 398,237,383 | 0.48 |
| 香港 | 株式 | CNOOC LTD | エネルギー | 2,333,000 | 178.12 | 415,567,012 | 164.56 | 383,940,877 | 0.46 |
| 韓国 | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS-PFD | テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器 | 106,340 | 3,238.01 | 344,330,372 | 3,533.07 | 375,706,664 | 0.45 |
| インド | 株式 | TATA CONSULTANCY SVCS LTD | ソフトウ ェア・サー ビス | 116,890 | 3,303.03 | 386,091,244 | 3,166.47 | 370,128,795 | 0.44 |
| ブラジル | 株式 | BANCO BRADESCO SA-PRF | 銀行 | 377,378 | 893.45 | 337,171,848 | 895.27 | 337,857,089 | 0.41 |
| カタール | 株式 | QATAR NATIONAL BANK | 銀行 | 591,920 | 542.73 | 321,255,270 | 566.97 | 335,604,434 | 0.40 |

| | | | | | | | | | |
|---------|----|---------------------------|------|-----------|----------|-------------|----------|-------------|------|
| ブラジル | 株式 | B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO | 各種金融 | 272,583 | 972.40 | 265,062,058 | 1,151.66 | 313,923,210 | 0.38 |
| インドネシア | 株式 | PT BANK CENTRAL ASIA | 銀行 | 1,302,700 | 218.82 | 285,066,216 | 230.66 | 300,480,782 | 0.36 |
| サウジアラビア | 株式 | AL RAJHI BANK | 銀行 | 160,900 | 1,899.71 | 305,664,603 | 1,812.77 | 291,675,980 | 0.35 |
| ケイマン | 株式 | JD.COM INC-ADR | 小売 | 96,670 | 3,234.87 | 312,715,490 | 3,002.33 | 290,235,666 | 0.35 |

ロ.種類別及び業種別の投資比率

| 種類 | 国内/国外 | 業種 | 投資比率(%) |
|--------------------|-------|------------------------|---------|
| 株式 | 国外 | エネルギー | 6.95 |
| | | 素材 | 6.59 |
| | | 資本財 | 2.92 |
| | | 商業・専門サービス | 0.15 |
| | | 運輸 | 1.71 |
| | | 自動車・自動車部品 | 2.12 |
| | | 耐久消費財・アパレル | 1.17 |
| | | 消費者サービス | 1.27 |
| | | メディア・娯楽 | 6.17 |
| | | 小売 | 7.10 |
| | | 食品・生活必需品小売り | 1.59 |
| | | 食品・飲料・タバコ | 3.58 |
| | | 家庭用品・パーソナル用品 | 1.02 |
| | | ヘルスケア機器・サービス | 0.64 |
| | | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 1.68 |
| | | 銀行 | 16.38 |
| | | 各種金融 | 2.28 |
| | | 保険 | 3.71 |
| | | 不動産 | 2.33 |
| | | ソフトウェア・サービス | 1.73 |
| テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 6.46 | | |
| 電気通信サービス | 4.10 | | |
| 公益事業 | 2.52 | | |
| 半導体・半導体製造装置 | 5.26 | | |
| 投資証券 | | | 0.25 |
| 合計 | | | 89.68 |

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

| 資産の種類 | 地域 | 取引所 | 名称 | 建別 | 数量 | 通貨 | 契約額等 (各通貨) | 契約額等(円) | 評価額 (各通貨) | 評価額(円) | 投資 比率 (%) |
|-------|----|-----|----|----|----|----|---------------|---------|--------------|--------|-----------------|
|-------|----|-----|----|----|----|----|---------------|---------|--------------|--------|-----------------|

| | | | | | | | | | | | |
|----------|------|-------------|--------------|----|-------|-----|------------|---------------|------------|---------------|-------|
| 株価指数先物取引 | アメリカ | ニューヨーク証券取引所 | MINMSCIE1912 | 買建 | 1,820 | 米ドル | 92,485,245 | 9,981,007,640 | 90,727,000 | 9,791,257,840 | 11.74 |
|----------|------|-------------|--------------|----|-------|-----|------------|---------------|------------|---------------|-------|

(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 | 19,900,000.00 | 2,146,845,500 | 2,147,271,000 | 2.58 |
| | メキシコペソ | 買建 | 3,550,000.00 | 19,468,200 | 19,418,500 | 0.02 |
| | コロンビアペソ | 買建 | 427,444,807.63 | 13,355,077 | 13,336,277 | 0.02 |
| | ユーロ | 買建 | 200,000.00 | 23,604,000 | 23,604,000 | 0.03 |
| | トルコリラ | 買建 | 1,050,000.00 | 20,005,650 | 19,992,000 | 0.02 |
| | ポーランドズロチ | 買建 | 1,250,000.00 | 33,695,000 | 33,662,500 | 0.04 |
| | 香港ドル | 買建 | 52,200,000.00 | 717,750,000 | 717,750,000 | 0.86 |
| | フィリピンペソ | 買建 | 18,492,705.58 | 38,257,709 | 38,464,827 | 0.05 |
| | 南アフリカランド | 買建 | 23,800,000.00 | 170,312,800 | 169,218,000 | 0.20 |
| | 米ドル | 売建 | 123,841.59 | 13,355,077 | 13,363,745 | 0.02 |

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

海外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9月30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 | 46,806,667,313 | 72.88 |
| | カナダ | 1,220,168,612 | 1.90 |
| | ドイツ | 165,565,651 | 0.26 |
| | イタリア | 14,576,631 | 0.02 |
| | フランス | 2,054,058,627 | 3.20 |
| | オランダ | 157,354,894 | 0.25 |
| | スペイン | 409,614,808 | 0.64 |
| | ベルギー | 625,529,049 | 0.97 |
| | アイルランド | 151,650,957 | 0.24 |
| | イギリス | 2,832,630,933 | 4.41 |
| | オーストラリア | 4,049,786,848 | 6.31 |
| | ニュージーランド | 125,916,222 | 0.20 |
| | 香港 | 1,258,470,887 | 1.96 |
| | シンガポール | 2,413,282,642 | 3.76 |
| | 韓国 | 5,836,195 | 0.01 |
| イスラエル | 52,099,775 | 0.08 | |

| | | | |
|-----------------------|------|----------------|--------|
| | ガーンジ | 107,576,165 | 0.17 |
| | マン島 | 17,842,305 | 0.03 |
| | 小計 | 62,468,628,514 | 97.27 |
| コール・ローン等、その他資産(負債控除後) | | 1,756,529,514 | 2.73 |
| 合計(純資産総額) | | 64,225,158,028 | 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 | | 1,248,949,500 | 1.94 |

(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 | 274,487 | 8,822.73 | 2,421,725,040 | 9,257.37 | 2,541,029,805 | 3.96 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUINIX INC | 36,883 | 62,814.39 | 2,316,783,514 | 62,228.83 | 2,295,185,952 | 3.57 |
| アメリカ | 投資証券 | SIMON PROPERTY GROUP INC | 133,910 | 17,184.02 | 2,301,112,217 | 17,047.04 | 2,282,769,555 | 3.55 |
| アメリカ | 投資証券 | PUBLIC STORAGE | 65,301 | 26,658.78 | 1,740,845,473 | 26,441.47 | 1,726,655,033 | 2.69 |
| アメリカ | 投資証券 | WELLTOWER INC | 176,307 | 9,172.87 | 1,617,242,262 | 9,744.09 | 1,717,952,475 | 2.67 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUITY RESIDENTIAL-REIT | 151,710 | 8,669.97 | 1,315,322,626 | 9,308.10 | 1,412,131,851 | 2.20 |
| アメリカ | 投資証券 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 60,714 | 22,558.07 | 1,369,590,693 | 23,124.01 | 1,403,951,653 | 2.19 |
| アメリカ | 投資証券 | VENTAS INC | 162,096 | 7,485.12 | 1,213,308,580 | 7,948.30 | 1,288,388,934 | 2.01 |
| アメリカ | 投資証券 | DIGITAL REALTY TRUST INC | 90,604 | 13,065.50 | 1,183,786,593 | 13,905.49 | 1,259,893,197 | 1.96 |
| アメリカ | 投資証券 | REALTY INCOME CORP | 138,504 | 7,862.27 | 1,088,956,762 | 8,323.86 | 1,152,889,235 | 1.80 |
| 香港 | 投資証券 | LINK REIT | 916,800 | 1,285.46 | 1,178,513,921 | 1,177.85 | 1,079,858,381 | 1.68 |
| アメリカ | 投資証券 | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 28,604 | 33,139.18 | 947,913,175 | 35,219.69 | 1,007,424,070 | 1.57 |
| フランス | 投資証券 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 59,900 | 15,445.58 | 925,190,271 | 15,531.43 | 930,332,777 | 1.45 |
| アメリカ | 投資証券 | BOSTON PROPERTIES INC | 62,577 | 14,295.28 | 894,556,150 | 14,042.55 | 878,740,676 | 1.37 |
| アメリカ | 投資証券 | HCP INC | 213,841 | 3,564.91 | 762,325,549 | 3,833.31 | 819,720,640 | 1.28 |
| アメリカ | 投資証券 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC | 49,372 | 16,095.74 | 794,679,059 | 16,523.63 | 815,804,720 | 1.27 |
| アメリカ | 投資証券 | WP CAREY INC | 74,377 | 9,307.87 | 692,291,507 | 9,717.11 | 722,729,996 | 1.13 |
| オーストラリア | 投資証券 | GOODMAN GROUP | 698,276 | 1,073.06 | 749,294,078 | 1,023.96 | 715,009,486 | 1.11 |
| アメリカ | 投資証券 | EXTRA SPACE STORAGE INC | 55,971 | 12,082.90 | 676,292,219 | 12,593.18 | 704,853,146 | 1.10 |
| アメリカ | 投資証券 | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 49,622 | 13,105.56 | 650,324,384 | 14,065.21 | 697,944,029 | 1.09 |
| オーストラリア | 投資証券 | SCENTRE GROUP | 2,322,457 | 282.39 | 655,851,855 | 287.14 | 666,887,025 | 1.04 |
| アメリカ | 投資証券 | UDR INC | 127,478 | 5,049.88 | 643,749,670 | 5,215.77 | 664,896,387 | 1.04 |
| アメリカ | 投資証券 | INVITATION HOMES INC | 207,953 | 3,024.89 | 629,036,872 | 3,195.51 | 664,516,141 | 1.03 |
| アメリカ | 投資証券 | SUN COMMUNITIES INC | 39,453 | 14,651.02 | 578,026,733 | 16,002.37 | 631,341,803 | 0.98 |
| アメリカ | 投資証券 | HOST HOTELS & RESORTS INC | 317,223 | 1,906.33 | 604,732,759 | 1,846.51 | 585,755,822 | 0.91 |

| | | | | | | | | |
|------|------|---------------------------------|---------|-----------|-------------|-----------|-------------|------|
| アメリカ | 投資証券 | DUKE REALTY CORPORATION | 157,379 | 3,509.23 | 552,280,015 | 3,673.59 | 578,146,991 | 0.90 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC | 39,646 | 13,732.74 | 544,448,494 | 14,398.68 | 570,850,321 | 0.89 |
| アメリカ | 投資証券 | REGENCY CENTERS CORP | 72,937 | 7,305.06 | 532,809,482 | 7,455.11 | 543,753,621 | 0.85 |
| イギリス | 投資証券 | SEGRO PLC | 471,631 | 995.44 | 469,480,387 | 1,070.01 | 504,650,905 | 0.79 |
| アメリカ | 投資証券 | CAMDEN PROPERTY TRUST | 42,182 | 11,566.68 | 487,905,803 | 11,961.85 | 504,574,875 | 0.79 |

ロ.種類別の投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 投資証券 | 97.27 |
| 合計 | 97.27 |

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 | 11,000,000.00 | 1,187,213,500 | 1,187,010,000 | 1.85 |
| | 豪ドル | 買建 | 850,000.00 | 61,980,130 | 61,939,500 | 0.10 |

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本リートインデックスJ-REITマザーファンド

以下の運用状況は2019年9月30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 | 65,927,431,690 | 98.27 |
| コール・ローン等、その他資産(負債控除後) | | 1,160,472,123 | 1.73 |
| 合計(純資産総額) | | 67,087,903,813 | 100.00 |

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量又は 額面総額 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------|----|-----|--------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
|------|----|-----|--------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|

| | | | | | | | | |
|----|------|---------------------------------|--------|------------|---------------|---------|---------------|------|
| 日本 | 投資証券 | 日本ビルファンド投資法人 投資証券 | 5,781 | 766,506.96 | 4,431,176,757 | 830,000 | 4,798,230,000 | 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 | 5,970 | 675,378.91 | 4,032,012,110 | 725,000 | 4,328,250,000 | 6.45 |
| 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 | 18,617 | 172,358.04 | 3,208,789,783 | 195,200 | 3,634,038,400 | 5.42 |
| 日本 | 投資証券 | オリックス不動産投資法人 投資証券 | 11,894 | 207,055.9 | 2,462,722,981 | 236,000 | 2,806,984,000 | 4.18 |
| 日本 | 投資証券 | ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券 | 13,403 | 186,222.19 | 2,495,936,033 | 207,000 | 2,774,421,000 | 4.14 |
| 日本 | 投資証券 | 日本リテールファンド投資法人 投資証券 | 11,282 | 217,843.66 | 2,457,712,208 | 228,600 | 2,579,065,200 | 3.84 |
| 日本 | 投資証券 | 日本プロロジスリート投資法人 投資証券 | 8,577 | 257,159.6 | 2,205,657,916 | 296,100 | 2,539,649,700 | 3.79 |
| 日本 | 投資証券 | 大和ハウスリート投資法人 投資証券 | 8,048 | 267,171.83 | 2,150,198,912 | 304,000 | 2,446,592,000 | 3.65 |
| 日本 | 投資証券 | G L P 投資法人 投資証券 | 14,868 | 125,584.48 | 1,867,190,058 | 143,400 | 2,132,071,200 | 3.18 |
| 日本 | 投資証券 | アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券 | 5,662 | 328,278.08 | 1,858,710,506 | 355,000 | 2,010,010,000 | 3.00 |
| 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 | 3,779 | 485,134.97 | 1,833,325,076 | 513,000 | 1,938,627,000 | 2.89 |
| 日本 | 投資証券 | インヴィンシブル投資法人 投資証券 | 26,185 | 61,039.66 | 1,598,323,600 | 66,700 | 1,746,539,500 | 2.60 |
| 日本 | 投資証券 | 積水ハウス・リート投資法人 投資証券 | 17,454 | 83,274.8 | 1,453,478,493 | 96,900 | 1,691,292,600 | 2.52 |
| 日本 | 投資証券 | アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券 | 2,991 | 489,739.15 | 1,464,809,808 | 552,000 | 1,651,032,000 | 2.46 |
| 日本 | 投資証券 | ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券 | 1,847 | 782,661.42 | 1,445,575,659 | 854,000 | 1,577,338,000 | 2.35 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券 | 19,230 | 86,406.12 | 1,661,589,853 | 80,600 | 1,549,938,000 | 2.31 |
| 日本 | 投資証券 | 日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券 | 1,984 | 619,842.91 | 1,229,768,344 | 673,000 | 1,335,232,000 | 1.99 |
| 日本 | 投資証券 | 森ヒルズリート投資法人 投資証券 | 6,868 | 157,536.94 | 1,081,963,733 | 171,600 | 1,178,548,800 | 1.76 |
| 日本 | 投資証券 | 大和証券オフィス投資法人 投資証券 | 1,378 | 791,658.09 | 1,090,904,852 | 839,000 | 1,156,142,000 | 1.72 |
| 日本 | 投資証券 | 産業ファンド投資法人 投資証券 | 7,345 | 139,590.71 | 1,025,293,809 | 155,200 | 1,139,944,000 | 1.70 |
| 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 | 3,900 | 255,822.76 | 997,708,783 | 267,400 | 1,042,860,000 | 1.55 |
| 日本 | 投資証券 | ヒューリックリート投資法人 投資証券 | 5,077 | 187,970.76 | 954,327,573 | 198,600 | 1,008,292,200 | 1.50 |
| 日本 | 投資証券 | フロンティア不動産投資法人 投資証券 | 2,120 | 465,905.79 | 987,720,291 | 460,500 | 976,260,000 | 1.46 |
| 日本 | 投資証券 | イオンリート投資法人 投資証券 | 6,443 | 138,056.36 | 889,497,178 | 148,900 | 959,362,700 | 1.43 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパンエクセレント投資法人 投資証券 | 5,346 | 163,549.08 | 874,333,432 | 176,400 | 943,034,400 | 1.41 |
| 日本 | 投資証券 | 日本リート投資法人 投資証券 | 1,939 | 433,027.59 | 839,640,500 | 451,500 | 875,458,500 | 1.30 |
| 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 | 2,485 | 317,473.01 | 788,920,451 | 347,000 | 862,295,000 | 1.29 |
| 日本 | 投資証券 | ラサールロジポート投資法人 投資証券 | 5,550 | 136,385.16 | 756,937,639 | 154,800 | 859,140,000 | 1.28 |
| 日本 | 投資証券 | プレミアム投資法人 投資証券 | 5,392 | 142,598.87 | 768,893,153 | 158,600 | 855,171,200 | 1.27 |
| 日本 | 投資証券 | M C U B S Mid C i t y 投資法人 投資証券 | 7,081 | 106,833.52 | 756,488,200 | 118,700 | 840,514,700 | 1.25 |

ロ.種類別の投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 投資証券 | 98.27 |

| | |
|-----|-------|
| 合 計 | 98.27 |
|-----|-------|

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。

マネー・オープン・マザーファンド

以下の運用状況は2019年 9月30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(%) |
|-----------------------|------|-------------|---------|
| コール・ローン等、その他資産(負債控除後) | | 422,331,425 | 100.00 |
| 合計(純資産総額) | | 422,331,425 | 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

該当事項はありません。

ロ. 種類別の投資比率

該当事項はありません。

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。

参考情報

運用実績

2019年9月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 12,074円

純資産総額…………… 1,005.00億円

※基準価額は、運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当りの値です。

※分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

| 2019年3月 | 2019年5月 | 2019年7月 | 2019年9月 | 設定来累計 |
|---------|---------|---------|---------|-------|
| 110円 | 110円 | 115円 | 120円 | 455円 |

主要な資産の状況

<資産構成比>

| 資産 | 比率 | 資産の内訳 | 比率 |
|---------------|--------|------------|--------|
| 株式 | 58.5% | 日本株式(先物) | 20.2% |
| | | 海外先進国株式 | 19.2% |
| | | 海外新興国株式 | 19.1% |
| 不動産投資信託(REIT) | 38.7% | 日本REIT | 19.3% |
| | | 海外先進国REIT | 19.4% |
| 債券 | 198.3% | 日本国債(先物) | 40.6% |
| | | 米国国債(先物) | 39.6% |
| | | ドイツ国債(先物) | 39.4% |
| | | イギリス国債(先物) | 39.3% |
| | | 豪州国債(先物) | 39.4% |
| 合計 | 295.5% | 合計 | 295.5% |
| 現金その他 | 23.0% | 現金その他 | 23.0% |

<通貨別構成比>

| 通貨名 | 比率 |
|---------|-------|
| 日本円 | 38.0% |
| アメリカドル | 33.3% |
| 香港ドル | 4.5% |
| ユーロ | 4.3% |
| イギリスポンド | 2.9% |
| その他 | 16.9% |

※比率は当ファンド純資産総額比で、先物取引による繰玉は含まれません。

※比率は当ファンドの純資産総額比です。

※先物取引にかかる証拠金は「現金その他」に含まれます。

※当ファンドはグローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)を通じて、主な投資対象ごとに次の資産へ投資を行いません。

日本株式(先物)：国内の株価指数先物取引に係る権利など

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

海外新興国株式：海外新興国株式インデックスMSCIマーキング(ヘッジなし)マザーファンド

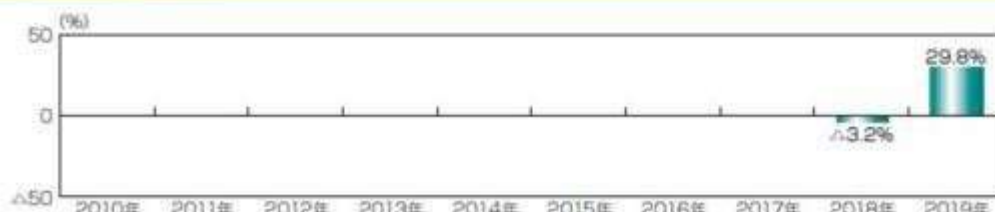
日本REIT：日本リートインデックスJ-REITマザーファンド

海外先進国REIT：海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド

世界国債(先物)：世界の国債先物取引に係る権利など

※日本、米国、ドイツ、イギリス、豪州の国債(先物)を指します。

年間収益率の推移



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

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2018年は、設定時から2018年末までの騰落率です。

※2019年は、2019年9月末までの騰落率です。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

(2) コースの選択

収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース＞と＜分配金受取りコース＞の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。

＜分配金再投資コース＞

収益分配金を自動的に再投資するコースです。なお、販売会社によっては、収益分配金を定期的に受け取るための「定期引出契約」を結ぶことができる場合があります。

＜分配金受取りコース＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

(3) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(4) 取扱時間

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

(5) 取得申込不可日

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

- ・ニューヨーク証券取引所の休業日
- ・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

(6) 申込金額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。

(7) 申込単位

販売会社の照会先にお問い合わせください。

(8) 申込代金の支払い

取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。

(9) 受付の中止および取消

委託会社は、投資対象とする投資信託証券への投資ができない場合、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、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、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。

(10) 償還乗換

- ・受益者は、証券投資信託の償還金額（手取額）の範囲内（単位型証券投資信託については、償還金額（手取額）とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する口数に係る申込手数料を徴収されない措置の適用を受けることができる場合があります。この償還乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・この措置の適用を受ける受益者は、販売会社から、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求められることがあります。

(11) 乗換優遇

受益者は、信託期間終了日の1年前以内などの一定の要件を満たした証券投資信託を解約または買取請求により換金した際の代金をもって、換金を行なった販売会社において、取得申込みをする場合の手数料率が割引となる措置の適用を受けることができる場合があります。この乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

2【換金(解約)手続等】

<解約請求による換金>

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約請求不可日

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

- ・ニューヨーク証券取引所の休業日
- ・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、解約価額から解約に係る所定の税金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られない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。)に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

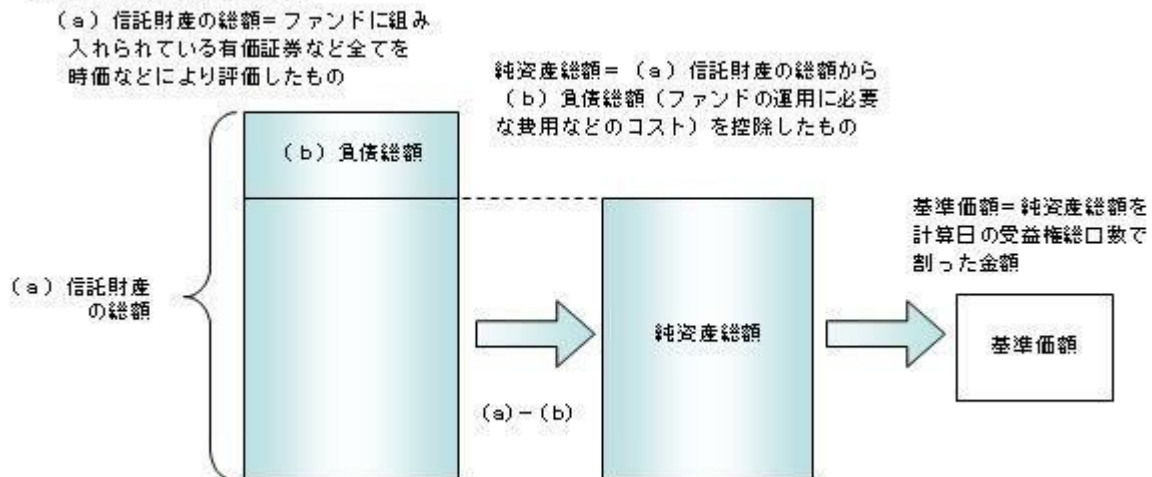
3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

基準価額の算出

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



有価証券などの評価基準

- ・信託財産に属する資産については、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価します。
- < 主な資産の評価方法 >
投資信託証券（国内籍）
原則として、基準価額計算日の基準価額で評価します。
- ・外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客相場の仲値によって計算します。

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス 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】

2028年9月21日までとします（2018年10月4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1月22日から3月21日まで、3月22日から5月21日まで、5月22日から7月21日まで、7月22日から9月21日まで、9月22日から11月21日までおよび11月22日から翌年1月21日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

（５）【その他】

信託の終了（繰上償還）

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

償還金について

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

信託約款の変更など

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

書面決議

- 1) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に対して、委託会社は書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにその内容および理由などの事項を定め、決議の日の2週間前までに知っ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、知っ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>



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。

運用報告書の作成

- ・委託会社は、年2回（3月、9月）および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。
- ・交付運用報告書は、原則として知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/

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。

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) 当ファンドの計算期間は、6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、2019年 3月23日から2019年 9月24日までの特定期間の財務諸表について、P w C 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】

【グローバル3倍3分法ファンド（隔月分配型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

| | 前期 2019年 3月22日現在 | 当期 2019年 9月24日現在 |
|-----------------|---------------------|---------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 7,640,337 | 3,580,412,296 |
| 投資信託受益証券 | 211,910,443 | 89,867,147,472 |
| 親投資信託受益証券 | 215,035 | 91,451,606 |
| 未収入金 | 1,271,620 | - |
| 流動資産合計 | 221,037,435 | 93,539,011,374 |
| 資産合計 | 221,037,435 | 93,539,011,374 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払収益分配金 | 2,169,123 | 921,106,072 |
| 未払解約金 | 613,505 | 150,172,039 |
| 未払受託者報酬 | 6,417 | 2,653,485 |
| 未払委託者報酬 | 109,450 | 45,109,632 |
| 未払利息 | 5 | 3,871 |
| その他未払費用 | 74,040 | 6,797,395 |
| 流動負債合計 | 2,972,540 | 1,125,842,494 |
| 負債合計 | 2,972,540 | 1,125,842,494 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 197,193,002 | 76,758,839,338 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 20,871,893 | 15,654,329,542 |
| （分配準備積立金） | 17,298,449 | 4,531,430,318 |
| 元本等合計 | 218,064,895 | 92,413,168,880 |
| 純資産合計 | 218,064,895 | 92,413,168,880 |
| 負債純資産合計 | 221,037,435 | 93,539,011,374 |

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

| | 前期 | | 当期 | |
|---|------------------------------------|------------|------------------------------------|----------------|
| | 自 2018年10月4日 至 2019年3月22日 | | 自 2019年3月23日 至 2019年9月24日 | |
| 営業収益 | | | | |
| 受取利息 | | 5 | | - |
| 有価証券売買等損益 | | 20,199,268 | | 6,106,603,924 |
| 営業収益合計 | | 20,199,273 | | 6,106,603,924 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払利息 | | 439 | | 293,864 |
| 受託者報酬 | | 16,391 | | 4,178,498 |
| 委託者報酬 | | 279,502 | | 71,035,473 |
| その他費用 | | 76,066 | | 7,065,875 |
| 営業費用合計 | | 372,398 | | 82,573,710 |
| 営業利益又は営業損失() | | 19,826,875 | | 6,024,030,214 |
| 経常利益又は経常損失() | | 19,826,875 | | 6,024,030,214 |
| 当期純利益又は当期純損失() | | 19,826,875 | | 6,024,030,214 |
| 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() | | 316,093 | | 40,805,572 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | | - | | 20,871,893 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 3,784,567 | | 11,446,967,058 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 30,912 | | - |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 3,753,655 | | 11,446,967,058 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 254,333 | | 173,894,273 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 137,376 | | 173,894,273 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 116,957 | | - |
| 分配金 | | 2,169,123 | | 1,622,839,778 |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | | 20,871,893 | | 15,654,329,542 |

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 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。 |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 当ファンドの計算期間は原則として、毎年1月22日から3月21日まで、3月22日から5月21日まで、5月22日から7月21日まで、7月22日から9月21日まで、9月22日から11月21日まで及び、11月22日から翌年1月21日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものいたしますので、当特定期間は2019年 3月23日から2019年 9月24日までとなっております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| | | 前期 2019年 3月22日現在 | 当期 2019年 9月24日現在 |
|----|-----------|---------------------|---------------------|
| 1. | 期首元本額 | 150,000,000円 | 197,193,002円 |
| | 期中追加設定元本額 | 58,721,302円 | 77,802,159,555円 |
| | 期中一部解約元本額 | 11,528,300円 | 1,240,513,219円 |
| 2. | 受益権の総数 | 197,193,002口 | 76,758,839,338口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 前期 自 2018年10月 4日 至 2019年 3月22日 | 当期 自 2019年 3月23日 至 2019年 9月24日 |
|---|---|
| <p>分配金の計算過程</p> <p>当ファンドは、信託約款の規定に基づき、第1計算期間（2018年10月 4日から2018年11月21日）から、第2計算期間（2018年11月22日から2019年 1月21日）は収益分配を行いません。</p> | <p>分配金の計算過程</p> <p>自 2019年 3月23日 至 2019年 5月21日</p> <p>A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 0円</p> <p>B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円</p> <p>C 信託約款に定める収益調整金 1,635,851,007円</p> <p>D 信託約款に定める分配準備積立 金 16,893,624円</p> <p>E 分配対象収益（A+B+C+D） 1,652,744,631円</p> <p>F 分配対象収益(1万口当たり) 980円</p> <p>G 分配金額 185,363,733円</p> <p>H 分配金額(1万口当たり) 110円</p> <p>自 2019年 5月22日 至 2019年 7月22日</p> |

| | | | | | | | |
|--------------------------------|-------------|--------------------------------|-----------------|---------------|--|--------------------------------|-----------------|
| | | A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 | 0円 | | | A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 | 0円 |
| | | B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 | 1,635,955,561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 | 4,349,552,356円 |
| | | C 信託約款に定める収益調整金 | 5,479,754,024円 | | | C 信託約款に定める収益調整金 | 11,122,899,224円 |
| | | D 信託約款に定める分配準備積立 金 | 8,601円 | | | D 信託約款に定める分配準備積立 金 | 1,102,984,034円 |
| | | E 分配対象収益(A+B+C+D) | 7,115,718,186円 | | | E 分配対象収益(A+B+C+D) | 16,575,435,614円 |
| | | F 分配対象収益(1万口当たり) | 1,584円 | | | F 分配対象収益(1万口当たり) | 2,159円 |
| | | G 分配金額 | 516,369,973円 | | | G 分配金額 | 921,106,072円 |
| | | H 分配金額(1万口当たり) | 115円 | | | H 分配金額(1万口当たり) | 120円 |
| 自 2019年 1月22日 | | | | 自 2019年 7月23日 | | | |
| 至 2019年 3月22日 | | | | 至 2019年 9月24日 | | | |
| A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 | 0円 | A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 | 0円 | | | | |
| B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 | 17,445,125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 | 4,349,552,356円 | | | | |
| C 信託約款に定める収益調整金 | 3,573,444円 | C 信託約款に定める収益調整金 | 11,122,899,224円 | | | | |
| D 信託約款に定める分配準備積立 金 | 2,022,447円 | D 信託約款に定める分配準備積立 金 | 1,102,984,034円 | | | | |
| E 分配対象収益(A+B+C+D) | 23,041,016円 | E 分配対象収益(A+B+C+D) | 16,575,435,614円 | | | | |
| F 分配対象収益(1万口当たり) | 1,168円 | F 分配対象収益(1万口当たり) | 2,159円 | | | | |
| G 分配金額 | 2,169,123円 | G 分配金額 | 921,106,072円 | | | | |
| H 分配金額(1万口当たり) | 110円 | H 分配金額(1万口当たり) | 120円 | | | | |

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| | 前期 自 2018年10月 4日 至 2019年 3月22日 | 当期 自 2019年 3月23日 至 2019年 9月24日 |
|-----------------------|---|--------------------------------------|
| 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 | 同左 |
| 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。 | 同左 |

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

金融商品の時価等に関する事項

| | 前期 2019年 3月22日現在 | 当期 2019年 9月24日現在 |
|-------------------------|---|--|
| 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。 | 同左 |
| 時価の算定方法 | (1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。 | (1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左 |
| 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左 |

(有価証券に関する注記)

前期(2019年 3月22日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

| 種類 | 最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|---------------------|
| 投資信託受益証券 | 17,650,698 |
| 親投資信託受益証券 | 21 |
| 合計 | 17,650,719 |

当期(2019年 9月24日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

| 種類 | 最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|---------------------|
| 投資信託受益証券 | 4,425,042,699 |
| 親投資信託受益証券 | 8,487 |
| 合計 | 4,425,034,212 |

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

| 前期 2019年 3月22日現在 | 当期 2019年 9月24日現在 |
|---------------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.1058円 (11,058円) |
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.2039円 (12,039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 | グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け) | 71,170,624,434 | 89,867,147,472 | |
| 投資信託受益証券 合計 | | 71,170,624,434 | 89,867,147,472 | |
| 親投資信託受益証券 | マネー・オープン・マザーファンド | 89,993,708 | 91,451,606 | |
| 親投資信託受益証券 合計 | | 89,993,708 | 91,451,606 | |
| 合計 | | 71,260,618,142 | 89,958,599,078 | |

(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、「グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）」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、「マネー・オープン・マザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

（参考）

グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）

貸借対照表

| | （単位：円） | |
|--------------|---------------|-----------------|
| | 2019年 3月22日現在 | 2019年 9月24日現在 |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 215,708,167 | 39,407,193,115 |
| 親投資信託受益証券 | 1,234,990,853 | 209,112,965,481 |
| 派生商品評価勘定 | 25,621,607 | 3,857,773,616 |
| 差入委託証拠金 | 86,841,043 | 17,666,262,156 |
| 流動資産合計 | 1,563,161,670 | 270,044,194,368 |
| 資産合計 | 1,563,161,670 | 270,044,194,368 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 494,755 | 1,481,140,000 |
| 前受金 | 493,500 | 1,855,075,000 |
| 未払解約金 | 1,271,619 | - |
| 未払受託者報酬 | 20,603 | 4,639,997 |
| 未払委託者報酬 | 61,835 | 13,920,025 |
| 未払利息 | 161 | 42,613 |
| その他未払費用 | 256,654 | 1,195,472 |
| 流動負債合計 | 2,599,127 | 3,356,013,107 |
| 負債合計 | 2,599,127 | 3,356,013,107 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1,392,050,287 | 211,197,961,092 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 168,512,256 | 55,490,220,169 |
| （分配準備積立金） | 100,078,686 | 18,776,777,498 |
| 元本等合計 | 1,560,562,543 | 266,688,181,261 |
| 純資産合計 | 1,560,562,543 | 266,688,181,261 |

2019年 3月22日現在

2019年 9月24日現在

| | | |
|---------|---------------|-----------------|
| 負債純資産合計 | 1,563,161,670 | 270,044,194,368 |
|---------|---------------|-----------------|

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 | (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)

| | | 2019年 3月22日現在 | 2019年 9月24日現在 |
|----|--------------|----------------|------------------|
| 1. | 期首 | 2018年10月 5日 | 2019年 3月23日 |
| | 期首元本額 | 297,000,000円 | 1,392,050,287円 |
| | 期首からの追加設定元本額 | 1,104,639,173円 | 209,805,910,805円 |
| | 期首からの一部解約元本額 | 9,588,886円 | - 円 |
| 2. | 受益権の総数 | 1,392,050,287口 | 211,197,961,092口 |

期首は当該投資信託の期首日であります。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| | 自 2018年10月 5日 至 2019年 3月22日 | 自 2019年 3月23日 至 2019年 9月24日 |
|--------------|--|--------------------------------|
| 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 | 同左 |

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

金融商品の時価等に関する事項

| | 2019年 3月22日現在 | 2019年 9月24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)

(2019年 3月22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 | 26,116,444 |
| 合計 | 26,116,444 |

(2019年 9月24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 | 7,643,382,136 |
| 合計 | 7,643,382,136 |

(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

(株式関連)

(2019年 3月22日現在)

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|------|----------|-------------|-------|-------------|---------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 322,233,500 | - | 322,493,000 | 259,500 |
| 合計 | | 322,233,500 | - | 322,493,000 | 259,500 |

(2019年 9月24日現在)

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|------|----------|----------------|-------|----------------|---------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 52,804,905,000 | - | 55,011,710,000 | 2,206,805,000 |
| 合計 | | 52,804,905,000 | - | 55,011,710,000 | 2,206,805,000 |

(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。

(債券関連)

(2019年 3月22日現在)

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|------|--------|---------------|-------|---------------|------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 債券先物取引 | | | | |
| | 買建 | 3,167,325,081 | - | 3,192,236,065 | 24,910,984 |
| 合計 | | 3,167,325,081 | - | 3,192,236,065 | 24,910,984 |

(2019年 9月24日現在)

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|------|--------|-----------------|-------|-----------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 債券先物取引 | | | | |
| | 買建 | 538,000,080,216 | - | 538,172,900,432 | 172,820,216 |
| 合計 | | 538,000,080,216 | - | 538,172,900,432 | 172,820,216 |

(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。

（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）

| 2019年 3月22日現在 | | 2019年 9月24日現在 | |
|---------------|-----------|---------------|-----------|
| 1口当たり純資産額 | 1.1211円 | 1口当たり純資産額 | 1.2627円 |
| (1万口当たり純資産額) | (11,211円) | (1万口当たり純資産額) | (12,627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 | 20,277,398,112 | 51,956,777,182 | |
| | 日本リートインデックスJ - REITマザーファンド | 21,360,348,829 | 53,029,202,002 | |
| | 海外リートインデックス(ヘッジなし) マザーファンド | 23,496,633,259 | 52,120,231,895 | |
| | 海外新興国株式インデックスMSCIエマージング (ヘッジなし) マザーファンド | 30,534,731,331 | 52,006,754,402 | |
| | 合計 | 95,669,111,531 | 209,112,965,481 | |

(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。

「グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）」は、「海外株式インデックスMSCI - KOKUSA I（ヘッジなし）マザーファンド」「海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド」「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」「日本リートインデックス」- R E I T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 - KOKUSA I（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

| | 2019年 3月22日現在 | 2019年 9月24日現在 |
|--------------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 164,855,904 | 378,871,259 |
| コール・ローン | 1,161,311,942 | 2,535,765,623 |
| 出資金 | 9,218,168 | 13,993,567 |
| 株式 | 104,021,427,342 | 154,271,771,168 |
| 投資証券 | 2,869,371,076 | 4,472,507,084 |
| 派生商品評価勘定 | 48,026,488 | 21,298,193 |
| 未収入金 | 2,501,281 | 6,400,944 |
| 未収配当金 | 213,285,772 | 216,455,325 |
| 差入委託証拠金 | 294,081,434 | 573,871,044 |
| 流動資産合計 | 108,784,079,407 | 162,490,934,207 |
| 資産合計 | 108,784,079,407 | 162,490,934,207 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 6,779,065 | 16,070,521 |
| 未払金 | - | 11,744,986 |
| 未払解約金 | 307,536,478 | 81,969,815 |
| 未払利息 | 870 | 2,742 |
| 流動負債合計 | 314,316,413 | 109,788,064 |
| 負債合計 | 314,316,413 | 109,788,064 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 42,945,778,033 | 63,373,285,462 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 65,523,984,961 | 99,007,860,681 |
| 元本等合計 | 108,469,762,994 | 162,381,146,143 |
| 純資産合計 | 108,469,762,994 | 162,381,146,143 |
| 負債純資産合計 | 108,784,079,407 | 162,490,934,207 |

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。 |
|--------------------|---|

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

(貸借対照表に関する注記)

| | | 2019年 3月22日現在 | 2019年 9月24日現在 |
|----|---------------------------------|-----------------|-----------------|
| 1. | 期首 | 2018年10月 5日 | 2019年 3月23日 |
| | 期首元本額 | 36,905,040,443円 | 42,945,778,033円 |
| | 期首からの追加設定元本額 | 7,488,571,810円 | 22,251,384,211円 |
| | 期首からの一部解約元本額 | 1,447,834,220円 | 1,823,876,782円 |
| | 元本の内訳 | | |
| | インデックスファンド海外株式ヘッジなし(DC専用) | 17,654,802,809円 | 18,431,103,739円 |
| | DCインデックスバランス(株式20) | 90,757,756円 | 111,883,464円 |
| | DCインデックスバランス(株式40) | 259,110,966円 | 281,396,173円 |
| | DCインデックスバランス(株式60) | 500,388,691円 | 545,674,185円 |
| | DCインデックスバランス(株式80) | 518,577,656円 | 556,733,403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 | 2,149,842,769円 | 2,057,754,830円 |
| | 日興五大陸株式ファンド | 5,375,296,194円 | 5,104,671,570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) | 87,212,512円 | 75,635,155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) | 149,883,088円 | 141,714,299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) | 7,075,380,432円 | 6,930,655,367円 |
| | グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け) | 121,995,691円 | 20,277,398,112円 |
| | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80) | 5,151,379円 | 4,877,282円 |
| | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60) | 4,247,226円 | 4,161,570円 |
| | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) | 7,943,567円 | 7,457,195円 |
| | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) | 6,260,015円 | 5,934,578円 |
| | 国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け) | 4,303,984,964円 | 4,234,104,494円 |

| | | |
|------------------------------|-----------------|-----------------|
| 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) | 27,236,925円 | 28,818,901円 |
| 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) | 81,194,984円 | 78,632,146円 |
| 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60) | 118,307,404円 | 113,627,458円 |
| 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80) | 112,807,008円 | 110,488,639円 |
| インデックスファンド海外株式(ヘッジなし) | 4,295,395,997円 | 4,270,562,902円 |
| 計 | 42,945,778,033円 | 63,373,285,462円 |
| 2. 受益権の総数 | 42,945,778,033口 | 63,373,285,462口 |

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| | 自 2018年10月 5日 至 2019年 3月22日 | 自 2019年 3月23日 至 2019年 9月24日 |
|-----------------------|---|--------------------------------|
| 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 | 同左 |
| 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。 | 同左 |
| 金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。 | 同左 |

金融商品の時価等に関する事項

| | 2019年 3月22日現在 | 2019年 9月24日現在 |
|-------------------|-------------------------------------|---------------|
| 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。 | 同左 |
| 時価の算定方法 | (1)有価証券 | (1)有価証券 |

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

（有価証券に関する注記）

（2019年 3月22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 | 1,348,461 |
| 株式 | 6,047,816,006 |
| 投資証券 | 259,119,033 |
| 合計 | 6,308,283,500 |

（2019年 9月24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 | 634,143 |
| 株式 | 10,722,548,126 |
| 投資証券 | 515,533,667 |
| 合計 | 11,238,715,936 |

(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)

(2019年 3月22日現在)

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|------|----------------|---------------|-------|---------------|------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | 1,534,626,204 | - | 1,575,872,272 | 41,246,068 |
| 合計 | | 1,534,626,204 | - | 1,575,872,272 | 41,246,068 |

(2019年 9月24日現在)

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|------|----------------|---------------|-------|---------------|-----------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | 4,689,724,645 | - | 4,684,469,167 | 5,255,478 |
| 合計 | | 4,689,724,645 | - | 4,684,469,167 | 5,255,478 |

(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)

(2019年 3月22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 | 1,220,416,645 | - | 1,219,248,000 | 1,168,645 | |
| | 米ドル | 1,030,816,580 | - | 1,030,455,500 | 361,080 | |
| | ユーロ | 189,600,065 | - | 188,792,500 | 807,565 | |
| | 売建 | 145,093,000 | - | 143,923,000 | 1,170,000 | |
| | 米ドル | 145,093,000 | - | 143,923,000 | 1,170,000 | |
| 合計 | | 1,365,509,645 | - | 1,363,171,000 | 1,355 | |

(2019年 9月24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 | 3,800,018,350 | - | 3,810,501,500 | 10,483,150 | |
| | 米ドル | 3,053,434,200 | - | 3,065,006,000 | 11,571,800 | |
| | ユーロ | 746,584,150 | - | 745,495,500 | 1,088,650 | |
| 合計 | | 3,800,018,350 | - | 3,810,501,500 | 10,483,150 | |

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

| 2019年 3月22日現在 | | 2019年 9月24日現在 | |
|---------------|-----------|---------------|-----------|
| 1口当たり純資産額 | 2.5257円 | 1口当たり純資産額 | 2.5623円 |
| (1万口当たり純資産額) | (25,257円) | (1万口当たり純資産額) | (25,623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 | APACHE CORP | 15,754 | 26.18 | 412,439.72 | |
| | BAKER HUGHES A GE CO | 18,095 | 23.90 | 432,470.50 | |
| | CABOT OIL & GAS CORP | 17,770 | 18.12 | 321,992.40 | |
| | CHENIERE ENERGY INC | 8,370 | 65.84 | 551,080.80 | |
| | CHEVRON CORP | 73,711 | 124.90 | 9,206,503.90 | |
| | CIMAREX ENERGY CO | 2,955 | 50.79 | 150,084.45 | |
| | CONCHO RESOURCES INC | 7,755 | 72.91 | 565,417.05 | |
| | CONOCOPHILLIPS | 44,050 | 60.18 | 2,650,929.00 | |
| | CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 3,310 | 34.05 | 112,705.50 | |
| | DEVON ENERGY CORPORATION | 18,101 | 25.83 | 467,548.83 | |
| | DIAMONDBACK ENERGY INC | 5,610 | 98.29 | 551,406.90 | |
| | EOG RESOURCES INC | 22,582 | 80.13 | 1,809,495.66 | |
| | EXXON MOBIL CORP | 163,791 | 72.13 | 11,814,244.83 | |
| | HALLIBURTON CO | 33,887 | 20.61 | 698,411.07 | |
| | HELMERICH & PAYNE | 4,280 | 43.33 | 185,452.40 | |
| | HESS CORP | 10,710 | 65.51 | 701,612.10 | |
| | HOLLYFRONTIER CORP | 7,740 | 53.17 | 411,535.80 | |
| | KINDER MORGAN INC | 77,170 | 20.78 | 1,603,592.60 | |
| | MARATHON OIL CORP | 36,877 | 13.10 | 483,088.70 | |
| | MARATHON PETROLEUM CORP | 26,072 | 55.78 | 1,454,296.16 | |
| | NATIONAL OILWELL VARCO INC | 16,021 | 22.69 | 363,516.49 | |
| | NOBLE ENERGY INC | 19,222 | 23.44 | 450,563.68 | |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 35,781 | 45.50 | 1,628,035.50 | | |
| ONEOK INC | 15,470 | 74.81 | 1,157,310.70 | | |
| PARSLEY ENERGY INC-CLASS A | 9,380 | 18.32 | 171,841.60 | | |

| | | | |
|------------------------------|--------|--------|--------------|
| PHILLIPS 66 | 17,355 | 104.26 | 1,809,432.30 |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 6,500 | 133.75 | 869,375.00 |
| SCHLUMBERGER LTD | 54,721 | 37.33 | 2,042,734.93 |
| TARGA RESOURCES CORP | 8,350 | 41.28 | 344,688.00 |
| TECHNIPFMC PLC | 17,311 | 24.53 | 424,638.83 |
| VALERO ENERGY CORP | 15,472 | 84.14 | 1,301,814.08 |
| WILLIAMS COS INC | 45,264 | 24.61 | 1,113,947.04 |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 8,715 | 220.46 | 1,921,308.90 |
| ALBEMARLE CORP | 4,530 | 68.22 | 309,036.60 |
| AMCOR PLC | 56,620 | 9.65 | 546,383.00 |
| AVERY DENNISON CORP | 3,270 | 113.20 | 370,164.00 |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD | 9,870 | 30.44 | 300,442.80 |
| BALL CORP | 11,570 | 74.48 | 861,733.60 |
| CELANESE CORP | 5,540 | 122.47 | 678,483.80 |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 8,120 | 49.91 | 405,269.20 |
| CORTEVA INC | 26,982 | 28.88 | 779,240.16 |
| CROWN HOLDINGS INC | 4,715 | 64.16 | 302,514.40 |
| DOW INC | 29,415 | 47.91 | 1,409,272.65 |
| DUPONT DE NEMOURS INC | 28,512 | 70.92 | 2,022,071.04 |
| EASTMAN CHEMICAL COMPANY | 6,125 | 72.41 | 443,511.25 |
| ECOLAB INC | 10,140 | 195.83 | 1,985,716.20 |
| FMC CORP | 5,320 | 88.70 | 471,884.00 |
| FREEMPORT-MCMORAN INC | 56,728 | 10.33 | 586,000.24 |
| INTERNATIONAL PAPER CO | 13,470 | 41.07 | 553,212.90 |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 4,355 | 122.78 | 534,706.90 |
| LINDE PLC | 21,120 | 193.52 | 4,087,142.40 |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 10,520 | 88.22 | 928,074.40 |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 2,275 | 266.85 | 607,083.75 |
| MOSAIC CO/THE | 17,490 | 20.89 | 365,366.10 |
| NEWMONT GOLDCORP CORP | 32,022 | 39.85 | 1,276,076.70 |
| NUCOR CORP | 13,279 | 52.86 | 701,927.94 |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 3,710 | 103.73 | 384,838.30 |
| PPG INDUSTRIES INC | 8,924 | 118.35 | 1,056,155.40 |
| SEALED AIR CORP | 7,116 | 41.40 | 294,602.40 |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 3,207 | 541.65 | 1,737,071.55 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| STEEL DYNAMICS INC | 9,050 | 30.48 | 275,844.00 |
| VULCAN MATERIALS CO | 4,803 | 149.78 | 719,393.34 |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP | 1,360 | 65.13 | 88,576.80 |
| WESTROCK CO | 9,359 | 36.16 | 338,421.44 |
| 3M CO | 22,436 | 166.76 | 3,741,427.36 |
| ACUITY BRANDS INC | 1,510 | 137.17 | 207,126.70 |
| AERCAP HOLDINGS NV | 4,190 | 56.00 | 234,640.00 |
| ALLEGION PLC | 3,230 | 101.16 | 326,746.80 |
| AMETEK INC | 8,033 | 89.45 | 718,551.85 |
| ARCONIC INC | 17,563 | 26.77 | 470,161.51 |
| BOEING CO/THE | 20,712 | 377.03 | 7,809,045.36 |
| CATERPILLAR INC | 22,286 | 128.42 | 2,861,968.12 |
| CUMMINS INC | 5,405 | 162.19 | 876,636.95 |
| DEERE & CO | 12,130 | 165.21 | 2,003,997.30 |
| DOVER CORP | 4,940 | 98.65 | 487,331.00 |
| EATON CORP PLC | 15,716 | 83.91 | 1,318,729.56 |
| EMERSON ELECTRIC CO | 23,900 | 64.93 | 1,551,827.00 |
| FASTENAL CO | 24,606 | 32.28 | 794,281.68 |
| FLOWSERVE CORP | 5,495 | 47.40 | 260,463.00 |
| FLUOR CORP | 4,943 | 20.70 | 102,320.10 |
| FORTIVE CORP | 11,054 | 67.95 | 751,119.30 |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI | 5,330 | 53.19 | 283,502.70 |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 9,902 | 186.79 | 1,849,594.58 |
| GENERAL ELECTRIC CO | 339,073 | 9.34 | 3,166,941.82 |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC | 5,570 | 38.88 | 216,561.60 |
| HEICO CORP | 1,500 | 128.56 | 192,840.00 |
| HEICO CORP-CLASS A | 2,840 | 99.91 | 283,744.40 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 28,296 | 167.14 | 4,729,393.44 |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | 1,440 | 212.34 | 305,769.60 |
| IDEX CORP | 2,660 | 163.60 | 435,176.00 |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 12,905 | 154.30 | 1,991,241.50 |
| INGERSOLL-RAND PLC | 9,786 | 123.08 | 1,204,460.88 |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 6,090 | 91.29 | 555,956.10 |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD | 8,970 | 55.80 | 500,526.00 |
| JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD | 10,600 | 31.59 | 334,854.00 |

| | | | |
|--------------------------------|--------|--------|--------------|
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL | 29,924 | 44.24 | 1,323,837.76 |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 8,735 | 213.30 | 1,863,175.50 |
| LENNOX INTERNATIONAL INC | 1,330 | 239.10 | 318,003.00 |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 9,831 | 387.67 | 3,811,183.77 |
| MASCO CORP | 11,999 | 40.51 | 486,079.49 |
| MIDDLEBY CORP | 1,960 | 117.49 | 230,280.40 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 6,299 | 369.13 | 2,325,149.87 |
| OWENS CORNING | 4,700 | 60.56 | 284,632.00 |
| PACCAR INC | 12,554 | 70.38 | 883,550.52 |
| PARKER HANNIFIN CORP | 4,920 | 181.06 | 890,815.20 |
| PENTAIR PLC | 5,938 | 36.98 | 219,587.24 |
| RAYTHEON COMPANY | 11,172 | 196.74 | 2,197,979.28 |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 4,383 | 164.17 | 719,557.11 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 4,160 | 360.53 | 1,499,804.80 |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 7,030 | 50.63 | 355,928.90 |
| SMITH (A.O.) CORP | 4,990 | 47.77 | 238,372.30 |
| SNAP-ON INC | 2,170 | 155.35 | 337,109.50 |
| SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A | 3,810 | 82.71 | 315,125.10 |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 5,826 | 140.85 | 820,592.10 |
| TEXTRON INC | 8,486 | 50.74 | 430,579.64 |
| TRANSDIGM GROUP INC | 1,850 | 529.44 | 979,464.00 |
| UNITED RENTALS INC | 2,810 | 128.40 | 360,804.00 |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP | 31,868 | 135.67 | 4,323,531.56 |
| WABCO HOLDINGS INC | 1,710 | 134.13 | 229,362.30 |
| WABTEC CORP | 6,490 | 73.85 | 479,286.50 |
| WW GRAINGER INC | 1,897 | 291.07 | 552,159.79 |
| XYLEM INC | 6,968 | 77.54 | 540,298.72 |
| CINTAS CORP | 3,717 | 254.65 | 946,534.05 |
| COPART INC | 8,360 | 81.79 | 683,806.20 |
| COSTAR GROUP INC | 1,535 | 595.00 | 913,325.00 |
| EQUIFAX INC | 4,614 | 140.95 | 650,343.30 |
| IHS MARKIT LTD | 15,573 | 66.92 | 1,042,145.16 |
| MANPOWERGROUP INC | 2,437 | 83.88 | 204,415.56 |
| NIELSEN HOLDINGS PLC | 15,295 | 22.40 | 342,608.00 |
| REPUBLIC SERVICES INC | 8,660 | 87.08 | 754,112.80 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| ROBERT HALF INTL INC | 4,995 | 54.90 | 274,225.50 |
| ROLLINS INC | 4,940 | 34.08 | 168,355.20 |
| TRANSUNION | 7,110 | 81.02 | 576,052.20 |
| VERISK ANALYTICS INC | 6,370 | 157.32 | 1,002,128.40 |
| WASTE CONNECTIONS INC | 9,626 | 90.99 | 875,869.74 |
| WASTE MANAGEMENT INC | 16,004 | 114.95 | 1,839,659.80 |
| AMERCO | 375 | 385.50 | 144,562.50 |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC | 3,860 | 27.50 | 106,150.00 |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 4,840 | 83.89 | 406,027.60 |
| CSX CORP | 29,853 | 68.86 | 2,055,677.58 |
| DELTA AIR LINES INC | 6,135 | 58.02 | 355,952.70 |
| EXPEDITORS INTL WASH INC | 5,977 | 72.58 | 433,810.66 |
| FEDEX CORP | 9,838 | 145.67 | 1,433,101.46 |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC | 3,290 | 113.45 | 373,250.50 |
| KANSAS CITY SOUTHERN | 3,840 | 131.61 | 505,382.40 |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION | 4,600 | 35.19 | 161,874.00 |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 10,220 | 179.51 | 1,834,592.20 |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | 2,140 | 170.30 | 364,442.00 |
| SOUTHWEST AIRLINES CO | 5,860 | 54.48 | 319,252.80 |
| UBER TECHNOLOGIES INC | 7,540 | 33.00 | 248,820.00 |
| UNION PACIFIC CORP | 27,526 | 166.05 | 4,570,692.30 |
| UNITED AIRLINES HOLDINGS INC | 2,925 | 88.21 | 258,014.25 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 27,157 | 119.05 | 3,233,040.85 |
| XPO LOGISTICS INC | 3,850 | 71.25 | 274,312.50 |
| APTIV PLC | 9,760 | 87.99 | 858,782.40 |
| AUTOLIV INC | 2,540 | 76.64 | 194,665.60 |
| BORGWARNER INC | 9,890 | 36.81 | 364,050.90 |
| FORD MOTOR COMPANY | 148,455 | 9.16 | 1,359,847.80 |
| GENERAL MOTORS CORP | 48,695 | 37.24 | 1,813,401.80 |
| HARLEY-DAVIDSON INC | 6,229 | 35.41 | 220,568.89 |
| LEAR CORP | 2,710 | 118.81 | 321,975.10 |
| TESLA INC | 4,840 | 241.23 | 1,167,553.20 |
| CAPRI HOLDINGS LTD | 5,890 | 32.79 | 193,133.10 |
| DR HORTON INC | 13,126 | 52.20 | 685,177.20 |
| GARMIN LTD | 5,265 | 84.48 | 444,787.20 |

| | | | |
|------------------------------|--------|----------|--------------|
| HANESBRANDS INC | 12,690 | 14.56 | 184,766.40 |
| HASBRO INC | 5,168 | 118.08 | 610,237.44 |
| LEGGETT & PLATT INC | 4,778 | 41.06 | 196,184.68 |
| LENNAR CORP-CL A | 10,970 | 54.89 | 602,143.30 |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 4,570 | 195.18 | 891,972.60 |
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 2,488 | 121.70 | 302,789.60 |
| NEWELL BRANDS INC | 13,866 | 17.92 | 248,478.72 |
| NIKE INC -CL B | 48,888 | 87.69 | 4,286,988.72 |
| NVR INC | 140 | 3,502.99 | 490,418.60 |
| POLARIS INC | 1,930 | 87.35 | 168,585.50 |
| PULTE GROUP INC | 11,880 | 35.66 | 423,640.80 |
| PVH CORP | 3,580 | 87.00 | 311,460.00 |
| RALPH LAUREN CORP | 1,725 | 92.73 | 159,959.25 |
| ROKU INC | 3,000 | 107.37 | 322,110.00 |
| TAPESTRY INC | 10,656 | 25.14 | 267,891.84 |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A | 5,960 | 19.78 | 117,888.80 |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C | 9,412 | 17.99 | 169,321.88 |
| VF CORP | 13,480 | 87.60 | 1,180,848.00 |
| WHIRLPOOL CORP | 2,054 | 149.44 | 306,949.76 |
| ARAMARK | 9,390 | 42.69 | 400,859.10 |
| CARNIVAL CORP | 16,887 | 47.70 | 805,509.90 |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 945 | 843.29 | 796,909.05 |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 4,363 | 119.19 | 520,025.97 |
| DOMINO'S PIZZA INC | 1,440 | 246.26 | 354,614.40 |
| H&R BLOCK INC | 7,790 | 23.74 | 184,934.60 |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 10,660 | 94.25 | 1,004,705.00 |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 13,330 | 56.19 | 749,012.70 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A | 10,413 | 125.85 | 1,310,476.05 |
| MCDONALD'S CORP | 29,661 | 211.54 | 6,274,487.94 |
| MELCO RESORTS & ENTERT-ADR | 8,700 | 20.60 | 179,220.00 |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 18,660 | 28.62 | 534,049.20 |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN | 8,190 | 53.51 | 438,246.90 |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 6,688 | 109.55 | 732,670.40 |
| STARBUCKS CORP | 47,094 | 90.81 | 4,276,606.14 |
| VAIL RESORTS INC | 1,690 | 239.46 | 404,687.40 |

| | | | |
|-------------------------------|---------|----------|---------------|
| WYNN RESORTS LTD | 3,430 | 108.11 | 370,817.30 |
| YUM! BRANDS INC | 12,194 | 113.59 | 1,385,116.46 |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 30,000 | 54.18 | 1,625,400.00 |
| ALPHABET INC-CL A | 11,610 | 1,234.69 | 14,334,750.90 |
| ALPHABET INC-CL C | 12,182 | 1,234.03 | 15,032,953.46 |
| ALTICE USA INC- A | 8,400 | 29.14 | 244,776.00 |
| CBS CORP-CLASS B NON VOTING | 13,468 | 41.97 | 565,251.96 |
| CHARTER COMMUNICATION-A | 6,126 | 421.51 | 2,582,170.26 |
| COMCAST CORP-CLASS A | 175,494 | 46.21 | 8,110,455.21 |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-A | 5,730 | 26.58 | 152,303.40 |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-C | 13,040 | 24.70 | 322,088.00 |
| DISH NETWORK CORP-A | 9,729 | 34.46 | 335,309.98 |
| ELECTRONIC ARTS INC | 11,284 | 98.18 | 1,107,863.12 |
| FACEBOOK INC-CLASS A | 93,200 | 186.82 | 17,411,624.00 |
| FOX CORP - CLASS A | 13,334 | 32.27 | 430,288.18 |
| FOX CORP- CLASS B | 7,746 | 32.18 | 249,266.28 |
| IAC/INTERACTIVECORP | 3,010 | 232.44 | 699,644.40 |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 17,186 | 21.22 | 364,686.92 |
| LIBERTY BROADBAND-C | 3,820 | 107.00 | 408,740.00 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A | 7,585 | 25.40 | 192,659.00 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C | 20,871 | 24.56 | 512,591.76 |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C | 7,470 | 42.08 | 314,337.60 |
| LIBERTY SIRIUS GROUP-C | 8,020 | 41.84 | 335,556.80 |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A | 3,315 | 41.34 | 137,042.10 |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN | 5,660 | 68.20 | 386,012.00 |
| NETFLIX INC | 16,950 | 265.92 | 4,507,344.00 |
| NEWS CORP - CLASS A | 18,680 | 14.01 | 261,706.80 |
| OMNICOM GROUP | 7,977 | 77.73 | 620,052.21 |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 67,730 | 6.29 | 426,021.70 |
| SNAP INC - A | 27,720 | 17.12 | 474,566.40 |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 4,200 | 125.73 | 528,066.00 |
| THE WALT DISNEY CO. | 69,862 | 132.46 | 9,253,920.52 |
| TRIPADVISOR INC | 3,330 | 38.15 | 127,056.15 |
| TWITTER INC | 27,220 | 43.38 | 1,180,803.60 |
| VIACOM INC-CLASS B | 11,888 | 25.00 | 297,200.00 |

| | | | |
|-------------------------|--------|----------|---------------|
| ZILLOW GROUP INC - C | 4,010 | 30.19 | 121,061.90 |
| ADVANCE AUTO PARTS INC | 2,638 | 161.22 | 425,298.36 |
| AMAZON.COM INC | 16,225 | 1,785.30 | 28,966,492.50 |
| AUTOZONE INC | 967 | 1,147.26 | 1,109,400.42 |
| BEST BUY CO INC | 8,924 | 67.41 | 601,566.84 |
| BOOKING HOLDINGS INC | 1,683 | 2,009.41 | 3,381,837.03 |
| BURLINGTON STORES INC | 2,590 | 198.46 | 514,011.40 |
| CARMAX INC | 5,879 | 86.90 | 510,885.10 |
| DOLLAR GENERAL CORP/OLD | 10,110 | 158.71 | 1,604,558.10 |
| DOLLAR TREE INC | 9,576 | 113.42 | 1,086,109.92 |
| EBAY INC | 31,377 | 40.24 | 1,262,610.48 |
| EXPEDIA INC | 5,432 | 132.37 | 719,033.84 |
| GAP INC/THE | 8,676 | 17.44 | 151,309.44 |
| GENUINE PARTS CO | 5,811 | 97.77 | 568,141.47 |
| GRUBHUB INC | 3,200 | 57.01 | 182,432.00 |
| HOME DEPOT INC | 42,630 | 226.25 | 9,645,037.50 |
| KOHL'S CORP | 7,462 | 49.03 | 365,861.86 |
| L BRANDS INC | 8,828 | 18.52 | 163,494.56 |
| LKQ CORP | 12,100 | 31.89 | 385,869.00 |
| LOWE'S COS INC | 30,912 | 110.44 | 3,413,921.28 |
| MACY'S INC | 13,499 | 15.54 | 209,774.46 |
| MERCADOLIBRE INC | 1,740 | 540.09 | 939,756.60 |
| NORDSTROM INC | 3,980 | 32.35 | 128,753.00 |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 2,925 | 397.88 | 1,163,799.00 |
| QURATE RETAIL INC | 16,340 | 10.67 | 174,347.80 |
| ROSS STORES INC | 14,502 | 107.03 | 1,552,149.06 |
| TARGET CORP | 20,000 | 108.78 | 2,175,600.00 |
| TIFFANY & CO | 4,790 | 91.78 | 439,626.20 |
| TJX COMPANIES INC | 47,266 | 55.19 | 2,608,610.54 |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 4,750 | 92.16 | 437,760.00 |
| ULTA BEAUTY INC | 2,180 | 237.31 | 517,335.80 |
| WAYFAIR INC- CLASS A | 2,530 | 118.29 | 299,273.70 |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 17,059 | 287.57 | 4,905,656.63 |
| KROGER CO | 33,060 | 25.72 | 850,303.20 |
| SYSCO CORP | 19,146 | 78.70 | 1,506,790.20 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 28,982 | 54.32 | 1,574,302.24 |
| WALMART INC | 55,562 | 117.62 | 6,535,202.44 |
| ALTRIA GROUP INC | 72,648 | 40.88 | 2,969,850.24 |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 21,873 | 40.40 | 883,669.20 |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B | 12,390 | 63.04 | 781,065.60 |
| BUNGE LTD | 6,327 | 55.97 | 354,122.19 |
| CAMPBELL SOUP CO | 6,865 | 46.66 | 320,320.90 |
| COCA-COLA CO/THE | 156,832 | 54.14 | 8,490,884.48 |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS | 9,300 | 55.93 | 520,149.00 |
| CONAGRA BRANDS INC | 18,480 | 28.90 | 534,072.00 |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 6,250 | 205.77 | 1,286,062.50 |
| GENERAL MILLS INC | 22,909 | 53.90 | 1,234,795.10 |
| HERSHEY CO/THE | 5,835 | 153.31 | 894,563.85 |
| HORMEL FOODS CORP | 11,960 | 42.60 | 509,496.00 |
| INGREDION INC | 3,120 | 80.47 | 251,066.40 |
| JM SMUCKER CO/THE | 4,630 | 107.03 | 495,548.90 |
| KELLOGG CO | 9,828 | 63.28 | 621,915.84 |
| KRAFT HEINZ CO/THE | 25,461 | 28.20 | 718,000.20 |
| LAMB WESTON HOLDING INC | 6,370 | 74.14 | 472,271.80 |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | 5,135 | 159.81 | 820,624.35 |
| MOLSON COORS BREWING CO -B | 6,180 | 56.21 | 347,377.80 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC | 56,095 | 54.61 | 3,063,347.95 |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 15,360 | 59.12 | 908,083.20 |
| PEPSICO INC | 54,231 | 135.44 | 7,345,046.64 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 60,208 | 72.00 | 4,334,976.00 |
| TYSON FOODS INC-CL A | 11,446 | 85.79 | 981,952.34 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 9,130 | 73.35 | 669,685.50 |
| CLOROX COMPANY | 4,546 | 150.23 | 682,945.58 |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 31,810 | 71.50 | 2,274,415.00 |
| COTY INC-CL A | 10,350 | 10.35 | 107,122.50 |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 8,650 | 193.00 | 1,669,450.00 |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 13,133 | 136.83 | 1,796,988.39 |
| PROCTER & GAMBLE CO | 97,289 | 123.22 | 11,987,950.58 |
| ABBOTT LABORATORIES | 68,486 | 83.16 | 5,695,295.76 |
| ABIOMED INC | 1,570 | 186.01 | 292,035.70 |

| | | | |
|------------------------------|--------|--------|--------------|
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 3,080 | 183.89 | 566,381.20 |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 6,044 | 83.85 | 506,789.40 |
| ANTHEM INC | 10,016 | 251.40 | 2,518,022.40 |
| BAXTER INTERNATIONAL INC | 19,299 | 86.84 | 1,675,925.16 |
| BECTON DICKINSON AND CO | 10,517 | 253.43 | 2,665,323.31 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 54,248 | 43.15 | 2,340,801.20 |
| CARDINAL HEALTH INC | 10,985 | 47.17 | 518,162.45 |
| CENTENE CORP | 16,040 | 46.39 | 744,095.60 |
| CERNER CORP | 11,550 | 68.58 | 792,099.00 |
| CIGNA CORP | 14,800 | 160.15 | 2,370,220.00 |
| COOPER COS INC/THE | 1,720 | 302.19 | 519,766.80 |
| CVS HEALTH CORP | 50,528 | 63.35 | 3,200,948.80 |
| DANAHER CORP | 25,079 | 144.60 | 3,626,423.40 |
| DAVITA INC | 5,038 | 59.35 | 299,005.30 |
| DENTSPLY SIRONA INC | 9,022 | 52.28 | 471,670.16 |
| DEXCOM INC | 3,600 | 155.33 | 559,188.00 |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 8,230 | 219.70 | 1,808,131.00 |
| HCA HEALTHCARE INC | 10,485 | 123.44 | 1,294,268.40 |
| HENRY SCHEIN INC | 6,170 | 62.33 | 384,576.10 |
| HOLOGIC INC | 10,138 | 50.00 | 506,900.00 |
| HUMANA INC | 5,265 | 277.30 | 1,459,984.50 |
| IDEXX LABORATORIES INC | 3,290 | 275.79 | 907,349.10 |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 4,505 | 527.96 | 2,378,459.80 |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 3,865 | 172.08 | 665,089.20 |
| MCKESSON CORP | 7,234 | 142.93 | 1,033,955.62 |
| MEDTRONIC PLC | 52,098 | 110.84 | 5,774,542.32 |
| QUEST DIAGNOSTICS | 4,946 | 106.82 | 528,331.72 |
| RESMED INC | 5,140 | 135.51 | 696,521.40 |
| STERIS PLC | 3,420 | 146.37 | 500,585.40 |
| STRYKER CORP | 13,103 | 220.19 | 2,885,149.57 |
| TELEFLEX INC | 1,780 | 347.76 | 619,012.80 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 36,780 | 228.77 | 8,414,160.60 |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 3,380 | 149.97 | 506,898.60 |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC | 3,454 | 117.97 | 407,468.38 |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A | 5,230 | 152.69 | 798,568.70 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| WELLCARE HEALTH PLANS INC | 1,820 | 269.66 | 490,781.20 |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 7,902 | 141.65 | 1,119,318.30 |
| ABBVIE INC | 57,516 | 72.93 | 4,194,641.88 |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 12,510 | 78.06 | 976,530.60 |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 8,530 | 104.62 | 892,408.60 |
| ALKERMES PLC | 5,060 | 21.27 | 107,626.20 |
| ALLERGAN PLC | 12,655 | 166.86 | 2,111,613.30 |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 4,260 | 84.74 | 360,992.40 |
| AMGEN INC | 23,711 | 197.76 | 4,689,087.36 |
| BEIGENE LTD-ADR | 1,160 | 135.07 | 156,681.20 |
| BIOGEN INC | 7,703 | 239.96 | 1,848,411.88 |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 6,520 | 73.54 | 479,480.80 |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 63,701 | 50.52 | 3,218,174.52 |
| CELGENE CORP | 27,484 | 99.42 | 2,732,459.28 |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC | 14,986 | 28.07 | 420,657.02 |
| ELI LILLY & CO | 33,884 | 114.18 | 3,868,875.12 |
| EXACT SCIENCES CORP | 4,640 | 103.77 | 481,492.80 |
| GILEAD SCIENCES INC | 49,524 | 65.73 | 3,255,212.52 |
| ILLUMINA INC | 5,720 | 305.83 | 1,749,347.60 |
| INCYTE CORP | 6,870 | 77.64 | 533,386.80 |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC | 4,780 | 61.00 | 291,580.00 |
| IQVIA HOLDINGS INC | 6,153 | 157.34 | 968,113.02 |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 2,330 | 129.23 | 301,105.90 |
| JOHNSON & JOHNSON | 102,981 | 131.74 | 13,566,716.94 |
| MERCK & CO. INC. | 99,743 | 84.36 | 8,414,319.48 |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 895 | 706.21 | 632,057.95 |
| MYLAN NV | 18,705 | 20.86 | 390,186.30 |
| NEKTAR THERAPEUTICS | 5,400 | 19.92 | 107,595.00 |
| PERKINELMER INC | 4,880 | 85.20 | 415,776.00 |
| PERRIGO CO PLC | 5,039 | 54.68 | 275,532.52 |
| PFIZER INC | 215,310 | 36.24 | 7,802,834.40 |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 2,900 | 294.70 | 854,630.00 |
| SAREPTA THERAPEUTICS INC | 2,700 | 80.38 | 217,026.00 |
| SEATTLE GENETICS INC | 4,870 | 74.71 | 363,837.70 |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR | 44,220 | 7.19 | 317,941.80 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 15,554 | 290.45 | 4,517,659.30 |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 10,340 | 175.88 | 1,818,599.20 |
| WATERS CORP | 2,826 | 227.79 | 643,734.54 |
| ZOETIS INC | 18,670 | 125.08 | 2,335,243.60 |
| BANK OF AMERICA CORP | 350,649 | 29.52 | 10,351,158.48 |
| BB&T CORP | 30,728 | 52.57 | 1,615,370.96 |
| CIT GROUP INC | 4,145 | 45.75 | 189,633.75 |
| CITIGROUP INC | 89,857 | 69.55 | 6,249,554.35 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 15,590 | 35.87 | 559,213.30 |
| COMERICA INC | 5,590 | 65.81 | 367,877.90 |
| EAST WEST BANCORP INC | 4,480 | 45.22 | 202,585.60 |
| FIFTH THIRD BANCORP | 28,379 | 27.72 | 786,665.88 |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA | 5,970 | 94.95 | 566,851.50 |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 41,490 | 14.45 | 599,530.50 |
| JPMORGAN CHASE & CO | 125,870 | 118.88 | 14,963,425.60 |
| KEYCORP | 39,118 | 17.79 | 695,909.22 |
| M & T BANK CORP | 4,623 | 156.15 | 721,881.45 |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL | 16,360 | 15.93 | 260,614.80 |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 17,610 | 141.20 | 2,486,532.00 |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 41,254 | 16.05 | 662,126.70 |
| SIGNATURE BANK | 2,310 | 121.78 | 281,311.80 |
| SUNTRUST BANKS INC | 16,597 | 67.86 | 1,126,272.42 |
| SVB FINANCIAL GROUP | 2,030 | 215.57 | 437,607.10 |
| US BANCORP | 58,911 | 55.68 | 3,280,164.48 |
| WELLS FARGO & CO | 165,810 | 48.96 | 8,118,057.60 |
| ZIONS BANCORP NA | 5,800 | 44.30 | 256,940.00 |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP | 2,200 | 85.32 | 187,704.00 |
| ALLY FINANCIAL INC | 15,270 | 33.77 | 515,667.90 |
| AMERICAN EXPRESS CO | 27,634 | 118.24 | 3,267,444.16 |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 4,800 | 147.29 | 706,992.00 |
| AXA EQUITABLE HOLDINGS INC | 11,900 | 22.34 | 265,846.00 |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 34,062 | 46.77 | 1,593,079.74 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 50,450 | 207.96 | 10,491,582.00 |
| BLACKROCK INC | 4,665 | 446.20 | 2,081,523.00 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 18,725 | 92.85 | 1,738,616.25 |

| | | | |
|-------------------------------|--------|--------|--------------|
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 4,400 | 115.92 | 510,048.00 |
| CME GROUP INC | 13,940 | 212.28 | 2,959,183.20 |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 12,320 | 83.31 | 1,026,379.20 |
| E*TRADE FINANCIAL CORP | 10,630 | 44.85 | 476,755.50 |
| EATON VANCE CORP | 5,440 | 44.97 | 244,636.80 |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 1,750 | 273.44 | 478,520.00 |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 11,655 | 29.08 | 338,927.40 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 12,838 | 213.46 | 2,740,399.48 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 21,770 | 92.50 | 2,013,725.00 |
| INVESCO LTD | 15,877 | 17.00 | 269,909.00 |
| JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN | 11,015 | 19.89 | 219,088.35 |
| KKR & CO INC -A | 17,080 | 29.44 | 502,835.20 |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC | 1,470 | 335.55 | 493,258.50 |
| MOODY'S CORP | 6,397 | 215.38 | 1,377,785.86 |
| MORGAN STANLEY | 48,405 | 43.56 | 2,108,521.80 |
| MSCI INC | 3,100 | 225.96 | 700,476.00 |
| NASDAQ INC | 4,125 | 100.25 | 413,531.25 |
| NORTHERN TRUST CORP | 7,970 | 94.62 | 754,121.40 |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 4,130 | 84.29 | 348,117.70 |
| S&P GLOBAL INC | 9,622 | 252.46 | 2,429,170.12 |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 45,464 | 42.58 | 1,935,857.12 |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 5,385 | 59.57 | 320,784.45 |
| STATE STREET CORP | 13,877 | 60.19 | 835,256.63 |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 24,140 | 34.12 | 823,656.80 |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 9,485 | 114.84 | 1,089,257.40 |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP | 10,670 | 49.06 | 523,470.20 |
| VOYA FINANCIAL INC | 6,040 | 55.16 | 333,166.40 |
| AFLAC INC | 29,864 | 52.35 | 1,563,380.40 |
| ALLEGHANY CORP | 630 | 778.30 | 490,329.00 |
| ALLSTATE CORP | 12,323 | 108.41 | 1,335,936.43 |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 3,240 | 107.10 | 347,004.00 |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 34,775 | 57.30 | 1,992,607.50 |
| AON PLC | 9,172 | 192.76 | 1,767,994.72 |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 17,425 | 41.10 | 716,254.62 |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 6,560 | 88.39 | 579,838.40 |

| | | | |
|------------------------------|--------|----------|--------------|
| ASSURANT INC | 2,080 | 125.84 | 261,747.20 |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A | 6,320 | 42.76 | 270,243.20 |
| BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC | 4,804 | 40.62 | 195,138.48 |
| CHUBB LTD | 17,835 | 157.71 | 2,812,757.85 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 5,920 | 114.28 | 676,537.60 |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A | 1,190 | 190.12 | 226,242.80 |
| EVEREST RE GROUP LTD | 1,694 | 265.00 | 448,910.00 |
| FNF GROUP | 9,791 | 43.65 | 427,377.15 |
| GLOBE LIFE INC | 3,666 | 95.35 | 349,553.10 |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP | 12,962 | 60.19 | 780,182.78 |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 7,573 | 60.90 | 461,195.70 |
| LOEWS CORP | 10,195 | 51.58 | 525,858.10 |
| MARKEL CORP | 520 | 1,187.87 | 617,692.40 |
| MARSH & MCLENNAN COS | 20,543 | 101.12 | 2,077,308.16 |
| METLIFE INC | 29,925 | 47.73 | 1,428,320.25 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 10,910 | 57.12 | 623,179.20 |
| PROGRESSIVE CORP | 22,160 | 76.38 | 1,692,580.80 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 16,382 | 89.66 | 1,468,810.12 |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA | 2,440 | 159.42 | 388,984.80 |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD | 1,887 | 192.11 | 362,511.57 |
| TRAVELERS COS INC/THE | 9,704 | 146.54 | 1,422,024.16 |
| UNUM GROUP | 8,138 | 29.62 | 241,047.56 |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 4,658 | 197.40 | 919,489.20 |
| WR BERKLEY CORP | 5,004 | 72.30 | 361,789.20 |
| CBRE GROUP INC - A | 11,880 | 52.78 | 627,026.40 |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 56,500 | 5.78 | 326,570.00 |
| JONES LANG LASALLE INC | 2,120 | 137.36 | 291,203.20 |
| ACCENTURE PLC-CL A | 24,798 | 192.84 | 4,782,046.32 |
| ADOBE INC | 18,929 | 277.44 | 5,251,661.76 |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC | 6,540 | 89.61 | 586,049.40 |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP | 2,040 | 129.30 | 263,772.00 |
| ANSYS INC | 3,060 | 216.73 | 663,193.80 |
| AUTODESK INC | 8,410 | 152.37 | 1,281,431.70 |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING | 16,956 | 159.70 | 2,707,873.20 |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO | 4,770 | 125.43 | 598,301.10 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| CADENCE DESIGN SYS INC | 10,090 | 65.97 | 665,637.30 |
| CDK GLOBAL INC | 5,890 | 48.48 | 285,547.20 |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH | 4,740 | 108.44 | 514,005.60 |
| CITRIX SYSTEMS INC | 5,338 | 96.25 | 513,782.50 |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A | 21,908 | 60.82 | 1,332,554.10 |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 1,230 | 105.45 | 129,703.50 |
| DOCUSIGN INC | 3,320 | 64.52 | 214,206.40 |
| DROPBOX INC-CLASS A | 6,480 | 20.27 | 131,382.00 |
| DXC TECHNOLOGY CO | 9,803 | 32.04 | 314,088.12 |
| EPAM SYSTEMS INC | 2,340 | 184.76 | 432,338.40 |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV | 23,898 | 131.52 | 3,143,064.96 |
| FISERV INC | 22,424 | 105.04 | 2,355,416.96 |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 3,530 | 287.72 | 1,015,651.60 |
| FORTINET INC | 5,730 | 79.26 | 454,159.80 |
| GARTNER INC | 3,900 | 142.64 | 556,296.00 |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 11,679 | 159.66 | 1,864,669.14 |
| GODADDY INC-CLASS A | 6,500 | 66.53 | 432,445.00 |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 34,472 | 142.07 | 4,897,437.04 |
| INTUIT INC | 10,096 | 269.00 | 2,715,824.00 |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 2,840 | 145.36 | 412,822.40 |
| LEIDOS HOLDINGS INC | 5,260 | 85.69 | 450,729.40 |
| MASTERCARD INC | 35,270 | 273.15 | 9,634,000.50 |
| MICROSOFT CORP | 282,274 | 139.14 | 39,275,604.36 |
| MONGODB INC | 1,660 | 131.35 | 218,041.00 |
| OKTA INC | 4,070 | 105.12 | 427,838.40 |
| ORACLE CORP | 92,993 | 54.02 | 5,023,481.86 |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 3,730 | 209.71 | 782,218.30 |
| PAYCHEX INC | 12,132 | 82.20 | 997,250.40 |
| PAYCOM SOFTWARE INC | 2,200 | 217.44 | 478,368.00 |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 43,347 | 105.11 | 4,556,203.17 |
| PTC INC | 3,690 | 67.51 | 249,111.90 |
| SABRE CORP | 10,440 | 22.96 | 239,702.40 |
| SALESFORCE.COM INC | 32,275 | 154.65 | 4,991,328.75 |
| SERVICENOW INC | 7,310 | 267.00 | 1,951,770.00 |
| SPLUNK INC | 5,540 | 122.74 | 679,979.60 |

| | | | |
|----------------------------|---------|--------|---------------|
| SQUARE INC - A | 13,530 | 56.76 | 767,962.80 |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS | 8,540 | 49.88 | 425,975.20 |
| SYMANTEC CORP | 22,205 | 23.76 | 527,590.80 |
| SYNOPSYS INC | 5,327 | 137.11 | 730,384.97 |
| TWILIO INC - A | 4,390 | 112.93 | 495,762.70 |
| VERISIGN INC | 4,000 | 189.82 | 759,280.00 |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 67,482 | 174.91 | 11,803,276.62 |
| VMWARE INC | 3,235 | 152.05 | 491,881.75 |
| WESTERN UNION CO | 19,111 | 22.40 | 428,086.40 |
| WIX.COM LTD | 1,980 | 120.97 | 239,520.60 |
| WORKDAY INC-CLASS A | 5,940 | 174.45 | 1,036,233.00 |
| AMPHENOL CORP-CL A | 11,180 | 93.64 | 1,046,895.20 |
| APPLE INC | 178,412 | 218.72 | 39,022,272.64 |
| ARISTA NETWORKS INC | 2,050 | 240.75 | 493,537.50 |
| ARROW ELECTRONICS INC | 3,320 | 74.62 | 247,738.40 |
| CDW CORP/DE | 5,760 | 119.34 | 687,398.40 |
| CISCO SYSTEMS INC | 166,230 | 49.42 | 8,215,086.60 |
| COGNEX CORP | 8,270 | 48.09 | 397,704.30 |
| CORNING INC | 30,908 | 27.67 | 855,224.36 |
| DELL TECHNOLOGIES -C | 5,742 | 52.94 | 303,981.48 |
| F5 NETWORKS INC | 2,825 | 139.06 | 392,844.50 |
| FLEX LTD | 18,516 | 10.52 | 194,788.32 |
| FLIR SYSTEMS INC | 5,685 | 53.46 | 303,920.10 |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRIS | 49,555 | 14.40 | 713,592.00 |
| HP INC | 57,005 | 18.52 | 1,055,732.60 |
| IPG PHOTONICS CORP | 1,160 | 133.83 | 155,242.80 |
| JUNIPER NETWORKS INC | 11,503 | 24.32 | 279,752.96 |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN | 6,890 | 99.87 | 688,104.30 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 5,985 | 168.47 | 1,008,292.95 |
| NETAPP INC | 8,396 | 54.53 | 457,833.88 |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 8,964 | 52.75 | 472,851.00 |
| TE CONNECTIVITY LTD | 13,635 | 91.57 | 1,248,556.95 |
| TRIMBLE INC | 8,980 | 38.16 | 342,676.80 |
| WESTERN DIGITAL CORP | 11,378 | 60.99 | 693,944.22 |
| XEROX HOLDINGS CORP | 8,148 | 29.83 | 243,054.84 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 2,190 | 205.40 | 449,826.00 |
| AT&T INC | 283,077 | 37.60 | 10,643,695.20 |
| CENTURYLINK INC | 39,676 | 12.92 | 512,613.92 |
| SPRINT CORP | 33,770 | 6.59 | 222,544.30 |
| T-MOBILE US INC | 13,432 | 79.96 | 1,074,022.72 |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC | 160,237 | 60.21 | 9,647,869.77 |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC | 10,290 | 34.01 | 349,962.90 |
| AES CORP | 25,998 | 16.25 | 422,467.50 |
| ALLIANT ENERGY CORP | 9,050 | 53.27 | 482,093.50 |
| AMEREN CORPORATION | 8,722 | 78.97 | 688,776.34 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 19,418 | 93.40 | 1,813,641.20 |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 7,165 | 122.58 | 878,285.70 |
| ATMOS ENERGY CORP | 4,120 | 112.59 | 463,870.80 |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 19,962 | 30.40 | 606,844.80 |
| CMS ENERGY CORP | 10,090 | 63.19 | 637,587.10 |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 13,006 | 92.75 | 1,206,306.50 |
| DOMINION ENERGY INC | 31,291 | 80.85 | 2,529,877.35 |
| DTE ENERGY COMPANY | 6,598 | 131.49 | 867,571.02 |
| DUKE ENERGY CORP | 28,376 | 95.40 | 2,707,070.40 |
| EDISON INTERNATIONAL | 14,219 | 74.16 | 1,054,481.04 |
| ENTERGY CORP | 7,127 | 115.63 | 824,095.01 |
| EVERGY INC | 10,050 | 66.20 | 665,310.00 |
| EVERSOURCE ENERGY | 12,720 | 83.49 | 1,061,992.80 |
| EXELON CORP | 36,946 | 48.31 | 1,784,861.26 |
| FIRSTENERGY CORP | 22,145 | 47.76 | 1,057,645.20 |
| NEXTERA ENERGY INC | 18,455 | 225.28 | 4,157,542.40 |
| NISOURCE INC | 12,390 | 29.62 | 366,991.80 |
| NRG ENERGY INC | 11,980 | 39.28 | 470,574.40 |
| OGE ENERGY CORP | 7,900 | 44.91 | 354,789.00 |
| PINNACLE WEST CAPITAL | 4,109 | 97.39 | 400,175.51 |
| PPL CORP | 26,288 | 31.59 | 830,437.92 |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 19,788 | 61.92 | 1,225,272.96 |
| SEMPRA ENERGY | 10,257 | 141.87 | 1,455,160.59 |
| SOUTHERN CO | 40,565 | 61.32 | 2,487,445.80 |
| UGI CORP | 9,220 | 50.27 | 463,489.40 |

| | | | | | |
|-------|------------------------------|------------|--------|----------------|-------------------|
| | VISTRA ENERGY CORP | 14,940 | 26.96 | 402,782.40 | |
| | WEC ENERGY GROUP INC | 12,780 | 93.96 | 1,200,808.80 | |
| | XCEL ENERGY INC | 19,414 | 64.60 | 1,254,144.40 | |
| | ADVANCED MICRO DEVICES | 38,700 | 30.64 | 1,185,768.00 | |
| | ANALOG DEVICES INC | 14,760 | 114.29 | 1,686,920.40 | |
| | APPLIED MATERIALS INC | 36,583 | 51.76 | 1,893,536.08 | |
| | BROADCOM INC | 15,370 | 285.46 | 4,387,520.20 | |
| | INTEL CORP | 173,702 | 50.90 | 8,841,431.80 | |
| | KLA CORP | 6,229 | 157.58 | 981,565.82 | |
| | LAM RESEARCH CORP | 5,677 | 238.24 | 1,352,488.48 | |
| | MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 22,674 | 25.03 | 567,643.59 | |
| | MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 11,030 | 57.94 | 639,078.20 | |
| | MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 9,394 | 91.92 | 863,496.48 | |
| | MICRON TECHNOLOGY INC | 42,947 | 49.60 | 2,130,171.20 | |
| | NVIDIA CORP | 22,485 | 174.84 | 3,931,277.40 | |
| | NXP SEMICONDUCTORS NV | 11,397 | 106.05 | 1,208,651.85 | |
| | ON SEMICONDUCTOR CORP | 17,620 | 19.38 | 341,475.60 | |
| | QORVO INC | 4,760 | 77.36 | 368,233.60 | |
| | QUALCOMM INC | 47,222 | 77.24 | 3,647,427.28 | |
| | SKYWORKS SOLUTIONS INC | 6,890 | 79.84 | 550,097.60 | |
| | TEXAS INSTRUMENTS INC | 36,482 | 127.77 | 4,661,305.14 | |
| | XILINX INC | 9,455 | 98.05 | 927,062.75 | |
| 米ドル小計 | | 11,694,157 | | 984,599,318.24 | (106,031,500,581) |
| 加ドル | CAMECO CORP | 11,792 | 12.63 | 148,932.96 | |
| | CANADIAN NATURAL RESOURCES | 45,094 | 36.63 | 1,651,793.22 | |
| | CENOVUS ENERGY INC | 38,273 | 13.09 | 500,993.57 | |
| | ENBRIDGE INC | 78,877 | 46.61 | 3,676,456.97 | |
| | ENCANA CORP | 48,808 | 6.68 | 326,037.44 | |
| | HUSKY ENERGY INC | 10,473 | 9.67 | 101,273.91 | |
| | IMPERIAL OIL LTD | 12,902 | 36.19 | 466,923.38 | |
| | INTER PIPELINE LTD | 16,700 | 24.00 | 400,800.00 | |
| | KEYERA CORP | 7,360 | 33.15 | 243,984.00 | |
| | PEMBINA PIPELINE CORP | 21,402 | 49.88 | 1,067,531.76 | |
| | PRAIRIESKY ROYALTY LTD | 6,890 | 18.83 | 129,738.70 | |

| | | | |
|-------------------------------------|--------|--------|--------------|
| SUNCOR ENERGY INC | 61,329 | 42.09 | 2,581,337.61 |
| TC ENERGY CORP | 36,063 | 68.89 | 2,484,380.07 |
| TOURMALINE OIL CORP | 11,075 | 14.02 | 155,271.50 |
| VERMILION ENERGY INC | 6,550 | 23.13 | 151,501.50 |
| AGNICO EAGLE MINES LTD | 9,115 | 78.92 | 719,355.80 |
| BARRICK GOLD CORP | 65,464 | 24.68 | 1,615,651.52 |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B | 4,870 | 54.85 | 267,119.50 |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 33,400 | 11.03 | 368,402.00 |
| FRANCO-NEVADA CORP | 7,595 | 126.64 | 961,830.80 |
| KINROSS GOLD CORP | 38,165 | 7.10 | 270,971.50 |
| KIRKLAND LAKE GOLD LTD | 8,760 | 65.74 | 575,882.40 |
| LUNDIN MINING CORP | 21,110 | 6.58 | 138,903.80 |
| METHANEX CORP | 2,760 | 49.62 | 136,951.20 |
| NUTRIEN LTD | 22,508 | 66.90 | 1,505,785.20 |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B | 16,595 | 22.61 | 375,212.95 |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD | 2,460 | 55.25 | 135,915.00 |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 18,095 | 37.25 | 674,038.75 |
| BOMBARDIER INC 'B' | 91,096 | 1.91 | 173,993.36 |
| CAE INC | 8,775 | 33.60 | 294,840.00 |
| SNC-LAVALIN GROUP INC | 6,175 | 20.31 | 125,414.25 |
| WSP GLOBAL INC | 3,500 | 78.02 | 273,070.00 |
| THOMSON REUTERS CORP | 7,436 | 88.84 | 660,614.24 |
| AIR CANADA | 4,800 | 43.04 | 206,592.00 |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 28,118 | 118.40 | 3,329,171.20 |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 5,575 | 299.73 | 1,670,994.75 |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 10,818 | 70.31 | 760,613.58 |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 9,950 | 46.69 | 464,565.50 |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 8,618 | 96.20 | 829,051.60 |
| STARS GROUP INC/THE | 7,400 | 20.60 | 152,440.00 |
| QUEBECOR INC -CL B | 6,060 | 30.75 | 186,345.00 |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B | 21,045 | 26.50 | 557,692.50 |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A | 2,560 | 147.88 | 378,572.80 |
| DOLLARAMA INC | 10,260 | 47.73 | 489,709.80 |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD-B | 17,250 | 82.62 | 1,425,195.00 |
| EMPIRE CO LTD 'A' | 8,290 | 35.99 | 298,357.10 |

| | | | |
|------------------------------|--------|----------|--------------|
| LOBLAW COMPANIES LTD | 6,039 | 75.05 | 453,226.95 |
| METRO INC | 9,270 | 57.55 | 533,488.50 |
| WESTON (GEORGE) LTD | 2,998 | 112.07 | 335,985.86 |
| SAPUTO INC | 10,250 | 40.73 | 417,482.50 |
| AURORA CANNABIS INC | 22,780 | 6.72 | 153,081.60 |
| BAUSCH HEALTH COS INC | 13,194 | 29.91 | 394,632.54 |
| CANOPY GROWTH CORP | 8,750 | 33.93 | 296,887.50 |
| CRONOS GROUP INC | 7,240 | 13.55 | 98,102.00 |
| BANK OF MONTREAL | 25,091 | 96.92 | 2,431,819.72 |
| BANK OF NOVA SCOTIA | 47,639 | 74.85 | 3,565,779.15 |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 16,445 | 110.64 | 1,819,474.80 |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 12,860 | 65.53 | 842,715.80 |
| ROYAL BANK OF CANADA | 55,609 | 107.36 | 5,970,182.24 |
| TORONTO-DOMINION BANK | 70,750 | 76.48 | 5,410,960.00 |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 32,943 | 70.48 | 2,321,822.64 |
| CI FINANCIAL CORP | 9,570 | 19.38 | 185,466.60 |
| IGM FINANCIAL INC | 3,295 | 38.01 | 125,242.95 |
| ONEX CORPORATION | 3,805 | 82.83 | 315,168.15 |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 1,160 | 585.00 | 678,600.00 |
| GREAT-WEST LIFE CO INC | 9,944 | 31.33 | 311,545.52 |
| IA FINANCIAL CORP INC | 3,855 | 59.96 | 231,145.80 |
| INTACT FINANCIAL CORP | 4,855 | 131.50 | 638,432.50 |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 79,401 | 24.42 | 1,938,972.42 |
| POWER CORP OF CANADA | 12,630 | 30.34 | 383,194.20 |
| POWER FINANCIAL CORP | 9,665 | 30.94 | 299,035.10 |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 22,104 | 59.14 | 1,307,230.56 |
| FIRST CAPITAL REALTY INC | 5,720 | 22.12 | 126,526.40 |
| BLACKBERRY LTD | 16,618 | 9.93 | 165,016.74 |
| CGI INC | 9,060 | 102.79 | 931,277.40 |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC | 835 | 1,299.37 | 1,084,973.95 |
| OPEN TEXT CORP | 9,830 | 54.48 | 535,538.40 |
| SHOPIFY INC - CLASS-A | 3,830 | 415.50 | 1,591,365.00 |
| BCE INC | 6,980 | 64.06 | 447,138.80 |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B | 13,145 | 66.00 | 867,570.00 |
| TELUS CORP | 7,466 | 48.45 | 361,727.70 |

| | | | | |
|-------|-----------------------------|-----------|--------|----------------------------------|
| | ALTAGAS LTD | 11,800 | 19.74 | 232,932.00 |
| | ATCO LTD -CLASS I | 3,260 | 47.90 | 156,154.00 |
| | CANADIAN UTILITIES LTD-A | 4,330 | 38.79 | 167,960.70 |
| | EMERA INC | 8,730 | 57.71 | 503,808.30 |
| | FORTIS INC | 16,095 | 55.92 | 900,032.40 |
| | HYDRO ONE LTD | 13,000 | 24.49 | 318,370.00 |
| 加ドル小計 | | 1,555,052 | | 73,960,277.08 (6,006,314,101) |
| ユーロ | ENI SPA | 97,536 | 14.14 | 1,379,159.04 |
| | GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS | 23,185 | 13.75 | 318,793.75 |
| | NESTE OYJ | 15,690 | 29.95 | 469,915.50 |
| | OMV AG | 6,310 | 49.30 | 311,083.00 |
| | REPSOL SA | 58,939 | 14.30 | 843,122.39 |
| | TENARIS SA | 19,815 | 9.74 | 193,116.99 |
| | TOTAL SA | 92,387 | 48.66 | 4,496,013.35 |
| | VOPAK | 2,090 | 45.75 | 95,617.50 |
| | AIR LIQUIDE SA | 16,759 | 130.10 | 2,180,345.90 |
| | AKZO NOBEL | 8,177 | 80.19 | 655,713.63 |
| | ARCELORMITTAL | 26,232 | 13.01 | 341,330.78 |
| | ARKEMA | 3,145 | 83.26 | 261,852.70 |
| | BASF SE | 35,845 | 63.42 | 2,273,289.90 |
| | COVESTRO AG | 6,340 | 44.34 | 281,115.60 |
| | CRH PLC | 30,540 | 30.61 | 934,829.40 |
| | EVONIK INDUSTRIES AG | 6,800 | 22.35 | 151,980.00 |
| | FUCHS PETROLUB SE-PRF | 2,920 | 33.64 | 98,228.80 |
| | HEIDELBERGCEMENT AG | 5,395 | 65.90 | 355,530.50 |
| | IMERYS SA | 830 | 37.34 | 30,992.20 |
| | KONINKLIJKE DSM NV | 6,482 | 106.70 | 691,629.40 |
| | LANXESS AG | 3,295 | 54.00 | 177,930.00 |
| | SMURFIT KAPPA GROUP PLC | 9,140 | 27.10 | 247,694.00 |
| | SOLVAY SA | 2,241 | 94.78 | 212,401.98 |
| | STORA ENSO OYJ-R SHS | 27,755 | 10.80 | 299,892.77 |
| | SYMRISE AG | 4,770 | 87.78 | 418,710.60 |
| | THYSSENKRUPP AG | 19,305 | 12.44 | 240,154.20 |
| | UMICORE | 8,650 | 33.08 | 286,142.00 |

| | | | |
|------------------------------|--------|----------|--------------|
| UPM-KYMMENE OYJ | 19,978 | 25.78 | 515,032.84 |
| VOESTALPINE AG | 4,239 | 22.02 | 93,342.78 |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 8,926 | 35.33 | 315,355.58 |
| AIRBUS GROUP SE | 22,638 | 119.80 | 2,712,032.40 |
| ALSTOM | 5,240 | 38.09 | 199,591.60 |
| ANDRITZ AG | 2,250 | 36.42 | 81,945.00 |
| BOUYGUES SA | 8,880 | 35.17 | 312,309.60 |
| BRENTAG AG | 6,625 | 45.11 | 298,853.75 |
| CNH INDUSTRIAL NV | 34,270 | 9.65 | 330,911.12 |
| COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN | 17,476 | 34.66 | 605,805.54 |
| DASSAULT AVIATION SA | 80 | 1,296.00 | 103,680.00 |
| EIFFAGE | 3,680 | 93.50 | 344,080.00 |
| FERROVIAL SA | 18,505 | 26.30 | 486,681.50 |
| GEA GROUP AG | 6,580 | 26.32 | 173,185.60 |
| HOCHTIEF AG | 870 | 103.60 | 90,132.00 |
| KINGSPAN GROUP PLC | 5,770 | 43.12 | 248,802.40 |
| KION GROUP AG | 2,380 | 46.62 | 110,955.60 |
| KNORR-BREMSE AG | 1,770 | 88.44 | 156,538.80 |
| KONE OYJ-B | 13,804 | 51.34 | 708,697.36 |
| LEGRAND SA | 10,308 | 65.10 | 671,050.80 |
| LEONARDO-FINMECCANICA SPA | 13,210 | 10.88 | 143,790.85 |
| METSO OYJ | 4,110 | 34.44 | 141,548.40 |
| MTU AERO ENGINES AG | 1,940 | 237.10 | 459,974.00 |
| PRYSMIAN SPA | 10,595 | 19.72 | 208,933.40 |
| SAFRAN SA | 12,720 | 141.10 | 1,794,792.00 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 20,928 | 78.82 | 1,649,544.96 |
| SIEMENS AG-REG | 29,806 | 96.63 | 2,880,153.78 |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE | 6,990 | 13.21 | 92,372.85 |
| THALES SA | 4,675 | 103.85 | 485,498.75 |
| VINCI SA | 19,910 | 97.70 | 1,945,207.00 |
| WARTSILA OYJ ABP | 21,180 | 10.10 | 213,918.00 |
| BUREAU VERITAS SA | 8,660 | 22.02 | 190,693.20 |
| EDENRED | 10,346 | 43.96 | 454,810.16 |
| RANDSTAD NV | 5,235 | 45.25 | 236,883.75 |
| SOCIETE BIC SA | 955 | 59.85 | 57,156.75 |

| | | | |
|-------------------------------------|--------|--------|--------------|
| TELEPERFORMANCE | 2,030 | 196.10 | 398,083.00 |
| WOLTERS KLUWER | 11,157 | 64.26 | 716,948.82 |
| ADP | 1,130 | 158.50 | 179,105.00 |
| AENA SA | 3,010 | 161.85 | 487,168.50 |
| ATLANTIA SPA | 19,420 | 21.66 | 420,637.20 |
| BOLLORE | 34,310 | 3.79 | 130,172.14 |
| DEUTCHE LUFTHANSA | 7,050 | 14.21 | 100,215.75 |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 38,263 | 29.83 | 1,141,576.60 |
| FRAPORT AG | 1,680 | 75.54 | 126,907.20 |
| GETLINK | 17,870 | 13.68 | 244,461.60 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 12,635 | 64.00 | 808,640.00 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD | 1,720 | 51.40 | 88,408.00 |
| CONTINENTAL AG | 3,975 | 118.00 | 469,050.00 |
| DAIMLER AG | 35,832 | 46.24 | 1,656,871.68 |
| FAURECIA | 2,770 | 43.23 | 119,747.10 |
| FERRARI NV | 4,744 | 138.45 | 656,806.80 |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 45,947 | 12.19 | 560,461.50 |
| MICHELIN (CGDE)-B | 7,199 | 101.20 | 728,538.80 |
| NOKIAN RENKAAT OYJ | 4,535 | 24.44 | 110,835.40 |
| PEUGEOT SA | 23,410 | 23.04 | 539,366.40 |
| PIRELLI & C SPA | 14,070 | 5.44 | 76,568.94 |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD | 6,110 | 60.52 | 369,777.20 |
| RENAULT SA | 8,677 | 55.35 | 480,271.95 |
| VALEO SA | 9,660 | 28.84 | 278,594.40 |
| VOLKSWAGEN AG | 1,521 | 159.20 | 242,143.20 |
| VOLKSWAGEN AG-PFD | 6,913 | 156.58 | 1,082,437.54 |
| ADIDAS AG | 7,031 | 272.40 | 1,915,244.40 |
| ESSILORLUXOTTICA | 11,065 | 132.45 | 1,465,559.25 |
| HERMES INTERNATIONAL | 1,157 | 626.00 | 724,282.00 |
| HUGO BOSS AG -ORD | 2,070 | 50.72 | 104,990.40 |
| KERING | 2,947 | 454.25 | 1,338,674.75 |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 10,774 | 366.45 | 3,948,132.30 |
| MONCLER SPA | 8,620 | 32.10 | 276,702.00 |
| PUMA SE | 3,260 | 68.95 | 224,777.00 |
| SEB SA | 770 | 140.60 | 108,262.00 |

| | | | |
|------------------------------|--------|--------|--------------|
| ACCOR SA | 8,656 | 38.90 | 336,718.40 |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC | 3,650 | 84.86 | 309,739.00 |
| SODEXO | 3,380 | 99.82 | 337,391.60 |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS | 5,925 | 16.84 | 99,777.00 |
| JC DECAUX SA | 2,720 | 24.84 | 67,564.80 |
| PUBLICIS GROUPE | 8,535 | 45.68 | 389,878.80 |
| RTL GROUP | 1,470 | 44.44 | 65,326.80 |
| SES | 15,290 | 15.21 | 232,637.35 |
| TELENET GROUP HOLDING NV | 2,110 | 43.80 | 92,418.00 |
| UBISOFT ENTERTAINMENT | 3,000 | 69.12 | 207,360.00 |
| VIVENDI | 34,490 | 24.97 | 861,215.30 |
| DELIVERY HERO SE | 5,320 | 41.63 | 221,471.60 |
| INDITEX | 42,065 | 27.62 | 1,161,835.30 |
| PROSUS | 18,000 | 69.95 | 1,259,100.00 |
| ZALANDO SE | 4,780 | 39.60 | 189,288.00 |
| CARREFOUR SA | 20,853 | 16.32 | 340,425.22 |
| CASINO GUICHARD PERRACHON | 2,304 | 46.05 | 106,099.20 |
| COLRUYT SA | 2,315 | 48.25 | 111,698.75 |
| JERONIMO MARTINS | 8,855 | 15.78 | 139,731.90 |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N | 44,498 | 22.50 | 1,001,427.49 |
| METRO WHOLESALE & FOOD SPECI | 7,040 | 14.35 | 101,059.20 |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 29,511 | 87.47 | 2,581,327.17 |
| DANONE | 24,094 | 80.50 | 1,939,567.00 |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA | 24,900 | 8.23 | 204,927.00 |
| HEINEKEN HOLDING NV | 4,485 | 90.00 | 403,650.00 |
| HEINEKEN NV | 10,343 | 97.14 | 1,004,719.02 |
| KERRY GROUP PLC-A | 5,630 | 105.00 | 591,150.00 |
| PERNOD-RICARD SA | 8,236 | 164.25 | 1,352,763.00 |
| REMY COINTREAU | 810 | 126.30 | 102,303.00 |
| BEIERSDORF AG | 3,645 | 107.50 | 391,837.50 |
| HENKEL AG & CO KGAA | 4,100 | 84.65 | 347,065.00 |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG | 7,283 | 92.88 | 676,445.04 |
| L'OREAL | 9,811 | 246.30 | 2,416,449.30 |
| UNILEVER NV | 56,355 | 54.35 | 3,062,894.25 |
| BIOMERIEUX | 1,820 | 74.50 | 135,590.00 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR | 1,900 | 103.80 | 197,220.00 |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & | 7,903 | 62.78 | 496,150.34 |
| FRESENIUS SE & CO KGAA | 16,815 | 44.39 | 746,417.85 |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 36,111 | 43.48 | 1,570,286.83 |
| SARTORIUS AG-VORZUG-PRF | 1,570 | 168.80 | 265,016.00 |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG | 5,680 | 35.28 | 200,418.80 |
| BAYER AG-REG | 36,224 | 65.85 | 2,385,350.40 |
| EUROFINS SCIENTIFIC | 470 | 428.00 | 201,160.00 |
| GRIFOLS SA | 12,270 | 27.10 | 332,517.00 |
| IPSEN | 1,330 | 89.40 | 118,902.00 |
| MERCK KGAA | 5,260 | 104.35 | 548,881.00 |
| ORION OYJ-CLASS B | 3,080 | 33.11 | 101,978.80 |
| QIAGEN N.V. | 10,894 | 30.53 | 332,593.82 |
| RECORDATI SPA | 4,230 | 39.80 | 168,354.00 |
| SANOFI | 43,616 | 83.69 | 3,650,223.04 |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH | 1,120 | 128.80 | 144,256.00 |
| UCB SA | 4,528 | 65.22 | 295,316.16 |
| ABN AMRO BANK NV-CVA | 16,560 | 18.18 | 301,060.80 |
| AIB GROUP PLC | 25,300 | 2.55 | 64,717.40 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 269,473 | 4.68 | 1,262,615.74 |
| BANCO DE SABADELL SA | 227,252 | 0.85 | 195,118.56 |
| BANCO SANTANDER SA | 655,289 | 3.65 | 2,396,064.22 |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC | 40,719 | 3.46 | 140,887.74 |
| BANKIA SA | 56,390 | 1.68 | 95,045.34 |
| BANKINTER SA | 23,710 | 5.66 | 134,246.02 |
| BNP PARIBAS | 43,962 | 44.01 | 1,934,767.62 |
| CAIXABANK S.A | 146,150 | 2.35 | 343,598.65 |
| COMMERZBANK AG | 48,544 | 5.29 | 257,089.02 |
| CREDIT AGRICOLE SA | 43,722 | 11.13 | 486,625.86 |
| ERSTE GROUP BANK AG | 11,618 | 31.08 | 361,087.44 |
| FINECOBANK SPA | 25,930 | 9.63 | 249,757.76 |
| ING GROEP NV-CVA | 147,725 | 9.53 | 1,407,966.97 |
| INTESA SANPAOLO | 553,193 | 2.14 | 1,184,109.61 |
| KBC GROEP NV | 8,939 | 59.16 | 528,831.24 |
| MEDIOBANCA SPA | 20,820 | 9.89 | 206,034.72 |

| | | | |
|-------------------------------|--------|--------|--------------|
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL | 4,580 | 21.27 | 97,416.60 |
| SOCIETE GENERALE | 31,419 | 25.43 | 798,985.17 |
| UNICREDIT SPA | 77,736 | 10.78 | 838,460.49 |
| AMUNDI SA | 1,940 | 63.00 | 122,220.00 |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED | 71,665 | 7.05 | 505,309.91 |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 7,720 | 139.70 | 1,078,484.00 |
| EURAZEO SE | 1,877 | 65.95 | 123,788.15 |
| EXOR NV | 3,474 | 61.04 | 212,052.96 |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 2,672 | 86.50 | 231,128.00 |
| NATIXIS | 29,240 | 3.78 | 110,527.20 |
| WENDEL | 1,010 | 122.30 | 123,523.00 |
| AEGON NV | 86,259 | 3.76 | 324,333.84 |
| AGEAS | 6,154 | 51.00 | 313,854.00 |
| ALLIANZ SE-REG | 16,518 | 211.25 | 3,489,427.50 |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 44,878 | 17.91 | 803,764.98 |
| AXA | 77,102 | 23.15 | 1,785,296.81 |
| CNP ASSURANCES | 6,040 | 17.89 | 108,055.60 |
| HANNOVER RUECK SE-REG | 2,175 | 151.70 | 329,947.50 |
| MAPFRE SA | 35,184 | 2.48 | 87,467.42 |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 5,626 | 232.90 | 1,310,295.40 |
| NN GROUP NV | 11,090 | 32.25 | 357,652.50 |
| POSTE ITALIANE SPA | 16,160 | 10.06 | 162,650.40 |
| SAMPO OYJ-A SHS | 17,089 | 37.86 | 646,989.54 |
| SCOR SE | 7,452 | 38.19 | 284,591.88 |
| AROUNDTOWN SA | 30,870 | 7.24 | 223,498.80 |
| DEUTSCHE WOHNEN SE | 13,280 | 31.55 | 418,984.00 |
| VONOVIA SE | 20,318 | 44.15 | 897,039.70 |
| ADYEN NV | 480 | 623.20 | 299,136.00 |
| AMADEUS IT GROUP SA | 16,180 | 65.48 | 1,059,466.40 |
| ATOS SE | 3,460 | 64.48 | 223,100.80 |
| CAP GEMINI SA | 5,619 | 105.60 | 593,366.40 |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 5,250 | 126.60 | 664,650.00 |
| SAP SE | 37,972 | 108.12 | 4,105,532.64 |
| WIRECARD AG | 4,660 | 145.50 | 678,030.00 |
| WORLDLINE SA | 3,120 | 59.75 | 186,420.00 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| INGENICO GROUP | 2,900 | 87.28 | 253,112.00 |
| NOKIA OYJ | 218,766 | 4.67 | 1,022,949.81 |
| CELLNEX TELECOM SAU | 8,530 | 37.16 | 316,974.80 |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 128,886 | 15.42 | 1,987,937.66 |
| DRILLISCH AG | 1,640 | 28.40 | 46,576.00 |
| ELISA OYJ | 6,135 | 46.61 | 285,952.35 |
| ILIAD SA | 890 | 81.08 | 72,161.20 |
| KONINKLIJKE KPN NV | 153,006 | 2.85 | 436,985.13 |
| ORANGE S.A. | 72,804 | 14.30 | 1,041,097.20 |
| PROXIMUS | 4,970 | 26.82 | 133,295.40 |
| TELECOM ITALIA SPA | 352,713 | 0.51 | 181,506.10 |
| TELECOM ITALIA-RSP | 211,957 | 0.50 | 106,317.63 |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 32,570 | 2.49 | 81,392.43 |
| TELEFONICA SA | 179,349 | 6.88 | 1,235,355.91 |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 4,020 | 32.37 | 130,127.40 |
| E.ON SE | 90,679 | 8.93 | 810,488.90 |
| EDF | 21,825 | 10.65 | 232,545.37 |
| ENAGAS SA | 7,610 | 20.63 | 156,994.30 |
| ENDESA SA | 11,770 | 23.71 | 279,066.70 |
| ENEL SPA | 313,287 | 6.67 | 2,089,937.57 |
| ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 98,571 | 3.51 | 345,984.21 |
| ENGIE | 68,394 | 14.34 | 980,769.96 |
| FORTUM OYJ | 16,625 | 21.55 | 358,268.75 |
| IBERDROLA SA | 230,582 | 9.35 | 2,155,941.70 |
| INNOGY SE | 6,350 | 44.60 | 283,210.00 |
| NATURGY ENERGY GROUP SA | 10,262 | 24.34 | 249,777.08 |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 16,720 | 18.27 | 305,474.40 |
| RWE AG | 22,395 | 28.57 | 639,825.15 |
| SNAM SPA | 86,480 | 4.46 | 386,133.20 |
| SUEZ | 12,499 | 14.23 | 177,923.26 |
| TERNA SPA | 54,797 | 5.66 | 310,370.20 |
| UNIPER SE | 7,650 | 30.14 | 230,571.00 |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT | 23,474 | 22.47 | 527,460.78 |
| VERBUND AG | 2,990 | 51.55 | 154,134.50 |
| ASML HOLDING NV | 16,562 | 225.30 | 3,731,418.60 |

| | | | | |
|-------|------------------------------|-----------|-------|------------------------------------|
| | INFINEON TECHNOLOGIES AG | 51,835 | 17.08 | 885,756.48 |
| | STMICROELECTRONICS NV | 26,033 | 17.63 | 459,091.95 |
| ユーロ小計 | | 7,556,805 | | 152,907,117.23 (18,093,499,181) |
| 英債券 | BP PLC | 786,278 | 5.18 | 4,079,996.54 |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 168,208 | 23.53 | 3,958,775.28 |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | 144,659 | 23.57 | 3,410,335.92 |
| | WOOD GROUP (JOHN) PLC | 29,210 | 4.19 | 122,389.90 |
| | ANGLO AMERICAN PLC | 39,624 | 18.70 | 741,285.79 |
| | ANTOFAGASTA PLC | 14,940 | 8.84 | 132,099.48 |
| | BHP GROUP PLC | 85,151 | 17.61 | 1,499,679.41 |
| | CRODA INTERNATIONAL PLC | 6,131 | 48.44 | 296,985.64 |
| | EVRAZ PLC | 16,000 | 4.87 | 77,920.00 |
| | FRESNILLO PLC | 8,070 | 7.42 | 59,911.68 |
| | GLENCORE PLC | 430,613 | 2.49 | 1,072,441.67 |
| | JOHNSON MATTHEY PLC | 6,669 | 30.29 | 202,004.01 |
| | MONDI PLC | 21,700 | 15.58 | 338,086.00 |
| | RIO TINTO PLC | 44,385 | 42.45 | 1,884,143.25 |
| | ASHTREAD GROUP PLC | 18,690 | 22.40 | 418,656.00 |
| | BAE SYSTEMS PLC ORD | 132,645 | 5.76 | 764,035.20 |
| | BUNZL PLC | 14,996 | 20.72 | 310,717.12 |
| | DCC PLC | 3,950 | 70.04 | 276,658.00 |
| | FERGUSON PLC | 8,212 | 59.36 | 487,464.32 |
| | MEGGITT PLC | 27,315 | 6.32 | 172,630.80 |
| | MELROSE INDUSTRIES PLC | 199,080 | 2.03 | 404,331.48 |
| | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 71,535 | 7.75 | 554,396.25 |
| | SMITHS GROUP PLC | 13,793 | 15.59 | 215,032.87 |
| | SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 2,460 | 80.05 | 196,923.00 |
| | WEIR GROUP PLC/THE | 10,140 | 14.72 | 149,311.50 |
| | EXPERIAN PLC | 37,048 | 25.48 | 943,983.04 |
| | G4S PLC | 58,799 | 1.92 | 113,129.27 |
| | INTERTEK GROUP PLC | 6,335 | 54.00 | 342,090.00 |
| | RELX PLC | 76,385 | 18.79 | 1,435,656.07 |
| | RENTOKIL INITIAL PLC | 72,430 | 4.52 | 328,035.47 |
| | EASYJET PLC | 6,550 | 11.06 | 72,475.75 |

| | | | |
|-----------------------------------|---------|-------|--------------|
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 49,140 | 6.46 | 317,739.24 |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS | 4,010 | 41.54 | 166,575.40 |
| BURBERRY GROUP PLC | 13,364 | 21.84 | 291,869.76 |
| PERSIMMON PLC | 11,260 | 21.15 | 238,149.00 |
| TAYLOR WIMPEY PLC | 146,790 | 1.63 | 239,414.49 |
| CARNIVAL PLC | 6,090 | 36.18 | 220,336.20 |
| COMPASS GROUP PLC | 62,028 | 20.30 | 1,259,168.40 |
| GVC HOLDINGS PLC | 27,190 | 7.27 | 197,888.82 |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 6,273 | 49.90 | 313,022.70 |
| MERLIN ENTERTAINME | 25,700 | 4.52 | 116,318.20 |
| TUI AG-DI | 14,113 | 9.01 | 127,214.58 |
| WHITBREAD PLC | 5,410 | 44.24 | 239,338.40 |
| AUTO TRADER GROUP PLC | 33,020 | 5.17 | 170,977.56 |
| INFORMA PLC | 54,470 | 8.28 | 451,120.54 |
| ITV PLC | 118,275 | 1.26 | 149,381.32 |
| PEARSON PLC | 29,059 | 8.53 | 247,931.38 |
| WPP PLC | 46,704 | 9.95 | 464,798.20 |
| KINGFISHER PLC | 69,577 | 2.01 | 139,919.34 |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC | 64,664 | 1.89 | 122,538.28 |
| NEXT PLC | 5,237 | 59.02 | 309,087.74 |
| OCADO GROUP PLC | 20,770 | 13.12 | 272,502.40 |
| SAINSBURY (J) PLC | 72,601 | 2.16 | 157,181.16 |
| TESCO PLC | 392,474 | 2.40 | 943,507.49 |
| WM MORRISON SUPERMARKETS | 86,455 | 2.02 | 174,725.55 |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 13,985 | 23.14 | 323,612.90 |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 88,707 | 28.84 | 2,558,309.88 |
| COCA-COLA HBC AG-CDI | 8,420 | 26.00 | 218,920.00 |
| DIAGEO PLC | 91,752 | 32.47 | 2,979,646.20 |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 38,352 | 20.94 | 803,090.88 |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 27,625 | 62.93 | 1,738,441.25 |
| UNILEVER PLC | 43,177 | 48.67 | 2,101,640.47 |
| NMC HEALTH PLC | 3,660 | 27.02 | 98,893.20 |
| SMITH & NEPHEW PLC | 31,716 | 19.22 | 609,740.10 |
| ASTRAZENECA PLC | 50,683 | 71.70 | 3,633,971.10 |
| GLAXOSMITHKLINE PLC | 192,641 | 16.85 | 3,247,541.97 |

| | | | | | |
|--------|------------------------------|------------|----------|---------------|-----------------|
| | BARCLAYS PLC | 666,291 | 1.49 | 994,505.94 | |
| | HSBC HOLDINGS PLC | 784,751 | 6.12 | 4,809,738.87 | |
| | LLOYDS BANKING GROUP PLC | 2,869,336 | 0.54 | 1,558,049.44 | |
| | ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP | 188,330 | 2.08 | 393,421.37 | |
| | STANDARD CHARTERED PLC | 99,590 | 6.85 | 682,191.50 | |
| | 3I GROUP PLC | 35,779 | 11.17 | 399,651.43 | |
| | HARGREAVES LANSDOWN PLC | 10,830 | 20.28 | 219,632.40 | |
| | INVESTEC PLC | 21,805 | 4.41 | 96,356.29 | |
| | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP | 11,657 | 73.06 | 851,660.42 | |
| | SCHRODERS PLC | 4,101 | 30.42 | 124,752.42 | |
| | ST JAMES'S PLACE PLC | 20,690 | 9.62 | 199,120.56 | |
| | STANDARD LIFE ABERDEEN PLC | 85,115 | 2.74 | 233,640.67 | |
| | ADMIRAL GROUP PLC | 6,455 | 21.35 | 137,814.25 | |
| | AVIVA PLC | 153,925 | 3.88 | 597,382.92 | |
| | DIRECT LINE INSURANCE GROUP | 44,053 | 3.02 | 133,436.53 | |
| | LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 241,801 | 2.50 | 605,953.30 | |
| | PRUDENTIAL PLC | 96,922 | 14.42 | 1,398,099.85 | |
| | RSA INSURANCE GROUP PLC | 34,438 | 5.24 | 180,592.87 | |
| | MICRO FOCUS INTERNATIONAL | 13,079 | 11.19 | 146,458.64 | |
| | SAGE GROUP PLC/THE | 38,650 | 6.73 | 260,269.10 | |
| | HALMA PLC | 12,580 | 19.51 | 245,435.80 | |
| | BT GROUP PLC | 350,552 | 1.76 | 617,953.06 | |
| | VODAFONE GROUP PLC | 1,025,588 | 1.59 | 1,640,530.56 | |
| | CENTRICA PLC | 272,675 | 0.71 | 195,671.58 | |
| | NATIONAL GRID PLC | 126,218 | 8.60 | 1,085,853.45 | |
| | SEVERN TRENT PLC | 11,503 | 20.79 | 239,147.37 | |
| | SSE PLC | 38,947 | 12.21 | 475,737.60 | |
| | UNITED UTILITIES GROUP PLC | 28,615 | 7.89 | 225,829.58 | |
| 英債券小計 | | 11,811,669 | | 69,454,982.58 | (9,300,022,167) |
| スイスフラン | CLARIANT AG-REG | 7,550 | 19.62 | 148,131.00 | |
| | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | 290 | 608.50 | 176,465.00 | |
| | GIVAUDAN-REG | 343 | 2,764.00 | 948,052.00 | |
| | LAFARGEHOLCIM LTD-REG | 17,629 | 49.40 | 870,872.60 | |
| | SIKA AG-REG | 5,360 | 146.70 | 786,312.00 | |

| | | | |
|------------------------------|---------|-----------|---------------|
| ABB LTD-REG | 70,985 | 19.69 | 1,398,049.57 |
| GEBERIT AG-REG | 1,410 | 473.30 | 667,353.00 |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG | 760 | 221.60 | 168,416.00 |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 1,560 | 223.30 | 348,348.00 |
| ADECCO GROUP AG-REG | 6,547 | 55.30 | 362,049.10 |
| SGS SA-REG | 198 | 2,452.00 | 485,496.00 |
| KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG | 2,550 | 145.20 | 370,260.00 |
| CIE FINANCIERE RICHEMON-REG | 19,939 | 73.48 | 1,465,117.72 |
| SWATCH GROUP AG/THE-BR | 1,040 | 265.50 | 276,120.00 |
| SWATCH GROUP AG/THE-REG | 1,870 | 49.98 | 93,462.60 |
| DUFREY AG-REG | 1,570 | 81.24 | 127,546.80 |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG | 75 | 2,012.00 | 150,900.00 |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC | 48 | 7,295.00 | 350,160.00 |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG | 4 | 80,700.00 | 322,800.00 |
| NESTLE SA-REG | 118,753 | 107.12 | 12,720,821.36 |
| ALCON INC | 15,314 | 59.54 | 911,795.56 |
| SONOVA HOLDING AG-REG | 2,060 | 223.30 | 459,998.00 |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG | 480 | 799.00 | 383,520.00 |
| LONZA GROUP AG-REG | 2,758 | 342.60 | 944,890.80 |
| NOVARTIS AG-REG | 83,433 | 85.65 | 7,146,036.45 |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 27,288 | 282.90 | 7,719,775.20 |
| VIFOR PHARMA AG | 1,840 | 159.45 | 293,388.00 |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG | 95,828 | 12.50 | 1,198,329.14 |
| JULIUS BAER GROUP LTD | 8,370 | 43.61 | 365,015.70 |
| PARGESA HOLDING SA-BR | 1,295 | 74.70 | 96,736.50 |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG | 695 | 773.80 | 537,791.00 |
| UBS GROUP AG-REG | 154,012 | 11.21 | 1,727,244.58 |
| BALOISE HOLDING AG - REG | 1,580 | 177.20 | 279,976.00 |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG | 1,300 | 480.30 | 624,390.00 |
| SWISS RE AG | 12,369 | 102.65 | 1,269,677.85 |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 5,906 | 379.30 | 2,240,145.80 |
| SWISS PRIME SITE-REG | 2,551 | 98.20 | 250,508.20 |
| TEMENOS AG | 2,850 | 164.10 | 467,685.00 |
| SWISSCOM AG-REG | 904 | 492.10 | 444,858.40 |
| | 679,314 | | 49,598,494.93 |

| スイスフラン小計 | | | | (5,392,348,368) | |
|----------------|------------------------------|---------|----------------|-----------------|--|
| スウェーデンク ローナ | LUNDIN PETROLEUM AB | 7,310 | 305.50 | 2,233,205.00 | |
| | BOLIDEN AB | 9,430 | 236.20 | 2,227,366.00 | |
| | ALFA LAVAL AB | 13,200 | 188.80 | 2,492,160.00 | |
| | ASSA ABLOY AB-B | 37,310 | 217.50 | 8,114,925.00 | |
| | ATLAS COPCO AB-A SHS | 27,545 | 311.30 | 8,574,758.50 | |
| | ATLAS COPCO AB-B SHS | 15,780 | 275.50 | 4,347,390.00 | |
| | EPIROC AB-A | 29,345 | 106.85 | 3,135,513.25 | |
| | EPIROC AB-B | 14,810 | 102.20 | 1,513,582.00 | |
| | SANDVIK AB | 46,040 | 152.05 | 7,000,382.00 | |
| | SKANSKA AB-B SHS | 11,960 | 188.00 | 2,248,480.00 | |
| | SKF AB-B SHARES-B | 11,729 | 162.75 | 1,908,894.75 | |
| | VOLVO AB-B SHS-B | 57,380 | 139.75 | 8,018,855.00 | |
| | SECURITAS AB-B SHS | 14,629 | 147.90 | 2,163,629.10 | |
| | ELECTROLUX AB - B | 8,065 | 233.00 | 1,879,145.00 | |
| | HUSQVARNA AB-B SHS | 14,680 | 78.68 | 1,155,022.40 | |
| | HENNES & MAURITZ AB-B SHS | 29,658 | 186.50 | 5,531,217.00 | |
| | ICA GRUPPEN AB | 4,230 | 447.10 | 1,891,233.00 | |
| | SWEDISH MATCH AB | 6,040 | 406.20 | 2,453,448.00 | |
| | ESSITY AKTIEBOLAG-B | 21,305 | 282.90 | 6,027,184.50 | |
| | NORDEA BANK ABP | 126,542 | 68.56 | 8,675,719.52 | |
| | SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 62,860 | 90.18 | 5,668,714.80 | |
| | SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS | 67,010 | 90.50 | 6,064,405.00 | |
| | SWEDBANK AB - A SHARES | 36,770 | 139.15 | 5,116,545.50 | |
| | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 5,870 | 214.60 | 1,259,702.00 | |
| | INVESTOR AB-B SHS | 18,115 | 470.60 | 8,524,919.00 | |
| | KINNEVIK AB - B | 8,115 | 254.00 | 2,061,210.00 | |
| | LUNDBERGS AB-B SHS | 2,350 | 368.40 | 865,740.00 | |
| | ERICSSON LM-B SHS | 113,075 | 79.98 | 9,043,738.50 | |
| | HEXAGON AB-B SHS | 10,500 | 463.80 | 4,869,900.00 | |
| | MILLICOM INTL CELLULAR-SDR | 2,330 | 488.80 | 1,138,904.00 | |
| TELE2 AB-B SHS | 21,615 | 145.10 | 3,136,336.50 | | |
| TELIA CO AB | 104,170 | 44.00 | 4,583,480.00 | | |
| スウェーデンクローナ小計 | 959,768 | | 133,925,705.32 | (1,483,896,814) | |

| | | | | | |
|---------------|-----------------------------|---------|--------------|---------------|-----------------|
| ノルウェーク ローネ | AKER BP ASA | 3,800 | 259.40 | 985,720.00 | |
| | EQUINOR ASA | 36,894 | 179.15 | 6,609,560.10 | |
| | NORSK HYDRO A S | 62,840 | 33.49 | 2,104,511.60 | |
| | YARA INTERNATIONAL ASA | 7,800 | 381.10 | 2,972,580.00 | |
| | SCHIBSTED ASA-B SHS | 3,020 | 258.00 | 779,160.00 | |
| | MOWI ASA | 15,540 | 214.00 | 3,325,560.00 | |
| | ORKLA ASA | 26,610 | 81.62 | 2,171,908.20 | |
| | DNB ASA | 40,535 | 162.90 | 6,603,151.50 | |
| | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 7,030 | 183.95 | 1,293,168.50 | |
| | TELENOR ASA | 29,525 | 182.85 | 5,398,646.25 | |
| ノルウェークローネ小計 | | 233,594 | | 32,243,966.15 | (383,703,197) |
| デンマークク ローネ | CHR HANSEN HOLDING A/S | 4,680 | 578.00 | 2,705,040.00 | |
| | NOVOZYMES A/S-B SHARES | 9,075 | 291.80 | 2,648,085.00 | |
| | VESTAS WIND SYSTEMS AS | 6,570 | 541.60 | 3,558,312.00 | |
| | ISS A/S | 4,720 | 170.50 | 804,760.00 | |
| | AP MOELLER - MAERSK A/S - A | 125 | 7,250.00 | 906,250.00 | |
| | AP MOELLER - MAERSK A/S - B | 253 | 7,730.00 | 1,955,690.00 | |
| | DSV A/S | 8,100 | 651.20 | 5,274,720.00 | |
| | PANDORA A/S | 4,560 | 283.00 | 1,290,480.00 | |
| | CARLSBERG AS-B | 4,630 | 992.60 | 4,595,738.00 | |
| | COLOPLAST-B | 4,445 | 822.00 | 3,653,790.00 | |
| | DEMANT A/S | 4,440 | 181.95 | 807,858.00 | |
| | GENMAB A/S | 2,630 | 1,405.00 | 3,695,150.00 | |
| | H LUNDBECK A/S | 2,450 | 240.30 | 588,735.00 | |
| | NOVO NORDISK A/S-B | 68,455 | 360.20 | 24,657,491.00 | |
| | DANSKE BANK A/S | 21,315 | 96.00 | 2,046,240.00 | |
| | TRYG A/S | 3,635 | 202.80 | 737,178.00 | |
| ORSTED A/S | 7,690 | 630.00 | 4,844,700.00 | | |
| デンマーククローネ小計 | | 157,773 | | 64,770,217.00 | (1,026,607,939) |
| 豪ドル | CALTEX AUSTRALIA LTD | 8,355 | 25.51 | 213,136.05 | |
| | OIL SEARCH LTD | 43,280 | 7.70 | 333,256.00 | |
| | ORIGIN ENERGY LTD | 68,720 | 7.93 | 544,949.60 | |
| | SANTOS LTD | 79,625 | 7.84 | 624,260.00 | |

| | | | |
|----------------------------------|---------|--------|--------------|
| WOODSIDE PETROLEUM LTD | 37,253 | 32.62 | 1,215,192.86 |
| WORLEYPARSONS LTD | 12,600 | 13.74 | 173,124.00 |
| ALUMINA LTD | 75,722 | 2.46 | 186,276.12 |
| BHP GROUP LTD | 114,786 | 37.62 | 4,318,249.32 |
| BLUESCOPE STEEL LTD | 18,750 | 12.26 | 229,875.00 |
| BORAL LTD | 42,795 | 4.91 | 210,123.45 |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD | 48,165 | 8.98 | 432,521.70 |
| INCITEC PIVOT LTD | 75,040 | 3.46 | 259,638.40 |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI | 18,225 | 24.75 | 451,068.75 |
| NEWCREST MINING LTD | 29,289 | 36.22 | 1,060,847.58 |
| ORICA LIMITED | 12,155 | 22.91 | 278,471.05 |
| RIO TINTO LTD | 13,348 | 92.84 | 1,239,228.32 |
| SOUTH32 LTD | 194,147 | 2.74 | 531,962.78 |
| CIMIC GROUP LTD | 2,897 | 32.50 | 94,152.50 |
| BRAMBLES LTD | 64,688 | 11.31 | 731,621.28 |
| SEEK LTD | 11,730 | 21.69 | 254,423.70 |
| AURIZON HOLDINGS LTD | 95,170 | 6.05 | 575,778.50 |
| SYDNEY AIRPORT | 51,686 | 8.04 | 415,555.44 |
| TRANSURBAN GROUP | 100,269 | 14.75 | 1,478,967.75 |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD | 19,040 | 30.87 | 587,764.80 |
| CROWN RESORTS LTD | 11,245 | 12.20 | 137,189.00 |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD | 1,630 | 47.82 | 77,946.60 |
| TABCORP HOLDINGS LTD | 97,874 | 4.85 | 474,688.90 |
| REA GROUP LTD | 1,800 | 108.49 | 195,282.00 |
| HARVEY NORMAN HOLDING-RIGHTS-RTS | 670 | 1.83 | 1,226.10 |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD | 11,392 | 4.58 | 52,175.36 |
| WESFARMERS LTD | 44,995 | 39.91 | 1,795,750.45 |
| COLES GROUP LTD | 40,685 | 15.00 | 610,275.00 |
| WOOLWORTHS GROUP LTD | 50,832 | 37.57 | 1,909,758.24 |
| COCA-COLA AMATIL LTD | 17,820 | 10.88 | 193,881.60 |
| TREASURY WINE ESTATES LTD | 26,956 | 19.15 | 516,207.40 |
| COCHLEAR LTD | 1,807 | 207.18 | 374,374.26 |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD | 6,855 | 64.39 | 441,393.45 |
| SONIC HEALTHCARE LTD | 20,390 | 28.33 | 577,648.70 |
| CSL LTD | 17,652 | 236.69 | 4,178,051.88 |

| | | | | | |
|--------------|------------------------------|-----------|--------|----------------------------------|--|
| | AUST AND NZ BANKING GROUP | 112,079 | 27.93 | 3,130,366.47 | |
| | BANK OF QUEENSLAND LIMITED | 14,130 | 9.78 | 138,191.40 | |
| | BENDIGO AND ADELAIDE BANK | 17,778 | 11.59 | 206,047.02 | |
| | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 68,747 | 82.05 | 5,640,691.35 | |
| | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 107,583 | 29.73 | 3,198,442.59 | |
| | WESTPAC BANKING CORP | 134,391 | 29.80 | 4,004,851.80 | |
| | AMP LTD | 156,627 | 1.87 | 292,892.49 | |
| | ASX LTD | 7,715 | 81.98 | 632,475.70 | |
| | CHALLENGER LTD | 20,840 | 7.60 | 158,384.00 | |
| | MACQUARIE GROUP LTD | 11,824 | 131.37 | 1,553,318.88 | |
| | MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD | 4,540 | 52.97 | 240,483.80 | |
| | INSURANCE AUSTRALIA GROUP | 92,475 | 8.02 | 741,649.50 | |
| | MEDIBANK PRIVATE LTD | 104,360 | 3.48 | 363,172.80 | |
| | QBE INSURANCE GROUP LTD | 55,820 | 12.78 | 713,379.60 | |
| | SUNCORP GROUP LTD | 45,280 | 13.66 | 618,524.80 | |
| | COMPUTERSHARE LTD | 14,790 | 15.93 | 235,604.70 | |
| | TELSTRA CORPORATION LTD | 171,384 | 3.65 | 625,551.60 | |
| | TPG TELECOM LTD | 7,840 | 7.02 | 55,036.80 | |
| | AGL ENERGY LTD | 28,301 | 18.96 | 536,586.96 | |
| | APA GROUP | 53,448 | 11.57 | 618,393.36 | |
| | AUSNET SERVICES | 69,210 | 1.76 | 121,809.60 | |
| 豪ドル小計 | | 2,889,500 | | 51,802,149.11 (3,778,448,756) | |
| ニュージーランドドル | FLETCHER BUILDING LTD | 30,583 | 5.11 | 156,279.13 | |
| | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 36,555 | 9.31 | 340,327.05 | |
| | A2 MILK CO LTD | 30,340 | 13.70 | 415,658.00 | |
| | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 24,590 | 17.10 | 420,489.00 | |
| | RYMAN HEALTHCARE LTD | 14,200 | 13.06 | 185,452.00 | |
| | SPARK NEW ZEALAND LTD | 80,377 | 4.43 | 356,070.11 | |
| | MERIDIAN ENERGY LTD | 55,650 | 5.14 | 286,041.00 | |
| ニュージーランドドル小計 | | 272,295 | | 2,160,316.29 (146,361,428) | |
| 香港ドル | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 101,708 | 69.35 | 7,053,449.80 | |
| | NWS HOLDINGS LTD | 48,500 | 13.12 | 636,320.00 | |
| | TECHTRONIC INDUSTRIES CO | 60,000 | 54.10 | 3,246,000.00 | |

| | | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| MTR CORP | 52,000 | 45.50 | 2,366,000.00 | |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG | 24,500 | 21.45 | 525,525.00 | |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 83,000 | 50.05 | 4,154,150.00 | |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD | 28,400 | 12.64 | 358,976.00 | |
| SANDS CHINA LTD | 85,000 | 36.70 | 3,119,500.00 | |
| SHANGRI-LA ASIA LTD | 28,000 | 8.12 | 227,360.00 | |
| SJM HOLDINGS LTD | 82,000 | 7.69 | 630,580.00 | |
| WYNN MACAU LTD | 55,800 | 15.80 | 881,640.00 | |
| VITASOY INTL HOLDINGS LTD | 24,000 | 33.05 | 793,200.00 | |
| WH GROUP LTD | 389,500 | 7.04 | 2,742,080.00 | |
| BANK OF EAST ASIA | 45,040 | 19.50 | 878,280.00 | |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 158,500 | 26.80 | 4,247,800.00 | |
| HANG SENG BANK LTD | 31,800 | 170.80 | 5,431,440.00 | |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 46,900 | 225.80 | 10,590,020.00 | |
| AIA GROUP LTD | 469,790 | 74.90 | 35,187,271.00 | |
| CK ASSET HOLDINGS LTD | 99,208 | 54.10 | 5,367,152.80 | |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD | 79,000 | 17.70 | 1,398,300.00 | |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT | 46,901 | 37.50 | 1,758,787.50 | |
| HYSAN DEVELOPMENT CO | 25,000 | 31.00 | 775,000.00 | |
| KERRY PROPERTIES LTD | 31,950 | 24.05 | 768,397.50 | |
| NEW WORLD DEVELOPMENT | 283,666 | 10.02 | 2,842,333.32 | |
| SINO LAND CO | 143,050 | 11.66 | 1,667,963.00 | |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES | 59,980 | 113.60 | 6,813,728.00 | |
| SWIRE PACIFIC LTD 'A' | 17,517 | 72.90 | 1,276,989.30 | |
| SWIRE PROPERTIES LTD | 39,200 | 24.55 | 962,360.00 | |
| WHARF HOLDINGS LTD | 42,800 | 16.60 | 710,480.00 | |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 47,800 | 42.25 | 2,019,550.00 | |
| WHEELLOCK & CO LTD | 29,600 | 44.70 | 1,323,120.00 | |
| HKT TRUST AND HKT LTD | 153,000 | 12.58 | 1,924,740.00 | |
| PCCW LTD | 136,000 | 4.37 | 594,320.00 | |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L | 27,000 | 52.80 | 1,425,600.00 | |
| CLP HOLDINGS LTD | 61,000 | 81.45 | 4,968,450.00 | |
| HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS | 93,500 | 7.56 | 706,860.00 | |
| HONG KONG & CHINA GAS | 427,434 | 15.46 | 6,608,129.64 | |
| POWER ASSETS HOLDINGS | 59,000 | 52.60 | 3,103,400.00 | |

| | | | | | |
|------------------------------|------------------------------|-----------|------------|-----------------------------------|--|
| | ASM PACIFIC TECHNOLOGY | 10,700 | 98.45 | 1,053,415.00 | |
| 香港ドル小計 | | 3,727,744 | | 131,138,667.86 (1,801,845,296) | |
| シンガポールドル | KEPPEL CORP LTD | 62,360 | 6.04 | 376,654.40 | |
| | SEMBCORP INDUSTRIES LTD | 21,000 | 2.14 | 44,940.00 | |
| | SINGAPORE TECH ENGINEERING | 51,000 | 3.88 | 197,880.00 | |
| | COMFORTDELGRO CORP LTD | 71,300 | 2.43 | 173,259.00 | |
| | SATS LTD | 22,000 | 4.82 | 106,040.00 | |
| | SINGAPORE AIRLINES LTD | 21,800 | 9.11 | 198,598.00 | |
| | GENTING SINGAPORE LTD | 212,600 | 0.89 | 189,214.00 | |
| | SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD | 56,250 | 2.08 | 117,000.00 | |
| | JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 3,500 | 30.43 | 106,505.00 | |
| | GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD | 130,000 | 0.24 | 31,850.00 | |
| | WILMAR INTERNATIONAL LTD | 84,360 | 3.72 | 313,819.20 | |
| | DBS GROUP HOLDINGS LTD | 68,815 | 24.91 | 1,714,181.65 | |
| | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 120,040 | 10.85 | 1,302,434.00 | |
| | UNITED OVERSEAS BANK LTD | 52,800 | 25.56 | 1,349,568.00 | |
| | SINGAPORE EXCHANGE LTD | 36,800 | 8.29 | 305,072.00 | |
| | CAPITALAND LTD | 109,900 | 3.49 | 383,551.00 | |
| | CITY DEVELOPMENTS LTD | 17,200 | 9.66 | 166,152.00 | |
| | UOL GROUP LTD | 15,650 | 7.37 | 115,340.50 | |
| | VENTURE CORP LTD | 9,700 | 15.27 | 148,119.00 | |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 286,980 | 3.17 | 909,726.60 | | |
| シンガポールドル小計 | | 1,454,055 | | 8,249,904.35 (644,895,023) | |
| イスラエルシュケル | ISRAEL CHEMICALS LTD | 21,770 | 17.00 | 370,090.00 | |
| | ELBIT SYSTEMS LTD | 770 | 572.40 | 440,748.00 | |
| | BANK HAPOLIM BM | 41,745 | 26.48 | 1,105,407.60 | |
| | BANK LEUMI LE-ISRAEL | 53,225 | 24.34 | 1,295,496.50 | |
| | ISRAEL DISCOUNT BANK-A | 41,400 | 15.20 | 629,280.00 | |
| | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 4,900 | 84.60 | 414,540.00 | |
| | AZRIELI GROUP LTD | 1,610 | 259.80 | 418,278.00 | |
| | NICE LTD | 2,455 | 519.30 | 1,274,881.50 | |
| イスラエルシュケル小計 | | 167,875 | | 5,948,721.60 (182,328,317) | |

| | | |
|-----|------------|--------------------------------------|
| 合 計 | 43,159,601 | 154,271,771,168 (154,271,771,168) |
|-----|------------|--------------------------------------|

(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 | 129,943.05 | | |
| | 出資金小計 | | 5,737.00 | 129,943.05 (13,993,567) | | |
| | 投資証券 | | AGNC INVESTMENT CORP | 22,170 | 361,592.70 | |
| | | | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC | 4,080 | 626,443.20 | |
| | | | AMERICAN TOWER CORP | 17,189 | 3,874,056.82 | |
| | | | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC | 48,540 | 436,860.00 | |
| | | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 5,535 | 1,164,785.40 | |
| | | | BOSTON PROPERTIES INC | 5,657 | 736,824.25 | |
| | | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 3,830 | 424,249.10 | |
| | | | CROWN CASTLE INTL CORP | 16,220 | 2,294,156.80 | |
| | | | DIGITAL REALTY TRUST INC | 7,585 | 958,061.35 | |
| | | | DUKE REALTY CORPORATION | 12,685 | 424,820.65 | |
| | | | EQUINIX INC | 3,218 | 1,871,942.78 | |
| | | | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC | 3,790 | 509,186.50 | |
| | | | EQUITY RESIDENTIAL-REIT | 13,840 | 1,179,583.20 | |
| | | | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 2,470 | 803,120.50 | |
| | | | EXTRA SPACE STORAGE INC | 4,640 | 537,033.60 | |
| | | | FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT | 2,755 | 370,850.55 | |
| | | | HCP INC | 17,975 | 630,203.50 | |
| | | | HOST HOTELS & RESORTS INC | 29,879 | 514,516.38 | |
| | | | INVITATION HOMES INC | 19,500 | 562,380.00 | |
| | | | IRON MOUNTAIN INC | 12,895 | 403,871.40 | |
| | | | KIMCO REALTY CORPORATION | 14,815 | 299,263.00 | |
| | LIBERTY PROPERTY TRUST | 5,203 | 266,705.78 | | | |
| | MACERICH CO/THE | 4,120 | 133,446.80 | | | |
| | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 4,800 | 619,872.00 | | | |

| | | | | | |
|------|------|-------------------------------------|---------|---------------|-----------------|
| | | NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 6,390 | 357,648.30 | |
| | | PROLOGIS INC | 24,632 | 2,084,359.84 | |
| | | PUBLIC STORAGE | 6,009 | 1,474,909.05 | |
| | | REALTY INCOME CORP | 12,050 | 916,282.00 | |
| | | REGENCY CENTERS CORP | 5,965 | 403,651.55 | |
| | | SBA COMMUNICATIONS CORP | 4,230 | 1,081,061.10 | |
| | | SIMON PROPERTY GROUP INC | 12,464 | 1,931,296.80 | |
| | | SL GREEN REALTY CORP | 3,450 | 280,933.50 | |
| | | SUN COMMUNITIES INC | 3,850 | 574,304.50 | |
| | | UDR INC | 10,870 | 522,738.30 | |
| | | VENTAS INC | 14,645 | 1,063,666.35 | |
| | | VEREIT INC | 31,824 | 309,647.52 | |
| | | VORNADO REALTY TRUST | 5,581 | 350,765.85 | |
| | | WELLTOWER INC | 16,250 | 1,447,225.00 | |
| | | WEYERHAEUSER CO | 27,858 | 769,437.96 | |
| | | WP CAREY INC | 7,400 | 665,112.00 | |
| | | 投資証券小計 | 476,859 | 34,236,865.88 | (3,686,968,086) |
| | | 米ドル小計 | 482,596 | 34,366,808.93 | (3,700,961,653) |
| 加ドル | 投資証券 | H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 6,690 | 153,334.80 | |
| | | RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 5,660 | 150,103.20 | |
| | | SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 1,690 | 54,925.00 | |
| | | 加ドル小計 | 14,040 | 358,363.00 | (29,102,659) |
| ユーロ | 投資証券 | COVIVIO | 1,665 | 158,924.25 | |
| | | GECINA SA | 1,490 | 213,368.00 | |
| | | ICADE | 1,175 | 94,293.75 | |
| | | KLEPIERRE | 7,522 | 223,328.18 | |
| | | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 5,340 | 696,069.00 | |
| | | ユーロ小計 | 17,192 | 1,385,983.18 | (164,003,389) |
| 英ポンド | 投資証券 | BRITISH LAND COMPANY PLC | 34,331 | 193,832.82 | |
| | | LAND SECURITIES GROUP PLC | 34,134 | 286,725.60 | |
| | | SEGRO PLC | 45,073 | 356,347.13 | |
| | | | 113,538 | 836,905.55 | |

| | | | | | |
|------------|------|------------------------------|---------|---------------|-----------------|
| 英ポンド小計 | | | | (112,061,653) | |
| 豪ドル | 投資証券 | DEXUS | 42,687 | 528,891.93 | |
| | | GOODMAN GROUP | 64,202 | 906,532.24 | |
| | | GPT GROUP | 87,135 | 537,622.95 | |
| | | LENDLEASE GROUP | 18,967 | 324,146.03 | |
| | | MIRVAC GROUP | 128,775 | 397,914.75 | |
| | | SCENTRE GROUP | 206,171 | 812,313.74 | |
| | | STOCKLAND | 115,500 | 515,130.00 | |
| | | VICINITY CENTRES | 123,402 | 320,845.20 | |
| 豪ドル小計 | | | 786,839 | 4,343,396.84 | (316,807,365) |
| 香港ドル | 投資証券 | LINK REIT | 80,000 | 6,972,000.00 | |
| 香港ドル小計 | | | 80,000 | 6,972,000.00 | (95,795,280) |
| シンガポールドル | 投資証券 | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 88,600 | 276,432.00 | |
| | | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 92,140 | 194,415.40 | |
| | | CAPITALAND MALL TRUST | 84,200 | 220,604.00 | |
| | | SUNTEC REIT | 91,400 | 175,488.00 | |
| シンガポールドル小計 | | | 356,340 | 866,939.40 | (67,768,652) |
| 合計 | | | | 4,486,500,651 | (4,486,500,651) |

(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 607銘柄 | 96.6% | | | 66.9% |
| | 投資証券 40銘柄 | | | 3.4% | 2.3% |
| 加ドル | 株式 87銘柄 | 99.5% | | | 3.8% |
| | 投資証券 3銘柄 | | | 0.5% | 0.0% |

| | | | | | | |
|------------|------|-------|--------|--|------|-------|
| ユーロ | 株式 | 239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 | 98.8% | | | 5.9% |
| | 投資証券 | 3銘柄 | | | 1.2% | 0.1% |
| スイスフラン | 株式 | 39銘柄 | 100.0% | | | 3.4% |
| スウェーデンクローナ | 株式 | 32銘柄 | 100.0% | | | 0.9% |
| ノルウェークローネ | 株式 | 10銘柄 | 100.0% | | | 0.2% |
| デンマーククローネ | 株式 | 17銘柄 | 100.0% | | | 0.6% |
| 豪ドル | 株式 | 60銘柄 | 92.3% | | | 2.4% |
| | 投資証券 | 8銘柄 | | | 7.7% | 0.2% |
| ニュージーランドドル | 株式 | 7銘柄 | 100.0% | | | 0.1% |
| 香港ドル | 株式 | 39銘柄 | 95.0% | | | 1.1% |
| | 投資証券 | 1銘柄 | | | 5.0% | 0.1% |
| シンガポールドル | 株式 | 20銘柄 | 90.5% | | | 0.4% |
| | 投資証券 | 4銘柄 | | | 9.5% | 0.0% |
| イスラエルシェケル | 株式 | 8銘柄 | 100.0% | | | 0.1% |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

海外新興国株式インデックスMSCIEマージング（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

| | 2019年 3月22日現在 | 2019年 9月24日現在 |
|----------|----------------|----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 209,534,325 | 411,831,706 |
| コール・ローン | 69,639,019 | 1,096,464,467 |
| 株式 | 24,836,057,316 | 71,886,451,715 |
| 投資信託受益証券 | 194,514,816 | - |

| | | |
|-------------|----------------|----------------|
| 投資証券 | 82,733,525 | 182,573,552 |
| 派生商品評価勘定 | 40,481,007 | 5,538,592 |
| 未収入金 | 17,059,397 | 14,903,462 |
| 未収配当金 | 52,474,696 | 119,128,252 |
| 差入委託証拠金 | 1,231,600,954 | 5,097,065,037 |
| 流動資産合計 | 26,734,095,055 | 78,813,956,783 |
| 資産合計 | 26,734,095,055 | 78,813,956,783 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | - | 34,398,870 |
| 未払金 | - | 61,181,876 |
| 未払解約金 | 12,078,565 | 13,066,519 |
| 未払利息 | 52 | 1,185 |
| 流動負債合計 | 12,078,617 | 108,648,450 |
| 負債合計 | 12,078,617 | 108,648,450 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 14,716,094,785 | 46,209,335,149 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 12,005,921,653 | 32,495,973,184 |
| 元本等合計 | 26,722,016,438 | 78,705,308,333 |
| 純資産合計 | 26,722,016,438 | 78,705,308,333 |
| 負債純資産合計 | 26,734,095,055 | 78,813,956,783 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

（貸借対照表に関する注記）

| | | 2019年 3月22日現在 | 2019年 9月24日現在 |
|----------------------------|---------------------------|-----------------|-----------------|
| 1. | 期首 | 2018年10月 5日 | 2019年 3月23日 |
| | 期首元本額 | 10,818,347,776円 | 14,716,094,785円 |
| | 期首からの追加設定元本額 | 4,194,999,978円 | 31,742,724,343円 |
| | 期首からの一部解約元本額 | 297,252,969円 | 249,483,979円 |
| | 元本の内訳 | | |
| | 日興五大陸株式ファンド | 1,843,221,102円 | 1,915,936,305円 |
| | インデックスファンド海外新興国（エマージング）株式 | 8,726,067,908円 | 9,814,924,389円 |
| インデックスファンド新興国株式（適格機関投資家向け） | 3,976,737,166円 | 3,943,743,124円 | |
| グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け） | 170,068,609円 | 30,534,731,331円 | |
| 計 | 14,716,094,785円 | 46,209,335,149円 | |
| 2. | 受益権の総数 | 14,716,094,785口 | 46,209,335,149口 |

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

| | 自 2018年10月 5日 至 2019年 3月22日 | 自 2019年 3月23日 至 2019年 9月24日 |
|-----------------------|---|--------------------------------|
| 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 | 同左 |
| 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。 | 同左 |
| 金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。 | 同左 |

金融商品の時価等に関する事項

| | 2019年 3月22日現在 | 2019年 9月24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)

(2019年 3月22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 | 218,566,414 |
| 投資信託受益証券 | 18,305,798 |
| 投資証券 | 7,477,970 |
| 合計 | 207,738,586 |

(2019年 9月24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 | 358,432,281 |
| 投資証券 | 1,373,409 |
| 合計 | 359,805,690 |

(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)

(2019年 3月22日現在)

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|------|----------------|---------------|-------|---------------|------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | 1,569,922,221 | - | 1,610,403,228 | 40,481,007 |
| | 合計 | 1,569,922,221 | - | 1,610,403,228 | 40,481,007 |

(2019年 9月24日現在)

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|------|----------------|---------------|-------|---------------|------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | 7,696,375,997 | - | 7,672,120,978 | 24,255,019 |
| | 合計 | 7,696,375,997 | - | 7,672,120,978 | 24,255,019 |

(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)

(2019年 3月22日現在)

該当事項はありません。

（2019年 9月24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 | 2,534,883,693 | - | 2,530,231,000 | 4,652,693 |
| | 米ドル | 1,046,609,000 | - | 1,044,464,000 | 2,145,000 |
| | 香港ドル | 910,649,100 | - | 908,926,000 | 1,723,100 |
| | 台湾ドル | 510,823,813 | - | 510,090,000 | 733,813 |
| | カタールリアル | 34,000,900 | - | 33,879,000 | 121,900 |
| | アラブディルハム | 32,800,880 | - | 32,872,000 | 71,120 |
| | 売建 | 510,823,813 | - | 510,776,379 | 47,434 |
| | 米ドル | 510,823,813 | - | 510,776,379 | 47,434 |
| 合計 | | 3,045,707,506 | - | 3,041,007,379 | 4,605,259 |

（注）1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

| | |
|---------------|---------------|
| 2019年 3月22日現在 | 2019年 9月24日現在 |
|---------------|---------------|

| | | | |
|--------------|-----------|--------------|-----------|
| 1口当たり純資産額 | 1.8158円 | 1口当たり純資産額 | 1.7032円 |
| (1万口当たり純資産額) | (18,158円) | (1万口当たり純資産額) | (17,032円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|--------------------------|-------------------------------------|---------|------------|--------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| 米ドル | ECOPETROL SA-SPONSORED ADR | 14,120 | 17.46 | 246,535.20 | |
| | GAZPROM PAO-SPON ADR | 660,410 | 7.15 | 4,725,893.96 | |
| | INNER MONGOLIA YITAI COAL-B | 95,100 | 0.91 | 87,396.90 | |
| | LUKOIL PJSC-SPON-ADR | 49,235 | 85.00 | 4,184,975.00 | |
| | NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S | 11,426 | 211.60 | 2,417,741.60 | |
| | PETROLEO BRASILEIRO S.A.-ADR | 50,000 | 14.56 | 728,000.00 | |
| | PETROLEO BRASILEIRO-SPON ADR | 65,150 | 13.10 | 853,465.00 | |
| | ROSNEFT PJSC-REG S GDR | 156,940 | 6.67 | 1,047,103.68 | |
| | SURGUTNEFTEGAS-SP ADR | 149,650 | 5.48 | 820,830.25 | |
| | TATNEFT-SPONSORED-ADR | 32,399 | 69.70 | 2,258,210.30 | |
| | TRANSPORTADOR GAS SUR-SP B-ADR | 7,300 | 8.43 | 61,539.00 | |
| | ULTRAPAR PARTICPAC-SPON ADR | 73,960 | 4.36 | 322,465.60 | |
| | YPF S.A.-SPONSORED-ADR | 16,050 | 8.99 | 144,289.50 | |
| | CEMEX SAB-SPONS ADR PART CER | 71,984 | 4.03 | 290,095.52 | |
| | CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR | 31,300 | 15.20 | 475,760.00 | |
| | CIA SIDERURGICA NAACL-SP ADR | 84,270 | 3.40 | 286,518.00 | |
| | GERDAU SA -SPON ADR | 106,500 | 3.12 | 332,280.00 | |
| | MAGNITOGORSK IRON & STEEL WORKS-GDR | 26,850 | 8.16 | 219,096.00 | |
| | MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR | 79,614 | 25.55 | 2,034,137.70 | |
| | NOVOLIPET STEEL-GDR REG S | 17,930 | 22.36 | 400,914.80 | |
| | PHOSAGRO PJSC REG S-GDR | 21,430 | 13.20 | 282,876.00 | |
| | POLYUS PJSC-REG S-GDR | 7,640 | 59.70 | 456,108.00 | |
| | QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR | 10,820 | 27.90 | 301,878.00 | |
| SEVERSTAL - GDR REG S | 31,120 | 14.85 | 462,132.00 | | |
| SOUTHERN COPPER CORP(US) | 11,480 | 34.57 | 396,863.60 | | |
| SUZANO SA - SPON ADR | 6,268 | 15.80 | 99,034.40 | | |

| | | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| VALE SA-SP ADR | 114,870 | 11.47 | 1,317,558.90 | |
| EMBRAER SA ADR | 17,770 | 18.35 | 326,079.50 | |
| 51JOB INC-ADR | 2,490 | 71.35 | 177,661.50 | |
| DP WORLD PLC | 21,110 | 14.20 | 299,762.00 | |
| GRUPO AEROPORTUARIO PAC-ADR | 3,470 | 96.67 | 335,444.90 | |
| GRUPO AEROPORTUARIO SUR-ADR | 1,660 | 158.00 | 262,280.00 | |
| LATAM AIRLINES GROUP-SP -ADR | 27,480 | 8.85 | 243,198.00 | |
| ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR | 38,350 | 21.03 | 806,500.50 | |
| NIO INC - ADR | 64,750 | 2.72 | 176,120.00 | |
| HUAZHU GROUP LTD-ADR | 15,700 | 34.27 | 538,039.00 | |
| NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP-ADR | 16,970 | 113.00 | 1,917,610.00 | |
| TAL EDUCATION GROUP- ADR | 46,450 | 36.02 | 1,673,129.00 | |
| YUM CHINA HOLDINGS INC | 42,950 | 45.58 | 1,957,661.00 | |
| 58.COM INC-ADR | 11,840 | 53.88 | 637,939.20 | |
| AUTOHOME INC-ADR | 7,190 | 93.66 | 673,415.40 | |
| BAIDU INC - SPON ADR | 34,760 | 102.37 | 3,558,381.20 | |
| GRUPO TELEVISA SA-SPONS ADR | 47,910 | 10.64 | 509,762.40 | |
| IQIYI INC-ADR | 15,800 | 18.08 | 285,664.00 | |
| MOMO INC-SPON-ADR | 18,480 | 34.72 | 641,625.60 | |
| NETEASE INC-ADR | 8,455 | 266.70 | 2,254,948.50 | |
| SINA CORP | 7,650 | 42.15 | 322,447.50 | |
| TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR | 11,400 | 13.40 | 152,760.00 | |
| WEIBO CORP-SPON-ADR | 6,364 | 47.57 | 302,735.48 | |
| YY INC-ADR | 7,290 | 62.00 | 451,980.00 | |
| ALIBABA GROUP HOLDING-SP-ADR | 174,550 | 176.98 | 30,891,859.00 | |
| BAOZUN INC-SPN-ADR | 5,100 | 45.25 | 230,775.00 | |
| CTIP.COM INTERNATIONAL-ADR | 50,590 | 32.04 | 1,620,903.60 | |
| JD.COM INC-ADR | 91,770 | 30.33 | 2,783,384.10 | |
| PINDUODUO INC-ADR | 22,850 | 33.82 | 772,787.00 | |
| VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR | 53,250 | 9.43 | 502,147.50 | |
| CIA BRASILEIRA-SP ADR PREF | 19,330 | 19.72 | 381,187.60 | |
| MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS | 47,670 | 13.69 | 652,840.65 | |
| X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR | 15,870 | 34.59 | 548,943.30 | |
| AMBEV SA-ADR | 254,550 | 4.65 | 1,183,657.50 | |
| BRF SA-ADR | 54,120 | 9.24 | 500,068.80 | |

| | | | | | |
|--------|----------------------------------|-----------|--------|----------------|------------------|
| | CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR | 7,080 | 22.49 | 159,229.20 | |
| | COCA-COLA FEMSA SAB-SP ADR | 5,600 | 62.08 | 347,648.00 | |
| | EMBOTELLADORA ANDINA-ADR B | 1,400 | 19.07 | 26,698.00 | |
| | FOMENTO ECONOMICO MEX-SP ADR | 4,370 | 94.94 | 414,887.80 | |
| | HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR | 6,400 | 20.48 | 131,072.00 | |
| | BANCO BRADESCO-ADR | 122,930 | 8.12 | 998,191.60 | |
| | BANCO DE CHILE-ADR | 3,613 | 28.61 | 103,367.93 | |
| | BANCO MACRO SA-ADR | 5,500 | 23.55 | 129,525.00 | |
| | BANCO SANTANDER BRASIL-ADS | 42,450 | 10.42 | 442,329.00 | |
| | BANCO SANTANDER-CHILE-ADR | 10,073 | 28.41 | 286,173.93 | |
| | BANCOLOMBIA S.A. -SPONS ADR | 11,660 | 50.83 | 592,677.80 | |
| | BBVA ARGENTINA SA-ADR | 6,700 | 4.21 | 28,207.00 | |
| | CREDICORP LTD | 8,455 | 207.70 | 1,756,103.50 | |
| | GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORE-ADR | 5,250 | 7.57 | 39,742.50 | |
| | GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR | 12,300 | 11.87 | 146,001.00 | |
| | ITAU UNIBANCO H-SPON PRF ADR-ADR | 115,220 | 8.25 | 950,565.00 | |
| | SBERBANK-SPONSORED ADR | 324,960 | 14.54 | 4,724,918.40 | |
| | VTB BANK OJSC-GDR-REG S | 279,630 | 1.30 | 365,476.41 | |
| | NOAH HOLDINGS LTD-SPON-ADR | 4,950 | 30.57 | 151,321.50 | |
| | SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B | 160,680 | 1.14 | 183,817.92 | |
| | GDS HOLDINGS LTD - ADR | 7,550 | 42.74 | 322,687.00 | |
| | GLOBANT SA | 4,130 | 91.43 | 377,605.90 | |
| | AMERICA MOVIL-SPN CL L-ADR | 67,900 | 14.97 | 1,016,463.00 | |
| | MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR | 69,692 | 8.33 | 580,534.36 | |
| | TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR | 11,100 | 9.72 | 107,892.00 | |
| | TELEF BRASIL-ADR | 49,024 | 12.91 | 632,899.84 | |
| | TIM PARTICIPACOES SA-ADR | 14,350 | 14.17 | 203,339.50 | |
| | CEMIG SA -SPONS ADR | 92,300 | 3.35 | 309,205.00 | |
| | CIA SANEAMIENTO BASICO DE-ADR | 40,780 | 11.64 | 474,679.20 | |
| | ENEL AMERICAS SA-ADR | 30,438 | 8.94 | 272,115.72 | |
| | ENEL CHILE SA-ADR | 13,300 | 4.36 | 57,988.00 | |
| | PAMPA ENERGIA SA-SPON-ADR | 8,500 | 15.94 | 135,490.00 | |
| 米ドル小計 | | 4,818,040 | | 100,296,250.65 | (10,800,903,232) |
| メキシコペソ | CEMEX SAB-CPO | 1,206,203 | 7.84 | 9,456,631.52 | |

| | | | | |
|------------------------------|-----------|--------|-----------------------------------|--|
| GRUPO MEXICO SA-SER B | 411,678 | 47.16 | 19,414,734.48 | |
| INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV | 20,610 | 266.02 | 5,482,672.20 | |
| ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV | 180,165 | 38.39 | 6,916,534.35 | |
| ALFA S.A.B. -A | 344,300 | 17.83 | 6,138,869.00 | |
| GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1 | 77,400 | 60.34 | 4,670,316.00 | |
| GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B | 7,900 | 188.84 | 1,491,836.00 | |
| GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B | 5,950 | 308.08 | 1,833,076.00 | |
| PROMOTORA Y OPERADORA DE INF | 26,670 | 179.59 | 4,789,665.30 | |
| ALSEA SAB DE CV | 92,400 | 45.26 | 4,182,024.00 | |
| GRUPO TELEVISA SAB | 49,700 | 41.43 | 2,059,071.00 | |
| MEGACABLE HOLDINGS-CPO | 33,800 | 81.03 | 2,738,814.00 | |
| EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1 | 18,200 | 110.06 | 2,003,092.00 | |
| WALMART DE MEXICO -SER V | 618,700 | 55.16 | 34,127,492.00 | |
| ARCA CONTINENTAL SAB DE CV | 54,000 | 107.28 | 5,793,120.00 | |
| COCA-COLA FEMSA SAB DE CV | 12,400 | 121.28 | 1,503,872.00 | |
| FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD | 190,700 | 184.98 | 35,275,686.00 | |
| GRUMA S.A.B. -B | 32,650 | 207.41 | 6,771,936.50 | |
| GRUPO BIMBO SAB- SERIES A | 189,000 | 37.90 | 7,163,100.00 | |
| KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A | 184,370 | 39.99 | 7,372,956.30 | |
| GRUPO FINANCIERO BANORTE-0 | 321,300 | 109.25 | 35,102,025.00 | |
| GRUPO FINANCIERO INBURSA-0 | 271,200 | 26.30 | 7,132,560.00 | |
| AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L | 2,706,400 | 14.67 | 39,702,888.00 | |
| INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N | 63,900 | 79.05 | 5,051,295.00 | |
| メキシコペソ小計 | 7,119,596 | | 256,174,266.65 (1,416,643,694) | |
| ブラジルリアル | | | | |
| COSAN SA | 22,600 | 52.81 | 1,193,506.00 | |
| PETROBRAS - PETROLEO BRAS | 260,560 | 30.45 | 7,934,052.00 | |
| PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | 387,000 | 27.48 | 10,634,760.00 | |
| ULTRAPAR PARTICIPACOES SA | 18,280 | 18.25 | 333,610.00 | |
| BRASKEM SA-PREF A | 19,100 | 32.83 | 627,053.00 | |
| CIA SIDERURGICA NACIONAL | 7,800 | 14.47 | 112,866.00 | |
| GERDAU SA-PREF | 34,600 | 13.21 | 457,066.00 | |
| KLABIN SA - UNIT | 83,400 | 15.37 | 1,281,858.00 | |
| SUZANO SA | 48,647 | 32.99 | 1,604,864.53 | |
| VALE SA | 268,139 | 48.10 | 12,897,485.90 | |

| | | | | |
|-------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| EMBRAER SA | 16,000 | 19.12 | 305,920.00 | |
| WEG SA | 107,586 | 24.20 | 2,603,581.20 | |
| CCR SA | 154,320 | 17.10 | 2,638,872.00 | |
| LOCALIZA RENT A CAR | 72,461 | 44.44 | 3,220,166.84 | |
| RUMO SA | 139,900 | 23.92 | 3,346,408.00 | |
| KROTON EDUCACIONAL SA | 173,708 | 11.43 | 1,985,482.44 | |
| B2W CIA DIGITAL | 24,500 | 47.29 | 1,158,605.00 | |
| B2W CIA DIGITAL-RCT | 2,493 | 47.00 | 117,171.00 | |
| LOJAS AMERICANAS SA-PRF | 96,692 | 19.55 | 1,890,328.60 | |
| LOJAS RENNER S.A. | 96,720 | 49.45 | 4,782,804.00 | |
| MAGAZINE LUIZA SA | 69,400 | 35.99 | 2,497,706.00 | |
| PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA | 80,700 | 27.30 | 2,203,110.00 | |
| ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC | 42,500 | 21.39 | 909,075.00 | |
| CIA BRASILEIRA DE DIS-PRF | 1,450 | 82.45 | 119,552.50 | |
| RAIA DROGASIL SA | 28,960 | 93.80 | 2,716,448.00 | |
| AMBEV SA | 312,300 | 19.41 | 6,061,743.00 | |
| BRF SA | 16,200 | 38.75 | 627,750.00 | |
| JBS SA | 132,900 | 30.70 | 4,080,030.00 | |
| M DIAS BRANCO SA | 11,350 | 35.50 | 402,925.00 | |
| NATURA COSMETICOS SA | 43,400 | 36.06 | 1,565,004.00 | |
| NOTRE DAME INTERMED PAR SA | 42,100 | 54.13 | 2,278,873.00 | |
| HYPERMARCAS SA | 45,800 | 33.48 | 1,533,384.00 | |
| BANCO BRADESCO S.A. | 144,522 | 31.64 | 4,572,676.08 | |
| BANCO BRADESCO SA-PRF | 377,378 | 34.25 | 12,925,196.50 | |
| BANCO DO BRASIL S.A. | 106,600 | 47.28 | 5,040,048.00 | |
| BANCO SAN. BRASIL-UNIT | 9,700 | 43.91 | 425,927.00 | |
| ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF | 480,854 | 34.64 | 16,656,782.56 | |
| ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PRF | 545,641 | 13.10 | 7,147,897.10 | |
| B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO | 247,683 | 44.86 | 11,111,059.38 | |
| BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT | 26,400 | 57.00 | 1,504,800.00 | |
| BB SEGURIDADE PARTICIPACOES | 86,500 | 34.53 | 2,986,845.00 | |
| IRB BRASIL RESSEGUROS SA | 28,600 | 111.88 | 3,199,768.00 | |
| PORTO SEGURO SA | 11,200 | 58.50 | 655,200.00 | |
| SUL AMERICA SA - UNITS | 27,462 | 45.00 | 1,235,790.00 | |
| BR MALLS PARTICIPACOES SA | 113,197 | 14.45 | 1,635,696.65 | |

| | | | | | |
|---------|----------------------------------|------------|-----------|------------------|-----------------|
| | MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS | 33,200 | 28.70 | 952,840.00 | |
| | CIELO SA | 158,788 | 8.61 | 1,367,164.68 | |
| | TELEFONICA BRASIL S.A. -PREF | 6,830 | 54.00 | 368,820.00 | |
| | TIM PARTICIPACOES SA | 19,905 | 11.87 | 236,272.35 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRAS | 28,100 | 40.69 | 1,143,389.00 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B | 28,500 | 42.65 | 1,215,525.00 | |
| | CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF | 19,399 | 14.20 | 275,465.80 | |
| | CIA SANEAMENTO BASICO DE SP | 2,160 | 49.08 | 106,012.80 | |
| | ENERGISA SA-UNITS | 23,000 | 50.47 | 1,160,810.00 | |
| | ENGIE BRASIL ENERGIA SA | 24,150 | 44.66 | 1,078,539.00 | |
| | EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD | 19,760 | 101.41 | 2,003,861.60 | |
| | ブラジルリアル小計 | 5,431,095 | | 163,128,447.51 | (4,216,870,368) |
| チリペソ | EMPRESAS COPEC SA | 55,420 | 7,070.00 | 391,819,400.00 | |
| | EMPRESAS CMPC SA | 116,000 | 1,749.90 | 202,988,400.00 | |
| | SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B-PRF | 2,020 | 20,189.00 | 40,781,780.00 | |
| | LATAM AIRLINES GROUP SA | 5,300 | 6,415.10 | 34,000,030.00 | |
| | S.A.C.I. FALABELLA | 99,150 | 4,222.00 | 418,611,300.00 | |
| | CENCOSUD SA | 160,950 | 1,220.20 | 196,391,190.00 | |
| | EMBOTELLADORA ANDINA-PRF B | 34,300 | 2,325.00 | 79,747,500.00 | |
| | BANCO DE CHILE | 4,825,584 | 103.66 | 500,220,037.44 | |
| | BANCO DE CREDITO E INVERSION | 5,644 | 45,601.00 | 257,372,044.00 | |
| | BANCO SANTANDER CHILE SA | 4,284,000 | 51.30 | 219,769,200.00 | |
| | ITAU CORPBANCA | 14,437,300 | 5.57 | 80,459,072.90 | |
| | EMPRESA NACIONAL DE TELECOM | 14,040 | 6,425.00 | 90,207,000.00 | |
| | AGUAS ANDINAS SA-A | 252,500 | 403.16 | 101,797,900.00 | |
| | COLBUN SA | 1,450,600 | 136.00 | 197,281,600.00 | |
| | ENEL AMERICAS SA | 2,889,721 | 128.13 | 370,259,951.73 | |
| | ENEL CHILE SA | 3,904,500 | 64.50 | 251,840,250.00 | |
| | チリペソ小計 | 32,537,029 | | 3,433,546,656.07 | (511,598,451) |
| コロンビアペソ | ECOPETROL SA | 353,800 | 3,000.00 | 1,061,400,000.00 | |
| | CEMENTOS ARGOS SA | 62,590 | 7,470.00 | 467,547,300.00 | |
| | GRUPO ARGOS SA | 36,760 | 17,660.00 | 649,181,600.00 | |
| | BANCOLOMBIA SA | 23,700 | 40,120.00 | 950,844,000.00 | |

| | | | | | |
|-----------|----------------------------------|-----------|-----------|------------------|---------------|
| | BANCOLOMBIA SA-PRF | 10,200 | 43,800.00 | 446,760,000.00 | |
| | GRUPO AVAL ACCIONES-PRF | 603,000 | 1,315.00 | 792,945,000.00 | |
| | GRUPO DE INV SURAMERICANA | 32,450 | 32,760.00 | 1,063,062,000.00 | |
| | GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF-PRF | 12,800 | 30,660.00 | 392,448,000.00 | |
| | INTERCONEXION ELECTRICA SA | 45,200 | 19,500.00 | 881,400,000.00 | |
| コロンビアペソ小計 | | 1,180,500 | | 6,705,587,900.00 | (209,884,901) |
| ユーロ | MOTOR OIL (HELLAS) SA | 9,780 | 20.98 | 205,184.40 | |
| | TITAN CEMENT INTERNATIONAL T | 3,050 | 18.76 | 57,218.00 | |
| | OPAP SA | 31,630 | 9.60 | 303,648.00 | |
| | JUMBO SA | 12,650 | 16.73 | 211,634.50 | |
| | ALPHA BANK AE | 166,300 | 1.67 | 278,885.10 | |
| | EUROBANK ERGASIAS SA | 346,200 | 0.85 | 294,270.00 | |
| | NATIONAL BANK OF GREECE | 53,100 | 2.71 | 144,007.20 | |
| | HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA | 28,100 | 12.73 | 357,713.00 | |
| ユーロ小計 | | 650,810 | | 1,852,560.20 | (219,213,448) |
| 英ポンド | POLYMETAL INTERNATIONAL PLC | 29,080 | 11.52 | 335,001.60 | |
| 英ポンド小計 | | 29,080 | | 335,001.60 | (44,856,714) |
| トルコリラ | TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE | 17,070 | 135.00 | 2,304,450.00 | |
| | EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK | 168,717 | 6.53 | 1,101,722.01 | |
| | ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI | 29,700 | 18.54 | 550,638.00 | |
| | KOC HOLDING AS | 74,124 | 17.99 | 1,333,490.76 | |
| | TURK SISE VE CAM FABRIKALARI | 114,370 | 4.48 | 512,377.60 | |
| | TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS | 18,300 | 23.04 | 421,632.00 | |
| | TURK HAVA YOLLARI AO | 53,350 | 11.40 | 608,190.00 | |
| | FORD OTOMOTIV SANAYI AS | 7,220 | 57.95 | 418,399.00 | |
| | ARCELIK A.S. | 23,500 | 18.40 | 432,400.00 | |
| | BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS | 47,260 | 49.40 | 2,334,644.00 | |
| | ANADOLU EFES BIRACILIK | 25,981 | 22.40 | 581,974.40 | |
| | AKBANK T.A.S. | 321,339 | 7.36 | 2,365,055.04 | |
| | TURKIYE GARANTI BANKASI | 331,190 | 9.33 | 3,090,002.70 | |
| | TURKIYE IS BANKASI-C | 241,904 | 5.79 | 1,400,624.16 | |
| | HACI OMER SABANCI HOLDING | 82,253 | 8.89 | 731,229.17 | |

| | | | | | |
|----------------|----------------------------------|-----------|-----------|----------------|---------------|
| | TURKCELL ILETISIM HIZMET AS | 119,056 | 12.85 | 1,529,869.60 | |
| トルコリラ小計 | | 1,675,334 | | 19,716,698.44 | (371,265,431) |
| チェココルナ | KOMERCNI BANKA AS | 11,200 | 812.00 | 9,094,400.00 | |
| | MONETA MONEY BANK AS | 63,400 | 73.00 | 4,628,200.00 | |
| | CEZ AS | 17,880 | 514.00 | 9,190,320.00 | |
| チェココルナ小計 | | 92,480 | | 22,912,920.00 | (104,712,044) |
| ハンガリーフォ リント | MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL | 48,490 | 2,978.00 | 144,403,220.00 | |
| | RICHTER GEDEON NYRT | 16,250 | 4,994.00 | 81,152,500.00 | |
| | OTP BANK PLC | 28,235 | 12,650.00 | 357,172,750.00 | |
| ハンガリーフォリント小計 | | 92,975 | | 582,728,470.00 | (205,761,422) |
| ポーランドズロ チ | GRUPA LOTOS SA | 11,550 | 86.46 | 998,613.00 | |
| | POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN | 38,890 | 96.80 | 3,764,552.00 | |
| | POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I | 160,835 | 4.87 | 783,266.45 | |
| | JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S | 4,750 | 24.08 | 114,380.00 | |
| | KGHM POLSKA MIEDZ SA | 16,380 | 78.64 | 1,288,123.20 | |
| | CCC SA | 5,300 | 123.20 | 652,960.00 | |
| | LPP SA | 178 | 8,235.00 | 1,465,830.00 | |
| | CD PROJEKT SA | 7,600 | 243.40 | 1,849,840.00 | |
| | CYFROWY POLSAT SA | 39,850 | 25.54 | 1,017,769.00 | |
| | DINO POLSKA SA | 5,890 | 153.60 | 904,704.00 | |
| | ALIOR BANK SA | 7,370 | 39.34 | 289,935.80 | |
| | BANK MILLENNIUM SA | 48,750 | 5.86 | 285,918.75 | |
| | BANK PEKAO SA | 19,112 | 102.00 | 1,949,424.00 | |
| | MBANK SA | 1,160 | 328.00 | 380,480.00 | |
| | PKO BANK POLSKI SA | 105,605 | 38.70 | 4,086,913.50 | |
| | SANTANDER BANK POLSKA SA | 3,940 | 309.20 | 1,218,248.00 | |
| | POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA | 81,130 | 37.36 | 3,031,016.80 | |
| | ORANGE POLSKA SA | 97,755 | 5.68 | 555,737.17 | |
| | POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA | 115,430 | 8.22 | 948,834.60 | |
| ポーランドズロチ小計 | | 771,475 | | 25,586,546.27 | (690,069,152) |
| 香港ドル | CHINA COAL ENERGY CO - H | 251,000 | 3.25 | 815,750.00 | |

| | | | | |
|------------------------------|-----------|-------|---------------|--|
| CHINA OILFIELD SERVICES-H | 216,000 | 9.85 | 2,127,600.00 | |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H | 3,101,300 | 4.74 | 14,700,162.00 | |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO - H | 414,000 | 16.22 | 6,715,080.00 | |
| CNOOC LTD | 2,139,000 | 12.42 | 26,566,380.00 | |
| PETROCHINA CO LTD-H | 2,601,000 | 4.13 | 10,742,130.00 | |
| YANZHOU COAL MINING CO-H | 300,000 | 8.32 | 2,496,000.00 | |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD | 579,000 | 2.50 | 1,447,500.00 | |
| ANGANG STEEL CO LTD-H | 132,600 | 2.92 | 387,192.00 | |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H | 152,500 | 46.05 | 7,022,625.00 | |
| BBMG CORP-H | 347,000 | 2.33 | 808,510.00 | |
| CHINA HONGQIAO GROUP LTD | 150,500 | 5.13 | 772,065.00 | |
| CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H | 570,000 | 2.50 | 1,425,000.00 | |
| CHINA NATIONAL BUILDING MA-H | 428,000 | 7.08 | 3,030,240.00 | |
| CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD | 52,000 | 2.91 | 151,320.00 | |
| CHINA RESOURCES CEMENT | 264,000 | 7.97 | 2,104,080.00 | |
| CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD | 146,400 | 3.17 | 464,088.00 | |
| JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H | 149,000 | 9.27 | 1,381,230.00 | |
| LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN | 128,000 | 4.20 | 537,600.00 | |
| MAANSHAN IRON & STEEL-H | 236,000 | 2.94 | 693,840.00 | |
| MMG LTD | 376,000 | 1.87 | 703,120.00 | |
| NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS | 207,000 | 6.70 | 1,386,900.00 | |
| SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H | 452,500 | 2.30 | 1,040,750.00 | |
| ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H | 101,500 | 9.65 | 979,475.00 | |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD | 699,750 | 2.84 | 1,987,290.00 | |
| AVICHINA INDUSTRY & TECH-H | 447,000 | 4.00 | 1,788,000.00 | |
| BOC AVIATION LTD | 26,900 | 73.35 | 1,973,115.00 | |
| CHINA COMMUNICATIONS CONST-H | 510,000 | 6.45 | 3,289,500.00 | |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H | 324,000 | 4.43 | 1,435,320.00 | |
| CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS | 227,000 | 28.80 | 6,537,600.00 | |
| CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H | 200,000 | 9.09 | 1,818,000.00 | |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-H | 528,000 | 5.05 | 2,666,400.00 | |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INT | 298,000 | 7.82 | 2,330,360.00 | |
| CITIC LTD | 718,000 | 9.99 | 7,172,820.00 | |
| CRRG CORP LTD- H | 474,000 | 5.64 | 2,673,360.00 | |
| FOSUN INTERNATIONAL LTD | 391,500 | 10.30 | 4,032,450.00 | |

| | | | | |
|------------------------------|---------|-------|--------------|--|
| HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS | 92,000 | 16.00 | 1,472,000.00 | |
| METALLURGICAL CORP OF CHIN-H | 448,000 | 1.80 | 806,400.00 | |
| SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H | 308,000 | 2.50 | 770,000.00 | |
| SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD | 62,000 | 14.76 | 915,120.00 | |
| SINOPEC ENGINEERING GROUP-H | 101,000 | 5.13 | 518,130.00 | |
| SINOTRUK HONG KONG LTD | 61,500 | 11.58 | 712,170.00 | |
| WEICHAH POWER CO LTD-H | 217,400 | 11.86 | 2,578,364.00 | |
| XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-H | 118,278 | 9.61 | 1,136,651.58 | |
| ZHUZHOU CRRR TIMES ELECTRIC | 60,000 | 33.10 | 1,986,000.00 | |
| CHINA EVERBRIGHT INTL LTD | 446,518 | 6.09 | 2,719,294.62 | |
| COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD | 144,000 | 22.40 | 3,225,600.00 | |
| GREENTOWN SERVICE GROUP CO L | 104,000 | 7.62 | 792,480.00 | |
| AIR CHINA LTD-H | 336,000 | 7.11 | 2,388,960.00 | |
| BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H | 214,000 | 6.96 | 1,489,440.00 | |
| CHINA COSCO HOLDINGS-H | 265,500 | 2.88 | 764,640.00 | |
| CHINA EASTERN AIRLINES CO-H | 96,000 | 3.89 | 373,440.00 | |
| CHINA MERCHANTS PORT HOLDING | 135,000 | 12.18 | 1,644,300.00 | |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H | 150,000 | 4.80 | 720,000.00 | |
| COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H | 110,000 | 4.25 | 467,500.00 | |
| COSCO SHIPPING PORTS LTD | 170,000 | 6.28 | 1,067,600.00 | |
| JIANGSU EXPRESS CO LTD-H | 166,000 | 10.50 | 1,743,000.00 | |
| SHENZHEN INTL HOLDINGS | 103,000 | 14.88 | 1,532,640.00 | |
| SINOTRANS LIMITED-H | 318,000 | 2.51 | 798,180.00 | |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H | 145,000 | 6.80 | 986,000.00 | |
| BAIC MOTOR CORP LTD-H | 205,000 | 4.80 | 984,000.00 | |
| BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE | 324,000 | 8.70 | 2,818,800.00 | |
| BYD CO LTD-H | 77,500 | 40.60 | 3,146,500.00 | |
| CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT | 322,000 | 2.22 | 714,840.00 | |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H | 402,000 | 7.79 | 3,131,580.00 | |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H | 59,200 | 21.65 | 1,281,680.00 | |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT | 620,000 | 12.90 | 7,998,000.00 | |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY-H | 464,000 | 5.31 | 2,463,840.00 | |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H | 372,845 | 7.75 | 2,889,548.75 | |
| NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD | 93,000 | 6.73 | 625,890.00 | |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | 131,000 | 63.30 | 8,292,300.00 | |

| | | | | |
|--------------------------------|-----------|--------|----------------|--|
| BOSIDENG INTL HLDGS LTD | 362,000 | 3.36 | 1,216,320.00 | |
| HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD | 183,000 | 19.98 | 3,656,340.00 | |
| LI NING CO LTD | 242,000 | 21.95 | 5,311,900.00 | |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP | 92,500 | 103.00 | 9,527,500.00 | |
| CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN | 55,000 | 10.86 | 597,300.00 | |
| HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI | 42,000 | 34.50 | 1,449,000.00 | |
| ALIBABA PICTURES GROUP LTD | 1,920,000 | 1.34 | 2,572,800.00 | |
| CHINA LITERATURE LTD | 18,800 | 26.35 | 495,380.00 | |
| TENCENT HOLDINGS LTD | 701,600 | 335.80 | 235,597,280.00 | |
| GOME RETAIL HOLDINGS LTD | 1,107,160 | 0.71 | 786,083.60 | |
| HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD | 2,680,000 | 0.12 | 332,320.00 | |
| MEITUAN DIANPING-CLASS B | 122,200 | 76.05 | 9,293,310.00 | |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS | 57,000 | 24.15 | 1,376,550.00 | |
| SUN ART RETAIL GROUP | 327,500 | 8.20 | 2,685,500.00 | |
| CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS | 273,000 | 2.38 | 649,740.00 | |
| CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS | 90,000 | 0.42 | 37,800.00 | |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO | 348,000 | 29.50 | 10,266,000.00 | |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDIN | 177,000 | 41.15 | 7,283,550.00 | |
| DALI FOODS GROUP CO LTD | 306,000 | 5.04 | 1,542,240.00 | |
| TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO | 194,000 | 11.14 | 2,161,160.00 | |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD-H | 54,000 | 48.50 | 2,619,000.00 | |
| UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS | 162,000 | 8.57 | 1,388,340.00 | |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD | 671,000 | 6.17 | 4,140,070.00 | |
| YIHAI INTERNATIONAL HOLDING | 59,000 | 45.50 | 2,684,500.00 | |
| HENGAN INTL GROUP CO LTD | 90,500 | 52.15 | 4,719,575.00 | |
| ALIBABA HEALTH INFORMATION T | 422,000 | 7.09 | 2,991,980.00 | |
| SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H | 272,000 | 8.18 | 2,224,960.00 | |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H | 89,100 | 14.76 | 1,315,116.00 | |
| SINOPHARM GROUP CO-H | 144,000 | 27.20 | 3,916,800.00 | |
| 3SBIO INC | 198,000 | 12.40 | 2,455,200.00 | |
| CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING | 181,000 | 8.96 | 1,621,760.00 | |
| CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC | 157,500 | 7.70 | 1,212,750.00 | |
| CHINA TRADITIONAL CHINESE ME | 332,000 | 3.70 | 1,228,400.00 | |
| CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT | 560,000 | 14.98 | 8,388,800.00 | |
| GENSCRIPT BIOTECH CORP | 118,000 | 16.80 | 1,982,400.00 | |

| | | | |
|--------------------------------------|------------|-------|---------------|
| LUYE PHARMA GROUP LTD | 168,500 | 6.08 | 1,024,480.00 |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H | 71,500 | 22.80 | 1,630,200.00 |
| SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS | 213,000 | 1.36 | 289,680.00 |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL | 817,500 | 10.36 | 8,469,300.00 |
| SSY GROUP LTD | 152,000 | 6.33 | 962,160.00 |
| TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H | 88,000 | 7.89 | 694,320.00 |
| WUXI APPTec CO LTD-H | 16,320 | 83.95 | 1,370,064.00 |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | 69,500 | 79.90 | 5,553,050.00 |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA | 3,670,000 | 3.10 | 11,377,000.00 |
| BANK OF CHINA LTD - H | 9,591,000 | 3.11 | 29,828,010.00 |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-H | 1,156,245 | 5.18 | 5,989,349.10 |
| CHINA CITIC BANK - H | 1,275,000 | 4.20 | 5,355,000.00 |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 11,903,920 | 5.96 | 70,947,363.20 |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H | 399,000 | 3.34 | 1,332,660.00 |
| CHINA MERCHANTS BANK - H | 469,150 | 36.30 | 17,030,145.00 |
| CHINA MINSHENG BANKING-H | 737,140 | 5.33 | 3,928,956.20 |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H | 246,000 | 4.13 | 1,015,980.00 |
| IND & COMM BK OF CHINA - H | 8,105,575 | 5.26 | 42,635,324.50 |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H | 960,000 | 4.75 | 4,560,000.00 |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H | 858,000 | 1.62 | 1,389,960.00 |
| CHINA DING YI FENG HOLDINGS | 40,000 | 23.08 | 923,200.00 |
| CHINA EVERBRIGHT LTD | 80,000 | 9.24 | 739,200.00 |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO-H | 360,500 | 4.24 | 1,528,520.00 |
| CHINA HUARONG ASSET MANAGEME | 1,012,000 | 1.24 | 1,254,880.00 |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H | 121,600 | 15.56 | 1,892,096.00 |
| CITIC SECURITIES CO LTD-H | 287,500 | 15.08 | 4,335,500.00 |
| FAR EAST HORIZON LTD | 272,000 | 7.18 | 1,952,960.00 |
| GF SECURITIES CO LTD-H | 155,800 | 8.44 | 1,314,952.00 |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H | 124,600 | 12.48 | 1,555,008.00 |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-H | 452,000 | 8.52 | 3,851,040.00 |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-H | 199,000 | 12.22 | 2,431,780.00 |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-H | 946,000 | 18.62 | 17,614,520.00 |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD | 340,800 | 30.20 | 10,292,160.00 |
| CHINA REINSURANCE GROUP CO-H | 628,000 | 1.28 | 803,840.00 |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLD | 178,540 | 18.02 | 3,217,290.80 |

| | | | | |
|---------------------------------|-----------|-------|---------------|--|
| NEW CHINA LIFE INSURANCE CO-H | 90,300 | 31.70 | 2,862,510.00 | |
| PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H | 1,101,000 | 3.21 | 3,534,210.00 | |
| PICC PROPERTY & CASUALTY -H | 840,001 | 9.25 | 7,770,009.25 | |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 685,000 | 91.15 | 62,437,750.00 | |
| ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H | 35,200 | 19.04 | 670,208.00 | |
| AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD | 246,000 | 9.43 | 2,319,780.00 | |
| CHINA AOYUAN GROUP LTD | 106,000 | 9.07 | 961,420.00 | |
| CHINA EVERGRANDE GROUP | 213,000 | 16.74 | 3,565,620.00 | |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP | 660,000 | 4.70 | 3,102,000.00 | |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVEST | 448,320 | 24.90 | 11,163,168.00 | |
| CHINA RESOURCES LAND LTD | 323,777 | 32.70 | 10,587,507.90 | |
| CHINA VANKE CO LTD-H | 166,226 | 27.50 | 4,571,215.00 | |
| CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD | 268,000 | 4.59 | 1,230,120.00 | |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO | 890,713 | 9.98 | 8,889,315.74 | |
| FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD | 220,000 | 6.56 | 1,443,200.00 | |
| GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H | 106,800 | 12.12 | 1,294,416.00 | |
| KAISA GROUP HOLDINGS LTD | 223,000 | 3.51 | 782,730.00 | |
| KWG GROUP HOLDINGS LTD | 116,000 | 6.69 | 776,040.00 | |
| LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L | 242,000 | 11.34 | 2,744,280.00 | |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD | 208,000 | 29.50 | 6,136,000.00 | |
| SHANGHAI INDUSTRIAL URBAN DE(N) | 62,000 | 1.07 | 66,340.00 | |
| SHENZHEN INVESTMENT LTD | 262,000 | 2.98 | 780,760.00 | |
| SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD | 181,000 | 23.20 | 4,199,200.00 | |
| SHUI ON LAND LTD | 472,500 | 1.62 | 765,450.00 | |
| SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD | 304,000 | 2.70 | 820,800.00 | |
| SOHO CHINA LTD | 239,500 | 2.40 | 574,800.00 | |
| SUNAC CHINA HOLDINGS LTD | 285,000 | 31.80 | 9,063,000.00 | |
| YUEXIU PROPERTY CO LTD | 606,000 | 1.77 | 1,072,620.00 | |
| YUZHOU PROPERTIES CO | 127,000 | 3.23 | 410,210.00 | |
| KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR | 327,000 | 8.41 | 2,750,070.00 | |
| KINGSOFT CORP LTD | 129,000 | 18.40 | 2,373,600.00 | |
| TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H | 99,000 | 16.32 | 1,615,680.00 | |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC | 80,000 | 43.10 | 3,448,000.00 | |
| BYD ELECTRONIC INTL CO LTD | 92,000 | 11.68 | 1,074,560.00 | |
| CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H | 168,000 | 4.96 | 833,280.00 | |

| | | | | | |
|---------|-------------------------------|-------------|--------|------------------|------------------|
| | KINGBOARD HOLDINGS LTD | 60,500 | 20.25 | 1,225,125.00 | |
| | KINGBOARD LAMINATES HOLDING | 144,000 | 7.06 | 1,016,640.00 | |
| | LEGEND HOLDINGS CORP-H | 59,600 | 17.48 | 1,041,808.00 | |
| | LENOVO GROUP LTD | 874,000 | 5.38 | 4,702,120.00 | |
| | MEITU INC | 168,000 | 1.85 | 310,800.00 | |
| | SUNNY OPTICAL TECH | 85,700 | 114.00 | 9,769,800.00 | |
| | XIAOMI CORP-CLASS B | 997,200 | 9.32 | 9,293,904.00 | |
| | ZTE CORP-H | 84,200 | 21.25 | 1,789,250.00 | |
| | CHINA MOBILE LTD | 757,200 | 64.60 | 48,915,120.00 | |
| | CHINA TELECOM CORP LTD | 1,683,000 | 3.57 | 6,008,310.00 | |
| | CHINA TOWER CORP LTD-H | 5,264,000 | 1.85 | 9,738,400.00 | |
| | CHINA UNICOM HONG KONG LTD | 827,882 | 8.27 | 6,846,584.14 | |
| | BEIJING ENTERPRISES HLDGS | 80,500 | 36.50 | 2,938,250.00 | |
| | BEIJING ENTERPRISES WATER GR | 776,000 | 4.28 | 3,321,280.00 | |
| | CGN POWER CO LTD-H | 1,589,000 | 2.03 | 3,225,670.00 | |
| | CHINA GAS HOLDINGS LTD | 232,000 | 29.75 | 6,902,000.00 | |
| | CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H | 311,000 | 4.57 | 1,421,270.00 | |
| | CHINA POWER INTERNATIONAL | 508,000 | 1.69 | 858,520.00 | |
| | CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD | 108,000 | 38.55 | 4,163,400.00 | |
| | CHINA RESOURCES POWER HOLDIN | 223,000 | 10.64 | 2,372,720.00 | |
| | DATANG INTL POWER GEN CO-H | 196,000 | 1.68 | 329,280.00 | |
| | ENN ENERGY HOLDINGS LTD | 92,500 | 82.15 | 7,598,875.00 | |
| | GUANGDONG INVEST | 354,000 | 15.84 | 5,607,360.00 | |
| | HUADIAN POWER INTL CORP-H | 254,000 | 3.07 | 779,780.00 | |
| | HUANENG POWER INTL INC-H | 548,000 | 4.22 | 2,312,560.00 | |
| | HUANENG RENEWABLES CORP-H | 472,000 | 2.70 | 1,274,400.00 | |
| | KUNLUN ENERGY CO LTD | 438,000 | 6.81 | 2,982,780.00 | |
| | TOWNGAS CHINA CO LTD | 70,000 | 6.00 | 420,000.00 | |
| | HANERGY THIN FILM POWER GROU | 240,000 | 3.54 | 849,600.00 | |
| | HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD | 64,000 | 16.40 | 1,049,600.00 | |
| | SEMICONDUCTOR MANUFACTURING | 397,500 | 10.42 | 4,141,950.00 | |
| | XINYI SOLAR HOLDINGS LTD | 376,000 | 5.16 | 1,940,160.00 | |
| 香港ドル小計 | | 113,712,860 | | 1,122,812,600.38 | (15,427,445,129) |
| マレーシアリン | DIALOG GROUP BHD | 416,300 | 3.46 | 1,440,398.00 | |

ギット

| | | | | |
|------------------------------|---------|--------|--------------|--|
| PETRONAS DAGANGAN BHD | 26,000 | 23.30 | 605,800.00 | |
| PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD | 280,600 | 7.54 | 2,115,724.00 | |
| PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN | 181,000 | 4.84 | 876,040.00 | |
| GAMUDA BHD | 160,100 | 3.55 | 568,355.00 | |
| HAP SENG CONSOLIDATED | 70,000 | 9.85 | 689,500.00 | |
| IJM CORP BHD | 242,000 | 2.19 | 529,980.00 | |
| SIME DARBY BERHAD | 369,720 | 2.30 | 850,356.00 | |
| AIRASIA GROUP BHD | 128,000 | 1.81 | 231,680.00 | |
| MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD | 166,100 | 8.61 | 1,430,121.00 | |
| MISC BHD | 174,700 | 7.75 | 1,353,925.00 | |
| WESTPORTS HOLDINGS BHD | 54,000 | 4.15 | 224,100.00 | |
| GENTING BHD | 246,000 | 5.94 | 1,461,240.00 | |
| GENTING MALAYSIA BHD | 337,100 | 3.10 | 1,045,010.00 | |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD | 13,600 | 19.42 | 264,112.00 | |
| FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD | 16,700 | 35.38 | 590,846.00 | |
| GENTING PLANTATIONS BHD | 15,500 | 9.91 | 153,605.00 | |
| IOI CORPORATION BERHAD | 219,675 | 4.38 | 962,176.50 | |
| KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD | 51,400 | 23.10 | 1,187,340.00 | |
| NESTLE (MALAYSIA) BERHAD | 8,700 | 145.40 | 1,264,980.00 | |
| PPB GROUP BERHAD | 58,980 | 18.26 | 1,076,974.80 | |
| QL RESOURCES BHD | 50,500 | 7.04 | 355,520.00 | |
| SIME DARBY PLANTATION BHD | 244,020 | 4.75 | 1,159,095.00 | |
| HARTALEGA HOLDINGS BHD | 226,800 | 5.26 | 1,192,968.00 | |
| IHH HEALTHCARE BHD | 268,300 | 5.69 | 1,526,627.00 | |
| TOP GLOVE CORP BHD | 153,500 | 4.75 | 729,125.00 | |
| ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD | 78,300 | 3.09 | 241,947.00 | |
| AMMB HOLDINGS BHD | 234,800 | 4.17 | 979,116.00 | |
| CIMB GROUP HOLDINGS BHD | 653,500 | 5.04 | 3,293,640.00 | |
| HONG LEONG BANK BERHAD | 99,900 | 16.34 | 1,632,366.00 | |
| HONG LEONG FINANCIAL GROUP | 26,300 | 16.16 | 425,008.00 | |
| MALAYAN BANKING BHD | 521,950 | 8.72 | 4,551,404.00 | |
| PUBLIC BANK BERHAD | 397,670 | 20.14 | 8,009,073.80 | |
| RHB BANK BHD | 156,659 | 5.65 | 885,123.35 | |
| SIME DARBY PROPERTY BHD | 180,720 | 0.86 | 155,419.20 | |
| SP SETIA BHD | 147,500 | 1.46 | 215,350.00 | |

| | | | | | |
|-------|-----------------------------------|-----------|--------|----------------------------------|--|
| | AXIATA GROUP BERHAD | 335,100 | 4.29 | 1,437,579.00 | |
| | DIGI.COM BHD | 392,300 | 4.72 | 1,851,656.00 | |
| | MAXIS BHD | 281,900 | 5.55 | 1,564,545.00 | |
| | TELEKOM MALAYSIA BHD | 91,000 | 3.48 | 316,680.00 | |
| | PETRONAS GAS BERHAD | 59,700 | 16.42 | 980,274.00 | |
| | TENAGA NASIONAL BERHAD | 367,125 | 13.64 | 5,007,585.00 | |
| | YTL CORP BHD | 379,498 | 0.94 | 358,625.61 | |
| | マレーシアリングット小計 | 8,583,217 | | 55,790,990.26 (1,437,733,819) | |
| タイバーツ | BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR | 534,800 | 11.80 | 6,310,640.00 | |
| | IRPC PCL - NVDR | 999,300 | 3.70 | 3,697,410.00 | |
| | PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR | 161,410 | 124.50 | 20,095,545.00 | |
| | PTT PCL-NVDR | 1,394,700 | 45.75 | 63,807,525.00 | |
| | THAI OIL PCL-NVDR | 130,800 | 69.50 | 9,090,600.00 | |
| | INDORAMA VENTURES PCL-NVDR | 175,000 | 32.25 | 5,643,750.00 | |
| | PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR | 292,645 | 54.00 | 15,802,830.00 | |
| | SIAM CEMENT PCL-NVDR | 92,800 | 416.00 | 38,604,800.00 | |
| | AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR | 547,100 | 72.50 | 39,664,750.00 | |
| | BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-NVDR | 1,029,200 | 10.90 | 11,218,280.00 | |
| | BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR | 799,900 | 13.30 | 10,638,670.00 | |
| | MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR | 410,700 | 36.75 | 15,093,225.00 | |
| | HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR | 689,900 | 16.90 | 11,659,310.00 | |
| | ROBINSON PCL-NVDR | 51,900 | 64.25 | 3,334,575.00 | |
| | BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR | 183,300 | 52.50 | 9,623,250.00 | |
| | CP ALL PCL-NVDR | 726,000 | 80.75 | 58,624,500.00 | |
| | CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR | 500,700 | 26.25 | 13,143,375.00 | |
| | THAI UNION GROUP PCL-NVDR | 326,500 | 16.00 | 5,224,000.00 | |
| | BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR | 1,148,400 | 23.60 | 27,102,240.00 | |
| | BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR | 57,300 | 125.50 | 7,191,150.00 | |
| | BANGKOK BANK-FOREIGN REG | 68,840 | 179.50 | 12,356,780.00 | |
| | KASIKORNBANK PCL-FOREIGN | 146,800 | 164.00 | 24,075,200.00 | |
| | KASIKORNBANK PCL-NVDR | 106,900 | 162.50 | 17,371,250.00 | |
| | KRUNG THAI BANK - NVDR | 422,825 | 17.40 | 7,357,155.00 | |
| | SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR | 95,800 | 117.50 | 11,256,500.00 | |
| | TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR | 806,000 | 1.71 | 1,378,260.00 | |

| | | | | | |
|---------|------------------------------|------------|----------|----------------|-----------------|
| | MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR | 77,500 | 55.25 | 4,281,875.00 | |
| | CENTRAL PATTANA PCL-NVDR | 306,800 | 66.25 | 20,325,500.00 | |
| | LAND & HOUSES PUB - NVDR | 989,900 | 10.00 | 9,899,000.00 | |
| | ADVANCED INFO SERVICE-NVDR | 143,600 | 211.00 | 30,299,600.00 | |
| | INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR | 292,100 | 63.75 | 18,621,375.00 | |
| | TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR | 74,400 | 56.75 | 4,222,200.00 | |
| | TRUE CORP PCL-NVDR | 1,308,200 | 5.25 | 6,868,050.00 | |
| | ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR | 34,300 | 345.00 | 11,833,500.00 | |
| | ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR | 198,700 | 48.00 | 9,537,600.00 | |
| | GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR | 57,800 | 149.50 | 8,641,100.00 | |
| | RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR | 77,700 | 70.50 | 5,477,850.00 | |
| タイパーツ小計 | | 15,460,520 | | 579,373,220.00 | (2,045,187,466) |
| フィリピンペソ | ABOITIZ EQUITY VENTURES INC | 191,400 | 55.65 | 10,651,410.00 | |
| | ALLIANCE GLOBAL GROUP INC | 479,200 | 12.06 | 5,779,152.00 | |
| | AYALA CORPORATION | 33,812 | 889.00 | 30,058,868.00 | |
| | DMCI HOLDINGS INC | 357,000 | 8.80 | 3,141,600.00 | |
| | GT CAPITAL HOLDINGS INC | 12,657 | 860.00 | 10,885,020.00 | |
| | JG SUMMIT HOLDINGS INC | 407,400 | 74.15 | 30,208,710.00 | |
| | SM INVESTMENTS CORP | 33,028 | 1,010.00 | 33,358,280.00 | |
| | INTL CONTAINER TERM SVCS INC | 112,310 | 130.00 | 14,600,300.00 | |
| | JOLLIBEE FOODS CORPORATION | 56,140 | 220.20 | 12,362,028.00 | |
| | UNIVERSAL ROBINA CORP | 129,560 | 166.90 | 21,623,564.00 | |
| | BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN | 85,187 | 90.35 | 7,696,645.45 | |
| | BDO UNIBANK INC | 246,384 | 141.50 | 34,863,336.00 | |
| | METROPOLITAN BANK & TRUST | 183,862 | 67.25 | 12,364,719.50 | |
| | SECURITY BANK CORP | 28,600 | 197.50 | 5,648,500.00 | |
| | METRO PACIFIC INVESTMENTS CO | 1,429,000 | 4.99 | 7,130,710.00 | |
| | AYALA LAND INC | 903,760 | 48.65 | 43,967,924.00 | |
| | MEGAWORLD CORP | 1,132,500 | 4.81 | 5,447,325.00 | |
| | ROBINSONS LAND CO | 142,300 | 25.05 | 3,564,615.00 | |
| | SM PRIME HOLDINGS INC | 1,240,310 | 35.45 | 43,968,989.50 | |
| | GLOBE TELECOM INC | 4,940 | 1,884.00 | 9,306,960.00 | |
| | PLDT INC | 9,380 | 1,112.00 | 10,430,560.00 | |
| | ABOITIZ POWER CORP | 196,500 | 39.95 | 7,850,175.00 | |

| | | | | | |
|------------------------------|-------------------------------|------------|-------------------|--------------------|-----------------|
| | MANILA ELECTRIC COMPANY | 34,900 | 368.00 | 12,843,200.00 | |
| フィリピンペソ小計 | | 7,450,130 | | 377,752,591.45 | (778,170,338) |
| インドネシアルピア | ADARO ENERGY TBK PT | 1,737,200 | 1,370.00 | 2,379,964,000.00 | |
| | BUKIT ASAM TBK PT | 144,000 | 2,400.00 | 345,600,000.00 | |
| | UNITED TRACTORS TBK PT | 182,200 | 22,100.00 | 4,026,620,000.00 | |
| | BARITO PACIFIC TBK PT | 2,640,000 | 965.00 | 2,547,600,000.00 | |
| | INDAH KIAT PULP & PAPER TBK | 379,700 | 6,825.00 | 2,591,452,500.00 | |
| | INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA | 262,000 | 20,600.00 | 5,397,200,000.00 | |
| | PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT | 116,500 | 10,425.00 | 1,214,512,500.00 | |
| | SEMEN GRESIK (PERSERO) PT | 334,000 | 12,500.00 | 4,175,000,000.00 | |
| | JASA MARGA (PERSERO) TBK PT | 144,000 | 5,550.00 | 799,200,000.00 | |
| | ASTRA INTERNATIONAL TBK PT | 2,422,200 | 6,625.00 | 16,047,075,000.00 | |
| | SURYA CITRA MEDIA PT TBK | 606,600 | 1,190.00 | 721,854,000.00 | |
| | CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT | 816,400 | 5,100.00 | 4,163,640,000.00 | |
| | GUDANG GARAM TBK PT | 61,100 | 52,800.00 | 3,226,080,000.00 | |
| | HM SAMPOERNA TBK PT | 898,700 | 2,290.00 | 2,058,023,000.00 | |
| | INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T | 317,400 | 11,875.00 | 3,769,125,000.00 | |
| | PT INDOFOOD SUKSES MAK TBK | 670,400 | 7,650.00 | 5,128,560,000.00 | |
| | PT UNILEVER INDONESIA TBK | 188,500 | 47,300.00 | 8,916,050,000.00 | |
| | KALBE FARMA TBK PT | 3,420,100 | 1,665.00 | 5,694,466,500.00 | |
| | BANK MANDIRI TBK | 2,198,200 | 7,000.00 | 15,387,400,000.00 | |
| | BANK RAKYAT INDONESIA | 6,876,400 | 4,180.00 | 28,743,352,000.00 | |
| | BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO | 339,700 | 2,250.00 | 764,325,000.00 | |
| | PT BANK CENTRAL ASIA | 1,191,400 | 30,125.00 | 35,890,925,000.00 | |
| | PT BANK NEGARA INDONESIA | 867,900 | 7,575.00 | 6,574,342,500.00 | |
| BUMI SERPONG DAMAI PT | 777,300 | 1,385.00 | 1,076,560,500.00 | | |
| PAKUWON JATI TBK PT | 1,510,700 | 675.00 | 1,019,722,500.00 | | |
| TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER | 6,082,100 | 4,250.00 | 25,848,925,000.00 | | |
| PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT | 1,127,700 | 2,280.00 | 2,571,156,000.00 | | |
| インドネシアルピア小計 | | 36,312,400 | | 191,078,731,000.00 | (1,471,306,228) |
| 韓国ウォン | GS HOLDINGS | 4,605 | 50,700.00 | 233,473,500.00 | |
| | S-OIL CORPORATION | 6,205 | 102,500.00 | 636,012,500.00 | |
| | SK INNOVATION CO LTD | 6,667 | 169,500.00 | 1,130,056,500.00 | |

| | | | | |
|------------------------------|--------|------------|------------------|--|
| HANWHA CHEMICAL CORP | 9,120 | 18,100.00 | 165,072,000.00 | |
| HYUNDAI STEEL CO | 7,790 | 39,800.00 | 310,042,000.00 | |
| KOREA ZINC CO LTD | 975 | 435,000.00 | 424,125,000.00 | |
| KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD | 1,400 | 72,400.00 | 101,360,000.00 | |
| LG CHEM LTD | 5,457 | 323,500.00 | 1,765,339,500.00 | |
| LG CHEM LTD-PRF | 690 | 179,500.00 | 123,855,000.00 | |
| LOTTE CHEMICAL CORP | 2,345 | 245,500.00 | 575,697,500.00 | |
| OCI CO LTD | 2,040 | 71,100.00 | 145,044,000.00 | |
| POSCO | 9,805 | 231,000.00 | 2,264,955,000.00 | |
| POSCO CHEMICAL CO LTD | 4,215 | 48,450.00 | 204,216,750.00 | |
| CJ CORP | 1,075 | 84,400.00 | 90,730,000.00 | |
| DAELIM INDUSTRIAL CO LTD | 3,610 | 101,500.00 | 366,415,000.00 | |
| DAEWOO ENGINEERING & CONSTR | 15,576 | 4,785.00 | 74,531,160.00 | |
| DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE | 3,360 | 31,500.00 | 105,840,000.00 | |
| DOOSAN BOBCAT INC | 4,040 | 35,550.00 | 143,622,000.00 | |
| GS ENGINEERING & CONSTRUCT | 8,013 | 33,500.00 | 268,435,500.00 | |
| HANWHA CORPORATION | 6,060 | 25,650.00 | 155,439,000.00 | |
| HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E | 4,469 | 33,200.00 | 148,370,800.00 | |
| HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR | 9,130 | 47,050.00 | 429,566,500.00 | |
| HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL | 1,286 | 356,000.00 | 457,816,000.00 | |
| KCC CORP | 1,040 | 233,000.00 | 242,320,000.00 | |
| KOREA AEROSPACE INDUSTRIES | 7,420 | 41,000.00 | 304,220,000.00 | |
| KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR | 5,217 | 124,500.00 | 649,516,500.00 | |
| LG CORP | 11,760 | 71,600.00 | 842,016,000.00 | |
| LOTTE CORP | 3,094 | 37,650.00 | 116,489,100.00 | |
| POSCO INTERNATIONAL CORP | 5,111 | 19,800.00 | 101,197,800.00 | |
| SAMSUNG C&T CORP | 10,727 | 91,300.00 | 979,375,100.00 | |
| SAMSUNG ENGINEERING CO LTD | 17,990 | 16,950.00 | 304,930,500.00 | |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES | 60,104 | 8,370.00 | 503,070,480.00 | |
| SK HOLDINGS CO LTD | 4,731 | 212,000.00 | 1,002,972,000.00 | |
| S1 CORPORATION | 1,810 | 97,300.00 | 176,113,000.00 | |
| CJ LOGISTICS | 765 | 144,000.00 | 110,160,000.00 | |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD | 2,400 | 154,000.00 | 369,600,000.00 | |
| KOREAN AIR LINES CO LTD | 4,234 | 23,550.00 | 99,710,700.00 | |
| PAN OCEAN CO LTD | 30,200 | 4,705.00 | 142,091,000.00 | |

| | | | | |
|------------------------------|--------|--------------|------------------|--|
| HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO | 11,242 | 30,650.00 | 344,567,300.00 | |
| HANON SYSTEMS | 24,240 | 12,350.00 | 299,364,000.00 | |
| HYUNDAI MOBIS | 8,450 | 251,500.00 | 2,125,175,000.00 | |
| HYUNDAI MOTOR CO | 18,460 | 133,000.00 | 2,455,180,000.00 | |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD | 4,550 | 86,100.00 | 391,755,000.00 | |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF | 1,890 | 76,500.00 | 144,585,000.00 | |
| KIA MOTORS CORPORATION | 31,950 | 46,400.00 | 1,482,480,000.00 | |
| FILA KOREA LTD | 5,520 | 62,100.00 | 342,792,000.00 | |
| HLB INC | 4,860 | 47,350.00 | 230,121,000.00 | |
| LG ELECTRONICS INC | 12,685 | 65,100.00 | 825,793,500.00 | |
| WOONGJIN COWAY CO LTD | 6,190 | 81,400.00 | 503,866,000.00 | |
| KANGWON LAND INC | 16,400 | 29,350.00 | 481,340,000.00 | |
| CHEIL WORLDWIDE INC | 7,330 | 24,650.00 | 180,684,500.00 | |
| KAKAO CORP | 6,205 | 134,500.00 | 834,572,500.00 | |
| NAVER CORP | 16,795 | 157,000.00 | 2,636,815,000.00 | |
| NCSOFT CORP | 1,930 | 522,000.00 | 1,007,460,000.00 | |
| NETMARBLE CORP | 3,620 | 97,900.00 | 354,398,000.00 | |
| PEARL ABYSS CORP | 1,025 | 195,600.00 | 200,490,000.00 | |
| CJ ENM CO LTD | 1,272 | 171,500.00 | 218,148,000.00 | |
| HOTEL SHILLA CO LTD | 4,430 | 83,900.00 | 371,677,000.00 | |
| HYUNDAI DEPT STORE CO | 2,510 | 78,200.00 | 196,282,000.00 | |
| LOTTE SHOPPING CO | 1,062 | 135,000.00 | 143,370,000.00 | |
| SHINSEGAE CO LTD | 922 | 262,000.00 | 241,564,000.00 | |
| BGF RETAIL CO LTD/NEW | 967 | 194,000.00 | 187,598,000.00 | |
| E-MART CO LTD | 3,412 | 115,500.00 | 394,086,000.00 | |
| GS RETAIL CO LTD | 3,820 | 41,250.00 | 157,575,000.00 | |
| CJ CHEILJEDANG CORP | 1,519 | 234,500.00 | 356,205,500.00 | |
| KT&G CORP | 13,725 | 104,000.00 | 1,427,400,000.00 | |
| ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA | 2,446 | 97,900.00 | 239,463,400.00 | |
| OTTOGI CORPORATION | 75 | 589,000.00 | 44,175,000.00 | |
| AMOREPACIFIC CORP | 4,175 | 137,500.00 | 574,062,500.00 | |
| AMOREPACIFIC CORP-PREF | 770 | 72,900.00 | 56,133,000.00 | |
| AMOREPACIFIC GROUP | 2,665 | 65,900.00 | 175,623,500.00 | |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE | 1,120 | 1,263,000.00 | 1,414,560,000.00 | |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH-PRF | 365 | 756,000.00 | 275,940,000.00 | |

| | | | | |
|-------------------------------|---------|------------|-------------------|--|
| CELLTRION HEALTHCARE CO LTD | 7,471 | 51,100.00 | 381,768,100.00 | |
| CELLTRION INC | 11,021 | 171,000.00 | 1,884,591,000.00 | |
| CELLTRION PHARM INC | 820 | 37,400.00 | 30,668,000.00 | |
| HANMI PHARM CO LTD | 536 | 288,500.00 | 154,636,000.00 | |
| HANMI SCIENCE CO LTD | 752 | 41,650.00 | 31,320,800.00 | |
| HELIXMITH CO LTD | 2,360 | 171,400.00 | 404,504,000.00 | |
| MEDY-TOX INC | 404 | 357,600.00 | 144,470,400.00 | |
| SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD | 1,990 | 317,000.00 | 630,830,000.00 | |
| SILLAJEN INC | 5,435 | 9,910.00 | 53,860,850.00 | |
| YUHAN CORP | 1,154 | 227,000.00 | 261,958,000.00 | |
| BNK FINANCIAL GROUP INC | 29,724 | 7,210.00 | 214,310,040.00 | |
| HANA FINANCIAL GROUP | 38,498 | 36,350.00 | 1,399,402,300.00 | |
| INDUSTRIAL BANK OF KOREA | 31,770 | 13,500.00 | 428,895,000.00 | |
| KB FINANCIAL GROUP INC | 51,150 | 43,800.00 | 2,240,370,000.00 | |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD | 55,190 | 42,850.00 | 2,364,891,500.00 | |
| WOORI FINANCIAL GROUP INC | 57,931 | 12,500.00 | 724,137,500.00 | |
| KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO | 4,665 | 75,700.00 | 353,140,500.00 | |
| MERITZ SECURITIES CO LTD | 30,260 | 5,030.00 | 152,207,800.00 | |
| MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD | 46,118 | 7,630.00 | 351,880,340.00 | |
| NH INVESTMENT & SECURITIES C | 18,101 | 12,800.00 | 231,692,800.00 | |
| SAMSUNG CARD CO | 1,690 | 33,950.00 | 57,375,500.00 | |
| SAMSUNG SECURITIES CO LTD | 6,217 | 36,000.00 | 223,812,000.00 | |
| DONGBU INSURANCE CO LTD | 5,150 | 51,400.00 | 264,710,000.00 | |
| HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD | 37,230 | 2,520.00 | 93,819,600.00 | |
| HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO | 8,950 | 26,000.00 | 232,700,000.00 | |
| ORANGE LIFE INSURANCE LTD | 5,860 | 27,300.00 | 159,978,000.00 | |
| SAMSUNG FIRE & MARINE INS | 3,660 | 228,500.00 | 836,310,000.00 | |
| SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD | 8,685 | 72,700.00 | 631,399,500.00 | |
| SAMSUNG SDS CO LTD | 3,940 | 200,500.00 | 789,970,000.00 | |
| LG DISPLAY CO LTD | 25,330 | 14,250.00 | 360,952,500.00 | |
| LG INNOTEK CO LTD | 1,255 | 106,000.00 | 133,030,000.00 | |
| SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO | 6,965 | 103,000.00 | 717,395,000.00 | |
| SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 586,910 | 49,300.00 | 28,934,663,000.00 | |
| SAMSUNG ELECTRONICS-PFD | 101,140 | 40,750.00 | 4,121,455,000.00 | |
| SAMSUNG SDI CO LTD | 6,993 | 237,000.00 | 1,657,341,000.00 | |

| | | | | | |
|---------|------------------------------|-----------|------------|--------------------------------------|--|
| | LG UPLUS CORP. | 17,980 | 13,750.00 | 247,225,000.00 | |
| | SK TELECOM | 2,430 | 241,000.00 | 585,630,000.00 | |
| | KOREA ELECTRIC POWER CORP | 32,990 | 26,350.00 | 869,286,500.00 | |
| | KOREA GAS CORPORATION | 2,248 | 41,100.00 | 92,392,800.00 | |
| | SK HYNIX INC | 67,810 | 82,800.00 | 5,614,668,000.00 | |
| 韓国ウォン小計 | | 1,841,916 | | 96,642,747,420.00 (8,736,504,366) | |
| 台湾ドル | FORMOSA PETROCHEMICAL CORP | 133,080 | 100.00 | 13,308,000.00 | |
| | ASIA CEMENT CORP | 278,978 | 43.15 | 12,037,900.70 | |
| | CHINA STEEL CORP | 1,439,181 | 23.15 | 33,317,040.15 | |
| | FORMOSA CHEMICALS & FIBRE | 423,047 | 89.60 | 37,905,011.20 | |
| | FORMOSA PLASTICS CORP | 557,424 | 96.80 | 53,958,643.20 | |
| | NAN YA PLASTICS CORP | 619,145 | 70.90 | 43,897,380.50 | |
| | TAIWAN CEMENT | 569,819 | 39.75 | 22,650,305.25 | |
| | AIRTAC INTERNATIONAL GROUP | 12,000 | 383.00 | 4,596,000.00 | |
| | FAR EASTERN NEW CENTURY CORP | 466,957 | 28.80 | 13,448,361.60 | |
| | HIWIN TECHNOLOGIES CORP | 23,650 | 275.50 | 6,515,575.00 | |
| | CHINA AIRLINES LTD | 465,000 | 9.21 | 4,282,650.00 | |
| | EVA AIRWAYS CORP | 267,276 | 13.80 | 3,688,408.80 | |
| | EVA AIRWAYS CORP(N) | 7,974 | 13.80 | 110,041.20 | |
| | EVERGREEN MARINE CORP LTD | 175,895 | 13.15 | 2,313,019.25 | |
| | TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP | 259,000 | 36.40 | 9,427,600.00 | |
| | CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD | 226,947 | 45.00 | 10,212,615.00 | |
| | ECLAT TEXTILE COMPANY LTD | 24,254 | 407.00 | 9,871,378.00 | |
| | FENG TAY ENTERPRISE CO LTD | 43,613 | 211.50 | 9,224,149.50 | |
| | FORMOSA TAFFETA CO. | 97,000 | 34.70 | 3,365,900.00 | |
| | GIANT MANUFACTURING | 42,000 | 212.50 | 8,925,000.00 | |
| | NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD | 15,000 | 275.00 | 4,125,000.00 | |
| | POU CHEN | 267,145 | 39.15 | 10,458,726.75 | |
| | RUENTEX INDUSTRIES LTD | 23,400 | 68.10 | 1,593,540.00 | |
| | TATUNG CO LTD | 236,000 | 18.00 | 4,248,000.00 | |
| | HOTAI MOTOR COMPANY LTD | 38,000 | 466.50 | 17,727,000.00 | |
| | PRESIDENT CHAIN STORE CORP | 70,448 | 295.00 | 20,782,160.00 | |
| | STANDARD FOODS CORP | 53,320 | 64.40 | 3,433,808.00 | |
| | UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO | 580,703 | 77.00 | 44,714,131.00 | |

| | | | | |
|-------------------------------------|-----------|--------|----------------|--|
| TAIMED BIOLOGICS INC | 20,000 | 150.00 | 3,000,000.00 | |
| CHANG HWA COMMERCIAL BANK | 697,437 | 21.60 | 15,064,639.20 | |
| CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD | 2,395,746 | 20.90 | 50,071,091.40 | |
| E.SUN FINANCIAL HOLDING CO | 1,234,518 | 26.60 | 32,838,178.80 | |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO | 1,161,220 | 22.20 | 25,779,084.00 | |
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C | 948,947 | 21.25 | 20,165,123.75 | |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT | 1,423,356 | 29.20 | 41,561,995.20 | |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS | 1,301,075 | 12.25 | 15,938,168.75 | |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDING | 1,226,105 | 14.00 | 17,165,470.00 | |
| TAIWAN BUSINESS BANK | 547,657 | 12.80 | 7,010,009.60 | |
| TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL | 1,093,060 | 20.70 | 22,626,342.00 | |
| THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA | 383,000 | 54.80 | 20,988,400.00 | |
| THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA-RTS(N) | 26,161 | 18.80 | 491,826.80 | |
| CHAILEASE HOLDING CO LTD | 155,054 | 128.00 | 19,846,912.00 | |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO | 1,156,257 | 18.85 | 21,795,444.45 | |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO | 877,538 | 41.15 | 36,110,688.70 | |
| CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL | 1,411,715 | 9.39 | 13,256,003.85 | |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD | 320,929 | 25.15 | 8,071,364.35 | |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO | 768,743 | 44.85 | 34,478,123.55 | |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS | 1,400,474 | 9.71 | 13,598,602.54 | |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS(N) | 29,210 | 9.71 | 283,629.10 | |
| HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP | 81,950 | 49.80 | 4,081,110.00 | |
| RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD | 98,613 | 41.95 | 4,136,815.35 | |
| ACER INC | 292,812 | 18.00 | 5,270,616.00 | |
| ADVANTECH CO LTD | 48,216 | 272.50 | 13,138,860.00 | |
| ASUSTEK COMPUTER INC | 78,797 | 211.00 | 16,626,167.00 | |
| AU OPTRONICS CORP | 1,444,994 | 8.35 | 12,065,699.90 | |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD | 92,405 | 231.00 | 21,345,555.00 | |
| CHICONY ELECTRONICS CO LTD | 69,356 | 90.30 | 6,262,846.80 | |
| COMPAL ELECTRONICS | 587,955 | 18.15 | 10,671,383.25 | |
| DELTA ELECTRONICS INC | 249,541 | 146.00 | 36,432,986.00 | |
| FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD | 89,787 | 65.90 | 5,916,963.30 | |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY | 1,520,212 | 74.70 | 113,559,836.40 | |
| INNOLUX CORP | 845,282 | 7.08 | 5,984,596.56 | |
| INVENTEC CORP | 242,162 | 21.80 | 5,279,131.60 | |

| | | | | | |
|--------|------------------------------|------------|----------|-------------------------------------|--|
| | LARGAN PRECISION CO LTD | 12,686 | 4,300.00 | 54,549,800.00 | |
| | LITE-ON TECHNOLOGY CORP | 270,787 | 48.25 | 13,065,472.75 | |
| | MICRO-STAR INTERNATIONAL CO | 101,000 | 92.20 | 9,312,200.00 | |
| | PEGATRON CORP | 284,854 | 54.50 | 15,524,543.00 | |
| | QUANTA COMPUTER INC | 315,416 | 57.80 | 18,231,044.80 | |
| | SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP | 168,120 | 36.85 | 6,195,222.00 | |
| | WALSIN TECHNOLOGY CORP | 30,000 | 161.50 | 4,845,000.00 | |
| | WISTRON CORP | 284,611 | 26.00 | 7,399,886.00 | |
| | WPG HOLDINGS LTD | 214,520 | 39.20 | 8,409,184.00 | |
| | YAGEO CORPORATION | 31,829 | 233.00 | 7,416,157.00 | |
| | ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING | 78,000 | 117.50 | 9,165,000.00 | |
| | CHUNGHWA TELECOM CO LTD | 462,371 | 112.00 | 51,785,552.00 | |
| | FAR EASTONE TELECOMM CO LTD | 203,000 | 73.60 | 14,940,800.00 | |
| | TAIWAN MOBILE CO LTD | 190,188 | 113.50 | 21,586,338.00 | |
| | ASE INDUSTRIAL HOLDING CO LT | 413,387 | 73.10 | 30,218,589.70 | |
| | GLOBALWAFERS CO LTD | 21,700 | 317.00 | 6,878,900.00 | |
| | MEDIATEK INC | 183,432 | 388.00 | 71,171,616.00 | |
| | NANYA TECHNOLOGY CORP | 134,000 | 85.00 | 11,390,000.00 | |
| | NOVATEK MICROELECTRONICS LTD | 63,522 | 184.00 | 11,688,048.00 | |
| | PHISON ELECTRONICS CORP | 15,000 | 289.00 | 4,335,000.00 | |
| | POWERTECH TECHNOLOGY INC | 81,635 | 85.40 | 6,971,629.00 | |
| | REALTEK SEMICONDUCTOR CORP | 51,815 | 228.00 | 11,813,820.00 | |
| | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 3,026,355 | 264.00 | 798,957,720.00 | |
| | UNITED MICROELECTRONICS CORP | 1,579,592 | 13.70 | 21,640,410.40 | |
| | VANGUARD INTERNATIONAL SEMI | 102,000 | 67.60 | 6,895,200.00 | |
| | WIN SEMICONDUCTORS CORP | 36,000 | 292.50 | 10,530,000.00 | |
| | WINBOND ELECTRONICS CORP | 491,000 | 18.65 | 9,157,150.00 | |
| 台湾ドル小計 | | 40,583,360 | | 2,335,125,292.95 (8,102,884,766) | |
| インドルピー | BHARAT PETROLEUM CORP LTD | 71,940 | 450.85 | 32,434,149.00 | |
| | COAL INDIA LTD | 190,280 | 202.70 | 38,569,756.00 | |
| | HINDUSTAN PETROLEUM CORP | 68,980 | 288.45 | 19,897,281.00 | |
| | INDIAN OIL CORP LTD | 268,550 | 142.65 | 38,308,657.50 | |
| | OIL & NATURAL GAS CORP LTD | 295,480 | 136.30 | 40,273,924.00 | |
| | PETRONET LNG LTD | 71,280 | 252.95 | 18,030,276.00 | |

| | | | | |
|------------------------------|---------|-----------|----------------|--|
| RELIANCE INDUSTRIES LTD | 351,992 | 1,239.20 | 436,188,486.40 | |
| AMBUJA CEMENTS LIMITED | 61,560 | 220.55 | 13,577,058.00 | |
| ASIAN PAINTS LTD | 34,860 | 1,802.75 | 62,843,865.00 | |
| GRASIM INDUSTRIES LTD | 39,030 | 759.30 | 29,635,479.00 | |
| HINDALCO INDUSTRIES LIMITED | 114,000 | 200.00 | 22,800,000.00 | |
| JSW STEEL LTD | 97,140 | 243.70 | 23,673,018.00 | |
| PIDILITE INDUSTRIES LTD | 14,370 | 1,481.35 | 21,286,999.50 | |
| SHREE CEMENT LTD | 785 | 19,918.30 | 15,635,865.50 | |
| TATA STEEL LIMITED | 49,442 | 377.35 | 18,656,938.70 | |
| ULTRATECH CEMENT LTD | 11,550 | 4,391.10 | 50,717,205.00 | |
| UPL LTD | 73,775 | 580.85 | 42,852,208.75 | |
| VEDANTA LTD | 248,270 | 157.90 | 39,201,833.00 | |
| ASHOK LEYLAND LTD | 118,570 | 74.65 | 8,851,250.50 | |
| HAVELLS INDIA LTD | 34,400 | 731.60 | 25,167,040.00 | |
| LARSEN & TOUBRO LTD | 55,240 | 1,528.50 | 84,434,340.00 | |
| ADANI PORTS AND SPECIAL ECON | 77,470 | 410.95 | 31,836,296.50 | |
| CONTAINER CORP OF INDIA LTD | 20,012 | 584.25 | 11,692,011.00 | |
| INTERGLOBE AVIATION LTD | 12,860 | 1,803.80 | 23,196,868.00 | |
| BAJAJ AUTO LTD | 11,850 | 2,995.15 | 35,492,527.50 | |
| BHARAT FORGE LTD | 28,220 | 452.35 | 12,765,317.00 | |
| BOSCH LTD | 850 | 14,807.20 | 12,586,120.00 | |
| EICHER MOTORS LTD | 1,940 | 19,239.35 | 37,324,339.00 | |
| HERO MOTOCORP LTD | 13,220 | 2,820.35 | 37,285,027.00 | |
| MAHINDRA & MAHINDRA LIMITED | 92,030 | 565.00 | 51,996,950.00 | |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD | 13,390 | 6,897.85 | 92,362,211.50 | |
| MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD | 81,940 | 115.90 | 9,496,846.00 | |
| TATA MOTORS LTD | 169,028 | 127.90 | 21,618,681.20 | |
| PAGE INDUSTRIES LTD | 535 | 23,820.15 | 12,743,780.25 | |
| TITAN CO LTD | 39,050 | 1,311.80 | 51,225,790.00 | |
| ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE | 58,610 | 271.60 | 15,918,476.00 | |
| AVENUE SUPERMARTS LTD | 13,540 | 1,917.00 | 25,956,180.00 | |
| BRITANNIA INDUSTRIES LTD | 8,490 | 3,053.65 | 25,925,488.50 | |
| ITC LTD | 420,845 | 254.85 | 107,252,348.25 | |
| NESTLE INDIA LIMITED | 2,645 | 13,713.20 | 36,271,414.00 | |
| UNITED SPIRITS LTD | 36,810 | 648.50 | 23,871,285.00 | |

| | | | | |
|------------------------------|---------|----------|----------------|--|
| DABUR INDIA LTD | 69,800 | 440.80 | 30,767,840.00 | |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD | 39,555 | 661.40 | 26,161,677.00 | |
| HINDUSTAN UNILEVER LIMITED | 77,110 | 2,039.75 | 157,285,122.50 | |
| MARICO LTD | 53,060 | 386.40 | 20,502,384.00 | |
| AUROBINDO PHARMA LTD | 35,320 | 616.95 | 21,790,674.00 | |
| CIPLA LTD | 45,390 | 448.90 | 20,375,571.00 | |
| DIVI'S LABORATORIES LTD | 9,550 | 1,611.70 | 15,391,735.00 | |
| DR. REDDY'S LABORATORIES | 13,740 | 2,767.25 | 38,022,015.00 | |
| GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD | 15,850 | 352.55 | 5,587,917.50 | |
| LUPIN LTD | 28,760 | 732.05 | 21,053,758.00 | |
| PIRAMAL ENTERPRISES LTD | 10,136 | 1,845.70 | 18,708,015.20 | |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUS | 108,844 | 409.45 | 44,566,175.80 | |
| AXIS BANK LTD | 231,320 | 725.50 | 167,822,660.00 | |
| HOUSING DEVELOPMENT FINANCE | 202,625 | 2,162.00 | 438,075,250.00 | |
| ICICI BANK LTD | 288,337 | 446.30 | 128,684,803.10 | |
| INDIABULLS HOUSING FINANCE L | 39,490 | 437.70 | 17,284,773.00 | |
| LIC HOUSING FINANCE LTD | 31,330 | 429.70 | 13,462,501.00 | |
| STATE BANK OF INDIA | 225,910 | 313.75 | 70,879,262.50 | |
| YES BANK LTD | 200,100 | 55.45 | 11,095,545.00 | |
| BAJAJ FINANCE LTD | 22,380 | 4,023.75 | 90,051,525.00 | |
| MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS | 28,130 | 357.10 | 10,045,223.00 | |
| REC LTD | 114,850 | 131.45 | 15,097,032.50 | |
| SHRIRAM TRANSPORT FINANCE | 20,220 | 1,167.30 | 23,602,806.00 | |
| BAJAJ FINSERV LTD | 4,140 | 8,297.75 | 34,352,685.00 | |
| HDFC LIFE INSURANCE CO LTD | 57,000 | 540.75 | 30,822,750.00 | |
| ICICI LOMBARD GENERAL INSURA | 15,550 | 1,224.90 | 19,047,195.00 | |
| HCL TECHNOLOGIES LTD | 65,760 | 1,032.90 | 67,923,504.00 | |
| INFOSYS LTD | 425,208 | 764.35 | 325,007,734.80 | |
| TATA CONSULTANCY SVCS LTD | 110,540 | 2,015.80 | 222,826,532.00 | |
| TECH MAHINDRA LTD | 55,640 | 682.80 | 37,990,992.00 | |
| WIPRO LTD | 142,859 | 239.35 | 34,193,301.65 | |
| BHARTI AIRTEL LTD | 247,165 | 348.00 | 86,013,420.00 | |
| BHARTI INFRATEL LTD | 29,190 | 263.80 | 7,700,322.00 | |
| VODAFONE IDEA LTD | 896,042 | 5.60 | 5,017,835.20 | |
| GAIL INDIA LTD | 232,656 | 141.30 | 32,874,292.80 | |

| | | | | | |
|------------|-------------------------------|-----------|--------|------------------|-----------------|
| | NTPC LIMITED | 278,922 | 116.05 | 32,368,898.10 | |
| | POWER GRID CORP OF INDIA LTD | 213,770 | 188.30 | 40,252,891.00 | |
| | TATA POWER CO LTD | 117,440 | 67.20 | 7,891,968.00 | |
| インドルピー小計 | | 8,178,518 | | 4,150,452,175.20 | (6,350,191,828) |
| パキスタンルピー | OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD | 38,400 | 120.50 | 4,627,200.00 | |
| | HABIB BANK LTD | 107,900 | 120.92 | 13,047,268.00 | |
| | MCB BANK LTD | 76,300 | 168.00 | 12,818,400.00 | |
| パキスタンルピー小計 | | 222,600 | | 30,492,868.00 | (21,040,078) |
| カタールリアル | QATAR FUEL QSC | 51,740 | 23.27 | 1,203,989.80 | |
| | MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI | 480,800 | 2.98 | 1,432,784.00 | |
| | INDUSTRIES QATAR | 237,000 | 11.03 | 2,614,110.00 | |
| | COMMERCIAL BANK PQSC | 206,130 | 4.50 | 927,585.00 | |
| | MASRAF AL RAYAN | 489,600 | 3.54 | 1,733,184.00 | |
| | QATAR ISLAMIC BANK | 146,230 | 15.82 | 2,313,358.60 | |
| | QATAR NATIONAL BANK | 553,970 | 19.35 | 10,719,319.50 | |
| | QATAR INSURANCE CO | 173,330 | 3.39 | 587,588.70 | |
| | BARWA REAL ESTATE CO | 224,800 | 3.36 | 755,328.00 | |
| | OORED00 QPSC | 113,600 | 7.22 | 820,192.00 | |
| | QATAR ELECTRICITY & WATER CO | 73,200 | 15.25 | 1,116,300.00 | |
| カタールリアル小計 | | 2,750,400 | | 24,223,739.60 | (713,631,368) |
| エジプトポンド | ELSWEDY ELECTRIC CO | 61,300 | 12.65 | 775,445.00 | |
| | EASTERN CO | 140,525 | 17.41 | 2,446,540.25 | |
| | COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK | 167,738 | 75.80 | 12,714,540.40 | |
| エジプトポンド小計 | | 369,563 | | 15,936,525.65 | (105,340,434) |
| 南アフリカランド | EXXARO RESOURCES LTD | 25,820 | 130.91 | 3,380,096.20 | |
| | ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD | 7,590 | 919.90 | 6,982,041.00 | |
| | ANGLOGOLD ASHANTI LTD | 48,322 | 305.64 | 14,769,136.08 | |
| | GOLD FIELDS LTD | 106,720 | 78.01 | 8,325,227.20 | |
| | KUMBA IRON ORE LTD | 6,000 | 388.87 | 2,333,220.00 | |
| | SAPPI LIMITED | 55,025 | 37.68 | 2,073,342.00 | |
| | SASOL LTD | 73,485 | 277.00 | 20,355,345.00 | |

| | | | | |
|------------------------------|---------|----------|----------------|--|
| BIDVEST GROUP LTD | 32,912 | 193.05 | 6,353,661.60 | |
| MULTICHOICE GROUP LTD | 50,010 | 119.20 | 5,961,192.00 | |
| FOSCHINI GROUP LTD/THE | 24,805 | 161.59 | 4,008,239.95 | |
| MR PRICE GROUP LTD | 26,810 | 159.32 | 4,271,369.20 | |
| NASPERS LTD-N SHS | 53,810 | 2,385.03 | 128,338,464.30 | |
| NASPERS LTD-N SHS(N) | 19,384 | 2,385.03 | 46,231,421.52 | |
| TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD | 50,100 | 54.89 | 2,749,989.00 | |
| WOOLWORTHS HOLDINGS LTD | 130,785 | 56.70 | 7,415,509.50 | |
| BID CORP LTD | 42,649 | 322.70 | 13,762,832.30 | |
| CLICKS GROUP LTD | 37,830 | 213.80 | 8,088,054.00 | |
| PICK'N PAY STORES LTD | 40,760 | 61.20 | 2,494,512.00 | |
| SHOPRITE HOLDINGS LTD | 55,870 | 124.49 | 6,955,256.30 | |
| SPAR GROUP LIMITED/THE | 21,520 | 191.13 | 4,113,117.60 | |
| TIGER BRANDS LTD | 19,630 | 214.00 | 4,200,820.00 | |
| LIFE HEALTHCARE GROUP | 158,313 | 22.82 | 3,612,702.66 | |
| NETCARE LTD | 149,830 | 17.00 | 2,547,110.00 | |
| ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT | 44,031 | 90.92 | 4,003,298.52 | |
| ABSA GROUP LTD | 96,210 | 161.60 | 15,547,536.00 | |
| CAPITEC BANK HOLDINGS LTD | 5,320 | 1,277.97 | 6,798,800.40 | |
| NEDBANK GROUP LTD | 43,640 | 232.95 | 10,165,938.00 | |
| STANDARD BANK GROUP LTD | 161,133 | 179.17 | 28,870,199.61 | |
| FIRSTRAND LTD | 421,080 | 64.14 | 27,008,071.20 | |
| INVESTEC LTD | 43,820 | 84.50 | 3,702,790.00 | |
| PSG GROUP LTD | 24,320 | 213.25 | 5,186,240.00 | |
| REINET INVESTMENTS SCA | 18,970 | 275.61 | 5,228,321.70 | |
| REMGRO LTD | 63,610 | 171.89 | 10,933,922.90 | |
| RMB HOLDINGS LTD | 101,150 | 78.10 | 7,899,815.00 | |
| DISCOVERY LTD | 42,417 | 114.24 | 4,845,718.08 | |
| LIBERTY HOLDINGS LTD | 12,270 | 114.13 | 1,400,375.10 | |
| MOMENTUM METROPOLITAN HOLDIN | 87,429 | 18.80 | 1,643,665.20 | |
| OLD MUTUAL LTD | 647,080 | 19.51 | 12,624,530.80 | |
| RAND MERCHANT INVESTMENT HOL | 105,710 | 30.17 | 3,189,270.70 | |
| SANLAM LTD | 241,461 | 75.10 | 18,133,721.10 | |
| NEPI ROCKCASTLE PLC | 43,400 | 135.72 | 5,890,248.00 | |
| MTN GROUP LTD | 210,082 | 100.08 | 21,025,006.56 | |

| | | | | | |
|--------------------------|------------------------------|-----------|------------|----------------|-----------------|
| | TELKOM SA SOC LTD | 31,700 | 74.30 | 2,355,310.00 | |
| | VODACOM GROUP LTD | 82,605 | 122.22 | 10,095,983.10 | |
| 南アフリカランド小計 | | 3,765,418 | | 515,871,421.38 | (3,734,909,090) |
| アラブディルハム | ABU DHABI COMMERCIAL BANK | 350,050 | 8.02 | 2,807,401.00 | |
| | DUBAI ISLAMIC BANK | 201,233 | 5.25 | 1,056,473.25 | |
| | FIRST ABU DHABI BANK PJSC | 327,655 | 15.04 | 4,927,931.20 | |
| | ALDAR PROPERTIES PJSC | 468,400 | 2.16 | 1,011,744.00 | |
| | EMAAR DEVELOPMENT PJSC | 147,100 | 4.11 | 604,581.00 | |
| | EMAAR MALLS PJSC | 328,900 | 1.89 | 621,621.00 | |
| | EMAAR PROPERTIES PJSC | 419,300 | 4.83 | 2,025,219.00 | |
| | EMIRATES TELECOM GROUP CO | 207,071 | 16.52 | 3,420,812.92 | |
| アラブディルハム小計 | | 2,449,709 | | 16,475,783.37 | (483,564,241) |
| 香港・オフショア 人民元 | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A | 194,217 | 5.05 | 980,795.85 | |
| | CHINA SHENHUA ENERGY CO-A | 22,300 | 19.22 | 428,606.00 | |
| | PETROCHINA CO LTD-A | 123,400 | 6.36 | 784,824.00 | |
| | SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A | 63,500 | 8.88 | 563,880.00 | |
| | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A | 33,100 | 41.28 | 1,366,368.00 | |
| | BAOSHAN IRON & STEEL CO-A | 87,000 | 6.12 | 532,440.00 | |
| | CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A | 146,200 | 3.67 | 536,554.00 | |
| | HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A | 44,900 | 15.40 | 691,460.00 | |
| | INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A | 140,792 | 1.49 | 209,780.08 | |
| | RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A | 31,967 | 10.91 | 348,759.97 | |
| | SHANDONG GOLD MINING CO LT-A | 13,160 | 37.63 | 495,210.80 | |
| | WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A | 25,300 | 44.95 | 1,137,235.00 | |
| | ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A | 9,100 | 15.18 | 138,138.00 | |
| | ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A | 87,500 | 3.45 | 301,875.00 | |
| | CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A | 87,700 | 9.71 | 851,567.00 | |
| | CHINA RAILWAY GROUP LTD-A | 149,900 | 6.17 | 924,883.00 | |
| | CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A | 189,262 | 5.88 | 1,112,860.56 | |
| | CHINA STATE CONSTRUCTION-A | 320,000 | 5.51 | 1,763,200.00 | |
| | CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A | 5,600 | 72.99 | 408,744.00 | |
| | CRRC CORP LTD-A | 180,400 | 7.60 | 1,371,040.00 | |
| NARI TECHNOLOGY CO LTD-A | 35,200 | 20.68 | 727,936.00 | | |

| | | | | |
|------------------------------|---------|----------|--------------|--|
| POWER CONSTRUCTION CORP OF-A | 97,102 | 4.74 | 460,263.48 | |
| SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A | 63,800 | 14.44 | 921,272.00 | |
| WEICHAH POWER CO LTD-A | 45,700 | 11.64 | 531,948.00 | |
| ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A | 16,400 | 22.80 | 373,920.00 | |
| ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A | 49,000 | 5.74 | 281,260.00 | |
| CHINA EASTERN AIRLINES CO-A | 74,800 | 5.36 | 400,928.00 | |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A | 65,600 | 6.71 | 440,176.00 | |
| DAQIN RAILWAY CO LTD-A | 113,300 | 7.60 | 861,080.00 | |
| S F HOLDING CO LTD-A | 9,000 | 39.23 | 353,070.00 | |
| SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A | 7,338 | 80.65 | 591,809.70 | |
| SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A | 26,200 | 5.99 | 156,938.00 | |
| SPRING AIRLINES CO LTD-A | 7,000 | 44.31 | 310,170.00 | |
| YUNDA HOLDING CO LTD-A | 11,300 | 34.60 | 390,980.00 | |
| BYD CO LTD -A | 15,000 | 49.18 | 737,700.00 | |
| CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A | 13,100 | 23.91 | 313,221.00 | |
| HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS-A | 24,071 | 23.72 | 570,964.12 | |
| SAIC MOTOR CORP LTD-A | 59,400 | 24.27 | 1,441,638.00 | |
| GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A | 14,002 | 57.71 | 808,055.42 | |
| HAIER SMART HOME CO LTD-A | 46,500 | 15.67 | 728,655.00 | |
| MIDEA GROUP CO LTD-A | 16,125 | 52.08 | 839,790.00 | |
| TCL CORP-A | 103,300 | 3.81 | 393,573.00 | |
| CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A | 14,900 | 92.79 | 1,382,571.00 | |
| SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A | 62,498 | 6.95 | 434,361.10 | |
| SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A | 11,100 | 27.08 | 300,588.00 | |
| FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A | 111,900 | 5.35 | 598,665.00 | |
| SUNING.COM CO LTD-A | 70,960 | 10.55 | 748,628.00 | |
| YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A | 72,941 | 8.95 | 652,821.95 | |
| FOSHAN HAITIAN FLAVOURING-A | 17,144 | 110.10 | 1,887,554.40 | |
| HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A | 20,977 | 24.10 | 505,545.70 | |
| INNER MONGOLIA YILI INDUS-A | 28,500 | 28.39 | 809,115.00 | |
| JIANGSU YANGHE BREWERY -A | 11,450 | 106.28 | 1,216,906.00 | |
| KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A | 7,174 | 1,149.00 | 8,242,926.00 | |
| LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A | 11,200 | 87.65 | 981,680.00 | |
| MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A | 13,200 | 72.46 | 956,472.00 | |
| NEW HOPE LIUHE CO LTD-A | 32,075 | 18.12 | 581,199.00 | |

| | | | | |
|------------------------------|---------|--------|--------------|--|
| SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A | 6,600 | 76.96 | 507,936.00 | |
| TONGWEI CO LTD-A | 29,600 | 13.95 | 412,920.00 | |
| WENS FOODSTUFFS GROUP CO-A | 40,500 | 38.20 | 1,547,100.00 | |
| WULIANGYE YIBIN CO LTD-A | 25,100 | 134.85 | 3,384,735.00 | |
| AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A | 23,600 | 35.29 | 832,844.00 | |
| HUADONG MEDICINE CO LTD-A | 13,240 | 28.21 | 373,500.40 | |
| LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A | 13,573 | 25.98 | 352,626.54 | |
| MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A | 28,571 | 11.82 | 337,709.22 | |
| SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A | 3,355 | 183.36 | 615,172.80 | |
| GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A | 10,700 | 36.24 | 387,768.00 | |
| HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A | 5,700 | 60.79 | 346,503.00 | |
| JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A | 33,590 | 81.10 | 2,724,149.00 | |
| SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A | 4,900 | 70.00 | 343,000.00 | |
| SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A | 11,000 | 27.00 | 297,000.00 | |
| WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A | 11,700 | 27.40 | 320,580.00 | |
| WUXI APPTec CO LTD-A | 11,800 | 82.60 | 974,680.00 | |
| YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A | 5,300 | 76.19 | 403,807.00 | |
| ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A | 1,900 | 103.23 | 196,137.00 | |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A | 546,300 | 3.47 | 1,895,661.00 | |
| BANK OF BEIJING CO LTD -A | 161,200 | 5.35 | 862,420.00 | |
| BANK OF CHINA LTD-A | 143,600 | 3.60 | 516,960.00 | |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-A | 135,700 | 5.50 | 746,350.00 | |
| BANK OF HANGZHOU CO LTD-A | 39,065 | 8.27 | 323,067.55 | |
| BANK OF JIANGSU CO LTD-A | 88,000 | 6.70 | 589,600.00 | |
| BANK OF NANJING CO LTD -A | 64,612 | 8.15 | 526,587.80 | |
| BANK OF NINGBO CO LTD -A | 39,670 | 23.80 | 944,146.00 | |
| BANK OF SHANGHAI CO LTD-A | 108,227 | 9.18 | 993,523.86 | |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-A | 29,600 | 6.99 | 206,904.00 | |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A | 281,500 | 3.92 | 1,103,480.00 | |
| CHINA MERCHANTS BANK-A | 121,810 | 34.04 | 4,146,412.40 | |
| CHINA MINSHENG BANKING-A | 270,300 | 6.05 | 1,635,315.00 | |
| HUAXIA BANK CO LTD-A | 97,743 | 7.45 | 728,185.35 | |
| IND & COMM BK OF CHINA-A | 274,000 | 5.48 | 1,501,520.00 | |
| INDUSTRIAL BANK CO LTD -A | 161,121 | 17.48 | 2,816,395.08 | |
| PING AN BANK CO LTD-A | 130,844 | 15.38 | 2,012,380.72 | |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A | 137,591 | 11.75 | 1,616,694.25 |
| AVIC CAPITAL CO LTD -A | 68,400 | 4.81 | 329,004.00 |
| CAITONG SECURITIES CO LTD-A | 29,700 | 10.60 | 314,820.00 |
| CHINA MERCHANTS SECURITIES-A | 43,600 | 16.96 | 739,456.00 |
| CITIC SECURITIES CO-A | 34,000 | 22.97 | 780,980.00 |
| EAST MONEY INFORMATION CO-A | 51,200 | 15.42 | 789,504.00 |
| EVERBRIGHT SECURITIE CO-A | 32,300 | 11.70 | 377,910.00 |
| FOUNDER SECURITIES CO LTD-A | 68,100 | 7.33 | 499,173.00 |
| GF SECURITIES CO LTD-A | 45,100 | 14.13 | 637,263.00 |
| GUOSEN SECURITIES CO LTD-A | 31,217 | 12.35 | 385,529.95 |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A | 38,000 | 18.08 | 687,040.00 |
| HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A | 4,300 | 111.90 | 481,170.00 |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-A | 49,800 | 19.30 | 961,140.00 |
| ORIENT SECURITIES CO LTD-A | 45,500 | 10.50 | 477,750.00 |
| SDIC CAPITAL CO LTD-A | 26,900 | 13.00 | 349,700.00 |
| SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A | 171,797 | 4.86 | 834,933.42 |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-A | 22,967 | 28.63 | 657,545.21 |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A | 21,612 | 36.45 | 787,757.40 |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A | 15,900 | 49.74 | 790,866.00 |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-A | 69,057 | 88.91 | 6,139,857.87 |
| CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A | 22,900 | 27.08 | 620,132.00 |
| CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A | 26,969 | 19.57 | 527,783.33 |
| CHINA VANKE CO LTD -A | 61,800 | 26.15 | 1,616,070.00 |
| GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A | 61,800 | 6.95 | 429,510.00 |
| POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A | 90,653 | 14.48 | 1,312,655.44 |
| RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A | 33,099 | 8.41 | 278,362.59 |
| SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A | 6,300 | 25.84 | 162,792.00 |
| HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A | 6,052 | 77.43 | 468,606.36 |
| IFLYTEK CO LTD-A | 16,800 | 33.52 | 563,136.00 |
| YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A | 18,932 | 32.91 | 623,052.12 |
| BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A | 258,012 | 3.90 | 1,006,246.80 |
| FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A | 30,300 | 14.21 | 430,563.00 |
| GOERTEK INC -A | 26,900 | 17.28 | 464,832.00 |
| HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A | 71,300 | 34.04 | 2,427,052.00 |
| LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A | 40,750 | 27.87 | 1,135,702.50 |

| | | | | | |
|----------------|------------------------------|-----------|--------|-----------------------------------|--|
| | ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A | 22,800 | 17.84 | 406,752.00 | |
| | ZTE CORP-A | 27,600 | 33.69 | 929,844.00 | |
| | CHINA UNITED NETWORK-A | 236,600 | 6.11 | 1,445,626.00 | |
| | CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A | 98,900 | 5.41 | 535,049.00 | |
| | CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A | 156,259 | 18.71 | 2,923,605.89 | |
| | GD POWER DEVELOPMENT CO -A | 149,800 | 2.45 | 367,010.00 | |
| | SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A | 54,600 | 9.29 | 507,234.00 | |
| | SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A | 33,600 | 9.92 | 333,312.00 | |
| | LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A | 27,620 | 27.06 | 747,397.20 | |
| | SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A | 31,100 | 15.58 | 484,538.00 | |
| | 香港・オフショア人民元小計 | 8,947,063 | | 122,174,637.18 (1,850,945,753) | |
| サウジアラビア リアル | RABIGH REFINING AND PETROCHE | 30,100 | 19.26 | 579,726.00 | |
| | ADVANCED PETROCHEMICALS CO | 16,060 | 47.40 | 761,244.00 | |
| | NATIONAL INDUSTRIALIZATION C | 47,400 | 13.02 | 617,148.00 | |
| | SAHARA INTERNATIONAL PETROCH | 50,560 | 16.66 | 842,329.60 | |
| | SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO | 19,900 | 81.70 | 1,625,830.00 | |
| | SAUDI ARABIAN MINING CO | 47,200 | 45.70 | 2,157,040.00 | |
| | SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP | 92,280 | 92.40 | 8,526,672.00 | |
| | SAUDI CEMENT | 9,400 | 63.80 | 599,720.00 | |
| | SAUDI IND INVESTMENT GROUP | 28,100 | 22.54 | 633,374.00 | |
| | SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO | 108,280 | 10.18 | 1,102,290.40 | |
| | YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL | 28,100 | 52.70 | 1,480,870.00 | |
| | SAUDI AIRLINES CATERING CO | 5,550 | 88.60 | 491,730.00 | |
| | JARIR MARKETING CO | 7,950 | 159.00 | 1,264,050.00 | |
| | ALMARAI CO | 30,150 | 50.90 | 1,534,635.00 | |
| | SAVOLA | 33,200 | 31.10 | 1,032,520.00 | |
| | AL RAJHI BANK | 147,550 | 62.10 | 9,162,855.00 | |
| | ALINMA BANK | 89,080 | 21.90 | 1,950,852.00 | |
| | BANK AL-JAZIRA | 57,400 | 13.66 | 784,084.00 | |
| | BANK ALBILAD | 46,470 | 26.30 | 1,222,161.00 | |
| | BANQUE SAUDI FRANSI | 62,060 | 34.60 | 2,147,276.00 | |
| | NATIONAL COMMERCIAL BANK | 145,320 | 46.15 | 6,706,518.00 | |
| | RIYAD BANK | 144,040 | 23.46 | 3,379,178.40 | |
| | SAMBA FINANCIAL GROUP | 122,300 | 28.50 | 3,485,550.00 | |

| | | | | | |
|--------------|------------------------------|-------------|--------|----------------|------------------|
| | SAUDI BRITISH BANK | 42,200 | 30.95 | 1,306,090.00 | |
| | BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE | 3,200 | 106.00 | 339,200.00 | |
| | CO FOR COOPERATIVE INSURANCE | 8,700 | 68.90 | 599,430.00 | |
| | DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV | 64,300 | 11.92 | 766,456.00 | |
| | EMAAR ECONOMIC CITY | 65,300 | 9.90 | 646,470.00 | |
| | ETIHAD ETISALAT CO | 47,120 | 23.84 | 1,123,340.80 | |
| | SAUDI TELECOM CO | 46,970 | 103.80 | 4,875,486.00 | |
| | SAUDI ELECTRICITY CO | 100,010 | 20.88 | 2,088,208.80 | |
| サウジアラビアリアル小計 | | 1,746,250 | | 63,832,335.00 | (1,835,817,954) |
| 合計 | | 306,772,338 | | 71,886,451,715 | (71,886,451,715) |

(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 |
|--------------|------|-----------------------------|-----------|---------------|---------------|
| メキシコ ペソ | 投資証券 | FIBRA UNO ADMINISTRACION SA | 374,400 | 10,872,576.00 | |
| メキシコペソ小計 | | | 374,400 | 10,872,576.00 | (60,125,345) |
| 南アフリ カランド | 投資証券 | FORTRESS REIT LTD-A | 169,450 | 3,626,230.00 | |
| | | GROWTHPOINT PROPERTIES LTD | 344,730 | 8,111,496.90 | |
| | | REDEFINE PROPERTIES LTD | 638,890 | 5,175,009.00 | |
| 南アフリカランド小計 | | | 1,153,070 | 16,912,735.90 | (122,448,207) |
| 合計 | | | | 182,573,552 | (182,573,552) |

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

| 種類 | 銘柄数 | 組入株式 時価比率 | 組入投資証券 時価比率 | 合計金額に 対する比率 |
|----|-----|--------------|----------------|----------------|
|----|-----|--------------|----------------|----------------|

| | | | | | |
|-------------|------|-------|--------|------|-------|
| 米ドル | 株式 | 93銘柄 | 100.0% | | 15.0% |
| メキシコペソ | 株式 | 24銘柄 | 95.9% | | 2.0% |
| | 投資証券 | 1銘柄 | | 4.1% | 0.1% |
| ブラジルリアル | 株式 | 56銘柄 | 100.0% | | 5.9% |
| チリペソ | 株式 | 16銘柄 | 100.0% | | 0.7% |
| コロンビアペソ | 株式 | 9銘柄 | 100.0% | | 0.3% |
| ユーロ | 株式 | 8銘柄 | 100.0% | | 0.3% |
| 英ポンド | 株式 | 1銘柄 | 100.0% | | 0.1% |
| トルコリラ | 株式 | 16銘柄 | 100.0% | | 0.5% |
| チェココルナ | 株式 | 3銘柄 | 100.0% | | 0.1% |
| ハンガリーフォリント | 株式 | 3銘柄 | 100.0% | | 0.3% |
| ポーランドズロチ | 株式 | 19銘柄 | 100.0% | | 1.0% |
| 香港ドル | 株式 | 208銘柄 | 100.0% | | 21.4% |
| マレーシアリングット | 株式 | 43銘柄 | 100.0% | | 2.0% |
| タイバーツ | 株式 | 37銘柄 | 100.0% | | 2.8% |
| フィリピンペソ | 株式 | 23銘柄 | 100.0% | | 1.1% |
| インドネシアルピア | 株式 | 27銘柄 | 100.0% | | 2.0% |
| 韓国ウォン | 株式 | 113銘柄 | 100.0% | | 12.1% |
| 台湾ドル | 株式 | 90銘柄 | 100.0% | | 11.2% |
| インドルピー | 株式 | 79銘柄 | 100.0% | | 8.8% |
| パキスタンルピー | 株式 | 3銘柄 | 100.0% | | 0.0% |
| カタールリアル | 株式 | 11銘柄 | 100.0% | | 1.0% |
| エジプトポンド | 株式 | 3銘柄 | 100.0% | | 0.1% |
| 南アフリカランド | 株式 | 44銘柄 | 96.8% | | 5.2% |
| | 投資証券 | 3銘柄 | | 3.2% | 0.2% |
| アラブディルハム | 株式 | 8銘柄 | 100.0% | | 0.7% |
| 香港・オフショア人民元 | 株式 | 136銘柄 | 100.0% | | 2.6% |
| サウジアラビアリアル | 株式 | 31銘柄 | 100.0% | | 2.5% |

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。

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）

| | 2019年 3月22日現在 | 2019年 9月24日現在 |
|--------------|---------------|----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 62,160,009 | 1,455,867,992 |
| コール・ローン | 36,079,409 | 35,277,833 |
| 投資証券 | 6,619,654,347 | 56,996,310,227 |
| 未収入金 | 113,852 | 2,315,297,470 |
| 未収配当金 | 13,575,060 | 87,073,178 |
| 流動資産合計 | 6,731,582,677 | 60,889,826,700 |
| 資産合計 | 6,731,582,677 | 60,889,826,700 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 115,700 | 156,195 |
| 未払金 | 1,226,180 | 2,414,082,067 |
| 未払解約金 | 18,738,536 | 27,307,114 |
| 未払利息 | 27 | 38 |
| 流動負債合計 | 20,080,443 | 2,441,545,414 |
| 負債合計 | 20,080,443 | 2,441,545,414 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 3,106,220,649 | 26,349,988,728 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 3,605,281,585 | 32,098,292,558 |
| 元本等合計 | 6,711,502,234 | 58,448,281,286 |
| 純資産合計 | 6,711,502,234 | 58,448,281,286 |
| 負債純資産合計 | 6,731,582,677 | 60,889,826,700 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

(貸借対照表に関する注記)

| | | 2019年 3月22日現在 | 2019年 9月24日現在 |
|----|--------------------------------|----------------|-----------------|
| 1. | 期首 | 2018年10月 5日 | 2019年 3月23日 |
| | 期首元本額 | 3,085,107,913円 | 3,106,220,649円 |
| | 期首からの追加設定元本額 | 203,604,853円 | 23,380,540,278円 |
| | 期首からの一部解約元本額 | 182,492,117円 | 136,772,199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 | 2,493,414,683円 | 2,409,954,706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) | 48,162,587円 | 41,277,362円 |
| | グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け) | 142,568,090円 | 23,496,633,259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) | 422,075,289円 | 402,123,401円 |
| | 計 | 3,106,220,649円 | 26,349,988,728円 |
| 2. | 受益権の総数 | 3,106,220,649口 | 26,349,988,728口 |

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| | 自 2018年10月 5日 至 2019年 3月22日 | 自 2019年 3月23日 至 2019年 9月24日 |
|--------------|--|--------------------------------|
| 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 | 同左 |

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

金融商品の時価等に関する事項

| | 2019年 3月22日現在 | 2019年 9月24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)

(2019年 3月22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 | 428,950,304 |
| 合計 | 428,950,304 |

(2019年 9月24日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

| 種類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|------|-------------------|
| 投資証券 | 1,333,261,030 |
| 合計 | 1,333,261,030 |

(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)

(2019年 3月22日現在)

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|-----------|--------|------------|-------|------------|---------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 27,792,000 | - | 27,676,300 | 115,700 |
| | 米ドル | 27,792,000 | - | 27,676,300 | 115,700 |
| | 合計 | 27,792,000 | - | 27,676,300 | 115,700 |

(2019年 9月24日現在)

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|-----------|----------|---------------|-------|---------------|---------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 1,211,314,595 | - | 1,211,158,400 | 156,195 |
| | 米ドル | 1,187,859,305 | - | 1,187,710,400 | 148,905 |
| | シンガポールドル | 23,455,290 | - | 23,448,000 | 7,290 |
| | 合計 | 1,211,314,595 | - | 1,211,158,400 | 156,195 |

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

| 2019年 3月22日現在 | | 2019年 9月24日現在 | |
|---------------|-----------|---------------|-----------|
| 1口当たり純資産額 | 2.1607円 | 1口当たり純資産額 | 2.2182円 |
| (1万口当たり純資産額) | (21,607円) | (1万口当たり純資産額) | (22,182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 | 34,858 | 994,150.16 | |
| | | AGREE REALTY CORPORATION | 16,688 | 1,224,899.20 | |
| | | ALEXANDER'S INC | 839 | 288,657.95 | |
| | | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC | 45,456 | 6,979,314.24 | |

| | | | |
|-----------------------------------|---------|---------------|--|
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 18,957 | 887,187.60 | |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC | 55,180 | 2,605,047.80 | |
| AMERICAN FINANCE TRUST INC | 42,512 | 587,090.72 | |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 101,975 | 2,588,125.50 | |
| AMERICOLD REALTY TRUST | 76,764 | 2,808,027.12 | |
| APARTMENT INVT&MGMT CO -A | 59,870 | 3,061,751.80 | |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 84,101 | 1,371,687.31 | |
| ARA US HOSPITALITY TRUST | 208,300 | 182,262.50 | |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 30,575 | 97,534.25 | |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 55,899 | 11,763,385.56 | |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH | 9,585 | 114,157.35 | |
| BOSTON PROPERTIES INC | 57,595 | 7,501,748.75 | |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 11,701 | 112,446.61 | |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 69,735 | 1,043,235.60 | |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 119,610 | 2,370,670.20 | |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A | 30,155 | 599,632.17 | |
| BRT APARTMENTS CORP | 3,995 | 59,205.90 | |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 38,827 | 4,300,866.79 | |
| CARETRUST REIT INC | 38,000 | 883,690.00 | |
| CBL&ASSOCIATES PROPERTIES | 86,324 | 113,947.68 | |
| CEDAR REALTY TRUST INC | 42,188 | 118,548.28 | |
| CHATHAM LODGING TRUST | 17,572 | 317,174.60 | |
| CITY OFFICE REIT INC | 16,878 | 240,173.94 | |
| CLIPPER REALTY INC | 4,436 | 48,441.12 | |
| COLONY CAPITAL INC-A | 193,377 | 1,100,315.13 | |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 45,797 | 980,055.80 | |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 6,685 | 288,591.45 | |
| CORECIVIC INC | 46,445 | 791,887.25 | |
| COREPOINT LODGING INC | 15,317 | 161,747.52 | |
| CORESITE REALTY CORP | 14,742 | 1,783,339.74 | |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST | 44,532 | 1,297,662.48 | |
| COUSINS PROPERTIES INC | 58,676 | 2,170,425.24 | |
| CUBESMART | 76,854 | 2,715,251.82 | |
| CYRUSONE INC | 45,304 | 3,508,341.76 | |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 78,026 | 800,546.76 | |

| | | | |
|--------------------------------------|---------|---------------|--|
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 83,389 | 10,532,864.59 | |
| DOUGLAS EMMETT INC | 65,771 | 2,780,140.17 | |
| DUKE REALTY CORPORATION | 144,860 | 4,851,361.40 | |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI | 28,425 | 596,356.50 | |
| EASTGROUP PROPERTIES INC | 15,279 | 1,935,238.14 | |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST-A | 60,262 | 845,475.86 | |
| EPR PROPERTIES | 31,418 | 2,412,902.40 | |
| EQUINIX INC | 33,944 | 19,745,564.24 | |
| EQUITY COMMONWEALTH | 48,895 | 1,639,449.35 | |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC | 36,522 | 4,906,730.70 | |
| EQUITY RESIDENTIAL-REIT | 139,612 | 11,899,130.76 | |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY | 31,158 | 724,111.92 | |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 26,339 | 8,564,125.85 | |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 51,512 | 5,961,998.88 | |
| FARMLAND PARTNERS INC | 8,724 | 55,571.88 | |
| FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT | 27,998 | 3,768,810.78 | |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC | 50,826 | 2,020,333.50 | |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 26,854 | 758,625.50 | |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP | 43,022 | 351,919.96 | |
| FRONT YARD RESIDENTIAL CORP | 17,430 | 202,362.30 | |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 81,734 | 3,167,192.50 | |
| GEO GROUP INC/THE | 48,530 | 822,583.50 | |
| GETTY REALTY CORPORATION | 14,308 | 450,988.16 | |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION | 12,430 | 288,376.00 | |
| GLADSTONE LAND CORP | 8,363 | 100,690.52 | |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 10,077 | 115,180.11 | |
| GLOBAL NET LEASE INC | 33,086 | 645,507.86 | |
| HCP INC | 196,837 | 6,901,105.22 | |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 52,008 | 1,734,466.80 | |
| HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A | 82,376 | 2,374,900.08 | |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 14,056 | 210,699.44 | |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 41,539 | 1,865,931.88 | |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST | 65,853 | 1,658,178.54 | |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 292,084 | 5,029,686.48 | |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 61,760 | 2,091,811.20 | |

| | | | |
|--------------------------------|---------|--------------|--|
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 36,600 | 527,772.00 | |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT | 26,135 | 569,743.00 | |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER | 4,596 | 439,055.88 | |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST | 4,307 | 310,147.07 | |
| INVITATION HOMES INC | 172,229 | 4,967,084.36 | |
| IRON MOUNTAIN INC | 114,935 | 3,599,764.20 | |
| JBG SMITH PROPERTIES | 47,343 | 1,870,995.36 | |
| KILROY REALTY CORPORATION | 37,200 | 2,933,220.00 | |
| KIMCO REALTY CORPORATION | 169,292 | 3,419,698.40 | |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 32,036 | 505,848.44 | |
| LEXINGTON REALTY TRUST | 99,600 | 1,034,844.00 | |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | 63,146 | 3,236,863.96 | |
| LIFE STORAGE INC | 18,757 | 1,955,604.82 | |
| LTC PROPERTIES INC | 15,702 | 789,025.50 | |
| MACERICH CO/THE | 43,913 | 1,422,342.07 | |
| MACK-CALI REALTY CORPORATION | 37,475 | 803,089.25 | |
| MANULIFE US REAL ESTATE INV | 546,433 | 497,254.03 | |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 178,938 | 3,412,347.66 | |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 45,734 | 5,906,088.76 | |
| MONMOUTH RE INVST CORP | 38,621 | 553,438.93 | |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 68,859 | 3,854,038.23 | |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 23,026 | 764,693.46 | |
| NATL HEALTH INVESTORS INC | 17,351 | 1,452,625.72 | |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP | 29,595 | 200,062.20 | |
| NEXPOINT RESIDENTIAL | 9,064 | 428,727.20 | |
| NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP | 16,317 | 277,389.00 | |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRU | 19,917 | 584,165.61 | |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 86,784 | 3,581,575.68 | |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 6,120 | 174,909.60 | |
| PARAMOUNT GROUP INC | 79,809 | 1,059,065.43 | |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 95,801 | 2,491,784.01 | |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 52,186 | 1,450,770.80 | |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | 26,706 | 149,019.48 | |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 74,004 | 1,308,390.72 | |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 49,800 | 1,026,378.00 | |

| | | | |
|-----------------------------------|---------|---------------|--|
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 2,945 | 57,869.25 | |
| PREFERRED APARTMENT COMMUN-A | 17,635 | 252,885.90 | |
| PROLOGIS INC | 252,571 | 21,372,558.02 | |
| PS BUSINESS PARKS INC | 7,980 | 1,453,716.60 | |
| PUBLIC STORAGE | 60,102 | 14,752,035.90 | |
| QTS REALTY TRUST INC-CL-A | 21,904 | 1,106,371.04 | |
| REALTY INCOME CORP | 127,493 | 9,694,567.72 | |
| REGENCY CENTERS CORP | 67,192 | 4,546,882.64 | |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS | 44,897 | 819,819.22 | |
| RETAIL PROPERTIES OF AME - A | 84,606 | 1,012,733.82 | |
| RETAIL VALUE INC | 5,598 | 208,581.48 | |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN | 43,836 | 1,948,071.84 | |
| RLJ LODGING TRUST | 68,865 | 1,189,987.20 | |
| RPT REALTY | 33,297 | 440,519.31 | |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 20,568 | 1,691,718.00 | |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 75,950 | 1,712,672.50 | |
| SAFEHOLD INC | 4,888 | 146,737.76 | |
| SAUL CENTERS INC | 5,027 | 271,206.65 | |
| SENIOR HOUSING PROPERTIES TRUST | 95,900 | 867,895.00 | |
| SERITAGE GROWTH PROP- A REIT | 13,360 | 557,512.80 | |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 123,265 | 19,099,911.75 | |
| SITE CENTERS CORP | 54,329 | 798,093.01 | |
| SL GREEN REALTY CORP | 32,998 | 2,687,027.14 | |
| SPIRIT MTA REIT | 19,604 | 167,222.12 | |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 36,305 | 1,747,359.65 | |
| STAG INDUSTRIAL INC | 50,453 | 1,523,680.60 | |
| STORE CAPITAL CORP | 84,027 | 3,156,894.39 | |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 42,529 | 491,209.95 | |
| SUN COMMUNITIES INC | 36,347 | 5,421,881.99 | |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 89,978 | 1,246,195.30 | |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTERS INC | 37,616 | 592,452.00 | |
| TAUBMAN CENTERS INC | 24,209 | 1,009,515.30 | |
| TERRENO REALTY CORP | 25,972 | 1,338,077.44 | |
| UDR INC | 117,070 | 5,629,896.30 | |
| UMH PROPERTIES INC | 12,519 | 173,638.53 | |

| | | | | | |
|-------|------|--|-----------|----------------|------------------|
| | | UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST | 5,069 | 516,176.27 | |
| | | URBAN EDGE PROPERTIES | 46,280 | 899,220.40 | |
| | | URSTADT BIDDLE PROPERTIES- CL A | 12,448 | 290,909.76 | |
| | | VENTAS INC | 149,208 | 10,836,977.04 | |
| | | VEREIT INC | 390,557 | 3,800,119.61 | |
| | | VICI PROPERTIES INC | 184,553 | 4,229,954.76 | |
| | | VORNADO REALTY TRUST | 63,438 | 3,987,078.30 | |
| | | WASHINGTON PRIME GROUP INC | 72,776 | 292,559.52 | |
| | | WASHINGTON REIT | 31,942 | 875,849.64 | |
| | | WEINGARTEN REALTY INVESTORS | 48,043 | 1,374,029.80 | |
| | | WELLTOWER INC | 162,269 | 14,451,677.14 | |
| | | WHITESTONE REIT | 16,528 | 221,475.20 | |
| | | WP CAREY INC | 68,542 | 6,160,554.96 | |
| | | XENIA HOTELS & RESORTS INC | 44,506 | 948,422.86 | |
| 米ドル小計 | | | 9,517,936 | 396,501,824.83 | (42,699,281,515) |
| 加ドル | 投資証券 | ALLIED PROPERTIES RE INVST TR | 22,724 | 1,216,870.20 | |
| | | ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 30,298 | 379,330.96 | |
| | | BOARDWALK EQUITIES INC | 9,496 | 420,198.00 | |
| | | CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST | 31,332 | 1,707,907.32 | |
| | | CHOICE PROPERTIES REIT | 59,167 | 851,413.13 | |
| | | COMINAR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 35,257 | 457,283.29 | |
| | | CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 18,050 | 286,453.50 | |
| | | CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 19,375 | 279,387.50 | |
| | | DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV | 39,153 | 649,939.80 | |
| | | DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE | 23,053 | 297,844.76 | |
| | | DREAM OFFICE REAL ESTATE INV | 11,092 | 325,328.36 | |
| | | GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 9,801 | 626,773.95 | |
| | | H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 56,538 | 1,295,850.96 | |
| | | INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 25,390 | 406,240.00 | |
| | | KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 18,329 | 364,380.52 | |
| | | MINTO APARTMENT REAL ESTATE | 3,919 | 86,609.90 | |
| | | MORGUARD NORTH AMERICAN RESI | 7,995 | 155,982.45 | |
| | | NORTHVIEW APARTMENT REAL EST | 12,516 | 367,219.44 | |
| | | NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 27,917 | 329,699.77 | |

| | | | | |
|-------|------|-------------------------------------|---------|----------------------------------|
| | | RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 60,535 | 1,605,388.20 |
| | | SLATE OFFICE REIT | 10,622 | 66,599.94 |
| | | SLATE RETAIL REIT | 8,232 | 104,217.12 |
| | | SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 28,135 | 914,387.50 |
| | | SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI | 21,448 | 273,890.96 |
| | | TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E | 18,467 | 128,899.66 |
| 加ドル小計 | | | 608,841 | 13,598,097.19 (1,104,301,472) |
| ユーロ | 投資証券 | AEDIFICA | 9,827 | 1,045,592.80 |
| | | ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 63,206 | 972,108.28 |
| | | ALTAREA | 1,470 | 274,008.00 |
| | | BEFIMMO S.C.A. | 9,351 | 520,850.70 |
| | | COFINIMMO | 10,028 | 1,303,640.00 |
| | | COVIVIO | 18,038 | 1,721,727.10 |
| | | EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 16,985 | 417,831.00 |
| | | GECINA SA | 22,013 | 3,152,261.60 |
| | | GREEN REIT PLC | 266,784 | 507,956.73 |
| | | HAMBORNER REIT AG | 27,283 | 256,078.23 |
| | | HIBERNIA REIT PLC | 270,913 | 400,951.24 |
| | | ICADE | 11,348 | 910,677.00 |
| | | IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | 22,214 | 123,287.70 |
| | | INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI | 99,235 | 1,064,791.55 |
| | | INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES | 9,376 | 240,494.40 |
| | | IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 157,881 | 263,345.50 |
| | | KLEPIERRE | 84,397 | 2,505,746.93 |
| | | LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | 22,964 | 182,793.44 |
| | | MERCIALYS | 10,334 | 124,214.68 |
| | | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 148,387 | 1,897,869.73 |
| | | MONTEA | 4,240 | 330,720.00 |
| | | NSI NV | 6,852 | 270,654.00 |
| | | RETAIL ESTATES | 3,193 | 275,555.90 |
| | | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 55,154 | 7,189,323.90 |
| | | VASTNED RETAIL | 7,044 | 188,427.00 |
| | | WAREHOUSES DE PAUW SCA | 7,028 | 1,177,892.80 |
| | | WERELDHAVE NV | 16,728 | 331,381.68 |

| | | | | |
|-----------------------------|---------|------------------------------|-----------|----------------------------------|
| ユーロ小計 | | | 1,382,273 | 27,650,181.89 (3,271,846,023) |
| 英債券 | 投資証券 | AEW UK REIT PLC | 66,705 | 61,101.78 |
| | | ASSURA PLC | 941,349 | 675,888.58 |
| | | BIG YELLOW GROUP PLC | 61,511 | 624,951.76 |
| | | BRITISH LAND COMPANY PLC | 377,122 | 2,129,230.81 |
| | | CAPITAL & REGIONAL PLC | 211,579 | 38,845.90 |
| | | CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 250,503 | 218,438.61 |
| | | DERWENT LONDON PLC | 42,256 | 1,349,656.64 |
| | | EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 224,548 | 208,155.99 |
| | | GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 105,816 | 759,970.51 |
| | | HAMMERSON PLC | 307,690 | 846,147.50 |
| | | HANSTEEN HOLDINGS PLC | 174,445 | 158,744.95 |
| | | INTU PROPERTIES PLC | 318,381 | 132,892.22 |
| | | LAND SECURITIES GROUP PLC | 301,141 | 2,529,584.40 |
| | | LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 334,250 | 718,637.50 |
| | | LXI REIT PLC | 219,671 | 283,375.59 |
| | | NEWRIVER REIT PLC | 119,464 | 225,786.96 |
| | | PICTON PROPERTY INCOME LTD | 234,379 | 206,253.52 |
| | | PRIMARY HEALTH PROPERTIES | 474,973 | 664,012.25 |
| | | RDI REIT PLC | 121,799 | 126,670.96 |
| | | REGIONAL REIT LTD | 174,151 | 180,072.13 |
| | | SAFESTORE HOLDINGS PLC | 81,960 | 528,232.20 |
| | | SCHRODER REAL ESTATE INVESTM | 240,176 | 129,454.86 |
| | | SEGRO PLC | 434,300 | 3,433,575.80 |
| SHAFTESBURY PLC | 89,070 | 797,176.50 | | |
| TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING | 130,036 | 121,973.76 | | |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 679,720 | 1,012,782.80 | | |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT | 347,404 | 296,335.61 | | |
| UNITE GROUP PLC | 116,208 | 1,238,777.28 | | |
| WORKSPACE GROUP PLC | 48,937 | 468,082.40 | | |
| 英債券小計 | | | 7,229,544 | 20,164,809.77 (2,700,068,028) |
| 豪ドル | 投資証券 | ABACUS PROPERTY GROUP | 151,762 | 591,871.80 |
| | | APN INDUSTRIA REIT | 57,180 | 167,537.40 |

| | | | | | |
|-------------------|------|---------------------------------------|------------|---------------|-----------------|
| | | ARENA REIT | 113,404 | 326,603.52 | |
| | | BWP TRUST | 210,446 | 822,843.86 | |
| | | CENTURIA METROPOLITAN REIT | 121,813 | 372,747.78 | |
| | | CHARTER HALL EDUCATION TRUST | 101,698 | 362,044.88 | |
| | | CHARTER HALL GROUP | 186,060 | 2,132,247.60 | |
| | | CHARTER HALL LONG WALE REIT | 125,898 | 730,208.40 | |
| | | CHARTER HALL RETAIL REIT | 140,769 | 603,899.01 | |
| | | CROMWELL PROPERTY GROUP | 768,997 | 984,316.16 | |
| | | DEXUS | 435,916 | 5,400,999.24 | |
| | | GDI PROPERTY GROUP | 209,708 | 326,095.94 | |
| | | GOODMAN GROUP | 642,433 | 9,071,153.96 | |
| | | GPT GROUP | 777,708 | 4,798,458.36 | |
| | | GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 127,484 | 555,830.24 | |
| | | HOTEL PROPERTY INVESTMENTS | 64,387 | 213,764.84 | |
| | | INGENIA COMMUNITIES GROUP | 92,404 | 354,831.36 | |
| | | MIRVAC GROUP | 1,590,737 | 4,915,377.33 | |
| | | NATIONAL STORAGE REIT | 306,942 | 549,426.18 | |
| | | RURAL FUNDS GROUP | 119,976 | 203,959.20 | |
| | | SCENTRE GROUP | 2,137,366 | 8,421,222.04 | |
| | | SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 358,704 | 936,217.44 | |
| | | STOCKLAND | 977,494 | 4,359,623.24 | |
| | | VICINITY CENTRES | 1,295,855 | 3,369,223.00 | |
| | | VIVA ENERGY REIT | 179,493 | 498,990.54 | |
| 豪ドル小計 | | | 11,294,634 | 51,069,493.32 | (3,725,008,842) |
| ニュー ジーラン ドル | 投資証券 | GOODMAN PROPERTY TRUST | 514,963 | 1,112,320.08 | |
| | | VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | 221,563 | 604,866.99 | |
| ニュージーランドドル小計 | | | 736,526 | 1,717,187.07 | (116,339,423) |
| 香港ドル | 投資証券 | CHAMPION REIT | 811,000 | 4,136,100.00 | |
| | | FORTUNE REIT | 568,000 | 5,185,840.00 | |
| | | LINK REIT | 844,800 | 73,624,320.00 | |
| | | PROSPERITY REIT | 460,000 | 1,334,000.00 | |
| | | RREEF CHINA COMMERCIAL TRUST | 201,000 | 874,350.00 | |
| | | SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 441,000 | 2,319,660.00 | |

| | | | | | |
|------------------------------|---------|-------------------------------------|-----------|---------------|-----------------|
| | | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 612,000 | 3,139,560.00 | |
| 香港ドル小計 | | | 3,937,800 | 90,613,830.00 | (1,245,034,024) |
| シンガ ポールド ル | 投資証券 | AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT | 186,625 | 266,873.75 | |
| | | ASCENDAS HOSPITALITY TRUST | 356,140 | 388,192.60 | |
| | | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 1,041,013 | 3,247,960.56 | |
| | | ASCOTT RESIDENCE TRUST | 468,942 | 614,314.02 | |
| | | CACHE LOGISTICS TRUST | 390,558 | 287,060.13 | |
| | | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 1,153,450 | 2,433,779.50 | |
| | | CAPITALAND MALL TRUST | 1,139,100 | 2,984,442.00 | |
| | | CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST | 304,057 | 465,207.21 | |
| | | CDL HOSPITALITY TRUSTS | 350,800 | 571,804.00 | |
| | | ESR REIT | 764,818 | 409,177.63 | |
| | | ESR REIT-RTS(N) | 26,941 | 673.52 | |
| | | FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 339,200 | 230,656.00 | |
| | | FIRST REAL ESTATE INVT TRUST | 213,400 | 228,338.00 | |
| | | FRASERS CENTREPOINT TRUST | 288,589 | 782,076.19 | |
| | | FRASERS COMMERCIAL TRUST | 296,400 | 474,240.00 | |
| | | FRASERS HOSPITALITY TRUST | 296,400 | 210,444.00 | |
| | | FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI | 609,210 | 731,052.00 | |
| | | KEPPEL DC REIT | 413,854 | 811,153.84 | |
| | | KEPPEL DC REIT-RTS(N) | 41,323 | 10,330.75 | |
| | | KEPPEL REIT | 758,600 | 940,664.00 | |
| | | LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL | 722,800 | 166,244.00 | |
| | | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 751,740 | 1,706,449.80 | |
| | | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 562,860 | 1,390,264.20 | |
| | | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 1,162,044 | 1,882,511.28 | |
| | | MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC | 862,900 | 1,139,028.00 | |
| | | QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I | 1,020,835 | 551,250.90 | |
| | | PARKWAYLIFE REAL ESTATE | 171,900 | 524,295.00 | |
| | | SABANA SHARIAH COMP IND REIT | 351,900 | 158,355.00 | |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTME | 206,400 | 165,120.00 | | | |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REI | 388,021 | 205,651.13 | | | |
| SPH REIT | 336,500 | 366,785.00 | | | |
| STARHILL GLOBAL REIT | 591,600 | 446,658.00 | | | |

| | | | | | |
|-------------|------|---------------------------|------------|------------------------------------|--|
| | | SUNTEC REIT | 939,400 | 1,803,648.00 | |
| シンガポールドル小計 | | | 17,508,320 | 26,594,700.01 (2,078,907,699) | |
| 韓国ウォン | 投資証券 | SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 8,125 | 64,837,500.00 | |
| 韓国ウォン小計 | | | 8,125 | 64,837,500.00 (5,861,310) | |
| イスラエルシェケル | 投資証券 | REIT 1 LTD | 76,791 | 1,620,290.10 | |
| イスラエルシェケル小計 | | | 76,791 | 1,620,290.10 (49,661,891) | |
| 合計 | | | | 56,996,310,227 (56,996,310,227) | |

(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 158銘柄 | 100.0% | 75.1% |
| 加ドル | 投資証券 25銘柄 | 100.0% | 1.9% |
| ユーロ | 投資証券 27銘柄 | 100.0% | 5.7% |
| 英ポンド | 投資証券 29銘柄 | 100.0% | 4.7% |
| 豪ドル | 投資証券 25銘柄 | 100.0% | 6.5% |
| ニュージーランドドル | 投資証券 2銘柄 | 100.0% | 0.2% |
| 香港ドル | 投資証券 7銘柄 | 100.0% | 2.2% |
| シンガポールドル | 投資証券 33銘柄 | 100.0% | 3.6% |
| 韓国ウォン | 投資証券 1銘柄 | 100.0% | 0.0% |
| イスラエルシェケル | 投資証券 1銘柄 | 100.0% | 0.1% |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

日本リートインデックスJ - REITマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

| | 2019年 3月22日現在 | 2019年 9月24日現在 |
|--------------|---------------|----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 196,172,297 | 1,588,914,975 |
| 投資証券 | 8,447,764,220 | 61,490,493,560 |
| 未収配当金 | 71,430,843 | 389,093,728 |
| 流動資産合計 | 8,715,367,360 | 63,468,502,263 |
| 資産合計 | 8,715,367,360 | 63,468,502,263 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | 124,183,100 | 1,200,526,840 |
| 未払解約金 | 6,912,509 | 38,909,284 |
| 未払利息 | 147 | 1,718 |
| 流動負債合計 | 131,095,756 | 1,239,437,842 |
| 負債合計 | 131,095,756 | 1,239,437,842 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 3,949,954,874 | 25,066,587,139 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 4,634,316,730 | 37,162,477,282 |
| 元本等合計 | 8,584,271,604 | 62,229,064,421 |
| 純資産合計 | 8,584,271,604 | 62,229,064,421 |
| 負債純資産合計 | 8,715,367,360 | 63,468,502,263 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

| | |
|--|---|
| | (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |
|--|---|

(貸借対照表に関する注記)

| | | 2019年 3月22日現在 | 2019年 9月24日現在 |
|----|---------------------------------|----------------|-----------------|
| 1. | 期首 | 2018年10月 5日 | 2019年 3月23日 |
| | 期首元本額 | 3,915,431,518円 | 3,949,954,874円 |
| | 期首からの追加設定元本額 | 304,106,432円 | 21,409,701,569円 |
| | 期首からの一部解約元本額 | 269,583,076円 | 293,069,304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 | 2,469,146,370円 | 2,233,136,295円 |
| | 財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型 | 1,170,837,469円 | 1,324,410,462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) | 167,326,722円 | 148,691,553円 |
| | グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け) | 142,644,313円 | 21,360,348,829円 |
| | 計 | 3,949,954,874円 | 25,066,587,139円 |
| 2. | 受益権の総数 | 3,949,954,874口 | 25,066,587,139口 |

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| | 自 2018年10月 5日 至 2019年 3月22日 | 自 2019年 3月23日 至 2019年 9月24日 |
|-----------------------|---|--------------------------------|
| 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 | 同左 |
| 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。当該有価証券の性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。 | 同左 |
| 金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。 | 同左 |

金融商品の時価等に関する事項

| | 2019年 3月22日現在 | 2019年 9月24日現在 |
|-------------------------|---|---|
| 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。 | 同左 |
| 時価の算定方法 | (1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。 | (1)有価証券 同左 (2)上記以外の金融商品 同左 |
| 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左 |

(有価証券に関する注記)

(2019年 3月22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 | 658,929,030 |
| 合計 | 658,929,030 |

(2019年 9月24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 | 4,173,525,569 |
| 合計 | 4,173,525,569 |

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

| 2019年 3月22日現在 | | 2019年 9月24日現在 | |
|---------------|-----------|---------------|-----------|
| 1口当たり純資産額 | 2.1733円 | 1口当たり純資産額 | 2.4826円 |
| (1万口当たり純資産額) | (21,733円) | (1万口当たり純資産額) | (24,826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 | 584 | 70,196,800 | |
| | サンケイリアルエステート投資法人 投資証券 | 825 | 99,825,000 | |
| | 日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券 | 1,892 | 1,239,260,000 | |
| | MCUBS Mid City投資法人 投資証券 | 6,754 | 787,516,400 | |
| | 森ヒルズリート投資法人 投資証券 | 6,551 | 1,095,327,200 | |
| | 産業ファンド投資法人 投資証券 | 7,005 | 1,069,663,500 | |
| | アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券 | 5,272 | 1,816,204,000 | |
| | 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 | 3,543 | 716,040,300 | |
| | アクティブア・プロパティーズ投資法人 投資証券 | 2,853 | 1,546,326,000 | |
| | GLP投資法人 投資証券 | 14,181 | 1,945,633,200 | |
| | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券 | 2,371 | 797,841,500 | |
| | 日本プロロジスリート投資法人 投資証券 | 8,180 | 2,424,552,000 | |
| | 星野リゾート・リート投資法人 投資証券 | 866 | 515,270,000 | |
| | Oneリート投資法人 投資証券 | 887 | 271,865,500 | |
| | イオンリート投資法人 投資証券 | 6,145 | 867,059,500 | |
| ヒューリックリート投資法人 投資証券 | 4,628 | 897,832,000 | | |

| | | | |
|----------------------------|--------|---------------|--|
| 日本リート投資法人 投資証券 | 1,849 | 807,088,500 | |
| インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券 | 36,579 | 758,648,460 | |
| 日本ヘルスケア投資法人 投資証券 | 276 | 53,847,600 | |
| 積水ハウス・リート投資法人 投資証券 | 16,648 | 1,539,940,000 | |
| トーセイ・リート投資法人 投資証券 | 1,047 | 139,355,700 | |
| ケネディクス商業リート投資法人 投資証券 | 2,087 | 577,055,500 | |
| ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券 | 1,214 | 163,525,800 | |
| サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券 | 1,140 | 138,396,000 | |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券 | 17,756 | 3,442,888,400 | |
| いちごホテルリート投資法人 投資証券 | 943 | 119,195,200 | |
| ラサールロジポート投資法人 投資証券 | 5,294 | 807,335,000 | |
| スターアジア不動産投資法人 投資証券 | 1,890 | 222,075,000 | |
| マリモ地方創生リート投資法人 投資証券 | 490 | 60,319,000 | |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券 | 1,402 | 614,777,000 | |
| 大江戸温泉リート投資法人 投資証券 | 967 | 87,030,000 | |
| さくら総合リート投資法人 投資証券 | 1,232 | 120,243,200 | |
| 投資法人みらい 投資証券 | 6,176 | 380,441,600 | |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券 | 1,336 | 188,242,400 | |
| 三菱地所物流リート投資法人 投資証券 | 909 | 314,059,500 | |
| CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券 | 799 | 104,748,900 | |
| ザイマックス・リート投資法人 投資証券 | 826 | 106,719,200 | |
| タカラレーベン不動産投資法人 投資証券 | 1,616 | 188,425,600 | |
| 伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券 | 881 | 100,169,700 | |
| 日本ビルファンド投資法人 投資証券 | 5,514 | 4,493,910,000 | |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券 | 5,694 | 4,105,374,000 | |
| 日本リテールファンド投資法人 投資証券 | 10,761 | 2,357,735,100 | |
| オリックス不動産投資法人 投資証券 | 11,345 | 2,609,350,000 | |
| 日本プライムリアルティ投資法人 投資証券 | 3,604 | 1,789,386,000 | |
| プレミア投資法人 投資証券 | 5,143 | 797,679,300 | |
| 東急リアル・エステート投資法人 投資証券 | 3,817 | 771,797,400 | |
| グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券 | 3,954 | 584,796,600 | |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券 | 12,784 | 2,581,089,600 | |
| 森トラスト総合リート投資法人 投資証券 | 4,069 | 809,324,100 | |
| インヴィンシブル投資法人 投資証券 | 24,975 | 1,600,897,500 | |

| | | | |
|------------------------|---------|----------------|--|
| フロンティア不動産投資法人 投資証券 | 2,022 | 908,889,000 | |
| 平和不動産リート投資法人 投資証券 | 3,546 | 472,327,200 | |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券 | 3,720 | 989,520,000 | |
| 福岡リート投資法人 投資証券 | 2,945 | 533,634,000 | |
| ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券 | 1,761 | 1,463,391,000 | |
| いちごオフィスリート投資法人 投資証券 | 4,409 | 471,763,000 | |
| 大和証券オフィス投資法人 投資証券 | 1,314 | 1,085,364,000 | |
| 阪急阪神リート投資法人 投資証券 | 2,572 | 412,034,400 | |
| スタートプロシード投資法人 投資証券 | 887 | 176,601,700 | |
| 大和ハウスリート投資法人 投資証券 | 7,676 | 2,276,701,600 | |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券 | 18,342 | 1,489,370,400 | |
| 日本賃貸住宅投資法人 投資証券 | 6,404 | 639,119,200 | |
| ジャパンエクセレント投資法人 投資証券 | 5,099 | 875,498,300 | |
| 合計 | 328,251 | 61,490,493,560 | |

(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。

マネー・オープン・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

| | 2019年 3月22日現在 | 2019年 9月24日現在 |
|--------------|---------------|---------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 134,603,426 | 396,746,330 |
| 流動資産合計 | 134,603,426 | 396,746,330 |
| 資産合計 | 134,603,426 | 396,746,330 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 19,601 | 7,271 |
| 未払利息 | 100 | 429 |
| 流動負債合計 | 19,701 | 7,700 |
| 負債合計 | 19,701 | 7,700 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 132,401,223 | 390,398,338 |

| | 2019年 3月22日現在 | 2019年 9月24日現在 |
|-------------|---------------|---------------|
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 2,182,502 | 6,340,292 |
| 元本等合計 | 134,583,725 | 396,738,630 |
| 純資産合計 | 134,583,725 | 396,738,630 |
| 負債純資産合計 | 134,603,426 | 396,746,330 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

| | 2019年 3月22日現在 | 2019年 9月24日現在 |
|--|---------------|---------------|
| 1. 期首 | 2018年10月 4日 | 2019年 3月23日 |
| 期首元本額 | 135,882,228円 | 132,401,223円 |
| 期首からの追加設定元本額 | 7,467,000円 | 270,861,549円 |
| 期首からの一部解約元本額 | 10,948,005円 | 12,864,434円 |
| 元本の内訳 | | |
| 上場インデックスファンド中国A株(パンダ) E F u n d C S I 3 0 0 | 198,295円 | 198,295円 |
| 上場インデックスファンド海外債券(F T S E W G B I) 毎月分配型 | 19,740円 | 19,740円 |
| 高金利先進国債券オープン(毎月分配型) | 13,957,826円 | 12,262,685円 |
| 世界銀行債券ファンド(毎月分配型) | 16,192,729円 | 13,808,022円 |
| 高金利先進国債券オープン(資産成長型) | 1,031,017円 | 951,470円 |
| 資源ファンド(株式と通貨)ブラジルリアル・コース | 14,616,417円 | 11,806,817円 |
| 資源ファンド(株式と通貨)南アフリカランド・コース | 4,117,986円 | 3,236,981円 |
| 資源ファンド(株式と通貨)オーストラリアドル・コース | 1,657,940円 | 1,315,354円 |
| 資源ファンド(株式と通貨)円コース | 31,398円 | 25,231円 |
| 資源ファンド(株式と通貨)メキシコペソ・コース | 36,452円 | 25,615円 |
| 資源ファンド(株式と通貨)トルコリラ・コース | 98,787円 | 88,232円 |
| 資源ファンド(株式と通貨)米ドル・コース | 172,589円 | 146,129円 |
| 資源ファンド(株式と通貨)ブラジルリアル・コース (資産成長型) | 18,093円 | 13,995円 |
| 資源ファンド(株式と通貨)南アフリカランド・コース (資産成長型) | 12,623円 | 11,472円 |
| 資源ファンド(株式と通貨)米ドル・コース(資産成長 型) | 49,200円 | 43,258円 |
| グローバル3倍3分法ファンド(1年決算型) | 1,398,434円 | 176,560,458円 |
| グローバル3倍3分法ファンド(隔月分配型) | 211,545円 | 89,993,708円 |
| 日興・G S 世界ソブリン・ファンド(毎月分配型) | 9,153,907円 | 8,702,713円 |
| 日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分 配型(米ドルコース) | 18,776,791円 | 18,894,122円 |

| | | |
|---|--------------|--------------|
| 日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(円ヘッジコース) | 4,891,765円 | 4,649,806円 |
| 日興・アッシュモア・グローイング・マルチストラテジー・ファンド | 3,529,517円 | 3,172,415円 |
| 日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド資産成長型(米ドルコース) | 1,207,963円 | 1,354,917円 |
| 日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(ブラジルリアルコース) | 5,014,891円 | 4,813,830円 |
| 日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(南アフリカランドコース) | 993,579円 | 919,016円 |
| 日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(トルコリラコース) | 31,793,973円 | 34,336,561円 |
| 日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(メキシコペソコース) | 1,131,538円 | 986,729円 |
| 日興・世界ソブリン・ファンド V A (適格機関投資家転売制限付) | 694,302円 | 675,640円 |
| 日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(インドネシアルピアコース) | 126,341円 | 224,871円 |
| 日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(インドルピーコース) | 1,265,585円 | 1,160,256円 |
| 計 | 132,401,223円 | 390,398,338円 |
| 2. 受益権の総数 | 132,401,223口 | 390,398,338口 |

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| | 自 2018年10月 4日 至 2019年 3月22日 | 自 2019年 3月23日 至 2019年 9月24日 |
|-----------------------|---|--------------------------------|
| 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 | 同左 |
| 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。 | 同左 |
| 金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。 | 同左 |

金融商品の時価等に関する事項

| | 2019年 3月22日現在 | 2019年 9月24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 該当事項はありません。 (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 |

（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）

| 2019年 3月22日現在 | | 2019年 9月24日現在 | |
|---------------|-----------|---------------|-----------|
| 1口当たり純資産額 | 1.0165円 | 1口当たり純資産額 | 1.0162円 |
| (1万口当たり純資産額) | (10,165円) | (1万口当たり純資産額) | (10,162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

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

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2019年 9月30日現在です。

【グローバル3倍3分法ファンド(隔月分配型)】

【純資産額計算書】

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 101,172,232,516円 |
| 負債総額 | 672,109,393円 |
| 純資産総額(-) | 100,500,123,123円 |
| 発行済口数 | 83,233,585,126口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.2074円 |

(参考)

グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)

純資産額計算書

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 287,454,021,905円 |
| 負債総額 | 1,491,615,858円 |
| 純資産総額(-) | 285,962,406,047円 |
| 発行済口数 | 225,790,917,404口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.2665円 |

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド

純資産額計算書

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 170,239,102,009円 |
| 負債総額 | 3,028,591,907円 |
| 純資産総額(-) | 167,210,510,102円 |
| 発行済口数 | 65,624,054,931口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 2.5480円 |

海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし)マザーファンド

純資産額計算書

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 87,602,316,110円 |
| 負債総額 | 4,217,031,553円 |
| 純資産総額（ - ） | 83,385,284,557円 |
| 発行済口数 | 49,545,933,579口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.6830円 |

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 69,304,643,449円 |
| 負債総額 | 5,079,485,421円 |
| 純資産総額（ - ） | 64,225,158,028円 |
| 発行済口数 | 28,709,747,766口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.2371円 |

日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド

純資産額計算書

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 68,587,603,494円 |
| 負債総額 | 1,499,699,681円 |
| 純資産総額（ - ） | 67,087,903,813円 |
| 発行済口数 | 26,424,872,053口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.5388円 |

マネー・オープン・マザーファンド

純資産額計算書

| | |
|----------------|--------------|
| 資産総額 | 422,390,444円 |
| 負債総額 | 59,019円 |
| 純資産総額（ - ） | 422,331,425円 |
| 発行済口数 | 415,584,863口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.0162円 |

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換

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

いものとしてします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【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9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9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9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9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 | 834 | 189,896 |
| 株式投資信託 | 788 | 162,499 |
| 単位型 | 257 | 9,328 |
| 追加型 | 531 | 153,171 |
| 公社債投資信託 | 46 | 27,397 |
| 単位型 | 32 | 834 |
| 追加型 | 14 | 26,562 |

3【委託会社等の経理状況】

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

(1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

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

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

(単位：百万円)

| | | 第59期 (2018年3月31日) | | 第60期 (2019年3月31日) |
|-----------------|---|----------------------|---|----------------------|
| 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 | 1,865 |
| 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 |
| デリバティブ費用 | 1 | 295 | - |
| 時効成立後支払分配金・償還金 | | 0 | 78 |
| 長期差入保証金償却額 | | 212 | - |
| その他 | | 34 | 24 |
| 営業外費用合計 | 767 | | 388 |
| 経常利益 | 10,030 | | 12,328 |
| 特別利益 | | | |
| 投資有価証券売却益 | | 199 | 218 |
| 特別利益合計 | 199 | | 218 |
| 特別損失 | | | |
| 投資有価証券売却損 | | 133 | 176 |
| 固定資産処分損 | | 7 | 0 |
| 役員退職一時金 | | 117 | 180 |
| 損害賠償損失 | | 81 | - |
| 特別損失合計 | 340 | | 357 |
| 税引前当期純利益 | 9,890 | | 12,189 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 3,217 | | 3,741 |
| 法人税等調整額 | 307 | | 375 |
| 法人税等合計 | 2,910 | | 3,366 |
| 当期純利益 | 6,979 | | 8,823 |

(3) 【株主資本等変動計算書】

第59期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

（単位：百万円）

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

評価・換算差額等

| | その他 有価証券 評価差額金 | 繰延ヘッジ 損益 | 評価・ 換算差額等 合計 | 純資産合計 |
|-------------------------|----------------------|-------------|--------------------|--------|
| 当期首残高 | 282 | 266 | 548 | 56,475 |
| 当期変動額 | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | 1,036 |
| 当期純利益 | | | | 6,979 |
| 自己株式の取得 | | | | 113 |
| 株主資本以外の項目の 当期変動額（純額） | 125 | 80 | 206 | 206 |
| 当期変動額合計 | 125 | 80 | 206 | 6,036 |
| 当期末残高 | 408 | 346 | 754 | 62,511 |

第60期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：百万円）

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

| | 評価・換算差額等 | | | 純資産合計 |
|-------------------------|----------------------|-------------|--------------------|--------|
| | その他 有価証券 評価差額金 | 繰延ヘッジ 損益 | 評価・ 換算差額 等合計 | |
| 当期首残高 | 408 | 346 | 754 | 62,511 |
| 当期変動額 | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | 1,640 |
| 当期純利益 | | | | 8,823 |
| 自己株式の取得 | | | | 47 |
| 株主資本以外の項目の 当期変動額（純額） | 85 | 160 | 75 | 75 |
| 当期変動額合計 | 85 | 160 | 75 | 7,060 |
| 当期末残高 | 493 | 185 | 679 | 69,571 |

[注記事項]

（重要な会計方針）

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

| | |
|---------------------------|--|
| 5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。 |
|---------------------------|--|

(未適用の会計基準等)

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

(1) 概要

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

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

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

(表示方法の変更)

| 第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日) |
|---|
| (「『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 | 1 有形固定資産の減価償却累計額 |
| 建物 1,260百万円 | 建物 1,281百万円 |
| 器具備品 612百万円 | 器具備品 655百万円 |
| 2 信託資産 | 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。 | 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。 | 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) | (流動資産) |
| 現金・預金 3,189百万円 | 現金・預金 1,347百万円 |
| 未収収益 592百万円 | 未収収益 127百万円 |
| その他 345百万円 | (流動負債) |
| (流動負債) | 未払手数料 350百万円 |
| 預り金 419百万円 | 未払費用 767百万円 |
| 未払手数料 376百万円 | その他 162百万円 |
| 未払費用 677百万円 | |

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

(損益計算書関係)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第59期(自 2017年 4月 1日 至 2018年 3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

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

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

2 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

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

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

2 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(リース取引関係)

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

(金融商品関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

りリスクをヘッジしております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

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

(1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

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

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

（単位：百万円）

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

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

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

(1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

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

(有価証券関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

| | 貸借対照表計上 額 |
|--------|--------------|
| 子会社株式 | 22,876 |
| 関連会社株式 | 2,892 |

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

2 その他有価証券

(単位:百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

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

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

| | 貸借対照表計上額 |
|--------|----------|
| 子会社株式 | 22,876 |
| 関連会社株式 | 2,892 |

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

2 その他有価証券

(単位:百万円)

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

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

(デリバティブ取引関係)

第59期(2018年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第60期(2019年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
(1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

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

(退職給付関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)

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

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

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

| | |
|-----------------|-------|
| 退職給付引当金 | 1,316 |
| 貸借対照表に計上された負債の額 | 1,316 |

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

| | |
|-----|------|
| 割引率 | 0.2% |
|-----|------|

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、222百万円でありました。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)

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

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

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

| | |
|-----------------|-------|
| 退職給付引当金 | 1,405 |
| 貸借対照表に計上された負債の額 | 1,405 |

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

| | |
|-----|------|
| 割引率 | 0.2% |
|-----|------|

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、230百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

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

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

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

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

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

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

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

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

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

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値(取引事例比準法等による評価額と行使価格との差額)の見積りに
よっております。
- 2 ス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 (単位:百万円) | 1 | 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 の主な原因別の内訳 (単位:百万円) |
| | 繰延税金資産 | | 繰延税金資産 |
| | 賞与引当金 700 | | 賞与引当金 820 |
| | 投資有価証券評価損 96 | | 投資有価証券評価損 96 |
| | 関係会社株式評価損 1,430 | | 関係会社株式評価損 1,430 |
| | 退職給付引当金 402 | | 退職給付引当金 430 |
| | 固定資産減価償却費 111 | | 固定資産減価償却費 103 |
| | その他 526 | | その他 761 |
| | 繰延税金資産小計 3,268 | | 繰延税金資産小計 3,643 |
| | 評価性引当金 1,430 | | 評価性引当金 1,430 |
| | 繰延税金資産合計 1,838 | | 繰延税金資産合計 2,212 |
| | 繰延税金負債 | | 繰延税金負債 |
| | その他有価証券評価差額金 180 | | その他有価証券評価差額金 217 |
| | 繰延ヘッジ利益 152 | | 繰延ヘッジ利益 81 |
| | 繰延税金負債合計 333 | | 繰延税金負債合計 299 |
| | 繰延税金資産の純額 1,504 | | 繰延税金資産の純額 1,913 |

| | | | | | | | | | | | |
|--|---|----------------|-------|------------------------|------|--------------------------|------|-----|------|-------------------|-------|
| <p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <p>法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。</p> | <p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 70%;">法定実効税率 (調整)</td> <td style="text-align: right;">30.6%</td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない 項目</td> <td style="text-align: right;">0.8%</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に参入されない 項目</td> <td style="text-align: right;">4.4%</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">0.6%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right;">27.6%</td> </tr> </table> | 法定実効税率 (調整) | 30.6% | 交際費等永久に損金に算入されない 項目 | 0.8% | 受取配当金等永久に益金に参入されない 項目 | 4.4% | その他 | 0.6% | 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | 27.6% |
| 法定実効税率 (調整) | 30.6% | | | | | | | | | | |
| 交際費等永久に損金に算入されない 項目 | 0.8% | | | | | | | | | | |
| 受取配当金等永久に益金に参入されない 項目 | 4.4% | | | | | | | | | | |
| その他 | 0.6% | | | | | | | | | | |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | 27.6% | | | | | | | | | | |

(関連当事者情報)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社(非上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

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

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

資産合計 26,768百万円
負債合計 5,586百万円

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

(セグメント情報等)

セグメント情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

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

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

関連情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

| 名 称 | 資本金の額 (2019年3月末現在) | 事業の内容 |
|------------------|------------------------|---------------------------------------|
| あかつき証券株式会社 | 3,067百万円 | 金融商品取引法に定める 第一種金融商品取引業を 営んでいます。 |
| 岩井コスモ証券株式会社 | 13,500百万円 | |
| エース証券株式会社 | 8,831百万円 | |
| auカブコム証券株式会社 | 7,196百万円 | |
| S M B C 日興証券株式会社 | 10,000百万円 | |
| 株式会社 S B I 証券 | 48,323百万円 | |
| F F G 証券株式会社 | 3,000百万円 | |
| O K B 証券株式会社 | 15億円 (2019年10月7日現在) | |
| 岡三オンライン証券株式会社 | 2,500百万円 | |
| 四国アライアンス証券株式会社 | 3,000百万円 | |
| 静銀ティーエム証券株式会社 | 3,000百万円 | |
| 七十七証券株式会社 | 3,000百万円 | |
| 株式会社証券ジャパン | 3,000百万円 | |
| 第四北越証券株式会社 | 600百万円 | |
| ちばぎん証券株式会社 | 4,374百万円 | |
| 八十二証券株式会社 | 3,000百万円 | |
| 浜銀 T T 証券株式会社 | 3,307百万円 | |
| P W M 日本証券株式会社 | 3,000百万円 | |
| 百五証券株式会社 | 3,000百万円 | |
| ひろぎん証券株式会社 | 5,000百万円 | |
| フィデリティ証券株式会社 | 9,257百万円 | |
| ほくほく T T 証券株式会社 | 1,250百万円 | |
| 北洋証券株式会社 | 3,000百万円 | |
| 松井証券株式会社 | 11,945百万円 | |
| マネックス証券株式会社 | 12,200百万円 | |
| 丸八証券株式会社 | 3,751百万円 | |
| 水戸証券株式会社 | 12,272百万円 | |
| 楽天証券株式会社 | 7,495百万円 | |
| 株式会社足利銀行 | 135,000百万円 | |
| 株式会社イオン銀行 | 51,250百万円 | |
| 株式会社伊予銀行 | 20,948百万円 | |
| 株式会社岩手銀行 | 12,089百万円 | |
| 株式会社大垣共立銀行 | 46,773百万円 | |
| 株式会社沖縄銀行 | 22,725百万円 | |
| 株式会社香川銀行 | 12,014百万円 | |
| 株式会社紀陽銀行 | 80,096百万円 | |
| 株式会社佐賀共栄銀行 | 2,679百万円 | |
| 株式会社七十七銀行 | 24,658百万円 | |
| 株式会社ジャパンネット銀行 | 37,250百万円 | |
| 株式会社十六銀行 | 36,839百万円 | |

| | | |
|------------------|------------|---|
| 株式会社荘内銀行 | 8,500百万円 | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。 |
| 株式会社常陽銀行 | 85,113百万円 | |
| ソニー銀行株式会社 1 | 31,000百万円 | |
| 株式会社第三銀行 2 | 37,461百万円 | |
| 株式会社但馬銀行 | 5,481百万円 | |
| 株式会社千葉銀行 | 145,069百万円 | |
| 株式会社千葉興業銀行 | 62,120百万円 | |
| 株式会社中京銀行 | 31,844百万円 | |
| 株式会社中国銀行 | 15,149百万円 | |
| 株式会社トマト銀行 | 17,810百万円 | |
| 株式会社富山銀行 | 6,730百万円 | |
| 株式会社長崎銀行 | 6,121百万円 | |
| 株式会社名古屋銀行 | 25,090百万円 | |
| 株式会社西日本シティ銀行 | 85,745百万円 | |
| 株式会社百五銀行 | 20,000百万円 | |
| 株式会社広島銀行 | 54,573百万円 | |
| 株式会社北都銀行 | 12,500百万円 | |
| 株式会社北洋銀行 | 121,101百万円 | |
| 株式会社三重銀行 | 15,295百万円 | |
| 株式会社宮崎銀行 | 14,697百万円 | |
| 株式会社宮崎太陽銀行 | 12,252百万円 | |
| 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。 |

1 2020年3月19日より取扱開始予定です。

2 2020年1月6日より取扱開始予定です。

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【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【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 |
|-------------|---------------|
| 2019年 3月29日 | 臨時報告書 |
| 2019年 5月31日 | 臨時報告書 |
| 2019年 6月21日 | 有価証券届出書の訂正届出書 |
| 2019年 6月21日 | 有価証券報告書 |
| 2019年 7月31日 | 臨時報告書 |

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2019年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2019年10月30日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

P w Cあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴司
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル3倍3分法ファンド（隔月分配型）の2019年3月23日から2019年9月24日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバル3倍3分法ファンド（隔月分配型）の2019年9月24日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。